

大成核心双动力混合型证券投资基金
2017 年半年度报告
2017 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：2017 年 8 月 24 日

§1 重要提示及目录

1.1 重要提示

基金管理人的董事会、董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带的法律责任。本半年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2017 年 8 月 22 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书及其更新。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2017 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	6
2.1 基金基本情况.....	6
2.2 基金产品说明.....	6
2.3 基金管理人和基金托管人.....	6
2.4 信息披露方式.....	7
2.5 其他相关资料.....	7
§3 主要财务指标和基金净值表现	8
3.1 主要会计数据和财务指标.....	8
3.2 基金净值表现.....	8
3.3 其他指标.....	9
§4 管理人报告	10
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	10
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	12
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	12
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.....	13
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	13
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	13
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	14
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明.....	14
§5 托管人报告	15
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	15
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.....	15
5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见.....	15
§6 半年度财务会计报告（未经审计）	16
6.1 资产负债表.....	16
6.2 利润表.....	17

6.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	18
6.4 报表附注.....	19
§7 投资组合报告.....	39
7.1 期末基金资产组合情况.....	39
7.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	39
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.....	40
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	48
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	50
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.....	50
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.....	50
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.....	50
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.....	50
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....	50
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	50
7.12 投资组合报告附注.....	51
§8 基金份额持有人信息.....	52
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	52
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	52
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况.....	52
§9 开放式基金份额变动.....	53
§10 重大事件揭示.....	54
10.1 基金份额持有人大会决议.....	54
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.....	54
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	54
10.4 基金投资策略的改变.....	54
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	54
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.....	54
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	54
10.8 其他重大事件.....	56
§11 影响投资者决策的其他重要信息.....	60

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	60
11.2 影响投资者决策的其他重要信息.....	60
§12 备查文件目录.....	61
12.1 备查文件目录.....	61
12.2 存放地点.....	61
12.3 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
交易代码	090011
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2010 年 6 月 22 日
基金管理人	大成基金管理有限公司
基金托管人	中国工商银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	121,910,468.10 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	罗登攀	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		刘卓	易会满

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《证券时报》、《上海证券报》、《中国证券报》
登载基金半年度报告正文的管理人互联网网址	http://www.dcfund.com.cn

基金半年度报告备置地点	基金管理人及基金托管人住所
-------------	---------------

2.5 其他相关资料

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

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2017年1月1日 - 2017年6月30日)
本期已实现收益	-1,665,174.97
本期利润	3,307,759.37
加权平均基金份额本期利润	0.0343
本期加权平均净值利润率	3.36%
本期基金份额净值增长率	4.39%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2017年6月30日)
期末可供分配利润	5,625,657.89
期末可供分配基金份额利润	0.0461
期末基金资产净值	127,536,125.99
期末基金份额净值	1.046
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2017年6月30日)
基金份额累计净值增长率	62.02%

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)。

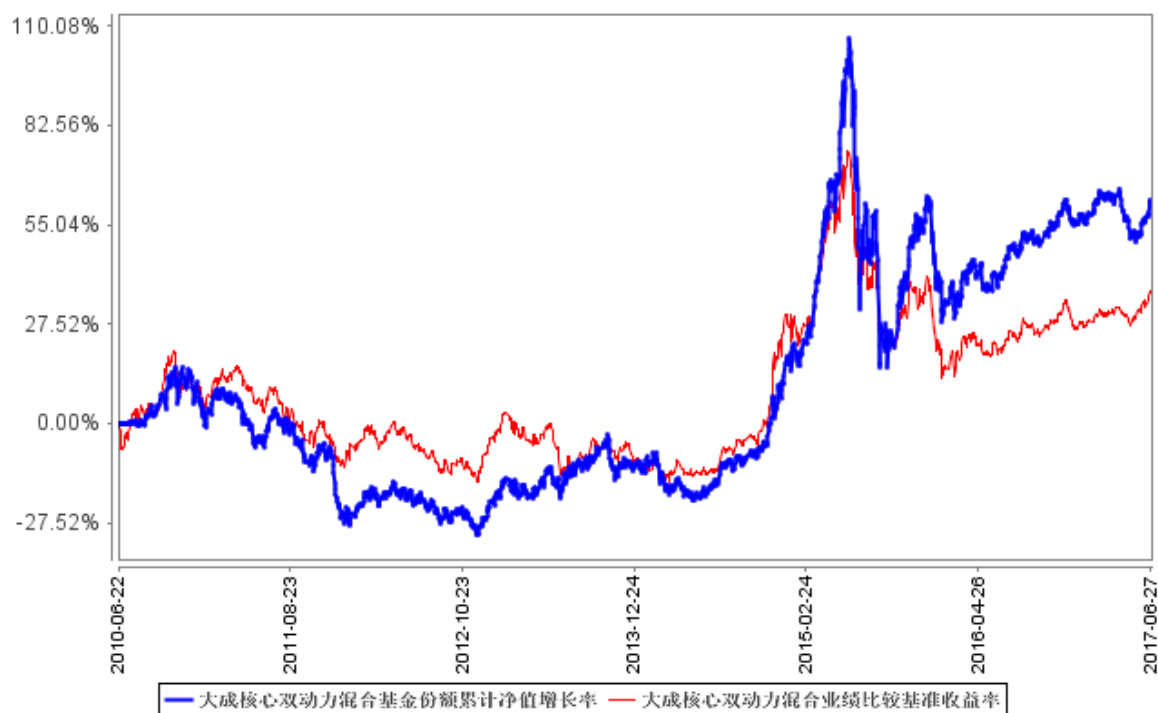
3、所述基金业绩指标不包括持有人交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

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	5.98%	0.59%	4.00%	0.51%	1.98%	0.08%
过去三个月	0.58%	0.64%	4.63%	0.47%	-4.05%	0.17%
过去六个月	4.39%	0.56%	8.05%	0.43%	-3.66%	0.13%
过去一年	13.06%	0.58%	12.26%	0.51%	0.80%	0.07%
过去三年	96.86%	1.65%	57.05%	1.31%	39.81%	0.34%
自基金合同生效起至今	62.02%	1.38%	36.78%	1.15%	25.24%	0.23%

3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较



注：按基金合同规定，本基金自基金合同生效之日起 6 个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的约定，截至本报告期末，本基金的各项投资比例已达到基金合同中规定的各项比例。

§4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

大成基金管理有限公司经中国证监会证监基金字[1999]10号文批准，于1999年4月12日正式成立，是中国证监会批准成立的首批十家基金管理公司之一，注册资本为2亿元人民币，注册地为深圳。目前公司由三家股东组成，分别为中泰信托有限责任公司(50%)、光大证券股份有限公司(25%)、中国银河投资管理有限公司(25%)。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。

经过十多年的稳健发展，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2017年6月30日，本基金管理人共管理5只ETF及1只ETF联接基金，4只QDII基金及74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		
张钟玉女士	本基金基金经理	2015年2月28日	-	7年	会计学硕士。2010年7月加入大成基金管理有限公司，历任研究部研究员、数量投资部数量分析师。2013年3月25日至2015年1月14日担任大成优选股票型证券投资基金（LOF）和大成沪深300指数证券投资基金基金经理助理。2015年2月28日至2015年7月21日任大成核心双动力股票型证券投资基金基金经理，2015年7月22日起任大成核心双动力混合型证券投资基金基金经理。2015年5月23日起任深证成长40交易型开放式指数证券投资基金、大成深证成长40交易型开放式指数证券投资基金联接基金

