

# 大成科技消费股票型证券投资基金 2021 年中期报告

2021 年 6 月 30 日

基金管理人：大成基金管理有限公司

基金托管人：中国银行股份有限公司

送出日期：2021 年 8 月 31 日

## § 1 重要提示及目录

### 1.1 重要提示

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

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

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

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

本报告财务资料未经审计。

本报告期自 2021 年 01 月 01 日起至 06 月 30 日止。

## 1.2 目录

<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	14
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	14
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明	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	16
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	17
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	17
<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等内容真实、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	19
6.3 所有者权益（基金净值）变动表	20
6.4 报表附注	21
<b>§ 7 投资组合报告</b>	<b>42</b>
7.1 期末基金资产组合情况	42
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	43
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细	44
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	47
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	48
7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细	48

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细.....	49
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.....	49
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.....	49
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....	49
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	49
7.12 投资组合报告附注.....	49
<b>§ 8 基金份额持有人信息.....</b>	<b>50</b>
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	50
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	51
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况.....	51
<b>§ 9 开放式基金份额变动.....</b>	<b>51</b>
<b>§ 10 重大事件揭示.....</b>	<b>52</b>
10.1 基金份额持有人大会决议.....	52
10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动.....	52
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	52
10.4 基金投资策略的改变.....	52
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	52
10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况.....	52
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	52
10.8 其他重大事件.....	55
<b>§ 11 影响投资者决策的其他重要信息.....</b>	<b>56</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.....	56
11.2 影响投资者决策的其他重要信息.....	56
<b>§ 12 备查文件目录.....</b>	<b>56</b>
12.1 备查文件目录.....	56
12.2 存放地点.....	56
12.3 查阅方式.....	56

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	大成科技消费股票型证券投资基金	
基金简称	大成科技消费股票	
基金主代码	008934	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2020 年 7 月 16 日	
基金管理人	大成基金管理有限公司	
基金托管人	中国银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	2,097,775,415.58 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	大成科技消费股票 A	大成科技消费股票 C
下属分级基金的交易代码	008934	008935
报告期末下属分级基金的份额总额	1,516,795,741.52 份	580,979,674.06 份

### 2.2 基金产品说明

投资目标	本基金在严格控制风险并保持良好流动性的前提下，重点投资于在科技和消费领域具有广阔成长空间和核心竞争力的优质企业，力争获得超额收益与长期资本增值。
投资策略	本基金采取“自上而下选行业”与“自下而上精选个股”相结合的积极投资策略。公司研究包括定性研究和定量研究两个方面，定性研究方面优选行业长期空间巨大/行业格局剧变，并且具备竞争优势的好公司。定量研究方面运用主营业务收入、EBITDA、净利润等的预期增长率指标，结合公司营运指标（如周转率指标等）以及财务杠杆指标（如权益乘数等），从财务报表验证公司的投资逻辑，做到相互印证。
业绩比较基准	中证科技 100 指数收益率×40%+中证主要消费指数收益率×40%+恒生综合指数收益率×10%+中债综合指数收益率×10%
风险收益特征	本基金是股票型证券投资基金，其预期长期风险和预期收益水平高于混合型基金、债券型基金、货币市场基金。本基金若投资港股通标的股票，则需承担港股通机制下因投资环境、投资标的、市场制度以及交易规则等差异带来的特有风险。

### 2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		大成基金管理有限公司	中国银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	赵冰	许俊
	联系电话	0755-83183388	010-66594319
	电子邮箱	office@dcfund.com.cn	fcid@bankofchina.com

客户服务电话	4008885558	95566
传真	0755-83199588	010-66594942
注册地址	深圳市福田区深南大道 7088 号 招商银行大厦 32 层	北京市西城区复兴门内大街 1 号
办公地址	深圳市福田区深南大道 7088 号 招商银行大厦 32 层	北京市西城区复兴门内大街 1 号
邮政编码	518040	100818
法定代表人	吴庆斌	刘连舸

## 2.4 信息披露方式

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

## 2.5 其他相关资料

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

## § 3 主要财务指标和基金净值表现

### 3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2021年1月1日-2021年6月30日)	
	大成科技消费股票 A	大成科技消费股票 C
本期已实现收益	308,075,106.17	89,666,138.09
本期利润	107,438,737.72	9,871,560.32
加权平均基金份额本期利润	0.0497	0.0136
本期加权平均净值利润率	4.65%	1.29%
本期基金份额净值增长率	0.94%	0.53%
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	152,605,288.26	53,556,127.66
期末可供分配基金份额利润	0.1006	0.0922
期末基金资产净值	1,669,401,029.78	634,535,801.72
期末基金份额净值	1.1006	1.0922
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	10.06%	9.22%

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

大成科技消费股票 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	-0.08%	1.11%	-0.96%	0.80%	0.88%	0.31%
过去三个月	12.36%	1.19%	6.89%	0.95%	5.47%	0.24%
过去六个月	0.94%	1.61%	2.54%	1.37%	-1.60%	0.24%
自基金合同生效起至今	10.06%	1.26%	13.11%	1.34%	-3.05%	-0.08%

