

# 大成核心价值甄选混合型证券投资基金 2024 年中期报告

2024 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：2024 年 8 月 30 日

## § 1 重要提示及目录

### 1.1 重要提示

基金管理人的董事会、董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带的法律责任。本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 2024 年 08 月 29 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告财务资料未经审计。

本报告期自 2024 年 01 月 01 日起至 06 月 30 日止。

## 1.2 目录

<b>§ 1 重要提示及目录</b>	<b>2</b>
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
<b>§ 2 基金简介</b>	<b>5</b>
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	6
2.5 其他相关资料	6
<b>§ 3 主要财务指标和基金净值表现</b>	<b>6</b>
3.1 主要会计数据和财务指标	6
3.2 基金净值表现	7
<b>§ 4 管理人报告</b>	<b>9</b>
4.1 基金管理人及基金经理情况	9
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	10
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	11
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明	11
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	12
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	12
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	13
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	13
<b>§ 5 托管人报告</b>	<b>13</b>
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	13
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	13
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	13
<b>§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）</b>	<b>13</b>
6.1 资产负债表	13
6.2 利润表	15
6.3 净资产变动表	16
6.4 报表附注	18
<b>§ 7 投资组合报告</b>	<b>42</b>
7.1 期末基金资产组合情况	42
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	42
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	43
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	49
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	51
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	51
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	51
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	51

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 .....	51
7.10 本基金投资股指期货的投资政策 .....	51
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 .....	51
7.12 投资组合报告附注 .....	51
<b>§ 8 基金份额持有人信息 .....</b>	<b>52</b>
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 .....	53
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 .....	53
<b>§ 9 开放式基金份额变动 .....</b>	<b>53</b>
<b>§ 10 重大事件揭示 .....</b>	<b>54</b>
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
<b>§ 11 影响投资者决策的其他重要信息 .....</b>	<b>57</b>
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 .....	57
11.2 影响投资者决策的其他重要信息 .....	57
<b>§ 12 备查文件目录 .....</b>	<b>57</b>
12.1 备查文件目录 .....	57
12.2 存放地点 .....	57
12.3 查阅方式 .....	57

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	大成核心价值甄选混合型证券投资基金	
基金简称	大成核心价值甄选混合	
基金主代码	010929	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2021 年 3 月 15 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	1,023,741,185.97 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	大成核心价值甄选混合 A	大成核心价值甄选混合 C
下属分级基金的交易代码	010929	010930
报告期末下属分级基金的份额总额	787,868,142.33 份	235,873,043.64 份

### 2.2 基金产品说明

投资目标	本基金将以合理价格买入并持有具备核心竞争力、能够持续创造价值的优质企业股票，通过资产配置和个股甄选，在控制风险的前提下，力争为基金份额持有人创造长期稳健的投资回报。
投资策略	本基金的投资策略分为两方面：一方面体现在采取“自上而下”的方式对权益类、固定收益类等不同类别资产进行大类配置；另一方面体现在对单个投资品种的精选上。
业绩比较基准	沪深 300 指数收益率×60%+恒生指数收益率×20%+中债综合全价指数收益率×20%
风险收益特征	本基金是混合型证券投资基金，预期风险和预期收益高于债券型基金和货币市场基金、但低于股票型基金。本基金若投资港股通标的股票，则需承担港股通机制下因投资环境、投资标的、市场制度以及交易规则等差异带来的特有风险。

### 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	段皓静	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		广东省深圳市南山区海德三道 1236 号大成基金总部大厦 5	北京市西城区复兴门内大街 55 号

	层、27-33 层	
办公地址	广东省深圳市南山区海德三道 1236 号大成基金总部大厦 5 层、27-33 层	北京市西城区复兴门内大街 55 号
邮政编码	518054	100140
法定代表人	吴庆斌	廖林

## 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	广东省深圳市南山区海德三 道 1236 号大成基金总部大厦 5 层、27-33 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(2024 年 1 月 1 日-2024 年 6 月 30 日)	
	大成核心价值甄选混合 A	大成核心价值甄选混合 C
本期已实现收益	-7,619,144.96	312,612.79
本期利润	50,643,605.66	17,643,635.39
加权平均基金份 额本期利润	0.0723	0.0855
本期加权平均净 值利润率	6.72%	8.00%
本期基金份额净 值增长率	8.00%	7.69%
3.1.2 期末数 据和指标	报告期末(2024 年 6 月 30 日)	
期末可供分配利 润	69,117,515.39	15,903,607.30
期末可供分配基 金份额利润	0.0877	0.0674

期末基金资产净值	867,047,492.94	254,533,136.02
期末基金份额净值	1.1005	1.0791
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2024年6月30日)	
基金份额累计净值增长率	10.05%	7.91%

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）扣除相关费用和信用减值损失后的余额，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认购或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

大成核心价值甄选混合 A

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	-1.34%	0.40%	-2.24%	0.39%	0.90%	0.01%
过去三个月	2.53%	0.58%	0.39%	0.61%	2.14%	-0.03%
过去六个月	8.00%	0.67%	2.02%	0.74%	5.98%	-0.07%
过去一年	1.94%	0.63%	-6.31%	0.73%	8.25%	-0.10%
过去三年	10.69%	0.87%	-27.16%	0.88%	37.85%	-0.01%
自基金合同生效起至今	10.05%	0.83%	-26.29%	0.87%	36.34%	-0.04%

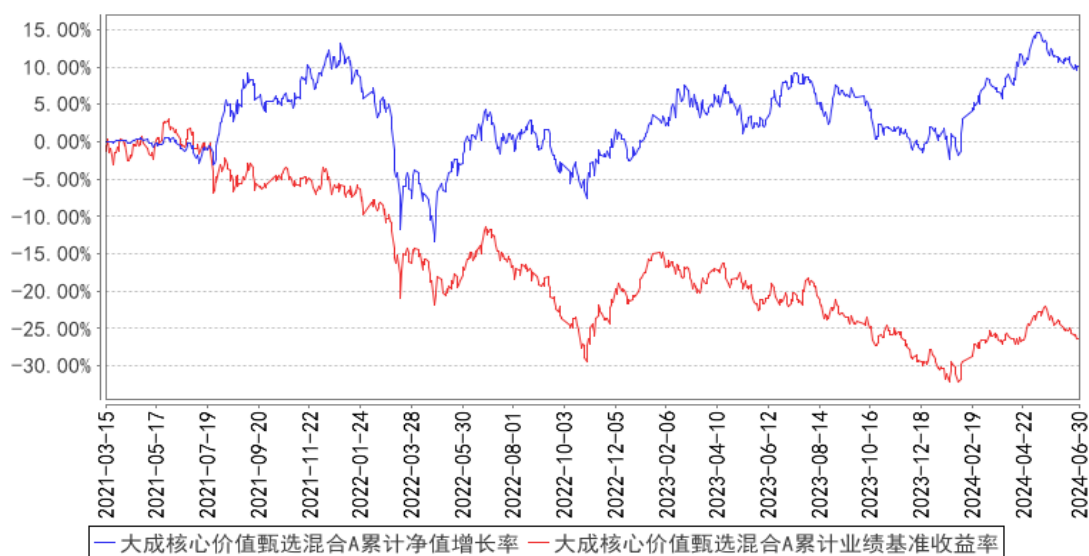
大成核心价值甄选混合 C

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	-1.39%	0.40%	-2.24%	0.39%	0.85%	0.01%
过去三个月	2.38%	0.58%	0.39%	0.61%	1.99%	-0.03%
过去六个月	7.69%	0.67%	2.02%	0.74%	5.67%	-0.07%

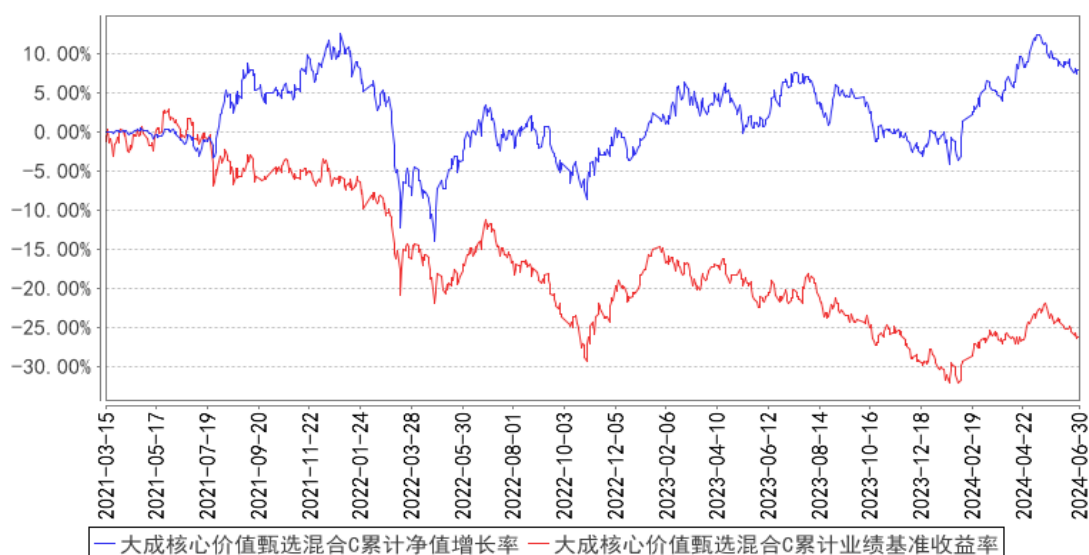
过去一年	1.34%	0.63%	-6.31%	0.73%	7.65%	-0.10%
过去三年	8.73%	0.87%	-27.16%	0.88%	35.89%	-0.01%
自基金合同生效 起至今	7.91%	0.83%	-26.29%	0.87%	34.20%	-0.04%

