

# 大成汇享一年持有期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：中国工商银行股份有限公司

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。

基金托管人中国工商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	13
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	13
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	14
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	15
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	16
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	16
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	16
<b>§ 5 托管人报告</b>	<b>17</b>
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	17
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	17
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	17
<b>§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）</b>	<b>17</b>
6.1 资产负债表	17
6.2 利润表	18
6.3 所有者权益（基金净值）变动表	19
6.4 报表附注	20
<b>§ 7 投资组合报告</b>	<b>39</b>
7.1 期末基金资产组合情况	39
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	39
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细	40
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	41
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	42
7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细	43

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细 .....	43
7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细 .....	43
7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细 .....	43
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明 .....	43
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 .....	43
7.12 投资组合报告附注 .....	44
<b>§ 8 基金份额持有人信息 .....</b>	<b>45</b>
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....	45
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....	45
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况 .....	46
<b>§ 9 开放式基金份额变动 .....</b>	<b>46</b>
<b>§ 10 重大事件揭示 .....</b>	<b>46</b>
10.1 基金份额持有人大会决议 .....	46
10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动 .....	46
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....	47
10.4 基金投资策略的改变 .....	47
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....	47
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 .....	47
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	47
10.8 其他重大事件 .....	48
<b>§ 11 影响投资者决策的其他重要信息 .....</b>	<b>49</b>
11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况 .....	49
11.2 影响投资者决策的其他重要信息 .....	49
<b>§ 12 备查文件目录 .....</b>	<b>49</b>
12.1 备查文件目录 .....	49
12.2 存放地点 .....	50
12.3 查阅方式 .....	50

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	大成汇享一年持有期混合型证券投资基金	
基金简称	大成汇享一年持有混合	
基金主代码	009796	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2020 年 9 月 3 日	
基金管理人	大成基金管理有限公司	
基金托管人	中国工商银行股份有限公司	
报告期末基金份 额总额	478,959,054.40 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基 金简称	大成汇享一年持有混合 A	大成汇享一年持有混合 C
下属分级基金的交 易代码	009796	009797
报告期末下属分级 基金的份额总额	462,584,747.05 份	16,374,307.35 份

### 2.2 基金产品说明

投资目标	在严格控制风险的基础上，通过积极主动的投资管理，追求基金资产的长期稳健增值，力争实现超越业绩比较基准的投资回报。
投资策略	本基金的投资策略分为两方面：一方面体现在采取“自上而下”的方式对权益类、固定收益类等不同类别资产进行大类配置；另一方面体现在对单个投资品种的精选上。
业绩比较基准	沪深 300 指数收益率*10%+恒生指数收益率*5%+中证综合债券指数收益率*80%+金融机构人民币活期存款利率(税后)*5%
风险收益特征	本基金为混合型基金，其预期风险与预期收益高于债券型基金与货币市场基金，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	中国工商银行股份有限公司
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	95588
传真	0755-83199588	010-66105798
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 55 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 55

	商银行大厦 32 层	号
邮政编码	518040	100140
法定代表人	吴庆斌	陈四清

## 2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《上海证券报》
登载基金中期报告正文的管理人互联网网址	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)	
	大成汇享一年持有混合 A	大成汇享一年持有混合 C
本期已实现收益	-3,816,751.63	-167,240.50
本期利润	-4,031,449.48	-174,291.10
加权平均基金份额本期利润	-0.0087	-0.0107
本期加权平均净值利润率	-0.86%	-1.06%
本期基金份额净值增长率	-0.85%	-1.04%
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	33,433.07
	期末可供分配基金份额利润	0.0020
	期末基金资产净值	16,521,388.65

期末基金份额净值	1.0123	1.0090
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	1.23%	0.90%

注：1、本期已实现收益指本期利息收入、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

大成汇享一年持有混合 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	0.50%	0.14%	-0.10%	0.12%	0.60%	0.02%
过去三个月	0.78%	0.27%	1.45%	0.13%	-0.67%	0.14%
过去六个月	-0.85%	0.27%	2.20%	0.18%	-3.05%	0.09%
自基金合同生效起至今	1.23%	0.23%	4.49%	0.17%	-3.26%	0.06%

大成汇享一年持有混合 C

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去一个月	0.47%	0.14%	-0.10%	0.12%	0.57%	0.02%

过去三个月	0.68%	0.27%	1.45%	0.13%	-0.77%	0.14%
过去六个月	-1.04%	0.27%	2.20%	0.18%	-3.24%	0.09%
自基金合同生效起 至今	0.90%	0.23%	4.49%	0.17%	-3.59%	0.06%

### 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

大成汇享一年持有混合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



大成汇享一年持有混合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9月3日，截至报告期末本基金合同生效未满一年。

2、本基金合同规定，基金管理人应当自基金合同生效之日起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		
王磊	本基金基金经理	2020年9月3日	-	17年	经济学硕士。2003年5月至2012年10月曾任证券时报社公司新闻部记者、世纪证券投资银行部业务董事、国信证券经济研究所分析师及资产管理总部专户投资经理、中银基金管理有限公司专户理财部投资经理及总监（主持工作）。2012年11月加入大成基金管理有限公司，曾担任社保基金及机构投资部投资经理、固定收益总部基金经理、股票投资部基金经理，现任股票投资部总监助理。2013年6月7日至2015年7月15日任大成强化收益债券型证券投资基金基金经理。2015年7月16日到2016年3月25日任大成强化收益定期开放债券型证券投资基金基金经理。2013年7月17日到2016年3月25日任大成景恒保本混合型证券投资基金基金经理。2013年11月9日到2016年3月25日任

