

# 大成动态量化配置策略混合型证券投资基金

## 2020 年第 4 季度报告

2020 年 12 月 31 日

基金管理人：大成基金管理有限公司

基金托管人：中国农业银行股份有限公司

报告送出日期：2021 年 1 月 22 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。

基金托管人中国农业银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2021 年 1 月 21 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 2020 年 10 月 01 日起至 12 月 31 日止。

## § 2 基金产品概况

|            |  |
|------------|--|
| 基金简称       | 大成动态量化配置策略混合   |
| 基金主代码      | 003147   |
| 基金运作方式     | 契约型开放式   |
| 基金合同生效日    | 2016 年 9 月 20 日  |
| 报告期末基金份额总额 | 232,614,269.32 份   |
| 投资目标       | 本基金运用量化投资策略进行资产配置和股票投资，并通过数学建模的方式根据宏观经济变量以及风险预警指标动态调整资产配置的比例，在有效控制风险的前提下追求基金资产长期稳定增长。  |
| 投资策略       | 本基金将通过量化建模的方式综合分析和持续跟踪基本面、政策面、市场面等多方面因素，对宏观经济、国家政策、资金面和市场情绪等影响证券市场的重要因素进行深入分析，确定当前市场环境下的主要投资方向和资产配置比例。同时，量化模型通过持续跟踪宏观经济变量、风险预警指标等，判断不同资产类别在当前市场环境下的风险收益状态，根据市场环境变化时，动态调整投资组合结构、各类资产配置比例。 |
| 业绩比较基准     | 沪深 300 指数收益率×50%+中债综合指数收益率×50%   |
| 风险收益特征     | 本基金是混合型基金，其预期收益及风险水平低于股票型基金，高于货币市场基金与债券型基金，属于风险水平中高的基金。  |
| 基金管理人      | 大成基金管理有限公司   |
| 基金托管人      | 中国农业银行股份有限公司   |

## § 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（2020 年 10 月 1 日-2020 年 12 月 31 日） |
|-----------------|---------------------------------------|
| 1. 本期已实现收益      | 748,402.31                            |
| 2. 本期利润         | 5,429,698.37                          |
| 3. 加权平均基金份额本期利润 | 0.1134                                |
| 4. 期末基金资产净值     | 337,622,676.23                        |
| 5. 期末基金份额净值     | 1.4514                                |

