大成景恒保本混合型证券投资基金

2016 第二季度 报告

2016年6月30日

基金管理人:大成基金管理有限公司
基金托管人:中国银行股份有限公司
报告送出日期:2016年7月20日

§1 重要提示

基金管理人的董事会及董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏,并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带责任。

基金托管人中国银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2016年7月18日复核了本报告中的财务指标、净值表现和投资组合报告等内容,保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产,但不保证基金一定盈利。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险,投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2016年4月1日起至6月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	大成景恒保本混合
交易代码	090019
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2012年6月15日
报告期末基金份额总额	227,432,824.38份
投资目标	本基金通过运用组合保险策略,在为符合保本条件的投资金额提供保本保障的基础上,追求基金资产的长期增值。
投资策略	本基金投资采用VPPI可变组合保险策略(Variable Proportion Portfolio Insurance)。VPPI策略是国际投资管理领域中一种常见的投资组合保险机制,将基金资产动态地在分配在保本资产和风险资产上;并根据数量分析、市场波动等来调整,修正风险资产与保本资产在投资组合中的比重,在大概率保证风险资产可能的损失金额不超过扣除相关费用后的安全垫的基础上,积极参与分享市场可能出现的风险收益,从而在保证本金安全的前提下实现基金资产长期稳定增值。保本资产主要包括货币市场工具和债券等低风险资产,其中债券包括国债、金融债、企业债、公司债、债券回购、央行票据、中期票据、可转换债券、可分离交易债券、短期融资券、银行存款、资产支持证券以及经法律法规或中国证监会允许投资的其他债券类金融工具;风险资产主要包括股票、股指期货、权证等高风险资产。
业绩比较基准	3年期银行定期存款利率(税后),指按照基金合同生效日或新的保本周期开始日中国人民银行公布并执行的同期金融机构人民币存款基准利率(按照四舍五入的方法保留到小数点后第2位,单位为百分数)计算的与当期保本周期同期限的税后收益率。
风险收益特征	本基金为保本混合型基金产品,属证券投资基金中的低风险收益品种。
基金管理人	大成基金管理有限公司
基金托管人	中国银行股份有限公司
基金保证人	深圳市高新投集团有限公司

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位:人民币元

主要财务指标	报告期(2016年4月1日 — 2016年6月30日)
1.本期已实现收益	3,569,794.02
2.本期利润	−2,778,807.06
3.加权平均基金份额本期利润	−0.0086
4.期末基金资产净值	230,005,766.70
5.期末基金份额净值	1.011

注:1.本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入(不含公允价值变动收益)扣除相关费用后的余额,本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

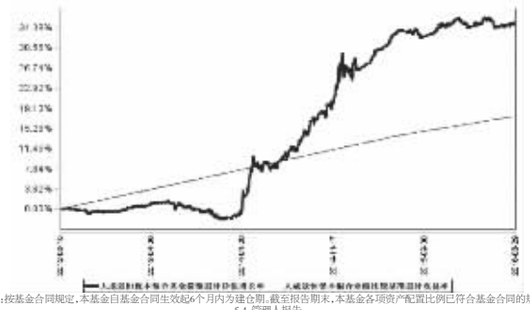
2.所述基金业绩指标不包括持有人交易基金的各项费用,计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

3.2 基金净值表现

3.2.1 本报告期基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①−③	②−④
过去三个月	−0.49%	0.11%	0.75%	0.01%	−1.24%	0.10%

3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较



注:按基金合同规定,本基金自基金合同生效起6个月内为建仓期,截至报告期末,本基金各项资产配置比例已符合基金合同的规定。

§4 管理人报告

4.1 基金经理(或基金经理小组)简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
赵世宏先生	本基金基金经理	2016年3月26日	−	5年	经济学硕士,2011年3月至2012年9月任中银基金管理有限公司研究员,2012年9月至2015年9月任易方达基金管理有限公司研究员,基金经理助理,2015年9月加入大成基金管理有限公司,任职于固定收益总部。自2016年3月26日起担任大成景丰债券型证券投资基金(LOF)、大成景恒保本混合型证券投资基金、大成景丽混合型证券投资基金、大成景稳益混合型证券投资基金、大成可转债增强债券型证券投资基金和大成强化收益定期开放债券型证券投资基金基金经理。具有基金从业资格,国籍:中国