### 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

大成核心价值甄选混合A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



大成核心价值甄选混合C累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：本基金合同规定，基金管理人应当自基金合同生效之日起六个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的约定。建仓期结束时，本基金的投资组合比例符合基金合同的约定。



## § 4 管理人报告

### 4.1 基金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成立于 1999 年 4 月 12 日，注册资本人民币 2 亿元，是中国首批获准成立的“老十家”基金管理公司之一。公司总部位于深圳，同时设置了北方、华东和南方营销总部，在北京、上海等地开设有 5 家分公司。2009 年，公司在香港设立大成国际资产管理有限公司，大力拓展国际业务；2013 年，设立大成创新资本管理有限公司，开拓专户及专项管理业务。

公司业务资质齐全，全面覆盖公募基金、机构投资、海外投资、财富管理、养老金管理等业务，还受全国社会保障基金理事会委托管理部分社保基金和基本养老保险基金。旗下大成国际资产管理公司具备 QFII、RQFII 等资格，是首批首家完成备案的能够提供港股通投资顾问服务的香港机构。历经二十余年的磨砺和沉淀，大成基金形成了以长期投资能力为核心的竞争优势，打造了一支具有良好职业素养和丰富经验的资产管理队伍。公司目前已形成权益投资、固收投资、指数与期货投资、跨境投资、混合资产投资、大类资产配置六大投资团队，全面覆盖各类投资领域，综合实力不断提升，各项业务迅猛发展，管理资产种类位居同业前列。

#### 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		
刘旭	本基金基金经理，股票投资部总监、董事总经理	2021 年 3 月 15 日	-	13 年	厦门大学管理学硕士。2009 年至 2010 年在毕马威华振会计师事务所任审计师。2011 年 2 月至 2013 年 5 月任广发证券研究所研究员。2013 年 5 月加入大成基金管理有限公司，曾担任研究部研究员、基金经理助理、股票投资部副总监，现任股票投资部总监、董事总经理。2015 年 7 月 29 日起任大成高新技术产业股票型证券投资基金基金经理。2016 年 8 月 20 日至 2021 年 3 月 17 日任大成创新成长混合型证券投资基金 (LOF) 基金经理。2019 年 12 月 24 日起任大成优势企业混合型证券投资基金基金经理。2020 年 6 月 5 日至 2024 年 7 月 3 日任大成睿裕六个月持有期股票型证券投资基金基金经理。2020 年 8 月 11 日起任大成睿鑫股票型证券投资基金基金经理。2021 年 3 月 15 日起任大成核心价值甄选混合型证券投资基金基金经理。2022 年 6 月 7 日起任大成匠心卓越

					三年持有期混合型证券投资基金基金经理。2023 年 1 月 18 日起任大成慧心优选一年持有期混合型证券投资基金基金经理。2023 年 12 月 1 日起任大成至信回报三年定期开放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
郑欣	本基金基金经理助理	2023 年 4 月 26 日	-	8 年	CFA, 厦门大学经济学硕士。2016 年 7 月至 2019 年 6 月任第一创业证券资产管理部研究员。2019 年 7 月加入大成基金管理有限公司, 现任固定收益总部研究部研究主管兼基金经理。2021 年 11 月 26 日起任大成惠恒一年定期开放债券型发起式证券投资基金基金经理。2022 年 2 月 25 日起任大成惠享一年定期开放债券型发起式证券投资基金基金经理。2022 年 7 月 14 日起任大成景乐纯债债券型证券投资基金、大成景泰纯债债券型证券投资基金基金经理。2023 年 10 月 27 日起任大成景悦中短债债券型证券投资基金基金经理。2024 年 1 月 17 日起任大成惠福纯债债券型证券投资基金基金经理。具备基金从业资格。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中国证监会《证券基金经营机构董事、监事、高级管理人员及从业人员监督管理办法》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

姓名	产品类型	产品数量（只）	资产净值（元）	任职时间
刘旭	公募基金	8	17,358,830,294.75	2015 年 7 月 29 日
	私募资产管理计划	1	9,999,842.30	2024 年 6 月 28 日
	其他组合	5	15,944,696,066.02	2018 年 8 月 1 日
	合计	14	33,313,526,203.07	-

#### 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，公司严格执行了公平交易的原则和制度。公司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、5 日内及 10 日内股票及债券交易同向交易价差进行分析，针对同一基金经理管理的多个投资组合及公私募兼任基金经理管理的多个投资组合的投资交易行为加强了公平交易监测与分析，包括对不同时间窗下（同日、3 日、5 日、10 日）反向交易和同向交易价差监控的分析。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投资策略差异、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，同时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，公司旗下所有投资组合未发现存在异常交易行为。公司旗下投资组合间存在证券同日反向交易，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证券当日成交量 5% 的情形。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

2024 上半年，不同指数表现较为分化。沪深 300 指数微涨 0.89%，中证红利指数上涨 7.75%，中证 1000 下跌 16.84%。上半年尤其进入二季度以来，国内经济复苏进程放缓，整体需求承压，同时叠加各行业供给压力仍然较大，部分上市公司面临竞争加剧和盈利下修。市场风格更加趋向于稳定收益率资产。本产品 A 类份额上半年涨幅 8.00%，净值跑赢沪深 300 指数，也是受益于此种阶段性趋势。组合中运营商、家用电器、能源类等被市场解读为稳定收益类别资产带来主要回报，组合中较多制造业成长类别资产成了市场的抛弃对象。

本组合上半年操作较少，新建仓 1-2 只资产负债表健康且定价显著低于净资产的个股。如果他们未来资本配置方式朝着积极方向运行，那么回报率就有可能兑现该资产本身具备的内涵回报率；如果资本配置行为低于预期，那么该类资产也有一定的安全边际。总之还是那句话，我们会时刻跟踪产业与企业变化，及时修正观点使之能够与客观世界相符合，而不只是停留在我们对外部世界一厢情愿的美好假设之上。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末大成核心价值甄选混合 A 的基金份额净值为 1.1005 元，本报告期基金份额净值增长率为 8.00%，同期业绩比较基准收益率为 2.02%；截至本报告期末大成核心价值甄选混合 C

的基金份额净值为 1.0791 元，本报告期基金份额净值增长率为 7.69%，同期业绩比较基准收益率为 2.02%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

红利类资产的合理估值水平，与两个因素密切相关。一是社会的无风险回报率，二是该资产本身的盈利稳定性。伴随着该类资产在过去 2 年的超额收益不断加大，市场把这类资产贴上了统一的标签，而忽视了这类资产内部也是包罗万象，不同细分行业有着不同的外部产业环境、竞争格局、与资产负债情况。还记得在几年前，地产也是红利类资产，有着看似稳定的分红回报。我们需要比以往更谨慎审视组合中被市场阶段性投票的资产，是否在未来具备与过去同样的竞争优势，以及他们的能力是进化了还是退化了。

另外，成长股经过几个季度的调整，存在部分优秀公司估值水平进入合理范围的情况。在国内供给端竞争中，如果这轮还能走出来优势清晰的成长股，那么是值得重视的。在未来我们也将加大在这方面的研究力度，努力实现组合的可持续回报。

#### 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。估值委员会由公司各投研部门、交易管理部、风险管理部、监察稽核部、基金运营部指定人员组成。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八名投资组合经理。

各投研部门、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交易的债券品种的估值数据，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

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，本基金托管人在对本基金的托管过程中，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，本基金的管理人——大成基金管理有限公司在本基金的投资运作、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，托管人未发现损害基金份额持有人利益的行为。

#### 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本基金 2024 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：大成核心价值甄选混合型证券投资基金

报告截止日：2024 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2024 年 6 月 30 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
----	-----	------------------------	--------------------------

<b>资产：</b>			
货币资金	6.4.7.1	428,184,392.48	175,455,478.87
结算备付金		-	-
存出保证金		16,308.41	47,199.73
交易性金融资产	6.4.7.2	694,809,708.81	606,789,377.24
其中：股票投资		694,809,708.81	606,789,377.24
基金投资		-	-
债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
其他投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
债权投资	6.4.7.5	-	-
其中：债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
其他投资		-	-
其他债权投资	6.4.7.6	-	-
其他权益工具投资	6.4.7.7	-	-
应收清算款		-	-
应收股利		-	-
应收申购款		979,256.74	37,035.70
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.8	-	-
资产总计		1,123,989,666.44	782,329,091.54
<b>负债和净资产</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2024年6月30日</b>	<b>上年度末 2023年12月31日</b>
<b>负 债：</b>			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付清算款		0.48	2.41
应付赎回款		859,066.94	268,755.15
应付管理人报酬		1,119,294.63	783,850.34
应付托管费		186,549.12	130,641.74
应付销售服务费		125,557.62	33,276.05
应付投资顾问费		-	-
应交税费		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.9	118,568.69	275,194.83
负债合计		2,409,037.48	1,491,720.52

<b>净资产：</b>			
实收基金	6.4.7.10	1,023,741,185.97	767,367,365.46
未分配利润	6.4.7.12	97,839,442.99	13,470,005.56
净资产合计		1,121,580,628.96	780,837,371.02
负债和净资产总计		1,123,989,666.44	782,329,091.54