					及大成中证 500 深市交易型开放式指数证券投资基金基金经理。2015 年 8 月 26 日起担任大成沪深 300 指数证券投资基金基金经理。具有基金从业资格。国籍：中国
苏秉毅先生	本基金基金经理 数量与指数投资部总监	2016 年 3 月 4 日	-	13 年	<p>经济学硕士。2004 年 9 月至 2008 年 5 月就职于华夏基金管理有限公司基金运作部。2008 年加入大成基金管理有限公司，历任产品设计师、高级产品设计师、基金经理助理、基金经理。2012 年 8 月 28 日至 2014 年 1 月 23 日担任大成中证 500 沪市交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理。2014 年 1 月 24 日至 2014 年 2 月 17 日任大成健康产业股票型证券投资基金基金经理。2012 年 2 月 9 日至 2014 年 9 月 11 日担任深证成长 40 交易型开放式指数证券投资基金及大成深证成长 40 交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理。2012 年 8 月 24 日起任中证 500 沪市交易型开放式指数证券投资基金基金经理。2013 年 1 月 1 日至 2015 年 8 月 25 日兼任大成沪深 300 指数证券投资基金基金经理。2013 年 2 月 7 日起任大成中证 100 交易型开放式指数证券投资基金基金经理。2015 年 6 月 5 日起任大成深证成份交易型开放式指数证券投资基金基金经理。2015 年 6 月 29 日起担任大成中证互联网金融</p>

					指数分级证券投资基金基金经理。2016 年 3 月 4 日起担任大成核心双动力混合型证券投资基金及大成沪深 300 指数证券投资基金基金经理。现任数量与指数投资部副总监。具有基金从业资格。国籍：中国
--	--	--	--	--	---

注：1、任职日期、离任日期为本基金管理人作出决定之日。

2、证券从业年限的计算标准遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

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；股票同向交易溢价率较大主要来源于市场因素（如个股当日价格振幅较高）及组合经理交易时机选择，即投资组合成交时间不一致以及成交价格的日内较大变动导致个别些组合间的成交价格差异较大，但结合交易价差专项统计分析，未发现违反公平交易原则的异常情况。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

报告期内，基金管理人旗下所有投资组合未发现存在异常交易行为。主动投资组合间股票交易存在 4 笔同日反向交易，原因为投资策略需要。主动型投资组合与指数型投资组合之间或指数型投资组合之间存在股票同日反向交易，但不存在参与交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量超过该股当日成交量 5% 的情形；主动投资组合间债券交易存在 6 笔同日反向交易，原因为投资策略需要。投资组合间相邻交易日反向交易的市场成交比例、成交均价等交易结果数据表明该类交易不对市场产生重大影响，无异常。

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

2017 年上半年 A 股行情分化严重，蓝筹股、价值股受到资金追捧，而高估值、小市值股票则大幅下跌，大盘指数上证 50 上涨 11.5%，沪深 300 上涨 10.78%，而创业板指下跌 7.34%。2017 年上半年国内经济延续去年的复苏态势，监管层在经济平稳时期推动金融去杠杆，化解金融泡沫风险。监管持续收紧使上半年流动性一直处于偏紧状态，投资者风险偏好下降，成长与估值匹配的消费和蓝筹股成为市场热点。

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、估值合理的小市值个股作为进攻组合。

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 1.046 元；本报告期基金份额净值增长率为 4.39%，业绩比较基准收益率为 8.05%。

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 2017 年下半年，在金融监管和房地产调控的双重压力下，经济复苏放缓趋势明显。我们认为在经济增速下台阶，中长期调整经济增长模式的宏观背景下，更多的投资机会来自在新形势下积极转变发展模式的传统行业，和在经济转型过程中快速成长的新兴产业。

我们将精选受益于供给侧改革、一带一路等政策的蓝筹股构建核心组合，同时选择受益于经济结构调整的成长股和业绩持续增长、估值合理的小市值个股进行投资。

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、风险管理部、基金运营部、监察稽核部、社保基金及机构投资部指定人员组成。公司估值委员会的相关成员均具备相应的专业胜任能力和相关工作经历，估值委员会成员中包括两名投资组合经理。

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

部负责审核估值政策和程序的一致性，监督估值委员会工作流程中的风险控制，并负责估值调整事项的信息披露工作。

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

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

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

无。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

无。

§5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内，本基金托管人在对大成核心双动力混合型证券投资基金的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他法律法规和基金合同的有关规定，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

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

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

5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容真实、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本半年度报告中财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容进行了核查，以上内容真实、准确和完整。

§6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：大成核心双动力混合型证券投资基金

报告截止日：2017 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2017 年 6 月 30 日	上年度末 2016 年 12 月 31 日
资产：			
银行存款	6.4.3.1	21,296,862.52	271,692,448.80
结算备付金		870,966.76	163,820.84
存出保证金		59,523.63	14,834.41
交易性金融资产	6.4.3.2	106,074,501.43	38,438,402.83
其中：股票投资		106,074,501.43	38,438,402.83
基金投资		-	-
债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	6.4.3.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.3.4	-	-
应收证券清算款		153,470.36	-
应收利息	6.4.3.5	4,209.05	29,480.99
应收股利		-	-
应收申购款		105,577.10	145,683.65
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.3.6	-	-
资产总计		128,565,110.85	310,484,671.52
负债和所有者权益	附注号	本期末 2017 年 6 月 30 日	上年度末 2016 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		545,298.37	19,105.69
应付赎回款		6,530.37	1,489.94
应付管理人报酬		152,154.20	131,404.81
应付托管费		25,359.04	21,900.78
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.3.7	210,370.11	33,352.19
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	89,272.77	110,005.62
负债合计		1,028,984.86	317,259.03
所有者权益：			
实收基金	6.4.3.9	121,910,468.10	309,489,012.68
未分配利润	6.4.3.10	5,625,657.89	678,399.81
所有者权益合计		127,536,125.99	310,167,412.49
负债和所有者权益总计		128,565,110.85	310,484,671.52

注：报告截止日 2017 年 6 月 30 日，基金份额净值 1.046 元，基金份额总额 121,910,468.10 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：2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日
一、收入		4,805,634.42	-4,846,961.46
1.利息收入		104,701.75	52,585.36
其中：存款利息收入	6.4.3.11	100,618.42	52,556.36
债券利息收入		-	29.00
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		4,083.33	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		-582,174.19	-653,220.11
其中：股票投资收益	6.4.3.12	-1,379,763.32	-1,023,140.25
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.3.13	-	-
资产支持证券投资收益	6.4.3.13.5	-	-
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	797,589.13	369,920.14
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.3.17	4,972,934.34	-4,257,700.05
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	310,172.52	11,373.34
减：二、费用		1,497,875.05	653,996.13
1. 管理人报酬	6.4.6.2.1	745,893.15	362,973.90

2. 托管费	6.4.6.2.2	124,315.54	60,495.64
3. 销售服务费	6.4.6.2.3	-	-
4. 交易费用	6.4.3.19	537,159.00	84,282.57
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 其他费用	6.4.3.20	90,507.36	146,244.02
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		3,307,759.37	-5,500,957.59
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		3,307,759.37	-5,500,957.59

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：2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2017 年 1 月 1 日至 2017 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）	309,489,012.68	678,399.81	310,167,412.49
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	3,307,759.37	3,307,759.37
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）	-187,578,544.58	1,639,498.71	-185,939,045.87
其中：1.基金申购款	62,090,801.82	2,340,067.47	64,430,869.29
2.基金赎回款	-249,669,346.40	-700,568.76	-250,369,915.16
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）	121,910,468.10	5,625,657.89	127,536,125.99
项目	上年度可比期间 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日		

	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益 (基金净值)	33,412,372.33	19,932,924.35	53,345,296.68
二、本期经营活动产生的 基金净值变动数(本 期利润)	-	-5,500,957.59	-5,500,957.59
三、本期基金份额交易 产生的基金净值变动数 (净值减少以“-”号 填列)	1,266,645.59	566,869.05	1,833,514.64
其中：1.基金申购款	8,446,870.48	3,570,896.08	12,017,766.56
2.基金赎回款	-7,180,224.89	-3,004,027.03	-10,184,251.92
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)	34,679,017.92	14,998,835.81	49,677,853.73

