

# 大成成长进取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：中国农业银行股份有限公司

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。

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

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

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

本报告财务资料未经审计。

本报告期自 2021 年 01 月 01 日起至 06 月 30 日止。

## 1.2 目录

<b>§ 1 重要提示及目录</b>	<b>2</b>
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
<b>§ 2 基金简介</b>	<b>5</b>
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人和基金托管人	5
2.4 信息披露方式	6
2.5 其他相关资料	6
<b>§ 3 主要财务指标和基金净值表现</b>	<b>6</b>
3.1 主要会计数据和财务指标	6
3.2 基金净值表现	7
<b>§ 4 管理人报告</b>	<b>9</b>
4.1 基金管理人及基金经理情况	9
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	12
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	12
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	13
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
<b>§ 5 托管人报告</b>	<b>14</b>
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	14
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	15
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	15
<b>§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）</b>	<b>15</b>
6.1 资产负债表	15
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
<b>§ 7 投资组合报告</b>	<b>43</b>
7.1 期末基金资产组合情况	43
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	50
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	51
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	52

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 .....	52
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 .....	52
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 .....	52
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明 .....	52
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 .....	52
7.12 投资组合报告附注 .....	52
<b>§ 8 基金份额持有人信息 .....</b>	<b>53</b>
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....	53
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....	54
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 .....	54
<b>§ 9 开放式基金份额变动 .....</b>	<b>55</b>
<b>§ 10 重大事件揭示 .....</b>	<b>55</b>
10.1 基金份额持有人大会决议 .....	55
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 .....	55
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....	55
10.4 基金投资策略的改变 .....	55
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....	56
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 .....	56
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	56
10.8 其他重大事件 .....	58
<b>§ 11 影响投资者决策的其他重要信息 .....</b>	<b>59</b>
11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况 .....	59
11.2 影响投资者决策的其他重要信息 .....	59
<b>§ 12 备查文件目录 .....</b>	<b>59</b>
12.1 备查文件目录 .....	59
12.2 存放地点 .....	59
12.3 查阅方式 .....	60

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	大成成长进取混合型证券投资基金	
基金简称	大成成长进取混合	
基金主代码	010371	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2020 年 11 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	871,211,277.66 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基 金简称	大成成长进取混合 A	大成成长进取混合 C
下属分级基金的交 易代码	010371	010372
报告期末下属分级 基金的份额总额	601,797,355.49 份	269,413,922.17 份

### 2.2 基金产品说明

投资目标	本基金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。
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	中证 500 指数收益率×70%+恒生指数收益率×10%+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	中国农业银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	赵冰	秦一楠
	联系电话	0755-83183388	010-66060069
	电子邮箱	office@dcfund.com.cn	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	北京市西城区复兴门内大街 28

	商银行大厦 32 层	号凯晨世贸中心东座 F9
邮政编码	518040	100031
法定代表人	吴庆斌	谷澍

## 2.4 信息披露方式

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

## 2.5 其他相关资料

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

## § 3 主要财务指标和基金净值表现

### 3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2021 年 1 月 1 日-2021 年 6 月 30 日)	
	大成成长进取混合 A	大成成长进取混合 C
本期已实现收益	153,219,297.21	56,311,330.43
本期利润	169,018,290.98	46,219,689.72
加权平均基金份额本期利润	0.1760	0.1255
本期加权平均净值利润率	15.91%	11.39%
本期基金份额净值增长率	13.98%	13.75%
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	39,596,391.55
	期末可供分配基金份额利润	0.1470
	期末基金资产净值	332,694,506.14

期末基金份额净值	1.2378	1.2349
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	23.78%	23.49%

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

大成成长进取混合 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	1.84%	1.54%	0.71%	0.55%	1.13%	0.99%
过去三个月	21.69%	1.46%	6.42%	0.53%	15.27%	0.93%
过去六个月	13.98%	1.83%	5.68%	0.77%	8.30%	1.06%
自基金合同生效起至今	23.78%	1.70%	6.19%	0.78%	17.59%	0.92%

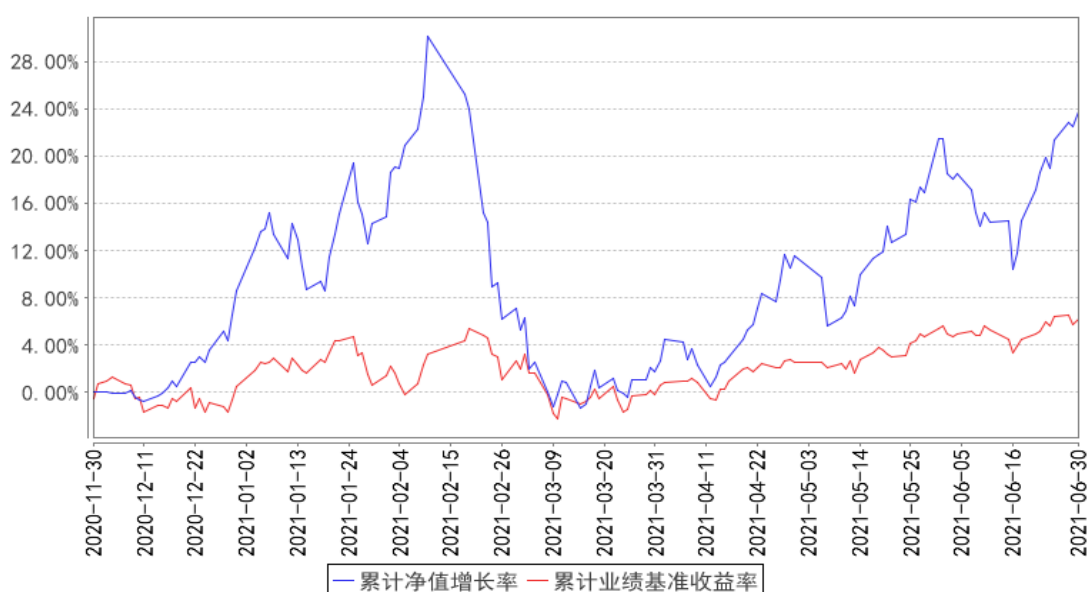
大成成长进取混合 C

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	1.81%	1.54%	0.71%	0.55%	1.10%	0.99%

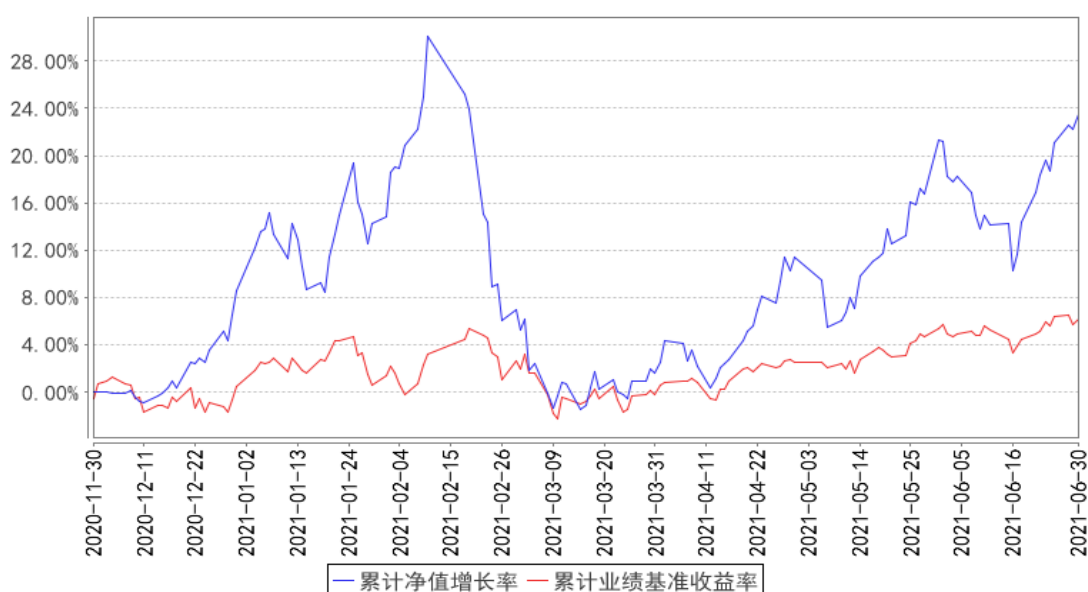
过去三个月	21.56%	1.46%	6.42%	0.53%	15.14%	0.93%
过去六个月	13.75%	1.83%	5.68%	0.77%	8.07%	1.06%
自基金合同生效起至今	23.49%	1.70%	6.19%	0.78%	17.30%	0.92%

