

# 大成健康产业混合型证券投资基金 2021 年中期报告

2021 年 6 月 30 日

基金管理人：大成基金管理有限公司

基金托管人：中国银行股份有限公司

送出日期：2021 年 8 月 31 日

## § 1 重要提示及目录

### 1.1 重要提示

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

基金托管人中国银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2021 年 8 月 30 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告财务资料未经审计。

本报告期自 2021 年 01 月 01 日起至 06 月 30 日止。

## 1.2 目录

<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	6
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	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	12
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	14
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	15
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	15
<b>§ 5 托管人报告</b>	<b>15</b>
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 托管人对本中期报告中财务信息内容的真实、准确和完整发表意见	16
<b>§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）</b>	<b>16</b>
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	20
<b>§ 7 投资组合报告</b>	<b>38</b>
7.1 期末基金资产组合情况	38
7.2 报告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	39
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	41
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	43
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	43

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 .....	44
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 .....	44
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 .....	44
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明 .....	44
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 .....	44
7.12 投资组合报告附注 .....	44
<b>§ 8 基金份额持有人信息 .....</b>	<b>45</b>
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....	45
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....	45
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 .....	45
<b>§ 9 开放式基金份额变动 .....</b>	<b>45</b>
<b>§ 10 重大事件揭示 .....</b>	<b>46</b>
10.1 基金份额持有人大会决议 .....	46
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 .....	46
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....	46
10.4 基金投资策略的改变 .....	46
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....	46
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 .....	46
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	46
10.8 其他重大事件 .....	49
<b>§ 11 影响投资者决策的其他重要信息 .....</b>	<b>49</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 .....	49
11.2 影响投资者决策的其他重要信息 .....	50
<b>§ 12 备查文件目录 .....</b>	<b>50</b>
12.1 备查文件目录 .....	50
12.2 存放地点 .....	50
12.3 查阅方式 .....	50

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	大成健康产业混合型证券投资基金
基金简称	大成健康产业混合
基金主代码	090020
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2014 年 1 月 24 日
基金管理人	大成基金管理有限公司
基金托管人	中国银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	201,103,957.79 份
基金合同存续期	不定期

### 2.2 基金产品说明

投资目标	本基金主要投资于与健康产业相关的优质上市公司，在控制风险的前提下，力争为投资者创造超越业绩比较基准的长期资本增值。
投资策略	本基金采用自上而下和自下而上相结合的主动投资策略。以宏观经济和政策研究为基础，通过分析影响证券市场整体运行的内外部因素，实施大类资产配置；通过对健康产业各个子行业发展生命周期、行业景气度、行业竞争格局、技术水平及其发展趋势等多角度，综合评估各个行业的投资价值，实行业配置；对健康产业各公司在所属行业的竞争优势进行分析，结合股票基本面指标（包括成长性指标和估值指标），精选优质上市公司股票，构建投资组合。为有效控制投资风险，本基金将根据风险管理的原则适度进行股指期货投资。股指期货投资将根据风险管理的原则，以套期保值为目的，并按照中国金融期货交易所套期保值管理的有关规定执行，对冲系统性风险和某些特殊情况下的流动性风险等。
业绩比较基准	申万医药生物行业指数×80%+中证综合债券指数×20%
风险收益特征	本基金为混合型基金，风险收益水平高于货币市场基金和债券型基金，属于中高风险的证券投资基金品种。

注：1、根据中国证监会 2014 年 1 月 24 日下发的《关于大成中证 500 沪市交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金份额持有人大会决议备案的回函》（基金部函[2014]51 号），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转型为大成健康产业股票型证券投资基金，修改基金合同中的基金名称、基金类别、基金的投资目标、投资范围、投资理念和投资策略、业绩比较基准、风险收益特征、基金投资组合比例限制、基金的费用等条款。修订后的《大成健康产业股票型证券投资基金基金合同》自 2014 年 1 月 24 日起正式生效。

2、根据中国证监会 2014 年 7 月 7 日颁布的《公开募集证券投资基金运作管理办法》的有关规定，经与本基金托管人中国银行股份有限公司协商一致，自 2015 年 7 月 22 日起本基金名称变更为“大成健康产业混合型证券投资基金”。

## 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	中国银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	赵冰	许俊
	联系电话	0755-83183388	010-66594319
	电子邮箱	office@dcfund.com.cn	fcid@bankofchina.com
客户服务电话		4008885558	95566
传真		0755-83199588	010-66594942
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 1 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 1 号
邮政编码		518040	100818
法定代表人		吴庆斌	刘连舸

## 2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《中国证券报》
登载基金中期报告正文的管理人互联网网址	www.dcfund.com.cn
基金中期报告备置地点	基金管理人及基金托管人住所

## 2.5 其他相关资料

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

## § 3 主要财务指标和基金净值表现

### 3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2021 年 1 月 1 日-2021 年 6 月 30 日)
本期已实现收益	3,763,784.05
本期利润	69,360,541.68
加权平均基金份额本期利润	0.5833
本期加权平均净值利润率	26.73%
本期基金份额净值增长率	32.54%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2021 年 6 月 30 日)
期末可供分配利润	95,035,192.57
期末可供分配基金份额利润	0.4726
期末基金资产净值	489,893,177.79
期末基金份额净值	2.436
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2021 年 6 月 30 日)
基金份额累计净值增长率	135.14%

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	1.71%	1.67%	-0.15%	1.06%	1.86%	0.61%
过去三个月	28.14%	1.65%	11.39%	1.12%	16.75%	0.53%
过去六个月	32.54%	1.96%	8.14%	1.32%	24.40%	0.64%
过去一年	60.58%	1.90%	15.27%	1.36%	45.31%	0.54%
过去三年	163.07%	1.64%	50.95%	1.31%	112.12%	0.33%
自基金合同生效起至今	135.14%	1.83%	144.33%	1.35%	-9.19%	0.48%

注: 1. 根据《大成健康产业股票型证券投资基金基金合同》, 业绩比较基准自 2014 年 1 月 24 日起, 由“中证 500 沪市指数×95%+银行活期存款利率(税后)×5%”变更为“申万医药生物行业指数×80%+中证综合债券指数×20%”; 基金业绩比较基准收益率在变更前后期间分别根据相应的指标计算。

2. 本基金自 2014 年 1 月 24 日起由大成中证 500 沪市交易型开放式指数证券投资基金联接基金转为大成健康产业股票型证券投资基金, 所涉及的相关数据计算起始日从本次年报开始由原大成中证 500 沪市交易型开放式指数证券投资基金联接基金成立日变更为大成健康产业股票型证券投资基金合同生效日。

### 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

大成健康产业混合累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：1、根据中国证监会 2014 年 1 月 24 日下发的《关于大成中证 500 沪市交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金份额持有人大会决议备案的回函》（基金部函[2014]51 号），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转型为大成健康产业股票型证券投资基金，修改基金合同中的基金名称、基金类别、基金的投资目标、投资范围、投资理念和投资策略、业绩比较基准、风险收益特征、基金投资组合比例限制、基金的费用等条款。修订后的《大成健康产业股票型证券投资基金基金合同》自 2014 年 1 月 24 日起正式生效。

2、按照《大成健康产业股票型证券投资基金基金合同》规定，基金管理人应当自 2014 年 1 月 24 日（基金合同生效日）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。

3、根据《大成健康产业股票型证券投资基金基金合同》，业绩比较基准自 2014 年 1 月 24 日起，由“中证 500 沪市指数×95%+银行活期存款利率（税后）×5%”变更为“申万医药生物行业指数×80%+中证综合债券指数×20%”；基金业绩比较基准收益率在变更前后期间分别根据相应的指标计算。

4、根据中国证监会 2014 年 7 月 7 日颁布的《公开募集证券投资基金运作管理办法》的有关规定，经与本基金托管人中国银行股份有限公司协商一致，自 2015 年 7 月 22 日起本基金名称变更为“大成健康产业混合型证券投资基金”。



## § 4 管理人报告

### 4.1 基金管理人及基金经理情况

#### 4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

大成基金管理有限公司经中国证监会证监基金字[1999]10 号文批准，于 1999 年 4 月 12 日正式成立，是中国证监会批准成立的首批十家基金管理公司之一，注册资本 2 亿元人民币，注册地广东省深圳市。目前公司由三家股东组成，分别为中泰信托有限责任公司(50%)、光大证券股份有限公司(25%)、中国银河投资管理有限公司(25%)。主要业务是公募基金的募集、销售和管理，还具有全国社保基金投资管理、基本养老保险投资管理、受托管理保险资金、保险保障基金投资管理、特定客户资产管理和 QDII 业务资格。

