

大成国企改革灵活配置混合型证券投资基金

2021 年中期报告

2021 年 6 月 30 日

基金管理人：大成基金管理有限公司

基金托管人：中国银行股份有限公司

送出日期：2021 年 8 月 31 日

§ 1 重要提示及目录

1.1 重要提示

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

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

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

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

本报告财务资料未经审计。

本报告期自 2021 年 01 月 01 日起至 06 月 30 日止。

1.2 目录

§ 1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
§ 2 基金简介	5
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人和基金托管人	5
2.4 信息披露方式	5
2.5 其他相关资料	6
§ 3 主要财务指标和基金净值表现	6
3.1 主要会计数据和财务指标	6
3.2 基金净值表现	6
§ 4 管理人报告	7
4.1 基金管理人及基金经理情况	7
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	13
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
§ 5 托管人报告	14
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
§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）	14
6.1 资产负债表	14
6.2 利润表	16
6.3 所有者权益（基金净值）变动表	17
6.4 报表附注	18
§ 7 投资组合报告	34
7.1 期末基金资产组合情况	34
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	34
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	35
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	36
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	40
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	40

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	40
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	41
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	41
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明	41
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	41
7.12 投资组合报告附注	41
§ 8 基金份额持有人信息	42
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	42
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	42
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	42
§ 9 开放式基金份额变动	42
§ 10 重大事件揭示	42
10.1 基金份额持有人大会决议	42
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	43
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	43
10.4 基金投资策略的改变	43
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	43
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	43
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	43
10.8 其他重大事件	45
§ 11 影响投资者决策的其他重要信息	47
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	47
11.2 影响投资者决策的其他重要信息	47
§ 12 备查文件目录	47
12.1 备查文件目录	47
12.2 存放地点	47
12.3 查阅方式	47

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	大成国企改革灵活配置混合型证券投资基金
基金简称	大成国企改革灵活配置混合
基金主代码	002258
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2017 年 9 月 21 日
基金管理人	大成基金管理有限公司
基金托管人	中国银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	41,784,787.66 份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金的投资目标是通过与国企改革相关的优质上市公司，在严格控制风险的前提下，力争获取超越业绩比较基准的收益。
投资策略	本基金通过对宏观经济环境、国家经济政策、股票市场风险、债券市场整体收益率曲线变化和资金供求关系等因素的分析，研判经济周期在美林投资时钟理论所处的阶段，综合评价各类资产的市场趋势、预期风险收益水平和配置时机。在此基础上，本基金将积极、主动地确定权益类资产、固定收益类资产和现金等各类资产的配置比例并进行实时动态调整。
业绩比较基准	沪深 300 指数收益率×60%+ 中债综合指数收益率×40%
风险收益特征	本基金是混合型基金，其预期收益及风险水平低于股票型基金，高于货币市场基金与债券型基金。

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	中国银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	赵冰	许俊
	联系电话	0755-83183388	010-66594319
	电子邮箱	office@dcfund.com.cn	fcid@bankofchina.com
客户服务电话		4008885558	95566
传真		0755-83199588	010-66594942
注册地址		深圳市福田区深南大道 7088 号招商银行大厦 32 层	北京市西城区复兴门内大街 1 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 1 号
邮政编码		518040	100818
法定代表人		吴庆斌	刘连舸

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《上海证券报》
登载基金中期报告正文的管理人互联网网	www.dcfund.com.cn

址	
基金中期报告备置地点	基金管理人及基金托管人住所

2.5 其他相关资料

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

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2021年1月1日-2021年6月30日)
本期已实现收益	23,507,403.09
本期利润	17,199,139.77
加权平均基金份额本期利润	0.5605
本期加权平均净值利润率	26.03%
本期基金份额净值增长率	28.66%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2021年6月30日)
期末可供分配利润	62,866,953.49
期末可供分配基金份额利润	1.5045
期末基金资产净值	104,651,741.15
期末基金份额净值	2.505
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2021年6月30日)
基金份额累计净值增长率	150.50%

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

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

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

3.2 基金净值表现

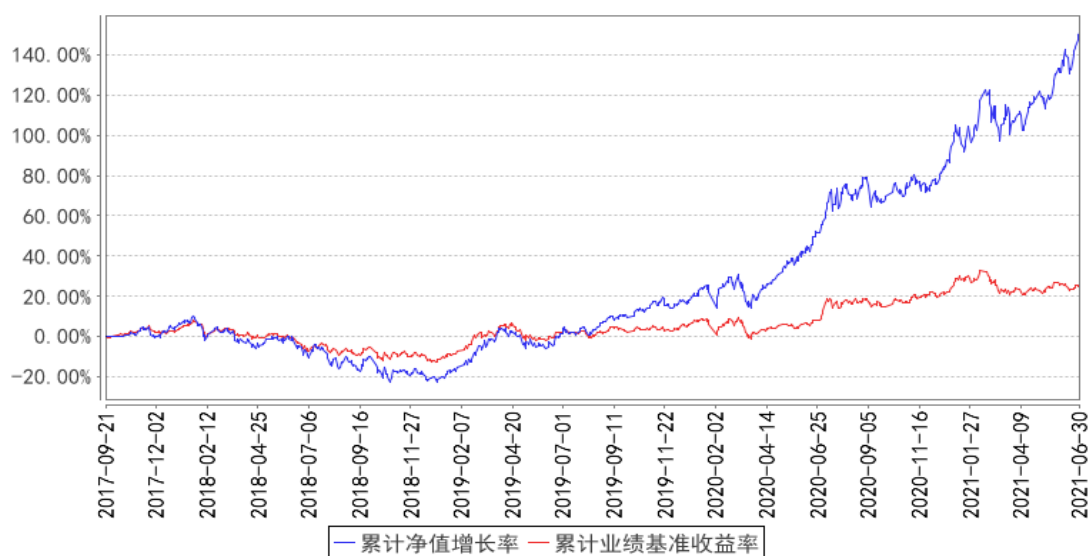
3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去一个月	7.74%	1.27%	-1.22%	0.48%	8.96%	0.79%

过去三个月	21.54%	1.18%	2.33%	0.59%	19.21%	0.59%
过去六个月	28.66%	1.59%	0.65%	0.79%	28.01%	0.80%
过去一年	62.14%	1.50%	15.09%	0.80%	47.05%	0.70%
过去三年	167.34%	1.39%	31.41%	0.81%	135.93%	0.58%
自基金合同生效起至今	150.50%	1.32%	25.33%	0.78%	125.17%	0.54%