### 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

大成成长进取混合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



大成成长进取混合C累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：1、本基金合同生效日为2020年11月30日，截止报告期末本基金合同生效未满一年。



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

## § 4 管理人报告

### 4.1 基金管理人及基金经理情况

#### 4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

大成基金管理有限公司经中国证监会证监基金字[1999]10号文批准，于1999年4月12日正式成立，是中国证监会批准成立的首批十家基金管理公司之一，注册资本2亿元人民币，注册地广东省深圳市。目前公司由三家股东组成，分别为中泰信托有限责任公司(50%)、光大证券股份有限公司(25%)、中国银河投资管理有限公司(25%)。主要业务是公募基金的募集、销售和管理，还具有全国社保基金投资管理、基本养老保险投资管理、受托管理保险资金、保险保障基金投资管理、特定客户资产管理和QDII业务资格。

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

#### 4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
谢家乐	本基金基金经理	2020年11月30日	-	9年	工学硕士。曾担任华泰证券股份有限公司研究所研究员。2014年6月加入大成基金管理有限公司，曾担任研究部研究员、大成睿景灵活配置混合型证券投资基金基金经理助理。2019年8月6日至2020年11月13日任大成国家安全主题灵活配置混合型证券投资基金基金经理。2019年8月6日起任大成科创主题3年封闭运作灵活配置混合型证券投资基金基金经理。2020年4月29日起任大成科技创新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。2020年11月30日起任大成成长进取混合型证券投资基金基金经理。2021年8月3日起任大成成长回报六个月持有期混合型证券投资基金基金经理。具备基金从业资格。国籍：中国

肖文瀚	本基金基金经理助理	2020 年 12 月 6 日	-	5 年	理学硕士。2015 年 6 月至 2016 年 8 月任异乡好居（波士顿分公司）分公司联合创始人。2017 年 2 月至 2019 年 3 月任东吴证券研究所研究员。2019 年 5 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、大成科技创新混合型证券投资基金、大成创业板两年定期开放混合型证券投资基金基金经理助理。2020 年 12 月 6 日起任大成成长进取混合型证券投资基金基金经理助理。具备基金从业资格。国籍：中国
孙丹	本基金基金经理助理	2021 年 2 月 1 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

				<p>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 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</p>
--	--	--	--	---

					<p>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>
--	--	--	--	--	---

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遵规守信情况的说明

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

2021 年上半年经济处在疫情后修复阶段，出现高通胀与货币宽松并存，宏观环境利于成长与周期，上半年行情主线也围绕新能源，半导体，医药，周期等板块。本基金上半年主要配置在新能源，医疗，高端制造等成长赛道。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末大成成长进取混合 A 的基金份额净值为 1.2378 元，本报告期基金份额净值增长率为 13.98%，同期业绩比较基准收益率为 5.68%；截至本报告期末大成成长进取混合 C 的基金份额净值为 1.2349 元，本报告期基金份额净值增长率为 13.75%，同期业绩比较基准收益率为 5.68%。

### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

站在当下，我们依然认为成长领域是未来最好的投资方向，我们也将坚持一贯的选股思路，挑选产业符合时代特征，中长期行业需求稳健增长，公司自身经营能力和方法论符合长期化取向的标的。

### 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

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

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

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

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

#### 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

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

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

无。

## § 5 托管人报告

### 5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

在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 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 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合规守信、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中期报告中的财务指标、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 半年度财务会计报告（未经审计）

## 6.1 资产负债表

会计主体：大成成长进取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
<b>资产：</b>			
银行存款	6.4.7.1	75,461,522.96	611,426,814.47
结算备付金		2,144,783.85	-
存出保证金		1,074,391.26	-
交易性金融资产	6.4.7.2	1,023,473,031.92	1,865,248,636.50
其中：股票投资		1,020,533,245.76	1,865,248,636.50
基金投资		-	-
债券投资		2,939,786.16	-
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		-	-
应收利息	6.4.7.5	21,102.71	146,778.47
应收股利		435.20	-
应收申购款		3,521,357.50	-

递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		1,105,696,625.40	2,476,822,229.44
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2021年6月30日</b>	<b>上年度末 2020年12月31日</b>
<b>负 债:</b>			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		5,760.99	127.72
应付赎回款		24,423,083.86	-
应付管理人报酬		1,410,365.88	2,925,575.17
应付托管费		235,060.97	487,595.84
应付销售服务费		113,024.48	158,523.44
应付交易费用	6.4.7.7	1,790,919.04	1,812,351.63
应交税费		21.50	-
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	133,075.92	-
负债合计		28,111,312.64	5,384,173.80
<b>所有者权益:</b>			
实收基金	6.4.7.9	871,211,277.66	2,275,981,404.99
未分配利润	6.4.7.10	206,374,035.10	195,456,650.65
所有者权益合计		1,077,585,312.76	2,471,438,055.64
负债和所有者权益总计		1,105,696,625.40	2,476,822,229.44

注：报告截止日 2021 年 06 月 30 日，基金份额总额 871,211,277.66 份，其中大成成长进取混合 A 基金份额总额为 601,797,355.49 份，基金份额净值 1.2378 元。大成成长进取混合 C 基金份额总额为 269,413,922.17 份，基金份额净值 1.2349 元。

## 6.2 利润表

会计主体：大成成长进取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 2021年1月1日至2021年6月30日
一、收入		238,503,772.68
1. 利息收入		1,008,410.86
其中：存款利息收入	6.4.7.11	1,006,460.84
债券利息收入		1,950.02



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）		225,375,855.92
其中：股票投资收益	6.4.7.12	223,307,585.45
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	2,068,270.47
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	5,707,353.06
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	6,412,152.84
减：二、费用		23,265,791.98
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	11,046,229.98
2. 托管费	6.4.10.2.2	1,841,038.32
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	812,218.07
4. 交易费用	6.4.7.19	9,422,337.84
5. 利息支出		-
其中：卖出回购金融资产支出		-
6. 税金及附加		6.99
7. 其他费用	6.4.7.20	143,960.78
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		215,237,980.70
减：所得税费用		-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		215,237,980.70

### 6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：大成成长进取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）	2,275,981,404.99	195,456,650.65	2,471,438,055.64
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	215,237,980.70	215,237,980.70

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）	-1,404,770,127.33	-204,320,596.25	-1,609,090,723.58
其中：1. 基金申购款	682,000,637.99	91,691,123.01	773,691,761.00
2. 基金赎回款	-2,086,770,765.32	-296,011,719.26	-2,382,782,484.58
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-	-
五、期末所有者权益（基金净值）	871,211,277.66	206,374,035.10	1,077,585,312.76

