

大成睿享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：中国农业银行股份有限公司

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。

基金托管人中国农业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

§ 1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
§ 2 基金简介	5
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人和基金托管人	5
2.4 信息披露方式	6
2.5 其他相关资料	6
§ 3 主要财务指标和基金净值表现	6
3.1 主要会计数据和财务指标	6
3.2 基金净值表现	7
§ 4 管理人报告	9
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	11
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	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	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
§ 5 托管人报告	13
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的真实、准确和完整发表意见	14
§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）	14
6.1 资产负债表	14
6.2 利润表	15
6.3 净资产变动表	16
6.4 报表附注	18
§ 7 投资组合报告	45
7.1 期末基金资产组合情况	45
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	45
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	46
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	54
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	55
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	55
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	56
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	56

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	56
7.10 本基金投资股指期货的投资政策	56
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	56
7.12 投资组合报告附注	56
§ 8 基金份额持有人信息	57
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	57
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	57
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	58
§ 9 开放式基金份额变动	58
§ 10 重大事件揭示	58
10.1 基金份额持有人大会决议	58
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	58
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	59
10.4 基金投资策略的改变	59
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	59
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	59
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	59
10.8 其他重大事件	61
§ 11 影响投资者决策的其他重要信息	63
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	63
11.2 影响投资者决策的其他重要信息	63
§ 12 备查文件目录	63
12.1 备查文件目录	63
12.2 存放地点	63
12.3 查阅方式	63

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	大成睿享混合型证券投资基金	
基金简称	大成睿享混合	
基金主代码	008269	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2019 年 12 月 30 日	
基金管理人	大成基金管理有限公司	
基金托管人	中国农业银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	5,120,818,767.06 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	大成睿享混合 A	大成睿享混合 C
下属分级基金的交易代码	008269	008270
报告期末下属分级基金的份额总额	3,478,247,030.30 份	1,642,571,736.76 份

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金在有效控制组合风险并保持良好流动性的前提下，通过专业化行业深度研究分析，力争实现基金资产的长期稳定增值。
投资策略	<p>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。</p> <p>（一）大类资产配置策略</p> <p>本基金将根据基金管理人对宏观经济、市场面、政策面等因素的分析，结合各类资产的市场发展趋势和预期收益风险的比较判别，对股票、债券及现金等大类资产的配置比例进行动态调整，以期在投资中达到风险和收益的优化平衡。</p> <p>（二）股票投资策略</p> <p>本基金将结合定性与定量分析，充分发挥基金管理人研究团队和投资团队“自下而上”的主动选股能力，基金经理在对行业发展进行研究的基础上，通过定性与定量相结合的分析方法，选择在行业内具有发展潜力的公司进行投资。</p>
业绩比较基准	沪深 300 指数收益率*60%+中证综合债券指数收益率*30%+恒生指数收益率*10%
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。

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	中国农业银行股份有限公司
信息披露 姓名	段皓静	任航

负责人	联系电话	0755-83183388	010-66060069
	电子邮箱	office@dcfund.com.cn	tgxxpl@abchina.com
客户服务电话		4008885558	95599
传真		0755-83199588	010-68121816
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 层、27-33 层	北京市东城区建国门内大街 69 号
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 28 号凯晨世贸中心东座 F9
邮政编码		518054	100031
法定代表人		吴庆斌	谷澍

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	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)	
	大成睿享混合 A	大成睿享混合 C
本期已实现收益	29,734,284.88	9,912,754.82
本期利润	21,429,445.62	18,107,452.70
加权平均基金份 额本期利润	0.0062	0.0106
本期加权平均净 值利润率	0.46%	0.81%
本期基金份额净 值增长率	0.65%	0.45%
3.1.2 期末数	报告期末(2024 年 6 月 30 日)	

据和指标		
期末可供分配利润	1,180,963,540.85	518,966,510.22
期末可供分配基金份额利润	0.3395	0.3159
期末基金资产净值	4,659,210,571.15	2,161,538,246.98
期末基金份额净值	1.3395	1.3159
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	57.20%	54.43%

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

大成睿享混合 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	-3.40%	0.65%	-1.92%	0.32%	-1.48%	0.33%
过去三个月	-0.64%	0.73%	-0.01%	0.51%	-0.63%	0.22%
过去六个月	0.65%	0.89%	2.26%	0.62%	-1.61%	0.27%
过去一年	-6.64%	0.76%	-4.71%	0.62%	-1.93%	0.14%
过去三年	18.11%	0.79%	-21.20%	0.75%	39.31%	0.04%
自基金合同生效起至今	57.20%	0.85%	-5.33%	0.81%	62.53%	0.04%

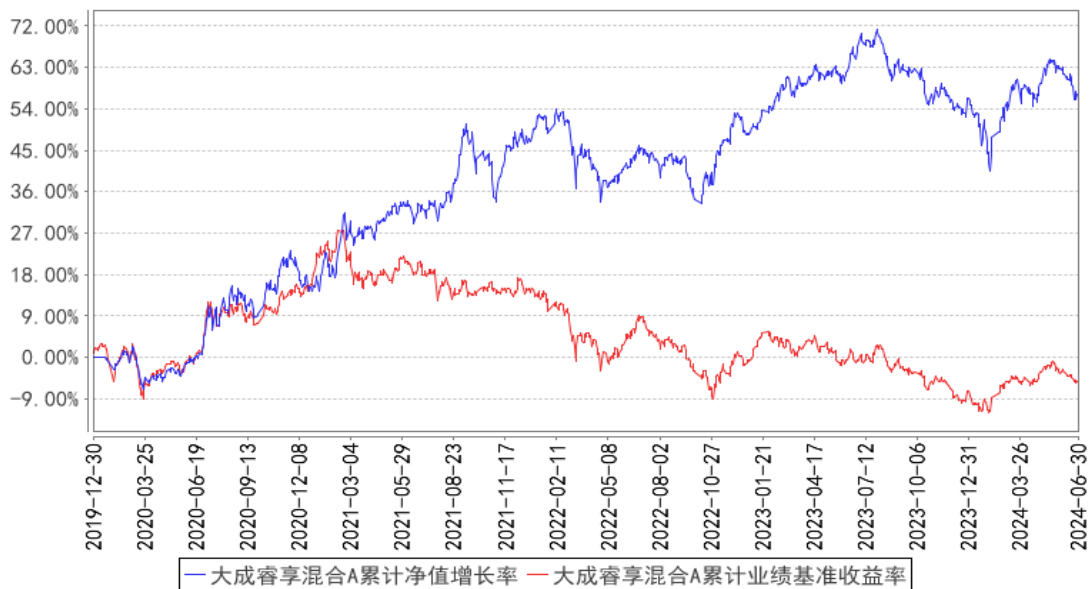
大成睿享混合 C

阶段	份额净值增长	份额净值增长率标准差	业绩比较基准收益	业绩比较基准收益率标准差	①-③	②-④
----	--------	------------	----------	--------------	-----	-----

