

大成产业趋势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 02 月 09 日（基金合同生效日）起至 06 月 30 日止。

1.2 目录

§ 1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
§ 2 基金简介	5
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人和基金托管人	5
2.4 信息披露方式	6
2.5 其他相关资料	6
§ 3 主要财务指标和基金净值表现	6
3.1 主要会计数据和财务指标	6
3.2 基金净值表现	7
§ 4 管理人报告	9
4.1 基金管理人及基金经理情况	9
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	10
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	10
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	10
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	11
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	11
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	12
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	12
§ 5 托管人报告	12
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	12
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	13
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	13
§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）	13
6.1 资产负债表	13
6.2 利润表	14
6.3 所有者权益（基金净值）变动表	15
6.4 报表附注	16
§ 7 投资组合报告	42
7.1 期末基金资产组合情况	42
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	43
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	44
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	46
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	48
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	48
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	48
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	48

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	48
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明	49
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	49
7.12 投资组合报告附注	49
§ 8 基金份额持有人信息	50
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	50
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	50
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	51
§ 9 开放式基金份额变动	51
§ 10 重大事件揭示	52
10.1 基金份额持有人大会决议	52
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	52
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	52
10.4 基金投资策略的改变	52
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	52
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	52
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	52
10.8 其他重大事件	54
§ 11 影响投资者决策的其他重要信息	56
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	56
11.2 影响投资者决策的其他重要信息	56
§ 12 备查文件目录	56
12.1 备查文件目录	56
12.2 存放地点	56
12.3 查阅方式	56

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	大成产业趋势混合型证券投资基金	
基金简称	大成产业趋势混合	
基金主代码	010826	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2021 年 2 月 9 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	1,485,829,314.81 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	大成产业趋势混合 A	大成产业趋势混合 C
下属分级基金的交易代码	010826	010827
报告期末下属分级基金的份额总额	1,428,339,806.62 份	57,489,508.19 份

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金将依据产业趋势投资的基本原理来构建和管理股票投资组合，在严格控制风险的前提下，寻求基金资产的长期稳健增值。
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。
业绩比较基准	沪深 300 指数收益率×60%+恒生指数收益率×20%+中债综合全价指数收益率×20%
风险收益特征	本基金是混合型证券投资基金，预期风险和预期收益高于债券型基金和货币市场基金、但低于股票型基金。本基金若投资港股通标的股票，则需承担港股通机制下因投资环境、投资标的、市场制度以及交易规则等差异带来的特有风险。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目	基金管理人	基金托管人
名称	大成基金管理有限公司	中国银行股份有限公司
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
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	北京市西城区复兴门内大街 1 号

	商银行大厦 32 层	
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	《中国证券报》
登载基金中期报告正文的管理人互联网网址	www.dcfund.com.cn
基金中期报告备置地点	基金管理人及基金托管人住所

2.5 其他相关资料

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

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2021年2月9日(基金合同生效日)-2021年6月30日)		
	大成产业趋势混合 A	大成产业趋势混合 C	
本期已实现收益	-61,714,981.27	-2,339,472.45	
本期利润	8,564,170.48	471,272.09	
加权平均基金份额本期利润	0.0058	0.0089	
本期加权平均净值利润率	0.60%	0.92%	
本期基金份额净值增长率	0.69%	0.38%	
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	-59,524,180.49	-2,564,006.65
	期末可供分配基金份额利润	-0.0417	-0.0446
	期末基金资产净值	1,438,191,028.58	57,707,924.41

期末基金份额净值	1.0069	1.0038
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	0.69%	0.38%

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

大成产业趋势混合 A

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去一个月	2.40%	1.07%	-1.43%	0.59%	3.83%	0.48%
过去三个月	6.26%	0.90%	2.56%	0.71%	3.70%	0.19%
自基金合同生效起至今	0.69%	1.19%	-3.73%	0.95%	4.42%	0.24%

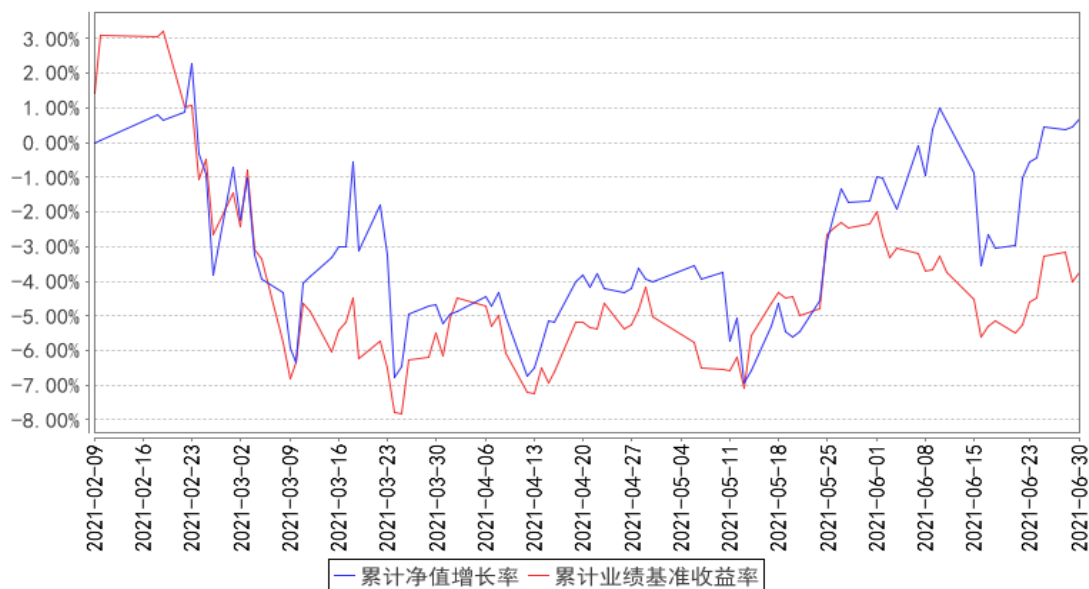
大成产业趋势混合 C

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去一个月	2.33%	1.07%	-1.43%	0.59%	3.76%	0.48%
过去三个月	6.05%	0.90%	2.56%	0.71%	3.49%	0.19%