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

大成国企改革灵活配置混合累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



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

§ 4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

大成基金管理有限公司经中国证监会证监基金字[1999]10号文批准，于1999年4月12日正

式成立，是中国证监会批准成立的首批十家基金管理公司之一，注册资本 2 亿元人民币，注册地广东省深圳市。目前公司由三家股东组成，分别为中泰信托有限责任公司(50%)、光大证券股份有限公司(25%)、中国银河投资管理有限公司(25%)。主要业务是公募基金的募集、销售和管理，还具有全国社保基金投资管理、基本养老保险投资管理、受托管理保险资金、保险保障基金投资管理、特定客户资产管理和 QDII 业务资格。

经过二十二年的稳健发展，公司形成了强大稳固的综合实力。公司旗下基金产品齐全、风格多样，构建了涵盖股票型基金、混合型基金、指数型基金、债券型基金和货币市场基金的完备产品线。截至 2021 年 6 月 30 日，本基金管理人共管理 9 只 ETF 及 3 只 ETF 联接基金，8 只 QDII 基金及 107 只开放式证券投资基金。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
孙丹	本基金基金经理助理	2020 年 7 月 6 日	-	13 年	经济学硕士。2008 年至 2012 年任景顺长城产品开发部产品经理。2012 年至 2014 年任华夏基金机构债券投资部研究员。2014 年 5 月加入大成基金管理有限公司，曾担任固定收益总部信用策略及宏观利率研究员、大成景辉灵活配置混合型证券投资基金、大成景荣保本混合型证券投资基金、大成景兴信用债债券型证券投资基金、大成景秀灵活配置混合型证券投资基金、大成景源灵活配置混合型证券投资基金基金经理助理，现任固定收益总部总监助理。2018 年 3 月 12 日起任大成策略回报混合型证券投资基金、大成创新成长混合型证券投资基金（LOF）、大成积极成长混合型证券投资基金、大成精选增值混合型证券投资基金、大成景阳领先混合型证券投资基金、大成竞争优势混合型证券投资基金、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

				<p>混合型证券投资基金、大成灵活配置混合型证券投资基金、大成产业升级股票型证券投资基金 (LOF)、大成健康产业混合型证券投资基金、大成正向回报灵活配置混合型证券投资基金、大成国家安全主题灵活配置混合型证券投资基金、大成新锐产业混合型证券投资基金、大成消费主题混合型证券投资基金基金经理助理。2020 年 11 月 6 日起任大成科技消费股票型证券投资基金、大成科创主题 3 年封闭运作灵活配置混合型证券投资基金、大成中小盘混合型证券投资基金 (LOF)、大成睿享混合型证券投资基金、大成行业先锋混合型证券投资基金基金经理助理。2021 年 2 月 1 日起任大成企业能力驱动混合型证券投资基金、大成优选升级一年持有期混合型证券投资基金、大成成长进取混合型证券投资基金基金经理助理。2021 年 2 月 22 日起任大成恒享春晓一年定期开放混合型证券投资基金基金经理助理。2021 年 4 月 19 日起任大成民稳增长混合型证券投资基金、大成恒享混合型证券投资基金基金经理助理。2021 年 7 月 29 日起任大成产业趋势混合型证券投资基金、大成投资严选六个月持有期混合型证券投资基金基金经理助理。2017 年 5 月 8 日起任大成景尚灵活配置混合型证券投资基金、大成景兴信用债债券型证券投资基金基金经理。2017 年 5 月 8 日至 2019 年 10 月 31 日任大成景荣债券型证券投资基金 (原大成景荣保本混合型证券投资基金转型) 基金经理。2017 年 5 月 31 日至 2020 年 10 月 20 日任大成惠裕定期开放纯债债券型证券投资基金基金经理。2017 年 6 月 2 日至 2018 年 11 月 19 日任大成景禄灵活配置混合型证券投资基金基金经理。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</p>
--	--	--	--	---

					<p>日任大成景沛灵活配置混合型证券投资基金基金经理。2018年3月14日至2018年7月20日任大成景裕灵活配置混合型证券投资基金基金经理。2018年3月14日起任大成财富管理 2020 生命周期证券投资基金基金经理。2019年7月31日至2020年5月23日任大成景丰债券型证券投资基金（LOF）基金经理。2020年2月27日至2021年4月13日任大成景泰纯债债券型证券投资基金基金经理。2020年3月5日至2021年4月14日任大成恒享混合型证券投资基金基金经理。2020年3月31日至2021年4月14日任大成民稳增长混合型证券投资基金基金经理。2020年4月26日起任大成景瑞稳健配置混合型证券投资基金基金经理。2020年8月21日至2021年5月18日任大成景和债券型证券投资基金基金经理。2020年9月3日起任大成汇享一年持有期混合型证券投资基金基金经理。2020年9月23日起任大成尊享18个月定期开放混合型证券投资基金基金经理。2020年11月16日起任大成卓享一年持有期混合型证券投资基金基金经理。2020年11月18日起任大成丰享回报混合型证券投资基金基金经理。2021年4月22日起任大成安享得利六个月持有期混合型证券投资基金基金经理。具有基金从业资格。国籍：中国</p>
张 家 旺	本基金基金经理助理	2021年1月6日	-	5.0年	<p>工程硕士。2016年7月加入大成基金管理有限公司，现任研究部研究员。2020年10月19日起任大成创新成长混合型证券投资基金（LOF）、大成高新技术产业股票型证券投资基金、大成优势企业混合型证券投资基金、大成睿裕六个月持有期股票型证券投资基金、大成睿鑫股票型证券投资基金基金经理助理。2021年1月6日起任大成国企改革灵活配置混合型证券投资基金基金经理助理。具有基金从业资格。国籍：中国</p>
韩 创	本基金基金经理	2021年1月13日	-	9年	<p>经济学硕士。2012年6月至2015年6月曾任招商证券研发中心研究员。2015年6月加入大成基金管理有限公司，曾担任研究部研究员、股票投资部基金经理，现任研究部总监助理。2019年1月10日至2020年2月3日任大成消费主题混合型证券投资</p>

					资基金基金经理。2019 年 1 月 10 日起任大成新锐产业混合型证券投资基金基金经理。2020 年 1 月 2 日起任大成睿景灵活配置混合型证券投资基金基金经理。2021 年 1 月 13 日起任大成国企改革灵活配置混合型证券投资基金基金经理。2021 年 2 月 9 日起任大成产业趋势混合型证券投资基金基金经理。2021 年 6 月 30 日起任大成核心趋势混合型证券投资基金基金经理。具有基金从业资格。国籍：中国
张焯	本基金基金经理	2017 年 9 月 26 日	2021 年 5 月 26 日	11 年	经济学硕士。2010 年 3 月至 2011 年 9 月任鹏华基金管理有限公司研究部研究员。2011 年 9 月加入大成基金管理有限公司，曾担任研究部研究员、基金经理助理。2017 年 9 月 26 日至 2021 年 5 月 26 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。2019 年 9 月 29 日起任大成内需增长混合型证券投资基金基金经理。2021 年 5 月 24 日起任大成消费精选股票型证券投资基金基金经理。具有基金从业资格。国籍：中国

