

大成行业轮动混合型证券投资基金 2021 年中期报告

2021 年 6 月 30 日

基金管理人：大成基金管理有限公司

基金托管人：中国农业银行股份有限公司

送出日期：2021 年 8 月 31 日

§ 1 重要提示及目录

1.1 重要提示

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

基金托管人中国农业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	5
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	6
§ 4 管理人报告	8
4.1 基金管理人及基金经理情况	8
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	13
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	13
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	14
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	15
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明	15
§ 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	17
6.3 所有者权益（基金净值）变动表	18
6.4 报表附注	19
§ 7 投资组合报告	35
7.1 期末基金资产组合情况	35
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	36
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	36
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	44
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	45
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	46

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	46
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	46
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	46
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明	46
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	46
7.12 投资组合报告附注	46
§ 8 基金份额持有人信息	47
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	47
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	48
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	48
§ 9 开放式基金份额变动	48
§ 10 重大事件揭示	48
10.1 基金份额持有人大会决议	48
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	48
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	48
10.4 基金投资策略的改变	48
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	48
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	49
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	49
10.8 其他重大事件	51
§ 11 影响投资者决策的其他重要信息	52
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	52
11.2 影响投资者决策的其他重要信息	52
§ 12 备查文件目录	52
12.1 备查文件目录	52
12.2 存放地点	53
12.3 查阅方式	53

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	大成行业轮动混合型证券投资基金
基金简称	大成行业轮动混合
基金主代码	090009
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2009 年 9 月 8 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	46,272,026.24 份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	利用行业轮动效应，优化行业配置，获取超额投资收益，实现基金资产长期稳健增值。
投资策略	本基金将重点围绕我国经济周期动力机制与发展规律，研究我国国民经济发展过程中的结构化特征，捕捉行业轮动效应下的投资机会，自上而下的实施大类资产间的战略配置和股票类别间的战术配置，精选优质行业的优质股票，获取超额投资收益，实现基金资产的长期稳健增值。
业绩比较基准	80%×沪深 300 指数+20%×中证综合债券指数
风险收益特征	本基金为混合型基金，属于证券投资基金中预期风险和预期收益适中的品种，其预期风险和预期收益低于股票型基金，高于债券型基金和货币市场基金。

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 负责人	姓名	赵冰	秦一楠
	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		深圳市福田区深南大道 7088 号招商银行大厦 32 层	北京市东城区建国门内大街 69 号
办公地址		深圳市福田区深南大道 7088 号招商银行大厦 32 层	北京市西城区复兴门内大街 28 号凯晨世贸中心东座 F9
邮政编码		518040	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	《上海证券报》
登载基金中期报告正文的管理人互联网网	http://www.dcfund.com.cn

址	
基金中期报告备置地点	基金管理人及基金托管人住所

2.5 其他相关资料

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

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2021年1月1日-2021年6月30日)
本期已实现收益	15,496,778.79
本期利润	15,177,197.19
加权平均基金份额本期利润	0.3173
本期加权平均净值利润率	10.26%
本期基金份额净值增长率	10.58%
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	88,591,222.18
期末可供分配基金份额利润	1.9146
期末基金资产净值	157,218,825.41
期末基金份额净值	3.398
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2021年6月30日)
基金份额累计净值增长率	239.80%

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

2. 期末可供分配利润，采用期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数(为期末余额，不是当期发生数)。

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

3.2 基金净值表现

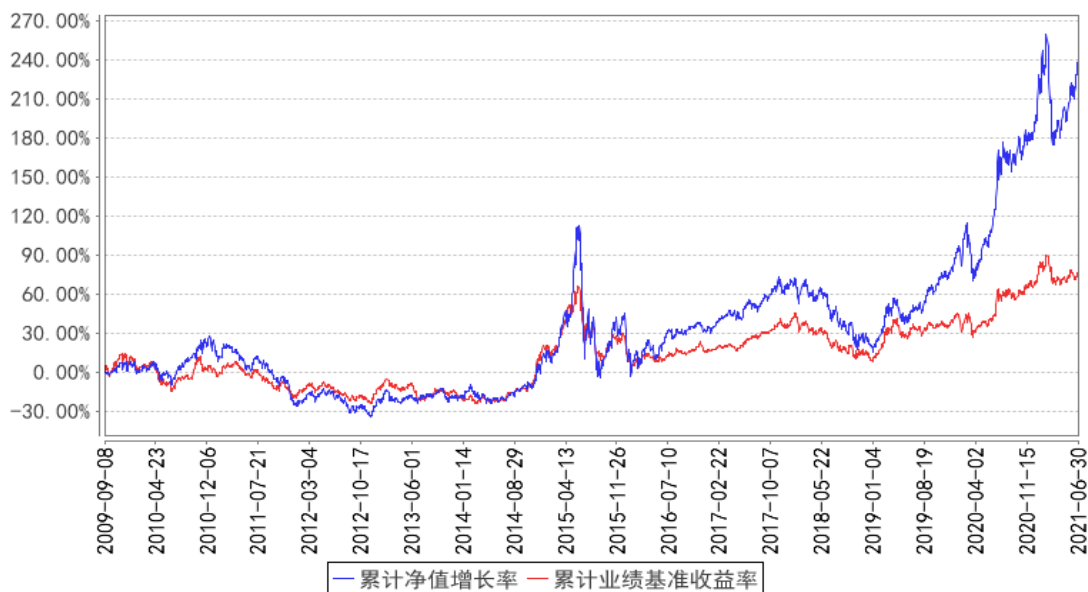
3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	5.33%	1.34%	-1.57%	0.64%	6.90%	0.70%

过去三个月	18.77%	1.19%	3.07%	0.78%	15.70%	0.41%
过去六个月	10.58%	1.72%	0.79%	1.05%	9.79%	0.67%
过去一年	49.10%	1.62%	20.99%	1.07%	28.11%	0.55%
过去三年	131.16%	1.53%	42.79%	1.09%	88.37%	0.44%
自基金合同生效起至今	239.80%	1.64%	75.47%	1.16%	164.33%	0.48%

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

大成行业轮动混合累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：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		
王磊	本基金基金经理	2015年12月14日	-	17年	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

					<p>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：中国</p>
孙丹	本基金基金经理助理	2020 年 7 月 6 日	-	13 年	<p>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。</p>