经过二十二年的稳健发展，公司形成了强大稳固的综合实力。公司旗下基金产品齐全、风格多样，构建了涵盖股票型基金、混合型基金、指数型基金、债券型基金和货币市场基金的完备产品线。截至 2021 年 6 月 30 日，本基金管理人共管理 9 只 ETF 及 3 只 ETF 联接基金，8 只 QDII 基金及 107 只开放式证券投资基金。

#### 4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
杨挺	本基金基金经理	2014 年 6 月 26 日	-	13 年	工学硕士。曾任广发证券股份有限公司发展研究中心研究员。2012 年 8 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。2019 年 2 月 20 日至 2020 年 6 月 29 日任大成国家安全主题灵活配置混合型证券投资基金基金经理。2014 年 6 月 26 日起任大成健康产业混合型证券投资基金基金经理（更名前为大成健康产业股票型证券投资基金）。2015 年 7 月 8 日任大成正向回报灵活配置混合型证券投资基金基金经理。2017 年 9 月 12 日起任大成价值增长证券投资基金基金经理。具有基金从业资格。国籍：中国
孙丹	本基金基金经理助理	2020 年 7 月 6 日	-	13 年	经济学硕士。2008 年至 2012 年任景顺长城产品开发部产品经理。2012 年至 2014 年任华夏基金机构债券投资部研究员。2014 年 5 月加入大成基金管理有限公司，曾担任固定收益总部信用策略及宏观利率研究员、大成景辉灵活配置混合型证券投资基金、大成景荣保本混合型证券投资基

				<p>金、大成景兴信用债债券型证券投资基金、大成景秀灵活配置混合型证券投资基金、大成景源灵活配置混合型证券投资基金基金经理助理，现任固定收益总部总监助理。2018 年 3 月 12 日起任大成策略回报混合型证券投资基金、大成创新成长混合型证券投资基金（LOF）、大成积极成长混合型证券投资基金、大成精选增值混合型证券投资基金、大成景阳领先混合型证券投资基金、大成竞争优势混合型证券投资基金、大成蓝筹稳健证券投资基金、大成优选混合型证券投资基金（LOF）基金经理助理。2020 年 7 月 1 日起任大成价值增长证券投资基金、大成多策略灵活配置混合型证券投资基金（LOF）、大成一带一路灵活配置混合型证券投资基金、大成内需增长混合型证券投资基金、大成睿景灵活配置混合型证券投资基金、大成盛世精选灵活配置混合型证券投资基金、大成国企改革灵活配置混合型证券投资基金、大成行业轮动混合型证券投资基金、大成灵活配置混合型证券投资基金、大成产业升级股票型证券投资基金（LOF）、大成健康产业混合型证券投资基金、大成正向回报灵活配置混合型证券投资基金、大成国家安全主题灵活配置混合型证券投资基金、大成新锐产业混合型证券投资基金、大成消费主题混合型证券投资基金基金经理助理。2020 年 11 月 6 日起任大成科技消费股票型证券投资基金、大成科创主题 3 年封闭运作灵活配置混合型证券投资基金、大成中小盘混合型证券投资基金（LOF）、大成睿享混合型证券投资基金、大成行业先锋混合型证券投资基金基金经理助理。2021 年 2 月 1 日起任大成企业能力驱动混合型证券投资基金、大成优选升级一年持有期混合型证券投资基金、大成成长进取混合型证券投资基金基金经理助理。2021 年 2 月 22 日起任大成恒享春晓一年定期开放混合型证券投资基金基金经理助理。2021 年 4 月 19 日起任大成民稳增长混合型证券投资基金、大成恒享混合型证券投资基金基金经理助理。2021 年 7 月 29 日起任大成产业趋势混合型证券投资基金、大成投资严选六个月持有期混合型证券投资基金基金经</p>
--	--	--	--	--------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------

				<p>理助理。2017 年 5 月 8 日起任大成景尚灵活配置混合型证券投资基金、大成景兴信用债债券型证券投资基金基金经理。2017 年 5 月 8 日至 2019 年 10 月 31 日任大成景荣债券型证券投资基金（原大成景荣保本混合型证券投资基金转型）基金经理。2017 年 5 月 31 日至 2020 年 10 月 20 日任大成惠裕定期开放纯债债券型证券投资基金基金经理。2017 年 6 月 2 日至 2018 年 11 月 19 日任大成景禄灵活配置混合型证券投资基金基金经理。2017 年 6 月 2 日至 2018 年 12 月 8 日任大成景源灵活配置混合型证券投资基金基金经理。2017 年 6 月 2 日至 2019 年 6 月 15 日任大成景秀灵活配置混合型证券投资基金。2017 年 6 月 6 日至 2019 年 9 月 29 日任大成惠明定期开放纯债债券型证券投资基金基金经理。2018 年 3 月 14 日至 2018 年 11 月 30 日任大成景辉灵活配置混合型证券投资基金基金经理。2018 年 3 月 14 日至 2018 年 11 月 30 日任大成景沛灵活配置混合型证券投资基金基金经理。2018 年 3 月 14 日至 2018 年 7 月 20 日任大成景裕灵活配置混合型证券投资基金基金经理。2018 年 3 月 14 日起任大成财富管理 2020 生命周期证券投资基金基金经理。2019 年 7 月 31 日至 2020 年 5 月 23 日任大成景丰债券型证券投资基金（LOF）基金经理。2020 年 2 月 27 日至 2021 年 4 月 13 日任大成景泰纯债债券型证券投资基金基金经理。2020 年 3 月 5 日至 2021 年 4 月 14 日任大成恒享混合型证券投资基金基金经理。2020 年 3 月 31 日至 2021 年 4 月 14 日任大成民稳增长混合型证券投资基金基金经理。2020 年 4 月 26 日起任大成景瑞稳健配置混合型证券投资基金基金经理。2020 年 8 月 21 日至 2021 年 5 月 18 日任大成景和债券型证券投资基金基金经理。2020 年 9 月 3 日起任大成汇享一年持有期混合型证券投资基金基金经理。2020 年 9 月 23 日起任大成尊享 18 个月定期开放混合型证券投资基金基金经理。2020 年 11 月 16 日起任大成卓享一年持有期混合型证券投资基金基金经理。2020 年 11 月 18 日起任大成丰享回报混合型证券投资基金基金经理。2021 年 4 月 22</p>
--	--	--	--	---------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------

					日起任大成安享得利六个月持有期混合型证券投资基金基金经理。具有基金从业资格。国籍：中国
--	--	--	--	--	---------------------------------------------

注：1、任职日期、离任日期为本基金管理人作出决定之日。

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

#### 4.1.3 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理同时管理的产品情况

无。

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

##### 4.3.2 异常交易行为的专项说明

报告期内，基金管理人旗下所有投资组合未发现存在异常交易行为。主动投资组合间股票交易不存在同日反向交易。主动型投资组合与指数型投资组合之间或指数型投资组合之间存在股票同日反向交易，但不存在参与交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量超过该股当日成交量 5% 的情形；主动投资组合间债券交易存在 2 笔同日反向交易，原因为流动性需要。投资组合间相邻交易日反向交易的市场成交比例、成交均价等交易结果数据表明该类交易不对市场产生重大影响，无异常。

#### 4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

##### 4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2021 年国内股票市场波动较大，多个板块和热点走出了相互快速轮动和切换的行情。2021

年一季度，国内股票市场走过了一个巨幅波动，春节前以“抱团股”为代表的传统白马股快速上涨，春节后，这类公司出现了大幅下跌，同时以传统周期板块为代表的低估值品种出现明显上涨。到一季度末，以钢铁、银行为代表的低估值板块领涨市场，以军工、TMT 为代表的高估值板块则出现较大幅度调整。二季度，市场在经历了一季度末期的快速调整后，走出了温和上升的行情，但是从版块和风格来看，市场热点明显扩散，多个版块和主题在二季度相互切换，市场进入更为复杂的阶段。整体来看，中小市值的公司比大市值公司表现更好，虽然指数比较平稳，但是各行业和主题的走势发生了较大波动。