注：1、任职日期、离任日期为本基金管理人作出决定之日。

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

4.1.3 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理同时管理的产品情况

无

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

报告期内，本基金管理人严格遵守《证券法》、《证券投资基金法》等有关法律法规及基金合同、基金招募说明书等有关基金法律文件的规定，以取信于市场、取信于社会投资公众为宗旨，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在规范基金运作和严格控制投资风险的前提下，为基金份额持有人谋求最大利益，无损害基金份额持有人利益的行为。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

报告期内，基金管理人严格执行了公平交易的原则和制度。基金管理人运用统计分析方法和工具，对旗下所有投资组合间连续 4 个季度的日内、3 日内及 5 日内股票及债券交易同向交易价差进行分析。分析结果表明：债券交易同向交易频率较低；部分股票同向交易溢价率较大主要来源于市场因素（如个股当日价格振幅较高）及组合经理交易时机选择，即投资组合成交时间不一致以及成交价格的日内较大变动导致个别些组合间的成交价格差异较大，但结合交易价差专项统

计分析，未发现违反公平交易原则的异常情况。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

报告期内，基金管理人旗下所有投资组合未发现存在异常交易行为。主动投资组合间股票交易不存在同日反向交易。主动型投资组合与指数型投资组合之间或指数型投资组合之间存在股票同日反向交易，但不存在参与交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量超过该股当日成交量 5% 的情形；主动投资组合间债券交易存在 2 笔同日反向交易，原因为流动性需要。投资组合间相邻交易日反向交易的市场成交比例、成交均价等交易结果数据表明该类交易不对市场产生重大影响，无异常。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

回顾 2021 年上半年，我们亲身经历了近几年一个最强趋势的终结。自 2016 年以来，伴随外资的不断进入，价值投资的理念变得从来没有过的流行。然而，大部分投资者与其说是皈依于价值投资，倒不如说是皈依于茅指数永远涨的趋势。到了后期，为了解释茅指数的超高估值，投资者们发明了终局思维、赛道思维等诸多理论，在茅指数们看起来强大的护城河面前，它们远期的终局似乎是不言自明的。因此从现金流折现的角度来看，只要远期的确定性足够高，则当前无论多高的估值都是合理的。而现在，大部分投资者又恍然大悟似地意识到，看起来确定性很高的终局，其实潜藏着太多的不确定性。

我们也想找到一个能够预言未来的水晶球，去洞穿历史发展的重重迷雾。然而，我们从来就不认为，这种水晶球是轻易可得的，或者是人人可得的。历史早就无数次证明，具备高度洞察力的头脑是极度稀缺的。我们坦然承认自己目前也尚不具备这样的洞察能力，但正是因为我们能够坦诚地面对自己和客户，所以我们至少不会让自己陷入到相应的风险之中。

春节之后，伴随着茅指数的逐步暗淡，新能源板块快速崛起。市场和部分投资者迅速地从过度强调护城河，强调终局思维，转换为对当期利润增速的高度关注。至此，赛道投资更臻于极致。在产业变革的大时代，如何在合适的风险水平下，捕捉到真正能给投资者带来明显收益的机会，也是我们一直在研究的课题。但毫无疑问的是，我们不会去做市场的跟风者，不会在市场捉摸不定的情绪中沉浮。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末本基金份额净值为 2.505 元；本报告期基金份额净值增长率为 28.66%，业绩比较基准收益率为 0.65%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望 2021 年下半年，我们仍然认为通胀是一条值得重视的主线。需求的逐步复苏，叠加上供给的诸多限制，通胀其实已经在很多行业中显现，只是大家对于它们的持续性存在很大分歧。我们认为，在目前这样前所未遇的大历史阶段，可能我们需要对以往的一些思维定势保持一定的警惕，并在独立思考和观察中去接近真相。

每一份申购都是真金白银的信任投票，我们非常感谢基金持有人的信任。我们将始终保持如履薄冰、独立审慎的工作态度，在控制好风险的前提下，为投资人争取更高的投资回报。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

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

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

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

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

的债券品种的估值数据和流通受限股票的折扣率数据。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

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

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

无。

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内，中国银行股份有限公司（以下称“本托管人”）在大成国企改革灵活配置混合型证券投资基金（以下称“本基金”）的托管过程中，严格遵守《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，完全尽职尽责地履行了应尽的义务。

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

本报告期内，本托管人根据《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规定，对本基金管理人的投资运作进行了必要的监督，对基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算以及基金费用开支等方面进行了认真地复核，未发现本基金管理人存在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

本报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告（注：财务会计报告中的“金融工具风险及管理”、“关联方承销证券”、“关联方证券出借”部分未在托管人复核范围内）、投资组合报告等数据真实、准确和完整。

§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：大成国企改革灵活配置混合型证券投资基金

报告截止日：2021 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2021 年 6 月 30 日	上年度末 2020 年 12 月 31 日
资产：			
银行存款	6.4.3.1	9,070,530.21	6,148,601.30

结算备付金		324,012.32	-
存出保证金		21,114.23	14,927.64
交易性金融资产	6.4.3.2	89,345,179.15	48,460,273.73
其中：股票投资		89,311,179.15	48,439,797.75
基金投资		-	-
债券投资		34,000.00	20,475.98
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	6.4.3.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.3.4	-	-
应收证券清算款		-	169,563.18
应收利息	6.4.3.5	908.82	628.87
应收股利		-	-
应收申购款		9,030,334.40	54,903.65
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.3.6	-	-
资产总计		107,792,079.13	54,848,898.37
负债和所有者权益	附注号	本期末 2021年6月30日	上年度末 2020年12月31日
负 债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.3.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		2,103,699.47	-
应付赎回款		520,479.70	25,353.17
应付管理人报酬		102,987.14	66,441.99
应付托管费		17,164.54	11,073.66
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.3.7	216,434.23	15,447.36
应交税费		-	-
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.3.8	179,572.90	160,045.57
负债合计		3,140,337.98	278,361.75
所有者权益：			
实收基金	6.4.3.9	41,784,787.66	28,023,723.05
未分配利润	6.4.3.10	62,866,953.49	26,546,813.57
所有者权益合计		104,651,741.15	54,570,536.62
负债和所有者权益总计		107,792,079.13	54,848,898.37