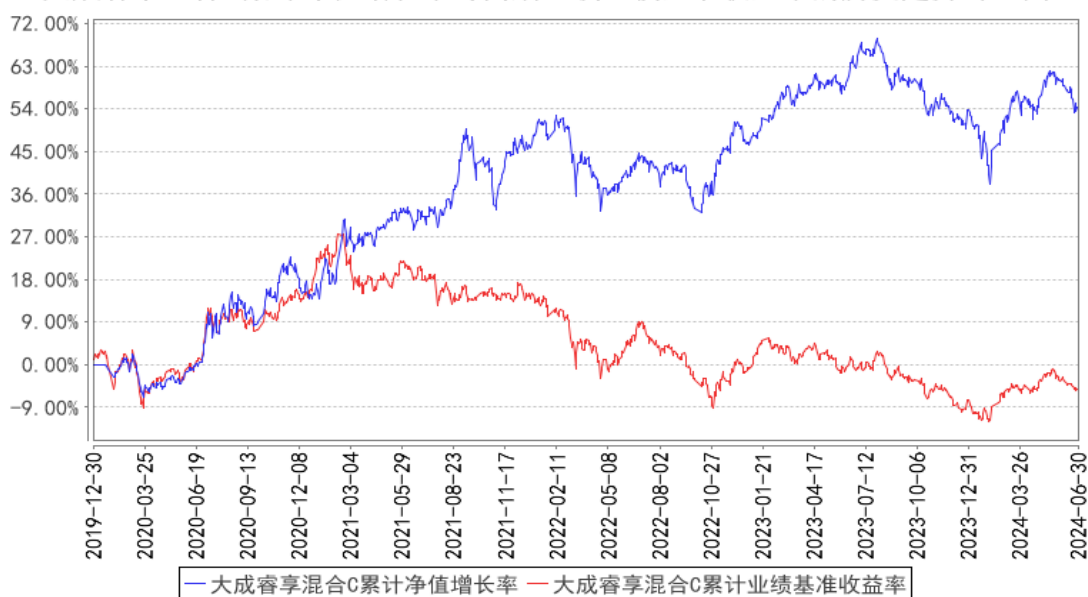
	率①	准差②	率③	④		
过去一个月	-3.43%	0.65%	-1.92%	0.32%	-1.51%	0.33%
过去三个月	-0.74%	0.73%	-0.01%	0.51%	-0.73%	0.22%
过去六个月	0.45%	0.89%	2.26%	0.62%	-1.81%	0.27%
过去一年	-7.01%	0.76%	-4.71%	0.62%	-2.30%	0.14%
过去三年	16.71%	0.79%	-21.20%	0.75%	37.91%	0.04%
自基金合同生效 起至今	54.43%	0.85%	-5.33%	0.81%	59.76%	0.04%

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

大成睿享混合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



大成睿享混合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		
徐彦	本基金基金经理，首席权益投资官	2019 年 12 月 30 日	-	18 年	复旦大学管理学硕士。2006 年 9 月至 2007 年 7 月任职于中国东方资产管理公司。2007 年 7 月至 2018 年 9 月任职于大成基金管理有限公司，先后担任研究员、研究主管、股票投资部价值组投资总监，2012 年 10 月起历任大成策略回报混合型证券投资基金、大成竞争优势混合型证券投资基金、大成高新技术产业股票型证券投资基金和大成景阳领先混合型证券投资基金基金经理。2018 年 10 月至 2019 年 7 月任正心谷创新资本研究团队负责人。2019 年 8 月至 2021 年 2 月任大成基金管理有限公司股票投资部总监。2021 年 2 月起任首席权益投资官。2019 年 12 月 30 日起任大成睿享混合型证券投资基金、大成竞争优势混合型证券投资基金基金经理。2019 年 12 月 30 日至 2021 年 5 月 19 日任大成景阳领先混合型证券投资基金基金经理。2020 年 3 月 20 日起任大成策略回报混合型证券投资基金基金经理。2020 年 7 月 16 日至 2021 年 8 月 18 日任大成创业板两年定期开放混合型证券投资基金基金经理。2021 年 7 月 16 日起任大成投资严选六个月持有期混合型证券投资基金基金经理。2021 年 11 月 26 日起任大成致远优势一年持有期混合型证券投资基金基金经理。2022 年 9 月 27 日起任大成弘远回报一年持有期混合型证券投资基金基金经理。2024 年 6 月 12 日起任大成卓远视野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
徐彦	公募基金	7	15,183,131,580.94	2019 年 12 月 30 日
	私募资产管理计划	2	1,256,878,230.15	2023 年 10 月 25 日
	其他组合	-	-	-
	合计	9	16,440,009,811.09	-

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

如果以报告期内收益率的提升为衡量标准，上半年有两次机会，一次是春节前的机会，一次是二季度低估值大市值公司的机会。

第一次机会更符合我的投资理念，但在最应该买入的时候，我却不敢买，这说明在股市里总会有新的挑战出现。第二次机会不太符合我的理念，我不确定拉到更长时间看如果买了会赚还是亏，但尝试性的相反操作拉低了本组合的收益率。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末大成睿享混合 A 的基金份额净值为 1.3395 元，本报告期基金份额净值增长率为 0.65%，同期业绩比较基准收益率为 2.26%；截至本报告期末大成睿享混合 C 的基金份额净值为 1.3159 元，本报告期基金份额净值增长率为 0.45%，同期业绩比较基准收益率为 2.26%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

概念能助人思考，也能束缚人思考。如果要立刻举出一个例子，“宏观经济”就是这样一个概念。一提到这个概念，每个人都能一下子明白别人在说什么，但越想好像又越不明白别人在说什么。生活中处处是类似这样的概念，每个人只能按自己的理解去解读。

过去几年，我一直很朴素的认为：价格对经济运行有重要的信号意义，但价格信号的形成受到历史和现实条件的制约，其对经济的调节作用在不同区域、不同阶段差异巨大。这大大提升了宏观经济展望的难度。

我将继续像过去几年一样，以谨慎谦卑的态度去做投资。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本基金管理人指导基金估值业务的领导小组为公司估值委员会，公司估值委员会主要负责估值政策和估值程序的制定、修订以及执行情况的监督。估值委员会由公司各投研部门、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验，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

在托管本基金的过程中，本基金托管人中国农业银行股份有限公司严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》相关法律法规的规定以及基金合同、托管协议的约定，对本基金基金管理人——大成基金管理有限公司 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日基金的投资运作，进行了认真、独立的会计核算和必要的投资监督，认真履行了托管人的义务，没有从事任何损害基金份额持有人利益的行为。

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

本托管人认为，大成基金管理有限公司在本基金的投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支及利润分配等问题上，不存在损害基金份额持有人利益的行为；在报告期内，严格遵守了《中华人民共和国证券投资基金法》等有关法律法规，在各重要

方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

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

本托管人认为，大成基金管理有限公司的信息披露事务符合《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》及其他相关法律法规的规定，基金管理人所编制和披露的本基金中期报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告等信息真实、准确、完整，未发现有损害基金持有人利益的行为。

§ 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：大成睿享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
资产：			
货币资金	6.4.7.1	1,704,269,139.64	2,241,400,979.20
结算备付金		54,126,839.59	64,912,943.82
存出保证金		292,005.37	512,076.47
交易性金融资产	6.4.7.2	4,347,334,365.64	4,261,096,428.32
其中：股票投资		4,167,844,378.83	4,060,011,592.26
基金投资		-	-
债券投资		179,489,986.81	201,084,836.06
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	707,144,871.25	-
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		7,319,829.75	45,497,411.40
应收股利		5,459,863.59	-
应收申购款		7,058,939.92	6,158,377.05
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.8	-	-
资产总计		6,833,005,854.75	6,619,578,216.26