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：

 罗登攀 周立新 崔伟
 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

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

6.4.2.1 印花税

证券（股票）交易印花税税率为 1%，由出让方缴纳。

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

6.4.2.2 营业税、增值税、企业所得税

以发行基金方式募集资金不属于营业税征收范围，不征收营业税。

证券投资基金（封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金）管理人运用基金买卖股票、债

券的差价收入，免征营业税。

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

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

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

6.4.2.3 个人所得税

个人所得税税率为 20%。

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

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

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

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

暂免征收储蓄存款利息所得个人所得税。

6.4.3 重要财务报表项目的说明

6.4.3.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2017 年 6 月 30 日
活期存款	21,296,862.52

定期存款	-
其中：存款期限 1-3 个月	-
其他存款	-
合计：	21,296,862.52

6.4.3.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2017 年 6 月 30 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	100,017,141.02	106,074,501.43	6,057,360.41
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	100,017,141.02	106,074,501.43	6,057,360.41

6.4.3.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末未持有衍生金融工具。

6.4.3.4 买入返售金融资产

本基金本报告期末未持有买入返售金融资产。

6.4.3.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2017 年 6 月 30 日
应收活期存款利息	3,830.09
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	352.71
应收债券利息	-
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	-
其他	24.12
合计	4,209.05

6.4.3.6 其他资产

本基金本报告期末未持有其他资产。

6.4.3.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2017年6月30日
交易所市场应付交易费用	210,370.11
银行间市场应付交易费用	-
合计	210,370.11

6.4.3.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2017年6月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	10.81
预提费用	89,261.96
预提审计费	-
预提信息披露费	-
其他	-
合计	89,272.77

6.4.3.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	309,489,012.68	309,489,012.68
本期申购	62,090,801.82	62,090,801.82
本期赎回(以“-”号填列)	-249,669,346.40	-249,669,346.40
- 基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算变动份额	-	-
本期申购	-	-
本期赎回(以“-”号填列)	-	-
本期末	121,910,468.10	121,910,468.10

注：申购含转换入份额，赎回含转换出份额。

6.4.3.10 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	30,673,530.97	-29,995,131.16	678,399.81
本期利润	-1,665,174.97	4,972,934.34	3,307,759.37
本期基金份额交易产生的变动数	-16,367,656.86	18,007,155.57	1,639,498.71
其中：基金申购款	8,444,627.66	-6,104,560.19	2,340,067.47
基金赎回款	-24,812,284.52	24,111,715.76	-700,568.76
本期已分配利润	-	-	-
本期末	12,640,699.14	-7,015,041.25	5,625,657.89

6.4.3.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年6月30日
活期存款利息收入	97,490.84
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	2,881.24
其他	246.34
合计	100,618.42

6.4.3.12 股票投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年6月30日
卖出股票成交总额	158,122,712.79
减：卖出股票成本总额	159,502,476.11
买卖股票差价收入	-1,379,763.32

6.4.3.13 债券投资收益

本基金本报告期内无债券投资收益。

6.4.3.14 贵金属投资收益

本基金本报告期内无贵金属投资收益。

6.4.3.15 衍生工具收益

本基金本报告期内无衍生工具收益。

6.4.3.16 股利收益

单位：人民币元

项目	本期
----	----

	2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日
股票投资产生的股利收益	797,589.13
基金投资产生的股利收益	-
合计	797,589.13

6.4.3.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日
1. 交易性金融资产	4,972,934.34
——股票投资	4,972,934.34
——债券投资	-
——资产支持证券投资	-
——贵金属投资	-
——其他	-
2. 衍生工具	-
——权证投资	-
3. 其他	-
合计	4,972,934.34

6.4.3.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日
基金赎回费收入	309,922.31
转换费收入	250.21
合计	310,172.52

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，其中将不低于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 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日
交易所市场交易费用	537,159.00
银行间市场交易费用	-
合计	537,159.00

6.4.3.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日
审计费用	14,876.39
信息披露费	74,385.57
银行汇划费用	1,245.40
中债登债券托管帐户维护费	-
合计	90,507.36

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**

截至本报告期末，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

截至财务报表批准报出日，本基金无需做披露的资产负债表日后事项。

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

本基金本报告期存在控制关系或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、注册登记机构、基金销售机构
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：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.6 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

本基金本期内未通过关联方交易单元进行交易。

6.4.6.1 关联方报酬**6.4.6.1.1 基金管理费**

单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年6 月30日	上年度可比期间 2016年1月1日至2016年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	745,893.15	362,973.90
其中：支付销售机构的客户维护费	108,426.42	125,415.87

注：基金管理费按前一日的基金资产净值的 1.5% 的年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 1.5\% / \text{当年天数}$$

H 为每日应支付的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

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

6.4.6.1.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年6月30日	上年度可比期间 2016年1月1日至2016年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	124,315.54	60,495.64

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

$$H = E \times 0.25\% / \text{当年天数}$$

H 为每日应支付的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

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

6.4.6.2 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

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

6.4.6.3 各关联方投资本基金的情况**6.4.6.3.1 报告期内基金管理人运用自有资金投资本基金的情况**

本基金本报告期内基金管理人未运用自有资金投资本基金。

6.4.6.3.2 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

本基金本报告期末除基金管理人之外的其他关联方未投资本基金。

6.4.6.4 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期		上年度可比期间	
	2017年1月1日至2017年6月30日		2016年1月1日至2016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	21,296,862.52	97,490.84	12,876,301.33	52,083.07

注：本基金的银行存款由基金托管人中国工商银行保管，并按银行间同业利率计息。

6.4.6.5 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金于本期及上年度可比期间均未在承销期内参与关联方承销证券。

6.4.6.6 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期及上年度可比期间无须作说明的其他关联交易事项。

6.4.7 利润分配情况

本报告期内本基金无利润分配事项。

6.4.8 期末（2017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

6.4.12.1.1 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
603933	睿能科技	2017年6月28日	2017年7月6日	新股流通受限	20.20	20.20	857	17,311.40	17,311.40	-
603305	旭升股份	2017年6月30日	2017年7月10日	新股流通受限	11.26	11.26	1,351	15,212.26	15,212.26	-
603331	百达精工	2017年6月27日	2017年7月5日	新股流通受限	9.63	9.63	999	9,620.37	9,620.37	-

			日							
603617	君禾股份	2017年6月23日	2017年7月3日	新股流通受限	8.93	8.93	832	7,429.76	7,429.76	-

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
000100	TCL集团	2017年4月21日	临时停牌	3.43	2017年7月26日	3.72	408,200	1,444,239.00	1,400,126.00	-
600666	奥瑞德	2017年4月28日	临时停牌	17.40	-	-	52,640	942,707.00	915,936.00	-
600460	士兰微	2017年5月12日	临时停牌	6.07	2017年8月15日	6.68	42,900	269,841.00	260,403.00	-
300209	天泽信息	2017年2月10日	临时停牌	27.72	-	-	7,700	163,683.00	213,444.00	-
002128	露天煤业	2017年3月17日	临时停牌	8.70	2017年8月14日	9.57	18,600	159,672.40	161,820.00	-
002076	雪莱特	2017年3月20日	临时停牌	7.07	-	-	19,200	127,567.65	135,744.00	-
000862	银星能源	2017年3月13日	临时停牌	7.90	-	-	17,000	140,349.43	134,300.00	-
002654	万润科技	2017年5月10日	临时停牌	9.28	-	-	11,000	99,880.00	102,080.00	-
300148	天舟文化	2017年1月25日	临时停牌	15.57	2017年8月1日	14.01	4,030	53,607.70	62,747.10	-
300252	金信诺	2017年5月12日	临时停牌	21.65	2017年7月27日	19.49	2,200	50,510.00	47,630.00	-
300104	乐视网	2017年4月17日	临时停牌	28.63	-	-	1,600	48,992.00	45,808.00	-
600485	信威集团	2016年12月26日	临时停牌	14.59	-	-	3,100	56,018.92	45,229.00	-
300414	中光防雷	2017年4月28日	临时停牌	24.78	-	-	1,700	50,314.00	42,126.00	-
601989	中国	2017年5	临时	6.21	-	-	6,700	50,477.00	41,607.00	-

