

# 大成睿鑫股票型证券投资基金 2021 年中期报告

2021 年 6 月 30 日

基金管理人：大成基金管理有限公司

基金托管人：招商银行股份有限公司

送出日期：2021 年 8 月 31 日

## § 1 重要提示及目录

### 1.1 重要提示

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

基金托管人招商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2021 年 8 月 30 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告财务资料未经审计。

本报告期自 2021 年 01 月 01 日起至 06 月 30 日止。

## 1.2 目录

<b>§ 1 重要提示及目录</b>	<b>2</b>
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
<b>§ 2 基金简介</b>	<b>5</b>
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
<b>§ 3 主要财务指标和基金净值表现</b>	<b>6</b>
3.1 主要会计数据和财务指标	6
3.2 基金净值表现	7
<b>§ 4 管理人报告</b>	<b>9</b>
4.1 基金管理人及基金经理情况	9
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	11
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	11
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明	12
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	12
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	12
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	13
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明	13
<b>§ 5 托管人报告</b>	<b>13</b>
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	13
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	13
5.3 托管人对本中期报告中财务信息内容的真实、准确和完整发表意见	13
<b>§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）</b>	<b>14</b>
6.1 资产负债表	14
6.2 利润表	15
6.3 所有者权益（基金净值）变动表	16
6.4 报表附注	17
<b>§ 7 投资组合报告</b>	<b>38</b>
7.1 期末基金资产组合情况	38
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	39
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	40
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	43
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	44
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	44

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 .....	44
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 .....	44
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 .....	45
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明 .....	45
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 .....	45
7.12 投资组合报告附注 .....	45
<b>§ 8 基金份额持有人信息 .....</b>	<b>46</b>
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....	46
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....	46
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 .....	47
<b>§ 9 开放式基金份额变动 .....</b>	<b>47</b>
<b>§ 10 重大事件揭示 .....</b>	<b>47</b>
10.1 基金份额持有人大会决议 .....	47
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 .....	47
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 .....	48
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	48
10.8 其他重大事件 .....	49
<b>§ 11 影响投资者决策的其他重要信息 .....</b>	<b>50</b>
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 .....	50
11.2 影响投资者决策的其他重要信息 .....	50
<b>§ 12 备查文件目录 .....</b>	<b>50</b>
12.1 备查文件目录 .....	50
12.2 存放地点 .....	50
12.3 查阅方式 .....	50

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	大成睿鑫股票型证券投资基金	
基金简称	大成睿鑫股票	
基金主代码	009069	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2020 年 8 月 11 日	
基金管理人	大成基金管理有限公司	
基金托管人	招商银行股份有限公司	
报告期末基金份 额总额	871,342,099.78 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基 金简称	大成睿鑫股票 A	大成睿鑫股票 C
下属分级基金的交 易代码	009069	009070
报告期末下属分级 基金的份额总额	814,099,851.69 份	57,242,248.09 份

### 2.2 基金产品说明

投资目标	本基金在有效控制组合风险并保持良好流动性的前提下，通过专业化行业深度研究分析，力争实现基金资产的长期稳定增值。
投资策略	本基金在把握宏观经济运行趋势和股票市场行业轮动的基础上，充分发挥公司股票研究团队“自下而上”的主动选股能力，以定性和定量相结合的方法，基于对个股深入的基本面研究和细致的实地调研，精选股票构建股票投资组合。
业绩比较基准	沪深 300 指数收益率×75%+恒生指数收益率×10%+中证综合债券指数收益率×15%
风险收益特征	本基金为股票基金，理论上其预期风险与预期收益高于混合基金、债券基金和货币市场基金。本基金可通过内地与香港股票市场交易互联互通机制投资于香港证券市场，除了需要承担与境内证券投资基金类似的市场波动风险等一般投资风险之外，本基金还面临汇率风险、投资于香港证券市场的风险、以及通过内地与香港股票市场交易互联互通机制投资的风险等特有风险。

### 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	招商银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	赵冰	张燕
	联系电话	0755-83183388	0755-83199084
	电子邮箱	office@dcfund.com.cn	yan_zhang@cmbchina.com
客户服务电话		4008885558	95555
传真		0755-83199588	0755-83195201

注册地址	深圳市福田区深南大道 7088 号招商银行大厦 32 层	深圳市深南大道 7088 号招商银行大厦
办公地址	深圳市福田区深南大道 7088 号招商银行大厦 32 层	深圳市深南大道 7088 号招商银行大厦
邮政编码	518040	518040
法定代表人	吴庆斌	缪建民

## 2.4 信息披露方式

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

## 2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	大成基金管理有限公司	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)	
	大成睿鑫股票 A	大成睿鑫股票 C
本期已实现收益	63,781,035.91	4,508,401.64
本期利润	-11,926,771.47	-1,092,885.68
加权平均基金份额本期利润	-0.0114	-0.0141
本期加权平均净值利润率	-1.06%	-1.32%
本期基金份额净值增长率	-1.57%	-1.77%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2021 年 6 月 30 日)	
	大成睿鑫股票 A	大成睿鑫股票 C
期末可供分配利润	50,969,635.21	3,368,292.96

期末可供分配基金份额利润	0.0626	0.0588
期末基金资产净值	865,069,486.90	60,610,541.05
期末基金份额净值	1.0626	1.0588
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	6.26%	5.88%

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认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

## 3.2 基金净值表现

### 3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

大成睿鑫股票 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	-2.67%	0.82%	-1.59%	0.65%	-1.08%	0.17%
过去三个月	0.83%	0.88%	3.00%	0.79%	-2.17%	0.09%
过去六个月	-1.57%	1.15%	1.27%	1.06%	-2.84%	0.09%
自基金合同生效起至今	6.26%	0.97%	10.48%	0.97%	-4.22%	0.00%