				<p>2018 年 3 月 12 日起任大成策略回报混合型证券投资基金、大成创新成长混合型证券投资基金 (LOF)、大成积极成长混合型证券投资基金、大成精选增值混合型证券投资基金、大成景阳领先混合型证券投资基金、大成竞争优势混合型证券投资基金、大成蓝筹稳健证券投资基金、大成优选混合型证券投资基金 (LOF) 基金经理助理。2020 年 7 月 1 日起任大成价值增长证券投资基金、大成多策略灵活配置混合型证券投资基金 (LOF)、大成一带一路灵活配置混合型证券投资基金、大成内需增长混合型证券投资基金、大成睿景灵活配置混合型证券投资基金、大成盛世精选灵活配置混合型证券投资基金、大成国企改革灵活配置混合型证券投资基金、大成行业轮动混合型证券投资基金、大成灵活配置混合型证券投资基金、大成产业升级股票型证券投资基金 (LOF)、大成健康产业混合型证券投资基金、大成正向回报灵活配置混合型证券投资基金、大成国家安全主题灵活配置混合型证券投资基金、大成新锐产业混合型证券投资基金、大成消费主题混合型证券投资基金基金经理助理。2020 年 11 月 6 日起任大成科技消费股票型证券投资基金、大成科创主题 3 年封闭运作灵活配置混合型证券投资基金、大成中小盘混合型证券投资基金 (LOF)、大成睿享混合型证券投资基金、大成行业先锋混合型证券投资基金基金经理助理。2021 年 2 月 1 日起任大成企业能力驱动混合型证券投资基金、大成优选升级一年持有期混合型证券投资基金、大成成长进取混合型证券投资基金基金经理助理。2021 年 2 月 22 日起任大成恒享春晓一年定期开放混合型证券投资基金基金经理助理。2021 年 4 月 19 日起任大成民稳增长混合型证券投资基金、大成恒享混合型证券投资基金基金经理助理。2021 年 7 月 29 日起任大成产业趋势混合型证券投资基金、大成投资严选六个月持有期混合型证券投资基金基金经理助理。2017 年 5 月 8 日起任大成景尚灵活配置混合型证券投资基金、大成景兴信用债债券型证券投资基金基金经理。2017 年 5 月 8 日至 2019 年 10 月 31 日任大成景</p>
--	--	--	--	---

					<p>荣债券型证券投资基金（原大成景荣保本混合型证券投资基金转型）基金经理。2017年5月31日至2020年10月20日任大成惠裕定期开放纯债债券型证券投资基金基金经理。2017年6月2日至2018年11月19日任大成景禄灵活配置混合型证券投资基金基金经理。2017年6月2日至2018年12月8日任大成景源灵活配置混合型证券投资基金基金经理。2017年6月2日至2019年6月15日任大成景秀灵活配置混合型证券投资基金。2017年6月6日至2019年9月29日任大成惠明定期开放纯债债券型证券投资基金基金经理。2018年3月14日至2018年11月30日任大成景辉灵活配置混合型证券投资基金基金经理。2018年3月14日至2018年11月30日任大成景沛灵活配置混合型证券投资基金基金经理。2018年3月14日至2018年7月20日任大成景裕灵活配置混合型证券投资基金基金经理。2018年3月14日起任大成财富管理 2020 生命周期证券投资基金基金经理。2019年7月31日至2020年5月23日任大成景丰债券型证券投资基金（LOF）基金经理。2020年2月27日至2021年4月13日任大成景泰纯债债券型证券投资基金基金经理。2020年3月5日至2021年4月14日任大成恒享混合型证券投资基金基金经理。2020年3月31日至2021年4月14日任大成民稳增长混合型证券投资基金基金经理。2020年4月26日起任大成景瑞稳健配置混合型证券投资基金基金经理。2020年8月21日至2021年5月18日任大成景和债券型证券投资基金基金经理。2020年9月3日起任大成汇享一年持有期混合型证券投资基金基金经理。2020年9月23日起任大成尊享18个月定期开放混合型证券投资基金基金经理。2020年11月16日起任大成卓享一年持有期混合型证券投资基金基金经理。2020年11月18日起任大成丰享回报混合型证券投资基金基金经理。2021年4月22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>
郭 玮	本基金基	2021 年 1	-	6 年	金融硕士。2015 年 7 月加入大成基金管理

羚	金经理	月 26 日			有限公司，先后担任研究部研究员、基金经理助理、基金经理，期间曾担任大成积极成长混合型证券投资基金、大成灵活配置混合型证券投资基金、大成行业轮动混合型证券投资基金基金经理助理。2021 年 1 月 26 日起任大成科技创新混合型证券投资基金、大成行业轮动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
郭 玮 羚	本基金基金经理助理	2020 年 3 月 2 日	2021 年 1 月 26 日	6 年	金融硕士。2015 年 7 月加入大成基金管理有限公司，先后担任研究部研究员、基金经理助理、基金经理，期间曾担任大成积极成长混合型证券投资基金、大成灵活配置混合型证券投资基金、大成行业轮动混合型证券投资基金基金经理助理。2021 年 1 月 26 日起任大成科技创新混合型证券投资基金、大成行业轮动混合型证券投资基金基金经理。具有基金从业资格。国籍：中国

注：1、任职日期、离任日期为本基金管理人作出决定之日。

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

4.1.3 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理同时管理的产品情况

无

4.2 管理人对报告期内本基金运作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，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，我国疫情防控仍然处于各大经济体中最好的水平，宏观经济也整体上处于持续回升的态势，上市公司的整体盈利水平不断回升。同时，我国提出了实现碳中和的宏伟目标和具体时间安排，在产业政策上仍然继续鼓励产业结构升级，这有利于我国以新能源产业和半导体产业为代表的科技行业的快速发展。

2021 年上半年，我国的权益市场出现了较大幅度的波动。在春节前，整体的市场情绪仍然维持在较高水平，交易活跃，绩优蓝筹股的估值得以不断提升，整个权益市场在春节前呈现快速上涨的势头。但在春节后，受部分蓝筹股估值过高和涨幅过大的情绪影响，部分蓝筹股在春节后出现了较大幅度的下跌。在市场企稳后，在我国提出的各项科技产业政策和碳中和政策的影响下，以新能源汽车、光伏、半导体为代表的行业出现了较大幅度的回升。同时由于我国宏观经济出现回暖，煤炭、有色、化工等行业在上半年也表现较好。

从市场指数看，2021 上半年中证 100 指数下跌 2.85%，上证 50 指数下跌 3.90%，上证指数上涨 3.40%，深证成指上涨 4.78%，创业板指数上涨 17.22%，小盘股指数表现要好于大盘股指数。

2021 年春节前，本产品权益仓位较高，净值出现一定幅度波动。但在权益市场企稳后，本产品增加了新能源等行业的配置比例，获得了一定收益。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末本基金份额净值为 3.398 元；本报告期基金份额净值增长率为 10.58%，业绩比较基准收益率为 0.79%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望 2021 年下半年，我们对我国的经济发展和产业结构升级仍然具有较强信心。同时，我国仍然具有较大的内需增长潜力，消费行业仍然具有广阔的市场空间。对应到权益市场上，新能源

汽车、光伏、半导体、医药、军工、消费等行业，仍然是我们下半年重点关注的行业。

我们非常感谢基金份额持有人的信任和支持，我们将按照本基金合同和风险收益特征的要求，严格控制投资风险，积极进行资产配置，适时调整组合结构，研究新的投资品种和挖掘投资机会，力争获得与基金风险特征一致的稳定收益回报给投资者。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