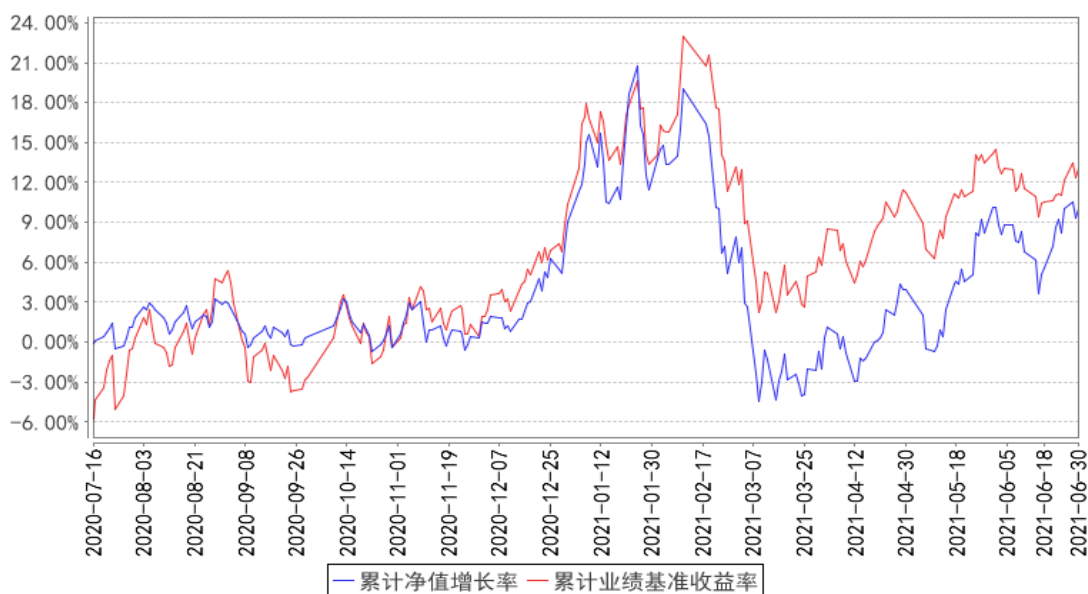
大成科技消费股票 C

阶段	份额净	份额净值	业绩比较基	业绩比较基准	①-③	②-④
----	-----	------	-------	--------	-----	-----

	值增长率①	增长率标准差②	准收益率③	收益率标准差④		
过去一个月	-0.15%	1.11%	-0.96%	0.80%	0.81%	0.31%
过去三个月	12.15%	1.19%	6.89%	0.95%	5.26%	0.24%
过去六个月	0.53%	1.61%	2.54%	1.37%	-2.01%	0.24%
自基金合同生效起至今	9.22%	1.26%	13.11%	1.34%	-3.89%	-0.08%

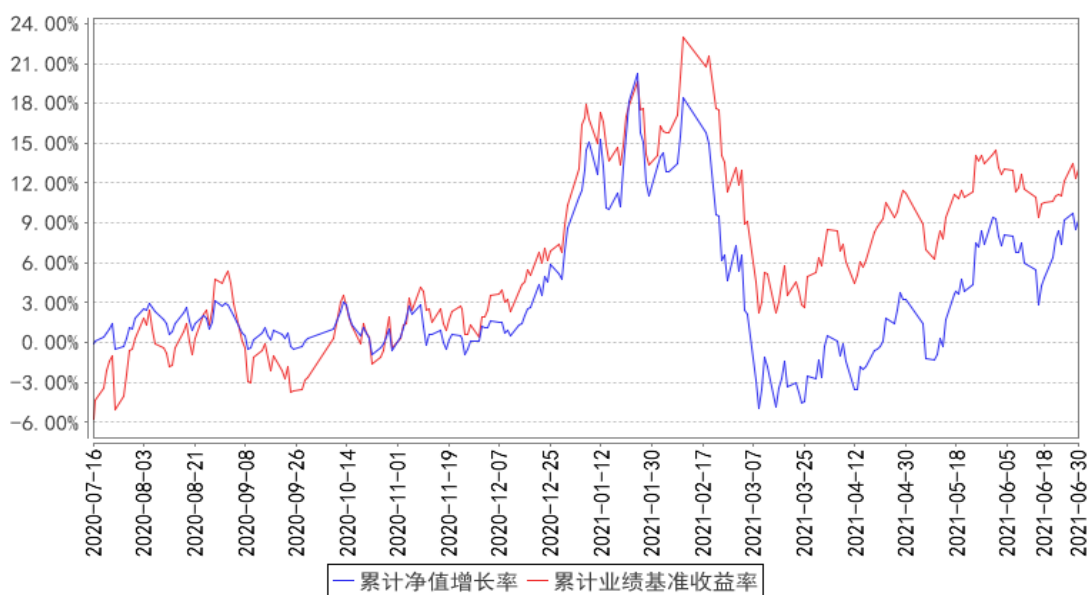
### 3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

