

大成卓享一年持有期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：上海浦东发展银行股份有限公司

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。

基金托管人上海浦东发展银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2021 年 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	13
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	13
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	14
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	15
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	16
§ 5 托管人报告	16
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	16
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	16
5.3 托管人对本中期报告中财务信息内容的真实、准确和完整发表意见	16
§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）	16
6.1 资产负债表	16
6.2 利润表	17
6.3 所有者权益（基金净值）变动表	18
6.4 报表附注	19
§ 7 投资组合报告	46
7.1 期末基金资产组合情况	46
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	47
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	48
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	50
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	52
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	52

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	52
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	53
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	53
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明	53
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	53
7.12 投资组合报告附注	53
§ 8 基金份额持有人信息	55
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	55
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	55
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	55
§ 9 开放式基金份额变动	56
§ 10 重大事件揭示	56
10.1 基金份额持有人大会决议	56
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	56
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	56
10.4 基金投资策略的改变	56
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	56
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	57
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	57
10.8 其他重大事件	58
§ 11 影响投资者决策的其他重要信息	58
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	58
11.2 影响投资者决策的其他重要信息	58
§ 12 备查文件目录	58
12.1 备查文件目录	58
12.2 存放地点	58
12.3 查阅方式	59

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	大成卓享一年持有期混合型证券投资基金	
基金简称	大成卓享一年持有混合	
基金主代码	010369	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2020 年 11 月 16 日	
基金管理人	大成基金管理有限公司	
基金托管人	上海浦东发展银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	5,237,194,702.64 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	大成卓享一年持有混合 A	大成卓享一年持有混合 C
下属分级基金的交易代码	010369	010370
报告期末下属分级基金的份额总额	4,573,375,960.36 份	663,818,742.28 份

2.2 基金产品说明

投资目标	在严格控制风险的基础上，通过积极主动的投资管理，追求基金资产的长期稳健增值，力争实现超越业绩比较基准的投资回报。
投资策略	<p>本基金的投资策略分为两方面：一方面体现在采取“自上而下”的方式对权益类、固定收益类等不同类别资产进行大类配置；另一方面体现在对单个投资品种的精选上。</p> <p>一）大类资产配置策略</p> <p>本基金采取“自上而下”的方式进行大类资产配置，根据基金管理人对宏观经济、市场面、政策面等因素的分析，结合各类资产的市场趋势和预期收益风险的比较判别，对股票、债券及现金等大类资产的配置比例进行动态调整，以期在投资中达到风险和收益的优化平衡。在大类资产调整过程中，本基金将在法律法规和基金合同规定范围内，适度运用股指期货的套期保值功能，控制投资组合的系统性风险暴露。</p> <p>二）债券投资策略</p> <p>本基金将灵活运用利率预期策略、信用债券投资策略、收益率利差策略、套利交易策略、个券选择策略等多种投资策略，构建资产组合。</p>
业绩比较基准	沪深 300 指数收益率*10%+恒生指数收益率*5%+中证综合债券指数收益率*80%+金融机构人民币活期存款利率(税后)*5%
风险收益特征	本基金为混合型基金，其预期风险与预期收益高于债券型基金与货币市场基金，低于股票型基金。本基金若投资港股通标的股票，则需承担港股通机制下因投资环境、投资标的、市场制度以及交易规则等差异带来的特有风险。

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	上海浦东发展银行股份有限公司

			司
信息披露 负责人	姓名	赵冰	胡波
	联系电话	0755-83183388	021-61618888
	电子邮箱	office@dcfund.com.cn	Hub5@spdb.com.cn
客户服务电话		4008885558	95528
传真		0755-83199588	021-63602540
注册地址		深圳市福田区深南大道 7088 号招商银行大厦 32 层	上海市中山东一路 12 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	上海市北京东路 689 号
邮政编码		518040	200001
法定代表人		吴庆斌	郑杨

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)	
	大成卓享一年持有混合 A	大成卓享一年持有混合 C
本期已实现收益	36,460,302.58	3,960,529.35
本期利润	33,522,933.73	3,533,982.51
加权平均基金份额本期利润	0.0073	0.0053
本期加权平均净值利润率	0.73%	0.53%
本期基金份额净值增长率	0.73%	0.53%
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	50,241,508.46	5,633,067.21
期末可供分配基金份额利润	0.0110	0.0085

期末基金资产净值	4,633,212,371.42	670,841,358.04
期末基金份额净值	1.0131	1.0106
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	1.31%	1.06%

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

大成卓享一年持有混合 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	0.23%	0.10%	-0.10%	0.12%	0.33%	-0.02%
过去三个月	1.35%	0.08%	1.45%	0.13%	-0.10%	-0.05%
过去六个月	0.73%	0.11%	2.20%	0.18%	-1.47%	-0.07%
自基金合同生效起至今	1.31%	0.10%	3.90%	0.17%	-2.59%	-0.07%

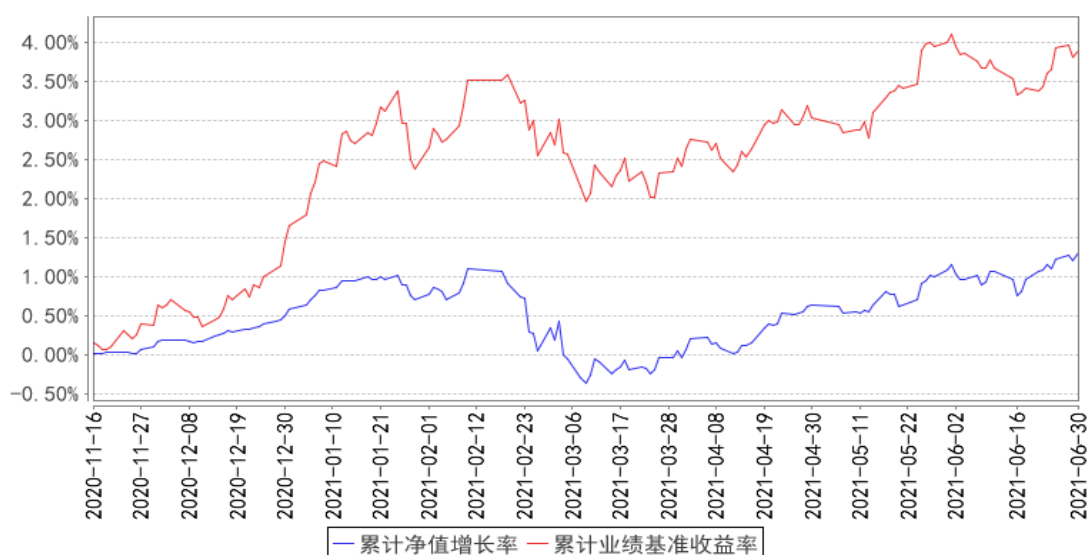
大成卓享一年持有混合 C

阶段	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	0.20%	0.10%	-0.10%	0.12%	0.30%	-0.02%

