

大成核心双动力混合型证券投资基金 2021 年中期报告

2021 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：2021 年 8 月 31 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 2021 年 8 月 30 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 2021 年 01 月 01 日起至 06 月 30 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 主要财务指标和基金净值表现	6
3.1 主要会计数据和财务指标	6
3.2 基金净值表现	6
§ 4 管理人报告	7
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	11
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
§ 5 托管人报告	12
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等内容真实、准确和完整发表意见	12
§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）	12
6.1 资产负债表	12
6.2 利润表	13
6.3 所有者权益（基金净值）变动表	15
6.4 报表附注	16
§ 7 投资组合报告	32
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	33
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	34
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	39
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	41
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	41
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	41
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	41

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	41
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明	41
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	42
7.12 投资组合报告附注	42
§ 8 基金份额持有人信息	43
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	43
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	43
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	43
§ 9 开放式基金份额变动	43
§ 10 重大事件揭示	44
10.1 基金份额持有人大会决议	44
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	44
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	44
10.4 基金投资策略的改变	44
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	44
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	44
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	44
10.8 其他重大事件	45
§ 11 影响投资者决策的其他重要信息	46
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	46
11.2 影响投资者决策的其他重要信息	47
§ 12 备查文件目录	47
12.1 备查文件目录	47
12.2 存放地点	47
12.3 查阅方式	47

§ 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	23,884,323.51 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	郭明
	联系电话	0755-83183388	010-66105799
	电子邮箱	office@dcfund.com.cn	custody@icbc.com.cn
客户服务电话		4008885558	95588
传真		0755-83199588	010-66105798
注册地址		深圳市福田区深南大道 7088 号招商银行大厦 32 层	北京市西城区复兴门内大街 55 号
办公地址		深圳市福田区深南大道 7088 号招商银行大厦 32 层	北京市西城区复兴门内大街 55 号
邮政编码		518040	100140
法定代表人		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(2021年1月1日-2021年6月30日)
本期已实现收益	18,831,403.71
本期利润	2,486,352.70
加权平均基金份额本期利润	0.0480
本期加权平均净值利润率	3.00%
本期基金份额净值增长率	5.37%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2021年6月30日)
期末可供分配利润	15,027,079.58
期末可供分配基金份额利润	0.6292
期末基金资产净值	38,911,403.09
期末基金份额净值	1.629
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2021年6月30日)
基金份额累计净值增长率	164.77%

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

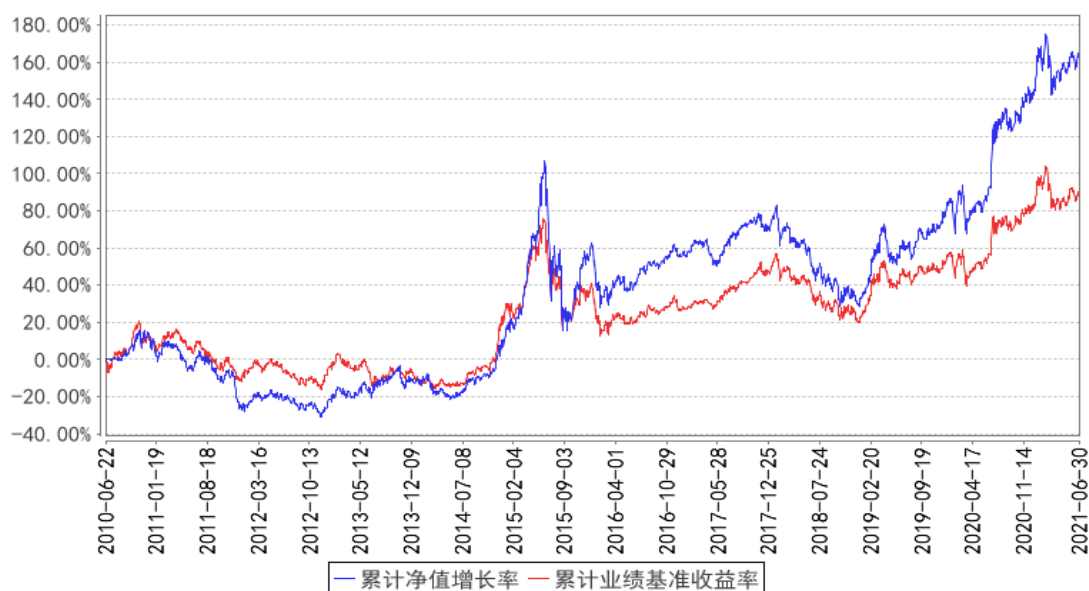
3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

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	0.00%	0.67%	-1.46%	0.60%	1.46%	0.07%
过去三个月	5.16%	0.68%	2.97%	0.73%	2.19%	-0.05%

过去六个月	5.37%	1.15%	0.92%	0.99%	4.45%	0.16%
过去一年	35.64%	1.16%	19.87%	1.00%	15.77%	0.16%
过去三年	77.45%	1.19%	41.20%	1.02%	36.25%	0.17%
自基金合同生效起至今	164.77%	1.29%	89.28%	1.08%	75.49%	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 2 亿元人民币，注册地广东省深圳市。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。