	重工	月 31 日	停牌							
600289	亿阳信通	2017 年 5 月 10 日	临时停牌	10.94	2017 年 8 月 18 日	12.03	3,100	49,104.00	33,914.00	-
002600	江粉磁材	2017 年 2 月 27 日	临时停牌	11.46	2017 年 8 月 9 日	6.25	1,900	19,325.00	21,774.00	-
002168	深圳惠程	2017 年 1 月 23 日	临时停牌	16.99	-	-	1,200	19,104.00	20,388.00	-
300367	东方网力	2016 年 12 月 15 日	临时停牌	20.00	2017 年 7 月 3 日	18.01	800	19,296.00	16,000.00	-
600671	天目药业	2017 年 3 月 28 日	临时停牌	32.89	2017 年 8 月 14 日	29.60	300	9,480.00	9,867.00	-
000506	中润资源	2017 年 4 月 25 日	临时停牌	8.75	-	-	1,000	10,350.00	8,750.00	-

注：本基金截至 2017 年 6 月 30 日止持有以上因公布的重大事项可能产生重大影响而被暂时停牌的股票，该类股票将在所公布事项的重大影响消除后，经交易所批准复牌。

6.4.8.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.8.3.1 银行间市场债券正回购

于本报告期末，本基金未持有从事银行间市场债券正回购交易中作为抵押的债券。

6.4.8.3.2 交易所市场债券正回购

于本报告期末，本基金未持有从事交易所市场债券正回购交易中作为抵押的债券。

6.4.9 金融工具风险及管理

6.4.9.1 风险管理政策和组织架构

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

本基金的基金管理人奉行全面风险管理体系的建设，建立了以由高层监控(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。

6.4.9.2 信用风险

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

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

6.4.9.3 流动性风险

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

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

6.4.9.4 市场风险

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动而发生波动的风险，包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

6.4.9.4.1 利率风险

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

本基金的基金管理人定期对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控，并通过调整投资组合的

久期等方法对上述利率风险进行管理。

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

6.4.9.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2017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	21,296,862.52	-	-	-	21,296,862.52
结算备付金	870,966.76	-	-	-	870,966.76
存出保证金	59,523.63	-	-	-	59,523.63
交易性金融资产	-	-	-	106,074,501.43	106,074,501.43
应收证券清算款	-	-	-	153,470.36	153,470.36
应收利息	-	-	-	4,209.05	4,209.05
应收申购款	-	-	-	105,577.10	105,577.10
资产总计	22,227,352.91	-	-	106,337,757.94	128,565,110.85
负债					
应付证券清算款	-	-	-	545,298.37	545,298.37
应付赎回款	-	-	-	6,530.37	6,530.37
应付管理人报酬	-	-	-	152,154.20	152,154.20
应付托管费	-	-	-	25,359.04	25,359.04
应付交易费用	-	-	-	210,370.11	210,370.11
其他负债	-	-	-	89,272.77	89,272.77
负债总计	-	-	-	1,028,984.86	1,028,984.86
利率敏感度缺口	22,227,352.91	-	-	105,308,773.08	127,536,125.99
上年度末 2016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	271,692,448.80	-	-	-	271,692,448.80
结算备付金	163,820.84	-	-	-	163,820.84
存出保证金	14,834.41	-	-	-	14,834.41
交易性金融资产	-	-	-	38,438,402.83	38,438,402.83
应收利息	-	-	-	29,480.99	29,480.99
应收申购款	496.42	-	-	145,187.23	145,683.65
资产总计	271,871,600.47	-	-	38,613,071.05	310,484,671.52
负债					

应付证券清算款	-	-	-	19,105.69	19,105.69
应付赎回款	-	-	-	1,489.94	1,489.94
应付管理人报酬	-	-	-	131,404.81	131,404.81
应付托管费	-	-	-	21,900.78	21,900.78
应付交易费用	-	-	-	33,352.19	33,352.19
其他负债	-	-	-	110,005.62	110,005.62
负债总计	-	-	-	317,259.03	317,259.03
利率敏感度缺口	271,871,600.47	-	-	38,295,812.02	310,167,412.49

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

6.4.9.4.1.2 利率风险的敏感性分析

本基金于 2017 年 6 月 30 日和 2016 年 12 月 31 日均未持有交易性债券投资，因此当利率发生合理、可能的变动时，为交易而持有的债券公允价值的变动对年末基金资产净值无重大影响。

6.4.9.4.2 外汇风险

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

6.4.9.4.3 其他价格风险

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

本基金的投资范围为：股票资产占基金资产的比例范围为 60%-95%，其中权证不超过基金资产净值的 3%。固定收益类证券和现金投资比例范围为基金资产的 5%-40%。其中，资产支持证券投资比例范围为基金资产净值的 0-20%，现金或到期日在一年以内的政府债券的比例不低于基金资产净值的 5%。于 2017 年 6 月 30 日，本基金面临的其他价格风险列示如下：

6.4.9.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2017 年 6 月 30 日		上年度末 2016 年 12 月 31 日	
	公允价值	占基金 资产净	公允价值	占基金资 产净值比

		值比例 (%)		例 (%)
交易性金融资产-股票投资	106,074,501.43	83.17	38,438,402.83	12.39
交易性金融资产-基金投资	-	0.00	-	0.00
交易性金融资产-债券投资	-	0.00	-	0.00
交易性金融资产-贵金属投资	-	0.00	-	0.00
衍生金融资产-权证投资	-	0.00	-	0.00
其他	-	0.00	-	0.00
合计	106,074,501.43	83.17	38,438,402.83	12.39

6.4.9.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	下表为其他价格风险的敏感性分析，反映了在其他变量不变的假设下，证券投资价格发生合理、可能的变动时，将对基金资产净值产生的影响。正数表示可能增加基金资产净值，负数表示可能减少基金资产净值。		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2017年6月30日）	上年度末（2016年12月31日）
	75×沪深300指数+25×中证综合债券指数上升5	6,973,749.93	17,140,009.60
75×沪深300指数+25×中证综合债券指数下降5	-6,973,749.93	-17,140,009.60	

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	106,074,501.43	82.51
	其中：股票	106,074,501.43	82.51
2	固定收益投资	-	0.00
	其中：债券	-	0.00
	资产支持证券	-	0.00
3	贵金属投资	-	0.00
4	金融衍生品投资	-	0.00
5	买入返售金融资产	-	0.00
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	0.00
6	银行存款和结算备付金合计	22,167,829.28	17.24
7	其他各项资产	322,780.14	0.25
8	合计	128,565,110.85	100.00

7.2 期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	368,568.00	0.29
B	采矿业	3,363,817.00	2.64
C	制造业	47,599,272.94	37.32
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	3,019,646.83	2.37
E	建筑业	3,968,669.16	3.11
F	批发和零售业	6,029,813.35	4.73
G	交通运输、仓储和邮政业	3,798,300.00	2.98
H	住宿和餐饮业	281,840.00	0.22
I	信息传输、软件和信息技术服务业	5,734,536.76	4.50
J	金融业	22,853,995.29	17.92
K	房地产业	4,494,112.00	3.52
L	租赁和商务服务业	1,708,618.00	1.34
M	科学研究和技术服务业	445,101.00	0.35
N	水利、环境和公共设施管理业	1,021,090.00	0.80
O	居民服务、修理和其他服务业	-	0.00
P	教育	-	0.00
Q	卫生和社会工作	-	0.00

