

大成核心双动力混合型证券投资基金 2020 年年度报告

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：中国工商银行股份有限公司

送出日期：2021 年 3 月 30 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 2021 年 03 月 29 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。

本报告财务资料已经审计。安永华明会计师事务所(特殊普通合伙)为本基金出具了无保留意见的审计报告，请投资者注意阅读。

本报告期自 2020 年 01 月 01 日起至 12 月 31 日止。

1.2 目录

§ 1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
§ 2 基金简介	5
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
§ 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况	6
3.1 主要会计数据和财务指标	6
3.2 基金净值表现	7
3.3 过去三年基金的利润分配情况	8
§ 4 管理人报告	8
4.1 基金管理人及基金经理情况	8
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	10
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	10
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	11
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	12
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况	12
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	13
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	14
4.9 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
§ 5 托管人报告	14
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 托管人对本年度报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	14
§ 6 审计报告	14
§ 7 年度财务报表	16
7.1 资产负债表	16
7.2 利润表	17
7.3 所有者权益（基金净值）变动表	18
7.4 报表附注	20
§ 8 投资组合报告	44
8.1 期末基金资产组合情况	44
8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	45
8.3 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	45
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动	50

8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	54
8.6 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	54
8.7 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	54
8.8 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	54
8.9 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	54
8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明	54
8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	54
8.12 投资组合报告附注	54
§ 9 基金份额持有人信息	55
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	55
9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	55
9.3 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	55
9.4 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理本人及其直系亲属持有本人管理的产品情况	56
§ 10 开放式基金份额变动	56
§ 11 重大事件揭示	56
11.1 基金份额持有人大会决议	56
11.2 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	56
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	56
11.4 基金投资策略的改变	57
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	57
11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况	57
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	57
11.8 其他重大事件	58
§ 12 影响投资者决策的其他重要信息	60
12.1 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	60
12.2 影响投资者决策的其他重要信息	60
§ 13 备查文件目录	61
13.1 备查文件目录	61
13.2 存放地点	61
13.3 查阅方式	61

§ 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	115,003,796.49 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》
登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	www.dcfund.com.cn
基金年度报告备置地点	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
会计师事务所	安永华明会计师事务所(特殊普通合伙)	北京市东城区东长安街1号东方广场安永大楼17层01-12室
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、基金净值表现及利润分配情况

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	2020 年	2019 年	2018 年
本期已实现收益	47,381,468.38	14,705,968.30	-15,803,719.72
本期利润	53,232,342.13	32,078,384.65	-24,013,495.80
加权平均基金份额本期利润	0.4565	0.3209	-0.2536
本期加权平均净值利润率	35.50%	32.41%	-26.27%
本期基金份额净值增长率	37.91%	39.78%	-23.84%
3.1.2 期末数据和指标	2020 年末	2019 年末	2018 年末
期末可供分配利润	62,786,957.89	11,306,943.00	-17,973,939.88
期末可供分配基金份额利润	0.5460	0.1149	-0.1978
期末基金资产净值	177,790,754.38	110,315,549.39	72,916,946.00
期末基金份额净值	1.546	1.121	0.802
3.1.3 累计期末指标	2020 年末	2019 年末	2018 年末
基金份额累计净值增长率	151.28%	82.20%	30.35%

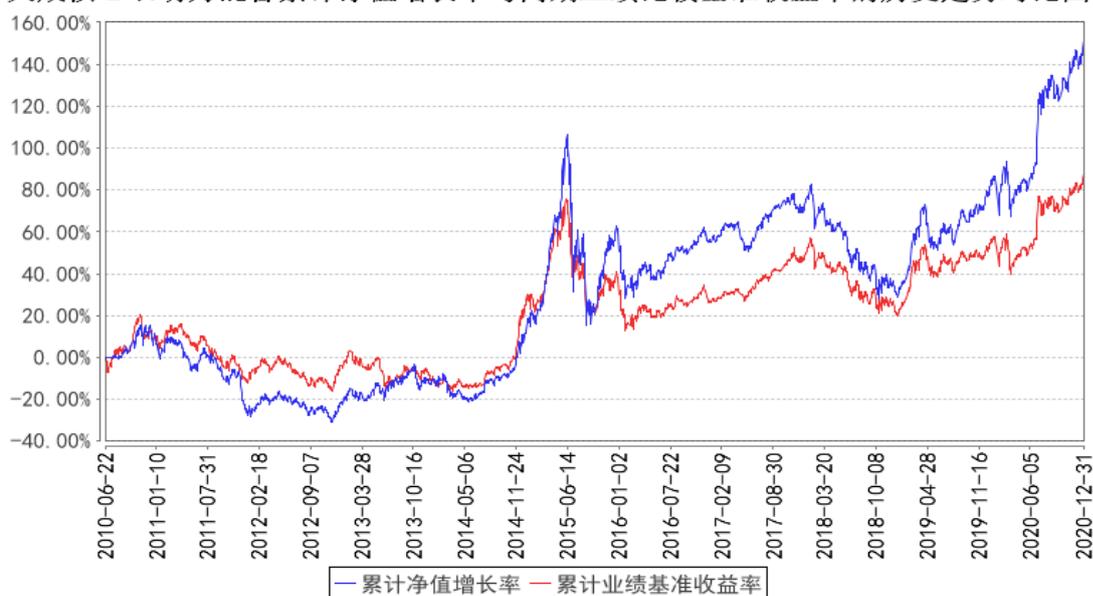
3.2 基金净值表现

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
过去三个月	12.19%	0.88%	10.43%	0.74%	1.76%	0.14%
过去六个月	28.73%	1.18%	18.77%	1.01%	9.96%	0.17%
过去一年	37.91%	1.27%	21.26%	1.07%	16.65%	0.20%
过去三年	46.82%	1.18%	27.60%	1.00%	19.22%	0.18%
过去五年	57.34%	1.09%	36.77%	0.93%	20.57%	0.16%
自基金合同生效起至今	151.28%	1.30%	87.56%	1.08%	63.72%	0.22%

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

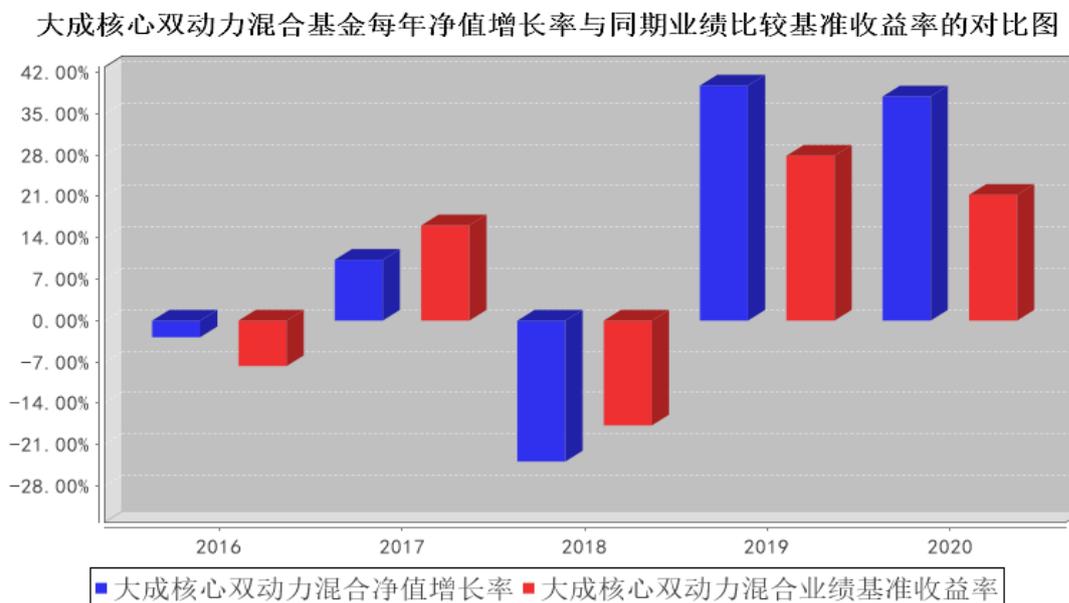
大成核心双动力混合累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



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。

3.2.3 过去五年基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较



注：合同生效当年按实际存续期计算，不按整个自然年度进行折算。

3.3 过去三年基金的利润分配情况

单位：人民币元

年度	每 10 份基金份额分 红数	现金形式发放总额	再投资形式发放总 额	年度利润分配合计	备注
2020 年	-	-	-	-	-
2019 年	-	-	-	-	-
2018 年	0.500	3,672,308.07	848,100.10	4,520,408.17	-
合计	0.500	3,672,308.07	848,100.10	4,520,408.17	-

§ 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%)。公司业务资质齐全，是全国同时具有境内、境外社保基金管理人资格和基本养老保险基金管理人资格的四家基金公司之一，全面涵盖公募基金、机构投资、海外投资、财富管理、养老金管理、私募股权投资等业务，旗下大成国际资产管理公司

具备 QFII、RQFII 以及 QFLP 等资格。

历经 21 年的发展，大成基金形成了以长期投资能力为核心竞争优势，打造了一支具有良好职业素养和丰富经验的资产管理队伍。目前已形成权益、固定收益、量化投资、商品期货、境外投资、大类资产配置等六大投资团队，全面覆盖各类投资领域。截至 2020 年 12 月 31 日，公司管理公募基金产品数量共 115 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 日至 2020 年 11 月 13 日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