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

大成成长进取混合型证券投资基金(以下简称“本基金”)经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2020]2238 号《关于准予大成成长进取混合型证券投资基金注册的批复》核准,由大成基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《大成成长进取混合型证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式,存续期限不定,首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币 2,275,438,115.89 元,业经普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)普华永道中天验字(2020)第 0966 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《大成成长进取混合型证券投资基金基金合同》于 2020 年 11 月 30 日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为 2,275,981,404.99 份基金份额,其中认购资金利息折合 543,289.10 份基金份额。本基金的基金管理人为大成基金管理有限公司,基金托管人为中国农业银行股份有限公司。

根据《大成成长进取混合型证券投资基金基金合同》和《大成成长进取混合型证券投资基金招募说明书》的有关规定,本基金根据认购/申购费用、销售服务费收取方式的不同,将基金份额分为不同的类别。其中 A 类基金份额为在投资人认购/申购时收取前端认购/申购费用,且不从本

类别基金资产中计提销售服务费的基金份额；C 类基金份额为从本类别基金资产中计提销售服务费，且不收取认购/申购费用的基金份额。本基金 A 类基金份额和 C 类基金份额分别设置基金代码并分别计算基金份额净值。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《大成成长进取混合型证券投资基金基金合同》的有关规定，基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的股票(包括主板、中小板、创业板、及其他中国证监会允许基金投资的股票)、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、可转换债券及其他经中国证监会允许投资的债券)、资产支持证券、债券回购、同业存单、银行存款(包括协议存款、定期存款等)、货币市场工具、股指期货、国债期货以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具，但须符合中国证监会相关规定。本基金投资组合中，股票、存托凭证投资比例为基金资产的 60%-95%(港股通标的股票投资比例不超过本基金股票资产的 50%)；每个交易日日终在扣除股指期货合约和国债期货合约需缴纳的交易保证金后，应当保持不低于基金资产净值 5%的现金或到期日在一年以内的政府债券，其中，现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。本基金的业绩比较基准为：中证 500 指数收益率×70%+恒生指数收益率×10%+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于 2006 年 2 月 15 日及以后期间颁布的《企业会计准则—基本准则》、各项具体会计准则及相关规定(以下合称“企业会计准则”)、中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和半年度报告>》、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《大成成长进取混合型证券投资基金基金合同》和在财务报表附注 6.4.4 所列示的中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

#### 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 1 月 1 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 1 月 1 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。

### 6.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

### 6.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

#### (1) 金融资产的分类

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

本基金目前以交易目的持有的债券投资分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在资产负债表中以交易性金融资产列示。

本基金持有的其他金融资产分类为应收款项，包括银行存款、买入返售金融资产和其他各类应收款项等。应收款项是指在活跃市场中没有报价、回收金额固定或可确定的非衍生金融资产。

#### (2) 金融负债的分类

金融负债于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债及其他金融负债。本基金目前暂无金融负债分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。本基金持有的其他金融负债包括卖出回购金融资产款和其他各类应付款项等。

### 6.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

金融资产或金融负债于本基金成为金融工具合同的一方时，按公允价值在资产负债表内确认。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，取得时发生的相关交易费用计入当期损益；对于支付的价款中包含的债券起息日或上次除息日至购买日止的利息，单独确认为应收项目。应收款项和其他金融负债的相关交易费用计入初始确认金额。

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，按照公允价值进行后续计量；对于应收款项和其他金融负债采用实际利率法，以摊余成本进行后续计量。

金融资产满足下列条件之一的，予以终止确认：(1) 收取该金融资产现金流量的合同权利终止；(2) 该金融资产已转移，且本基金将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方；或者(3) 该金融资产已转移，虽然本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬，但是放弃了对该金融资产控制。

金融资产终止确认时，其账面价值与收到的对价的差额，计入当期损益。

当金融负债的现时义务全部或部分已经解除时，终止确认该金融负债或义务已解除的部分。

终止确认部分的账面价值与支付的对价之间的差额，计入当期损益。

#### 6.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

本基金持有的股票投资、债券投资和衍生工具按如下原则确定公允价值并进行估值：

(1) 存在活跃市场的金融工具按其估值日的市场交易价格确定公允价值；估值日无交易且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，按最近交易日的市场交易价格确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的市场交易价格不能真实反映公允价值的，应对市场交易价格进行调整，确定公允价值。与上述投资品种相同，但具有不同特征的，应以相同资产或负债的公允价值为基础，并在估值技术中考虑不同特征因素的影响。特征是指对资产出售或使用的限制等，如果该限制是针对资产持有者的，那么在估值技术中不应将该限制作为特征考虑。此外，基金管理人不应考虑因大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价。

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

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

#### 6.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

本基金持有的资产和承担的负债基本为金融资产和金融负债。当本基金 1) 具有抵销已确认金额的法定权利且该种法定权利现在是可执行的；且 2) 交易双方准备按净额结算时，金融资产与金融负债按抵销后的净额在资产负债表中列示。

#### 6.4.4.7 实收基金

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

#### 6.4.4.8 损益平准金

损益平准金包括已实现平准金和未实现平准金。已实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现损益占基金净值比例计算的金额。未实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未实现损益占基金净值比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日认列，并于期末全额转入未分配利润/(累计亏损)。

#### 6.4.4.9 收入/（损失）的确认和计量

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

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在持有期间的公允价值变动确认为公允价值变动损益；于处置时，其处置价格与初始确认金额之间的差额扣除在适用情况下由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为投资收益，其中包括从公允价值变动损益结转的公允价值累计变动额。

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

#### 6.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬和托管费在费用涵盖期间按基金合同约定的费率和计算方法逐日确认。

其他金融负债在持有期间确认的利息支出按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

#### 6.4.4.11 基金的收益分配政策

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

经宣告的拟分配基金收益于分红除权日从所有者权益转出。

#### 6.4.4.12 外币交易

外币交易按交易发生日的即期汇率将外币金额折算为人民币入账。

以公允价值计量的外币非货币性项目，于估值日采用估值日的即期汇率折算为人民币，所产生的折算差额直接计入公允价值变动损益科目。

#### 6.4.4.13 分部报告

本基金以内部组织结构、管理要求、内部报告制度为依据确定经营分部，以经营分部为基础确定报告分部并披露分部信息。经营分部是指本基金内同时满足下列条件的组成部分：(1) 该组成部分能够在日常活动中产生收入、发生费用；(2) 本基金的基金管理人能够定期评价该组成部

分的经营成果，以决定向其配置资源、评价其业绩；(3) 本基金能够取得该组成部分的财务状况、经营成果和现金流量等有关会计信息。如果两个或多个经营分部具有相似的经济特征，并且满足一定条件的，则合并为一个经营分部。

本基金目前以一个单一的经营分部运作，不需要披露分部信息。

#### 6.4.4.14 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

本基金本报告期末发生会计政策变更。

##### 6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期末发生会计估计变更。

##### 6.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明会计差错更正。

#### 6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2008]1号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2015]101号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2016]36号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、财税[2016]140号《关于明确金融 房地产开发 教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税[2017]2号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017]56号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1) 资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人。资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为，暂适用简易计税方法，按照3%的征收率缴纳增值税。

对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税，对国债、地方政府债以及金融同业往来利息收入亦免征增值税。资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务，以产生的利息及利息性质的收入为销售额。