注：报告截止日 2024 年 06 月 30 日，基金份额总额 1,023,741,185.97 份，其中大成核心价值甄选混合 A 基金份额总额为 787,868,142.33 份，基金份额净值 1.1005 元。大成核心价值甄选混合 C 基金份额总额为 235,873,043.64 份，基金份额净值 1.0791 元。

## 6.2 利润表

会计主体：大成核心价值甄选混合型证券投资基金

本报告期：2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
<b>一、营业总收入</b>		75,801,425.70	93,206,857.85
1. 利息收入		527,791.18	302,602.42
其中：存款利息收入	6.4.7.13	527,791.18	302,602.42
债券利息收入		-	-
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	-
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		-528,418.84	39,057,584.56
其中：股票投资收益	6.4.7.14	-16,813,578.98	29,226,706.05
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.15	-	-
资产支持证券投资	6.4.7.16	-	-
贵金属投资收益	6.4.7.17	-	-
衍生工具收益	6.4.7.18	-	-
股利收益	6.4.7.19	16,285,160.14	9,830,878.51
其他投资收益		-	-
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.20	75,593,773.22	53,739,736.05
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-

5. 其他收入（损失以“-”号填列）	6. 4. 7. 21	208, 280. 14	106, 934. 82
<b>减：二、营业总支出</b>		7, 514, 184. 65	8, 110, 205. 62
1. 管理人报酬	6. 4. 10. 2. 1	5, 784, 672. 64	6, 635, 651. 65
其中：暂估管理人报酬		-	-
2. 托管费	6. 4. 10. 2. 2	964, 112. 01	1, 105, 942. 00
3. 销售服务费	6. 4. 10. 2. 3	650, 803. 97	259, 486. 65
4. 投资顾问费		-	-
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 信用减值损失	6. 4. 7. 22	-	-
7. 税金及附加		-	-
8. 其他费用	6. 4. 7. 23	114, 596. 03	109, 125. 32
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		68, 287, 241. 05	85, 096, 652. 23
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		68, 287, 241. 05	85, 096, 652. 23
<b>五、其他综合收益的税后净额</b>		-	-
<b>六、综合收益总额</b>		68, 287, 241. 05	85, 096, 652. 23

### 6.3 净资产变动表

会计主体：大成核心价值甄选混合型证券投资基金

本报告期：2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	767, 367, 365. 46	-	13, 470, 005. 56	780, 837, 371. 02
二、本期期初净资产	767, 367, 365. 46	-	13, 470, 005. 56	780, 837, 371. 02
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	256, 373, 820. 51	-	84, 369, 437. 43	340, 743, 257. 94
（一）、综合收益总额	-	-	68, 287, 241. 05	68, 287, 241. 05
（二）、本期基金份额交易产生的净资产变动数（净资产减少以“-”号填列）	256, 373, 820. 51	-	16, 082, 196. 38	272, 456, 016. 89



其中：1. 基金申购款	504,083,954.54	-	37,063,166.75	541,147,121.29
2. 基金赎回款	- 247,710,134.03	-	-20,980,970.37	-268,691,104.40
(三)、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动（净资产减少以“-”号填列）	-	-	-	-
四、本期期末净资产	1,023,741,185. 97	-	97,839,442.99	1,121,580,628.9 6
项目	上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	944,661,093.92	-	-16,523,685.62	928,137,408.30
二、本期期初净资产	944,661,093.92	-	-16,523,685.62	928,137,408.30
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	- 152,245,114.86	-	78,286,215.66	-73,958,899.20
(一)、综合收益总额	-	-	85,096,652.23	85,096,652.23
(二)、本期基金份额交易产生的净资产变动数（净资产减少以“-”号填列）	- 152,245,114.86	-	-6,810,436.57	-159,055,551.43
其中：1. 基金申购款	58,203,751.03	-	2,674,282.63	60,878,033.66
2. 基金赎回款	- 210,448,865.89	-	-9,484,719.20	-219,933,585.09
(三)、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动（净资产减少以“-”号填列）	-	-	-	-
四、本期期末净资产	792,415,979.06	-	61,762,530.04	854,178,509.10

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：

<u>谭晓冈</u>	<u>范瑛</u>	<u>梁靖</u>
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 基金基本情况

大成核心价值甄选混合型证券投资基金（以下简称“本基金”），系经中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）证监许可[2020]2710 号文《关于准予大成核心价值甄选混合型证券投资基金注册的批复》的注册，由大成基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《大成核心价值甄选混合型证券投资基金基金合同》作为发起人于 2021 年 2 月 26 日至 2021 年 3 月 11 日向社会公开募集，募集期结束经安永华明会计师事务所验证并出具安永华明（2021）验字第 60469430\_H05 号验资报告后，向中国证监会报送基金备案材料。基金合同于 2021 年 3 月 15 日正式生效。本基金为契约型开放式，存续期限不定。

本基金的基金管理人为大成基金管理有限公司，注册登记机构为大成基金管理有限公司，基金托管人为中国工商银行股份有限公司（简称“中国工商银行”）。

本基金的投资范围主要为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的股票（包括主板、中小板、创业板及其他中国证监会允许基金投资的股票）、存托凭证、内地与香港股票市场交易互联互通机制下允许投资的规定范围内的香港联合交易所上市的股票（简称“港股通标的股票”）、债券（包括国债、央行票据、金融债券、企业债券、公司债券、中期票据、短期融资券、超短期融资券、公开发行的次级债券、政府支持机构债、政府支持债券、地方政府债、可转换债券及其他中国证监会允许投资的债券）、资产支持证券、债券回购、同业存单、银行存款（包括协议存款、定期存款等）、货币市场工具、股指期货、国债期货，以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具，但须符合中国证监会的相关规定。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。

本基金的投资组合比例为：本基金投资于股票、存托凭证的比例为基金资产的 60%-95%（港股通标的股票投资比例不超过本基金股票资产的 50%）；本基金每个交易日日终在扣除股指期货合约和国债期货合约需缴纳的交易保证金后，应当保持不低于基金资产净值 5%的现金或到期日在一年以内的政府债券，其中，现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。如法律法规或监管机构变更投资品种的投资比例限制，基金管理人在履行适当程序后，可以调整上述投资品种的

投资比例。

本基金的业绩比较基准为：沪深 300 指数收益率×60%+恒生指数收益率×20%+中债综合全价指数收益率×20%。

本财务报表已于 2024 年 8 月 29 日经本基金的基金管理人批准报出。

#### 6.4.2 会计报表的编制基础

本财务报表系按照财政部颁布的《企业会计准则——基本准则》以及其后颁布及修订的具体会计准则、应用指南、解释以及《资产管理产品相关会计处理规定》和其他相关规定（统称“企业会计准则”）编制，同时，在信息披露和估值方面，也参考了中国证监会颁布的《中国证券监督管理委员会关于证券投资基金估值业务的指导意见》、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》、《证券投资基金信息披露内容与格式准则》第 3 号《半年度报告的内容与格式》、《证券投资基金信息披露编报规则》第 3 号《会计报表附注的编制及披露》、《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号〈年度报告和中期报告〉》以及中国证监会和中国证券投资基金业协会颁布的其他相关规定。

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

#### 6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金于 2024 年 06 月 30 日的财务状况以及自 2024 年 01 月 01 日起至 2024 年 06 月 30 日止期间的经营成果和净资产变动情况等有关信息。

#### 6.4.4 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。

#### 6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

##### 6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期未发生会计政策变更。

##### 6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

##### 6.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

#### 6.4.6 税项

##### (1) 印花税

证券（股票）交易印花税税率为 1%，由出让方缴纳。自 2023 年 8 月 28 日起，证券交易印花税实施减半征收。

## （2）增值税及附加

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]46 号文《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》的规定，金融机构开展的质押式买入返售金融商品业务及持有政策性金融债券取得的利息收入属于金融同业往来利息收入；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]70 号文《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》的规定，金融机构开展的买断式买入返售金融商品业务、同业存款、同业存单以及持有金融债券取得的利息收入属于金融同业往来利息收入；

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，本基金运营过程中发生的增值税应税行为，以本基金的基金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，证券投资基金的基金管理人运营证券投资基金过程中发生的增值税应税行为，暂适用简易计税方法，按照 3%的征收率缴纳增值税。对证券投资基金在 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，已纳税额从证券投资基金的基金管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。增值税应税行为的销售额根据财政部、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》的规定确定。

增值税附加税包括城市维护建设税、教育费附加和地方教育费附加，以实际缴纳的增值税税额为计税依据，分别按 7%、3%和 2%的比例缴纳城市维护建设税、教育费附加和地方教育费附加。

## （3）企业所得税

根据财政部、国家税务总局财税[2004]78 号文《关于证券投资基金税收政策的通知》的规定，自 2004 年 1 月 1 日起，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、债券的差价收入，继续免征企业所得税。

根据财政部、国家税务总局财税[2005]103 号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》的规定，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。

根据财政部、国家税务总局财税[2008]1 号文《关于企业所得税若干优惠政策的通知》的规定，对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。

#### (4) 个人所得税

根据财政部、国家税务总局财税[2005]103 号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》的规定，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。

根据财政部、国家税务总局财税[2008]132 号文《财政部、国家税务总局关于储蓄存款利息所得有关个人所得税政策的通知》的规定，自 2008 年 10 月 9 日起，对储蓄存款利息所得暂免征收个人所得税。

