

# 大成睿享混合型证券投资基金 2020 年年度报告

2020 年 12 月 31 日

基金管理人：大成基金管理有限公司

基金托管人：中国农业银行股份有限公司

送出日期：2021 年 3 月 30 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。本年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人中国农业银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2021 年 03 月 29 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。

本报告财务资料已经审计。安永华明会计师事务所(特殊普通合伙)为本基金出具了无保留意见的审计报告，请投资者注意阅读。

本报告期自 2020 年 01 月 01 日起至 12 月 31 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、基金净值表现及利润分配情况</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
3.3 过去三年基金的利润分配情况 .....	10
<b>§ 4 管理人报告</b> .....	<b>11</b>
4.1 基金管理人及基金经理情况 .....	11
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明 .....	14
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明 .....	14
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 .....	15
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望 .....	16
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况 .....	16
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明 .....	17
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明 .....	17
4.9 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 .....	18
<b>§ 5 托管人报告</b> .....	<b>18</b>
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明 .....	18
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 .....	18
5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见 .....	18
<b>§ 6 审计报告</b> .....	<b>18</b>
<b>§ 7 年度财务报表</b> .....	<b>20</b>
7.1 资产负债表 .....	20
7.2 利润表 .....	21
7.3 所有者权益（基金净值）变动表 .....	22
7.4 报表附注 .....	24
<b>§ 8 投资组合报告</b> .....	<b>53</b>
8.1 期末基金资产组合情况 .....	53
8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合 .....	53

8.3 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 .....	54
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动 .....	60
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合 .....	61
8.6 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 .....	61
8.7 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 .....	62
8.8 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 .....	62
8.9 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 .....	62
8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明 .....	62
8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 .....	62
8.12 投资组合报告附注 .....	62
<b>§ 9 基金份额持有人信息 .....</b>	<b>63</b>
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....	63
9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....	64
9.3 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 .....	64
9.4 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理本人及其直系亲属持有本人管理的产品情况 .....	64
<b>§ 10 开放式基金份额变动 .....</b>	<b>64</b>
<b>§ 11 重大事件揭示 .....</b>	<b>65</b>
11.1 基金份额持有人大会决议 .....	65
11.2 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 .....	65
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....	65
11.4 基金投资策略的改变 .....	65
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....	65
11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况 .....	66
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	66
11.8 其他重大事件 .....	68
<b>§ 12 影响投资者决策的其他重要信息 .....</b>	<b>70</b>
12.1 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 .....	70
12.2 影响投资者决策的其他重要信息 .....	70
<b>§ 13 备查文件目录 .....</b>	<b>70</b>
13.1 备查文件目录 .....	70
13.2 存放地点 .....	71
13.3 查阅方式 .....	71

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	大成睿享混合型证券投资基金	
基金简称	大成睿享混合	
基金主代码	008269	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2019 年 12 月 30 日	
基金管理人	大成基金管理有限公司	
基金托管人	中国农业银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	860,584,358.10 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	大成睿享混合 A	大成睿享混合 C
下属分级基金的交易代码	008269	008270
报告期末下属分级基金的份额总额	810,499,771.80 份	50,084,586.30 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。 （一）大类资产配置策略 本基金将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发展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。 （二）股票投资策略 本基金将结合定性与定量分析，充分发挥基金管理人研究团队和投资团队“自下而上”的主动选股能力，基金经理在对行业发展进行研究的基础上，通过定性与定量相结合的分析方法，选择在行业内具有发展潜力的公司进行投资。
业绩比较基准	沪深 300 指数收益率*60%+中证综合债券指数收益率*30%+恒生指数收益率*10%
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。

### 2.3 基金管理人和基金托管人

项目	基金管理人	基金托管人
名称	大成基金管理有限公司	中国农业银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	赵冰
	联系电话	0755-83183388
	电子邮箱	office@dcfund.com.cn
		秦一楠
		010-66060069
		tgxxpl@abchina.com

客户服务电话	4008885558	95599
传真	0755-83199588	010-68121816
注册地址	深圳市福田区深南大道 7088 号招商银行大厦 32 层	北京市东城区建国门内大街 69 号
办公地址	深圳市福田区深南大道 7088 号招商银行大厦 32 层	北京市西城区复兴门内大街 28 号凯晨世贸中心东座 F9
邮政编码	518040	100031
法定代表人	吴庆斌	周慕冰

注：中国农业银行股份有限公司法定代表人已于 2021 年 2 月 9 日变更为谷澍。

## 2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《中国证券报》
登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	www.dcfund.com.cn
基金年度报告备置地点	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
会计师事务所	安永华明会计师事务所(特殊普通合伙)	北京市东城区东长安街 1 号东方广场安永大楼 17 层 01-12 室
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、基金净值表现及利润分配情况

### 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	2020 年		2019 年 12 月 30 日(基金合同生效日)-2019 年 12 月 31 日	
	大成睿享混合 A	大成睿享混合 C	大成睿享混合 A	大成睿享混合 C
本期已实现收益	338,467,216.29	14,355,539.32	182,905.25	7,264.34
本期利润	392,147,689.67	14,903,286.54	143,038.90	4,978.70
加权平均基金份额本期利润	0.1339	0.1093	0.0000	0.0000
本期加权平均净值利	13.19%	10.74%	0.00%	0.00%

润率				
本期基金份额净值增长率	15.45%	14.98%	0.00%	0.00%
3.1.2 期末数据和指标	2020 年末		2019 年末	
期末可供分配利润	125,248,335.35	7,505,168.37	143,038.90	4,978.70
期末可供分配基金份额利润	0.1545	0.1498	0.0000	0.0000
期末基金资产净值	935,748,107.15	57,589,754.67	5,128,093,456.11	294,003,862.55
期末基金份额净值	1.1545	1.1498	1.0000	1.0000
3.1.3 累计期末指标	2020 年末		2019 年末	
基金份额累计净值增长率	15.45%	14.98%	0.00%	0.00%

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

大成睿享混合 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
过去三个月	5.68%	0.97%	10.06%	0.65%	-4.38%	0.32%
过去六个月	13.81%	1.17%	16.21%	0.87%	-2.40%	0.30%
过去一年	15.45%	0.96%	16.91%	0.96%	-1.46%	0.00%
自基金合同生效起至今	15.45%	0.96%	18.22%	0.96%	-2.77%	0.00%

## 大成睿享混合 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
过去三个月	5.57%	0.97%	10.06%	0.65%	-4.49%	0.32%
过去六个月	13.58%	1.17%	16.21%	0.87%	-2.63%	0.30%
过去一年	14.98%	0.96%	16.91%	0.96%	-1.93%	0.00%
自基金合同生效起至今	14.98%	0.96%	18.22%	0.96%	-3.24%	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



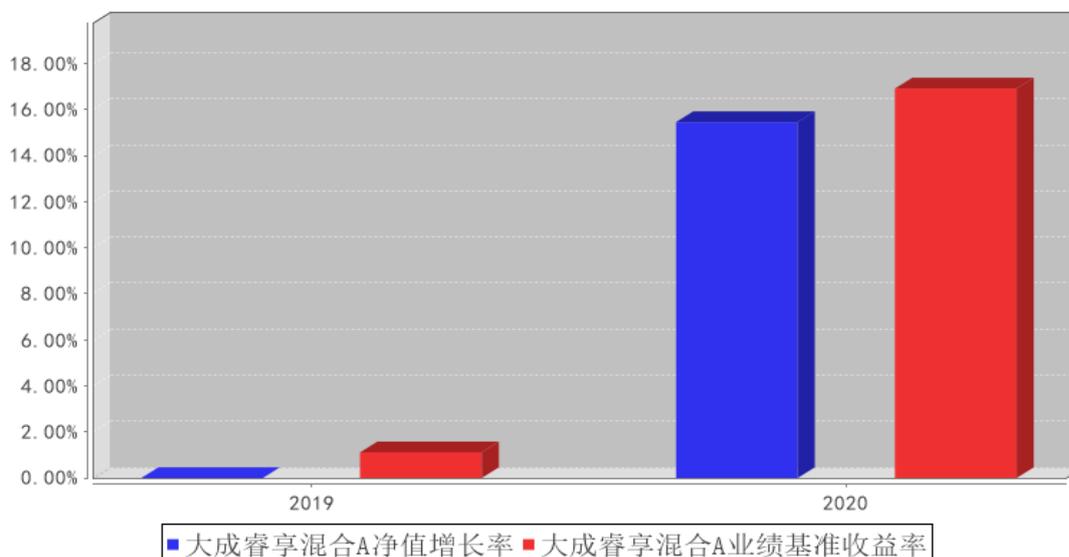
大成睿享混合C累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



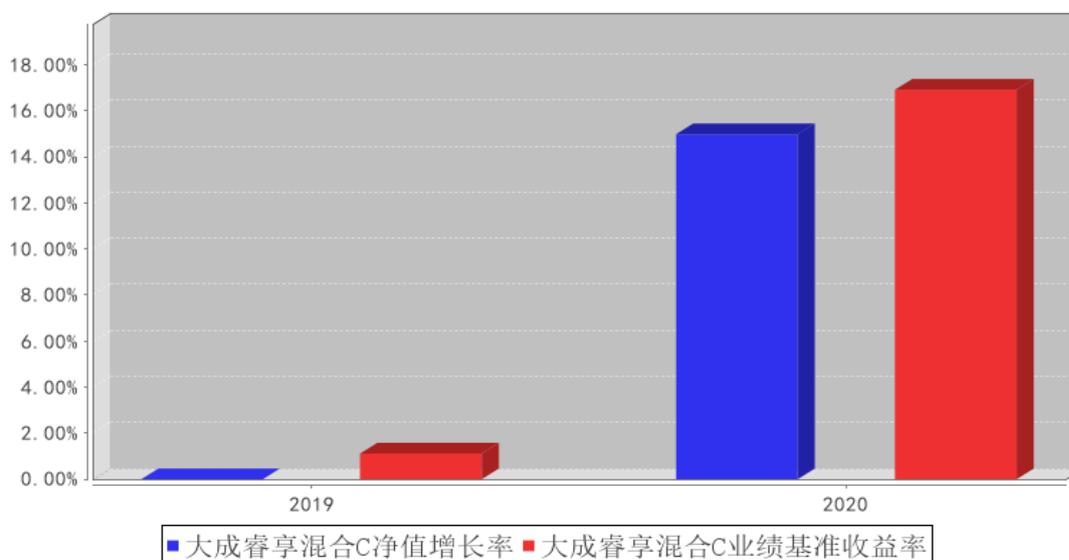
注：本基金合同规定，基金管理人应当自基金合同生效之日起六个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的约定。建仓期结束时，本基金的投资组合比例符合基金合同的约定。

### 3.2.3 自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

大成睿享混合A基金每年净值增长率与同期业绩比较基准收益率的对比图



大成睿享混合C基金每年净值增长率与同期业绩比较基准收益率的对比图



注：合同生效当年按实际存续期计算，不按整个自然年度进行折算。

### 3.3 过去三年基金的利润分配情况

无。

## § 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%)。公司业务资质齐全，是全国同时具有境内、境外社保基金管理人资格和基本养老保险基金管理人资格的四家基金公司之一，全面涵盖公募基金、机构投资、海外投资、财富管理、养老金管理、私募股权投资等业务，旗下大成国际资产管理公司具备 QFII、RQFII 以及 QFLP 等资格。