这样的市场情况应该说还是在我们的预期之中的，在 2021 年初，我们就认为新冠疫情、复杂的国际环境以及可能出现的货币政策变化将给市场判断带来很大困难。基于这个判断我们认为今年策略还是以稳健为主，在降低预期收益率的同时，希望通过投资一些有长期价值的企业来度过今年极其复杂的市场环境。目前我们的组合构建跟一季度一样，继续以具备长期成长能力的医疗公司为主，希望以长期的成长性来对抗今年较难判断的市场情况，这一策略我们从年初制定以后一直使用到现在，应该也会在后边继续维持。标的选择上我们对组合做了一些细微调整，但是整体风格和仓位变化不大。

总体来说我们对今年以来的操作和组合调整基本满意。由于今年面对大量难以明确判断的不确定因素，我们目前的持仓品种以稳健风格为主，更为注重公司在复杂环境下的成长确定性。我们将根据疫情及整体宏观情况谨慎调整持仓。

#### 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 2.436 元；本报告期基金份额净值增长率为 32.54%，业绩比较基准收益率为 8.14%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

由于医药板块目前依然是我们组合持仓的主要方向，因此我们先聊聊对于医药行业的展望。目前来看，无论是全球还是疫情已经取得阶段胜利的国内，新冠疫情依然是 2021 年无法回避的一个主题，对于身处现代文明社会的人类来说，已经可以基本远离战争和饥饿的威胁，但是新冠疫情的肆虐再次提醒我们：稳定安逸的生活环境甚至是我们的生命本身，都随时可能受到威胁。我认为这次事件对我们生活和产业的影响，很可能会持续很久远：首先公共卫生建设不仅仅是一项民生工程，而是涉及到全体国民安全的“国防”工程，而且这一领域的威胁对国民生命的威胁要远远高于战争、饥荒等其他威胁；其次，在医疗资源和药品生产甚至是最新的疫苗开发上，中国制造已经可以跟上全球最快的步伐，并且在医药高端制造的产能建设上，中国企业已经在参与全球竞争；最后，我们也应该看到，在疫苗开发和最前沿的医学研究上，中国企业跟第一梯队还

有差距。以上的判断会指导我们未来 3-5 年的医疗投资。解决医疗生产和研发的“补短板”和优势企业在全市场占有更多市场份额的“强长板”，将会是我们在医药领域最看好的两个方向。

对于 2021 年下半年的其他方面展望，我们分为以下几个领域：

政策方面：相比“十三五”时期，“十四五”期间我国将面临稳宏观杠杆、高质量发展的更高级别挑战，把握“十四五”产业趋势的三条主线，规划历史方位尤为重要。第一，安全与创新主线；第二，双循环扩内需主线；第三，强国主线。

流动性方面：21 年“紧信用”的基调将贯穿全年。海外流动性维持宽松，但缺乏进一步宽松信息。全球市场对于流动性的关注度也是空前高涨。国内监管更注重“稳杠杆”和“风险防范化解”，现阶段社融数据反映“需求扩张+供给收紧”的信用格局，当前仍处于供给主导的一般信用收缩阶段，盈利保持较好韧性。需要关注是否会转变为需求下行背景下的糟糕的信用紧缩，从而对企业盈利造成负面影响。

市场和行业方面：下半年，国内经济结构上出口走弱但仍有韧性，制造业投资仍有扩张空间。出口方面，美国商品消费增速回落意味着外需会逐渐走弱，5 月的新出口订单指数已回落至荣枯线以下，但全球贸易的供给端依然对中国有所依赖；国内方面，制造业投资本身具有滞后性，10 和 18 年制造业投资扩张的起点正好是下游需求增速的高点。今年在领先指标均向好的情况下，制造业投资下半年仍有扩张空间。在标的选择上以盈利能力为核心，紧跟“十四五”产业趋势，注重行业的长期景气。

整体来说，我们基于中国国力的稳步增强，继续对在长周期上对 A 股保持乐观。但国内外情况复杂多变，加上疫情干扰，短期来看上半年涨幅过大的板块有一定调整压力，初步判断 21 年收益预期应该不如前两年。

#### 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本基金管理人指导基金估值业务的领导小组为公司估值委员会，公司估值委员会主要负责估值政策和估值程序的制定、修订以及执行情况的监督。估值委员会由股票投资部、研究部、固定收益总部、数量与指数投资部、大类资产配置部、交易管理部、风险管理部、基金运营部、监察稽核部指定人员组成。公司估值委员会的相关成员均具备相应的专业胜任能力和相关工作经历，估值委员会成员中包括五名投资组合经理。

股票投资部、研究部、固定收益总部、数量与指数投资部、大类资产配置部、风险管理部负责关注相关投资品种的动态，评判基金持有的投资品种是否处于不活跃的交易状态或者最近交易日后经济环境发生了重大变化或证券发行机构发生了影响证券价格的重大事件，从而确定估值日需要进行估值测算或者调整的投资品种；提出合理的数量分析模型对需要进行估值测算或者调整

的投资品种进行公允价值定价与计量；定期对估值政策和程序进行评价，以保证其持续适用；交易管理部负责关注相关投资品种的流动性状况，协助反馈其市场交易信息；基金运营部负责日常的基金资产的估值业务，执行基金估值政策，并负责与托管行沟通估值调整事项；监察稽核部负责审核估值政策和程序的一致性，监督估值委员会工作流程中的风险控制，并负责估值调整事项的信息披露工作。

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

本基金管理人参与估值流程各方之间不存在任何重大利益冲突。截止报告期末本基金管理人已与中央国债登记结算有限责任公司及中证指数有限公司签署服务协议，由中央国债登记结算有限责任公司按约定提供银行间同业市场的估值数据，由中证指数有限公司按约定提供交易所交易的债券品种的估值数据和流通受限股票的折扣率数据。

#### 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金管理人将严格按照本基金基金合同的规定进行收益分配。本报告期内本基金无收益分配事项。

#### 4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

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，中国银行股份有限公司（以下称“本托管人”）在大成健康产业混合型证券投资基金（以下称“本基金”）的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了应尽的义务。

### 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，本托管人根据《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，对本基金管理人的投资运作进行了必要的监督，对基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算以及基金费用开支等方面进行了认真地复核，未发现本基金管理人存在损害基金

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

本报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告（注：财务会计报告中的“金融工具风险及管理”、“关联方承销证券”、“关联方证券出借”部分未在托管人复核范围内）、投资组合报告等数据真实、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：大成健康产业混合型证券投资基金

报告截止日：2021 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2021 年 6 月 30 日	上年度末 2020 年 12 月 31 日
<b>资产：</b>			
银行存款	6.4.3.1	35,802,738.78	10,835,475.45
结算备付金		2,058,818.57	53,956.32
存出保证金		119,133.87	24,451.43
交易性金融资产	6.4.3.2	456,952,337.23	98,409,851.47
其中：股票投资		456,592,654.83	97,928,899.57
基金投资		-	-
债券投资		359,682.40	480,951.90
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		310,131.22	8,744.61
应收利息	6.4.3.5	4,529.44	11,531.70
应收股利		-	-
应收申购款		5,225,114.47	412,964.90
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.3.6	-	-
资产总计		500,472,803.58	109,756,975.88
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2021 年 6 月 30 日</b>	<b>上年度末 2020 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	6.4.3.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-



应付证券清算款		-	-
应付赎回款		9,234,364.62	1,209,332.81
应付管理人报酬		635,842.45	135,106.35
应付托管费		105,973.75	22,517.71
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.3.7	495,835.57	55,855.07
应交税费		2.69	-
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.3.8	107,606.71	34,367.15
负债合计		10,579,625.79	1,457,179.09
<b>所有者权益：</b>			
实收基金	6.4.3.9	201,103,957.79	58,917,116.14
未分配利润	6.4.3.10	288,789,220.00	49,382,680.65
所有者权益合计		489,893,177.79	108,299,796.79
负债和所有者权益总计		500,472,803.58	109,756,975.88

注：报告截止日 2021 年 06 月 30 日，基金份额净值 2.436 元，基金份额总额 201,103,957.79 份。

## 6.2 利润表

会计主体：大成健康产业混合型证券投资基金

本报告期：2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期	上年度可比期间
		2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日	2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日
一、收入		72,588,292.45	29,021,776.50
1. 利息收入		60,957.54	19,660.25
其中：存款利息收入	6.4.3.11	60,481.89	17,712.81
债券利息收入		475.65	1,947.44
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	-
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		6,159,352.51	3,116,034.45
其中：股票投资收益	6.4.3.12	5,215,277.87	2,763,112.37
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.3.13	-625.30	-