4.1.4 基金经理薪酬机制

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 公平交易制度和控制方法

根据《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》的规定，公司制订了《大成基金管理有限公司公平交易制度》、《大成基金管理有限公司异常交易监控与报告制度》。公司旗下投资组合严格按照制度的规定，参与股票、债券的一级市场申购、二级市场交易等投资管理活动，内容包

括授权、研究分析、投资决策、交易执行、业绩评估等与投资活动相关的各个环节。研究部负责提供投资研究支持，投资部门负责投资决策，交易管理部负责实施交易并实时监控，监察稽核部负责事前监督、事中检查和事后稽核，风险管理部负责对交易情况进行合理性分析，通过各部门的协作互控，保证了公平交易的可操作、可稽核和可持续。

4.3.2 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。

4.3.2.1 增加执行的基金经理公平交易制度执行情况及公平交易管理情况

无。

4.3.3 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 7 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 5 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 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

2020 A 股市场表现优异，全年沪深 300 指数上涨 27.2%，创业板指数上涨 65.0%。一季度流感疫情的黑天鹅事件给全球经济增长造成巨大影响，且疫情持续时间远比初期市场预计的要长。中国防疫工作取得巨大胜利，经济受损情况远好于全球多数国家，吸引了大量国际资金流入 A 股。从板块上看，电力设备及新能源、食品饮料和消费者服务涨幅领先，而综合金融、房地产和通信等行业则表现不佳，从市场风格上看，成长风格明显好于价值风格。

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 1.546 元；本报告期基金份额净值增长率为 37.91%，业绩比较基准收益率为 21.26%。

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 2021，随着新冠疫苗的推出，全球疫情正逐渐好转，但是预计防疫措施依然是长期工作，对各行各业的经营模式和盈利增长依然有显著影响。一些受疫情影响大的行业，如餐饮、旅游、航空等可能在今年迎来反弹行情，另外年初以来外资仍延续净流入态势，社养老、银行理财等长期资金也有望逐渐入市，对股市形成长线支撑。

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 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

本报告期内，依据相关的法律法规、基金合同以及内部监察稽核制度，本基金管理人对本基金运作、内部管理、制度执行及遵规守法情况进行了监察稽核。内部监察稽核的重点是：国家法律法规及行业监管规则的执行情况；基金合同的遵守情况；内部规章制度的执行情况；资讯管制和保密工作落实情况；员工职业操守规范情况，目的是规范基金财产的运作，防范和控制投资风险，确保经营业务的稳健运行和受托资产的安全完整，维护基金份额持有人的合法权益。

（一）根据最新的法律法规、规章、规范性文件，本基金管理人及时制定了相应的公司制度，并对现有制度进行不断修订和完善，确保本基金管理人内控制度的适时性、全面性和合法合规性。同时，为保障制度的适时性，避免部分内控制度、业务规则与业务发展不相适应，报告期内本基金管理人组织各部门对内部管理制度作了进一步梳理和完善。

（二）全面加强风险监控，不断提高基金业务风险管理水平。为督促各部门完善并落实各项内控措施，公司严格执行风险控制管理员制度，健全内控工作协调机制及监督机制，并进一步加强投资风险数量化评价能力及事前风险防范能力，有效防范相关业务风险。同时，公司严格执行投资报备制度，建立了基金从业人员证券投资管理监控信息系统，将投资报备工作纳入常态。

（三）日常监察和专项监察相结合，确保监察稽核的有效性和深入性。本年度，公司继续对本基金销售、宣传等方面的材料、协议及其他法律资料等进行了严格审查，对本基金各项投资比例、投资权限、基金交易、股票投资限制、股票库维护等方面进行实时监控，同时，还专门针对基金投资交易（包括公平交易、转债投资、投资权限、投资比例、流动性风险、基金重仓股等）、基金运营（基金头寸、基金结算、登记清算等）、网上交易、基金销售等进行专项监察。通过日常监察，保证了公司监察的全面性、实时性，通过专项监察，及时发现并纠正了业务中的潜在风险，

加强了业务部门和人员的风险意识，从而较好地预防了风险的发生。

（四）加强了对投资管理人员通讯工具在交易时间的集中管理，定期或不定期对投资管理人员的网络即时通讯记录、电话录音等进行抽查，有效的防范了各种形式的利益输送行为。

（五）以多种方式加强合规教育与培训，提高全公司的合规守法意识。及时向全公司传达与基金相关的法律法规，并要求公司各部门贯彻到日常工作中。公司监察稽核部通过解答各业务部门提出的法律问题，提供法律依据，对于较为重大疑难法律事项及时咨询公司外部律师或监管部门，避免了业务发展中的盲目性，及时防范风险，维护了基金份额持有人的利益。

4.7 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。

4.8 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。

4.9 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。

5.3 托管人对本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 2020 年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 审计报告

审计报告标题	审计报告
审计报告收件人	大成核心双动力混合型证券投资基金全体基金份额持有人
审计意见	我们审计了大成核心双动力混合型证券投资基金的财务报表（以下简称“大成核心双动力混合基金”），包括 2020 年 12 月 31 日的资产负债表，2020 年度的利润表、所有者权益（基金净值）变动表以及相关财务报表附注。 我们认为，后附的大成核心双动力混合基金的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则的规定编制，公允反映了大成核心双动力混合型证券投资基金 2020 年 12 月 31 日的财务状况以及 2020 年度的经营成果和净值变动情况。

形成审计意见的基础	<p>我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。审计报告的“注册会计师对财务报表审计的责任”部分进一步阐述了我们在这些准则下的责任。按照中国注册会计师职业道德守则，我们独立于大成核心双动力混合基金，并履行了职业道德方面的其他责任。我们相信，我们获取的审计证据是充分、适当的，为发表审计意见提供了基础。</p>
其他信息	<p>大成核心双动力混合型证券投资基金管理层对其他信息负责。其他信息包括年度报告中涵盖的信息，但不包括财务报表和我们的审计报告。</p> <p>我们对财务报表发表的审计意见不涵盖其他信息，我们也不对其他信息发表任何形式的鉴证结论。</p> <p>结合我们对财务报表的审计，我们的责任是阅读其他信息，在此过程中，考虑其他信息是否与财务报表或我们在审计过程中了解到的情况存在重大不一致或者似乎存在重大错报。基于我们已执行的工作，如果我们确定其他信息存在重大错报，我们应当报告该事实。在这方面，我们无任何事项需要报告。</p>
管理层和治理层对财务报表的责任	<p>管理层负责按照企业会计准则的规定编制财务报表，使其实现公允反映，并设计、执行和维护必要的内部控制，以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。</p> <p>在编制财务报表时，管理层负责评估大成核心双动力混合基金的持续经营能力，披露与持续经营相关的事项（如适用），并运用持续经营假设，除非计划进行清算、终止运营或别无其他现实的选择。</p> <p>治理层负责监督大成核心双动力混合基金的财务报告过程。</p>
注册会计师对财务报表审计的责任	<p>我们的目标是对财务报表整体是否不存在由于舞弊或错误导致的重大错报获取合理保证，并出具包含审计意见的审计报告。合理保证是高水平的保证，但并不能保证按照审计准则执行的审计在某一重大错报存在时总能发现。错报可能由于舞弊或错误导致，如果合理预期错报单独或汇总起来可能影响财务报表使用者依据财务报表作出的经济决策，则通常认为错报是重大的。</p> <p>在按照审计准则执行审计工作的过程中，我们运用职业判断，并保持职业怀疑。同时，我们也执行以下工作：</p> <p>（1）识别和评估由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险，设计和实施审计程序以应对这些风险，并获取充分、适当的审计证据，作为发表审计意见的基础。由于舞弊可能涉及串通、伪造、故意遗漏、虚假陈述或凌驾于内部控制之上，未能发现由于舞弊导致的重大错报的风险高于未能发现由于错误导致的重大错报的风险。</p> <p>（2）了解与审计相关的内部控制，以设计恰当的审计程序，但目的并非对内部控制的有效性发表意见。</p> <p>（3）评价管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计及相关披露的合理性。</p>

	<p>(4) 对管理层使用持续经营假设的恰当性得出结论。同时，根据获取的审计证据，就可能对大成核心双动力混合基金持续经营能力产生重大疑虑的事项或情况是否存在重大不确定性得出结论。如果我们得出结论认为存在重大不确定性，审计准则要求我们在审计报告中提请报表使用者注意财务报表中的相关披露；如果披露不充分，我们应当发表非无保留意见。我们的结论基于截至审计报告日可获得的信息。然而，未来的事项或情况可能导致大成核心双动力混合基金不能持续经营。</p> <p>(5) 评价财务报表的总体列报（包括披露）、结构和内容，并评价财务报表是否公允反映相关交易和事项。我们与治理层就计划的审计范围、时间安排和重大审计发现等事项进行沟通，包括沟通我们在审计中识别出的值得关注的内部控制缺陷。</p>
会计师事务所的名称	安永华明会计师事务所(特殊普通合伙)
注册会计师的姓名	昌华 高鹤
会计师事务所的地址	北京市东城区东长安街1号东方广场安永大楼17层01-12室
审计报告日期	2021年3月29日