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

(3)对基金取得的企业债券利息收入,应由发行债券的企业在向基金支付利息时代扣代缴 20% 的个人所得税。对基金从上市公司取得的股息红利所得,持股期限在 1 个月以内(含 1 个月)的,其股息红利所得全额计入应纳税所得额;持股期限在 1 个月以上至 1 年(含 1 年)的,暂减按 50% 计入应纳税所得额;持股期限超过 1 年的,暂免征收个人所得税。对基金持有的上市公司限售股,解禁后取得的股息、红利收入,按照上述规定计算纳税,持股时间自解禁日起计算;解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按 50% 计入应纳税所得额。上述所得统一适用 20% 的税率计征个人所得税。

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

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

#### 6.4.7 重要财务报表项目的说明

##### 6.4.7.1 银行存款

单位:人民币元

项目	本期末 2021 年 6 月 30 日
活期存款	75,461,522.96
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	75,461,522.96

##### 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	814,317,194.91	1,020,533,245.76	206,216,050.85
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	2,939,786.16	422,386.16
	银行间市场	-	-
	合计	2,939,786.16	422,386.16
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-



其他	-	-	-
合计	816,834,594.91	1,023,473,031.92	206,638,437.01

#### 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

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	17,241.74
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	1,371.72
应收债券利息	2,008.26
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	480.99
合计	21,102.71

#### 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	1,790,919.04
银行间市场应付交易费用	-
合计	1,790,919.04

#### 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	19,020.58

应付证券出借违约金	-
预提费用	114,055.34
合计	133,075.92

#### 6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

##### 大成成长进取混合 A

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	1,813,451,860.87	1,813,451,860.87
本期申购	364,216,932.62	364,216,932.62
本期赎回（以“-”号填列）	-1,575,871,438.00	-1,575,871,438.00
-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	601,797,355.49	601,797,355.49

##### 大成成长进取混合 C

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	462,529,544.12	462,529,544.12
本期申购	317,783,705.37	317,783,705.37
本期赎回（以“-”号填列）	-510,899,327.32	-510,899,327.32
-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	269,413,922.17	269,413,922.17

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

##### 大成成长进取混合 A

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-4,235,693.93	160,106,460.48	155,870,766.55
本期利润	153,219,297.21	15,798,993.77	169,018,290.98
本期基金份额交易产生的变动数	-58,909,769.10	-122,885,837.30	-181,795,606.40
其中：基金申购款	22,503,388.32	28,809,502.18	51,312,890.50

基金赎回款	-81,413,157.42	-151,695,339.48	-233,108,496.90
本期已分配利润	-	-	-
本期末	90,073,834.18	53,019,616.95	143,093,451.13

## 大成成长进取混合 C

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-1,238,739.37	40,824,623.47	39,585,884.10
本期利润	56,311,330.43	-10,091,640.71	46,219,689.72
本期基金份额交易产生的变动数	-15,476,199.51	-7,048,790.34	-22,524,989.85
其中：基金申购款	20,199,363.98	20,178,868.53	40,378,232.51
基金赎回款	-35,675,563.49	-27,227,658.87	-62,903,222.36
本期已分配利润	-	-	-
本期末	39,596,391.55	23,684,192.42	63,280,583.97

## 6.4.7.11 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	914,584.55
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	81,712.35
其他	10,163.94
合计	1,006,460.84

## 6.4.7.12 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	3,388,840,058.62
减：卖出股票成本总额	3,165,532,473.17
买卖股票差价收入	223,307,585.45

## 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1月1日至2021年6月30日
股票投资产生的股利收益	2,068,270.47
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	2,068,270.47

**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1月1日至2021年6月30日
1. 交易性金融资产	5,707,353.06
股票投资	5,284,966.90
债券投资	422,386.16
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	5,707,353.06

**6.4.7.18 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	6,398,720.57
基金转换费收入	13,432.27
合计	6,412,152.84

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 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
交易所市场交易费用	9,422,337.84
银行间市场交易费用	-
合计	9,422,337.84

#### 6.4.7.20 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	54,547.97
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
银行划款手续费	26,905.44
账户维护费	3,000.00
合计	143,960.78

#### 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
中国农业银行股份有限公司（“农业银行”）	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。

## 6.4.10 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1月1日至2021年6月30日	
	成交金额	占当期股票 成交总额的比例 (%)
光大证券	898,570,369.78	15.78

## 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	728,235.23	14.33	50,467.60	2.82

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 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	11,046,229.98
其中：支付销售机构的客户维护费	4,514,614.59

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。

#### 6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期
	2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	1,841,038.32

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。

#### 6.4.10.2.3 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 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	大成成长进取混合 A	大成成长进取混合 C	合计
大成基金	-	1,917.99	1,917.99
光大证券	-	14,696.55	14,696.55
中国农业银行	-	33,191.31	33,191.31
合计	-	49,805.85	49,805.85

注：支付基金销售机构的销售服务费按前一日 C 类基金份额基金资产净值 0.40%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付给大成基金，再由大成基金计算并支付给各基金销售机构。其计算公式为：日销售服务费=前一日 C 类基金资产净值×0.40%/当年天数。

#### 6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

无。

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

无。

## 6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

## 6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

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1月1日至2021年6月30日	
	期末余额	当期利息收入
中国农业银行	75,461,522.96	914,584.55

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	-
300929	华骐环保	2021年1月12日	2021年7月21日	新股锁定	13.87	29.55	183	2,538.21	5,407.65	-



		日	日								
300932	三友联众	2021年 1月15 日	2021年 7月22 日	新股锁 定	24.69	31.71	492	12,147.48	15,601.32	-	
300933	中辰股份	2021年 1月15 日	2021年 7月22 日	新股锁 定	3.37	10.44	1,112	3,747.44	11,609.28	-	
300937	药易购	2021年 1月20 日	2021年 7月27 日	新股锁 定	12.25	53.71	244	2,989.00	13,105.24	-	
300940	南极光	2021年 1月27 日	2021年 8月3 日	新股锁 定	12.76	43.38	307	3,917.32	13,317.66	-	
300941	创识科技	2021年 2月2日	2021年 8月9 日	新股锁 定	21.31	49.94	399	8,502.69	19,926.06	-	
300942	易瑞生物	2021年 2月2日	2021年 8月9 日	新股锁 定	5.31	28.52	443	2,352.33	12,634.36	-	
300943	春晖智控	2021年 2月3日	2021年 8月10 日	新股锁 定	9.79	23.01	255	2,496.45	5,867.55	-	
300945	曼卡龙	2021年 2月3日	2021年 8月10 日	新股锁 定	4.56	18.88	474	2,161.44	8,949.12	-	
300952	恒辉安防	2021年 3月3日	2021年 9月13 日	新股锁 定	11.72	27.08	340	3,984.80	9,207.20	-	
300953	震裕科技	2021年 3月11 日	2021年 9月22 日	新股锁 定	28.77	99.85	240	6,904.80	23,964.00	-	
300955	嘉亨家化	2021年 3月16 日	2021年 9月24 日	新股锁 定	16.53	46.07	232	3,834.96	10,688.24	-	
300956	英力股份	2021年 3月16 日	2021年 9月27 日	新股锁 定	12.85	25.80	371	4,767.35	9,571.80	-	
300957	贝泰妮	2021年 3月18 日	2021年 9月27 日	新股锁 定	47.33	251.96	826	39,094.58	208,118.96	-	
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	2021年	2021年	新股锁	12.08	23.06	234	2,826.72	5,396.04	-	