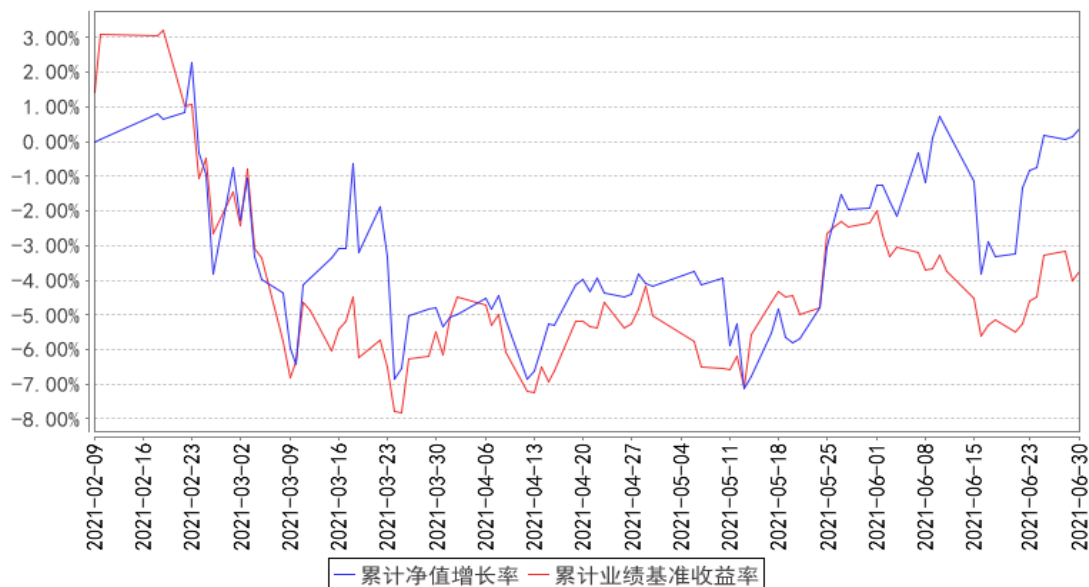
自基金合同生效起 至今	0.38%	1.19%	-3.73%	0.95%	4.11%	0.24%
----------------	-------	-------	--------	-------	-------	-------

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

大成产业趋势混合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



大成产业趋势混合C累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：1、本基金合同生效日为 2021 年 2 月 9 日，截止报告期末本基金合同生效未满一年。

2、本基金合同规定，本基金自基金合同生效之日起六个月内为建仓期。截至报告期末，本基金仍处于建仓期。

§ 4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

大成基金管理有限公司经中国证监会证监基金字[1999]10 号文批准，于 1999 年 4 月 12 日正式成立，是中国证监会批准成立的首批十家基金管理公司之一，注册资本 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		
韩创	本基金基金经理	2021 年 2 月 9 日	-	9 年	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

注：1、任职日期、离任日期为本基金管理人作出决定之日。

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

4.1.3 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理同时管理的产品情况

无

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

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

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

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

4.3.2 异常交易行为的专项说明

报告期内，基金管理人旗下所有投资组合未发现存在异常交易行为。主动投资组合间股票交易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

截至本报告期末大成产业趋势混合 A 的基金份额净值为 1.0069 元，本报告期基金份额净值增长率为 0.69%，同期业绩比较基准收益率为-3.73%；截至本报告期末大成产业趋势混合 C 的基金份额净值为 1.0038 元，本报告期基金份额净值增长率为 0.38%，同期业绩比较基准收益率为-3.73%。

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”）在大成产业趋势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合规守信、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：大成产业趋势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
资产：		
银行存款	6.4.7.1	292,236,688.07
结算备付金		3,821,134.55
存出保证金		549,440.01
交易性金融资产	6.4.7.2	1,191,715,530.17
其中：股票投资		1,188,285,530.17
基金投资		-
债券投资		3,430,000.00
资产支持证券投资		-
贵金属投资		-
衍生金融资产	6.4.7.3	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-
应收证券清算款		11,921,577.83
应收利息	6.4.7.5	31,698.90
应收股利		1,120,736.64
应收申购款		741,936.86
递延所得税资产		-
其他资产	6.4.7.6	-
资产总计		1,502,138,743.03
负债和所有者权益	附注号	本期末 2021 年 6 月 30 日

负 债：		
短期借款		-
交易性金融负债		-
衍生金融负债	6.4.7.3	-
卖出回购金融资产款		-
应付证券清算款		25.40
应付赎回款		2,343,144.97
应付管理人报酬		1,837,306.63
应付托管费		306,217.77
应付销售服务费		36,640.00
应付交易费用	6.4.7.7	1,633,999.26
应交税费		1.64
应付利息		-
应付利润		-
递延所得税负债		-
其他负债	6.4.7.8	82,454.37
负债合计		6,239,790.04
所有者权益：		
实收基金	6.4.7.9	1,485,829,314.81
未分配利润	6.4.7.10	10,069,638.18
所有者权益合计		1,495,898,952.99
负债和所有者权益总计		1,502,138,743.03

注：报告截止日 2021 年 06 月 30 日，基金份额总额 1,485,829,314.81 份，其中大成产业趋势混合 A 基金份额总额为 1,428,339,806.62 份，基金份额净值 1.0069 元。大成产业趋势混合 C 基金份额总额为 57,489,508.19 份，基金份额净值 1.0038 元。

6.2 利润表

会计主体：大成产业趋势混合型证券投资基金

本报告期：2021 年 2 月 9 日（基金合同生效日）至 2021 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期
		2021 年 2 月 9 日（基金合同生效日）至 2021 年 6 月 30 日
一、收入		23,652,794.23
1. 利息收入		755,436.84
其中：存款利息收入	6.4.7.11	755,185.45
债券利息收入		251.39
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）		-50,504,871.92

其中：股票投资收益	6.4.7.12	-65,513,735.48
基金投资收益		-
债券投资收益	6.4.7.13	-
资产支持证券投资收益		-
贵金属投资收益	6.4.7.14	-
衍生工具收益	6.4.7.15	-
股利收益	6.4.7.16	15,008,863.56
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	73,089,896.29
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.18	312,333.02
减：二、费用		14,617,351.66
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	8,601,495.58
2. 托管费	6.4.10.2.2	1,433,582.62
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	158,391.38
4. 交易费用	6.4.7.19	4,335,847.18
5. 利息支出		-
其中：卖出回购金融资产支出		-
6. 税金及附加		0.17
7. 其他费用	6.4.7.20	88,034.73
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		9,035,442.57
减：所得税费用		-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		9,035,442.57

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：大成产业趋势混合型证券投资基金

本报告期：2021 年 2 月 9 日（基金合同生效日）至 2021 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 2 月 9 日（基金合同生效日）至 2021 年 6 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	1,541,049,601.68	-	1,541,049,601.68
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	9,035,442.57	9,035,442.57
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）	-55,220,286.87	1,034,195.61	-54,186,091.26
其中：1. 基金申	62,284,626.72	-1,772,575.94	60,512,050.78

购款			
2. 基金赎回款	-117,504,913.59	2,806,771.55	-114,698,142.04
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）	1,485,829,314.81	10,069,638.18	1,495,898,952.99