§ 7 年度财务报表

7.1 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12月31日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2020年12月31日	上年度末 2019年12月31日
资产：			
银行存款	7.4.7.1	22,906,397.91	16,697,848.68
结算备付金		-	-
存出保证金		62,621.81	28,900.86
交易性金融资产	7.4.7.2	155,059,972.54	94,222,049.41
其中：股票投资		155,059,972.54	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	7.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	-	-
应收证券清算款		451,855.42	1,256.56
应收利息	7.4.7.5	2,264.79	3,075.23
应收股利		-	-
应收申购款		5,284.01	9,043.82

递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.6	-	-
资产总计		178,488,396.48	110,962,174.56
负债和所有者权益	附注号	本期末 2020年12月31日	上年度末 2019年12月31日
负 债:			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	7.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		-	-
应付赎回款		178,316.54	294,525.94
应付管理人报酬		219,528.16	139,570.82
应付托管费		36,588.02	23,261.82
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	7.4.7.7	77,582.76	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	7.4.7.8	185,626.62	131,042.26
负债合计		697,642.10	646,625.17
所有者权益:			
实收基金	7.4.7.9	115,003,796.49	98,448,114.79
未分配利润	7.4.7.10	62,786,957.89	11,867,434.60
所有者权益合计		177,790,754.38	110,315,549.39
负债和所有者权益总计		178,488,396.48	110,962,174.56

注：报告截止日 2020 年 12 月 31 日，基金份额净值 1.546 元，基金份额总额 115,003,796.49 份。

7.2 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 12 月 31 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 12 月 31 日	2019 年 1 月 1 日至 2019 年 12 月 31 日
一、收入		57,416,955.03	34,445,377.73
1. 利息收入		98,547.74	115,980.18
其中：存款利息收入	7.4.7.11	98,547.74	115,980.18
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）		51,357,624.22	16,886,519.39
其中：股票投资收益	7.4.7.12	48,701,063.30	15,236,861.59
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.13	-	-
资产支持证券投资		-	-
收益			
贵金属投资收益	7.4.7.14	-	-
衍生工具收益	7.4.7.15	-	-
股利收益	7.4.7.16	2,656,560.92	1,649,657.80
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.17	5,850,873.75	17,372,416.35
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）			-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.18	109,909.32	70,461.81
减：二、费用		4,184,612.90	2,366,993.08
1. 管理人报酬	7.4.10.2.1	2,233,468.53	1,488,235.78
2. 托管费	7.4.10.2.2	372,244.72	248,039.36
3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用	7.4.7.19	1,389,887.67	497,846.59
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	7.4.7.20	189,011.98	132,871.35
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		53,232,342.13	32,078,384.65
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		53,232,342.13	32,078,384.65

7.3 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12月31日

单位：人民币元

项目	本期
	2020年1月1日至2020年12月31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)	-	53,232,342.13	53,232,342.13
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)	16,555,681.70	-2,312,818.84	14,242,862.86
其中:1.基金申购款	141,806,689.01	40,476,659.76	182,283,348.77
2.基金赎回款	-125,251,007.31	-42,789,478.60	-168,040,485.91
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)	115,003,796.49	62,786,957.89	177,790,754.38
项目	上年度可比期间 2019年1月1日至2019年12月31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)	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)	-	32,078,384.65	32,078,384.65
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)	7,557,228.91	-2,237,010.17	5,320,218.74
其中:1.基金申购款	63,959,400.80	-70,674.93	63,888,725.87
2.基金赎回款	-56,402,171.89	-2,166,335.24	-58,568,507.13
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）	98,448,114.79	11,867,434.60	110,315,549.39

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.4 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

7.4 报表附注

7.4.1 基金基本情况

大成核心双动力混合型证券投资基金(原名大成核心双动力股票型证券投资基金，以下简称“本基金”)，系经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监基金字[2010]591号文《关于核准大成核心双动力股票型证券投资基金募集的批复》的核准，由基金管理人大成基金管理有限公司向社会公开发行募集，基金合同于 2010 年 6 月 22 日正式生效，首次设立募集规模为 1,173,262,454.69 份基金份额。本基金为契约型开放式，存续期限不定。本基金的基金管理人为大成基金管理有限公司，注册登记机构为大成基金管理有限公司，基金托管人为中国工商银行股份有限公司(简称“中国工商银行”)。

根据中国证监会 2014 年 7 月 7 日颁布的《公开募集证券投资基金运作管理办法》的有关规定，经与本基金托管人中国工商银行协商一致，自 2015 年 7 月 22 日起本基金名称变更为“大成核心双动力混合型证券投资基金”；基金简称变更为“大成核心双动力混合”；基金类别变更为“混合型”。上述事项已报中国证监会备案。

本基金的投资对象为具有较好流动性的金融工具，包括国内依法发行交易的股票、债券、权证及法律、法规或监管机构允许基金投资的其他金融工具。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。本基金是混合型基金，对股票类资产的投资比例不低于基金资产的 60%，在满足股票投资比例要求的基础上，可以投资于非股票类金融工具。本基金股票资产、存托凭证占基金资产的比例范围为 60%-95%；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%；现金(不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等)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%。因基金规模或市场变化等因素导致投资组合不符合上述规定的，基金管理人应在合

理的期限内调整基金的投资组合，以符合上述比例限定。法律法规另有规定时，从其规定。如法律法规或监管机构以后允许本基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围，并可依据届时有效的法律法规适时合理地调整投资范围。本基金的业绩比较基准为：沪深 300 指数×75%+中证综合债券指数×25%。

7.4.2 会计报表的编制基础

本财务报表系按照财政部颁布的《企业会计准则—基本准则》以及其后颁布及修订的具体会计准则、应用指南、解释以及其他相关规定（以下合称“企业会计准则”）编制，同时，对于在具体会计核算和信息披露方面，也参考了中国证券投资基金业协会修订并发布的《证券投资基金会计核算业务指引》、中国证监会制定的《中国证券监督管理委员会关于证券投资基金估值业务的指导意见》、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》、《证券投资基金信息披露内容与格式准则》第 2 号《年度报告的内容与格式》、《证券投资基金信息披露编报规则》第 3 号《会计报表附注的编制及披露》、《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号〈年度报告和中期报告〉》及其他中国证监会及中国证券投资基金业协会颁布的相关规定。本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金于 2020 年 12 月 31 日的财务状况以及 2020 年度的经营成果和净值变动情况。

7.4.4 重要会计政策和会计估计

7.4.4.1 会计年度

本基金会计年度采用公历年度，即每年 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

7.4.4.2 记账本位币

本基金记账本位币和编制本财务报表所采用的货币均为人民币。除有特别说明外，均以人民币元为单位表示。

7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

金融工具是指形成本基金的金融资产（或负债），并形成其他单位的金融负债（或资产）或权益工具的合同。

（1）金融资产分类

本基金的金融资产于初始确认时分为以下两类：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、贷款和应收款项；

本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产主要包括股票投资、债券投资和衍生工具等；

本基金目前持有的其他金融资产分类为应收款项，包括银行存款、结算备付金、买入返售金融资产和各类应收款项等。

(2) 金融负债分类

本基金的金融负债于初始确认时归类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债和其他金融负债。

本基金目前持有的金融负债划分为其他金融负债。

7.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

初始确认

本基金于成为金融工具合同的一方时确认一项金融资产或金融负债，按照取得时的公允价值作为初始确认金额。划分为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产取得时发生的相关交易费用计入当期损益；应收款项及其他金融负债的相关交易费用计入初始确认金额。

后续计量

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产采用公允价值进行后续计量。在持有该类金融资产期间取得的利息或现金股利，应当确认为当期收益。每日，本基金将以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产或金融负债的公允价值变动计入当期损益；应收款项及其他金融负债采用实际利率法，按照摊余成本进行后续计量，其摊销或减值产生的利得或损失，均计入当期损益。

终止确认

当收取该金融资产现金流量的合同权利终止，或该金融资产已转移，且符合金融资产转移的终止确认条件的，金融资产将终止确认；

当金融负债的现时义务全部或部分已经解除的，该金融负债或其一部分将终止确认；

处置该金融资产或金融负债时，其公允价值与初始入账金额之间的差额应确认为投资收益，同时调整公允价值变动收益。

金融资产转移

本基金已将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方的，终止确认该金融资产；保留了金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬的，不终止确认该金融资产；本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬的，分别下列情况处理：放弃了对该金融资产控制的，终止确认该金融资产并确认产生的资产和负债；未放弃对该金融资产控制的，按照其继续涉入所转移金融资产的程度确认有关金融资产，并相应确认有关负债。

7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

公允价值，是指市场参与者在计量日发生的有序交易中，出售一项资产所能收到或者转移一项负债所需支付的价格。本基金以公允价值计量相关资产或负债，假定出售资产或者转移负债的有序交易在相关资产或负债的主要市场进行；不存在主要市场的，本基金假定该交易在相关资产或负债的最有利市场进行。主要市场(或最有利市场)是本基金在计量日能够进入的交易市场。本基金采用市场参与者在对该资产或负债定价时为实现其经济利益最大化所使用的假设。

在财务报表中以公允价值计量或披露的资产和负债，根据对公允价值计量整体而言具有重要意义的最低层次输入值，确定所属的公允价值层次：第一层次输入值，在计量日能够取得的相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价；第二层次输入值，除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值；第三层次输入值，相关资产或负债的不可观察输入值。