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

股票投资部、研究部、固定收益总部、数量与指数投资部、大类资产配置部、风险管理部负责关注相关投资品种的动态，评判基金持有的投资品种是否处于不活跃的交易状态或者最近交易日后经济环境发生了重大变化或证券发行机构发生了影响证券价格的重大事件，从而确定估值日需要进行估值测算或者调整的投资品种；提出合理的数量分析模型对需要进行估值测算或者调整的投资品种进行公允价值定价与计量；定期对估值政策和程序进行评价，以保证其持续适用；交易管理部负责关注相关投资品种的流动性状况，协助反馈其市场交易信息；基金运营部负责日常的基金资产的估值业务，执行基金估值政策，并负责与托管行沟通估值调整事项；监察稽核部负责审核估值政策和程序的一致性，监督估值委员会工作流程中的风险控制，并负责估值调整事项的信息披露工作。

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

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

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

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

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

无。

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

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 2021 年 1 月 1 日至 2021 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：大成行业轮动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	6.4.7.1	11,244,875.40	25,547,393.98
结算备付金		350,869.68	298,345.98
存出保证金		81,728.45	86,196.63
交易性金融资产	6.4.7.2	140,797,175.57	135,594,844.75
其中：股票投资		140,602,836.29	135,594,844.75
基金投资		-	-
债券投资		194,339.28	-
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
应收证券清算款		5,303,999.30	-
应收利息	6.4.7.5	3,427.76	8,326.91
应收股利		-	-
应收申购款		275,582.61	38,263.86
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		158,057,658.77	161,573,372.11
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	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		-	6,042,234.62
应付赎回款		215,840.03	685,553.16
应付管理人报酬		184,214.92	188,605.94
应付托管费		30,702.47	31,434.32
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	198,766.55	236,739.74
应交税费		0.67	-
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	209,308.72	180,906.32
负债合计		838,833.36	7,365,474.10
所有者权益：			
实收基金	6.4.7.9	46,272,026.24	50,184,698.40
未分配利润	6.4.7.10	110,946,799.17	104,023,199.61
所有者权益合计		157,218,825.41	154,207,898.01
负债和所有者权益总计		158,057,658.77	161,573,372.11

注：报告截止日 2021 年 06 月 30 日，基金份额净值 3.398 元，基金份额总额 46,272,026.24 份。

6.2 利润表

会计主体：大成行业轮动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		17,252,533.43	32,050,790.99
1. 利息收入		100,616.66	67,717.21
其中：存款利息收入	6.4.7.11	100,571.97	67,717.21
债券利息收入		44.69	-
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	-
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		17,450,549.99	25,824,557.17
其中：股票投资收益	6.4.7.12	17,031,911.13	25,184,374.98
基金投资收益	-	-	-
债券投资收益	6.4.7.13	-	-
资产支持证券投资收益		-	-
贵金属投资收益	6.4.7.14	-	-
衍生工具收益	6.4.7.15	-	-
股利收益	6.4.7.16	418,638.86	640,182.19
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	-319,581.60	6,133,001.48
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.18	20,948.38	25,515.13
减：二、费用		2,075,336.24	2,230,895.76
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	1,105,918.75	1,041,900.79
2. 托管费	6.4.10.2.2	184,319.74	173,650.15
3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用	6.4.7.19	682,542.31	907,457.13
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 税金及附加		0.19	-
7. 其他费用	6.4.7.20	102,555.25	107,887.69

三、利润总额(亏损总额以“-”号填列)		15,177,197.19	29,819,895.23
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		15,177,197.19	29,819,895.23

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：大成行业轮动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)	50,184,698.40	104,023,199.61	154,207,898.01
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	15,177,197.19	15,177,197.19
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)	-3,912,672.16	-8,253,597.63	-12,166,269.79
其中：1. 基金申购款	6,312,366.84	14,030,003.15	20,342,369.99
2. 基金赎回款	-10,225,039.00	-22,283,600.78	-32,508,639.78
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)	46,272,026.24	110,946,799.17	157,218,825.41
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)	80,655,810.21	68,416,243.63	149,072,053.84
二、本期经营活	-	29,819,895.23	29,819,895.23

动产生的基金净值变动数（本期利润）			
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）	-18,817,401.66	-19,133,721.90	-37,951,123.56
其中：1. 基金申购款	11,420,784.11	10,819,983.38	22,240,767.49
2. 基金赎回款	-30,238,185.77	-29,953,705.28	-60,191,891.05
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）	61,838,408.55	79,102,416.96	140,940,825.51

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。

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。

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。

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	11,244,875.40
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	11,244,875.40

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	107,400,120.29	140,602,836.29	33,202,716.00	
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	
债券	交易所市场	138,800.00	194,339.28	55,539.28
	银行间市场	-	-	-
	合计	138,800.00	194,339.28	55,539.28
资产支持证券	-	-	-	
基金	-	-	-	
其他	-	-	-	
合计	107,538,920.29	140,797,175.57	33,258,255.28	

6.4.3.3 衍生金融资产/负债

无。

6.4.3.4 买入返售金融资产

6.4.3.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

无。

6.4.3.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

无。

6.4.3.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2021年6月30日
应收活期存款利息	3,206.23
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	142.11
应收债券利息	46.39
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	33.03
合计	3,427.76

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	198,766.55
银行间市场应付交易费用	-
合计	198,766.55

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	48.57
应付证券出借违约金	-
预提费用	209,260.15
合计	209,308.72

6.4.3.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	50,184,698.40	50,184,698.40

本期申购	6,312,366.84	6,312,366.84
本期赎回（以“-”号填列）	-10,225,039.00	-10,225,039.00
本期末	46,272,026.24	46,272,026.24

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

6.4.3.10 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	79,761,095.04	24,262,104.57	104,023,199.61
本期利润	15,496,778.79	-319,581.60	15,177,197.19
本期基金份额交易产生的变动数	-6,666,651.65	-1,586,945.98	-8,253,597.63
其中：基金申购款	10,775,676.46	3,254,326.69	14,030,003.15
基金赎回款	-17,442,328.11	-4,841,272.67	-22,283,600.78
本期已分配利润	-	-	-
本期末	88,591,222.18	22,355,576.99	110,946,799.17

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	96,990.04
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	2,899.58
其他	682.35
合计	100,571.97

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	228,801,787.90
减：卖出股票成本总额	211,769,876.77
买卖股票差价收入	17,031,911.13

6.4.3.13 债券投资收益

无。

6.4.3.14 贵金属投资收益

无。

6.4.3.15 衍生工具收益

无。

6.4.3.16 股利收益

单位：人民币元

项目	本期
	2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
股票投资产生的股利收益	418,638.86
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	418,638.86

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	-319,581.60
股票投资	-375,120.88
债券投资	55,539.28
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	-319,581.60

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	19,240.50
基金转换费收入	1,707.88
合计	20,948.38

注：1) 本基金的赎回费率按持有期间递减，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，其中不低于赎回费总额的 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	682,542.31
银行间市场交易费用	-
合计	682,542.31

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	29,752.78
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
银行划款手续费	4,295.10
账户维护费	9,000.00
合计	102,555.25

6.4.4 或有事项、资产负债表日后事项的说明**6.4.4.1 或有事项**

无。

6.4.4.2 资产负债表日后事项

无。

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

本基金本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

6.4.5.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
大成基金管理有限公司（“大成基金”）	基金管理人、基金销售机构、注册登记机构
中国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：以下关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.6 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.6.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.6.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 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	62,544,095.30	14.12	-	-