历经 21 年的发展，大成基金形成了以长期投资能力为核心竞争优势，打造了一支具有良好职业素养和丰富经验的资产管理队伍。目前已形成权益、固定收益、量化投资、商品期货、境外投资、大类资产配置等六大投资团队，全面覆盖各类投资领域。截至 2020 年 12 月 31 日，公司管理公募基金产品数量共 115 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		
徐彦	本基金基金经理，公司首席权益投资官	2019 年 12 月 30 日	-	14 年	管理学硕士。2006 年 9 月至 2007 年 7 月任职于中国东方资产管理公司。2007 年 7 月至 2018 年 9 月任职于大成基金管理有限公司，先后担任研究员、研究主管，2012 年 10 月起历任大成策略回报、大成竞争优势、大成高新技术和大成景阳领先混合型证券投资基金基金经理。2018 年 10 月至 2019 年 7 月任正心谷创新资本研究团队负责人。2019 年 8 月至 2021 年 2 月任大成基金管理有限公司股票投资部总监。2021 年 2 月任公司首席权益投资官。2019 年 12 月 30 日起任大成睿享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基金经理。2020 年 3 月 20 日起任大成策略回报混合型证券投资基金基金经理。2020 年 7 月 16 日起任大成创业板两年定期开放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	本基金基金经理助理	2020 年 11 月 6 日	-	12 年	<p>经济学硕士。2008 年至 2012 年任景顺长城产品开发部产品经理。2012 年至 2014 年任华夏基金机构债券投资部研究员。2014 年 5 月加入大成基金管理有限公司，曾担任固定收益总部信用策略及宏观利率研究员、大成景辉灵活配置混合型证券投资基金、大成景荣保本混合型证券投资基金、大成景兴信用债债券型证券投资基金、大成景秀灵活配置混合型证券投资基金、大成景源灵活配置混合型证券投资基金基金经理助理，现任固定收益总部总监助理。2018 年 3 月 12 日起任大成策略回报混合型证券投资基金、大成创新成长混合型证券投资基金 (LOF)、大成积极成长混合型证券投资基金、大成精选增值混合型证券投资基金、大成景阳领先混合型证券投资基金、大成竞争优势混合型证券投资基金、大成蓝筹稳健证券投资基金、大成优选混合型证券投资基金 (LOF) 基金经理助理。2020 年 7 月 1 日起任大成价值增长证券投资基金、大成多策略灵活配置混合型证券投资基金 (LOF)、大成一带一路灵活配置混合型证券投资基金、大成内需增长混合型证券投资基金、大成睿景灵活配置混合型证券投资基金、大成盛世精选灵活配置混合型证券投资基金、大成国企改革灵活配置混合型证券投资基金、大成行业轮动混合型证券投资基金、大成灵活配置混合型证券投资基金、大成产业升级股票型证券投资基金 (LOF)、大成健康产业混合型证券投资基金、大成正向回报灵活配置混合型证券投资基金、大成国家安全主题灵活配置混合型证券投资基金、大成新锐产业混合型证券投资基金、大成消费主题混合型证券投资基金基金经理助理。2020 年 11 月 6 日起任大成科技消费股票型证券投资基金、大成科创主题 3 年封闭运作灵活配置混合型证券投资基金、大成中小盘混合型证券投资基金 (LOF)、大成睿享混合型证券投资基金、大成行业先锋混合型证券投资基金基金经理助理。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</p>
----	-----------	-----------------	---	------	---

				<p>证券投资基金（原大成景荣保本混合型证券投资基金转型）基金经理。2017年5月31日至2020年10月20日任大成惠裕定期开放纯债债券型证券投资基金基金经理。2017年6月2日至2018年11月19日任大成景禄灵活配置混合型证券投资基金基金经理。2017年6月2日至2018年12月8日任大成景源灵活配置混合型证券投资基金基金经理。2017年6月2日至2019年6月15日任大成景秀灵活配置混合型证券投资基金。2017年6月6日至2019年9月29日任大成惠明定期开放纯债债券型证券投资基金基金经理。2018年3月14日至2018年11月30日任大成景辉灵活配置混合型证券投资基金基金经理。2018年3月14日至2018年11月30日任大成景沛灵活配置混合型证券投资基金基金经理。2018年3月14日至2018年7月20日任大成景裕灵活配置混合型证券投资基金基金经理。2018年3月14日起任大成财富管理 2020 生命周期证券投资基金基金经理。2019年7月31日至2020年5月23日任大成景丰债券型证券投资基金（LOF）基金经理。2020年2月27日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。2020年8月21日起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。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

#### 4.1.4 基金经理薪酬机制

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 公平交易制度和控制方法

根据《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》的规定，公司制订了《大成基金管理有限公司公平交易制度》、《大成基金管理有限公司异常交易监控与报告制度》。公司旗下投资组合严格按照制度的规定，参与股票、债券的一级市场申购、二级市场交易等投资管理活动，内容包括授权、研究分析、投资决策、交易执行、业绩评估等与投资活动相关的各个环节。研究部负责提供投资研究支持，投资部门负责投资决策，交易管理部负责实施交易并实时监控，监察稽核部负责事前监督、事中检查和事后稽核，风险管理部负责对交易情况进行合理性分析，通过多部门的协作互控，保证了公平交易的可操作、可稽核和可持续。

#### 4.3.2 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。

##### 4.3.2.1 增加执行的基金经理公平交易制度执行情况及公平交易管理情况

无。

#### 4.3.3 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 7 笔同日反向交易，原因为流动性需要或合规比例调整。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 5 笔同日反向交易，原因为流动性需要或合规比例调整。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

2020 年本基金虽然取得了约 20% 的正收益，但在同类基金中业绩排名处在后 10% 分位。排名落后的原因是，在很多重大问题的判断上我和市场有明显的差异，这背后是方法的差异。在做投资判断时，我坚持了以下方法：1) 分析问题时从系统出发，并在系统的发展过程中把握大小变量；2) 认识到语言的模糊性，并时刻警惕这对思维的影响；3) 企业价值是长期未来的折现，判断长期未来时即不能过于受当期的影响，也要注意经验和理性的局限性。

基于以上三点和我观察到的事实，我的判断是：1) 整体上，在全球系统不确定性、不稳定性明显增强的背景下，对投资中的安全边际提出了更高要求；微观上，充分考虑行业和企业在不同阶段、不同体量下和系统的不同反馈，不轻易做线性外推。2) 国外某主要国家的货币政策蕴含着潜在的系统风险。现代货币是高度抽象复杂的名词，信用和资本（资本-资本回报-实体经济形成循环）是根基，当前该国的货币政策正在削弱货币的根基。放水、钱多是用模糊语言描述复杂概念和事实，大众基于这种理解追逐资产的直觉式反应不可避免，让我困惑的是该国政策制定者对货币政策工具应急式使用的持续性以及他们将怎么解决由此带来的问题。货币政策不解决系统的长期问题，过度使用将进一步加大系统的不稳定性。3) 对长期企业价值判断的难度大幅增加。这是个巨变的时代，很多历史经验完全不适用于将来，而理性逻辑由于系统的不确定性、不稳定性很难展开。

而市场的普遍判断大概是：某些个体（而不强调它们是系统的一部分）历史上优秀，现在优秀，未来也将一直优秀；叠加放水的大环境，这些个体应该给予估值溢价。

这些判断的差异是组合配置和业绩表现差异的主因。在我的判断框架内，我的挑战是：符合选股标准的标的越来越少，但组合管理要求我必须在更多股票上做配置，降低标准很容易带来惩罚。

##### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末大成睿享混合 A 的基金份额净值为 1.1545 元，本报告期基金份额净值增长率为 15.45%，同期业绩比较基准收益率为 16.91%；截至本报告期末大成睿享混合 C 的基金份额净值为 1.1498 元，本报告期基金份额净值增长率为 14.98%，同期业绩比较基准收益率为 16.91%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

企业价值被高估的程度、市场不谨慎的程度、整个体系的脆弱性三者结合在一起，让我很难对 2021 年的股市、尤其是过去两年结构牛的板块有乐观预期。音乐不停就继续跳舞是一种选择，准点休息是另一种选择。

未来我会继续坚持自己的投资理念，希望为持有人带来长期稳健的回报。

#### 4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

本报告期内，依据相关的法律法规、基金合同以及内部监察稽核制度，本基金管理人对本基金运作、内部管理、制度执行及遵规守法情况进行了监察稽核。内部监察稽核的重点是：国家法律法规及行业监管规则的执行情况；基金合同的遵守情况；内部规章制度的执行情况；资讯管制和保密工作落实情况；员工职业操守规范情况，目的是规范基金财产的运作，防范和控制投资风险，确保经营业务的稳健运行和受托资产的安全完整，维护本基金份额持有人的合法权益。

（一）根据最新的法律法规、规章、规范性文件，本基金管理人及时制定了相应的公司制度，并对现有制度进行不断修订和完善，确保本基金管理人内控制度的适时性、全面性和合法合规性。同时，为保障制度的适时性，避免部分内控制度、业务规则与业务发展不相适应，报告期内本基金管理人组织各部门对内部管理制度作了进一步梳理和完善。

（二）全面加强风险监控，不断提高基金业务风险管理水平。为督促各部门完善并落实各项内控措施，公司严格执行风险控制管理员制度，健全内控工作协调机制及监督机制，并进一步加强投资风险量化评价能力及事前风险防范能力，有效防范相关业务风险。同时，公司严格执行投资报备制度，建立了基金从业人员证券投资管理监控信息系统，将投资报备工作纳入常态。

（三）日常监察和专项监察相结合，确保监察稽核的有效性和深入性。本年度，公司继续对本基金销售、宣传等方面的材料、协议及其他法律资料等进行了严格审查，对本基金各项投资比例、投资权限、基金交易、股票投资限制、股票库维护等方面进行实时监控，同时，还专门针对基金投资交易（包括公平交易、转债投资、投资权限、投资比例、流动性风险、基金重仓股等）、基金运营（基金头寸、基金结算、登记清算等）、网上交易、基金销售等进行专项监察。通过日常监察，保证了公司监察的全面性、实时性，通过专项监察，及时发现并纠正了业务中的潜在风险，加强了业务部门和人员的风险意识，从而较好地预防了风险的发生。

（四）加强了对投资管理人员通讯工具在交易时间的集中管理，定期或不定期对投资管理人员的网络即时通讯记录、电话录音等进行抽查，有效的防范了各种形式的利益输送行为。

（五）以多种方式加强合规教育与培训，提高全公司的合规守法意识。及时向全公司传达与基金相关的法律法规，并要求公司各部门贯彻到日常工作中。公司监察稽核部通过解答各业务部

门提出的法律问题，提供法律依据，对于较为重大疑难法律事项及时咨询公司外部律师或监管部门，避免了业务发展中的盲目性，及时防范风险，维护了基金份额持有人的利益。

#### 4.7 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。

#### 4.8 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。

#### 4.9 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

无。

### § 5 托管人报告

#### 5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

在托管本基金的过程中，本基金托管人中国农业银行股份有限公司严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》相关法律法规的规定以及基金合同、托管协议的约定，对本基金基金管理人——大成基金管理有限公司 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日基金的投资运作，进行了认真、独立的会计核算和必要的投资监督，认真履行了托管人的义务，没有从事任何损害基金份额持有人利益的行为。