注:1.任职日期、离任日期为本基金管理人作出决定之日。

2.证券从业年限的计算标准遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

本报告期内,本基金管理人严格遵守《证券法》、《证券投资基金法》、《大成景恒保本混合型证券投资基金基金合同》和其他有关法律法规的规定,在基金管理运作中,大成景恒保本混合型证券投资基金的投资范围、投资比例、投资组合、证券交易行为、信息披露等符合有关法律法规、行业监管规则和基金合同等规定,本基金没有发生重大违法违规行为,没有运用基金财产进行内幕交易和操纵市场行为以及进行有损基金投资人利益的关联交易,整体运作合法、合规。本基金将继续以取信于市场、取信于社会投资公众为宗旨,承诺将一如既往地本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金财产,在规范基金运作和严格控制投资风险的前提下,努力为基金份额持有人谋求最大利益。

4.3 公平交易专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

根据《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》的规定,公司制订了《大成基金管理有限公司公平交易制度》、《大成基金管理有限公司异常交易监控与报告制度》,公司旗下投资组合严格按照制度的规定,参与股票、债券的一级市场申购、二级市场交易等投资管理活动,内容包括授权、研究分析、投资决策、交易执行、业绩评估等与投资管理活动相关的各个环节,研究部负责提供投资研究支持,投资部门负责投资决策,交易管理部负责实施交易并实时监控,监察稽核部负责事前监督、事中检查和事后稽核,风险管理部负责对交易情况进行合理性分析,通过多部门的协作互控,保证了公平交易的可操作、可稽核和可持续。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

公司风险管理部定期对公司旗下所有投资组合间同向交易、反向交易等可能存在异常交易的行为进行分析,2016年2季度公司旗下主动投资组合间股票交易不存在同日反向交易;主动型投资组合与指数型投资组合之间或指数型投资组合之间存在股票同日反向交易,但不存在参与交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量超过该股当日成交量5%的交易情形;投资组合间债券交易不存在同日反向交易;投资组合间相邻交易日反向交易的市场成交比例、成交均价等交易结果数据表明该类交易不对市场产生重大影响,无异常;投资组合间虽然存在同向交易行为,但结合交易价差分布统计分析和潜在利益输送金额统计结果表明投资组合间不存在利益输送的可能性。

4.4 投资期内基金投资策略和运作分析

二季度以"权威"人士谈话作为分界线,经济政策有所转向;而临近季末,英国"退欧"公投又给资本市场带来极大的扰动。受此影响,各类金融资产价格在二季度明显波动。4月份,周期行业个股受追捧,债市则收益惨淡;5月初"权威"人士发文强调供给侧改革的政策基调,黑色金属价格大幅下跌,权益市场波动走熊,债市收益率持续走低。季末的英国"退欧"导致市场预期全球货币宽松的格局将持续更长时间,从而推升了全球的股、债、商品的价格。

组合操作上,本基金根据市场变化灵活调整了仓位,并积极参与新股的申购。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截止本报告期末,本基金份额资产净值为1.011元,本报告期基金份额净值增长率为−0.49%,同期业绩比较基准收益率为0.75%,低于业绩比较基准的表现。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

