

大成核心双动力混合型证券投资基金  
2016 年半年度报告  
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

送出日期：2016 年 8 月 25 日

## § 1 重要提示及目录

### 1.1 重要提示

基金管理人的董事会、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的法律责任。本半年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

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 8 月 23 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、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及其更新。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2016 年 01 月 01 日起至 06 月 30 日止。

## 1.2 目录

<b>§ 1 重要提示及目录</b> .....	<b>2</b>
1.1 重要提示.....	2
1.2 目录.....	3
<b>§ 2 基金简介</b> .....	<b>5</b>
2.1 基金基本情况.....	5
2.2 基金产品说明.....	5
2.3 基金管理人和基金托管人.....	5
2.4 信息披露方式.....	5
2.5 其他相关资料.....	6
<b>§ 3 主要财务指标和基金净值表现</b> .....	<b>6</b>
3.1 主要会计数据和财务指标.....	6
3.2 基金净值表现.....	6
<b>§ 4 管理人报告</b> .....	<b>7</b>
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	7
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	11
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	11
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明.....	12
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	13
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	13
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	14
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明.....	14
<b>§ 5 托管人报告</b> .....	<b>14</b>
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	14
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明.....	14
5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见.....	15
<b>§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）</b> .....	<b>15</b>
6.1 资产负债表.....	15
6.2 利润表.....	16
6.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	17
6.4 报表附注.....	18
<b>§ 7 投资组合报告</b> .....	<b>31</b>
7.1 期末基金资产组合情况.....	31
7.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	31
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细.....	32
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	37
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	38
7.6 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.....	39
7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细.....	39
7.8 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贵金属投资明细.....	39
7.9 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.....	39
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....	39
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	39
7.12 投资组合报告附注.....	40

<b>§ 8 基金份额持有人信息</b> .....	<b>40</b>
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	40
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	41
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况.....	41
<b>§ 9 开放式基金份额变动</b> .....	<b>41</b>
<b>§ 10 重大事件揭示</b> .....	<b>41</b>
10.1 基金份额持有人大会决议.....	41
10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动.....	41
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	42
10.4 基金投资策略的改变.....	42
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	42
10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况.....	42
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	42
10.8 其他重大事件.....	43
<b>§ 11 影响投资者决策的其他重要信息</b> .....	<b>45</b>
<b>§ 12 备查文件目录</b> .....	<b>46</b>
12.1 备查文件目录.....	46
12.2 存放地点.....	46
12.3 查阅方式.....	46

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	大成核心双动力混合型证券投资基金
基金简称	大成核心双动力混合
基金主代码	090011
交易代码	090011
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2010 年 6 月 22 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
报告期末基金份额总额	34,679,017.92 份
基金合同存续期	不定期

### 2.2 基金产品说明

投资目标	以稳健的投资策略为主，采用合理的方法适当提升风险收益水平，力争获取超越业绩比较基准的中长期投资收益。
投资策略	本基金采用自上而下的方式实施大类资产间的战略配置，并采用“核心-双卫星”策略管理股票资产。
业绩比较基准	75%×沪深 300 指数+25%×中证综合债券指数
风险收益特征	本基金是主动投资的混合基金，预期风险收益水平低于股票基金，高于债券基金和货币市场基金。

### 2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		大成基金管理有限公司	中国工商银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	杜鹏	洪渊
	联系电话	0755-83183388	010-66105799
	电子邮箱	dupeng@dcfund.com.cn	custody@icbc.com.cn
客户服务电话		4008885558	95588
传真		0755-83199588	010-66105798
注册地址		深圳市福田区深南大道 7088 号招商银行大厦 32 层	北京市西城区复兴门内大街 55 号
办公地址		深圳市福田区深南大道 7088 号招商银行大厦 32 层	北京市西城区复兴门内大街 55 号
邮政编码		518040	100140
法定代表人		刘卓	易会满

### 2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《证券时报》、《上海证券报》、《中国证券报》
----------------	------------------------

登载基金半年度报告正文的管理人互联网网址	http://www.dcfund.com.cn
基金半年度报告备置地点	基金管理人及基金托管人住所

## 2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	大成基金管理有限公司	深圳市福田区深南大道 7088 号招商银行大厦 32 层

## § 3 主要财务指标和基金净值表现

### 3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2016 年 1 月 1 日 - 2016 年 6 月 30 日)
本期已实现收益	-1,243,257.54
本期利润	-5,500,957.59
加权平均基金份额本期利润	-0.1576
本期加权平均净值利润率	-11.30%
本期基金份额净值增长率	-10.27%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2016 年 6 月 30 日)
期末可供分配利润	14,998,835.81
期末可供分配基金份额利润	0.4325
期末基金资产净值	49,677,853.73
期末基金份额净值	1.433
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2016 年 6 月 30 日)
基金份额累计净值增长率	43.30%

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、期末可供分配利润，采用期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数(为期末余额，不是当期发生数)。

3、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。

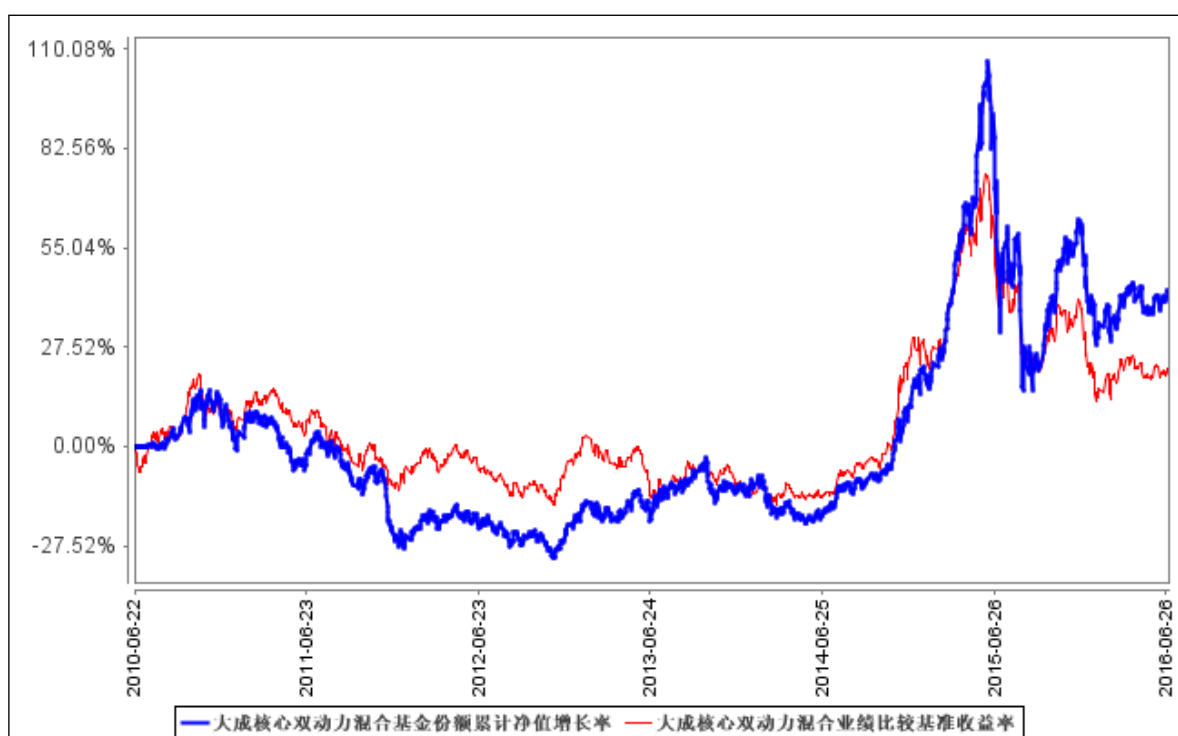
### 3.2 基金净值表现

#### 3.2.1 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	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差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

过去一个月	1.92%	0.87%	-0.20%	0.74%	2.12%	0.13%
过去三个月	0.84%	0.92%	-1.34%	0.76%	2.18%	0.16%
过去六个月	-10.27%	1.58%	-11.15%	1.38%	0.88%	0.20%
过去一年	-17.50%	2.27%	-20.87%	1.73%	3.37%	0.54%
过去三年	74.12%	1.73%	39.56%	1.38%	34.56%	0.35%
自基金合同生效起至今	43.30%	1.47%	21.85%	1.22%	21.45%	0.25%

### 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之日起 6 个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的约定，截至报告日本基金的各项投资比例已达到基金合同中规定的各项比例。

## § 4 管理人报告

### 4.1 基金管理人及基金经理情况

#### 4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

大成基金管理有限公司经中国证监会证监基金字[1999]10 号文批准，于 1999 年 4 月 12 日正式成立，是中国证监会批准成立的首批十家基金管理公司之一，注册资本为 2 亿元人民币，注册地为深圳。目前公司由三家股东组成，分别为中泰信托有限责任公司(50%)、光大证券股份有