R	文化、体育和娱乐业	780,613.10	0.61
S	综合	606,508.00	0.48
	合计	106,074,501.43	83.17

7.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有港股通投资股票。

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	600309	万华化学	91,860	2,630,870.40	2.06
2	002142	宁波银行	101,700	1,962,810.00	1.54
3	600015	华夏银行	202,440	1,866,496.80	1.46
4	600016	民生银行	224,700	1,847,034.00	1.45
5	601169	北京银行	199,300	1,827,581.00	1.43
6	601328	交通银行	295,600	1,820,896.00	1.43
7	002304	洋河股份	20,830	1,808,252.30	1.42
8	600816	安信信托	131,740	1,790,346.60	1.40
9	601288	农业银行	508,100	1,788,512.00	1.40
10	000651	格力电器	40,400	1,663,268.00	1.30
11	000776	广发证券	92,200	1,590,450.00	1.25
12	000783	长江证券	167,707	1,588,185.29	1.25
13	601668	中国建筑	163,600	1,583,648.00	1.24
14	600999	招商证券	91,386	1,573,666.92	1.23
15	601628	中国人寿	58,100	1,567,538.00	1.23
16	600068	葛洲坝	136,159	1,530,427.16	1.20
17	600109	国金证券	125,600	1,472,032.00	1.15
18	000100	TCL 集团	408,200	1,400,126.00	1.10
19	002241	歌尔股份	72,000	1,388,160.00	1.09
20	000063	中兴通讯	45,946	1,090,758.04	0.86
21	601985	中国核电	139,400	1,088,714.00	0.85
22	000027	深圳能源	161,171	1,084,680.83	0.85
23	600596	新安股份	128,200	1,083,290.00	0.85
24	600837	海通证券	71,634	1,063,764.90	0.83
25	000039	中集集团	57,300	1,033,119.00	0.81
26	600031	三一重工	125,700	1,021,941.00	0.80
27	000069	华侨城 A	101,500	1,021,090.00	0.80
28	000338	潍柴动力	73,200	966,240.00	0.76
29	601607	上海医药	33,100	955,928.00	0.75

30	601155	新城控股	50,600	938,124.00	0.74
31	603993	洛阳钼业	184,900	935,594.00	0.73
32	600666	奥瑞德	52,640	915,936.00	0.72
33	001979	招商蛇口	42,600	909,936.00	0.71
34	000963	华东医药	18,200	904,540.00	0.71
35	002424	贵州百灵	47,900	903,394.00	0.71
36	601633	长城汽车	67,400	895,746.00	0.70
37	600415	小商品城	123,700	895,588.00	0.70
38	600487	亨通光电	31,700	889,185.00	0.70
39	600340	华夏幸福	25,900	869,722.00	0.68
40	600704	物产中大	108,795	793,115.55	0.62
41	600498	烽火通信	30,709	778,473.15	0.61
42	000627	天茂集团	95,800	774,064.00	0.61
43	600029	南方航空	88,400	769,080.00	0.60
44	000800	一汽轿车	75,029	763,044.93	0.60
45	601600	中国铝业	168,100	759,812.00	0.60
46	600153	建发股份	56,500	730,545.00	0.57
47	000555	神州信息	42,500	709,750.00	0.56
48	601006	大秦铁路	82,500	692,175.00	0.54
49	600118	中国卫星	22,900	637,536.00	0.50
50	601216	君正集团	129,200	631,788.00	0.50
51	002195	二三四五	81,780	584,727.00	0.46
52	600089	特变电工	55,963	578,097.79	0.45
53	600566	济川药业	15,200	578,056.00	0.45
54	002174	游族网络	18,100	574,856.00	0.45
55	601231	环旭电子	36,200	568,702.00	0.45
56	600529	山东药玻	22,800	560,196.00	0.44
57	603338	浙江鼎力	8,300	547,219.00	0.43
58	002065	东华软件	25,000	544,750.00	0.43
59	601877	正泰电器	27,095	544,338.55	0.43
60	002027	分众传媒	38,300	527,008.00	0.41
61	600893	航发动力	19,300	526,890.00	0.41
62	600637	东方明珠	23,128	501,183.76	0.39
63	600028	中国石化	84,500	501,085.00	0.39
64	600183	生益科技	40,600	501,004.00	0.39
65	600960	渤海活塞	64,300	490,609.00	0.38
66	002152	广电运通	58,983	490,148.73	0.38
67	300182	捷成股份	50,900	486,604.00	0.38
68	600688	上海石化	73,400	485,174.00	0.38

69	603818	曲美家居	30,400	484,272.00	0.38
70	300251	光线传媒	58,300	477,477.00	0.37
71	601000	唐山港	90,200	470,844.00	0.37
72	601933	永辉超市	64,200	454,536.00	0.36
73	600808	马钢股份	122,800	434,712.00	0.34
74	600019	宝钢股份	61,988	415,939.48	0.33
75	600966	博汇纸业	77,900	404,301.00	0.32
76	600035	楚天高速	68,600	377,986.00	0.30
77	603968	醋化股份	16,800	377,328.00	0.30
78	603128	华贸物流	43,300	370,648.00	0.29
79	000709	河钢股份	87,400	366,206.00	0.29
80	000426	兴业矿业	40,500	365,310.00	0.29
81	000960	锡业股份	26,100	355,221.00	0.28
82	601518	吉林高速	92,600	353,732.00	0.28
83	600497	驰宏锌锗	53,700	351,735.00	0.28
84	600879	航天电子	40,000	351,600.00	0.28
85	600978	宜华生活	34,700	348,735.00	0.27
86	600585	海螺水泥	15,200	345,496.00	0.27
87	000930	中粮生化	31,700	341,726.00	0.27
88	002340	格林美	56,290	340,554.50	0.27
89	600200	江苏吴中	25,600	337,920.00	0.26
90	601225	陕西煤业	46,900	331,583.00	0.26
91	000878	云南铜业	24,900	328,431.00	0.26
92	600889	南京化纤	32,200	305,578.00	0.24
93	600161	天坛生物	7,800	302,718.00	0.24
94	600801	华新水泥	31,700	302,101.00	0.24
95	002217	合力泰	30,400	300,352.00	0.24
96	002019	亿帆医药	17,900	298,572.00	0.23
97	002001	新和成	15,300	296,973.00	0.23
98	002118	紫鑫药业	43,343	296,032.69	0.23
99	600125	铁龙物流	32,700	292,992.00	0.23
100	002050	三花智控	17,500	285,600.00	0.22
101	000078	海王生物	47,300	285,219.00	0.22
102	600466	蓝光发展	33,000	284,790.00	0.22
103	600188	兖州煤业	23,100	282,744.00	0.22
104	600862	中航高科	29,100	281,979.00	0.22
105	600754	锦江股份	10,400	281,840.00	0.22
106	002745	木林森	7,500	280,425.00	0.22
107	300136	信维通信	7,000	280,140.00	0.22

