

# 大成恒享混合型证券投资基金 2020 年中期报告

2020 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：北京银行股份有限公司

送出日期：2020 年 8 月 28 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。

基金托管人北京银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2020 年 8 月 27 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 2020 年 03 月 05 日（基金合同生效日）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 .....	6
<b>§ 4 管理人报告</b> .....	<b>8</b>
4.1 基金管理人及基金经理情况 .....	8
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明 .....	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 .....	13
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明 .....	14
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明 .....	14
<b>§ 5 托管人报告</b> .....	<b>14</b>
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明 .....	14
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 .....	14
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 .....	14
<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>39</b>
7.1 期末基金资产组合情况 .....	39
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 .....	41
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合 .....	42
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 .....	43

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 .....	43
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 .....	43
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 .....	43
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明 .....	43
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 .....	43
7.12 投资组合报告附注 .....	43
<b>§ 8 基金份额持有人信息 .....</b>	<b>45</b>
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....	45
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....	45
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 .....	45
<b>§ 9 开放式基金份额变动 .....</b>	<b>46</b>
<b>§ 10 重大事件揭示 .....</b>	<b>46</b>
10.1 基金份额持有人大会决议 .....	46
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 .....	46
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....	46
10.4 基金投资策略的改变 .....	46
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....	46
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 .....	46
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	47
10.8 其他重大事件 .....	47
<b>§ 11 影响投资者决策的其他重要信息 .....</b>	<b>49</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 .....	49
11.2 影响投资者决策的其他重要信息 .....	49
<b>§ 12 备查文件目录 .....</b>	<b>49</b>
12.1 备查文件目录 .....	49
12.2 存放地点 .....	49
12.3 查阅方式 .....	49

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	大成恒享混合型证券投资基金	
基金简称	大成恒享混合	
基金主代码	008869	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2020 年 3 月 5 日	
基金管理人	大成基金管理有限公司	
基金托管人	北京银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	596,030,342.49 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	大成恒享混合 A	大成恒享混合 C
下属分级基金的交易代码	008869	008870
报告期末下属分级基金的份额总额	496,241,008.43 份	99,789,334.06 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，力争为基金份额持有人创造长期稳健的投资回报。
投资策略	本基金的投资策略分为两方面：一方面体现在采取“自上而下”的方式对权益类、固定收益类等不同类别资产进行大类配置；另一方面体现在对单个投资品种的精选上。
业绩比较基准	沪深 300 指数收益率*15%+恒生指数收益率*5%+中证综合债券指数收益率*75%+金融机构人民币活期存款利率(税后)*5%
风险收益特征	本基金是混合型证券投资基金，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	北京银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	赵冰	刘晔
	联系电话	0755-83183388	010-66223586
	电子邮箱	office@dcfund.com.cn	liuyel@bankofbeijing.com.cn
客户服务电话		400885558	95526
传真		0755-83199588	010-66225309
注册地址		深圳市福田区深南大道 7088 号招商银行大厦 32 层	北京市西城区金融大街甲 17 号首层
办公地址		深圳市福田区深南大道 7088 号招商银行大厦 32 层	北京市西城区金融大街丙 17 号
邮政编码		518040	100033
法定代表人		吴庆斌	张东宁

## 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(2020年3月5日(基金合同生效日)-2020年6月30日)	
	大成恒享混合 A	大成恒享混合 C
本期已实现收益	5,134,470.91	944,318.88
本期利润	3,297,435.53	586,139.02
加权平均基金份额本期利润	0.0074	0.0054
本期加权平均净值利润率	0.74%	0.54%
本期基金份额净值增长率	0.70%	0.57%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2020年6月30日)	
期末可供分配利润	3,459,347.88	567,836.27
期末可供分配基金份额利润	0.0070	0.0057
期末基金资产净值	499,700,356.31	100,357,170.33
期末基金份额净值	1.0070	1.0057
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2020年6月30日)	
基金份额累计净值增长率	0.70%	0.57%

### 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

大成恒享混合 A

阶段	份额净值增	份额净值增	业绩比较基	业绩比较基	①-③	②-④
----	-------	-------	-------	-------	-----	-----

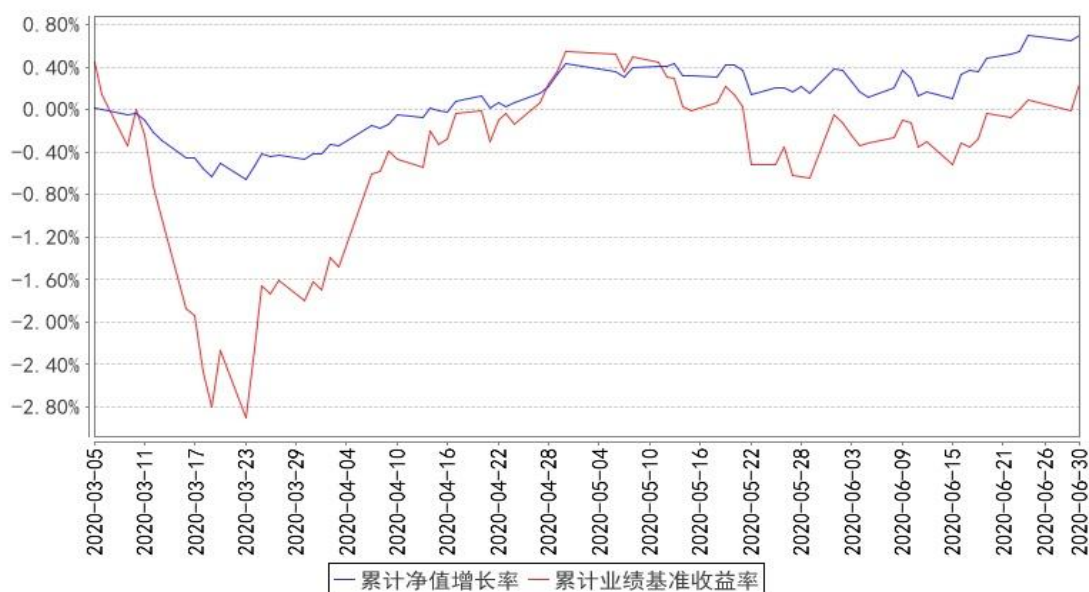
	长率①	长率标准差 ②	准收益率③	准收益率标 准差④		
过去一个月	0.54%	0.11%	0.89%	0.19%	-0.35%	-0.08%
过去三个月	1.12%	0.09%	1.89%	0.21%	-0.77%	-0.12%
自基金合同生效起至	0.70%	0.09%	0.24%	0.29%	0.46%	-0.20%