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

本托管人认为，大成基金管理有限公司在本基金的投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支及利润分配等问题上，不存在损害基金份额持有人利益的行为；在报告期内，严格遵守了《中华人民共和国证券投资基金法》等有关法律法规，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

#### 5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人认为，大成基金管理有限公司的信息披露事务符合《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》及其他相关法律法规的规定，基金管理人所编制和披露的本基金年度报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告等信息真实、准确、完整，未发现有损害基金持有人利益的行为。

### § 6 审计报告

审计报告标题	审计报告
审计报告收件人	大成睿享混合型证券投资基金全体基金份额持有人
审计意见	我们审计了大成睿享混合型证券投资基金的财务报表（以下简称“大成睿享混合基金”），包括 2020 年 12 月 31 日的资产负债表，2020 年度的利润表、所有者权益（基金净值）变动表以及相关财务报表附注。 我们认为，后附的大成睿享混合基金的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则的规定编制，公允反映了大成睿享混合型证券投资基金 2020 年 12 月 31 日的财务状况以及 2020 年度的经营成果和净值变动情况。
形成审计意见的基础	我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。审计报告的“注册会计师对财务报表审计的责任”部分进一步阐述了我们在这些准则下的责任。按照中国注册会计师职

	<p>业道德守则，我们独立于大成睿享混合基金，并履行了职业道德方面的其他责任。我们相信，我们获取的审计证据是充分、适当的，为发表审计意见提供了基础。</p>
其他信息	<p>大成睿享混合型证券投资基金管理层对其他信息负责。其他信息包括年度报告中涵盖的信息，但不包括财务报表和我们的审计报告。</p> <p>我们对财务报表发表的审计意见不涵盖其他信息，我们也不对其他信息发表任何形式的鉴证结论。</p> <p>结合我们对财务报表的审计，我们的责任是阅读其他信息，在此过程中，考虑其他信息是否与财务报表或我们在审计过程中了解到的情况存在重大不一致或者似乎存在重大错报。</p> <p>基于我们已执行的工作，如果我们确定其他信息存在重大错报，我们应当报告该事实。在这方面，我们无任何事项需要报告。</p>
管理层和治理层对财务报表的责任	<p>管理层负责按照企业会计准则的规定编制财务报表，使其实现公允反映，并设计、执行和维护必要的内部控制，以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。</p> <p>在编制财务报表时，管理层负责评估大成睿享混合基金的持续经营能力，披露与持续经营相关的事项（如适用），并运用持续经营假设，除非计划进行清算、终止运营或别无其他现实的选择。</p> <p>治理层负责监督大成睿享混合基金的财务报告过程。</p>
注册会计师对财务报表审计的责任	<p>我们的目标是对财务报表整体是否不存在由于舞弊或错误导致的重大错报获取合理保证，并出具包含审计意见的审计报告。合理保证是高水平的保证，但并不能保证按照审计准则执行的审计在某一重大错报存在时总能发现。错报可能由于舞弊或错误导致，如果合理预期错报单独或汇总起来可能影响财务报表使用者依据财务报表作出的经济决策，则通常认为错报是重大的。</p> <p>在按照审计准则执行审计工作的过程中，我们运用职业判断，并保持职业怀疑。同时，我们也执行以下工作：</p> <p>（1）识别和评估由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险，设计和实施审计程序以应对这些风险，并获取充分、适当的审计证据，作为发表审计意见的基础。由于舞弊可能涉及串通、伪造、故意遗漏、虚假陈述或凌驾于内部控制之上，未能发现由于舞弊导致的重大错报的风险高于未能发现由于错误导致的重大错报的风险。</p> <p>（2）了解与审计相关的内部控制，以设计恰当的审计程序，但目的并非对内部控制的有效性发表意见。</p> <p>（3）评价管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计及相关披露的合理性。</p> <p>（4）对管理层使用持续经营假设的恰当性得出结论。同时，根据获取的审计证据，就可能对大成睿享混合基金持续经营能力产生重大疑虑的事项或情况是否存在重大不确定性得出结论。如果我们得出结论认为存在重大不确定性，审计</p>

	<p>准则要求我们在审计报告中提请报表使用者注意财务报表中的相关披露；如果披露不充分，我们应当发表非无保留意见。我们的结论基于截至审计报告日可获得的信息。然而，未来的事项或情况可能导致大成睿享混合基金不能持续经营。</p> <p>(5) 评价财务报表的总体列报（包括披露）、结构和内容，并评价财务报表是否公允反映相关交易和事项。</p> <p>我们与治理层就计划的审计范围、时间安排和重大审计发现等事项进行沟通，包括沟通我们在审计中识别出的值得关注的内部控制缺陷。</p>
会计师事务所的名称	安永华明会计师事务所(特殊普通合伙)
注册会计师的姓名	昌华 高鹤
会计师事务所的地址	北京市东城区东长安街1号东方广场安永大楼17层01-12室
审计报告日期	2021年3月29日

## § 7 年度财务报表

### 7.1 资产负债表

会计主体：大成睿享混合型证券投资基金

报告截止日：2020年12月31日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2020年12月31日	上年度末 2019年12月31日
<b>资产：</b>			
银行存款	7.4.7.1	93,078,516.52	1,421,948,901.06
结算备付金		378,886.79	4,000,000,000.00
存出保证金		710,901.85	-
交易性金融资产	7.4.7.2	911,703,509.70	54,949,075.55
其中：股票投资		859,379,759.70	54,949,075.55
基金投资		-	-
债券投资		52,323,750.00	-
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	7.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	-	2,000,000,000.00
应收证券清算款		331,968.16	-
应收利息	7.4.7.5	565,369.96	508,755.96
应收股利		-	-
应收申购款		225,980.10	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.6	-	-
资产总计		1,006,995,133.08	7,477,406,732.57
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2020年12月31日</b>	<b>上年度末 2019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	7.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		60.70	2,054,996,104.12
应付赎回款		11,258,437.47	-
应付管理人报酬		1,351,080.95	222,833.20
应付托管费		225,180.15	37,138.87
应付销售服务费		20,591.26	3,222.10
应付交易费用	7.4.7.7	556,486.08	50,115.62
应交税费		-	-
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.8	245,434.65	-
负债合计		13,657,271.26	2,055,309,413.91
<b>所有者权益:</b>			
实收基金	7.4.7.9	860,584,358.10	5,421,949,301.06
未分配利润	7.4.7.10	132,753,503.72	148,017.60
所有者权益合计		993,337,861.82	5,422,097,318.66
负债和所有者权益总计		1,006,995,133.08	7,477,406,732.57

注：报告截止日 2020 年 12 月 31 日，A 类基金份额净值 1.1545 元，C 类基金份额净值 1.1498 元。

基金份额总额 860,584,358.10 份，其中 A 类基金份额 810,499,771.80 份，C 类基金份额 50,084,586.30 份。

## 7.2 利润表

会计主体：大成睿享混合型证券投资基金

本报告期：2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2019 年 12 月 30 日（基金 合同生效日）至 2019 年 12 月 31 日
一、收入		475,010,121.01	466,603.97
1. 利息收入		14,160,859.12	508,755.96
其中：存款利息收入	7.4.7.11	9,690,090.91	508,755.96
债券利息收入		609,706.70	-
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		3,861,061.51	-

证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		401,276,264.49	-
其中：股票投资收益	7.4.7.12	353,090,558.76	-
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.13	-239,234.06	-
资产支持证券投资收益		-	-
贵金属投资收益	7.4.7.14	-	-
衍生工具收益	7.4.7.15	-	-
股利收益	7.4.7.16	48,424,939.79	-
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.17	54,228,220.60	-42,151.99
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.18	5,344,776.80	-
减：二、费用		67,959,144.80	318,586.37
1. 管理人报酬	7.4.10.2.1	47,399,980.25	222,833.20
2. 托管费	7.4.10.2.2	7,899,996.75	37,138.87
3. 销售服务费	7.4.10.2.3	567,679.98	3,222.10
4. 交易费用	7.4.7.19	11,777,597.11	54,992.20
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	7.4.7.20	313,890.71	400.00
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		407,050,976.21	148,017.60
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		407,050,976.21	148,017.60

### 7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：大成睿享混合型证券投资基金

本报告期：2020年1月1日至2020年12月31日

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年12月31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）	5,421,949,301.06	148,017.60	5,422,097,318.66

二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	407,050,976.21	407,050,976.21
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	-4,561,364,942.96	-274,445,490.09	-4,835,810,433.05
其中：1. 基金申购款	296,319,906.75	17,114,515.26	313,434,422.01
2. 基金赎回款	-4,857,684,849.71	-291,560,005.35	-5,149,244,855.06
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）	860,584,358.10	132,753,503.72	993,337,861.82
项目	上年度可比期间 2019年12月30日（基金合同生效日）至2019年12月31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）	5,421,949,301.06	-	5,421,949,301.06
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	148,017.60	148,017.60
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）	-	-	-
其中：1. 基金申购款	-	-	-
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)	5,421,949,301.06	148,017.60	5,422,097,318.66

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.4 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

## 7.4 报表附注

### 7.4.1 基金基本情况

大成睿享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[2019]2075号文“关于核准大成睿享混合型证券投资基金募集的批复”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《大成睿享混合型证券投资基金基金合同》作为发起人向社会公开募集,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(2019)验字第60469430\_H09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2019年12月30日生效。本基金为契约型开放式,存续期限不定。

本基金募集期间为2019年12月2日至2019年12月25日,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5,420,799,845.45元,折合5,420,799,845.45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1,149,455,61元,折合1,149,455,61份基金份额。其中A类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5,126,834,459.30元,折合5,126,834,459.30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1,115,957.91元,折合1,115,957.91份基金份额。C类基金已收到的首次发售募集的有效认购资金金额为人民币293,965,386.15元,折合293,965,386.15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33,497.70元,折合33,497.70份基金份额。以上收到的实收基金共计人民币5,421,949,301.06元,折合5,421,949,301.06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,基金托管人为中国农业银行股份有限公司(以下简称“中国农业银行”)。

本基金A类和C类基金份额分别设置代码。由于两类份额的收费方式不同,本基金A类基金份额和C类基金份额将分别计算基金份额净值并公告。A类份额收取申购、赎回费;C类份额从本类别基金资产中计提销售服务费、不收取认购/申购费用,但对持有期限少于30日的本类别基金份额的赎回收取赎回费。

本基金的投资范围主要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

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、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。如法律法规或监管机构变更投资品种的投资比例限制,基金管理人在履行适当程序后,可以调整投资品种的投资比例。

本基金的业绩比较基准为沪深 300 指数×60%+中证综合债券指数×30%+恒生指数×10%。

#### 7.4.2 会计报表的编制基础

本财务报表系按照财政部颁布的《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,对于在具体会计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〉》及其他中国证监会及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。