					大成可转债增强债券型证券投资基金基金经理。2014 年 6 月 26 到 2016 年 3 月 25 日任大成景益平稳收益混合型证券投资基金基金经理。2014 年 9 月 3 日至 2016 年 3 月 23 日任大成景丰债券型证券投资基金 (LOF) 基金经理。2014 年 12 月 9 日至 2016 年 3 月 25 日任大成景利混合型证券投资基金基金经理。2015 年 12 月 14 日起任大成行业轮动混合型证券投资基金基金经理。2016 年 11 月 11 日起担任大成景尚灵活配置混合型证券投资基金基金经理。2017 年 6 月 9 日起任大成积极成长混合型证券投资基金基金经理。2017 年 6 月 9 日起任大成灵活配置混合型证券投资基金基金经理。2017 年 9 月 21 日至 2019 年 1 月 9 日任大成国企改革灵活配置混合型证券投资基金基金经理。2017 年 12 月 1 日至 2020 年 10 月 30 日任大成财富管理 2020 生命周期证券投资基金基金经理。2020 年 3 月 5 日起任大成恒享混合型证券投资基金基金经理。2020 年 3 月 31 日起任大成民稳增长混合型证券投资基金基金经理。2020 年 4 月 26 日起任大成景瑞稳健配置混合型证券投资基金基金经理。2020 年 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 2 月 9 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。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
孙丹	本基金基金经理	2020 年 9 月 3 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、

				<p>大成景源灵活配置混合型证券投资基金基金经理助理, 现任固定收益总部总监助理。2018 年 3 月 12 日起任大成策略回报混合型证券投资基金、大成创新成长混合型证券投资基金 (LOF)、大成积极成长混合型证券投资基金、大成精选增值混合型证券投资基金、大成景阳领先混合型证券投资基金、大成竞争优势混合型证券投资基金、大成蓝筹稳健证券投资基金、大成优选混合型证券投资基金 (LOF) 基金经理助理。2020 年 7 月 1 日起任大成价值增长证券投资基金、大成多策略灵活配置混合型证券投资基金 (LOF)、大成一带一路灵活配置混合型证券投资基金、大成内需增长混合型证券投资基金、大成睿景灵活配置混合型证券投资基金、大成盛世精选灵活配置混合型证券投资基金、大成国企改革灵活配置混合型证券投资基金、大成行业轮动混合型证券投资基金、大成灵活配置混合型证券投资基金、大成产业升级股票型证券投资基金 (LOF)、大成健康产业混合型证券投资基金、大成正向回报灵活配置混合型证券投资基金、大成国家安全主题灵活配置混合型证券投资基金、大成新锐产业混合型证券投资基金、大成消费主题混合型证券投资基金基金经理助理。2020 年 11 月 6 日起任大成科技消费股票型证券投资基金、大成科创主题 3 年封闭运作灵活配置混合型证券投资基金、大成中小盘混合型证券投资基金 (LOF)、大成睿享混合型证券投资基金、大成行业先锋混合型证券投资基金基金经理助理。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</p>
--	--	--	--	---

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

					格。国籍：中国
徐 雄 晖	本基金基 金经理	2021 年 6 月 17 日	-	13 年	经济学硕士。2008 年 7 月至 2015 年 5 月先后担任大成基金管理有限公司研究部行业研究主管、基金经理助理，股票投资部基金经理。2015 年 11 月至 2017 年 10 月任红土创新基金管理有限公司股票投资部基金经理。2018 年 6 月至 2021 年 4 月任生命保险资产管理有限公司权益投资部投资经理。2021 年 4 月起任大成基金管理有限公司股票投资部基金经理。2021 年 6 月 16 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。2021 年 7 月 14 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。具有基金从业资格。国籍：中国

注：1、任职日期、离任日期为本基金管理人作出决定之日。

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

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

无

#### 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

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

#### 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

##### 4.3.1 公平交易制度的执行情况

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

##### 4.3.2 异常交易行为的专项说明

报告期内，基金管理人旗下所有投资组合未发现存在异常交易行为。主动投资组合间股票交易不存在同日反向交易。主动型投资组合与指数型投资组合之间或指数型投资组合之间存在股票

同日反向交易，但不存在参与交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量超过该股当日成交量 5%的情形；主动投资组合间债券交易存在 2 笔同日反向交易，原因为流动性需要。投资组合间相邻交易日反向交易的市场成交比例、成交均价等交易结果数据表明该类交易不对市场产生重大影响，无异常。

#### 4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

##### 4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

毫无疑问，过去三年里我们的资本市场发生了一些永久性的变化。我们看到了史无前例的估值分化，也看到了估值本身对股价解释力的下降。从市场的结构来看，我们看到市场上大部分交易日个股涨跌参半的现象已经持续了相当长的时间，这意味着投资者的行为更加多元化。信息充分流通、投资者行为多元化、市场深度的增加等等，根据经典的市场理论，这些特征都预示着市场正在变得更加有效。我们倾向于认为当前的市场就是对当前宏观状态的有效反应。而这种状态是否会被打破则取决于宏观环境是否会发生超预期的冲击。

上半年国内经济复苏的态势有所放缓，我们认为这属于正常现象，过去一年我们的经济经历了一次超常规的复苏。从这样超常规的状态恢复正常是否就意味着衰退？我们是否会经历一次由于长期投资不足带来的大宗商品价格远超预期的上涨？同样，当我们担忧货币收紧对大宗商品价格中隐含的金融属性打击的时候，这种打击是否也会同样作用于权益市场中估值的金融属性？而当市场期待由于经济复苏动力减弱，货币进一步放松再次带来估值普遍性地提升的同时，这种金融属性是否同样会在大宗商品中急剧放大，将全球的经济带入滞胀的困局？

当前的宏观环境充满分歧，甚至存在一些定义上的混乱，我们在努力寻找答案，也希望在组合中进行一定程度的平衡，以应对一些潜在的风险。我们持有一部分银行组合，以应对利率超预期的上升。同时在大宗商品领域，我们观察到与油气和服装相关的消费是实物消费中最后的复苏洼地，我们进行一定的配置，以应对大宗商品价格超预期上涨的风险。我们密切关注经济走势，并根据概率分布的变化适当地调整组合中的资产分布。