## 大成恒享混合 C

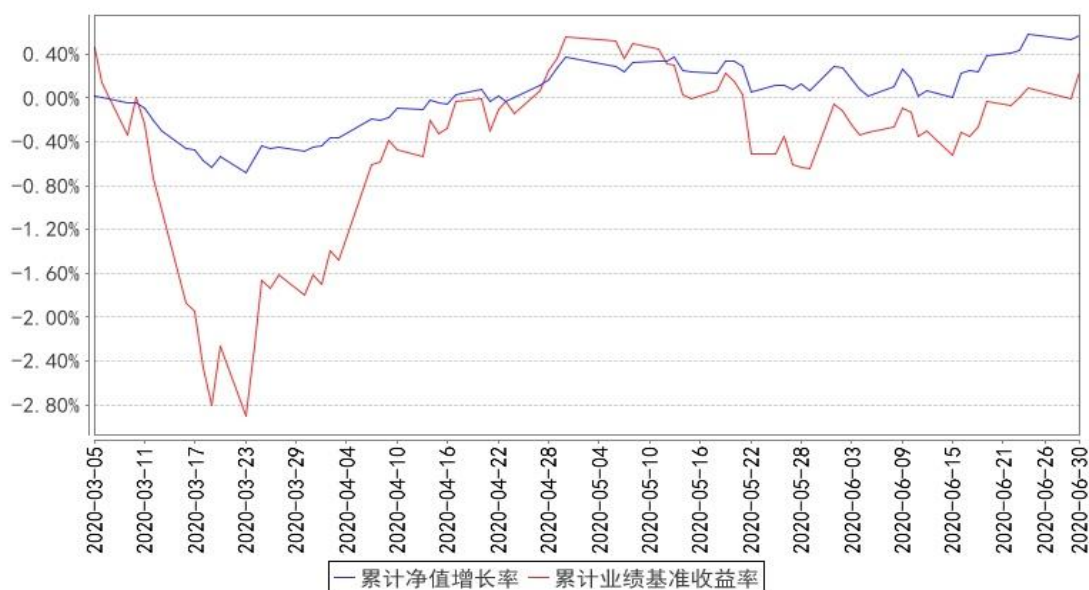
阶段	份额净值增 长率①	份额净值增 长率标准差 ②	业绩比较基 准收益率③	业绩比较基 准收益率标 准差④	①-③	②-④
过去一个月	0.50%	0.11%	0.89%	0.19%	-0.39%	-0.08%
过去三个月	1.02%	0.09%	1.89%	0.21%	-0.87%	-0.12%
自基金合同生效起至	0.57%	0.09%	0.24%	0.29%	0.33%	-0.20%

## 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

大成恒享混合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



大成恒享混合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 3 月 5 日，截至报告期末本基金合同生效未满一年。

2、本基金合同规定，基金管理人应当自基金合同生效之日起 6 个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的有关约定。截至报告期末，本基金处于建仓期。

## § 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，注册资本为 2 亿元人民币，注册地为深圳。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 2020 年 6 月 30 日，公司管理公募基金产品数量共 103 只。

#### 4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
王磊	本基金基	2020 年 3	-	16 年	经济学硕士。2003 年 5 月至 2012 年 10 月



	金经理	月 5 日			曾任证券时报社公司新闻部记者、世纪证券投资银行部业务董事、国信证券经济研究所分析师及资产管理总部专户投资经理、中银基金管理有限公司专户理财部投资经理及总监（主持工作）。2012 年 11 月加入大成基金管理有限公司，曾担任社保基金及机构投资部投资经理、固定收益总部基金经理、股票投资部基金经理，现任股票投资部总监助理。2013 年 6 月 7 日至 2015 年 7 月 15 日任大成强化收益债券型证券投资基金基金经理。2015 年 7 月 16 日到 2016 年 3 月 25 日任大成强化收益定期开放债券型证券投资基金基金经理。2013 年 7 月 17 日到 2016 年 3 月 25 日任大成景恒保本混合型证券投资基金基金经理。2013 年 11 月 9 日到 2016 年 3 月 25 日任大成可转债增强债券型证券投资基金基金经理。2014 年 6 月 26 到 2016 年 3 月 25 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 日起任大成财富管理 2020 混合型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。具有基金从业资格。国籍：中国
孙丹	本基金基金经理	2020 年 3 月 5 日	-	12 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，

				<p>曾担任固定收益总部信用策略及宏观利率研究员、大成景辉灵活配置混合型证券投资基金、大成景荣保本混合型证券投资基金、大成景兴信用债债券型证券投资基金、大成景秀灵活配置混合型证券投资基金、大成景源灵活配置混合型证券投资基金基金经理助理，现任固定收益总部总监助理。2018 年 3 月 12 日起任大成策略回报混合型证券投资基金、大成创新成长混合型证券投资基金（LOF）、大成积极成长混合型证券投资基金、大成精选增值混合型证券投资基金、大成景阳领先混合型证券投资基金、大成竞争优势混合型证券投资基金、大成蓝筹稳健证券投资基金、大成优选混合型证券投资基金（LOF）基金经理助理。2020 年 7 月 6 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。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 日起任大成惠裕定期开放纯债债券型证券投资基金基金经理。2017 年 6 月 2 日至 2018 年 11 月 19 日任大成景禄灵活配置混合型证券投资基金基金经理。2017 年 6 月 2 日至 2018 年 12 月 8 日任大成景源灵活配置混合型证券投资基金基金经理。2017 年 6 月 2 日至 2019 年 6 月 15 日任大成景秀灵活配置混合型证券投资基金。</p>
--	--	--	--	---

					<p>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 日起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。具有基金从业资格。国籍：中国</p>
--	--	--	--	--	---

注：1、任职日期、离任日期为本基金管理人作出决定之日。

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

#### 4.1.3 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理同时管理的产品情况

无。

#### 4.2 管理人对报告期内本基金运作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存在 1 笔同日反向交易，原因为组合流动性需要。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 1 笔同日反向交易，原因为组合流动性需要。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

上半年，疫情和政府的应对政策是影响国内外经济和资本市场的主导因素。一季度，受到疫情影响后，国内经济犹如按下暂停键，由于采取了有力的措施，疫情在较短时间内被控制。同时，政府也迅速出台了稳定经济和金融体系的措施。2 月中下旬以后，新冠疫情在全球蔓延，全球经济活动受到很大影响，全球资本市场大幅波动，风险资产下跌为主，利率明显下行。二季度以后，随着刺激政策的出台和不同程度的复工复产，全球风险偏好恢复。国内风险资产上涨，资金利率明显反弹，债券收益率也随之调整。

具体到市场方面，上半年权益市场上涨，但结构分化很明显，创业板指上涨 35.6%，沪深 300 指数仅微涨，这主要与宽松的货币政策、低迷的经济增长以及新旧经济前景不同有关。债券市场先涨后跌，剧烈震荡，6 月末的收益率比上年末仍有所下降。

