

大成景禄灵活配置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：招商银行股份有限公司

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。

基金托管人招商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

| | |
|---|-----------|
| § 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 | 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 | 14 |
| 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 | 14 |
| § 5 托管人报告 | 15 |
| 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 | 15 |
| § 6 半年度财务会计报告（未经审计） | 15 |
| 6.1 资产负债表 | 15 |
| 6.2 利润表 | 16 |
| 6.3 所有者权益（基金净值）变动表 | 17 |
| 6.4 报表附注 | 19 |
| § 7 投资组合报告 | 42 |
| 7.1 期末基金资产组合情况 | 42 |
| 7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合 | 42 |
| 7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细 | 43 |
| 7.4 报告期内股票投资组合的重大变动 | 45 |
| 7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合 | 47 |
| 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 | 47 |

| | |
|---|-----------|
| 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 | 47 |
| 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 | 47 |
| 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 | 48 |
| 7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明 | 48 |
| 7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 | 48 |
| 7.12 投资组合报告附注 | 48 |
| § 8 基金份额持有人信息 | 49 |
| 8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 | 49 |
| 8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 | 50 |
| 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 | 50 |
| § 9 开放式基金份额变动 | 51 |
| § 10 重大事件揭示 | 51 |
| 10.1 基金份额持有人大会决议 | 51 |
| 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 | 51 |
| 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 | 51 |
| 10.4 基金投资策略的改变 | 51 |
| 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 | 51 |
| 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 | 52 |
| 10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 | 52 |
| 10.8 其他重大事件 | 53 |
| § 11 影响投资者决策的其他重要信息 | 53 |
| 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 | 53 |
| 11.2 影响投资者决策的其他重要信息 | 54 |
| § 12 备查文件目录 | 54 |
| 12.1 备查文件目录 | 54 |
| 12.2 存放地点 | 54 |
| 12.3 查阅方式 | 54 |

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

| | | |
|---------------------|-------------------|------------------|
| 基金名称 | 大成景禄灵活配置混合型证券投资基金 | |
| 基金简称 | 大成景禄灵活配置混合 | |
| 基金主代码 | 003373 | |
| 基金运作方式 | 契约型开放式 | |
| 基金合同生效日 | 2016 年 9 月 29 日 | |
| 基金管理人 | 大成基金管理有限公司 | |
| 基金托管人 | 招商银行股份有限公司 | |
| 报告期末基金份 额总额 | 508,254,256.21 份 | |
| 基金合同存续期 | 不定期 | |
| 下属分级基金的基 金简称 | 大成景禄灵活配置混合 A | 大成景禄灵活配置混合 C |
| 下属分级基金的交 易代码 | 003373 | 003374 |
| 报告期末下属分级 基金的份额总额 | 279,306,823.49 份 | 228,947,432.72 份 |

2.2 基金产品说明

| | |
|--------|--|
| 投资目标 | 本基金通过灵活的资产配置和主动的投资管理，在控制风险的前提下为投资者谋求资本的长期增值。 |
| 投资策略 | 本基金的投资策略分为两方面：一方面体现在采取“自上而下”的方式对权益类、固定收益类等不同类别资产进行大类配置；另一方面体现在对单个投资品种的精选上。 |
| 业绩比较基准 | 沪深 300 指数收益率*55%+中证综合债券指数收益率*45% |
| 风险收益特征 | 本基金是混合型基金，其预期收益及风险水平低于股票型基金，高于货币市场基金与债券型基金，属于风险水平中高的基金。 |

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 | 招商银行股份有限公司 |
| 信息披露 负责人 | 姓名 | 赵冰 | 张燕 |
| | 联系电话 | 0755-83183388 | 0755-83199084 |
| | 电子邮箱 | office@dcfund.com.cn | yan_zhang@cmbchina.com |
| 客户服务电话 | | 4008885558 | 95555 |
| 传真 | | 0755-83199588 | 0755-83195201 |
| 注册地址 | | 深圳市福田区深南大道 7088 号招商 银行大厦 32 层 | 深圳市深南大道 7088 号招商银 行大厦 |
| 办公地址 | | 深圳市福田区深南大道 7088 号招商 银行大厦 32 层 | 深圳市深南大道 7088 号招商银 行大厦 |
| 邮政编码 | | 518040 | 518040 |
| 法定代表人 | | 吴庆斌 | 缪建民 |

2.4 信息披露方式

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

2.5 其他相关资料

| 项目 | 名称 | 办公地址 |
|--------|------------|----------------------------------|
| 注册登记机构 | 大成基金管理有限公司 | 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) | | |
|---------------|-------------------------------------|----------------|----------------|
| | 大成景禄灵活配置混合 A | 大成景禄灵活配置混合 C | |
| 本期已实现收益 | 25,458,104.38 | 16,661,786.23 | |
| 本期利润 | 19,705,775.81 | 13,814,669.44 | |
| 加权平均基金份额本期利润 | 0.0647 | 0.0688 | |
| 本期加权平均净值利润率 | 4.45% | 4.74% | |
| 本期基金份额净值增长率 | 4.69% | 4.64% | |
| 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 | 54,507,535.86 | 44,343,795.91 |
| | 期末可供分配基金份额利润 | 0.1952 | 0.1937 |
| | 期末基金资产净值 | 418,078,528.32 | 342,510,736.66 |
| | 期末基金份额净值 | 1.4968 | 1.4960 |
| 3.1.3 累计期末 | 报告期末(2021 年 6 月 30 日) | | |

| 指标 | | |
|-------------|--------|--------|
| 基金份额累计净值增长率 | 49.68% | 49.60% |

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

大成景禄灵活配置混合 A

| 阶段 | 份额净值增长率① | 份额净值增长率标准差② | 业绩比较基准收益率③ | 业绩比较基准收益率标准差④ | ①—③ | ②—④ |
|------------|----------|-------------|------------|---------------|--------|--------|
| 过去一个月 | 1.73% | 0.31% | -1.02% | 0.44% | 2.75% | -0.13% |
| 过去三个月 | 4.50% | 0.25% | 2.53% | 0.54% | 1.97% | -0.29% |
| 过去六个月 | 4.69% | 0.33% | 1.37% | 0.73% | 3.32% | -0.40% |
| 过去一年 | 25.06% | 0.92% | 15.34% | 0.73% | 9.72% | 0.19% |
| 过去三年 | 48.45% | 0.82% | 34.55% | 0.75% | 13.90% | 0.07% |
| 自基金合同生效起至今 | 49.68% | 0.75% | 43.19% | 0.65% | 6.49% | 0.10% |

大成景禄灵活配置混合 C

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

| | | | | | | |
|----------------|--------|-------|--------|-------|--------|--------|
| 过去一个月 | 1.71% | 0.30% | -1.02% | 0.44% | 2.73% | -0.14% |
| 过去三个月 | 4.48% | 0.25% | 2.53% | 0.54% | 1.95% | -0.29% |
| 过去六个月 | 4.64% | 0.33% | 1.37% | 0.73% | 3.27% | -0.40% |
| 过去一年 | 25.29% | 0.92% | 15.34% | 0.73% | 9.95% | 0.19% |
| 过去三年 | 48.44% | 0.82% | 34.55% | 0.75% | 13.89% | 0.07% |
| 自基金合同生效起 至今 | 49.60% | 0.75% | 43.19% | 0.65% | 6.41% | 0.10% |

