大成恒丰宝货币市场基金

2016 第二季度 报告

2016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:恒丰银行股份有限公司
报告送出日期:2016年7月20日

§1 重要提示

基金管理人的董事会及董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏,并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带责任。

基金托管人恒丰银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2016年7月18日复核了本报告中的财务指标、净值表现和投资组合报告等内容,保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2016年4月1日起至6月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	大成恒丰宝货币		
交易代码	001697		
基金运作方式	契约型开放式		
基金合同生效日	2015年8月4日		
报告期末基金份额总额	168,477,980.84份		
投资目标	在保持本金安全和资产流动性基础上追求较高的当期收益。		
投资策略	本基金通过对宏观经济、宏观政策、市场资金面供求等因素的综合分析,对资金利率变动趋势进行评估,最大限度地优化存款期限、回购和债券品种组合。基金管理人在评估各品种在流动性、收益率稳定性基础上,结合预先制定的组合平均期限范围确定类属资产配置。基金根据经未来短期利率走势的研判,结合基金资产流动性的需求动态调整组合久期。在确保安全性和流动性的前提下,通过不同商业银行和不同存款期限的选择,挖掘出利率相对较高的多家银行进行银行协议存款和大额存单的投资,在获取较高投资收益的同时尽量分散投资风险,提高存款及存单资产的流动性。在日常的投资管理过程中,本基金将会紧密关注申购与赎回资金变化情况、季节性资金流动等影响货币市场基金流动性管理的因素,建立组合流动性监控管理指标,实现对基金资产流动性的实时管理。		
业绩比较基准	银行活期存款利率(税后)		
风险收益特征	本基金为货币市场基金,为证券投资基金中的低风险品种。本基金长期的风险和预期收益低于股票型基金、混合型基金、债券型基金。		
基金管理人	大成基金管理有限公司		
基金托管人	恒丰银行股份有限公司		
下属分级基金的基金简称	大成恒丰宝货币A	大成恒丰宝货币B	大成恒丰宝货币E
下属分级基金的交易代码	001697	001698	001699
报告期末下属分级基金的份额总额	10,184,023.58份	70,299,990.40份	87,993,966.86份

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位:人民币元

主要财务指标	报告期(2016年4月1日—2016年6月30日)		
	大成恒丰宝货币A	大成恒丰宝货币B	大成恒丰宝货币E
1. 本期已实现收益	57,149.02	1,169,521.51	503,263.54
2. 本期利润	57,149.02	1,169,521.51	503,263.54
3. 期末基金资产净值	10,184,023.58	70,299,990.40	87,993,966.86

注: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,由于本基金采用摊余成本法核算,因此,公允价值变动收益为零,本期已实现收益和本期利润的金额相等。

3.2 基金净值表现

3.2.1 本报告期基金份额净值收益率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

大成恒丰宝货币A

阶段	净值收益率①	净值收益率标准差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	0.6992%	0.0081%	0.0870%	0.0000%	0.5222%	0.0081%

大成恒丰宝货币B

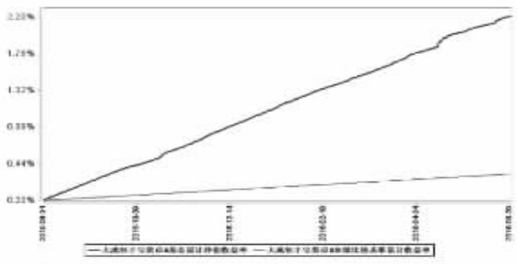
阶段	净值收益率①	净值收益率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	0.6689%	0.0081%	0.0870%	0.0000%	0.5819%	0.0081%