操作上，上半年本组合将股票底仓控制在中低仓位以内，在控制波动性的基础上，精选个股增强收益。债券部分以信用债投资为主。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末大成恒享混合 A 的基金份额净值为 1.0070 元，本报告期基金份额净值增长率为 0.70%，同期业绩比较基准收益率为 0.24%；截至本报告期末大成恒享混合 C 的基金份额净值为 1.0057 元，本报告期基金份额净值增长率为 0.57%，同期业绩比较基准收益率为 0.24%。

### 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，内需逐渐改善，但高度将受限于疫情影响和较为温和的对冲政策。海外方面，美国的大规模刺激政策和始终高居不下的疫情形势给外需留下了较大的不确定性，对于国内基本面和资本市场都将有明显的外溢效应。

组合策略方面，组合将以票息收益为基础收益；对于权益资产的投资，随着估值的提升，需要注意控制波动。

我们非常感谢基金份额持有人的信任和支持，我们将继续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

在本报告期内，本基金托管人在托管大成恒享混合型证券投资基金过程中，严格遵守了《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，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

在本报告期内，本基金托管人按照相关法律法规、基金合同、托管协议和其他有关规定，对本基金的基金资产净值计算、基金费用开支以及利润分配等方面进行了认真的复核，对本基金的投资运作进行了监督，未发现基金管理人有关损害基金份额持有人利益的行为。

#### 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

在本报告期内，本托管人复核了本中期报告中的财务指标、净值表现、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，保证复核内容真实、准确和完整，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：大成恒享混合型证券投资基金

报告截止日：2020 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2020 年 6 月 30 日
<b>资产：</b>		
银行存款	6.4.7.1	6,113,942.10
结算备付金		3,071,122.57
存出保证金		102,750.19
交易性金融资产	6.4.7.2	540,079,535.92
其中：股票投资		80,219,421.12
基金投资		-

债券投资		459,860,114.80
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	52,451,346.23
应收证券清算款		-
应收利息	6.4.7.5	7,978,418.48
应收股利		-
应收申购款		11,915.84
递延所得税资产		-
其他资产	6.4.7.6	-
资产总计		609,809,031.33
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2020年6月30日</b>
<b>负 债:</b>		
短期借款		-
交易性金融负债		-
衍生金融负债	6.4.7.3	-
卖出回购金融资产款		-
应付证券清算款		2,996,474.37
应付赎回款		5,992,484.03
应付管理人报酬		456,583.55
应付托管费		91,316.71
应付销售服务费		31,369.14
应付交易费用	6.4.7.7	119,616.87
应交税费		32,616.30
应付利息		-
应付利润		-
递延所得税负债		-
其他负债	6.4.7.8	31,043.72
负债合计		9,751,504.69
<b>所有者权益:</b>		
实收基金	6.4.7.9	596,030,342.49
未分配利润	6.4.7.10	4,027,184.15
所有者权益合计		600,057,526.64
负债和所有者权益总计		609,809,031.33

注：报告截止日 2020 年 06 月 30 日，基金份额总额 596,030,342.49 份，其中大成恒享混合 A 基金份额总额为 496,241,008.43 份，基金份额净值 1.0070 元。大成恒享混合 C 基金份额总额为 99,789,334.06 份，基金份额净值 1.0057 元。

## 6.2 利润表

会计主体：大成恒享混合型证券投资基金

本报告期：2020 年 3 月 5 日（基金合同生效日）至 2020 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2020 年 3 月 5 日（基金合同生效日）至 2020 年 6 月 30 日
一、收入		6,393,742.72
1. 利息收入		3,882,868.10
其中：存款利息收入	6.4.7.11	324,753.64
债券利息收入		2,776,501.75
资产支持证券利息收入		-
买入返售金融资产收入		781,612.71
证券出借利息收入		-
其他利息收入		-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		4,573,156.88
其中：股票投资收益	6.4.7.12	3,686,090.48
基金投资收益	-	-
债券投资收益	6.4.7.13	-190,269.49
资产支持证券投资收益	6.4.7.13.5	-
贵金属投资收益	6.4.7.14	-
衍生工具收益	6.4.7.15	-
股利收益	6.4.7.16	1,077,335.89
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	-2,195,215.24
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	132,932.98
减：二、费用		2,510,168.17
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	1,776,983.80
2. 托管费	6.4.10.2.2	355,396.81
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	139,129.64
4. 交易费用	6.4.7.19	201,849.94
5. 利息支出		1,018.82
其中：卖出回购金融资产支出		1,018.82
6. 税金及附加		8,214.68
7. 其他费用	6.4.7.20	27,574.48
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		3,883,574.55
减：所得税费用		-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		3,883,574.55

### 6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：大成恒享混合型证券投资基金

本报告期：2020 年 3 月 5 日（基金合同生效日）至 2020 年 6 月 30 日

单位：人民币元



项目	本期 2020 年 3 月 5 日（基金合同生效日）至 2020 年 6 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益(基金净值)	561,340,576.17	-	561,340,576.17
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	3,883,574.55	3,883,574.55
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)	34,689,766.32	143,609.60	34,833,375.92
其中：1. 基金申购款	114,010,913.23	399,916.23	114,410,829.46
2. 基金赎回款	-79,321,146.91	-256,306.63	-79,577,453.54
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)	596,030,342.49	4,027,184.15	600,057,526.64

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

大成恒享混合型证券投资基金(以下简称“本基金”)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[2019]2894 号《关于准予大成恒享混合型证券投资基金注册的批复》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《大成恒享混合型证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式,存续期限不定,首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币 561,106,630.35 元,业经普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)普华永道中天验字(2020)第 0099 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《大成恒享混合型证券投资基金基金合同》于 2020 年 3 月 5 日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为 561,340,576.17 份基金份额,其中认购资金利息折合 233,945.82 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,基金托管人为北京银行股份有限公司。

根据《大成恒享混合型证券投资基金基金合同》和《大成恒享混合型证券投资基金招募说明书》的有关规定,本基金根据认购/申购费用、销售服务费收取方式的不同,将基金份额分为不同的类别。其中 A 类基金份额为在投资人认购/申购时收取前端认购/申购费用,且不从本类别基金资产净值中计提销售服务费的基金份额;C 类基金份额为从本类别基金资产净值中计提销售服务