根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2012]85 号文《关于实施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 2013 年 1 月 1 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，暂减按 50% 计入应纳税所得额；持股期限超过 1 年的，暂减按 25% 计入应纳税所得额。上述所得统一适用 20% 的税率计征个人所得税。

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。

#### (5) 境外投资

本基金运作过程中涉及的境外投资的税项问题，根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2014]81 号文《关于沪港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》、财税[2016]127 号文《关于深港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》及其他境内外相关税务法规的规定和实务操作执行。

### 6.4.7 重要财务报表项目的说明

#### 6.4.7.1 货币资金

单位：人民币元

项目	本期末 2024 年 6 月 30 日
活期存款	428,184,392.48
等于：本金	428,142,606.35
加：应计利息	41,786.13

减：坏账准备	-
定期存款	-
等于：本金	-
加：应计利息	-
减：坏账准备	-
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	-
等于：本金	-
加：应计利息	-
减：坏账准备	-
合计	428,184,392.48

#### 6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2024 年 6 月 30 日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	658,437,046.88	-	694,809,708.81	36,372,661.93
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	658,437,046.88	-	694,809,708.81	36,372,661.93

#### 6.4.7.3 衍生金融资产/负债

##### 6.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

无。

##### 6.4.7.3.2 期末基金持有的期货合约情况

无。

##### 6.4.7.3.3 期末基金持有的黄金衍生品情况

无。

## 6.4.7.4 买入返售金融资产

## 6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

无。

## 6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

无。

## 6.4.7.4.3 按预期信用损失一般模型计提减值准备的说明

无。

## 6.4.7.5 债权投资

## 6.4.7.5.1 债权投资情况

无。

## 6.4.7.5.2 债权投资减值准备计提情况

无。

## 6.4.7.6 其他债权投资

## 6.4.7.6.1 其他债权投资情况

无。

## 6.4.7.6.2 其他债权投资减值准备计提情况

无。

## 6.4.7.7 其他权益工具投资

## 6.4.7.7.1 其他权益工具投资情况

无。

## 6.4.7.7.2 报告期末其他权益工具投资情况

无。

## 6.4.7.8 其他资产

无。

## 6.4.7.9 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2024年6月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	3.71
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	12,124.96

其中：交易所市场	12,124.96
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用	106,440.02
合计	118,568.69

#### 6.4.7.10 实收基金

金额单位：人民币元

##### 大成核心价值甄选混合 A

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	700,943,343.38	700,943,343.38
本期申购	239,051,328.42	239,051,328.42
本期赎回（以“-”号填列）	-152,126,529.47	-152,126,529.47
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	787,868,142.33	787,868,142.33

##### 大成核心价值甄选混合 C

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	66,424,022.08	66,424,022.08
本期申购	265,032,626.12	265,032,626.12
本期赎回（以“-”号填列）	-95,583,604.56	-95,583,604.56
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	235,873,043.64	235,873,043.64

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）。

#### 6.4.7.11 其他综合收益

无。

#### 6.4.7.12 未分配利润

单位：人民币元

##### 大成核心价值甄选混合 A

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	69,548,263.74	-56,212,764.20	13,335,499.54
本期期初	69,548,263.74	-56,212,764.20	13,335,499.54
本期利润	-7,619,144.96	58,262,750.62	50,643,605.66



本期基金份额交易产生的变动数	7,188,396.61	8,011,848.80	15,200,245.41
其中：基金申购款	19,338,835.79	8,604,338.38	27,943,174.17
基金赎回款	-12,150,439.18	-592,489.58	-12,742,928.76
本期已分配利润	-	-	-
本期末	69,117,515.39	10,061,835.22	79,179,350.61

## 大成核心价值甄选混合 C

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	5,427,179.01	-5,292,672.99	134,506.02
本期期初	5,427,179.01	-5,292,672.99	134,506.02
本期利润	312,612.79	17,331,022.60	17,643,635.39
本期基金份额交易产生的变动数	10,163,815.50	-9,281,864.53	881,950.97
其中：基金申购款	16,049,469.25	-6,929,476.67	9,119,992.58
基金赎回款	-5,885,653.75	-2,352,387.86	-8,238,041.61
本期已分配利润	-	-	-
本期末	15,903,607.30	2,756,485.08	18,660,092.38

## 6.4.7.13 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年6月30日
活期存款利息收入	525,882.52
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	1,671.15
其他	237.51
合计	527,791.18

## 6.4.7.14 股票投资收益

## 6.4.7.14.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年6月30日
股票投资收益——买卖股票差价收入	-16,813,578.98
股票投资收益——赎回差价收入	-
股票投资收益——申购差价收入	-
股票投资收益——证券出借差价收入	-
合计	-16,813,578.98

## 6.4.7.14.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期
	2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日
卖出股票成交总额	59,830,861.52
减：卖出股票成本总额	76,465,455.95
减：交易费用	178,984.55
买卖股票差价收入	-16,813,578.98

## 6.4.7.14.3 股票投资收益——证券出借差价收入

无。

## 6.4.7.15 债券投资收益

## 6.4.7.15.1 债券投资收益项目构成

无。

## 6.4.7.15.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

无。

## 6.4.7.15.3 债券投资收益——赎回差价收入

无。

## 6.4.7.15.4 债券投资收益——申购差价收入

无。

## 6.4.7.16 资产支持证券投资收益

## 6.4.7.16.1 资产支持证券投资收益项目构成

无。

## 6.4.7.16.2 资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入

无。

## 6.4.7.16.3 资产支持证券投资收益——赎回差价收入

无。

## 6.4.7.16.4 资产支持证券投资收益——申购差价收入

无。

## 6.4.7.17 贵金属投资收益

## 6.4.7.17.1 贵金属投资收益项目构成

无。

## 6.4.7.17.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

无。

## 6.4.7.17.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

无。

## 6.4.7.17.4 贵金属投资收益——申购差价收入

无。

## 6.4.7.18 衍生工具收益

## 6.4.7.18.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

无。

## 6.4.7.18.2 衍生工具收益——其他投资收益

无。

## 6.4.7.19 股利收益

单位：人民币元

项目	本期
	2024年1月1日至2024年6月30日
股票投资产生的股利收益	16,285,160.14
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	16,285,160.14

## 6.4.7.20 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期
	2024年1月1日至2024年6月30日
1. 交易性金融资产	75,593,773.22
股票投资	75,593,773.22
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	75,593,773.22

## 6.4.7.21 其他收入

单位：人民币元

项目	本期
	2024年1月1日至2024年6月30日

基金赎回费收入	200,120.16
基金转换费收入	8,159.98
合计	208,280.14

#### 6.4.7.22 信用减值损失

无。

#### 6.4.7.23 其他费用

单位：人民币元

项目	本期
	2024年1月1日至2024年6月30日
审计费用	42,267.68
信息披露费	59,672.34
证券出借违约金	-
深港通证券组合费	130.39
银行划款手续费	3,525.62
账户维护费	9,000.00
合计	114,596.03

#### 6.4.7.24 分部报告

无。

#### 6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

##### 6.4.8.1 或有事项

无。

##### 6.4.8.2 资产负债表日后事项

无。

#### 6.4.9 关联方关系

##### 6.4.9.1 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。

##### 6.4.9.2 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
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：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

## 6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

## 6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

## 6.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2024年1月1日至2024年6月 30日		上年度可比期间 2023年1月1日至2023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	8,847,642.73	6.01	225,675,871.80	50.71

## 6.4.10.1.2 债券交易

无。

## 6.4.10.1.3 债券回购交易

无。

## 6.4.10.1.4 权证交易

无。

## 6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2024年1月1日至2024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	7,078.11	5.27	-	-
关联方名称	上年度可比期间 2023年1月1日至2023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	207,915.63	50.71	77,379.44	49.86

注：1. 上述佣金参考市场价格经本基金的基金管理人与对方协商确定。

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。

## 6.4.10.2 关联方报酬

## 6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日	2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	5,784,672.64	6,635,651.65
其中：应支付销售机构的客户维护费	1,863,690.08	2,744,865.23
应支付基金管理人的净管理费	3,920,982.56	3,890,786.42

注：（1）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 1.20% 年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 1.20\% / \text{当年天数}$$

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

（2）本基金自 2023 年 7 月 10 日起，基金管理费的年费率由 1.50% 调整为 1.20%。

#### 6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日	2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	964,112.01	1,105,942.00

注：（1）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 0.20% 年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 0.20\% / \text{当年天数}$$

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

（2）本基金自 2023 年 7 月 10 日起，基金托管费的年费率由 0.25% 调整为 0.20%。

#### 6.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期		
	2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	大成核心价值甄选混合 A	大成核心价值甄选混合 C	合计
大成基金	-	339,406.71	339,406.71
光大证券	-	2,651.54	2,651.54

中国工商银行	-	54,034.86	54,034.86
合计	-	396,093.11	396,093.11
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间		
	2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	大成核心价值甄选混合 A	大成核心价值甄选混合 C	合计
大成基金	-	8,103.40	8,103.40
光大证券	-	3,408.77	3,408.77
中国工商银行	-	26,964.32	26,964.32
合计	-	38,476.49	38,476.49

注：本基金 A 类基金份额不收取销售服务费，C 类基金份额的销售服务付费将专门用于本基金 C 类基金份额的销售与基金份额持有人服务。C 类基金份额的销售服务费按前一日 C 类基金份额基金资产净值的 0.60% 的年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 0.60\% / \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的销售服务费