每个资产负债表日，本基金对在财务报表中确认的持续以公允价值计量的资产和负债进行重新评估，以确定是否在公允价值计量层次之间发生转换。

本基金持有的股票投资、债券投资和权证投资等投资按如下原则确定公允价值并进行估值：

(1) 存在活跃市场的金融工具，按照估值日能够取得的相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价作为公允价值；估值日无报价且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，采用最近交易日的报价确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的报价不能真实反映公允价值的，应对报价进行调整，确定公允价值。

与上述投资品种相同，但具有不同特征的，应以相同资产或负债的公允价值为基础，并在估值技术中考虑不同特征因素的影响。特征是指对资产出售或使用的限制等，如果该限制是针对资产持有者的，那么在估值技术中不应将该限制作为特征考虑。此外，基金管理人不应考虑因大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价。

(2) 不存在活跃市场的金融工具，采用在当前情况下适用并且有足够可利用数据和其他信息支持的估值技术确定公允价值。采用估值技术确定公允价值时，应优先使用可观察输入值，只有在无法取得相关资产或负债可观察输入值或取得不切实可行的情况下，才使用不可观察输入值。

(3) 如有确凿证据表明按上述方法进行估值不能客观反映其公允价值的，基金管理人可根据具体情况与基金托管人商定后，按最能反映公允价值的方法估值；

(4) 如有新增事项，按国家最新规定估值。

7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

当本基金同时满足下列条件时，金融资产和金融负债以相互抵销后的净额在资产负债表内列示：具有抵销已确认金额的法定权利，且该种法定权利是当前可执行的；计划以净额结算，或同

时变现该金融资产和清偿该金融负债。

7.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行的基金份额总额所对应的金额。由于申购和赎回引起的实收基金份额变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日确认。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

7.4.4.8 损益平准金

损益平准金包括已实现损益平准金和未实现损益平准金。已实现损益平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现收益/（损失）占基金净值比例计算的金额。未实现损益平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未实现利得/（损失）占基金净值比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日确认。未实现损益平准金与已实现损益平准金均在“损益平准金”科目中核算，并于期末全额转入“未分配利润/（累计亏损）”。

7.4.4.9 收入/（损失）的确认和计量

（1）存款利息收入按存款的本金与适用的利率逐日计提的金额入账。若提前支取定期存款，按协议规定的利率及持有期重新计算存款利息收入，并根据提前支取所实际收到的利息收入与账面已确认的利息收入的差额确认利息损失，列入利息收入减项，存款利息收入以净额列示；

（2）债券利息收入按债券票面价值与票面利率或内含票面利率计算的金额扣除应由债券发行企业代扣代缴的个人所得税及应由管理人缴纳的增值税后的净额确认，在债券实际持有期内逐日计提；

（3）资产支持证券利息收入按证券票面价值与票面利率计算的金额，扣除应由资产支持证券发行企业代扣代缴的个人所得税及应由管理人缴纳的增值税后的净额确认，在证券实际持有期内逐日计提；

（4）买入返售金融资产收入，按买入返售金融资产的成本及实际利率（当实际利率与合同利率差异较小时，也可以用合同利率），在回购期内逐日计提；

（5）股票投资收益/（损失）于卖出股票成交日确认，并按卖出股票成交金额与其成本的差额入账；

（6）债券投资收益/（损失）于成交日确认，并按成交总额与其成本、应收利息的差额入账；

（7）衍生工具收益/（损失）于卖出权证成交日确认，并按卖出权证成交金额与其成本的差额扣除应由基金管理人缴纳的增值税后的净额入账；

（8）股利收益于除息日确认，并按上市公司宣告的分红派息比例计算的金额扣除应由上市公

司代扣代缴的个人所得税后的净额入账；

(9) 公允价值变动收益/（损失）系本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债等公允价值变动形成的应计入当期损益的利得或损失；

(10) 其他收入在主要风险和报酬已经转移给对方，经济利益很可能流入且金额可以可靠计量的时候确认。

7.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬和托管费等费用在费用涵盖期间按基金合同或相关公告约定的费率和计算方法逐日确认。

其他金融负债在持有期间确认的利息支出按实际利率计算，当实际利率与合同利率差异较小时，也可以用合同利率计算。

7.4.4.11 基金的收益分配政策

(1) 在符合有关基金分红条件的前提下，本基金每年收益分配次数最多为 6 次，每次收益分配比例不得低于收益分配基准日可供分配利润的 20%，若《基金合同》生效不满 3 个月可不进行收益分配。

(2) 本基金收益分配方式分两种：现金分红与红利再投资，投资者可选择现金红利或将现金红利自动转为基金份额进行再投资；若投资者不选择，本基金默认的收益分配方式是现金分红。

(3) 基金红利发放日距离收益分配基准日（即可供分配利润计算截止日）的时间不得超过 15 个工作日。

(4) 每一基金份额享有同等分配权。

(5) 法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

7.4.4.12 分部报告

截至本报告期末，本基金仅在中国大陆境内从事证券投资单一业务，因此，无需作披露的分部报告。

7.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计

本基金本报告期间无需要说明的其他重要会计政策和会计估计事项。

7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

7.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期末发生会计政策变更。

7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期末未发生会计估计变更。

7.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无重大会计差错更正。

7.4.6 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。

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。

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。

暂免征收储蓄存款利息所得个人所得税。

7.4.7 重要财务报表项目的说明

7.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2020 年 12 月 31 日	上年度末 2019 年 12 月 31 日
活期存款	22,906,397.91	16,697,848.68
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	22,906,397.91	16,697,848.68

7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2020 年 12 月 31 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	137,927,575.70	155,059,972.54	17,132,396.84
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	137,927,575.70	155,059,972.54	17,132,396.84
项目	上年度末		
	2019年12月31日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	82,940,526.32	94,222,049.41	11,281,523.09
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	82,940,526.32	94,222,049.41	11,281,523.09

7.4.7.3 衍生金融资产/负债

无。

7.4.7.4 买入返售金融资产

无。

7.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2020年12月31日	上年度末 2019年12月31日
应收活期存款利息	2,234.46	3,060.10
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	-	-
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	2.13
应收黄金合约拆借孳息	-	-
应收出借证券利息	-	-
其他	28.20	13.00
合计	2,264.79	3,075.23

7.4.7.6 其他资产

无。

7.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2020年12月31日	上年度末 2019年12月31日
交易所市场应付交易费用	77,582.76	58,224.33
银行间市场应付交易费用	-	-
合计	77,582.76	58,224.33

7.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2020年12月31日	上年度末 2019年12月31日
应付券商交易单元保证金	-	-
应付赎回费	626.62	1,042.26
应付证券出借违约金	-	-
预提费用	185,000.00	130,000.00
合计	185,626.62	131,042.26

7.4.7.9 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12月31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	141,806,689.01	141,806,689.01
本期赎回（以“-”号填列）	-125,251,007.31	-125,251,007.31
- 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	115,003,796.49	115,003,796.49

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)。

7.4.7.10 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	47,381,468.38	5,850,873.75	53,232,342.13
本期基金份额交易产生的变动数	6,752,460.93	-9,065,279.77	-2,312,818.84
其中：基金申购款	54,060,540.41	-13,583,880.65	40,476,659.76
基金赎回款	-47,308,079.48	4,518,600.88	-42,789,478.60
本期已分配利润	-	-	-
本期末	65,440,872.31	-2,653,914.42	62,786,957.89

7.4.7.11 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12月31日	上年度可比期间 2019年1月1日至2019年12月31日
活期存款利息收入	91,813.84	113,814.99
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	6,092.55	1,840.71
其他	641.35	324.48
合计	98,547.74	115,980.18

7.4.7.12 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12月31日	上年度可比期间 2019年1月1日至2019年12月31日
卖出股票成交总额	453,828,733.51	159,676,750.38
减：卖出股票成本总额	405,127,670.21	144,439,888.79
买卖股票差价收入	48,701,063.30	15,236,861.59

7.4.7.13 债券投资收益

无。

7.4.7.14 贵金属投资收益

无。

7.4.7.15 衍生工具收益

无。

7.4.7.16 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年12月31日	上年度可比期间 2019年1月1日至2019年12月31日
股票投资产生的股利收益	2,656,560.92	1,649,657.80
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	2,656,560.92	1,649,657.80
----	--------------	--------------

7.4.7.17 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 12月31日	上年度可比期间 2019年1月1日至2019 年12月31日
1. 交易性金融资产	5,850,873.75	17,372,416.35
股票投资	5,850,873.75	17,372,416.35
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	5,850,873.75	17,372,416.35

7.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年12月 31日	上年度可比期间 2019年1月1日至2019年 12月31日
基金赎回费收入	101,935.26	70,251.57
基金转换费收入	7,974.06	210.24
合计	109,909.32	70,461.81

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总额的 25% 归入转出基金的基金资产。

7.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年12月 31日	上年度可比期间 2019年1月1日至2019年12月31日
交易所市场交易费用	1,389,887.67	497,846.59
银行间市场交易费用	-	-
合计	1,389,887.67	497,846.59

7.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
----	----	---------

	2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日	2019 年 1 月 1 日至 2019 年 12 月 31 日
审计费用	65,000.00	50,000.00
信息披露费	120,000.00	80,000.00
证券出借违约金	-	-
银行划款手续费	4,011.98	2,871.35
合计	189,011.98	132,871.35

7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

7.4.8.1 或有事项

无。

7.4.8.2 资产负债表日后事项

无。

7.4.9 关联方关系

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
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
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：以下关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