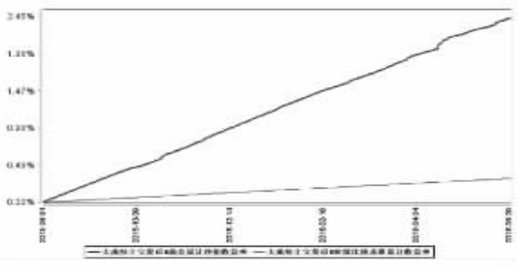
大成恒丰宝货币E

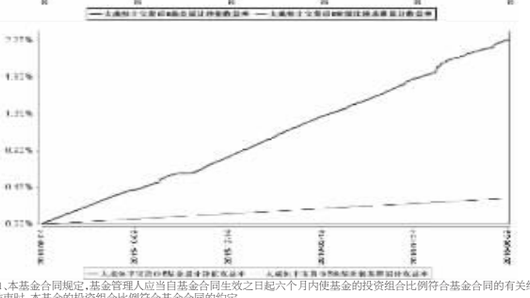
阶段	净值收益率①	净值收益率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	0.6590%	0.0081%	0.0870%	0.0000%	0.5720%	0.0081%

注:本货币基金收益分配按日结转份额。

3.2.2 自基金合同生效以来基金累计净值收益率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较







注:1.本基金合同规定,基金管理人应当自基金合同生效之日起六个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的有关约定。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.本基金合同生效日为2015年8月4日,截至报告期末本基金合同生效未满一年。

§4 管理人报告

4.1 基金经理(或基金经理小组)简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
李达夫先生	本基金基金经理	2015年8月4日	-	10年	数量经济学硕士,2006年7月至2008年4月就职于东莞农商银行资金营运中心,历任交易员、研究员,2008年4月至2012年9月就职于国投瑞银基金管理有限公司固定收益部,2011年6月30日至2012年9月15日担任国投瑞银货币市场基金基金经理,2012年9月加入大成基金管理有限公司,2013年3月7日至2014年4月4日任大成货币市场证券投资基金基金经理,2013年3月7日起任大成现金增利货币市场基金基金经理,2013年7月17日起兼任大成景安短融债券型证券投资基金基金经理,2014年9月3日起任大成信用增利一年定期开放债券型证券投资基金基金经理,2015年8月4日起任大成恒丰宝货币市场基金基金经理,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。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

本报告期内,本基金管理人严格遵守《证券法》、《证券投资基金法》、《大成恒丰宝货币市场基金基金合同》和其他有关法律法规的规定,在基金管理运作中,大成恒丰宝货币市场基金的投资范围、投资比例、投资组合、证券交易行为、信息披露等符合有关法律法规、行业监管规则和基金合同等规定,本基金没有发生重大违法违规行为,没有运用基金财产进行内幕交易和操纵市场行为以及进行有损基金投资人利益的关联交易,整体运作合法、合规。本基金将继续以取信于市场、取信于社会投资公众为宗旨,承诺将一如既往地本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金财产,在规范基金运作和严格控制投资风险的前提下,努力为基金份额持有人谋求最大利益。

4.3 公平交易专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

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、业绩评估等与投资管理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,通过多部门的协作互控,保证了公平交易的可操作、可稽核和可持续。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

公司风险管理部定期对公司旗下所有投资组合间同向交易、反向交易等可能存在异常交易的行为进行分析。2016年2季度公司旗下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%的交易情形;投资组合间债券交易不存在同日反向交易;投资组合间相邻交易日反向交易的市场成交比例、成交均价等交易不对市场产生重大影响,无异常;投资组合间虽然存在同向交易行为,但结合交易价差分析统计分析和潜在利益输送金额统计结果表明投资组合间不存在利益输送的可能性。

4.4 报告期内基金投资策略和运作分析

上半年工业增速基本稳定于6%的水平。目前大宗主要品种的库存已回落到较低水平,而投资需求有支撑,未来几个月的工业生产情况不会差。其中,6月耗煤增速数据较5月改善,PMI生产分项也继续上升,虽然去年6月基数很高,预计6月工业生产同比数仍在6%附近。CPI 1-5月累积环比增长1%,高于历史均值,而不含鲜菜和鲜果的CPI 1-5月累积环比增长1.2%,明显高于往年,体现出了货币宽松后对于整体物价抬升的影响。

