

# 大成卓享一年持有期混合型证券投资基金 2021 年第 2 季度报告

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：上海浦东发展银行股份有限公司

报告送出日期：2021 年 7 月 21 日

## § 1 重要提示

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

基金托管人上海浦东发展银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2021 年 07 月 20 日复核了本报告中的财务指标、净值表现和投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2021 年 04 月 01 日起至 06 月 30 日止。

## § 2 基金产品概况

基金简称	大成卓享一年持有混合
基金主代码	010369
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2020 年 11 月 16 日
报告期末基金份额总额	5,237,194,702.64 份
投资目标	在严格控制风险的基础上，通过积极主动的投资管理，追求基金资产的长期稳健增值，力争实现超越业绩比较基准的投资回报。
投资策略	本基金的投资策略分为两方面：一方面体现在采取“自上而下”的方式对权益类、固定收益类等不同类别资产进行大类配置；另一方面体现在对单个投资品种的精选上。 （一）大类资产配置策略；（二）债券投资策略 1、利率预期策略； 2、信用债券投资策略； 3、套利交易策略； 5、个券选择策略；（三）股票投资策略：基金经理主要通过公司基本面和股票估值两个方面进行筛选股票：（ 1 ）公司基本面分析 2 ）股票估值分析；（四）资产支持证券投资策略；（五）股指期货投资策略；（六）融资买入股票策略；（七）国债期货投资策略。
业绩比较基准	沪深 300 指数收益率*10%+恒生指数收益率*5%+中证综合债券指数收益率*80%+金融机构人民币活期存款利率（税后）*5%
风险收益特征	本基金为混合型基金，其预期风险与预期收益高于债券

	型基金与货币市场基金，低于股票型基金。本基金若投资港股通标的股票，则需承担港股通机制下因投资环境、投资标的、市场制度以及交易规则等差异带来的特有风险。	
基金管理人	大成基金管理有限公司	
基金托管人	上海浦东发展银行股份有限公司	
下属分级基金的基金简称	大成卓享一年持有混合 A	大成卓享一年持有混合 C
下属分级基金的交易代码	010369	010370
报告期末下属分级基金的份额总额	4,573,375,960.36 份	663,818,742.28 份

### § 3 主要财务指标和基金净值表现

#### 3.1 主要财务指标

单位：人民币元

主要财务指标	报告期（2021 年 4 月 1 日-2021 年 6 月 30 日）	
	大成卓享一年持有混合 A	大成卓享一年持有混合 C
1. 本期已实现收益	28,880,045.92	3,517,589.69
2. 本期利润	61,769,495.25	8,283,297.34
3. 加权平均基金份额本期利润	0.0135	0.0125
4. 期末基金资产净值	4,633,212,371.42	670,841,358.04
5. 期末基金份额净值	1.0131	1.0106