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

大成景禄灵活配置混合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



大成景禄灵活配置混合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 | | |
| 李富 | 本基金基 | 2018年 | - | 7年 | 经济学硕士。2009年7月至2013年12月 |

| | | | | | |
|-----|---------|-----------------|---|------|---|
| 强 | 金经理 | 11 月 16 日 | | | 任中国银行间市场交易商协会市场创新部高级助理。2014 年 1 月至 2017 年 7 月任北信瑞丰基金管理有限公司固定收益部基金经理。2017 年 7 月加入大成基金管理有限公司，任职于固定收益总部。2018 年 7 月 16 日至 2019 年 3 月 9 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。2018 年 7 月 16 日至 2019 年 3 月 2 日任大成景利混合型证券投资基金基金经理。2018 年 7 月 16 日至 2020 年 3 月 11 日任大成景益平稳收益混合型证券投资基金基金经理。2018 年 7 月 16 日至 2019 年 9 月 29 日任大成景丰债券型证券投资基金 (LOF) 基金经理。2018 年 7 月 16 日至 2020 年 8 月 12 日任大成安汇金融债债券型证券投资基金 (转型前大成月月盈短期理财债券型证券投资基金)。2018 年 7 月 16 日起任大成可转债增强债券型证券投资基金基金经理。2018 年 7 月 16 日至 2020 年 12 月 18 日任大成景盛一年定期开放债券型证券投资基金基金经理。2018 年 11 月 16 日起任大成景禄灵活配置混合型证券投资基金基金经理。2019 年 6 月 12 日起任大成景润灵活配置混合型证券投资基金基金经理。2019 年 9 月 26 日至 2020 年 11 月 3 日任大成中债 1-3 年国开行债券指数证券投资基金基金经理。2019 年 11 月 25 日起任大成通嘉三年定期开放债券型证券投资基金基金经理。2019 年 12 月 9 日起任大成惠嘉一年定期开放债券型证券投资基金基金经理。2020 年 6 月 22 日起任大成惠兴一年定期开放债券型发起式证券投资基金基金经理。2020 年 10 月 29 日起任大成趋势回报灵活配置混合型证券投资基金基金经理。2020 年 12 月 2 日起任大成景荣债券型证券投资基金基金经理。2020 年 12 月 18 日起任大成动态量化配置策略混合型证券投资基金基金经理。2021 年 4 月 8 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。2021 年 4 月 13 日起任大成惠泽一年定期开放债券型发起式证券投资基金基金经理。具有基金从业资格。国籍：中国 |
| 黄万青 | 本基金基金经理 | 2019 年 6 月 21 日 | - | 25 年 | 经济学硕士。曾任职于大鹏证券有限责任公司。1999 年 5 月加入大成基金管理有限 |

| | | | | |
|--|--|--|--|---|
| | | | | <p>公司，曾担任研究部研究员、固定收益部高级研究员。2010年4月7日至2013年3月7日任景宏证券投资基金基金经理。2011年7月13日至2013年3月7日任大成行业轮动股票型证券投资基金基金经理。2011年3月8日至2011年6月5日任大成积极成长股票型证券投资基金基金经理。2011年3月8日至2011年6月5日任大成策略回报股票型证券投资基金基金经理。2015年4月28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基金经理。2015年11月30日至2017年3月18日任大成景辉灵活配置混合型证券投资基金基金经理。2016年5月25日至2020年12月4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。2016年8月6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。2016年9月20日至2018年10月20日任大成景穗灵活配置混合型证券投资基金基金经理。2016年9月29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1月25日起任大成景润灵活配置混合型证券投资基金基金经理。2017年3月18日至2018年11月9日任大成景鹏灵活配置混合型证券投资基金基金经理。2019年6月21日至2020年5月21日任大成景益平稳收益混合型证券投资基金基金经理。2019年6月21日起任大成景禄灵活配置混合型证券投资基金基金经理。2019年7月18日至2020年9月18日任大成惠福纯债债券型证券投资基金基金经理。2020年4月30日起任大成趋势回报灵活配置混合型证券投资基金基金经理。2020年12月4日起任大成动态量化配置策略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> |
|--|--|--|--|---|

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 年上半年经济继续恢复，由于经济复苏存在结构不平衡，一季度宏观数据公布之后，市场整体资金面比较宽松，A 股走出一波周期和成长快速上涨的行情，结构分化非常严重。上半年 A 股成长和周期表现较优，科创板 50 和创业板 50 指数上半年涨幅较大，创出年内新高。上半年，上证指数涨 3.4%，沪深 300 指数涨 0.24%，中小板涨 3.66%，创业板涨 17.22%，成长明显占优。从行业上看，钢铁、煤炭、电气设备、化工等上涨幅度都在 20% 以上，非银、家电、农业等跌幅都在 10% 以上。

操作上，本基金在一季度相对防御，二季度相对看好成长，重点配置的 TMT、医药等板块获得相对不错的收益，值得反思的是一度居于防御思路配置的地产板块期间带来的持股体验不佳。

债券市场方面，去年出现信用风险事件后，为应对市场恐慌以及跨年资金缺口压力，央行加大公开市场投放力度，2020 年 11 月“打破惯例”连续两次续作 MLF，推动资金利率明显回落，2021 年初隔夜利率再度破 1%，10Y 国债收益率由 3.3% 快速回落至 3.1%。农历新年前，债券市场情绪平复叠加债市杠杆率上升触发政策调整，央行操作明显缩量，导致 1 月底资金利率大幅跳升，收益率迅速反弹。春节后首个工作日，10Y 国债收益率一度升至年内高点 3.28%。新年之后，资金面平稳偏宽，叠加经济、通胀等利空因素钝化，债市走出慢牛行情。10Y 国债收益率一度跌破 3.1%，创年内新低。6 月以来，流动性回归紧平衡，资金利率中枢小幅抬升，乐观预期有所修正，10Y 国债收益率震荡回升至 3.14% 附近。为维护半年末流动性平稳，6 月 24 日，央行打破了今年 3 月以来每日 100 亿元的逆回购操作，将操作量提升至 300 亿元。10Y 国债收益率震荡回升至 3.08% 附近。2021 上半年，本基金适度调整了组合久期和组合持仓。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末大成景禄灵活配置混合 A 的基金份额净值为 1.4968 元，本报告期基金份额净值增长率为 4.69%，同期业绩比较基准收益率为 1.37%；截至本报告期末大成景禄灵活配置混合 C 的基金份额净值为 1.4960 元，本报告期基金份额净值增长率为 4.64%，同期业绩比较基准收益率为 1.37%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

股票方面，展望 2021 年下半年，我们认为市场继续震荡整理，总体风险可控，结构性的机会多一些。站在当前的时点，比较有利权益市场的是：经济结构性复苏，下半年流动性明显收紧的概率不大；公募基金发行企稳回升，在人民币升值的背景下，外资有望持续流入。不利的因素是：通胀高斜率上升，没有回头的迹象；不少行业估值处于相对较高的位置。由于是追求绝对收益的基金，我们总体仓位进行控制，相对看好 TMT、医药、银行、食品饮料、化工、有色等行业，个股选择那些业绩增长可预见性强、近期已经有一定调整，正在走出短期底部的公司，强调估值盈利匹配度和安全边际。

债券方面，展望 2021 年下半年，出口拉动逐步回落，受欧美推进重启、美国财政补贴逐步取消、耐用品需求透支、商品与服务消费趋势收敛等因素影响，近期我国出口压力初显苗头，PMI 新出口订单指数已连续两月落入收缩区间。地产投资仍将下滑，受到房地产调控及“三条红线”影响，房地产企业加速竣工回笼资金，未来投资增速将下行。基金投资受到地方政府债务投资审查更加严格，优质基建项目不足等影响很难有大幅上行。货币政策仍将保持宽松，未来仍有降准的可能。预计下半年资金面较为平稳，债市仍处于较为有利的宏观环境。

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合规守信情况声明

招商银行具备完善的公司治理结构、内部稽核监控制度和风险控制制度，我行在履行托管职责中，严格遵守有关法律法规、托管协议的规定，尽职尽责地履行托管义务并安全保管托管资产。

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

招商银行根据法律法规、托管协议约定的投资监督条款，对托管产品的投资行为进行监督，并根据监管要求履行报告义务。

招商银行按照托管协议约定的统一记账方法和会计处理原则，独立地设置、登录和保管本产品的全套账册，进行会计核算和资产估值并与管理人建立对账机制。

本年度中期报告中利润分配情况真实、准确。

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

本年度中期报告中财务指标、净值表现、财务会计报告、投资组合报告内容真实、准确，不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