大成科技消费股票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





大成科技消费股票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 7 月 16 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		
魏庆国	本基金基金经理	2020年7月16日	-	11年	<p>经济学硕士。2010年7月至2012年11月任华夏基金管理有限公司研究部研究员。2012年12月至2013年3月任平安大华基金研究部研究员。2013年5月加入大成基金管理有限公司，曾担任大成财富管理2020生命周期证券投资基金基金经理助理，现任股票投资部总监助理。2015年4月7日起任大成中小盘混合型证券投资基金（LOF）基金经理（更名前为大成中小盘股票型证券投资基金（LOF））。2015年4月7日至2016年8月19日任大成精选增值混合型证券投资基金基金经理。2015年7月28日至2016年8月19日任大成创新成长混合型证券投资基金（LOF）基金经理。2016年3月22日至2020年5月18日任大成趋势回报灵活配置混合型证券投资基金基金经理。2020年1月2日起任大成盛世精选灵活配置混合型证券投资基金基金经理。2020年3月23日起任大成行业先锋混合型证券投资基金基金经理。2020年4月29日至2021年5月20日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日起任大成科技消费股票型证券投资基金基金经理。2021年5月25日起任大成创新趋势混合型证券投资基金基金经理。具有基金从业资格。国籍：中国</p>
王帅	本基金基金经理助理	2020年10月19日	-	4年	<p>工程硕士。2017年3月至2019年9月任广发证券股份有限公司发展研究中心研究员。2019年9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日起任大成中小盘混合型证券投资基金（LOF）、大成盛世精选灵活配置混合型证券投资基金、大成行业先锋混合型证券投资基金、大成科技消费股票型证券投资基金基金经理助理。具有基金从业资格。国籍：中国</p>
孙丹	本基金基金经理助理	2020年11月6日	-	13年	<p>经济学硕士。2008年至2012年任景顺长城产品开发部产品经理。2012年至2014年任华夏基金机构债券投资部研究员。2014年5月加入大成基金管理有限公司，曾担任固定收益总部信用策略及宏观利率研究员、大成景辉灵活配置混合型证券投</p>

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

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

					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
邹建	本基金基金经理	2021 年 1 月 26 日	-	5.0 年	工学硕士。2016 年 7 月加入大成基金管理有限公司，先后担任研究部研究员、基金经理助理、基金经理，期间曾担任大成创新成长混合型证券投资基金(LOF)、大成高新技术产业股票型证券投资基金、大成创业板两年定期开放混合型证券投资基金、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、大成科技创新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、大成中小盘混合型证券投资基金(LOF)、大成盛世精选灵活配置混合型证券投资基金、大成行业先锋混合型证券投资基金、大成科技消费股票型证券投资基金基金经理助理。2021 年 1 月 26 日起任大成科技消费股票型证券投资基金、大成创业板两年定期开放混合型证券投资基金基金经理。具有基金从业资格。国籍：中国
邹建	本基金基金经理助理	2020 年 7 月 19 日	2021 年 1 月 26 日	5 年	工学硕士。2016 年 7 月加入大成基金管理有限公司，先后担任研究部研究员、基金经理助理、基金经理，期间曾担任大成创新成长混合型证券投资基金(LOF)、大成高新技术产业股票型证券投资基金、大成创业板两年定期开放混合型证券投资基金、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、大成科技创新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、大成中小盘混合型证券投资基金(LOF)、大成盛世精选灵活配置混合型证券投资基金、大成行业先锋混合型证券投资基金、大成科技消费股票型证券投资基金基金经理助理。2021 年 1 月 26 日起任大成科技消费股票型证券投资基金、大成创业板两年定期开放混合型证券投资基金基金经理。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

市场表现：

上半年市场表现最好的几个主线：

消费板块：医药

科技板块：新能源&电动车、电子

周期板块：化工、有色、钢铁、煤炭

这其中表现最好的是周期板块，减碳背景下供应约束非常刚性，产品涨价对低毛利的行业盈

利弹性特别大，到 7 月底为止，表现最好的依然是这些板块。这一块我投入的精力比较少，预期以后也不会投入更多的精力，因为在消费和科技板块也依然存在不少机会没有抓住，这个是我更值得检讨的地方。经过过去近 7 年的投资，我认为想什么机会都抓住，最后只能什么都抓不住。

在二季度季报中就我们的投资思路和方法已经做了反思如下：

在过去和客户的沟通中，我把投资体系归纳“选股+下注+心态”三块，这也是一个德扑高手总结的打牌体系（德扑里第 1 条是输赢牌面）。这 3 条相互支撑，首先尽量选择好股票，这个是基础；选股的不足通过下注来弥补，遇到好机会下重注，搞错了坚决清仓绝不与恶龙缠斗；如果不幸前 2 条都没做好，那努力避免陷入恶性循环，被股市各种杠杆放大效应给击溃，迅速调整好心态，重新再战。

选股体系归纳为“三好=好企业、好行业和好价格”，实操过程中，一方面是案头研究通过标准化模板化不断迭代的公司的研究文档，通过不断更新迭代来提高认知深度，另一方面是产业链验证网络，为有源头活水来通过调研来验证。“三好”中好企业和好行业大家经过研究应该没有大的分歧，主要的分歧就是“好价格”，这也是市面上所谓“投资理念”的区分所在，是相信低估是好价格还是相信趋势，我们现在倾向于认为还是认为价格按趋势驱动，按照逻辑证伪方式来运动，估值只是一个概率指标。趋势投资可能更符合我现在的认知，也更符合我的性格，也是我现在和未来聚焦和努力的方向。