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

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

#### 3.2 基金净值表现

##### 3.2.1 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

大成卓享一年持有混合 A

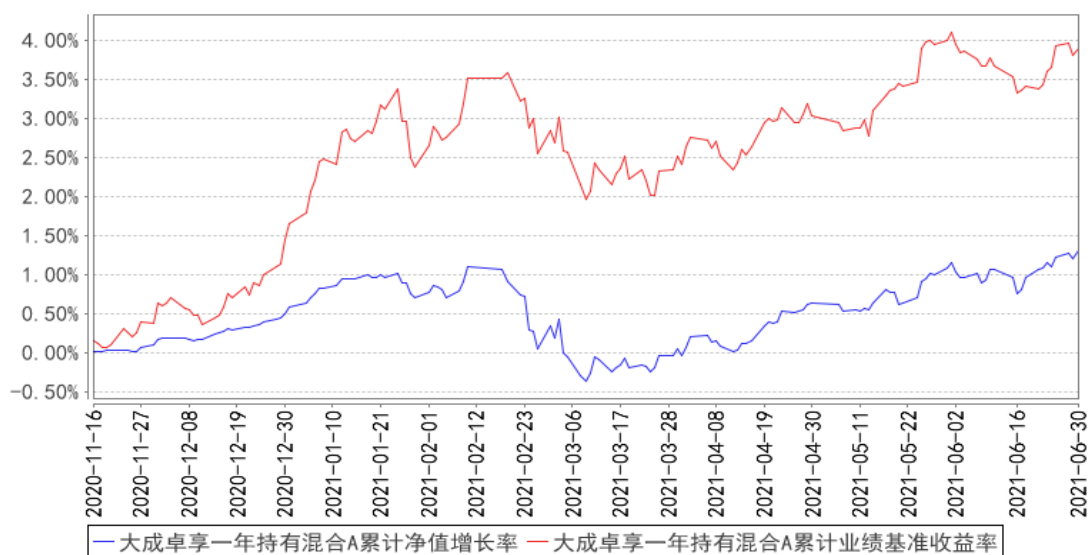
阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	1.35%	0.08%	1.45%	0.13%	-0.10%	-0.05%
过去六个月	0.73%	0.11%	2.20%	0.18%	-1.47%	-0.07%
自基金合同生效起至今	1.31%	0.10%	3.90%	0.17%	-2.59%	-0.07%

## 大成卓享一年持有混合 C

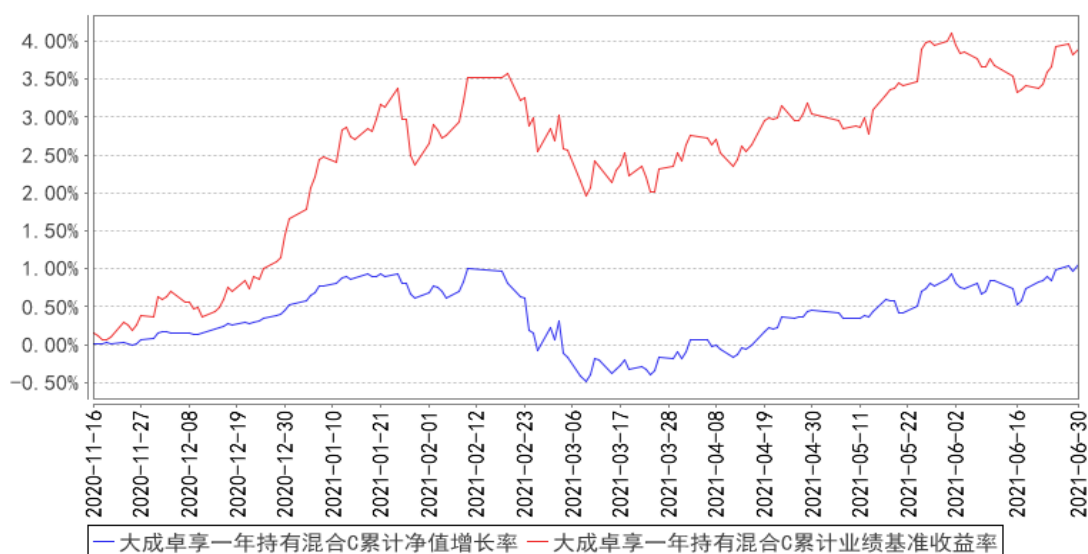
阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	1.25%	0.08%	1.45%	0.13%	-0.20%	-0.05%
过去六个月	0.53%	0.11%	2.20%	0.18%	-1.67%	-0.07%
自基金合同生效起至今	1.06%	0.10%	3.90%	0.17%	-2.84%	-0.07%

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

大成卓享一年持有混合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



大成卓享一年持有混合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：1、本基金合同生效日为 2020 年 11 月 16 日，截至报告期末本基金合同生效未满一年。

2、本基金合同规定，基金管理人应当自基金合同生效之日起 6 个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的有关约定。建仓期结束时，本基金的投资组合比例符合基金合同的约定。

## § 4 管理人报告

### 4.1 基金经理（或基金经理小组）简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
孙丹	本基金基金经理	2020 年 11 月 16 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