注：报告截止日 2021 年 06 月 30 日，基金份额净值 2.505 元，基金份额总额 41,784,787.66 份。

6.2 利润表

会计主体：大成国企改革灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期	上年度可比期间
		2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日	2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日
一、收入		18,527,382.99	19,834,589.14
1. 利息收入		15,845.17	27,917.27
其中：存款利息收入	6.4.3.11	15,841.37	27,917.27
债券利息收入		3.80	-
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	-
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		24,714,821.90	18,813,250.41
其中：股票投资收益	6.4.3.12	24,074,884.89	18,438,392.41
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.3.13	4,843.35	-
资产支持证券投资收益	6.4.3.13.2	-	-
贵金属投资收益	6.4.3.14	-	-
衍生工具收益	6.4.3.15	-	-
股利收益	6.4.3.16	635,093.66	374,858.00
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.3.17	-6,308,263.32	928,321.71
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.3.18	104,979.24	65,099.75
减：二、费用		1,328,243.22	1,172,130.73
1. 管理人报酬	6.4.6.2.1	487,903.17	603,842.96
2. 托管费	6.4.6.2.2	81,317.22	100,640.51
3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用	6.4.3.19	687,835.96	366,018.17
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 税金及附加		-	-
7. 其他费用	6.4.3.20	71,186.87	101,629.09

三、利润总额(亏损总额以“-”号填列)		17,199,139.77	18,662,458.41
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		17,199,139.77	18,662,458.41

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：大成国企改革灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益(基金净值)	28,023,723.05	26,546,813.57	54,570,536.62
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	17,199,139.77	17,199,139.77
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)	13,761,064.61	19,121,000.15	32,882,064.76
其中：1. 基金申购款	26,346,051.14	33,261,624.38	59,607,675.52
2. 基金赎回款	-12,584,986.53	-14,140,624.23	-26,725,610.76
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)	41,784,787.66	62,866,953.49	104,651,741.15
项目	上年度可比期间 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益(基金净值)	94,859,120.11	19,485,470.94	114,344,591.05
二、本期经营活	-	18,662,458.41	18,662,458.41

动产生的基金净值变动数（本期利润）			
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	-47,405,720.01	-12,272,656.20	-59,678,376.21
其中：1. 基金申购款	3,633,714.69	1,118,545.64	4,752,260.33
2. 基金赎回款	-51,039,434.70	-13,391,201.84	-64,430,636.54
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）	47,453,400.10	25,875,273.15	73,328,673.25

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署：

谭晓冈

周立新

刘亚林

基金管理人负责人

主管会计工作负责人

会计机构负责人

6.4 报表附注

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

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

6.4.2 税项

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。

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 2018 年 1 月 1 日起产生的利息及利息性质的收入为销售额。资管产品管理人运营资管产品转让 2017 年 12 月 31 日前取得的非货物期货，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非货物期货结算价格作为买入价计算销售额。

(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。

6.4.3 重要财务报表项目的说明

6.4.3.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 6 月 30 日
活期存款	9,070,530.21
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	9,070,530.21

6.4.3.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 6 月 30 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	76,632,465.03	89,311,179.15	12,678,714.12
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	34,000.00	34,000.00
	银行间市场	-	-
	合计	34,000.00	34,000.00
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	76,666,465.03	89,345,179.15	12,678,714.12

6.4.3.3 衍生金融资产/负债

无。

6.4.3.4 买入返售金融资产

6.4.3.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

无。

6.4.3.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

无。

6.4.3.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 6 月 30 日
应收活期存款利息	765.83
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	131.31
应收债券利息	3.13
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	8.55
合计	908.82

6.4.3.6 其他资产

无。

6.4.3.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2021年6月30日
交易所市场应付交易费用	216,434.23
银行间市场应付交易费用	-
合计	216,434.23

6.4.3.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2021年6月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	65.53
应付证券出借违约金	-
预提费用	179,507.37
合计	179,572.90

6.4.3.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	28,023,723.05	28,023,723.05
本期申购	26,346,051.14	26,346,051.14
本期赎回（以“-”号填列）	-12,584,986.53	-12,584,986.53
- 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	41,784,787.66	41,784,787.66

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

6.4.3.10 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	23,546,854.52	2,999,959.05	26,546,813.57
本期利润	23,507,403.09	-6,308,263.32	17,199,139.77
本期基金份额交易产生的变动数	24,772,060.88	-5,651,060.73	19,121,000.15
其中：基金申购款	43,819,912.13	-10,558,287.75	33,261,624.38
基金赎回款	-19,047,851.25	4,907,227.02	-14,140,624.23
本期已分配利润	-	-	-
本期末	71,826,318.49	-8,959,365.00	62,866,953.49

6.4.3.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期
	2021年1月1日至2021年6月30日
活期存款利息收入	13,201.50
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	-
结算备付金利息收入	2,497.49
其他	142.38
合计	15,841.37

6.4.3.12 股票投资收益

单位：人民币元

项目	本期
	2021年1月1日至2021年6月30日
卖出股票成交总额	221,783,865.17
减：卖出股票成本总额	197,708,980.28
买卖股票差价收入	24,074,884.89

6.4.3.13 债券投资收益

6.4.3.13.1 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期
	2021年1月1日至2021年6月30日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	20,946.10
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	16,100.00
减：应收利息总额	2.75
买卖债券差价收入	4,843.35

6.4.3.13.2 资产支持证券投资收益

无。

6.4.3.14 贵金属投资收益

无。

6.4.3.15 衍生工具收益

6.4.3.15.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

无。

6.4.3.15.2 衍生工具收益——其他投资收益

无。

6.4.3.16 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月30日
股票投资产生的股利收益	635,093.66
其中：证券出借权益补偿收入	-
基金投资产生的股利收益	-
合计	635,093.66

6.4.3.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2021年1月1日至2021年6月30日
1. 交易性金融资产	-6,308,263.32
股票投资	-6,303,887.34
债券投资	-4,375.98
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	-6,308,263.32
----	---------------

6.4.3.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
基金赎回费收入	99,267.53
基金转换费收入	5,711.71
合计	104,979.24

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，其中将不低于转出基金的赎回费的 25% 归入转出基金的基金资产。

6.4.3.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
交易所市场交易费用	687,835.96
银行间市场交易费用	-
合计	687,835.96

6.4.3.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
审计费用	19,835.79
信息披露费	39,671.58
证券出借违约金	-
银行划款手续费	2,679.50
账户维护费	9,000.00
合计	71,186.87

6.4.3.21 分部报告

无。

6.4.4 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.4.1 或有事项

无。

6.4.4.2 资产负债表日后事项

无。

6.4.5 关联方关系

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

本基金本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

6.4.5.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
大成基金管理有限公司(“大成基金”)	基金管理人、基金销售机构、注册登记机构
中国银行股份有限公司(“中国银行”)	基金托管人、基金销售机构
光大证券股份有限公司(“光大证券”)	基金管理人的股东

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。

6.4.6 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.6.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.6.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2021年1月1日至2021年6月30日		上年度可比期间 2020年1月1日至2020年6月30日	
	成交金额	占当期股票 成交总额的比例 (%)	成交金额	占当期股票 成交总额的比例(%)
光大证券	42,137,817.68	9.04	30,261,164.79	13.68