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。

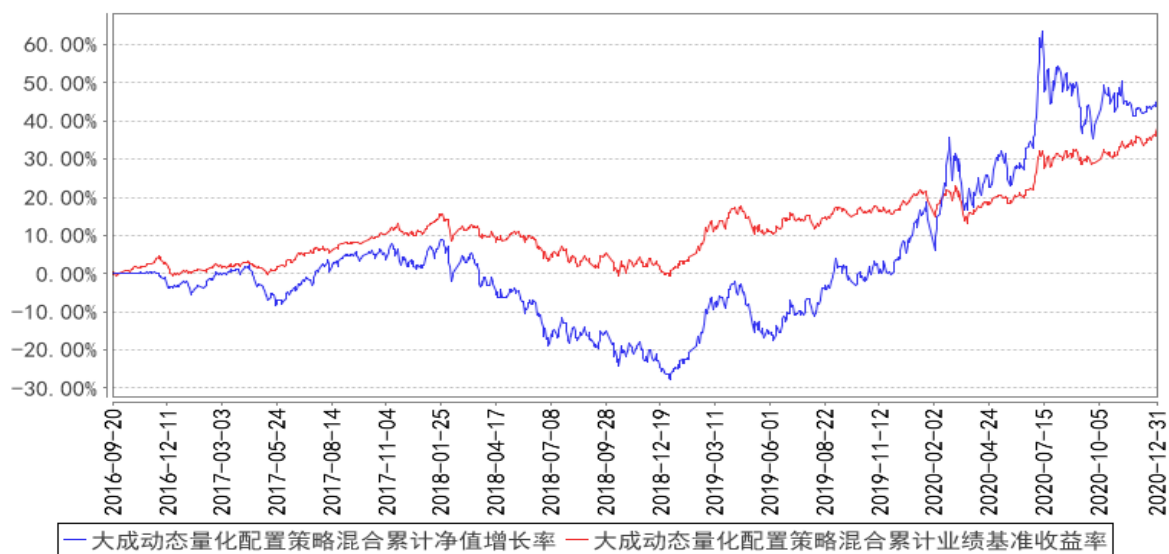
### 3.2 基金净值表现

#### 3.2.1 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<br>① | 净值增长率<br>标准差② | 业绩比较基<br>准收益率③ | 业绩比较基<br>准收益率标<br>准差④ | ①-③    | ②-④   |
|----------------|------------|---------------|----------------|-----------------------|--------|-------|
| 过去三个月          | 4.61%      | 1.13%         | 7.33%          | 0.50%                 | -2.72% | 0.63% |
| 过去六个月          | 7.05%      | 1.59%         | 12.55%         | 0.66%                 | -5.50% | 0.93% |
| 过去一年           | 31.80%     | 1.71%         | 15.22%         | 0.70%                 | 16.58% | 1.01% |
| 过去三年           | 41.85%     | 1.46%         | 24.90%         | 0.66%                 | 16.95% | 0.80% |
| 自基金合同<br>生效起至今 | 45.14%     | 1.27%         | 38.33%         | 0.58%                 | 6.81%  | 0.69% |

#### 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

大成动态量化配置策略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：本基金合同规定，基金管理人应当自基金合同生效之日起六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。

## § 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 |        |   |
| 李富强 | 本基金基金经理 | 2020年12月18日 | -    | 6年     | 经济学硕士。2009年7月至2013年12月任中国银行间市场交易商协会市场创新部高级助理。2014年1月至2017年7月任北信瑞丰基金管理有限公司固定收益部基金经理。2017年7月加入大成基金管理有限公司，任职于固定收益总部。2018年7月16日至2019年3月9日任大成强化收益定期开放债券型证券投资基金基金经理。2018年7月16日至2019年3月2日任大成景利混合型证券投资基金基金经理。2018年7月16日至2020年3月11日任大成景益平稳收益混合型证券投资基金基金经理。2018年7月16日至2019年9月29日任大成景丰债券型证券投资基金（LOF）基金经理。2018年7月16日至2020年8月12日任大成安汇金融债债券型证券投资基金（转型前大成月月盈短期理财债券型证券投资基金）。2018年7月16日起任大成可转债 |

|     |         |                 |   |      |  |
|-----|---------|-----------------|---|------|--|
|     |         |                 |   |      | 增强债券型证券投资基金基金经理。2018 年 7 月 16 日至 2020 年 12 月 18 日任大成景盛一年定期开放债券型证券投资基金基金经理。2018 年 11 月 16 日起任大成景禄灵活配置混合型证券投资基金基金经理。2019 年 6 月 12 日起任大成景润灵活配置混合型证券投资基金基金经理。2019 年 9 月 26 日至 2020 年 11 月 3 日任大成中债 1-3 年国开行债券指数证券投资基金基金经理。2019 年 11 月 25 日起任大成通嘉三年定期开放债券型证券投资基金基金经理。2019 年 12 月 9 日起任大成惠嘉一年定期开放债券型证券投资基金基金经理。2020 年 6 月 22 日起任大成惠兴一年定期开放债券型发起式证券投资基金基金经理。2020 年 10 月 29 日起任大成趋势回报灵活配置混合型证券投资基金基金经理。2020 年 12 月 2 日起任大成景荣债券型证券投资基金基金经理。2020 年 12 月 18 日起任大成动态量化配置策略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 |
| 夏高  | 本基金基金经理 | 2020 年 9 月 18 日 | - | 9 年  | 工学博士。2011 年 1 月至 2012 年 5 月就职于博时基金管理有限公司，任股票投资部投资分析员。2012 年 7 月加入大成基金管理有限公司，曾担任数量与指数投资部高级数量分析师、基金经理助理，现任数量与指数投资部总监助理。2014 年 12 月 6 日起任大成中证红利指数证券投资基金基金经理。2015 年 6 月 29 日至 2020 年 11 月 13 日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 2 月 3 日起任大成中证 360 互联网+大数据 100 指数型证券投资基金基金经理。2017 年 3 月 21 日起任大成智惠量化多策略灵活配置混合型证券投资基金基金经理。2020 年 9 月 18 日起任大成动态量化配置策略混合型证券投资基金、大成绝对收益策略混合型发起式证券投资基金基金经理。具有基金从业资格。国籍：中国  |
| 黄万青 | 本基金基金经理 | 2020 年 12 月 4 日 | - | 24 年 | 经济学硕士。曾任职于大鹏证券有限责任公司。1999 年 5 月加入大成基金管理有限公司，曾担任研究部研究员、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  |