经过二十二年的稳健发展，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 2021 年 6 月 30 日，本基金管理人共管理 9 只 ETF 及 3 只 ETF 联接基金，8 只 QDII 基金及 107 只开放式证券投资基金。

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		
苏秉毅	本基金基金经理，数量与指数投资部副总监（主持工作）	2016 年 3 月 4 日	-	17 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、数量与指数投资部总监助理，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。2021年4月23日起任大成智慧量化多策略灵活配置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
张钟玉	本基金基金经理	2015年2月28日	-	11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

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。

4.1.3 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不存在同日反向交易。主动型投资组合与指数型投资组合之间或指数型投资组合之间存在股票同日反向交易，但不存在参与交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量超过该股当日成交量 5% 的情形；主动投资组合间债券交易存在 2 笔同日反向交易，原因为流动性需要。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

2021 年上半年国内经济延续新冠疫情后的复苏态势，一季度 GDP 同比增长 18.3%，二季度 GDP 同比增长 7.9%，经济逐渐由强劲反弹过渡到平稳复苏阶段，经济增速放缓，重新回到长期结构优化轨道。上半年 A 股板块轮动，分化剧烈，PPI 上涨推动的顺周期行情和光伏、新能源汽车、芯片等热点板块是上半年的投资热点。上半年沪深 300 上涨 0.2%，创业板上涨 17.2%，中小盘股票表现明显好于大盘股。行业方面，基础化工、钢铁、煤炭和新能源涨幅居前，地产、军工、家电和非银行金融跌幅较大。

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 1.629 元；本报告期基金份额净值增长率为 5.37%，业绩比较基准收益率为 0.92%。

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 下半年，经济恢复性增长高点已过，经济增速趋于下行，国内经济的重点将回到疫情前的调结构上。地产高压政策持续，投资增长受限，随国外疫情好转生产恢复，出口也将下行，消费有望随国内服务性行业复苏进一步增长。虽然下半年经济承压，但 PPI 仍处高位的环境下，货币政策放松幅度可能有限，A 股行情仍以结构性为主。一方面，我国经济在本次疫情中表现出来的良好韧性，不断吸引海外资本投资，利好各行业内具有长期竞争优势的龙头白马。另一方面，碳中和、新能源、高端制造等赛道成长空间大，值得长期关注，但需警惕短期板块估值过高的回调风险。

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

本基金在本报告期内，曾出现了连续 60 个工作日资产净值低于五千万元的情形。我公司已根据法律法规及基金合同要求拟定相关应对方案上报中国证券监督管理委员会。

§ 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 2021 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：2021 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2021 年 6 月 30 日	上年度末 2020 年 12 月 31 日
资产：			
银行存款	6.4.3.1	5,800,995.62	22,906,397.91
结算备付金		107,916.65	-
存出保证金		51,768.63	62,621.81
交易性金融资产	6.4.3.2	33,151,972.65	155,059,972.54
其中：股票投资		33,150,272.65	155,059,972.54
基金投资		-	-
债券投资		1,700.00	-

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		14,252.95	451,855.42
应收利息	6.4.3.5	565.29	2,264.79
应收股利		-	-
应收申购款		28,101.32	5,284.01
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.3.6	-	-
资产总计		39,155,573.11	178,488,396.48
负债和所有者权益	附注号	本期末 2021年6月30日	上年度末 2020年12月31日
负 债:			
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		173.98	-
应付赎回款		1,717.01	178,316.54
应付管理人报酬		47,485.68	219,528.16
应付托管费		7,914.26	36,588.02
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.3.7	95,136.64	77,582.76
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	91,742.45	185,626.62
负债合计		244,170.02	697,642.10
所有者权益:			
实收基金	6.4.3.9	23,884,323.51	115,003,796.49
未分配利润	6.4.3.10	15,027,079.58	62,786,957.89
所有者权益合计		38,911,403.09	177,790,754.38
负债和所有者权益总计		39,155,573.11	178,488,396.48

注：报告截止日 2021 年 06 月 30 日，基金份额净值 1.629 元，基金份额总额 23,884,323.51 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：2021 年 1 月 1 日至 2021 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
		2021 年 1 月 1 日至 2021 年	2020 年 1 月 1 日至 2020 年

		6 月 30 日	6 月 30 日
一、收入		4,133,603.34	13,489,625.88
1. 利息收入		20,029.86	52,189.03
其中：存款利息收入	6.4.3.11	20,029.70	52,189.03
债券利息收入		0.16	-
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）		20,210,827.12	13,511,758.43
其中：股票投资收益	6.4.3.12	19,894,443.61	11,987,494.14
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	316,383.51	1,524,264.29
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.3.17	-16,345,051.01	-88,429.62
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	247,797.37	14,108.04
减：二、费用		1,647,250.64	1,694,300.29
1. 管理人报酬	6.4.6.2.1	626,468.19	925,706.25
2. 托管费	6.4.6.2.2	104,411.31	154,284.35
3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用	6.4.3.19	822,185.79	528,138.35
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	94,185.35	86,171.34
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		2,486,352.70	11,795,325.59
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		2,486,352.70	11,795,325.59