限公司(25%)、中国银河投资管理有限公司(25%)。截至 2016 年 6 月 30 日, 本基金管理人共管理 5 只 ETF 及 1 只 ETF 联接基金: 大成中证 100 交易型开放式指数证券投资基金、深证成长 40 交易型开放式指数证券投资基金及大成深证成长 40 交易型开放式指数证券投资基金联接基金、中证 500 深市交易型开放式指数证券投资基金、中证 500 沪市交易型开放式指数证券投资基金、大成深证成份交易型开放式指数证券投资基金, 2 只 QDII 基金: 大成标普 500 等权重指数证券投资基金、大成纳斯达克 100 指数证券投资基金及 61 只开放式证券投资基金: 大成景丰债券型证券投资基金 (LOF)、大成价值增长证券投资基金、大成债券投资基金、大成蓝筹稳健证券投资基金、大成精选增值混合型证券投资基金、大成货币市场证券投资基金、大成沪深 300 指数证券投资基金、大成财富管理 2020 生命周期证券投资基金、大成积极成长混合型证券投资基金、大成创新成长混合型证券投资基金 (LOF)、大成景阳领先混合型证券投资基金、大成强化收益定期开放债券型证券投资基金、大成策略回报混合型证券投资基金、大成行业轮动混合型证券投资基金、大成中证红利指数证券投资基金、大成核心双动力混合型证券投资基金、大成竞争优势混合型证券投资基金、大成景恒保本混合型证券投资基金、大成内需增长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、大成消费主题混合型证券投资基金、大成新锐产业混合型证券投资基金、大成优选混合型证券投资基金 (LOF)、大成月添利理财债券型证券投资基金、大成现金增利货币市场证券投资基金、大成月月盈短期理财债券型证券投资基金、大成现金宝场内实时申赎货币市场基金、大成景安短融债券型证券投资基金、大成景兴信用债债券型证券投资基金、大成景旭纯债债券型证券投资基金、大成景祥分级债券型证券投资基金、大成信用增利一年定期开放债券型证券投资基金、大成健康产业混合型证券投资基金、大成中小盘混合型证券投资基金 (LOF)、大成灵活配置混合型证券投资基金、大成丰财宝货币市场基金、大成景益平稳收益混合型证券投资基金、大成添利宝货币市场基金、大成景利混合型证券投资基金、大成产业升级股票型证券投资基金 (LOF)、大成高新技术产业股票型证券投资基金、大成景秀灵活配置混合型证券投资基金、大成互联网思维混合型证券投资基金、大成景明灵活配置混合型证券投资基金、大成景穗灵活配置混合型证券投资基金、大成景鹏灵活配置混合型证券投资基金、大成睿景灵活配置混合型证券投资基金、大成景源灵活配置混合型证券投资基金、大成景裕灵活配置混合型证券投资基金、大成中证互联网金融指数分级证券投资基金、大成正向回报灵活配置混合型证券投资基金、大成恒丰宝货币市场基金、大成绝对收益策略混合型发起式证券投资基金、大成景沛灵活配置混合型证券投资基金、大成景辉灵活配置混合型证券投资基金、大成中证 360 互联网+大数据 100 指数型证券投资基金、大成慧成货币市场基金、大成趋势回报灵活配置混合型证券投资基金、大成国家安全主题灵活配置混合型证券投资基金、大成景荣保本混合型证券投资基金和大成景华



一年定期开放债券型证券投资基金等。

#### 4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
石国武先生	本基金基金经理	2014年8月23日	2016年3月8日	14年	工学硕士。2002年12月至2012年11月就职于博时基金管理有限公司，历任系统分析员、股票投资部投资经理助理，特定资产部投资经理。2012年11月加入大成基金管理有限公司。2013年4月18日起担任大成价值增长证券投资基金基金经理。2014年8月23日至2015年7月21日任大成核心双动力股票型证券投资基金基金经理，2015年7月22日至2016年3月8日任大成核心双动力混合型证券投资基金基金经理。2015年4月18日至2015年7月23日担任大成优选股票型证券投资基金（LOF）基金经理，2015年7月24日至2016年5月25日任大成优选混合型证券投资基金（LOF）基金经理，2015年9月23日起任大成绝对收益策略混合型发起式证券投资基金基金经理。2016年8月20日起任大成创新成长混合型证券投资基金（LOF）基金经理。现任股票投资部价值组投资总监。具有基金从业资格。国籍：中国
张钟玉女士	本基金基金经理	2015年2月28日	-	6年	会计学硕士。2010年7月加入大成基金管理有限公司，历任研究部研究员、数量投资部数量分析师。2013年3月25日至2015

					<p>年 1 月 14 日担任大成优选股票型证券投资基金（LOF）和大成沪深 300 指数证券投资基金基金经理助理。2015 年 2 月 28 日至 2015 年 7 月 21 日任大成核心双动力股票型证券投资基金基金经理，2015 年 7 月 22 日起任大成核心双动力混合型证券投资基金基金经理。2015 年 5 月 23 日起任深证成长 40 交易型开放式指数证券投资基金、大成深证成长 40 交易型开放式指数证券投资基金联接基金及大成中证 500 深市交易型开放式指数证券投资基金基金经理。2015 年 8 月 26 日起担任大成沪深 300 指数证券投资基金基金经理。具有基金从业资格。国籍：中国</p>
苏秉毅先生	本基金基金经理 数量与指数投资部总监	2016 年 3 月 4 日	-	12 年	<p>经济学硕士。2004 年 9 月至 2008 年 5 月就职于华夏基金管理有限公司基金运作部。2008 年加入大成基金管理有限公司，历任产品设计师、高级产品设计师、基金经理助理、基金经理。2012 年 8 月 28 日至 2014 年 1 月 23 日担任大成中证 500 沪市交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理。2014 年 1 月 24 日至 2014 年 2 月 17 日任大成健康产业股票型证券投资基金基金经理。2012 年 2 月 9 日至 2014 年 9 月 11 日担任深证成长 40 交易型开放式指数证券投资基金及大成深证成长 40 交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理。</p>

					<p>2012 年 8 月 24 日起任中证 500 沪市交易型开放式指数证券投资基金基金经理。2013 年 1 月 1 日至 2015 年 8 月 25 日兼任大成沪深 300 指数证券投资基金基金经理。2013 年 2 月 7 日起任大成中证 100 交易型开放式指数证券投资基金基金经理。</p> <p>2015 年 6 月 5 日起任大成深证成份交易型开放式指数证券投资基金基金经理。2015 年 6 月 29 日起担任大成中证互联网金融指数分级证券投资基金基金经理。2016 年 3 月 4 日起担任大成核心双动力混合型证券投资基金及大成沪深 300 指数证券投资基金基金经理。现任数量与指数投资部副总监。具有基金从业资格。国籍：中国</p>
--	--	--	--	--	--

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》、《大成核心双动力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，大成核心双动力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 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

#### 4.3.1 公平交易制度的执行情况

报告期内，基金管理人严格执行了公平交易的原则和制度。基金管理人对旗下所有投资组合间连续 4 个季度的日内、3 日内及 5 日内股票及债券交易同向交易价差分析及相应交易情形的分析结果表明：债券交易同向交易频率较低；股票同向交易溢价率较大主要来源于市场因素（如个股当日价格振幅较高）及组合经理交易时机选择，即投资组合成交时间不一致以及成交价格的日内较大变动导致个别组合间的成交价格差异较大。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。

#### 4.3.2 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 上半年公司旗下主动投资组合间股票交易存在 9 笔同日反向交易，原因是投资组合投资策略需要。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% 的情形；投资组合间存在 2 笔债券同日反向交易，原因为投资策略需要。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 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

#### 4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

上半年，随着政策的摇摆，宏观经济也在不断反复。年初，在供给侧改革、去库存、投资需求拉动等措施的共振下，宏观经济有了起色。新增信贷放出巨量，PMI 等经济数据都得到了明显改善。在需求回暖和资金炒作叠加作用下，以黑色系为代表的大宗商品价格一度大幅反弹。后来，在权威人士表态定调经济“L”型后，情况发生了变化，政策刺激力度明显减弱，经济重新回到筑底的轨道上。人民币汇率在保持稳定一段时间后汇率继续贬值，但对出口的提振仍然有限。

国内环境起伏不定，国际环境同样充满变数。欧洲恶性事件层出不穷，英国公投脱欧，各经济体“负利率”愈演愈烈却收效甚微。若应对失当，爆发全球范围的政治、经济危机并非毫无可能。

和宏观经济的先扬后抑相反，股市在上半年走出了结实的“L”型。甫一进入新年，股市便出现暴跌。由于锚定效应，新推行的熔断机制成为了加大市场波动的助推器，和推出该制度的初