6.4.6.1.2 债券交易

无。

6.4.6.1.3 债券回购交易

无。

6.4.6.1.4 权证交易

无。

6.4.6.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2021年1月1日至2021年6月30日			
	当期 佣金	占当期佣金总量 的比例 (%)	期末应付佣金余 额	占期末应付佣金 总额的比例 (%)
光大证券	57,006.16	14.12	-	-
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) 上述佣金按市场佣金率计算，以扣除由中国证券登记结算有限责任公司收取的证管费和经手费后的净额列示。

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

等。

6.4.6.2 关联方报酬

6.4.6.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	1,105,918.75	1,041,900.79
其中：支付销售机构的客户维护费	311,402.85	270,446.06

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 1.5% 的年费率计提。

计算方法如下：

$$H = E \times 1.5\% / \text{当年天数}$$

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

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	184,319.74	173,650.15

注：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 0.25% 的年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 0.25\% / \text{当年天数}$$

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

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
中国农业银行	11,244,875.40	96,990.04	17,341,091.89	64,342.43

注：本基金由基金托管人保管的银行存款，按银行约定利率计息。

6.4.6.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

无。

6.4.6.8 其他关联交易事项的说明

无。

6.4.7 利润分配情况

无。

6.4.8 期末(2021年6月30日)本基金持有的流通受限证券

6.4.8.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

6.4.8.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量 (单位：股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
688059	华锐	2021年	2021年	新股锁	37.09	160.26	1,023	37,943.07	163,945.98	-

	精密	2月1日	8月9日	定							
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	1,283	28,174.68	28,174.68		-
688109	品茗股份	2021年3月22日	2021年9月30日	新股锁定	50.05	72.10	346	17,317.30	24,946.60		-
688226	威腾电气	2021年6月28日	2021年7月7日	新股未上市	6.42	6.42	2,693	17,289.06	17,289.06		-
688239	航宇科技	2021年6月25日	2021年7月5日	新股未上市	11.48	11.48	4,926	56,550.48	56,550.48		-
688323	瑞华泰	2021年4月21日	2021年10月28日	新股锁定	5.97	22.78	4,513	26,942.61	102,806.14		-
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	1,091	42,385.35	42,385.35		-
688533	上声电子	2021年4月9日	2021年10月19日	新股锁定	7.72	19.11	2,910	22,465.20	55,610.10		-
688609	九联科技	2021年3月15日	2021年9月23日	新股锁定	3.99	15.29	5,424	21,641.76	82,932.96		-
688676	金盘科技	2021年3月2日	2021年9月9日	新股锁定	10.10	16.24	3,161	31,926.10	51,334.64		-
688677	海泰新光	2021年2月18日	2021年8月26日	新股锁定	35.76	103.23	1,022	36,546.72	105,501.06		-
688686	奥普特	2020年12月24日	2021年7月1日	新股锁定	78.49	451.00	582	45,681.18	262,482.00		-
688687	凯因科技	2021年1月29日	2021年8月9日	新股锁定	18.98	27.98	2,563	48,645.74	71,712.74		-
688689	银河微电	2021年1月15日	2021年7月27日	新股锁定	14.01	35.62	1,674	23,452.74	59,627.88		-

6.4.8.1.2 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)	期末成本总额	期末估值总额	备注
------	------	-------	------	--------	------	--------	-------	--------	--------	----

							位：张)			
127038	国微转债	2021年6月10日	2021年7月14日	新债未上市	100.00	100.00	190	19,000.00	19,000.00	-

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，锁定期为自发行人股票上市之日起 6 个月。根据《上海证券交易所科创板上市公司股东以向特定机构投资者询价转让和配售方式减持股份实施细则》，基金通过询价转让受让的股份，在受让后 6 个月内不得转让。

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

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

6.4.8.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

无。

6.4.8.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

无。

6.4.8.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

无。

6.4.9 金融工具风险及管理

6.4.9.1 风险管理政策和组织架构

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

本基金的基金管理人奉行全面风险管理体系的建设，建立了以由高层监控(合规与风险管理委员会、公司投资风险控制委员会)、专业监控(监察稽核部、风险管理部)、部门互控、岗位自控构

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

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

6.4.9.2 信用风险

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

本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的活期银行存款存放在本基金的托管行中国农业银行，因而与银行存款相关的信用风险不重大。本基金在交易所进行的交易均以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，违约风险可能性很小；在银行间同业市场进行交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式进行限制以控制相应的信用风险。

本基金的基金管理人建立了信用风险管理流程，通过对投资品种信用等级评估来控制证券发行人的信用风险，且通过分散化投资以分散信用风险。

于本期末，本基金持有的除国债、央行票据和政策性金融债以外的债券占基金资产净值的比例为 0.12%（上年度末：0.00%）。

6.4.9.3 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。

6.4.9.3.1 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%。

本基金主要投资于上市交易的证券，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

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

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

本基金持有及承担的大部分金融资产和金融负债不计息，因此本基金的收入及经营活动的现

金流量在很大程度上独立于市场利率变化。本基金持有的利率敏感性资产主要为银行存款、结算备付金、债券投资等。

6.4.9.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2021年6月30日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	11,244,875.40	-	-	-	11,244,875.40
结算备付金	350,869.68	-	-	-	350,869.68
存出保证金	81,728.45	-	-	-	81,728.45
交易性金融资产	-	-	194,339.28	140,602,836.29	140,797,175.57
应收利息	-	-	-	3,427.76	3,427.76
应收申购款	5,134.19	-	-	270,448.42	275,582.61
应收证券清算款	-	-	-	5,303,999.30	5,303,999.30
资产总计	11,682,607.72	-	194,339.28	146,180,711.77	158,057,658.77
负债					
应付赎回款	-	-	-	215,840.03	215,840.03
应付管理人报酬	-	-	-	184,214.92	184,214.92
应付托管费	-	-	-	30,702.47	30,702.47
应付交易费用	-	-	-	198,766.55	198,766.55
应交税费	-	-	-	0.67	0.67
其他负债	-	-	-	209,308.72	209,308.72
负债总计	-	-	-	838,833.36	838,833.36
利率敏感度缺口	11,682,607.72	-	194,339.28	145,341,878.41	157,218,825.41
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	25,547,393.98	-	-	-	25,547,393.98
结算备付金	298,345.98	-	-	-	298,345.98
存出保证金	86,196.63	-	-	-	86,196.63
交易性金融资产	-	-	-	135,594,844.75	135,594,844.75
应收利息	-	-	-	8,326.91	8,326.91
应收申购款	-	-	-	38,263.86	38,263.86
资产总计	25,931,936.59	-	-	135,641,435.52	161,573,372.11
负债					
应付赎回款	-	-	-	685,553.16	685,553.16
应付管理人报酬	-	-	-	188,605.94	188,605.94
应付托管费	-	-	-	31,434.32	31,434.32
应付证券清算款	-	-	-	6,042,234.62	6,042,234.62
应付交易费用	-	-	-	236,739.74	236,739.74
其他负债	-	-	-	180,906.32	180,906.32
负债总计	-	-	-	7,365,474.10	7,365,474.10

利率敏感度缺口	25,931,936.59	-	-128,275,961.42	154,207,898.01
---------	---------------	---	-----------------	----------------