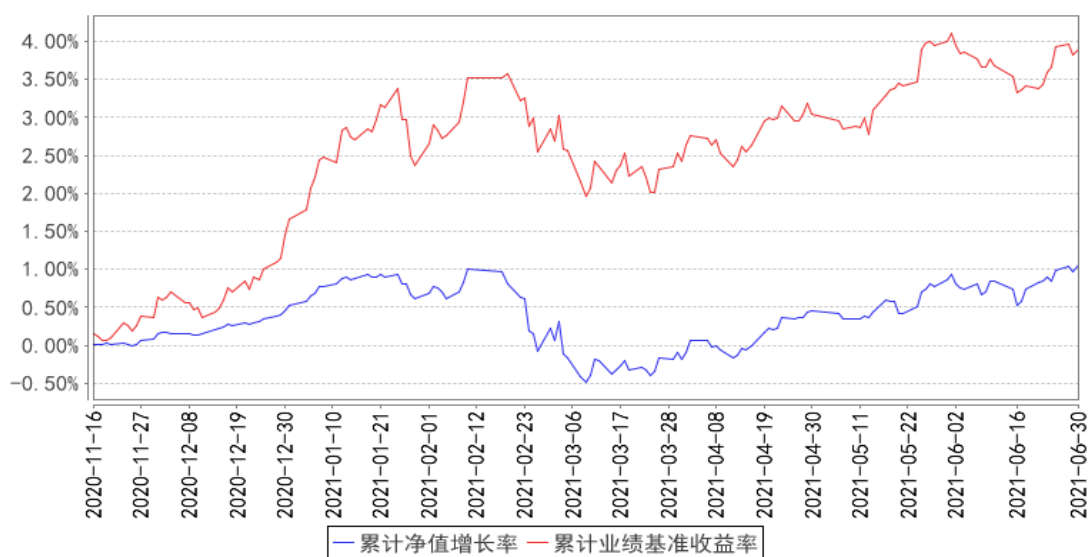
过去三个月	1.25%	0.08%	1.45%	0.13%	-0.20%	-0.05%
过去六个月	0.53%	0.11%	2.20%	0.18%	-1.67%	-0.07%
自基金合同生效起 至今	1.06%	0.10%	3.90%	0.17%	-2.84%	-0.07%

3.2.2 自基金合同生效以来基金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

大成卓享一年持有混合A累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



大成卓享一年持有混合C累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：1、本基金合同生效日为2020年11月16日，截止报告期末本基金合同生效未满一年。

2、本基金合同规定，基金管理人应当自基金合同生效之日起六个月内使基金的投资组合比例符合基金合同约定。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		
孙丹	本基金基金经理	2020年11月16日	-	13年	经济学硕士。2008年至2012年任景顺长城产品开发部产品经理。2012年至2014年任华夏基金机构债券投资部研究员。2014年5月加入大成基金管理有限公司，曾担任固定收益总部信用策略及宏观利率研究员、大成景辉灵活配置混合型证券投资基金、大成景荣保本混合型证券投资基金、大成景兴信用债债券型证券投资基金、大成景秀灵活配置混合型证券投资基金、大成景源灵活配置混合型证券投资基金基金经理助理，现任固定收益总部总监助理。2018年3月12日起任大成策略回报混合型证券投资基金、大成创新成长混合型证券投资基金（LOF）、大成积极成长混合型证券投资基金、大成精选增值混合型证券投资基金、大成景阳领先混合型证券投资基金、大成竞争优势混合型证券投资基金、

				<p>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</p>
--	--	--	--	--

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

				<p>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</p>
--	--	--	--	---

					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，国内货币端平稳，财政和信用主动收缩，经济增长逐渐回落。美国通胀走高，经济活动随着疫情的缓解逐步恢复正常，但是刺激政策并未很快退出，直到 6 月中旬，美联储的议息会议才释放了一定的鹰派信号。二季度的后半段，市场也更多地关注到了内需的放缓，全球

通胀预期和通胀交易回落。

国内债券市场上半年整体呈现窄幅震荡偏强的走势，主要由于 1) 货币政策取向中性，资金利率主要围绕政策利率震荡；2) 财政政策的不积极助推了信用较快收缩，社融余额增速从 20 年底的 13% 降至 21 年 5-6 月的 11% 左右；3) 中国国债估值合理，经过 20 年下半年的调整，年初时债券收益率已经回到了疫情前的水平。

我们的组合在 3 月货币政策取向更为明朗化之后，逐渐提升了组合久期。信用债投资方面，今年规避风险事件的原则是加大发行人自身的经营情况与债务负担在信用评估中的权重，弱化战略地位、外部支持等因素对信用资质的加持。

权益方面，大盘股票内部分化明显，部分增长不高而估值不低的大股票表现较差，而景气度高的行业，包括新能源汽车、光伏、部分医药子行业和电子等行业的龙头股票仍表现较好。另外，今年结构上还呈现市值下沉的特征，同一行业里，非龙头公司和龙头公司的估值有所收敛。组合主要降低了估值与增长匹配度欠佳的大股票，向高景气度行业和中小市值公司做了倾斜。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末大成卓享一年持有混合 A 的基金份额净值为 1.0131 元，本报告期基金份额净值增长率为 0.73%，同期业绩比较基准收益率为 2.20%；截至本报告期末大成卓享一年持有混合 C 的基金份额净值为 1.0106 元，本报告期基金份额净值增长率为 0.53%，同期业绩比较基准收益率为 2.20%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望下半年，整体而言，经济仍趋于放缓，不过国内政策仍留有回旋余地，失速风险不大。具体来说，货币端由于正常化的较早，仍有调节空间。财政政策方面，由于上半年政府债券发行节奏较慢，预算内赤字和地方政府债务限额仍剩余较多额度，可以部分对冲房地产行业管控和地方政府债务风险管理的影响。由于上半年经济增长回落较为明显，加上大宗商品价格上涨对企业经营产生了一定影响，7 月的货币政策的调整出现的较预期更早一些，但政策取向的全面调整目前还面临着很多中期约束。

另外，海外政策退出也是影响资本市场的因素之一，美国对于应对疫情的政策对资本市场流动性和估值产生了巨大的影响。今年下半年，美联储预计将释放更清晰的有关于政策路径的信息。

下半年，国内的基本面和政策背景对债券市场相对有利，波动风险主要来自于资金面波动和债券市场微观杠杆率的上升。对于权益市场来说，短期估值压力可能较 2 季度压力有所增加。不过，随着上市公司增加，行业分布更广泛，对于企业盈利增长的驱动因素更多元，市场仍会有结构性机会。

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

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

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

无。

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内，上海浦东发展银行股份有限公司（以下简称“本托管人”）在对大成卓享一年持有期混合型证券投资基金的托管过程中，严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同、托管协议的规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

本报告期内，本托管人依照《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同、托管协议的规定，对大成卓享一年持有期混合型证券投资基金的投资运作进行了监督，对基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算以及基金费用开支等方面进行了认真的复核，未发现基金管理人存在损害基金份额持有人利益的行为。该基金本报告期内未进行利润分配。

5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本报告期内，由大成基金管理有限公司编制本托管人复核的本报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告（注：财务会计报告中的“金融工具风险及管理”部分未在托管人复核范围内）、投资组合报告等内容真实、准确、完整。

§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：大成卓享一年持有期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	2,643,459.82	1,482,638.74
结算备付金		17,189,812.50	32,247,204.80
存出保证金		553,248.36	137,382.90
交易性金融资产	6.4.7.2	4,465,344,872.37	3,653,040,009.73
其中：股票投资		429,335,433.68	154,534,297.32
基金投资		-	-
债券投资		4,036,009,438.69	3,498,505,712.41

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	974,893,822.34	1,529,723,665.11
应收证券清算款		1,045,865.62	31,063,902.86
应收利息	6.4.7.5	60,175,257.41	40,718,429.39
应收股利		-	-
应收申购款		9.99	23,822.63
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		5,521,846,348.41	5,288,437,056.16
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		211,994,580.00	-
应付证券清算款		4.66	19,978,826.08
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		2,608,999.62	2,667,123.90
应付托管费		434,833.25	444,520.63
应付销售服务费		220,018.62	225,280.77
应付交易费用	6.4.7.7	2,173,587.33	267,425.46
应交税费		200,846.40	169,860.17
应付利息		16,857.94	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	142,891.13	-
负债合计		217,792,618.95	23,753,037.01
所有者权益:			
实收基金	6.4.7.9	5,237,194,702.64	5,234,896,387.15
未分配利润	6.4.7.10	66,859,026.82	29,787,632.00
所有者权益合计		5,304,053,729.46	5,264,684,019.15
负债和所有者权益总计		5,521,846,348.41	5,288,437,056.16