二季度资金环境整体保持宽松,月末以及季末受央行MPA政策影响,市场资金面初现较大波动。至季末,短端隔夜与7天回购利率较一季末分别下行10bp和14bp。1年期金融债收益率较上季度有所走高,上行20bp;1年期AAA短融上行21bp,AA+上行约35bp。1个月、3个月shibor利率均值较上个季度小幅上行8bp和15bp。

二季度本基金在投资管理过程中继续贯彻稳健操作的原则,高度重视组合的流动性管理和安全性管理。在对基金份额持有人结构分析、未来投资期内持有人申赎赎回带来的基金流动性变化预测以及货币市场利率判断的基础上,灵活管理组合现金流的到期分布。在实际操作中,二季度维持高比例短融投资比例,提高杠杆,增加了大额存单配置力度以提高组合静态收益。

4.5 报告期内基金的业绩表现

报告期内本基金A类净值收益率为0.6092%,B类净值收益率0.6689%,E类净值收益率0.6661%,期间业绩比较基准收益率为0.0870%。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

无。

§5 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	固定收益投资	154,806,224.66	83.87
	其中:债券	154,806,224.66	83.87
	资产支持证券	-	0.00
2	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
3	银行存款和结算备付金合计	24,128,870.30	13.07
4	其他资产	5,654,455.47	3.06
5	合计	184,589,550.43	100.00

5.2 报告期债券回购融资情况

序号	项目	占基金资产净值的比例(%)
1	报告期内债券回购融资余额	4.56
	其中:买断式回购融资	0.00

序号	项目	金额	占基金资产净值的比例(%)
2	报告期末债券回购融资余额	15,799,792.10	9.38
	其中:买断式回购融资	-	0.00

注:报告期内债券回购融资余额占基金资产净值的比例为报告期内每个交易日融资余额占资产净值比例的简单平均值。

债券正回购的资金余额超过基金资产净值的20%的说明

本报告期内本基金债券正回购的资金余额未超过基金资产净值的20%。

5.3 基金投资组合平均剩余期限

5.3.1 投资组合平均剩余期限基本情况

项目	天数
报告期末投资组合平均剩余期限	76
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	80
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	22

报告期内投资组合平均剩余期限超过180天情况说明

本基金合同约定:"本基金投资组合的平均剩余期限在每个交易日均不得超过120天",本报告期内,本基金未发生超标情况。

5.3.2 报告期末投资组合平均剩余期限分布比例

序号	平均剩余期限	各期限资产占基金资产净值的比例(%)	各期限负债占基金资产净值的比例(%)
1	30天以内	36.88	9.38
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	0.00	0.00
2	30天(含)-60天	27.90	0.00
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	0.00	0.00
3	60天(含)-90天	11.89	0.00
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	0.00	0.00
4	90天(含)-180天	5.89	0.00
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	0.00	0.00
5	180天(含)-397天(含)	23.64	0.00
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	0.00	0.00
合计		106.21	9.38

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	摊余成本(元)	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	-	0.00
2	央行票据	-	0.00
3	金融债券	39,992,127.44	23.74
	其中:政策性金融债	39,992,127.44	23.74
4	企业债券	-	0.00
5	企业短期融资券	95,037,410.21	56.41
6	中期票据	-	0.00
7	同业存单	19,776,687.01	11.74
8	其他	-	0.00
9	合计	154,806,224.66	91.89
10	剩余存续期超过397天的浮动利率债券	-	0.00