资产支持证券投资收益			-
贵金属投资收益	6.4.3.14		-
衍生工具收益	6.4.3.15		-
股利收益	6.4.3.16	944,699.94	352,922.08
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.3.17	65,596,757.63	25,739,192.35
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	771,224.77	146,889.45
减：二、费用		3,227,750.77	675,588.84
1. 管理人报酬	6.4.6.2.1	1,913,310.43	392,400.23
2. 托管费	6.4.6.2.2	318,885.07	65,400.10
3. 销售服务费			-
4. 交易费用	6.4.3.19	910,545.80	203,665.38
5. 利息支出			-
其中：卖出回购金融资产支出			-
6. 税金及附加		0.87	-
7. 其他费用	6.4.3.20	85,008.60	14,123.13
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		69,360,541.68	28,346,187.66
减：所得税费用			-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		69,360,541.68	28,346,187.66

### 6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：大成健康产业混合型证券投资基金

本报告期：2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	58,917,116.14	49,382,680.65	108,299,796.79
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	69,360,541.68	69,360,541.68
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数	142,186,841.65	170,045,997.67	312,232,839.32

(净值减少以“-”号填列)			
其中：1. 基金申购款	336,620,313.01	407,674,913.61	744,295,226.62
2. 基金赎回款	-194,433,471.36	-237,628,915.94	-432,062,387.30
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)	201,103,957.79	288,789,220.00	489,893,177.79
项目	上年度可比期间 2020年1月1日至2020年6月30日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益(基金净值)	24,156,836.88	-651,276.74	23,505,560.14
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	28,346,187.66	28,346,187.66
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)	84,368,242.10	28,375,681.04	112,743,923.14
其中：1. 基金申购款	145,114,563.08	44,853,140.23	189,967,703.31
2. 基金赎回款	-60,746,320.98	-16,477,459.19	-77,223,780.17
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)	108,525,078.98	56,070,591.96	164,595,670.94

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署：

谭晓冈周立新刘亚林

基金管理人负责人

主管会计工作负责人

会计机构负责人

## 6.4 报表附注

### 6.4.1 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

### 6.4.2 税项

#### 1、印花税

证券（股票）交易印花税税率为 1‰，由出让方缴纳；

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

#### 2、增值税、企业所得税

根据财政部、国家税务总局财税[2016]36 号文《关于全面推开营业税改增值税试点的通知》的规定，经国务院批准，自 2016 年 5 月 1 日起在全国范围内全面推开营业税改征增值税试点，金融业纳入试点范围，由缴纳营业税改为缴纳增值税。对证券投资基金（封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金）管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税；国债、地方政府债利息收入以及金融同业往来利息收入免征增值税；存款利息收入不征收增值税。

根据财政部、国家税务总局财税[2016]140 号文《关于明确金融、房地产开发、教育辅助服务等增值税政策的通知》的规定，资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人；

根据财政部、国家税务总局财税[2017]56 号文《关于资管产品增值税有关问题的通知》的规定，自 2018 年 1 月 1 日起，资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为（以下简称“资管产品运营业务”），暂适用简易计税方法，按照 3% 的征收率缴纳增值税，资管产品管理人未分别核算资管产品运营业务和其他业务的销售额和增值税应纳税额的除外。资管产品管理人可选择分别或汇总核算资管产品运营业务销售额和增值税应纳税额。对资管产品在 2018 年 1 月 1 日前运营过程中发生的增值税应税行为，未缴纳增值税的，不再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从资管产品管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。

根据财政部、国家税务总局财税[2017]90 号文《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》的规定，提供贷款服务，以 2018 年 1 月 1 日起产生的利息及利息性质的收入为销售额；转让 2017 年 12 月 31 日前取得的股票（不包括限售股）、债券、基金、非货物期货，可以选择按照实际买入价计算销售额，或者以 2017 年最后一个交易日的股票收盘价（2017 年最后一个交易

日处于停牌期间的股票，为停牌前最后一个交易日收盘价）、债券估值（中债金融估值中心有限公司或中证指数有限公司提供的债券估值）、基金份额净值、非货物期货结算价格作为买入价计算销售净额。

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

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

### 3、个人所得税

个人所得税税率为 20%。

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

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

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

暂免征收储蓄存款利息所得个人所得税。

## 6.4.3 重要财务报表项目的说明

### 6.4.3.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 6 月 30 日
活期存款	35,802,738.78
定期存款	-
其中：存款期限 1 个月以内	-
存款期限 1-3 个月	-
存款期限 3 个月以上	-
其他存款	-
合计	35,802,738.78

### 6.4.3.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 6 月 30 日
----	------------------------

	成本	公允价值	公允价值变动
股票	364,677,177.59	456,592,654.83	91,915,477.24
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	359,682.40	51,682.40
	银行间市场	-	-
	合计	359,682.40	51,682.40
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	364,985,177.59	456,952,337.23	91,967,159.64

#### 6.4.3.3 衍生金融资产/负债

无。

#### 6.4.3.4 买入返售金融资产

##### 6.4.3.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

无。

##### 6.4.3.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

无。

#### 6.4.3.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2021年6月30日
应收活期存款利息	3,401.63
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	833.85
应收债券利息	245.72
应收资产支持证券利息	-
应收买入返售证券利息	-
应收申购款利息	-
应收黄金合约拆借孳息	-
应收出借证券利息	-
其他	48.24
合计	4,529.44

## 6.4.3.6 其他资产

无。

## 6.4.3.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2021年6月30日
交易所市场应付交易费用	495,835.57
银行间市场应付交易费用	-
合计	495,835.57

## 6.4.3.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2021年6月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	33,222.95
应付证券出借违约金	-
预提费用	74,383.76
合计	107,606.71

## 6.4.3.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	58,917,116.14	58,917,116.14
本期申购	336,620,313.01	336,620,313.01
本期赎回（以“-”号填列）	-194,433,471.36	-194,433,471.36
- 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	201,103,957.79	201,103,957.79

注：申购含红利再投份额（如有）、转换入份额（如有）；赎回含转换出份额（如有）。

## 6.4.3.10 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	24,256,249.08	25,126,431.57	49,382,680.65
本期利润	3,763,784.05	65,596,757.63	69,360,541.68
本期基金份额交易产生的变动数	67,015,159.44	103,030,838.23	170,045,997.67
其中：基金申购款	157,454,502.27	250,220,411.34	407,674,913.61

基金赎回款	-90,439,342.83	-147,189,573.11	-237,628,915.94
本期已分配利润	-	-	-
本期末	95,035,192.57	193,754,027.43	288,789,220.00

#### 6.4.3.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期	
	2021年1月1日至2021年6月30日	
活期存款利息收入	55,043.02	
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	5,027.43	
其他	411.44	
合计	60,481.89	

#### 6.4.3.12 股票投资收益

单位：人民币元

项目	本期	
	2021年1月1日至2021年6月30日	
卖出股票成交总额	207,448,892.74	
减：卖出股票成本总额	202,233,614.87	
买卖股票差价收入	5,215,277.87	

#### 6.4.3.13 债券投资收益

单位：人民币元

项目	本期	
	2021年1月1日至2021年6月30日	
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	491,822.50	
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	481,625.30	
减：应收利息总额	10,822.50	
买卖债券差价收入	-625.30	

#### 6.4.3.14 贵金属投资收益

无。

#### 6.4.3.15 衍生工具收益

无。

#### 6.4.3.16 股利收益

单位：人民币元

项目	本期	
	2021年1月1日至2021年6月30日	



股票投资产生的股利收益	944,699.94
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	944,699.94

#### 6.4.3.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期
	2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
1. 交易性金融资产	65,596,757.63
股票投资	65,544,401.83
债券投资	52,355.80
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	65,596,757.63

#### 6.4.3.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期
	2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
基金赎回费收入	755,334.98
基金转换费收入	15,889.79
合计	771,224.77