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：2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 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）	115,003,796.49	62,786,957.89	177,790,754.38
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	2,486,352.70	2,486,352.70
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）	-91,119,472.98	-50,246,231.01	-141,365,703.99
其中：1. 基金申购款	37,627,715.07	23,530,780.14	61,158,495.21
2. 基金赎回款	-128,747,188.05	-73,777,011.15	-202,524,199.20
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）	23,884,323.51	15,027,079.58	38,911,403.09
项目	上年度可比期间 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	34,021,382.52	3,008,320.58	37,029,703.10

（净值减少以“-”号填列）			
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、期末所有者权益（基金净值）	132,469,497.31	26,671,080.77	159,140,578.08

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 2021年6月30日
活期存款	5,800,995.62
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	5,800,995.62

6.4.3.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2021年6月30日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	32,362,926.82	33,150,272.65	787,345.83
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	1,700.00	1,700.00
	银行间市场	-	-
	合计	1,700.00	1,700.00
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	32,364,626.82	33,151,972.65	787,345.83

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 2021 年 6 月 30 日
应收活期存款利息	498.38
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	43.65
应收债券利息	0.16
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	20.97
合计	565.29

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 2021 年 6 月 30 日
交易所市场应付交易费用	95,136.64
银行间市场应付交易费用	-
合计	95,136.64

6.4.3.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	2.60
应付证券出借违约金	-
预提费用	91,739.85
合计	91,742.45

6.4.3.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	115,003,796.49	115,003,796.49
本期申购	37,627,715.07	37,627,715.07
本期赎回（以“-”号填列）	-128,747,188.05	-128,747,188.05

- 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	23,884,323.51	23,884,323.51

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	65,440,872.31	-2,653,914.42	62,786,957.89
本期利润	18,831,403.71	-16,345,051.01	2,486,352.70
本期基金份额交易产生的变动数	-64,998,031.48	14,751,800.47	-50,246,231.01
其中：基金申购款	24,351,020.94	-820,240.80	23,530,780.14
基金赎回款	-89,349,052.42	15,572,041.27	-73,777,011.15
本期已分配利润	-	-	-
本期末	19,274,244.54	-4,247,164.96	15,027,079.58

6.4.3.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月30日
活期存款利息收入	17,499.23
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	2,113.91
其他	416.56
合计	20,029.70

6.4.3.12 股票投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月30日
卖出股票成交总额	315,008,707.31
减：卖出股票成本总额	295,114,263.70
买卖股票差价收入	19,894,443.61

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
	2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
股票投资产生的股利收益	316,383.51
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	316,383.51

6.4.3.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期
	2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
1. 交易性金融资产	-16,345,051.01
股票投资	-16,345,051.01
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	-16,345,051.01

6.4.3.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期
	2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
基金赎回费收入	247,563.01
基金转换费收入	234.36
合计	247,797.37

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 2021年1月1日至2021年6月30日
交易所市场交易费用	822,185.79
银行间市场交易费用	-
合计	822,185.79

6.4.3.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月30日
审计费用	32,232.48
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
银行划款手续费	2,445.50
合计	94,185.35

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 2021年1月1日至2021年6月30日	上年度可比期间 2020年1月1日至2020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	44,964,418.43	8.95	2,312,476.54	0.66

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 2021年1月1日至2021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	40,976.16	8.95	40,976.16	43.07
关联方名称	上年度可比期间 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

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。

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	上年度可比期间
	2021年1月1日至2021年6月	2020年1月1日至2020年

	月 30 日	6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	626,468.19	925,706.25
其中：支付销售机构的客户维护费	100,695.82	93,448.14

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	上年度可比期间
	2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日	2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	104,411.31	154,284.35

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 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

6.4.6.4.1 与关联方通过约定申报方式进行的适用固定期限费率的证券出借业务的情况

无。

6.4.6.4.2 与关联方通过约定申报方式进行的适用市场化期限费率的证券出借业务的情况

无。

6.4.6.5 各关联方投资本基金的情况

6.4.6.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

无。

6.4.6.5.2 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。

6.4.6.6 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 2021年1月1日至2021年6月30日		上年度可比期间 2020年1月1日至2020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	5,800,995.62	17,499.23	25,123,206.73	49,976.01

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。

6.4.6.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

无。

6.4.6.8 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(2021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

6.4.8.1.1 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
300926	博俊科技	2020年12月29日	2021年7月12日	新股锁定	10.76	22.20	359	3,862.84	7,969.80	-
300927	江天化学	2020年12月29日	2021年7月7日	新股锁定	13.39	30.10	217	2,905.63	6,531.70	-