具体操作上，本季度我们主要提高了对电子、服装、家居、风电的持仓。服装和家居是消费行业中在过去几年因为激烈的竞争罕见地出现了相当程度出清的行业，我们观察到其中部分公司在激烈的竞争中已经脱颖而出。而反过来许多其他的消费行业我们观察到竞争明显的加剧。消费品公司长期的高盈利能力是企业护城河的体现，但严重偏离历史平均的盈利能力必然会导致竞争的加剧和利润率的回归。服装和家居行业与其他消费品类在竞争格局和估值上的背离，我们认为存在较大的投资机会。风电行业里，我们观察到组件价格的大幅下调带来的风电投资回报率的上升，以及未来装机大幅增长的潜力，我们相信行业内优质公司经历了需求、产品价格和成本等不

利因素的洗礼后，有望再次走上成长的轨道。

我们希望通过定期地回顾，来总结投资中的经验与教训，以保持自己在投资中的坦诚。我们无法保证对市场的全知全能，但对于错失的投资机遇我们会反思是由于过往积累的不足还是只是市场阶段性的风险偏好的变化，对于前者我们会继续加强研究的积累，对于后者我们会保持对市场的敬畏。本期服装行业的投资给我们贡献了较好的收益。

固收部分，组合在 3 月货币政策取向更为明朗化之后，逐渐提升了组合久期。信用债投资方面，今年规避风险事件的原则是加大发行人自身的经营情况与债务负担在信用评估中的权重，弱化战略地位、外部支持等因素对信用资质的加持。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末大成汇享一年持有混合 A 的基金份额净值为 1.0123 元，本报告期基金份额净值增长率为-0.85%，同期业绩比较基准收益率为 2.20%；截至本报告期末大成汇享一年持有混合 C 的基金份额净值为 1.0090 元，本报告期基金份额净值增长率为-1.04%，同期业绩比较基准收益率为 2.20%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望下半年，整体而言，经济仍趋于放缓，不过国内政策仍留有回旋余地，失速风险不大。具体来说，货币端由于正常化的较早，仍有调节空间。财政政策方面，由于上半年政府债券发行节奏较慢，预算内赤字和地方政府债务限额仍剩余较多额度，可以部分对冲房地产行业管控和地方政府债务风险管理的影响。由于上半年经济增长回落较为明显，加上大宗商品价格上涨对企业经营产生了一定影响，7 月的货币政策的调整出现的较预期更早一些，但政策取向的全面调整目前还面临着很多中期约束，可结合 7 月底的中央政治局会议来验证。

另外，海外政策也是影响资本市场的因素之一，美国对于应对疫情的政策对资本市场流动性和估值产生了巨大的影响。今年下半年，美联储预计将释放更清晰的有关于政策路径的信息。

下半年，国内的基本面和政策背景对债券市场相对有利，波动风险主要来自于资金面波动和债券市场微观杠杆率的上升。

对于权益市场来说，关于行业和选股，市场的偏好在不断地变化中。但不管市场风格如何变化，投资的最底层逻辑永远是一致的：“好资产+好价格”。阶段性的，市场会对这两个要素各有倾向。当前的市场状态下，市场更倾向于好资产，而对价格并不敏感，这造成了公认的好资产难有好的价格。但市场公认的好资产与未来收益率的高低并没有必然的联系。

我们非常感谢基金份额持有人的信任和支持，我们将按照本基金合同和风险收益特征的要求，严格控制投资风险，积极进行资产配置，适时调整组合结构，研究新的投资品种和挖掘投资机会，

力争获得与基金风险特征一致的稳定收益回报给投资者。

#### 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

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

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

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

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

#### 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

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

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

无。

## § 5 托管人报告

### 5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内，本基金托管人在对大成汇享一年持有期混合型证券投资基金的托管过程中，严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》及其他法律法规和基金合同的有关规定，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

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

本报告期内，大成汇享一年持有期混合型证券投资基金的管理人——大成基金管理有限公司在大成汇享一年持有期混合型证券投资基金的投资运作、基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格计算、基金费用开支等问题上，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，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真实、准确和完整发表意见

本托管人依法对大成基金管理有限公司编制和披露的大成汇享一年持有期混合型证券投资基金 2021 年中期报告中财务指标、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进行了核查，以上内容真实、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：大成汇享一年持有期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	6.4.3.1	580,604.03	563,737.47
结算备付金		3,354,090.36	2,983.66
存出保证金		38,562.00	19,309.59
交易性金融资产	6.4.3.2	470,113,013.57	491,891,683.40
其中：股票投资		112,244,394.17	64,110,201.80
基金投资		-	-
债券投资		357,868,619.40	427,781,481.60
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	6.4.3.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.3.4	42,500,303.75	-
应收证券清算款		3,499,338.68	441,990.10

应收利息	6.4.3.5	6,088,343.56	5,996,634.05
应收股利		-	-
应收申购款		9,186.28	9,974.90
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.3.6	-	-
资产总计		526,183,442.23	498,926,313.17
<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	6.4.3.3	-	-
卖出回购金融资产款		39,069,785.46	16,054,855.92
应付证券清算款		1,447,373.90	-
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		396,464.48	406,064.37
应付托管费		99,116.12	101,516.07
应付销售服务费		5,395.42	5,515.10
应付交易费用	6.4.3.7	244,612.42	58,038.11
应交税费		18,337.33	17,648.76
应付利息		2,603.86	3,576.54
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.3.8	103,219.55	70,000.00
负债合计		41,386,908.54	16,717,214.87
<b>所有者权益:</b>			
实收基金	6.4.3.9	478,959,054.40	472,332,906.68
未分配利润	6.4.3.10	5,837,479.29	9,876,191.62
所有者权益合计		484,796,533.69	482,209,098.30
负债和所有者权益总计		526,183,442.23	498,926,313.17

注：报告截止日 2021 年 06 月 30 日，基金份额总额 478,959,054.40 份，其中大成汇享一年持有混合 A 基金份额总额为 462,584,747.05 份，基金份额净值 1.0123 元。大成汇享一年持有混合 C 基金份额总额为 16,374,307.35 份，基金份额净值 1.0090 元。