#### 7.4.3 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 2020 年 12 月 31 日的财务状况以及 2020 年度的经营成果和净值变动情况。

#### 7.4.4 重要会计政策和会计估计

##### 7.4.4.1 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。惟上年度可比期间财务报表的实际编制期间系自 2019 年 12 月 30 日(基金合同生效日)至 2019 年 12 月 31 日止。

##### 7.4.4.2 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。

#### 7.4.4.3 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、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投资、债券投资和衍生工具等。

本基金目前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各类应收款项等。

##### （2）金融负债分类

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和其他金融负债。

本基金目前持有的金融负债均划分为其他金融负债。

#### 7.4.4.4 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一项金融资产或金融负债，按照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；应收款项及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；应收款项及其他金融负债采用实际利率法，按照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。

#### 7.4.4.5 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。

本基金持有的股票投资、债券投资和权证投资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，按照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，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，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方法进行估值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。

#### 7.4.4.6 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，且该种法定权利是当前可执行的；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。

#### 7.4.4.7 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份额变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日确认列。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。

#### 7.4.4.8 损益平准金

损益平准金包括已实现损益平准金和未实现损益平准金。已实现损益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收益/（损失）占基金净值比例计算的金额。未实现损益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利得/（损失）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。

未实现损益平准金与已实现损益平准金均在“损益平准金”科目中核算，并于期末全额转入“未分配利润/（累计亏损）”。

#### 7.4.4.9 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。

#### 7.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬和托管费等费用在费用涵盖期间按基金合同或相关公告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计算，当实际利率与合同利率差异较小时，也可以用合同利率计算。

#### 7.4.4.11 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。

#### 7.4.4.12 分部报告

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

#### 7.4.4.13 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。

#### 7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

##### 7.4.5.1 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。

##### 7.4.5.2 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。

##### 7.4.5.3 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。

#### 7.4.6 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、企业所得税

根据财政部、国家税务总局财税[2016]36 号文《关于全面推开营业税改增值税试点的通知》的规定，经国务院批准，自 2016 年 5 月 1 日起在全国范围内全面推开营业税改征增值税试点，金融业纳入试点范围，由缴纳营业税改为缴纳增值税。对证券投资基金（封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金）管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税；国债、地方政府债利息收入以及金融同业往来利息收入免征增值税；存款利息收入不征收增值税。

根据财政部、国家税务总局财税[2016]140 号文《关于明确金融、房地产开发、教育辅助服务等增值税政策的通知》的规定，资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人；

根据财政部、国家税务总局财税[2017]56 号文《关于资管产品增值税有关问题的通知》的规定，自 2018 年 1 月 1 日起，资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为（以下简称“资管产品运营业务”），暂适用简易计税方法，按照 3% 的征收率缴纳增值税，资管产品管理人未分别核算资管产品运营业务和其他业务的销售额和增值税应纳税额的除外。资管产品管理人可选择分别或汇总核算资管产品运营业务销售额和增值税应纳税额。对资管产品在 2018 年 1 月 1 日前运营过程中发生的增值税应税行为，未缴纳增值税的，不再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从资管产品管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。

根据财政部、国家税务总局财税[2017]90 号文《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》的规定, 提供贷款服务, 以 2018 年 1 月 1 日起产生的利息及利息性质的收入为销售额; 转让 2017 年 12 月 31 日前取得的股票 (不包括限售股)、债券、基金、非货物期货, 可以选择按照实际买入价计算销售额, 或者以 2017 年最后一个交易日的股票收盘价 (2017 年最后一个交易日处于停牌期间的股票, 为停牌前最后一个交易日收盘价)、债券估值 (中债金融估值中心有限公司或中证指数有限公司提供的债券估值)、基金份额净值、非货物期货结算价格作为买入价计算销售额。

证券投资基金从证券市场中取得的收入, 包括买卖股票、债券的差价收入, 股权的股息、红利收入, 债券的利息收入及其他收入, 暂不征收企业所得税。

### 3. 个人所得税

个人所得税税率为 20%。

基金取得的股票的股息、红利收入、债券的利息收入及储蓄利息收入, 由上市公司、债券发行企业及金融机构在向基金派发股息、红利收入、债券的利息收入及储蓄利息收入时代扣代缴个人所得税。

基金从上市公司分配取得的股息红利所得, 持股期限在 1 个月以内 (含 1 个月) 的, 其股息红利所得全额计入应纳税所得额; 持股期限在 1 个月以上至 1 年 (含 1 年) 的, 减按 50% 计入应纳税所得额; 持股期限超过 1 年的, 暂免征收个人所得税。

暂免征收储蓄存款利息所得个人所得税。

## 7.4.7 重要财务报表项目的说明

### 7.4.7.1 银行存款

单位: 人民币元

项目	本期末 2020 年 12 月 31 日	上年度末 2019 年 12 月 31 日
活期存款	93,078,516.52	421,948,901.06
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	-	1,000,000,000.00
合计	93,078,516.52	1,421,948,901.06

### 7.4.7.2 交易性金融资产

单位: 人民币元

项目	本期末 2020 年 12 月 31 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	805,223,759.62	859,379,759.70	54,156,000.08
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	-	-
	银行间市场	52,293,681.47	52,323,750.00
	合计	52,293,681.47	52,323,750.00
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	857,517,441.09	911,703,509.70	54,186,068.61
项目	上年度末 2019 年 12 月 31 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	54,991,227.54	54,949,075.55	-42,151.99
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	54,991,227.54	54,949,075.55	-42,151.99

#### 7.4.7.3 衍生金融资产/负债

无。

#### 7.4.7.4 买入返售金融资产

##### 7.4.7.4.1 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 12 月 31 日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	-	-
银行间市场	-	-
合计	-	-
项目	上年度末 2019 年 12 月 31 日	

	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	2,000,000,000.00	-
银行间市场	-	-
合计	2,000,000,000.00	-

#### 7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

无。

#### 7.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2020年12月31日	上年度末 2019年12月31日
应收活期存款利息	23,988.87	433,755.96
应收定期存款利息	-	-
应收其他存款利息	-	75,000.00
应收结算备付金利息	170.50	-
应收债券利息	540,890.69	-
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	319.90	-
合计	565,369.96	508,755.96

#### 7.4.7.6 其他资产

无。

#### 7.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2020年12月31日	上年度末 2019年12月31日
交易所市场应付交易费用	555,304.83	50,115.62
银行间市场应付交易费用	1,181.25	-
合计	556,486.08	50,115.62

#### 7.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2020年12月31日	上年度末 2019年12月31日
应付券商交易单元保证金	-	-
应付赎回费	5,434.65	-

应付证券出借违约金	-	-
预提费用	240,000.00	-
合计	245,434.65	-

## 7.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

## 大成睿享混合 A

项目	本期 2020年1月1日至2020年12月31日	
	基金份额(份)	账面金额
上年度末	5,127,950,417.21	5,127,950,417.21
本期申购	251,731,146.26	251,731,146.26
本期赎回(以“-”号填列)	-4,569,181,791.67	-4,569,181,791.67
-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	810,499,771.80	810,499,771.80

## 大成睿享混合 C

项目	本期 2020年1月1日至2020年12月31日	
	基金份额(份)	账面金额
上年度末	293,998,883.85	293,998,883.85
本期申购	44,588,760.49	44,588,760.49
本期赎回(以“-”号填列)	-288,503,058.04	-288,503,058.04
-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	50,084,586.30	50,084,586.30

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)。

## 7.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

## 大成睿享混合 A

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	182,905.25	-39,866.35	143,038.90
本期利润	338,467,216.29	53,680,473.38	392,147,689.67
本期基金份额交易产生的变动数	-198,372,635.15	-68,669,758.07	-267,042,393.22
其中：基金申购款	12,386,622.37	924,933.88	13,311,556.25

基金赎回款	-210,759,257.52	-69,594,691.95	-280,353,949.47
本期已分配利润	-	-	-
本期末	140,277,486.39	-15,029,151.04	125,248,335.35

## 大成睿享混合 C

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	7,264.34	-2,285.64	4,978.70
本期利润	14,355,539.32	547,747.22	14,903,286.54
本期基金份额交易产生的变动数	-5,929,679.28	-1,473,417.59	-7,403,096.87
其中：基金申购款	3,433,926.01	369,033.00	3,802,959.01
基金赎回款	-9,363,605.29	-1,842,450.59	-11,206,055.88
本期已分配利润	-	-	-
本期末	8,433,124.38	-927,956.01	7,505,168.37

## 7.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年12月31日	上年度可比期间 2019年12月30日（基金合同生效日）至2019年12月31日
活期存款利息收入	8,737,584.84	433,755.96
定期存款利息收入	-	-
其他存款利息收入	450,000.00	75,000.00
结算备付金利息收入	488,640.84	-
其他	13,865.23	-
合计	9,690,090.91	508,755.96

## 7.4.7.12 股票投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年12月31日	上年度可比期间 2019年12月30日（基金合同生效日）至2019年12月31日
卖出股票成交总额	3,630,072,173.45	-
减：卖出股票成本总额	3,276,981,614.69	-
买卖股票差价收入	353,090,558.76	-

## 7.4.7.13 债券投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年12月31日	上年度可比期间 2019年12月30日（基金合同生效日）至2019年12月31日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	78,260,702.80	-
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	76,653,454.46	-
减：应收利息总额	1,846,482.40	-
买卖债券差价收入	-239,234.06	-

#### 7.4.7.14 贵金属投资收益

无。

#### 7.4.7.15 衍生工具收益

无。

#### 7.4.7.16 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年12月31日	上年度可比期间 2019年12月30日（基金合同生效日）至2019年12月31日
股票投资产生的股利收益	48,424,939.79	-
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	48,424,939.79	-

#### 7.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2020年1月1日至2020年12月31日	上年度可比期间 2019年12月30日（基金合同生效日）至2019年12月31日
1. 交易性金融资产	54,228,220.60	-42,151.99
股票投资	54,198,152.07	-42,151.99
债券投资	30,068.53	-
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	54,228,220.60	-42,151.99

#### 7.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年12月31日	上年度可比期间 2019年12月30日(基金合同生效日)至2019年12月31日
基金赎回费收入	4,756,658.15	-
基金转换费收入	588,118.65	-
合计	5,344,776.80	-

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。

#### 7.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年12月31日	上年度可比期间 2019年12月30日(基金合同生效日)至2019年12月31日
交易所市场交易费用	11,776,415.86	54,992.20
银行间市场交易费用	1,181.25	-
合计	11,777,597.11	54,992.20

#### 7.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年12月31日	上年度可比期间 2019年12月30日(基金合同生效日)至2019年12月31日
审计费用	120,000.00	-
信息披露费	120,000.00	-
证券出借违约金	-	-
银行划款手续费	57,083.17	-
账户维护费	16,807.54	-
其他	-	400.00
合计	313,890.71	400.00

## 7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

## 7.4.8.1 或有事项

无。

## 7.4.8.2 资产负债表日后事项

无。

## 7.4.9 关联方关系

关联方名称	与本基金的关系
大成基金管理有限公司(“大成基金”)	基金管理人、基金销售机构、注册登记机构
中国农业银行股份有限公司(“中国农业银行”)	基金托管人、基金销售机构
中泰信托有限责任公司	基金管理人的股东
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
中国银河投资管理有限公司	基金管理人的股东
大成国际资产管理有限公司(“大成国际”)	基金管理人的子公司
大成创新资本管理有限公司(“大成创新资本”)	基金管理人的合营企业