5.5 报告期末按摊余成本占基金资产净值比例大小排序的前十名债券投资明细

序号	债券代码	债券名称	债券数量(张)	摊余成本(元)	占基金资产净值比例(%)
1	150416	15农发16	200,000	20,000,189.78	11.87
2	160401	16农发01	200,000	19,991,937.66	11.87
3	041558085	15中航集CP001	100,000	10,038,569.85	5.96
4	011599768	15招轮SCP002	100,000	10,008,429.68	5.94
5	071608004	16东方证券CP004	100,000	10,002,317.82	5.94
6	011699008	16苏交通SCP001	100,000	9,999,946.58	5.94
7	011534005	15东航联SCP005	100,000	9,999,588.79	5.94
8	071617002	16东北证券CP002	100,000	9,999,384.70	5.94
9	071633003	16华融证券CP003	100,000	9,998,977.73	5.93
10	011552003	15南航SCP003	100,000	9,998,488.51	5.93

5.6 "影子定价"与"摊余成本法"确定的基金资产净值的偏离

项目	偏离情况
报告期内偏离度的绝对值在0.25(含)-0.5%间的次数	-
报告期内偏离度的最高值	0.2180%
报告期内偏离度的最低值	0.0531%
报告期内每个工作日偏离度的绝对值的简单平均值	0.1129%

5.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名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。

5.8 投资组合报告附注

5.8.1 本基金估值采用摊余成本法估值,即估值对象以买入成本列示,按票面利率或协议利率并考虑其买入时的溢价与折价,在其剩余存续期内按照实际利率法每日计提摊益。本基金通过每日计算基金收益并分配的方式,使基金份额净值保持在人民币1.00元。

5.8.2 报告期内不存在基金持有剩余期限小于397天但剩余存续期超过397天的浮动利率债券的摊余成本超过当日基金资产净值的20%的情况。

5.8.3 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。

5.8.4 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	-
2	应收证券清算款	-
3	应收利息	1,839,488.18
4	应收申购款	3,814,967.29
5	其他应收款	-
6	待摊费用	-
7	其他	-
8	合计	5,654,455.47

5.8.5 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入原因,分项之和与合计可能有尾差。

§6 开放式基金份额变动

单位:份

项目	大成恒丰宝货币A	大成恒丰宝货币B	大成恒丰宝货币E
报告期期初基金份额总额	1,556,325.41	342,166,668.89	61,701,829.54
报告期期间基金总申购份额	47,347,423.53	56,279,361.24	236,550,007.25
报告期期间基金总赎回份额	38,719,725.36	328,146,039.73	210,257,869.93
报告期期末基金份额总额	10,184,023.58	70,299,990.40	87,993,966.86

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

本报告期基金管理人未运用固有资金投资本基金。

§8 影响投资者决策的其他重要信息

基金管理人于2016年6月25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十七次会议审议通过,钟鸣远先生不再担任公司副总经理。

§9 备查文件目录

9.1 备查文件目录

1、中国证监会批准设立大成恒丰宝货币市场基金的文件;

2、《大成恒丰宝货币市场基金基金合同》;

3、《大成恒丰宝货币市场基金托管协议》;

4、大成基金管理有限公司批准文件、营业执照、公司章程;

5、本报告期内在指定报刊上披露的各种公告原稿。

9.2 存放地点

备查文件存放于本基金管理人和托管人的住所。

9.3 查阅方式

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

大成基金管理有限公司
2016年7月20日

大成核心双动力混合型证券投资基金

2016 第二季度 报告

2016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
报告送出日期:2016年7月20日

§1 重要提示

基金管理人的董事会及董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏,并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带责任。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2016年7月18日复核了本报告中的财务指标、净值表现和投资组合报告等内容,保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2016年4月1日起至6月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	大成核心双动力混合
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
报告期末基金份额总额	34,679,017.92份
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。
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

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位:人民币元

主要财务指标	报告期(2016年4月1日—2016年6月30日)
1.本期已实现收益	-1,058,648.72
2.本期利润	367,712.38
3.加权平均基金份额本期利润	0.0102
4.期末基金资产净值	49,677,853.73
5.期末基金份额净值	1.433