费，且不收取认购/申购费用的基金份额。本基金 A 类基金份额和 C 类基金份额分别设置基金代码并分别计算基金份额净值。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《大成恒享混合型证券投资基金基金合同》的有关规定，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)、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、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。本基金可以根据有关法律法规的规定参与融资业务。本基金投资组合中，股票投资比例为基金资产的 0%-50%(港股通标的股票投资比例不超过本基金股票资产的 50%)；每个交易日日终在扣除股指期货合约和国债期货合约需缴纳的交易保证金后，应当保持不低于基金资产净值 5%的现金或到期日在一年以内的政府债券，其中，现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。本基金的业绩比较基准为：沪深 300 指数收益率×15%+恒生指数收益率×5%+中证综合债券指数收益率×75%+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于 2006 年 2 月 15 日及以后期间颁布的《企业会计准则—基本准则》、各项具体会计准则及相关规定(以下合称“企业会计准则”)、中国证监会颁布的《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>》、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《大成恒享混合型证券投资基金基金合同》和在财务报表附注 6.4.4 所列示的中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

本财务报表以持续经营为基础编制。

#### 6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2020 年 3 月 5 日(基金合同生效日)至 2020 年 6 月 30 日止期间的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 2020 年 6 月 30 日的财务状况以及 2020 年 3 月 5 日(基金合同生效日)至 2020 年 6 月 30 日止期间的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

## 6.4.4 重要会计政策和会计估计

### 6.4.4.1 会计年度

本基金会计年度为公历 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。本期财务报表的实际编制期间为 2020 年 3 月 5 日(基金合同生效日)至 2020 年 6 月 30 日。

### 6.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

### 6.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

#### (1) 金融资产的分类

金融资产于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、应收款项、可供出售金融资产及持有至到期投资。金融资产的分类取决于本基金对金融资产的持有意图和持有能力。本基金现无金融资产分类为可供出售金融资产及持有至到期投资。

本基金目前以交易目的持有的股票投资、债券投资和衍生工具分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。除衍生工具所产生的金融资产在资产负债表中以衍生金融资产列示外，以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在资产负债表中以交易性金融资产列示。

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、买入返售金融资产和其他各类应收款项等。应收款项是指在活跃市场中没有报价、回收金额固定或可确定的非衍生金融资产。

#### (2) 金融负债的分类

金融负债于初始确认时分类为：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。本基金目前暂无金融负债分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。本基金持有的其他金融负债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

金融资产或金融负债于本基金成为金融工具合同的一方时，按公允价值在资产负债表内确认。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；对于支付的价款中包含的债券起息日或上次除息日至购买日止的利息，单独确认为应收项目。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。

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，按照公允价值进行后续计量；对于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。

金融资产满足下列条件之一的，予以终止确认：(1) 收取该金融资产现金流量的合同权利终止；(2) 该金融资产已转移，且本基金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；或者(3) 该金融资产已转移，虽然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，但是放弃了对该金融资产控制。

金融资产终止确认时，其账面价值与收到的对价的差额，计入当期损益。

当金融负债的现时义务全部或部分已经解除时，终止确认该金融负债或义务已解除的部分。终止确认部分的账面价值与支付的对价之间的差额，计入当期损益。

#### 6.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

本基金持有的股票投资、债券投资和衍生工具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的市场交易价格确定公允价值；估值日无交易且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，按最近交易日的市场交易价格确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的市场交易价格不能真实反映公允价值的，应对市场交易价格进行调整，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) 当金融工具不存在活跃市场，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。采用估值技术时，优先使用可观察输入值，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，才可以使用不可观察输入值。

(3) 如经济环境发生重大变化或证券发行人发生影响金融工具价格的重大事件，应对估值进行调整并确定公允价值。

#### 6.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

本基金持有的资产和承担的负债基本为金融资产和金融负债。当本基金 1) 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；且 2) 交易双方准备按净额结算时，金融资产与金融负债按抵销后的净额在资产负债表中列示。

#### 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认列。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认列，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

股票投资在持有期间应取得的现金股利扣除由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额确认为投资收益。债券投资在持有期间应取得的按票面利率或者发行价计算的利息扣除在适用情况下由债券发行企业代扣代缴的个人所得税及由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为利息收入。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在持有期间的公允价值变动确认为公允价值变动损益；于处置时，其处置价格与初始确认金额之间的差额确认为投资收益，其中包括从公允价值变动损益结转的公允价值累计变动额。

应收款项在持有期间确认的利息收入按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

#### 6.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬、托管费和销售服务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

本基金同一类别的每一基金份额享有同等分配权。本基金收益以现金形式分配，但基金份额持有人可选择现金红利或将现金红利按分红除权日的基金份额净值自动转为基金份额进行再投资。若期末未分配利润中的未实现部分为正数，包括基金经营活动产生的未实现损益以及基金份额交易产生的未实现平准金等，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润中的已实现部分；若期末未分配利润的未实现部分为负数，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润，即已实现部分相抵未实现部分后的余额。

经宣告的拟分配基金收益于分红除权日从所有者权益转出。

#### 6.4.4.12 分部报告

本基金以内部组织结构、管理要求、内部报告制度为依据确定经营分部，以经营分部为基础确定报告分部并披露分部信息。经营分部是指本基金内同时满足下列条件的组成部分：(1) 该组成部分能够在日常活动中产生收入、发生费用；(2) 本基金的基金管理人能够定期评价该组成部分的经营成果，以决定向其配置资源、评价其业绩；(3) 本基金能够取得该组成部分的财务状况、经营成果和现金流量等有关会计信息。如果两个或多个经营分部具有相似的经济特征，并且满足一定条件的，则合并为一个经营分部。

本基金目前以一个单一的经营分部运作，不需要披露分部信息。

#### 6.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计

根据本基金的估值原则和中国证监会允许的基金行业估值实务操作，本基金确定以下类别股票投资和债券投资的公允价值时采用的估值方法及其关键假设如下：

(1) 对于证券交易所上市的股票和债券，若出现重大事项停牌或交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)等情况，本基金根据中国证监会公告[2017]13号《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》，根据具体情况采用《关于发布中基协(AMAC)基金行业股票估值指数的通知》提供的指数收益法、市盈率法、现金流量折现法等估值技术进行估值。

(2) 对于在锁定期内的非公开发行股票、首次公开发行股票时公司股东公开发售股份、通过大宗交易取得的带限售期的股票等流通受限股票，根据中国基金业协会中基协发[2017]6号《关于发布〈证券投资基金投资流通受限股票估值指引(试行)〉的通知》之附件《证券投资基金投资流通受限股票估值指引(试行)》(以下简称“指引”)，按估值日在证券交易所上市交易的同一股票的公允价值扣除中证指数有限公司根据指引所独立提供的该流通受限股票剩余限售期对应的流动性折扣后的价值进行估值。

(3) 对于在证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券、可交换债券和私募债券除外)及在银行间同业市场交易的固定收益品种，根据中国证监会公告[2017]13号《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》及《中国证券投资基金业协会估值核算工作小组关于2015年1季度固定收益品种的估值处理标准》采用估值技术确定公允价值。本基金持有的证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券、可交换债券和私募债券除外)，按照中证指数有限公司所独立提供的估值结果确定公允价值。本基金持有的银行间同业市场固定收益品种按照中债金融估值中心有限公司所独立提供的估值结果确定公允价值。