注：报告截止日 2021 年 06 月 30 日，基金份额总额 5,237,194,702.64 份，其中大成卓享一年持有混合 A 基金份额总额为 4,573,375,960.36 份，基金份额净值 1.0131 元。大成卓享一年持有混合 C 基金份额总额为 663,818,742.28 份，基金份额净值 1.0106 元。

6.2 利润表

会计主体：大成卓享一年持有期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 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
一、收入		62,594,163.79
1. 利息收入		80,292,545.62
其中：存款利息收入	6.4.7.11	269,329.88
债券利息收入		71,528,343.64
资产支持证券利息收入		-
买入返售金融资产收入		8,494,872.10
证券出借利息收入		-
其他利息收入		-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		-14,334,466.14
其中：股票投资收益	6.4.7.12	-6,679,227.71
基金投资收益		-
债券投资收益	6.4.7.13	-10,795,416.82
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	1,581,315.73
股利收益	6.4.7.16	1,558,862.66
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	-3,363,915.69
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	-
减：二、费用		25,537,247.55
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	15,670,687.15
2. 托管费	6.4.10.2.2	2,611,781.22
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	1,322,362.12
4. 交易费用	6.4.7.19	5,393,737.96
5. 利息支出		211,350.64
其中：卖出回购金融资产支出		211,350.64
6. 税金及附加		152,450.85
7. 其他费用	6.4.7.20	174,877.61
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		37,056,916.24
减：所得税费用		-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		37,056,916.24

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：大成卓享一年持有期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）	5,234,896,387.15	29,787,632.00	5,264,684,019.15
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	37,056,916.24	37,056,916.24
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）	2,298,315.49	14,478.58	2,312,794.07
其中：1. 基金申购款	2,298,315.49	14,478.58	2,312,794.07
2. 基金赎回款	-	-	-
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）	5,237,194,702.64	66,859,026.82	5,304,053,729.46

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 基金基本情况

大成卓享一年持有期混合型证券投资基金（以下简称“本基金”），系经中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）证监许可【2020】2351 号文“关于准予大成卓享一年持有期混合型证券投资基金注册的批复”的核准，由大成基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《大成卓享一年持有期混合型证券投资基金基金合同》作为发起人于 2020 年 11 月 6 日至 2020 年 11 月 11 日向社会公开募集，募集期结束经安永华明会计师事务所验证并出具安永华明（2020）验字第 60469430_H14 号验资报告后，向中国证监会报送基金备案材料。基金合同于 2020 年 11 月 16 日生效。本基金为契约型开放式，存续期限不定。

设立时，本基金已收到的首次发售募集的有效认购资金扣除认购费后的净认购金额为人民币 5,233,727,104.98 元，折合 5,233,727,104.98 份基金份额；有效认购资金在首次发售募集期内产生的利息为人民币 381,170.76 元，折合 381,170.76 份基金份额。其中 A 类份额已收到的首次发售募集的有效认购资金扣除认购费后的净认购金额为人民币 4,570,415,262.27 元，折合 4,570,415,262.27 份基金份额，有效认购资金在首次发售募集期内产生的利息为人民币 333,347.21 元，折合 333,347.21 份基金份额；C 类份额已收到的首次发售募集的有效认购资金扣

除认购费后的净认购金额为人民币 663,311,842.71 元,折合 663,311,842.71 份基金份额,有效认购资金在首次发售募集期内产生的利息为人民币 47,823.55 元,折合 47,823.55 份基金份额。

以上收到的实收基金共计人民币 5,234,108,275.74 元,折合 5,234,108,275.74 份基金份额。

本基金的基金管理人为大成基金管理有限公司,注册登记机构为本基金管理人,基金托管人为上海浦东发展银行股份有限公司(以下简称“上海浦发银行”)。

本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具,包括国内依法发行上市的股票(包括主板、中小板、创业板及其他中国证监会允许基金投资的股票)、存托凭证、内地与香港股票市场交易互联互通机制下允许投资的规定范围内的香港联合交易所上市的股票(简称“港股通标的股票”)、债券(包括国债、央行票据、金融债券、企业债券、公司债券、中期票据、短期融资券、超短期融资券、公开发行的次级债券、政府支持机构债、政府支持债券、地方政府债、可转换债券及其他经中国证监会允许投资的债券)、资产支持证券、债券回购、同业存单、银行存款(包括协议存款、定期存款等)、货币市场工具、股指期货、国债期货,以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具,但须符合中国证监会的相关规定。本基金可参与融资业务。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种,基金管理人在履行适当程序后,可以将其纳入投资范围。

本基金的业绩比较基准由中证综合债券指数收益率*80%+沪深 300 指数收益率*10%+恒生指数收益率*5%+金融机构人民币活期存款利率(税后)*5%。

6.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部颁布的《企业会计准则—基本准则》以及其后颁布及修订的具体会计准则、应用指南、解释以及其他相关规定(以下合称“企业会计准则”)编制。同时,在具体会计估值核算和信息披露方面,也参考了中国证券投资基金业协会修订并发布的《证券投资基金会计核算业务指引》、中国证监会制定的《中国证券监督管理委员会关于证券投资基金估值业务的指导意见》、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》、《证券投资基金信息披露内容与格式准则》第 2 号《年度报告的内容与格式》、《证券投资基金信息披露编报规则》第 3 号《会计报表附注的编制及披露》、《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和中期报告>》及其他中国证监会和中国证券投资基金业协会颁布的相关规定。

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合企业会计准则的要求,真实、完整地反映了本基金于 2021 年 6 月 30 日的财务状况以及 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日的经营成果和净值变动情况。

6.4.4 重要会计政策和会计估计

6.4.4.1 会计年度

本基金会计年度采用公历年度，即每年 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

6.4.4.2 记账本位币

本基金记账本位币和编制本财务报表所采用的货币均为人民币。除有特别说明外，均以人民币元为单位表示。

6.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

金融工具是指形成本基金的金融资产（或负债），并形成其他单位的金融负债（或资产）或权益工具的合同。

(1) 金融资产的分类

本基金的金融资产于初始确认时分为以下两类：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产及贷款和应收款项。

本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产主要包括股票、债券和衍生工具等投资。

本基金持有的其他金融资产分类为应收款项，包括银行存款、结算备付金、买入返售金融资产和其他各类应收款项等。

(2) 金融负债的分类

本基金的金融负债于初始确认时归类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债及其他金融负债。

本基金持有的金融负债均划分为其他金融负债，主要包括卖出回购金融资产款和其他各类应付款项等。

6.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

初始确认

本基金于成为金融工具合同的一方时确认金融资产或金融负债，按取得时的公允价值作为初始确认金额。划分为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产取得时发生的相关交易费用计入当期损益；应收款项和其他金融负债的相关交易费用计入初始确认金额。

后续计量

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，采用公允价值进行后续计量。在持有该类金融资产期间取得的利息或现金股利，应当确认为当期收益。每日，本基金将以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产或金融负债的公允价值变动计入当期损益；应收款项和其他金融负债采用实际利率法，以摊余成本进行后续计量，其摊销或减值产生的利得或损失，均计入当

期损益。

终止确认

当收取该金融资产现金流量的合同权利终止，或该金融资产已转移，且符合金融资产转移的终止确认条件时的金融资产将终止确认；当金融负债的现时义务全部或部分已经解除的，该金融负债或其一部分将终止确认；