无。

§5 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	11,715,912.08	5.08
	其中:股票	11,715,912.08	5.08
2	基金投资	−	0.00
3	固定收益投资	146,372,850.52	63.42
	其中:债券	146,372,850.52	63.42
	资产支持证券	−	0.00
4	贵金属投资	−	0.00
5	金融衍生品投资	−	0.00
6	买入返售金融资产	60,000,380.00	26.00
	其中:买断式回购的买入返售金融资产	−	0.00
7	银行存款和结算备付金合计	5,217,533.24	2.26
8	其他资产	7,493,947.85	3.25
9	合计	230,800,623.69	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	−	0.00
B	采矿业	1,238,889.00	0.54
C	制造业	8,609,407.00	3.74
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	−	0.00
E	建筑业	−	0.00
F	批发和零售业	745,243.08	0.32
G	交通运输、仓储和邮政业	445,673.00	0.19
H	住宿和餐饮业	−	0.00
I	信息传输、软件和信息技术服务业	−	0.00
J	金融业	676,700.00	0.29
K	房地产业	−	0.00
L	租赁和商务服务业	−	0.00
M	科学研究和技术服务业	−	0.00
N	水利、环境和公共设施管理业	−	0.00
O	居民服务、修理和其他服务业	−	0.00
P	教育	−	0.00
Q	卫生和社会工作	−	0.00
R	文化、体育和娱乐业	−	0.00
S	综合	−	0.00
	合计	11,715,912.08	5.09

5.2.2 报告期末按行业分类的沪港通投资股票投资组合

无。

5.3 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	600110	诺德股份	137,100	1,349,064.00	0.59
2	002155	湖南黄金	86,900	1,144,473.00	0.50
3	601799	星宇股份	18,200	833,924.00	0.36
4	300153	科泰电源	28,200	761,118.00	0.33
5	600386	北巴传媒	39,938	745,243.08	0.32
6	000338	潍柴动力	90,000	702,900.00	0.31
7	002440	闰土股份	47,200	700,920.00	0.30
8	601555	东吴证券	50,500	676,700.00	0.29
9	002196	方正电机	18,300	625,677.00	0.27
10	002045	国光电器	38,600	551,208.00	0.24

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	−	0.00
2	央行票据	−	0.00
3	金融债券	29,949,000.00	13.02
	其中:政策性金融债	29,949,000.00	13.02
4	企业债券	99,876,400.00	43.42
5	企业短期融资券	−	0.00
6	中期票据	9,981,000.00	4.34
7	可转债(可交换债)	6,566,450.52	2.85
8	同业存单	−	0.00
9	其他	−	0.00
10	合计	146,372,850.52	63.64

5.5 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

序号	债券代码	债券名称	数量(张)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	160209	16国开09	300,000	29,949,000.00	13.02
2	1080111	10渝江北嘴债	150,000	15,390,000.00	6.69
3	1480233	14昌平债	100,000	10,856,000.00	4.72
4	1480459	14石景山债	100,000	10,765,000.00	4.68
5	1480385	14德州城投债	100,000	10,749,000.00	4.67

5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

5.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

5.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金本报告期末投资股指期货。

5.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期末投资股指期货。

5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.10.1 本期国债期货投资政策

本基金管理人将按照相关法律法规的规定,结合对宏观经济形势和政策趋势的判断、对债券市场进行定性和定量分析、构建量化分析体系,对国债期货和现货的基差、国债期货的流动性、波动水平、套期保值的有效性等指标进行跟踪监控,在最大限度保证基金资产安全的基础上,力求实现资产的长期稳定增值。

5.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末投资国债期货。

5.10.3 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末投资国债期货。

5.11 投资组合报告附注

5.11.1 本基金投资的前十名证券的发行主体未出现本期被监管部门立案调查,或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

5.11.2 基金投资的前十名股票中,没有投资于超出基金合同规定备选股票库之外的股票。

5.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	64,659.43
2	应收证券清算款	5,549,893.63
3	应收股利	−
4	应收利息	1,879,295.74
5	应收申购款	99.05
6	其他应收款	−
7	待摊费用	−
8	其他	−
9	合计	7,493,947.85

5.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

序号	债券代码	债券名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	128009	歌尔转债	3,372,752.52	1.47