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署：

谭晓冈

周立新

刘亚林

基金管理人负责人

主管会计工作负责人

会计机构负责人

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

大成产业趋势混合型证券投资基金（以下简称“本基金”），系经中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）证监许可【2020】3007 号文“大成产业趋势混合型证券投资基金份额发售公告”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《大成产业趋势混合型证券投资基金份额发售公告》作为发起人于 2021 年 1 月 25 日至 2021 年 2 月 5 日向社会公开发售，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（2021）验字第 60469430_H02 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 2021 年 2 月 9 日生效。本基金为契约型开放式，存续期限不定。

设立时，本基金已收到的首次发售募集的有效认购资金扣除认购费后的净认购金额为人民币 1,540,509,972.34 元，折合 1,540,509,972.34 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 539,629.34 元，折合 539,629.34 份基金份额。其中 A 类份额已收到的首次发售募集的有效认购资金扣除认购费后的净认购金额为人民币 1,489,397,932.57 元，折合 1,489,397,932.57 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 523,681.41 元，折合 523,681.41 份基金份额；C 类份额已收到的首次发售募集的有效认购资金扣除认购费后的净认购金额为人民币 51,112,039.77 元，折合 51,112,039.77 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 15,947.93 元，折合 15,947.93 份基金份额。以上收到的实收基金共计人民币 1,541,049,601.68 元，折合 1,541,049,601.68 份基金份额。

本基金的管理人为基金大成基金管理有限公司，注册登记机构为本基金管理人，基金托管人为中国银行股份有限公司。

本基金的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（包括主板、中小板、创业板及其他中国证监会允许基金投资的股票）、内地与香港股票市场交易互联互通机制下允许投资的规定范围内的香港联合交易所上市的股票（简称“港股通标的股票”）、债券（包括国债、央行票据、金融债券、企业债券、公司债券、中期票据、短期融资券、超短期融资券、公开发行的次级债券、政府支持机构债、政府支持债券、地方政府债、可转换债券及其他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。

本基金的业绩比较基准由沪深 300 指数收益率×60%+恒生指数收益率×20%+中债综合全价指数收益率×20%。

6.4.2 会计报表的编制基础

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

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2021 年 2 月 9 日（基金合同生效日）至 2021 年 6 月 30 日止期间的财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金 2021 年 6 月 30 日的财务状况以及 2021 年 2 月 9 日（基金合同生效日）至 2021 年 6 月 30 日止期间的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

6.4.4 重要会计政策和会计估计

6.4.4.1 会计年度

本基金会计年度为公历 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。本期财务报表的实际编制期间为 2021 年 2 月 9 日（基金合同生效日）至 2021 年 6 月 30 日。

6.4.4.2 记账本位币

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

6.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

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

(1) 金融资产的分类

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

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

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

(2) 金融负债的分类

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

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

6.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

初始确认

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

后续计量

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

终止确认

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

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

金融资产转移

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

6.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

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

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

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

本基金持有的股票、债券和衍生工具等投资按如下原则确定公允价值并进行估值：

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

与上述投资品种相同，但具有不同特征的，应以相同资产或负债的公允价值为基础，并在估值技术中考虑不同特征因素的影响。特征是指对资产出售或使用的限制等，如果该限制是针对资

产持有者的，那么在估值技术中不应将该限制作为特征考虑。此外，基金管理人不应考虑因大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价。

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

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

(4) 如有新增事项，按国家最新规定估值

6.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

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

6.4.4.7 实收基金

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

6.4.4.8 损益平准金

损益平准金包括已实现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)”。

6.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

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

(2) 债券利息收入按债券票面价值与票面利率或内含票面利率计算的金额扣除应由债券发行企业代扣代缴的个人所得税及应由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) 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；

(5) 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；

(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) 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；

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

6.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬和托管费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。

6.4.4.11 基金的收益分配政策

(1) 在符合有关基金分红条件的前提下，本基金每年收益分配次数最多为 12 次，每份基金份额每次基金收益分配比例不得低于基金收益分配基准日每份基金份额可供分配利润的 10%，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，各类别基金份额对应的可供分配利润将有所不同；本基金同一类别的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。

6.4.4.12 分部报告

截至本报告期末，本基金仅在中国大陆境内从事证券投资单一业务，因此，无需披露分部报告。

6.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计

本基金本报告期间无需要说明的其他重要会计政策和会计估计事项。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期未发生会计政策变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

6.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无重大会计差错更正。

6.4.6 税项

1、印花税

证券（股票）交易印花税税率为 1%，由出让方缴纳。

2、增值税、企业所得税

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

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

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

根据财政部、国家税务总局财税[2017]90 号文《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》的规定，提供贷款服务，以 2018 年 1 月 1 日起产生的利息及利息性质的收入为销售额；转让 2018 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 2018 年最后一个交易日的股票收盘价（2018 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。

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 6 月 30 日
活期存款	292,236,688.07
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	292,236,688.07

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 6 月 30 日
----	------------------------

	成本	公允价值	公允价值变动
股票	1,115,195,633.88	1,188,285,530.17	73,089,896.29
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	3,430,000.00	-
	银行间市场	-	-
	合计	3,430,000.00	-
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	1,118,625,633.88	1,191,715,530.17	73,089,896.29

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

无。

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

无。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

无。

6.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2021年6月30日
应收活期存款利息	29,675.92
应收定期存款利息	-
应收其他存款利息	-
应收结算备付金利息	1,547.55
应收债券利息	252.86
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	222.57
合计	31,698.90

6.4.7.6 其他资产

无。

6.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2021年6月30日
交易所市场应付交易费用	1,633,999.26
银行间市场应付交易费用	-
合计	1,633,999.26

6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2021年6月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	4,049.07
应付证券出借违约金	-
预提费用	78,405.30
合计	82,454.37

6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

大成产业趋势混合 A

项目	本期 2021年2月9日（基金合同生效日）至2021年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
基金合同生效日	1,489,921,613.98	1,489,921,613.98
本期申购	45,098,024.18	45,098,024.18
本期赎回（以“-”号填列）	-106,679,831.54	-106,679,831.54
-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	1,428,339,806.62	1,428,339,806.62

大成产业趋势混合 C

项目	本期 2021年2月9日（基金合同生效日）至2021年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
基金合同生效日	51,127,987.70	51,127,987.70
本期申购	17,186,602.54	17,186,602.54
本期赎回（以“-”号填列）	-10,825,082.05	-10,825,082.05
-基金拆分/份额折算前	-	-

基金拆分/份额折算调整	-	-
本期申购	-	-
本期赎回（以“-”号填列）	-	-
本期末	57,489,508.19	57,489,508.19

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

6.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

大成产业趋势混合 A

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
基金合同生效日	-	-	-
本期利润	-61,714,981.27	70,279,151.75	8,564,170.48
本期基金份额交易产生的变动数	2,190,800.78	-903,749.30	1,287,051.48
其中：基金申购款	-1,474,355.34	222,382.19	-1,251,973.15
基金赎回款	3,665,156.12	-1,126,131.49	2,539,024.63
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-59,524,180.49	69,375,402.45	9,851,221.96