|  |  |  |  |  |
|--|--|--|--|--|
|  |  |  |  | <p>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 日至 2019 年 6 月 15 日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 日至 2017 年 3 月 18 日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 日至 2020 年 12 月 4 日任大成景荣债券型证券投资基金(原大成景荣保本混合型证券投资基金转型)基金经理。2016 年 8 月 6 日至 2018 年 12 月 8 日任大成景源灵活配置混合型证券投资基金基金经理。2016 年 9 月 20 日至 2018 年 10 月 20 日任大成景穗灵活配置混合型证券投资基金基金经理。2016 年 9 月 29 日至 2018 年 11 月 19 日任大成景禄灵活配置混合型证券投资基金基金经理。2017 年 1 月 25 日起任大成景润灵活配置混合型证券投资基金基金经理。2017 年 3 月 18 日至 2018 年 11 月 9 日任大成景鹏灵活配置混合型证券投资基金基金经理。2019 年 6 月 21 日至 2020 年 5 月 21 日任大成景益平稳收益混合型证券投资基金基金经理。2019 年 6 月 21 日起任大成景禄灵活配置混合型证券投资基金基金经理。2019 年 7 月 18 日至 2020 年 9 月 18 日任大成惠福纯债债券型证券投资基金基金经理。2020 年 4 月 30 日起任大成趋势回报灵活配置混合型证券投资基金基金经理。2020 年 12 月 4 日起任大成动态量化配置策略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</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。

#### 4.1.1 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 公平交易专项说明

### 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些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 3 笔同日反向交易，原因为流动性需要或合规比例调整。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，原因为流动性需要或合规比例调整。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 报告期内基金的投资策略和运作分析

2020 年第 4 季度国内经济继续恢复，第 4 季度的 A 股市场表现震荡上行，上证指数涨 7.92%，沪深 300 指数涨 13.60%，中小板涨 10.07%，创业板涨 15.21%，行业上看，电气设备、有色金属、汽车、食品饮料涨幅在 25% 以上，商贸、传媒、房地产、通信跌幅在 6% 以上。

本基金在 12 月 9 日有新增资金进来，不再是迷你基金，我们开始按照绝对收益产品来进行投资，在季度末进行了组合结构调整，股票比例控制在 30% 以内，重点配置食品饮料、医药、家电、消费电子、有色、银行、保险等行业。

债券方面，2020 年四季度的前半季度央行货币政策退出延续，但 11 月末发生信用风险事件后，央行意外提前并大幅超量续作 MLF，通过公开市场操作投放资金，银行间隔夜回购利率回到

1%左右的水平。债券市场到期收益率也经历了先上后下的过程。总体来看，1 年期和 10 年期国开债券到期收益率分别下行 32bp 和 23bp。

2020 年四季度，本基金主要投资于高评级短久期债券，降低市值波动风险增厚基金收益，并对个券进行了波段操作。

#### 4.5 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 1.4514 元；本报告期基金份额净值增长率为 4.61%，业绩比较基准收益率为 7.33%。

#### 4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

本基金在本报告期内，曾出现了连续 20 个工作日资产净值低于五千万元的情形。

### § 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              | 94,251,729.98  | 27.36        |
|    | 其中：股票             | 94,251,729.98  | 27.36        |
| 2  | 基金投资              | -              | -            |
| 3  | 固定收益投资            | 37,801,230.30  | 10.97        |
|    | 其中：债券             | 37,801,230.30  | 10.97        |
|    | 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          | 80,000,135.00  | 23.22        |
|    | 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      | 12,043,541.48  | 3.50         |
| 8  | 其他资产              | 120,415,039.89 | 34.95        |
| 9  | 合计                | 344,511,676.65 | 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        | -             | -            |
| B  | 采矿业             | 1,250,000.00  | 0.37         |
| C  | 制造业             | 63,007,779.98 | 18.66        |
| D  | 电力、热力、燃气及水生产和供应 | -             | -            |