衷可谓南辕北辙。尽管成命很快被收回，熔断机制无限期暂停，但市场未能迅速恢复元气，继续下挫，直至两会前后开始企稳并开启“慢牛”式反弹。从各基准指数来看，主要的波动发生在一季度，二季度波动幅度相对较小，其中沪深 300 指数下跌 15.47%。大、中、小盘指数表现较为接近，市值因子对市场的影响较小。总体来说，白酒、家电等估值较低的非周期股票表现较好，呈现出良好的防御性。

报告期内本基金基于基金契约，根据数量化投资模型，精选沪深 300 成份股构建了核心组合，同时选择业绩持续增长、估值合理的小市值个股作为进攻组合。上半年度基金净值增长率为-10.27%，在全市场窄幅振荡的环境下，取得了一定的超额收益，体现了量化策略的稳定性。

#### 4.4.2 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 1.433 元。本报告期内基金份额净值增长率为-10.27%，同期业绩比较基准收益率-11.15%，高于业绩比较基准的表现。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望下半年，宏观经济继续筑底已经成为共识，分歧在于政府对经济下滑容忍的底线，以及是否会据此加码刺激经济。在某种程度上，我国已陷入流动性陷阱，尽管总体流动性非常宽松，但由于税负过重、投资环境恶化等原因，资金脱实向虚，推高金融产品价格，但对实体经济支持力度有限。虽然通胀仍然不高，但货币政策继续放松的边际效应不大，若政府有意刺激经济，将会更多在财政政策上发力。

宏观经济持续低迷，投射到资本市场上，直接体现为上市公司总体盈利下滑，成长放缓。而且，从上市公司大股东减持的热情来看，目前市场估值水平仍然偏高。再加上增量资金难觅，权益市场流动性不足以推动整体牛市，下半年出现鸡犬升天式系统性行情的可能性极小。

从另一方面看，上半年的急跌已经释放了不少风险，而政策面侧重维稳，会尽量避免大波动。综合来看，下半年市场大跌的可能性也不高，预计将反复震荡筑底。局部性机会将主要来自于价值回归。在全社会优质资产稀缺的大背景下，部分基本面良好、估值合理的股票有可能获得增量资金的配置，尤其是分红率较高、具有一定安全边际、可以长期持有的股票。而且，这也符合监管政策的引导方向。

#### 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本基金管理人指导基金估值业务的领导小组为公司估值委员会，公司估值委员会主要负责估值政策和估值程序的制定、修订以及执行情况的监督。估值委员会由股票投资部、研究部、固定收益总部、风险管理部、基金运营部、监察稽核部、专户投资部指定人员组成。公司估值委员会

的相关成员均具备相应的专业胜任能力和相关工作经历，估值委员会成员中包括两名投资组合经理。

股票投资部、研究部、固定收益总部、风险管理部和专户投资部负责关注相关投资品种的动态，评判基金持有的投资品种是否处于不活跃的交易状态或者最近交易日后经济环境发生了重大变化或证券发行机构发生了影响证券价格的重大事件，从而确定估值日需要进行估值测算或者调整的投资品种；提出合理的数量分析模型对需要进行估值测算或者调整的投资品种进行公允价值定价与计量；定期对估值政策和程序进行评价，以保证其持续适用；基金运营部负责日常的基金资产的估值业务，执行基金估值政策，并负责与托管行沟通估值调整事项；监察稽核部负责审核估值政策和程序的一致性，监督估值委员会工作流程中的风险控制，并负责估值调整事项的信息披露工作。

本基金的日常估值程序由基金运营部基金估值核算员执行，并与托管银行的估值结果核对一致。基金估值政策的议定和修改采用集体讨论机制，基金经理及投资经理作为估值小组成员，对本基金持仓证券的交易情况、信息披露情况保持应有的职业敏感，向估值委员会提供估值参考信息，参与估值政策讨论。对需采用特别估值程序的证券，基金管理人及时启动特别估值程序，由估值委员会讨论议定特别估值方案并与托管行沟通后由基金运营部具体执行。

本基金管理人参与估值流程各方之间不存在任何重大利益冲突。截止报告期末本基金管理人已与中央国债登记结算有限责任公司/中证指数有限公司签署服务协议，由其按约定提供在银行间同业市场交易的债券品种/在交易所市场上市交易或挂牌转让的固定收益品种（估值处理标准另有规定的除外）的估值数据。

#### 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

无。

#### 4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

本基金在本报告期内，曾于 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日出现了连续 20 个工作日资产净值低于五千万元的情形。

## § 5 托管人报告

### 5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内，本基金托管人在对大成核心双动力混合型证券投资基金的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他法律法规和基金合同的有关规定，不存在任何损害基金份额持有人

利益的行为，完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

## 5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

本报告期内，大成核心双动力混合型证券投资基金的管理人——大成基金管理有限公司在大成核心双动力混合型证券投资基金的投资运作、基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格计算、基金费用开支等问题上，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。本报告期内，大成核心双动力混合型证券投资基金未进行利润分配。

## 5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人依法对大成基金管理有限公司编制和披露的大成核心双动力混合型证券投资基金 2016 年半年度报告中财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容进行了核查，以上内容真实、准确和完整。

## § 6 半年度财务会计报告（未经审计）

### 6.1 资产负债表

会计主体：大成核心双动力混合型证券投资基金

报告截止日：2016 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2016 年 6 月 30 日	上年度末 2015 年 12 月 31 日
<b>资产：</b>			
银行存款	6.4.3.1	12,876,301.33	13,474,448.43
结算备付金		228,077.61	82,075.45
存出保证金		4,921.60	15,582.16
交易性金融资产	6.4.3.2	36,852,797.80	39,981,409.47
其中：股票投资		36,828,534.00	39,952,844.67
基金投资		-	-
债券投资		24,263.80	28,564.80
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	6.4.3.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.3.4	-	-
应收证券清算款		-	-
应收利息	6.4.3.5	2,421.10	2,836.51
应收股利		-	-
应收申购款		118.78	82,152.87

递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.3.6	-	-
资产总计		49,964,638.22	53,638,504.89
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2016年6月30日</b>	<b>上年度末 2015年12月31日</b>
<b>负 债:</b>			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.3.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		-	1,201.06
应付赎回款		24,467.96	43,269.87
应付管理人报酬		61,039.18	67,030.81
应付托管费		10,173.18	11,171.80
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.3.7	51,798.25	30,523.58
应交税费		-	-
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.3.8	139,305.92	140,011.09
负债合计		286,784.49	293,208.21
<b>所有者权益:</b>			
实收基金	6.4.3.9	34,679,017.92	33,412,372.33
未分配利润	6.4.3.10	14,998,835.81	19,932,924.35
所有者权益合计		49,677,853.73	53,345,296.68
负债和所有者权益总计		49,964,638.22	53,638,504.89

注：报告截止日 2016 年 6 月 30 日，基金份额净值 1.433 元，基金份额总额 34,679,017.92 份。

## 6.2 利润表

会计主体：大成核心双动力混合型证券投资基金

本报告期：2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2016年1月1日至 2016年6月30日	上年度可比期间 2015年1月1日至 2015年6月30日
<b>一、收入</b>		-4,846,961.46	40,173,972.00
1. 利息收入		52,585.36	32,501.49
其中：存款利息收入	6.4.3.11	52,556.36	32,499.66
债券利息收入		29.00	1.83
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	-
其他利息收入		-	-



2. 投资收益（损失以“-”填列）		-653,220.11	37,038,224.94
其中：股票投资收益	6.4.3.12	-1,023,140.25	36,563,661.69
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.3.13	-	-
资产支持证券投资收益	6.4.3.13.1	-	-
贵金属投资收益	6.4.3.14	-	-
衍生工具收益	6.4.3.15	-	-
股利收益	6.4.3.16	369,920.14	474,563.25
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.3.17	-4,257,700.05	3,063,438.31
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.3.18	11,373.34	39,807.26
<b>减：二、费用</b>		653,996.13	1,387,660.85
1. 管理人报酬	6.4.6.2.1	362,973.90	653,608.22
2. 托管费	6.4.6.2.2	60,495.64	108,934.64
3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用	6.4.3.19	84,282.57	444,934.76
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 其他费用	6.4.3.20	146,244.02	180,183.23
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		-5,500,957.59	38,786,311.15
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		-5,500,957.59	38,786,311.15

### 6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：大成核心双动力混合型证券投资基金

本报告期：2016年1月1日至2016年6月30日

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年6月30日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	33,412,372.33	19,932,924.35	53,345,296.68
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-5,500,957.59	-5,500,957.59
三、本期基金份额交易	1,266,645.59	566,869.05	1,833,514.64