大成产业趋势混合 C

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
基金合同生效日	-	-	-
本期利润	-2,339,472.45	2,810,744.54	471,272.09
本期基金份额交易产生的变动数	-224,534.20	-28,321.67	-252,855.87
其中：基金申购款	-626,667.49	106,064.70	-520,602.79
基金赎回款	402,133.29	-134,386.37	267,746.92
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-2,564,006.65	2,782,422.87	218,416.22

6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2021年2月9日（基金合同生效日）至2021年6月30日

活期存款利息收入	709,216.87
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	42,049.71
其他	3,918.87
合计	755,185.45

6.4.7.12 股票投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2021年2月9日（基金合同生效日）至2021年6月30日
卖出股票成交总额	988,523,856.61
减：卖出股票成本总额	1,054,037,592.09
买卖股票差价收入	-65,513,735.48

6.4.7.13 债券投资收益

无。

6.4.7.14 贵金属投资收益

无。

6.4.7.15 衍生工具收益

无。

6.4.7.16 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2021年2月9日（基金合同生效日）至2021年6月30日
股票投资产生的股利收益	15,008,863.56
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	15,008,863.56

6.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2021年2月9日（基金合同生效日）至2021年6月30日
1. 交易性金融资产	73,089,896.29
股票投资	73,089,896.29

债券投资	-
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	73,089,896.29

6.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2021年2月9日（基金合同生效日）至2021年 6月30日
基金赎回费收入	288,940.98
基金转换费收入	23,392.04
合计	312,333.02

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，其中转出基金的赎回费的 25% 归入转出基金的基金资产。

6.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2021年2月9日（基金合同生效日）至2021年6月30日
交易所市场交易费用	4,335,847.18
银行间市场交易费用	-
合计	4,335,847.18

6.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2021年2月9日（基金合同生效日）至2021年6 月30日
审计费用	34,846.80
信息披露费	43,558.50
证券出借违约金	-
银行划款手续费	8,129.43
账户维护费	1,500.00
合计	88,034.73

6.4.7.21 分部报告

无。

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 或有事项

无。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

无。

6.4.9 关联方关系

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

本基金本报告期存在控制关系或者其他重大利害关系的关联方未发生变化。

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
大成基金管理有限公司（“大成基金”）	基金管理人、注册登记机构、基金销售机构
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、基金销售机构

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2021年2月9日（基金合同生效日）至2021年6月 30日	
	成交金额	占当期股票 成交总额的比例（%）
光大证券	250,364,610.65	7.95

6.4.10.1.2 债券交易

无。

6.4.10.1.3 债券回购交易

无。

6.4.10.1.4 权证交易

无。

6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2021年2月9日（基金合同生效日）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	201,928.41	7.10	108,129.65	6.62

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

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

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2021年2月9日（基金合同生效日）至2021年6月30日
	当期发生的基金应支付的管理费
其中：支付销售机构的客户维护费	4,060,430.96

注：本基金的管理费按前一日基金资产净值的 1.50% 年费率计提。管理费的计算方法如下：

$$H = E \times 1.50\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期

	2021 年 2 月 9 日（基金合同生效日）至 2021 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	1,433,582.62

注：本基金的托管费按前一日基金资产净值的 0.25% 的年费率计提。托管费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.25\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

6.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期 2021 年 2 月 9 日（基金合同生效日）至 2021 年 6 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	大成产业趋势混合 A	大成产业趋势混合 C	合计
大成基金	-	1,845.43	1,845.43
中国银行	-	48,310.94	48,310.94
合计	-	50,156.37	50,156.37

注：C 类基金份额的销售服务费按前一日 C 类基金份额基金资产净值的 0.80% 的年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 0.80\% \div \text{当年天数}$$

H 为 C 类基金份额每日应计提的销售服务费

E 为前一日 C 类基金份额的基金资产净值

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

无。

6.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

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

无。

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

无。

6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用自有资金投资本基金的情况

无。

6.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

无。

6.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2021年2月9日（基金合同生效日）至2021年6月30日	
	期末余额	当期利息收入
中国银行	292,236,688.07	709,216.87

注：本基金由基金托管人保管的银行存款，按银行约定利率计息。

6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

无。

6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

无。

6.4.11 利润分配情况

无。

6.4.12 期末(2021年6月30日)本基金持有的流通受限证券

6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

6.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量 (单位：股)	期末成本总额	期末估值总额	备注

300614	百川畅银	2021年5月18日	2021年11月25日	新股锁定	9.19	40.38	329	3,023.51	13,285.02	-
300955	嘉亨家化	2021年3月16日	2021年9月24日	新股锁定	16.53	46.07	232	3,834.96	10,688.24	-
300956	英力股份	2021年3月16日	2021年9月27日	新股锁定	12.85	25.80	371	4,767.35	9,571.80	-
300957	贝泰妮	2021年3月18日	2021年9月27日	新股锁定	47.33	251.96	853	40,372.49	214,921.88	-
300958	建工修复	2021年3月18日	2021年9月29日	新股锁定	8.53	27.22	300	2,559.00	8,166.00	-
300960	通业科技	2021年3月22日	2021年9月29日	新股锁定	12.08	23.06	234	2,826.72	5,396.04	-
300961	深水海纳	2021年3月23日	2021年9月30日	新股锁定	8.48	22.07	394	3,341.12	8,695.58	-
300962	中金辐照	2021年3月29日	2021年10月11日	新股锁定	3.40	16.37	576	1,958.40	9,429.12	-
300963	中洲特材	2021年3月30日	2021年10月11日	新股锁定	12.13	22.49	283	3,432.79	6,364.67	-
300966	共同药业	2021年3月31日	2021年10月11日	新股锁定	8.24	31.54	286	2,356.64	9,020.44	-
300967	晓鸣股份	2021年4月2日	2021年10月13日	新股锁定	4.54	11.54	507	2,301.78	5,850.78	-
300968	格林精密	2021年4月6日	2021年10月15日	新股锁定	6.87	12.07	1,162	7,982.94	14,025.34	-
300971	博亚精工	2021年4月	2021年10	新股锁定	18.24	28.29	245	4,468.80	6,931.05	-