负债和净资产	附注号	本期末 2024 年 6 月 30 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
负 债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付清算款		-	-
应付赎回款		1,989,589.29	44,595,962.53
应付管理人报酬		6,993,277.17	6,772,466.74
应付托管费		1,165,546.17	1,128,744.45
应付销售服务费		735,554.15	704,603.23
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	1,373,069.84	1,649,390.12
负债合计		12,257,036.62	54,851,167.07
净资产：			
实收基金	6.4.7.10	5,120,818,767.06	4,956,909,928.70
未分配利润	6.4.7.12	1,699,930,051.07	1,607,817,120.49
净资产合计		6,820,748,818.13	6,564,727,049.19
负债和净资产总计		6,833,005,854.75	6,619,578,216.26

注：报告截止日 2024 年 06 月 30 日，基金份额总额 5,120,818,767.06 份，其中大成睿享混合 A 基金份额总额为 3,478,247,030.30 份，基金份额净值 1.3395 元。大成睿享混合 C 基金份额总额为 1,642,571,736.76 份，基金份额净值 1.3159 元。

6.2 利润表

会计主体：大成睿享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
一、营业总收入		91,802,212.58	586,592,305.62
1. 利息收入		9,799,990.92	6,364,567.83
其中：存款利息收入	6.4.7.13	9,496,383.46	6,098,196.86
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		303,607.46	266,370.97

其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		80,332,449.21	334,271,741.63
其中：股票投资收益	6.4.7.14	30,508,294.31	247,067,722.03
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.15	2,442,369.64	1,010,068.19
资产支持证券投资	6.4.7.16	-	-
收益			
贵金属投资收	6.4.7.17	-	-
益			
衍生工具收益	6.4.7.18	-	-2,436,976.36
股利收益	6.4.7.19	47,381,785.26	88,630,927.77
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	-110,141.38	244,287,726.08
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	1,779,913.83	1,668,270.08
减：二、营业总支出		52,265,314.26	40,707,954.35
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	40,810,245.75	32,907,486.49
其中：暂估管理人报酬		-	-
2. 托管费	6.4.10.2.2	6,801,707.53	5,484,581.11
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	4,442,905.04	2,101,825.84
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	210,455.94	214,060.91
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		39,536,898.32	545,884,351.27
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		39,536,898.32	545,884,351.27
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		39,536,898.32	545,884,351.27

6.3 净资产变动表

会计主体：大成睿享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	4,956,909,928.70	-	1,607,817,120.49	6,564,727,049.19
二、本期期初净资产	4,956,909,928.70	-	1,607,817,120.49	6,564,727,049.19
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	163,908,838.36	-	92,112,930.58	256,021,768.94
(一)、综合收益总额	-	-	39,536,898.32	39,536,898.32
(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)	163,908,838.36	-	52,576,032.26	216,484,870.62
其中：1. 基金申购款	1,815,422,183.88	-	568,395,680.59	2,383,817,864.47
2. 基金赎回款	-1,651,513,345.52	-	-515,819,648.33	-2,167,332,993.85
(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	5,120,818,767.06	-	1,699,930,051.07	6,820,748,818.13
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	2,524,129,342.49	-	671,569,091.67	3,195,698,434.16

二、本期期初净资产	2,524,129,342.49	-	671,569,091.67	3,195,698,434.16
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	2,171,427,867.03	-	1,341,943,253.07	3,513,371,120.10
(一)、综合收益总额	-	-	545,884,351.27	545,884,351.27
(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)	2,171,427,867.03	-	796,058,901.80	2,967,486,768.83
其中：1. 基金申购款	3,153,907,101.94	-	1,135,318,187.45	4,289,225,289.39
2. 基金赎回款	-982,479,234.91	-	-339,259,285.65	-1,321,738,520.56
(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	4,695,557,209.52	-	2,013,512,344.74	6,709,069,554.26

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

基金管理人负责人

范瑛

主管会计工作负责人

梁靖

会计机构负责人

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

大成睿享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[2019]2075号文“关于准予大成睿享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《大成睿享混

合型证券投资基金基金合同》作为发起人向社会公开募集，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(2019)验字第 60469430_H09 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 2019 年 12 月 30 日生效。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，注册登记机构为本基金管理人，基金托管人为中国农业银行股份有限公司（以下简称“中国农业银行”）。

本基金 A 类和 C 类基金份额分别设置代码。由于两类份额的收费方式不同，本基金 A 类基金份额和 C 类基金份额将分别计算基金份额净值并公告。A 类份额收取申购、赎回费；C 类份额从本类别基金资产中计提销售服务费、不收取认购/申购费用，但对持有期限少于 30 日的本类别基金份额的赎回收取赎回费。

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、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。本基金可参与融资业务。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：本基金股票、存托凭证投资占基金资产的比例范围为 60%–95%（其中港股通标的股票最高投资比例不得超过股票资产的 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；股指期货、国债期货的投资比例遵循国家相关法律法规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%+中证综合债券指数收益率×30%+恒生指数收益率×10%。

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	1,704,269,139.64
等于：本金	1,703,806,101.62
加：应计利息	463,038.02
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	1,704,269,139.64

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	4,618,614,088.64	-	4,167,844,378.83	- 450,769,709.81
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	-
债券	交易所市场	-	-	-
	银行间市场	179,387,080.00	119,986.81	179,489,986.81 -17,080.00
	合计	179,387,080.00	119,986.81	179,489,986.81 -17,080.00
资产支持证券	-	-	-	-
基金	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	4,798,001,168.64	119,986.81	4,347,334,365.64	- 450,786,789.81

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

单位：人民币元

项目	本期末 2024年6月30日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	-	-
银行间市场	707,144,871.25	-
合计	707,144,871.25	-

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	872.09
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	1,238,580.83
其中：交易所市场	1,232,197.33
银行间市场	6,383.50
应付利息	-
预提费用	133,616.92
合计	1,373,069.84

6.4.7.10 实收基金

金额单位：人民币元

大成睿享混合 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	3,407,811,374.52	3,407,811,374.52
本期申购	908,735,472.09	908,735,472.09
本期赎回（以“-”号填列）	-838,299,816.31	-838,299,816.31
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	3,478,247,030.30	3,478,247,030.30

大成睿享混合 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	1,549,098,554.18	1,549,098,554.18
本期申购	906,686,711.79	906,686,711.79
本期赎回（以“-”号填列）	-813,213,529.21	-813,213,529.21
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	1,642,571,736.76	1,642,571,736.76

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

大成睿享混合 A

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	1,791,497,564.02	-663,963,064.07	1,127,534,499.95
本期期初	1,791,497,564.02	-663,963,064.07	1,127,534,499.95
本期利润	29,734,284.88	-8,304,839.26	21,429,445.62
本期基金份额交易产生的变动数	36,446,357.22	-4,446,761.94	31,999,595.28
其中：基金申购款	475,337,378.58	-174,483,617.03	300,853,761.55
基金赎回款	-438,891,021.36	170,036,855.09	-268,854,166.27
本期已分配利润	-	-	-
本期末	1,857,678,206.12	-676,714,665.27	1,180,963,540.85

大成睿享混合 C

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	779,020,078.96	-298,737,458.42	480,282,620.54
本期期初	779,020,078.96	-298,737,458.42	480,282,620.54
本期利润	9,912,754.82	8,194,697.88	18,107,452.70
本期基金份额交易产生的变动数	46,332,426.04	-25,755,989.06	20,576,436.98
其中：基金申购款	451,473,445.84	-183,931,526.80	267,541,919.04
基金赎回款	-405,141,019.80	158,175,537.74	-246,965,482.06
本期已分配利润	-	-	-
本期末	835,265,259.82	-316,298,749.60	518,966,510.22