300929	华骐环 保	2021年 1月12 日	2021年 7月21 日	新股锁定	13.87	29.55	183	2,538.21	5,407.65	-
300932	三友联 众	2021年 1月15 日	2021年 7月22 日	新股锁定	24.69	31.71	320	7,900.80	10,147.20	-
300933	中辰股 份	2021年 1月15 日	2021年 7月22 日	新股锁定	3.37	10.44	1,112	3,747.44	11,609.28	-
300937	药易购	2021年 1月20 日	2021年 7月27 日	新股锁定	12.25	53.71	244	2,989.00	13,105.24	-
300940	南极光	2021年 1月27 日	2021年 8月3 日	新股锁定	12.76	43.38	307	3,917.32	13,317.66	-
300941	创识科 技	2021年 2月2日	2021年 8月9 日	新股锁定	21.31	49.94	235	5,007.85	11,735.90	-
300942	易瑞生 物	2021年 2月2日	2021年 8月9 日	新股锁定	5.31	28.52	443	2,352.33	12,634.36	-
300943	春晖智 控	2021年 2月3日	2021年 8月10 日	新股锁定	9.79	23.01	255	2,496.45	5,867.55	-
300945	曼卡龙	2021年 2月3日	2021年 8月10 日	新股锁定	4.56	18.88	441	2,010.96	8,326.08	-
300950	德固特	2021年 2月24 日	2021年 9月3 日	新股锁定	8.41	39.13	219	1,841.79	8,569.47	-
300952	恒辉安 防	2021年 3月3日	2021年 9月13 日	新股锁定	11.72	27.08	255	2,988.60	6,905.40	-
300953	震裕科 技	2021年 3月11 日	2021年 9月22 日	新股锁定	28.77	99.85	127	3,653.79	12,680.95	-
300955	嘉亨家 化	2021年 3月16 日	2021年 9月24 日	新股锁定	16.53	46.07	154	2,545.62	7,094.78	-
300956	英力股 份	2021年 3月16 日	2021年 9月27 日	新股锁定	12.85	25.80	201	2,582.85	5,185.80	-
300957	贝泰妮	2021年 3月18	2021年 9月27	新股锁定	47.33	251.96	62	2,934.46	15,621.52	-

		日	日							
300958	建工修复	2021年 3月18 日	2021年 9月29 日	新股锁定	8.53	27.22	300	2,559.00	8,166.00	-
6.4.8.1.2 受限证券类别：债券										
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：张)	期末成本总额	期末估值总额	备注
127038	国微转债	2021年 6月10 日	2021年 7月14 日	新债未上市	100.00	100.00	17	1,700.00	1,700.00	-

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。

6.4.8.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量 (股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
600460	士兰微	2021年 06月 30日	重大事项	56.35	2021 年07 月01 日	59.49	4,400	151,400.56	247,940.00	-

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

无。

6.4.8.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

无。

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內。

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。本报告期内，本基金未发生重大流动性风险事件。

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 2021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	5,800,995.62	-	-	-	5,800,995.62
结算备付金	107,916.65	-	-	-	107,916.65
存出保证金	51,768.63	-	-	-	51,768.63
交易性金融资产	-	-	1,700.00	33,150,272.65	33,151,972.65
应收利息	-	-	-	565.29	565.29
应收申购款	-	-	-	28,101.32	28,101.32
应收证券清算款	-	-	-	14,252.95	14,252.95
资产总计	5,960,680.90	-	1,700.00	33,193,192.21	39,155,573.11
负债					
应付赎回款	-	-	-	1,717.01	1,717.01
应付管理人报酬	-	-	-	47,485.68	47,485.68
应付托管费	-	-	-	7,914.26	7,914.26
应付证券清算款	-	-	-	173.98	173.98
应付交易费用	-	-	-	95,136.64	95,136.64
其他负债	-	-	-	91,742.45	91,742.45
负债总计	-	-	-	244,170.02	244,170.02
利率敏感度缺口	5,960,680.90	-	1,700.00	32,949,022.19	38,911,403.09
上年度末 2020年12月31日					
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

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。

6.4.9.4.1.2 利率风险的敏感性分析

于本期末，本基金持有的交易性债券投资公允价值占基金资产净值的比例为 0.00%(上年度末：无)，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 2021年6月30日		上年度末 2020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	33,150,272.65	85.19	155,059,972.54	87.21
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
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	33,150,272.65	85.19	155,059,972.54	87.21

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（2021年6月30日）	上年度末（2020年12月31日）
分析	业绩比较基准上升5%	2,182,467.35	10,327,094.67
	业绩比较基准下降5%	-2,182,467.35	-10,327,094.67

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	33,150,272.65	84.66
	其中：股票	33,150,272.65	84.66
2	基金投资	-	-

3	固定收益投资	1,700.00	0.00
	其中：债券	1,700.00	0.00
	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	5,908,912.27	15.09
8	其他各项资产	94,688.19	0.24
9	合计	39,155,573.11	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	443,707.20	1.14
B	采矿业	697,160.00	1.79
C	制造业	19,103,836.50	49.10
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	805,432.80	2.07
E	建筑业	486,272.00	1.25
F	批发和零售业	824,557.32	2.12
G	交通运输、仓储和邮政业	956,276.00	2.46
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	721,915.50	1.86
J	金融业	5,795,352.56	14.89
K	房地产业	792,266.82	2.04
L	租赁和商务服务业	777,501.00	2.00
M	科学研究和技术服务业	237,200.00	0.61
N	水利、环境和公共设施管理业	265,385.65	0.68
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	960,786.30	2.47
R	文化、体育和娱乐业	282,623.00	0.73
S	综合	-	-
	合计	33,150,272.65	85.19