				<p>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。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</p>
--	--	--	--	---

					<p>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 日起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 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</p>
王磊	本基金基金经理	2020 年 11 月 16 日	-	17 年	<p>经济学硕士。2003 年 5 月至 2012 年 10 月曾任证券时报社公司新闻部记者、世纪证券投资银行部业务董事、国信证券经济研究所分析师及资产管理总部专户投资经理、中银基金管理有限公司专户理财部投资经理及总监 (主持工作)。2012 年 11 月加入大成基金管理有限公司, 曾担任社保基金及机构投资部投资经理、固定收益总部基金经理、股票投资部基金经理, 现</p>

				<p>任股票投资部总监助理。2013 年 6 月 7 日至 2015 年 7 月 15 日任大成强化收益债券型证券投资基金基金经理。2015 年 7 月 16 日到 2016 年 3 月 25 日任大成强化收益定期开放债券型证券投资基金基金经理。2013 年 7 月 17 日到 2016 年 3 月 25 日任大成景恒保本混合型证券投资基金基金经理。2013 年 11 月 9 日到 2016 年 3 月 25 日任大成可转债增强债券型证券投资基金基金经理。2014 年 6 月 26 到 2016 年 3 月 25 日任大成景益平稳收益混合型证券投资基金基金经理。2014 年 9 月 3 日至 2016 年 3 月 23 日任大成景丰债券型证券投资基金 (LOF) 基金经理。2014 年 12 月 9 日至 2016 年 3 月 25 日任大成景利混合型证券投资基金基金经理。2015 年 12 月 14 日起任大成行业轮动混合型证券投资基金基金经理。2016 年 11 月 11 日起担任大成景尚灵活配置混合型证券投资基金基金经理。2017 年 6 月 9 日起任大成积极成长混合型证券投资基金基金经理。2017 年 6 月 9 日起任大成灵活配置混合型证券投资基金基金经理。2017 年 9 月 21 日至 2019 年 1 月 9 日任大成国企改革灵活配置混合型证券投资基金基金经理。2017 年 12 月 1 日至 2020 年 10 月 30 日任大成财富管理 2020 生命周期证券投资基金基金经理。2020 年 3 月 5 日起任大成恒享混合型证券投资基金基金经理。2020 年 3 月 31 日起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 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 2 月 9 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。2021 年 4 月 22 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：</p>
--	--	--	--	--



					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。

#### 4.1.1 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 公平交易专项说明

##### 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不存在同日反向交易。投资组合间相邻交易日反向交易的市场成交比例、成交均价等交易结果数据表明该类交易不对市场产生重大影响，无异常。

#### 4.4 报告期内基金的投资策略和运作分析

二季度，国内资金面整体中性偏松，社融增速下行明显，主要是由于在货币政策取向中性的背景下，政府债发行节奏较慢。海外方面，美国通胀回升明显，就业数据由于高额财政补贴而改善偏慢。不过 6 月中旬的美联储议息会议释放出了更鹰派的信号，叠加国内增长有所放缓，市场

的通胀预期回落。

国内资本市场方面，股债均上涨。受益于国内外流动性皆宽松，且一季度调整之后，估值有所下降，权益市场整体反弹，尤其是成长风格和中小市值风格股票。债市二季度收益也好于一季度，中高等级信用债收益率明显下行，长端利率债收益率整体保持低位震荡。

本季度，产品阶段性的提升了权益仓位，并增加了新能源汽车、光伏、科技和石化等板块的配置。债券部分久期有所提升，主要增加了 1-2 年期信用债的配置。

#### 4.5 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末大成卓享一年持有混合 A 的基金份额净值为 1.0131 元，本报告期基金份额净值增长率为 1.35%；截至本报告期末大成卓享一年持有混合 C 的基金份额净值为 1.0106 元，本报告期基金份额净值增长率为 1.25%。同期业绩比较基准收益率为 1.45%。