下注方面是过去一段主要的失误所在。一类失误是发掘了好股票没有重仓，机会是有限的，资金是无限的，必须集中火力；另一类失误搞错了犹豫不决没想明白机会成本才是最大的成本。这是现在和以后我必须努力修炼提高的方面，敢于重仓，敢于杀伐决断。

心态调节对投资也很关键，必须就不确定和市场分歧来下注，就必然没有常胜将军。而股市杠杆放大效应又特别显著，很容易陷入亏钱正反馈被棒杀，或者进入赚钱正反馈被捧杀，必须要随时调整心态，重新再战。

以上就是过去一个季度我们对投资体系三个方面的反思和检讨，未来将力争更加纯粹，做符合自己信仰的投资。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末大成科技消费股票 A 的基金份额净值为 1.1006 元，本报告期基金份额净值增长率为 0.94%，同期业绩比较基准收益率为 2.54%；截至本报告期末大成科技消费股票 C 的基金份额净值为 1.0922 元，本报告期基金份额净值增长率为 0.53%，同期业绩比较基准收益率为 2.54%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

对未来我们依然维持“坚信大国复兴、重配幸运行业、抱紧龙头公司”的看法。

现在 A+H 有接近 5000 只股票，构筑组合仅 20 只左右，所以我们只要能找到这 20 个股票就可以了，哪怕再熊的市场都有 0.4% 的股票是有机会的，所以不会杞人忧天，会想尽办法抓机会。从我们的产业链调研来看，在新能源、生物医药、高端制造、新材料、半导体、军工等领域中国不断都出现具备全球竞争力的好公司。从他们的地域分布来看，集中在长三角江浙沪和北京地区，集群效应明显。

#### 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

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

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

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

本基金管理人参与估值流程各方之间不存在任何重大利益冲突。截止报告期末本基金管理人已与中央国债登记结算有限责任公司及中证指数有限公司签署服务协议，由中央国债登记结算有



限责任公司按约定提供银行间同业市场的估值数据，由中证指数有限公司按约定提供交易所交易的债券品种的估值数据和流通受限股票的折扣率数据。

#### 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

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

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

无。

## § 5 托管人报告

### 5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内，中国银行股份有限公司（以下称“本托管人”）在大成科技消费股票型证券投资基金（以下称“本基金”）的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了应尽的义务。

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

本报告期内，本托管人根据《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，对本基金管理人的投资运作进行了必要的监督，对基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算以及基金费用开支等方面进行了认真地复核，未发现本基金管理人存在损害基金份额持有人利益的行为。

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

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

## § 6 半年度财务会计报告（未经审计）

### 6.1 资产负债表

会计主体：大成科技消费股票型证券投资基金

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	上年度末
----	-----	-----	------

		2021 年 6 月 30 日	2020 年 12 月 31 日
<b>资产：</b>			
银行存款	6.4.3.1	300,727,647.99	1,595,309,955.36
结算备付金		1,726,381.20	23,940,442.32
存出保证金		1,198,201.00	10,300,952.53
交易性金融资产	6.4.3.2	1,906,208,627.07	4,267,081,415.44
其中：股票投资		1,900,595,034.03	4,267,081,415.44
基金投资		-	-
债券投资		5,613,593.04	-
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	-	375,060,682.59
应收证券清算款		119,075,690.47	70,552,393.39
应收利息	6.4.3.5	37,646.87	313,324.02
应收股利		69,414.40	-
应收申购款		1,314,240.57	1,215,648.66
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.3.6	-	-
资产总计		2,330,357,849.57	6,343,774,814.31
<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		-	-
应付证券清算款		61.65	141,059,451.60
应付赎回款		20,562,852.18	146,581,720.56
应付管理人报酬		3,006,654.15	8,490,378.44
应付托管费		501,108.98	1,415,063.09
应付销售服务费		432,872.96	772,916.21
应付交易费用	6.4.3.7	1,775,473.11	7,950,172.94
应交税费		18.82	-
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.3.8	141,976.22	485,864.63
负债合计		26,421,018.07	306,755,567.47
<b>所有者权益：</b>			
实收基金	6.4.3.9	2,097,775,415.58	5,539,916,622.27
未分配利润	6.4.3.10	206,161,415.92	497,102,624.57
所有者权益合计		2,303,936,831.50	6,037,019,246.84

负债和所有者权益总计		2,330,357,849.57	6,343,774,814.31
------------	--	------------------	------------------

注：报告截止日 2021 年 06 月 30 日，基金份额总额 2,097,775,415.58 份，其中大成科技消费股票 A 基金份额总额为 1,516,795,741.52 份，基金份额净值 1.1006 元。大成科技消费股票 C 基金份额总额为 580,979,674.06 份，基金份额净值 1.0922 元。