7.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

无。

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	600519	贵州茅台	500	1,028,350.00	2.64
2	000858	五粮液	2,600	774,514.00	1.99
3	601166	兴业银行	24,400	501,420.00	1.29
4	601318	中国平安	7,600	488,528.00	1.26
5	300059	东方财富	14,812	485,685.48	1.25
6	000651	格力电器	9,200	479,320.00	1.23
7	600036	招商银行	8,600	466,034.00	1.20
8	600887	伊利股份	11,800	434,594.00	1.12
9	000725	京东方 A	64,200	400,608.00	1.03
10	601939	建设银行	59,400	395,010.00	1.02
11	601888	中国中免	1,300	390,130.00	1.00
12	603501	韦尔股份	1,200	386,400.00	0.99
13	601919	中远海控	12,400	378,696.00	0.97
14	600031	三一重工	13,000	377,910.00	0.97
15	000063	中兴通讯	11,100	368,853.00	0.95
16	300124	汇川技术	4,950	367,587.00	0.94
17	600809	山西汾酒	800	358,400.00	0.92
18	300122	智飞生物	1,900	354,787.00	0.91
19	600000	浦发银行	34,700	347,000.00	0.89
20	002714	牧原股份	5,360	325,995.20	0.84
21	000100	TCL 科技	42,200	322,830.00	0.83
22	601288	农业银行	104,900	317,847.00	0.82
23	002179	中航光电	4,000	316,080.00	0.81
24	300015	爱尔眼科	4,335	307,698.30	0.79
25	601211	国泰君安	17,800	305,092.00	0.78
26	600837	海通证券	26,200	301,300.00	0.77
27	600104	上汽集团	13,100	287,807.00	0.74
28	600763	通策医疗	700	287,700.00	0.74
29	300408	三环集团	6,700	284,214.00	0.73
30	688111	金山办公	700	276,360.00	0.71
31	600018	上港集团	57,500	274,275.00	0.70
32	601988	中国银行	88,600	272,888.00	0.70
33	600176	中国巨石	17,459	270,789.09	0.70
34	300003	乐普医疗	8,400	269,808.00	0.69
35	600346	恒力石化	10,200	267,648.00	0.69
36	601009	南京银行	25,300	266,156.00	0.68
37	603806	福斯特	2,500	262,825.00	0.68

38	601377	兴业证券	27,100	261,786.00	0.67
39	002027	分众传媒	27,600	259,716.00	0.67
40	600111	北方稀土	12,400	256,680.00	0.66
41	688036	传音控股	1,200	251,400.00	0.65
42	603486	科沃斯	1,100	250,888.00	0.64
43	600332	白云山	7,400	250,490.00	0.64
44	600309	万华化学	2,300	250,286.00	0.64
45	000776	广发证券	16,400	248,296.00	0.64
46	600460	士兰微	4,400	247,940.00	0.64
47	002601	龙佰集团	7,100	245,518.00	0.63
48	601899	紫金矿业	24,900	241,281.00	0.62
49	601668	中国建筑	51,400	239,010.00	0.61
50	601336	新华保险	5,200	238,732.00	0.61
51	600795	国电电力	97,800	237,654.00	0.61
52	600383	金地集团	23,200	237,568.00	0.61
53	300676	华大基因	2,000	237,200.00	0.61
54	601985	中国核电	46,400	234,784.00	0.60
55	601607	上海医药	10,900	230,317.00	0.59
56	600089	特变电工	17,900	230,015.00	0.59
57	002414	高德红外	8,280	228,362.40	0.59
58	000656	金科股份	39,300	227,547.00	0.58
59	002600	领益智造	24,500	225,155.00	0.58
60	603882	金城医学	1,400	223,678.00	0.57
61	600741	华域汽车	7,800	204,906.00	0.53
62	603195	公牛集团	1,000	202,000.00	0.52
63	603290	斯达半导	600	192,000.00	0.49
64	600171	上海贝岭	6,100	185,623.00	0.48
65	601636	旗滨集团	9,800	181,888.00	0.47
66	603260	合盛硅业	2,300	176,893.00	0.45
67	300699	光威复材	2,300	174,685.00	0.45
68	000338	潍柴动力	9,600	171,552.00	0.44
69	002028	思源电气	5,500	169,345.00	0.44
70	603589	口子窖	2,500	169,225.00	0.43
71	000039	中集集团	9,200	167,256.00	0.43
72	300014	亿纬锂能	1,600	166,288.00	0.43
73	600739	辽宁成大	7,900	164,399.00	0.42
74	600862	中航高科	5,300	163,134.00	0.42
75	601628	中国人寿	4,800	162,672.00	0.42
76	300595	欧普康视	1,560	161,538.00	0.42
77	000830	鲁西化工	8,600	161,078.00	0.41
78	601012	隆基股份	1,740	154,581.60	0.40
79	600779	水井坊	1,200	151,620.00	0.39