	科技	3月22日	9月29日	定							
300961	深水海纳	2021年3月23日	2021年9月30日	新股锁定	8.48	22.07	394	3,341.12	8,695.58		-
300962	中金辐照	2021年3月29日	2021年10月11日	新股锁定	3.40	16.37	576	1,958.40	9,429.12		-
300963	中洲特材	2021年3月30日	2021年10月11日	新股锁定	12.13	22.49	283	3,432.79	6,364.67		-
300966	共同药业	2021年3月31日	2021年10月11日	新股锁定	8.24	31.54	286	2,356.64	9,020.44		-
300967	晓鸣股份	2021年4月2日	2021年10月13日	新股锁定	4.54	11.54	507	2,301.78	5,850.78		-
300968	格林精密	2021年4月6日	2021年10月15日	新股锁定	6.87	12.07	1,162	7,982.94	14,025.34		-
300971	博亚精工	2021年4月7日	2021年10月15日	新股锁定	18.24	28.29	245	4,468.80	6,931.05		-
300973	立高食品	2021年4月8日	2021年10月15日	新股锁定	28.28	115.71	360	10,180.80	41,655.60		-
300975	商络电子	2021年4月14日	2021年10月21日	新股锁定	5.48	13.03	492	2,696.16	6,410.76		-
300978	东箭科技	2021年4月15日	2021年10月26日	新股锁定	8.42	13.60	593	4,993.06	8,064.80		-
300979	华利集团	2021年4月15日	2021年10月26日	新股锁定	33.22	87.50	925	30,728.50	80,937.50		-
300981	中红医疗	2021年4月19日	2021年10月27日	新股锁定	48.59	90.39	421	20,456.39	38,054.19		-
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	-
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	-

		日	日							
301016	雷尔伟	2021年 6月23 日	2021年 12月30 日	新股锁定	13.75	32.98	275	3,781.25	9,069.50	-
301020	密封科技	2021年 6月28 日	2021年 7月6 日	新股未上市	10.64	10.64	4,210	44,794.40	44,794.40	-
301021	英诺激光	2021年 6月28 日	2021年 7月6 日	新股未上市	9.46	9.46	2,899	27,424.54	27,424.54	-
605162	新中港	2021年 6月29 日	2021年 7月7 日	新股未上市	6.07	6.07	1,377	8,358.39	8,358.39	-
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	-
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	-
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	-
688625	呈和科技	2021年 5月31 日	2021年 12月7 日	新股锁定	16.48	42.63	2,672	44,034.56	113,907.36	-
688630	芯碁微装	2021年 3月25 日	2021年 10月8 日	新股锁定	15.23	58.42	3,397	51,736.31	198,452.74	-
688677	海泰新光	2021年 2月18 日	2021年 8月26 日	新股锁定	35.76	103.23	1,768	63,223.68	182,510.64	-

## 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
127038	国微转债	2021年 6月10 日	2021年 7月14 日	新债未上市	100.00	100.00	2	200.00	200.00	-

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

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、拒绝支付到期本息等情况，导致基金资产损失和收益变化的风险。

本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的银行存款存放在本基金的托管行中国农业银行，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，本基金无债券投资。（上年度末：无）

#### 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	75,461,522.96	-	-	-	75,461,522.96
结算备付金	2,144,783.85	-	-	-	2,144,783.85

存出保证金	1,074,391.26	-	-	-	1,074,391.26
交易性金融资产	-	-	2,939,786.16	1,020,533,245.76	1,023,473,031.92
应收利息	-	-	-	21,102.71	21,102.71
应收股利	-	-	-	435.20	435.20
应收申购款	-	-	-	3,521,357.50	3,521,357.50
资产总计	78,680,698.07	-	2,939,786.16	1,024,076,141.17	1,105,696,625.40
负债	-	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	24,423,083.86	24,423,083.86
应付管理人报酬	-	-	-	1,410,365.88	1,410,365.88
应付托管费	-	-	-	235,060.97	235,060.97
应付证券清算款	-	-	-	5,760.99	5,760.99
应付销售服务费	-	-	-	113,024.48	113,024.48
应付交易费用	-	-	-	1,790,919.04	1,790,919.04
应交税费	-	-	-	21.50	21.50
其他负债	-	-	-	133,075.92	133,075.92
负债总计	-	-	-	28,111,312.64	28,111,312.64
利率敏感度缺口	78,680,698.07	-	2,939,786.16	995,964,828.53	1,077,585,312.76
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	611,426,814.47	-	-	-	611,426,814.47
交易性金融资产	-	-	-	1,865,248,636.50	1,865,248,636.50
应收利息	-	-	-	146,778.47	146,778.47
资产总计	611,426,814.47	-	-	1,865,395,414.97	2,476,822,229.44
负债	-	-	-	-	-
应付管理人报酬	-	-	-	2,925,575.17	2,925,575.17
应付托管费	-	-	-	487,595.84	487,595.84
应付证券清算款	-	-	-	127.72	127.72
应付销售服务费	-	-	-	158,523.44	158,523.44
应付交易费用	-	-	-	1,812,351.63	1,812,351.63
负债总计	-	-	-	5,384,173.80	5,384,173.80
利率敏感度缺口	611,426,814.47	-	-	1,860,011,241.17	2,471,438,055.64

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

#### 6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

于本期末，本基金未持有交易性债券投资（上年度末：同），因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响（上年度末：同）。

#### 6.4.13.4.2 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



金持有不以记账本位币计价的资产，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。

#### 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	-	116,159,341.53	-	116,159,341.53
资产合计	-	116,159,341.53	-	116,159,341.53
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	-	116,159,341.53	-	116,159,341.53
项目	上年度末 2020年12月31日			
	美元 折合人民币 元	港币 折合人民币元	其他币种 折合人民币元	合计
以外币计价的 资产				
交易性金融资产	-	299,992,141.66	-	299,992,141.66
资产合计	-	299,992,141.66	-	299,992,141.66
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	-	299,992,141.66	-	299,992,141.66

#### 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	对资产负债表日基金资产净值的

	动	影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2021年6月30日）	上年度末（2020年12月31日）
分析	港币相对人民币升值 5%	5,807,967.08	-
	港币相对人民币贬值 5%	-5,807,967.07	-

#### 6.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场交易的股票和债券，所面临的其他价格风险来源于单个证券发行主体自身经营情况或特殊事项的影响，也可能来源于证券市场整体波动的影响。

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

#### 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		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	1,020,533,245.76	94.71	1,865,248,636.50	75.47
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	1,020,533,245.76	94.71	1,865,248,636.50	75.47

## 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）	上年度末（2020年12月31日）
分析	1. 业绩比较基准上升 5%	74,962,135.69	-
	2. 业绩比较基准下降 5%	-74,962,135.69	-

## 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	1,020,533,245.76	92.30
	其中：股票	1,020,533,245.76	92.30
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	2,939,786.16	0.27
	其中：债券	2,939,786.16	0.27
	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	77,606,306.81	7.02
8	其他各项资产	4,617,286.67	0.42
9	合计	1,105,696,625.40	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	26,977,805.60	2.50
B	采矿业	87,263.74	0.01

C	制造业	767,650,805.23	71.24
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	125,531.19	0.01
E	建筑业	196,154.94	0.02
F	批发和零售业	626,776.98	0.06
G	交通运输、仓储和邮政业	27,865.35	0.00
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	960,651.09	0.09
J	金融业	105,965,994.40	9.83
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	162,396.66	0.02
M	科学研究和技术服务业	1,099,563.49	0.10
N	水利、环境和公共设施管理业	458,403.83	0.04
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	34,691.73	0.00
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	904,373,904.23	83.93