E 为前一日的基金资产净值

#### 6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

无。

#### 6.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

##### 6.4.10.4.1 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。

##### 6.4.10.4.2 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。

#### 6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

##### 6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

无。

##### 6.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

无。

#### 6.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2024年1月1日至2024年6月 30日		上年度可比期间 2023年1月1日至2023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	428,184,392.48	525,882.52	183,285,863.27	300,756.25

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。

#### 6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

无。

#### 6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

无。

#### 6.4.11 利润分配情况

无。

#### 6.4.12 期末（2024年6月30日）本基金持有的流通受限证券

##### 6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

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	受限期	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
001359	平安电工	2024年3月19日	6个月	新股锁定	17.39	20.60	184	3,199.76	3,790.40	-
001379	腾达科技	2024年1月11日	6个月	新股锁定	16.98	13.48	213	3,616.74	2,871.24	-
301392	汇成真空	2024年5月28日	6个月	新股锁定	12.20	41.66	219	2,671.80	9,123.54	-
301502	华阳智能	2024年1月26日	6个月	新股锁定	28.01	37.83	138	3,865.38	5,220.54	-
301536	星辰科	2024年3月20日	6个月	新股锁定	16.16	32.27	481	7,772.96	15,521.87	-



	技	日									
301538	骏鼎达	2024年3月13日	6个月	新股锁定	-	91.24	43	-	3,923.32	转增股	
301538	骏鼎达	2024年3月13日	6个月	新股锁定	55.82	91.24	107	5,972.74	9,762.68	-	
301539	宏鑫科技	2024年4月3日	6个月	新股锁定	10.64	19.82	361	3,841.04	7,155.02	-	
301565	中仑新材	2024年6月13日	6个月	新股锁定	11.88	18.98	711	8,446.68	13,494.78	-	
301566	达利凯普	2023年12月22日	6个月	新股锁定	8.90	16.97	576	5,126.40	9,774.72	-	
301587	中瑞股份	2024年3月27日	6个月	新股锁定	21.73	25.26	306	6,649.38	7,729.56	-	
301588	美新科技	2024年3月6日	6个月	新股锁定	14.50	21.25	257	3,726.50	5,461.25	-	
301589	诺瓦星云	2024年2月1日	6个月	新股锁定	-	188.01	553	-	103,969.53	转增股	
301589	诺瓦星云	2024年2月1日	6个月	新股锁定	126.89	188.01	691	87,680.99	129,914.91	-	
301591	肯特股份	2024年2月20日	6个月	新股锁定	19.43	36.98	219	4,255.17	8,098.62	-	
601033	永兴股	2024年1月11日	6个月	新股锁定	16.20	15.96	963	15,600.60	15,369.48	-	

	份	日								
603082	北自科技	2024年1月23日	6个月	新股锁定	21.28	29.49	107	2,276.96	3,155.43	-
603285	键邦股份	2024年6月28日	6个月	新股未上市	18.65	18.65	129	2,405.85	2,405.85	-
603285	键邦股份	2024年6月28日	1个月内(含)	新股未上市	18.65	18.65	1,158	21,596.70	21,596.70	-
603312	西典新能	2024年1月4日	6个月	新股锁定	29.02	25.36	130	3,772.60	3,296.80	-
603325	博隆技术	2024年1月3日	6个月	新股锁定	72.46	68.06	66	4,782.36	4,491.96	-
603341	龙旗科技	2024年2月23日	6个月	新股锁定	26.00	37.49	298	7,748.00	11,172.02	-
603344	星德胜	2024年3月13日	6个月	新股锁定	19.18	22.66	182	3,490.76	4,124.12	-
603350	安乃达	2024年6月26日	6个月	新股未上市	20.56	20.56	106	2,179.36	2,179.36	-
603350	安乃达	2024年6月26日	1个月内(含)	新股未上市	20.56	20.56	945	19,429.20	19,429.20	-
603381	永臻股份	2024年6月19日	6个月	新股锁定	23.35	25.13	178	4,156.30	4,473.14	-
688530	欧莱新	2024年4月29日	6个月	新股锁定	9.60	16.10	344	3,302.40	5,538.40	-

	材	日								
688692	达 梦 数 据	2024 年 6 月 4 日	6 个月	新 股 锁 定	86.96	174.93	175	15,218.00	30,612.75	-
688695	中 创 股 份	2024 年 3 月 6 日	6 个月	新 股 锁 定	22.43	31.55	186	4,171.98	5,868.30	-
688709	成 都 华 微	2024 年 1 月 31 日	6 个月	新 股 锁 定	15.69	18.79	1,045	16,396.05	19,635.55	-

注：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中需要限售的部分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。

#### 6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

无。

#### 6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

##### 6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

无。

##### 6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

无。

#### 6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

无。

#### 6.4.13 金融工具风险及管理

##### 6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金在日常经营活动中由金融工具产生的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金管理人制定了政策和程序来识别及分析这些风险，并设定适当的风险限额及内部控制流程，通过可靠的管理及信息系统持续监控上述各类风险。本基金的基金管理人奉行全面风险管理体系的建设，建立了以由高层监控（合规与风险管理委员会、公司投资风险控制委员会）、专业监控（监察稽核部、风险管理部）、部门互控、岗位自控构成的风险管理架构体系。本基金的基金管理人在董事会下设立合规与风险管理委员会，对公司整体运营风险进行监督，监督风险控制措施的执行。

在管理层层面设立投资风险控制委员会，通过定期会议讨论涉及投资风险的重大议题，形成正式决议提交投委会。在业务操作层面，监察稽核部履行合规控制职责，通过定期、不定期检查内控制度的执行情况、对重大风险点以专项稽核的方式确保公司内控制度、流程得到贯彻执行。风险管理部履行风险量化评估分析职责。本基金的基金管理人对于金融工具的风险管理方法主要是通过定性分析和定量分析的方法去估测各种风险产生的可能损失。从定性分析的角度出发，判断风险损失的严重程度和出现同类风险损失的频度。而从定量分析的角度出发，根据本基金的投资目标，结合基金资产所运用金融工具特征通过特定的风险量化指标、模型，日常的量化报告，确定风险损失的限度和相应置信程度，及时可靠地对各种风险进行监督、检查和评估，并通过相应决策，将风险控制在可承受的范围内。

#### 6.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息等情况，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。本基金的银行存款存放在本基金的托管人中国工商银行股份有限公司，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。信用等级评估以内部信用评级为主，外部信用评级为辅。内部债券信用评级主要考察发行人的经营风险、财务风险和流动性风险，以及信用产品的条款和担保人的情况等。此外，本基金的基金管理人根据信用产品的内部评级，通过单只信用产品投资占基金资产净值的比例及占发行量的比例进行控制，通过分散化投资以分散信用风险。

本期末，本基金无债券投资(上年度末：同)。

#### 6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金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。

##### 6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》及《公开募集开放式

《证券投资基金流动性风险管理规定》等有关法规的要求建立健全开放式基金流动性风险管理的内部控制体系，审慎评估各类资产的流动性，针对性制定流动性风险管理措施，对本基金组合资产的流动性风险进行管理。本基金的基金管理人采用监控基金组合资产持仓集中度指标、逆回购交易的到期日与交易对手的集中度、流动性受限资产比例、基金组合资产中 7 个工作日可变现资产的可变现价值以及压力测试等方式防范流动性风险。并于开放日对本基金的申购赎回情况进行监控，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配，确保本基金资产的变现能力与投资者赎回需求的匹配与平衡。本基金的基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款，约定在非正常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。于本期末，本基金持有的流动性受限资产的估值占基金资产净值的比例未超过 15%。

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。

#### 6.4.13.4 市场风险

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

##### 6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指金融工具的公允价值或现金流量因市场利率变动而发生波动的风险。利率敏感性金融工具均面临由于市场利率上升而导致公允价值下降的风险，其中浮动利率类金融工具还面临每个付息期间结束根据市场利率重新定价时对于未来现金流影响的风险。本基金的基金管理人定期对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控，并通过调整投资组合的久期等方法对上述利率风险进行管理。本基金持有的大部分金融资产和金融负债不计息，因此本基金的收入及经营活动的现金流量在很大程度上独立于市场利率变化。本基金持有的利率敏感性资产主要为银行存款、存出保证金等。

##### 6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2024 年 6 月 30 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计

资产					
货币资金	428,184,392.48	-	-	-	428,184,392.48
存出保证金	16,308.41	-	-	-	16,308.41
交易性金融资产	-	-	-	-694,809,708.81	694,809,708.81
应收申购款	-	-	-	979,256.74	979,256.74
资产总计	428,200,700.89	-	-	-695,788,965.55	1,123,989,666.44
负债					
应付赎回款	-	-	-	859,066.94	859,066.94
应付管理人报酬	-	-	-	1,119,294.63	1,119,294.63
应付托管费	-	-	-	186,549.12	186,549.12
应付清算款	-	-	-	0.48	0.48
应付销售服务费	-	-	-	125,557.62	125,557.62
其他负债	-	-	-	118,568.69	118,568.69
负债总计	-	-	-	2,409,037.48	2,409,037.48
利率敏感度缺口	428,200,700.89	-	-	-693,379,928.07	1,121,580,628.96
上年度末 2023 年 12 月 31 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
货币资金	175,455,478.87	-	-	-	175,455,478.87
存出保证金	47,199.73	-	-	-	47,199.73
交易性金融资产	-	-	-	-606,789,377.24	606,789,377.24
应收申购款	-	-	-	37,035.70	37,035.70
资产总计	175,502,678.60	-	-	-606,826,412.94	782,329,091.54
负债					
应付赎回款	-	-	-	268,755.15	268,755.15
应付管理人报酬	-	-	-	783,850.34	783,850.34
应付托管费	-	-	-	130,641.74	130,641.74
应付清算款	-	-	-	2.41	2.41
应付销售服务费	-	-	-	33,276.05	33,276.05
其他负债	-	-	-	275,194.83	275,194.83
负债总计	-	-	-	1,491,720.52	1,491,720.52
利率敏感度缺口	175,502,678.60	-	-	-605,334,692.42	780,837,371.02