7.4.10.1.1 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 12 月 31 日		上年度可比期间 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 12 月 31 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	0.26	31,753,846.72	10.23
------	--------------	------	---------------	-------

7.4.10.1.2 债券交易

无。

7.4.10.1.3 债券回购交易

无。

7.4.10.1.4 权证交易

无。

7.4.10.1.5 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12月31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	0.26	-	-
关联方名称	上年度可比期间 2019年1月1日至2019年12月31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	28,937.25	10.23	13,995.29	24.04

注：(1) 上述佣金按市场佣金率计算，以扣除由中国证券登记结算有限责任公司收取的证管费和经手费后的净额列示。

(2) 该类佣金协议的服务范围还包括佣金收取方为本基金提供的证券投资研究成果和市场信息服务等。

7.4.10.2 关联方报酬

7.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年12 月31日	上年度可比期间 2019年1月1日至2019年 12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	2,233,468.53	1,488,235.78
其中：支付销售机构的客户维护费	193,131.17	207,637.94

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

7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日	2019 年 1 月 1 日至 2019 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的托管费	372,244.72	248,039.36

注：基金托管费每日计提，逐日累计值每月月末，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

7.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

无。

7.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

无。

7.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

7.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

无。

7.4.10.5.2 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。

7.4.10.6 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12月31日		上年度可比期间 2019年1月1日至2019年12月31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	22,906,397.91	91,813.84	16,697,848.68	113,814.99

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。

7.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

无。

7.4.10.8 其他关联交易事项的说明

无。

7.4.11 利润分配情况

无。

7.4.12 期末(2020年12月31日)本基金持有的流通受限证券

7.4.12.1 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

7.4.12.1.1 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
003030	祖名股份	2020年12月25日	2021年1月6日	新股未上市	15.18	15.18	480	7,286.40	7,286.40	-
003031	中瓷电子	2020年12月24日	2021年1月4日	新股未上市	15.27	15.27	387	5,909.49	5,909.49	-
300864	南大环境	2020年8月13日	2021年2月25日	新股锁定	71.71	90.85	66	4,732.86	5,996.10	-
300867	圣元环保	2020年8月12日	2021年3月3日	新股锁定	19.34	31.97	390	7,542.60	12,468.30	-
300868	杰美	2020	2021	新股锁	41.26	43.28	146	6,023.96	6,318.88	-

	特	年 8 月	年 2 月	定						
		12 日	24 日							
300873	海晨股份	2020年8月14日	2021年3月2日	新股锁定	30.72	41.32	172	5,283.84	7,107.04	-
300877	金春股份	2020年8月17日	2021年3月3日	新股锁定	30.54	50.85	222	6,779.88	11,288.70	-
300878	维康药业	2020年8月17日	2021年3月3日	新股锁定	41.34	48.72	166	6,862.44	8,087.52	-
300879	大叶股份	2020年8月25日	2021年3月1日	新股锁定	10.58	27.12	453	4,792.74	12,285.36	-
300882	万胜智能	2020年8月27日	2021年3月10日	新股锁定	10.33	25.79	440	4,545.20	11,347.60	-
300884	狄耐克	2020年11月5日	2021年5月12日	新股锁定	24.87	33.51	230	5,720.10	7,707.30	-
300886	华业香料	2020年9月8日	2021年3月16日	新股锁定	18.59	45.67	147	2,732.73	6,713.49	-
300887	谱尼测试	2020年9月9日	2021年3月16日	新股锁定	44.47	74.52	120	5,336.40	8,942.40	-
300889	爱克股份	2020年9月9日	2021年3月16日	新股锁定	27.97	30.12	235	6,572.95	7,078.20	-
300890	翔丰华	2020年9月10日	2021年3月18日	新股锁定	14.69	48.85	286	4,201.34	13,971.10	-
300891	惠云钛业	2020年9月10日	2021年3月17日	新股锁定	3.64	16.40	1,143	4,160.52	18,745.20	-
300892	品渥食品	2020年9月11日	2021年3月30日	新股锁定	26.66	60.01	159	4,238.94	9,541.59	-
300893	松原股份	2020年9月17日	2021年3月24日	新股锁定	13.47	35.08	238	3,205.86	8,349.04	-
300895	铜牛信息	2020年9月17日	2021年3月24日	新股锁定	12.65	45.30	262	3,314.30	11,868.60	-

300896	爱美客	2020年9月21日	2021年3月29日	新股锁定	118.27	603.36	71	8,397.17	42,838.56	-
300898	熊猫乳品	2020年10月9日	2021年4月16日	新股锁定	10.78	33.03	496	5,346.88	16,382.88	-
300900	广联航空	2020年10月19日	2021年4月29日	新股锁定	17.87	33.16	440	7,862.80	14,590.40	-
300908	仲景食品	2020年11月13日	2021年5月24日	新股锁定	39.74	60.44	132	5,245.68	7,978.08	-
300909	汇创达	2020年11月11日	2021年5月18日	新股锁定	29.57	40.67	232	6,860.24	9,435.44	-
300911	亿田智能	2020年11月24日	2021年6月3日	新股锁定	24.35	33.06	220	5,357.00	7,273.20	-
300917	特发服务	2020年12月14日	2021年6月21日	新股锁定	18.78	31.94	277	5,202.06	8,847.38	-
300918	南山智尚	2020年12月15日	2021年6月22日	新股锁定	4.97	8.94	967	4,805.99	8,644.98	-
300919	中伟股份	2020年12月15日	2021年6月23日	新股锁定	24.60	61.51	168	4,132.80	10,333.68	-
300922	天秦装备	2020年12月18日	2021年6月25日	新股锁定	16.05	31.58	287	4,606.35	9,063.46	-
300926	博俊科技	2020年12月29日	2021年1月7日	新股未上市	10.76	10.76	3,225	34,701.00	34,701.00	-
300926	博俊科技	2020年12月	2021年7月	新股锁定	10.76	10.76	359	3,862.84	3,862.84	-

		月 29 日	7 日							
300927	江天化学	2020 年 12 月 29 日	2021 年 1 月 7 日	新股未上市	13.39	13.39	1,946	26,056.94	26,056.94	-
300927	江天化学	2020 年 12 月 29 日	2021 年 7 月 7 日	新股锁定	13.39	13.39	217	2,905.63	2,905.63	-
300999	金龙鱼	2020 年 9 月 29 日	2021 年 4 月 15 日	新股锁定	25.70	88.29	969	24,903.30	85,553.01	-
601995	中金公司	2020 年 10 月 22 日	2021 年 5 月 6 日	新股锁定	28.78	68.71	24,951	718,089.78	1,714,383.21	-
605277	新亚电子	2020 年 12 月 25 日	2021 年 1 月 6 日	新股未上市	16.95	16.95	507	8,593.65	8,593.65	-
688215	瑞晟智能	2020 年 8 月 20 日	2021 年 3 月 1 日	新股锁定	34.73	46.12	1,229	42,683.17	56,681.48	-
688301	奕瑞科技	2020 年 9 月 9 日	2021 年 3 月 18 日	新股锁定	119.60	162.72	680	81,328.00	110,649.60	-
688335	复洁环保	2020 年 8 月 7 日	2021 年 2 月 18 日	新股锁定	46.22	36.69	918	42,429.96	33,681.42	-
688550	瑞联新材	2020 年 8 月 24 日	2021 年 3 月 2 日	新股锁定	113.72	84.08	711	80,854.92	59,780.88	-
688617	惠泰医疗	2020 年 12 月 30 日	2021 年 1 月 7 日	新股未上市	74.46	74.46	535	39,836.10	39,836.10	-
688698	伟创电气	2020 年 12 月 22 日	2021 年 6 月 29 日	新股锁定	10.75	15.29	4,751	51,073.25	72,642.79	-

注：1. 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。根据《上海证券交易所科创板上市公司股东以向特定机构投资者询价转让和配售方式减持股份实施细则》，基金通过询价转让受让的股份，在受让后 6 个月内不得转让。

2. 根据《深圳证券交易所创业板首次公开发行证券发行与承销业务实施细则》，发行人和主承销商可以采用摇号限售方式或比例限售方式，安排基金通过网下发行获配的部分创业板股票设置不低于 6 个月的限售期。

3. 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。其中基金参与网下申购获得的新股或作为战略投资者参与配售获得的新股，在新股上市后的约定期限内不能自由转让；基金参与网上申购获配的新股，从新股获配日至新股上市日之间不能自由转让。

7.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

无。

7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

无。

7.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

无。

7.4.13 金融工具风险及管理

7.4.13.1 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。

7.4.13.2 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：0.00%)

7.4.13.3 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。

7.4.13.3.1 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。本报告期内，本基金未发生重大流动性风险事件。

7.4.13.4 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。

7.4.13.4.1 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、存出保证金。

7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2020 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	22,906,397.91	-	-	-	22,906,397.91
存出保证金	62,621.81	-	-	-	62,621.81
交易性金融资产	-	-	-	155,059,972.54	155,059,972.54
应收利息	-	-	-	2,264.79	2,264.79
应收申购款	-	-	-	5,284.01	5,284.01
应收证券清算款	-	-	-	451,855.42	451,855.42
资产总计	22,969,019.72	-	-	155,519,376.76	178,488,396.48
负债					
应付赎回款	-	-	-	178,316.54	178,316.54
应付管理人报酬	-	-	-	219,528.16	219,528.16
应付托管费	-	-	-	36,588.02	36,588.02