		7日	月15日							
300973	立高食品	2021年4月8日	2021年10月15日	新股锁定	28.28	115.71	360	10,180.80	41,655.60	-
300975	商络电子	2021年4月14日	2021年10月21日	新股锁定	5.48	13.03	492	2,696.16	6,410.76	-
300978	东箭科技	2021年4月15日	2021年10月26日	新股锁定	8.42	13.60	593	4,993.06	8,064.80	-
300979	华利集团	2021年4月15日	2021年10月26日	新股锁定	33.22	87.50	925	30,728.50	80,937.50	-
300981	中红医疗	2021年4月19日	2021年10月27日	新股锁定	48.59	90.39	468	22,740.12	42,302.52	-
300982	苏文电能	2021年4月19日	2021年10月27日	新股锁定	15.83	45.29	317	5,018.11	14,356.93	-
300986	志特新材	2021年4月21日	2021年11月1日	新股锁定	14.79	30.57	264	3,904.56	8,070.48	-
300991	创益通	2021年5月12日	2021年11月22日	新股锁定	13.06	26.51	254	3,317.24	6,733.54	-
300992	泰福泵业	2021年5月17日	2021年11月25日	新股锁定	9.36	20.32	200	1,872.00	4,064.00	-
300993	玉马遮阳	2021年5月17日	2021年11月24日	新股锁定	12.10	19.29	410	4,961.00	7,908.90	-
300995	奇德新材	2021年5月17日	2021年11月26日	新股锁定	14.72	23.32	191	2,811.52	4,454.12	-

			日							
300996	普联软件	2021年5月26日	2021年12月3日	新股锁定	20.81	42.23	241	5,015.21	10,177.43	-
300997	欢乐家	2021年5月26日	2021年12月2日	新股锁定	4.94	13.05	928	4,584.32	12,110.40	-
300998	宁波方正	2021年5月25日	2021年12月2日	新股锁定	6.02	21.32	201	1,210.02	4,285.32	-
301002	崧盛股份	2021年5月27日	2021年12月7日	新股锁定	18.71	57.62	201	3,760.71	11,581.62	-
301007	德迈仕	2021年6月4日	2021年12月16日	新股锁定	5.29	14.44	303	1,602.87	4,375.32	-
301009	可靠股份	2021年6月8日	2021年12月17日	新股锁定	12.54	27.89	801	10,044.54	22,339.89	-
301010	晶雪节能	2021年6月9日	2021年12月20日	新股锁定	7.83	17.61	218	1,706.94	3,838.98	-
301011	华立科技	2021年6月9日	2021年12月17日	新股锁定	14.20	33.84	175	2,485.00	5,922.00	-
301012	扬电科技	2021年6月15日	2021年12月22日	新股锁定	8.05	24.26	170	1,368.50	4,124.20	-
301013	利和兴	2021年6月21日	2021年12月29日	新股锁定	8.72	27.11	471	4,107.12	12,768.81	-
301015	百洋医药	2021年6月22日	2021年12月30日	新股锁定	7.64	38.83	462	3,529.68	17,939.46	-
301016	雷尔伟	2021年6月23日	2021年12月30日	新股锁定	13.75	32.98	275	3,781.25	9,069.50	-

			日							
301020	密封科技	2021年6月28日	2021年7月6日	新股未上市	10.64	10.64	4,210	44,794.40	44,794.40	-
301021	英诺激光	2021年6月28日	2021年7月6日	新股未上市	9.46	9.46	2,899	27,424.54	27,424.54	-
605162	新中港	2021年6月29日	2021年7月7日	新股未上市	6.07	6.07	1,377	8,358.39	8,358.39	-
688087	英科再生	2021年6月30日	2021年7月9日	新股未上市	21.96	21.96	2,469	54,219.24	54,219.24	-
688109	品茗股份	2021年3月22日	2021年9月30日	新股锁定	50.05	72.10	1,301	65,115.05	93,802.10	-
688226	威腾电气	2021年6月28日	2021年7月7日	新股未上市	6.42	6.42	2,693	17,289.06	17,289.06	-
688239	航宇科技	2021年6月25日	2021年7月5日	新股未上市	11.48	11.48	4,926	56,550.48	56,550.48	-
688314	康拓医疗	2021年5月11日	2021年11月18日	新股锁定	17.34	74.48	1,085	18,813.90	80,810.80	-
688425	铁建重工	2021年6月11日	2021年12月22日	新股锁定	2.87	4.75	135,282	388,259.34	642,589.50	-
688468	科美诊断	2021年3月31日	2021年10月11日	新股锁定	7.15	16.50	3,919	28,020.85	64,663.50	-
688499	利元亨	2021年6月23日	2021年7月1日	新股未上市	38.85	38.85	2,149	83,488.65	83,488.65	-
688533	上声电子	2021年4月9日	2021年10月19日	新股锁定	7.72	19.11	3,493	26,965.96	66,751.23	-
688662	富信科技	2021年3月25日	2021年10月8日	新股锁定	15.61	29.51	2,556	39,899.16	75,427.56	-

6.4.12.1.2 受限证券类别：债券

证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量 (单位：张)	期末成本总额	期末估值总额	备注
113049	长汽转债	2021年6月10日	2021年07月08日	新债未上市	100.00	100.00	5,610	561,000.00	561,000.00	-
113050	南银转债	2021年6月15日	2021年07月01日	新债未上市	100.00	100.00	28,690	2,869,000.00	2,869,000.00	-

注：1、根据《上海证券交易所科创板股票公开发行自律委员会促进科创板初期企业平稳发行行业倡导建议》，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。本基金参与网下申购获得的新股，在新股上市之前及上市之后的约定期限(若有)内不得转让；本基金参与网上申购获得的新股，在新股上市之前不得转让。

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

无。

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

无。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

无。

6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

无。

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金是混合型基金，其预期风险和预期收益高于债券型基金和货币市场基金，但低于股票型基金。本基金投资的金融工具主要为股票投资等。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在严格控制风险的前提下，追求超越业绩比较基准的投资回报，力争实现基金资产的长期稳定增值。

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

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

6.4.13.2 信用风险

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

本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的活期银行存款存放在本基金的托管行中国工商银行，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 0.23%。

6.4.13.3 流动性风险

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

6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

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

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

6.4.13.4 市场风险

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

6.4.13.4.1 利率风险

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

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

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

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2021年6月30日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	292,236,688.07	-	-	-	292,236,688.07
结算备付金	3,821,134.55	-	-	-	3,821,134.55
存出保证金	549,440.01	-	-	-	549,440.01
交易性金融资产	-	-	3,430,000.00	1,188,285,530.17	1,191,715,530.17
应收利息	-	-	-	31,698.90	31,698.90
应收股利	-	-	-	1,120,736.64	1,120,736.64
应收申购款	-	-	-	741,936.86	741,936.86
应收证券清算款	-	-	-	11,921,577.83	11,921,577.83
资产总计	296,607,262.63	-	3,430,000.00	1,202,101,480.40	1,502,138,743.03
负债					
应付赎回款	-	-	-	2,343,144.97	2,343,144.97
应付管理人报酬	-	-	-	1,837,306.63	1,837,306.63
应付托管费	-	-	-	306,217.77	306,217.77
应付证券清算款	-	-	-	25.40	25.40
应付销售服务费	-	-	-	36,640.00	36,640.00
应付交易费用	-	-	-	1,633,999.26	1,633,999.26
应交税费	-	-	-	1.64	1.64
其他负债	-	-	-	82,454.37	82,454.37
负债总计	-	-	-	6,239,790.04	6,239,790.04
利率敏感度缺口	296,607,262.63	-	3,430,000.00	1,195,861,690.36	1,495,898,952.99