注：（1）本基金的赎回费率按持有期间递减，赎回费总额的 25% 归入基金资产。

（2）本基金的转换费由申购补差费和转出基金的赎回费两部分构成，其中转出基金的赎回费的 25% 归入转出基金的基金资产。

#### 6.4.3.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期
	2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
交易所市场交易费用	910,545.80
银行间市场交易费用	-
合计	910,545.80

#### 6.4.3.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期
	2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
审计费用	14,876.39
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
银行划款手续费	10,624.84
合计	85,008.60

#### 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

无。

##### 6.4.4.2 资产负债表日后事项

无。

#### 6.4.5 关联方关系

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

本基金本报告期存在控制关系或者其他重大利害关系的关联方未发生变化。

##### 6.4.5.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
大成基金管理有限公司(“大成基金”)	基金管理人、基金销售机构、注册登记机构
中国银行股份有限公司(“中国银行”)	基金托管人、基金销售机构
光大证券股份有限公司(“光大证券”)	基金管理人的股东、基金销售机构

注：以下关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

#### 6.4.6 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

##### 6.4.6.1 通过关联方交易单元进行的交易

###### 6.4.6.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期		上年度可比期间	
	2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日		2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日	
	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	-	-	39,936,293.04	23.82

###### 6.4.6.1.2 债券交易

无。

## 6.4.6.1.3 债券回购交易

无。

## 6.4.6.1.4 权证交易

无。

## 6.4.6.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2021年1月1日至2021年6月30日			
	当期 佣金	占当期佣金总量 的比例 (%)	期末应付佣金余 额	占期末应付佣金 总额的比例 (%)
光大证券	-	-	-	-
关联方名称	上年度可比期间 2020年1月1日至2020年6月30日			
	当期 佣金	占当期佣金总量 的比例 (%)	期末应付佣金余 额	占期末应付佣金 总额的比例 (%)
光大证券	36,393.94	23.82	27,259.69	24.07

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

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

## 6.4.6.2 关联方报酬

## 6.4.6.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6 月30日	上年度可比期间 2020年1月1日至2020年 6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	1,913,310.43	392,400.23
其中：支付销售机构的客户维护费	748,660.93	142,858.73

注：基金管理费每日计提，按月支付。本基金的管理费按前一日基金资产净值的 1.50%年费率计提。管理费的计算方法如下：

$$H = E \times 1.50\% / \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

#### 6.4.6.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	318,885.07	65,400.10

注：基金托管费每日计提，按月支付。本基金的托管费按前一日基金资产净值的 0.25% 年费率计提。托管费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.25\% / \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

#### 6.4.6.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

无。

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

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

无。

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

无。

#### 6.4.6.5 各关联方投资本基金的情况

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

份额单位：份

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日
基金合同生效日（2014 年 1 月 24 日）持有的基金份额	-	-

报告期初持有的基金份额	-	5,024,120.60
报告期内申购/买入总份额	-	-
报告期内因拆分变动份额	-	-
减：报告期内赎回/卖出总份额	-	-
报告期末持有的基金份额	-	5,024,120.60
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	-	4.63%

注：基金管理人大成基金投资本基金适用的交易费率与本基金法律文件规定一致。

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

无。

#### 6.4.6.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2021年1月1日至2021年6月30日		上年度可比期间 2020年1月1日至2020年6月30日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国银行	35,802,738.78	55,043.02	20,361,262.08	16,471.73

注：本基金由基金托管人保管的银行存款，按银行约定利率计息。

#### 6.4.6.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

无。

#### 6.4.6.8 其他关联交易事项的说明

无。

#### 6.4.7 利润分配情况

无。

#### 6.4.8 期末(2021年6月30日)本基金持有的流通受限证券

##### 6.4.8.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

6.4.8.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量 (单位：股)	期末成本总额	期末估值总额	备注

300614	百川畅银	2021年5月18日	2021年11月25日	新股锁定	9.19	40.38	329	3,023.51	13,285.02	-
300953	震裕科技	2021年3月11日	2021年9月22日	新股锁定	28.77	99.85	106	3,049.62	10,584.10	-
300955	嘉亨家化	2021年3月16日	2021年9月24日	新股锁定	16.53	46.07	96	1,586.88	4,422.72	-
300956	英力股份	2021年3月16日	2021年9月27日	新股锁定	12.85	25.80	215	2,762.75	5,547.00	-
300957	贝泰妮	2021年3月18日	2021年9月27日	新股锁定	47.33	251.96	90	4,259.70	22,676.40	-
300958	建工修复	2021年3月18日	2021年9月29日	新股锁定	8.53	27.22	300	2,559.00	8,166.00	-
300960	通业科技	2021年3月22日	2021年9月29日	新股锁定	12.08	23.06	234	2,826.72	5,396.04	-
300961	深水海纳	2021年3月23日	2021年9月30日	新股锁定	8.48	22.07	336	2,849.28	7,415.52	-
300962	中金辐照	2021年3月29日	2021年10月11日	新股锁定	3.40	16.37	576	1,958.40	9,429.12	-
300963	中洲特材	2021年3月30日	2021年10月11日	新股锁定	12.13	22.49	116	1,407.08	2,608.84	-
300967	晓鸣股份	2021年4月2日	2021年10月13日	新股锁定	4.54	11.54	453	2,056.62	5,227.62	-
300968	格林精密	2021年4月6日	2021年10月15日	新股锁定	6.87	12.07	362	2,486.94	4,369.34	-
300971	博亚精工	2021年4月7日	2021年10月15日	新股锁定	18.24	28.29	151	2,754.24	4,271.79	-

			日							
300973	立高食品	2021年4月8日	2021年10月15日	新股锁定	28.28	115.71	57	1,611.96	6,595.47	-
300975	商络电子	2021年4月14日	2021年10月21日	新股锁定	5.48	13.03	321	1,759.08	4,182.63	-
300978	东箭科技	2021年4月15日	2021年10月26日	新股锁定	8.42	13.60	430	3,620.60	5,848.00	-
300981	中红医疗	2021年4月19日	2021年10月27日	新股锁定	48.59	90.39	48	2,332.32	4,338.72	-
300982	苏文电能	2021年4月19日	2021年10月27日	新股锁定	15.83	45.29	286	4,527.38	12,952.94	-
300986	志特新材	2021年4月21日	2021年11月1日	新股锁定	14.79	30.57	145	2,144.55	4,432.65	-
300991	创益通	2021年5月12日	2021年11月22日	新股锁定	13.06	26.51	254	3,317.24	6,733.54	-
300992	泰福泵业	2021年5月17日	2021年11月25日	新股锁定	9.36	20.32	200	1,872.00	4,064.00	-
300993	玉马遮阳	2021年5月17日	2021年11月24日	新股锁定	12.10	19.29	410	4,961.00	7,908.90	-
300995	奇德新材	2021年5月17日	2021年11月26日	新股锁定	14.72	23.32	191	2,811.52	4,454.12	-
300996	普联软件	2021年5月26日	2021年12月3日	新股锁定	20.81	42.23	241	5,015.21	10,177.43	-
300997	欢乐	2021年	2021	新股锁	4.94	13.05	928	4,584.32	12,110.40	-

	家	5月26日	年12月2日	定							
300998	宁波方正	2021年5月25日	2021年12月2日	新股锁定	6.02	21.32	201	1,210.02	4,285.32	-	
301002	崧盛股份	2021年5月27日	2021年12月7日	新股锁定	18.71	57.62	201	3,760.71	11,581.62	-	
301007	德迈仕	2021年6月4日	2021年12月16日	新股锁定	5.29	14.44	303	1,602.87	4,375.32	-	
301009	可靠股份	2021年6月8日	2021年12月17日	新股锁定	12.54	27.89	801	10,044.54	22,339.89	-	
301010	晶雪节能	2021年6月9日	2021年12月20日	新股锁定	7.83	17.61	218	1,706.94	3,838.98	-	
301011	华立科技	2021年6月9日	2021年12月17日	新股锁定	14.20	33.84	175	2,485.00	5,922.00	-	
301012	扬电科技	2021年6月15日	2021年12月22日	新股锁定	8.05	24.26	170	1,368.50	4,124.20	-	
301013	利和兴	2021年6月21日	2021年12月29日	新股锁定	8.72	27.11	471	4,107.12	12,768.81	-	
301015	百洋医药	2021年6月22日	2021年12月30日	新股锁定	7.64	38.83	462	3,529.68	17,939.46	-	
301016	雷尔伟	2021年6月23日	2021年12月30日	新股锁定	13.75	32.98	275	3,781.25	9,069.50	-	
301020	密封科技	2021年6月28日	2021年7月6日	新股未上市	10.64	10.64	4,210	44,794.40	44,794.40	-	
301021	英诺	2021年	2021	新股未	9.46	9.46	2,899	27,424.54	27,424.54	-	



