

# 大成核心双动力混合型证券投资基金 2020 年中期报告

2020 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：2020 年 8 月 28 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。本中期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 2020 年 8 月 27 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。

本报告财务资料未经审计。

本报告期自 2020 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	9
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	9
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	10
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	10
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	11
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	12
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	12
<b>§ 5 托管人报告</b>	<b>12</b>
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	12
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	12
5.3 托管人对本中期报告中财务信息内容的真实、准确和完整发表意见	12
<b>§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）</b>	<b>12</b>
6.1 资产负债表	12
6.2 利润表	14
6.3 所有者权益（基金净值）变动表	15
6.4 报表附注	16
<b>§ 7 投资组合报告</b>	<b>32</b>
7.1 期末基金资产组合情况	32
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	32
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	33
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	36
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	37
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	38

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 .....	38
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 .....	38
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 .....	38
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明 .....	38
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 .....	38
7.12 投资组合报告附注 .....	38
<b>§ 8 基金份额持有人信息 .....</b>	<b>39</b>
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....	39
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....	39
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情况 .....	39
<b>§ 9 开放式基金份额变动 .....</b>	<b>40</b>
<b>§ 10 重大事件揭示 .....</b>	<b>40</b>
10.1 基金份额持有人大会决议 .....	40
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 .....	40
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....	40
10.4 基金投资策略的改变 .....	40
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....	40
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 .....	40
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	41
10.8 其他重大事件 .....	42
<b>§ 11 影响投资者决策的其他重要信息 .....</b>	<b>43</b>
11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况 .....	43
11.2 影响投资者决策的其他重要信息 .....	43
<b>§ 12 备查文件目录 .....</b>	<b>43</b>
12.1 备查文件目录 .....	43
12.2 存放地点 .....	43
12.3 查阅方式 .....	44

## § 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
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	132,469,497.31 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	赵冰
	联系电话	0755-83183388
	电子邮箱	office@dcfund.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	吴庆斌	陈四清

### 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》
登载基金中期报告正文的管理人互联网网址	www.dcfund.com.cn
基金中期报告备置地点	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(2020年1月1日-2020年6月30日)
本期已实现收益	11,883,755.21
本期利润	11,795,325.59
加权平均基金份额本期利润	0.1070
本期加权平均净值利润率	9.50%
本期基金份额净值增长率	7.14%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2020年6月30日)
期末可供分配利润	26,671,080.77
期末可供分配基金份额利润	0.2013
期末基金资产净值	159,140,578.08
期末基金份额净值	1.201
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2020年6月30日)
基金份额累计净值增长率	95.20%

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

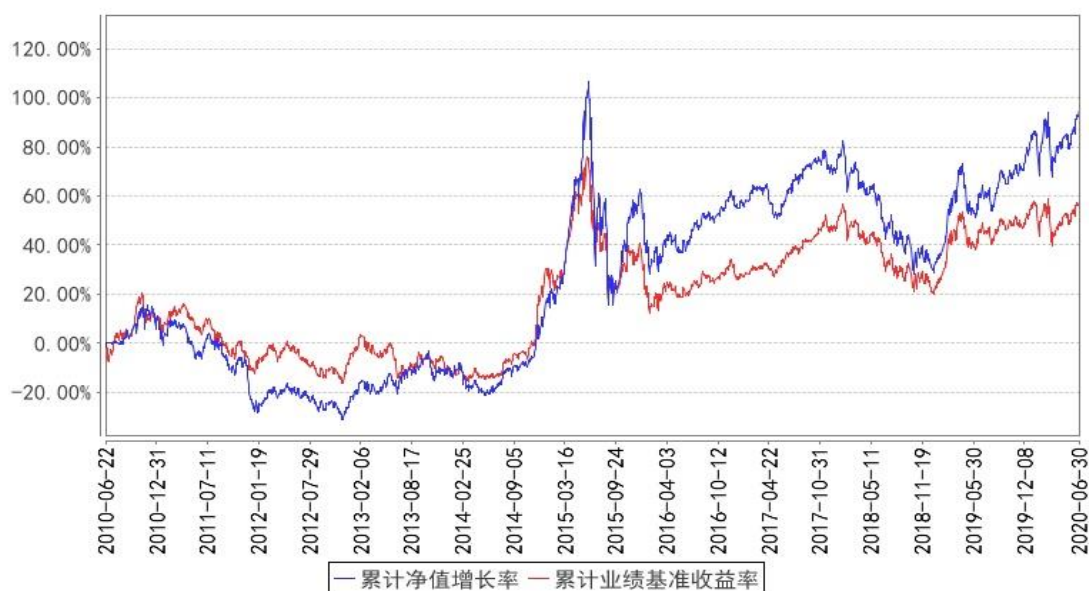
#### 3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

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	7.81%	0.71%	5.53%	0.67%	2.28%	0.04%
过去三个月	11.93%	0.75%	9.55%	0.67%	2.38%	0.08%

过去六个月	7.14%	1.36%	2.09%	1.13%	5.05%	0.23%
过去一年	21.93%	1.09%	8.26%	0.91%	13.67%	0.18%
过去三年	20.49%	1.10%	15.45%	0.94%	5.04%	0.16%
自基金合同生效起至今	95.20%	1.30%	57.91%	1.09%	37.29%	0.21%

### 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

大成核心双动力混合累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：1、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。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。2、本基金于 2015 年 7 月 22 日由大成核心双动力股票型证券投资基金更名为大成核心双动力混合型证券投资基金。

## § 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%)。主要业务是公募基金的募集、销售和管理，还具有全国社保基金投资管理、基本养老保险投资管理、受托管理保险资金、保险保障基金投资管理、特定客户资产管理和 QDII 业务资格。

经过二十年的稳健发展，公司形成了强大稳固的综合实力。公司旗下基金产品齐全、风格多样，构建了涵盖股票型基金、混合型基金、指数型基金、债券型基金和货币市场基金的完备产品线。截至 2020 年 6 月 30 日，公司管理公募基金产品数量共 103 只。