108	002479	富春环保	23,500	279,650.00	0.22
109	600664	哈药股份	48,100	279,461.00	0.22
110	002317	众生药业	22,500	279,450.00	0.22
111	600499	科达洁能	35,099	278,686.06	0.22
112	600483	福能股份	26,600	275,842.00	0.22
113	002106	莱宝高科	27,200	275,536.00	0.22
114	600645	中源协和	12,700	272,161.00	0.21
115	002233	塔牌集团	22,300	271,391.00	0.21
116	600848	上海临港	12,500	269,500.00	0.21
117	600522	中天科技	22,300	268,715.00	0.21
118	000009	中国宝安	33,200	268,588.00	0.21
119	000997	新大陆	11,800	267,742.00	0.21
120	002078	太阳纸业	35,800	263,130.00	0.21
121	600180	瑞茂通	18,700	262,548.00	0.21
122	000581	威孚高科	10,100	261,590.00	0.21
123	000488	晨鸣纸业	20,200	260,580.00	0.20
124	600460	士兰微	42,900	260,403.00	0.20
125	000006	深振业A	29,500	259,895.00	0.20
126	600428	中远海特	41,700	259,374.00	0.20
127	000830	鲁西化工	37,500	258,750.00	0.20
128	600720	祁连山	32,600	255,258.00	0.20
129	002589	瑞康医药	16,560	255,024.00	0.20
130	600503	华丽家族	36,100	249,451.00	0.20
131	600409	三友化工	24,700	248,729.00	0.20
132	000090	天健集团	22,400	248,640.00	0.19
133	002482	广田集团	27,500	247,225.00	0.19
134	600872	中炬高新	13,500	247,050.00	0.19
135	600971	恒源煤电	30,200	245,526.00	0.19
136	002092	中泰化学	19,300	245,110.00	0.19
137	002416	爱施德	22,700	244,933.00	0.19
138	601678	滨化股份	35,100	243,945.00	0.19
139	000501	鄂武商A	13,130	242,379.80	0.19
140	600639	浦东金桥	13,200	239,184.00	0.19
141	000400	许继电气	13,227	237,556.92	0.19
142	000528	柳工	27,300	235,872.00	0.18
143	600067	冠城大通	34,300	235,641.00	0.18
144	601012	隆基股份	13,700	234,270.00	0.18
145	600597	光明乳业	18,324	233,631.00	0.18
146	002444	巨星科技	14,900	232,142.00	0.18

147	002440	闰土股份	15,200	231,952.00	0.18
148	300287	飞利信	25,100	230,418.00	0.18
149	600565	迪马股份	41,500	228,665.00	0.18
150	002431	棕榈股份	20,700	228,114.00	0.18
151	300324	旋极信息	12,400	226,176.00	0.18
152	600073	上海梅林	23,601	225,389.55	0.18
153	601718	际华集团	25,500	224,145.00	0.18
154	002048	宁波华翔	10,700	223,202.00	0.18
155	002670	国盛金控	13,800	219,420.00	0.17
156	300010	立思辰	16,640	215,488.00	0.17
157	600169	太原重工	55,800	215,388.00	0.17
158	300209	天泽信息	7,700	213,444.00	0.17
159	002277	友阿股份	33,000	212,850.00	0.17
160	600260	凯乐科技	8,300	210,322.00	0.16
161	600312	平高电气	15,300	210,222.00	0.16
162	603766	隆鑫通用	28,758	209,358.24	0.16
163	002266	浙富控股	42,788	208,805.44	0.16
164	000417	合肥百货	25,300	208,725.00	0.16
165	600628	新世界	18,000	207,900.00	0.16
166	002073	软控股份	24,300	206,064.00	0.16
167	002714	牧原股份	7,400	201,428.00	0.16
168	000761	本钢板材	38,400	200,832.00	0.16
169	002354	天神娱乐	9,240	198,660.00	0.16
170	600737	中粮糖业	20,700	195,408.00	0.15
171	600406	国电南瑞	10,600	187,090.00	0.15
172	000703	恒逸石化	13,100	186,544.00	0.15
173	002315	焦点科技	7,400	184,556.00	0.14
174	601233	桐昆股份	13,000	180,180.00	0.14
175	600348	阳泉煤业	26,500	179,670.00	0.14
176	000916	华北高速	27,200	175,712.00	0.14
177	300430	诚益通	4,900	170,716.00	0.13
178	002508	老板电器	3,900	169,572.00	0.13
179	002128	露天煤业	18,600	161,820.00	0.13
180	002503	搜于特	22,500	158,175.00	0.12
181	002029	七匹狼	16,300	155,991.00	0.12
182	601996	丰林集团	35,400	152,220.00	0.12
183	600138	中青旅	6,900	145,314.00	0.11
184	002076	雪莱特	19,200	135,744.00	0.11
185	000862	银星能源	17,000	134,300.00	0.11

186	002699	美盛文化	8,640	119,232.00	0.09
187	002326	永太科技	8,600	119,196.00	0.09
188	300247	乐金健康	17,400	115,884.00	0.09
189	300235	方直科技	6,700	110,483.00	0.09
190	600677	航天通信	8,000	109,840.00	0.09
191	001896	豫能控股	15,500	108,810.00	0.09
192	002605	姚记扑克	7,800	108,732.00	0.09
193	600336	澳柯玛	18,700	108,647.00	0.09
194	002093	国脉科技	12,200	107,360.00	0.08
195	600257	大湖股份	14,700	107,310.00	0.08
196	300006	莱美药业	16,500	106,920.00	0.08
197	300405	科隆股份	5,100	106,743.00	0.08
198	002235	安妮股份	8,700	106,140.00	0.08
199	300282	汇冠股份	5,000	105,500.00	0.08
200	002776	柏堡龙	4,500	104,310.00	0.08
201	002150	通润装备	8,800	103,400.00	0.08
202	002414	高德红外	5,600	102,480.00	0.08
203	300058	蓝色光标	13,100	102,442.00	0.08
204	002654	万润科技	11,000	102,080.00	0.08
205	300465	高伟达	9,400	100,298.00	0.08
206	002488	金固股份	8,600	99,502.00	0.08
207	600291	西水股份	4,500	99,000.00	0.08
208	002024	苏宁云商	8,700	97,875.00	0.08
209	300458	全志科技	3,606	94,982.04	0.07
210	002429	兆驰股份	29,500	90,565.00	0.07
211	002194	武汉凡谷	9,800	86,730.00	0.07
212	600433	冠豪高新	15,000	82,800.00	0.06
213	300027	华谊兄弟	10,000	80,900.00	0.06
214	002364	中恒电气	5,900	80,771.00	0.06
215	300199	翰宇药业	4,900	75,166.00	0.06
216	603308	应流股份	5,000	72,300.00	0.06
217	600831	广电网络	6,700	66,665.00	0.05
218	300148	天舟文化	4,030	62,747.10	0.05
219	002170	芭田股份	7,500	55,725.00	0.04
220	300213	佳讯飞鸿	5,500	49,445.00	0.04
221	002663	普邦股份	9,100	49,413.00	0.04
222	600055	万东医疗	3,920	49,392.00	0.04
223	600859	王府井	3,000	48,450.00	0.04
224	600617	国新能源	5,000	47,650.00	0.04

225	300252	金信诺	2,200	47,630.00	0.04
226	603801	志邦股份	1,405	47,489.00	0.04
227	300045	华力创通	4,600	46,920.00	0.04
228	300012	华测检测	10,000	46,300.00	0.04
229	300104	乐视网	1,600	45,808.00	0.04
230	002517	恺英网络	1,300	45,747.00	0.04
231	600485	信威集团	3,100	45,229.00	0.04
232	300419	浩丰科技	3,400	44,302.00	0.03
233	300414	中光防雷	1,700	42,126.00	0.03
234	300403	地尔汉宇	2,300	41,814.00	0.03
235	601989	中国重工	6,700	41,607.00	0.03
236	300238	冠昊生物	1,600	40,560.00	0.03
237	601117	中国化学	5,800	40,542.00	0.03
238	000156	华数传媒	2,700	40,257.00	0.03
239	002099	海翔药业	6,000	39,960.00	0.03
240	002445	中南文化	3,100	39,835.00	0.03
241	002303	美盈森	5,000	38,600.00	0.03
242	000882	华联股份	10,600	38,266.00	0.03
243	603043	广州酒家	1,502	37,955.54	0.03
244	600794	保税科技	8,700	35,757.00	0.03
245	600289	亿阳信通	3,100	33,914.00	0.03
246	603335	迪生力	2,230	24,864.50	0.02
247	002458	益生股份	1,100	22,715.00	0.02
248	002139	拓邦股份	2,100	22,617.00	0.02
249	002738	中矿资源	1,100	22,330.00	0.02
250	002325	洪涛股份	3,000	21,900.00	0.02
251	002600	江粉磁材	1,900	21,774.00	0.02
252	300227	光韵达	1,000	21,690.00	0.02
253	603679	华体科技	809	21,438.50	0.02
254	002546	新联电子	3,600	21,420.00	0.02
255	600110	诺德股份	1,500	21,135.00	0.02
256	300132	青松股份	2,600	21,112.00	0.02
257	603558	健盛集团	1,200	21,024.00	0.02
258	603938	三孚股份	1,246	20,932.80	0.02
259	600898	国美通讯	1,400	20,622.00	0.02
260	300463	迈克生物	800	20,400.00	0.02
261	002168	深圳惠程	1,200	20,388.00	0.02
262	002798	帝王洁具	500	20,260.00	0.02
263	002411	必康股份	700	20,244.00	0.02