## 6.4.2 税项

### 6.4.2.1 印花税

证券（股票）交易印花税税率为 1%，由出让方缴纳。

股权分置改革过程中因非流通股股东向流通股股东支付对价而发生的股权转让，暂免征收印花税。

### 6.4.2.2 营业税、增值税、企业所得税

以发行基金方式募集资金不属于营业税征收范围，不征收营业税。

证券投资基金（封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金）管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入，免征营业税。

自 2016 年 5 月 1 日起，在全国范围内全面推开营业税改征增值税试点，金融业纳入试点范围，由缴纳营业税改为缴纳增值税。对证券投资基金（封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金）管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税；国债、地方政府债利息收入免征增值税；存款利息收入不征收增值税；质押式买入返售金融商品及持有政策性金融债券的利息收入免征增值税。

证券投资基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股权的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

股权分置改革中非流通股股东通过对价方式向流通股股东支付的股份、现金等收入，暂免征收流通股股东应缴纳的企业所得税。

### 6.4.2.3 个人所得税

个人所得税税率为 20%。

基金取得的股票的股息、红利收入、债券的利息收入及储蓄利息收入，由上市公司、债券发行企业及金融机构在向基金派发股息、红利收入、债券的利息收入及储蓄利息收入时代扣代缴个人所得税。

基金从上市公司分配取得的股息红利所得，持股期限在 1 个月以内（含 1 个月）的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在 1 个月以上至 1 年（含 1 年）的，减按 50% 计入应纳税所得额；持股期限超过 1 年的，减按 25% 计入应纳税所得额。

根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2015]101 号文《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》的规定，自 2015 年 9 月 8 日起，证券投资基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，持股期限超过 1 年的，股息红利所得暂免征收个人所得税。

股权分置改革中非流通股股东通过对价方式向流通股股东支付的股份、现金等收入，暂免征收流通股股东应缴纳的个人所得税。

暂免征收储蓄存款利息所得个人所得税。

### 6.4.3 重要财务报表项目的说明

#### 6.4.3.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2016年6月30日
活期存款	12,876,301.33
定期存款	-
其中：存款期限 1-3 个月	-
其他存款	-
合计：	12,876,301.33

#### 6.4.3.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2016年6月30日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	37,302,382.26	36,828,534.00	-473,848.26
贵金属投资-金交所 黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	24,263.80	2,263.80
	银行间市场	-	-
	合计	24,263.80	2,263.80
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	37,324,382.26	36,852,797.80	-471,584.46

#### 6.4.3.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末未持有衍生金融工具。

#### 6.4.3.4 买入返售金融资产

本基金本报告期末未持有买入返售金融资产。

#### 6.4.3.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末
----	-----

	2016 年 6 月 30 日
应收活期存款利息	2,319.98
应收定期存款利息	-
应收其他存款利息	-
应收结算备付金利息	92.43
应收债券利息	4.58
应收买入返售证券利息	-
应收申购款利息	2.13
应收黄金合约拆借孳息	-
其他	1.98
合计	2,421.10

#### 6.4.3.6 其他资产

本基金本报告期末未持有其他资产。

#### 6.4.3.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2016 年 6 月 30 日
交易所市场应付交易费用	51,798.25
银行间市场应付交易费用	-
合计	51,798.25

#### 6.4.3.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2016 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	70.46
预提费用	139,235.46
预提审计费	-
预提信息披露费	-
其他	-
合计	139,305.92

#### 6.4.3.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	33,412,372.33	33,412,372.33
本期申购	8,446,870.48	8,446,870.48
本期赎回（以“-”号填列）	-7,180,224.89	-7,180,224.89

本期末	34,679,017.92	34,679,017.92
-----	---------------	---------------

注：申购含转换入份额，赎回含转换出份额。

#### 6.4.3.10 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	20,330,727.12	-397,802.77	19,932,924.35
本期利润	-1,243,257.54	-4,257,700.05	-5,500,957.59
本期基金份额交易产生的变动数	816,522.35	-249,653.30	566,869.05
其中：基金申购款	5,076,013.18	-1,505,117.10	3,570,896.08
基金赎回款	-4,259,490.83	1,255,463.80	-3,004,027.03
本期已分配利润	-	-	-
本期末	19,903,991.93	-4,905,156.12	14,998,835.81

#### 6.4.3.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年6月30日
活期存款利息收入	52,083.07
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	-
结算备付金利息收入	407.02
其他	66.27
合计	52,556.36

#### 6.4.3.12 股票投资收益

##### 6.4.3.12.1 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年6月30日
卖出股票成交总额	27,441,406.68
减：卖出股票成本总额	28,464,546.93
买卖股票差价收入	-1,023,140.25

#### 6.4.3.13 债券投资收益

本基金本报告期内无债券投资收益。

##### 6.4.3.13.1 资产支持证券投资收益

本基金本报告期内无资产支持证券投资收益。

**6.4.3.14 贵金属投资收益**

本基金本报告期内无贵金属投资收益。

**6.4.3.15 衍生工具收益**

本基金本报告期内无衍生工具收益。

**6.4.3.16 股利收益**

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年6月30日
股票投资产生的股利收益	369,920.14
基金投资产生的股利收益	-
合计	369,920.14

**6.4.3.17 公允价值变动收益**

单位：人民币元

项目名称	本期 2016年1月1日至2016年6月30日
1. 交易性金融资产	-4,257,700.05
——股票投资	-4,253,399.05
——债券投资	-4,301.00
——资产支持证券投资	-
——贵金属投资	-
——其他	-
2. 衍生工具	-
——权证投资	-
3. 其他	-
合计	-4,257,700.05

**6.4.3.18 其他收入**

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年6月30日
基金赎回费收入	11,020.37
转换费收入	352.97
基金转换费收入	-
合计	11,373.34

注：1、本基金的赎回费率按持有期间递减，赎回费总额的 25% 归入基金资产。

2、本基金的转换费由申购补差费和转出基金的赎回费两部分构成，其中转出基金的赎回费的 25% 归入转出基金的基金资产。

**6.4.3.19 交易费用**

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年6月30日
交易所市场交易费用	84,282.57
银行间市场交易费用	-
合计	84,282.57

**6.4.3.20 其他费用**

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年6月30日
审计费用	19,890.78
信息披露费	119,344.68
银行汇划费用	1,008.56
中债登债券托管帐户维护费	6,000.00
合计	146,244.02

**6.4.4 或有事项、资产负债表日后事项的说明****6.4.4.1 或有事项**

本基金无需要说明的重大或有事项。

**6.4.4.2 资产负债表日后事项**

本基金无需做披露的资产负债表日后事项。

**6.4.5 关联方关系****6.4.5.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况**

根据本基金管理人大成基金管理有限公司(以下简称“大成基金”)董事会及股东会的有关决议,大成基金原股东广东证券股份有限公司将所持大成基金2%股权以拍卖竞买的方式转让给大成基金股东中泰信托有限责任公司。上述股权变更及修改《大成基金管理有限公司公司章程》的工商变更手续已于2016年4月25日在深圳市市场监督管理局办理完毕。

**6.4.5.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方**

关联方名称	与本基金的关系
大成基金管理有限公司	基金管理人、注册登记机构、基金销售机构
中国工商银行股份有限公司(“工商银行”)	基金托管人、基金销售机构
中泰信托有限责任公司	基金管理人的股东
光大证券股份有限公司(“光大证券”)	基金管理人的股东、基金销售机构
中国银河投资管理有限公司	基金管理人的股东



广东证券股份有限公司(“广东证券”)	基金管理人的股东(2016年4月25日前)
大成国际资产管理有限公司(“大成国际”)	基金管理人的子公司
大成创新资本管理有限公司(“大成创新资本”)	基金管理人的合营企业

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

#### 6.4.6 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

##### 6.4.6.1 通过关联方交易单元进行的交易

无。

##### 6.4.6.2 关联方报酬

###### 6.4.6.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年6 月30日	上年度可比期间 2015年1月1日至2015年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	362,973.90	653,608.22
其中：支付销售机构的客户维护费	125,415.87	233,143.06

注：基金管理费按前一日的基金资产净值的1.5%的年费率计提。计算方法如下：

$$H=E \times 1.5\% / \text{当年天数}$$

H为每日应支付的基金管理费

E为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计提，按月支付。由基金管理人向基金托管人发送基金管理费划付指令，经基金托管人复核后于次月首日起2个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人，若遇法定节假日、休息日，支付日期顺延。

###### 6.4.6.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年6月30日	上年度可比期间 2015年1月1日至2015年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	60,495.64	108,934.64

注：基金托管费按前一日的基金资产净值的0.25%的年费率计提。计算方法如下：

$$H=E \times 0.25\% / \text{当年天数}$$

H为每日应支付的基金托管费

E为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计提，按月支付。由基金管理人向基金托管人发送基金托管费划付指令，经基金托管人复核后于次月首日起 2 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金托管人，若遇法定节假日、休息日，支付日期顺延。