6.4.6.1.2 债券交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2021年1月1日至2021年6月30日		上年度可比期间 2020年1月1日至2020年6月30日	
	成交金额	占当期债券 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	20,946.10	100.00	-	-

6.4.6.1.3 债券回购交易

无。

6.4.6.1.4 权证交易

无。

6.4.6.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2021年1月1日至2021年6月30日			
	当期 佣金	占当期佣金总量 的比例 (%)	期末应付佣金余 额	占期末应付佣金 总额的比例 (%)
光大证券	38,397.73	9.04	-	-
关联方名称	上年度可比期间 2020年1月1日至2020年6月30日			
	当期 佣金	占当期佣金总量 的比例 (%)	期末应付佣金余 额	占期末应付佣金 总额的比例 (%)
光大证券	27,581.12	13.68	-	-

注：1. 上述佣金参考市场价格经本基金的基金管理人与对方协商确定。

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

6.4.6.2 关联方报酬

6.4.6.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6 月30日	上年度可比期间 2020年1月1日至2020年 6月30日
	当期发生的基金应支付的管理费	487,903.17
其中：支付销售机构的客户维护费	194,549.41	247,573.80

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 1.50%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：

日管理人报酬 = 前一日基金资产净值 × 1.50% / 当年天数。

6.4.6.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6 月30日	上年度可比期间 2020年1月1日至2020年 6月30日
	当期发生的基金应支付的托管费	81,317.22

注：支付基金托管人中国银行的托管费按前一日基金资产净值 0.25%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：

日托管费 = 前一日基金资产净值 × 0.25% / 当年天数。

6.4.6.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

无。

6.4.6.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

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

无。

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

无。

6.4.6.5 各关联方投资本基金的情况

6.4.6.5.1 报告期内基金管理人运用自有资金投资本基金的情况

份额单位：份

项目	本期 2021年1月1日至2021年6 月30日	上年度可比期间 2020年1月1日至2020 年6月30日
基金合同生效日(2017年9月21日)持有的基金份额	0.00	-
报告期初持有的基金份额	4,066,590.35	-
报告期内申购/买入总份额	0.00	-
报告期内因拆分变动份额	0.00	-
减:报告期内赎回/卖出总份额	0.00	-
报告期末持有的基金份额	4,066,590.35	-
报告期末持有的基金份额 占基金总份额比例	9.73%	-

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。

6.4.6.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

无。

6.4.6.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2021年1月1日至2021年6月30日		上年度可比期间 2020年1月1日至2020年6月30日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国银行	9,070,530.21	13,201.50	11,500,055.29	26,406.61

注：本基金由基金托管人保管的银行存款，按银行约定利率计息。

6.4.6.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

无。

6.4.6.8 其他关联交易事项的说明

无。

6.4.7 利润分配情况

无。

6.4.8 期末(2021年6月30日)本基金持有的流通受限证券

6.4.8.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

6.4.8.1.1 受限证券类别：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
113049	长汽转债	2021年6月10日	2021年7月8日	新债未上市	100.00	100.00	340	34,000.00	34,000.00	-

6.4.8.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

无。

6.4.8.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.8.3.1 银行间市场债券正回购

无。

6.4.8.3.2 交易所市场债券正回购

无。

6.4.8.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

无。

6.4.9 金融工具风险及管理

6.4.9.1 风险管理政策和组织架构

本基金属于混合型基金，其预期收益及风险水平低于股票基金，高于债券基金与货币市场基金，属于较高风险/收益特征的开放式基金。本基金投资的金融工具主要包括股票投资、债券投资及股指期货投资等。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通过投资于国企改革相关的优质上市公司，在严格控制风险的前提下，力争获取超越业绩比较基准的收益。

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

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

6.4.9.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息，导致基金资产损失和收益变化的风险。本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的活期银行存款存放在本基金的托管行中国农业银行，因而与银行存款相关的信用风险不重大。本基金在交易所进行的交易均以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，违约风险可能性很小；在银行间同

业市场进行交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式进行限制以控制相应的信用风险。

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

于本期末，本基金持有的除国债、央行票据和政策性金融债以外的债券占基金资产净值的比例为 0.03%(上年度末：0.04%)。

6.4.9.3 流动性风险

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

6.4.9.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

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

6.4.9.4 市场风险

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

6.4.9.4.1 利率风险

利率风险是指金融工具的公允价值或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。

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

6.4.9.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2021年6月30日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	9,070,530.21	-	-	-	9,070,530.21
结算备付金	324,012.32	-	-	-	324,012.32
存出保证金	21,114.23	-	-	-	21,114.23
交易性金融资产	-	-	34,000.00	89,311,179.15	89,345,179.15
应收利息	-	-	-	908.82	908.82
应收申购款	-	-	-	9,030,334.40	9,030,334.40
资产总计	9,415,656.76	-	34,000.00	98,342,422.37	107,792,079.13
负债					
应付赎回款	-	-	-	520,479.70	520,479.70
应付管理人报酬	-	-	-	102,987.14	102,987.14
应付托管费	-	-	-	17,164.54	17,164.54
应付证券清算款	-	-	-	2,103,699.47	2,103,699.47
应付交易费用	-	-	-	216,434.23	216,434.23
其他负债	-	-	-	179,572.90	179,572.90
负债总计	-	-	-	3,140,337.98	3,140,337.98
利率敏感度缺口	9,415,656.76	-	34,000.00	95,202,084.39	104,651,741.15
上年度末 2020年12月31日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计

资产					
银行存款	6,148,601.30	-	-	-	6,148,601.30
存出保证金	14,927.64	-	-	-	14,927.64
交易性金融资产	-	-	20,475.98	48,439,797.75	48,460,273.73
应收利息	-	-	-	628.87	628.87
应收申购款	-	-	-	54,903.65	54,903.65
应收证券清算款	-	-	-	169,563.18	169,563.18
资产总计	6,163,528.94	-	20,475.98	48,664,893.45	54,848,898.37
负债					
应付赎回款	-	-	-	25,353.17	25,353.17
应付管理人报酬	-	-	-	66,441.99	66,441.99
应付托管费	-	-	-	11,073.66	11,073.66
应付交易费用	-	-	-	15,447.36	15,447.36
其他负债	-	-	-	160,045.57	160,045.57
负债总计	-	-	-	278,361.75	278,361.75
利率敏感度缺口	6,163,528.94	-	20,475.98	48,386,531.70	54,570,536.62

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

6.4.9.4.1.2 利率风险的敏感性分析

于本期末，本基金持有的交易性债券投资公允价值占基金资产净值的比例为 0.03%(上年度末：0.04%)，因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响(上年度末：同)。