应付交易费用	-	-	-	77,582.76	77,582.76
其他负债	-	-	-	185,626.62	185,626.62
负债总计	-	-	-	697,642.10	697,642.10
利率敏感度缺口	22,969,019.72	-	-	-154,821,734.66	177,790,754.38
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，并按照合约规定的利率重新定价日或到期日孰早者予以分类。

7.4.13.4.1.2 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，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)。

7.4.13.4.2 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。

7.4.13.4.3 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%。

7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2020 年 12 月 31 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	155,059,972.54	87.21	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	155,059,972.54	87.21	94,222,049.41	85.41

7.4.13.4.3.2 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 12 月 31 日）	上年度末（2019 年 12 月 31 日）
分析	业绩比较基准上升 5%	10,327,094.67	6,133,464.40
	业绩比较基准下降 5%	-10,327,094.67	-6,133,464.40

7.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

1、承诺事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的承诺事项。

2、其他事项

(1) 公允价值

管理层已经评估了银行存款、结算备付金、买入返售金融资产、其他应收款项类投资以及其他金融负债因剩余期限不长，公允价值与账面价值相若。

各层次金融工具公允价值

于 2020 年 12 月 31 日，本基金持有的持续以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产中划分为第一层次的余额为人民币 152,494,243.62 元，划分为第二层次的余额为人民币 2,565,728.92 元，无划分为第三层次的余额。（于 2019 年 12 月 31 日，本基金持有的持续以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产中划分为第一层次的余额为人民币 91,334,424.97 元，划分为第二层次的余额为人民币 2,887,624.44 元，无划分为第三层次的余额。）

公允价值所属层次间重大变动

本基金调整公允价值计量层次转换时点的相关会计政策在前后各会计期间保持一致。

对于证券交易所上市的股票和可转换债券，若出现重大事项停牌或交易不活跃（包括涨跌停时的交易不活跃）等情况，本基金不会于停牌日至交易恢复活跃日期间及交易不活跃期间将相关股票和可转换债券的公允价值列入第一层次；并根据估值调整中采用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度，确定相关股票和可转换债券公允价值应属第二层次还是第三层次。

第三层次公允价值期初金额和本期变动金额

本基金于本报告期初未持有公允价值归属于第三层次的金融工具，本基金本报告期未发生第三层次公允价值转入转出情况。

(2) 除公允价值外，截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

3、财务报表的批准

本财务报表已于 2021 年 03 月 29 日经本基金的基金管理人批准。

§ 8 投资组合报告

8.1 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	155,059,972.54	86.87
	其中：股票	155,059,972.54	86.87
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	22,906,397.91	12.83
8	其他各项资产	522,026.03	0.29
9	合计	178,488,396.48	100.00

8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

8.2.1 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	2,245,936.00	1.26
B	采矿业	3,301,583.00	1.86
C	制造业	73,101,925.24	41.12
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	5,699,580.00	3.21
E	建筑业	2,676,480.00	1.51
F	批发和零售业	4,408,769.59	2.48
G	交通运输、仓储和邮政业	4,044,369.04	2.27
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	5,839,108.04	3.28
J	金融业	39,452,627.45	22.19
K	房地产业	4,912,758.38	2.76
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	3,983,182.40	2.24
N	水利、环境和公共设施管理业	18,464.40	0.01
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	1,752,500.00	0.99
Q	卫生和社会工作	3,225,228.00	1.81
R	文化、体育和娱乐业	397,461.00	0.22
S	综合	-	-
	合计	155,059,972.54	87.21

8.2.2 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。

8.3 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	000333	美的集团	72,700	7,156,588.00	4.03
2	000858	五 粮 液	18,200	5,311,670.00	2.99
3	600036	招商银行	106,200	4,667,490.00	2.63
4	002415	海康威视	94,200	4,569,642.00	2.57
5	600519	贵州茅台	2,200	4,395,600.00	2.47
6	601318	中国平安	47,500	4,131,550.00	2.32
7	603259	药明康德	29,500	3,974,240.00	2.24
8	000661	长春高新	8,500	3,815,735.00	2.15
9	601166	兴业银行	173,000	3,610,510.00	2.03
10	300059	东方财富	111,160	3,445,960.00	1.94
11	601939	建设银行	513,800	3,226,664.00	1.81
12	600104	上汽集团	130,200	3,182,088.00	1.79
13	600926	杭州银行	213,100	3,179,452.00	1.79
14	002001	新 和 成	92,400	3,112,032.00	1.75
15	601009	南京银行	384,600	3,107,568.00	1.75
16	000157	中联重科	308,300	3,052,170.00	1.72
17	601985	中国核电	602,100	2,962,332.00	1.67
18	000776	广发证券	178,400	2,904,352.00	1.63
19	000895	双汇发展	58,000	2,722,520.00	1.53
20	000166	申万宏源	497,300	2,625,744.00	1.48
21	600048	保利地产	164,700	2,605,554.00	1.47
22	002475	立讯精密	46,428	2,605,539.36	1.47
23	600998	九州通	136,500	2,478,840.00	1.39
24	601628	中国人寿	62,800	2,410,892.00	1.36
25	600745	闻泰科技	23,900	2,366,100.00	1.33
26	601688	华泰证券	130,900	2,357,509.00	1.33
27	002202	金风科技	164,600	2,345,550.00	1.32
28	300347	泰格医药	14,400	2,327,184.00	1.31
29	002493	荣盛石化	83,300	2,299,913.00	1.29
30	601668	中国建筑	459,800	2,285,206.00	1.29
31	002624	完美世界	77,100	2,274,450.00	1.28
32	300498	温氏股份	123,200	2,245,936.00	1.26
33	600760	中航沈飞	28,300	2,212,494.00	1.24
34	600027	华电国际	614,000	2,087,600.00	1.17
35	600570	恒生电子	19,620	2,058,138.00	1.16
36	002008	大族激光	47,900	2,047,725.00	1.15
37	600219	南山铝业	586,400	1,853,024.00	1.04
38	600585	海螺水泥	35,500	1,832,510.00	1.03
39	600018	上港集团	399,300	1,824,801.00	1.03
40	601899	紫金矿业	193,200	1,794,828.00	1.01

41	600989	宝丰能源	150,800	1,764,360.00	0.99
42	002352	顺丰控股	19,700	1,738,131.00	0.98
43	601377	兴业证券	198,900	1,726,452.00	0.97
44	601995	中金公司	24,951	1,714,383.21	0.96
45	002607	中公教育	46,800	1,644,084.00	0.92
46	000961	中南建设	179,800	1,587,634.00	0.89
47	300433	蓝思科技	50,300	1,539,683.00	0.87
48	601088	中国神华	48,300	869,883.00	0.49
49	600019	宝钢股份	133,900	796,705.00	0.45
50	002709	天赐材料	6,800	705,840.00	0.40
51	000625	长安汽车	30,200	660,776.00	0.37
52	600006	东风汽车	67,200	634,368.00	0.36
53	300496	中科创达	5,200	608,400.00	0.34
54	603882	金域医学	4,200	538,104.00	0.30
55	601933	永辉超市	70,400	505,472.00	0.28
56	600143	金发科技	29,100	498,774.00	0.28
57	000630	铜陵有色	193,800	498,066.00	0.28
58	600739	辽宁成大	19,900	483,968.00	0.27
59	002414	高德红外	11,400	475,950.00	0.27
60	603899	晨光文具	5,300	469,368.00	0.26
61	300482	万孚生物	5,200	463,892.00	0.26
62	600845	宝信软件	6,600	455,268.00	0.26
63	000027	深圳能源	73,300	446,397.00	0.25
64	600298	安琪酵母	8,500	434,095.00	0.24
65	002056	横店东磁	28,500	432,915.00	0.24
66	000988	华工科技	18,300	424,377.00	0.24
67	000623	吉林敖东	24,900	410,103.00	0.23
68	601717	郑煤机	37,000	404,410.00	0.23
69	000400	许继电气	27,900	403,434.00	0.23
70	002185	华天科技	29,600	403,152.00	0.23
71	002030	达安基因	11,700	401,310.00	0.23
72	002028	思源电气	19,700	395,182.00	0.22
73	000528	柳工	53,600	394,496.00	0.22
74	002124	天邦股份	26,600	388,360.00	0.22
75	000932	华菱钢铁	79,200	378,576.00	0.21
76	002511	中顺洁柔	18,000	375,660.00	0.21
77	600026	中远海能	56,200	375,416.00	0.21
78	600757	长江传媒	70,100	370,829.00	0.21
79	300244	迪安诊断	10,500	359,940.00	0.20
80	600039	四川路桥	78,400	353,584.00	0.20
81	002223	鱼跃医疗	12,500	352,625.00	0.20
82	600266	城建发展	69,300	352,044.00	0.20