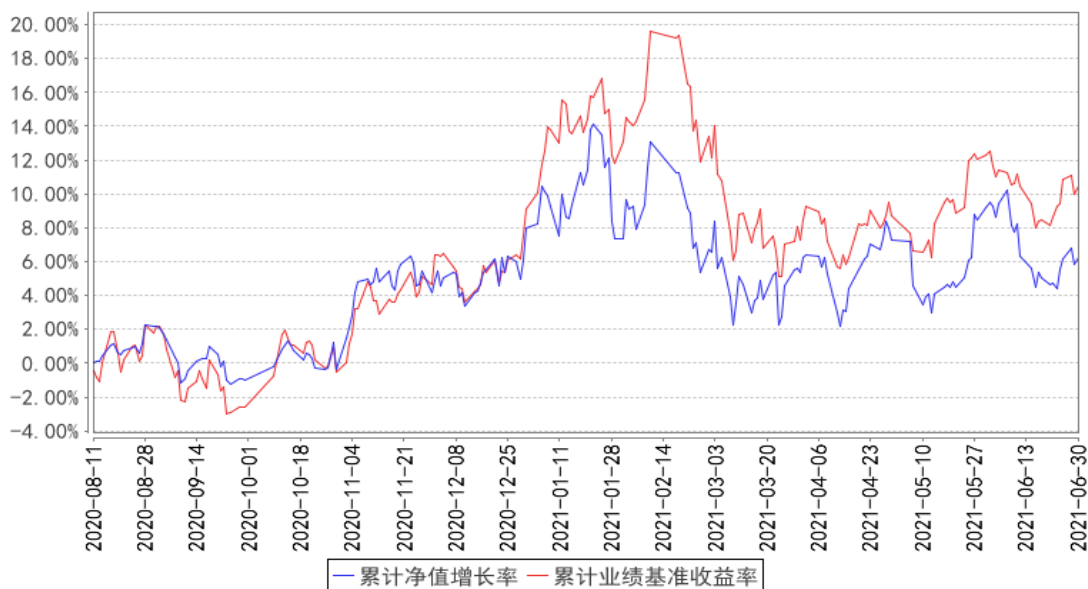
大成睿鑫股票 C

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	-2.71%	0.82%	-1.59%	0.65%	-1.12%	0.17%
过去三个月	0.72%	0.88%	3.00%	0.79%	-2.28%	0.09%
过去六个月	-1.77%	1.15%	1.27%	1.06%	-3.04%	0.09%
自基金合同生效起 至今	5.88%	0.97%	10.48%	0.97%	-4.60%	0.00%

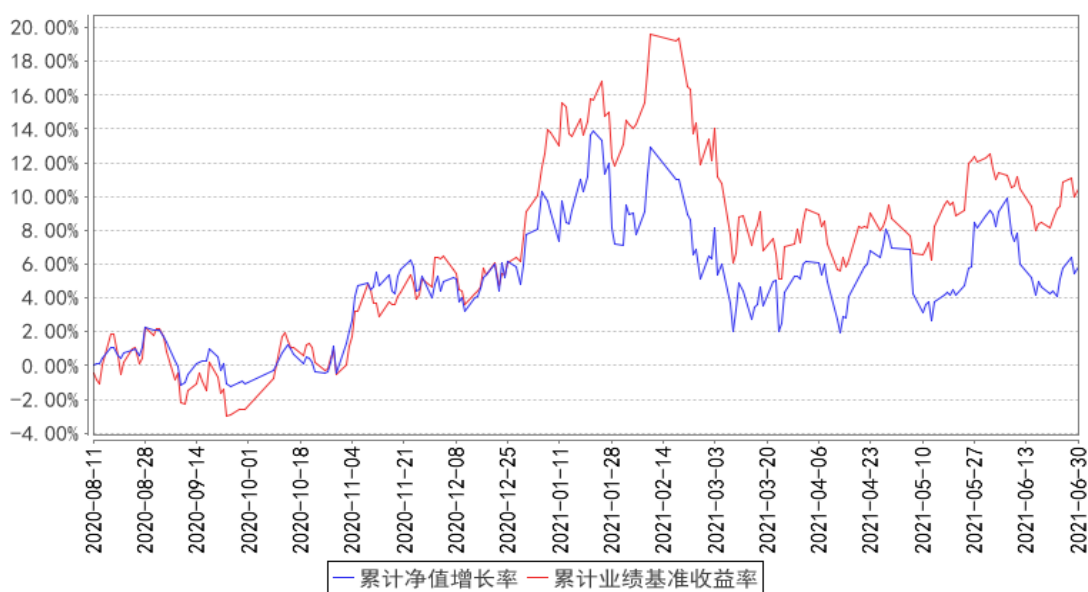
### 3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

大成睿鑫股票A累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图





大成睿鑫股票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 8 月 11 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		
刘旭	本基金基金经理，股票投资部总监	2020 年 8 月 11 日	-	10 年	管理学硕士。2009 年至 2010 年在毕马威华振会计师事务所任审计师。2011 年 2 月至 2013 年 5 月任广发证券研究所研究员。2013 年 5 月加入大成基金管理有限公司，曾担任研究部研究员、基金经理助理、股票投资部副总监，现任股票投资部总监。2015 年 7 月 29 日起任大成高新技术产业股票型证券投资基金基金经理。2016 年 8 月 20 日至 2021 年 3 月 17 日任大成创新成长混合型证券投资基金 (LOF) 基金经理。2019 年 12 月 24 日起任大成优势企业混合型证券投资基金基金经理。2020 年 6 月 5 日起任大成睿裕六个月持有期股票型证券投资基金基金经理。2020 年 8 月 11 日起任大成睿鑫股票型证券投资基金基金经理。2021 年 3 月 15 日起任大成核心价值甄选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
张家旺	本基金基金经理助理	2020 年 10 月 19 日	-	5 年	工程硕士。2016 年 7 月加入大成基金管理有限公司，现任研究部研究员。2020 年 10 月 19 日起任大成创新成长混合型证券投资基金 (LOF)、大成高新技术产业股票型证券投资基金、大成优势企业混合型证券投资基金、大成睿裕六个月持有期股票型证券投资基金、大成睿鑫股票型证券投资基金基金经理助理。2021 年 1 月 6 日起任大成国企改革灵活配置混合型证券投资基金基金经理助理。具有基金从业资格。国籍：中国
方锐	本基金基金经理助理	2020 年 11 月 6 日	-	5 年	经济学硕士。2015 年 7 月至 2016 年 11 月就职于中国人民银行深圳市中心支行，任货币信贷管理处科员。2016 年 11 月加入大成基金管理有限公司，先后担任固定收益总部助理研究员、基金经理。2018 年 11 月 6 日起任大成惠明定期开放纯债债券型证券投资基金、大成景荣债券型证券投资基金基金经理助理。2018 年 12 月 28 日起任大成价值增长证券投资基金基金经理助理。2020 年 11 月 6 日起任大成睿鑫股票型证券投资基金、大成高新技术产业股票型证券投资基金、大成睿裕六个月持有期股票型证券投资基金、大成互联网思维混合型证券投资基金基金经理助理。2018 年