## 6.2 利润表

会计主体：大成科技消费股票型证券投资基金

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		160,255,262.14
1. 利息收入		1,246,607.81
其中：存款利息收入	6.4.3.11	1,043,829.71
债券利息收入		1,592.66
资产支持证券利息收入		-
买入返售金融资产收入		201,185.44
证券出借利息收入		-
其他利息收入		-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		435,033,667.60
其中：股票投资收益	6.4.3.12	426,257,785.01
基金投资收益	-	-
债券投资收益	6.4.3.13	-
资产支持证券投资收益	6.4.3.13.5	-
贵金属投资收益	6.4.3.14	-
衍生工具收益	6.4.3.15	-
股利收益	6.4.3.16	8,775,882.59
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.3.17	-280,430,946.22
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	4,405,932.95
减：二、费用		42,944,964.10
1. 管理人报酬	6.4.6.2.1	23,135,841.68
2. 托管费	6.4.6.2.2	3,855,973.58
3. 销售服务费	6.4.6.2.3	3,062,187.33
4. 交易费用	6.4.3.19	12,722,770.20
5. 利息支出		-
其中：卖出回购金融资产支出		-
6. 税金及附加		5.80
7. 其他费用	6.4.3.20	168,185.51
三、利润总额（亏损总额以“-”号填		117,310,298.04

列)		
减：所得税费用		-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		117,310,298.04

### 6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：大成科技消费股票型证券投资基金

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）	5,539,916,622.27	497,102,624.57	6,037,019,246.84
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	117,310,298.04	117,310,298.04
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）	-3,442,141,206.69	-408,251,506.69	-3,850,392,713.38
其中：1. 基金申购款	343,309,101.47	27,832,049.68	371,141,151.15
2. 基金赎回款	-3,785,450,308.16	-436,083,556.37	-4,221,533,864.53
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）	2,097,775,415.58	206,161,415.92	2,303,936,831.50

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署：

谭晓冈

周立新

刘亚林

基金管理人负责人

主管会计工作负责人

会计机构负责人

## 6.4 报表附注

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

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

### 6.4.2 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2008]1号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2014]81号《财政部国家税务总局证监会关于沪港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》、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]127号《财政部国家税务总局证监会关于深港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》、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。

对基金通过港股通投资香港联交所上市 H 股取得的股息红利，H 股公司应向中国证券登记结算有限责任公司（以下简称“中国结算”）提出申请，由中国结算向 H 股公司提供内地个人投资者名册，H 股公司按照 20% 的税率代扣个人所得税。基金通过港股通投资香港联交所上市的非 H 股取得的股息红利，由中国结算按照 20% 的税率代扣个人所得税。

(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。基金通过港股通买卖、继承、赠与联交所上市股票，按照香港特别行政区现行税法规定缴纳印花税。

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

### 6.4.3 重要财务报表项目的说明

#### 6.4.3.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 6 月 30 日
活期存款	300,727,647.99
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	300,727,647.99

#### 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	1,637,277,227.57	1,900,595,034.03	263,317,806.46
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	5,613,593.04	1,692,593.04
	银行间市场	-	-
	合计	5,613,593.04	1,692,593.04
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-

其他	-	-	-
合计	1,641,198,227.57	1,906,208,627.07	265,010,399.50

#### 6.4.3.3 衍生金融资产/负债

无。

#### 6.4.3.4 买入返售金融资产

##### 6.4.3.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

无。

##### 6.4.3.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

无。

#### 6.4.3.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2021年6月30日
应收活期存款利息	30,344.18
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	5,038.34
应收债券利息	1,640.92
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	623.43
合计	37,646.87

#### 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	1,775,053.86
银行间市场应付交易费用	419.25

合计	1,775,473.11
----	--------------

## 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	13,044.49
应付证券出借违约金	-
预提费用	128,931.73
合计	141,976.22

## 6.4.3.9 实收基金

金额单位：人民币元

## 大成科技消费股票 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	4,568,679,239.00	4,568,679,239.00
本期申购	105,863,877.11	105,863,877.11
本期赎回(以“-”号填列)	-3,157,747,374.59	-3,157,747,374.59
-基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算调整	-	-
本期申购	-	-
本期赎回(以“-”号填列)	-	-
本期末	1,516,795,741.52	1,516,795,741.52

## 大成科技消费股票 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	971,237,383.27	971,237,383.27
本期申购	237,445,224.36	237,445,224.36
本期赎回(以“-”号填列)	-627,702,933.57	-627,702,933.57
-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	580,979,674.06	580,979,674.06

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

## 大成科技消费股票 A

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	40,160,409.07	372,989,635.81	413,150,044.88
本期利润	308,075,106.17	-200,636,368.45	107,438,737.72
本期基金份额交易产生的变动数	-159,350,617.04	-208,632,877.30	-367,983,494.34
其中：基金申购款	7,926,199.48	2,202,683.83	10,128,883.31
基金赎回款	-167,276,816.52	-210,835,561.13	-378,112,377.65
本期已分配利润	-	-	-
本期末	188,884,898.20	-36,279,609.94	152,605,288.26