	激光	6月28日	2021年7月6日	上市							
603456	九洲药业	2021年2月10日	2021年8月9日	非公开发行	38.21	46.38	52,342	1,999,987.82	2,427,621.96		-
605162	新中港	2021年6月29日	2021年7月7日	新股未上市	6.07	6.07	1,377	8,358.39	8,358.39		-
688087	英科再生	2021年6月30日	2021年7月9日	新股未上市	21.96	21.96	2,469	54,219.24	54,219.24		-
688226	威腾电气	2021年6月28日	2021年7月7日	新股未上市	6.42	6.42	2,693	17,289.06	17,289.06		-
688239	航宇科技	2021年6月25日	2021年7月5日	新股未上市	11.48	11.48	4,926	56,550.48	56,550.48		-
688499	利元亨	2021年6月23日	2021年7月1日	新股未上市	38.85	38.85	2,149	83,488.65	83,488.65		-
688625	呈和科技	2021年5月31日	2021年12月7日	新股锁定	16.48	42.63	2,672	44,034.56	113,907.36		-

注：1. 根据《上海证券交易所科创板股票公开发行自律委员会促进科创板初期企业平稳发行行业倡导建议》，本基金获配的科创板股票如经抽签方式确定需要锁定的，锁定期限为自发行人股票上市之日起 6 个月。根据《上海证券交易所科创板上市公司股东以向特定机构投资者询价转让和配售方式减持股份实施细则》，基金通过询价转让受让的股份，在受让后 6 个月内不得转让。

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

3. 基金可使用以基金名义开设的股票账户，选择网上或者网下一种方式进行新股申购。其中基金参与网下申购获得的新股或作为战略投资者参与配售获得的新股，在新股上市后的约定期限内不能自由转让；基金参与网上申购获配的新股，从新股获配日至新股上市日之间不能自由转让。

#### 6.4.8.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

无。

### 6.4.8.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

无。

### 6.4.8.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

无。

## 6.4.9 金融工具风险及管理

### 6.4.9.1 风险管理政策和组织架构

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

本基金的基金管理人奉行全面风险管理体系的建设，建立了以由高层监控(合规与风险管理委员会、公司投资风险控制委员会)、专业监控(监察稽核部、风险管理部)、部门互控、岗位自控构成的风险管理架构体系。本基金的基金管理人在董事会下设立合规与风险管理委员会，对公司整体运营风险进行监督，监督风险控制措施的执行；在管理层层面设立投资风险控制委员会，通过定期会议讨论涉及投资风险的重大议题，形成正式决议提交投委会；在业务操作层面，监察稽核部履行合规控制职责，通过定期、不定期检查内控制度的执行情况、对重大风险点以专项稽核的方式确保公司内控制度、流程得到贯彻执行。风险管理部履行风险量化评估分析职责。

本基金的基金管理人对于金融工具的风险管理方法主要是通过定性分析和定量分析的方法去估测各种风险产生的可能损失。从定性分析的角度出发，判断风险损失的严重程度和出现同类风险损失的频度。而从定量分析的角度出发，根据本基金的投资目标，结合基金资产所运用金融工具特征通过特定的风险量化指标、模型，日常的量化报告，确定风险损失的限度和相应置信程度，及时可靠地对各种风险进行监督、检查和评估，并通过相应决策，将风险控制在可承受的范围内。

### 6.4.9.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息，导致基金资产损失和收益变化的风险。

本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的活期银行存款存放在本基金的托管行中国银行，因而与银行存款相关的信用风险不重大。

本基金在交易所进行的交易均以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，违约风险可能性很小；在银行间同业市场进行交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式进行限制以控制相应的信用风险。

本基金的基金管理人建立了信用风险管理流程，通过对投资品种信用等级评估来控制证券发

行人的信用风险，且通过分散化投资以分散信用风险。

于本期末，本基金持有的除国债、央行票据和政策性金融债以外的债券占基金资产净值的比例为 0.07%（上年度末：0.00%）。

### 6.4.9.3 流动性风险

流动性风险是指在履行与金融负债有关的义务时遇到资金短缺的风险。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难或因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理的价格变现。

#### 6.4.9.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

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

本基金主要投资于交易所及银行间市场内交易的证券的证券，除在附注“期末本基金持有的流通受限证券”中列示的部分基金资产流通暂时受限制外（如有），其余均能及时变现。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券资产的公允价值。除附注“期末债券正回购交易中作为抵押的债券”中列示的卖出回购金融资产款余额（如有）将在 1 个月内到期且计息外，本基金于资产负债表日所持有的金融负债的合同约定剩余到期日均为一年以内且一般不计息，可赎回基金份额净值无固定到期日且不计息，因此账面余额一般即为未折现的合约到期现金流量。本报告期内，本基金未发生重大流动性风险事件。

#### 6.4.9.4 市场风险

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

##### 6.4.9.4.1 利率风险

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

本基金的基金管理人定期对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控，并通过调整投资组合的久期等方法对上述利率风险进行管理。

本基金持有及承担的大部分金融资产和金融负债不计息，因此本基金的收入及经营活动的现金流量在很大程度上独立于市场利率变化。本基金持有的利率敏感性资产主要为银行存款、结算备付金及买入返售金融资产等。

##### 6.4.9.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2021年6月30日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	35,802,738.78	-	-	-	35,802,738.78
结算备付金	2,058,818.57	-	-	-	2,058,818.57
存出保证金	119,133.87	-	-	-	119,133.87
交易性金融资产	-	-	359,682.40	456,592,654.83	456,952,337.23
应收利息	-	-	-	4,529.44	4,529.44
应收申购款	35,229.13	-	-	5,189,885.34	5,225,114.47
应收证券清算款	-	-	-	310,131.22	310,131.22
资产总计	38,015,920.35	-	359,682.40	462,097,200.83	500,472,803.58
负债					
应付赎回款	-	-	-	9,234,364.62	9,234,364.62
应付管理人报酬	-	-	-	635,842.45	635,842.45
应付托管费	-	-	-	105,973.75	105,973.75
应付交易费用	-	-	-	495,835.57	495,835.57
应交税费	-	-	-	2.69	2.69
其他负债	-	-	-	107,606.71	107,606.71
负债总计	-	-	-	10,579,625.79	10,579,625.79
利率敏感度缺口	38,015,920.35	-	359,682.40	451,517,575.04	489,893,177.79
上年度末 2020年12月31日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					

银行存款	10,835,475.45	-	-	-	10,835,475.45
结算备付金	53,956.32	-	-	-	53,956.32
存出保证金	24,451.43	-	-	-	24,451.43
交易性金融资产	480,951.90	-	-	97,928,899.57	98,409,851.47
应收利息	-	-	-	11,531.70	11,531.70
应收申购款	25.84	-	-	412,939.06	412,964.90
应收证券清算款	-	-	-	8,744.61	8,744.61
资产总计	11,394,860.94	-	-	98,362,114.94	109,756,975.88
负债					
应付赎回款	-	-	-	1,209,332.81	1,209,332.81
应付管理人报酬	-	-	-	135,106.35	135,106.35
应付托管费	-	-	-	22,517.71	22,517.71
应付交易费用	-	-	-	55,855.07	55,855.07
其他负债	-	-	-	34,367.15	34,367.15
负债总计	-	-	-	1,457,179.09	1,457,179.09
利率敏感度缺口	11,394,860.94	-	-	96,904,935.85	108,299,796.79

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

#### 6.4.9.4.1.2 利率风险的敏感性分析

于本期末，本基金持有的交易性债券投资占基金资产净值的比例为 0.07% (上年度末：0.44%)，因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响 (上年度末：同)。

#### 6.4.9.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基金持有的金融工具均以人民币计价，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。本基金所面临的其他价格风险来源于单个证券发行主体自身经营情况或特殊事项的影响，也可能来源于证券市场整体波动的影响。