#### 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		
张钟玉	本基金基金经理	2015 年 2 月 28 日	-	10 年	会计学硕士。2010 年 7 月加入大成基金管理有限公司，曾担任研究部研究员、数量与指数投资部数量分析师、基金经理助理。2015 年 2 月 28 日起任大成核心双动力混合型证券投资基金基金经理（更名前为大成核心双动力股票型证券投资基金）。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、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 日起任大成沪深 300 指数证券投资基金基金经理。2019 年 9 月 26 日起任大成 MSCI 中国 A 股质优价值 100 交易型开放式指数证券投资基金、大成 MSCI 中国 A 股质优价值 100 交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理。具有基金从业资格。国籍：中国
苏秉毅	本基金基金经理，数量与指数投资部副总监	2016 年 3 月 4 日	-	16 年	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，曾担任规划发展部高级产品设计师、数量与指数投资部基金经理助理，现任数量与指数投资部副总监。2012 年 8 月 28 日至 2014 年 1 月 23 日任大成中证 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。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。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 日起任大成核心双动力混合型证券投资基金、大成沪深 300 指数证券投资基金基金经理。2018 年 6 月 26 日起任大成景恒混合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。

3、本基金经理张钟玉自 2020 年 6 月 29 日起休产假。在产假期间，由共同管理该基金的基金经理苏秉毅先生继续管理。上述事项已按有关法规进行披露并向中国证监会深圳证监局备案。

#### 4.1.3 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理同时管理的产品情况

无。

#### 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

报告期内，本基金管理人严格遵守《证券法》、《证券投资基金法》等有关法律法规及基金合同、基金招募说明书等有关基金法律文件的规定，以取信于市场、取信于社会投资公众为宗旨，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在规范基金运作和严格控制投资风险的前提下，为基金份额持有人谋求最大利益，无损害基金份额持有人利益的行为。

#### 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。基金管理人运用统计分析方法和工具，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进行分析。分析结果表明：债券交易同向交易频率较低；部分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，但结合交易价差专项统

计分析，未发现违反公平交易原则的异常情况。

### 4.3.2 异常交易行为的专项说明

报告期内，基金管理人旗下所有投资组合未发现存在异常交易行为。主动投资组合间股票交易存在 1 笔同日反向交易，原因为组合流动性需要。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；主动投资组合间债券交易存在 1 笔同日反向交易，原因为组合流动性需要。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。

## 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，由于史无前例的疫情，宏观经济运行偏离了既有轨道，外部环境也面临巨大变局。尽管疫情已经得到一定控制，但短时间内仍无法根治，持续影响社会运作。巨震之下，保障民生、维持社会稳定是政府的首要目标，宽松的货币政策和积极的财政政策成为必然选择。相对于国内形势，海外疫情更为严重，世界格局也发生了一定程度的变化。

股票市场同样波动极大。以春节前后新冠肺炎的爆发为转折点，节后市场一度暴跌，相关部门及时出手，股市从流动性危机的边缘被挽救回来，并在流动性和情绪驱动下走出一波反弹行情。三月份海外疫情进一步蔓延并引发了各类资产的史诗级波动，也导致了 A 股产生系统性调整，随后市场利空出尽站稳，并走出了一波可观的普涨行情。

经过反复剧烈波动，上半年市场基准沪深 300 指数小幅上涨 1.64%。行业和风格分化较大，机构持仓较为集中的板块优势明显。成长风格大幅领先价值风格，创业板指成为上半年表现最为优异的主流宽基指数。在行业板块方面，医药生物一枝独秀，消费、科技依然表现较好，“赛道”优势淋漓尽致；而采掘、银行等传统行业则表现较弱。

报告期内本基金基于基金契约，精选沪深 300 成分股构建了核心组合，同时选择业绩持续增长、估值合理的成长股作为进攻组合。

### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末本基金份额净值为 1.201 元；本报告期基金份额净值增长率为 7.14%，业绩比较基准收益率为 2.09%。

## 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，宏观经济局面依然严峻。新冠疫情已经给世界经济带来了巨大的损失，在短期内也难以看到问题解决的曙光。雪上加霜的是，由此引起的全球范围社会撕裂，形成了经济复苏

的巨大障碍。

对于股票市场，我们持总体中性、略偏乐观的观点。尽管基本面并不理想，股票市场走势却并不仅仅反映当前经济形势，有望展现出更强的韧性。近年来，股票市场得到国家层面前所未有的重视，在当前局面下有望成为支持经济、发展科技、推动改革的抓手。在监管部门的呵护下，股市下半年有望继续平稳运行，系统性大幅上涨或下跌的可能性都较小，且不乏结构性的机会，风格切换可能较为频繁。

另一方面，即便市场平稳运行，也不排除会有阶段性、局部回撤。当前部分股票估值已非常高，连乐观的未来增长预期也不足以支撑其估值水平，若出现流动性边际收紧等利空，股价开始回归合理区间的话，跌幅将相当可观。此外，国际形势不稳，我们也要警惕小概率高烈度风险事件的发生，不可过度乐观。

我们将继续精选受益于稳增长政策、消费升级等的蓝筹股构建核心组合，同时选择受益于经济结构调整、业绩持续增长、估值合理的成长个股进行投资。

#### 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、数量与指数投资部、大类资产配置部、交易管理部、风险管理部、基金运营部、监察稽核部指定人员组成。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五名投资组合经理。

股票投资部、研究部、固定收益总部、数量与指数投资部、大类资产配置部、风险管理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；交易管理部负责关注相关投资品种的流动性状况，协助反馈其市场交易信息；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人员执行，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，投资组合经理作为估值小组成员，对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及中证指数有限公司签署服务协议，由中央国债登记结算有限责任公司按约定提供银行间同业市场的估值数据，由中证指数有限公司按约定提供交易所交易的债券品种的估值数据和流通受限股票的折扣率数据。

#### 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金管理人将严格按照本基金基金合同的规定进行收益分配。本报告期内本基金无收益分配事项。

#### 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

无。

## § 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 托管人对本中期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 2020 年中期报告中财务指标、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：2020 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2020 年 6 月 30 日	上年度末 2019 年 12 月 31 日
<b>资产：</b>			
银行存款	6.4.3.1	25,123,206.73	16,697,848.68
结算备付金		585,018.70	-
存出保证金		23,897.81	28,900.86
交易性金融资产	6.4.3.2	134,354,145.44	94,222,049.41
其中：股票投资		134,354,145.44	94,222,049.41
基金投资		-	-
债券投资		-	-
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		25,309.48	1,256.56
应收利息	6.4.3.5	2,318.33	3,075.23
应收股利		-	-
应收申购款		28,662.78	9,043.82
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.3.6	-	-
资产总计		160,142,559.27	110,962,174.56
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2020 年 6 月 30 日</b>	<b>上年度末 2019 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		-	-
应付赎回款		387,969.36	294,525.94
应付管理人报酬		189,868.48	139,570.82
应付托管费		31,644.74	23,261.82
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.3.7	227,348.09	58,224.33
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	165,150.52	131,042.26
负债合计		1,001,981.19	646,625.17
<b>所有者权益：</b>			