处置该金融资产或金融负债时，其公允价值与初始入账金额之间的差额应确认为投资收益，同时调整公允价值变动收益。

金融资产转移

本基金已将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方的，终止确认该金融资产；保留了金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬的，不终止确认该金融资产；本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬的，分别下列情况处理：放弃了对该金融资产控制的，终止确认该金融资产并确认产生的资产和负债；未放弃对该金融资产控制的，按照其继续涉入所转移金融资产的程度确认有关金融资产，并相应确认有关负债。

6.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

公允价值，是指市场参与者在计量日发生的有序交易中，出售一项资产所能收到或者转移一项负债所需支付的价格。本基金以公允价值计量相关资产或负债，假定出售资产或者转移负债的有序交易在相关资产或负债的主要市场进行；不存在主要市场的，本基金假定该交易在相关资产或负债的最有利市场进行。主要市场(或最有利市场)是本基金在计量日能够进入的交易市场。本基金采用市场参与者在对该资产或负债定价时为实现其经济利益最大化所使用的假设。

在财务报表中以公允价值计量或披露的资产和负债，根据对公允价值计量整体而言具有重要意义的最低层次输入值，确定所属的公允价值层次：第一层次输入值，在计量日能够取得的相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价；第二层次输入值，除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值；第三层次输入值，相关资产或负债的不可观察输入值。

每个资产负债表日，本基金对在财务报表中确认的持续以公允价值计量的资产和负债进行重新评估，以确定是否在公允价值计量层次之间发生转换。

本基金持有的股票、债券和衍生工具等投资按如下原则确定公允价值并进行估值：

(1) 存在活跃市场的金融工具，按其估值日能够取得的相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价作为公允价值；估值日无报价且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，应采用最近交易日的报价确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的报价不能真实反映公允价值的，应对报价进行调整，确定公允价值。

与上述投资品种相同，但具有不同特征的，应以相同资产或负债的公允价值为基础，并在估值技术中考虑不同特征因素的影响。特征是指对资产出售或使用的限制等，如果该限制是针对资产持有者的，那么在估值技术中不应将该限制作为特征考虑。此外，基金管理人不应考虑因大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价。

(2) 不存在活跃市场的金融工具，应采用在当前情况下适用并且有足够可利用数据和其他信息支持的估值技术确定公允价值。采用估值技术确定公允价值时，应优先使用相关可观察输入值，只有在无法取得相关资产或负债可观察输入值或取得不切实可行的情况下，才使用不可观察输入值。

(3) 如有确凿证据表明按上述估值原则仍不能客观反映其公允价值的，基金管理人可根据具体情况与基金托管人商定后，按最能适当反映公允价值的价格估值。

(4) 如有新增事项，按国家最新规定估值。

6.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

当本基金同时满足下列条件时，金融资产和金融负债以相互抵销后的净额在资产负债表内列示：具有抵销已确认金额的法定权利且该种法定权利现在是可执行的；计划以净额结算，或同时变现该金融资产和清偿该金融负债。

6.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行基金份额所募集的总金额在扣除损益平准金分摊部分后的余额。由于申购和赎回引起的实收基金变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日确认。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

6.4.4.8 损益平准金

损益平准金包括已实现平准金和未实现平准金。已实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现损益占基金净值比例计算的金额。未实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未实现损益占基金净值比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日确认，并于期末全额转入未分配利润/(累计亏损)。

6.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

(1) 存款利息收入按存款的本金与适用的利率逐日计提的金额入账。若提前支取定期存款，按协议规定的利率及持有期重新计算存款利息收入，并根据提前支取所实际收到的利息收入与账面已确认的利息收入的差额确认利息损失，列入利息收入减项，存款利息收入以净额列示；

(2) 债券利息收入按债券票面价值与票面利率或内含票面利率计算的金额扣除应由债券发行

企业代扣代缴的个人所得税及应由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认，在债券实际持有期内逐日计提；

(3) 资产支持证券利息收入按证券票面价值与票面利率计算的金额，扣除应由资产支持证券发行企业代扣代缴的个人所得税及应由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认，在证券实际持有期内逐日计提；

(4) 买入返售金融资产收入，按买入返售金融资产的成本及实际利率（当实际利率与合同利率差异较小时，也可以用合同利率），在回购期内逐日计提；

(5) 股票投资收益/（损失）于卖出股票成交日确认，并按卖出股票成交金额与其成本的差额入账；

(6) 债券投资收益/（损失）于成交日确认，并按成交总额与其成本、应收利息的差额入账；

(7) 衍生工具收益/（损失）于卖出权证成交日确认，并按卖出权证成交金额与其成本的差额扣除应由基金管理人缴纳的增值税后的净额入账；

(8) 股利收益于除息日确认，并按上市公司宣告的分红派息比例计算的金额扣除应由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额入账；

(9) 公允价值变动收益/（损失）系本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债等公允价值变动形成的应计入当期损益的利得或损失；

(10) 其他收入在主要风险和报酬已经转移给对方，经济利益很可能流入且金额可以可靠计量的时候确认。

6.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬和托管费在费用涵盖期间按基金合同约定的费率和计算方法逐日确认。

其他金融负债在持有期间确认的利息支出按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

6.4.4.11 基金的收益分配政策

(1) 在符合有关基金分红条件的前提下，基金管理人可以根据实际情况进行收益分配，具体分配方案以公告为准，若《基金合同》生效不满 3 个月可不进行收益分配；

(2) 本基金收益分配方式分两种：现金分红与红利再投资，投资者可选择现金红利或将现金红利自动转为相应类别的基金份额进行再投资；若投资者不选择，本基金默认的收益分配方式是现金分红；

(3) 基金收益分配后基金份额净值不能低于面值，即基金收益分配基准日的基金份额净值

减去每单位基金份额收益分配金额后不能低于面值；

(4) 由于本基金 A 类基金份额不收取销售服务费，而 C 类基金份额收取销售服务费，各基金份额类别对应的可供分配利润将有所不同。本基金同一类别每一基金份额享有同等分配权；

(5) 法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

在符合法律法规及基金合同约定，并对基金份额持有人利益无实质性不利影响的前提下，基金管理人可对基金收益分配原则和支付方式进行调整，不需召开基金份额持有人大会。

6.4.4.12 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，无需披露分部报告。

6.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计

本基金本报告期间无需要说明的其他重要会计政策和会计估计事项。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期末发生会计政策变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期末发生会计估计变更。

6.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无重大会计差错更正。

6.4.6 税项

(1) 印花税

证券（股票）交易印花税税率为 1%，由出让方缴纳。

(2) 增值税及附加、企业所得税

自根据财政部、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。

(2) 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。

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 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	2,643,459.82

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	2,643,459.82

6.4.7.2 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	430,760,560.45	429,335,433.68	-1,425,126.77
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	1,173,912,985.11	1,175,958,298.69
	银行间市场	2,849,690,728.69	2,860,051,140.00
	合计	4,023,603,713.80	4,036,009,438.69
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	4,454,364,274.25	4,465,344,872.37	10,980,598.12

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

无。

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 6 月 30 日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	-	-
银行间市场	974,893,822.34	-
合计	974,893,822.34	-

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

无。

6.4.7.5 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	4,318.93
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	8,623.80
应收债券利息	59,679,662.59
应收资产支持证券利息	-
应收买入返售证券利息	482,403.09
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	249.00
合计	60,175,257.41

6.4.7.6 其他资产

无。

6.4.7.7 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	2,130,093.01
银行间市场应付交易费用	43,494.32
合计	2,173,587.33

6.4.7.8 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	-
应付证券出借违约金	-
预提费用	142,891.13
合计	142,891.13

6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

大成卓享一年持有混合 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	4,571,503,296.17	4,571,503,296.17
本期申购	1,872,664.19	1,872,664.19