注：表中所示为本基金资产及负债的账面价值，并按照合同约定的利率重新定价日或到期日孰早者予以分类。

#### 6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

于本期末，本基金未持有交易性债券投资和交易性资产支持证券投资（上年度末：同），因此市场利率的变动对于本基金净资产无重大影响（上年度末：同）。

#### 6.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基金持有以非记账本位币人民币计价的资产和负债，因此存在相应的外汇风险。本基金管理人每日

对本基金的外汇头寸进行监控。

#### 6.4.13.4.2.1 外汇风险敞口

单位：人民币元

项目	本期末 2024年6月30日			
	美元 折合人民币元	港币 折合人民币元	其他币种 折合人民币元	合计
以外币计价的资产				
交易性金融资产	-	2,144,834.51	-	2,144,834.51
资产合计	-	2,144,834.51	-	2,144,834.51
以外币计价的负债				
负债合计	-	-	-	-
资产负债表外汇风险敞口净额	-	2,144,834.51	-	2,144,834.51
项目	上年度末 2023年12月31日			
	美元 折合人民币元	港币 折合人民币元	其他币种 折合人民币元	合计
以外币计价的资产				
交易性金融资产	-	10,974,881.53	-	10,974,881.53
资产合计	-	10,974,881.53	-	10,974,881.53
以外币计价的负债				
负债合计	-	-	-	-
资产负债表外汇风险敞口净额	-	10,974,881.53	-	10,974,881.53

#### 6.4.13.4.2.2 外汇风险的敏感性分析

假设	除汇率以外的其他市场变量保持不变		
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（2024年6月30日）	上年度末（2023年12月）

			31 日 )
	所有外币相对人民币升值 5%	107,241.72	548,744.08
	所有外币相对人民币贬值 5%	-107,241.72	-548,744.08

#### 6.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市的股票，所面临的最大市场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市场价格风险，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。本基金的基金管理人在构建和管理投资组合的过程中，采用“自上而下”的策略，通过对宏观经济情况及政策的分析，结合证券市场运行情况，做出资产配置及组合构建的决定；通过对单个证券的定性分析及定量分析，选择符合基金合同约定范围的投资品种进行投资。本基金的基金管理人定期结合宏观及微观环境的变化，对投资策略、资产配置、投资组合进行修正，来主动应对可能发生的市场价格风险。本基金的投资组合比例为：本基金投资于股票、存托凭证的比例为基金资产的 60%-95%（港股通标的股票投资比例不超过本基金股票资产的 50%）；本基金每个交易日日终在扣除股指期货合约和国债期货合约需缴纳的交易保证金后，应当保持不低于基金资产净值 5% 的现金或到期日在一年以内的政府债券，其中，现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。

#### 6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2024 年 6 月 30 日		上年度末 2023 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	694,809,708.81	61.95	606,789,377.24	77.71
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	694,809,708.81	61.95	606,789,377.24	77.71



## 6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除业绩比较基准以外的其他市场变量保持不变		
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（2024年6月30日）	上年度末（2023年12月31日）
	业绩比较基准上升5%	37,036,837.74	26,659,172.17
业绩比较基准下降5%	-37,036,837.74	-26,659,172.17	

## 6.4.14 公允价值

## 6.4.14.1 金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属的层次，由对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次决定：

第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

## 6.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

## 6.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2024年6月30日	上年度末 2023年12月31日
第一层次	694,320,547.77	606,081,750.89
第二层次	45,611.11	-
第三层次	443,549.93	707,626.35
合计	694,809,708.81	606,789,377.24

## 6.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

本基金调整公允价值计量层次转换时点的相关会计政策在前后各会计期间保持一致。

对于公开市场交易的证券等投资，若出现交易不活跃、非公开发行等情况，本基金不会于交易不活跃期间及限售期间将相关投资的公允价值列入第一层次，并根据估值调整中采用

的对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次，确定相关投资的公允价值应属第二层次或第三层次。

#### 6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

于本期末，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产(上年度末：同)。

#### 6.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

本基金持有的不以公允价值计量的金融工具为以摊余成本计量的金融资产和金融负债，这些金融工具因其剩余期限较短，所以其账面价值与公允价值相若。

#### 6.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

## § 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	694,809,708.81	61.82
	其中：股票	694,809,708.81	61.82
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	428,184,392.48	38.10
8	其他各项资产	995,565.15	0.09
9	合计	1,123,989,666.44	100.00

注：本基金通过深港通交易机制投资的港股公允价值为 2,144,834.51 元，占期末基金资产净值的比例为 0.19%。

### 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	-	-
B	采矿业	72,486,919.00	6.46
C	制造业	568,870,482.07	50.72
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	2,211.15	0.00
E	建筑业	1,770.30	0.00
F	批发和零售业	123,552.48	0.01
G	交通运输、仓储和邮政业	10,443,432.98	0.93
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	40,458,995.93	3.61
J	金融业	10,744.83	0.00
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	4,168.76	0.00
M	科学研究和技术服务业	2,091.73	0.00
N	水利、环境和公共设施管理业	20,617.99	0.00
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	220,605.84	0.02
R	文化、体育和娱乐业	19,281.24	0.00
S	综合	-	-
	合计	692,664,874.30	61.76

### 7.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

行业类别	公允价值（人民币）	占基金资产净值比例（%）
通讯	-	-
非必需消费品	-	-
必需消费品	-	-
能源	-	-
金融	-	-
房地产	-	-
医疗保健	-	-
工业	2,144,834.51	0.19
材料	-	-
科技	-	-
公用事业	-	-
政府	-	-
合计	2,144,834.51	0.19

注：以上分类采用彭博行业分类标准。

### 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	公允价值（元）	占基金资产净值比例
----	------	------	----	---------	-----------

	码		(股)		(%)
1	000651	格力电器	2,073,900	81,338,358.00	7.25
2	601225	陕西煤业	2,812,800	72,485,856.00	6.46
3	000333	美的集团	1,087,012	70,112,274.00	6.25
4	002884	凌霄泵业	3,628,827	69,673,478.40	6.21
5	002595	豪迈科技	1,822,076	69,548,640.92	6.20
6	600519	贵州茅台	36,800	53,999,952.00	4.81
7	000063	中兴通讯	1,702,057	47,606,534.29	4.24
8	603337	杰克股份	1,750,950	46,085,004.00	4.11
9	600941	中国移动	353,803	38,033,822.50	3.39
10	600031	三一重工	1,946,274	32,113,521.00	2.86
11	600352	浙江龙盛	3,416,700	29,349,453.00	2.62
12	603279	景津装备	906,380	19,659,382.20	1.75
13	002484	江海股份	983,100	13,026,075.00	1.16
14	603187	海容冷链	1,027,662	11,982,538.92	1.07
15	600233	圆通速递	666,400	10,429,160.00	0.93
16	002223	鱼跃医疗	230,400	8,663,040.00	0.77
17	600660	福耀玻璃	136,100	6,519,190.00	0.58
18	01199	中远海运港口	436,000	2,144,834.51	0.19
19	688249	晶合集成	48,373	709,631.91	0.06
20	688213	思特威	14,046	681,231.00	0.06
21	688271	联影医疗	5,524	605,982.80	0.05
22	688428	诺诚健华	70,700	573,377.00	0.05
23	688172	燕东微	30,053	486,257.54	0.04
24	301589	诺瓦星云	2,486	475,453.44	0.04
25	688031	星环科技	11,693	429,250.03	0.04
26	688692	达梦数据	1,745	382,889.35	0.03
27	301153	中科江南	12,872	363,762.72	0.03
28	688472	阿特斯	33,596	342,007.28	0.03
29	688326	经纬恒润	5,390	309,008.70	0.03
30	301165	锐捷网络	10,209	304,636.56	0.03
31	301498	乖宝宠物	5,531	297,567.80	0.03
32	688549	中巨芯	42,933	289,797.75	0.03
33	603296	华勤技术	5,142	283,992.66	0.03
34	688382	益方生物	36,208	261,783.84	0.02
35	688515	裕太微	4,183	242,614.00	0.02
36	688702	盛科通信	5,488	222,264.00	0.02
37	301267	华夏眼科	10,647	220,605.84	0.02
38	301200	大族数控	6,567	207,254.52	0.02
39	301511	德福科技	13,738	202,772.88	0.02
40	688709	成都华微	10,448	201,301.51	0.02
41	301565	中仑新材	7,103	174,381.42	0.02
42	301536	星辰科技	4,809	167,218.27	0.01