5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

5.11.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入原因,分项之和与合计可能有尾差。

§6 开放式基金份额变动

单位:份

报告期期初基金份额总额	654,570,790.51
报告期期间基金总申购份额	310,229.05
减:报告期期间基金总赎回份额	427,448,195.18
报告期期间基金拆分变动份额(份额减少以"−"填列)	−
报告期期末基金份额总额	227,432,824.38

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

本报告期基金管理人未持有本基金份额。

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

本报告期基金管理人未运用固有资金投资本基金

§8 影响投资者决策的其他重要信息

基金管理人于2016年6月25日发布了《大成基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告》,经大成基金管理有限公司第六届董事会第十七次会议审议通过,钟鸣远先生不再担任公司副总经理。

§9 备查文件目录

9.1 备查文件目录

1、中国证监会批准设立大成景恒保本混合型证券投资基金的文件;

2、《大成景恒保本混合型证券投资基金基金合同》;

3、《大成景恒保本混合型证券投资基金托管协议》;

4、大成基金管理有限公司批准文件、营业执照、公司章程;

5、本报告期内在指定报刊上披露的各种公告原稿。

9.2 存放地点

备查文件存放在本基金管理人和托管人的住所。

9.3 查阅方式

投资者可在营业时间免费查阅,或登录本基金管理人网站http://www.dcfund.com.cn进行查阅。

大成基金管理有限公司
2016年7月20日

大成景辉灵活配置混合型证券投资基金

2016 第二季度 报告

2016年6月30日

基金管理人:大成基金管理有限公司
基金托管人:北京银行股份有限公司
报告送出日期:2016年7月20日

§1 重要提示

基金管理人的董事会及董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏,并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带责任。

基金托管人北京银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2016年7月18日复核了本报告中的财务指标、净值表现和投资组合报告等内容,保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产,但不保证基金一定盈利。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险,投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2016年4月1日起至6月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	大成景辉灵活配置混合	
交易代码	001582	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2015年11月30日	
报告期末基金份额总额	503,914,900.02份	
投资目标	在严格控制风险的前提下,追求基金资产稳定增值。	
投资策略	本基金将采用"自上而下"的资产配置策略,在综合判断宏观经济基本面、证券市场走势等宏观因素的基础上,通过动态调整资产配置比例以控制基金资产整体风险,在个券投资方面采用"自下而上"精选策略,通过严谨个股选择,信用分析以及对券种收益水平、流动性的客观判断,综合运用多种投资策略,精选个券构建投资组合。	
业绩比较基准	三年期定存款税后利率+2%	
风险收益特征	本基金为混合型基金,基金的风险与预期收益高于债券型基金和货币市场基金低于股票型基金,属证券投资基金中的中高风险品种。	
基金管理人	大成基金管理有限公司	
基金托管人	北京银行股份有限公司	
下属分级基金的基金简称	大成景辉灵活配置混合A	大成景辉灵活配置混合C
下属分级基金的交易代码	001582	002290
报告期末下属分级基金的份额总额	503,914,900.02份	0.00份

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位:人民币元

主要财务指标	报告期(2016年4月1日 — 2016年6月30日)	
	大成景辉灵活配置混合A	大成景辉灵活配置混合C
1. 本期已实现收益	−999,345.04	−
2. 本期利润	377,106.37	−
3. 加权平均基金份额本期利润	0.0007	−
4. 期末基金资产净值	516,516,421.94	−
5. 期末基金份额净值	1.025	−

注:1.本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入(不含公允价值变动收益)扣除相关费用后的余额,本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

2.所述基金业绩指标不包括持有人交易基金的各项费用,计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

3.根据我司2015年12月17日《关于大成景辉灵活配置混合型证券投资基金增加C类份额并相应修订基金合同的公告》,自2015年12月17日起,大成景辉灵活配置混合型证券投资基金增加收取销售服务费的C类份额,截止本报告期末,景辉C类份额未发生申购业务,本报告期无景辉C类份额的相关财务指标及净值表现的数据。