#### 6.4.6.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本报告期内及上年度可比期间本基金未发生与关联方进行的银行间同业市场的债券(含回购)交易。

#### 6.4.6.4 各关联方投资本基金的情况

无。

#### 6.4.6.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期		上年度可比期间	
	2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日		2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国工商银行	12,876,301.33	52,083.07	4,790,034.00	29,670.26

注：本基金的银行存款由基金托管人中国工商银行保管，并按银行间同业利率计息。

#### 6.4.6.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金于本期及上年度可比期间均未在承销期内参与关联方承销证券。

#### 6.4.6.7 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期及上年度可比期间无须作说明的其他关联交易事项。

#### 6.4.7 利润分配情况

##### 6.4.7.1 利润分配情况——非货币市场基金

本报告期内本基金无利润分配事项。

#### 6.4.8 期末（2016 年 6 月 30 日）本基金持有的流通受限证券

##### 6.4.8.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

本基金本期末无因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券。

##### 6.4.8.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单	复牌日期	复牌开盘单	数量（股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
------	------	------	------	-------	------	-------	-------	--------	--------	----

				价		价				
000818	方大化工	2016-02-15	重大事项	6.57	2016-8-23	7.23	42,500	256,909.00	279,225.00	-
002465	海格通信	2016-06-13	重大事项	12.44	-	-	22,400	333,355.05	278,656.00	-
300176	鸿特精密	2016-05-26	重大事项	30.20	-	-	6,800	136,864.52	205,360.00	-
002567	唐人神	2016-06-15	重大事项	13.98	2016-07-29	13.23	12,200	111,506.24	170,556.00	-
600019	宝钢股份	2016-06-27	重大事项	4.90	-	-	33,900	233,388.96	166,110.00	-
600035	楚天高速	2016-06-16	重大事项	5.06	2016-08-01	5.57	29,100	152,193.00	147,246.00	-
002319	乐通股份	2016-06-02	重大事项	17.28	-	-	8,000	132,960.00	138,240.00	-
000916	华北高速	2016-06-27	重大事项	5.01	-	-	27,200	132,778.00	136,272.00	-
300345	红宇新材	2016-06-21	重大事项	10.46	2016-07-19	11.46	12,200	130,509.00	127,612.00	-
600475	华光股份	2016-05-18	重大事项	14.85	-	-	8,000	129,000.00	118,800.00	-
300080	易成新能	2016-05-19	重大事项	7.76	-	-	14,800	130,308.00	114,848.00	-

注：本基金截至 2016 年 6 月 30 日止持有以上因公布的重大事项可能产生重大影响而被暂时停牌的股票，该类股票将在所公布事项的重大影响消除后，经交易所批准复牌。

#### 6.4.8.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

##### 6.4.8.3.1 银行间市场债券正回购

于本报告期末，本基金未持有从事银行间市场债券正回购交易中作为抵押的债券。

##### 6.4.8.3.2 交易所市场债券正回购

于本报告期末，本基金未持有从事交易所市场债券正回购交易中作为抵押的债券。

#### 6.4.9 金融工具风险及管理

##### 6.4.9.1 风险管理政策和组织架构

本基金在日常经营活动中由金融工具产生的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金管理人制定了政策和程序来识别及分析这些风险，并设定适当的风险限额及内部控制流程，通过可靠的管理及信息系统持续监控上述各类风险。

本基金的基金管理人奉行全面风险管理体系的建设，建立了以由高层监控(董事会合规审计

和风险控制委员会、公司投资风险控制委员会)、专业监控(监察稽核部、风险管理部)、部门互控、岗位自控构成的风险管理架构体系。本基金的基金管理人在董事会下设立合规审计和风险控制委员会,对公司整体运营风险进行监督,监督风险控制措施的执行。在管理层层面设立投资风险控制委员会,通过定期会议讨论涉及投资风险的重大议题,形成正式决议提交投委会。在业务操作层面,监察稽核部履行合规控制职责,通过定期、不定期检查内控制度的执行情况、对重大风险点以专项稽核的方式确保公司内控制度、流程得到贯彻执行。风险管理部履行风险量化评估分析职责。

#### 6.4.9.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任,或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息,导致基金资产损失和收益变化的风险。本基金均投资于具有良好信用等级的证券,且通过分散化投资以分散信用风险。本基金投资于一家上市公司发行的股票市值不超过基金资产净值的 10%,且本基金与由本基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司发行的证券,不得超过该证券的 10%。

本基金在交易所进行的交易均与中国证券登记结算有限责任公司完成证券交收和款项清算,因此违约风险发生的可能性很小;基金在进行银行间同业市场交易前均对交易对手进行信用评估,以控制相应的信用风险。

#### 6.4.9.3 流动性风险

流动性风险,是指在履行以交付现金或其他金融资产的方式结算的义务时发生资金短缺的风险。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额,另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难。本基金所持有的证券在证券交易所上市,于本期末,除附注 6.4.8 期末持有的暂时停牌等流通受限股票外,均能及时变现。此外,本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求,其上限一般不超过基金持有的可回购交易债券投资的公允价值。于资产负债表日,本基金所持有的金融负债的合同约定剩余到期日均为一年以内且不计息,可赎回基金份额净值(所有者权益)无固定到期日且不计息,因此账面余额即为未折现的合约到期现金流量。

本基金管理人每日预测本基金的流动性需求,并同时通过独立的风险管理部门设定流动性比例要求,对流动性指标进行持续的监测和分析。

#### 6.4.9.4 市场风险

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动

而发生波动的风险，包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

#### 6.4.9.4.1 利率风险

利率风险是指金融工具的公允价值或现金流量因市场利率变动而发生波动的风险。利率敏感性金融工具均面临由于市场利率上升而导致公允价值下降的风险，其中浮动利率类金融工具还面临每个付息期间结束根据市场利率重新定价时对于未来现金流影响的风险。

本基金的基金管理人定期对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控，并通过调整投资组合的久期等方法对上述利率风险进行管理。

本基金持有的大部分金融资产和金融负债不计息，因此本基金的收入及经营活动的现金流量在很大程度上独立于市场利率变化。本基金的生息资产主要为银行存款、结算备付金、存出保证金、债券投资等。下表统计了本基金的利率风险敞口。表中所示为本基金资产及负债的公允价值，并按照合约规定的重新定价日或到期日孰早者进行了分类。

##### 6.4.9.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2016年6月30日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	12,876,301.33	-	-	-	12,876,301.33
结算备付金	228,077.61	-	-	-	228,077.61
存出保证金	4,921.60	-	-	-	4,921.60
交易性金融资产	-	24,263.80	-	36,828,534.00	36,852,797.80
应收利息	-	-	-	2,421.10	2,421.10
应收申购款	-	-	-	118.78	118.78
资产总计	13,109,300.54	24,263.80	-	36,831,073.88	49,964,638.22
负债					
应付赎回款	-	-	-	24,467.96	24,467.96
应付管理人报酬	-	-	-	61,039.18	61,039.18
应付托管费	-	-	-	10,173.18	10,173.18
应付交易费用	-	-	-	51,798.25	51,798.25
其他负债	-	-	-	139,305.92	139,305.92
负债总计	-	-	-	286,784.49	286,784.49
利率敏感度缺口	13,109,300.54	24,263.80	-	36,544,289.39	49,677,853.73
上年度末 2015年12月31日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	13,474,448.43	-	-	-	13,474,448.43
结算备付金	82,075.45	-	-	-	82,075.45

存出保证金	15,582.16	-	-	-	15,582.16
交易性金融资产	-	-	28,564.80	39,952,844.67	39,981,409.47
应收利息	-	-	-	2,836.51	2,836.51
应收申购款	19,792.18	-	-	62,360.69	82,152.87
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	13,591,898.22	-	28,564.80	40,018,041.87	53,638,504.89
负债					
应付证券清算款	-	-	-	1,201.06	1,201.06
应付赎回款	-	-	-	43,269.87	43,269.87
应付管理人报酬	-	-	-	67,030.81	67,030.81
应付托管费	-	-	-	11,171.80	11,171.80
应付交易费用	-	-	-	30,523.58	30,523.58
其他负债	-	-	-	140,011.09	140,011.09
负债总计	-	-	-	293,208.21	293,208.21
利率敏感度缺口	13,591,898.22	-	28,564.80	39,724,833.66	53,345,296.68

注：表中所示为本基金资产及负债的公允价值，并按照合约规定的利率重新定价日或到期日孰早予以分类。

#### 6.4.9.4.1.2 利率风险的敏感性分析

本基金于 2016 年 6 月 30 日持有交易性债券投资占基金资产净值仅为 0.05%（2015 年 12 月 31 日：0.05%），因此当利率发生合理、可能的变动时，为交易而持有的债券公允价值的变动对年末基金资产净值无重大影响。