					12月28日至2020年9月7日任大成景旭纯债债券型证券投资基金基金经理助理。2021年7月29日起任大成消费精选股票型证券投资基金基金经理助理。2020年9月7日起任大成彭博巴克莱农发行债券1-3年指数证券投资基金、大成景旭纯债债券型证券投资基金基金经理。2020年10月30日起任大成中债1-3年国开行债券指数证券投资基金基金经理。2021年6月4月起任大成安诚债券型证券投资基金基金经理。具备基金从业资格。国籍：中国
--	--	--	--	--	---

注：1、任职日期、离任日期为本基金管理人作出决定之日。

2、证券从业年限的计算标准遵从行业协会《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

合同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 年以来，随着赛道交易越发拥挤，行情的波动性也在放大。本基金上半年进一步加大合理估值的优秀制造业持仓比重，降低位于历史较高估值位置的消费品公司占比。

##### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末大成睿鑫股票 A 的基金份额净值为 1.0626 元，本报告期基金份额净值增长率为-1.57%，同期业绩比较基准收益率为 1.27%；截至本报告期末大成睿鑫股票 C 的基金份额净值为 1.0588 元，本报告期基金份额净值增长率为-1.77%，同期业绩比较基准收益率为 1.27%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

我们坚信中国政府为国内企业家群体提供了非常健康稳定的经营大环境，绝大多数企业的成败主要与自身经营能力有关。本基金未来仍将并只将精力专注于寻找那些具有优秀管理层、清晰竞争力的估值合理企业。

#### 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**

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

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

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

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

本年度中期报告中利润分配情况真实、准确。

### **5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见**

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

## § 6 半年度财务会计报告（未经审计）

## 6.1 资产负债表

会计主体：大成睿鑫股票型证券投资基金

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
<b>资产：</b>			
银行存款	6.4.3.1	117,262,989.00	323,954,617.89
结算备付金		344,164.37	1,372,209.97
存出保证金		243,883.90	349,123.76
交易性金融资产	6.4.3.2	811,665,042.92	1,561,636,013.14
其中：股票投资		811,665,042.92	1,521,860,013.14
基金投资		-	-
债券投资		-	39,776,000.00
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	6.4.3.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.3.4	-	-
应收证券清算款		-	-
应收利息	6.4.3.5	10,694.89	77,256.78
应收股利		-	-
应收申购款		444,443.93	524,670.05
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.3.6	-	-
资产总计		929,971,219.01	1,887,913,891.59
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2021 年 6 月 30 日</b>	<b>上年度末 2020 年 12 月 31 日</b>
<b>负债：</b>			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.3.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		15.08	24,439,780.42
应付赎回款		2,473,406.88	12,781,246.79
应付管理人报酬		1,195,748.44	2,473,716.30
应付托管费		199,291.40	412,286.06
应付销售服务费		21,138.77	43,044.90
应付交易费用	6.4.3.7	276,296.46	678,261.66
应交税费		-	-
应付利息		-	-

应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.3.8	125,294.03	158,002.94
负债合计		4,291,191.06	40,986,339.07
<b>所有者权益：</b>			
实收基金	6.4.3.9	871,342,099.78	1,710,922,068.61
未分配利润	6.4.3.10	54,337,928.17	136,005,483.91
所有者权益合计		925,680,027.95	1,846,927,552.52
负债和所有者权益总计		929,971,219.01	1,887,913,891.59

注：报告截止日 2021 年 06 月 30 日，基金份额总额 871,342,099.78 份，其中大成睿鑫股票 A 基金份额总额为 814,099,851.69 份，基金份额净值 1.0626 元。大成睿鑫股票 C 基金份额总额为 57,242,248.09 份，基金份额净值 1.0588 元。

## 6.2 利润表

会计主体：大成睿鑫股票型证券投资基金

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		-35,346.55
1. 利息收入		571,650.58
其中：存款利息收入	6.4.3.11	231,413.15
债券利息收入		340,237.43
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）		79,083,470.12
其中：股票投资收益	6.4.3.12	69,797,606.25
基金投资收益	-	-
债券投资收益	6.4.3.13	48,870.00
贵金属投资收益	6.4.3.14	-
衍生工具收益	6.4.3.15	-
股利收益	6.4.3.16	9,236,993.87
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.3.17	-81,309,094.70
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.3.18	1,618,627.45
减：二、费用		12,984,310.60
1. 管理人报酬	6.4.6.2.1	9,054,064.97
2. 托管费	6.4.6.2.2	1,509,010.79

3. 销售服务费	6.4.6.2.3	165,152.62
4. 交易费用	6.4.3.19	2,106,655.51
5. 利息支出		-
其中：卖出回购金融资产支出		-
6. 税金及附加		-
7. 其他费用	6.4.3.20	149,426.71
三、利润总额(亏损总额以“-”号填列)		-13,019,657.15
减：所得税费用		-
四、净利润(净亏损以“-”号填列)		-13,019,657.15

### 6.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体：大成睿鑫股票型证券投资基金

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)	1,710,922,068.61	136,005,483.91	1,846,927,552.52
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	-13,019,657.15	-13,019,657.15
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)	-839,579,968.83	-68,647,898.59	-908,227,867.42
其中：1. 基金申购款	159,596,642.49	19,260,916.35	178,857,558.84
2. 基金赎回款	-999,176,611.32	-87,908,814.94	-1,087,085,426.26
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)	871,342,099.78	54,337,928.17	925,680,027.95

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署：



谭晓冈

周立新

刘亚林

基金管理人负责人

主管会计工作负责人

会计机构负责人

## 6.4 报表附注

### 6.4.1 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

### 6.4.2 税项

#### (1) 印花税

证券（股票）交易印花税税率为 1‰，由出让方缴纳。

#### (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。

### 6.4.3 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	117,262,989.00
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	117,262,989.00

#### 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	741,112,024.51	811,665,042.92	70,553,018.41
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	-	-
	银行间市场	-	-
	合计	-	-

资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	741,112,024.51	811,665,042.92	70,553,018.41

#### 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	10,430.29
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	154.90
应收债券利息	-
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	109.70
合计	10,694.89

#### 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	274,946.46
银行间市场应付交易费用	1,350.00
合计	276,296.46

## 6.4.3.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2021年6月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	1,779.29
应付证券出借违约金	-
预提费用	123,514.74
合计	125,294.03

## 6.4.3.9 实收基金

金额单位：人民币元

## 大成睿鑫股票 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	1,599,004,358.18	1,599,004,358.18
本期申购	143,635,675.67	143,635,675.67
本期赎回（以“-”号填列）	-928,540,182.16	-928,540,182.16
-基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算调整	-	-
本期申购	-	-
本期赎回（以“-”号填列）	-	-
本期末	814,099,851.69	814,099,851.69