本基金的基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控，定期运用多种定量方法对基金进行风险度量，来测试本基金面临的潜在价格风险，及时可靠地对风险进行跟踪和控制。于 2021 年 6 月 30 日，本基金面临的整体市场价格风险列示如下：

##### 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 2021 年 6 月 30 日		上年度末 2020 年 12 月 31 日	
	公允价值	占基金资产净值比 例 (%)	公允价值	占基金资产净值 比例 (%)
交易性金融资产—股票投资	456,592,654.83	93.20	97,928,899.57	90.42
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	456,592,654.83	93.20	97,928,899.57	90.42

#### 6.4.9.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除业绩比较基准以外的其他市场变量保持不变		
	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2021 年 6 月 30 日）	上年度末（2020 年 12 月 31 日）
分析	业绩比较基准上升 5%	29,699,956.20	6,636,994.56
	业绩比较基准下降 5%	-29,699,956.20	-6,636,994.56

#### 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	456,592,654.83	91.23
	其中：股票	456,592,654.83	91.23
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	359,682.40	0.07
	其中：债券	359,682.40	0.07
	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	37,861,557.35	7.57
8	其他各项资产	5,658,909.00	1.13
9	合计	500,472,803.58	100.00

## 7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

### 7.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	5,227.62	0.00
B	采矿业	-	-
C	制造业	346,498,124.04	70.73
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	13,020.39	0.00
E	建筑业	12,952.94	0.00
F	批发和零售业	25,548,470.09	5.22
G	交通运输、仓储和邮政业	18,850.59	0.00
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	22,407.83	0.00
J	金融业	34,721.10	0.01
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	19,603,658.69	4.00
N	水利、环境和公共设施管理业	28,866.54	0.01
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	64,806,355.00	13.23
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	456,592,654.83	93.20

### 7.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

无。

## 7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	300363	博腾股份	507,835	42,719,080.20	8.72
2	603392	万泰生物	154,140	39,950,005.20	8.15
3	300896	爱美客	48,980	38,639,342.40	7.89
4	688029	南微医学	110,110	34,320,185.90	7.01
5	000516	国际医学	1,797,500	33,810,975.00	6.90
6	603882	金域医学	194,000	30,995,380.00	6.33
7	605369	拱东医疗	260,040	29,909,800.80	6.11
8	603456	九洲药业	572,942	27,718,369.96	5.66
9	300122	智飞生物	144,119	26,911,340.87	5.49
10	000963	华东医药	554,800	25,526,348.00	5.21
11	300151	昌红科技	790,624	21,299,410.56	4.35
12	300529	健帆生物	236,220	20,399,959.20	4.16
13	603259	药明康德	125,191	19,603,658.69	4.00
14	300595	欧普康视	102,800	10,644,940.00	2.17
15	002612	朗姿股份	193,100	10,431,262.00	2.13
16	688363	华熙生物	37,006	10,282,487.16	2.10
17	002675	东诚药业	353,300	7,444,031.00	1.52
18	002821	凯莱英	19,600	7,302,960.00	1.49
19	300760	迈瑞医疗	14,100	6,768,705.00	1.38
20	300725	药石科技	32,200	5,116,902.00	1.04
21	300630	普利制药	66,473	3,483,185.20	0.71
22	688276	百克生物	14,377	1,503,546.66	0.31
23	688690	纳微科技	3,477	408,547.50	0.08
24	688161	威高骨科	3,069	325,467.45	0.07
25	688269	凯立新材	1,941	270,808.32	0.06
26	688625	呈和科技	2,672	113,907.36	0.02
27	688499	利元亨	2,149	83,488.65	0.02
28	688239	航宇科技	4,926	56,550.48	0.01
29	688087	英科再生	2,469	54,219.24	0.01
30	301020	密封科技	4,210	44,794.40	0.01
31	601528	瑞丰银行	2,230	34,721.10	0.01
32	301021	英诺激光	2,899	27,424.54	0.01
33	300957	贝泰妮	90	22,676.40	0.00
34	001207	联科科技	682	22,581.02	0.00
35	301009	可靠股份	801	22,339.89	0.00
36	001205	盛航股份	577	18,850.59	0.00
37	301015	百洋医药	462	17,939.46	0.00
38	688226	威腾电气	2,693	17,289.06	0.00
39	001208	华菱线缆	1,754	13,558.42	0.00
40	300614	百川畅银	329	13,285.02	0.00



41	300982	苏文电能	286	12,952.94	0.00
42	301013	利和兴	471	12,768.81	0.00
43	603171	税友股份	637	12,230.40	0.00
44	300997	欢乐家	928	12,110.40	0.00
45	301002	崧盛股份	201	11,581.62	0.00
46	300953	震裕科技	106	10,584.10	0.00
47	300996	普联软件	241	10,177.43	0.00
48	003041	真爱美家	349	9,876.70	0.00
49	300962	中金辐照	576	9,429.12	0.00
50	301016	雷尔伟	275	9,069.50	0.00
51	605162	新中港	1,377	8,358.39	0.00
52	300958	建工修复	300	8,166.00	0.00
53	300993	玉马遮阳	410	7,908.90	0.00
54	300961	深水海纳	336	7,415.52	0.00
55	300991	创益通	254	6,733.54	0.00
56	300973	立高食品	57	6,595.47	0.00
57	301011	华立科技	175	5,922.00	0.00
58	300978	东箭科技	430	5,848.00	0.00
59	300956	英力股份	215	5,547.00	0.00
60	300960	通业科技	234	5,396.04	0.00
61	300967	晓鸣股份	453	5,227.62	0.00
62	605011	杭州热电	525	4,662.00	0.00
63	300995	奇德新材	191	4,454.12	0.00
64	300986	志特新材	145	4,432.65	0.00
65	300955	嘉亨家化	96	4,422.72	0.00
66	301007	德迈仕	303	4,375.32	0.00
67	300968	格林精密	362	4,369.34	0.00
68	300981	中红医疗	48	4,338.72	0.00
69	300998	宁波方正	201	4,285.32	0.00
70	300971	博亚精工	151	4,271.79	0.00
71	300975	商络电子	321	4,182.63	0.00
72	301012	扬电科技	170	4,124.20	0.00
73	300992	泰福泵业	200	4,064.00	0.00
74	301010	晶雪节能	218	3,838.98	0.00
75	300963	中洲特材	116	2,608.84	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	300363	博腾股份	34,237,157.05	31.61
2	002612	朗姿股份	30,525,837.00	28.19

3	000516	国际医学	28,267,331.00	26.10
4	300122	智飞生物	27,191,295.22	25.11
5	603392	万泰生物	25,788,696.95	23.81
6	000963	华东医药	24,826,341.02	22.92
7	000739	普洛药业	24,202,167.31	22.35
8	600196	复星医药	22,327,500.10	20.62
9	300482	万孚生物	19,314,088.00	17.83
10	688029	南微医学	18,521,876.36	17.10
11	603259	药明康德	18,450,264.51	17.04
12	605369	拱东医疗	18,241,518.80	16.84
13	300529	健帆生物	17,510,703.20	16.17
14	603456	九洲药业	17,498,216.77	16.16
15	603882	金域医学	17,390,621.00	16.06
16	300151	昌红科技	16,948,591.00	15.65
17	300896	爱美客	14,920,474.00	13.78
18	300871	回盛生物	12,122,827.50	11.19
19	688575	亚辉龙	12,033,176.40	11.11
20	002675	东诚药业	11,783,352.00	10.88
21	300595	欧普康视	10,384,564.60	9.59
22	688363	华熙生物	9,956,246.41	9.19
23	002001	新和成	7,876,909.18	7.27
24	002821	凯莱英	7,578,233.00	7.00
25	300171	东富龙	5,228,562.00	4.83
26	300253	卫宁健康	4,865,040.00	4.49
27	300685	艾德生物	4,728,931.84	4.37
28	300132	青松股份	4,420,044.00	4.08
29	300725	药石科技	4,241,244.40	3.92
30	002223	鱼跃医疗	3,618,946.77	3.34
31	300630	普利制药	3,104,103.04	2.87
32	002332	仙琚制药	2,537,120.00	2.34

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	600196	复星医药	24,828,904.97	22.93
2	000739	普洛药业	22,391,125.90	20.68
3	002612	朗姿股份	21,506,390.93	19.86
4	300482	万孚生物	17,963,178.59	16.59
5	300871	回盛生物	10,410,261.50	9.61
6	688575	亚辉龙	8,333,951.11	7.70
7	600276	恒瑞医药	8,055,582.99	7.44