## 6.2 利润表

会计主体：大成汇享一年持有期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		-202,627.26

1. 利息收入		7,551,582.41
其中：存款利息收入	6.4.3.11	28,701.60
债券利息收入		7,330,362.94
资产支持证券利息收入		-
买入返售金融资产收入		192,517.87
证券出借利息收入		-
其他利息收入		-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		-7,532,461.22
其中：股票投资收益	6.4.3.12	773,923.37
基金投资收益		-
债券投资收益	6.4.3.13	-9,212,733.56
资产支持证券投资		-
贵金属投资收益	6.4.3.14	-
衍生工具收益	6.4.3.15	197,684.85
股利收益	6.4.3.16	708,664.12
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.3.17	-221,748.45
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.3.18	-
减：二、费用		4,003,113.32
1. 管理人报酬	6.4.6.2.1	2,401,007.84
2. 托管费	6.4.6.2.2	600,251.96
3. 销售服务费	6.4.6.2.3	32,733.75
4. 交易费用	6.4.3.19	698,013.40
5. 利息支出		123,928.23
其中：卖出回购金融资产支出		123,928.23
6. 税金及附加		15,371.95
7. 其他费用	6.4.3.20	131,806.19
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-4,205,740.58
减：所得税费用		-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-4,205,740.58

### 6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：大成汇享一年持有期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）	472,332,906.68	9,876,191.62	482,209,098.30
二、本期经营活	-	-4,205,740.58	-4,205,740.58

动产生的基金净值变动数（本期利润）			
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	6,626,147.72	167,028.25	6,793,175.97
其中：1. 基金申购款	6,626,147.72	167,028.25	6,793,175.97
2. 基金赎回款	-	-	-
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-	-
五、期末所有者权益（基金净值）	478,959,054.40	5,837,479.29	484,796,533.69

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署：

谭晓冈

周立新

刘亚林

基金管理人负责人

主管会计工作负责人

会计机构负责人

## 6.4 报表附注

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

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

### 6.4.2 税项

#### 1、印花税

证券（股票）交易印花税税率为 1‰，由出让方缴纳；

#### 2、增值税、企业所得税

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

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

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

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

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

### 3、个人所得税

个人所得税税率为 20%。

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

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

暂免征收储蓄存款利息所得个人所得税。

## 6.4.3 重要财务报表项目的说明

## 6.4.3.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2021年6月30日	
	账面余额	公允价值
活期存款	580,604.03	
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	580,604.03	

## 6.4.3.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2021年6月30日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	109,570,824.87	112,244,394.17	2,673,569.30
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	131,549,245.64	131,227,619.40
	银行间市场	225,757,946.91	226,641,000.00
	合计	357,307,192.55	357,868,619.40
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	466,878,017.42	470,113,013.57	3,234,996.15

## 6.4.3.3 衍生金融资产/负债

无。

## 6.4.3.4 买入返售金融资产

## 6.4.3.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

单位：人民币元

项目	本期末 2021年6月30日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	-	-
银行间市场	42,500,303.75	-
合计	42,500,303.75	-

## 6.4.3.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

无。

## 6.4.3.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2021年6月30日
应收活期存款利息	493.50
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	1,736.60
应收债券利息	6,059,723.48
应收资产支持证券利息	-
应收买入返售证券利息	26,374.32
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	15.66
合计	6,088,343.56

## 6.4.3.6 其他资产

无。

## 6.4.3.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2021年6月30日
交易所市场应付交易费用	234,569.96
银行间市场应付交易费用	10,042.46
合计	244,612.42

## 6.4.3.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2021年6月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	-
应付证券出借违约金	-
预提费用	103,219.55
合计	103,219.55

## 6.4.3.9 实收基金

金额单位：人民币元

## 大成汇享一年持有混合 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	456,117,966.34	456,117,966.34
本期申购	6,466,780.71	6,466,780.71
本期赎回 (以“-”号填列)	-	-
本期末	462,584,747.05	462,584,747.05

## 大成汇享一年持有混合 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	16,214,940.34	16,214,940.34
本期申购	159,367.01	159,367.01
本期赎回 (以“-”号填列)	-	-
本期末	16,374,307.35	16,374,307.35

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

## 6.4.3.10 未分配利润

单位：人民币元

## 大成汇享一年持有混合 A

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	6,208,520.73	3,349,407.93	9,557,928.66
本期利润	-3,816,751.63	-214,697.85	-4,031,449.48
本期基金份额交易产生的变动数	83,768.81	80,150.00	163,918.81
其中：基金申购款	83,768.81	80,150.00	163,918.81
基金赎回款	-	-	-
本期已分配利润	-	-	-
本期末	2,475,537.91	3,214,860.08	5,690,397.99

## 大成汇享一年持有混合 C

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	199,261.93	119,001.03	318,262.96
本期利润	-167,240.50	-7,050.60	-174,291.10
本期基金份额交易产生的变动数	1,411.64	1,697.80	3,109.44
其中：基金申	1,411.64	1,697.80	3,109.44

购款			
基金赎回款			
本期已分配利润			
本期末	33,433.07	113,648.23	147,081.30

#### 6.4.3.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期	
	2021年1月1日至2021年6月30日	
活期存款利息收入		5,245.31
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		23,194.92
其他		261.37
合计		28,701.60

#### 6.4.3.12 股票投资收益

单位：人民币元

项目	本期	
	2021年1月1日至2021年6月30日	
卖出股票成交总额		213,027,651.64
减：卖出股票成本总额		212,253,728.27
买卖股票差价收入		773,923.37

#### 6.4.3.13 债券投资收益

单位：人民币元

项目	本期	
	2021年1月1日至2021年6月30日	
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额		187,604,008.00
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额		192,634,606.12
减：应收利息总额		4,182,135.44
买卖债券差价收入		-9,212,733.56