§ 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：大成景禄灵活配置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 |
|------------|---------|------------------------|--------------------------|
| 资产： | | | |
| 银行存款 | 6.4.3.1 | 2,077,341.30 | 246,709.70 |
| 结算备付金 | | 3,321,832.17 | 5,045,231.05 |
| 存出保证金 | | 157,867.39 | 391,338.87 |
| 交易性金融资产 | 6.4.3.2 | 711,275,958.70 | 734,877,523.76 |
| 其中：股票投资 | | 190,201,524.50 | 212,051,940.20 |
| 基金投资 | | - | - |
| 债券投资 | | 521,074,434.20 | 522,825,583.56 |
| 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 | 37,000,000.00 | 10,600,000.00 |
| 应收证券清算款 | | 1,327,941.97 | 6,969,975.82 |
| 应收利息 | 6.4.3.5 | 6,478,513.86 | 9,108,668.15 |

| | | | |
|-----------------|------------|---------------------------|-----------------------------|
| 应收股利 | | - | - |
| 应收申购款 | | 1,712.37 | 65,082.47 |
| 递延所得税资产 | | - | - |
| 其他资产 | 6.4.3.6 | - | - |
| 资产总计 | | 761,641,167.76 | 767,304,529.82 |
| 负债和所有者权益 | 附注号 | 本期末 2021年6月30日 | 上年度末 2020年12月31日 |
| 负 债: | | | |
| 短期借款 | | - | - |
| 交易性金融负债 | | - | - |
| 衍生金融负债 | 6.4.3.3 | - | - |
| 卖出回购金融资产款 | | - | 28,000,000.00 |
| 应付证券清算款 | | - | 4,949,170.17 |
| 应付赎回款 | | 4,065.00 | 66,366.22 |
| 应付管理人报酬 | | 367,548.10 | 365,205.26 |
| 应付托管费 | | 91,887.02 | 91,301.34 |
| 应付销售服务费 | | 27,435.56 | 23,297.78 |
| 应付交易费用 | 6.4.3.7 | 423,595.13 | 685,109.58 |
| 应交税费 | | 24,232.32 | 27,125.81 |
| 应付利息 | | - | -7,482.33 |
| 应付利润 | | - | - |
| 递延所得税负债 | | - | - |
| 其他负债 | 6.4.3.8 | 113,139.65 | 179,065.47 |
| 负债合计 | | 1,051,902.78 | 34,379,159.30 |
| 所有者权益: | | | |
| 实收基金 | 6.4.3.9 | 508,254,256.21 | 512,634,216.72 |
| 未分配利润 | 6.4.3.10 | 252,335,008.77 | 220,291,153.80 |
| 所有者权益合计 | | 760,589,264.98 | 732,925,370.52 |
| 负债和所有者权益总计 | | 761,641,167.76 | 767,304,529.82 |

注：报告截止日 2021 年 06 月 30 日，基金份额总额 508,254,256.21 份，其中大成景禄灵活配置混合 A 基金份额总额为 279,306,823.49 份，基金份额净值 1.4968 元。大成景禄灵活配置混合 C 基金份额总额为 228,947,432.72 份，基金份额净值 1.4960 元。

6.2 利润表

会计主体：大成景禄灵活配置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 | | 38,006,008.90 | 64,138,697.03 |
| 1. 利息收入 | | 10,665,957.25 | 1,207,291.13 |

| | | | |
|------------------------|-----------|---------------|---------------|
| 其中：存款利息收入 | 6.4.3.11 | 44,266.65 | 97,881.27 |
| 债券利息收入 | | 10,218,210.83 | 709,739.15 |
| 资产支持证券利息收入 | | - | - |
| 买入返售金融资产收入 | | 403,479.77 | 399,670.71 |
| 证券出借利息收入 | | - | - |
| 其他利息收入 | | - | - |
| 2. 投资收益（损失以“-”填列） | | 35,840,069.13 | 38,103,143.45 |
| 其中：股票投资收益 | 6.4.3.12 | 33,991,141.36 | 36,528,174.44 |
| 基金投资收益 | | - | - |
| 债券投资收益 | 6.4.3.13 | 95,889.32 | -539,478.69 |
| 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 | 1,753,038.45 | 2,114,447.70 |
| 3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列） | 6.4.3.17 | -8,599,445.36 | 24,822,933.36 |
| 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 | 99,427.88 | 5,329.09 |
| 减：二、费用 | | 4,485,563.65 | 4,076,842.57 |
| 1. 管理人报酬 | 6.4.6.2.1 | 2,183,259.21 | 976,514.77 |
| 2. 托管费 | 6.4.6.2.2 | 545,814.80 | 244,128.65 |
| 3. 销售服务费 | 6.4.6.2.3 | 144,488.43 | 156,437.30 |
| 4. 交易费用 | 6.4.3.19 | 1,429,727.57 | 2,578,073.72 |
| 5. 利息支出 | | 33,885.74 | 17,262.37 |
| 其中：卖出回购金融资产支出 | | 33,885.74 | 17,262.37 |
| 6. 税金及附加 | | 23,639.55 | 887.73 |
| 7. 其他费用 | 6.4.3.20 | 124,748.35 | 103,538.03 |
| 三、利润总额（亏损总额以“-”号填列） | | 33,520,445.25 | 60,061,854.46 |
| 减：所得税费用 | | - | - |
| 四、净利润（净亏损以“-”号填列） | | 33,520,445.25 | 60,061,854.46 |

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：大成景禄灵活配置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) | 512,634,216.72 | 220,291,153.80 | 732,925,370.52 |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润) | - | 33,520,445.25 | 33,520,445.25 |
| 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) | -4,379,960.51 | -1,476,590.28 | -5,856,550.79 |
| 其中：1. 基金申购款 | 35,349,981.03 | 16,631,583.39 | 51,981,564.42 |
| 2. 基金赎回款 | -39,729,941.54 | -18,108,173.67 | -57,838,115.21 |
| 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) | 508,254,256.21 | 252,335,008.77 | 760,589,264.98 |
| 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) | 216,741,605.08 | -908,300.62 | 215,833,304.46 |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润) | - | 60,061,854.46 | 60,061,854.46 |
| 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) | 103,134,320.84 | 2,943,873.36 | 106,078,194.20 |
| 其中：1. 基金申购款 | 108,767,820.68 | 3,510,102.50 | 112,277,923.18 |
| 2. 基金赎回款 | -5,633,499.84 | -566,229.14 | -6,199,728.98 |

| | | | |
|--|----------------|---------------|----------------|
| 回款 | | | |
| 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） | 319,875,925.92 | 62,097,427.20 | 381,973,353.12 |

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 | 2,077,341.30 |
| 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 | 2,077,341.30 |

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 | 174,147,568.12 | 190,201,524.50 | 16,053,956.38 |
| 贵金属投资-金交所黄金合约 | - | - | - |
| 债券 | 交易所市场 | 104,670,034.20 | -555,601.80 |
| | 银行间市场 | 416,404,400.00 | -617,697.12 |
| | 合计 | 521,074,434.20 | -1,173,298.92 |
| 资产支持证券 | - | - | - |
| 基金 | - | - | - |
| 其他 | - | - | - |
| 合计 | 696,395,301.24 | 711,275,958.70 | 14,880,657.46 |

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

单位：人民币元

| 项目 | 本期末 2021 年 6 月 30 日 | |
|-------|------------------------|-----------|
| | 账面余额 | 其中：买断式逆回购 |
| 交易所市场 | 37,000,000.00 | - |
| 银行间市场 | - | - |
| 合计 | 37,000,000.00 | - |

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 | 324.08 |
| 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 | 1,494.90 |
| 应收债券利息 | 6,476,623.88 |
| 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 | 71.00 |
| 合计 | 6,478,513.86 |

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 | 423,100.06 |
| 银行间市场应付交易费用 | 495.07 |
| 合计 | 423,595.13 |

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 | 1.30 |
| 应付证券出借违约金 | - |
| 预提费用 | 113,138.35 |
| 合计 | 113,139.65 |

6.4.3.9 实收基金

金额单位：人民币元

大成景禄灵活配置混合 A

| 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 | 316,393,649.36 | 316,393,649.36 |
| 本期申购 | 539,482.95 | 539,482.95 |
| 本期赎回(以“-”号填列) | -37,626,308.82 | -37,626,308.82 |
| -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 | 279,306,823.49 | 279,306,823.49 |

大成景禄灵活配置混合 C

| 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 | 196,240,567.36 | 196,240,567.36 |
| 本期申购 | 34,810,498.08 | 34,810,498.08 |
| 本期赎回(以“-”号填列) | -2,103,632.72 | -2,103,632.72 |
| -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 | 228,947,432.72 | 228,947,432.72 |

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

6.4.3.10 未分配利润

单位：人民币元

大成景禄灵活配置混合 A

| 项目 | 已实现部分 | 未实现部分 | 未分配利润合计 |
|----------------|---------------|----------------|----------------|
| 上年度末 | 35,107,241.78 | 100,863,408.95 | 135,970,650.73 |
| 本期利润 | 25,458,104.38 | -5,752,328.57 | 19,705,775.81 |
| 本期基金份额交易产生的变动数 | -6,057,810.30 | -10,846,911.41 | -16,904,721.71 |
| 其中：基金申购款 | 74,886.67 | 174,798.58 | 249,685.25 |
| 基金赎回款 | -6,132,696.97 | -11,021,709.99 | -17,154,406.96 |
| 本期已分配利润 | - | - | - |
| 本期末 | 54,507,535.86 | 84,264,168.97 | 138,771,704.83 |