6.4.9.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无重大外汇风险。

6.4.9.4.3 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。

本基金采用自上而下与自下而上相结合的方法进行主动投资策略，以宏观经济和政策研究为基础，通过分析影响证券市场整体运行的内外部因素，进行自上而下的资产配置和组合管理，同时自下而上的精选各个行业中具有良好治理结构、在细分行业具有竞争优势以及有较高成长性的产业升级股票进行投资。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(包括融资买入股票)等权益类占基金资产的比例为 0%-95%，持有的融资买入股票与其他有价证券市值之和不超过基金资产净值的 95%，其中投资于国企改革主题相关的上市公司的比例不低于基金非现金资产的 80%；债券、货币市场工具、银行存款等固定收益类资产占基金资产比例不低于 5%；每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，保持现金(不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等)或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%；权证、股指期货及其他金融工具的投资比例依照法律法规或监管机构的规定执行。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。

6.4.9.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2021年6月30日		上年度末 2020年12月31日	
	公允价值	占基金资产净值比例(%)	公允价值	占基金资产净值比例(%)
交易性金融资产—股票投资	89,311,179.15	85.34	48,439,797.75	88.77
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产—贵金属投资	-	-	-	-
衍生金融资产—权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	89,311,179.15	85.34	48,439,797.75	88.77

6.4.9.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除业绩比较基准以外的其他市场变量保持不变		
相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额(单位：人民币元)		
	本期末(2021年6月30日)	上年度末(2020年12月31日)	
分析	1. 业绩比较基准上	7,400,870.34	3,982,244.87

	升 5%		
	2. 业绩比较基准下	-7,400,870.34	-3,982,244.87
	降 5%		

6.4.10 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

无。

§ 7 投资组合报告

7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	89,311,179.15	82.86
	其中：股票	89,311,179.15	82.86
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	34,000.00	0.03
	其中：债券	34,000.00	0.03
	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	9,394,542.53	8.72
8	其他各项资产	9,052,357.45	8.40
9	合计	107,792,079.13	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	832,662.00	0.80
C	制造业	79,346,828.69	75.82
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	4,662.00	0.00
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服	974,575.20	0.93

	务业		
J	金融业	34,721.10	0.03
K	房地产业	969,746.00	0.93
L	租赁和商务服务业	856,548.00	0.82
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	6,291,436.16	6.01
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	89,311,179.15	85.34

7.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

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	002088	鲁阳节能	359,600	8,267,204.00	7.90
2	600141	兴发集团	353,900	6,663,937.00	6.37
3	605098	行动教育	111,808	6,291,436.16	6.01
4	000683	远兴能源	1,050,100	4,903,967.00	4.69
5	002597	金禾实业	140,600	4,878,820.00	4.66
6	002154	报喜鸟	695,300	4,429,061.00	4.23
7	300138	晨光生物	271,200	4,149,360.00	3.96
8	002884	凌霄泵业	167,400	3,898,746.00	3.73
9	688668	鼎通科技	114,872	3,762,058.00	3.59
10	601677	明泰铝业	190,200	3,718,410.00	3.55
11	688269	凯立新材	25,675	3,582,176.00	3.42
12	601633	长城汽车	58,700	2,558,733.00	2.44
13	002092	中泰化学	246,000	2,526,420.00	2.41
14	000830	鲁西化工	133,300	2,496,709.00	2.39
15	002835	同为股份	195,100	2,444,603.00	2.34
16	300910	瑞丰新材	23,366	2,442,915.30	2.33
17	600063	皖维高新	455,300	2,331,136.00	2.23
18	600060	海信视像	132,900	2,246,010.00	2.15
19	300806	斯迪克	41,300	1,957,620.00	1.87
20	600399	抚顺特钢	100,000	1,814,000.00	1.73
21	300395	菲利华	37,500	1,808,250.00	1.73

22	002810	山东赫达	38,080	1,795,852.80	1.72
23	601058	赛轮轮胎	161,700	1,615,383.00	1.54
24	603587	地素时尚	63,900	1,591,749.00	1.52
25	300900	广联航空	32,600	1,218,588.00	1.16
26	000036	华联控股	208,100	969,746.00	0.93
27	688191	智洋创新	44,553	962,344.80	0.92
28	603100	川仪股份	53,600	938,536.00	0.90
29	688665	四方光电	6,561	893,280.15	0.85
30	603300	华铁应急	75,600	856,548.00	0.82
31	000983	山西焦煤	100,200	832,662.00	0.80
32	601566	九牧王	24,100	377,165.00	0.36
33	601528	瑞丰银行	2,230	34,721.10	0.03
34	001207	联科科技	682	22,581.02	0.02
35	001208	华菱线缆	1,754	13,558.42	0.01
36	603171	税友股份	637	12,230.40	0.01
37	605011	杭州热电	525	4,662.00	0.00

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	601677	明泰铝业	10,375,741.00	19.01
2	000683	远兴能源	9,558,977.00	17.52
3	601058	赛轮轮胎	8,897,657.00	16.30
4	002597	金禾实业	7,042,285.23	12.90
5	002884	凌霄泵业	6,484,982.74	11.88
6	002088	鲁阳节能	5,813,942.49	10.65
7	603300	华铁应急	5,703,953.80	10.45
8	000830	鲁西化工	5,445,890.00	9.98
9	300910	瑞丰新材	5,354,339.78	9.81
10	605098	行动教育	5,309,489.46	9.73
11	600141	兴发集团	5,245,865.00	9.61
12	603156	养元饮品	4,922,257.00	9.02
13	601899	紫金矿业	4,257,519.00	7.80
14	601166	兴业银行	4,126,126.00	7.56
15	600063	皖维高新	3,921,233.00	7.19
16	300138	晨光生物	3,917,599.51	7.18
17	688665	四方光电	3,872,282.01	7.10
18	600028	中国石化	3,672,491.00	6.73
19	688668	鼎通科技	3,657,184.04	6.70
20	600426	华鲁恒升	3,603,547.34	6.60
21	002154	报喜鸟	3,565,365.00	6.53