80	002092	中泰化学	14,600	149,942.00	0.39
81	600808	马钢股份	34,800	149,292.00	0.38
82	688208	道通科技	1,700	147,883.00	0.38
83	002382	蓝帆医疗	6,900	143,865.00	0.37
84	000333	美的集团	2,000	142,740.00	0.37
85	601168	西部矿业	11,900	141,967.00	0.36
86	300244	迪安诊断	3,700	141,710.00	0.36
87	002408	齐翔腾达	11,400	141,588.00	0.36
88	002648	卫星石化	3,600	141,084.00	0.36
89	002603	以岭药业	4,800	139,968.00	0.36
90	600141	兴发集团	7,400	139,342.00	0.36
91	002056	横店东磁	10,700	139,100.00	0.36
92	300463	迈克生物	3,300	138,897.00	0.36
93	002048	宁波华翔	7,100	138,450.00	0.36
94	002281	光迅科技	5,600	137,760.00	0.35
95	600707	彩虹股份	14,600	137,386.00	0.35
96	603156	养元饮品	4,800	137,184.00	0.35
97	600271	航天信息	10,500	136,815.00	0.35
98	601997	贵阳银行	19,100	136,756.00	0.35
99	002030	达安基因	6,420	136,360.80	0.35
100	002429	兆驰股份	22,400	135,968.00	0.35
101	600901	江苏租赁	25,895	134,654.00	0.35
102	600373	中文传媒	13,600	134,096.00	0.34
103	600390	五矿资本	22,100	132,158.00	0.34
104	600377	宁沪高速	13,500	131,760.00	0.34
105	300002	神州泰岳	26,700	129,495.00	0.33
106	600729	重庆百货	4,700	129,015.00	0.33
107	300058	蓝色光标	21,100	127,655.00	0.33
108	600039	四川路桥	20,300	127,281.00	0.33
109	000930	中粮科技	14,100	127,041.00	0.33
110	601928	凤凰传媒	17,700	126,378.00	0.32
111	002266	浙富控股	25,300	126,247.00	0.32
112	002002	鸿达兴业	32,100	126,153.00	0.32
113	600019	宝钢股份	16,500	126,060.00	0.32
114	600623	华谊集团	14,300	125,983.00	0.32
115	603568	伟明环保	5,500	125,565.00	0.32
116	000807	云铝股份	10,500	124,950.00	0.32
117	000425	徐工机械	19,500	124,215.00	0.32
118	600409	三友化工	12,200	123,342.00	0.32
119	002653	海思科	5,700	122,664.00	0.32
120	002745	木林森	9,100	121,940.00	0.31
121	600566	济川药业	6,800	121,720.00	0.31

122	600648	外高桥	8,200	121,196.00	0.31
123	000402	金融街	17,900	120,825.00	0.31
124	600167	联美控股	13,500	120,555.00	0.31
125	600350	山东高速	19,600	120,540.00	0.31
126	600507	方大特钢	17,500	118,650.00	0.30
127	600446	金证股份	8,100	116,964.00	0.30
128	000581	威孚高科	5,600	116,648.00	0.30
129	002985	北摩高科	1,190	116,025.00	0.30
130	000528	柳工	14,100	115,620.00	0.30
131	000488	晨鸣纸业	14,200	115,588.00	0.30
132	300271	华宇软件	6,000	115,500.00	0.30
133	601003	柳钢股份	19,200	113,280.00	0.29
134	002925	盈趣科技	2,900	112,839.00	0.29
135	601699	潞安环能	9,500	112,195.00	0.29
136	000090	天健集团	19,700	108,941.00	0.28
137	600064	南京高科	11,500	106,835.00	0.27
138	600598	北大荒	7,100	106,216.00	0.27
139	600006	东风汽车	14,300	104,390.00	0.27
140	600919	江苏银行	14,500	102,950.00	0.26
141	601225	陕西煤业	8,400	99,540.00	0.26
142	002532	天山铝业	11,500	96,485.00	0.25
143	688698	伟创电气	4,751	94,972.49	0.24
144	600642	申能股份	14,500	89,030.00	0.23
145	000501	鄂武商 A	7,500	87,750.00	0.23
146	600011	华能国际	20,700	87,354.00	0.22
147	600276	恒瑞医药	1,280	87,001.60	0.22
148	000519	中兵红箭	8,000	85,760.00	0.22
149	002415	海康威视	1,300	83,850.00	0.22
150	601869	长飞光纤	3,300	80,388.00	0.21
151	600398	海澜之家	11,100	80,364.00	0.21
152	601233	桐昆股份	3,300	79,497.00	0.20
153	002128	露天煤业	7,400	77,034.00	0.20
154	002701	奥瑞金	13,300	68,362.00	0.18
155	002839	张家港行	12,000	65,280.00	0.17
156	600570	恒生电子	700	65,275.00	0.17
157	600999	招商证券	3,300	62,766.00	0.16
158	600655	豫园股份	5,100	59,109.00	0.15
159	000012	南玻 A	5,700	58,368.00	0.15
160	000623	吉林敖东	3,600	55,764.00	0.14
161	600867	通化东宝	4,500	53,730.00	0.14
162	002249	大洋电机	10,000	52,500.00	0.13
163	601598	中国外运	10,100	51,005.00	0.13