## 大成睿鑫股票 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	111,917,710.43	111,917,710.43
本期申购	15,960,966.82	15,960,966.82
本期赎回（以“-”号填列）	-70,636,429.16	-70,636,429.16
-基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算调整	-	-
本期申购	-	-
本期赎回（以“-”号填列）	-	-
本期末	57,242,248.09	57,242,248.09

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

## 大成睿鑫股票 A

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	10,870,742.88	116,413,508.70	127,284,251.58
本期利润	63,781,035.91	-75,707,807.38	-11,926,771.47
本期基金份额交易产生的变动数	-22,518,616.02	-41,869,228.88	-64,387,844.90
其中：基金申购款	4,246,256.04	13,688,261.09	17,934,517.13
基金赎回款	-26,764,872.06	-55,557,489.97	-82,322,362.03
本期已分配利润	-	-	-
本期末	52,133,162.77	-1,163,527.56	50,969,635.21

## 大成睿鑫股票 C

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	582,146.88	8,139,085.45	8,721,232.33
本期利润	4,508,401.64	-5,601,287.32	-1,092,885.68
本期基金份额交易产生的变动数	-1,646,525.61	-2,613,528.08	-4,260,053.69
其中：基金申购款	408,180.74	918,218.48	1,326,399.22
基金赎回款	-2,054,706.35	-3,531,746.56	-5,586,452.91
本期已分配利润	-	-	-
本期末	3,444,022.91	-75,729.95	3,368,292.96

## 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	221,113.67
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	6,653.62
其他	3,645.86
合计	231,413.15

## 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	900,377,722.56
减：卖出股票成本总额	830,580,116.31
买卖股票差价收入	69,797,606.25

#### 6.4.3.13 债券投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月30日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	179,214,875.21
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	178,773,710.00
减：应收利息总额	392,295.21
买卖债券差价收入	48,870.00

#### 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	9,236,993.87
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	9,236,993.87

#### 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	-81,309,094.70
股票投资	-81,272,854.70
债券投资	-36,240.00
资产支持证券投资	-
基金投资	-
贵金属投资	-
其他	-
2. 衍生工具	-

权证投资	-
3. 其他	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税	-
合计	-81,309,094.70

#### 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	1,610,532.23
基金转换费收入	8,095.22
合计	1,618,627.45

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	2,104,830.51
银行间市场交易费用	1,825.00
合计	2,106,655.51

#### 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	59,507.37
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
银行划款手续费	19,911.97
账户维护费	10,500.00
合计	149,426.71

#### 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者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、注册登记机构、基金销售机构
招商银行股份有限公司(“招商银行”)	基金托管人、基金销售机构
光大证券股份有限公司(“光大证券”)	基金管理人的股东、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	
	成交金额	占当期股票 成交总额的比例(%)
光大证券	478,222,359.58	43.80

#### 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	426,184.00	43.25	110,446.75	40.17



注：1. 上述佣金参考市场价格经本基金的基金管理人与对方协商确定，以扣除由中国证券登记结算有限责任公司收取的证管费和经手费的净额列示。

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

#### 6.4.6.2 关联方报酬

##### 6.4.6.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	9,054,064.97
其中：支付销售机构的客户维护费	3,890,443.41

注：基金管理人的管理费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付。基金管理费按前一日的基金资产净值的 1.50% 的年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 1.50\% / \text{当年天数}$$

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

##### 6.4.6.2.2 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
当期发生的基金应支付的托管费	1,509,010.79

注：基金托管费每日计算，逐日累计至每月月末，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 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

##### 6.4.6.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联	本期
-------------	----

方名称	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		
	大成睿鑫股票 A	大成睿鑫股票 C	合计
大成基金	-	6,961.05	6,961.05
招商银行	-	39,062.09	39,062.09
合计	-	46,023.14	46,023.14

注：基金销售服务费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付。本基金 A 类基金份额不收取销售服务费，C 类基金份额的销售服务费按前一日 C 类基金资产净值的 0.40% 年费率计提。销售服务费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.40\% / \text{当年天数}$$

H 为 C 类基金份额每日应计提的销售服务费

E 为 C 类基金份额前一日基金资产净值

#### 6.4.6.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

无。

#### 6.4.6.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

##### 6.4.6.4.1 与关联方通过约定申报方式进行的适用固定期限费率的证券出借业务的情况

无。

##### 6.4.6.4.2 与关联方通过约定申报方式进行的适用市场化期限费率的证券出借业务的情况

无。

#### 6.4.6.5 各关联方投资本基金的情况

##### 6.4.6.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

无。

## 6.4.6.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

无。

## 6.4.6.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2021年1月1日至2021年6月30日	
	期末余额	当期利息收入
招商银行	117,262,989.00	221,113.67

注：本基金的活期银行存款由基金托管人招商银行保管，并按银行间同业利率计息。

## 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
300614	百川畅银	2021年5月18日	2021年11月25日	新股锁定	9.19	40.38	329	3,023.51	13,285.02	-
300926	博俊科技	2020年12月29日	2021年7月12日	新股锁定	10.76	22.20	359	3,862.84	7,969.80	-
300927	江天化学	2020年12月29日	2021年7月7日	新股锁定	13.39	30.10	217	2,905.63	6,531.70	-
300929	华骐环保	2021年1月12日	2021年7月21日	新股锁定	13.87	29.55	183	2,538.21	5,407.65	-
300932	三友	2021年	2021年	新股锁	24.69	31.71	492	12,147.48	15,601.32	-

	联众	1月15日	7月22日	定						
300933	中辰股份	2021年1月15日	2021年7月22日	新股锁定	3.37	10.44	1,112	3,747.44	11,609.28	-
300937	药易购	2021年1月20日	2021年7月27日	新股锁定	12.25	53.71	244	2,989.00	13,105.24	-
300940	南极光	2021年1月27日	2021年8月3日	新股锁定	12.76	43.38	307	3,917.32	13,317.66	-
300941	创识科技	2021年2月2日	2021年8月9日	新股锁定	21.31	49.94	399	8,502.69	19,926.06	-
300942	易瑞生物	2021年2月2日	2021年8月9日	新股锁定	5.31	28.52	443	2,352.33	12,634.36	-
300943	春晖智控	2021年2月3日	2021年8月10日	新股锁定	9.79	23.01	255	2,496.45	5,867.55	-
300945	曼卡龙	2021年2月3日	2021年8月10日	新股锁定	4.56	18.88	474	2,161.44	8,949.12	-
300950	德固特	2021年2月24日	2021年9月3日	新股锁定	8.41	39.13	219	1,841.79	8,569.47	-
300952	恒辉安防	2021年3月3日	2021年9月13日	新股锁定	11.72	27.08	340	3,984.80	9,207.20	-
300953	震裕科技	2021年3月11日	2021年9月22日	新股锁定	28.77	99.85	240	6,904.80	23,964.00	-
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	740	35,024.20	186,450.40	-
300958	建工修复	2021年3月18日	2021年9月29日	新股锁定	8.53	27.22	300	2,559.00	8,166.00	-