#### 6.4.9.4.2 外汇风险

外外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基金持有的金融工具以人民币计价，因此无重大外汇风险。

#### 6.4.9.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场交易的股票和债券，所面临的最大其他价格风险由所持有的金融工具的公允价值决定。本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险，并且本基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控。

本基金的投资范围为：股票资产占基金资产的比例范围为 60%-95%，其中权证不超过基金资产净值的 3%。固定收益类证券和现金投资比例范围为基金资产的 5%-40%。其中，资产支持证券投资比例范围为基金资产净值的 0-20%，现金或到期日在一年以内的政府债券的比例不低于基金资产净值的 5%。于 2016 年 6 月 30 日，本基金面临的其他价格风险列示如下：

## 6.4.9.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2016年6月30日		上年度末 2015年12月31日	
	公允价值	占基金 资产净 值比例 (%)	公允价值	占基金资 产净值比 例 (%)
交易性金融资产-股票投资	36,828,534.00	74.13	39,952,844.67	74.89
交易性金融资产-基金投资	-	0.00	-	0.00
交易性金融资产-贵金属投资	-	0.00	-	0.00
衍生金融资产-权证投资	-	0.00	-	0.00
其他	-	0.00	-	0.00
合计	36,828,534.00	74.13	39,952,844.67	74.89

## 6.4.9.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	下表为其他价格风险的敏感性分析，反映了在其他变量不变的假设下，证券投资价格发生合理、可能的变动时，将对基金资产净值产生的影响。正数表示可能增加基金资产净值，负数表示可能减少基金资产净值。		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2016年6月30日）	上年度末（2015年12月31日）
	75%×沪深300指数+25%×中证综合债券指数上升5%	2,790,000.00	3,324,356.70
75%×沪深300指数+25%×中证综合债券指数下降5%	-2,790,000.00	-3,324,356.70	

## 6.4.10 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

无。

## §7 投资组合报告

## 7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	36,828,534.00	73.71
	其中：股票	36,828,534.00	73.71
2	固定收益投资	24,263.80	0.05
	其中：债券	24,263.80	0.05

	资产支持证券	-	0.00
3	贵金属投资	-	0.00
4	金融衍生品投资	-	0.00
5	买入返售金融资产	-	0.00
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	0.00
6	银行存款和结算备付金合计	13,104,378.94	26.23
7	其他各项资产	7,461.48	0.01
8	合计	49,964,638.22	100.00

## 7.2 期末按行业分类的股票投资组合

### 7.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

金额单位：人民币元

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	424,300.00	0.85
B	采矿业	784,920.00	1.58
C	制造业	18,561,451.44	37.36
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	1,340,084.00	2.70
E	建筑业	915,981.00	1.84
F	批发和零售业	1,438,807.00	2.90
G	交通运输、仓储和邮政业	2,002,548.00	4.03
H	住宿和餐饮业	130,284.00	0.26
I	信息传输、软件和信息技术服务业	802,992.80	1.62
J	金融业	7,996,705.12	16.10
K	房地产业	1,286,305.00	2.59
L	租赁和商务服务业	159,444.00	0.32
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	389,204.64	0.78
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	595,507.00	1.20
S	综合	-	0.00
	合计	36,828,534.00	74.13

### 7.2.2 报告期末按行业分类的沪港通投资股票投资组合

无。



## 7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	601009	南京银行	90,360	848,480.40	1.71
2	601939	建设银行	174,500	828,875.00	1.67
3	002142	宁波银行	54,200	801,076.00	1.61
4	601328	交通银行	142,000	799,460.00	1.61
5	601166	兴业银行	50,100	763,524.00	1.54
6	600016	民生银行	82,400	735,832.00	1.48
7	601318	中国平安	21,468	687,834.72	1.38
8	000858	五粮液	21,100	686,383.00	1.38
9	600109	国金证券	48,400	652,432.00	1.31
10	600705	中航资本	107,600	632,688.00	1.27
11	000750	国海证券	84,900	627,411.00	1.26
12	601211	国泰君安	34,800	619,092.00	1.25
13	000895	双汇发展	25,600	534,528.00	1.08
14	600048	保利地产	52,900	456,527.00	0.92
15	600068	葛洲坝	68,400	398,088.00	0.80
16	601800	中国交建	37,700	396,981.00	0.80
17	600383	金地集团	36,200	375,032.00	0.75
18	600060	海信电器	21,200	374,816.00	0.75
19	000413	东旭光电	43,200	371,088.00	0.75
20	600703	三安光电	17,700	353,469.00	0.71
21	600690	青岛海尔	39,400	349,872.00	0.70
22	600547	山东黄金	8,400	326,844.00	0.66
23	600031	三一重工	62,200	312,244.00	0.63
24	000425	徐工机械	100,200	306,612.00	0.62
25	601238	广汽集团	12,600	295,974.00	0.60
26	600518	康美药业	18,800	285,572.00	0.57
27	600100	同方股份	19,000	284,240.00	0.57
28	002594	比亚迪	4,600	280,646.00	0.56
29	000818	方大化工	42,500	279,225.00	0.56
30	002465	海格通信	22,400	278,656.00	0.56
31	601098	中南传媒	15,300	277,083.00	0.56
32	601607	上海医药	15,300	276,165.00	0.56
33	600642	申能股份	47,500	272,650.00	0.55
34	000768	中航飞机	13,800	271,722.00	0.55
35	600741	华域汽车	19,200	268,992.00	0.54

36	600795	国电电力	89,800	263,114.00	0.53
37	000623	吉林敖东	10,400	259,480.00	0.52
38	002422	科伦药业	16,600	255,806.00	0.51
39	600196	复星医药	13,400	254,868.00	0.51
40	300070	碧水源	17,003	253,004.64	0.51
41	000630	铜陵有色	97,800	248,412.00	0.50
42	600023	浙能电力	48,600	247,374.00	0.50
43	000063	中兴通讯	17,146	245,873.64	0.49
44	000917	电广传媒	14,200	234,726.00	0.47
45	000156	华数传媒	12,600	233,730.00	0.47
46	300315	掌趣科技	21,400	224,486.00	0.45
47	600804	鹏博士	12,000	218,760.00	0.44
48	600221	海南航空	67,800	214,926.00	0.43
49	600340	华夏幸福	8,700	212,106.00	0.43
50	600271	航天信息	8,800	209,440.00	0.42
51	601111	中国国航	30,600	206,856.00	0.42
52	300176	鸿特精密	6,800	205,360.00	0.41
53	002450	康得新	11,774	201,335.40	0.41
54	600350	山东高速	37,800	200,340.00	0.40
55	601333	广深铁路	50,000	195,500.00	0.39
56	002202	金风科技	12,900	195,177.00	0.39
57	600028	中国石化	40,800	192,576.00	0.39
58	600891	秋林集团	15,000	191,550.00	0.39
59	600688	上海石化	31,400	191,540.00	0.39
60	600707	彩虹股份	16,200	191,160.00	0.38
61	600232	金鹰股份	14,000	184,660.00	0.37
62	000400	许继电气	11,800	182,192.00	0.37
63	002024	苏宁云商	16,600	180,276.00	0.36
64	002395	双象股份	6,500	176,930.00	0.36
65	002567	唐人神	12,200	170,556.00	0.34
66	601216	君正集团	22,800	170,316.00	0.34
67	002454	松芝股份	9,200	167,256.00	0.34
68	002746	仙坛股份	4,000	166,720.00	0.34
69	600019	宝钢股份	33,900	166,110.00	0.33
70	000709	河钢股份	58,700	162,599.00	0.33
71	002087	新野纺织	20,600	162,534.00	0.33
72	603609	禾丰牧业	10,200	161,466.00	0.33
73	600415	小商品城	25,800	159,444.00	0.32
74	002438	江苏神通	7,200	157,608.00	0.32