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。

## 7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

## 7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

## 7.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2020年1月1日至2020年12月31日		上年度可比期间 2019年12月30日(基金合同生效日) 至2019年12月31日	
	成交金额	占当期股票 成交总额的比例 (%)	成交金额	占当期股票 成交总额的比例(%)
光大证券	1,701,520,377.50	22.35	-	-

## 7.4.10.1.2 债券交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2020年1月1日至2020年12月31日		上年度可比期间 2019年12月30日(基金合同生效日) 至2019年12月31日	
	成交金额	占当期债券 成交总额的比例 (%)	成交金额	占当期债券 成交总额的比例 (%)

光大证券	32,046,624.60	25.83	-	-
------	---------------	-------	---	---

#### 7.4.10.1.3 债券回购交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2020年1月1日至2020年12月31日		上年度可比期间 2019年12月30日（基金合同生效日） 至2019年12月31日	
	成交金额	占当期债券回购 成交总额的比例 （%）	成交金额	占当期债券回购 成交总额的比例 （%）
光大证券	1,000,000,000.00	19.83	-	-

#### 7.4.10.1.4 权证交易

无。

#### 7.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2020年1月1日至2020年12月31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	1,495,923.34	21.73	142,535.52	25.67
关联方名称	上年度可比期间 2019年12月30日（基金合同生效日）至2019年12月31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	-	-	-	-

注：1. 上述佣金按市场佣金率计算，以扣除由中国证券登记结算有限责任公司收取的证管费和经手费后的净额列示。

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

#### 7.4.10.2 关联方报酬

##### 7.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年12月31日	上年度可比期间 2019年12月30日（基金合同生效日）至2019年12月31日

		月 31 日
当期发生的基金应支付的管理费	47,399,980.25	222,833.20
其中：支付销售机构的客户维护费	27,863,021.11	134,236.39

注：基金管理费每日计提，按月支付。基金管理费按前一日的基金资产净值的 1.50% 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 为前一日基金资产净值

#### 7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日	2019 年 12 月 30 日（基金合同生效日）至 2019 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的托管费	7,899,996.75	37,138.87

注：基金托管费每日计提，按月支付。基金托管费按前一日的基金资产净值的 0.25% 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

#### 7.4.10.2.3 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		
	2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	大成睿享混合 A	大成睿享混合 C	合计
大成基金	-	10,080.14	10,080.14
光大证券	-	11,254.98	11,254.98
中国农业银行	-	60,385.72	60,385.72
合计	-	81,720.84	81,720.84
获得销售服务费的各关联方	上年度可比期间		
	2019 年 12 月 30 日（基金合同生效日）至 2019 年 12 月 31 日		

方名称	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	大成睿享混合 A	大成睿享混合 C	合计
大成基金	-	36.41	36.41
光大证券	-	116.89	116.89
中国农业银行	-	296.20	296.20
合计	-	449.50	449.50

注：销售服务费每日计提，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率 0.40%，本基金销售服务费将专门用于本基金的销售与基金份额持有人服务。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。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财产净值

#### 7.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

无。

#### 7.4.10.4 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。

#### 7.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

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

无。

##### 7.4.10.5.2 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。

#### 7.4.10.6 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 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日		上年度可比期间 2019 年 12 月 30 日(基金合同生效日)至 2019 年 12 月 31 日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国农业银行	93,078,516.52	8,737,584.84	421,948,901.06	433,755.96

注：本基金的银行存款由基金托管人中国农业银行保管，并按银行约定利率计息。

## 7.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

无。

## 7.4.10.8 其他关联交易事项的说明

无。

## 7.4.11 利润分配情况

无。

## 7.4.12 期末(2020年12月31日)本基金持有的流通受限证券

## 7.4.12.1 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

7.4.12.1.1 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
003030	祖名股份	2020年12月25日	2021年1月6日	新股未上市	15.18	15.18	480	7,286.40	7,286.40	-
003031	中瓷电子	2020年12月24日	2021年1月4日	新股未上市	15.27	15.27	387	5,909.49	5,909.49	-
300864	南大环境	2020年8月13日	2021年2月25日	新股锁定	71.71	90.85	166	11,903.86	15,081.10	-
300865	大宏立	2020年8月11日	2021年3月1日	新股锁定	20.20	37.22	3,311	66,882.20	123,235.42	-
300867	圣元环保	2020年8月12日	2021年3月3日	新股锁定	19.34	31.97	1,498	28,971.32	47,891.06	-
300868	杰美特	2020年8月12日	2021年2月24日	新股锁定	41.26	43.28	593	24,467.18	25,665.04	-
300871	回盛生物	2020年8月13日	2021年2月24日	新股锁定	33.61	38.70	618	20,770.98	23,916.60	-
300873	海晨股份	2020年8月14日	2021年3月2日	新股锁定	30.72	41.32	484	14,868.48	19,998.88	-
300877	金春	2020年	2021	新股锁	30.54	50.85	569	17,377.26	28,933.65	-

	股份	8月17日	年3月3日	定						
300878	维康药业	2020年8月17日	2021年3月3日	新股锁定	41.34	48.72	401	16,577.34	19,536.72	-
300879	大叶股份	2020年8月25日	2021年3月1日	新股锁定	10.58	27.12	466	4,930.28	12,637.92	-
300880	迦南智能	2020年8月25日	2021年3月1日	新股锁定	9.73	34.73	3,732	36,312.36	129,612.36	-
300882	万胜智能	2020年8月27日	2021年3月10日	新股锁定	10.33	25.79	440	4,545.20	11,347.60	-
300884	狄耐克	2020年11月5日	2021年5月12日	新股锁定	24.87	33.51	499	12,410.13	16,721.49	-
300886	华业香料	2020年9月8日	2021年3月16日	新股锁定	18.59	45.67	147	2,732.73	6,713.49	-
300887	谱尼测试	2020年9月9日	2021年3月16日	新股锁定	44.47	74.52	210	9,338.70	15,649.20	-
300889	爱克股份	2020年9月9日	2021年3月16日	新股锁定	27.97	30.12	479	13,397.63	14,427.48	-
300890	翔丰华	2020年9月10日	2021年3月18日	新股锁定	14.69	48.85	286	4,201.34	13,971.10	-
300891	惠云钛业	2020年9月10日	2021年3月17日	新股锁定	3.64	16.40	1,143	4,160.52	18,745.20	-
300892	品渥食品	2020年9月11日	2021年3月30日	新股锁定	26.66	60.01	272	7,251.52	16,322.72	-
300893	松原股份	2020年9月17日	2021年3月24日	新股锁定	13.47	35.08	276	3,717.72	9,682.08	-
300895	铜牛信息	2020年9月17日	2021年3月24日	新股锁定	12.65	45.30	283	3,579.95	12,819.90	-
300896	爱美客	2020年9月21日	2021年3月29日	新股锁定	118.27	603.36	473	55,941.71	285,389.28	-

300898	熊猫乳品	2020年10月9日	2021年4月16日	新股锁定	10.78	33.03	496	5,346.88	16,382.88	-
300900	广联航空	2020年10月19日	2021年4月29日	新股锁定	17.87	33.16	879	15,707.73	29,147.64	-
300903	科翔股份	2020年10月29日	2021年5月6日	新股锁定	13.06	30.47	4,775	62,361.50	145,494.25	-
300908	仲景食品	2020年11月13日	2021年5月24日	新股锁定	39.74	60.44	285	11,325.90	17,225.40	-
300909	汇创达	2020年11月11日	2021年5月18日	新股锁定	29.57	40.67	386	11,414.02	15,698.62	-
300910	瑞丰新材	2020年11月20日	2021年5月27日	新股锁定	30.26	47.87	474	14,343.24	22,690.38	-
300911	亿田智能	2020年11月24日	2021年6月3日	新股锁定	24.35	33.06	309	7,524.15	10,215.54	-
300912	凯龙高科	2020年11月26日	2021年6月7日	新股锁定	17.62	28.49	5,117	90,161.54	145,783.33	-
300917	特发服务	2020年12月14日	2021年6月21日	新股锁定	18.78	31.94	281	5,277.18	8,975.14	-
300918	南山智尚	2020年12月15日	2021年6月22日	新股锁定	4.97	8.94	1,063	5,283.11	9,503.22	-
300919	中伟股份	2020年12月15日	2021年6月23日	新股锁定	24.60	61.51	610	15,006.00	37,521.10	-
300922	天秦装备	2020年12月18日	2021年6月25日	新股锁定	16.05	31.58	287	4,606.35	9,063.46	-
300926	博俊科技	2020年12月29日	2021年1月7日	新股未上市	10.76	10.76	3,225	34,701.00	34,701.00	-
300926	博俊科技	2020年12月29日	2021年7月7日	新股锁定	10.76	10.76	359	3,862.84	3,862.84	-
300927	江天化学	2020年12月	2021年1月	新股未上市	13.39	13.39	1,946	26,056.94	26,056.94	-

		29 日	7 日							
300927	江天化学	2020 年 12 月 29 日	2021 年 7 月 7 日	新股锁定	13.39	13.39	217	2,905.63	2,905.63	-
300999	金龙鱼	2020 年 9 月 29 日	2021 年 4 月 15 日	新股锁定	25.70	88.29	6,542	168,129.40	577,593.18	-
601995	中金公司	2020 年 10 月 22 日	2021 年 5 月 6 日	新股锁定	28.78	68.71	24,951	718,089.78	1,714,383.21	-
605277	新亚电子	2020 年 12 月 25 日	2021 年 1 月 6 日	新股未上市	16.95	16.95	507	8,593.65	8,593.65	-
688093	世华科技	2020 年 9 月 22 日	2021 年 3 月 30 日	新股锁定	17.55	23.63	4,595	80,642.25	108,579.85	-
688160	步科股份	2020 年 11 月 4 日	2021 年 5 月 12 日	新股锁定	20.34	31.29	2,771	56,362.14	86,704.59	-
688311	盟升电子	2020 年 7 月 24 日	2021 年 2 月 1 日	新股锁定	41.58	115.36	4,182	173,887.56	482,435.52	-
688335	复洁环保	2020 年 8 月 7 日	2021 年 2 月 18 日	新股锁定	46.22	36.69	4,076	188,392.72	149,548.44	-
688338	赛科希德	2020 年 7 月 27 日	2021 年 2 月 8 日	新股锁定	50.35	54.59	3,041	153,114.35	166,008.19	-
688356	键凯科技	2020 年 8 月 17 日	2021 年 2 月 26 日	新股锁定	41.18	105.06	2,433	100,190.94	255,610.98	-
688551	科威尔	2020 年 9 月 1 日	2021 年 3 月 10 日	新股锁定	37.94	33.34	2,211	83,885.34	73,714.74	-
688617	惠泰医疗	2020 年 12 月 30 日	2021 年 1 月 7 日	新股未上市	74.46	74.46	1,673	124,571.58	124,571.58	-
688699	明微电子	2020 年 12 月 10 日	2021 年 6 月 18 日	新股锁定	38.43	45.27	1,869	71,825.67	84,609.63	-