本期赎回（以“-”号填列）	-	-
本期末	4,573,375,960.36	4,573,375,960.36

大成卓享一年持有混合 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	663,393,090.98	663,393,090.98
本期申购	425,651.30	425,651.30
本期赎回（以“-”号填列）	-	-
本期末	663,818,742.28	663,818,742.28

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

6.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

大成卓享一年持有混合 A

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	13,771,272.84	12,527,962.67	26,299,235.51
本期利润	36,460,302.58	-2,937,368.85	33,522,933.73
本期基金份额交易产生的变动数	9,933.04	4,308.78	14,241.82
其中：基金申购款	9,933.04	4,308.78	14,241.82
基金赎回款	-	-	-
本期已分配利润	-	-	-
本期末	50,241,508.46	9,594,902.60	59,836,411.06

大成卓享一年持有混合 C

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	1,671,114.26	1,817,282.23	3,488,396.49
本期利润	3,960,529.35	-426,546.84	3,533,982.51
本期基金份额交易产生的变动数	1,423.60	-1,186.84	236.76
其中：基金申购款	1,423.60	-1,186.84	236.76
基金赎回款	-	-	-
本期已分配利润	-	-	-
本期末	5,633,067.21	1,389,548.55	7,022,615.76

6.4.7.11 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	153,572.61
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	111,993.32	
其他	3,763.95	

合计	269,329.88
----	------------

6.4.7.12 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	1,674,414,372.28
减：卖出股票成本总额	1,681,093,599.99
买卖股票差价收入	-6,679,227.71

6.4.7.13 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	2,165,682,339.34
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	2,139,938,119.60
减：应收利息总额	36,539,636.56
买卖债券差价收入	-10,795,416.82

6.4.7.14 贵金属投资收益

无。

6.4.7.15 衍生工具收益

6.4.7.15.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

无。

6.4.7.15.2 衍生工具收益——其他投资收益

单位：人民币元

项目	本期收益金额 2021年1月1日至2021年6月30日
股指期货投资收益	1,581,315.73

6.4.7.16 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	1,558,862.66
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	1,558,862.66

6.4.7.17 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	-3,363,915.69
股票投资	-7,248,581.74
债券投资	3,884,666.05
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	-3,363,915.69

6.4.7.18 其他收入

无。

6.4.7.19 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	5,368,965.46
银行间市场交易费用	24,772.50
合计	5,393,737.96

6.4.7.20 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	74,383.76
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
银行划款手续费	19,586.48
账户维护费	21,000.00
其他	400.00
合计	174,877.61

6.4.7.21 分部报告

无。

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金无需作披露的重大或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至本财务报表批准报出日，本基金无需作披露的资产负债表日后事项。

6.4.9 关联方关系

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

本基金本报告期存在控制关系或者其他重大利害关系的关联方未发生变化。

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
大成基金管理有限公司（“大成基金”）	基金管理人、注册登记机构、基金销售机构
上海浦东发展银行股份有限公司（“上海浦东发展银行”）	基金托管人、基金销售机构

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 股票交易

无。

6.4.10.1.2 债券交易

无。

6.4.10.1.3 债券回购交易

无。

6.4.10.1.4 权证交易

无。

6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

无。

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期
	2021年1月1日至2021年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	15,670,687.15
其中：支付销售机构的客户维护费	7,832,698.09

注：本基金的管理费按前一日基金资产净值的0.6%年费率计提。管理费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.6\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

6.4.10.2.2 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
当期发生的基金应支付的托管费	2,611,781.22

注：支付基金托管人中国银行的托管费按前一日基金资产净值0.10%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

$$\text{日托管费} = \text{前一日基金资产净值} \times 0.10\% / \text{当年天数}。$$

6.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	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		
	大成卓享一年持有混合 A	大成卓享一年持有混合 C	合计
浦发银行	-	1,320,786.83	1,320,786.83
合计	-	1,320,786.83	1,320,786.83

注：支付基金销售机构的销售服务费按前一日C类基金份额的基金资产净值0.40%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付给大成基金，再由大成基金计算并支付给各基金销售机构。其计算公式为：

$$\text{日销售服务费} = \text{前一日C类的基金资产净值} \times 0.40\% / \text{当年天数}。$$

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

无。

6.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

无。

6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

无。

6.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

无。

6.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2021年1月1日至2021年6月30日	
	期末余额	当期利息收入
上海浦东发展银行	2,643,459.82	153,572.61

注：本基金由基金托管人保管的银行存款，按银行约定利率计息。

6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

无。

6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

无。

6.4.11 利润分配情况

无。

6.4.12 期末(2021年6月30日)本基金持有的流通受限证券

6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

6.4.12.1.1 受限证券类别：股票											
证券	证券	成功	可流通	流通受	认购	期末估	数量	期末	期末估值总额	备注	

代码	名称	认购日	日	限类型	价格	值单价	(单 位: 股)	成本总额		
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	-
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	-
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	853	40,372.49	214,921.88	-
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	新股锁定	4.54	11.54	507	2,301.78	5,850.78	-

		日	月 13 日							
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 20 日	新股锁 定	14.20	33.84	175	2,485.00	5,922.00	-

		日	月 17 日								
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	新股未 上市	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	-	
688059	华锐精密	2021年 2月1 日	2021 年8月 9日	新股锁 定	37.09	160.26	1,023	37,943.07	163,945.98	-	
688079	美迪凯	2021年 2月23 日	2021 年9月 2日	新股锁 定	10.19	18.40	10,622	108,238.18	195,444.80	-	
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	-	
688191	智洋创新	2021年 3月30 日	2021 年10 月8日	新股锁 定	11.38	17.74	3,203	36,450.14	56,821.22	-	
688226	威腾	2021年	2021	新股未	6.42	6.42	2,693	17,289.06	17,289.06	-	

	电气	6月28日	2021年7月7日	上市							
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		-
688269	凯立新材	2021年6月1日	2021年12月9日	新股锁定	18.94	100.92	1,941	36,762.54	195,885.72		-
688456	有研粉材	2021年3月10日	2021年9月17日	新股锁定	10.62	26.50	3,396	36,065.52	89,994.00		-
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		-
688575	亚辉龙	2021年5月10日	2021年11月17日	新股锁定	14.80	32.09	3,435	50,838.00	110,229.15		-
688633	星球石墨	2021年3月17日	2021年9月24日	新股锁定	33.62	53.14	1,558	52,379.96	82,792.12		-
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		-
688660	电气风电	2021年5月11日	2021年11月19日	新股锁定	5.44	7.26	51,238	278,734.72	371,987.88		-
688686	奥普特	2020年12月24日	2021年7月1日	新股锁定	78.49	451.00	2,330	182,881.70	1,050,830.00		-
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	5,354	101,618.92	149,804.92		-
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	3,258	45,644.58	116,049.96		-
688700	东威科技	2021年6月7日	2021年12月15日	新股锁定	9.41	38.46	3,049	28,691.09	117,264.54		-

6.4.12.1.2 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)			
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	8,720	872,000.00	872,000.00	-

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。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。

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

无。

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末，本基金从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额人民币 199,994,580.00 元，是以如下债券作为质押：

金额单位：人民币元

债券代码	债券名称	回购到期日	期末估值单价	数量（张）	期末估值总额
012004014	20 招金 SCP007	2021 年 7 月 1 日	100.19	97,000	9,718,430.00
012101033	21 电网 SCP011	2021 年 7 月 1 日	100.14	600,000	60,084,000.00
101801449	18 平安租赁 MTN001	2021 年 7 月 1 日	101.11	500,000	50,555,000.00
102000277	20 招商蛇口 MTN001A	2021 年 7 月 1 日	99.88	500,000	49,940,000.00
102100353	21 汇金 MTN001	2021 年 7 月 1 日	100.64	421,000	42,369,440.00
合计				2,118,000	212,666,870.00