#### 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

本基金本报告期未发生会计政策变更。

##### 6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

##### 6.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

#### 6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通

知》、财税[2008]1号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2015]101号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2016]36号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、财税[2016]140号《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》、财税[2017]2号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017]56号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1) 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。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，暂适用简易计税方法，按照 3% 的征收率缴纳增值税。

对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，对国债、地方政府债以及金融同业往来利息收入亦免征增值税。资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务，以产生的利息及利息性质的收入为销售额。

(2) 对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，股票的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

(3) 对基金取得的企业债券利息收入，应由发行债券的企业在向基金支付利息时代扣代缴 20% 的个人所得税。对基金从上市公司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，暂减按 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。对基金持有的上市公司限售股，解禁后取得的股息、红利收入，按照上述规定计算纳税，持股时间自解禁日起计算；解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按 50% 计入应纳税所得额。上述所得统一适用 20% 的税率计征个人所得税。

(4) 基金卖出股票按 0.1% 的税率缴纳股票交易印花税，买入股票不征收股票交易印花税。

(5) 本基金的城市维护建设税、教育费附加和地方教育附加等税费按照实际缴纳增值税额的适用比例计算缴纳。

#### 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
	2020 年 6 月 30 日
活期存款	6,113,942.10
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	6,113,942.10

#### 6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末			
	2020 年 6 月 30 日			
	成本	公允价值	公允价值变动	
股票	79,208,222.91	80,219,421.12	1,011,198.21	
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	
债券	交易所市场	222,183,255.16	220,390,614.80	-1,792,640.36
	银行间市场	240,883,273.09	239,469,500.00	-1,413,773.09
	合计	463,066,528.25	459,860,114.80	-3,206,413.45
资产支持证券	-	-	-	
基金	-	-	-	
其他	-	-	-	
合计	542,274,751.16	540,079,535.92	-2,195,215.24	

#### 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	
	2020 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	52,451,346.23	-
合计	52,451,346.23	-

##### 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 2020年6月30日
应收活期存款利息	922.09
应收定期存款利息	-
应收其他存款利息	-
应收结算备付金利息	1,382.00
应收债券利息	7,967,073.83
应收资产支持证券利息	-
应收买入返售证券利息	8,994.36
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	46.20
合计	7,978,418.48

## 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 2020年6月30日
交易所市场应付交易费用	110,240.70
银行间市场应付交易费用	9,376.17
合计	119,616.87

## 6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2020年6月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	7,599.48
应付证券出借违约金	-
预提费用	23,444.24
合计	31,043.72

## 6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

大成恒享混合 A

项目	本期 2020年3月5日（基金合同生效日）至2020年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额

基金合同生效日	444,457,199.53	444,457,199.53
本期申购	96,874,869.19	96,874,869.19
本期赎回(以“-”号填列)	-45,091,060.29	-45,091,060.29
-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	496,241,008.43	496,241,008.43

## 大成恒享混合 C

项目	本期 2020年3月5日(基金合同生效日)至2020年6月30日	
	基金份额(份)	账面金额
基金合同生效日	116,883,376.64	116,883,376.64
本期申购	17,136,044.04	17,136,044.04
本期赎回(以“-”号填列)	-34,230,086.62	-34,230,086.62
-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	99,789,334.06	99,789,334.06

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

大成恒享混合 A			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
基金合同生效日	-	-	-
本期利润	5,134,470.91	-1,837,035.38	3,297,435.53
本期基金份额交易产生的变动数	357,611.98	-195,699.63	161,912.35
其中：基金申购款	611,480.90	-276,385.26	335,095.64
基金赎回款	-253,868.92	80,685.63	-173,183.29
本期已分配利润	-	-	-
本期末	5,492,082.89	-2,032,735.01	3,459,347.88
大成恒享混合 C			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
基金合同生效日	-	-	-
本期利润	944,318.88	-358,179.86	586,139.02
本期基金份额交易产生的变动数	31,985.28	-50,288.03	-18,302.75
其中：基金申购款	134,128.70	-69,308.11	64,820.59
基金赎回款	-102,143.42	19,020.08	-83,123.34
本期已分配利润	-	-	-

本期末	976,304.16	-408,467.89	567,836.27
-----	------------	-------------	------------

#### 6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期	
	2020年3月5日（基金合同生效日）至2020年6月30日	
活期存款利息收入		178,096.26
定期存款利息收入		-
其他存款利息收入		113,750.00
结算备付金利息收入		32,575.42
其他		331.96
合计		324,753.64

#### 6.4.7.12 股票投资收益

单位：人民币元

项目	本期	
	2020年3月5日（基金合同生效日）至2020年6月30日	
卖出股票成交总额		38,238,390.53
减：卖出股票成本总额		34,552,300.05
买卖股票差价收入		3,686,090.48

#### 6.4.7.13 债券投资收益

单位：人民币元

项目	本期	
	2020年3月5日（基金合同生效日）至2020年6月30日	
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额		23,973,595.39
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额		22,778,804.29
减：应收利息总额		1,385,060.59
买卖债券差价收入		-190,269.49

#### 6.4.7.14 贵金属投资收益

无。

#### 6.4.7.15 衍生工具收益

无。

#### 6.4.7.16 股利收益

单位：人民币元

项目	本期	
	2020年3月5日（基金合同生效日）至2020年6月30日	
股票投资产生的股利收益		1,077,335.89
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	1,077,335.89

#### 6.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2020年3月5日（基金合同生效日）至2020年6月30日
1. 交易性金融资产	-2,195,215.24
股票投资	1,011,198.21
债券投资	-3,206,413.45
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	-2,195,215.24

#### 6.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2020年3月5日（基金合同生效日）至2020年6月30日
基金赎回费收入	132,813.87
基金转换费收入	119.11
合计	132,932.98

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，其中不低于转出基金的赎回费的 25% 归入转出基金的基金资产。

#### 6.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2020年3月5日（基金合同生效日）至2020年6月30日
交易所市场交易费用	198,524.94
银行间市场交易费用	3,325.00
合计	201,849.94

#### 6.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期
	2020 年 3 月 5 日（基金合同生效日）至 2020 年 6 月 30 日
审计费用	23,444.24
信息披露费	-
证券出借违约金	-
银行划款手续费	3,730.24
其他	400.00
合计	27,574.48

#### 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

无。

##### 6.4.8.2 资产负债表日后事项

无。

#### 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
北京银行股份有限公司（“北京银行”）	基金托管人

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
	2020年3月5日（基金合同生效日）至2020年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	1,776,983.80
其中：支付销售机构的客户维护费	869,662.67