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

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

无。

6.4.13.4.2 外汇风险

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

6.4.13.4.2.1 外汇风险敞口

单位：人民币元

项目	本期末 2021年6月30日			
	美元 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	-	115,840,698.16	-	115,840,698.16
资产合计	-	115,840,698.16	-	115,840,698.16
以外币计价的 负债				
负债合计	-	-	-	-
资产负债表外 汇风险敞口净 额	-	115,840,698.16	-	115,840,698.16

6.4.13.4.2.2 外汇风险的敏感性分析

假设	除港币以外的其他市场变量保持不变	
	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）
		本期末（2021年6月30日）
分析	港币相对人民币升值 5%	5,792,034.91
	港币相对人民币贬值 5%	-5,792,034.91

6.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场

交易的固定收益品种，因此无重大其他价格风险。

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2021年6月30日	
	公允价值	占基金资产净值比例（%）
交易性金融资产—股票投资	1,188,285,530.17	79.44
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	1,188,285,530.17	79.44

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除业绩比较基准以外的其他市场变量保持不变	
	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的 影响金额（单位：人民币元）
		本期末（2021年6月30日）
分析	1. 业绩比较基准上升5%	48,712,185.00
	2. 业绩比较基准下降5%	-48,712,185.00

6.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

无。

§ 7 投资组合报告

7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	1,188,285,530.17	79.11
	其中：股票	1,188,285,530.17	79.11
2	基金投资	—	—
3	固定收益投资	3,430,000.00	0.23

	其中：债券	3,430,000.00	0.23
	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	296,057,822.62	19.71
8	其他各项资产	14,365,390.24	0.96
9	合计	1,502,138,743.03	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	7,007,466.78	0.47
B	采矿业	123,679,783.20	8.27
C	制造业	871,631,953.13	58.27
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	13,020.39	0.00
E	建筑业	14,356.93	0.00
F	批发和零售业	257,526.54	0.02
G	交通运输、仓储和邮政业	18,850.59	0.00
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	185,394.73	0.01
J	金融业	52,603,452.30	3.52
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	30,146.60	0.00
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	17,002,880.82	1.14
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	1,072,444,832.01	71.69

7.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

行业类别	公允价值（人民币）	占基金资产净值比例（%）
通信服务	-	-
非日常生活消费品	8,465,109.30	0.57
日常消费品	-	-

能源	55,626,153.91	3.72
金融	-	-
医疗保健	-	-
工业	-	-
信息技术	24,852,066.19	1.66
原材料	26,897,368.76	1.80
房地产	-	-
合计	115,840,698.16	7.74

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	600141	兴发集团	6,361,040	119,778,383.20	8.01
2	002088	鲁阳节能	4,394,629	101,032,520.71	6.75
3	002597	金禾实业	2,496,133	86,615,815.10	5.79
4	601677	明泰铝业	4,239,506	82,882,342.30	5.54
5	601058	赛轮轮胎	7,922,194	79,142,718.06	5.29
6	000683	远兴能源	16,834,900	78,618,983.00	5.26
7	00883	中国海洋石油	7,571,000	55,626,153.91	3.72
8	002154	报喜鸟	8,501,400	54,153,918.00	3.62
9	600028	中国石化	10,110,270	44,080,777.20	2.95
10	601633	长城汽车	978,539	42,654,515.01	2.85
11	601838	成都银行	2,963,800	37,462,432.00	2.50
12	000830	鲁西化工	1,873,400	35,088,782.00	2.35
13	601899	紫金矿业	2,798,400	27,116,496.00	1.81
14	00826	天工国际	9,766,000	26,897,368.76	1.80
15	01810	小米集团-W	1,106,200	24,852,066.19	1.66
16	002810	山东赫达	470,050	22,167,558.00	1.48
17	000902	新洋丰	1,367,161	21,368,726.43	1.43
18	600060	海信视像	1,193,346	20,167,547.40	1.35
19	688269	凯立新材	123,551	17,237,835.52	1.15
20	605098	行动教育	302,166	17,002,880.82	1.14
21	000960	锡业股份	1,038,153	16,641,592.59	1.11
22	000983	山西焦煤	1,923,400	15,983,454.00	1.07
23	002258	利尔化学	612,400	15,799,920.00	1.06
24	002092	中泰化学	1,510,600	15,513,862.00	1.04
25	601009	南京银行	1,435,960	15,106,299.20	1.01
26	601225	陕西煤业	1,208,700	14,323,095.00	0.96
27	603156	养元饮品	459,836	13,142,112.88	0.88
28	603100	川仪股份	740,400	12,964,404.00	0.87
29	002824	和胜股份	287,400	10,133,724.00	0.68

30	601168	西部矿业	841,400	10,037,902.00	0.67
31	01999	敏华控股	545,200	8,465,109.30	0.57
32	300806	斯迪克	176,500	8,366,100.00	0.56
33	600063	皖维高新	1,534,000	7,854,080.00	0.53
34	002299	圣农发展	293,200	7,001,616.00	0.47
35	002835	同为股份	550,700	6,900,271.00	0.46
36	601699	潞安环能	507,700	5,995,937.00	0.40
37	601808	中海油服	230,400	3,308,544.00	0.22
38	601001	晋控煤业	390,300	2,833,578.00	0.19
39	688425	铁建重工	135,282	642,589.50	0.04
40	688690	纳微科技	3,477	408,547.50	0.03
41	688276	百克生物	3,486	364,565.88	0.02
42	688161	威高骨科	3,069	325,467.45	0.02
43	301015	百洋医药	4,614	251,115.78	0.02
44	300957	贝泰妮	853	214,921.88	0.01
45	301006	迈拓股份	5,051	154,055.50	0.01
46	301016	雷尔伟	2,747	115,711.58	0.01
47	688109	品茗股份	1,301	93,802.10	0.01
48	688499	利元亨	2,149	83,488.65	0.01
49	300979	华利集团	925	80,937.50	0.01
50	688314	康拓医疗	1,085	80,810.80	0.01
51	688662	富信科技	2,556	75,427.56	0.01
52	688663	新风光	3,279	71,023.14	0.00
53	688191	智洋创新	3,203	69,184.80	0.00
54	688533	上声电子	3,493	66,751.23	0.00
55	688468	科美诊断	3,919	64,663.50	0.00
56	688239	航宇科技	4,926	56,550.48	0.00
57	688087	英科再生	2,469	54,219.24	0.00
58	301010	晶雪节能	2,172	50,480.96	0.00
59	301020	密封科技	4,210	44,794.40	0.00
60	688395	正弦电气	1,627	44,465.91	0.00
61	300981	中红医疗	468	42,302.52	0.00
62	300973	立高食品	360	41,655.60	0.00
63	688067	爱威科技	1,259	39,520.01	0.00
64	601528	瑞丰银行	2,230	34,721.10	0.00
65	301021	英诺激光	2,899	27,424.54	0.00
66	001207	联科科技	682	22,581.02	0.00
67	301009	可靠股份	801	22,339.89	0.00
68	001205	盛航股份	577	18,850.59	0.00
69	688226	威腾电气	2,693	17,289.06	0.00
70	300982	苏文电能	317	14,356.93	0.00
71	605180	华生科技	384	14,208.00	0.00