大成景禄灵活配置混合 C

| 项目 | 已实现部分 | 未实现部分 | 未分配利润合计 |
|----|-------|-------|---------|
| | | | |

| | | | |
|----------------|---------------|---------------|----------------|
| 上年度末 | 21,632,148.27 | 62,688,354.80 | 84,320,503.07 |
| 本期利润 | 16,661,786.23 | -2,847,116.79 | 13,814,669.44 |
| 本期基金份额交易产生的变动数 | 6,049,861.41 | 9,378,270.02 | 15,428,131.43 |
| 其中：基金申购款 | 6,377,611.68 | 10,004,286.46 | 16,381,898.14 |
| 基金赎回款 | -327,750.27 | -626,016.44 | -953,766.71 |
| 本期已分配利润 | - | - | - |
| 本期末 | 44,343,795.91 | 69,219,508.03 | 113,563,303.94 |

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 | 6,989.92 |
| 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 | 35,144.96 |
| 其他 | 2,131.77 |
| 合计 | 44,266.65 |

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 | 486,411,829.30 |
| 减：卖出股票成本总额 | 452,420,687.94 |
| 买卖股票差价收入 | 33,991,141.36 |

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 | 62,757,152.48 |
| 减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额 | 61,991,296.78 |
| 减：应收利息总额 | 669,966.38 |
| 买卖债券差价收入 | 95,889.32 |

6.4.3.14 贵金属投资收益

无。

6.4.3.15 衍生工具收益

6.4.3.15.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

无。

6.4.3.15.2 衍生工具收益——其他投资收益

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 | 1,753,038.45 |
| 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 | 1,753,038.45 |

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 | -8,599,445.36 |
| 股票投资 | -7,827,662.04 |
| 债券投资 | -771,783.32 |
| 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 | -8,599,445.36 |

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 | 98,629.54 |
| 基金转换费收入 | 798.34 |
| 合计 | 99,427.88 |

注：1) 本基金的赎回费率按持有期间递减，赎回费在扣除手续费后，余额不低于赎回费总额的 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 | 1,429,502.57 |
| 银行间市场交易费用 | 225.00 |
| 合计 | 1,429,727.57 |

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 | 44,630.98 |
| 信息披露费 | 59,507.37 |
| 证券出借违约金 | - |
| 银行划款手续费 | 2,010.00 |
| 账户维护费 | 18,000.00 |
| 其他 | 600.00 |
| 合计 | 124,748.35 |

6.4.3.21 分部报告

截至本报告期末，本基金仅在中国大陆境内从事证券投资单一业务，因此，无需作披露的分部报告。

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

本报告期存在控制关系或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 |

| | |
|--------------------|-----------------|
| 招商银行股份有限公司(“招商银行”) | 基金托管人、基金销售机构 |
| 光大证券股份有限公司(“光大证券”) | 基金销售机构、基金管理人的股东 |

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。

6.4.6 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 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 | |
|-------|----------------------------|-------------------------|---------------------------------|---------------------|
| | 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 | 465,050,622.30 | 50.79 | - | - |

6.4.6.1.2 债券交易

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 | | 上年度可比期间 2020年1月1日至2020年6月30日 | |
|-------|----------------------------|-------------------------|---------------------------------|-------------------------|
| | 成交金额 | 占当期债券 成交总额的比例 (%) | 成交金额 | 占当期债券 成交总额的比例 (%) |
| 光大证券 | 106,157.24 | 0.18 | - | - |

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 | 423,815.15 | 50.79 | 195,605.46 | 46.23 |

| 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 (%) |
| - | - | - | - | - |

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，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 | 2,183,259.21 | 976,514.77 |
| 其中：支付销售机构的客户维护费 | 10,893.09 | 4,119.86 |

注：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 0.60% 的年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 0.60\% / \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日基金资产净值

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 | 545,814.80 | 244,128.65 |

注：基金托管费每日计提，按月支付。基金托管人的基金托管费按前一日的基金资产净值的 0.15% 年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 0.15\% / \text{当年天数}$$

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

6.4.6.2.3 销售服务费

单位：人民币元

| 获得销售服务费的各关联方名称 | 本期 2021年1月1日至2021年6月30日 | | |
|----------------|---------------------------------|-----------------|------------|
| | 当期发生的基金应支付的销售服务费 | | |
| | 大成景禄灵活配置混合 A | 大成景禄灵活配置混合 C | 合计 |
| 大成基金 | - | 139,726.88 | 139,726.88 |
| 合计 | - | 139,726.88 | 139,726.88 |
| 获得销售服务费的各关联方名称 | 上年度可比期间 2020年1月1日至2020年6月30日 | | |
| | 当期发生的基金应支付的销售服务费 | | |
| | 大成景禄灵活配置混合 A | 大成景禄灵活配置混合 C | 合计 |
| 大成基金 | - | 156,047.68 | 156,047.68 |
| 合计 | - | 156,047.68 | 156,047.68 |

注：基金销售服务费可用于本基金的市场推广、销售、服务等各项费用，由基金管理人支配使用。

基金销售服务费每日计算，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按前一日 C 类基金资产净值的 0.1% 年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 0.1\% / \text{当年天数}$$

H 为 C 类基金份额每日应计提的销售服务费

E 为 C 类基金份额前一日基金资产净值

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

无。

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 |
| 招商银行 | 2,077,341.30 | 6,989.92 | 4,483,352.80 | 50,945.43 |

注：本基金的银行存款由基金托管人招商银行保管，并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

| 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 | - |
| 300926 | 博俊科技 | 2020年 12月29 日 | 2021年 7月12 日 | 新股锁 定 | 10.76 | 22.20 | 359 | 3,862.84 | 7,969.80 | - |
| 300927 | 江天化学 | 2020年 12月29 日 | 2021年 7月7 日 | 新股锁 定 | 13.39 | 30.10 | 217 | 2,905.63 | 6,531.70 | - |
| 300929 | 华骐环保 | 2021年 1月12 日 | 2021年 7月21 日 | 新股锁 定 | 13.87 | 29.55 | 183 | 2,538.21 | 5,407.65 | - |
| 300932 | 三友联众 | 2021年 1月15 日 | 2021年 7月22 日 | 新股锁 定 | 24.69 | 31.71 | 492 | 12,147.48 | 15,601.32 | - |
| 300933 | 中辰股份 | 2021年 1月15 日 | 2021年 7月22 日 | 新股锁 定 | 3.37 | 10.44 | 1,112 | 3,747.44 | 11,609.28 | - |
| 300937 | 药易购 | 2021年 1月20 日 | 2021年 7月27 日 | 新股锁 定 | 12.25 | 53.71 | 244 | 2,989.00 | 13,105.24 | - |
| 300940 | 南极光 | 2021年 1月27 日 | 2021年 8月3 日 | 新股锁 定 | 12.76 | 43.38 | 307 | 3,917.32 | 13,317.66 | - |
| 300941 | 创识科技 | 2021年 2月2 日 | 2021年 8月9 日 | 新股锁 定 | 21.31 | 49.94 | 399 | 8,502.69 | 19,926.06 | - |
| 300942 | 易瑞生物 | 2021年 2月2 日 | 2021年 8月9 日 | 新股锁 定 | 5.31 | 28.52 | 443 | 2,352.33 | 12,634.36 | - |
| 300943 | 春晖智控 | 2021年 2月3 日 | 2021年 8月10 日 | 新股锁 定 | 9.79 | 23.01 | 255 | 2,496.45 | 5,867.55 | - |
| 300945 | 曼卡龙 | 2021年 2月3 日 | 2021年 8月10 日 | 新股锁 定 | 4.56 | 18.88 | 474 | 2,161.44 | 8,949.12 | - |
| 300950 | 德固特 | 2021年 2月24 日 | 2021年 9月3 日 | 新股锁 定 | 8.41 | 39.13 | 219 | 1,841.79 | 8,569.47 | - |
| 300952 | 恒辉安防 | 2021年 3月3 日 | 2021年 9月13 日 | 新股锁 定 | 11.72 | 27.08 | 340 | 3,984.80 | 9,207.20 | - |
| 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 | 240 | 6,904.80 | 23,964.00 | - |