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。

#### 7.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

无。

#### 7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

无。

#### 7.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

无。

### 7.4.13 金融工具风险及管理

#### 7.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金是一只混合型证券投资基金，本混合型基金预期风险收益水平低于股票基金，高于债券基金和货币市场基金。本基金投资的金融工具主要包括股票投资和债券投资。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。

#### 7.4.13.2 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农业银行，因而与银行存款相关的信用风险不重大。

本基金在交易所进行的交易均与中国证券登记结算有限责任公司完成证券交收和款项清算，因此违约风险发生的可能性很小；基金在进行银行间同业市场交易前均对交易对手进行信用评估，以控制相应的信用风险。

于本期末，本基金持有的除国债、央行票据和政策性金融债以外的债券占基金资产净值的比例为 0.50% (上年度末：0.00%)。

#### 7.4.13.3 流动性风险

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

##### 7.4.13.3.1 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，约定在非正常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。

于本期末，本基金持有的流动性受限资产的估值占基金资产净值的比例未超过 15%，且本基金组合资产中 7 个工作日可变现资产未超过最近工作日确认的净赎回金额。

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

#### 7.4.13.4 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。

##### 7.4.13.4.1 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。

本基金主要投资于银行间同业市场交易的固定收益品种，因此存在相应的利率风险。本基金的生息资产主要为银行存款、结算备付金、债券投资及买入返售金融资产等。

##### 7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 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	93,078,516.52	-	-	-	93,078,516.52
结算备付金	378,886.79	-	-	-	378,886.79
存出保证金	710,901.85	-	-	-	710,901.85
交易性金融资产	47,315,750.00	5,008,000.00	-	859,379,759.70	911,703,509.70
应收利息	-	-	-	565,369.96	565,369.96
应收申购款	-	-	-	225,980.10	225,980.10
应收证券清算款	-	-	-	331,968.16	331,968.16
资产总计	141,484,055.16	5,008,000.00	-	860,503,077.92	1,006,995,133.08

负债					
应付赎回款	-	-	-	11,258,437.47	11,258,437.47
应付管理人报酬	-	-	-	1,351,080.95	1,351,080.95
应付托管费	-	-	-	225,180.15	225,180.15
应付证券清算款	-	-	-	60.70	60.70
应付销售服务费	-	-	-	20,591.26	20,591.26
应付交易费用	-	-	-	556,486.08	556,486.08
其他负债	-	-	-	245,434.65	245,434.65
负债总计	-	-	-	13,657,271.26	13,657,271.26
利率敏感度缺口	141,484,055.16	5,008,000.00	-	846,845,806.66	993,337,861.82
上年度末 2019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	1,421,948,901.06	-	-	-	1,421,948,901.06
结算备付金	4,000,000,000.00	-	-	-	4,000,000,000.00
交易性金融资产	-	-	-	54,949,075.55	54,949,075.55
买入返售金融资产	2,000,000,000.00	-	-	-	2,000,000,000.00
应收利息	-	-	-	508,755.96	508,755.96
资产总计	7,421,948,901.06	-	-	55,457,831.51	7,477,406,732.57
负债					
应付管理人报酬	-	-	-	222,833.20	222,833.20
应付托管费	-	-	-	37,138.87	37,138.87
应付证券清算款	-	-	-	2,054,996,104.12	2,054,996,104.12
应付销售服务费	-	-	-	3,222.10	3,222.10
应付交易费用	-	-	-	50,115.62	50,115.62
负债总计	-	-	-	2,055,309,413.91	2,055,309,413.91
利率敏感度缺口	7,421,948,901.06	-	-	-1,999,851,582.40	5,422,097,318.66

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。

#### 7.4.13.4.1.2 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12月31日）	上年度末（2019年12月31日）	
分析	市场利率下降25个基点	82,504.47	-
	市场利率上升25个基点	-81,728.06	-

## 7.4.13.4.2 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。本基金持有以非记账本位币人民币计价的资产和负债，因此存在相应的外汇风险。本基金管理人每日对本基金的外汇头寸进行监控。

## 7.4.13.4.2.1 外汇风险敞口

单位：人民币元

项目	本期末 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				
交易性金融资产	-	136,678,197.70	-	136,678,197.70
资产合计	-	136,678,197.70	-	136,678,197.70
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	-	136,678,197.70	-	136,678,197.70
项目	上年度末 2019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 外汇风险敞口净 额	-	-	-	-

## 7.4.13.4.2.2 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（2020年12月31日）	上年度末（2019年12月31日）
分析	港币相对人民币升值 5%	6,833,909.88	-
	港币相对人民币贬值 5%	-6,833,909.89	-

#### 7.4.13.4.3 其他价格风险

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

本基金投资组合的资产配置范围为：股票、存托凭证投资占基金资产的比例范围为 60%-95%（其中港股通标的股票最高投资比例不得超过股票资产的 50%）；本基金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；股指期货、国债期货的投资比例遵循国家相关法律法规。

#### 7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2020年12月31日		上年度末 2019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	859,379,759.70	86.51	54,949,075.55	1.01
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	859,379,759.70	86.51	54,949,075.55	1.01

#### 7.4.13.4.3.2 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12月31日）	上年度末（2019年12月31日）
分析	业绩比较基准上升5%	36,015,969.26	2,807,631.44
	业绩比较基准下降5%	-36,015,969.26	-2,807,631.44

#### 7.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

##### 1. 承诺事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的承诺事项。

##### 2. 其他事项

###### (1) 公允价值

管理层已经评估了银行存款、结算备付金、买入返售金融资产、其他应收款项类投资以及其他金融负债因剩余期限不长，公允价值与账面价值相若。

###### 各层次金融工具公允价值

于2020年12月31日，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中划分为第一层次余额为854,130,684.59元，第二层次的余额为57,572,825.11元，无划分为第三层次余额。（于2019年12月31日，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中划分为第一层次余额为54,949,075.55元，无划分为第二层次的余额，无划分为第三层次余额。）

###### 公允价值所属层次间重大变动

本基金调整公允价值计量层次转换时点的相关会计政策在前后各会计期间保持一致。

对于证券交易所上市的股票和可转换债券，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，本基金不会于停牌日至交易恢复活跃日期间及交易不活跃期间将相关股票

和可转换债券的公允价值列入第一层次；并根据估值调整中采用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度，确定相关股票和可转换债券公允价值应属第二层次还是第三层次。

#### 第三层次公允价值期初金额和本期变动金额

本基金于本报告期初未持有公允价值归属于第三层次的金融工具，本基金本报告期未发生第三层次公允价值转入转出情况。

(2)除公允价值外，截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

#### 3. 财务报表的批准

本财务报表已于 2021 年 3 月 29 日经本基金的基金管理人批准。

## § 8 投资组合报告

### 8.1 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	859,379,759.70	85.34
	其中：股票	859,379,759.70	85.34
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	52,323,750.00	5.20
	其中：债券	52,323,750.00	5.20
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	93,457,403.31	9.28
8	其他各项资产	1,834,220.07	0.18
9	合计	1,006,995,133.08	100.00

### 8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

#### 8.2.1 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	41,324,377.75	4.16
B	采矿业	149,861,894.78	15.09
C	制造业	365,062,099.87	36.75
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	43,947.04	0.00
E	建筑业	49,702.48	0.01

F	批发和零售业	77,246,153.20	7.78
G	交通运输、仓储和邮政业	16,866,730.95	1.70
H	住宿和餐饮业	23,405.23	0.00
I	信息传输、软件和信息技术服务业	12,872,237.07	1.30
J	金融业	1,997,658.58	0.20
K	房地产业	15,540,401.14	1.56
L	租赁和商务服务业	16,850.30	0.00
M	科学研究和技术服务业	74,405.84	0.01
N	水利、环境和公共设施管理业	344,890.19	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	41,376,807.58	4.17
S	综合	-	-
	合计	722,701,562.00	72.75

### 8.2.2 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（%）
原材料	-	-
医疗保健	-	-
信息技术	-	-
通信服务	91,424,900.37	9.20
日常消费品	-	-
能源	45,173,173.20	4.55
金融	-	-
公用事业	-	-
工业	80,124.13	0.01
非日常生活消费品	-	-
房地产	-	-
合计	136,678,197.70	13.76

注：以上分类采用全球行业分类标准（GICS）。

### 8.3 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	601088	中国神华	3,063,535	55,174,265.35	5.55
1	01088	中国神华	3,676,219	45,173,173.20	4.55
2	600352	浙江龙盛	7,334,518	99,896,135.16	10.06
3	002327	富安娜	13,027,409	99,789,952.94	10.05
4	603337	杰克股份	3,268,303	99,421,777.26	10.01
5	601225	陕西煤业	10,133,537	94,647,235.58	9.53

6	00728	中国电信	50,478,691	91,342,503.81	9.20
7	300788	中信出版	975,638	41,376,807.58	4.17
8	002299	圣农发展	1,557,000	41,322,780.00	4.16
9	600998	九州通	2,149,042	39,026,602.72	3.93
10	600993	马应龙	1,893,221	38,129,470.94	3.84
11	601766	中国中车	4,101,600	21,779,496.00	2.19
12	002202	金风科技	1,418,021	20,206,799.25	2.03
13	002120	韵达股份	1,070,400	16,805,280.00	1.69
14	600007	中国国贸	1,239,300	15,429,285.00	1.55
15	300785	值得买	137,644	12,509,086.72	1.26
16	603989	艾华集团	412,700	11,060,360.00	1.11
17	601995	中金公司	24,951	1,714,383.21	0.17
18	688063	派能科技	4,511	1,166,634.82	0.12
19	688608	恒玄科技	2,935	971,485.00	0.10
20	300999	金龙鱼	6,542	577,593.18	0.06
21	688686	奥普特	2,330	505,144.00	0.05
22	300919	中伟股份	6,093	485,591.86	0.05
23	688311	盟升电子	4,182	482,435.52	0.05
24	688505	复旦张江	22,688	392,275.52	0.04
25	300577	开润股份	12,090	315,307.20	0.03
26	688578	艾力斯	10,734	305,704.32	0.03
27	300910	瑞丰新材	4,736	293,327.38	0.03
28	300896	爱美客	473	285,389.28	0.03
29	688566	吉贝尔	9,882	257,722.56	0.03
30	688356	键凯科技	2,433	255,610.98	0.03
31	688135	利扬芯片	5,658	242,784.78	0.02
32	688550	瑞联新材	2,539	218,633.29	0.02
33	300908	仲景食品	2,847	218,419.26	0.02
34	300884	狄耐克	4,985	212,669.97	0.02
35	688136	科兴制药	4,981	203,424.04	0.02
36	601398	工商银行	40,243	200,812.57	0.02
37	300909	汇创达	3,858	199,193.82	0.02
38	688338	赛科希德	3,041	166,008.19	0.02
39	688335	复洁环保	4,076	149,548.44	0.02
40	300912	凯龙高科	5,117	145,783.33	0.01
41	300903	科翔股份	4,775	145,494.25	0.01
42	688219	会通股份	7,336	139,970.88	0.01
43	300883	龙利得	8,911	132,773.90	0.01
44	300880	迦南智能	3,732	129,612.36	0.01
45	300911	亿田智能	3,083	126,030.04	0.01
46	688617	惠泰医疗	1,673	124,571.58	0.01
47	300918	南山智尚	10,626	123,398.55	0.01