注:1.本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入(不含公允价值变动收益)扣除相关费用后的余额,本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

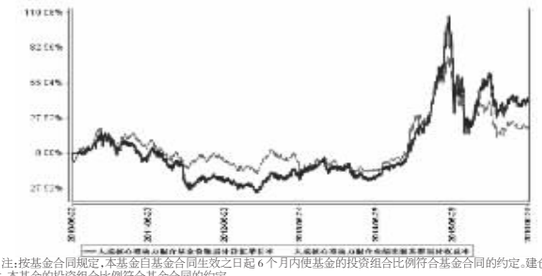
2.所述基金业绩指标不包括持有人交易基金的各项费用,计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

3.2 基金净值表现

3.2.1 本报告期基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	净值增长率①	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	0.84%	0.92%	-1.34%	0.76%	2.18%	0.16%

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



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。建仓期结束时,本基金的投资组合比例符合基金合同的约定。

§4 管理人报告

4.1 基金经理(或基金经理小组)简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
张钟玉女士	本基金基金经理	2015年2月28日	-	6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	2016年3月5日	-	12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,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

本报告期内,本基金管理人严格遵守《证券法》、《证券投资基金法》、《大成核心双动力混合型证券投资基金基金合同》和其他有关法律法规的规定,在基金管理运作中,大成核心双动力混合型证券投资基金的投资范围、投资比例、投资组合、证券交易行为、信息披露等符合有关法律法规、行业监管规则和基金合同等规定,本基金没有发生重大违法违规行为,没有运用基金财产进行内幕交易和操纵市场行为以及进行有损基金投资人利益的关联交易,整体运作合法、合规。本基金将继续以取信于市场、取信于社会投资公众为宗旨,承诺将一如既往地本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金财产,在规范基金运作和严格控制投资风险的前提下,努力为基金份额持有人谋求最大利益。

4.3 公平交易专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

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、业绩评估等与投资管理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,通过多部门的协作互控,保证了公平交易的可操作、可稽核和可持续。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

公司风险管理部定期对公司旗下所有投资组合间同向交易、反向交易等可能存在异常交易的行为进行分析。2016年2季度公司旗下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%的交易情形;投资组合间债券交易不存在同日反向交易;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;投资组合间虽然存在同向交易行为,但结合交易价差分布统计分析和潜在利益输送金额统计结果表明投资组合间不存在利益输送的可能性。

4.4 报告期内基金投资策略和运作分析

二季度宏观经济环境相对动荡,季初,以房地产和基建为主体,投资继续拉动经济回升。在需求回暖和资金炒作叠加作用下,以黑色系为代表的大宗商品价格一度大幅反弹。然而,在权威人士表态后,情况发生了变化,政策刺激力度明显减弱,大宗商品价格也迅速回落。本季度国际环境也并不稳定,人民币汇率继续贬值,英国公投脱欧,对宏观经济有深远影响。

相对于风雨飘摇的宏观经济基本面,股市显得非常顽强。尽管有多重利空侵袭,A股始终坚守,并没有创出年内新低。二季度各基准指数均窄幅震荡,波动率极低。沪深300指数小幅下跌1.99%。大、中、小盘指数表现非常接近,市值因子对市场的影响较小。市场风格更多体现在热点的轮动上。本季度表现较为突出的板块包括有色、白酒、医药等。

报告期内本基金基于基金契约,根据数量化投资模型,精选沪深300成份股构建了核心组合,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。本季度基金净值增长率为0.84%,在全市场窄幅振荡的环境下,取得了一定的超额收益,体现了量化策略的稳定性。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截止本报告期末,本基金份额资产净值为1.433元,本报告期基金份额净值增长率为0.84%,同期业绩比较基准收益率为-1.34%,高于业绩比较基准的表现。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