注：支付基金管理人大成基金的管理人报酬按前一日基金资产净值 1.00%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：

$$\text{日管理人报酬} = \text{前一日基金资产净值} \times 1.00\% / \text{当年天数}。$$

**6.4.10.2.2 基金托管费**

单位：人民币元

项目	本期
	2020年3月5日（基金合同生效日）至2020年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	355,396.81

注：支付基金托管人中国工商银行的托管费按前一日基金资产净值 0.20%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：

$$\text{日托管费} = \text{前一日基金资产净值} \times 0.20\% / \text{当年天数}。$$

**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	本期
	2020年3月5日（基金合同生效日）至2020年6月30日

方名称	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	大成恒享混合 A	大成恒享混合 C	合计
北京银行	-	137,397.57	137,397.57
大成基金	-	1,554.74	1,554.74
合计	-	138,952.31	138,952.31

注：支付基金销售机构的销售服务费按前一日 C 类基金资产净值 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：

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

#### 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

##### 6.4.10.4.1 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。

##### 6.4.10.4.2 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。

#### 6.4.10.5 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

份额单位：份

项目	本期 2020 年 3 月 5 日(基金合同生效 日)至 2020 年 6 月 30 日	本期 2020 年 3 月 5 日(基金合 同生效日)至 2020 年 6 月 30 日
	大成恒享混合 A	大成恒享混合 C
基金合同生效日(2020 年 3 月 5 日)持有的基金份额	-	-
报告期初持有的基金份额	-	-
报告期间申购/买入总份额	19,945,148.10	-

报告期间因拆分变动份额	-	-
减：报告期间赎回/卖出总份额	0.00	-
报告期末持有的基金份额	19,945,148.10	-
报告期末持有的基金份额 占基金总份额比例	3.3500%	-

注：基金管理人大成基金投资本基金适用的交易费率与本基金法律文件规定一致。

#### 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 2020年3月5日（基金合同生效日）至2020年6月30日	
	期末余额	当期利息收入
北京银行	6,113,942.10	178,096.26

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(2020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
688004	博汇科技	2020年6月5日	2020年12月14日	新股锁定	28.77	71.90	2,500	71,925.00	179,750.00	-
688027	国盾	2020年	2020年	新股未	36.18	36.18	2,830	102,389.40	102,389.40	-



	量子	6月30日	7月9日	上市						
688277	天智航	2020年6月24日	2020年7月7日	新股未上市	12.04	12.04	8,810	106,072.40	106,072.40	-
688377	迪威尔	2020年6月29日	2020年7月8日	新股未上市	16.42	16.42	7,894	129,619.48	129,619.48	-
688520	神州细胞	2020年6月11日	2020年12月22日	新股锁定	25.64	58.82	9,812	251,579.68	577,141.84	-
688528	秦川物联	2020年6月19日	2020年7月1日	新股未上市	11.33	11.33	8,337	94,458.21	94,458.21	-
688568	中科星图	2020年6月30日	2020年7月8日	新股未上市	16.21	16.21	11,020	178,634.20	178,634.20	-

#### 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 (单位:张)	期末成本总额	期末估值总额	备注
128112	歌尔转2	2020年6月17日	2020年7月13日	新债未上市	100.00	100.00	10	1,000.00	1,000.00	-

注：1、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。其中基金作为一般法人或战略投资者认购的新股，根据基金与上市公司所签订申购协议的规定，在新股上市后的约定期限内不能自由转让。

2、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。

#### 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

无。

#### 6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

无。

#### 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，力争为基金份额持有人创造长期稳健的投资回报。

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、拒绝支付到期本息等情况，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。本基金的银行存款存放在本基金的托管人北京银行，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 2020年6月30日
A-1	-
A-1 以下	-
未评级	71,208,923.20
合计	71,208,923.20

注：未评级债券为政策性金融债和超短期融资券。

#### 6.4.13.2.2 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 2020年6月30日
AAA	223,514,214.40
AAA 以下	155,080,977.20
未评级	10,056,000.00
合计	388,651,191.60

注：未评级债券为政策性金融债。

#### 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

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

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

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

##### 6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2020 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	6,113,942.10	-	-	-	6,113,942.10

结算备付金	3,071,122.57	-	-	-	3,071,122.57
存出保证金	102,750.19	-	-	-	102,750.19
交易性金融资产	111,461,114.80	348,398,000.00	1,000.00	80,219,421.12	540,079,535.92
买入返售金融资产	52,451,346.23	-	-	-	52,451,346.23
应收利息	-	-	-	7,978,418.48	7,978,418.48
应收申购款	-	-	-	11,915.84	11,915.84
资产总计	173,200,275.89	348,398,000.00	1,000.00	88,209,755.44	609,809,031.33
负债	-	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	5,992,484.03	5,992,484.03
应付管理人报酬	-	-	-	456,583.55	456,583.55
应付托管费	-	-	-	91,316.71	91,316.71
应付证券清算款	-	-	-	2,996,474.37	2,996,474.37
应付销售服务费	-	-	-	31,369.14	31,369.14
应付交易费用	-	-	-	119,616.87	119,616.87
应交税费	-	-	-	32,616.30	32,616.30
其他负债	-	-	-	31,043.72	31,043.72
负债总计	-	-	-	9,751,504.69	9,751,504.69
利率敏感度缺口	173,200,275.89	348,398,000.00	1,000.00	78,458,250.75	600,057,526.64

#### 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（2020年6月30日）
分析	市场利率上升 25 个基点	-1,400,000.00
	市场利率下降 25 个基点	1,408,100.00

#### 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。

#### 6.4.13.4.3 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股票和债券，所面临的其他价格风险来源于单个证券发行主体自身经营情况或特殊事项的影响，也可能来源于证券市场整体波动的影响。

本基金的基金管理人在构建和管理投资组合的过程中，采用“自上而下”的策略，通过对宏

观经济情况及政策的分析，结合证券市场运行情况，做出资产配置及组合构建的决定；通过对单个证券的定性分析及定量分析，选择符合基金合同约定范围的投资品种进行投资。本基金的基金管理人定期结合宏观及微观环境的变化，对投资策略、资产配置、投资组合进行修正，来主动应对可能发生的市场价格风险。

本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险。本基金投资于股票的比例为基金资产的 0%-50% (港股通标的股票投资比例不超过本基金股票资产的 50%)。每个交易日日终扣除股指期货合约和国债期货合约需缴纳的交易保证金后，应当保持不低于基金资产净值 5% 的现金或到期日在一年以内的政府债券，其中，现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。此外，本基金的基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控，定期运用多种定量方法对基金进行风险度量，包括 VaR (Value at Risk) 指标等来测试本基金面临的潜在价格风险，及时可靠地对风险进行跟踪和控制。

#### 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 2020 年 6 月 30 日	
	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
交易性金融资产—股票投资	80,219,421.12	13.37
交易性金融资产—基金投资	-	-
交易性金融资产—债券投资	-	-
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	80,219,421.12	13.37