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

6.4.9.4.1.2 利率风险的敏感性分析

于本期末，本基金持有的交易性债券投资公允价值占基金资产净值的比例为 0.12%（上年度末：0.00%），因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响（上年度末：同）。

6.4.9.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基金持有的金融工具以人民币计价，因此无重大外汇风险。

6.4.9.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市的股票，所面临的最大市场价格风险由所持有的金融工具的公允价值决定。本基金通过投资组合的分散化降低市场价格风险，并且本基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控。

本基金是混合型基金，对股票类资产的投资比例不低于基金资产的 60%，在满足股票投资比例要求的基础上，可以投资于非股票类金融工具。股票资产占基金资产的比例范围为 60%-95%，其中权证不超过基金资产净值的 3%。固定收益类证券和现金投资比例范围为基金资产的 5%-40%。其中，资产支持证券投资比例范围为基金资产净值的 0-20%，现金或到期日在一年以内的政府债券的比例不低于基金资产净值的 5%。

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	140,602,836.29	89.43	135,594,844.75	87.93
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	140,602,836.29	89.43	135,594,844.75	87.93

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%	10,855,485.61	9,629,693.61
	业绩比较基准下降5%	-10,855,485.61	-9,629,693.61

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	140,602,836.29	88.96
	其中：股票	140,602,836.29	88.96
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	194,339.28	0.12
	其中：债券	194,339.28	0.12
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	11,595,745.08	7.34
8	其他各项资产	5,664,738.12	3.58
9	合计	158,057,658.77	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	37,508.17	0.02
B	采矿业	6,884,884.95	4.38
C	制造业	113,911,353.17	72.45
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	174,538.71	0.11
E	建筑业	37,181.86	0.02
F	批发和零售业	86,908.70	0.06
G	交通运输、仓储和邮政业	43,979.21	0.03
H	住宿和餐饮业	498.68	0.00
I	信息传输、软件和信息技术服务业	6,633,711.28	4.22
J	金融业	2,572,273.02	1.64
K	房地产业	1,638,573.56	1.04
L	租赁和商务服务业	6,848,349.14	4.36
M	科学研究和技术服务业	234,462.84	0.15
N	水利、环境和公共设施管理业	44,870.27	0.03
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	559,030.73	0.36
Q	卫生和社会工作	894,712.00	0.57
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	140,602,836.29	89.43

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	600519	贵州茅台	5,532	11,377,664.40	7.24
2	601888	中国中免	22,600	6,782,260.00	4.31
3	000725	京东方 A	971,500	6,062,160.00	3.86
4	601899	紫金矿业	623,024	6,037,102.56	3.84
5	600438	通威股份	138,703	6,001,678.81	3.82
6	688036	传音控股	24,370	5,105,515.00	3.25

7	603806	福斯特	46,160	4,852,800.80	3.09
8	000568	泸州老窖	19,700	4,648,018.00	2.96
9	000100	TCL 科技	571,400	4,371,210.00	2.78
10	688665	四方光电	30,815	4,195,462.25	2.67
11	603986	兆易创新	20,900	3,927,110.00	2.50
12	688208	道通科技	42,043	3,657,320.57	2.33
13	300750	宁德时代	6,800	3,636,640.00	2.31
14	002371	北方华创	12,600	3,494,988.00	2.22
15	600196	复星医药	46,100	3,325,193.00	2.12
16	603392	万泰生物	12,719	3,296,510.42	2.10
17	688599	天合光能	114,954	3,258,945.90	2.07
18	000858	五粮液	10,200	3,038,478.00	1.93
19	600745	闻泰科技	30,900	2,994,210.00	1.90
20	603486	科沃斯	11,900	2,714,152.00	1.73
21	688276	百克生物	25,033	2,617,951.14	1.67
22	300496	中科创达	16,600	2,607,196.00	1.66
23	603290	斯达半导	7,200	2,304,000.00	1.47
24	300059	东方财富	68,740	2,253,984.60	1.43
25	002824	和胜股份	61,800	2,179,068.00	1.39
26	002139	拓邦股份	98,900	1,779,211.00	1.13
27	300661	圣邦股份	6,700	1,693,291.00	1.08
28	000002	万科 A	68,800	1,638,128.00	1.04
29	002008	大族激光	38,880	1,570,363.20	1.00
30	688037	芯源微	10,010	1,491,490.00	0.95
31	600845	宝信软件	28,770	1,464,393.00	0.93
32	002415	海康威视	22,200	1,431,900.00	0.91
33	002241	歌尔股份	32,400	1,384,776.00	0.88
34	300327	中颖电子	15,800	1,346,634.00	0.86
35	300613	富瀚微	8,500	1,324,980.00	0.84
36	603989	艾华集团	37,000	1,205,830.00	0.77
37	002185	华天科技	77,300	1,189,647.00	0.76
38	688700	东威科技	22,247	1,187,544.86	0.76
39	002049	紫光国微	7,700	1,187,263.00	0.76
40	688536	思瑞浦	2,034	1,120,734.00	0.71
41	002402	和而泰	45,700	1,095,429.00	0.70
42	002484	江海股份	70,200	1,086,696.00	0.69
43	688169	石头科技	809	1,020,149.00	0.65
44	603882	金域医学	5,600	894,712.00	0.57
45	000762	西藏矿业	31,500	837,270.00	0.53
46	002920	德赛西威	7,300	803,584.00	0.51
47	300477	合纵科技	101,000	695,890.00	0.44
48	603187	海容冷链	12,800	548,864.00	0.35

49	002607	中公教育	25,100	524,339.00	0.33
50	688055	龙腾光电	36,922	290,576.14	0.18
51	688339	亿华通	939	265,455.30	0.17
52	600732	爱旭股份	19,000	264,480.00	0.17
53	688686	奥普特	582	262,482.00	0.17
54	688135	利扬芯片	4,073	229,635.74	0.15
55	688630	芯碁微装	2,643	203,722.44	0.13
56	688059	华锐精密	1,023	163,945.98	0.10
57	600906	财达证券	7,597	128,237.36	0.08
58	688696	极米科技	143	118,976.00	0.08
59	688216	气派科技	1,725	115,057.50	0.07
60	003035	南网能源	11,046	109,797.24	0.07
61	605111	新洁能	609	109,784.43	0.07
62	688621	阳光诺和	1,218	108,158.40	0.07
63	688319	欧林生物	2,827	105,758.07	0.07
64	688677	海泰新光	1,022	105,501.06	0.07
65	605376	博迁新材	1,422	105,057.36	0.07
66	688323	瑞华泰	4,513	102,806.14	0.07
67	688161	威高骨科	918	97,353.90	0.06
68	003022	联泓新科	2,995	91,946.50	0.06
69	688625	呈和科技	1,710	91,365.30	0.06
70	688093	世华科技	2,166	86,120.16	0.05
71	688609	九联科技	5,424	82,932.96	0.05
72	601963	重庆银行	7,472	81,220.64	0.05
73	688117	圣诺生物	1,672	80,924.80	0.05
74	688359	三孚新科	2,213	78,561.50	0.05
75	688528	秦川物联	5,679	76,382.55	0.05
76	688687	凯因科技	2,563	71,712.74	0.05
77	688560	明冠新材	2,822	68,010.20	0.04
78	688685	迈信林	2,612	67,781.40	0.04
79	688656	浩欧博	877	65,222.49	0.04
80	688260	昀冢科技	2,990	64,105.60	0.04
81	601665	齐鲁银行	6,731	62,598.30	0.04
82	688689	银河微电	1,674	59,627.88	0.04
83	688578	艾力斯	1,751	57,730.47	0.04
84	688683	莱尔科技	3,296	56,757.12	0.04
85	688239	航宇科技	4,926	56,550.48	0.04
86	688533	上声电子	2,910	55,610.10	0.04
87	688127	蓝特光学	1,987	55,258.47	0.04
88	688336	三生国健	2,687	54,895.41	0.03
89	688577	浙海德曼	1,036	53,540.48	0.03
90	600916	中国黄金	3,371	52,317.92	0.03