300960	通业科技	2021年 3月22 日	2021年 9月29 日	新股锁 定	12.08	23.06	234	2,826.72	5,396.04	-
300961	深水海纳	2021年 3月23 日	2021年 9月30 日	新股锁 定	8.48	22.07	394	3,341.12	8,695.58	-
300962	中金辐照	2021年 3月29 日	2021年 10月 11日	新股锁 定	3.40	16.37	576	1,958.40	9,429.12	-
300963	中洲特材	2021年 3月30 日	2021年 10月 11日	新股锁 定	12.13	22.49	283	3,432.79	6,364.67	-
300966	共同药业	2021年 3月31 日	2021年 10月 11日	新股锁 定	8.24	31.54	286	2,356.64	9,020.44	-
300967	晓鸣股份	2021年 4月2 日	2021年 10月 13日	新股锁 定	4.54	11.54	507	2,301.78	5,850.78	-
300968	格林精密	2021年 4月6 日	2021年 10月 15日	新股锁 定	6.87	12.07	1,162	7,982.94	14,025.34	-
300971	博亚精工	2021年 4月7 日	2021年 10月 15日	新股锁 定	18.24	28.29	245	4,468.80	6,931.05	-
300973	立高食品	2021年 4月8 日	2021年 10月 15日	新股锁 定	28.28	115.71	360	10,180.80	41,655.60	-
300975	商络电子	2021年 4月14 日	2021年 10月 21日	新股锁 定	5.48	13.03	492	2,696.16	6,410.76	-
300978	东箭科技	2021年 4月15 日	2021年 10月 26日	新股锁 定	8.42	13.60	593	4,993.06	8,064.80	-
300979	华利集团	2021年 4月15 日	2021年 10月 26日	新股锁 定	33.22	87.50	925	30,728.50	80,937.50	-
300981	中红医疗	2021年 4月19 日	2021年 10月 27日	新股锁 定	48.59	90.39	361	17,540.99	32,630.79	-
300982	苏文电能	2021年 4月19 日	2021年 10月 27日	新股锁 定	15.83	45.29	317	5,018.11	14,356.93	-
300986	志特新材	2021年 4月21 日	2021年 11月1 日	新股锁 定	14.79	30.57	264	3,904.56	8,070.48	-

		日	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 17日	新股锁 定	14.20	33.84	175	2,485.00	5,922.00	-
301012	扬电科技	2021年 6月15 日	2021年 12月 22日	新股锁 定	8.05	24.26	170	1,368.50	4,124.20	-
301013	利和兴	2021年 6月21 日	2021年 12月 29日	新股锁 定	8.72	27.11	471	4,107.12	12,768.81	-
301015	百洋	2021年	2021年	新股锁	7.64	38.83	462	3,529.68	17,939.46	-

	医药	6月22日	12月30日	定							
301016	雷尔伟	2021年6月23日	2021年12月30日	新股锁定	13.75	32.98	275	3,781.25	9,069.50		-
301020	密封科技	2021年6月28日	2021年7月6日	新股未上市	10.64	10.64	4,210	44,794.40	44,794.40		-
301021	英诺激光	2021年6月28日	2021年7月6日	新股未上市	9.46	9.46	2,899	27,424.54	27,424.54		-
605162	新中港	2021年6月29日	2021年7月7日	新股未上市	6.07	6.07	1,377	8,358.39	8,358.39		-
688067	爱威科技	2021年6月7日	2021年12月16日	新股锁定	14.71	24.83	1,259	18,519.89	31,260.97		-
688087	英科再生	2021年6月30日	2022年01月10日	新股未上市	21.96	21.96	2,469	54,219.24	54,219.24		-
688092	爱科科技	2021年3月12日	2021年9月22日	新股锁定	19.11	33.21	1,137	21,728.07	37,759.77		-
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		-
688276	百克生物	2021年6月17日	2021年12月27日	新股锁定	36.35	79.48	3,486	126,716.10	277,067.28		-
688317	之江生物	2021年1月8日	2021年7月19日	新股锁定	43.22	63.82	5,740	248,082.80	366,326.80		-
688499	利元亨	2021年6月23日	2022年1月1日	新股锁定	38.85	38.85	2,149	83,488.65	83,488.65		-
688565	力源科技	2021年5月6日	2021年11月15日	新股锁定	9.39	14.00	2,464	23,136.96	34,496.00		-
688626	翔宇医疗	2021年3月23日	2021年10月8日	新股锁定	28.82	104.16	3,652	105,250.64	380,392.32		-

688636	智明达	2021年 3月30 日	2021年 10月8 日	新股锁 定	34.50	80.72	918	31,671.00	74,100.96	-
688663	新风光	2021年 4月6 日	2021年 10月 13日	新股锁 定	14.48	19.21	3,279	47,479.92	62,989.59	-
688682	霍莱沃	2021年 4月13 日	2021年 10月 20日	新股锁 定	45.72	103.85	946	43,251.12	98,242.10	-
688683	莱尔科技	2021年 4月1 日	2021年 10月 12日	新股锁 定	9.51	14.73	3,296	31,344.96	48,550.08	-

注：1. 根据《上海证券交易所科创板股票公开发行自律委员会促进科创板初期企业平稳发行行业倡导建议》，本基金获配的科创板股票如经抽签方式确定需要锁定的，锁定期限为自发行人股票上市之日起 6 个月。根据《上海证券交易所科创板上市公司股东以向特定机构投资者询价转让和配售方式减持股份实施细则》，基金通过询价转让受让的股份，在受让后 6 个月内不得转让。

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

3. 基金可使用以基金名义开设的股票账户，选择网上或者网下一种方式进行新股申购。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