#### 6.4.3.14 贵金属投资收益

无。

#### 6.4.3.15 衍生工具收益

##### 6.4.3.15.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

无。

## 6.4.3.15.2 衍生工具收益——其他投资收益

单位：人民币元

项目	本期收益金额 2021年1月1日至2021年6月30日
股指期货投资收益	197,684.85

## 6.4.3.16 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月30日
股票投资产生的股利收益	708,664.12
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	708,664.12

## 6.4.3.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2021年1月1日至2021年6月30日
1. 交易性金融资产	-221,748.45
股票投资	-927,684.69
债券投资	705,936.24
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	-221,748.45

## 6.4.3.18 其他收入

无。

## 6.4.3.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月30日
交易所市场交易费用	696,188.40
银行间市场交易费用	1,825.00
合计	698,013.40

## 6.4.3.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期	
	2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日	
审计费用		34,712.18
信息披露费		59,507.37
证券出借违约金		-
银行划款手续费		9,986.64
账户维护费		27,000.00
其他		600.00
合计		131,806.19

## 6.4.4 或有事项、资产负债表日后事项的说明

## 6.4.4.1 或有事项

无。

## 6.4.4.2 资产负债表日后事项

无。

## 6.4.5 关联方关系

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

本基金本报告期存在控制关系或者其他重大利害关系的关联方未发生变化。

## 6.4.5.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
大成基金管理有限公司（“大成基金”）	基金管理人、注册登记机构、基金销售机构
中国工商银行股份有限公司（“中国工商银行”）	基金托管人
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。

## 6.4.6 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

## 6.4.6.1 通过关联方交易单元进行的交易

## 6.4.6.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期	
	2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日	
	成交金额	占当期股票 成交总额的比例（%）
光大证券	50,956,013.74	10.81

## 6.4.6.1.2 债券交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2021年1月1日至2021年6月30日	
	成交金额	占当期债券 成交总额的比例 (%)
光大证券	3,641.22	0.02

## 6.4.6.1.3 债券回购交易

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	占当期债券回购 成交总额的比例 (%)
光大证券	43,362,000.00	7.54

## 6.4.6.1.4 权证交易

无。

## 6.4.6.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2021年1月1日至2021年6月30日			
	当期 佣金	占当期佣金总量 的比例 (%)	期末应付佣金余额	占期末应付佣金 总额的比例 (%)
光大证券	46,436.09	10.81	46,436.09	19.80

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。

## 6.4.6.2 关联方报酬

## 6.4.6.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	2,401,007.84

其中：支付销售机构的客户维护费	1,167,425.01
-----------------	--------------

注：基金管理费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付。本基金的管理费按前一日基金资产净值的 1.00% 年费率计提。管理费的计算方法如下：

$$H = E \times 1.00\% / \text{当年天数}$$

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

#### 6.4.6.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期
	2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	600,251.96

注：基金托管费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付。本基金的托管费按前一日基金资产净值的 0.25% 年费率计提。托管费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.25\% / \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

#### 6.4.6.2.3 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		
	大成汇享一年持有混合	大成汇享一年持有混合	合计
	A	C	
大成基金	-	3.21	3.21
工商银行	-	23,025.88	23,025.88
合计	-	23,029.09	23,029.09

注：销售服务费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付。本基金 A 类基金份额不收取销售服务费，C 类基金份额的销售服务费按前一日 C 类基金资产净值的 0.40% 年费率计提。销售服务费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.40\% / \text{当年天数}$$

H 为 C 类基金份额每日应计提的销售服务费

E 为 C 类基金份额前一日基金资产净值

#### 6.4.6.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

无。

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

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

无。

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

无。

#### 6.4.6.5 各关联方投资本基金的情况

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

无。

##### 6.4.6.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

无。

#### 6.4.6.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日	
	期末余额	当期利息收入
中国工商银行	580,604.03	5,245.31

#### 6.4.6.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

无。

#### 6.4.6.8 其他关联交易事项的说明

无。

## 6.4.7 利润分配情况

无。

## 6.4.8 期末(2021年6月30日)本基金持有的流通受限证券

## 6.4.8.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

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
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07月05日	新股未上市	11.48	11.48	4,926	56,550.48	56,550.48	-
688355	明志科技	2021年4月30日	2021年11月12日	新股锁定	17.65	23.80	2,710	47,831.50	64,498.00	-
688383	新益昌	2021年4月21日	2021年10月28日	新股锁定	19.58	106.24	2,701	52,885.58	286,954.24	-
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	-
688621	阳光诺和	2021年6月11日	2021年12月21日	新股锁定	26.89	63.99	1,485	39,931.65	95,025.15	-
688681	科汇股份	2021年6月4日	2021年12月16日	新股锁定	9.56	14.54	1,899	18,154.44	27,611.46	-
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
113050	南银	2021年	2021年	新债未	100.00	100.00	1,400	140,000.00	140,000.00	-

	转债	6月17日	7月1日	上市						
--	----	-------	------	----	--	--	--	--	--	--

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。

#### 6.4.8.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

无。

#### 6.4.8.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

##### 6.4.8.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末，本基金从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额 29,069,785.46 元，是以如下债券作为抵押：

金额单位：人民币元

债券代码	债券名称	回购到期日	期末估值单价	数量（张）	期末估值总额
091900004	19 长城债 01（品种一）	2021 年 7 月 1 日	100.50	300,000	30,150,000.00
101901168	19 中化工 MTN003	2021 年 7 月 1 日	101.03	6,000	606,180.00
合计				306,000	30,756,180.00

##### 6.4.8.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末止，本基金从事证券交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额 10,000,000.00 元，于 2021 年 07 月 05 日到期。该类交易要求本基金转入质押库的债券，按证券交易所规定的比例折算为标准券后，不低于债券回购交易的余额。

#### 6.4.8.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

无。

#### 6.4.9 金融工具风险及管理

##### 6.4.9.1 风险管理政策和组织架构

本基金在日常经营活动中由金融工具产生的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金管理人制定了政策和程序来识别及分析这些风险，并设定适当的风险限额及内部控制流程，通过可靠的管理及信息系统持续监控上述各类风险。