83	300418	昆仑万维	17,200	343,140.00	0.19
84	002648	卫星石化	12,800	334,336.00	0.19
85	600056	中国医药	23,100	331,023.00	0.19
86	600729	重庆百货	10,900	315,010.00	0.18
87	601615	明阳智能	16,100	305,578.00	0.17
88	600751	海航科技	115,400	304,656.00	0.17
89	002233	塔牌集团	23,800	303,212.00	0.17
90	600177	雅戈尔	40,700	292,633.00	0.16
91	000519	中兵红箭	29,200	292,584.00	0.16
92	002281	光迅科技	9,900	287,496.00	0.16
93	002936	郑州银行	58,700	261,802.00	0.15
94	600339	中油工程	82,500	254,100.00	0.14
95	600064	南京高科	24,300	249,561.00	0.14
96	000581	威孚高科	10,100	234,219.00	0.13
97	002507	涪陵榨菜	5,100	215,730.00	0.12
98	002155	湖南黄金	23,900	203,389.00	0.11
99	000690	宝新能源	26,500	193,450.00	0.11
100	000937	冀中能源	40,700	169,312.00	0.10
101	600060	海信视像	14,100	161,868.00	0.09
102	600704	物产中大	36,300	158,631.00	0.09
103	600755	厦门国贸	21,500	143,620.00	0.08
104	000778	新兴铸管	35,000	128,800.00	0.07
105	601992	金隅集团	41,500	123,255.00	0.07
106	688301	奕瑞科技	680	110,649.60	0.06
107	603377	东方时尚	5,600	108,416.00	0.06
108	300999	金龙鱼	969	85,553.01	0.05
109	688698	伟创电气	4,751	72,642.79	0.04
110	601975	招商南油	28,400	71,284.00	0.04
111	002503	搜于特	31,300	70,112.00	0.04
112	300315	掌趣科技	13,500	68,985.00	0.04
113	600120	浙江东方	10,400	62,088.00	0.03
114	688550	瑞联新材	711	59,780.88	0.03
115	688215	瑞晟智能	1,229	56,681.48	0.03
116	300896	爱美客	71	42,838.56	0.02
117	688617	惠泰医疗	535	39,836.10	0.02
118	300926	博俊科技	3,584	38,563.84	0.02
119	688335	复洁环保	918	33,681.42	0.02
120	300927	江天化学	2,163	28,962.57	0.02
121	003026	中晶科技	461	21,740.76	0.01
122	002385	大北农	2,100	20,286.00	0.01
123	300891	惠云钛业	1,143	18,745.20	0.01
124	003029	吉大正元	716	18,716.24	0.01

125	003028	振邦智能	432	18,010.08	0.01
126	605179	一鸣食品	939	16,582.74	0.01
127	300898	熊猫乳品	496	16,382.88	0.01
128	300900	广联航空	440	14,590.40	0.01
129	300890	翔丰华	286	13,971.10	0.01
130	300867	圣元环保	390	12,468.30	0.01
131	300879	大叶股份	453	12,285.36	0.01
132	300895	铜牛信息	262	11,868.60	0.01
133	300882	万胜智能	440	11,347.60	0.01
134	300877	金春股份	222	11,288.70	0.01
135	002004	华邦健康	1,900	10,526.00	0.01
136	601155	新城控股	300	10,449.00	0.01
137	002540	亚太科技	2,000	10,400.00	0.01
138	601003	柳钢股份	2,000	10,380.00	0.01
139	300919	中伟股份	168	10,333.68	0.01
140	600782	新钢股份	2,200	10,098.00	0.01
141	600985	淮北矿业	900	10,071.00	0.01
142	600210	紫江企业	2,300	10,005.00	0.01
143	600325	华发股份	1,600	9,936.00	0.01
144	600170	上海建工	3,300	9,933.00	0.01
145	600901	江苏租赁	1,800	9,918.00	0.01
146	601216	君正集团	2,000	9,900.00	0.01
147	601328	交通银行	2,200	9,856.00	0.01
148	600023	浙能电力	2,700	9,801.00	0.01
149	600548	深高速	1,100	9,768.00	0.01
150	600970	中材国际	1,400	9,632.00	0.01
151	300892	品渥食品	159	9,541.59	0.01
152	600479	千金药业	1,100	9,504.00	0.01
153	601928	凤凰传媒	1,500	9,495.00	0.01
154	300909	汇创达	232	9,435.44	0.01
155	600376	首开股份	1,600	9,392.00	0.01
156	603365	水星家纺	700	9,345.00	0.01
157	600606	绿地控股	1,600	9,328.00	0.01
158	000789	万年青	700	9,310.00	0.01
159	001979	招商蛇口	700	9,303.00	0.01
160	600466	蓝光发展	2,000	9,260.00	0.01
161	603858	步长制药	400	9,228.00	0.01
162	000069	华侨城 A	1,300	9,217.00	0.01
163	002775	文科园林	1,900	9,215.00	0.01
164	600377	宁沪高速	1,000	9,210.00	0.01
165	002303	美盈森	2,300	9,200.00	0.01
166	002327	富安娜	1,200	9,192.00	0.01

167	603878	武进不锈	1,200	9,144.00	0.01
168	300922	天秦装备	287	9,063.46	0.01
169	600153	建发股份	1,100	9,031.00	0.01
170	000402	金融街	1,400	9,030.00	0.01
171	002533	金杯电工	1,700	9,027.00	0.01
172	300887	谱尼测试	120	8,942.40	0.01
173	000090	天健集团	1,500	8,910.00	0.01
174	002443	金洲管道	1,400	8,876.00	0.00
175	603839	安正时尚	900	8,874.00	0.00
176	300917	特发服务	277	8,847.38	0.00
177	002367	康力电梯	900	8,847.00	0.00
178	600823	世茂股份	1,900	8,759.00	0.00
179	600350	山东高速	1,400	8,652.00	0.00
179	300193	佳士科技	1,200	8,652.00	0.00
180	300918	南山智尚	967	8,644.98	0.00
181	605277	新亚电子	507	8,593.65	0.00
182	601098	中南传媒	900	8,577.00	0.00
183	000156	华数传媒	1,000	8,560.00	0.00
184	000656	金科股份	1,200	8,508.00	0.00
185	300893	松原股份	238	8,349.04	0.00
186	600383	金地集团	600	8,100.00	0.00
187	300878	维康药业	166	8,087.52	0.00
188	300908	仲景食品	132	7,978.08	0.00
189	002146	荣盛发展	1,200	7,836.00	0.00
190	300884	狄耐克	230	7,707.30	0.00
191	003030	祖名股份	480	7,286.40	0.00
192	300911	亿田智能	220	7,273.20	0.00
193	300873	海晨股份	172	7,107.04	0.00
194	300889	爱克股份	235	7,078.20	0.00
195	300886	华业香料	147	6,713.49	0.00
196	300868	杰美特	146	6,318.88	0.00
197	300864	南大环境	66	5,996.10	0.00
198	003031	中瓷电子	387	5,909.49	0.00
199	600837	海通证券	34	437.24	0.00
200	002602	世纪华通	20	142.20	0.00

8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

8.4.1 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	8,524,384.14	7.73
2	600036	招商银行	8,187,310.70	7.42

3	000858	五 粮 液	8,173,184.25	7.41
4	601318	中国平安	8,162,598.00	7.40
5	000776	广发证券	8,162,397.00	7.40
6	000333	美的集团	7,591,443.08	6.88
7	601688	华泰证券	7,290,243.68	6.61
8	300433	蓝思科技	7,029,821.55	6.37
9	601166	兴业银行	7,014,009.00	6.36
10	000001	平安银行	6,874,032.00	6.23
11	601009	南京银行	6,083,684.00	5.51
12	300003	乐普医疗	5,981,840.92	5.42
13	002624	完美世界	5,943,709.93	5.39
14	002202	金风科技	5,573,842.39	5.05
15	300498	温氏股份	5,432,489.00	4.92
16	600018	上港集团	5,418,830.00	4.91
17	000661	长春高新	5,361,043.00	4.86
18	300059	东方财富	5,296,097.80	4.80
19	600390	五矿资本	5,283,710.88	4.79
20	002001	新 和 成	5,230,369.00	4.74
21	600104	上汽集团	5,104,643.00	4.63
22	000157	中联重科	4,960,479.00	4.50
23	600519	贵州茅台	4,885,937.00	4.43
24	000963	华东医药	4,614,742.00	4.18
25	000895	双汇发展	4,528,203.00	4.10
26	002415	海康威视	4,485,985.00	4.07
27	000338	潍柴动力	4,480,070.00	4.06
28	600030	中信证券	4,428,556.50	4.01
29	601939	建设银行	4,358,896.00	3.95
30	300628	亿联网络	4,168,220.83	3.78
31	601628	中国人寿	4,136,613.00	3.75
32	601668	中国建筑	3,983,586.00	3.61
33	002142	宁波银行	3,890,206.00	3.53
34	601012	隆基股份	3,877,702.00	3.52
35	600760	中航沈飞	3,840,599.00	3.48
36	600745	闻泰科技	3,792,067.00	3.44
37	002236	大华股份	3,733,082.00	3.38
38	000166	申万宏源	3,731,546.95	3.38
39	002916	深南电路	3,726,526.00	3.38
40	000961	中南建设	3,696,366.00	3.35
41	601066	中信建投	3,583,619.00	3.25
42	600998	九州通	3,539,088.00	3.21
43	002607	中公教育	3,401,989.00	3.08
44	603259	药明康德	3,333,258.60	3.02