实收基金	6.4.3.9	132,469,497.31	98,448,114.79
未分配利润	6.4.3.10	26,671,080.77	11,867,434.60
所有者权益合计		159,140,578.08	110,315,549.39
负债和所有者权益总计		160,142,559.27	110,962,174.56

注：报告截止日 2020 年 06 月 30 日，基金份额净值 1.201 元，基金份额总额 132,469,497.31 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：2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期	上年度可比期间
		2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日	2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日
一、收入		13,489,625.88	17,683,902.67
1. 利息收入		52,189.03	49,462.12
其中：存款利息收入	6.4.3.11	52,189.03	49,462.12
债券利息收入		-	-
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	-
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		13,511,758.43	7,270,615.95
其中：股票投资收益	6.4.3.12	11,987,494.14	6,359,955.74
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		-	-
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	1,524,264.29	910,660.21
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.3.17	-88,429.62	10,360,618.71
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	14,108.04	3,205.89
减：二、费用		1,694,300.29	1,010,005.99
1. 管理人报酬	6.4.6.2.1	925,706.25	632,620.25

2. 托管费	6.4.6.2.2	154,284.35	105,436.75
3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用	6.4.3.19	528,138.35	208,175.16
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 税金及附加		-	-
7. 其他费用	6.4.3.20	86,171.34	63,773.83
三、利润总额(亏损总额以“-”号填列)		11,795,325.59	16,673,896.68
减：所得税费用		-	-
四、净利润(净亏损以“-”号填列)		11,795,325.59	16,673,896.68

### 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：2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 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)	98,448,114.79	11,867,434.60	110,315,549.39
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	11,795,325.59	11,795,325.59
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数(净值减少以“-”号填列)	34,021,382.52	3,008,320.58	37,029,703.10
其中：1. 基金申购款	48,436,273.51	4,589,327.54	53,025,601.05
2. 基金赎回款	-14,414,890.99	-1,581,006.96	-15,995,897.95
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以“-”号填列)	-	-	-
五、期末所有者	132,469,497.31	26,671,080.77	159,140,578.08

项目	上年度可比期间 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
	权益(基金净值)		
一、期初所有者权益(基金净值)	90,890,885.88	-17,973,939.88	72,916,946.00
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	16,673,896.68	16,673,896.68
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数(净值减少以“-”号填列)	-940,752.07	-69,723.79	-1,010,475.86
其中：1. 基金申购款	3,143,405.93	-161,589.78	2,981,816.15
2. 基金赎回款	-4,084,158.00	91,865.99	-3,992,292.01
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以“-”号填列)	-	-	-
五、期末所有者权益(基金净值)	89,950,133.81	-1,369,766.99	88,580,366.82

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署：

谭晓冈

周立新

刘亚林

基金管理人负责人

主管会计工作负责人

会计机构负责人

## 6.4 报表附注

### 6.4.1 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

### 6.4.2 税项

#### 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。

## 2. 增值税、企业所得税

自根据财政部、国家税务总局财税[2016]36 号文《关于全面推开营业税改增值税试点的通知》的规定，经国务院批准，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以及金融同业往来利息收入免征增值税；存款利息收入不征收增值税。

根据财政部、国家税务总局财税[2016]140 号文《关于明确金融、房地产开发、教育辅助服务等增值税政策的通知》的规定，资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人；

根据财政部、国家税务总局财税[2017]56 号文《关于资管产品增值税有关问题的通知》的规定，自 2018 年 1 月 1 日起，资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为（以下简称“资管产品运营业务”），暂适用简易计税方法，按照 3% 的征收率缴纳增值税，资管产品管理人未分别核算资管产品运营业务和其他业务的销售额和增值税应纳税额的除外。资管产品管理人可选择分别或汇总核算资管产品运营业务销售额和增值税应纳税额。对资管产品在 2018 年 1 月 1 日前运营过程中发生的增值税应税行为，未缴纳增值税的，不再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从资管产品管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。

根据财政部、国家税务总局财税[2017]90 号文《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》的规定，提供贷款服务，以 2018 年 1 月 1 日起产生的利息及利息性质的收入为销售额；转让 2018 年 12 月 31 日前取得的股票（不包括限售股）、债券、基金、非货物期货，可以选择按照实际买入价计算销售额，或者以 2018 年最后一个交易日的股票收盘价（2018 年最后一个交易日处于停牌期间的股票，为停牌前最后一个交易日收盘价）、债券估值（中债金融估值中心有限公司或中证指数有限公司提供的债券估值）、基金份额净值、非货物期货结算价格作为买入价计算销售额。

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。

## 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，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 2020 年 6 月 30 日
活期存款	25,123,206.73
定期存款	-
其中：存款期限 1 个月以内	-
存款期限 1-3 个月	-
存款期限 3 个月以上	-
其他存款	-
合计	25,123,206.73

#### 6.4.3.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2020 年 6 月 30 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	123,161,051.97	134,354,145.44	11,193,093.47
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	-	-
	银行间市场	-	-
	合计	-	-
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	123,161,051.97	134,354,145.44	11,193,093.47

## 6.4.3.3 衍生金融资产/负债

无。

## 6.4.3.4 买入返售金融资产

## 6.4.3.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

无。

## 6.4.3.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

无。

## 6.4.3.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2020年6月30日
应收活期存款利息	2,069.51
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	236.97
应收债券利息	-
应收资产支持证券利息	-
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	-
应收出借证券利息	-
其他	9.72
合计	2,318.33

## 6.4.3.6 其他资产

无。

## 6.4.3.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2020年6月30日
交易所市场应付交易费用	227,348.09
银行间市场应付交易费用	-
合计	227,348.09

## 6.4.3.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末
----	-----

	2020 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	615.16
应付证券出借违约金	-
预提费用	164,535.36
合计	165,150.52