75	600398	海澜之家	13,700	154,810.00	0.31
76	002734	利民股份	4,600	154,514.00	0.31
77	000910	大亚科技	10,000	154,500.00	0.31
78	002579	中京电子	9,800	153,664.00	0.31
79	600382	广东明珠	9,600	153,600.00	0.31
80	603100	川仪股份	9,600	153,216.00	0.31
81	600310	桂东电力	18,600	152,706.00	0.31
82	300194	福安药业	7,000	151,550.00	0.31
83	002218	拓日新能	14,800	150,960.00	0.30
84	002045	国光电器	10,400	148,512.00	0.30
85	000601	韶能股份	14,200	148,390.00	0.30
86	300138	晨光生物	8,880	148,296.00	0.30
87	601965	中国汽研	15,400	147,994.00	0.30
88	601137	博威合金	11,000	147,510.00	0.30
89	600035	楚天高速	29,100	147,246.00	0.30
90	603128	华贸物流	15,000	147,150.00	0.30
91	600210	紫江企业	25,200	145,152.00	0.29
92	300218	安利股份	9,400	144,666.00	0.29
93	000922	佳电股份	14,800	143,560.00	0.29
94	300200	高盟新材	8,800	143,440.00	0.29
95	300193	佳士科技	13,800	143,382.00	0.29
96	300270	中威电子	8,400	143,052.00	0.29
97	002362	汉王科技	5,200	142,948.00	0.29
98	600470	六国化工	19,000	142,690.00	0.29
99	002374	丽鹏股份	20,780	142,343.00	0.29
100	601116	三江购物	12,200	142,008.00	0.29
101	600537	亿晶光电	18,400	141,864.00	0.29
102	603010	万盛股份	6,400	141,568.00	0.28
103	300069	金利华电	4,400	141,240.00	0.28
104	300415	伊之密	8,200	140,712.00	0.28
105	002097	山河智能	13,600	139,944.00	0.28
106	002319	乐通股份	8,000	138,240.00	0.28
107	600188	兖州煤业	12,600	137,844.00	0.28
108	600529	山东药玻	7,800	137,358.00	0.28
109	002523	天桥起重	23,400	136,422.00	0.27
110	000916	华北高速	27,200	136,272.00	0.27
111	000430	张家界	12,000	136,200.00	0.27
112	600353	旭光股份	16,400	135,628.00	0.27
113	600480	凌云股份	9,600	135,360.00	0.27

114	002083	孚日股份	21,400	134,820.00	0.27
115	002039	黔源电力	7,000	134,610.00	0.27
116	000333	美的集团	5,650	134,018.00	0.27
117	300129	泰胜风能	19,100	133,700.00	0.27
118	300086	康芝药业	11,600	133,400.00	0.27
119	603167	渤海轮渡	13,400	133,330.00	0.27
120	600987	航民股份	11,000	133,320.00	0.27
121	000429	粤高速 A	24,200	133,100.00	0.27
122	300018	中元股份	10,400	132,184.00	0.27
123	002406	远东传动	15,400	131,978.00	0.27
124	300094	国联水产	9,000	131,580.00	0.26
125	002394	联发股份	8,700	131,370.00	0.26
126	002404	嘉欣丝绸	16,600	130,974.00	0.26
127	002026	山东威达	10,400	130,728.00	0.26
128	603008	喜临门	7,600	130,644.00	0.26
129	002187	广百股份	10,600	130,592.00	0.26
130	600258	首旅酒店	6,600	130,284.00	0.26
131	000488	晨鸣纸业	16,400	130,216.00	0.26
132	601218	吉鑫科技	24,800	129,952.00	0.26
133	600558	大西洋	28,500	129,675.00	0.26
134	000153	丰原药业	12,400	127,844.00	0.26
135	600157	永泰能源	32,400	127,656.00	0.26
136	300345	红宇新材	12,200	127,612.00	0.26
137	000698	沈阳化工	19,500	127,530.00	0.26
138	002457	青龙管业	12,400	127,348.00	0.26
139	000656	金科股份	33,200	126,824.00	0.26
140	600515	海航基础	9,800	126,420.00	0.25
141	002086	东方海洋	14,400	126,000.00	0.25
142	002144	宏达高科	6,400	125,824.00	0.25
143	002238	天威视讯	8,640	125,020.80	0.25
144	000952	广济药业	7,400	124,764.00	0.25
145	600449	宁夏建材	13,800	124,476.00	0.25
146	603366	日出东方	14,800	124,320.00	0.25
147	002258	利尔化学	13,200	123,948.00	0.25
148	601188	龙江交通	30,600	123,930.00	0.25
149	000507	珠海港	22,600	123,848.00	0.25
150	600106	重庆路桥	17,400	123,192.00	0.25
151	000876	新希望	14,600	121,472.00	0.24
152	000301	东方市场	28,000	121,240.00	0.24

153	002060	粤水电	17,600	120,912.00	0.24
154	002333	罗普斯金	12,400	120,776.00	0.24
155	002607	亚夏汽车	10,400	119,496.00	0.24
156	000597	东北制药	13,400	118,992.00	0.24
157	600475	华光股份	8,000	118,800.00	0.24
158	000906	物产中拓	10,000	118,700.00	0.24
159	600798	宁波海运	23,800	116,858.00	0.24
160	600889	南京化纤	10,800	116,424.00	0.23
161	600159	大龙地产	24,800	115,816.00	0.23
162	600356	恒丰纸业	10,800	115,560.00	0.23
163	300080	易成新能	14,800	114,848.00	0.23
164	600585	海螺水泥	7,200	104,688.00	0.21
165	002179	中航光电	2,300	99,636.00	0.20
166	300161	华中数控	3,000	91,950.00	0.19
167	300144	宋城演艺	3,400	84,694.00	0.17
168	600973	宝胜股份	9,280	73,126.40	0.15
169	600273	嘉化能源	8,000	71,280.00	0.14
170	601992	金隅股份	9,000	69,750.00	0.14
171	600887	伊利股份	1,400	23,338.00	0.05
172	000625	长安汽车	900	12,303.00	0.02
173	002470	金正大	1,000	8,050.00	0.02

#### 7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

##### 7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	002142	宁波银行	783,333.00	1.47
2	600016	民生银行	769,731.80	1.44
3	601328	交通银行	769,640.00	1.44
4	600109	国金证券	650,777.00	1.22
5	000750	国海证券	647,635.00	1.21
6	601211	国泰君安	646,580.23	1.21
7	600705	中航资本	645,295.00	1.21
8	000895	双汇发展	543,749.00	1.02
9	600383	金地集团	437,689.00	0.82
10	600068	葛洲坝	419,986.00	0.79
11	600031	三一重工	343,344.00	0.64

12	000425	徐工机械	343,185.00	0.64
13	600690	青岛海尔	341,477.00	0.64
14	000413	东旭光电	338,472.00	0.63
15	601238	广汽集团	295,536.00	0.55
16	002594	比亚迪	292,590.00	0.55
17	600741	华域汽车	287,176.45	0.54
18	000630	铜陵有色	270,417.00	0.51
19	600795	国电电力	268,951.00	0.50
20	000623	吉林敖东	268,472.00	0.50

注：本期累计买入金额指买入成交金额（成交单价乘以成交数量），不考虑相关交易费用。

#### 7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	601169	北京银行	1,233,854.50	2.31
2	000001	平安银行	1,017,744.00	1.91
3	000686	东北证券	626,026.20	1.17
4	600837	海通证券	625,869.20	1.17
5	601009	南京银行	625,658.00	1.17
6	601377	兴业证券	584,957.00	1.10
7	000776	广发证券	509,728.00	0.96
8	300124	汇川技术	499,329.00	0.94
9	002081	金螳螂	465,330.00	0.87
10	600009	上海机场	432,366.70	0.81
11	601318	中国平安	419,694.00	0.79
12	601668	中国建筑	419,008.00	0.79
13	000039	中集集团	408,931.00	0.77
14	600660	福耀玻璃	402,111.00	0.75
15	000333	美的集团	382,352.00	0.72
16	002415	海康威视	379,949.00	0.71
17	600038	中直股份	368,762.00	0.69
18	300015	爱尔眼科	360,286.00	0.68
19	600066	宇通客车	354,017.00	0.66
20	300017	网宿科技	349,644.40	0.66

注：本期累计卖出金额指卖出成交金额（成交单价乘以成交数量），不考虑相关交易费用。

## 7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	29,593,635.31
卖出股票收入（成交）总额	27,441,406.68

注：上述金额均指成交金额（成交单价乘以成交数量），不考虑相关交易费用。

## 7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	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	-	0.00
	其中：政策性金融债	-	0.00
4	企业债券	-	0.00
5	企业短期融资券	-	0.00
6	中期票据	-	0.00
7	可转债（可交换债）	24,263.80	0.05
8	同业存单	-	0.00
9	其他	-	0.00
10	合计	24,263.80	0.05

## 7.6 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

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	110031	航信转债	220	24,263.80	0.05

## 7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有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。

## 7.8 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贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

## 7.9 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。

## 7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

## 7.10.1 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。

### 7.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期末未投资股指期货。

### 7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

#### 7.11.1 本期国债期货投资政策

本基金本报告期末持有国债期货。

#### 7.11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末持有国债期货。

#### 7.11.3 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末持有国债期货。

### 7.12 投资组合报告附注

7.12.1 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。

7.12.2 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股票。

#### 7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	4,921.60
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	2,421.10
5	应收申购款	118.78
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	7,461.48

#### 7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
1	110031	航信转债	24,263.80	0.05



**7.12.5 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未存在流通受限情况。

**7.12.6 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。

**§ 8 基金份额持有人信息****8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构**

份额单位：份

持有人户数 (户)	户均持有的 基金份额	持有人结构			
		机构投资者		个人投资者	
		持有份额	占总份 额比例	持有份额	占总份 额比例
3,631	9,550.82	-	0.00%	34,679,017.92	100.00%