|   | 业               |               |       |
|---|-----------------|---------------|-------|
| E | 建筑业             |               | -     |
| F | 批发和零售业          |               | -     |
| G | 交通运输、仓储和邮政业     |               | -     |
| H | 住宿和餐饮业          |               | -     |
| I | 信息传输、软件和信息技术服务业 | 3,900,000.00  | 1.16  |
| J | 金融业             | 17,815,600.00 | 5.28  |
| K | 房地产业            |               | -     |
| L | 租赁和商务服务业        | 4,236,750.00  | 1.25  |
| M | 科学研究和技术服务业      | 4,041,600.00  | 1.20  |
| 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              |               | -     |
| Q | 卫生和社会工作         |               | -     |
| R | 文化、体育和娱乐业       |               | -     |
| S | 综合              |               | -     |
|   | 合计              | 94,251,729.98 | 27.92 |

#### 5.2.2 报告期末按行业分类的港股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  | 300999 | 金龙鱼  | 70,000    | 7,582,400.00 | 2.25         |
| 2  | 600276 | 恒瑞医药 | 66,000    | 7,356,360.00 | 2.18         |
| 3  | 601318 | 中国平安 | 80,000    | 6,958,400.00 | 2.06         |
| 4  | 601398 | 工商银行 | 1,000,000 | 4,990,000.00 | 1.48         |
| 5  | 603501 | 韦尔股份 | 20,000    | 4,622,000.00 | 1.37         |
| 6  | 300433 | 蓝思科技 | 150,000   | 4,591,500.00 | 1.36         |
| 7  | 600887 | 伊利股份 | 102,000   | 4,525,740.00 | 1.34         |
| 8  | 603986 | 兆易创新 | 22,903    | 4,523,342.50 | 1.34         |
| 9  | 600690 | 海尔智家 | 150,000   | 4,381,500.00 | 1.30         |
| 10 | 601888 | 中国中免 | 15,000    | 4,236,750.00 | 1.25         |

#### 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 | 17,572,230.30 | 5.20         |
| 2  | 央行票据 | -             | -            |
| 3  | 金融债券 | -             | -            |

|    |           |               |       |
|----|-----------|---------------|-------|
|    | 其中：政策性金融债 | -             | -     |
| 4  | 企业债券      | 10,080,000.00 | 2.99  |
| 5  | 企业短期融资券   | -             | -     |
| 6  | 中期票据      | 10,149,000.00 | 3.01  |
| 7  | 可转债（可交换债） | -             | -     |
| 8  | 同业存单      | -             | -     |
| 9  | 其他        | -             | -     |
| 10 | 合计        | 37,801,230.30 | 11.20 |

#### 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  | 019640    | 20 国债 10          | 155,940 | 15,573,727.80 | 4.61         |
| 2  | 101900636 | 19 厦门市政<br>MTN001 | 100,000 | 10,149,000.00 | 3.01         |
| 3  | 155274    | 19 国新 01          | 100,000 | 10,080,000.00 | 2.99         |
| 4  | 010107    | 21 国债(7)          | 19,750  | 1,998,502.50  | 0.59         |

#### 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

无。

#### 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

无。

#### 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

无。

#### 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

| 代码                | 名称 | 持仓量（买/卖） | 合约市值（元） | 公允价值变动（元） | 风险说明      |
|-------------------|----|----------|---------|-----------|-----------|
| -                 | -  | -        | -       | -         | -         |
| 公允价值变动总额合计（元）     |    |          |         |           | -         |
| 股指期货投资本期收益（元）     |    |          |         |           | 32,310.68 |
| 股指期货投资本期公允价值变动（元） |    |          |         |           | -         |

##### 5.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金在进行股指期货投资时，将根据风险管理的原则，以套期保值为主要目的，在风险可控的前提下，本着谨慎原则，参与股指期货的投资，以管理投资组合的系统性风险，改善组合的风险收益特性。套期保值将主要采用流动性好、交易活跃的期货合约。本基金在进行股指期货投资时，将通过对证券市场和期货市场运行趋势的研究，并结合股指期货的定价模型寻求其合理的估值水平。