### 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	33,873,352.74	3.14
日常消费品	-	-
能源	-	-
金融	-	-
医疗保健	57,657,951.82	5.35
工业	-	-
信息技术	24,628,036.97	2.29
原材料	-	-
房地产	-	-
合计	116,159,341.53	10.78

注：以上分类采用全球行业分类标准（GICS）

### 7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	300750	宁德时代	204,307	109,263,383.60	10.14
2	300059	东方财富	3,222,300	105,659,217.00	9.81
3	603392	万泰生物	395,377	102,473,810.86	9.51

4	688029	南微医学	265,404	82,723,772.76	7.68
5	688036	传音控股	357,662	74,930,189.00	6.95
6	300595	欧普康视	670,330	69,412,671.50	6.44
7	01951	锦欣生殖	3,528,000	57,537,333.50	5.34
8	300151	昌红科技	1,686,775	45,441,718.50	4.22
9	300363	博腾股份	528,513	44,458,513.56	4.13
10	300119	瑞普生物	1,155,271	39,071,265.22	3.63
11	601012	隆基股份	432,460	38,419,746.40	3.57
12	00175	吉利汽车	1,665,000	33,873,352.74	3.14
13	300761	立华股份	810,200	26,841,926.00	2.49
14	300274	阳光电源	226,900	26,107,114.00	2.42
15	00968	信义光能	1,766,000	24,628,036.97	2.29
16	002459	晶澳科技	432,500	21,192,500.00	1.97
17	000625	长安汽车	683,400	17,959,752.00	1.67
18	688599	天合光能	539,859	15,305,002.65	1.42
19	300979	华利集团	132,282	15,042,499.80	1.40
20	605089	味知香	159,170	13,850,973.40	1.29
21	688116	天奈科技	107,363	12,668,834.00	1.18
22	300390	天华超净	236,100	11,339,883.00	1.05
23	002241	歌尔股份	156,800	6,701,632.00	0.62
24	605337	李子园	88,588	5,270,986.00	0.49
25	688131	皓元医药	1,955	676,801.45	0.06
26	300973	立高食品	3,593	542,770.60	0.05
27	300981	中红医疗	4,202	464,777.85	0.04
28	688660	电气风电	51,238	450,894.40	0.04
29	688626	翔宇医疗	3,652	441,307.68	0.04
30	688690	纳微科技	3,477	408,547.50	0.04
31	688606	奥泰生物	2,703	402,747.00	0.04
32	688383	新益昌	2,701	380,868.01	0.04
33	688317	之江生物	5,740	372,813.00	0.03
34	688276	百克生物	3,486	364,565.88	0.03
35	688076	诺泰生物	4,984	339,958.64	0.03
36	688161	威高骨科	3,069	325,467.45	0.03
37	688269	凯立新材	1,941	270,808.32	0.03
38	688183	生益电子	18,394	267,264.82	0.02
39	300953	震裕科技	2,394	258,642.30	0.02
40	301015	百洋医药	4,614	251,115.78	0.02
41	688819	天能股份	5,563	247,497.87	0.02
42	688613	奥精医疗	2,617	237,597.43	0.02
43	688180	君实生物	2,838	230,473.98	0.02
44	688538	和辉光电	57,569	219,337.89	0.02
45	300957	贝泰妮	851	214,911.21	0.02

46	688408	中信博	1,054	211,643.20	0.02
47	688083	中望软件	378	208,769.40	0.02
48	300941	创识科技	3,989	204,452.06	0.02
49	688630	芯碁微装	3,397	198,452.74	0.02
50	688677	海泰新光	1,768	182,510.64	0.02
51	688315	诺禾致源	3,711	181,096.80	0.02
52	300968	格林精密	11,620	179,261.74	0.02
53	688609	九联科技	10,372	179,228.16	0.02
54	300614	百川畅银	3,283	176,700.30	0.02
55	300982	苏文电能	3,170	173,982.28	0.02
56	688059	华锐精密	1,023	171,761.70	0.02
57	301013	利和兴	4,704	168,966.51	0.02
58	300997	欢乐家	9,279	168,775.16	0.02
59	688425	铁建重工	27,017	165,344.04	0.02
60	688700	东威科技	3,049	162,755.62	0.02
61	301002	崧盛股份	2,001	159,001.62	0.01
62	605499	东鹏饮料	632	158,505.60	0.01
63	300932	三友联众	4,918	157,897.22	0.01
64	688687	凯因科技	5,354	155,266.00	0.01
65	301006	迈拓股份	5,051	154,055.50	0.01
66	688323	瑞华泰	4,513	142,565.67	0.01
67	300940	南极光	3,068	136,458.26	0.01
68	688157	松井股份	1,075	134,009.50	0.01
69	300962	中金辐照	5,757	133,773.12	0.01
70	300937	药易购	2,434	133,599.04	0.01
71	688216	气派科技	2,000	133,400.00	0.01
72	300996	普联软件	2,410	132,487.34	0.01
73	688621	阳光诺和	1,485	131,868.00	0.01
74	300942	易瑞生物	4,428	131,028.71	0.01
75	600906	财达证券	7,597	128,237.36	0.01
76	688319	欧林生物	3,412	127,642.92	0.01
77	300966	共同药业	2,858	126,586.56	0.01
78	688208	道通科技	1,450	126,135.50	0.01
79	688682	霍莱沃	946	121,277.20	0.01
80	688689	银河微电	3,258	121,165.02	0.01
81	01066	威高股份	8,000	120,618.32	0.01
82	300933	中辰股份	11,117	117,462.18	0.01
83	300955	嘉亨家化	2,314	115,870.88	0.01
84	301016	雷尔伟	2,747	115,711.58	0.01
85	688314	康拓医疗	1,085	114,619.40	0.01
86	688617	惠泰医疗	299	113,916.01	0.01
87	688625	呈和科技	2,672	113,907.36	0.01

88	688201	信安世纪	2,129	111,240.25	0.01
89	688639	华恒生物	2,302	110,472.98	0.01
90	002920	德赛西威	1,000	110,080.00	0.01
91	003035	南网能源	11,046	109,797.24	0.01
92	300978	东箭科技	5,930	105,678.53	0.01
93	300986	志特新材	2,632	103,429.84	0.01
94	688656	浩欧博	1,371	101,961.27	0.01
95	688109	品茗股份	1,301	101,009.64	0.01
96	300956	英力股份	3,707	100,044.12	0.01
97	300993	玉马遮阳	4,097	99,899.55	0.01
98	688636	智明达	918	97,583.40	0.01
99	601888	中国中免	323	96,932.30	0.01
100	300961	深水海纳	3,936	95,687.10	0.01
101	300952	恒辉安防	3,398	95,320.48	0.01
102	688662	富信科技	2,556	93,856.32	0.01
103	688456	有研粉材	3,396	93,729.60	0.01
104	688628	优利德	2,789	93,292.05	0.01
105	688113	联测科技	1,415	93,107.00	0.01
106	300945	曼卡龙	4,731	92,939.73	0.01
107	688533	上声电子	3,493	91,865.90	0.01
108	300991	创益通	2,535	89,214.50	0.01
109	300975	商络电子	4,917	88,140.51	0.01
110	688607	康众医疗	1,890	87,507.00	0.01
111	688468	科美诊断	3,919	87,432.89	0.01
112	688070	纵横股份	2,407	87,085.26	0.01
113	688633	星球石墨	1,558	87,045.46	0.01
114	300958	建工修复	2,993	86,747.74	0.01
115	688217	睿昂基因	1,040	86,736.00	0.01
116	300963	中洲特材	2,830	85,321.67	0.01
117	300971	博亚精工	2,445	84,503.05	0.01
118	688499	利元亨	2,149	83,488.65	0.01
119	300967	晓鸣股份	5,061	81,674.88	0.01
120	601963	重庆银行	7,472	81,220.64	0.01
121	688117	圣诺生物	1,672	80,924.80	0.01
122	301011	华立科技	1,750	79,474.50	0.01
123	688359	三孚新科	2,213	78,561.50	0.01
124	001203	大中矿业	3,809	76,751.35	0.01
125	688355	明志科技	2,710	72,384.10	0.01
126	688663	新风光	3,279	71,023.14	0.01
127	002612	朗姿股份	1,300	70,226.00	0.01
128	688191	智洋创新	3,203	69,184.80	0.01
129	688611	杭州柯林	1,400	68,726.00	0.01