91	688551	科威尔	1,032	51,682.56	0.03
92	688676	金盘科技	3,161	51,334.64	0.03
93	601156	东航物流	2,090	49,470.30	0.03
94	688597	煜邦电力	3,907	49,306.34	0.03
95	688355	明志科技	1,806	48,238.26	0.03
96	605337	李子园	788	46,886.00	0.03
97	688611	杭州柯林	924	45,359.16	0.03
98	688557	兰剑智能	1,329	44,720.85	0.03
99	688395	正弦电气	1,627	44,465.91	0.03
100	688618	三旺通信	1,028	43,916.16	0.03
101	003039	顺控发展	1,024	42,813.44	0.03
102	688499	利元亨	1,091	42,385.35	0.03
103	688418	震有科技	2,118	41,915.22	0.03
104	688517	金冠电气	2,892	41,095.32	0.03
105	002993	奥海科技	936	40,762.80	0.03
106	688092	爱科科技	1,137	39,283.35	0.02
107	688067	爱威科技	1,208	37,919.12	0.02
108	003012	东鹏控股	2,278	37,905.92	0.02
109	605339	南侨食品	864	37,307.52	0.02
110	600032	浙江新能	3,045	37,027.20	0.02
111	605090	九丰能源	1,090	35,326.90	0.02
112	688681	科汇股份	1,899	34,903.62	0.02
113	601528	瑞丰银行	2,230	34,721.10	0.02
114	688191	智洋创新	1,575	34,020.00	0.02
115	003040	楚天龙	1,101	33,470.40	0.02
116	688156	路德环境	1,788	32,934.96	0.02
117	605338	巴比食品	1,012	32,717.96	0.02
118	603529	爱玛科技	543	31,559.16	0.02
119	003031	中瓷电子	542	29,647.40	0.02
120	601702	华峰铝业	4,166	29,370.30	0.02
121	605077	华康股份	618	28,193.16	0.02
122	688087	英科再生	1,283	28,174.68	0.02
123	001201	东瑞股份	668	27,347.92	0.02
124	603324	盛剑环境	732	26,630.16	0.02
125	688109	品茗股份	346	24,946.60	0.02
126	605080	浙江自然	374	23,487.20	0.01
127	600563	法拉电子	148	23,437.28	0.01
128	605068	明新旭腾	641	23,056.77	0.01
129	603759	海天股份	1,119	22,939.50	0.01
130	605268	王力安防	1,642	22,659.60	0.01
131	001207	联科科技	682	22,581.02	0.01
132	003028	振邦智能	432	22,291.20	0.01

133	601279	英利汽车	2,004	20,901.72	0.01
134	605389	长龄液压	356	20,890.08	0.01
135	001206	依依股份	321	20,389.92	0.01
136	605008	长鸿高科	1,039	19,886.46	0.01
137	605006	山东玻纤	1,618	19,739.60	0.01
138	605366	宏柏新材	1,588	19,373.60	0.01
139	605305	中际联合	368	19,364.16	0.01
140	003020	立方制药	374	19,148.80	0.01
141	605399	晨光新材	810	19,043.10	0.01
142	605336	帅丰电器	701	18,856.90	0.01
143	001205	盛航股份	577	18,850.59	0.01
144	003032	传智教育	586	18,429.70	0.01
145	603511	爱慕股份	553	18,249.00	0.01
146	002835	同为股份	1,400	17,542.00	0.01
147	605222	起帆电缆	858	17,486.04	0.01
148	605208	永茂泰	801	17,485.83	0.01
149	688226	威腾电气	2,693	17,289.06	0.01
150	605368	蓝天燃气	1,204	17,217.20	0.01
151	003029	吉大正元	716	17,069.44	0.01
152	605066	天正电气	1,278	16,856.82	0.01
153	605179	一鸣食品	939	16,836.27	0.01
154	003037	三和管桩	1,274	16,765.84	0.01
155	003013	地铁设计	724	16,507.20	0.01
156	003019	宸展光电	601	16,263.06	0.01
157	605098	行动教育	289	16,262.03	0.01
158	605196	华通线缆	1,172	16,079.84	0.01
159	605300	佳禾食品	576	16,012.80	0.01
160	603836	海程邦达	733	15,994.06	0.01
161	605299	舒华体育	738	15,874.38	0.01
162	002996	顺博合金	849	14,500.92	0.01
163	605016	百龙创园	445	14,222.20	0.01
164	605180	华生科技	384	14,208.00	0.01
165	605060	联德股份	883	13,933.74	0.01
166	605169	洪通燃气	950	13,898.50	0.01
167	002998	优彩资源	1,353	13,719.42	0.01
168	605319	无锡振华	764	13,706.16	0.01
169	001208	华菱线缆	1,754	13,558.42	0.01
170	002985	北摩高科	139	13,552.50	0.01
171	003030	祖名股份	480	13,516.80	0.01
172	002997	瑞鹤模具	751	13,487.96	0.01
173	605133	嵘泰股份	618	13,398.24	0.01
174	002999	天禾股份	1,726	13,376.50	0.01