##### 6.4.8.3.1 银行间市场债券正回购

无。

##### 6.4.8.3.2 交易所市场债券正回购

无。



#### 6.4.8.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

无。

#### 6.4.9 金融工具风险及管理

##### 6.4.9.1 风险管理政策和组织架构

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

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

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

##### 6.4.9.2 信用风险

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

本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的活期银行存款无定期/协议存款，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。

### 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。

### 6.4.9.4 市场风险

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

#### 6.4.9.4.1 利率风险

利率风险是指金融工具的公允价值或未来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。本基金持有的生息资产主要为银行存款、结算备付金、债券投资、资产支持证券投资及买入返售金融资产等。

#### 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	117,262,989.00	-	-	-	117,262,989.00
结算备付金	344,164.37	-	-	-	344,164.37
存出保证金	243,883.90	-	-	-	243,883.90
交易性金融资产	-	-	-	811,665,042.92	811,665,042.92
应收利息	-	-	-	10,694.89	10,694.89
应收申购款	-	-	-	444,443.93	444,443.93
资产总计	117,851,037.27	-	-	812,120,181.74	929,971,219.01
负债					
应付赎回款	-	-	-	2,473,406.88	2,473,406.88
应付管理人报酬	-	-	-	1,195,748.44	1,195,748.44
应付托管费	-	-	-	199,291.40	199,291.40
应付证券清算款	-	-	-	15.08	15.08
应付销售服务费	-	-	-	21,138.77	21,138.77
应付交易费用	-	-	-	276,296.46	276,296.46
其他负债	-	-	-	125,294.03	125,294.03
负债总计	-	-	-	4,291,191.06	4,291,191.06
利率敏感度缺口	117,851,037.27	-	-	807,828,990.68	925,680,027.95
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	323,954,617.89	-	-	-	323,954,617.89
结算备付金	1,372,209.97	-	-	-	1,372,209.97
存出保证金	349,123.76	-	-	-	349,123.76
交易性金融资产	39,776,000.00	-	-	1,521,860,013.14	1,561,636,013.14
应收利息	-	-	-	77,256.78	77,256.78
应收申购款	-	-	-	524,670.05	524,670.05

资产总计	365,451,951.62	-	-	-1,522,461,939.97	1,887,913,891.59
负债					
应付赎回款	-	-	-	12,781,246.79	12,781,246.79
应付管理人报酬	-	-	-	2,473,716.30	2,473,716.30
应付托管费	-	-	-	412,286.06	412,286.06
应付证券清算款	-	-	-	24,439,780.42	24,439,780.42
应付销售服务费	-	-	-	43,044.90	43,044.90
应付交易费用	-	-	-	678,261.66	678,261.66
其他负债	-	-	-	158,002.94	158,002.94
负债总计	-	-	-	40,986,339.07	40,986,339.07
利率敏感度缺口	365,451,951.62	-	-	-1,481,475,600.90	1,846,927,552.52

注：表中所示为本基金资产及负债的账面价值，并按照合同约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，本基金未持有交易性债券投资（上年度末：同），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。本基金持有的所有资产及负债以人民币计价，因此无重大外汇风险。

##### 6.4.9.4.2.1 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 折合人民币 元	港币 折合人民币元	其他币种 折合人民币元	合计
以外币计价的 资产				
交易性金融资产	-	67,982,267.33	-	67,982,267.33
资产合计	-	67,982,267.33	-	67,982,267.33
以外币计价的 负债				
负债合计	-	-	-	-
资产负债表外 外汇风险敞口净 额	-	67,982,267.33	-	67,982,267.33

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	-	-	-	-

#### 6.4.9.4.2.2 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%	3,399,113.36	-
	港币相对人民币贬值 5%	-3,399,113.37	-

#### 6.4.9.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因除外汇风险和利率风险以外的市场价格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，所面临的最大的价格风险由所持有的金融工具的公允价值决定。本基金通过投资组合的分散化降低其它价格风险，并且本基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控。

##### 6.4.9.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 6 月 30 日		上年度末 2020 年 12 月 31 日	
	公允价值	占基金资产净值比例（%）	公允价值	占基金资产净值比例（%）

交易性金融资产—股票投资	811,665,042.92	87.68	1,521,860,013.14	82.40
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	811,665,042.92	87.68	1,521,860,013.14	82.40

#### 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%	40,393,461.17	57,030,774.04
	业绩比较基准下降5%	-40,393,461.17	-57,030,774.04

#### 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	811,665,042.92	87.28
	其中：股票	811,665,042.92	87.28
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	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	-	-

	产		
7	银行存款和结算备付金合计	117,607,153.37	12.65
8	其他各项资产	699,022.72	0.08
9	合计	929,971,219.01	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	109,022.80	0.01
B	采矿业	82,466,674.05	8.91
C	制造业	659,319,070.16	71.23
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	13,020.39	0.00
E	建筑业	14,356.93	0.00
F	批发和零售业	426,457.51	0.05
G	交通运输、仓储和邮政业	27,865.35	0.00
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	325,101.99	0.04
J	金融业	272,056.30	0.03
K	房地产业	10,095.90	0.00
L	租赁和商务服务业	49,470.30	0.01
M	科学研究和技术服务业	337,536.64	0.04
N	水利、环境和公共设施管理业	312,047.27	0.03
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	743,682,775.59	80.34

### 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	67,982,267.33	7.34
非日常生活消费品	-	-
日常消费品	-	-
能源	-	-
金融	-	-
医疗保健	-	-
工业	-	-
信息技术	-	-