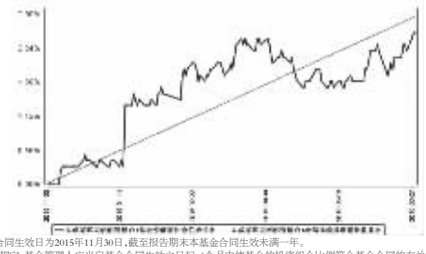
3.2 基金净值表现

3.2.1 本报告期基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

大成景辉灵活配置混合A

阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①−③	②−④
过去三个月	0.10%	0.11%	1.16%	0.01%	−1.06%	0.10%

3.2.2 自基金合同生效以来基金累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较



注:1.本基金合同生效日为2015年11月30日,截至报告期末本基金合同生效不满一年。

2.按基金合同规定,基金管理人应当自基金合同生效之日起 6个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的有关约定,建仓期结束时,本基金的投资组合比例符合基金合同的约定。

§4 管理人报告

4.1 基金经理(或基金经理小组)简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
黄万青女士	本基金基金经理	2015年11月30日	−	20年	经济学硕士,1999年5月加入大成基金管理有限公司研究部,历任研究部研究员、固定收益部高级研究员,2010年4月7日至2013年3月7日任景宏证券投资基金基金经理,2011年7月13日至2013年3月7日任大成行业轮动股票型证券投资基金基金经理,2011年3月8日至2011年6月5日任大成积极成长股票型证券投资基金基金经理,2011年3月8日至2011年6月5日任大成策略回报股票型证券投资基金基金经理,2015年4月28日起任大成景秀灵活配置混合型证券投资基金基金经理,2015年11月30日起任大成景辉灵活配置混合型证券投资基金基金经理,2016年5月25日起任大成景荣保本混合型证券投资基金基金经理。

注:1.任职日期、离任日期为本基金管理人作出决定之日。

2.证券从业年限的计算标准遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

本报告期内,本基金管理人严格遵守《证券法》、《证券投资基金法》、《大成景辉灵活配置混合型证券投资基金基金合同》和其他有关法律法规的规定,在基金管理运作中,大成景辉灵活配置混合型证券投资基金的投资范围、投资比例、投资组合、证券交易行为、信息披露等符合有关法律法规、行业监管规则和基金合同等规定,本基金没有发生重大违法违规行为,没有运用基金财产进行内幕交易和操纵市场行为以及进行有损基金投资人利益的关联交易,整体运作合法、合规。本基金将继续以取信于市场、取信于社会投资公众为宗旨,承诺将一如既往地本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金财产,在规范基金运作和严格控制投资风险的前提下,努力为基金份额持有人谋求最大利益。

4.3 公平交易专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

根据《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》的规定,公司制订了《大成基金管理有限公司公平交易制度》、《大成基金管理有限公司异常交易监控与报告制度》,公司旗下投资组合严格按照制度的规定,参与股票、债券的一级市场申购、二级市场交易等投资管理活动,内容包括授权、研究分析、投资决策、交易执行、业绩评估等与投资管理活动相关的各个环节,研究部负责提供投资研究支持,投资部门负责投资决策,交易管理部负责实施交易并实时监控,监察稽核部负责事前监督、事中检查和事后稽核,风险管理部负责对交易情况进行合理性分析,通过多部门的协作互控,保证了公平交易的可操作、可稽核和可持续。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

公司风险管理部定期对公司旗下所有投资组合间同向交易、反向交易等可能存在异常交易的行为进行分析。2016年2季度公司旗下主动投资组合间股票交易不存在同日反向交易;主动型投资组合与指数型投资组合之间或指数型投资组合之间存在股票同日反向交易,但不存在参与交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量超过该股当日成交量5%的交易情形;投资组合间债券交易不存在同日反向交易;投资组合间相邻交易日反向交易的市场成交比例、成交均价等交易结果数据表明该类交易不对市场产生重大影响,无异常;投资组合间虽然存在同向交易行为,但结合交易价差分布统计分析和潜在利益输送金额统计结果表明投资组合间不存在利益输送的可能性。