| | | | | | | | | | | | |
|--------|------|--------------------|---------------------|----------|-------|--------|-------|-----------|------------|--|---|
| | | 日 | 日 | | | | | | | | |
| 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 | 232 | 3,834.96 | 10,688.24 | | - |
| 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 | 371 | 4,767.35 | 9,571.80 | | - |
| 300957 | 贝泰妮 | 2021年 3月18 日 | 2021年 9月27 日 | 新股锁 定 | 47.33 | 251.96 | 489 | 23,144.37 | 123,208.44 | | - |
| 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 | 394 | 3,341.12 | 8,695.58 | | - |
| 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 | 283 | 3,432.79 | 6,364.67 | | - |
| 300966 | 共同药业 | 2021年 3月31 日 | 2021年 10月 11日 | 新股锁 定 | 8.24 | 31.54 | 286 | 2,356.64 | 9,020.44 | | - |
| 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 | 507 | 2,301.78 | 5,850.78 | | - |
| 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 | 1,162 | 7,982.94 | 14,025.34 | | - |
| 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 | 245 | 4,468.80 | 6,931.05 | | - |
| 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 | 360 | 10,180.80 | 41,655.60 | | - |
| 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 | 492 | 2,696.16 | 6,410.76 | | - |
| 300978 | 东箭 | 2021年 | 2021年 | 新股锁 | 8.42 | 13.60 | 593 | 4,993.06 | 8,064.80 | | - |

| | | | | | | | | | | | |
|--------|------|------------|-------------|------|-------|-------|-----|-----------|-----------|--|---|
| | 科技 | 4月15日 | 10月26日 | 定 | | | | | | | |
| 300979 | 华利集团 | 2021年4月15日 | 2021年10月26日 | 新股锁定 | 33.22 | 87.50 | 842 | 27,971.24 | 73,675.00 | | - |
| 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 | 481 | 23,371.79 | 43,477.59 | | - |
| 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 | 317 | 5,018.11 | 14,356.93 | | - |
| 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 | 264 | 3,904.56 | 8,070.48 | | - |
| 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 | 欢乐家 | 2021年5月26日 | 2021年12月2日 | 新股锁定 | 4.94 | 13.05 | 928 | 4,584.32 | 12,110.40 | | - |
| 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 | 英诺激光 | 2021年 6月28 日 | 2021年 7月6 日 | 新股未 上市 | 9.46 | 9.46 | 2,899 | 27,424.54 | 27,424.54 | - |
| 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 | - |
| 688161 | 威高骨科 | 2021年 6月23 日 | 2021年 12月 30日 | 新股锁 定 | 36.22 | 82.27 | 3,069 | 111,159.18 | 252,486.63 | - |
| 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 | 2022年 1月5 日 | 新股锁 定 | 11.48 | 11.48 | 4,926 | 56,550.48 | 56,550.48 | - |
| 688383 | 新益昌 | 2021年 4月21 日 | 2021年 10月 28日 | 新股锁 定 | 19.58 | 106.24 | 2,701 | 52,885.58 | 286,954.24 | - |
| 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 | - |

| | | 日 | 日 | | | | | | | | |
|-----------|----------|--------------------|---------------------|------------|----------|------------|------------------|------------|------------|----|---|
| 688565 | 力源科技 | 2021年 5月6 日 | 2021年 11月 15日 | 新股锁 定 | 9.39 | 14.00 | 2,464 | 23,136.96 | 34,496.00 | | - |
| 688621 | 阳光诺和 | 2021年 6月11 日 | 2021年 12月 21日 | 新股锁 定 | 26.89 | 63.99 | 1,485 | 39,931.65 | 95,025.15 | | - |
| 688626 | 翔宇医疗 | 2021年 3月23 日 | 2021年 10月8 日 | 新股锁 定 | 28.82 | 104.16 | 3,652 | 105,250.64 | 380,392.32 | | - |
| 688659 | 元琛科技 | 2021年 3月24 日 | 2021年 10月8 日 | 新股锁 定 | 6.50 | 10.46 | 3,671 | 23,861.50 | 38,398.66 | | - |
| 688681 | 科汇股份 | 2021年 6月4 日 | 2021年 12月 16日 | 新股锁 定 | 9.56 | 14.54 | 1,899 | 18,154.44 | 27,611.46 | | - |
| 受限证券类别：债券 | | | | | | | | | | | |
| 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：张) | 期末 成本总额 | 期末估值总 额 | 备注 | |
| 113050 | 南银转债 | 2021年 6月16 日 | 2021年 7月1 日 | 新债未 上市 | 100.00 | 100.00 | 1,950 | 195,000.00 | 195,000.00 | | - |

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。本基金参与网下申购获得的新股，在新股上市之前及上市之后的约定期限(若有)内不得转让；本基金参与网上申购获得的新股，在新股上市之前不得转让。

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

6.4.8.3.1 银行间市场债券正回购

无。

6.4.8.3.2 交易所市场债券正回购

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招商银行，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。

本基金债券投资的信用评级情况按《中国人民银行信用评级管理指导意见》设定的标准统计及汇总。

6.4.9.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

| 短期信用评级 | 本期末 2021年6月30日 | 上年度末 2020年12月31日 |
|--------|-------------------|---------------------|
| A-1 | - | - |
| A-1 以下 | - | - |
| 未评级 | 31,490,000.00 | 63,010,500.00 |
| 合计 | 31,490,000.00 | 63,010,500.00 |

注：上述未评级债券为政策性金融债。

6.4.9.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

无。

6.4.9.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

无。

6.4.9.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

| 长期信用评级 | 本期末 2021年6月30日 | 上年度末 2020年12月31日 |
|--------|-------------------|---------------------|
| AAA | 477,603,121.50 | 447,650,400.00 |
| AAA 以下 | 3,058.50 | 119,531.76 |
| 未评级 | 11,978,254.20 | 12,045,151.80 |
| 合计 | 489,584,434.20 | 459,815,083.56 |

注：未评级债券为政策性金融债。

6.4.9.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

无。

6.4.9.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

无。

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%。

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

6.4.9.4 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

利率风险是指金融工具的公允价值或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。

本基金投资于交易所及银行间市场交易的固定收益品种比重较大，此外还持有银行存款、结算备付金、存出保证金及买入返售金融资产等利率敏感性资产，因此存在相应的利率风险。

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 | 2,077,341.30 | - | - | - | 2,077,341.30 |
| 结算备付金 | 3,321,832.17 | - | - | - | 3,321,832.17 |
| 存出保证金 | 157,867.39 | - | - | - | 157,867.39 |
| 交易性金融资产 | 318,741,654.20 | 201,628,000.00 | 704,780.00 | 190,201,524.50 | 711,275,958.70 |
| 买入返售金融资产 | 37,000,000.00 | - | - | - | 37,000,000.00 |
| 应收利息 | - | - | - | 6,478,513.86 | 6,478,513.86 |
| 应收申购款 | - | - | - | 1,712.37 | 1,712.37 |
| 应收证券清算款 | - | - | - | 1,327,941.97 | 1,327,941.97 |
| 资产总计 | 361,298,695.06 | 201,628,000.00 | 704,780.00 | 198,009,692.70 | 761,641,167.76 |
| 负债 | | | | | |
| 应付赎回款 | - | - | - | 4,065.00 | 4,065.00 |
| 应付管理人报酬 | - | - | - | 367,548.10 | 367,548.10 |
| 应付托管费 | - | - | - | 91,887.02 | 91,887.02 |
| 应付销售服务费 | - | - | - | 27,435.56 | 27,435.56 |
| 应付交易费用 | - | - | - | 423,595.13 | 423,595.13 |
| 应交税费 | - | - | - | 24,232.32 | 24,232.32 |
| 其他负债 | - | - | - | 113,139.65 | 113,139.65 |
| 负债总计 | - | - | - | 1,051,902.78 | 1,051,902.78 |
| 利率敏感度缺口 | 361,298,695.06 | 201,628,000.00 | 704,780.00 | 196,957,789.92 | 760,589,264.98 |
| 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 | 246,709.70 | - | - | - | 246,709.70 |
| 结算备付金 | 5,045,231.05 | - | - | - | 5,045,231.05 |
| 存出保证金 | 391,338.87 | - | - | - | 391,338.87 |
| 交易性金融资产 | 180,009,651.80 | 342,356,400.00 | 459,531.76 | 212,051,940.20 | 734,877,523.76 |
| 买入返售金融资产 | 10,600,000.00 | - | - | - | 10,600,000.00 |
| 应收利息 | - | - | - | 9,108,668.15 | 9,108,668.15 |
| 应收申购款 | - | - | - | 65,082.47 | 65,082.47 |
| 应收证券清算款 | - | - | - | 6,969,975.82 | 6,969,975.82 |
| 资产总计 | 196,292,931.42 | 342,356,400.00 | 459,531.76 | 228,195,666.64 | 767,304,529.82 |
| 负债 | | | | | |
| 应付赎回款 | - | - | - | 66,366.22 | 66,366.22 |
| 应付管理人报酬 | - | - | - | 365,205.26 | 365,205.26 |
| 应付托管费 | - | - | - | 91,301.34 | 91,301.34 |
| 应付证券清算款 | - | - | - | 4,949,170.17 | 4,949,170.17 |
| 卖出回购金融资产款 | 28,000,000.00 | - | - | - | 28,000,000.00 |
| 应付销售服务费 | - | - | - | 23,297.78 | 23,297.78 |
| 应付交易费用 | - | - | - | 685,109.58 | 685,109.58 |
| 应付利息 | - | - | - | -7,482.33 | -7,482.33 |
| 应交税费 | - | - | - | 27,125.81 | 27,125.81 |
| 其他负债 | - | - | - | 179,065.47 | 179,065.47 |
| 负债总计 | 28,000,000.00 | - | - | 6,379,159.30 | 34,379,159.30 |
| 利率敏感度缺口 | 168,292,931.42 | 342,356,400.00 | 459,531.76 | 221,816,507.34 | 732,925,370.52 |