22	300087	荃银高科	3,443,883.00	6.31
23	603100	川仪股份	3,441,217.00	6.31
24	600256	广汇能源	3,210,968.00	5.88
25	000703	恒逸石化	3,173,241.49	5.81
26	002092	中泰化学	3,027,564.00	5.55
27	603587	地素时尚	2,955,727.84	5.42
28	002375	亚厦股份	2,918,269.73	5.35
29	600216	浙江医药	2,917,325.00	5.35
30	600691	阳煤化工	2,708,094.00	4.96
31	002221	东华能源	2,675,331.00	4.90
32	603601	再升科技	2,669,176.00	4.89
33	600096	云天化	2,668,711.00	4.89
34	300873	海晨股份	2,637,727.16	4.83
35	688191	智洋创新	2,637,210.84	4.83
36	601808	中海油服	2,581,027.84	4.73
37	002835	同为股份	2,579,375.00	4.73
38	601009	南京银行	2,539,379.00	4.65
39	300119	瑞普生物	2,511,084.00	4.60
40	002624	完美世界	2,509,034.84	4.60
41	002274	华昌化工	2,457,797.00	4.50
42	002258	利尔化学	2,312,618.00	4.24
43	300192	科德教育	2,197,388.00	4.03
44	601633	长城汽车	2,177,013.00	3.99
45	603000	人民网	2,152,457.00	3.94
46	000902	新洋丰	2,125,945.00	3.90
47	002142	宁波银行	2,124,649.00	3.89
48	002254	泰和新材	2,086,153.00	3.82
49	600486	扬农化工	2,066,445.00	3.79
50	300870	欧陆通	2,050,978.00	3.76
51	002236	大华股份	2,035,458.00	3.73
52	600060	海信视像	2,014,306.00	3.69
53	688269	凯立新材	1,967,725.32	3.61
54	300395	菲利华	1,686,272.00	3.09
55	600619	海立股份	1,626,502.14	2.98
56	002643	万润股份	1,601,755.00	2.94
57	600859	王府井	1,599,867.00	2.93
58	600845	宝信软件	1,577,372.00	2.89
59	601966	玲珑轮胎	1,525,990.00	2.80
60	300806	斯迪克	1,491,091.40	2.73
61	600399	抚顺特钢	1,480,820.00	2.71
62	688127	蓝特光学	1,450,227.32	2.66
63	300871	回盛生物	1,422,378.50	2.61

64	002381	双箭股份	1,355,654.00	2.48
65	002859	洁美科技	1,347,601.00	2.47
66	002824	和胜股份	1,337,319.00	2.45
67	603187	海容冷链	1,333,863.00	2.44
68	002312	川发龙蟒	1,296,990.00	2.38
69	300900	广联航空	1,289,556.00	2.36
70	600567	山鹰国际	1,272,799.00	2.33
71	002810	山东赫达	1,266,007.00	2.32
72	000011	深物业 A	1,235,115.00	2.26
73	002653	海思科	1,229,908.00	2.25
74	601918	新集能源	1,182,920.00	2.17
75	601699	潞安环能	1,146,429.30	2.10

注：本期累计买入金额按买入成交金额（成交单价乘以成交数量），不考虑相关交易费用。

7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	601058	赛轮轮胎	7,587,166.15	13.90
2	601677	明泰铝业	7,065,585.00	12.95
3	601888	中国中免	6,481,444.00	11.88
4	600519	贵州茅台	5,853,651.00	10.73
5	000683	远兴能源	5,703,761.00	10.45
6	603300	华铁应急	5,664,464.40	10.38
7	603156	养元饮品	5,124,152.29	9.39
8	300760	迈瑞医疗	4,931,234.95	9.04
9	000858	五粮液	4,689,255.25	8.59
10	688665	四方光电	4,613,553.11	8.45
11	601166	兴业银行	4,505,248.04	8.26
12	600426	华鲁恒升	4,260,813.00	7.81
13	601899	紫金矿业	4,240,183.23	7.77
14	300910	瑞丰新材	3,853,562.24	7.06
15	002624	完美世界	3,775,170.31	6.92
16	600028	中国石化	3,691,396.00	6.76
17	600256	广汇能源	3,304,487.00	6.06
18	300087	荃银高科	3,248,254.00	5.95
19	600096	云天化	2,743,135.00	5.03
20	600216	浙江医药	2,738,824.00	5.02
21	603100	川仪股份	2,725,345.00	4.99
22	300119	瑞普生物	2,714,356.00	4.97
23	600691	阳煤化工	2,704,126.00	4.96
24	002375	亚厦股份	2,700,551.00	4.95
25	300873	海晨股份	2,676,154.00	4.90

26	603601	再升科技	2,656,795.00	4.87
27	002884	凌霄泵业	2,635,568.00	4.83
28	000830	鲁西化工	2,635,198.00	4.83
29	600276	恒瑞医药	2,571,290.00	4.71
30	002274	华昌化工	2,566,134.00	4.70
31	601009	南京银行	2,539,441.00	4.65
32	000703	恒逸石化	2,506,692.00	4.59
33	601808	中海油服	2,479,852.00	4.54
34	002258	利尔化学	2,433,598.00	4.46
35	000333	美的集团	2,388,860.00	4.38
36	002221	东华能源	2,288,014.00	4.19
37	002142	宁波银行	2,186,498.00	4.01
38	002475	立讯精密	2,180,082.65	3.99
39	000860	顺鑫农业	2,143,010.00	3.93
40	300192	科德教育	2,125,670.50	3.90
41	002415	海康威视	2,033,520.80	3.73
42	603000	人民网	1,999,848.35	3.66
43	002254	泰和新材	1,974,071.00	3.62
44	600486	扬农化工	1,958,127.00	3.59
45	300870	欧陆通	1,953,562.00	3.58
46	600063	皖维高新	1,939,904.00	3.55
47	002236	大华股份	1,939,407.00	3.55
48	688191	智洋创新	1,870,158.98	3.43
49	600079	人福医药	1,869,854.00	3.43
50	688036	传音控股	1,828,631.31	3.35
51	600619	海立股份	1,824,005.41	3.34
52	603517	绝味食品	1,777,849.40	3.26
53	002824	和胜股份	1,774,104.00	3.25
54	601877	正泰电器	1,707,484.00	3.13
55	600305	恒顺醋业	1,630,139.00	2.99
56	300015	爱尔眼科	1,622,862.19	2.97
57	002643	万润股份	1,610,545.00	2.95
58	300871	回盛生物	1,605,194.00	2.94
59	000902	新洋丰	1,583,799.00	2.90
60	601966	玲珑轮胎	1,572,927.00	2.88
61	603187	海容冷链	1,532,931.40	2.81
62	688127	蓝特光学	1,482,090.60	2.72
63	600859	王府井	1,473,600.00	2.70
64	600845	宝信软件	1,448,980.00	2.66
65	002597	金禾实业	1,427,661.00	2.62
66	002381	双箭股份	1,358,732.00	2.49
67	603587	地素时尚	1,327,267.00	2.43

68	000011	深物业 A	1,314,767.00	2.41
69	002859	洁美科技	1,260,220.00	2.31
70	002653	海思科	1,209,527.00	2.22
71	601918	新集能源	1,192,482.00	2.19
72	600885	宏发股份	1,181,612.00	2.17
73	002312	川发龙蟒	1,176,131.00	2.16
74	600567	山鹰国际	1,157,607.00	2.12
75	601699	潞安环能	1,122,667.00	2.06
76	600926	杭州银行	1,102,048.00	2.02

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	244,884,249.02
卖出股票收入（成交）总额	221,783,865.17