4.4 投资期内基金投资策略和运作分析

2016年上半年上证指数下跌17.22%,中小板综指下跌14.22%,创业板综指下跌13.89%。2016年上半年股票市场经过1月份的暴跌,后面几个月基本是围绕2800点-3000点区间作窄幅震荡,基本都是存量资金的博弈,所以指数涨不高,但主题表现非常活跃。债券市场方面,由于资金面整体宽松,年初至3月底,债券收益率一直下行,但4月份由于信用违约事件的暴发,债券收益率上行一段时间,但目前整体已经回到3月份的水平。

由于年初对股票市场相对谨慎,所以权益仓位控制在相对较低的水平,但3月底因为中购,刚把权益仓位加到年初的水平,债券组合也有一定的杠杆,就遇上股票市场和债券市场大跌,净值造成一定的回撤,5月底,我们判断股票市场反弹,在仓位基本不变的情况下,我们对组合进行了调整,加大食品饮料和中药等低估值的配置,获得了较好的回报,净值开始回升。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截止本报告期末,景辉A基金份额资产净值为1.025元,本报告期景辉A基金份额净值增长率为0.10%,同期业绩比较基准收益率为1.16%,低于业绩比较基准的表现。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

无。

§5 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额(元)	占基金资产的比例(%)
1	权益投资	24,983,955.60	4.82
	其中:股票	24,983,955.60	4.82
2	基金投资	−	0.00
3	固定收益投资	437,490,000.00	84.49
	其中:债券	437,490,000.00	84.49
	资产支持证券	−	0.00
4	贵金属投资	−	0.00
5	金融衍生品投资	−	0.00
6	买入返售金融资产	42,500,000.00	8.21
	其中:买断式回购的买入返售金融资产	−	0.00
7	银行存款和结算备付金合计	5,966,868.74	1.15
8	其他资产	6,888,005.42	1.33
9	合计	517,828,829.76	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	−	0.00
B	采矿业	−	0.00
C	制造业	20,981,145.14	4.06
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	−	0.00
E	建筑业	282,691.96	0.05
F	批发和零售业	−	0.00
G	交通运输、仓储和邮政业	−	0.00
H	住宿和餐饮业	−	0.00
I	信息传输、软件和信息技术服务业	3,699,992.40	0.72
J	金融业	−	0.00
K	房地产业	−	0.00
L	租赁和商务服务业	−	0.00
M	科学研究和技术服务业	20,126.10	0.00
N	水利、环境和公共设施管理业	−	0.00
O	居民服务、修理和其他服务业	−	0.00
P	教育	−	0.00
Q	卫生和社会工作	−	0.00
R	文化、体育和娱乐业	−	0.00
S	综合	−	0.00
	合计	24,983,955.60	4.84

5.2.2 报告期末按行业分类的沪港通投资股票投资组合

无。

5.3 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	000538	云南白药	60,000	3,858,000.00	0.75
2	600085	同仁堂	100,000	2,979,000.00	0.58
3	600519	贵州茅台	10,000	2,919,200.00	0.57
4	000423	东阿阿胶	50,000	2,641,500.00	0.51
5	600332	白云山	100,000	2,464,000.00	0.48
6	000568	泸州老窖	80,000	2,376,000.00	0.46
7	600718	东软集团	100,000	1,832,000.00	0.35
8	600446	金证股份	50,000	1,797,500.00	0.35
9	000858	五粮液	50,000	1,626,500.00	0.31
10	002304	洋河股份	20,095	1,445,232.40	0.28