43	688652	京仪装备	4,157	162,497.13	0.01
44	601096	宏盛华源	39,171	160,209.39	0.01
45	301559	中集环科	10,816	157,589.12	0.01
46	688410	山外山	7,231	154,020.30	0.01
47	301538	骏鼎达	1,492	150,945.76	0.01
48	301371	敷尔佳	4,735	147,069.10	0.01
49	301421	波长光电	3,315	143,307.45	0.01
50	301525	儒竞科技	2,422	136,310.16	0.01
51	301509	金凯生科	3,720	135,333.60	0.01
52	301392	汇成真空	2,189	128,899.54	0.01
53	301558	三态股份	14,578	122,309.42	0.01
54	603341	龙旗科技	2,978	115,638.42	0.01
55	301516	中远通	6,033	112,394.79	0.01
56	301507	民生健康	8,509	107,383.58	0.01
57	301517	陕西华达	1,841	99,414.00	0.01
58	301566	达利凯普	5,755	97,662.35	0.01
59	301539	宏鑫科技	3,607	92,654.66	0.01
60	301587	中瑞股份	3,056	89,267.06	0.01
61	301591	肯特股份	2,184	88,113.42	0.01
62	301413	安培龙	2,123	87,786.05	0.01
63	301459	丰茂股份	2,077	82,477.67	0.01
64	301418	协昌科技	1,886	75,440.00	0.01
65	688530	欧莱新材	3,437	69,099.55	0.01
66	688267	中触媒	3,390	67,325.40	0.01
67	688648	中邮科技	3,025	66,066.00	0.01
68	688695	中创股份	1,856	63,082.50	0.01
69	301309	万得凯	2,271	58,046.76	0.01
70	603381	永臻股份	1,778	49,273.14	0.00
71	301358	湖南裕能	1,380	43,414.80	0.00
72	603285	键邦股份	1,287	24,002.55	0.00
73	001360	南矿集团	1,762	21,654.98	0.00
74	603350	安乃达	1,051	21,608.56	0.00
75	835179	凯德石英	1,300	21,320.00	0.00
76	301389	隆扬电子	1,290	20,382.00	0.00
77	001308	康冠科技	867	19,507.50	0.00
78	001330	博纳影业	3,564	19,281.24	0.00
79	301391	卡莱特	378	16,548.84	0.00
80	601033	永兴股份	1,026	16,389.45	0.00
81	301251	威尔高	407	14,013.01	0.00
82	688591	泰凌微	681	13,313.55	0.00
83	601083	锦江航运	1,320	12,619.20	0.00
84	301489	思泉新材	178	12,563.24	0.00
85	301548	崇德科技	219	11,624.52	0.00

86	301335	天元宠物	689	10,948.21	0.00
87	301396	宏景科技	552	10,769.52	0.00
88	001236	弘业期货	1,399	9,946.89	0.00
89	301578	辰奕智能	227	8,982.39	0.00
90	688653	康希通信	648	8,346.24	0.00
91	301568	思泰克	256	8,145.92	0.00
92	301308	江波龙	81	7,673.94	0.00
93	301528	多浦乐	178	7,625.52	0.00
94	301117	佳缘科技	262	6,759.60	0.00
95	688720	艾森股份	165	6,689.10	0.00
96	688573	信宇人	285	6,093.30	0.00
97	001336	楚环科技	274	5,986.90	0.00
98	603051	鹿山新材	272	5,937.76	0.00
99	301316	慧博云通	384	5,637.12	0.00
100	301269	华大九天	71	5,470.55	0.00
101	301588	美新科技	257	5,461.25	0.00
102	301502	华阳智能	138	5,220.54	0.00
103	301327	华宝新能	91	5,214.30	0.00
104	001270	铖昌科技	124	4,553.28	0.00
105	832419	路斯股份	600	4,500.00	0.00
106	603325	博隆技术	66	4,491.96	0.00
107	603344	星德胜	182	4,124.12	0.00
108	001359	平安电工	184	3,790.40	0.00
109	603004	鼎龙科技	195	3,305.25	0.00
110	603312	西典新能	130	3,296.80	0.00
111	603082	北自科技	107	3,155.43	0.00
112	001379	腾达科技	213	2,871.24	0.00
113	301221	光庭信息	80	2,854.40	0.00
114	001301	尚太科技	64	2,766.08	0.00
115	603231	索宝蛋白	161	2,743.44	0.00
116	301261	恒工精密	73	2,706.11	0.00
117	001239	永达股份	189	2,623.32	0.00
118	301367	怡和嘉业	41	2,550.20	0.00
119	001358	兴欣新材	122	2,503.44	0.00
120	603373	安邦护卫	88	2,419.12	0.00
121	301270	汉仪股份	95	2,292.35	0.00
122	301319	唯特偶	71	2,132.13	0.00
123	001323	慕思股份	73	2,100.21	0.00
124	301196	唯科科技	71	2,096.63	0.00
125	301182	凯旺科技	94	2,084.92	0.00
126	603255	鼎际得	89	2,073.70	0.00
127	603097	江苏华辰	77	2,042.04	0.00
128	301138	华研精机	85	2,030.65	0.00

129	301398	星源卓镁	49	1,986.95	0.00
130	603281	江瀚新材	88	1,975.60	0.00
131	603173	福斯达	88	1,910.48	0.00
132	301162	国能日新	43	1,873.08	0.00
133	301468	博盈特焊	79	1,827.27	0.00
134	001269	欧晶科技	64	1,779.20	0.00
135	301046	能辉科技	90	1,770.30	0.00
136	001228	永泰运	83	1,749.64	0.00
137	603235	天新药业	72	1,730.16	0.00
138	301049	超越科技	96	1,723.20	0.00
139	001367	海森药业	73	1,703.82	0.00
140	301377	鼎泰高科	95	1,667.25	0.00
141	301072	中捷精工	81	1,610.28	0.00
142	603190	亚通精工	70	1,607.20	0.00
143	001238	浙江正特	74	1,466.68	0.00
144	603130	云中马	80	1,411.20	0.00
145	001229	魅视科技	47	1,370.99	0.00
146	301279	金道科技	56	1,365.28	0.00
147	301313	凡拓数创	64	1,302.40	0.00
148	301163	宏德股份	64	1,300.48	0.00
149	001230	劲旅环境	90	1,250.10	0.00
150	603280	南方路机	63	1,249.92	0.00
151	603211	晋拓股份	87	1,192.77	0.00
152	301068	大地海洋	57	1,182.18	0.00
153	001260	坤泰股份	84	1,170.12	0.00
154	001278	一彬科技	73	1,154.13	0.00
155	001328	登康口腔	45	1,138.50	0.00
156	301111	粤万年青	79	1,102.05	0.00
157	301053	远信工业	55	1,097.80	0.00
158	301139	元道通信	51	1,097.01	0.00
159	301330	熵基科技	48	1,079.04	0.00
160	301190	善水科技	75	1,052.25	0.00
161	301258	富士莱	42	1,044.12	0.00
162	001368	通达创智	51	997.05	0.00
163	001266	宏英智能	45	977.40	0.00
164	603282	亚光股份	57	961.02	0.00
165	603215	比依股份	75	959.25	0.00
166	301273	瑞晨环保	61	949.77	0.00
167	301148	嘉戎技术	53	938.10	0.00
168	001311	多利科技	38	918.84	0.00
169	301050	雷电微力	19	915.04	0.00
170	001299	美能能源	76	896.80	0.00
171	603237	五芳斋	35	863.10	0.00

172	301180	万祥科技	54	844.56	0.00
173	603070	万控智造	75	839.25	0.00
174	301179	泽宇智能	43	836.78	0.00
175	301059	金三江	92	819.72	0.00
176	301150	中一科技	45	808.65	0.00
177	601136	首创证券	39	797.94	0.00
178	301282	金禄电子	33	784.74	0.00
179	001231	农心科技	55	773.85	0.00
180	301063	海锅股份	53	760.02	0.00
181	603057	紫燕食品	49	750.68	0.00
182	301091	深城交	27	732.78	0.00
183	601022	宁波远洋	83	732.06	0.00
184	603191	望变电气	49	725.20	0.00
185	001300	三柏硕	63	716.31	0.00
186	301223	中荣股份	48	706.08	0.00
187	301095	广立微	17	699.04	0.00
188	001322	箭牌家居	95	694.45	0.00
189	301188	力诺特玻	47	684.79	0.00
190	301228	实朴检测	73	682.55	0.00
191	601089	福元医药	49	678.65	0.00
192	603153	上海建科	40	676.40	0.00
193	301066	万事利	82	664.20	0.00
194	301079	邵阳液压	52	663.52	0.00
195	301055	张小泉	55	652.30	0.00
196	301219	腾远钴业	16	612.16	0.00
197	001258	立新能源	88	609.84	0.00
198	603065	宿迁联盛	81	605.07	0.00
199	301089	拓新药业	20	593.40	0.00
200	001319	铭科精技	36	586.80	0.00
201	603132	金徽股份	42	577.92	0.00
202	301126	达嘉维康	62	559.86	0.00
203	301056	森赫股份	72	552.24	0.00
204	301207	华兰疫苗	30	530.10	0.00
205	301092	争光股份	23	520.72	0.00
206	603170	宝立食品	42	498.96	0.00
207	301356	天振股份	38	491.72	0.00
208	603182	嘉华股份	46	483.92	0.00
209	001338	永顺泰	49	480.20	0.00
210	301216	万凯新材	42	469.98	0.00
211	603162	海通发展	50	465.00	0.00
212	603209	兴通股份	33	456.72	0.00
213	603291	联合水务	36	441.36	0.00
214	001318	阳光乳业	42	432.18	0.00