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2021 年 6 月 30 日止，基金从事证券交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额 12,000,000.00 元，于 2021 年 7 月 1 日到期。该类交易要求本基金在回购期内持有的证券交易所交易的债券和/或在新质押式回购下转入质押库的债券，按证券交易所规定的比例折算为标准券后，不低于债券回购交易的余额。

6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

无。

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金是混合型基金，其预期风险和预期收益高于债券型基金和货币市场基金，但低于股票型基金。本基金投资的金融工具主要为股票投资和债券投资。本基金在日常经营活动中面临的与这些金融工具相关的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金的基金管理人从事风险管理的主要目标是在严格控制风险的基础上，通过积极主动的投资管理，追求基金资产的长期稳健增值，力争实现超越业绩比较基准的投资回报。

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。

6.4.13.2 信用风险

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

本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的活期银行存款存放在本基金的托管行中国浦东发展银行，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。

6.4.13.2.1 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	105,400,000.00	70,043,000.00
A-1 以下	-	-
未评级	730,876,340.00	419,504,000.00
合计	836,276,340.00	489,547,000.00

注：未评级债券为短期融资券、国债和政策性金融债。

6.4.13.2.2 按短期信用评级列示的同业存单投资

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	195,010,000.00	-
合计	195,010,000.00	-

6.4.13.2.3 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	2,487,411,578.00	-
AAA 以下	183,876,000.00	-
未评级	333,435,520.69	-
合计	3,004,723,098.69	-

注：未评级债券为国债、政策性金融债。

6.4.13.3 流动性风险

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

6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》及《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》等有关法规的要求建立健全开放式基金流动性风险管理的内部控制体系，审慎评估各类资产的流动性，针对性制定流动性风险管理措施，对本基金组合资产的流动性风险进行管理。本基金的基金管理人采用监控基金组合资产持仓集中度指标、逆回购交易的到期日与交易对手的集中度、流动性受限资产比例、基金组合资产中 7 个工作日可变现资产的可变现价值以及压力测试等方式防范流动性风险。并于开放日对本基金的申购赎回情况进行监控，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配，确保本基金资产的变现能力与投资者赎回需求的匹配与平衡。本基金的基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。于本期末，本基金持有的流动性受限资产的估值占基金资产净值的比例未超过 15%。

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

6.4.13.4 市场风险

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

6.4.13.4.1 利率风险

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

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

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

6.4.13.4.1.1 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	2,643,459.82	-	-	-	2,643,459.82
结算备付金	17,189,812.50	-	-	-	17,189,812.50
存出保证金	553,248.36	-	-	-	553,248.36
交易性金融资产	2,270,114,860.69	1,613,387,578.00	152,507,000.00	429,335,433.68	4,465,344,872.37
买入返售金融资产	974,893,822.34	-	-	-	974,893,822.34
应收利息	-	-	-	60,175,257.41	60,175,257.41
应收申购款	-	-	-	9.99	9.99
应收证券清算款	-	-	-	1,045,865.62	1,045,865.62
资产总计	3,265,395,203.71	1,613,387,578.00	152,507,000.00	490,556,566.70	5,521,846,348.41
负债					
应付管理人报酬	-	-	-	2,608,999.62	2,608,999.62
应付托管费	-	-	-	434,833.25	434,833.25
应付证券清算款	-	-	-	4.66	4.66
卖出回购金融资产款	211,994,580.00	-	-	-	211,994,580.00
应付销售服务费	-	-	-	220,018.62	220,018.62
应付交易费用	-	-	-	2,173,587.33	2,173,587.33
应付利息	-	-	-	16,857.94	16,857.94
应交税费	-	-	-	200,846.40	200,846.40
其他负债	-	-	-	142,891.13	142,891.13
负债总计	211,994,580.00	-	-	5,798,038.95	217,792,618.95
利率敏感度缺口	3,053,400,623.71	1,613,387,578.00	152,507,000.00	484,758,527.75	5,304,053,729.46
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	1,482,638.74	-	-	-	1,482,638.74
结算备付金	32,247,204.80	-	-	-	32,247,204.80
存出保证金	137,382.90	-	-	-	137,382.90
交易性金融资产	1,849,744,462.31	1,556,386,250.10	92,375,000.00	154,534,297.32	3,653,040,009.73
买入返售金融资产	1,529,723,665.11	-	-	-	1,529,723,665.11
应收利息	-	-	-	40,718,429.39	40,718,429.39
应收申购款	-	-	-	23,822.63	23,822.63
应收证券清算款	-	-	-	31,063,902.86	31,063,902.86
资产总计	3,413,335,353.86	1,556,386,250.10	92,375,000.00	226,340,452.20	5,288,437,056.16
负债	-	-	-	-	-
应付管理人报酬	-	-	-	2,667,123.90	2,667,123.90
应付托管费	-	-	-	444,520.63	444,520.63
应付证券清算款	-	-	-	19,978,826.08	19,978,826.08
应付销售服务费	-	-	-	225,280.77	225,280.77
应付交易费用	-	-	-	267,425.46	267,425.46
应交税费	-	-	-	169,860.17	169,860.17
负债总计	-	-	-	23,753,037.01	23,753,037.01
利率敏感度缺口	3,413,335,353.86	1,556,386,250.10	92,375,000.00	202,587,415.19	5,264,684,019.15

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

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	除市场利率以外的其他市场变量保持不变		
	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	市场利率上升 25 个基点	-11,102,632.65	-10,186,351.17
	市场利率下降 25 个基点	11,238,912.58	10,287,422.89

6.4.13.4.2 外汇风险

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

6.4.13.4.2.1 外汇风险敞口

单位：人民币元

项目	本期末 2021年6月30日			
	美元	港币	其他币种	合计

	折合人民币元	折合人民币元	折合人民币元	
以外币计价的资产				
交易性金融资产	-	20,993,478.25	-	20,993,478.25
资产合计	-	20,993,478.25	-	20,993,478.25
以外币计价的负债				
负债合计	-	-	-	-
资产负债表外汇风险敞口净额	-	20,993,478.25	-	20,993,478.25
项目	上年度末 2020 年 12 月 31 日			
	美元 折合人民币元	港币 折合人民币元	其他币种 折合人民币元	合计
以外币计价的资产				
资产合计	-	-	-	-
以外币计价的负债				
负债合计	-	-	-	-
资产负债表外汇风险敞口净额	-	-	-	-

6.4.13.4.2.2 外汇风险的敏感性分析

假设	除港币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	港币相对人民币升值 5%	1,049,673.91	-
	港币相对人民币贬值 5%	-1,049,673.91	-

6.4.13.4.3 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或银行间同业市场交易的固定收益品种，因此无重大其他价格风险。

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 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	429,335,433.68	8.09	154,534,297.32	2.94
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	429,335,433.68	8.09	154,534,297.32	2.94

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除业绩比较基准以外的其他市场变量保持不变		
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	1. 业绩比较基准上升 5%	27,163,876.53	32,060,007.86
	2. 业绩比较基准下降 5%	-27,163,876.53	-32,060,007.86

6.4.14 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	429,335,433.68	7.78
	其中：股票	429,335,433.68	7.78
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	4,036,009,438.69	73.09
	其中：债券	4,036,009,438.69	73.09
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	974,893,822.34	17.66
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	19,833,272.32	0.36

8	其他各项资产	61,774,381.38	1.12
9	合计	5,521,846,348.41	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	9,107.58	0.00
B	采矿业	41,204,787.00	0.78
C	制造业	294,115,951.78	5.55
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	85,374.49	0.00
E	建筑业	6,139,884.00	0.12
F	批发和零售业	252,954.09	0.00
G	交通运输、仓储和邮政业	9,344,244.00	0.18
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	79,229.05	0.00
J	金融业	97,414.20	0.00
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	46,082,115.36	0.87
M	科学研究和技术服务业	131,868.00	0.00
N	水利、环境和公共设施管理业	33,133.88	0.00
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	10,765,892.00	0.20
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	408,341,955.43	7.70