175	605151	西上海	723	13,288.74	0.01
176	605183	确成股份	741	12,967.50	0.01
177	003025	思进智能	427	12,959.45	0.01
178	605050	福然德	1,197	12,939.57	0.01
179	605058	澳弘电子	548	12,899.92	0.01
180	605122	四方新材	477	12,735.90	0.01
181	003001	中岩大地	493	12,423.60	0.01
182	603171	税友股份	637	12,230.40	0.01
183	605286	同力日升	597	12,208.65	0.01
184	003036	泰坦股份	776	11,958.16	0.01
185	605218	伟时电子	837	11,860.29	0.01
186	003018	金富科技	1,027	11,718.07	0.01
187	003027	同兴环保	430	11,717.50	0.01
188	003021	兆威机电	191	11,666.28	0.01
189	605228	神通科技	1,217	11,464.14	0.01
190	003002	壶化股份	921	11,365.14	0.01
191	603408	建霖家居	762	11,292.84	0.01
192	605007	五洲特纸	598	11,260.34	0.01
193	605303	园林股份	610	11,242.30	0.01
194	605488	福莱新材	416	11,103.04	0.01
195	605018	长华股份	840	11,096.40	0.01
196	605258	协和电子	340	10,931.00	0.01
197	605289	罗曼股份	379	10,930.36	0.01
198	605055	迎丰股份	1,147	10,919.44	0.01
199	003003	天元股份	756	10,765.44	0.01
200	605358	立昂微	93	10,748.94	0.01
201	605277	新亚电子	507	10,662.21	0.01
202	605259	绿田机械	295	10,516.75	0.01
203	605086	龙高股份	443	10,512.39	0.01
204	605009	豪悦护理	145	10,493.65	0.01
205	003038	鑫铂股份	383	10,463.56	0.01
206	605005	合兴股份	634	10,321.52	0.01
207	605189	富春染织	423	10,190.07	0.01
208	603112	华翔股份	920	10,018.80	0.01
209	003041	真爱美家	349	9,876.70	0.01
210	300832	新产业	156	9,609.60	0.01
211	002001	新和成	334	9,579.12	0.01
212	003033	征和工业	301	9,538.69	0.01
213	605333	沪光股份	670	9,172.30	0.01
214	003000	劲仔食品	684	9,117.72	0.01
215	001202	炬申股份	459	9,014.76	0.01
216	605116	奥锐特	642	9,000.84	0.01

217	003023	彩虹集团	296	8,968.80	0.01
218	003004	声迅股份	306	8,613.90	0.01
219	605298	必得科技	391	7,847.37	0.00
220	300884	狄耐克	291	7,822.08	0.00
221	300829	金丹科技	118	7,729.00	0.00
222	605123	派克新材	99	7,543.80	0.00
223	002407	多氟多	200	7,108.00	0.00
224	300850	新强联	78	6,839.82	0.00
225	601211	国泰君安	379	6,496.06	0.00
226	605089	味知香	70	6,091.40	0.00
227	688777	中控技术	64	6,025.60	0.00
228	300657	弘信电子	330	5,593.50	0.00
229	000651	格力电器	100	5,210.00	0.00
230	600570	恒生电子	50	4,662.50	0.00
231	605011	杭州热电	525	4,662.00	0.00
232	603087	甘李药业	42	4,476.36	0.00
233	600104	上汽集团	200	4,394.00	0.00
234	603155	新亚强	87	3,957.63	0.00
235	300003	乐普医疗	122	3,918.64	0.00
236	300858	科拓生物	51	3,884.67	0.00
237	300853	申昊科技	101	3,878.40	0.00
238	300855	图南股份	96	3,684.48	0.00
239	002982	湘佳股份	81	3,454.65	0.00
240	300498	温氏股份	240	3,448.80	0.00
241	300856	科思股份	67	3,370.77	0.00
242	605296	神农集团	69	3,256.80	0.00
243	601995	中金公司	51	3,136.50	0.00
244	002987	京北方	98	3,131.10	0.00
245	002459	晶澳科技	55	2,695.00	0.00
246	002989	中天精装	80	2,585.60	0.00
247	300903	科翔股份	80	2,564.80	0.00
248	002938	鹏鼎控股	68	2,439.84	0.00
249	002258	利尔化学	94	2,425.20	0.00
250	603888	新华网	100	2,117.00	0.00
251	601233	桐昆股份	85	2,047.65	0.00
252	605136	丽人丽妆	67	2,038.81	0.00
253	002992	宝明科技	119	1,969.45	0.00
254	605100	华丰股份	49	1,954.12	0.00
255	603565	中谷物流	65	1,937.65	0.00
256	300630	普利制药	36	1,886.40	0.00
257	002983	芯瑞达	60	1,832.40	0.00
258	300828	锐新科技	77	1,701.70	0.00

259	000960	锡业股份	100	1,603.00	0.00
260	300845	捷安高科	70	1,596.00	0.00
261	605003	众望布艺	66	1,542.42	0.00
262	603950	长源东谷	81	1,509.84	0.00
263	603439	贵州三力	97	1,453.06	0.00
264	603931	格林达	44	1,414.16	0.00
265	000786	北新建材	35	1,373.75	0.00
266	300843	胜蓝股份	51	1,303.05	0.00
267	003016	欣贺股份	81	1,296.81	0.00
268	605177	东亚药业	39	1,266.33	0.00
269	300840	酷特智能	85	1,247.80	0.00
270	605155	西大门	50	1,099.50	0.00
271	605377	华旺科技	70	1,080.80	0.00
272	002986	宇新股份	42	1,043.28	0.00
273	300849	锦盛新材	72	1,031.76	0.00
274	605099	共创草坪	24	1,017.12	0.00
275	605118	力鼎光电	67	959.44	0.00
276	300857	协创数据	34	949.28	0.00
277	600918	中泰证券	87	941.34	0.00
278	002340	格林美	100	935.00	0.00
279	002976	瑞玛工业	43	903.00	0.00
280	605186	健麾信息	26	891.28	0.00
281	601686	友发集团	74	825.84	0.00
282	002120	韵达股份	60	811.80	0.00
283	002990	盛视科技	24	776.64	0.00
284	605199	葫芦娃	26	746.98	0.00
285	605388	均瑶健康	30	682.80	0.00
286	601456	国联证券	43	662.20	0.00
287	002912	中新赛克	16	655.52	0.00
288	605001	威奥股份	69	636.87	0.00
289	300846	首都在线	31	563.58	0.00
290	002027	分众传媒	54	508.14	0.00
291	605108	同庆楼	26	498.68	0.00
292	603212	赛伍技术	15	484.35	0.00
293	603035	常熟汽饰	28	456.40	0.00
294	605255	天普股份	30	451.50	0.00
295	002146	荣盛发展	79	445.56	0.00
296	600004	白云机场	38	424.84	0.00
297	605318	法狮龙	28	410.76	0.00
298	600956	新天绿能	33	386.43	0.00
299	605166	聚合顺	41	381.30	0.00
300	300833	浩洋股份	6	312.72	0.00

301	600079	人福医药	11	310.97	0.00
302	601187	厦门银行	29	274.92	0.00
303	601778	晶科科技	49	267.54	0.00
304	605088	冠盛股份	16	258.24	0.00
305	300831	派瑞股份	16	256.16	0.00
306	002007	华兰生物	6	220.08	0.00
307	601827	三峰环境	23	217.81	0.00
308	002879	长缆科技	13	195.65	0.00
309	300838	浙江力诺	9	140.49	0.00
310	605158	华达新材	16	132.64	0.00
311	603682	锦和商业	18	116.64	0.00
312	605188	国光连锁	3	26.67	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	002241	歌尔股份	6,689,586.38	4.34
2	300122	智飞生物	6,530,692.89	4.23
3	601899	紫金矿业	6,310,100.00	4.09
4	000858	五粮液	6,161,698.94	4.00
5	000725	京东方 A	6,025,150.00	3.91
6	002466	天齐锂业	5,979,517.00	3.88
7	601318	中国平安	5,880,556.00	3.81
8	603806	福斯特	5,758,850.80	3.73
9	300274	阳光电源	5,010,151.00	3.25
10	002371	北方华创	4,843,427.00	3.14
11	000568	泸州老窖	4,534,925.00	2.94
12	000100	TCL 科技	4,469,709.00	2.90
13	300059	东方财富	4,351,001.00	2.82
14	600845	宝信软件	4,176,359.95	2.71
15	002824	和胜股份	4,124,759.05	2.67
16	002027	分众传媒	4,123,791.00	2.67
17	603993	洛阳钼业	3,335,031.00	2.16
18	300601	康泰生物	3,244,215.00	2.10
19	600418	江淮汽车	3,215,139.00	2.08
20	603986	兆易创新	3,182,440.40	2.06
21	002415	海康威视	3,104,861.00	2.01