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

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

##### 6.4.9.2 信用风险

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

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

本基金债券投资的信用评级情况按《中国人民银行信用评级管理指导意见》设定的标准统计

及汇总。

#### 6.4.9.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2021年6月30日	上年度末 2020年12月31日
A-1	-	29,992,000.00
A-1 以下	-	-
未评级	47,977,500.00	17,809,285.80
合计	47,977,500.00	47,801,285.80

注：1. 债券评级取自第三方评级机构的债项评级。

2. 未评级债券期限在一年以内的国债、政策性金融债及超短期融资券。

#### 6.4.9.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

无。

#### 6.4.9.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2021年6月30日	上年度末 2020年12月31日
A-1	-	-
A-1 以下	-	-
未评级	-	49,325,000.00
合计	-	49,325,000.00

#### 6.4.9.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2021年6月30日	上年度末 2020年12月31日
AAA	213,099,500.00	194,011,400.00
AAA 以下	44,868,000.00	54,715,074.80
未评级	51,923,619.40	81,928,721.00
合计	309,891,119.40	330,655,195.80

注：未评级债券为国债、政策性金融债。

#### 6.4.9.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

无。

#### 6.4.9.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

无。

#### 6.4.9.3 流动性风险

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

##### 6.4.9.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

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

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

#### 6.4.9.4 市场风险

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

#### 6.4.9.4.1 利率风险

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

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

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

##### 6.4.9.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2021年6月30日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	580,604.03	-	-	-	580,604.03
结算备付金	3,354,090.36	-	-	-	3,354,090.36
存出保证金	38,562.00	-	-	-	38,562.00
交易性金融资产	154,252,119.40	193,222,500.00	10,394,000.00	112,244,394.17	470,113,013.57
买入返售金融资产	42,500,303.75	-	-	-	42,500,303.75
应收利息	-	-	-	6,088,343.56	6,088,343.56
应收申购款	-	-	-	9,186.28	9,186.28
应收证券清算款	-	-	-	3,499,338.68	3,499,338.68
资产总计	200,725,679.54	193,222,500.00	10,394,000.00	121,841,262.69	526,183,442.23
负债					
应付管理人报酬	-	-	-	396,464.48	396,464.48
应付托管费	-	-	-	99,116.12	99,116.12
应付证券清算款	-	-	-	1,447,373.90	1,447,373.90
卖出回购金融资产款	39,069,785.46	-	-	-	39,069,785.46
应付销售服务费	-	-	-	5,395.42	5,395.42
应付交易费用	-	-	-	244,612.42	244,612.42
应付利息	-	-	-	2,603.86	2,603.86
应交税费	-	-	-	18,337.33	18,337.33
其他负债	-	-	-	103,219.55	103,219.55
负债总计	39,069,785.46	-	-	2,317,123.08	41,386,908.54
利率敏感度缺口	161,655,894.08	193,222,500.00	10,394,000.00	119,524,139.61	484,796,533.69
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	563,737.47	-	-	-	563,737.47
结算备付金	2,983.66	-	-	-	2,983.66

存出保证金	19,309.59	-	-	-	19,309.59
交易性金融资产	142,986,006.80	274,381,400.00	10,414,074.80	64,110,201.80	491,891,683.40
应收利息	-	-	-	5,996,634.05	5,996,634.05
应收申购款	-	-	-	9,974.90	9,974.90
应收证券清算款	-	-	-	441,990.10	441,990.10
资产总计	143,572,037.52	274,381,400.00	10,414,074.80	70,558,800.85	498,926,313.17
负债	-	-	-	-	-
应付管理人报酬	-	-	-	406,064.37	406,064.37
应付托管费	-	-	-	101,516.07	101,516.07
卖出回购金融资产款	16,054,855.92	-	-	-	16,054,855.92
应付销售服务费	-	-	-	5,515.10	5,515.10
应付交易费用	-	-	-	58,038.11	58,038.11
应付利息	-	-	-	3,576.54	3,576.54
应交税费	-	-	-	17,648.76	17,648.76
其他负债	-	-	-	70,000.00	70,000.00
负债总计	16,054,855.92	-	-	662,358.95	16,717,214.87
利率敏感度缺口	127,517,181.60	274,381,400.00	10,414,074.80	69,896,441.90	482,209,098.30

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

#### 6.4.9.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	除市场利率以外的其他市场变量保持不变		
	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2021年6月30日）	上年度末（2020年12月31日）
分析	市场利率下降25个基点	1,288,001.89	1,751,857.99
	市场利率上升25个基点	-1,256,034.45	-1,717,808.83

#### 6.4.9.4.2 外汇风险

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

#### 6.4.9.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以

外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金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每日对本基金所持有的证券价格实施监控，定期运用多种定量方法对基金进行风险度量，来测试本基金面临的潜在价格风险，及时可靠地对风险进行跟踪和控制。

#### 6.4.9.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2021年6月30日		上年度末 2020年12月31日	
	公允价值	占基金资产净值比例 (%)	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
交易性金融资产—股票投资	112,244,394.17	23.15	64,110,201.80	13.30
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	112,244,394.17	23.15	64,110,201.80	13.30

#### 6.4.9.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除业绩比较基准以外的其他市场变量保持不变		
	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2021年6月30日）	上年度末（2020年12月31日）
分析	业绩比较基准上升5%	4,353,036.86	20,595,891.48
	业绩比较基准下降5%	-4,353,036.86	-20,595,891.48

#### 6.4.10 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

无。

## § 7 投资组合报告

### 7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	112,244,394.17	21.33
	其中：股票	112,244,394.17	21.33
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	357,868,619.40	68.01
	其中：债券	357,868,619.40	68.01
	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	42,500,303.75	8.08
	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	3,934,694.39	0.75
8	其他各项资产	9,635,430.52	1.83
9	合计	526,183,442.23	100.00