45	601998	中信银行	3,293,940.00	2.99
46	601006	大秦铁路	3,250,490.00	2.95
47	600027	华电国际	3,194,294.00	2.90
48	002475	立讯精密	2,974,345.00	2.70
49	600887	伊利股份	2,837,974.00	2.57
50	002555	三七互娱	2,794,534.00	2.53
51	601985	中国核电	2,724,502.00	2.47
52	600048	保利地产	2,710,641.00	2.46
53	600926	杭州银行	2,675,279.00	2.43
54	600566	济川药业	2,663,716.00	2.41
55	600346	恒力石化	2,637,163.00	2.39
56	601601	中国太保	2,558,905.00	2.32
57	002602	世纪华通	2,331,351.00	2.11
58	600383	金地集团	2,316,659.00	2.10
59	601377	兴业证券	2,289,380.00	2.08
60	600585	海螺水泥	2,250,825.00	2.04

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。

8.4.2 累计卖出金额超期初基金资产净值 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	600276	恒瑞医药	10,294,760.00	9.33
2	000001	平安银行	7,007,034.00	6.35
3	601318	中国平安	6,465,532.00	5.86
4	000963	华东医药	6,258,466.00	5.67
5	300433	蓝思科技	6,199,622.75	5.62
6	601166	兴业银行	5,440,476.08	4.93
7	000776	广发证券	5,316,784.00	4.82
8	000858	五粮液	5,278,845.00	4.79
9	000338	潍柴动力	5,238,159.86	4.75
10	600390	五矿资本	5,173,536.00	4.69
11	002236	大华股份	5,089,205.00	4.61
12	300003	乐普医疗	4,918,870.00	4.46
13	601688	华泰证券	4,892,556.00	4.44
14	601012	隆基股份	4,795,282.28	4.35
15	600519	贵州茅台	4,569,053.00	4.14
16	600030	中信证券	4,464,992.00	4.05
17	002624	完美世界	4,432,074.82	4.02
18	601066	中信建投	4,377,462.00	3.97
19	002475	立讯精密	4,244,605.61	3.85
20	300628	亿联网络	4,154,453.92	3.77
21	000333	美的集团	4,152,638.44	3.76

22	600760	中航沈飞	4,043,247.00	3.67
23	600036	招商银行	4,036,082.00	3.66
24	300059	东方财富	4,021,126.85	3.65
25	002142	宁波银行	3,962,187.00	3.59
26	601628	中国人寿	3,922,202.00	3.56
27	002916	深南电路	3,800,258.00	3.44
28	601006	大秦铁路	3,795,877.00	3.44
29	600018	上港集团	3,675,709.00	3.33
30	000895	双汇发展	3,509,146.09	3.18
31	601998	中信银行	3,331,153.60	3.02
32	002202	金风科技	3,308,783.00	3.00
33	002508	老板电器	3,285,380.82	2.98
34	000157	中联重科	3,229,245.00	2.93
35	688981	中芯国际	3,221,573.51	2.92
36	600837	海通证券	3,160,725.00	2.87
37	600346	恒力石化	3,153,960.00	2.86
38	601009	南京银行	3,115,287.00	2.82
39	600383	金地集团	3,021,484.00	2.74
40	601328	交通银行	2,993,264.00	2.71
41	601988	中国银行	2,935,648.00	2.66
42	600566	济川药业	2,885,763.00	2.62
43	600887	伊利股份	2,874,487.00	2.61
44	002001	新和成	2,803,179.70	2.54
45	300498	温氏股份	2,658,476.60	2.41
46	600352	浙江龙盛	2,514,588.00	2.28
47	601899	紫金矿业	2,510,361.00	2.28
48	600809	山西汾酒	2,486,925.00	2.25
49	600919	江苏银行	2,481,284.48	2.25
50	000876	新希望	2,465,323.00	2.23
51	600570	恒生电子	2,411,612.00	2.19
52	601601	中国太保	2,382,790.00	2.16
53	600031	三一重工	2,363,207.00	2.14
54	002602	世纪华通	2,355,027.00	2.13
55	000961	中南建设	2,340,975.00	2.12
56	000656	金科股份	2,307,136.00	2.09
57	601377	兴业证券	2,283,846.00	2.07
58	002607	中公教育	2,238,115.21	2.03

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。

8.4.3 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	460,114,719.59
--------------	----------------

卖出股票收入（成交）总额	453,828,733.51
--------------	----------------

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。

8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

无。

8.6 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。

8.7 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。

8.8 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。

8.9 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。

8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

无。

8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

无。

8.12 投资组合报告附注

8.12.1 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

本基金投资的前十名证券的发行主体本期没有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。

8.12.2 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。

8.12.3 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	62,621.81
2	应收证券清算款	451,855.42
3	应收股利	-
4	应收利息	2,264.79
5	应收申购款	5,284.01
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	522,026.03

8.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

无。

8.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

无。

8.12.6 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。

§ 9 基金份额持有人信息

9.1 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 (%)
2,501	45,983.13	88,222,610.95	76.71	26,781,185.54	23.29

注：持有人户数为有效户数，即存量份额大于零的账户。

9.2 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	6,106.31	0.0053

9.3 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
-----------------	---

9.4 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理本人及其直系亲属持有本人管理的产品情况

无。

§ 10 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	141,806,689.01
减：本报告期基金总赎回份额	125,251,007.31
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	115,003,796.49

§ 11 重大事件揭示

11.1 基金份额持有人大会决议

无。

11.2 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. 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。

上述变更详见公司相关公告。

二、基金托管人的基金托管部门的重大人事变动

无。

11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

无。

11.4 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。

11.5 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），本年度应支付的审计费用为 65,000.00 元整。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。

11.6 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。

11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

11.7.1 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	454,743,953.89	50.44%	414,404.88	50.44%	-
海通证券	1	403,285,201.59	44.73%	367,514.64	44.73%	-
申万宏源	1	40,965,165.51	4.54%	37,331.79	4.54%	-
光大证券	1	2,312,476.54	0.26%	2,107.39	0.26%	-
东方证券	1	307,136.60	0.03%	279.92	0.03%	-
中信证券	1	-	-	-	-	-

注：1、本报告期内，本基金新增交易单元：无；退租交易单元：无。

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。

11.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

无。

11.8 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	关于再次提请投资者及时更新已过期身份证件或者身份证明文件的公告	中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站	2020 年 12 月 31 日
2	大成基金管理有限公司关于基金经理张钟玉女士因延长产假暂停履行职务的公告	中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站	2020 年 12 月 28 日
3	大成基金管理有限公司关于提示泰诚财富基金销售（大连）有限公司代销客户及时办理转托管业务的公告	中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站	2020 年 12 月 17 日
4	大成核心双动力混合型证券投资基金招募说明书更新	中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站	2020 年 12 月 2 日
5	大成核心双动力混合型证券投资基金托管协议更新	中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站	2020 年 12 月 2 日
6	大成核心双动力混合型证券投资基金基金合同更新	中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站	2020 年 12 月 2 日
7	大成核心双动力混合型证券投资基金基金产品资料概要更新	中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站	2020 年 12 月 2 日
8	关于调整旗下部分基金投资范围、增加侧袋机制并相应修改法律文件的公告	中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站	2020 年 12 月 1 日
9	关于大成核心双动力混合型证券投资基金恢复大额申购（含定期定额申购）及转换转入业务的公告	中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站	2020 年 11 月 6 日
10	大成核心双动力混合型证券投资基金第三季度报告	中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站	2020 年 10 月 28 日

11	关于大成核心双动力混合型证券投资基金暂停大额申购(含定期定额申购)及转换转入业务的公告	中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站	2020 年 10 月 23 日
12	大成核心双动力混合型证券投资基金基金产品资料概要更新	中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站	2020 年 8 月 27 日
13	大成核心双动力混合型证券投资基金中期报告	中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站	2020 年 8 月 28 日
14	大成核心双动力混合型证券投资基金更新招募说明书摘要	中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站	2020 年 7 月 22 日
15	大成核心双动力混合型证券投资基金更新招募说明书	中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站	2020 年 7 月 22 日
16	大成核心双动力混合型证券投资基金第二季度报告	中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站	2020 年 7 月 21 日
17	关于再次提请投资者及时更新已过期身份证件或者身份证明文件的公告	中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站	2020 年 7 月 1 日
18	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	中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站	2020 年 6 月 13 日
19	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	中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站	2020 年 6 月 5 日
20	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	中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站	2020 年 5 月 22 日
21	大成核心双动力混合 2019 年年度报告	中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站	2020 年 4 月 29 日
22	大成基金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	中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站	2020 年 4 月 25 日
23	大成核心双动力混合 2020 年第一季度报告	中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站	2020 年 4 月 21 日
24	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	中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站	2020 年 3 月 25 日
25	大成基金管理有限公司关于注销南京分公司的公告	中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本	2020 年 3 月 21 日

		公司网站	
26	大成基金管理有限公司关于注销青岛分公司的公告	中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站	2020年2月29日
27	大成基金关于 APP 交易平台汇款交易费率优惠的公告	中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站	2020年2月26日
28	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	中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站	2020年1月30日
29	大成核心双动力混合 2019 年第四季度报告	中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站	2020年1月17日

§ 12 影响投资者决策的其他重要信息

12.1 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	-	-
	2	20200414-20200921	-	45,744,739.25	45,744,739.25	-	-
	3	20200101-20200717	31,113,308.54	-	31,113,308.54	-	-
	4	20200729-20200923	-	22,058,088.24	-	22,058,088.24	19.18
	5	20200923-20200923	-	21,738,405.80	-	21,738,405.80	18.90
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。							

12.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§ 13 备查文件目录

13.1 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。

13.2 存放地点

备查文件存放在本基金管理人和托管人的住所。

13.3 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 3 月 30 日