264	002166	莱茵生物	1,800	20,034.00	0.02
265	002559	亚威股份	1,800	19,584.00	0.02
266	300473	德尔股份	400	19,040.00	0.01
267	603918	金桥信息	700	18,893.00	0.01
268	002086	东方海洋	1,500	18,825.00	0.01
269	002717	岭南园林	700	18,760.00	0.01
270	002652	扬子新材	2,600	18,746.00	0.01
271	002579	中京电子	1,700	18,649.00	0.01
272	600097	开创国际	1,000	18,290.00	0.01
273	300451	创业软件	600	18,228.00	0.01
274	002657	中科金财	600	17,394.00	0.01
275	603933	睿能科技	857	17,311.40	0.01
276	300444	双杰电气	800	17,168.00	0.01
277	300236	上海新阳	600	16,908.00	0.01
278	300367	东方网力	800	16,000.00	0.01
279	600515	海航基础	1,500	15,405.00	0.01
280	603305	旭升股份	1,351	15,212.26	0.01
281	603286	日盈电子	890	13,528.00	0.01
282	002335	科华恒盛	300	10,632.00	0.01
283	300049	福瑞股份	600	10,122.00	0.01
284	600671	天目药业	300	9,867.00	0.01
285	603331	百达精工	999	9,620.37	0.01
286	600094	大名城	1,200	9,204.00	0.01
287	002436	兴森科技	1,400	8,820.00	0.01
288	000506	中润资源	1,000	8,750.00	0.01
289	603617	君禾股份	832	7,429.76	0.01
290	600958	东方证券	158	2,197.78	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	601166	兴业银行	4,974,727.00	1.60
2	600068	葛洲坝	4,447,627.76	1.43
3	601390	中国中铁	3,868,622.00	1.25
4	600837	海通证券	3,801,062.00	1.23
5	601668	中国建筑	3,653,363.00	1.18

6	600028	中国石化	3,419,603.00	1.10
7	601988	中国银行	3,381,653.00	1.09
8	601186	中国铁建	2,996,677.52	0.97
9	600015	华夏银行	2,599,377.00	0.84
10	600873	梅花生物	2,409,396.31	0.78
11	601328	交通银行	2,162,403.00	0.70
12	601009	南京银行	2,129,509.68	0.69
13	601288	农业银行	2,112,551.00	0.68
14	000001	平安银行	2,096,765.00	0.68
15	600016	民生银行	2,089,810.00	0.67
16	000858	五粮液	2,016,253.00	0.65
17	600309	万华化学	1,997,719.17	0.64
18	002142	宁波银行	1,983,914.00	0.64
19	601628	中国人寿	1,882,424.92	0.61
20	000686	东北证券	1,709,959.16	0.55

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	5,101,145.00	1.64
2	601988	中国银行	4,104,392.00	1.32
3	601390	中国中铁	3,757,567.00	1.21
4	600028	中国石化	3,211,189.60	1.04
5	601186	中国铁建	2,937,047.00	0.95
6	600068	葛洲坝	2,831,442.00	0.91
7	601668	中国建筑	2,830,448.00	0.91
8	600837	海通证券	2,732,009.46	0.88
9	601009	南京银行	2,614,674.60	0.84
10	600873	梅花生物	2,476,481.00	0.80
11	000858	五粮液	2,122,593.00	0.68
12	000001	平安银行	2,000,438.48	0.64
13	600008	首创股份	1,912,533.00	0.62
14	000333	美的集团	1,763,734.28	0.57
15	600958	东方证券	1,685,374.75	0.54
16	000725	京东方 A	1,627,476.00	0.52

17	600820	隧道股份	1,550,679.00	0.50
18	601555	东吴证券	1,505,219.00	0.49
19	002500	山西证券	1,476,325.00	0.48
20	002456	欧菲光	1,455,952.00	0.47

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	222,165,640.37
卖出股票收入（成交）总额	158,122,712.79

注：上述金额均指成交金额（成交单价乘以成交数量），不考虑相关交易费用。

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

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

本基金本报告期末未持有债券。

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

本基金本报告期末未投资股指期货。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

本基金本报告期末未持有国债期货。

7.12 投资组合报告附注

7.12.1 本基金投资的前十名证券的发行主体未出现本期被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

7.12.2 基金投资的前十名股票中，没有投资于超出基金合同规定备选股票库之外股票。

7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	59,523.63

2	应收证券清算款	153,470.36
3	应收股利	-
4	应收利息	4,209.05
5	应收申购款	105,577.10
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	322,780.14

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中未存在流通受限情况。

7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入原因，分项之和与合计可能有尾差。

§8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

持有人户数 (户)	户均持有的 基金份额	持有人结构			
		机构投资者		个人投资者	
		持有份额	占总份 额比例	持有份额	占总份 额比例
3,473	35,102.35	83,575,056.37	68.55%	38,335,411.73	31.45%

注：持有人户数为有效户数，即存量份额大于零的账户。

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

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

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

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

§9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2010年6月22日）基金份额总额	1,173,262,454.69
本报告期期初基金份额总额	309,489,012.68
本报告期基金总申购份额	62,090,801.82
减：本报告期基金总赎回份额	249,669,346.40
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	121,910,468.10

§10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内无基金份额持有人大会决议。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

一、基金管理人的重大人事变动

1、基金管理人于 2017 年 2 月 18 日发布了《大成基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告》，经大成基金管理有限公司第六届董事会第二十四次会议（以下简称“董事会”）审议通过，杜鹏女士不再担任公司督察长。董事会同时决议，同意在公司新督察长任职前，由公司总经理罗登攀先生代为履行督察长职务，代为履职时间不超过 90 日。基金管理人于 2017 年 5 月 17 日发布了《大成基金管理有限公司关于总经理继续代为履行督察长职务的公告》，经公司第六届董事会第二十六次会议审议通过，决定继续由总经理罗登攀先生代为履行督察长职务。代为履行职务的时间自董事会决议通过之日起不超过 90 日。

2、基金管理人于 2017 年 2 月 18 日发布了《大成基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告》，经大成基金管理有限公司第六届董事会第二十四次会议审议通过，陈翔凯先生、谭晓冈先生和姚余栋先生担任公司副总经理。

二、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本报告期基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内没有涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

10.4 基金投资策略的改变

本基金投资策略在本报告期内没有重大改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

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

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期，本基金管理人、托管人及高级管理人员未受到监管部门稽查或处罚。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

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	
中信证券	1	152,675,115.19	40.26%	139,132.54	40.26%	-

申银万国	1	114,175,372.22	30.10%	104,047.88	30.10%	-
长江证券	1	112,413,780.86	29.64%	102,441.05	29.64%	-
东方证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
华创证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-

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

租用证券公司交易单元的选择标准主要包括：

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

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

本报告期内本基金新增租用交易单元：长江证券。本报告期内本基金退租席位：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

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例
中信证券	-	0.00%	5,000,000.00	100.00%	-	0.00%