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	8,952,458.12
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	540,694.33
其他	3,231.01
合计	9,496,383.46

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	30,508,294.31
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	30,508,294.31

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	1,314,600,058.47
减：卖出股票成本总额	1,280,278,557.05
减：交易费用	3,813,207.11

买卖股票差价收入	30,508,294.31
----------	---------------

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

单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年6月30日
债券投资收益——利息收入	1,635,839.63
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	806,530.01
债券投资收益——赎回差价收入	-
债券投资收益——申购差价收入	-
合计	2,442,369.64

6.4.7.15.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年6月30日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	891,486,858.89
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	887,975,020.00
减：应计利息总额	2,698,058.88
减：交易费用	7,250.00
买卖债券差价收入	806,530.01

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	47,381,785.26
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	47,381,785.26

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	-110,141.38
股票投资	192,038.62
债券投资	-302,180.00
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	-110,141.38

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	1,404,870.47
基金转换费收入	375,043.36
合计	1,779,913.83

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	64,644.58
信息披露费	59,672.34
证券出借违约金	-
深港通证券组合费	41,551.90
银行划款手续费	25,987.12
账户维护费	18,600.00
合计	210,455.94

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
中国农业银行股份有限公司(“中国农业银行”)	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	533,641,673.02	19.76	1,149,441,534.36	19.80

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	443,110.56	18.42	315,611.44	25.61
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	929,741.01	17.98	741,547.94	22.57

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 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
当期发生的基金应支付的管理费	40,810,245.75	32,907,486.49
其中：应支付销售机构的客户维护费	10,783,520.84	6,420,726.12
应支付基金管理人的净管理费	30,026,724.91	26,486,760.37

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 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
当期发生的基金应支付的托管费	6,801,707.53	5,484,581.11

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	本期 2024年1月1日至2024年6月30日

关联方名称	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	大成睿享混合 A	大成睿享混合 C	合计
大成基金	-	1,545,128.46	1,545,128.46
光大证券	-	587.01	587.01
中国农业银行	-	82,522.93	82,522.93
合计	-	1,628,238.40	1,628,238.40
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		
	大成睿享混合 A	大成睿享混合 C	合计
大成基金	-	934,025.71	934,025.71
光大证券	-	673.54	673.54
中国农业银行	-	17,534.16	17,534.16
合计	-	952,233.41	952,233.41

注：销售服务费每日计提，按月支付。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费率 0.40%，本基金销售服务费将专门用于本基金的销售与基金份额持有人服务。销售服务费按前一日 C 类基金资产净值的 0.40% 年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 0.40\% / \text{当年天数}$$

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

份额单位：份

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日
	大成睿享混合 A	大成睿享混合 C
基金合同生效日（2019 年 12 月 30 日）持有的基金份额	-	-
报告期初持有的基金份额	16,356,415.41	-
报告期间申购/买入总份额	-	-
报告期间因拆分变动份额	-	-
减：报告期间赎回/卖出总份额	-	-
报告期末持有的基金份额	16,356,415.41	-
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	0.32%	-
项目	上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 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
	大成睿享混合 A	大成睿享混合 C
基金合同生效日（2019 年 12 月 30 日）持有的基金份额	-	-
报告期初持有的基金份额	16,356,415.41	-
报告期间申购/买入总份额	-	-
报告期间因拆分变动份额	-	-
减：报告期间赎回/卖出总份额	-	-
报告期末持有的基金份额	16,356,415.41	-
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	0.35%	-

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。

6.4.10.5.2 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
中国农业银行	1,704,269,139.64	8,952,458.12	2,088,598,371.85	5,621,038.97

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	2024	6个月	新	16.16	32.27	481	7,772.96	15,521.87	-

	宸科技	年3月20日		股锁定						
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	2024	6个月	新	16.20	15.96	1,258	20,379.60	20,077.68	-

	兴股份	年1月11日		股锁定						
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	2024	6个月	新	23.35	25.13	178	4,156.30	4,473.14	-

	臻股份	年6月19日		股锁定						
688530	欧莱新材	2024年4月29日	6个月	新股锁定	9.60	16.10	344	3,302.40	5,538.40	-
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	-
688717	艾罗能源	2023年12月26日	6个月	新股锁定	55.66	47.02	11,303	629,124.98	531,467.06	-

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之内。

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农业银行股份有限公司，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，本基金未持有除国债、央行票据和政策性金融债以外的债券(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。

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未来现金流量受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。

本基金持有交易所及银行间同业市场交易的固定收益品种，因此存在相应的利率风险。本基金持有的利率敏感性资产主要为银行存款、结算备付金、债券投资等。

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	1,704,269,139.64	-	-	-	1,704,269,139.64
结算备付金	54,126,839.59	-	-	-	54,126,839.59
存出保证金	292,005.37	-	-	-	292,005.37
交易性金融资产	179,489,986.81	-	-	4,167,844,378.83	4,347,334,365.64
买入返售金融资产	707,144,871.25	-	-	-	707,144,871.25
应收股利	-	-	-	5,459,863.59	5,459,863.59
应收申购款	-	-	-	7,058,939.92	7,058,939.92
应收清算款	-	-	-	7,319,829.75	7,319,829.75
资产总计	2,645,322,842.66	-	-	4,187,683,012.09	6,833,005,854.75
负债					
应付赎回款	-	-	-	1,989,589.29	1,989,589.29
应付管理人报酬	-	-	-	6,993,277.17	6,993,277.17
应付托管费	-	-	-	1,165,546.17	1,165,546.17
应付销售服务费	-	-	-	735,554.15	735,554.15
其他负债	-	-	-	1,373,069.84	1,373,069.84
负债总计	-	-	-	12,257,036.62	12,257,036.62
利率敏感度缺口	2,645,322,842.66	-	-	4,175,425,975.47	6,820,748,818.13
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	2,241,400,979.20	-	-	-	2,241,400,979.20
结算备付金	64,912,943.82	-	-	-	64,912,943.82
存出保证金	512,076.47	-	-	-	512,076.47
交易性金融资产	201,084,836.06	-	-	4,060,011,592.26	4,261,096,428.32
应收申购款	-	-	-	6,158,377.05	6,158,377.05

应收清算款	-	-	-	45,497,411.40	45,497,411.40
资产总计	2,507,910,835.55	-	-	4,111,667,380.71	6,619,578,216.26
负债					
应付赎回款	-	-	-	44,595,962.53	44,595,962.53
应付管理人报酬	-	-	-	6,772,466.74	6,772,466.74
应付托管费	-	-	-	1,128,744.45	1,128,744.45
应付销售服务费	-	-	-	704,603.23	704,603.23
其他负债	-	-	-	1,649,390.12	1,649,390.12
负债总计	-	-	-	54,851,167.07	54,851,167.07
利率敏感度缺口	2,507,910,835.55	-	-	4,056,816,213.64	6,564,727,049.19

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。

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	除市场利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）
	市场利率上升 25 个基点	-93,038.70	-366,946.59
市场利率下降 25 个基点	93,135.33	368,309.50	

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。本基金持有不以记账本位币计价的资产，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	-	960,820,205.14	-	960,820,205.14
资产合计	-	960,820,205.14	-	960,820,205.14
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	-	960,820,205.14	-	960,820,205.14
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	-	1,122,480,323.82	-	1,122,480,323.82
资产合计	-	1,122,480,323.82	-	1,122,480,323.82
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	-	1,122,480,323.82	-	1,122,480,323.82

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%	48,041,010.26	56,124,016.20
所有外币相对人民币贬值 5%	-48,041,010.26	-56,124,016.20	