#### 6.4.3.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	98,448,114.79	98,448,114.79
本期申购	48,436,273.51	48,436,273.51
本期赎回（以“-”号填列）	-14,414,890.99	-14,414,890.99
- 基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算调整	-	-
本期申购	-	-
本期赎回（以“-”号填列）	-	-
本期末	132,469,497.31	132,469,497.31

注：申购含红利再投份额(如有)、转换入份额(如有)；赎回含转换出份额(如有)。

#### 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	11,306,943.00	560,491.60	11,867,434.60
本期利润	11,883,755.21	-88,429.62	11,795,325.59
本期基金份额交易产生的变动数	6,847,171.98	-3,838,851.40	3,008,320.58
其中：基金申购款	9,098,383.33	-4,509,055.79	4,589,327.54
基金赎回款	-2,251,211.35	670,204.39	-1,581,006.96
本期已分配利润	-	-	-
本期末	30,037,870.19	-3,366,789.42	26,671,080.77

#### 6.4.3.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日
	活期存款利息收入
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	2,041.77
其他	171.25

合计	52,189.03
----	-----------

## 6.4.3.12 股票投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年6月30日
卖出股票成交总额	163,913,026.78
减：卖出股票成本总额	151,925,532.64
买卖股票差价收入	11,987,494.14

## 6.4.3.13 债券投资收益

无。

## 6.4.3.14 贵金属投资收益

无。

## 6.4.3.15 衍生工具收益

无。

## 6.4.3.16 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年6月30日
股票投资产生的股利收益	1,524,264.29
其中：证券出借权益补偿收入	-
基金投资产生的股利收益	-
合计	1,524,264.29

## 6.4.3.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2020年1月1日至2020年6月30日
1. 交易性金融资产	-88,429.62
股票投资	-88,429.62
债券投资	-
资产支持证券投资	-
基金投资	-
贵金属投资	-
其他	-
2. 衍生工具	-
权证投资	-

3. 其他	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税	-
合计	-88,429.62

#### 6.4.3.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年6月30日
基金赎回费收入	13,913.72
基金转换费收入	194.32
合计	14,108.04

注：(1) 本基金的赎回费率按持有期间递减，不低于赎回费总额的 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 2020年1月1日至2020年6月30日
交易所市场交易费用	528,138.35
银行间市场交易费用	-
合计	528,138.35

#### 6.4.3.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年6月30日
审计费用	24,863.02
信息披露费	59,672.34
证券出借违约金	-
银行划款手续费	1,635.98
合计	86,171.34

#### 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

截至资产负债表日，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

截至财务报表批准日，本基金无其他需要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

本基金本报告期存在控制关系或者其他重大利害关系的关联方未发生变化。

## 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（“大成基金”）	基金管理人、基金销售机构、注册登记机构
中国工商银行股份有限公司（“中国工商银行”）	基金托管人、基金销售机构
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

注：以下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

## 6.4.6.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2020年1月1日至2020年6月30日		上年度可比期间 2019年1月1日至2019年6月30日	
	成交金额	占当期股票 成交总额的比例 (%)	成交金额	占当期股票 成交总额的比例(%)
光大证券	2,312,476.54	0.66	16,289,107.30	11.69

## 6.4.6.1.2 债券交易

无。

## 6.4.6.1.3 债券回购交易

无。

## 6.4.6.1.4 权证交易

无。

## 6.4.6.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2020年1月1日至2020年6月30日			
	当期 佣金	占当期佣金总量 的比例(%)	期末应付佣金余 额	占期末应付佣金 总额的比例(%)
光大证券	2,107.39	0.66	2,107.39	0.93
关联方名称	上年度可比期间 2019年1月1日至2019年6月30日			

	当期佣金	占当期佣金总量的比例 (%)	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例 (%)
光大证券	14,844.28	11.69	14,844.28	15.10

#### 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 2020年1月1日至2020年6月30日	上年度可比期间 2019年1月1日至2019年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	925,706.25	632,620.25
其中：支付销售机构的客户维护费	93,448.14	80,218.87

注：基金管理费每日计提，按月支付。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。

##### 6.4.6.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年6月30日	上年度可比期间 2019年1月1日至2019年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	154,284.35	105,436.75

注：基金托管费每日计提，按月支付。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。

##### 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

无。

##### 6.4.6.4 各关联方投资本基金的情况

###### 6.4.6.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

无。



## 6.4.6.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他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 2020年1月1日至2020年6月30日		上年度可比期间 2019年1月1日至2019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	25,123,206.73	49,976.01	9,581,809.03	48,812.07

注：本基金由基金托管人保管的银行存款，按银行约定利率计息。

## 6.4.6.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

无。

## 6.4.6.7 其他关联交易事项的说明

无。

## 6.4.7 利润分配情况

无。

## 6.4.8 期末(2020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

金额单位：人民币元

受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量 (单位：股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
300840	酷特智能	2020年6月30日	2020年7月8日	新股未上市	5.94	5.94	1,185	7,038.90	7,038.90	-
300843	胜蓝股份	2020年6月23日	2020年7月2日	新股未上市	10.01	10.01	751	7,517.51	7,517.51	-
300845	捷安高科	2020年6月24日	2020年7月3日	新股未上市	17.63	17.63	470	8,286.10	8,286.10	-
300846	首都在线	2020年6月22日	2020年7月1日	新股未上市	3.37	3.37	1,131	3,811.47	3,811.47	-