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予以分类。

6.4.9.4.1.2 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 | | |
|----|--------------------|-----------------------------|-------------------|
| | 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 | 利率上升 25 个基点 | -1,097,454.63 | -1,296,683.65 |
| | 利率下降 25 个基点 | 1,103,584.37 | 1,302,492.74 |

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。

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 | 190,201,524.50 | 25.01 | 212,051,940.20 | 28.93 |
| 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 | 190,201,524.50 | 25.01 | 212,051,940.20 | 28.93 |

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% | 9,052,096.45 | 46,787,164.16 |
| | 业绩比较基准下降5% | -9,052,096.45 | -46,787,164.16 |

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 | 190,201,524.50 | 24.97 |
| | 其中：股票 | 190,201,524.50 | 24.97 |
| 2 | 基金投资 | - | - |
| 3 | 固定收益投资 | 521,074,434.20 | 68.41 |
| | 其中：债券 | 521,074,434.20 | 68.41 |
| | 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 | 37,000,000.00 | 4.86 |
| | 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 | 5,399,173.47 | 0.71 |
| 8 | 其他各项资产 | 7,966,035.59 | 1.05 |
| 9 | 合计 | 761,641,167.76 | 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 | 5,850.78 | 0.00 |
| B | 采矿业 | 5,160,000.00 | 0.68 |
| C | 制造业 | 158,464,910.01 | 20.83 |
| D | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | 13,020.39 | 0.00 |
| E | 建筑业 | 14,356.93 | 0.00 |
| F | 批发和零售业 | 46,404.58 | 0.01 |
| G | 交通运输、仓储和邮政业 | - | - |
| H | 住宿和餐饮业 | - | - |
| I | 信息传输、软件和信息技术服务业 | 7,214,281.85 | 0.95 |
| J | 金融业 | 19,109,852.10 | 2.51 |
| K | 房地产业 | 7,772.46 | 0.00 |
| L | 租赁和商务服务业 | - | - |
| M | 科学研究和技术服务业 | 95,025.15 | 0.01 |

| | | | |
|---|---------------|----------------|-------|
| N | 水利、环境和公共设施管理业 | 70,050.25 | 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 | - | - |
| R | 文化、体育和娱乐业 | - | - |
| S | 综合 | - | - |
| | 合计 | 190,201,524.50 | 25.01 |

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 | 002475 | 立讯精密 | 459,960 | 21,158,160.00 | 2.78 |
| 2 | 603986 | 兆易创新 | 76,085 | 14,296,371.50 | 1.88 |
| 3 | 300433 | 蓝思科技 | 450,000 | 13,234,500.00 | 1.74 |
| 4 | 600085 | 同仁堂 | 300,000 | 12,255,000.00 | 1.61 |
| 5 | 000538 | 云南白药 | 98,200 | 11,363,704.00 | 1.49 |
| 6 | 603501 | 韦尔股份 | 35,079 | 11,295,438.00 | 1.49 |
| 7 | 002938 | 鹏鼎控股 | 300,000 | 10,764,000.00 | 1.42 |
| 8 | 300999 | 金龙鱼 | 120,000 | 10,195,200.00 | 1.34 |
| 9 | 600332 | 白云山 | 300,000 | 10,155,000.00 | 1.34 |
| 10 | 601398 | 工商银行 | 1,874,300 | 9,690,131.00 | 1.27 |
| 11 | 000625 | 长安汽车 | 300,000 | 7,884,000.00 | 1.04 |
| 12 | 002624 | 完美世界 | 299,956 | 7,171,947.96 | 0.94 |
| 13 | 603160 | 汇顶科技 | 50,000 | 6,481,500.00 | 0.85 |
| 14 | 600703 | 三安光电 | 200,000 | 6,410,000.00 | 0.84 |
| 15 | 300888 | 稳健医疗 | 50,000 | 6,181,000.00 | 0.81 |
| 16 | 601288 | 农业银行 | 2,000,000 | 6,060,000.00 | 0.80 |
| 17 | 603993 | 洛阳钼业 | 1,000,000 | 5,160,000.00 | 0.68 |
| 18 | 600104 | 上汽集团 | 200,000 | 4,394,000.00 | 0.58 |
| 19 | 601939 | 建设银行 | 500,000 | 3,325,000.00 | 0.44 |
| 20 | 002242 | 九阳股份 | 100,000 | 3,249,000.00 | 0.43 |
| 21 | 300824 | 北鼎股份 | 100,000 | 2,512,000.00 | 0.33 |
| 22 | 603808 | 歌力思 | 150,000 | 2,370,000.00 | 0.31 |
| 23 | 600380 | 健康元 | 100,000 | 1,373,000.00 | 0.18 |
| 24 | 688063 | 派能科技 | 4,511 | 887,764.80 | 0.12 |
| 25 | 688626 | 翔宇医疗 | 3,652 | 380,392.32 | 0.05 |
| 26 | 688383 | 新益昌 | 2,701 | 286,954.24 | 0.04 |