48	300865	大宏立	3,311	123,235.42	0.01
49	300850	新强联	746	119,277.94	0.01
50	300917	特发服务	2,803	111,116.14	0.01
51	300922	天秦装备	2,863	108,883.46	0.01
52	688093	世华科技	4,595	108,579.85	0.01
53	300893	松原股份	2,756	106,451.68	0.01
54	688560	明冠新材	3,832	105,226.72	0.01
55	601568	北元集团	11,007	101,154.33	0.01
56	605009	豪悦护理	497	94,579.10	0.01
57	688309	恒誉环保	2,880	94,550.40	0.01
58	688678	福立旺	4,198	91,516.40	0.01
59	688013	天臣医疗	3,022	91,294.62	0.01
60	688160	步科股份	2,771	86,704.59	0.01
61	605111	新洁能	435	85,059.90	0.01
62	688698	伟创电气	4,751	84,995.39	0.01
63	688699	明微电子	1,869	84,609.63	0.01
64	605358	立昂微	693	83,437.20	0.01
65	00762	中国联通	22,000	82,396.56	0.01
66	688590	新致软件	4,171	82,168.70	0.01
67	00525	广深铁路股份	68,000	80,124.13	0.01
68	688551	科威尔	2,211	73,714.74	0.01
69	688557	兰剑智能	1,812	73,331.64	0.01
70	300886	华业香料	1,464	70,324.59	0.01
71	601187	厦门银行	5,129	67,702.80	0.01
72	688308	欧科亿	2,457	66,928.68	0.01
73	605376	博迁新材	1,422	66,834.00	0.01
74	688577	浙海德曼	1,503	65,245.23	0.01
75	688585	上纬新材	4,922	64,773.52	0.01
76	688618	三旺通信	1,117	59,938.22	0.01
77	601827	三峰环境	6,723	55,666.44	0.01
78	300824	北鼎股份	1,954	54,575.22	0.01
79	688156	路德环境	2,602	53,445.08	0.01
80	002990	盛视科技	612	52,754.40	0.01
81	002991	甘源食品	638	52,284.10	0.01
82	300867	圣元环保	1,498	47,891.06	0.00
83	002993	奥海科技	720	47,779.20	0.00
84	300825	阿尔特	1,642	45,319.20	0.00
85	002979	雷赛智能	1,005	44,561.70	0.00
86	300855	图南股份	896	42,909.44	0.00
87	300822	贝仕达克	933	41,527.83	0.00
88	002978	安宁股份	881	40,393.85	0.00
89	300926	博俊科技	3,584	38,563.84	0.00

90	605338	巴比食品	1,012	38,213.12	0.00
91	002989	中天精装	980	36,358.00	0.00
92	003022	联泓新科	2,304	35,665.92	0.00
93	002984	森麒麟	1,386	35,190.54	0.00
94	300837	浙矿股份	736	34,967.36	0.00
95	300847	中船汉光	1,421	34,814.50	0.00
96	601702	华峰铝业	4,166	34,744.44	0.00
97	003012	东鹏控股	2,278	32,803.20	0.00
98	002980	华盛昌	700	31,570.00	0.00
99	300856	科思股份	567	30,941.19	0.00
100	003021	兆威机电	425	30,226.00	0.00
101	601686	友发集团	2,374	29,390.12	0.00
102	300900	广联航空	882	29,283.51	0.00
103	300927	江天化学	2,163	28,962.57	0.00
104	300877	金春股份	569	28,933.65	0.00
105	300828	锐新科技	977	28,694.49	0.00
106	603565	中谷物流	1,250	28,512.50	0.00
107	300857	协创数据	934	27,581.02	0.00
108	605388	均瑶健康	1,230	27,527.40	0.00
109	603353	和顺石油	689	26,388.70	0.00
110	300868	杰美特	593	25,665.04	0.00
111	600956	新天绿能	2,533	25,481.98	0.00
112	300846	首都在线	1,131	25,096.89	0.00
113	605136	丽人丽妆	867	24,510.09	0.00
114	603950	长源东谷	1,081	23,998.20	0.00
115	300871	回盛生物	618	23,916.60	0.00
116	300851	交大思诺	673	23,884.77	0.00
117	605108	同庆楼	983	23,405.23	0.00
118	605001	威奥股份	1,353	23,271.60	0.00
119	300853	申昊科技	356	23,136.44	0.00
120	002986	宇新股份	630	22,837.50	0.00
121	300843	胜蓝股份	751	21,981.77	0.00
122	003026	中晶科技	461	21,740.76	0.00
123	300858	科拓生物	351	21,260.07	0.00
124	605068	明新旭腾	641	21,095.31	0.00
125	003005	竞业达	412	20,406.36	0.00
126	003006	百亚股份	804	20,220.60	0.00
127	300840	酷特智能	1,185	20,050.20	0.00
128	300873	海晨股份	484	19,998.88	0.00
129	605336	帅丰电器	701	19,880.36	0.00
130	300878	维康药业	401	19,536.72	0.00
131	605099	共创草坪	624	19,375.20	0.00

132	605366	宏柏新材	1,588	19,373.60	0.00
133	605158	华达新材	1,712	19,105.92	0.00
134	603221	爱丽家居	1,442	18,774.84	0.00
135	300891	惠云钛业	1,143	18,745.20	0.00
136	003029	吉大正元	716	18,716.24	0.00
137	300833	浩洋股份	406	18,582.62	0.00
138	002992	宝明科技	692	18,559.44	0.00
139	603949	雪龙集团	1,225	18,534.25	0.00
140	605169	洪通燃气	731	18,465.06	0.00
141	605222	起帆电缆	858	18,438.42	0.00
142	605008	长鸿高科	742	18,386.76	0.00
143	003019	宸展光电	601	18,084.09	0.00
144	003028	振邦智能	432	18,010.08	0.00
145	003010	若羽臣	562	17,837.88	0.00
146	605186	健麾信息	626	17,609.38	0.00
147	603931	格林达	431	17,567.56	0.00
148	605199	葫芦娃	726	17,511.12	0.00
149	300838	浙江力诺	909	17,271.00	0.00
150	603682	锦和商业	2,018	16,850.30	0.00
151	003015	日久光电	1,128	16,818.48	0.00
152	605066	天正电气	1,278	16,716.24	0.00
153	605179	一鸣食品	939	16,582.74	0.00
154	603948	建业股份	860	16,537.80	0.00
155	300898	熊猫乳品	496	16,382.88	0.00
156	605166	聚合顺	1,641	16,377.18	0.00
157	300892	品渥食品	272	16,322.72	0.00
158	605003	众望布艺	553	16,247.14	0.00
159	003016	欣贺股份	1,681	15,784.59	0.00
160	300887	谱尼测试	210	15,649.20	0.00
161	605177	东亚药业	439	15,584.50	0.00
162	605100	华丰股份	349	15,450.23	0.00
163	605088	冠盛股份	716	15,343.88	0.00
164	605151	西上海	723	15,219.15	0.00
165	300864	南大环境	166	15,081.10	0.00
166	605377	华旺科技	750	14,977.50	0.00
167	300845	捷安高科	470	14,870.80	0.00
168	601128	常熟银行	2,000	14,760.00	0.00
169	603095	越剑智能	630	14,748.30	0.00
170	605007	五洲特纸	598	14,465.62	0.00
171	300889	爱克股份	479	14,427.48	0.00
172	605399	晨光新材	810	14,361.30	0.00
173	002976	瑞玛工业	536	14,086.08	0.00

174	003002	壶化股份	921	14,017.62	0.00
175	003027	同兴环保	349	14,008.86	0.00
176	300890	翔丰华	286	13,971.10	0.00
177	003013	地铁设计	724	13,437.44	0.00
178	003001	中岩大地	432	13,344.48	0.00
179	605058	澳弘电子	548	13,168.44	0.00
180	300823	建科机械	453	13,073.58	0.00
181	300859	西域旅游	643	13,014.32	0.00
182	605050	福然德	1,197	12,939.57	0.00
183	003020	立方制药	374	12,858.12	0.00
184	300895	铜牛信息	283	12,819.90	0.00
185	003018	金富科技	1,027	12,806.69	0.00
186	300879	大叶股份	466	12,637.92	0.00
187	605183	确成股份	741	12,567.36	0.00
188	002998	优彩资源	1,353	12,528.78	0.00
189	603408	建霖家居	762	12,428.22	0.00
190	605258	协和电子	340	12,420.20	0.00
191	605218	伟时电子	837	11,977.47	0.00
192	300882	万胜智能	440	11,347.60	0.00
193	003023	彩虹集团	296	11,262.80	0.00
194	003003	天元股份	756	11,256.84	0.00
195	300849	锦盛新材	448	10,922.24	0.00
196	003025	思进智能	305	10,763.45	0.00
197	605155	西大门	350	10,668.00	0.00
198	603112	华翔股份	920	10,488.00	0.00
199	605018	长华股份	840	10,416.00	0.00
200	605116	奥锐特	642	10,188.54	0.00
201	605118	力鼎光电	667	10,105.05	0.00
202	003000	华文食品	684	10,047.96	0.00
203	605333	沪光股份	670	10,009.80	0.00
204	605188	国光连锁	1,003	9,999.91	0.00
205	003004	声迅股份	306	9,984.78	0.00
206	605299	舒华体育	738	9,335.70	0.00
207	605318	法狮龙	628	9,219.04	0.00
208	605277	新亚电子	507	8,593.65	0.00
209	003030	祖名股份	480	7,286.40	0.00
210	003031	中瓷电子	387	5,909.49	0.00
211	600598	北大荒	83	1,597.75	0.00
212	002444	巨星科技	33	1,026.63	0.00

注：截至报告期末，本基金投资的一家公司发行的证券浙江龙盛（600352.SH）、中国神华（601088.SH、1088.HK）、富安娜（002327.SZ）、杰克股份（603337.SH）因市值波动导致投资比例被动超标。

## 8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

## 8.4.1 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	601225	陕西煤业	434,455,240.43	8.01
2	600352	浙江龙盛	402,369,776.36	7.42
3	002202	金风科技	384,894,385.73	7.10
4	601398	工商银行	348,656,843.72	6.43
5	300788	中信出版	261,073,940.27	4.81
6	601128	常熟银行	253,930,755.25	4.68
7	600598	北大荒	212,254,579.68	3.91
8	600993	马应龙	184,087,854.50	3.40
9	00728	中国电信	164,378,814.82	3.03
10	300577	开润股份	126,123,282.73	2.33
11	002563	森马服饰	120,771,425.03	2.23
12	002444	巨星科技	118,772,364.77	2.19
13	603337	杰克股份	96,128,400.44	1.77
14	002327	富安娜	93,383,538.68	1.72
15	600690	海尔智家	90,685,170.48	1.67
16	01088	中国神华	83,885,838.64	1.55
17	601088	中国神华	82,181,078.00	1.52
18	002299	圣农发展	64,296,566.60	1.19
19	600507	方大特钢	57,977,168.01	1.07
20	001696	宗申动力	54,856,597.45	1.01