原材料	-	-
房地产	-	-
合计	67,982,267.33	7.34

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	002884	凌霄泵业	4,020,259	93,631,832.11	10.11
2	603989	艾华集团	2,840,890	92,584,605.10	10.00
3	601877	正泰电器	2,682,231	89,532,870.78	9.67
4	603187	海容冷链	2,067,053	88,635,232.64	9.58
5	002372	伟星新材	4,037,800	83,461,326.00	9.02
6	601225	陕西煤业	6,959,213	82,466,674.05	8.91
7	600690	海尔智家	3,130,297	81,105,995.27	8.76
8	00700	腾讯控股	139,900	67,982,267.33	7.34
9	600519	贵州茅台	21,502	44,223,163.40	4.78
10	000860	顺鑫农业	845,293	35,654,458.74	3.85
11	603583	捷昌驱动	268,940	13,613,742.80	1.47
12	002749	国光股份	1,422,021	13,153,694.25	1.42
13	603337	杰克股份	459,120	12,272,277.60	1.33
14	600079	人福医药	120,441	3,404,867.07	0.37
15	688063	派能科技	5,499	1,082,203.20	0.12
16	300919	中伟股份	6,093	993,159.00	0.11
17	300896	爱美客	851	671,336.88	0.07
18	688626	翔宇医疗	3,652	380,392.32	0.04
19	688317	之江生物	5,740	366,326.80	0.04
20	300887	谱尼测试	3,776	337,536.64	0.04
21	688161	威高骨科	3,069	325,467.45	0.04
22	688276	百克生物	3,486	277,067.28	0.03
23	300953	震裕科技	2,394	258,642.30	0.03
24	301015	百洋医药	4,614	251,115.78	0.03
25	300911	亿田智能	3,083	213,590.24	0.02
26	300941	创识科技	3,989	204,452.06	0.02
27	300884	狄耐克	7,477	200,981.76	0.02
28	300957	贝泰妮	740	186,450.40	0.02
29	300968	格林精密	11,620	179,261.74	0.02
30	300614	百川畅银	3,283	176,700.30	0.02
31	301013	利和兴	4,704	168,966.51	0.02
32	300909	汇创达	3,858	166,279.80	0.02
33	300890	翔丰华	2,854	155,828.40	0.02



34	301006	迈拓股份	5,051	154,055.50	0.02
35	300940	南极光	3,068	136,458.26	0.01
36	300937	药易购	2,434	133,599.04	0.01
37	600906	财达证券	7,597	128,237.36	0.01
38	300966	共同药业	2,858	126,586.56	0.01
39	301016	雷尔伟	2,747	115,711.58	0.01
40	300918	南山智尚	10,626	110,616.66	0.01
41	300986	志特新材	2,632	103,429.84	0.01
42	300993	玉马遮阳	4,097	99,899.55	0.01
43	688682	霍莱沃	946	98,242.10	0.01
44	300952	恒辉安防	3,398	95,320.48	0.01
45	300991	创益通	2,535	89,214.50	0.01
46	300958	建工修复	2,993	86,747.74	0.01
47	688499	利元亨	2,149	83,488.65	0.01
48	300967	晓鸣股份	5,061	81,674.88	0.01
49	601963	重庆银行	7,472	81,220.64	0.01
50	300979	华利集团	925	80,937.50	0.01
51	605358	立昂微	693	80,096.94	0.01
52	688636	智明达	918	74,100.96	0.01
53	688663	新风光	3,279	62,989.59	0.01
54	601665	齐鲁银行	6,731	62,598.30	0.01
55	688239	航宇科技	4,926	56,550.48	0.01
56	688087	英科再生	2,469	54,219.24	0.01
57	002984	森麒麟	1,386	50,519.70	0.01
58	301010	晶雪节能	2,172	50,480.96	0.01
59	601156	东航物流	2,090	49,470.30	0.01
60	688683	莱尔科技	3,296	48,550.08	0.01
61	605337	李子园	788	46,886.00	0.01
62	301020	密封科技	4,210	44,794.40	0.00
63	300973	立高食品	360	41,655.60	0.00
64	688092	爱科科技	1,137	37,759.77	0.00
65	688565	力源科技	2,464	34,496.00	0.00
66	300900	广联航空	879	32,857.02	0.00
67	300981	中红医疗	361	32,630.79	0.00
68	688067	爱威科技	1,259	31,260.97	0.00
69	601702	华峰铝业	4,166	29,370.30	0.00
70	301021	英诺激光	2,899	27,424.54	0.00
71	001201	东瑞股份	668	27,347.92	0.00
72	003016	欣贺股份	1,681	26,912.81	0.00
73	601686	友发集团	2,374	26,493.84	0.00
74	605136	丽人丽妆	867	26,382.81	0.00
75	301009	可靠股份	801	22,339.89	0.00

76	001205	盛航股份	577	18,850.59	0.00
77	300898	熊猫乳品	496	17,984.96	0.00
78	688226	威腾电气	2,693	17,289.06	0.00
79	605300	佳禾食品	576	16,012.80	0.00
80	300932	三友联众	492	15,601.32	0.00
81	300982	苏文电能	317	14,356.93	0.00
82	605180	华生科技	384	14,208.00	0.00
83	605319	无锡振华	764	13,706.16	0.00
84	001208	华菱线缆	1,754	13,558.42	0.00
85	003030	祖名股份	480	13,516.80	0.00
86	300942	易瑞生物	443	12,634.36	0.00
87	603171	税友股份	637	12,230.40	0.00
88	605286	同力日升	597	12,208.65	0.00
89	300997	欢乐家	928	12,110.40	0.00
90	003036	泰坦股份	776	11,958.16	0.00
91	300933	中辰股份	1,112	11,609.28	0.00
92	301002	崧盛股份	201	11,581.62	0.00
93	003003	天元股份	756	10,765.44	0.00
94	300955	嘉亨家化	232	10,688.24	0.00
95	300996	普联软件	241	10,177.43	0.00
96	300917	特发服务	365	10,095.90	0.00
97	300922	天秦装备	287	9,996.21	0.00
98	300956	英力股份	371	9,571.80	0.00
99	300962	中金辐照	576	9,429.12	0.00
100	003000	劲仔食品	684	9,117.72	0.00
101	001202	炬申股份	459	9,014.76	0.00
102	003023	彩虹集团	296	8,968.80	0.00
103	300945	曼卡龙	474	8,949.12	0.00
104	300961	深水海纳	394	8,695.58	0.00
105	300950	德固特	219	8,569.47	0.00
106	605162	新中港	1,377	8,358.39	0.00
107	300978	东箭科技	593	8,064.80	0.00
108	300926	博俊科技	359	7,969.80	0.00
109	300971	博亚精工	245	6,931.05	0.00
110	300927	江天化学	217	6,531.70	0.00
111	300975	商络电子	492	6,410.76	0.00
112	300963	中洲特材	283	6,364.67	0.00
113	301011	华立科技	175	5,922.00	0.00
114	300943	春晖智控	255	5,867.55	0.00
115	300929	华骐环保	183	5,407.65	0.00
116	300960	通业科技	234	5,396.04	0.00
117	605011	杭州热电	525	4,662.00	0.00

118	300995	奇德新材	191	4,454.12	0.00
119	301007	德迈仕	303	4,375.32	0.00
120	300998	宁波方正	201	4,285.32	0.00
121	301012	扬电科技	170	4,124.20	0.00
122	300992	泰福泵业	200	4,064.00	0.00