#### 4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

无。

## § 5 投资组合报告

### 5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额（元）	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	429,335,433.68	7.78
	其中：股票	429,335,433.68	7.78
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	4,036,009,438.69	73.09
	其中：债券	4,036,009,438.69	73.09
	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	974,893,822.34	17.66
	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	19,833,272.32	0.36
8	其他资产	61,774,381.38	1.12
9	合计	5,521,846,348.41	100.00

### 5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

#### 5.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
----	------	---------	--------------

A	农、林、牧、渔业	9,107.58	0.00
B	采矿业	41,204,787.00	0.78
C	制造业	294,115,951.78	5.55
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	85,374.49	0.00
E	建筑业	6,139,884.00	0.12
F	批发和零售业	252,954.09	0.00
G	交通运输、仓储和邮政业	9,344,244.00	0.18
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	79,229.05	0.00
J	金融业	97,414.20	0.00
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	46,082,115.36	0.87
M	科学研究和技术服务业	131,868.00	0.00
N	水利、环境和公共设施管理业	33,133.88	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	10,765,892.00	0.20
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	408,341,955.43	7.70

### 5.2.2 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（%）
通信服务	9,864,474.82	0.19
非日常生活消费品	-	-
日常消费品	-	-
能源	-	-
金融	11,129,003.43	0.21
医疗保健	-	-
工业	-	-
信息技术	-	-
原材料	-	-
房地产	-	-
合计	20,993,478.25	0.40

### 5.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的股票投资明细

#### 5.3.1 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	601899	紫金矿业	4,252,300	41,204,787.00	0.78
2	600519	贵州茅台	14,100	28,999,470.00	0.55

3	601888	中国中免	88,313	26,502,731.30	0.50
4	000568	泸州老窖	104,200	24,584,948.00	0.46
5	002008	大族激光	509,200	20,566,588.00	0.39
6	002027	分众传媒	2,079,000	19,563,390.00	0.37
7	000100	TCL 科技	2,545,100	19,470,015.00	0.37
8	600732	爱旭股份	1,397,000	19,446,240.00	0.37
9	000725	京东方 A	2,459,800	15,349,152.00	0.29
10	300363	博腾股份	159,000	13,375,080.00	0.25

### 5.3.2 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的全国中小企业股份转让系统挂牌股票投资明细

无。

### 5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	11,426,000.00	0.22
2	央行票据	-	-
3	金融债券	977,845,320.69	18.44
	其中：政策性金融债	423,528,520.69	7.98
4	企业债券	1,346,180,000.00	25.38
5	企业短期融资券	704,742,340.00	13.29
6	中期票据	785,855,000.00	14.82
7	可转债（可交换债）	14,950,778.00	0.28
8	同业存单	195,010,000.00	3.68
9	其他	-	-
10	合计	4,036,009,438.69	76.09

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

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	180412	18 农发 12	1,000,000	100,440,000.00	1.89
2	200314	20 进出 14	1,000,000	100,210,000.00	1.89
3	112118035	21 华夏银行 CD035	1,000,000	97,920,000.00	1.85
4	112008313	20 中信银行 CD313	1,000,000	97,090,000.00	1.83
5	200215	20 国开 15	800,000	81,112,000.00	1.53

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

无。

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

无。

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

无。

#### 5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

##### 5.9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

代码	名称	持仓量（买/卖）	合约市值(元)	公允价值变动 (元)	风险说明
-	-	-	-	-	-
公允价值变动总额合计（元）					-
股指期货投资本期收益（元）					-404,160.00
股指期货投资本期公允价值变动（元）					-82,140.00

注：买入持仓量以正数表示，卖出持仓量以负数表示，单位为手。

##### 5.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金投资股指期货以套期保值为目的进行投资组合避险和有效管理，通过套期保值策略，对冲系统性风险，应对组合构建与调整中的流动性风险，力求风险收益的优化。