164	603899	晨光文具	600	50,736.00	0.13
165	000001	平安银行	1,700	38,454.00	0.10
166	000825	太钢不锈	4,800	35,952.00	0.09
167	600643	爱建集团	4,400	30,712.00	0.08
168	300919	中伟股份	168	27,384.00	0.07
169	601528	瑞丰银行	1,344	20,926.08	0.05
170	600585	海螺水泥	500	20,525.00	0.05
171	300957	贝泰妮	62	15,621.52	0.04
172	600663	陆家嘴	1,100	14,652.00	0.04
173	600325	华发股份	2,000	13,480.00	0.03
174	600985	淮北矿业	1,100	13,431.00	0.03
175	300940	南极光	307	13,317.66	0.03
176	300937	药易购	244	13,105.24	0.03
177	300953	震裕科技	127	12,680.95	0.03
178	300942	易瑞生物	443	12,634.36	0.03
179	002117	东港股份	1,500	12,585.00	0.03
180	600479	千金药业	1,400	12,460.00	0.03
181	601328	交通银行	2,500	12,250.00	0.03
182	002540	亚太科技	2,500	12,175.00	0.03
183	603165	荣晟环保	900	11,961.00	0.03
184	600376	首开股份	2,100	11,760.00	0.03
185	300941	创识科技	235	11,735.90	0.03
186	601088	中国神华	600	11,712.00	0.03
187	600027	华电国际	3,400	11,696.00	0.03
188	002327	富安娜	1,500	11,610.00	0.03
189	300933	中辰股份	1,112	11,609.28	0.03
190	000156	华数传媒	1,500	11,565.00	0.03
191	300498	温氏股份	800	11,496.00	0.03
192	603365	水星家纺	800	11,448.00	0.03
193	600606	绿地控股	2,100	11,445.00	0.03
194	600023	浙能电力	3,100	11,377.00	0.03
195	600153	建发股份	1,400	11,340.00	0.03
196	002533	金杯电工	2,200	11,308.00	0.03
197	603858	步长制药	500	11,245.00	0.03
198	600170	上海建工	4,000	11,040.00	0.03
199	603878	武进不锈	1,500	11,025.00	0.03
200	001979	招商蛇口	1,000	10,950.00	0.03
201	600048	保利地产	900	10,836.00	0.03
202	002367	康力电梯	1,200	10,728.00	0.03
203	601098	中南传媒	1,200	10,584.00	0.03
204	600681	百川能源	2,200	10,230.00	0.03
205	002146	荣盛发展	1,800	10,152.00	0.03

206	300932	三友联众	320	10,147.20	0.03
207	300918	南山智尚	967	10,066.47	0.03
208	300922	天秦装备	287	9,996.21	0.03
209	002381	双箭股份	1,200	9,864.00	0.03
210	600449	宁夏建材	800	9,088.00	0.02
211	001208	华菱线缆	1,169	9,036.37	0.02
212	300950	德固特	219	8,569.47	0.02
213	600466	蓝光发展	2,900	8,555.00	0.02
214	600720	祁连山	800	8,432.00	0.02
215	300945	曼卡龙	441	8,326.08	0.02
216	300958	建工修复	300	8,166.00	0.02
217	300926	博俊科技	359	7,969.80	0.02
218	300917	特发服务	277	7,661.82	0.02
219	300955	嘉亨家化	154	7,094.78	0.02
220	300952	恒辉安防	255	6,905.40	0.02
221	603171	税友股份	343	6,585.60	0.02
222	300927	江天化学	217	6,531.70	0.02
223	300943	春晖智控	255	5,867.55	0.02
224	300929	华骐环保	183	5,407.65	0.01
225	300956	英力股份	201	5,185.80	0.01
226	605011	杭州热电	310	2,752.80	0.01
227	002443	金洲管道	100	630.00	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	5,768,643.71	3.24
2	603501	韦尔股份	5,221,028.00	2.94
3	002241	歌尔股份	4,872,137.64	2.74
4	300122	智飞生物	4,430,779.00	2.49
5	601919	中远海控	4,260,598.00	2.40
6	601166	兴业银行	4,177,032.00	2.35
7	300124	汇川技术	4,092,911.00	2.30
8	002157	正邦科技	3,859,479.00	2.17
9	000895	双汇发展	3,736,860.00	2.10
10	002508	老板电器	3,472,338.72	1.95
11	600809	山西汾酒	3,423,447.00	1.93
12	600522	中天科技	3,351,870.00	1.89
13	600352	浙江龙盛	3,225,049.00	1.81
14	600887	伊利股份	3,166,704.00	1.78
15	002202	金风科技	3,121,972.50	1.76

16	002027	分众传媒	3,070,101.00	1.73
17	600900	长江电力	3,025,352.29	1.70
18	000001	平安银行	3,000,779.00	1.69
19	601939	建设银行	2,917,832.00	1.64
20	000786	北新建材	2,876,467.00	1.62

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	601166	兴业银行	8,097,350.00	4.55
2	600036	招商银行	7,448,990.00	4.19
3	000333	美的集团	6,759,506.89	3.80
4	002415	海康威视	6,545,686.00	3.68
5	601939	建设银行	6,439,545.00	3.62
6	000895	双汇发展	5,834,618.00	3.28
7	601318	中国平安	5,637,096.15	3.17
8	002202	金风科技	5,610,684.25	3.16
9	300059	东方财富	5,609,014.00	3.15
10	000661	长春高新	5,554,283.00	3.12
11	600519	贵州茅台	5,498,357.00	3.09
12	000858	五粮液	5,448,283.65	3.06
13	603501	韦尔股份	5,128,499.00	2.88
14	600276	恒瑞医药	5,017,557.66	2.82
15	601009	南京银行	4,831,817.00	2.72
16	601899	紫金矿业	4,756,807.00	2.68
17	000157	中联重科	4,738,757.00	2.67
18	300122	智飞生物	4,704,770.00	2.65
19	000166	申万宏源	4,641,069.00	2.61
20	600104	上汽集团	4,580,786.00	2.58
21	002241	歌尔股份	4,407,725.08	2.48
22	000776	广发证券	4,326,641.00	2.43
23	603259	药明康德	4,299,198.98	2.42
24	600048	保利地产	4,102,638.00	2.31
25	601985	中国核电	4,048,854.67	2.28
26	601919	中远海控	3,738,118.16	2.10
27	600352	浙江龙盛	3,605,240.00	2.03