688027	国盾量子	2020年6月30日	2020年7月9日	新股未上市	36.18	36.18	1,132	40,955.76	40,955.76	-
688090	瑞松科技	2020年2月7日	2020年8月17日	新股锁定	27.55	59.45	1,757	48,405.35	104,453.65	-
688096	京源环保	2020年3月31日	2020年10月9日	新股锁定	14.34	21.42	2,890	41,442.60	61,903.80	-
688181	八亿时空	2019年12月27日	2020年7月6日	新股锁定	43.98	61.09	1,315	57,833.70	80,333.35	-
688277	天智航	2020年6月24日	2020年7月7日	新股未上市	12.04	12.04	4,374	52,662.96	52,662.96	-
688312	燕麦科技	2020年5月29日	2020年12月8日	新股锁定	19.68	41.77	3,291	64,766.88	137,465.07	-
688365	光云科技	2020年4月22日	2020年10月29日	新股锁定	10.80	43.22	4,913	53,060.40	212,339.86	-
688377	迪威尔	2020年6月29日	2020年7月8日	新股未上市	16.42	16.42	2,533	41,591.86	41,591.86	-
688518	联赢激光	2020年6月12日	2020年12月22日	新股锁定	7.81	20.83	6,604	51,577.24	137,561.32	-
688528	秦川物联	2020年6月19日	2020年7月1日	新股未上市	11.33	11.33	3,855	43,677.15	43,677.15	-
688555	泽达易盛	2020年6月12日	2020年12月23日	新股锁定	19.49	56.80	2,703	52,681.47	153,530.40	-
688568	中科星图	2020年6月30日	2020年7月8日	新股未上市	16.21	16.21	3,650	59,166.50	59,166.50	-
688598	金博股份	2020年5月8日	2020年11月18日	新股锁定	47.20	77.94	1,912	90,246.40	149,021.28	-

注：1. 基金可使用以基金名义开设的股票账户，选择网上或者网下一种方式进行新股申购。其中基金作为一般法人或战略投资者认购的新股，根据基金与上市公司所签订申购协议的规定，在新股上市后的约定期限内不能自由转让。

2. 根据《上海证券交易所科创板股票公开发行自律委员会促进科创板初期企业平稳发行行业倡导建议》，本基金获配的科创板股票如经抽签方式确定需要锁定的，锁定期限为自发行人股票上市之日起 6 个月。

#### 6.4.8.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

无。

#### 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

无。

##### 6.4.8.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末，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（合规与风险管理委员会、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与风险管理委员会，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。

本基金的基金管理人对于金融工具的风险管理方法主要是通过定性分析和定量分析的方法去估测各种风险产生的可能损失。从定性分析的角度出发，判断风险损失的严重程度和出现同类风险损失的频度。而从定量分析的角度出发，根据本基金的投资目标，结合基金资产所运用金融工具特征通过特定的风险量化指标、模型，日常的量化报告，确定风险损失的限度和相应置信程度，及时可靠地对各种风险进行监督、检查和评估，并通过相应决策，将风险控制在可承受的范围内。

### 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。

本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的活期银行存款存放在本基金的托管行中国工商银行，因而与银行存款相关的信用风险不重大。本基金在交易所进行的交易均以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，违约风险可能性很小；在银行间同业市场进行交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式进行限制以控制相应的信用风险。

本基金的基金管理人建立了信用风险管理流程，通过对投资品种信用等级评估来控制证券发行人的信用风险，且通过分散化投资以分散信用风险。

于本期末，本基金持有的除国债、央行票据和政策性金融债以外的债券占基金资产净值的比例为 0.00%。（上年度末：同）

### 6.4.9.3 流动性风险

流动性风险是指在履行与金融负债有关的义务时遇到资金短缺的风险。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或因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理的价格变现。

#### 6.4.9.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》及《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》等有关法规的要求建立健全开放式基金流动性风险管理的内部控制体系，审慎评估各类资产的流动性，针对性制定流动性风险管理措施，对本基金组合资产的流动性风险进行管理。本基金的基金管理人采用监控基金组合资产持仓集中度指标、逆回购交易的到期日与交易对手的集中度、流动性受限资产比例、基金组合资产中 7 个工作日可变现资产的可变现价值以及压力测试等方式防范流动性风险。并于开放日对本基金的申购赎回情况进行监控，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配，确保本基金资产的变现能力与投资者赎回需求的匹配与平衡。本基金的基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款，约定在非正常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。

本基金主要投资于交易所及银行间市场内交易的证券，除在附注“期末本基金持有的流通受限证券”中列示的部分基金资产流通暂时受限制外（如有），其余均能及时变现。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债券资

产的公允价值。除附注“期末债券正回购交易中作为抵押的债券”中列示的卖出回购金融资产款余额（如有）将在 1 个月内到期且计息外，本基金于资产负债表日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一般不计息，可赎回基金份额净值无固定到期日且不计息，因此账面余额一般即为未折现的合约到期现金流量。

#### 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。

本基金持有及承担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。本基金持有的利率敏感性资产主要为银行存款、结算备付金、债券投资、资产支持证券投资及买入返售金融资产等。

##### 6.4.9.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2020 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	25,123,206.73	-	-	-	25,123,206.73
结算备付金	585,018.70	-	-	-	585,018.70
存出保证金	23,897.81	-	-	-	23,897.81
交易性金融资产	-	-	-	134,354,145.44	134,354,145.44
应收利息	-	-	-	2,318.33	2,318.33
应收申购款	-	-	-	28,662.78	28,662.78
应收证券清算款	-	-	-	25,309.48	25,309.48
资产总计	25,732,123.24	-	-	134,410,436.03	160,142,559.27
负债					
应付赎回款	-	-	-	387,969.36	387,969.36
应付管理人报酬	-	-	-	189,868.48	189,868.48
应付托管费	-	-	-	31,644.74	31,644.74
应付交易费用	-	-	-	227,348.09	227,348.09
其他负债	-	-	-	165,150.52	165,150.52

负债总计	-	-	-	1,001,981.19	1,001,981.19
利率敏感度缺口	25,732,123.24	-	-	-133,408,454.84	159,140,578.08
上年度末 2019 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	16,697,848.68	-	-	-	16,697,848.68
存出保证金	28,900.86	-	-	-	28,900.86
交易性金融资产	-	-	-	94,222,049.41	94,222,049.41
应收利息	-	-	-	3,075.23	3,075.23
应收申购款	-	-	-	9,043.82	9,043.82
应收证券清算款	-	-	-	1,256.56	1,256.56
资产总计	16,726,749.54	-	-	94,235,425.02	110,962,174.56
负债					
应付赎回款	-	-	-	294,525.94	294,525.94
应付管理人报酬	-	-	-	139,570.82	139,570.82
应付托管费	-	-	-	23,261.82	23,261.82
应付交易费用	-	-	-	58,224.33	58,224.33
其他负债	-	-	-	131,042.26	131,042.26
负债总计	-	-	-	646,625.17	646,625.17
利率敏感度缺口	16,726,749.54	-	-	-93,588,799.85	110,315,549.39