10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	大成核心双动力混合型证券投资基金 2017 年第 1 季度报告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2017 年 4 月 21 日
2	大成核心双动力混合型证券投资基金 2016 年年度报告摘要	中国证监会指定报刊及本公司网站	2017 年 3 月 25 日
3	大成核心双动力混合型证券投资基金 2016 年年度报告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2017 年 3 月 25 日
4	大成核心双动力混合型证券投资基金更新招募说明书摘要（2016	中国证监会指定报刊及本公司网站	2017 年 1 月 25 日

	年第 2 期)		
5	大成核心双动力混合型证券投资基金更新招募说明书(2016 年第 2 期)	中国证监会指定报刊及本公司网站	2017 年 1 月 25 日
6	大成核心双动力混合型证券投资基金 2016 年第 4 季度报告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2017 年 1 月 21 日
7	关于增加北京恒天明泽基金销售有限公司为开放式基金销售机构并开通相关业务的公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2017 年 3 月 25 日
8	关于大成基金管理有限公司旗下部分基金增加郑州银行股份有限公司为销售机构的公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2017 年 1 月 11 日
9	关于大成基金管理有限公司旗下部分基金增加长沙银行股份有限公司为销售机构的公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2017 年 3 月 7 日
10	关于大成基金管理有限公司旗下部分基金增加上海银行股份有限公司为销售机构的公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2017 年 5 月 12 日
11	关于大成基金管理有限公司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	中国证监会指定报刊及本公司网站	2017 年 3 月 31 日
12	关于大成基金管理有限公司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	中国证监会指定报刊及本公司网站	2017 年 6 月 28 日
13	关于大成基金管理有限公司旗下部分基金增加汉口银行股份有限公司为销售机构的公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2017 年 2 月 15 日
14	关于大成基金管理有限公司旗下部分基金增加方正证券股份有限公司为销售机构的公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2017 年 4 月 11 日
15	关于大成基金管理有限公司旗下部分基金增加北京植信基金销售有限公司为销售机构的公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2017 年 6 月 14 日
16	关于大成基金管理有限公司撤销西安分公司的公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2017 年 1 月 6 日
17	大成基金管理有限公司关于总经理继续代为履行督察长职务的公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2017 年 5 月 17 日
18	大成基金管理有限公司关于通过网上直销系统适用渠道大成钱柜交易实施费率优惠活动的公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2017 年 1 月 11 日
19	大成基金管理有限公司关于调整网上直销系统招行直联渠道基金交易费率优惠的公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2017 年 3 月 8 日

20	大成基金管理有限公司关于调整网上直销系统建行直联渠道基金交易费率优惠的公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2017 年 5 月 4 日
21	大成基金管理有限公司关于旗下基金投资非公开发行股票的公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2017 年 1 月 19 日
22	大成基金管理有限公司关于旗下基金投资非公开发行股票的公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2017 年 4 月 1 日
23	大成基金管理有限公司关于旗下基金投资非公开发行股票的公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2017 年 4 月 28 日
24	大成基金管理有限公司关于旗下基金投资非公开发行股票的公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2017 年 5 月 27 日
25	大成基金管理有限公司关于旗下基金实行网上直销申购费率优惠的公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2017 年 1 月 3 日
26	大成基金管理有限公司关于旗下基金持有的“中文在线”股票估值调整的公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2017 年 6 月 2 日
27	大成基金管理有限公司关于旗下基金持有的“三诺生物”股票估值调整的公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2017 年 6 月 2 日
28	大成基金管理有限公司关于旗下基金持有的“乐视网”股票估值调整的公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2017 年 6 月 2 日
29	大成基金管理有限公司关于旗下部分基金增加万联证券有限责任公司为销售机构的公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2017 年 1 月 17 日
30	大成基金管理有限公司关于旗下部分基金增加上海利得基金销售有限公司为销售机构的公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2017 年 6 月 27 日
31	大成基金管理有限公司关于公司旗下部分基金估值调整的公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2017 年 1 月 17 日
32	大成基金管理有限公司关于公司旗下部分基金估值调整的公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2017 年 2 月 11 日
33	大成基金管理有限公司关于公司旗下部分基金估值调整的公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2017 年 3 月 17 日
34	大成基金管理有限公司关于公司旗下部分基金估值调整的公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2017 年 4 月 18 日
35	大成基金管理有限公司关于公司旗下部分基金估值调整的公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2017 年 4 月 22 日
36	大成基金管理有限公司关于公司旗下部分基金估值调整的公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2017 年 5 月 12 日
37	大成基金管理有限公司关于公司旗下部分基金估值调整的公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2017 年 5 月 24 日
38	大成基金管理有限公司关于高级	中国证监会指定报	2017 年 2 月 18 日

	管理人员变更的公告（姚余栋）	刊及本公司网站	
39	大成基金管理有限公司关于高级 管理人员变更的公告（谭晓冈）	中国证监会指定报 刊及本公司网站	2017 年 2 月 18 日
40	大成基金管理有限公司关于高级 管理人员变更的公告（杜鹏）	中国证监会指定报 刊及本公司网站	2017 年 2 月 18 日
41	大成基金管理有限公司关于高级 管理人员变更的公告（陈翔凯）	中国证监会指定报 刊及本公司网站	2017 年 2 月 18 日
42	大成基金管理有限公司关于撤销 北京理财中心的公告	中国证监会指定报 刊及本公司网站	2017 年 4 月 14 日
43	大成基金管理有限公司关于《上 海证券交易所分级基金业务管理 指引》实施的风险提示公告	中国证监会指定报 刊及本公司网站	2017 年 4 月 26 日
44	大成基金管理有限公司关于《上 海证券交易所分级基金业务管理 指引》实施的风险提示公告	中国证监会指定报 刊及本公司网站	2017 年 4 月 27 日
45	大成基金管理有限公司关于《上 海证券交易所分级基金业务管理 指引》实施的风险提示公告	中国证监会指定报 刊及本公司网站	2017 年 4 月 28 日
46	大成基金管理有限公司关于《上 海证券交易所分级基金业务管理 指引》实施的风险提示公告	中国证监会指定报 刊及本公司网站	2017 年 4 月 29 日
47	大成基金管理有限公司更正公告	中国证监会指定报 刊及本公司网站	2017 年 3 月 29 日
48	大成基金关于旗下部分基金增加 平安证券股份有限公司为销售机 构的公告	中国证监会指定报 刊及本公司网站	2017 年 6 月 16 日
49	大成基金关于旗下部分基金增加 北京肯特瑞财富管理有限公 司为销售机构的公告	中国证监会指定报 刊及本公司网站	2017 年 6 月 21 日
50	大成基金关于旗下部分基金增加 北京虹点基金销售有限公司为销 售机构的公告	中国证监会指定报 刊及本公司网站	2017 年 5 月 6 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	20170101-20170102	238,402,058.02	-	238,402,058.02	-	0.00%
	2	20170103-20170630	25,772,551.55	-	-	25,772,551.55	21.14%
	3	20170331-20170630	-	57,802,504.82	-	57,802,504.82	47.41%
个人	-	-	-	-	-	-	-
产品特有风险							
<p>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。</p>							

11.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

- 1、中国证监会批准设立《大成核心双动力股票型证券投资基金》的文件；
- 2、《大成核心双动力混合型证券投资基金基金合同》；
- 3、《大成核心双动力混合型证券投资基金基金托管协议》；
- 4、大成基金管理有限公司批准文件、营业执照、公司章程；
- 5、本报告期内在指定报刊上披露的各种公告原稿。

12.2 存放地点

备查文件存放在本基金管理人和托管人的办公住所。

12.3 查阅方式

投资者可在营业时间免费查阅，或登录本基金管理人网站 <http://www.dcfund.com.cn> 进行查阅。

投资者对本报告书如有疑问，可咨询本基金管理人大成基金管理有限公司。

客户服务中心电话：400-888-5558（免长途通话费用）

国际互联网址：<http://www.dcfund.com.cn>

大成基金管理有限公司

2017年8月24日