注：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	189,549,614.82
--------------	----------------

卖出股票收入（成交）总额	315,008,707.31
--------------	----------------

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

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	1,700.00	0.00
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	1,700.00	0.00

7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	127038	国微转债	17	1,700.00	0.00

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建设银行（601939.SH）的发行主体中国建设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，受到中国银行保险监督管理委员会处罚（银保监罚决字〔2020〕8 号），于 2020 年 7 月 13 日因内控管理不到位，支行原负责人擅自为同业投资违规提供担保并发生案件等，受到中国银行保险监督管理委员会处罚（银保监罚决字〔2020〕32 号），于 2021 年 8 月 13 日因占压财政存款或者资金等，受到中国人民银行处罚（银罚字〔2021〕22 号）。本基金认为，对建设银行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招商银行（600036.SH）的发行主体招商银行股份有限公司于 2021 年 5 月 17 日因为同业投资提供第三方信用担保、为非保本理财产品出具保本承诺，部分未按规定计提风险加权资产等，受到中国银行保险监督管理委员会处罚（银保监罚决字〔2021〕16 号）。本基金认为，对招商银行的处罚不会对其投资价值构成实质性负面影响。

3. 本基金投资的前十名证券之一兴业银行（601166.SH）的发行主体兴业银行股份有限公司于 2021 年 8 月 13 日因违反信用信息采集、提供、查询及相关管理规定，受到中国人民银行处罚（银罚字〔2021〕26 号）。本基金认为，对兴业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	51,768.63
2	应收证券清算款	14,252.95
3	应收股利	-
4	应收利息	565.29
5	应收申购款	28,101.32
6	其他应收款	-

7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	94,688.19

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 (%)
2,368	10,086.29	-	-	23,884,323.51	100.00

注：持有人户数为有效户数，即存量份额大于零的账户。

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	持有份额总数 (份)	占基金总份额比例 (%)
基金管理人所有从业人员持有本基金	1,202.81	0.0050

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	115,003,796.49
本报告期基金总申购份额	37,627,715.07
减：本报告期基金总赎回份额	128,747,188.05
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	23,884,323.51

§ 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

基金管理人报告期内无重大人事变动。

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	

申万宏源	1	189,807,561.38	37.77%	172,972.56	37.77%	-
东方证券	1	156,176,057.31	31.07%	142,326.12	31.07%	-
长江证券	1	101,934,720.45	20.28%	92,891.81	20.28%	-
光大证券	1	44,964,418.43	8.95%	40,976.16	8.95%	-
中信证券	1	9,704,907.23	1.93%	8,843.79	1.93%	-
海通证券	1	-	-	-	-	-
招商证券	1	-	-	-	-	-

注：1、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。

2. 本报告期内新增交易单元：招商证券

本报告期内退出交易单元：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	关于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	2021年6月30日
2	大成基金管理有限公司关于旗下部分基金增加上海基煜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	2021年6月15日
3	大成基金管理有限公司关于旗下部分	中国证监会基金电子披	2021年5月27日

	基金增加海银基金销售有限公司为销售机构的公告	露网站、规定报刊及本公司网站	
4	大成基金管理有限公司关于旗下部分基金增加腾安基金销售（深圳）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	2021 年 5 月 18 日
5	大成核心双动力混合型证券投资基金 2021 年第 1 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	2021 年 4 月 22 日
6	大成核心双动力混合型证券投资基金 2020 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	2021 年 3 月 30 日
7	大成基金管理有限公司提醒投资者谨防金融诈骗的公告	中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站	2021 年 3 月 23 日
8	大成基金管理有限公司关于旗下部分基金增加鼎信汇金（北京）投资管理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	2021 年 3 月 11 日
9	大成基金管理有限公司关于大成核心双动力混合型证券投资基金开展赎回费率优惠活动的公告	中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站	2021 年 3 月 10 日
10	大成基金管理有限公司关于基金经理张钟玉女士恢复履行职务的公告	中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站	2021 年 1 月 25 日
11	大成核心双动力混合型证券投资基金第四季度报告	中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站	2021 年 1 月 22 日
12	大成基金管理有限公司大成核心双动力混合型证券投资基金开展赎回费率优惠活动的公告	中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站	2021 年 1 月 8 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	20210107-20210308	22,058,088.24	-	22,058,088.24	-	-

2	20210107-20210108	21,738,405.80	21,738,405.80	-	-
3	20210311-20210311	10,683,048.43	10,683,048.43	-	-

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、本报告期内在规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

2021 年 8 月 31 日