## 大成科技消费股票 C

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	4,834,262.49	79,118,317.20	83,952,579.69
本期利润	89,666,138.09	-79,794,577.77	9,871,560.32
本期基金份额交易产生的变动数	-27,115,837.85	-13,152,174.50	-40,268,012.35
其中：基金申购款	18,689,118.37	-985,952.00	17,703,166.37
基金赎回款	-45,804,956.22	-12,166,222.50	-57,971,178.72
本期已分配利润	-	-	-
本期末	67,384,562.73	-13,828,435.07	53,556,127.66

## 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	882,023.06
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	137,296.43
其他	24,510.22
合计	1,043,829.71

## 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	4,827,587,198.57
减：卖出股票成本总额	4,401,329,413.56
买卖股票差价收入	426,257,785.01

## 6.4.3.13 债券投资收益

无。

## 6.4.3.14 贵金属投资收益

无。

## 6.4.3.15 衍生工具收益

无。

## 6.4.3.16 股利收益

单位：人民币元

项目	本期
	2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
股票投资产生的股利收益	8,775,882.59
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	8,775,882.59

## 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	-280,430,946.22
股票投资	-282,123,539.26
债券投资	1,692,593.04
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	-280,430,946.22

#### 6.4.3.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月30日
基金赎回费收入	4,396,734.96
基金转换费收入	9,197.99
合计	4,405,932.95

注：1. 本基金的赎回费率按持有期间递减，不低于赎回费总额的 25% 归入基金资产。

2. 本基金的转换费由申购补差费和转出基金的赎回费两部分构成，其中不低于赎回费总额的 25% 归入转出基金的基金资产。

#### 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	12,722,770.20
银行间市场交易费用	-
合计	12,722,770.20

#### 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	69,424.36
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
银行划款手续费	33,253.78
账户维护费	6,000.00
合计	168,185.51

#### 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
中国银行股份有限公司(“中国银行”)	基金托管人、基金销售机构
光大证券股份有限公司(“光大证券”)	基金管理人的股东、基金销售机构

注：以下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	1,869,347,062.50	26.20

## 6.4.6.1.2 债券交易

无。

## 6.4.6.1.3 债券回购交易

无。

## 6.4.6.1.4 权证交易

无。

## 6.4.6.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2021年1月1日至2021年6月30日			
	当期 佣金	占当期佣金总量 的比例(%)	期末应付佣金余额	占期末应付佣金 总额的比例(%)
光大证券	1,495,479.02	23.85	427,296.46	24.07

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	23,135,841.68
其中：支付销售机构的客户维护费	10,658,627.85

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：

$$\text{日管理人报酬} = \text{前一日基金资产净值} \times 1.50\% / \text{当年天数}。$$

##### 6.4.6.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期
	2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	3,855,973.58

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：

$$\text{日托管费} = \text{前一日基金资产净值} \times 0.25\% / \text{当年天数}。$$

##### 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		
	大成科技消费股票 A	大成科技消费股票 C	合计
大成基金	-	9,471.59	9,471.59
光大证券	-	1,827.55	1,827.55
中国银行	-	116,705.54	116,705.54
合计	-	128,004.68	128,004.68

注：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将专门用于本基金 C 类基金份额的销售与基金份额持有人服务。

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

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

H 为 C 类基金份额每日应计提的销售服务费

E 为前一日 C 类基金份额的基金资产净值

#### 6.4.6.3 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
中国银行	300,727,647.99	882,023.06

注：本基金由基金托管人保管的银行存款，按银行约定利率计息。

#### 6.4.6.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

无。

#### 6.4.6.8 其他关联交易事项的说明

无。

#### 6.4.7 利润分配情况

无。

#### 6.4.8 期末(2021年6月30日)本基金持有的流通受限证券

##### 6.4.8.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

6.4.8.1.1 受限证券类别：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	-
300926	博俊科技	2020年12月29日	2021年07月12日	新股锁定	10.76	22.20	359	3,862.84	7,969.80	-
300927	江天化学	2020年12月29日	2021年7月7日	新股锁定	13.39	30.10	217	2,905.63	6,531.70	-
300929	华骐环保	2021年1月12日	2021年07月21日	新股锁定	13.87	29.55	183	2,538.21	5,407.65	-
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	2021年7月	新股锁定	3.37	10.44	1,112	3,747.44	11,609.28	-

		15 日	22 日								
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	853	40,372.49	214,921.88		-
300958	建工修复	2021 年 3 月 18 日	2021 年 9 月 29 日	新股锁 定	8.53	27.22	300	2,559.00	8,166.00		-
300960	通业科技	2021 年 3 月 22 日	2021 年 9 月 29 日	新股锁 定	12.08	23.06	234	2,826.72	5,396.04		-
300961	深水海纳	2021 年 3 月 23 日	2021 年 9 月 30 日	新股锁 定	8.48	22.07	394	3,341.12	8,695.58		-
300962	中金	2021	2021	新股锁	3.40	16.37	576	1,958.40	9,429.12		-



	辐照	年 3 月 29 日	年 10 月 11 日	定							
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	601	29,202.59	54,324.39	-	
300982	苏文	2021	2021	新股锁	15.83	45.29	317	5,018.11	14,356.93	-	

	电能	年 4 月 19 日	年 10 月 27 日	定							
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 25 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	2021 年 12	新股锁 定	7.83	17.61	218	1,706.94	3,838.98	-	