注：截至报告期末，本基金投资的一家公司发行的证券凌霄泵业（002884.SZ）、艾华集团（603989.SH）因市值波动导致投资比例被动超标。

## 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	00700	腾讯控股	86,554,748.34	4.69
2	002372	伟星新材	71,691,873.51	3.88
3	601225	陕西煤业	10,190,822.00	0.55
4	002749	国光股份	7,424,274.40	0.40
5	603989	艾华集团	7,295,486.42	0.40
6	002884	凌霄泵业	4,323,404.14	0.23
7	000860	顺鑫农业	3,185,231.00	0.17
8	688819	天能股份	1,011,150.84	0.05
9	688157	松井股份	753,780.18	0.04
10	688538	和辉光电	624,732.20	0.03
11	688606	奥泰生物	361,310.01	0.02
12	300957	贝泰妮	350,194.67	0.02
13	688425	铁建重工	337,451.73	0.02
14	300979	华利集团	307,152.12	0.02
15	688660	电气风电	278,734.72	0.02
16	688083	中望软件	276,468.50	0.01
17	688317	之江生物	248,082.80	0.01
18	688183	生益电子	228,453.48	0.01
19	300981	中红医疗	175,021.18	0.01
20	688696	极米科技	167,429.96	0.01

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	600079	人福医药	104,061,349.83	5.63
2	600690	海尔智家	99,362,608.50	5.38
3	603337	杰克股份	80,175,830.80	4.34
4	601877	正泰电器	78,724,716.48	4.26

5	000860	顺鑫农业	77,153,016.34	4.18
6	600993	马应龙	71,432,982.17	3.87
7	000002	万科 A	58,300,641.54	3.16
8	002884	凌霄泵业	57,512,176.54	3.11
9	000423	东阿阿胶	52,020,014.59	2.82
10	603187	海容冷链	45,358,616.10	2.46
11	603989	艾华集团	41,794,349.70	2.26
12	601225	陕西煤业	27,750,528.00	1.50
13	002299	圣农发展	26,008,830.90	1.41
14	603583	捷昌驱动	22,645,284.28	1.23
15	300791	仙乐健康	16,724,849.50	0.91
16	300445	康斯特	3,907,569.37	0.21
17	000902	新洋丰	3,005,795.00	0.16
18	601995	中金公司	1,922,213.69	0.10
19	300957	贝泰妮	1,419,074.00	0.08
20	688608	恒玄科技	1,385,466.90	0.08

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	201,658,000.79
卖出股票收入（成交）总额	900,377,722.56

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

无。

#### 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

无。

#### 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	243,883.90
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	10,694.89
5	应收申购款	444,443.93
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	699,022.72

**7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细**

无。

**7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明**

无。

## 7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入原因，分项之和与合计可能有尾差。

## § 8 基金份额持有人信息

## 8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额级别	持有人户数 (户)	户均持有的基金份额	持有人结构			
			机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总份额比例 (%)	持有份额	占总份额比例 (%)
大成睿鑫股票 A	12,262	66,392.09	118,700,861.57	14.58	695,398,990.12	85.42
大成睿鑫股票 C	5,100	11,223.97	446,667.86	0.78	56,795,580.23	99.22
合计	17,362	50,186.74	119,147,529.43	13.67	752,194,570.35	86.33

注：1、上述机构/个人投资者持有份额占总份额比例的计算中，对分级份额，比例的分母采用各自级别的份额，对合计数，比例的分母采用下属分级基金份额的合计数（即期末基金份额总额）。

2、持有人户数为有效户数，即存量份额大于零的账户。

## 8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数 (份)	占基金总份额比例 (%)
基金管理人所有从业人员持有本基金	大成睿鑫股票 A	131,016.75	0.0161
	大成睿鑫股票 C	520.22	0.0009
	合计	131,536.97	0.0151

## 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	大成睿鑫股票 A	10~50
	大成睿鑫股票 C	0
	合计	10~50
本基金基金经理持有本开放式基金	大成睿鑫股票 A	0
	大成睿鑫股票 C	0
	合计	0

## §9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	大成睿鑫股票 A	大成睿鑫股票 C
基金合同生效日 (2020 年 8 月 11 日) 基金份额总额	2,168,218,011.38	161,705,779.50
本报告期期初基金份额总额	1,599,004,358.18	111,917,710.43
本报告期基金总申购份额	143,635,675.67	15,960,966.82
减：本报告期基金总赎回份额	928,540,182.16	70,636,429.16
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	814,099,851.69	57,242,248.09

## §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

本报告期内，无涉及本基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动。

### 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

无。

### 10.4 基金投资策略的改变

本基金投资策略在本报告期内没有重大改变。

### 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

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

### 10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，基金管理人、托管人及其相关高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

### 10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

#### 10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
招商证券	1	613,574,982.97	56.20%	559,103.31	56.75%	-
光大证券	1	478,222,359.58	43.80%	426,184.00	43.25%	-
国信证券	1	-	-	-	-	-

注：根据中国证监会颁布的《关于完善证券投资基金交易席位制度有关问题的通知》（证监基金字[2007]48号）的有关规定，本公司制定了租用证券公司交易单元的选择标准和程序。

租用证券公司交易单元的选择标准主要包括：

- (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。

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：

本报告期内增加交易单元：无。本报告期内退租交易单元：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

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平安银行股份有限公司为销售机构的公告	中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站	2021年6月28日
3	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
4	大成基金管理有限公司关于旗下部分基金增加宁波银行股份有限公司为销售机构的公告	中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站	2021年5月13日
5	大成基金管理有限公司关于旗下部分基金增加上海中正达广基金销售有限公司为销售机构的公告	中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站	2021年5月12日
6	大成睿鑫股票型证券投资基金 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
7	大成睿鑫股票型证券投资基金 2020 年年度报告	中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站	2021年3月30日
8	大成基金管理有限公司关于旗下部分基金增加东莞证券股份有限公司为销售机构的公告	中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站	2021年3月24日
9	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
10	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
11	大成基金管理有限公司关于旗下部分基金增加腾安基金销售（深圳）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2日
12	大成睿鑫股票型证券投资基金第四季	中国证监会基金电子披	2021年1月22日

	度报告	露网站、规定报刊及本 公司网站	
--	-----	--------------------	--

## § 11 影响投资者决策的其他重要信息

### 11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

无。

### 11.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

## § 12 备查文件目录

### 12.1 备查文件目录

- 1、中国证监会批准设立大成睿鑫股票型证券投资基金的文件；
- 2、《大成睿鑫股票型证券投资基金基金合同》；
- 3、《大成睿鑫股票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、本报告期内在指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