无。

§5 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	36,828,534.00	73.71
	其中:股票	36,828,534.00	73.71
2	基金投资	-	0.00
3	固定收益投资	24,263.80	0.05
	其中:债券	24,263.80	0.05
	资产支持证券	-	0.00
4	贵金属投资	-	0.00
5	金融衍生品投资	-	0.00
6	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
7	银行存款和结算备付金合计	13,104,378.94	26.23
8	其他资产	7,461.48	0.01
9	合计	49,964,638.22	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	424,300.00	0.85
B	采矿业	784,920.00	1.58
C	制造业	18,561,451.44	37.36
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	1,340,084.00	2.70
E	建筑业	915,981.00	1.84
F	批发和零售业	1,438,807.00	2.90
G	交通运输、仓储和邮政业	2,002,548.00	4.03
H	住宿和餐饮业	130,284.00	0.26
I	信息传输、软件和信息技术服务业	802,992.80	1.62
J	金融业	7,996,705.12	16.10
K	房地产业	1,286,305.00	2.59
L	租赁和商务服务业	159,444.00	0.32
M	科学研究和技术服务业	-	0.00
N	水利、环境和公共设施管理业	389,204.64	0.78
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	595,507.00	1.20
S	综合	-	0.00
	合计	36,828,534.00	74.13

5.2.2 报告期末按行业分类的沪港通投资股票投资组合

无。

5.3 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	601009	南京银行	90,360	848,480.40	1.71
2	601939	建设银行	174,500	828,875.00	1.67
3	002142	宁波银行	54,200	801,076.00	1.61
4	601328	交通银行	142,000	799,460.00	1.61
5	601166	兴业银行	50,100	763,524.00	1.54
6	600016	民生银行	82,400	735,832.00	1.48
7	601318	中国平安	21,468	687,834.72	1.38
8	000858	五粮液	21,100	686,383.00	1.38
9	600109	国金证券	48,400	652,432.00	1.31
10	600705	中航资本	107,600	632,688.00	1.27

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	-	0.00
2	央行票据	-	0.00
3	金融债券	-	0.00
	其中:政策性金融债	-	0.00
4	企业债券	-	0.00
5	企业短期融资券	-	0.00
6	中期票据	-	0.00
7	可转债(可交换债)	24,263.80	0.05
8	同业存单	-	0.00
9	其他	-	0.00
10	合计	24,263.80	0.05

5.5 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

序号	债券代码	债券名称	数量(张)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	110031	航信转债	220	24,263.80	0.05

5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

5.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属投资。

5.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金本报告期末投资股指期货。

5.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期末投资股指期货。

5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.10.1 本期国债期货投资政策

本基金本报告期末投资国债期货。

5.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末投资国债期货。

5.10.3 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末投资国债期货。

5.11 投资组合报告附注

5.11.1 本基金投资的前十名证券的发行主体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。

5.11.2 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。

5.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	4,921.60
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	2,421.10
5	应收申购款	118.78
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	7,461.48

5.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

序号	债券代码	债券名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	110031	航信转债	24,263.80	0.05

5.11.5 报告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不存在流通受限情况。

5.11.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入原因,分项之和与合计可能有尾差。

§6 开放式基金份额变动

单位:份

报告期期初基金份额总额	33,576,589.49
报告期期间基金总申购份额	7,216,601.33
减:报告期期间基金总赎回份额	6,114,172.90
报告期期间基金拆分变动份额(份额减少以"-"填列)	-
报告期期末基金份额总额	34,679,017.92

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

基金管理人未持有本基金份额。

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

基金管理人未运用固有资金投资本基金。

§8 影响投资者决策的其他重要信息

基金管理人于2016年6月25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十七次会议审议通过,钟鸣远先生不再担任公司副总经理。

§9 备查文件目录

9.1 备查文件目录

1、中国证监会批准设立大成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、大成基金管理有限公司批准文件、营业执照、公司章程;

5、本报告期内在指定报刊上披露的各种公告原稿。

9.2 存放地点

备查文件存放于本基金管理人和托管人的住所。

9.3 查阅方式

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