8	300171	东富龙	7,312,612.00	6.75
9	002001	新和成	6,876,521.90	6.35
10	300685	艾德生物	6,758,233.84	6.24
11	600521	华海药业	6,748,973.61	6.23
12	600529	山东药玻	5,648,543.00	5.22
13	300595	欧普康视	5,588,491.28	5.16
14	603259	药明康德	5,377,780.60	4.97
15	300132	青松股份	4,283,293.00	3.96
16	300253	卫宁健康	4,085,482.00	3.77
17	600763	通策医疗	3,997,793.00	3.69
18	002675	东诚药业	3,647,028.00	3.37
19	002223	鱼跃医疗	3,375,385.00	3.12
20	002821	凯莱英	2,840,945.00	2.62
21	002332	仙琚制药	2,551,927.00	2.36
22	300347	泰格医药	2,481,142.00	2.29

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	495,352,968.30
卖出股票收入（成交）总额	207,448,892.74

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

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	359,682.40	0.07
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	359,682.40	0.07

#### 7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	123109	昌红转债	3,080	359,682.40	0.07

**7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细**

无。

**7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细**

无。

**7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细**

无。

**7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明**

无。

**7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明**

无。

**7.12 投资组合报告附注****7.12.1 基金投资的前十名证券的发行主体本期是否出现被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形**

本基金投资的前十名证券的发行主体本期未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	119,133.87
2	应收证券清算款	310,131.22
3	应收股利	-
4	应收利息	4,529.44
5	应收申购款	5,225,114.47
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	5,658,909.00

## 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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值	占基金资产净值比例 (%)	流通受限情况说明
1	603456	九洲药业	2,427,621.96	0.50	非公开发行

## 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 (%)
56,968	3,530.12	9,765,869.19	4.86	191,338,088.60	95.14

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	111,252.25	0.0553

## 8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

项目	持有基金份额总量的数量区间 (万份)
本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	0~10
本基金基金经理持有本开放式基金	0

## § 9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日 (2014 年 1 月 24 日) 基金份额总额	22,376,979.98
本报告期期初基金份额总额	58,917,116.14
本报告期基金总申购份额	336,620,313.01

减：本报告期基金总赎回份额	194,433,471.36
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	201,103,957.79

## § 10 重大事件揭示

### 10.1 基金份额持有人大会决议

无。

### 10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

一、基金管理人的重大人事变动

基金管理人报告期内无重大人事变动。

二、基金托管人的基金托管部门的重大人事变动

无。

### 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

无。

### 10.4 基金投资策略的改变

本基金投资策略在本报告期内没有重大改变。

### 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

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

### 10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，基金管理人、托管人的托管业务部门及其相关高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

### 10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

#### 10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
中金公司	2	117,213,352.36	16.80%	106,820.18	16.80%	-

华林证券	1	111,991,158.13	16.05%	102,057.46	16.05%	-
东莞证券	1	109,945,679.19	15.76%	100,193.57	15.76%	-
安信证券	2	87,405,260.56	12.53%	79,652.69	12.53%	-
财信证券	1	81,263,741.24	11.65%	74,058.27	11.65%	-
华福证券	1	68,565,990.69	9.83%	62,483.88	9.83%	-
长江证券	2	30,467,880.24	4.37%	27,766.99	4.37%	-
中国银河证 券	1	28,406,451.90	4.07%	25,887.16	4.07%	-
东海证券	1	21,042,430.96	3.02%	19,176.46	3.02%	-
中信建投证 券	1	19,349,073.72	2.77%	17,632.77	2.77%	-
万联证券	1	14,249,353.88	2.04%	12,983.63	2.04%	-
中信证券	2	4,135,187.71	0.59%	3,768.40	0.59%	-
广发证券	1	3,006,876.35	0.43%	2,740.21	0.43%	-
申万宏源	1	638,671.09	0.09%	581.99	0.09%	-
渤海证券	1	-	-	-	-	-
长城证券	1	-	-	-	-	-
东方证券	1	-	-	-	-	-
东吴证券	1	-	-	-	-	-
东兴证券	1	-	-	-	-	-
方正证券	1	-	-	-	-	-
光大证券	2	-	-	-	-	-
广州证券	1	-	-	-	-	-
国都证券	1	-	-	-	-	-
国海证券	1	-	-	-	-	-
国泰君安	1	-	-	-	-	-
国信证券	1	-	-	-	-	-
海通证券	2	-	-	-	-	-
恒泰证券	1	-	-	-	-	-

华宝证券	1	-	-	-	-	-
华泰证券	2	-	-	-	-	-
华西证券	1	-	-	-	-	-
华鑫证券	1	-	-	-	-	-
江海证券	1	-	-	-	-	-
开源证券	1	-	-	-	-	-
民生证券	1	-	-	-	-	-
摩根大通	1	-	-	-	-	-
平安证券	1	-	-	-	-	-
太平洋证券	1	-	-	-	-	-
西南证券	1	-	-	-	-	-
湘财证券	1	-	-	-	-	-
招商证券	3	-	-	-	-	-
中金财富	2	-	-	-	-	-

注：1、根据中国证监会颁布的《关于完善证券投资基金交易席位制度有关问题的通知》（证监基金字[2007]48号）的有关规定，本公司制定了租用证券公司交易单元的选择标准和程序。租用证券公司交易单元的选择标准主要包括：

- （一）财务状况良好，最近一年无重大违规行为；
  - （二）经营行为规范，内控制度健全，能满足各投资组合运作的保密性要求；
  - （三）研究实力较强，能提供包括研究报告、路演服务、协助进行上市公司调研等研究服务；
  - （四）具备各投资组合运作所需的高效、安全的通讯条件，有足够的交易和清算能力，满足各投资组合证券交易需要；
  - （五）能提供投资组合运作、管理所需的其他券商服务；
  - （六）相关基金合同、资产管理合同以及法律法规规定的其他条件。
- 租用证券公司交易单元的程序：首先根据租用证券公司交易单元的选择标准形成《券商服务评价表》，然后根据评分高低进行选择基金交易单元。

2、报告期内租用交易单元变更情况，新增交易单元：摩根大通。退出交易单元：中泰证券。

### 10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

无。



## 10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	关于提请投资者及时更新已过期身份证件或者身份证明文件的公告	中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站	2021 年 6 月 30 日
2	大成基金管理有限公司关于旗下部分基金增加海银基金销售有限公司为销售机构的公告	中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站	2021 年 5 月 27 日
3	大成基金管理有限公司关于旗下部分基金增加腾安基金销售（深圳）有限公司为销售机构的公告	中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站	2021 年 5 月 18 日
4	大成基金管理有限公司关于旗下部分基金增加宁波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	2021 年 5 月 13 日
5	大成健康产业混合型证券投资基金 2021 年第 1 季度报告	中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站	2021 年 4 月 22 日
6	大成基金管理有限公司关于旗下部分基金增加江苏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	2021 年 4 月 12 日
7	大成健康产业混合型证券投资基金 2020 年年度报告	中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站	2021 年 3 月 30 日
8	大成基金管理有限公司提醒投资者谨防金融诈骗的公告	中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站	2021 年 3 月 23 日
9	大成基金管理有限公司关于旗下部分基金增加鼎信汇金（北京）投资管理有限公司为销售机构的公告	中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站	2021 年 3 月 11 日
10	大成健康产业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	2021 年 2 月 24 日
11	大成基金管理有限公司关于旗下基金获配九洲药业（603456）非公开发行 A 股的公告	中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站	2021 年 2 月 19 日
12	大成健康产业混合型证券投资基金第四季度报告	中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站	2021 年 1 月 22 日

## § 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中证 500 沪市交易型开放式指数证券投资基金联接基金的文件；
- 2、《关于大成中证 500 沪市交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金份额持有人大会决议备案的回函》；
- 3、《大成健康产业股票型证券投资基金变更基金名称、基金类别以及修订基金合同部分条款的公告》；
- 4、《大成健康产业混合型证券投资基金基金合同》；
- 5、《大成健康产业混合型证券投资基金托管协议》；
- 6、大成基金管理有限公司批准文件、营业执照、公司章程；
- 7、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住所。

### 12.3 查阅方式

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

大成基金管理有限公司

2021 年 8 月 31 日