| | | | | | |
|----|--------|------|-------|------------|------|
| 27 | 688161 | 威高骨科 | 3,069 | 252,486.63 | 0.03 |
| 28 | 300957 | 贝泰妮 | 489 | 123,208.44 | 0.02 |
| 29 | 688621 | 阳光诺和 | 1,485 | 95,025.15 | 0.01 |
| 30 | 688499 | 利元亨 | 2,149 | 83,488.65 | 0.01 |
| 31 | 300919 | 中伟股份 | 491 | 80,033.00 | 0.01 |
| 32 | 300979 | 华利集团 | 842 | 73,675.00 | 0.01 |
| 33 | 688239 | 航宇科技 | 4,926 | 56,550.48 | 0.01 |
| 34 | 688087 | 英科再生 | 2,469 | 54,219.24 | 0.01 |
| 35 | 301020 | 密封科技 | 4,210 | 44,794.40 | 0.01 |
| 36 | 300981 | 中红医疗 | 481 | 43,477.59 | 0.01 |
| 37 | 300973 | 立高食品 | 360 | 41,655.60 | 0.01 |
| 38 | 688659 | 元琛科技 | 3,671 | 38,398.66 | 0.01 |
| 39 | 601528 | 瑞丰银行 | 2,230 | 34,721.10 | 0.00 |
| 40 | 688565 | 力源科技 | 2,464 | 34,496.00 | 0.00 |
| 41 | 688681 | 科汇股份 | 1,899 | 27,611.46 | 0.00 |
| 42 | 301021 | 英诺激光 | 2,899 | 27,424.54 | 0.00 |
| 43 | 300953 | 震裕科技 | 240 | 23,964.00 | 0.00 |
| 44 | 001207 | 联科科技 | 682 | 22,581.02 | 0.00 |
| 45 | 301009 | 可靠股份 | 801 | 22,339.89 | 0.00 |
| 46 | 300941 | 创识科技 | 399 | 19,926.06 | 0.00 |
| 47 | 301015 | 百洋医药 | 462 | 17,939.46 | 0.00 |
| 48 | 688226 | 威腾电气 | 2,693 | 17,289.06 | 0.00 |
| 49 | 300932 | 三友联众 | 492 | 15,601.32 | 0.00 |
| 50 | 300982 | 苏文电能 | 317 | 14,356.93 | 0.00 |
| 51 | 300968 | 格林精密 | 1,162 | 14,025.34 | 0.00 |
| 52 | 001208 | 华菱线缆 | 1,754 | 13,558.42 | 0.00 |
| 53 | 300940 | 南极光 | 307 | 13,317.66 | 0.00 |
| 54 | 300614 | 百川畅银 | 329 | 13,285.02 | 0.00 |
| 55 | 300937 | 药易购 | 244 | 13,105.24 | 0.00 |
| 56 | 301013 | 利和兴 | 471 | 12,768.81 | 0.00 |
| 57 | 300942 | 易瑞生物 | 443 | 12,634.36 | 0.00 |
| 58 | 603171 | 税友股份 | 637 | 12,230.40 | 0.00 |
| 59 | 300997 | 欢乐家 | 928 | 12,110.40 | 0.00 |
| 60 | 300933 | 中辰股份 | 1,112 | 11,609.28 | 0.00 |
| 61 | 301002 | 崧盛股份 | 201 | 11,581.62 | 0.00 |
| 62 | 300918 | 南山智尚 | 1,063 | 11,065.83 | 0.00 |
| 63 | 300955 | 嘉亨家化 | 232 | 10,688.24 | 0.00 |
| 64 | 300996 | 普联软件 | 241 | 10,177.43 | 0.00 |
| 65 | 300922 | 天秦装备 | 287 | 9,996.21 | 0.00 |
| 66 | 300956 | 英力股份 | 371 | 9,571.80 | 0.00 |
| 67 | 300962 | 中金辐照 | 576 | 9,429.12 | 0.00 |
| 68 | 300952 | 恒辉安防 | 340 | 9,207.20 | 0.00 |

| | | | | | |
|----|--------|------|-------|----------|------|
| 69 | 301016 | 雷尔伟 | 275 | 9,069.50 | 0.00 |
| 70 | 300966 | 共同药业 | 286 | 9,020.44 | 0.00 |
| 71 | 300945 | 曼卡龙 | 474 | 8,949.12 | 0.00 |
| 72 | 300961 | 深水海纳 | 394 | 8,695.58 | 0.00 |
| 73 | 300950 | 德固特 | 219 | 8,569.47 | 0.00 |
| 74 | 605162 | 新中港 | 1,377 | 8,358.39 | 0.00 |
| 75 | 300958 | 建工修复 | 300 | 8,166.00 | 0.00 |
| 76 | 300986 | 志特新材 | 264 | 8,070.48 | 0.00 |
| 77 | 300978 | 东箭科技 | 593 | 8,064.80 | 0.00 |
| 78 | 300926 | 博俊科技 | 359 | 7,969.80 | 0.00 |
| 79 | 300993 | 玉马遮阳 | 410 | 7,908.90 | 0.00 |
| 80 | 300917 | 特发服务 | 281 | 7,772.46 | 0.00 |
| 81 | 300971 | 博亚精工 | 245 | 6,931.05 | 0.00 |
| 82 | 300991 | 创益通 | 254 | 6,733.54 | 0.00 |
| 83 | 300927 | 江天化学 | 217 | 6,531.70 | 0.00 |
| 84 | 300975 | 商络电子 | 492 | 6,410.76 | 0.00 |
| 85 | 300963 | 中洲特材 | 283 | 6,364.67 | 0.00 |
| 86 | 301011 | 华立科技 | 175 | 5,922.00 | 0.00 |
| 87 | 300943 | 春晖智控 | 255 | 5,867.55 | 0.00 |
| 88 | 300967 | 晓鸣股份 | 507 | 5,850.78 | 0.00 |
| 89 | 300929 | 华骐环保 | 183 | 5,407.65 | 0.00 |
| 90 | 300960 | 通业科技 | 234 | 5,396.04 | 0.00 |
| 91 | 605011 | 杭州热电 | 525 | 4,662.00 | 0.00 |
| 92 | 300995 | 奇德新材 | 191 | 4,454.12 | 0.00 |
| 93 | 301007 | 德迈仕 | 303 | 4,375.32 | 0.00 |
| 94 | 300998 | 宁波方正 | 201 | 4,285.32 | 0.00 |
| 95 | 301012 | 扬电科技 | 170 | 4,124.20 | 0.00 |
| 96 | 300992 | 泰福泵业 | 200 | 4,064.00 | 0.00 |
| 97 | 301010 | 晶雪节能 | 218 | 3,838.98 | 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 | 300433 | 蓝思科技 | 31,478,534.47 | 4.29 |
| 2 | 603986 | 兆易创新 | 25,332,187.96 | 3.46 |
| 3 | 002475 | 立讯精密 | 24,113,371.11 | 3.29 |
| 4 | 300999 | 金龙鱼 | 21,836,919.23 | 2.98 |
| 5 | 002415 | 海康威视 | 20,727,203.00 | 2.83 |
| 6 | 601995 | 中金公司 | 16,782,019.08 | 2.29 |
| 7 | 603501 | 韦尔股份 | 16,725,216.49 | 2.28 |
| 8 | 603993 | 洛阳钼业 | 14,999,383.00 | 2.05 |

| | | | | |
|----|--------|------|---------------|------|
| 9 | 600030 | 中信证券 | 14,846,968.00 | 2.03 |
| 10 | 002466 | 天齐锂业 | 14,477,945.00 | 1.98 |
| 11 | 002624 | 完美世界 | 14,449,622.52 | 1.97 |
| 12 | 600085 | 同仁堂 | 12,907,780.00 | 1.76 |
| 13 | 002938 | 鹏鼎控股 | 10,757,951.00 | 1.47 |
| 14 | 002460 | 赣锋锂业 | 10,648,658.00 | 1.45 |
| 15 | 002555 | 三七互娱 | 9,810,419.88 | 1.34 |
| 16 | 600332 | 白云山 | 9,344,989.00 | 1.28 |
| 17 | 002146 | 荣盛发展 | 7,646,670.00 | 1.04 |
| 18 | 000625 | 长安汽车 | 7,605,539.00 | 1.04 |
| 19 | 603799 | 华友钴业 | 7,527,419.00 | 1.03 |
| 20 | 601288 | 农业银行 | 6,720,000.00 | 0.92 |

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 | 300999 | 金龙鱼 | 36,464,759.93 | 4.98 |
| 2 | 300433 | 蓝思科技 | 30,710,915.11 | 4.19 |
| 3 | 002415 | 海康威视 | 30,533,729.47 | 4.17 |
| 4 | 603986 | 兆易创新 | 25,705,924.68 | 3.51 |
| 5 | 002475 | 立讯精密 | 19,222,388.24 | 2.62 |
| 6 | 002466 | 天齐锂业 | 18,153,228.72 | 2.48 |
| 7 | 601318 | 中国平安 | 17,730,621.00 | 2.42 |
| 8 | 603501 | 韦尔股份 | 15,900,827.86 | 2.17 |
| 9 | 601995 | 中金公司 | 13,680,196.32 | 1.87 |
| 10 | 000651 | 格力电器 | 12,806,145.46 | 1.75 |
| 11 | 600030 | 中信证券 | 12,449,426.36 | 1.70 |
| 12 | 603993 | 洛阳钼业 | 12,279,586.00 | 1.68 |
| 13 | 002460 | 赣锋锂业 | 11,866,575.80 | 1.62 |
| 14 | 603799 | 华友钴业 | 9,878,475.00 | 1.35 |
| 15 | 002142 | 宁波银行 | 9,839,193.23 | 1.34 |
| 16 | 603444 | 吉比特 | 9,672,384.00 | 1.32 |
| 17 | 601888 | 中国中免 | 9,480,056.00 | 1.29 |
| 18 | 002624 | 完美世界 | 7,724,721.00 | 1.05 |
| 19 | 600438 | 通威股份 | 7,242,068.00 | 0.99 |
| 20 | 600196 | 复星医药 | 6,834,236.00 | 0.93 |