#### 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 (2020 年 6 月 30 日)	
分析	业绩比较基准上升 5%	2,520,000.00
	业绩比较基准下降 5%	-2,520,000.00

#### 6.4.13.4.4 采用风险价值法管理风险

无。

## 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	80,219,421.12	13.15
	其中：股票	80,219,421.12	13.15
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	459,860,114.80	75.41
	其中：债券	459,860,114.80	75.41
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	52,451,346.23	8.60
	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	9,185,064.67	1.51
8	其他各项资产	8,093,084.51	1.33
9	合计	609,809,031.33	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	-	-
B	采矿业	13,651,129.00	2.27
C	制造业	24,640,311.33	4.11
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	5,548,928.32	0.92
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	6,496,170.00	1.08
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	358,384.20	0.06
J	金融业	22,267,632.00	3.71
K	房地产业	6,030,498.00	1.00
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-

N	水利、环境和公共设施管理业	218.27	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	1,226,150.00	0.20
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	80,219,421.12	13.37

### 7.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

无。

### 7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	000002	万科A	230,700	6,030,498.00	1.00
2	600900	长江电力	292,300	5,536,162.00	0.92
3	601939	建设银行	788,200	4,973,542.00	0.83
4	601288	农业银行	1,466,200	4,955,756.00	0.83
5	601398	工商银行	976,500	4,862,970.00	0.81
6	600377	宁沪高速	493,000	4,836,330.00	0.81
7	601225	陕西煤业	663,400	4,783,114.00	0.80
8	601088	中国神华	313,000	4,494,680.00	0.75
9	600028	中国石化	1,118,500	4,373,335.00	0.73
10	600438	通威股份	215,100	3,738,438.00	0.62
11	600887	伊利股份	113,600	3,536,368.00	0.59
12	600036	招商银行	97,400	3,284,328.00	0.55
13	601318	中国平安	41,800	2,984,520.00	0.50
14	600519	贵州茅台	1,400	2,048,032.00	0.34
15	603160	汇顶科技	8,300	1,850,070.00	0.31
16	002292	奥飞娱乐	214,600	1,806,932.00	0.30
17	688169	石头科技	4,784	1,803,089.60	0.30
18	688036	传音控股	25,079	1,780,609.00	0.30
19	600233	圆通速递	114,000	1,659,840.00	0.28
20	300003	乐普医疗	44,900	1,639,748.00	0.27
21	002007	华兰生物	27,100	1,357,981.00	0.23
22	603882	金域医学	13,700	1,226,150.00	0.20
23	601988	中国银行	346,700	1,206,516.00	0.20
24	300630	普利制药	15,900	1,175,805.00	0.20
25	002643	万润股份	68,200	1,170,994.00	0.20
26	300769	德方纳米	11,620	1,131,555.60	0.19



27	688520	神州细胞	9,812	577,141.84	0.10
28	600885	宏发股份	11,900	477,428.00	0.08
29	688004	博汇科技	2,500	179,750.00	0.03
30	688568	中科星图	11,020	178,634.20	0.03
31	688377	迪威尔	7,894	129,619.48	0.02
32	603087	甘李药业	1,076	107,922.80	0.02
33	688277	天智航	8,810	106,072.40	0.02
34	688027	国盾量子	2,830	102,389.40	0.02
35	688528	秦川物联	8,337	94,458.21	0.02
36	600956	新天绿能	2,533	12,766.32	0.00
37	000651	格力电器	100	5,657.00	0.00
38	601827	三峰环境	23	218.27	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末基金资产净值 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	占期末基金资产净值比例(%)
1	000002	万科A	5,999,724.00	1.00
2	601988	中国银行	4,999,892.00	0.83
3	600900	长江电力	4,999,820.00	0.83
4	601939	建设银行	4,999,770.00	0.83
5	601288	农业银行	4,999,742.00	0.83
6	600028	中国石化	4,999,695.00	0.83
7	601398	工商银行	4,999,680.00	0.83
8	601088	中国神华	4,999,207.00	0.83
9	601225	陕西煤业	4,998,875.00	0.83
10	600377	宁沪高速	4,978,065.00	0.83
11	600438	通威股份	3,391,786.00	0.57
12	600036	招商银行	3,364,577.00	0.56
13	600887	伊利股份	3,364,095.00	0.56
14	000333	美的集团	3,358,068.00	0.56
15	601318	中国平安	3,354,178.00	0.56
16	601211	国泰君安	2,657,295.00	0.44
17	603160	汇顶科技	1,946,648.00	0.32
18	688085	三友医疗	1,870,854.98	0.31
19	688169	石头科技	1,797,944.00	0.30
20	002292	奥飞娱乐	1,742,001.00	0.29

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末基金资产净值 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	占期末基金资产净值比例(%)
----	------	------	----------	----------------

1	601988	中国银行	3,724,018.00	0.62
2	000333	美的集团	3,551,104.00	0.59
3	688085	三友医疗	2,770,072.60	0.46
4	601211	国泰君安	2,710,859.00	0.45
5	000513	丽珠集团	1,738,176.00	0.29
6	600745	闻泰科技	1,674,005.00	0.28
7	002624	完美世界	1,671,084.00	0.28
8	000651	格力电器	1,634,304.00	0.27
9	000710	贝瑞基因	1,480,080.00	0.25
10	600031	三一重工	1,346,431.00	0.22
11	002460	赣锋锂业	1,346,211.00	0.22
12	002027	分众传媒	1,313,354.00	0.22
13	002938	鹏鼎控股	1,263,678.00	0.21
14	603259	药明康德	1,258,499.20	0.21
15	600585	海螺水泥	1,178,568.33	0.20
16	002157	正邦科技	1,134,973.00	0.19
17	600612	老凤祥	1,100,190.35	0.18
18	601888	中国中免	1,055,686.00	0.18
19	002415	海康威视	995,404.00	0.17
20	688106	金宏气体	940,104.62	0.16

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	113,760,522.96
卖出股票收入（成交）总额	38,238,390.53

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	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	31,219,923.20	5.20
	其中：政策性金融债	31,219,923.20	5.20
4	企业债券	292,564,691.60	48.76
5	企业短期融资券	50,045,000.00	8.34
6	中期票据	86,029,500.00	14.34
7	可转债（可交换债）	1,000.00	0.00
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-

10	合计	459,860,114.80	76.64
----	----	----------------	-------

#### 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	139048	PR 白国资	400,000	24,284,000.00	4.05
2	1680089	16 下城债	400,000	24,244,000.00	4.04
3	1680341	16 榕经开债	300,000	24,102,000.00	4.02
4	101900035	19 抚州投资 MTN001	200,000	20,480,000.00	3.41
5	101901692	19 广安控股 MTN001	200,000	20,260,000.00	3.38