### 7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

#### 7.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值 (元)	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	15,238,124.00	3.14
C	制造业	65,504,346.89	13.51
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	13,020.39	0.00
E	建筑业	7,445,124.00	1.54
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	12,230.40	0.00
J	金融业	21,660,513.34	4.47
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	2,276,010.00	0.47
M	科学研究和技术服务业	95,025.15	0.02
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-

Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	112,244,394.17	23.15

### 7.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

无。

### 7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	601225	陕西煤业	688,800	8,162,280.00	1.68
2	003016	欣贺股份	490,000	7,844,900.00	1.62
3	601117	中国化学	849,900	7,445,124.00	1.54
4	600036	招商银行	135,286	7,331,148.34	1.51
5	603180	金牌厨柜	150,087	7,157,649.03	1.48
6	601166	兴业银行	347,900	7,149,345.00	1.47
7	600028	中国石化	1,622,900	7,075,844.00	1.46
8	603218	日月股份	253,000	6,851,240.00	1.41
9	603801	志邦家居	200,000	6,392,000.00	1.32
10	601677	明泰铝业	250,300	4,893,365.00	1.01
11	002859	洁美科技	147,800	4,621,706.00	0.95
12	601233	桐昆股份	152,400	3,671,316.00	0.76
13	601658	邮储银行	720,000	3,614,400.00	0.75
14	600919	江苏银行	502,200	3,565,620.00	0.74
15	603225	新凤鸣	175,200	3,556,560.00	0.73
16	603986	兆易创新	15,500	2,912,450.00	0.60
17	603877	太平鸟	50,000	2,669,000.00	0.55
18	002049	紫光国微	17,200	2,652,068.00	0.55
19	688345	博力威	35,000	2,574,250.00	0.53
20	300394	天孚通信	90,000	2,278,800.00	0.47
21	300058	蓝色光标	376,200	2,276,010.00	0.47
22	300121	阳谷华泰	183,800	2,262,578.00	0.47
23	688208	道通科技	25,000	2,174,750.00	0.45
24	688276	百克生物	18,896	1,976,143.68	0.41
25	688161	威高骨科	3,069	325,467.45	0.07
26	688383	新益昌	2,701	286,954.24	0.06
27	688678	福立旺	4,198	99,492.60	0.02
28	688621	阳光诺和	1,485	95,025.15	0.02
29	688499	利元亨	2,149	83,488.65	0.02

30	688355	明志科技	2,710	64,498.00	0.01
31	688239	航宇科技	4,926	56,550.48	0.01
32	688087	英科再生	2,469	54,219.24	0.01
33	688681	科汇股份	1,899	27,611.46	0.01
34	688226	威腾电气	2,693	17,289.06	0.00
35	603171	税友股份	637	12,230.40	0.00
36	605162	新中港	1,377	8,358.39	0.00
37	605011	杭州热电	525	4,662.00	0.00

#### 7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	300122	智飞生物	8,828,326.00	1.83
2	601225	陕西煤业	7,998,805.00	1.66
3	600519	贵州茅台	7,785,921.00	1.61
4	603180	金牌厨柜	7,540,249.14	1.56
5	601288	农业银行	7,499,728.00	1.56
6	600028	中国石化	7,445,486.00	1.54
7	601012	隆基股份	7,374,178.57	1.53
8	601166	兴业银行	7,121,110.91	1.48
9	603801	志邦家居	7,084,031.74	1.47
10	603218	日月股份	7,063,305.00	1.46
11	601117	中国化学	6,546,101.00	1.36
12	601939	建设银行	6,396,281.00	1.33
13	003016	欣贺股份	6,254,521.00	1.30
14	600600	青岛啤酒	5,995,612.00	1.24
15	300601	康泰生物	5,984,905.80	1.24
16	601838	成都银行	5,478,178.00	1.14
17	600000	浦发银行	5,037,814.00	1.04
18	601899	紫金矿业	4,999,099.00	1.04
19	688008	澜起科技	4,997,443.10	1.04
20	600036	招商银行	4,996,735.00	1.04

注：本项中“本期累计买入金额”按买入成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，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	600519	贵州茅台	15,910,499.00	3.30
2	600036	招商银行	10,294,334.00	2.13
3	600048	保利地产	8,195,627.00	1.70

4	601088	中国神华	7,870,699.00	1.63
5	300122	智飞生物	7,530,504.00	1.56
6	601288	农业银行	7,518,816.00	1.56
7	601225	陕西煤业	6,854,470.00	1.42
8	601939	建设银行	5,983,159.00	1.24
9	601899	紫金矿业	5,524,000.00	1.15
10	601012	隆基股份	5,416,522.00	1.12
11	600600	青岛啤酒	5,084,887.00	1.05
12	601838	成都银行	5,057,636.28	1.05
13	688008	澜起科技	4,981,905.32	1.03
14	002475	立讯精密	4,841,361.60	1.00
15	600000	浦发银行	4,740,058.97	0.98
16	002027	分众传媒	4,689,445.12	0.97
17	603882	金城医学	4,619,845.00	0.96
18	002460	赣锋锂业	4,378,900.50	0.91
19	603187	海容冷链	4,336,799.00	0.90
20	601211	国泰君安	4,063,504.00	0.84

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

#### 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	261,315,605.33
卖出股票收入（成交）总额	213,027,651.64

注：本项中“买入股票的成本(成交)总额”及“卖出股票的收入(成交)总额”均按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

#### 7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
1	国家债券	13,108,000.00	2.70
2	央行票据	-	-
3	金融债券	71,819,619.40	14.81
	其中：政策性金融债	41,669,619.40	8.60
4	企业债券	140,948,000.00	29.07
5	企业短期融资券	45,123,500.00	9.31
6	中期票据	86,729,500.00	17.89
7	可转债（可交换债）	140,000.00	0.03
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	357,868,619.40	73.82