6.4.13.4.3 其他价格风险

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

本基金投资组合的资产配置范围为：股票、存托凭证投资占基金资产的比例范围为 60%-95%（其中港股通标的股票最高投资比例不得超过股票资产的 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；股指期货、国债期货的投资比例遵循国家相关法律法规。

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	4,167,844,378.83	61.11	4,060,011,592.26	61.85
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	4,167,844,378.83	61.11	4,060,011,592.26	61.85

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%	405,080,793.36	254,258,246.36

	业绩比较基准下降 5%	-405,080,793.36	-254,258,246.36
--	----------------	-----------------	-----------------

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	4,166,819,042.53	4,058,377,991.97
第二层次	179,535,597.92	201,983,578.08
第三层次	979,725.19	734,858.27
合计	4,347,334,365.64	4,261,096,428.32

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	4,167,844,378.83	61.00
	其中：股票	4,167,844,378.83	61.00
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	179,489,986.81	2.63
	其中：债券	179,489,986.81	2.63
	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	707,144,871.25	10.35
	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	1,758,395,979.23	25.73
8	其他各项资产	20,130,638.63	0.29
9	合计	6,833,005,854.75	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 960,820,205.14 元，占期末基金资产净值的比例为 14.09%。

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	23,194,301.70	0.34
B	采矿业	38,012,637.32	0.56
C	制造业	2,340,301,045.25	34.31
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	8,483,988.73	0.12
E	建筑业	48,987.00	0.00
F	批发和零售业	53,267,972.70	0.78
G	交通运输、仓储和邮政业	516,044,457.94	7.57
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	104,777,513.15	1.54

J	金融业	101,720.30	0.00
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	24,081.24	0.00
M	科学研究和技术服务业	119,942,739.32	1.76
N	水利、环境和公共设施管理业	203,332.29	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	2,488,960.97	0.04
R	文化、体育和娱乐业	132,435.78	0.00
S	综合	-	-
	合计	3,207,024,173.69	47.02

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	33,151,236.40	0.49
非必需消费品	38,460.34	0.00
必需消费品	251,969,408.75	3.69
能源	214,690,410.04	3.15
金融	-	-
房地产	171,729.87	0.00
医疗保健	66,758,758.34	0.98
工业	183,500,520.22	2.69
材料	17,428.76	0.00
科技	209,266,673.98	3.07
公用事业	1,255,578.44	0.02
政府	-	-
合计	960,820,205.14	14.09

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（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	000063	中兴通讯	10,560,963	295,390,135.11	4.33
1	00763	中兴通讯	13,266,200	209,222,704.79	3.07
2	601333	广深铁路	90,132,401	292,028,979.24	4.28
2	00525	广深铁路股份	64,024,000	123,878,859.56	1.82
3	603296	华勤技术	5,155,301	284,727,274.23	4.17
4	600741	华域汽车	13,932,130	228,208,289.40	3.35
5	03800	协鑫科技	199,811,000	211,541,664.04	3.10
6	00001	长和	5,196,000	177,361,469.47	2.60
7	601919	中远海控	6,713,396	103,990,504.04	1.52
7	01919	中远海控	4,782,000	59,618,192.48	0.87

8	000739	普洛药业	11,352,647	154,055,419.79	2.26
9	002075	沙钢股份	37,951,897	143,078,651.69	2.10
10	002841	视源股份	4,345,800	128,331,474.00	1.88
11	600562	国睿科技	8,697,860	118,812,767.60	1.74
12	000661	长春高新	1,293,445	118,699,447.65	1.74
13	601311	骆驼股份	14,062,700	112,782,854.00	1.65
14	300725	药石科技	4,089,533	109,476,798.41	1.61
15	688002	睿创微纳	3,550,912	99,319,008.64	1.46
16	600233	圆通速递	5,643,300	88,317,645.00	1.29
17	600637	东方明珠	14,212,424	86,411,537.92	1.27
18	603237	五芳斋	3,410,051	84,091,857.66	1.23
19	02319	蒙牛乳业	5,839,000	74,607,939.28	1.09
20	002129	TCL 中环	8,353,625	72,258,856.25	1.06
21	01066	威高股份	18,398,400	62,465,688.37	0.92
22	600352	浙江龙盛	6,944,918	59,656,845.62	0.87
23	600998	九州通	10,749,200	52,456,096.00	0.77
24	000880	潍柴重机	6,322,442	50,516,311.58	0.74
25	603337	杰克股份	1,605,357	42,252,996.24	0.62
26	603600	永艺股份	3,674,700	38,363,868.00	0.56
27	600583	海油工程	6,101,960	36,062,583.60	0.53
28	603995	甬金股份	1,985,000	34,777,200.00	0.51
29	00941	中国移动	467,081	32,824,752.51	0.48
30	600111	北方稀土	1,847,800	31,782,160.00	0.47
31	601369	陕鼓动力	3,623,900	29,063,678.00	0.43
32	300193	佳士科技	3,803,610	28,222,786.20	0.41
33	688426	康为世纪	1,375,072	25,576,339.20	0.37
34	600598	北大荒	1,857,000	23,193,930.00	0.34
35	600802	福建水泥	6,097,300	16,950,494.00	0.25
36	300773	拉卡拉	1,349,400	16,773,042.00	0.25
37	688056	莱伯泰科	682,207	15,117,707.12	0.22
38	603056	德邦股份	972,331	12,737,536.10	0.19
39	603301	振德医疗	574,300	11,979,898.00	0.18
40	605376	博迁新材	466,600	10,531,162.00	0.15
41	300981	中红医疗	1,088,623	10,418,122.11	0.15
42	688222	成都先导	906,549	10,289,331.15	0.15
43	603967	中创物流	1,092,200	10,157,460.00	0.15
44	601006	大秦铁路	1,203,300	8,615,628.00	0.13
45	600116	三峡水利	1,226,200	8,460,780.00	0.12
46	002318	久立特材	355,900	8,303,147.00	0.12
47	603989	艾华集团	577,100	8,114,026.00	0.12
48	688428	诺诚健华	427,573	3,467,617.03	0.05
48	09969	诺诚健华	826,937	3,637,793.11	0.05
49	002434	万里扬	1,385,800	6,790,420.00	0.10