注：表中所示为本基金资产及负债的账面价值，并按照合同约定的利率重新定价日或到期日孰早者予以分类。

#### 6.4.9.4.1.2 利率风险的敏感性分析

于本期末，本基金未持有交易性债券投资(上年度末：同)，因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响(上年度末：同)。

#### 6.4.9.4.2 外汇风险

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%。

#### 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 2020年6月30日		上年度末 2019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	134,354,145.44	84.42	94,222,049.41	85.41
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产—债券投资	-	-	-	-
交易性金融资产—贵金属投资	-	-	-	-
衍生金融资产—权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	134,354,145.44	84.42	94,222,049.41	85.41

#### 6.4.9.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除业绩比较基准以外的其他市场变量保持不变		
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（2020年6月30日）	上年度末（2019年12月31日）	
分析	业绩比较基准上升5%	9,400,000.00	6,133,464.40
	业绩比较基准下降5%	-9,400,000.00	-6,133,464.40

#### 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	134,354,145.44	83.90
	其中：股票	134,354,145.44	83.90
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	25,708,225.43	16.05
8	其他各项资产	80,188.40	0.05
9	合计	160,142,559.27	100.00

## 7.2 报告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	2,113,680.00	1.33
B	采矿业	3,940,508.00	2.48
C	制造业	67,109,998.01	42.17
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	2,988,508.32	1.88
E	建筑业	2,525,775.00	1.59
F	批发和零售业	6,200,996.80	3.90
G	交通运输、仓储和邮政业	3,241,805.00	2.04
H	住宿和餐饮业	188,700.00	0.12
I	信息传输、软件和信息技术服务业	7,468,440.33	4.69
J	金融业	29,893,970.98	18.78
K	房地产业	7,127,100.00	4.48
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	1,334,775.00	0.84



Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	219,888.00	0.14
S	综合	-	-
	合计	134,354,145.44	84.42

### 7.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末无沪港通投资。

### 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（元）	占基金资产净值比例（%）
1	600276	恒瑞医药	46,100	4,255,030.00	2.67
2	002475	立讯精密	82,028	4,212,137.80	2.65
3	000333	美的集团	66,800	3,993,972.00	2.51
4	601318	中国平安	54,600	3,898,440.00	2.45
5	601166	兴业银行	217,800	3,436,884.00	2.16
6	300059	东方财富	170,040	3,434,808.00	2.16
7	000858	五粮液	16,900	2,891,928.00	1.82
8	300628	亿联网络	39,200	2,675,792.00	1.68
9	601688	华泰证券	138,300	2,600,040.00	1.63
10	601328	交通银行	499,600	2,562,948.00	1.61
11	300433	蓝思科技	90,100	2,526,404.00	1.59
12	601899	紫金矿业	534,400	2,351,360.00	1.48
13	002001	新和成	80,800	2,351,280.00	1.48
14	601066	中信建投	57,900	2,280,102.00	1.43
15	000963	华东医药	89,400	2,261,820.00	1.42
16	002236	大华股份	115,900	2,226,439.00	1.40
17	000895	双汇发展	48,100	2,216,929.00	1.39
18	600809	山西汾酒	15,200	2,204,000.00	1.38
19	601009	南京银行	300,000	2,199,000.00	1.38
20	600519	贵州茅台	1,500	2,194,320.00	1.38
21	002202	金风科技	215,000	2,143,550.00	1.35
22	002602	世纪华通	138,600	2,121,966.00	1.33
23	600018	上港集团	479,900	2,015,580.00	1.27
24	000656	金科股份	243,200	1,984,512.00	1.25
25	600048	保利地产	134,000	1,980,520.00	1.24
26	601668	中国建筑	410,000	1,955,700.00	1.23
27	000961	中南建设	211,300	1,880,570.00	1.18
28	600390	五矿资本	265,121	1,871,754.26	1.18
29	600027	华电国际	544,700	1,862,874.00	1.17
30	000157	中联重科	279,300	1,795,899.00	1.13

31	300498	温氏股份	78,600	1,713,480.00	1.08
32	600919	江苏银行	300,900	1,706,103.00	1.07
33	600036	招商银行	50,300	1,696,116.00	1.07
34	600585	海螺水泥	27,400	1,449,734.00	0.91
35	002607	中公教育	48,100	1,334,775.00	0.84
36	600346	恒力石化	94,700	1,325,800.00	0.83
37	002594	比亚迪	16,400	1,177,520.00	0.74
38	000338	潍柴动力	80,900	1,109,948.00	0.70
39	600760	中航沈飞	33,300	1,092,906.00	0.69
40	600352	浙江龙盛	81,800	1,046,222.00	0.66
41	600570	恒生电子	9,620	1,036,074.00	0.65
42	000001	平安银行	80,000	1,024,000.00	0.64
43	600837	海通证券	75,334	947,701.72	0.60
44	603444	吉比特	1,700	933,317.00	0.59
45	300496	中科创达	11,900	924,630.00	0.58
46	601006	大秦铁路	125,900	886,336.00	0.56
47	000513	丽珠集团	17,600	844,976.00	0.53
48	300418	昆仑万维	33,800	843,648.00	0.53
49	601012	隆基股份	20,600	839,038.00	0.53
50	002508	老板电器	26,800	833,748.00	0.52
51	000739	普洛药业	35,700	831,453.00	0.52
52	002223	鱼跃医疗	22,800	829,920.00	0.52
53	601865	福莱特	44,000	827,200.00	0.52
54	002065	东华软件	65,800	823,816.00	0.52
55	603233	大参林	9,940	807,326.80	0.51
56	300115	长盈精密	35,100	802,035.00	0.50
57	002152	广电运通	61,500	795,810.00	0.50
58	002925	盈趣科技	13,600	787,984.00	0.50
59	600486	扬农化工	9,400	775,500.00	0.49
60	600862	中航高科	45,700	773,244.00	0.49
61	002019	亿帆医药	33,400	767,198.00	0.48
62	600566	济川药业	30,000	763,800.00	0.48
63	002463	沪电股份	30,500	761,890.00	0.48
64	603866	桃李面包	14,600	742,994.00	0.47
65	600755	厦门国贸	111,900	738,540.00	0.46
66	601966	玲珑轮胎	36,200	731,240.00	0.46
67	000581	威孚高科	35,100	725,868.00	0.46
68	000975	银泰黄金	46,100	722,848.00	0.45
69	000932	华菱钢铁	190,400	717,808.00	0.45
70	000600	建投能源	139,200	708,528.00	0.45
71	600657	信达地产	171,800	707,816.00	0.44
72	000400	许继电气	53,600	707,520.00	0.44