		9日	月20日							
301011	华立科技	2021年6月9日	2021年12月17日	新股锁定	14.20	33.84	175	2,485.00	5,922.00	-
301012	扬电科技	2021年6月15日	2021年12月22日	新股锁定	8.05	24.26	170	1,368.50	4,124.20	-
301013	利和兴	2021年6月21日	2021年12月29日	新股锁定	8.72	27.11	471	4,107.12	12,768.81	-
301015	百洋医药	2021年6月22日	2021年12月30日	新股锁定	7.64	38.83	462	3,529.68	17,939.46	-
301016	雷尔伟	2021年6月23日	2021年12月30日	新股锁定	13.75	32.98	275	3,781.25	9,069.50	-
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	-
688217	睿昂基因	2021年5月7日	2021年11月17日	新股锁定	18.42	58.40	1,040	19,156.80	60,736.00	-
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	-
688597	煜邦电力	2021年6月9日	2021年12月17日	新股锁定	5.88	10.16	3,907	22,973.16	39,695.12	-
688611	杭州柯林	2021年4月1日	2021年10月12日	新股锁定	33.44	42.34	1,400	46,816.00	59,276.00	-
688639	华恒生物	2021年4月14日	2021年10月22日	新股锁定	23.16	42.28	2,302	53,314.32	97,328.56	-
688655	迅捷兴	2021年4月28日	2021年11月11日	新股锁定	7.59	15.77	3,083	23,399.97	48,618.91	-
688690	纳微科技	2021年6月16日	2021年12月23日	新股锁定	8.07	79.89	3,477	28,059.39	277,777.53	-

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

无。

#### 6.4.8.3.2 交易所市场债券正回购

无。

### 6.4.8.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

无。

## 6.4.9 金融工具风险及管理

### 6.4.9.1 风险管理政策和组织架构

本基金为股票型证券投资基金，预期风险收益高于混合型基金、债券型基金和货币市场基金。本基金投资的金融工具主要为股票投资。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并保持良好流动性的前提下，重点投资于在科技和消费领域具有广阔成长空间和核心竞争力的优质企业，力争获得超额收益与长期资本增值。

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。

#### 6.4.9.2 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无定期/协议存款，因而与银行存款相关的信用风险不重大。本基金在交易所进行的交易均以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，违约风险可能性很小；在银行间同业市场进行交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式进行限制以控制相应的信用风险。

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

于本期末，本基金持有的除国债、央行票据和政策性金融债以外的债券占基金资产净值的比例为 0.24%(上年度末：0.00%)。

#### 6.4.9.3 流动性风险

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

##### 6.4.9.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

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

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。

#### 6.4.9.4 市场风险

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

##### 6.4.9.4.1 利率风险

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

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

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

##### 6.4.9.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2021 年 6 月 30 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	300,727,647.99	-	-	-	300,727,647.99
结算备付金	1,726,381.20	-	-	-	1,726,381.20
存出保证金	1,198,201.00	-	-	-	1,198,201.00
交易性金融资产	-	-	5,613,593.04	1,900,595,034.03	1,906,208,627.07
应收利息	-	-	-	37,646.87	37,646.87
应收股利	-	-	-	69,414.40	69,414.40
应收申购款	-	-	-	1,314,240.57	1,314,240.57
应收证券清算款	-	-	-	119,075,690.47	119,075,690.47
资产总计	303,652,230.19	-	5,613,593.04	2,021,092,026.34	2,330,357,849.57

负债					
应付赎回款	-	-	-	20,562,852.18	20,562,852.18
应付管理人报酬	-	-	-	3,006,654.15	3,006,654.15
应付托管费	-	-	-	501,108.98	501,108.98
应付证券清算款	-	-	-	61.65	61.65
应付销售服务费	-	-	-	432,872.96	432,872.96
应付交易费用	-	-	-	1,775,473.11	1,775,473.11
应交税费	-	-	-	18.82	18.82
其他负债	-	-	-	141,976.22	141,976.22
负债总计	-	-	-	26,421,018.07	26,421,018.07
利率敏感度缺口	303,652,230.19	-	5,613,593.04	1,994,671,008.27	2,303,936,831.50
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	1,595,309,955.36	-	-	-	1,595,309,955.36
结算备付金	23,940,442.32	-	-	-	23,940,442.32
存出保证金	10,300,952.53	-	-	-	10,300,952.53
交易性金融资产	-	-	-	4,267,081,415.44	4,267,081,415.44
买入返售金融资产	375,060,682.59	-	-	-	375,060,682.59
应收利息	-	-	-	313,324.02	313,324.02
应收申购款	-	-	-	1,215,648.66	1,215,648.66
应收证券清算款	-	-	-	70,552,393.39	70,552,393.39
资产总计	2,004,612,032.80	-	-	4,339,162,781.51	6,343,774,814.31
负债					
应付赎回款	-	-	-	146,581,720.56	146,581,720.56
应付管理人报酬	-	-	-	8,490,378.44	8,490,378.44
应付托管费	-	-	-	1,415,063.09	1,415,063.09
应付证券清算款	-	-	-	141,059,451.60	141,059,451.60
应付销售服务费	-	-	-	772,916.21	772,916.21
应付交易费用	-	-	-	7,950,172.94	7,950,172.94
其他负债	-	-	-	485,864.63	485,864.63
负债总计	-	-	-	306,755,567.47	306,755,567.47
利率敏感度缺口	2,004,612,032.80	-	-	4,032,407,214.04	6,037,019,246.84