72	300968	格林精密	1,162	14,025.34	0.00
73	001208	华菱线缆	1,754	13,558.42	0.00
74	300614	百川畅银	329	13,285.02	0.00
75	301013	利和兴	471	12,768.81	0.00
76	603171	税友股份	637	12,230.40	0.00
77	300997	欢乐家	928	12,110.40	0.00
78	301002	崧盛股份	201	11,581.62	0.00
79	300955	嘉亨家化	232	10,688.24	0.00
80	300996	普联软件	241	10,177.43	0.00
81	300956	英力股份	371	9,571.80	0.00
82	300962	中金辐照	576	9,429.12	0.00
83	300966	共同药业	286	9,020.44	0.00
84	300961	深水海纳	394	8,695.58	0.00
85	605162	新中港	1,377	8,358.39	0.00
86	300958	建工修复	300	8,166.00	0.00
87	300986	志特新材	264	8,070.48	0.00
88	300978	东箭科技	593	8,064.80	0.00
89	300993	玉马遮阳	410	7,908.90	0.00
90	300971	博亚精工	245	6,931.05	0.00
91	300991	创益通	254	6,733.54	0.00
92	300975	商络电子	492	6,410.76	0.00
93	300963	中洲特材	283	6,364.67	0.00
94	301011	华立科技	175	5,922.00	0.00
95	300967	晓鸣股份	507	5,850.78	0.00
96	300960	通业科技	234	5,396.04	0.00
97	605011	杭州热电	525	4,662.00	0.00
98	300995	奇德新材	191	4,454.12	0.00
99	301007	德迈仕	303	4,375.32	0.00
100	300998	宁波方正	201	4,285.32	0.00
101	301012	扬电科技	170	4,124.20	0.00
102	300992	泰福泵业	200	4,064.00	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末基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期末基金资产净值比例(%)
1	601677	明泰铝业	133,271,865.29	8.91
2	601058	赛轮轮胎	120,179,211.90	8.03
3	002597	金禾实业	102,009,293.26	6.82
4	000902	新洋丰	100,413,199.90	6.71
5	600141	兴发集团	94,029,338.04	6.29
6	000703	恒逸石化	91,321,948.75	6.10

7	000683	远兴能源	91,248,236.25	6.10
8	601899	紫金矿业	81,217,855.35	5.43
9	601966	玲珑轮胎	77,549,938.93	5.18
10	002088	鲁阳节能	72,941,681.72	4.88
11	00883	中国海洋石油	64,440,323.46	4.31
12	002624	完美世界	56,274,406.11	3.76
13	600216	浙江医药	54,127,286.08	3.62
14	00941	中国移动	52,808,960.83	3.53
15	002154	报喜鸟	50,693,528.39	3.39
16	600028	中国石化	47,058,903.29	3.15
17	000830	鲁西化工	45,941,003.00	3.07
18	600096	云天化	38,621,773.23	2.58
19	601633	长城汽车	37,199,543.38	2.49
20	601838	成都银行	37,105,464.00	2.48
21	00826	天工国际	34,979,658.86	2.34
22	600567	山鹰国际	31,229,328.10	2.09
23	601166	兴业银行	30,846,935.86	2.06
24	002092	中泰化学	30,493,410.00	2.04

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

7.4.2 累计卖出金额超出期末基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期末基金资产净值比例(%)
1	601966	玲珑轮胎	79,380,895.67	5.31
2	000703	恒逸石化	70,047,781.03	4.68
3	601677	明泰铝业	63,723,848.88	4.26
4	002624	完美世界	52,931,367.82	3.54
5	601899	紫金矿业	51,815,227.29	3.46
6	00941	中国移动	50,315,460.75	3.36
7	600216	浙江医药	49,676,411.08	3.32
8	000902	新洋丰	48,653,057.94	3.25
9	601058	赛轮轮胎	40,009,140.87	2.67
10	600096	云天化	38,555,072.61	2.58
11	000683	远兴能源	32,285,579.98	2.16
12	601166	兴业银行	30,570,678.62	2.04
13	600567	山鹰国际	27,876,022.80	1.86
14	002221	东华能源	22,646,898.64	1.51
15	601666	平煤股份	22,520,127.23	1.51
16	002236	大华股份	21,071,293.00	1.41
17	600123	兰花科创	19,328,574.99	1.29
18	603156	养元饮品	19,290,040.56	1.29
19	000960	锡业股份	14,930,624.00	1.00

20	002092	中泰化学	14,799,549.60	0.99
----	--------	------	---------------	------

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	2,169,233,225.97
卖出股票收入（成交）总额	988,523,856.61

注：买入股票成本、卖出股票收入均按买卖成交金额（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）	3,430,000.00	0.23
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	3,430,000.00	0.23

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	113050	南银转债	28,690	2,869,000.00	0.19
2	113049	长汽转债	5,610	561,000.00	0.04

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

无。

7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

无。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

无。

7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

无。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

无。

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

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

7.12.2 基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库

本基金投资的前十名股票未超出基金合同规定的备选股票库

7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	549,440.01
2	应收证券清算款	11,921,577.83
3	应收股利	1,120,736.64
4	应收利息	31,698.90
5	应收申购款	741,936.86
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	14,365,390.24

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

无。

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

无。

7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入原因，分项之和与合计可能有尾差。

§ 8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额级别	持有人户数(户)	户均持有的基金份额	持有人结构			
			机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总份额比例(%)	持有份额	占总份额比例(%)
大成产业趋势混合 A	15,990	89,327.07	24,839,201.67	1.74	1,403,500,604.95	98.26
大成产业趋势混合 C	2,881	19,954.71	2,608,399.17	4.54	54,881,109.02	95.46
合计	18,871	78,736.12	27,447,600.84	1.85	1,458,381,713.97	98.15