注：持有人户数为有效户数，即存量份额大于零的账户。

**8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况**

项目	持有份额总数（份）	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	-	0.000%

**8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况**

项目	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	0
本基金基金经理持有本开放式基金	0

**§ 9 开放式基金份额变动**

单位：份

基金合同生效日（2010年6月22日）基金份额总额	1,173,262,454.69
本报告期期初基金份额总额	33,412,372.33
本报告期基金总申购份额	8,446,870.48
减：本报告期基金总赎回份额	7,180,224.89

本报告期基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-
本报告期期末基金份额总额	34,679,017.92

## § 10 重大事件揭示

### 10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内无基金份额持有人大会决议。

### 10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

一、基金管理人的重大人事变动

1、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。

二、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

无。

### 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内没有涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

### 10.4 基金投资策略的改变

本基金投资策略在本报告期内没有重大改变。

### 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金聘任的为本基金审计的会计师事务所为安永华明会计师事务所（特殊普通合伙），该事务所自基金合同生效日起为本基金提供审计服务至今。

### 10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期，本基金管理人、托管人及高级管理人员未受到监管部门稽查或处罚。

### 10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

#### 10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

	股票交易	应支付该券商的佣金	
--	------	-----------	--

	交易单元 数量	成交金额	占当期股票 成交总额的比 例	佣金	占当期佣金 总量的比例	备注
申万宏源	1	29,584,609.66	52.05%	26,960.15	52.05%	-
中信证券	1	27,254,814.23	47.95%	24,838.10	47.95%	-
华创证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-

注：根据中国证监会颁布的《关于完善证券投资基金交易席位制度有关问题的通知》（证监基金字[2007]48号）的有关规定，本公司制定了租用证券公司交易单元的选择标准和程序。

租用证券公司交易单元的选择标准主要包括：

- （一）财务状况良好，最近一年无重大违规行为；
- （二）经营行为规范，内控制度健全，能满足各投资组合运作的保密性要求；
- （三）研究实力较强，能提供包括研究报告、路演服务、协助进行上市公司调研等研究服务；
- （四）具备各投资组合运作所需的高效、安全的通讯条件，有足够的交易和清算能力，满足各投资组合证券交易需要；
- （五）能提供投资组合运作、管理所需的其他券商服务；
- （六）相关基金合同、资产管理合同以及法律法规规定的其他条件。

租用证券公司交易单元的程序：首先根据租用证券公司交易单元的选择标准形成《券商服务评价表》，然后根据评分高低进行选择基金交易单元。

本报告期内租用交易单元变更情况：无。

#### 10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

无。

#### 10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	大成核心双动力混合型证券投资基金 2015 年第 4 季度报告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2016 年 1 月 20 日
2	大成基金管理有限公司关于公司旗下部分基金估值调整的公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2016 年 1 月 20 日
3	大成基金管理有限公司关于公司旗下部分基金估值调整的公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2016 年 1 月 27 日
4	大成核心双动力混合型证券投资基金更新招募说明书（2015 年第 2 期）	中国证监会指定报刊及本公司网站	2016 年 2 月 5 日
5	大成基金管理有限公司关于公司旗下部分基金估值调整的公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2016 年 3 月 1 日

6	大成核心双动力混合型证券投资基金增聘基金经理的公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2016 年 3 月 5 日
7	大成核心双动力混合型证券投资基金变更基金经理的公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2016 年 3 月 9 日
8	大成基金管理有限公司关于公司旗下部分基金估值调整的公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2016 年 3 月 22 日
9	大成核心双动力混合型证券投资基金 2015 年年度报告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2016 年 3 月 26 日
10	大成核心双动力混合型证券投资基金 2015 年年度报告摘要	中国证监会指定报刊及本公司网站	2016 年 3 月 26 日
11	大成核心双动力混合型证券投资基金 2016 年第 1 季度报告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2016 年 4 月 22 日
12	大成基金管理有限公司关于基金经理暂停履职的公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2016 年 5 月 26 日
13	大成基金管理有限公司关于因指数熔断调整公司旗下部分公募基金开放时间的公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2016 年 1 月 5 日
14	关于旗下场内基金在指数熔断期间暂停申购赎回业务的提示性公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2016 年 1 月 6 日
15	大成基金管理有限公司关于因指数熔断调整公司旗下部分公募基金开放时间的公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2016 年 1 月 8 日
16	大成基金管理有限公司关于养老金账户通过直销中心申购旗下部分基金费率优惠的公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2016 年 1 月 18 日
17	大成基金管理有限公司关于降低旗下部分开放式基金申购、赎回、转换转出及最低持有份额数额限制的公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2016 年 1 月 30 日
18	大成基金管理有限公司关于增加上海凯石财富基金销售有限公司代销公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2016 年 2 月 18 日
19	大成基金关于旗下部分基金增加深圳前海微众银行股份有限公司为代销机构的公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2016 年 2 月 27 日
20	大成基金管理有限公司关于增加北京葱次方资产管理有限公司为开放式基金代销机构及相关费率优惠的公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2016 年 3 月 1 日
21	大成基金管理有限公司关于增加徽商期货有限责任公司为开放式基金代销机构并开通相关业务的公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2016 年 3 月 12 日

22	关于增加深圳市金斧子投资咨询有限公司为开放式基金代销机构及相关费率优惠的公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2016 年 3 月 17 日
23	大成基金管理有限公司关于旗下基金实行网上直销申购费率优惠的公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2016 年 3 月 18 日
24	大成基金管理有限公司关于增加万和证券有限责任公司为开放式基金代销机构并开通相关业务的公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2016 年 3 月 26 日
25	关于大成基金管理有限公司上海理财中心业务变更的公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2016 年 3 月 29 日
26	大成基金管理有限公司关于支付宝基金支付业务下线的公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2016 年 4 月 18 日
27	大成基金管理来有限公司关于股权变更及修改《公司章程》的公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2016 年 4 月 27 日
28	大成基金管理有限公司关于增加奕丰金融服务（深圳）有限公司为开放式基金代销机构并开通相关业务的公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2016 年 4 月 30 日
29	大成基金管理有限公司关于旗下部分基金增加北京钱景财富投资管理有限公司为代销机构的公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2016 年 5 月 5 日
30	大成基金管理有限公司关于增加深圳市金斧子投资咨询有限公司为开放式基金代销机构并开通相关业务的公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2016 年 5 月 5 日
31	大成基金管理有限公司关于增加珠海盈米财富管理有限公司为开放式基金代销机构并开通相关业务的公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2016 年 5 月 7 日
32	大成基金管理有限公司关于旗下部分基金增加上海好买基金销售有限公司为代销机构的公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2016 年 5 月 10 日
33	大成基金管理有限公司关于增加武汉市伯嘉基金销售有限公司为开放式基金代销机构并开通相关业务的公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2016 年 5 月 17 日
34	大成基金管理有限公司关于增加泰诚财富基金销售（大连）有限公司为开放式基金代销机构并开通相关业务的公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2016 年 6 月 22 日
35	大成基金管理有限公司关于高级	中国证监会指定报	2016 年 6 月 25 日

	管理人员变更的公告	刊及本公司网站	
--	-----------	---------	--

### § 11 影响投资者决策的其他重要信息

根据 2016 年 4 月 27 日《大成基金管理有限公司关于股权变更及修改《公司章程》的公告》，根据大成基金管理有限公司（以下简称“本公司”）第六届董事会第十四次会议和 2016 年第一次临时股东大会的有关决议，本公司原股东广东证券股份有限公司通过其破产管理人将所持本公司 2% 股权（对应出资额 400 万元）以拍卖竞买的方式转让给本公司股东中泰信托有限责任公司，广东证券股份有限公司退出本公司投资，中泰信托有限责任公司所持本公司股权增至 50%（对应出资额 1 亿元），同时，就本公司股权变更的相关内容修改《大成基金管理有限公司公司章程》。本公司股权变更及修改《大成基金管理有限公司公司章程》的工商变更手续已于 2016 年 4 月 25 日在深圳市市场监督管理局办理完毕。

### § 12 备查文件目录

#### 12.1 备查文件目录

- 1、中国证监会批准设立《大成核心双动力股票型证券投资基金》的文件；
- 2、《大成核心双动力股票型证券投资基金基金合同》；
- 3、《大成核心双动力股票型证券投资基金基金托管协议》；
- 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。

#### 12.2 存放地点

备查文件存放在本基金管理人和托管人的办公住所。

#### 12.3 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。

投资者对本报告书如有疑问，可咨询本基金管理人大成基金管理有限公司。

客户服务中心电话：400-888-5558（免长途通话费用）

国际互联网址：<http://www.dcfund.com.cn>

大成基金管理有限公司  
2016 年 8 月 25 日