50	688658	悦康药业	376,132	6,710,194.88	0.10
51	600884	杉杉股份	737,400	5,987,688.00	0.09
52	600597	光明乳业	716,415	5,566,544.55	0.08
53	300531	优博讯	531,400	5,537,188.00	0.08
54	300318	博晖创新	913,500	4,457,880.00	0.07
55	603182	嘉华股份	384,200	4,041,784.00	0.06
56	835185	贝特瑞	206,757	3,800,193.66	0.06
57	301063	海锅股份	228,200	3,272,388.00	0.05
58	02883	中海油田服务	460,000	3,148,746.00	0.05
59	605338	巴比食品	192,800	2,554,600.00	0.04
60	603882	金域医学	84,400	2,294,836.00	0.03
61	002661	克明食品	305,300	2,280,591.00	0.03
62	688162	巨一科技	111,763	2,177,143.24	0.03
63	300171	东富龙	155,600	1,850,084.00	0.03
64	688076	诺泰生物	17,910	1,401,994.80	0.02
65	01193	华润燃气	50,300	1,255,578.44	0.02
66	600188	兖矿能源	44,600	1,013,758.00	0.01
67	000651	格力电器	24,907	976,852.54	0.01
68	300445	康斯特	57,520	926,072.00	0.01
69	688443	智翔金泰	30,329	901,984.46	0.01
70	603727	博迈科	66,604	876,508.64	0.01
71	688717	艾罗能源	16,147	761,799.26	0.01
72	06855	亚盛医药-B	28,000	652,931.27	0.01
73	688129	东来技术	51,058	637,714.42	0.01
74	603601	再升科技	228,700	631,212.00	0.01
75	688469	芯联集成	137,994	546,456.24	0.01
76	301589	诺瓦星云	2,486	475,453.44	0.01
77	600104	上汽集团	31,300	433,818.00	0.01
78	301260	格力博	31,202	424,971.24	0.01
79	688692	达梦数据	1,745	382,889.35	0.01
80	603612	索通发展	29,108	371,418.08	0.01
81	301165	锐捷网络	10,769	321,346.96	0.00
82	603567	珍宝岛	29,800	313,794.00	0.00
83	301498	乖宝宠物	5,531	297,567.80	0.00
84	688549	中巨芯	42,933	289,797.75	0.00
85	600511	国药股份	9,200	283,268.00	0.00
86	601061	中信金属	40,154	275,857.98	0.00
87	688507	索辰科技	5,643	274,249.80	0.00
88	688531	日联科技	5,017	231,584.72	0.00
89	301487	盟固利	8,662	223,999.32	0.00
90	688702	盛科通信	5,488	222,264.00	0.00
91	688249	晶合集成	14,562	213,624.54	0.00
92	601033	永兴股份	12,577	203,332.29	0.00

93	301511	德福科技	13,738	202,772.88	0.00
94	688709	成都华微	10,448	201,301.51	0.00
95	301367	怡和嘉业	3,121	194,126.20	0.00
96	301559	中集环科	13,144	191,508.08	0.00
97	688321	微芯生物	10,825	190,520.00	0.00
98	301325	曼恩斯特	4,363	185,078.46	0.00
99	03690	美团-W	1,800	182,517.75	0.00
100	688570	天玛智控	8,837	180,186.43	0.00
101	301371	敷尔佳	5,637	175,085.22	0.00
102	301565	中仑新材	7,103	174,381.42	0.00
103	00081	中国海外宏洋集团	96,000	171,729.87	0.00
104	301303	真兰仪表	14,804	170,542.08	0.00
105	301536	星辰科技	4,809	167,218.27	0.00
106	301293	三博脑科	4,321	162,858.49	0.00
107	688652	京仪装备	4,157	162,497.13	0.00
108	601096	宏盛华源	39,171	160,209.39	0.00
109	688410	山外山	7,231	154,020.30	0.00
110	301391	卡莱特	3,458	151,391.24	0.00
111	301538	骏鼎达	1,493	151,048.04	0.00
112	301525	儒竞科技	2,660	149,704.80	0.00
113	603916	苏博特	22,100	148,291.00	0.00
114	301345	涛涛车业	2,652	146,125.20	0.00
115	301387	光大同创	4,298	143,983.00	0.00
116	00762	中国联通	22,000	143,966.14	0.00
117	301421	波长光电	3,315	143,307.45	0.00
118	600060	海信视像	5,600	138,544.00	0.00
119	301468	博盈特焊	5,979	138,294.27	0.00
120	301310	鑫宏业	5,725	137,972.50	0.00
121	688576	西山科技	2,395	137,377.20	0.00
122	301509	金凯生科	3,720	135,333.60	0.00
123	301307	美利信	6,865	134,416.70	0.00
124	688591	泰凌微	6,806	133,057.30	0.00
125	300788	中信出版	5,338	132,435.78	0.00
126	301381	赛维时代	5,710	129,788.30	0.00
127	688472	阿特斯	12,522	127,473.96	0.00
128	301558	三态股份	14,578	122,309.42	0.00
129	601083	锦江航运	12,630	120,742.80	0.00
130	301439	泓淋电力	9,486	120,187.62	0.00
131	688173	希荻微	10,813	119,267.39	0.00
132	603341	龙旗科技	2,978	115,638.42	0.00
133	301516	中远通	6,033	112,394.79	0.00
134	301251	威尔高	3,207	110,417.01	0.00
135	301317	鑫磊股份	6,936	107,785.44	0.00

136	301507	民生健康	8,509	107,383.58	0.00
137	688073	毕得医药	3,562	106,076.36	0.00
138	301548	崇德科技	1,959	103,983.72	0.00
139	301398	星源卓镁	2,549	103,361.95	0.00
140	688627	精智达	2,212	102,681.04	0.00
141	301322	绿通科技	5,468	102,634.36	0.00
142	688623	双元科技	1,776	99,864.48	0.00
143	301517	陕西华达	1,841	99,414.00	0.00
144	301332	德尔玛	11,211	99,105.24	0.00
145	301566	达利凯普	5,755	97,662.35	0.00
146	601136	首创证券	4,739	96,959.94	0.00
147	301539	宏鑫科技	3,607	92,654.66	0.00
148	688610	埃科光电	2,747	92,381.61	0.00
149	301489	思泉新材	1,278	90,201.24	0.00
150	301269	华大九天	1,168	89,994.40	0.00
151	301587	中瑞股份	3,056	89,267.06	0.00
152	301591	肯特股份	2,184	88,113.42	0.00
153	301413	安培龙	2,123	87,786.05	0.00
154	002938	鹏鼎控股	2,100	83,496.00	0.00
155	688653	康希通信	6,478	83,436.64	0.00
156	301459	丰茂股份	2,077	82,477.67	0.00
157	688489	三未信安	2,953	78,667.92	0.00
158	301568	思泰克	2,456	78,149.92	0.00
159	688361	中科飞测	1,651	78,092.30	0.00
160	301308	江波龙	819	77,592.06	0.00
161	301429	森泰股份	4,989	76,331.70	0.00
162	601065	江盐集团	8,748	75,845.16	0.00
163	301418	协昌科技	1,886	75,440.00	0.00
164	301315	威士顿	2,253	73,425.27	0.00
165	301261	恒工精密	1,973	73,139.11	0.00
166	688530	欧莱新材	3,437	69,099.55	0.00
167	688720	艾森股份	1,644	66,647.76	0.00
168	688648	中邮科技	3,025	66,066.00	0.00
169	301428	世纪恒通	2,289	65,694.30	0.00
170	301170	锡南科技	2,496	65,020.80	0.00
171	301337	亚华电子	2,318	63,930.44	0.00
172	301528	多浦乐	1,478	63,317.52	0.00
173	688695	中创股份	1,856	63,082.50	0.00
174	301232	飞沃科技	2,300	62,606.00	0.00
175	688512	慧智微	7,209	61,204.41	0.00
176	688573	信宇人	2,844	60,804.72	0.00
177	301578	辰奕智能	1,527	60,423.39	0.00
178	301529	福赛科技	1,816	59,582.96	0.00