#### 7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

无。

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

无。

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

无。

#### 7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

无。

#### 7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

无。

#### 7.12 投资组合报告附注

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

1、本基金投资的前十名证券之一工商银行（601398.SH）的发行主体中国工商银行股份有限公司于 2020 年 4 月 20 日因监管标准化数据（EAST）系统数据质量及数据报送存在违法违规行为等，受到中国银行保险监督管理委员会处罚（银保监罚决字〔2020〕7 号）。本基金认为，对工商银行的处罚不会对其投资价值构成实质性负面影响。

2、本基金投资的前十名证券之一建设银行（601939.SH）的发行主体中国建设银行股份有限公司于 2019 年 12 月 27 日因用于风险缓释的保证金管理存在漏洞等，受到中国银行保险监督管理委员会处罚（银保监罚决字〔2019〕22 号），于 2020 年 4 月 20 日因监管标准化数据（EAST）系统数据质量及数据报送存在违法违规行为，受到中国银行保险监督管理委员会处罚（银保监罚决字〔2020〕8 号）。本基金认为，对建设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农业银行（601288.SH）的发行主体中国农业银行股份有限公司于 2020 年 3 月 9 日因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〕3 号），于 2020 年 4 月 22 日因“两会一层”境外机构管理履职不到位等，受到中国银行保险监督管理委员会处罚（银保监罚决字〔2020〕11 号），因监管标准化数据（EAST）系统数据质量及数据报送存在违法违规行为，受到中国银行保险监督管理委员会处罚（银保监罚决字〔2020〕12 号）。本基金认为，对农业银行的处罚不会对其投资价值构成实质性负面影响。

#### 7.12.2 基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库

本基金投资的前十名股票未超出基金合同规定的备选股票库。

#### 7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	102,750.19
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	7,978,418.48
5	应收申购款	11,915.84
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	8,093,084.51

#### 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 (%)
大成恒享混合 A	2,782	178,375.63	92,676,439.63	18.68	403,564,568.80	81.32
大成恒享混合 C	775	128,760.43	16,935,644.55	16.97	82,853,689.51	83.03
合计	3,557	167,565.46	109,612,084.18	18.39	486,418,258.31	81.61

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	大成恒享混合 A	159,542.32	0.0322
	大成恒享混合 C	0.00	0.0000
	合计	159,542.32	0.0268

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	大成恒享混合 A	0~10
	大成恒享混合 C	0
	合计	0~10
本基金基金经理持有本开放式基金	大成恒享混合 A	0
	大成恒享混合 C	0
	合计	0

## § 9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	大成恒享混合 A	大成恒享混合 C
基金合同生效日（2020 年 3 月 5 日）基金份额总额	444,457,199.53	116,883,376.64
基金合同生效日起至报告期期末基金总申购份额	96,874,869.19	17,136,044.04
减：基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回份额	45,091,060.29	34,230,086.62
基金合同生效日起至报告期期末基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-	-
本报告期期末基金份额总额	496,241,008.43	99,789,334.06

## § 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

无。

二、基金托管人的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

无。

### 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普华永道中天会计师事务所（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	
国信证券	1	102,438,395.35	68.31%	93,354.39	68.31%	-
招商证券	1	47,513,914.48	31.69%	43,305.91	31.69%	-

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

本报告期内本基金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：国信证券、招商证券。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
国信证券	209,644,034.40	87.31%	4,298,700,000.00	89.57%	-	-
招商证券	30,468,749.34	12.69%	500,324,000.00	10.43%	-	-

## 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	关于大成恒享混合型证券投资基金 A、C 类份额增加北京植信基金销售有限公司为销售机构的公告	证券时报、中国证监会基金电子披露网站及本公司网站	2020 年 5 月 13 日

2	大成恒享混合型证券投资基金开放日常申购、赎回、转换和定期定额投资业务的公告	证券时报、中国证监会基金电子披露网站及本公司网站	2020 年 4 月 28 日
3	大成基金管理有限公司关于终止泰诚财富基金销售（大连）有限公司办理相关销售业务的公告	证券时报、中国证监会基金电子披露网站及本公司网站	2020 年 4 月 25 日
4	大成基金管理有限公司关于延迟披露旗下公募基金 2019 年年度报告的公告	证券时报、中国证监会基金电子披露网站及本公司网站	2020 年 3 月 25 日
5	大成基金管理有限公司关于注销南京分公司的公告	证券时报、中国证监会基金电子披露网站及本公司网站	2020 年 3 月 21 日
6	大成基金管理有限公司关于大成恒享混合型证券投资基金基金合同生效公告	证券时报、中国证监会基金电子披露网站及本公司网站	2020 年 3 月 6 日
7	大成基金管理有限公司关于注销青岛分公司的公告	证券时报、中国证监会基金电子披露网站及本公司网站	2020 年 2 月 29 日
8	大成基金管理有限公司关于 APP 交易平台汇款交易费率优惠的公告	证券时报、中国证监会基金电子披露网站及本公司网站	2020 年 2 月 26 日
9	关于大成恒享混合型证券投资基金 A、C 类份额增加上海浦东发展银行股份有限公司为销售机构的公告	证券时报、中国证监会基金电子披露网站及本公司网站	2020 年 2 月 17 日
10	大成基金管理有限公司关于大成恒享混合型证券投资基金调整募集期限的公告	证券时报、中国证监会基金电子披露网站及本公司网站	2020 年 2 月 12 日
11	关于大成恒享混合型证券投资基金 A、C 类份额增加北京农村商业银行股份有限公司为销售机构的公告	证券时报、中国证监会基金电子披露网站及本公司网站	2020 年 2 月 7 日
12	大成基金管理有限公司关于 2020 年春节假期延长期间调整公司公募基金开放时间等相关事宜的公告	证券时报、中国证监会基金电子披露网站及本公司网站	2020 年 1 月 30 日
13	大成恒享混合型证券投资基金基金合同及摘要	证券时报、中国证监会基金电子披露网站及本公司网站	2020 年 1 月 17 日
14	大成恒享混合型证券投资基金托管协议	证券时报、中国证监会基金电子披露网站及本公司网站	2020 年 1 月 17 日
15	大成恒享混合型证券投资基金招募说明书	证券时报、中国证监会基金电子披露网站及本公司网站	2020 年 1 月 17 日
16	大成恒享混合型证券投资基金基金合同	证券时报、中国证监会基金电子披露网站及本	2020 年 1 月 17 日



		公司网站	
17	大成恒享混合型证券投资基金份额发售公告	证券时报、中国证监会基金电子披露网站及本公司网站	2020 年 1 月 17 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恒享混合型证券投资基金的文件；
- 2、《大成恒享混合型证券投资基金基金合同》；
- 3、《大成恒享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

2020 年 8 月 28 日