73	000987	越秀金控	60,100	700,766.00	0.44
74	300316	晶盛机电	27,600	682,824.00	0.43
75	002926	华西证券	63,500	675,005.00	0.42
76	600019	宝钢股份	147,200	671,232.00	0.42
77	600745	闻泰科技	5,300	667,535.00	0.42
78	601088	中国神华	45,000	646,200.00	0.41
79	002444	巨星科技	48,900	580,932.00	0.37
80	002024	苏宁易购	66,100	579,697.00	0.36
81	600639	浦东金桥	35,900	573,682.00	0.36
82	000090	天健集团	82,500	570,075.00	0.36
83	002233	塔牌集团	47,200	567,816.00	0.36
84	000661	长春高新	1,300	565,890.00	0.36
85	600153	建发股份	67,800	549,180.00	0.35
86	002221	东华能源	53,600	471,144.00	0.30
87	002124	天邦股份	35,300	453,605.00	0.29
88	000878	云南铜业	41,700	442,437.00	0.28
89	000598	兴蓉环境	87,900	404,340.00	0.25
90	000778	新兴铸管	117,200	401,996.00	0.25
91	002299	圣农发展	13,800	400,200.00	0.25
92	601128	常熟银行	52,900	397,279.00	0.25
93	600298	安琪酵母	7,900	390,892.00	0.25
94	000488	晨鸣纸业	78,100	385,814.00	0.24
95	601577	长沙银行	46,100	366,034.00	0.23
96	600811	东方集团	82,700	365,534.00	0.23
97	603868	飞科电器	7,400	365,042.00	0.23
98	002373	千方科技	14,500	347,855.00	0.22
99	601872	招商轮船	58,300	339,889.00	0.21
100	002440	闰土股份	36,700	335,438.00	0.21
101	002028	思源电气	16,100	329,406.00	0.21
102	002048	宁波华翔	21,300	328,872.00	0.21
103	600765	中航重机	30,400	310,688.00	0.20
104	600704	物产中大	70,600	297,226.00	0.19
105	002078	太阳纸业	25,100	238,952.00	0.15
106	002128	露天煤业	28,400	220,100.00	0.14
107	600757	长江传媒	43,200	219,888.00	0.14
108	688365	光云科技	4,913	212,339.86	0.13
109	603899	晨光文具	3,700	202,020.00	0.13
110	600754	锦江酒店	6,800	188,700.00	0.12
111	600177	雅戈尔	29,300	174,628.00	0.11
112	300088	长信科技	15,500	173,600.00	0.11
113	688555	泽达易盛	2,703	153,530.40	0.10
114	688598	金博股份	1,912	149,021.28	0.09

115	688518	联赢激光	6,604	137,561.32	0.09
116	688312	燕麦科技	3,291	137,465.07	0.09
117	000028	国药一致	2,900	130,529.00	0.08
118	688090	瑞松科技	1,757	104,453.65	0.07
119	600643	爱建集团	12,200	96,990.00	0.06
120	601992	金隅集团	29,800	91,188.00	0.06
121	601718	际华集团	27,300	90,636.00	0.06
122	688181	八亿时空	1,315	80,333.35	0.05
123	688096	京源环保	2,890	61,903.80	0.04
124	688568	中科星图	3,650	59,166.50	0.04
125	688277	天智航	4,374	52,662.96	0.03
126	603087	甘李药业	452	45,335.60	0.03
127	688528	秦川物联	3,855	43,677.15	0.03
128	688377	迪威尔	2,533	41,591.86	0.03
129	688027	国盾量子	1,132	40,955.76	0.03
130	600956	新天绿能	2,533	12,766.32	0.01
131	300845	捷安高科	470	8,286.10	0.01
132	300843	胜蓝股份	751	7,517.51	0.00
133	300840	酷特智能	1,185	7,038.90	0.00
134	300846	首都在线	1,131	3,811.47	0.00

#### 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	600276	恒瑞医药	4,187,443.14	3.80
2	300433	蓝思科技	3,486,427.55	3.16
3	600036	招商银行	3,088,031.70	2.80
4	601688	华泰证券	3,048,498.00	2.76
5	000333	美的集团	2,895,030.00	2.62
6	600887	伊利股份	2,837,974.00	2.57
7	000858	五粮液	2,744,342.25	2.49
8	300059	东方财富	2,635,648.00	2.39
9	601601	中国太保	2,558,905.00	2.32
10	600030	中信证券	2,542,429.50	2.30
11	300628	亿联网络	2,527,508.50	2.29
12	000963	华东医药	2,358,330.00	2.14
13	600383	金地集团	2,308,151.00	2.09
14	601009	南京银行	2,286,000.00	2.07
15	601166	兴业银行	2,248,362.00	2.04
16	002236	大华股份	2,234,321.00	2.03
17	300003	乐普医疗	2,231,158.92	2.02

18	002202	金风科技	2,220,502.00	2.01
19	601318	中国平安	2,188,454.00	1.98
20	002001	新和成	2,179,896.00	1.98

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	601628	中国人寿	3,224,026.00	2.92
2	600383	金地集团	3,021,484.00	2.74
3	601988	中国银行	2,935,648.00	2.66
4	600887	伊利股份	2,874,487.00	2.61
5	000876	新希望	2,465,323.00	2.23
6	600030	中信证券	2,446,183.00	2.22
7	601601	中国太保	2,382,790.00	2.16
8	600031	三一重工	2,363,207.00	2.14
9	002916	深南电路	2,328,815.00	2.11
10	601377	兴业证券	2,283,846.00	2.07
11	300003	乐普医疗	2,189,840.00	1.99
12	600837	海通证券	2,087,700.00	1.89
13	600522	中天科技	2,048,891.00	1.86
14	002241	歌尔股份	2,038,507.00	1.85
15	300122	智飞生物	2,004,388.00	1.82
16	600104	上汽集团	1,919,179.50	1.74
17	601006	大秦铁路	1,869,656.00	1.69
18	601111	中国国航	1,852,260.00	1.68
19	000651	格力电器	1,807,045.00	1.64
20	003816	中国广核	1,790,206.44	1.62