179	301588	美新科技	2,568	59,238.22	0.00
180	301505	苏州规划	1,934	58,020.00	0.00
181	603275	众辰科技	1,929	57,870.00	0.00
182	688716	中研股份	2,668	56,561.60	0.00
183	603193	润本股份	3,022	55,574.58	0.00
184	688657	浩辰软件	1,472	54,405.12	0.00
185	688143	长盈通	2,519	53,956.98	0.00
186	301502	华阳智能	1,375	53,673.83	0.00
187	603889	新澳股份	6,820	52,786.80	0.00
188	688651	盛邦安全	1,778	52,006.50	0.00
189	603119	浙江荣泰	2,929	51,901.88	0.00
190	600362	江西铜业	1,900	44,992.00	0.00
190	00358	江西铜业股份	485	6,896.48	0.00
191	001301	尚太科技	1,164	50,308.08	0.00
192	688420	美腾科技	2,408	49,797.44	0.00
193	603381	永臻股份	1,778	49,273.14	0.00
194	300804	广康生化	2,257	49,202.60	0.00
195	600031	三一重工	2,810	46,365.00	0.00
196	603325	博隆技术	660	45,347.28	0.00
197	600925	苏能股份	8,960	45,248.00	0.00
198	603344	星德胜	1,813	42,892.99	0.00
199	600897	厦门空港	3,390	42,747.90	0.00
200	02018	瑞声科技	1,500	42,028.91	0.00
201	603062	麦加芯彩	1,258	41,778.18	0.00
202	001359	平安电工	1,833	40,513.63	0.00
203	688450	光格科技	1,662	40,453.08	0.00
204	603270	金帝股份	1,943	38,549.12	0.00
205	02333	长城汽车	3,500	38,460.34	0.00
206	001328	登康口腔	1,445	36,558.50	0.00
207	001326	联域股份	986	35,357.96	0.00
208	001306	夏厦精密	631	34,067.69	0.00
209	603312	西典新能	1,296	33,263.00	0.00
210	603004	鼎龙科技	1,948	33,018.60	0.00
211	603273	天元智能	1,772	32,516.20	0.00
212	688631	莱斯信息	521	32,312.42	0.00
213	603082	北自科技	1,070	32,276.55	0.00
214	603075	热威股份	1,812	31,981.80	0.00
215	301267	华夏眼科	1,509	31,266.48	0.00
216	301095	广立微	740	30,428.80	0.00
217	002375	亚厦股份	9,000	29,250.00	0.00
218	001379	腾达科技	2,128	29,183.34	0.00
219	603231	索宝蛋白	1,610	27,434.40	0.00
220	603281	江瀚新材	1,208	27,119.60	0.00

221	001239	永达股份	1,887	26,191.56	0.00
222	001358	兴欣新材	1,214	24,911.28	0.00
223	603276	恒兴新材	1,737	24,213.78	0.00
224	603373	安邦护卫	876	24,081.24	0.00
225	603285	键邦股份	1,287	24,002.55	0.00
226	001360	南矿集团	1,762	21,654.98	0.00
227	603350	安乃达	1,051	21,608.56	0.00
228	001311	多利科技	844	20,407.92	0.00
229	301330	熵基科技	902	20,276.96	0.00
230	301389	隆扬电子	1,269	20,050.20	0.00
231	603137	恒尚节能	1,935	19,737.00	0.00
232	001314	亿道信息	508	19,522.44	0.00
233	001367	海森药业	813	18,975.42	0.00
234	301327	华宝新能	315	18,049.50	0.00
235	300750	宁德时代	99	17,822.97	0.00
236	601022	宁波远洋	1,983	17,490.06	0.00
237	688557	兰剑智能	698	16,179.64	0.00
238	833346	威贸电子	1,300	15,249.00	0.00
239	001376	百通能源	804	14,970.48	0.00
240	301195	北路智控	495	14,721.30	0.00
241	601121	宝地矿业	2,532	14,407.08	0.00
242	301356	天振股份	1,105	14,298.70	0.00
243	301377	鼎泰高科	770	13,513.50	0.00
244	688256	寒武纪	66	13,112.22	0.00
245	301363	美好医疗	445	12,905.00	0.00
246	603173	福斯达	588	12,765.48	0.00
247	603153	上海建科	740	12,513.40	0.00
248	300406	九强生物	801	12,319.38	0.00
249	301139	元道通信	566	12,174.66	0.00
250	002327	富安娜	1,205	12,110.25	0.00
251	301223	中荣股份	815	11,988.65	0.00
252	603190	亚通精工	470	10,791.20	0.00
253	603162	海通发展	1,146	10,657.80	0.00
254	01088	中国神华	321	10,532.28	0.00
255	301282	金禄电子	434	10,320.52	0.00
256	301335	天元宠物	588	9,343.32	0.00
257	301396	宏景科技	475	9,267.25	0.00
258	301392	汇成真空	219	9,123.54	0.00
259	688639	华恒生物	112	8,555.68	0.00
260	601598	中国外运	900	5,067.00	0.00
260	00598	中国外运	1,000	3,468.18	0.00
261	603282	亚光股份	457	7,705.02	0.00
262	831689	克莱特	700	7,525.00	0.00

263	301296	新巨丰	1,042	7,512.82	0.00
264	001278	一彬科技	473	7,478.13	0.00
265	001333	光华股份	426	7,029.00	0.00
266	001368	通达创智	351	6,862.05	0.00
267	002317	众生药业	600	6,858.00	0.00
268	001260	坤泰股份	484	6,742.12	0.00
269	002028	思源电气	100	6,690.00	0.00
270	603291	联合水务	536	6,571.36	0.00
271	600585	海螺水泥	270	6,369.30	0.00
272	301309	万得凯	228	5,827.68	0.00
273	301316	慧博云通	359	5,270.12	0.00
274	603160	汇顶科技	74	5,087.50	0.00
275	301270	汉仪股份	210	5,067.30	0.00
276	301313	凡拓数创	247	5,026.45	0.00
277	301319	唯特偶	167	5,015.01	0.00
278	301366	一博科技	142	4,833.68	0.00
279	832419	路斯股份	600	4,500.00	0.00
280	603065	宿迁联盛	581	4,340.07	0.00
281	301273	瑞晨环保	277	4,312.89	0.00
282	601318	中国平安	100	4,136.00	0.00
283	301358	湖南裕能	126	3,963.96	0.00
284	01513	丽珠医药	100	2,345.59	0.00
285	603000	人民网	100	1,999.00	0.00
286	01810	小米集团-W	129	1,940.28	0.00
287	000538	云南白药	37	1,892.55	0.00
288	300782	卓胜微	20	1,554.80	0.00
289	600900	长江电力	51	1,474.92	0.00
290	688118	普元信息	91	1,313.13	0.00
291	601138	工业富联	40	1,096.00	0.00
292	300785	值得买	61	1,031.51	0.00
293	600737	中粮糖业	100	959.00	0.00
294	002950	奥美医疗	100	660.00	0.00
295	002867	周大生	50	653.00	0.00
296	601229	上海银行	86	624.36	0.00
297	601118	海南橡胶	76	345.80	0.00
298	603699	纽威股份	19	325.28	0.00
299	000629	钒钛股份	100	250.00	0.00
300	600023	浙能电力	27	191.97	0.00
301	600938	中国海油	4	132.00	0.00
302	300511	雪榕生物	10	25.90	0.00
303	600987	航民股份	1	7.06	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	000661	长春高新	156,638,356.55	2.39
2	002841	视源股份	140,944,296.50	2.15
3	002129	TCL 中环	112,357,886.51	1.71
4	688002	睿创微纳	105,847,979.36	1.61
5	600637	东方明珠	91,198,509.36	1.39
6	02319	蒙牛乳业	89,304,155.04	1.36
7	01066	威高股份	78,675,068.52	1.20
8	600233	圆通速递	68,744,224.00	1.05
9	000739	普洛药业	62,759,495.17	0.96
10	600998	九州通	53,441,918.86	0.81
11	300725	药石科技	42,378,906.00	0.65
12	601311	骆驼股份	33,930,540.12	0.52
13	00941	中国移动	31,976,284.01	0.49
14	000880	潍柴重机	27,566,930.80	0.42
15	601333	广深铁路	26,967,674.00	0.41
16	603237	五芳斋	26,570,063.50	0.40
17	600598	北大荒	26,525,853.59	0.40
18	002434	万里扬	24,351,367.00	0.37
19	603995	甬金股份	24,020,027.50	0.37
20	300773	拉卡拉	18,168,196.48	0.28