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

2、持有人户数为有效户数，即存量份额大于零的账户。

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数(份)	占基金总份额比例(%)
基金管理人所有从业	大成产业趋势混合 A	1,941,471.20	0.1359
	大成产业趋势混合 C	100.05	0.0002

人员持有本基金			
	合计	1,941,571.25	0.1307

注：上述占基金总份额比例的计算中，对分级份额，比例的分母采用各自级别的份额，对合计数，比例的分母采用下属分级基金份额的合计数（即期末基金份额总额）。

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

项目	份额级别	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	大成产业趋势混合 A	10~50
	大成产业趋势混合 C	0
	合计	10~50
本基金基金经理持有本开放式基金	大成产业趋势混合 A	0
	大成产业趋势混合 C	0
	合计	0

§9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	大成产业趋势混合 A	大成产业趋势混合 C
基金合同生效日 (2021 年 2 月 9 日) 基金份额总额	1,489,921,613.98	51,127,987.70
基金合同生效日起至 报告期期末基金总申 购份额	45,098,024.18	17,186,602.54
减：基金合同生效日 起至报告期期末基金 总赎回份额	106,679,831.54	10,825,082.05
基金合同生效日起至 报告期期末基金拆分 变动份额（份额减少 以“-”填列）	-	-
本报告期期末基金份 额总额	1,428,339,806.62	57,489,508.19

§ 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

无

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

无。

10.4 基金投资策略的改变

本基金投资策略在本报告期内没有重大改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

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

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，基金管理人、托管人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	
海通证券	2	553,155,150.83	17.56%	504,090.57	17.72%	-
长江证券	2	378,261,335.27	12.01%	344,719.99	12.12%	-
中信证券	2	376,214,100.27	11.94%	342,851.67	12.05%	-
中金公司	2	305,549,573.04	9.70%	278,472.15	9.79%	-

华泰证券	2	304,503,824.40	9.66%	277,517.91	9.75%	-
光大证券	2	250,364,610.65	7.95%	201,928.41	7.10%	-
安信证券	2	232,618,808.04	7.38%	211,991.13	7.45%	-
华福证券	1	224,330,487.96	7.12%	204,417.45	7.19%	-
中国银河证 券	1	169,167,093.46	5.37%	154,159.07	5.42%	-
国泰君安	1	163,314,265.36	5.18%	148,841.21	5.23%	-
东方证券	1	69,532,568.04	2.21%	63,357.27	2.23%	-
华林证券	1	52,092,623.36	1.65%	47,472.64	1.67%	-
申万宏源	1	45,588,969.45	1.45%	41,550.04	1.46%	-
财信证券	1	21,066,444.62	0.67%	19,199.27	0.67%	-
广发证券	1	4,208,229.00	0.13%	3,835.40	0.13%	-
招商证券	3	689,344.77	0.02%	628.18	0.02%	-
渤海证券	1	-	-	-	-	-
长城证券	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	-	-	-	-	-
广州证券	1	-	-	-	-	-
国都证券	1	-	-	-	-	-
国海证券	1	-	-	-	-	-
国信证券	1	-	-	-	-	-
恒泰证券	1	-	-	-	-	-
华宝证券	1	-	-	-	-	-
华西证券	1	-	-	-	-	-
华鑫证券	1	-	-	-	-	-
江海证券	1	-	-	-	-	-

开源证券	1	-	-	-	-	-
民生证券	1	-	-	-	-	-
摩根大通	1	-	-	-	-	-
平安证券	1	-	-	-	-	-
太平洋证券	1	-	-	-	-	-
万联证券	1	-	-	-	-	-
西南证券	1	-	-	-	-	-
湘财证券	1	-	-	-	-	-
中金财富	2	-	-	-	-	-
中信建投证 券	1	-	-	-	-	-

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

租用证券公司交易单元的选择标准主要包括：

- （一）财务状况良好，最近一年无重大违规行为；
- （二）经营行为规范，内控制度健全，能满足各投资组合运作的保密性要求；
- （三）研究实力较强，能提供包括研究报告、路演服务、协助进行上市公司调研等研究服务；
- （四）具备各投资组合运作所需的高效、安全的通讯条件，有足够的交易和清算能力，满足各投资组合证券交易需要；
- （五）能提供投资组合运作、管理所需的其他券商服务；
- （六）相关基金合同、资产管理合同以及法律法规规定的其他条件。

租用证券公司交易单元的程序：首先根据租用证券公司交易单元的选择标准形成《券商服务评价表》，然后根据评分高低进行选择基金交易单元。本基金本报告期内交易单元均新增单元，本报告期内本基金退租席位：无。

10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

无。

10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
----	------	--------	--------

1	关于提请投资者及时更新已过期身份证件或者身份证明文件的公告	中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站	2021 年 6 月 30 日
2	大成基金管理有限公司关于旗下部分基金增加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
3	大成基金管理有限公司关于旗下部分基金增加腾安基金销售（深圳）有限公司为销售机构的公告	中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站	2021 年 5 月 18 日
4	大成基金管理有限公司关于旗下部分基金增加上海中正达广基金销售有限公司为销售机构的公告	中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站	2021 年 5 月 12 日
5	大成产业趋势混合型证券投资基金开放日常申购、赎回、转换及定投业务的公告	中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站	2021 年 4 月 9 日
6	大成基金管理有限公司关于旗下部分基金增加蚂蚁（杭州）基金销售有限公司为销售机构的公告	中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站	2021 年 3 月 31 日
7	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
8	大成产业趋势混合型证券投资基金(C类份额)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 2 月 18 日
9	大成产业趋势混合型证券投资基金(A类份额)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 2 月 18 日
10	关于大成产业趋势混合型证券投资基金基金合同生效公告	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 10 日
11	关于大成产业趋势混合型证券投资基金 A、C 类份额增加部分代销机构的公告	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 1 月 23 日
12	关于大成产业趋势混合型证券投资基金 A、C 类份额增加部分代销机构的公告	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 1 月 21 日
13	大成产业趋势混合型证券投资基金基金份额发售公告	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 11 日
14	大成产业趋势混合型证券投资基金托管协议	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 11 日
15	大成产业趋势混合型证券投资基金基金合同	中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本	2021 年 1 月 11 日

		公司网站	
16	大成产业趋势混合型证券投资基金基金产品资料概要	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 11 日
17	大成产业趋势混合型证券投资基金基金产品资料概要	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 11 日
18	大成产业趋势混合型证券投资基金招募说明书	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 11 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产业趋势混合型证券投资基金的文件；
- 2、《大成产业趋势混合型证券投资基金基金合同》；
- 3、《大成产业趋势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