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 | 438,397,934.28 |
|--------------|----------------|

| | |
|--------------|----------------|
| 卖出股票收入（成交）总额 | 486,411,829.30 |
|--------------|----------------|

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），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 | 1,478,000.00 | 0.19 |
| 2 | 央行票据 | - | - |
| 3 | 金融债券 | 182,064,254.20 | 23.94 |
| | 其中：政策性金融债 | 41,990,254.20 | 5.52 |
| 4 | 企业债券 | 120,794,000.00 | 15.88 |
| 5 | 企业短期融资券 | - | - |
| 6 | 中期票据 | 216,033,400.00 | 28.40 |
| 7 | 可转债（可交换债） | 704,780.00 | 0.09 |
| 8 | 同业存单 | - | - |
| 9 | 其他 | - | - |
| 10 | 合计 | 521,074,434.20 | 68.51 |

7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

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 | 101900491 | 19 粤铁建 MTN001 | 600,000 | 60,636,000.00 | 7.97 |
| 2 | 1828014 | 18 兴业绿色金融 01 | 400,000 | 40,400,000.00 | 5.31 |
| 3 | 1928005 | 19 浦发银行小微债 01 | 400,000 | 40,256,000.00 | 5.29 |
| 4 | 101801237 | 18 甘国投 MTN002 | 340,000 | 34,326,400.00 | 4.51 |
| 5 | 101751004 | 17 中节能 MTN001 | 300,000 | 30,492,000.00 | 4.01 |

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

1. 本基金投资的前十名证券之一 18 民生银行 01 (1828016. IB) 的发行主体中国民生银行股份有限公司于 2020 年 7 月 14 日因违反宏观调控政策，违规为房地产企业缴纳土地出让金提供融资等，受到中国人民银行处罚（银罚字（2020）43 号），于 2021 年 7 月 13 日因监管发现问题屡查屡犯等，受到中国银行保险监督管理委员会处罚（银保监罚决字（2021）26 号）。本基金认为，对民生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 19 浦发银行小微债 01 (1928005. IB) 的发行主体上海浦东发展银行股份有限公司于 2021 年 7 月 13 日因监管发现的问题屡查屡犯等，受到中国银行保险监督管理委员会处罚（银保监罚决字（2021）27 号）。本基金认为，对浦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 19 交通银行 01 (1928034. 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），于 2021 年 8 月 13 日因违反信用信息采集、提供、查询及相关管理规定，受到中国人民银行处罚（银罚字（2021）23 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。

4. 本基金投资的前十名证券之一工商银行 (601398. SH) 的发行主体中国工商银行股份有限公司于 2020 年 12 月 25 日因未按规定将案件风险事件确认为案件并报送案件信息确认报告等，受到中国银行保险监督管理委员会处罚（银保监罚决字（2020）71 号）。本基金认为，对工商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 18 兴业绿色金融 01 (1828014. IB) 的发行主体兴业银行股份有限公司于 2021 年 8 月 13 日因违反信用信息采集、提供、查询及相关管理规定，受到中国人民银行处罚（银罚字（2021）26 号）。本基金认为，对兴业银行的处罚不会对其投资价值构成实质性负面影响。

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 | 157,867.39 |
| 2 | 应收证券清算款 | 1,327,941.97 |
| 3 | 应收股利 | - |
| 4 | 应收利息 | 6,478,513.86 |
| 5 | 应收申购款 | 1,712.37 |
| 6 | 其他应收款 | - |
| 7 | 待摊费用 | - |
| 8 | 其他 | - |
| 9 | 合计 | 7,966,035.59 |

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（%） |
| 大成景禄灵活配 | 522 | 535,070.54 | 278,800,809.12 | 99.82 | 506,014.37 | 0.18 |

| | | | | | | |
|--------------|-------|------------|----------------|-------|--------------|------|
| 置混合 A | | | | | | |
| 大成景禄灵活配置混合 C | 723 | 316,663.12 | 227,979,009.80 | 99.58 | 968,422.92 | 0.42 |
| 合计 | 1,245 | 408,236.35 | 506,779,818.92 | 99.71 | 1,474,437.29 | 0.29 |

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 | 大成景禄灵活配置混合 A | 1,026.17 | 0.0004 |
| | 大成景禄灵活配置混合 C | 25,757.06 | 0.0113 |
| | 合计 | 26,783.23 | 0.0053 |

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、基金投资和部门负责人持有本开放式基金 | 大成景禄灵活配置混合 A | 0~10 |
| | 大成景禄灵活配置混合 C | 0~10 |
| | 合计 | 0~10 |
| 本基金基金经理持有本开放式基金 | 大成景禄灵活配置混合 A | 0 |
| | 大成景禄灵活配置混合 C | 0 |

| | | | |
|--|----|--|---|
| | 合计 | | 0 |
|--|----|--|---|

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

| 项目 | 大成景禄灵活配置混合 A | 大成景禄灵活配置混合 C |
|--|----------------|----------------|
| 基金合同生效日 (2016 年 9 月 29 日) 基金份额总额 | 25,464.87 | 800,261,983.00 |
| 本报告期期初基金份额总额 | 316,393,649.36 | 196,240,567.36 |
| 本报告期基金总申购份额 | 539,482.95 | 34,810,498.08 |
| 减：本报告期基金总赎回份额 | 37,626,308.82 | 2,103,632.72 |
| 本报告期基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列） | - | - |
| 本报告期末基金份额总额 | 279,306,823.49 | 228,947,432.72 |

§ 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

基金托管人的基金托管部门无重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

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 | |
| 光大证券 | 1 | 465,050,622.30 | 50.79% | 423,815.15 | 50.79% | - |
| 招商证券 | 1 | 450,596,417.61 | 49.21% | 410,630.70 | 49.21% | - |
| 国信证券 | 1 | - | - | - | - | - |

注：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。

本报告期内本基金新增席位：无。

本报告期内本基金退租席位：无。

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

金额单位：人民币元

| 券商名称 | 债券交易 | | 债券回购交易 | | 权证交易 | |
|------|------|------------|--------|---------|------|-------|
| | 成交金额 | 占当期债券成交总额的 | 成交金额 | 占当期债券回购 | 成交金额 | 占当期权证 |

| | | 比例 | | 成交总额的 比例 | | 成交总额的 比例 |
|------|---------------|--------|------------------|-------------|---|-------------|
| 光大证券 | 106,157.24 | 0.18% | - | - | - | - |
| 招商证券 | 59,093,286.00 | 99.82% | 4,341,300,000.00 | 100.00% | - | - |

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 | 关于大成景禄灵活配置混合型证券投资基金恢复大额申购（含定期定额投资）及基金转换转入业务的公告 | 中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站 | 2021年6月1日 |
| 3 | 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 |
| 4 | 大成基金管理有限公司关于旗下部分基金增加上海中正达广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12日 |
| 5 | 大成景禄灵活配置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 | 大成景禄灵活配置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 |
| 7 | 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 |
| 8 | 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 |
| 9 | 大成景禄灵活配置混合型证券投资基金 2020 年第四季度报告 | 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

| 投资者类 | 报告期内持有基金份额变化情况 | 报告期末持有基金情况 |
|------|----------------|------------|
|------|----------------|------------|

| 别 | 序号 | 持有基金份额比例达到或者超过20%的时间区间 | 期初份额 | 申购份额 | 赎回份额 | 持有份额 | 份额占比(%) |
|---|----|------------------------|----------------|------|------|----------------|---------|
| 机构 | 1 | 20210101-20210630 | 109,785,552.22 | - | - | 109,785,552.22 | 21.60 |
| | 2 | 20210101-20210630 | 241,564,254.68 | - | - | 241,564,254.68 | 47.53 |
| 产品特有风险 | | | | | | | |
| 当基金份额持有人占比过于集中时，可能会因某单一基金份额持有人大额赎回而引发基金净值剧烈波动的风险，甚至有可能引起基金的流动性风险，基金管理人可能无法及时变现基金资产以应对基金份额持有人的赎回申请，基金份额持有人可能无法及时赎回持有的全部基金份额。 | | | | | | | |

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景禄灵活配置混合型证券投资基金的文件；
- 2、《大成景禄灵活配置混合型证券投资基金基金合同》；
- 3、《大成景禄灵活配置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

2021年8月31日