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	601919	中远海控	86,743,709.94	1.32
1	01919	中远海控	222,207,258.03	3.38
2	600741	华域汽车	253,253,570.14	3.86
3	03800	协鑫科技	130,096,079.58	1.98
4	002075	沙钢股份	113,409,651.88	1.73
5	600583	海油工程	93,298,062.77	1.42
6	600233	圆通速递	90,784,095.28	1.38
7	03690	美团-W	52,983,905.92	0.81
8	601369	陕鼓动力	51,552,205.85	0.79

9	603600	永艺股份	28,688,770.00	0.44
10	600031	三一重工	24,548,534.00	0.37
11	00525	广深铁路股份	19,097,681.78	0.29
12	603296	华勤技术	18,142,950.60	0.28
13	002434	万里扬	14,253,551.00	0.22
14	02208	金风科技	13,735,926.57	0.21
15	01193	华润燃气	12,370,359.54	0.19
16	301219	腾远钴业	11,682,833.73	0.18
17	00001	长和	9,443,611.89	0.14
18	300445	康斯特	8,073,617.00	0.12
19	603056	德邦股份	6,948,109.00	0.11
20	002938	鹏鼎控股	6,347,757.00	0.10

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	1,387,919,305.00
卖出股票收入（成交）总额	1,314,600,058.47

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

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	179,489,986.81	2.63
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）	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	179,489,986.81	2.63

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	债券名称	数量	公允价值	占基金资产净值比例
----	-----	------	----	------	-----------

	码		(张)		(%)
1	249934	24 贴现国债 34	1,800,000	179,489,986.81	2.63

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	292,005.37
2	应收清算款	7,319,829.75
3	应收股利	5,459,863.59
4	应收利息	-
5	应收申购款	7,058,939.92
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-

9	合计	20,130,638.63
---	----	---------------

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 (%)
大成睿享混合 A	168,732	20,614.03	2,226,581,781.45	64.01	1,251,665,248.85	35.99
大成睿享混合 C	70,147	23,416.14	996,327,926.70	60.66	646,243,810.06	39.34
合计	238,879	21,436.87	3,222,909,708.15	62.94	1,897,909,058.91	37.06

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	大成睿享混合 A	4,369,966.03	0.1256
	大成睿享混合 C	637,829.58	0.0388
	合计	5,007,795.61	0.0978

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、基金投资和相关部门负责人持有本开放式基金	大成睿享混合 A	50~100
	大成睿享混合 C	10~50
	合计	50~100
本基金基金经理持有本开放式基金	大成睿享混合 A	10~50
	大成睿享混合 C	0
	合计	10~50

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	大成睿享混合 A	大成睿享混合 C
基金合同生效日（2019 年 12 月 30 日）基金份额总额	5,127,950,417.21	293,998,883.85
本报告期期初基金份额总额	3,407,811,374.52	1,549,098,554.18
本报告期基金总申购份额	908,735,472.09	906,686,711.79
减：本报告期基金总赎回份额	838,299,816.31	813,213,529.21
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期末基金份额总额	3,478,247,030.30	1,642,571,736.76

§ 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

无。

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

无。

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 (%)	
光大证券	2	533,641,673.02	19.76	443,110.56	18.42	-
中信建投证券	2	361,648,257.90	13.39	338,467.06	14.07	-
华创证券	1	313,850,830.69	11.62	293,770.25	12.21	-
中金公司	2	297,331,284.18	11.01	241,089.41	10.02	-
天风证券	2	213,455,139.29	7.90	199,776.82	8.31	-
中信证券	4	194,403,539.50	7.20	181,946.21	7.56	-
兴业证券	2	162,889,283.54	6.03	152,446.07	6.34	-
国泰君安	3	155,481,434	5.76	145,514.86	6.05	-

		. 18				
财通证券	1	145,296,644 . 68	5.38	106,914.04	4.45	-
山西证券	1	113,664,717 . 48	4.21	106,382.83	4.42	-
国信证券	1	105,631,355 . 35	3.91	98,858.90	4.11	-
招商证券	2	49,977,125. 45	1.85	46,772.41	1.94	-
东兴证券	1	28,898,045. 91	1.07	27,049.05	1.12	-
东方证券	1	15,520,407. 00	0.57	14,518.94	0.60	-
广发证券	2	9,213,524.8 0	0.34	8,625.69	0.36	本期 报告 新增 1个
爱建证券	1	-	-	-	-	-
川财证券	1	-	-	-	-	-
第一创业	1	-	-	-	-	-
东北证券	2	-	-	-	-	-
东财证券	1	-	-	-	-	-
东吴证券	1	-	-	-	-	-
东亚前海	2	-	-	-	-	-
方正证券	1	-	-	-	-	-
高盛中国 证券	1	-	-	-	-	-
国金证券	2	-	-	-	-	-
国盛证券	1	-	-	-	-	-
国投证券	1	-	-	-	-	-
海通证券	1	-	-	-	-	-
红塔证券	1	-	-	-	-	-
华泰证券	1	-	-	-	-	-
华西证券	1	-	-	-	-	-
民生证券	1	-	-	-	-	-
南京证券	1	-	-	-	-	-
平安证券	1	-	-	-	-	-
瑞银证券	2	-	-	-	-	-
上海证券	1	-	-	-	-	-
申万宏源	1	-	-	-	-	-
世纪证券	0	-	-	-	-	本期 报告 退租 1个

万和证券	1	-	-	-	-	-
西部证券	1	-	-	-	-	-
湘财证券	0	-	-	-	-	本期 报告 退租 1个
信达证券	2	-	-	-	-	-
粤开证券	1	-	-	-	-	-
浙商证券	1	-	-	-	-	-
中国银河 证券	4	-	-	-	-	-
中泰证券	2	-	-	-	-	-
中银国际 证券	1	-	-	-	-	-
中原证券	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	大成睿享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
2	大成睿享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
3	大成基金管理有限公司关于提请投	中国证监会基金电子披	2024年6月28日

	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	露网站、规定报刊及本公司网站	
4	大成基金管理有限公司关于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	大成基金管理有限公司关于旗下部分基金增加华西证券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 30 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	大成睿享混合型证券投资基金 A、C 类份额增加第一创业证券股份有限公司为代销机构的公告	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 25 日
8	大成基金管理有限公司关于旗下部分基金增加英大证券有限责任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 25 日
9	大成睿享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
10	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
11	大成基金管理有限公司关于旗下部分基金增加山西证券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 4 月 1 日
12	大成睿享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
13	大成基金管理有限公司关于旗下部分基金增加深圳前海微众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 3 月 18 日
14	大成基金管理有限公司关于旗下部分基金增加东兴证券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 3 月 14 日
15	大成睿享混合型证券投资基金 C 类份额增加中泰证券股份有限公司为代销机构的公告	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 2 月 1 日
16	大成睿享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 1 月 30 日
17	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

18	大成睿享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
----	------------------------------	--------------------------	-----------------

§ 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睿享混合型证券投资基金的文件；
- 2、《大成睿享混合型证券投资基金基金合同》；
- 3、《大成睿享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