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	−	0.00
2	央行票据	−	0.00
3	金融债券	60,177,000.00	11.65
	其中:政策性金融债	60,177,000.00	11.65
4	企业债券	43,901,000.00	8.50
5	企业短期融资券	235,253,000.00	45.55
6	中期票据	−	0.00
7	可转债(可交换债)	399,000.00	0.08
8	同业存单	97,760,000.00	18.93
9	其他	−	0.00
10	合计	437,490,000.00	84.70

5.5 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

序号	债券代码	债券名称	数量(张)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	111616065	16上海银行CD065	500,000	49,265,000.00	9.54
2	111619058	16恒丰银行CD058	500,000	48,495,000.00	9.39
3	160416	16农发16	300,000	30,228,000.00	5.85
4	160209	16国开09	300,000	29,949,000.00	5.80
5	1280488	12南城资债	300,000	25,641,000.00	4.96

5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

5.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

5.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金本报告期末投资股指期货。

5.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期末投资股指期货。

5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.10.1 本期国债期货投资政策

基金管理人将按照相关法律法规的规定,结合对宏观经济形势和政策趋势的判断、对债券市场进行定性和定量分析、构建量化分析体系,对国债期货和现货的基差、国债期货的流动性、波动水平、套期保值的有效性等指标进行跟踪监控,在最大限度保证基金资产安全的基础上,力求实现资产的长期稳定增值。

5.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末投资国债期货。

5.10.3 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末投资国债期货。

5.11 投资组合报告附注

5.11.1 本基金投资的前十名证券的发行主体未出现本期被监管部门立案调查,或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

5.11.2 基金投资的前十名股票中,没有投资于超出基金合同规定备选股票库之外的股票。

5.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	117,356.17
2	应收证券清算款	1,846,603.97
3	应收股利	−
4	应收利息	4,924,045.28
5	应收申购款	−
6	其他应收款	−
7	待摊费用	−
8	其他	−
9	合计	6,888,005.42

5.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有可转换债。

5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末未持有流通受限的股票。

5.11.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入原因,分项之和与合计可能有尾差。

§6 开放式基金份额变动

单位:份

项目	大成景辉灵活配置混合A	大成景辉灵活配置混合C
报告期期初基金份额总额	517,074,877.41	−
报告期期间基金总申购份额	386.25	−
减:报告期期间基金总赎回份额	13,160,363.64	−
报告期期间基金拆分变动份额(份额减少以"−"填列)	−	−
报告期期末基金份额总额	503,914,900.02	−

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

基金管理人未持有本基金份额。

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

本报告期基金管理人未运用固有资金投资本基金。

§8 影响投资者决策的其他重要信息

基金管理人于2016年6月25日发布了《大成基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告》,经大成基金管理有限公司第六届董事会第十七次会议审议通过,钟鸣远先生不再担任公司副总经理。

§9 备查文件目录

9.1 备查文件目录

1、中国证监会批准设立大成景辉灵活配置混合型证券投资基金的文件;

2、《大成景辉灵活配置混合型证券投资基金基金合同》;

3、《大成景辉灵活配置混合型证券投资基金托管协议》;

4、大成基金管理有限公司批准文件、营业执照、公司章程;

5、本报告期内在指定报刊上披露的各种公告原稿。

9.2 存放地点

备查文件存放于本基金管理人和托管人的住所。

9.3 查阅方式

投资者可在营业时间免费查阅,或登录本基金管理人网站http://www.dcfund.com.cn进行查阅。

大成基金管理有限公司
2016年7月20日

大成景利混合型证券投资基金

2016 第二季度 报告

2016年6月30日

基金管理人:大成基金管理有限公司
基金托管人:中国工商银行股份有限公司
报告送出日期:2016年7月20日

§1 重要提示

基金管理人的董事会及董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏,并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带责任。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2016年7月18日复核了本报告中的财务指标、净值表现和投资组合报告等内容,保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产,但不保证基金一定盈利。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险,投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2016年4月1日起至6月30日止。

§2 基金产品概况

| | |
|