基金管理人将建立股指期货交易决策部门或小组，授权特定的管理人员负责股指期货的投资审批事项，同时针对股指期货交易制定投资决策流程和风险控制等制度并报董事会批准。

## 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

国债期货作为利率衍生品的一种，有助于管理债券组合久期、流动性和风险水平。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、国债期流动性、套保有效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

无。

### 5.10.3 本期国债期货投资评价

无。

## 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

本基金投资的前十名证券之一工商银行（601398.SH）的发行主体中国工商银行股份有限公司于 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等，受到中国银行保险监督管理委员会处罚（银保监罚决字〔2020〕7 号）。本基金认为，对工商银行的处罚不会对其投资价值构成实质性负面影响。

### 5.11.2 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中，没有投资于超出基金合同规定备选股票库之外股票。

### 5.11.3 其他资产构成

| 序号 | 名称      | 金额（元）          |
|----|---------|----------------|
| 1  | 存出保证金   | 18,143.56      |
| 2  | 应收证券清算款 | 2,778,485.58   |
| 3  | 应收股利    | -              |
| 4  | 应收利息    | 631,660.64     |
| 5  | 应收申购款   | 116,986,750.11 |
| 6  | 其他应收款   | -              |
| 7  | 待摊费用    | -              |
| 8  | 其他      | -              |
| 9  | 合计      | 120,415,039.89 |

### 5.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

无。

### 5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

无。

### 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               | 14,264,958.42  |
| 报告期期间基金总申购份额              | 221,995,860.90 |
| 减：报告期期间基金总赎回份额            | 3,646,550.00   |
| 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               | 232,614,269.32 |

## § 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

单位：份

|                  |              |
|------------------|--------------|
| 报告期期初管理人持有的本基金份额 | -            |
| 报告期期间买入/申购总份     | 1,375,388.59 |

|                           |              |
|---------------------------|--------------|
| 额                         |              |
| 报告期期间卖出/赎回总份额             | -            |
| 报告期期末管理人持有的本基金份额          | 1,375,388.59 |
| 报告期期末持有的本基金份额占基金总份额比例 (%) | 0.59         |

## 7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

| 序号 | 交易方式 | 交易日期       | 交易份额(份)      | 交易金额(元)      | 适用费率(%) |
|----|------|------------|--------------|--------------|---------|
| 1  | 申购   | 2020-12-31 | 1,375,388.59 | 2,000,000.00 | 0.50    |
| 合计 |      |            | 1,375,388.59 | 2,000,000.00 |         |

注：1、申购或者购买基金份额的，金额为正；赎回或者卖出基金份额的，金额为负。

2、合计数以绝对值填列。

3、红利发放为期间合计数。

## § 8 影响投资者决策的其他重要信息

### 8.1 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              | 20201210-20201231       | -    | 70,327,730.50 | -          | 70,327,730.50 | 30.23   |
|   | 2              | 20201210-20201231       | -    | 70,327,730.50 | -          | 70,327,730.50 | 30.23   |
| -   | -              | -                       | -    | -             | -          | -             | -       |
| 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。 |                |                         |      |               |            |               |         |

### 8.2 影响投资者决策的其他重要信息

1. 2020 年 12 月 28 日，经大成基金管理有限公司 2020 年第一次临时股东会审议通过，选举林昌先生担任公司股东董事，翟斌先生不再担任公司股东董事。

2. 2020 年 12 月 28 日，经大成基金管理有限公司第七届董事会第八次会议审议通过，选举林昌先生担任公司第七届董事会副董事长，同时，选举其担任第七届董事会合规与风险管理委员会

委员，第七届董事会审计委员会委员。翟斌先生不再担任公司第七届董事会副董事长、第七届董事会合规与风险管理委员会委员、第七届董事会审计委员会委员。

## § 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动态量化配置策略混合型证券投资基金的文件；
- 2、《大成动态量化配置策略混合型证券投资基金基金合同》；
- 3、《大成动态量化配置策略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

2021 年 1 月 22 日