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	603882	金域医学	10,768,673.00	6.98
2	688036	传音控股	9,338,035.71	6.06
3	300059	东方财富	7,686,900.00	4.98
4	601012	隆基股份	7,560,715.12	4.90
5	601877	正泰电器	6,226,602.00	4.04
6	300122	智飞生物	6,175,819.00	4.00
7	601318	中国平安	5,831,030.00	3.78
8	002812	恩捷股份	5,647,841.00	3.66
9	002241	歌尔股份	5,408,482.00	3.51
10	600079	人福医药	5,086,233.16	3.30
11	002179	中航光电	4,946,452.00	3.21
12	002824	和胜股份	4,487,768.50	2.91
13	002466	天齐锂业	4,456,683.34	2.89
14	300454	深信服	4,182,996.00	2.71
15	000603	盛达资源	3,973,214.71	2.58
16	603392	万泰生物	3,904,943.00	2.53
17	002027	分众传媒	3,903,458.00	2.53
18	688390	固德威	3,683,471.87	2.39
19	002304	洋河股份	3,525,228.00	2.29
20	600732	爱旭股份	3,378,349.00	2.19
21	300274	阳光电源	3,254,538.00	2.11
22	002410	广联达	3,117,986.00	2.02
23	600519	贵州茅台	3,090,187.00	2.00

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	217,152,989.19
卖出股票收入（成交）总额	228,801,787.90

注：上述金额均指成交金额（成交单价乘以成交数量），不考虑相关交易费用。

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-

4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	194,339.28	0.12
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	194,339.28	0.12

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	123111	东财转 3	1,198	175,339.28	0.11
2	127038	国微转债	190	19,000.00	0.01

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

本基金投资的前十名证券的发行主体本期未出现被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

7.12.2 基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库

本基金投资的前十名股票未超出基金合同规定的备选股票库

7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	81,728.45
2	应收证券清算款	5,303,999.30
3	应收股利	-
4	应收利息	3,427.76
5	应收申购款	275,582.61
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	5,664,738.12

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

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 (%)
8,622	5,366.74	98,820.23	0.21	46,173,206.01	99.79

注：持有人户数为有效户数，即存量份额大于零的账户。

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	持有份额总数（份）	占基金总份额比例（%）
基金管理人所有从业人员持有本基金	69,784.06	0.1508

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

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

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2009年9月8日）基 金份额总额	3,086,196,884.20
本报告期期初基金份额总额	50,184,698.40
本报告期基金总申购份额	6,312,366.84
减：本报告期基金总赎回份额	10,225,039.00
本报告期基金拆分变动份额（份额减少 以“-”填列）	-
本报告期期末基金份额总额	46,272,026.24

§ 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

2021年5月，中国农业银行总行决定谭敦宇任托管业务部总裁。

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	
华西证券	1	242,835,016.72	54.82%	221,283.45	54.82%	-
中泰证券	2	71,577,834.62	16.16%	65,220.86	16.16%	-
安信证券	1	65,982,055.05	14.90%	60,128.20	14.90%	-
光大证券	2	62,544,095.30	14.12%	57,006.16	14.12%	-
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	-	-	-	-	-
东方证券	1	-	-	-	-	-
东吴证券	1	-	-	-	-	-
东兴证券	1	-	-	-	-	-
方正证券	1	-	-	-	-	-
高华证券	1	-	-	-	-	-
广发证券	2	-	-	-	-	-
国金证券	2	-	-	-	-	-
国盛证券	1	-	-	-	-	-
国泰君安	3	-	-	-	-	-
国信证券	1	-	-	-	-	-

海通证券	1	-	-	-	-	-
红塔证券	1	-	-	-	-	-
华创证券	1	-	-	-	-	-
华泰证券	1	-	-	-	-	-
民生证券	1	-	-	-	-	-
南京证券	1	-	-	-	-	-
平安证券	1	-	-	-	-	-
瑞银证券	2	-	-	-	-	-
山西证券	1	-	-	-	-	-
上海证券	1	-	-	-	-	-
申万宏源	1	-	-	-	-	-
申万宏源西 部	1	-	-	-	-	-
世纪证券	1	-	-	-	-	-
天风证券	2	-	-	-	-	-
万和证券	1	-	-	-	-	-
西部证券	1	-	-	-	-	-
湘财证券	1	-	-	-	-	-
信达证券	1	-	-	-	-	-
兴业证券	2	-	-	-	-	-
粤开证券	1	-	-	-	-	-
招商证券	2	-	-	-	-	-
浙商证券	1	-	-	-	-	-
中国银河证 券	4	-	-	-	-	-
中金公司	3	-	-	-	-	-
中信建投证 券	2	-	-	-	-	-
中信证券	2	-	-	-	-	-

中银国际证 券	1	-	-	-	-	-
中原证券	1	-	-	-	-	-

注：1、租用券商专用交易单元的选择标准和程序：

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：

- （1）财务状况良好，最近一年无重大违规行为；
- （2）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；
- （3）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；
- （4）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；
- （5）能提供投资组合运作、管理所需的其他券商服务；
- （6）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专用席位。

2、本报告期内本基金租用证券公司交易单元的变更情况如下：

本报告期内退租交易单元：无，

本报告期内新增交易单元：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

无。

10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	关于提请投资者及时更新已过期身份证件或者身份证明文件的公告	中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站	2021年6月30日
2	大成基金管理有限公司关于旗下部分基金增加海银基金销售有限公司为销售机构的公告	中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站	2021年5月27日
3	大成行业轮动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
4	大成行业轮动混合型证券投资基金	中国证监会基金电子披	2021年3月30日

	2020 年年度报告	露网站、规定报刊及本公司网站	
5	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
6	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
7	大成行业轮动混合型证券投资基金更新招募说明书	中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站	2021 年 1 月 28 日
8	大成行业轮动混合型证券投资基金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	2021 年 1 月 28 日
9	大成行业轮动混合型证券投资基金增聘基金经理的公告	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 1 月 27 日
10	大成行业轮动混合型证券投资基金第四季度报告	中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站	2021 年 1 月 22 日

§ 11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

无。

11.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§ 12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

- 1、中国证监会批准设立大成行业轮动股票型证券投资基金的文件；
- 2、《大成行业轮动混合型证券投资基金基金合同》；
- 3、《大成行业轮动混合型证券投资基金托管协议》；
- 4、《大成行业轮动股票型证券投资基金变更基金名称、基金类别以及修订基金合同部分条款的公告》；
- 5、大成基金管理有限公司批准文件、营业执照、公司章程；
- 6、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