7.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

行业类别	公允价值（人民币）	占基金资产净值比例（%）
通信服务	9,864,474.82	0.19
非日常生活消费品	-	-
日常消费品	-	-
能源	-	-
金融	11,129,003.43	0.21
医疗保健	-	-
工业	-	-
信息技术	-	-
原材料	-	-
房地产	-	-

合计	20,993,478.25	0.40
----	---------------	------

注：以上分类采用全球行业分类标准（GICS）。

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	601899	紫金矿业	4,252,300	41,204,787.00	0.78
2	600519	贵州茅台	14,100	28,999,470.00	0.55
3	601888	中国中免	88,313	26,502,731.30	0.50
4	000568	泸州老窖	104,200	24,584,948.00	0.46
5	002008	大族激光	509,200	20,566,588.00	0.39
6	002027	分众传媒	2,079,000	19,563,390.00	0.37
7	000100	TCL 科技	2,545,100	19,470,015.00	0.37
8	600732	爱旭股份	1,397,000	19,446,240.00	0.37
9	000725	京东方 A	2,459,800	15,349,152.00	0.29
10	300363	博腾股份	159,000	13,375,080.00	0.25
11	601012	隆基股份	138,600	12,313,224.00	0.23
12	600438	通威股份	277,500	12,007,425.00	0.23
13	00388	香港交易所	28,900	11,129,003.43	0.21
14	000516	国际医学	571,500	10,749,915.00	0.20
15	300567	精测电子	165,300	10,149,420.00	0.19
16	600104	上汽集团	457,200	10,044,684.00	0.19
17	00700	腾讯控股	20,300	9,864,474.82	0.19
18	600745	闻泰科技	100,900	9,777,210.00	0.18
19	002463	沪电股份	629,700	9,741,459.00	0.18
20	300477	合纵科技	1,378,900	9,500,621.00	0.18
21	688276	百克生物	90,409	9,454,973.22	0.18
22	600029	南方航空	1,552,200	9,344,244.00	0.18
23	688345	博力威	116,097	8,538,934.35	0.16
24	601117	中国化学	700,900	6,139,884.00	0.12
25	603799	华友钴业	53,700	6,132,540.00	0.12
26	688388	嘉元科技	59,062	5,372,279.52	0.10
27	300390	天华超净	106,500	5,115,195.00	0.10
28	002444	巨星科技	148,100	5,047,248.00	0.10
29	603650	彤程新材	103,900	4,997,590.00	0.09
30	300224	正海磁材	453,700	4,931,719.00	0.09
31	002597	金禾实业	138,400	4,802,480.00	0.09
32	002835	同为股份	382,700	4,795,231.00	0.09
33	300151	昌红科技	176,400	4,752,216.00	0.09
34	300073	当升科技	83,200	4,675,008.00	0.09

35	603020	爱普股份	238,700	4,456,529.00	0.08
36	000858	五 粮 液	5,000	1,489,450.00	0.03
37	688686	奥普特	2,330	1,050,830.00	0.02
38	688660	电气风电	51,238	371,987.88	0.01
39	688161	威高骨科	3,069	252,486.63	0.00
40	301015	百洋医药	4,614	251,115.78	0.00
41	300957	贝泰妮	853	214,921.88	0.00
42	688269	凯立新材	1,941	195,885.72	0.00
43	688079	美迪凯	10,622	195,444.80	0.00
44	688059	华锐精密	1,023	163,945.98	0.00
45	688687	凯因科技	5,354	149,804.92	0.00
46	688216	气派科技	2,000	133,400.00	0.00
47	688621	阳光诺和	1,485	131,868.00	0.00
48	688700	东威科技	3,049	117,264.54	0.00
49	688689	银河微电	3,258	116,049.96	0.00
50	301016	雷尔伟	2,747	115,711.58	0.00
51	688575	亚辉龙	3,435	110,229.15	0.00
52	688456	有研粉材	3,396	89,994.00	0.00
53	688499	利元亨	2,149	83,488.65	0.00
54	688633	星球石墨	1,558	82,792.12	0.00
55	601665	齐鲁银行	6,731	62,598.30	0.00
56	603529	爱玛科技	1,019	59,224.28	0.00
57	301012	扬电科技	1,691	56,994.16	0.00
58	688191	智洋创新	3,203	56,821.22	0.00
59	688239	航宇科技	4,926	56,550.48	0.00
60	688087	英科再生	2,469	54,219.24	0.00
61	301020	密封科技	4,210	44,794.40	0.00
62	688517	金冠电气	2,892	41,095.32	0.00
63	688067	爱威科技	1,259	39,520.01	0.00
64	688659	元琛科技	3,671	38,398.66	0.00
65	600032	浙江新能	3,045	37,027.20	0.00
66	605090	九丰能源	1,090	35,326.90	0.00
67	688681	科汇股份	1,899	34,903.62	0.00
68	601528	瑞丰银行	2,230	34,721.10	0.00
69	301021	英诺激光	2,899	27,424.54	0.00
70	300953	震裕科技	240	23,964.00	0.00
71	603396	金辰股份	400	22,844.00	0.00
72	001207	联科科技	682	22,581.02	0.00
73	301009	可靠股份	807	22,541.97	0.00
74	603511	爱慕股份	553	18,249.00	0.00
75	688226	威腾电气	2,693	17,289.06	0.00
76	300614	百川畅银	383	16,272.30	0.00

77	603836	海程邦达	733	15,994.06	0.00
78	603882	金域医学	100	15,977.00	0.00
79	605319	无锡振华	764	13,706.16	0.00
80	001208	华菱线缆	1,754	13,558.42	0.00
81	300997	欢乐家	979	13,067.16	0.00
82	301013	利和兴	471	12,768.81	0.00
83	603171	税友股份	637	12,230.40	0.00
84	301002	崧盛股份	201	11,581.62	0.00
85	300955	嘉亨家化	232	10,688.24	0.00
86	605259	绿田机械	295	10,516.75	0.00
87	605189	富春染织	423	10,190.07	0.00
88	300996	普联软件	241	10,177.43	0.00
89	300993	玉马遮阳	497	10,079.55	0.00
90	300956	英力股份	371	9,571.80	0.00
91	300962	中金辐照	576	9,429.12	0.00
92	301011	华立科技	250	9,424.50	0.00
93	300952	恒辉安防	340	9,207.20	0.00
94	300966	共同药业	286	9,020.44	0.00
95	300961	深水海纳	394	8,695.58	0.00
96	605162	新中港	1,377	8,358.39	0.00
97	300958	建工修复	300	8,166.00	0.00
98	300991	创益通	254	6,733.54	0.00
99	300963	中洲特材	283	6,364.67	0.00
100	300967	晓鸣股份	507	5,850.78	0.00
101	300960	通业科技	234	5,396.04	0.00
102	605011	杭州热电	525	4,662.00	0.00
103	300995	奇德新材	191	4,454.12	0.00
104	301007	德迈仕	303	4,375.32	0.00
105	300998	宁波方正	201	4,285.32	0.00
106	603806	福斯特	40	4,205.20	0.00
107	300992	泰福泵业	200	4,064.00	0.00
108	301010	晶雪节能	218	3,838.98	0.00
109	605296	神农集团	69	3,256.80	0.00
110	002460	赣锋锂业	25	3,027.25	0.00
111	600584	长电科技	65	2,449.20	0.00
112	002156	通富微电	91	2,187.64	0.00
113	601607	上海医药	87	1,838.31	0.00
114	601688	华泰证券	6	94.80	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	600519	贵州茅台	113,760,855.20	2.16
2	601899	紫金矿业	57,760,088.50	1.10
3	300122	智飞生物	52,231,484.00	0.99
4	601012	隆基股份	51,824,544.79	0.98
5	000568	泸州老窖	44,879,808.82	0.85
6	600438	通威股份	40,427,201.32	0.77
7	002304	洋河股份	39,980,157.00	0.76
8	600048	保利地产	39,967,142.01	0.76
9	603806	福斯特	39,962,664.54	0.76
10	002027	分众传媒	36,990,745.00	0.70
11	603799	华友钴业	35,792,726.06	0.68
12	600196	复星医药	34,967,010.72	0.66
13	002460	赣锋锂业	31,687,001.69	0.60
14	601888	中国中免	30,854,557.01	0.59
15	000002	万科 A	29,995,427.00	0.57
16	601607	上海医药	29,989,369.29	0.57
17	601318	中国平安	29,987,226.00	0.57
18	000768	中航西飞	29,987,132.79	0.57
19	603160	汇顶科技	29,973,038.21	0.57
20	000762	西藏矿业	27,978,796.66	0.53