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	192,146,058.29
卖出股票收入（成交）总额	163,913,026.78

注：买入股票成本、卖出股票收入均按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，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

无。

## 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

无。

## 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

无。

## 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

无。

## 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

无。

## 7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

无。

## 7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

无。

## 7.12 投资组合报告附注

### 7.12.1 基金投资的前十名证券的发行主体本期是否出现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

1、本基金投资的前十名证券之一华泰证券（601688.SH）的发行主体华泰证券股份有限公司于2020年2月10日因未按规定履行客户身份识别义务等，受到中国人民银行处罚（银罚字（2020）23号）。本基金认为，对华泰证券的处罚不会对其投资价值构成实质性负面影响。

2、本基金投资的前十名证券之一交通银行（601328.SH）的发行主体交通银行股份有限公司于2019年12月27日因授信审批不审慎等，受到中国银行保险监督管理委员会处罚（银保监罚决字（2019）24号），于2020年4月20日因监管标准化数据（EAST）系统数据质量及数据报送存在违法违规行为，受到中国银行保险监督管理委员会处罚（银保监罚决字（2020）6号）。本基金认为，对交通银行的处罚不会对其投资价值构成实质性负面影响。

### 7.12.2 基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库

本基金投资的前十名股票未超出基金合同规定的备选股票库

## 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	23,897.81
2	应收证券清算款	25,309.48
3	应收股利	-
4	应收利息	2,318.33
5	应收申购款	28,662.78
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	80,188.40

## 7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

无。

## 7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

无。

## 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 (%)
2,711	48,863.70	102,630,599.34	77.47	29,838,897.97	22.53

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	6,152.08	0.0046

## 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	0~10
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	98,448,114.79
本报告期基金总申购份额	48,436,273.51
减：本报告期基金总赎回份额	14,414,890.99
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	132,469,497.31

## § 10 重大事件揭示

### 10.1 基金份额持有人大会决议

无。

### 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

无

二、基金托管人的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

无。

### 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

本报告期内，基金管理人、托管人及其相关高级管理人员无受稽查或处罚等情况。



## 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

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		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	
长江证券	1	202,082,178.26	57.28%	184,155.57	57.28%	-
海通证券	1	148,420,658.63	42.07%	135,256.82	42.07%	-
光大证券	1	2,312,476.54	0.66%	2,107.39	0.66%	-
东方证券	1	-	-	-	-	-
申万宏源	1	-	-	-	-	-
中信证券	1	-	-	-	-	-

注：1、本报告期内，本基金新增交易单元有海通证券；退租交易单元有华创证券。

2、租用券商专用交易单元的选择标准和程序：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。

本报告期内退出交易单元：无。

本报告期内新增交易单元：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	大成基金管理有限公司关于基金经理张钟玉女士因休产假暂停履行职务的公告	证券时报、中国证监会基金电子披露网站及本公司网站	2020 年 6 月 13 日
2	大成基金管理有限公司关于旗下部分基金增加泛华普益基金销售有限公司为销售机构的公告	证券时报、中国证监会基金电子披露网站及本公司网站	2020 年 6 月 5 日
3	大成基金管理有限公司关于旗下部分基金增加中国人寿保险股份有限公司为销售机构的公告	证券时报、中国证监会基金电子披露网站及本公司网站	2020 年 5 月 22 日
4	大成基金管理有限公司关于旗下部分基金增加中国人寿保险股份有限公司为销售机构的公告	证券时报、中国证监会基金电子披露网站及本公司网站	2020 年 5 月 22 日
5	大成核心双动力混合型证券投资基金 2019 年年度报告	证券时报、中国证监会基金电子披露网站及本公司网站	2020 年 4 月 29 日
6	大成基金管理有限公司关于终止泰诚财富基金销售（大连）有限公司办理相关销售业务的公告	证券时报、中国证监会基金电子披露网站及本公司网站	2020 年 4 月 25 日
7	大成核心双动力混合型证券投资基金 2020 年第 1 季度报告	证券时报、中国证监会基金电子披露网站及本公司网站	2020 年 4 月 22 日
8	大成基金管理有限公司关于延迟披露旗下公募基金 2019 年年度报告的公告	证券时报、中国证监会基金电子披露网站及本公司网站	2020 年 3 月 25 日
9	大成基金管理有限公司关于注销南京分公司的公告	证券时报、中国证监会基金电子披露网站及本公司网站	2020 年 3 月 21 日
10	大成基金管理有限公司关于注销青岛分公司的公告	证券时报、中国证监会基金电子披露网站及本公司网站	2020 年 2 月 29 日
11	大成基金管理有限公司关于 APP 交易平台汇款交易费率优惠的公告	证券时报、中国证监会基金电子披露网站及本公司网站	2020 年 2 月 26 日
12	大成基金管理有限公司关于 2020 年春节假期延长期间调整公司公募基金开放时间等相关事宜的公告	证券时报、中国证监会基金电子披露网站及本公司网站	2020 年 1 月 30 日
13	大成核心双动力混合型证券投资基金 2019 年第 4 季度报告	证券时报、中国证监会基金电子披露网站及本公司网站	2020 年 1 月 17 日

## § 11 影响投资者决策的其他重要信息

### 11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过 20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比 (%)
机构	1	20200101-20200413	25,772,551.55	-	-	25,772,551.55	19.46
	2	20200414-20200630	-	45,744,739.25	-	45,744,739.25	34.53
	3	20200101-20200630	31,113,308.54	-	-	31,113,308.54	23.49
个人	-	-	-	-	-	-	-
产品特有风险							
当基金份额持有人占比过于集中时，可能会因某单一基金份额持有人大额赎回而引发基金净值剧烈波动的风险，甚至有可能引起基金的流动性风险，基金管理人可能无法及时变现基金资产以应对基金份额持有人的赎回申请，基金份额持有人可能无法及时赎回持有的全部基金份额。							

### 11.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

## § 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、《大成核心双动力混合型证券投资基金基金合同》；
- 3、《大成核心双动力混合型证券投资基金基金托管协议》；
- 4、《大成核心双动力股票型证券投资基金变更基金名称、基金类别以及修订基金合同部分条款的公告》；
- 5、大成基金管理有限公司批准文件、营业执照、公司章程；
- 6、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。

大成基金管理有限公司

2020 年 8 月 28 日