130	688685	迈信林	2,612	67,781.40	0.01
131	688260	昀冢科技	2,990	64,105.60	0.01
132	688655	迅捷兴	3,083	62,893.20	0.01
133	688676	金盘科技	3,750	62,812.50	0.01
134	601665	齐鲁银行	6,731	62,598.30	0.01
135	688328	深科达	1,499	60,514.63	0.01
136	301007	德迈仕	3,022	60,305.15	0.01
137	300998	宁波方正	2,003	60,075.24	0.01
138	300943	春晖智控	2,542	59,955.10	0.01
139	603529	爱玛科技	1,019	59,224.28	0.01
140	688350	富淼科技	2,552	58,236.64	0.01
141	300995	奇德新材	1,909	57,368.52	0.01
142	300960	通业科技	2,332	57,006.84	0.01
143	301012	扬电科技	1,691	56,994.16	0.01
144	688683	莱尔科技	3,296	56,757.12	0.01
145	688239	航宇科技	4,926	56,550.48	0.01
146	688616	西力科技	3,918	55,870.68	0.01
147	300992	泰福泵业	1,998	55,828.42	0.01
148	002913	奥士康	715	55,734.25	0.01
149	300929	华骐环保	1,827	54,892.05	0.01
150	300627	华测导航	1,600	54,576.00	0.01
151	688087	英科再生	2,469	54,219.24	0.01
152	600916	中国黄金	3,371	52,317.92	0.00
153	301010	晶雪节能	2,172	50,480.96	0.00
154	601156	东航物流	2,090	49,470.30	0.00
155	688597	煜邦电力	3,907	49,306.34	0.00
156	688659	元琛科技	3,671	48,530.62	0.00
157	301020	密封科技	4,210	44,794.40	0.00
158	688395	正弦电气	1,627	44,465.91	0.00
159	688565	力源科技	2,464	44,376.64	0.00
160	688517	金冠电气	2,892	41,095.32	0.00
161	688067	爱威科技	1,259	39,520.01	0.00
162	688092	爱科科技	1,137	39,283.35	0.00
163	605339	南侨食品	864	37,307.52	0.00
164	600032	浙江新能	3,045	37,027.20	0.00
165	301000	肇民科技	500	36,075.00	0.00
166	605090	九丰能源	1,090	35,326.90	0.00
167	688681	科汇股份	1,899	34,903.62	0.00
168	601528	瑞丰银行	2,230	34,721.10	0.00
169	003040	楚天龙	1,101	33,470.40	0.00
170	301009	可靠股份	1,007	29,277.97	0.00
171	605077	华康股份	618	28,193.16	0.00



172	301021	英诺激光	2,899	27,424.54	0.00
173	001201	东瑞股份	668	27,347.92	0.00
174	605296	神农集团	569	26,856.80	0.00
175	603324	盛剑环境	732	26,630.16	0.00
176	605080	浙江自然	374	23,487.20	0.00
177	603759	海天股份	1,119	22,939.50	0.00
178	605268	王力安防	1,642	22,659.60	0.00
179	001207	联科科技	682	22,581.02	0.00
180	601279	英利汽车	2,004	20,901.72	0.00
181	605389	长龄液压	356	20,890.08	0.00
182	001206	依依股份	321	20,389.92	0.00
183	605305	中际联合	368	19,364.16	0.00
184	001205	盛航股份	577	18,850.59	0.00
185	605122	四方新材	703	18,770.10	0.00
186	003032	传智教育	586	18,429.70	0.00
187	603511	爱慕股份	553	18,249.00	0.00
188	605208	永茂泰	801	17,485.83	0.00
189	688226	威腾电气	2,693	17,289.06	0.00
190	605368	蓝天燃气	1,204	17,217.20	0.00
191	003037	三和管桩	1,274	16,765.84	0.00
192	605098	行动教育	289	16,262.03	0.00
193	605196	华通线缆	1,172	16,079.84	0.00
194	605300	佳禾食品	576	16,012.80	0.00
195	603836	海程邦达	733	15,994.06	0.00
196	002049	紫光国微	100	15,419.00	0.00
197	605016	百龙创园	445	14,222.20	0.00
198	605180	华生科技	384	14,208.00	0.00
199	605060	联德股份	883	13,933.74	0.00
200	605319	无锡振华	764	13,706.16	0.00
201	001208	华菱线缆	1,754	13,558.42	0.00
202	605133	嵘泰股份	618	13,398.24	0.00
203	603171	税友股份	637	12,230.40	0.00
204	605286	同力日升	597	12,208.65	0.00
205	003036	泰坦股份	776	11,958.16	0.00
206	605228	神通科技	1,217	11,464.14	0.00
207	605303	园林股份	610	11,242.30	0.00
208	605488	福莱新材	416	11,103.04	0.00
209	605289	罗曼股份	379	10,930.36	0.00
210	605055	迎丰股份	1,147	10,919.44	0.00
211	605259	绿田机械	295	10,516.75	0.00
212	605086	龙高股份	443	10,512.39	0.00
213	003038	鑫铂股份	383	10,463.56	0.00

214	605005	合兴股份	634	10,321.52	0.00
215	605189	富春染织	423	10,190.07	0.00
216	003041	真爱美家	349	9,876.70	0.00
217	003033	征和工业	301	9,538.69	0.00
218	001202	炬申股份	459	9,014.76	0.00
219	600859	王府井	300	8,664.00	0.00
220	605162	新中港	1,377	8,358.39	0.00
221	605298	必得科技	391	7,847.37	0.00
222	002810	山东赫达	129	6,083.64	0.00
223	605011	杭州热电	525	4,662.00	0.00
224	002179	中航光电	57	4,504.14	0.00
225	000338	潍柴动力	177	3,162.99	0.00
226	600161	天坛生物	91	3,116.75	0.00
227	002001	新和成	108	3,097.44	0.00
228	603187	海容冷链	60	2,572.80	0.00
229	600733	北汽蓝谷	75	1,011.00	0.00
230	600276	恒瑞医药	10	679.70	0.00
231	300124	汇川技术	1	74.26	0.00

注：截至报告期末，本基金投资的一家公司发行的证券宁德时代（300750.SZ）因市值波动导致投资比例被动超标。

## 7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

### 7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	300059	东方财富	105,555,290.77	4.27
2	300124	汇川技术	102,269,190.90	4.14
3	300750	宁德时代	101,626,364.10	4.11
4	603392	万泰生物	98,916,525.22	4.00
5	00700	腾讯控股	98,463,642.96	3.98
6	300151	昌红科技	78,517,224.52	3.18
7	688036	传音控股	74,366,912.10	3.01
8	688029	南微医学	68,210,660.09	2.76
9	00388	香港交易所	67,591,279.91	2.73
10	002612	朗姿股份	66,874,696.70	2.71
11	600519	贵州茅台	64,621,484.00	2.61
12	300595	欧普康视	64,557,877.00	2.61
13	300628	亿联网络	64,321,151.35	2.60
14	688575	亚辉龙	52,769,066.76	2.14
15	01951	锦欣生殖	52,338,829.55	2.12
16	03690	美团-W	48,178,243.73	1.95