注：本项中“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。

## 8.4.2 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	002202	金风科技	421,979,182.29	7.78
2	601225	陕西煤业	337,228,537.14	6.22
3	600352	浙江龙盛	331,781,800.24	6.12
4	601398	工商银行	315,161,075.09	5.81
5	600598	北大荒	297,159,754.72	5.48
6	601128	常熟银行	270,648,146.00	4.99
7	600993	马应龙	235,637,666.52	4.35
8	300788	中信出版	226,192,470.56	4.17
9	002444	巨星科技	136,830,830.18	2.52
10	300577	开润股份	130,533,977.45	2.41
11	600690	海尔智家	124,372,953.48	2.29

12	002563	森马服饰	99,704,976.83	1.84
13	02333	长城汽车	68,727,344.30	1.27
14	600507	方大特钢	68,398,478.96	1.26
15	001696	宗申动力	67,259,169.64	1.24
16	00728	中国电信	54,513,692.40	1.01
17	002262	恩华药业	51,857,051.48	0.96
18	688020	方邦股份	45,452,810.44	0.84
19	603337	杰克股份	45,136,338.82	0.83
20	01088	中国神华	44,202,603.12	0.82

注：本项中“本期累计卖出金额”按卖出成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

#### 8.4.3 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	4,027,214,146.77
卖出股票收入（成交）总额	3,630,072,173.45

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。

#### 8.5 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	32,269,250.00	3.25
2	央行票据	-	-
3	金融债券	15,046,500.00	1.51
	其中：政策性金融债	15,046,500.00	1.51
4	企业债券	5,008,000.00	0.50
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	52,323,750.00	5.27

#### 8.6 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	180203	18 国开 03	100,000	10,042,000.00	1.01
2	209962	20 贴现国债 62	100,000	9,944,000.00	1.00
3	209963	20 贴现国债	75,000	7,458,000.00	0.75

		63			
4	209959	20 贴现国债 59	75,000	7,456,500.00	0.75
5	209964	20 贴现国债 64	75,000	7,410,750.00	0.75

#### 8.7 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。

#### 8.8 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。

#### 8.9 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。

#### 8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

无。

#### 8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

无。

#### 8.12 投资组合报告附注

##### 8.12.1 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中的 18 国开 03 (180203.IB)、16 国开 06 (160206.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。

##### 8.12.2 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。

##### 8.12.3 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	710,901.85
2	应收证券清算款	331,968.16

3	应收股利	-
4	应收利息	565,369.96
5	应收申购款	225,980.10
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	1,834,220.07

#### 8.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

无。

#### 8.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

无。

#### 8.12.6 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。

## § 9 基金份额持有人信息

### 9.1 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（%）
大成睿享混合 A	14,981	54,101.85	53,953,685.35	6.66	756,546,086.45	93.34
大成睿享混合 C	3,887	12,885.15	104,733.92	0.21	49,979,852.38	99.79
合	18,868	45,610.79	54,058,419.27	6.28	806,525,938.83	93.72

计						
---	--	--	--	--	--	--

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。

### 9.2 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	大成睿享混合 A	2,275,259.76	0.2807
	大成睿享混合 C	196,613.34	0.3926
	合计	2,471,873.10	0.2872

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）。

### 9.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

项目	份额级别	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和部门负责人持有本开放式基金	大成睿享混合 A	>100
	大成睿享混合 C	10~50
	合计	>100
本基金基金经理持有本开放式基金	大成睿享混合 A	0
	大成睿享混合 C	0
	合计	0

### 9.4 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理本人及其直系亲属持有本人管理的产品情况

无。

## § 10 开放式基金份额变动

单位：份

项目	大成睿享混合 A	大成睿享混合 C
基金合同生效日（2019 年 12 月 30 日）基金份额总额	5,127,950,417.21	293,998,883.85
本报告期期初基金份	5,127,950,417.21	293,998,883.85

额总额		
本报告期基金总申购份额	251,731,146.26	44,588,760.49
减：本报告期基金总赎回份额	4,569,181,791.67	288,503,058.04
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	810,499,771.80	50,084,586.30

## § 11 重大事件揭示

### 11.1 基金份额持有人大会决议

无。

### 11.2 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

1. 2020 年 12 月 28 日, 经大成基金管理有限公司 2020 年第一次临时股东会审议通过, 选举林昌先生担任公司股东董事, 翟斌先生不再担任公司股东董事。

2. 2020 年 12 月 28 日, 经大成基金管理有限公司第七届董事会第八次会议审议通过, 选举林昌先生担任公司第七届董事会副董事长, 同时, 选举其担任第七届董事会合规与风险管理委员会委员, 第七届董事会审计委员会委员。翟斌先生不再担任公司第七届董事会副董事长、第七届董事会合规与风险管理委员会委员、第七届董事会审计委员会委员。

上述变更详见公司相关公告。

#### 二、基金托管人的基金托管部门的重大人事变动

2020 年 8 月, 中国农业银行总行决定刘琳任托管业务部副总裁。

### 11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

无。

### 11.4 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。

### 11.5 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), 本年度应支付的审计费用为 12 万元整。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。

### 11.6 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。

### 11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

#### 11.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
光大证券	2	1,701,520,377.50	22.35%	1,495,923.34	21.73%	-
中泰证券	2	1,104,420,028.53	14.51%	1,006,437.41	14.62%	-
海通证券	1	675,756,031.99	8.88%	615,845.67	8.95%	-
兴业证券	2	582,217,714.50	7.65%	530,566.06	7.71%	-
安信证券	1	510,873,378.88	6.71%	465,574.83	6.76%	-
天风证券	2	409,287,757.60	5.38%	372,978.93	5.42%	-
中信建投	2	403,423,412.74	5.30%	367,641.46	5.34%	-
广发证券	2	372,538,927.62	4.89%	339,513.19	4.93%	-
招商证券	2	354,086,652.54	4.65%	322,675.78	4.69%	-
华西证券	1	290,099,198.23	3.81%	264,386.72	3.84%	-
国泰君安	3	279,141,214.54	3.67%	254,380.45	3.70%	-
申万宏源	2	175,850,508.81	2.31%	160,253.11	2.33%	-
中信证券	2	170,890,975.24	2.24%	155,718.07	2.26%	-
中金公司	3	168,374,722.76	2.21%	153,441.24	2.23%	-
国盛证券	1	114,473,884.63	1.50%	104,322.87	1.52%	-
西部证券	1	113,362,838.69	1.49%	103,302.63	1.50%	-
联讯证券	1	98,185,360.59	1.29%	89,493.13	1.30%	-
瑞银证券	2	88,900,823.68	1.17%	81,018.67	1.18%	-
爱建证券	1	-	-	-	-	-

川财证券	1	-	-	-	-	-
第一创业	1	-	-	-	-	-
东北证券	2	-	-	-	-	-
东方证券	1	-	-	-	-	-
东吴证券	1	-	-	-	-	-
东兴证券	1	-	-	-	-	-
方正证券	1	-	-	-	-	-
高华证券	1	-	-	-	-	-
国金证券	2	-	-	-	-	-
国信证券	1	-	-	-	-	-
红塔证券	1	-	-	-	-	-
华创证券	1	-	-	-	-	-
华泰证券	1	-	-	-	-	-
民生证券	1	-	-	-	-	-
南京证券	1	-	-	-	-	-
平安证券	1	-	-	-	-	-
山西证券	1	-	-	-	-	-
上海证券	1	-	-	-	-	-
世纪证券	1	-	-	-	-	-
万和证券	1	-	-	-	-	-
西藏东财	1	-	-	-	-	-
湘财证券	1	-	-	-	-	-
信达证券	1	-	-	-	-	-
浙商证券	1	-	-	-	-	-
银河证券	4	-	-	-	-	-
中银国际	1	-	-	-	-	-
中原证券	1	-	-	-	-	-

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：

本报告期内增加交易单元：信达证券；

本报告期内退租交易单元：长城证券。

### 11.7.2 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
光大证券	32,046,624.60	25.83%	1,000,000,000.00	19.83%	-	-
中泰证券	21,021,019.86	16.94%	1,989,700,000.00	39.46%	-	-
兴业证券	3,499,810.00	2.82%	2,052,000,000.00	40.70%	-	-
安信证券	47,423,220.40	38.22%	-	-	-	-
华西证券	20,086,000.00	16.19%	-	-	-	-

### 11.8 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	关于再次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	2020年12月31日
2	大成基金管理有限公司关于提示泰诚财富基金销售（大连）有限公司代销客户及时办理转托管业务的公告	中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站	2020年12月17日
3	大成睿享混合型证券投资基金招募说明书更新	中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站	2020年12月2日

4	大成睿享混合型证券投资基金托管协议更新	中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站	2020 年 12 月 2 日
5	大成睿享混合型证券投资基金基金合同更新	中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站	2020 年 12 月 2 日
6	大成睿享混合型证券投资基金基金产品资料概要更新	中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站	2020 年 12 月 2 日
7	大成睿享混合型证券投资基金基金产品资料概要更新	中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站	2020 年 12 月 2 日
8	关于调整旗下部分基金投资范围、增加侧袋机制并相应修改法律文件的公告	中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站	2020 年 12 月 1 日
9	大成睿享混合型证券投资基金第三季度报告	中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站	2020 年 10 月 28 日
10	大成睿享混合型证券投资基金基金产品资料概要更新	中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站	2020 年 8 月 27 日
11	大成睿享混合型证券投资基金基金产品资料概要更新	中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站	2020 年 8 月 27 日
12	大成睿享混合型证券投资基金中期报告	中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站	2020 年 8 月 28 日
13	大成基金管理有限公司关于旗下部分基金增加北京汇成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	2020 年 8 月 19 日
14	大成睿享混合型证券投资基金第二季度报告	中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站	2020 年 7 月 21 日
15	大成基金管理有限公司关于旗下部分基金增加重庆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	2020 年 7 月 13 日
16	关于再次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	2020 年 7 月 1 日
17	大成基金管理有限公司关于旗下部分基金增加中国人寿保险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	2020 年 5 月 22 日
18	大成基金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	中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本	2020 年 4 月 25 日

	的公告	公司网站	
19	大成睿享混合 2020 年第一季度报告	中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站	2020 年 4 月 21 日
20	大成基金管理有限公司关于旗下部分基金增加浙江绍兴瑞丰农村商业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	2020 年 3 月 30 日
21	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	中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站	2020 年 3 月 25 日
22	大成基金管理有限公司关于注销南京分公司的公告	中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站	2020 年 3 月 21 日
23	大成基金管理有限公司关于注销青岛分公司的公告	中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站	2020 年 2 月 29 日
24	大成基金关于 APP 交易平台汇款交易费率优惠的公告	中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站	2020 年 2 月 26 日
25	大成睿享混合基金开放日常申购（赎回、转换、定期定额投资）业务公告	中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站	2020 年 2 月 7 日
26	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	中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站	2020 年 1 月 30 日

## § 12 影响投资者决策的其他重要信息

### 12.1 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。

### 12.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

## § 13 备查文件目录

### 13.1 备查文件目录

- 1、中国证监会批准设立大成睿享混合型证券投资基金的文件；
- 2、《大成睿享混合型证券投资基金基金合同》；
- 3、《大成睿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。

### 13.2 存放地点

备查文件存放在本基金管理人和托管人的住所。

### 13.3 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 3 月 30 日