#### 5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

无。

#### 5.11 投资组合报告附注

##### 5.11.1 本基金投资的前十名证券的发行主体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

1. 华夏银行股份有限公司于 2020 年 7 月 13 日因内控制度执行不到位，严重违反审慎经营规则等，受到中国银行保险监督管理委员会处罚（银保监罚决字（2020）24 号），于 2021 年 5 月 17 日因违规使用自营资金、理财资金购买本行转让的信贷资产等，受到中国银行保险监督管理委员会处罚（银保监罚决字（2021）19 号）。本基金认为，对华夏银行的处罚不会对其投资价值构成实质性负面影响。

2. 本基金投资的前十名证券之一 20 国开 15 (200215. IB) 的发行主体国家开发银行于 2020 年 12 月 25 日因为违规的政府购买服务项目提供融资等, 受到中国银行保险监督管理委员会处罚 (银保监罚决字 (2020) 67 号)。本基金认为, 对国家开发银行的处罚不会对其投资价值构成实质性负面影响。

3. 本基金投资的前十名证券之一 20 中信银行 CD313 (112008313. IB) 的发行主体中信银行股份有限公司于 2021 年 2 月 5 日因未按规定履行客户身份识别义务等, 受到中国人民银行处罚 (银罚字 (2021) 1 号), 于 2021 年 3 月 17 日因客户信息保护体制机制不健全等, 受到中国银行保险监督管理委员会处罚 (银保监罚决字 (2021) 5 号)。本基金认为, 对中信银行的处罚不会对其投资价值构成实质性负面影响。

4. 本基金投资的前十名证券之一 20 交通银行 01 (2028029. IB) 的发行主体交通银行股份有限公司于 2021 年 7 月 13 日因理财业务和同业业务制度不健全等, 受到中国银行保险监督管理委员会处罚 (银保监罚决字 (2021) 28 号)。本基金认为, 对交通银行的处罚不会对其投资价值构成实质性负面影响。

5. 本基金投资的前十名证券之一 20 进出 14 (200314. IB) 的发行主体中国进出口银行于 2021 年 7 月 13 日因违规投资企业股权等, 受到中国银行保险监督管理委员会处罚 (银保监罚决字 (2021) 31 号)。本基金认为, 对中国进出口银行的处罚不会对其投资价值构成实质性负面影响。

### 5.11.2 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

基金投资的前十名股票中, 没有投资于超出基金合同规定备选股票库之外股票。

### 5.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额 (元)
1	存出保证金	553, 248. 36
2	应收证券清算款	1, 045, 865. 62
3	应收股利	-
4	应收利息	60, 175, 257. 41
5	应收申购款	9. 99
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	61, 774, 381. 38

### 5.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

序号	债券代码	债券名称	公允价值 (元)	占基金资产净值比例 (%)
----	------	------	----------	---------------

1	132009	17 中油 EB	14,078,778.00	0.27
---	--------	----------	---------------	------

#### 5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

无。

#### 5.11.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入原因，分项之和与合计可能有尾差。

### § 6 开放式基金份额变动

单位：份

项目	大成卓享一年持有混合 A	大成卓享一年持有混合 C
报告期期初基金份额总额	4,573,314,106.34	663,810,608.10
报告期期间基金总申购份额	61,854.02	8,134.18
减：报告期期间基金总赎回份额	-	-
报告期期间基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-	-
报告期期末基金份额总额	4,573,375,960.36	663,818,742.28

### § 7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

#### 7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

无。

#### 7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

无。

### § 8 影响投资者决策的其他重要信息

#### 8.1 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。

#### 8.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

## § 9 备查文件目录

### 9.1 备查文件目录

- 1、中国证监会批准设立大成卓享一年持有期混合型证券投资基金的文件；
- 2、《大成卓享一年持有期混合型证券投资基金基金合同》；
- 3、《大成卓享一年持有期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。

### 9.2 存放地点

备查文件存放在本基金管理人和托管人的住所。

### 9.3 查阅方式

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

大成基金管理有限公司

2021 年 7 月 21 日