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	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	34,000.00	0.03
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	34,000.00	0.03

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	113049	长汽转债	340	34,000.00	0.03

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

无。

7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

无。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

无。

7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

无。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

无。

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

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

7.12.2 基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库

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	21,114.23
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	908.82
5	应收申购款	9,030,334.40
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	9,052,357.45

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

无。

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

无。

7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入原因，分项之和与合计可能有尾差。

§ 8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

持有人户数 (户)	户均持有的 基金份额	持有人结构			
		机构投资者		个人投资者	
		持有份额	占总份额比例 (%)	持有份额	占总份额比例 (%)
5,650	7,395.54	4,066,590.35	9.73	37,718,197.31	90.27

注：持有人户数为有效户数，即存量份额大于零的账户。

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	持有份额总数（份）	占基金总份额比例（%）
基金管理人所有从业人员持有本基金	42.15	0.0001

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

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

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2017年9月21日） 基金份额总额	724,148,060.11
本报告期期初基金份额总额	28,023,723.05
本报告期基金总申购份额	26,346,051.14
减：本报告期基金总赎回份额	12,584,986.53
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	41,784,787.66

§ 10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

无。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动**一、基金管理人的重大人事变动**

基金管理人报告期内无重大人事变动。

二、基金托管人的基金托管部门的重大人事变动

本报告期内，无涉及本基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

无。

10.4 基金投资策略的改变

本基金投资策略在本报告期内没有重大改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金聘任的为本基金审计的会计师事务所为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、托管人的托管业务部门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	
中国银河证券	1	99,422,628.06	21.33%	90,603.89	21.33%	-
华西证券	1	83,939,353.96	18.01%	76,498.78	18.01%	-
渤海证券	1	81,635,670.15	17.52%	74,405.42	17.52%	-
长江证券	2	68,590,178.89	14.72%	62,502.22	14.72%	-
光大证券	2	42,137,817.68	9.04%	38,397.73	9.04%	-
华福证券	1	35,977,876.42	7.72%	32,771.37	7.72%	-
江海证券	1	27,069,150.79	5.81%	24,670.10	5.81%	-

摩根大通	1	26,141,461.78	5.61%	23,820.99	5.61%	-
安信证券	2	1,114,947.00	0.24%	1,015.96	0.24%	-
财信证券	1	-	-	-	-	-
长城证券	1	-	-	-	-	-
东方证券	1	-	-	-	-	-
东海证券	1	-	-	-	-	-
东吴证券	1	-	-	-	-	-
东兴证券	1	-	-	-	-	-
东莞证券	1	-	-	-	-	-
方正证券	1	-	-	-	-	-
广发证券	1	-	-	-	-	-
广州证券	1	-	-	-	-	-
国都证券	1	-	-	-	-	-
国海证券	1	-	-	-	-	-
国泰君安	1	-	-	-	-	-
国信证券	1	-	-	-	-	-
海通证券	2	-	-	-	-	-
恒泰证券	1	-	-	-	-	-
华宝证券	1	-	-	-	-	-
华林证券	1	-	-	-	-	-
华泰证券	2	-	-	-	-	-
华鑫证券	1	-	-	-	-	-
开源证券	1	-	-	-	-	-
民生证券	1	-	-	-	-	-
平安证券	1	-	-	-	-	-
申万宏源	1	-	-	-	-	-
太平洋证券	1	-	-	-	-	-
万联证券	1	-	-	-	-	-
西南证券	1	-	-	-	-	-

湘财证券	1	-	-	-	-	-
招商证券	3	-	-	-	-	-
中金财富	2	-	-	-	-	-
中金公司	2	-	-	-	-	-
中信建投证 券	1	-	-	-	-	-
中信证券	2	-	-	-	-	-

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、报告期内租用交易单元变更情况，新增交易单元：摩根大通。退租交易单元：中泰证券。

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
光大证券	20,946.10	100.00%	-	-	-	-

10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	关于提请投资者及时更新已过期身份证件或者身份证明文件的公告	中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站	2021年6月30日
2	大成基金管理有限公司关于旗下部分基金增加平安银行股份有限公司为销售机构的公告	中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站	2021年6月28日
3	关于大成国企改革灵活配置混合型证	中国证监会基金电子披	2021年5月31日

	券投资基金增加恒泰证券股份有限公司为销售机构的公告	露网站、规定报刊及本公司网站	
4	大成国企改革灵活配置混合型证券投资基金基金产品资料概要更新	中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站	2021 年 5 月 28 日
5	大成国企改革灵活配置混合型证券投资基金更新招募说明书	中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站	2021 年 5 月 28 日
6	大成基金管理有限公司关于旗下部分基金增加海银基金销售有限公司为销售机构的公告	中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站	2021 年 5 月 27 日
7	大成国企改革灵活配置混合型证券投资基金基金经理变更公告	中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站	2021 年 5 月 27 日
8	大成基金管理有限公司关于旗下部分基金增加宁波银行股份有限公司为销售机构的公告	中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站	2021 年 5 月 13 日
9	大成国企改革灵活配置混合型证券投资基金 2021 年第 1 季度报告	中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站	2021 年 4 月 22 日
10	大成国企改革灵活配置混合型证券投资基金 2020 年年度报告	中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站	2021 年 3 月 30 日
11	大成基金管理有限公司提醒投资者谨防金融诈骗的公告	中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站	2021 年 3 月 23 日
12	大成基金管理有限公司关于旗下部分基金增加鼎信汇金（北京）投资管理有限公司为销售机构的公告	中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站	2021 年 3 月 11 日
13	关于大成国企改革灵活配置混合型证券投资基金增加阳光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	2021 年 2 月 9 日
14	大成国企改革灵活配置混合型证券投资基金 2020 年第四季度报告	中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站	2021 年 1 月 22 日
15	大成国企改革灵活配置混合型证券投资基金基金产品资料概要更新	中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站	2021 年 1 月 18 日
16	大成国企改革灵活配置混合型证券投资基金更新招募说明书	中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站	2021 年 1 月 18 日
17	大成国企改革灵活配置混合型证券投资基金增聘基金经理的公告	中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站	2021 年 1 月 14 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国企改革灵活配置混合型证券投资基金的文件；
- 2、《大成国企改革灵活配置混合型证券投资基金基金合同》；
- 3、《大成国企改革灵活配置混合型证券投资基金托管协议》；
- 4、大成基金管理有限公司批准文件、营业执照、公司章程；
- 5、本报告期内在规定报刊上披露的各种公告原稿。

12.2 存放地点

备查文件存放在本基金管理人和托管人的住所。

12.3 查阅方式

投资者可在营业时间免费查阅，或登录本基金管理人网站 <http://www.dcfund.com.cn> 进行查阅。

大成基金管理有限公司

2021 年 8 月 31 日