17	000913	钱江摩托	46,658,533.63	1.89
18	000100	TCL 科技	45,401,035.00	1.84
19	300119	瑞普生物	44,639,828.92	1.81
20	000338	潍柴动力	42,701,887.94	1.73

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

#### 7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	300750	宁德时代	251,910,401.60	10.19
2	601888	中国中免	221,194,767.09	8.95
3	002179	中航光电	211,923,796.33	8.57
4	600519	贵州茅台	188,576,260.46	7.63
5	000568	泸州老窖	167,862,370.14	6.79
6	000858	五粮液	144,425,564.62	5.84
7	600809	山西汾酒	138,977,515.34	5.62
8	02269	药明生物	122,060,551.79	4.94
9	688029	南微医学	120,798,613.58	4.89
10	00291	华润啤酒	115,909,262.67	4.69
11	600872	中炬高新	107,566,120.59	4.35
12	000596	古井贡酒	105,211,951.07	4.26
13	603392	万泰生物	102,234,905.80	4.14
14	300124	汇川技术	98,980,119.01	4.00
15	00700	腾讯控股	98,178,815.74	3.97
16	002612	朗姿股份	88,113,618.73	3.57
17	00388	香港交易所	69,083,857.00	2.80
18	300628	亿联网络	68,302,737.20	2.76
19	01579	颐海国际	56,809,861.10	2.30
20	03690	美团-W	49,515,216.70	2.00

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	2,315,532,115.53
卖出股票收入（成交）总额	3,388,840,058.62

注：上述金额均指成交金额（成交单价乘以成交数量），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）	2,939,786.16	0.27
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	2,939,786.16	0.27

#### 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	123109	昌红转债	25,172	2,939,586.16	0.27
2	127038	国微转债	2	200.00	0.00

#### 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	1,074,391.26
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	435.20
4	应收利息	21,102.71
5	应收申购款	3,521,357.50
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	4,617,286.67

### 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（%）
大成成长	19,503	30,856.66	2,194,553.44	0.36	599,602,802.05	99.64

进取混合 A						
大成成长进取混合 C	47,878	5,627.09	10,005.77	-	269,403,916.40	100.00
合计	67,381	12,929.63	2,204,559.21	0.25	869,006,718.45	99.75

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

2、持有人户数为有效户数，即存量份额大于零的账户。

## 8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数（份）	占基金总份额比例（%）
基金管理人所有从业人员持有本基金	大成成长进取混合 A	467,222.61	0.0776
	大成成长进取混合 C	37,806.90	0.0140
	合计	505,029.51	0.0580

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、基金投资和研发部门负责人持有本开放式基金	大成成长进取混合 A	0~10
	大成成长进取混合 C	0
	合计	0~10

本基金基金经理持有 本开放式基金	大成成长进取混合 A	0
	大成成长进取混合 C	0
	合计	0

## § 9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	大成成长进取混合 A	大成成长进取混合 C
基金合同生效日 (2020 年 11 月 30 日) 基金份额总额	1,813,451,860.87	462,529,544.12
本报告期期初基金份 额总额	1,813,451,860.87	462,529,544.12
本报告期基金总申购 份额	364,216,932.62	317,783,705.37
减: 本报告期基金总 赎回份额	1,575,871,438.00	510,899,327.32
本报告期基金拆分变 动份额 (份额减少以 “-” 填列)	-	-
本报告期末基金份 额总额	601,797,355.49	269,413,922.17

## § 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

2021 年 5 月, 中国农业银行总行决定谭敦宇任托管业务部总裁。

### 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	
光大证券	2	898,570,369.78	15.78%	728,235.23	14.33%	-
西部证券	1	802,622,549.73	14.10%	731,431.72	14.39%	-
兴业证券	2	767,526,796.14	13.48%	699,451.92	13.76%	-
中泰证券	2	708,594,930.49	12.44%	645,745.92	12.70%	-
招商证券	2	490,587,036.87	8.62%	436,427.66	8.59%	-
国盛证券	1	462,322,309.44	8.12%	421,333.32	8.29%	-
方正证券	1	365,570,881.30	6.42%	333,138.52	6.55%	-
安信证券	1	295,046,809.31	5.18%	268,875.66	5.29%	-
广发证券	2	287,631,864.97	5.05%	262,125.87	5.16%	-
中金公司	3	219,660,190.13	3.86%	200,198.05	3.94%	-
瑞银证券	2	175,304,641.41	3.08%	155,603.42	3.06%	-
东财证券	1	120,367,043.58	2.11%	109,690.67	2.16%	-
东兴证券	1	78,184,255.40	1.37%	71,244.90	1.40%	-
国泰君安	3	21,975,026.08	0.39%	20,026.28	0.39%	-
爱建证券	1	-	-	-	-	-
长城证券	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	-	-	-	-	-
高华证券	1	-	-	-	-	-
国金证券	2	-	-	-	-	-
国信证券	1	-	-	-	-	-
海通证券	1	-	-	-	-	-
红塔证券	1	-	-	-	-	-
华创证券	1	-	-	-	-	-
华泰证券	1	-	-	-	-	-
华西证券	1	-	-	-	-	-
民生证券	1	-	-	-	-	-
平安证券	1	-	-	-	-	-
山西证券	1	-	-	-	-	-
上海证券	1	-	-	-	-	-
申万宏源	2	-	-	-	-	-
世纪证券	1	-	-	-	-	-
天风证券	2	-	-	-	-	-
万和证券	1	-	-	-	-	-
湘财证券	1	-	-	-	-	-
信达证券	1	-	-	-	-	-
粤开证券	1	-	-	-	-	-
浙商证券	1	-	-	-	-	-
中国银河证 券	4	-	-	-	-	-
中信建投证 券	2	-	-	-	-	-
中信证券	2	-	-	-	-	-
中银国际证	1	-	-	-	-	-

券						
中原证券	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。

本报告期内本基金租用证券公司交易单元的变更情况如下：

本报告期内本基金新增的交易单元：无；退租交易单元：无。

#### 10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

无。

#### 10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	关于提请投资者及时更新已过期身份证件或者身份证明文件的公告	中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站	2021年6月30日
2	大成基金管理有限公司关于旗下部分基金增加平安银行股份有限公司为销售机构的公告	中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站	2021年6月28日
3	大成基金管理有限公司关于旗下部分基金增加北京蛋卷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6月11日
4	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
5	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

6	大成基金管理有限公司关于旗下部分基金增加招商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 12 日
7	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
8	大成成长进取混合型证券投资基金第一季度报告	中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站	2021 年 4 月 22 日
9	大成基金管理有限公司提醒投资者谨防金融诈骗的公告	中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站	2021 年 3 月 23 日
10	大成基金管理有限公司关于旗下部分基金增加鼎信汇金（北京）投资管理有限公司为销售机构的公告	中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站	2021 年 3 月 11 日
11	大成成长进取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 1 月 6 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成长进取混合型证券投资基金的文件；
- 2、《大成成长进取混合型证券投资基金基金合同》；
- 3、《大成成长进取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