注：本期累计买入金额按买入成交金额（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	600519	贵州茅台	84,766,586.76	1.61
2	600048	保利地产	48,163,382.34	0.91
3	300122	智飞生物	46,854,020.43	0.89
4	603806	福斯特	46,772,527.81	0.89
5	002304	洋河股份	46,230,817.25	0.88
6	600036	招商银行	40,979,862.00	0.78
7	000002	万科 A	38,066,043.40	0.72
8	601318	中国平安	35,600,180.48	0.68
9	600196	复星医药	35,079,414.12	0.67
10	603160	汇顶科技	32,373,287.93	0.61
11	600438	通威股份	31,084,118.00	0.59
12	000762	西藏矿业	30,903,224.89	0.59
13	000768	中航西飞	30,835,581.12	0.59
14	601012	隆基股份	30,571,893.72	0.58
15	601607	上海医药	28,923,796.17	0.55
16	600031	三一重工	26,953,668.50	0.51

17	002460	赣锋锂业	26,108,873.91	0.50
18	002624	完美世界	24,805,162.50	0.47
19	601838	成都银行	24,251,951.20	0.46
20	300979	华利集团	24,139,640.75	0.46

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	1,963,143,318.09
卖出股票收入（成交）总额	1,674,414,372.28

注：本项中“买入股票的成本(成交)总额”及“卖出股票的收入(成交)总额”均按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

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

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	180412	18 农发 12	1,000,000	100,440,000.00	1.89
2	200314	20 进出 14	1,000,000	100,210,000.00	1.89
3	112118035	21 华夏银行 CD035	1,000,000	97,920,000.00	1.85
4	112008313	20 中信银行 CD313	1,000,000	97,090,000.00	1.83
5	200215	20 国开 15	800,000	81,112,000.00	1.53

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

7.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

代 码	名 称	持仓量 (买/ 卖)	合约市值(元)	公允价值变动 (元)	风险说明
-	-	-	-	-	-
公允价值变动总额合计 (元)					-
股指期货投资本期收益 (元)					1,581,315.73
股指期货投资本期公允价值变动 (元)					-

7.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

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

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. 华夏银行股份有限公司于 2020 年 7 月 13 日因内控制度执行不到位，严重违反审慎经营规则等，受到中国银行保险监督管理委员会处罚（银保监罚决字（2020）24 号），于 2021 年 5 月 17 日因违规使用自营资金、理财资金购买本行转让的信贷资产等，受到中国银行保险监督管理委员会处罚（银保监罚决字（2021）19 号），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）25 号）。本基金认为，对华夏银行的处罚不会对其投资价值构成实质性负面影响。

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

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

4. 本基金投资的前十名证券之一 20 交通银行 01 (2028029. IB) 的发行主体交通银行股份有限公司于 2021 年 7 月 13 日因理财业务和同业业务制度不健全等, 受到中国银行保险监督管理委员会处罚 (银保监罚决字 (2021) 28 号), 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。

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

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

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	553,248.36
2	应收证券清算款	1,045,865.62
3	应收股利	-
4	应收利息	60,175,257.41
5	应收申购款	9.99
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	61,774,381.38

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

金额单位: 人民币元

序号	债券代码	债券名称	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
1	132009	17 中油 EB	14,078,778.00	0.27

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 (%)
大成卓享一年持有混合 A	23,795	192,199.03	-	-	4,573,375,960.36	100.00
大成卓享一年持有混合 C	3,047	217,859.78	-	-	663,818,742.28	100.00
合计	26,842	195,111.94	-	-	5,237,194,702.64	100.00

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	大成卓享一年持有混合 A	110.00	0.0000
	大成卓享一年持有混合 C	0.00	0.0000
	合计	110.00	0.0000

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、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	大成卓享一年持有混合 A	0
	大成卓享一年持有混合 C	0

	合计	0
本基金基金经理持有 本开放式基金	大成卓享一年持有混合 A	0
	大成卓享一年持有混合 C	0
	合计	0

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	大成卓享一年持有混合 A	大成卓享一年持有混合 C
基金合同生效日（2020 年 11 月 16 日）基金份额总额	4,570,748,609.48	663,359,666.26
本报告期期初基金份额总额	4,571,503,296.17	663,393,090.98
本报告期基金总申购份额	1,872,664.19	425,651.30
减：本报告期基金总赎回份额	-	-
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	4,573,375,960.36	663,818,742.28

§ 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、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

无

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

无。

10.4 基金投资策略的改变

本基金投资策略在本报告期内没有重大改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

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

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，基金管理人、托管人及其高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
中信建投证券	2	2,847,355,465.79	78.48%	2,597,047.71	78.50%	-
东方证券	1	497,742,798.26	13.72%	453,594.77	13.71%	-
国盛证券	1	282,907,629.80	7.80%	257,821.82	7.79%	-

注：1、根据中国证监会颁布的《关于完善证券投资基金交易席位制度有关问题的通知》（证监基金字[2007]48号）的有关规定，本公司制定了租用证券公司交易单元的选择标准和程序。租用证券公司交易单元的选择标准主要包括：（一）财务状况良好，最近一年无重大违规行为；（二）经营行为规范，内控制度健全，能满足各投资组合运作的保密性要求；（三）研究实力较强，能提供包括研究报告、路演服务、协助进行上市公司调研等研究服务；（四）具备各投资组合运作所需的高效、安全的通讯条件，有足够的交易和清算能力，满足各投资组合证券交易需要；（五）能提供投资组合运作、管理所需的其他券商服务；（六）相关基金合同、资产管理合同以及法律法规规定的其他条件。租用证券公司交易单元的程序：首先根据租用证券公司交易单元的选择标准形成《券商服务评价表》，然后根据评分高低进行选择基金交易单元。

2、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：本报告期内本基金新增交易单元：东方证券、国盛证券。本报告期内本基金退租交易单元：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

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比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例
中信建投证券	158,446,638.67	100.00%	1,242,494,000.00	94.38%	-	-

东方证券	-	-	35,500,000.00	2.70%	-	-
国盛证券	-	-	38,511,000.00	2.93%	-	-

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	大成卓享一年持有期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
3	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
4	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
5	大成基金管理有限公司关于旗下部分基金增加北京度小满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3月8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卓享一年持有期混合型证券投资基金的文件；
- 2、《大成卓享一年持有期混合型证券投资基金基金合同》；
- 3、《大成卓享一年持有期混合型证券投资基金托管协议》；
- 4、大成基金管理有限公司批准文件、营业执照、公司章程；
- 5、本报告期内在规定报刊上披露的各种公告原稿。

12.2 存放地点

备查文件存放在本基金管理人和托管人住所。

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