215	001333	光华股份	26	429.00	0.00
216	301217	铜冠铜箔	44	422.40	0.00
217	603151	邦基科技	35	403.90	0.00
218	301222	浙江恒威	15	371.40	0.00
219	603272	联翔股份	43	365.50	0.00
220	301248	杰创智能	24	361.68	0.00
221	301048	金鹰重工	43	356.90	0.00
222	301366	一博科技	10	340.40	0.00
223	001339	智微智能	12	331.32	0.00
224	001314	亿道信息	8	307.44	0.00
225	600925	苏能股份	60	303.00	0.00
226	300774	倍杰特	44	287.32	0.00
227	301078	孩子王	56	283.36	0.00
228	001331	胜通能源	19	263.15	0.00
229	301083	百胜智能	16	259.68	0.00
230	001313	粤海饲料	32	240.64	0.00
231	301062	上海艾录	23	234.83	0.00
232	301381	赛维时代	10	227.30	0.00
233	301118	恒光股份	15	223.65	0.00
234	301057	汇隆新材	18	205.92	0.00
235	601121	宝地矿业	32	182.08	0.00
236	301288	清研环境	16	178.56	0.00
237	301093	华兰股份	9	173.34	0.00
238	688403	汇成股份	16	135.68	0.00
239	301036	双乐股份	5	130.10	0.00
240	301149	隆华新材	14	129.36	0.00
241	001298	好上好	6	127.74	0.00
242	603206	嘉环科技	10	126.30	0.00
243	301268	铭利达	7	108.85	0.00
244	301296	新巨丰	11	79.31	0.00
245	301088	戎美股份	4	44.80	0.00
246	300854	中兰环保	3	29.82	0.00

注：对于同时在 A+H 股上市的股票（如有），合并计算公允价值参与排序，并按照不同股票分别披露。

## 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	600519	贵州茅台	47,973,421.00	6.14
2	000333	美的集团	9,998,775.00	1.28
3	002223	鱼跃医疗	7,689,870.00	0.98

4	600233	圆通速递	7,676,667.00	0.98
5	600660	福耀玻璃	5,997,059.00	0.77
6	600352	浙江龙盛	4,990,482.00	0.64
7	603279	景津装备	2,997,446.00	0.38
8	301589	诺瓦星云	175,235.09	0.02
9	688709	成都华微	163,929.12	0.02
10	601033	永兴股份	155,941.20	0.02
11	688692	达梦数据	151,745.20	0.02
12	301565	中仑新材	84,383.64	0.01
13	301536	星宸科技	77,713.44	0.01
14	603341	龙旗科技	77,428.00	0.01
15	301587	中瑞股份	66,406.88	0.01
16	301538	骏鼎达	59,504.12	0.01
17	603325	博隆技术	47,823.60	0.01
18	301591	肯特股份	42,435.12	0.01
19	688695	中创股份	41,630.08	0.01
20	603381	永臻股份	41,516.30	0.01

注：1. 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。

2. 对于同时在 A+H 股上市的股票（如有），合并计算公允价值参与排序，并按照不同股票分别披露。

#### 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	603989	艾华集团	22,995,426.54	2.94
2	01919	中远海控	8,847,642.73	1.13
3	601225	陕西煤业	7,532,063.00	0.96
4	002484	江海股份	7,460,048.00	0.96
5	603337	杰克股份	5,999,139.00	0.77
6	688361	中科飞测	494,316.28	0.06
7	688469	芯联集成	381,932.03	0.05
8	301487	盟固利	255,341.14	0.03
9	301325	曼恩斯特	208,994.03	0.03
10	601061	中信金属	189,560.01	0.02
11	688570	天玛智控	187,181.01	0.02
12	301293	三博脑科	175,796.60	0.02
13	301387	光大同创	156,827.00	0.02
14	688507	索辰科技	154,611.90	0.02
15	301307	美利信	151,510.55	0.02
16	301310	鑫宏业	149,314.50	0.02
17	688576	西山科技	146,056.70	0.02
18	301381	赛维时代	142,443.00	0.02

19	301468	博盈特焊	138,379.00	0.02
20	688591	泰凌微	128,368.42	0.02

注：1. 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。

2. 对于同时在 A+H 股上市的股票（如有），合并计算公允价值参与排序，并按照不同股票分别披露。

#### 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	88,892,014.30
卖出股票收入（成交）总额	59,830,861.52

注：本项中“买入股票的成本(成交)总额”及“卖出股票的收入(成交)总额”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

无。

#### 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

无。

#### 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 本基金投资股指期货的投资政策

无。

#### 7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

##### 7.11.1 本期国债期货投资政策

无。

##### 7.11.2 本期国债期货投资评价

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

本基金投资的前十名证券的发行主体本期没有出现被监管部门立案调查，或在报告编制日前

一年内受到公开谴责、处罚的情形。

### 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	16,308.41
2	应收清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	979,256.74
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	995,565.15

### 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

份额级别	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 (%)
大成核心 价值甄选 混合 A	11,916	66,118.51	243,369,740.09	30.89	544,498,402.24	69.11
大成核心 价值甄选 混合 C	5,232	45,082.77	139,363,279.20	59.08	96,509,764.44	40.92

合计	17,148	59,700.33	382,733,019.29	37.39	641,008,166.68	62.61
----	--------	-----------	----------------	-------	----------------	-------

注：1、上述机构/个人投资者持有份额占总份额比例的计算中，对分级份额，比例的分母采用各自级别的份额，对合计数，比例的分母采用下属分级基金份额的合计数（即期末基金份额总额）。

2、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	份额级别	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	大成核心价值甄选混合 A	687,940.92	0.0873
	大成核心价值甄选混合 C	22.00	0.0000
	合计	687,962.92	0.0672

注：上述占基金总份额比例的计算中，对分级份额，比例的分母采用各自级别的份额，对合计数，比例的分母采用下属分级基金份额的合计数（即期末基金份额总额）。

## 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	份额级别	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和研发部门负责人持有本开放式基金	大成核心价值甄选混合 A	10~50
	大成核心价值甄选混合 C	0
	合计	10~50
本基金基金经理持有本开放式基金	大成核心价值甄选混合 A	0
	大成核心价值甄选混合 C	0
	合计	0

## § 9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	大成核心价值甄选混合 A	大成核心价值甄选混合 C
基金合同生效日（2021年3月15日）基金份额总额	2,928,418,149.91	299,236,878.64
本报告期期初基金份额总额	700,943,343.38	66,424,022.08
本报告期基金总申购份额	239,051,328.42	265,032,626.12
减：本报告期基金	152,126,529.47	95,583,604.56

总赎回份额		
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期末基金份额总额	787,868,142.33	235,873,043.64

## § 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

无。

二、基金托管人的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

本报告期内无涉及本基金管理人、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

#### 10.6.1 管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，基金管理人及其相关高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

#### 10.6.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内托管人及其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	

			(%)		(%)	
长江证券	1	96,155,557.19	65.34	89,984.22	66.99	-
申万宏源	1	26,865,335.00	18.26	25,143.38	18.72	-
中信建投证券	2	13,665,900.66	9.29	10,932.73	8.14	本期报告新增 2 个
光大证券	1	8,847,642.73	6.01	7,078.11	5.27	-
中信证券	2	1,620,145.94	1.10	1,192.23	0.89	-
东方证券	1	-	-	-	-	-
广发证券	1	-	-	-	-	本期报告新增 1 个
海通证券	1	-	-	-	-	-
汇丰前海证券	1	-	-	-	-	本期报告新增 1 个
招商证券	2	-	-	-	-	-
中金公司	1	-	-	-	-	-

注：本基金采用托管人结算模式，本基金管理人负责选择证券经纪商，租用其交易单元作为本基金的交易单元。证券经纪商的选择标准如下：

- （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）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。

租用交易单元的使用流程为：首先根据证券经纪商选择标准形成《券商服务评价表》，然后根据评分高低进行本基金交易单元选择。

## 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	大成核心价值甄选混合型证券投资基金(A类份额)基金产品资料概要更新	中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站	2024年6月28日
2	大成核心价值甄选混合型证券投资基金(C类份额)基金产品资料概要更新	中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站	2024年6月28日
3	大成基金管理有限公司关于提请投资者及时更新已过期身份证件及其他身份基本信息的公告	中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站	2024年6月28日
4	大成基金管理有限公司关于暂停海银基金销售有限公司办理相关销售业务的公告	中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站	2024年6月12日
5	大成核心价值甄选混合型证券投资基金A、C类份额增加中国人寿保险股份有限公司为销售机构的公告	中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站	2024年5月17日
6	大成基金管理有限公司关于旗下部分基金增加新华信通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	2024年4月26日
7	大成核心价值甄选混合型证券投资基金2024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	2024年4月19日
8	大成核心价值甄选混合型证券投资基金更新招募说明书	中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站	2024年4月15日
9	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	2024年4月2日
10	大成核心价值甄选混合型证券投资基金2023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	2024年3月29日
11	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	2024年1月23日
12	大成核心价值甄选混合型证券投资基金2023年第4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	2024年1月19日
13	大成基金管理有限公司关于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	中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站	2024年1月3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

无。

### 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价值甄选混合型证券投资基金的文件；
- 2、《大成核心价值甄选混合型证券投资基金基金合同》；
- 3、《大成核心价值甄选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

2024 年 8 月 30 日