## 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	091900004	19 长城债 01 （品种一）	300,000	30,150,000.00	6.22
2	101800148	18 南京地铁 MTN001	200,000	20,784,000.00	4.29
3	152023	18 宁地铁	200,000	20,288,000.00	4.18
4	102001822	20 黄石城投 MTN002	200,000	20,256,000.00	4.18
5	101901168	19 中化工 MTN003	200,000	20,206,000.00	4.17

## 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

## 7.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

代 码	名 称	持仓量（买/ 卖）	合约市值(元)	公允价值变动 (元)	风险说明
-	-	-	-	-	-
公允价值变动总额合计（元）					-
股指期货投资本期收益（元）					197,684.85
股指期货投资本期公允价值变动（元）					-

## 7.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金投资股指期货将以套期保值为目的进行投资组合避险和有效管理，通过套期保值策略，对冲系统性风险，应对组合构建与调整中的流动性风险，力求风险收益的优化。

## 7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

无。

## 7.12 投资组合报告附注

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

1. 本基金投资的前十名证券之一招商银行（600036.SH）的发行主体招商银行股份有限公司于 2021 年 5 月 17 日因为同业投资提供第三方信用担保、为非保本理财产品出具保本承诺，部分未按规定计提风险加权资产等，受到中国银行保险监督管理委员会处罚（银保监罚决字（2021）16 号）。本基金认为，对招商银行的处罚不会对其投资价值构成实质性负面影响。

2. 本基金投资的前十名证券之一 20 进出 12（200312.IB）的发行主体中国进出口银行于 2021 年 7 月 13 日因违规投资企业股权等，受到中国银行保险监督管理委员会处罚（银保监罚决字（2021）31 号）。本基金认为，对中国进出口银行的处罚不会对其投资价值构成实质性负面影响。

3. 本基金投资的前十名证券之一兴业银行（601166.SH）的发行主体兴业银行股份有限公司于 2021 年 8 月 13 日因违反信用信息采集、提供、查询及相关管理规定，受到中国人民银行处罚（银罚字（2021）26 号）。本基金认为，对兴业银行的处罚不会对其投资价值构成实质性负面影响。

### 7.12.2 基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库

本基金投资的前十名股票未超出基金合同规定的备选股票库。

### 7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	38,562.00
2	应收证券清算款	3,499,338.68
3	应收股利	-
4	应收利息	6,088,343.56
5	应收申购款	9,186.28
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	9,635,430.52

### 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（%）
大成汇享一年持有混合 A	2,020	229,002.35	-	-	462,584,747.05	100.00
大成汇享一年持有混合 C	1,635	10,014.87	-	-	16,374,307.35	100.00
合计	3,655	131,042.15	-	-	478,959,054.40	100.00

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

无。

## 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	大成汇享一年持有混合 A	0
	大成汇享一年持有混合 C	0
	合计	0
本基金基金经理持有本开放式基金	大成汇享一年持有混合 A	0
	大成汇享一年持有混合 C	0
	合计	0

## §9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	大成汇享一年持有混合 A	大成汇享一年持有混合 C
基金合同生效日 （2020 年 9 月 3 日） 基金份额总额	455,049,891.19	15,683,367.90
本报告期期初基金份额总额	456,117,966.34	16,214,940.34
本报告期基金总申购份额	6,466,780.71	159,367.01
减：本报告期基金总赎回份额	-	-
本报告期基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-	-
本报告期期末基金份额总额	462,584,747.05	16,374,307.35

## §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

中国工商银行股份有限公司（以下简称“本公司”）根据工作需要，任命刘彤女士担任本

公司资产托管部总经理，全面主持资产托管部相关工作。刘彤女士的托管人高级管理人员任职信息已经在中国证券投资基金业协会备案。李勇先生不再担任本公司资产托管部总经理职务。

### 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	
长江证券	1	314,536,883.18	66.73%	286,642.21	66.73%	-
申万宏源	1	60,170,616.05	12.77%	54,834.19	12.77%	-
光大证券	1	50,956,013.74	10.81%	46,436.09	10.81%	-
中信证券	1	34,821,774.46	7.39%	31,727.77	7.39%	-
东方证券	1	10,855,748.30	2.30%	9,892.80	2.30%	-
海通证券	1	-	-	-	-	-
招商证券	1	-	-	-	-	-

注：1、租用券商专用交易单元的选择标准和程序：

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

租用证券公司交易单元的选择标准主要包括：

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

租用证券公司交易单元的程序：首先根据租用证券公司交易单元的选择标准形成《券商服务评价表》，然后根据评分高低进行选择基金交易单元。

2、本基金本报告期内新增交易单元：招商证券，退租交易单元：无。

### 10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例
长江证券	595,192.20	2.87%	173,200,000.00	30.10%	-	-
申万宏源	2,314.21	0.01%	350,083,000.00	60.84%	-	-
光大证券	3,641.22	0.02%	43,362,000.00	7.54%	-	-
中信证券	20,130,800.00	97.10%	5,600,000.00	0.97%	-	-
东方证券	-	-	3,200,000.00	0.56%	-	-

### 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	大成汇享一年持有期混合型证券投资基金增聘基金经理公告	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18日
4	大成汇享一年持有期混合型证券投资基金更新招募说明书	中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站	2021年6月18日
5	大成汇享一年持有期混合型证券投资	中国证监会基金电子披	2021年6月18日

	基金(C类份额)基金产品资料概要更新	露网站、规定报刊及本公司网站	
6	大成汇享一年持有期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6月18日
7	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
8	大成汇享一年持有期混合型证券投资基金 2021 年第 1 季度报告	中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站	2021年4月22日
9	大成汇享一年持有期混合型证券投资基金 2020 年年度报告	中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站	2021年3月30日
10	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
11	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
12	大成汇享一年持有期混合型证券投资基金第四季度报告	中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站	2021年1月22日

## § 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汇享一年持有期混合型证券投资基金的文件；
- 2、《大成汇享一年持有期混合型证券投资基金基金合同》；
- 3、《大成汇享一年持有期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