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

#### 6.4.9.4.1.2 利率风险的敏感性分析

于本期末，本基金持有的交易性债券投资公允价值占基金资产净值的比例为 0.24%（上年度末：0.00%），因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响（上年度末：同）。



#### 6.4.9.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基金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。

##### 6.4.9.4.2.1 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	-	280,477,267.79	-	280,477,267.79
资产合计	-	280,477,267.79	-	280,477,267.79
以外币计价的 负债				
负债合计	-	-	-	-
资产负债表外 汇风险敞口净额	-	280,477,267.79	-	280,477,267.79
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	-	579,407,384.68	-	579,407,384.68
资产合计	-	579,407,384.68	-	579,407,384.68
以外币计价的 负债				
负债合计	-	-	-	-
资产负债表外 汇风险敞口净额	-	579,407,384.68	-	579,407,384.68

## 6.4.9.4.2 外汇风险的敏感性分析

假设	除港币以外的其他市场变量保持不变		
	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2021年6月30日）	上年度末（2020年12月31日）
分析	港币相对人民币升值 5%	14,023,863.39	28,970,369.22
	港币相对人民币贬值 5%	-14,023,863.39	-28,970,369.25

## 6.4.9.4.3 其他价格风险

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

本基金采用“自上而下选行业”与“自下而上精选个股”相结合的积极投资策略，以宏观经济和政策研究为基础，通过分析影响证券市场整体运行的内外部因素，进行自上而下的资产配置和组合管理；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。

本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险。本基金投资于股票资产、存托凭证的比例占基金资产的 80%-95%（其中港股通标的股票投资比例不超过本基金股票资产的 50%），投资于科技消费主题相关的股票、存托凭证合计比例不低于非现金资产的 80%，其中分别投资于本基金定义的科技行业和消费行业的股票比例均不低于非现金资产的 20%；本基金每个交易日日终在扣除股指期货合约和国债期货合约需缴纳的交易保证金后，应当保持不低于基金资产净值 5% 的现金或到期日在一年以内的政府债券，其中，现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。此外，本基金的基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控，定期运用多种定量方法对基金进行风险度量，包括 VaR (Value at Risk) 指标等来测试本基金面临的潜在价格风险，及时可靠地对风险进行跟踪和控制。

## 6.4.9.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2021年6月30日		上年度末 2020年12月31日	
	公允价值	占基金资产净值比例 (%)	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
交易性金融资产—股票投资	1,900,595,034.03	82.49	4,267,081,415.44	70.68
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	1,900,595,034.03	82.49	4,267,081,415.44	70.68

## 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%	123,358,593.99	131,429,182.78
	业绩比较基准下降5%	123,358,593.99	-131,429,182.78

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	1,900,595,034.03	81.56
	其中：股票	1,900,595,034.03	81.56
2	基金投资	-	-

3	固定收益投资	5,613,593.04	0.24
	其中：债券	5,613,593.04	0.24
	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	302,454,029.19	12.98
8	其他各项资产	121,695,193.31	5.22
9	合计	2,330,357,849.57	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	6,749.88	0.00
B	采矿业	-	-
C	制造业	1,133,696,806.23	49.21
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	13,020.39	0.00
E	建筑业	28,252.64	0.00
F	批发和零售业	55,863.06	0.00
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	71,972,850.40	3.12
J	金融业	312,942,960.02	13.58
K	房地产业	10,870.38	0.00
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	101,346,782.05	4.40
N	水利、环境和公共设施管理业	43,611.19	0.00
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	1,620,117,766.24	70.32

### 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	68,773,369.05	2.99
非日常生活消费品	29,159,203.50	1.27

日常消费品	-	-
能源	-	-
金融	8,471.91	0.00
医疗保健	106,946,831.02	4.64
工业	-	-
信息技术	75,589,392.31	3.28
原材料	-	-
房地产	-	-
合计	280,477,267.79	12.17

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	300760	迈瑞医疗	501,235	240,617,861.75	10.44
2	300059	东方财富	6,154,434	201,803,890.86	8.76
3	600862	中航高科	4,465,416	137,445,504.48	5.97
4	600036	招商银行	2,050,274	111,104,348.06	4.82
5	000568	泸州老窖	444,500	104,875,330.00	4.55
6	300395	菲利华	2,110,226	101,755,097.72	4.42
7	600519	贵州茅台	44,484	91,490,242.80	3.97
8	603259	药明康德	569,195	89,130,245.05	3.87
9	601567	三星医疗	3,552,400	75,666,120.00	3.28
10	00981	中芯国际	3,801,000	75,589,392.31	3.28
11	002624	完美世界	3,008,000	71,921,280.00	3.12
12	00700	腾讯控股	141,528	68,773,369.05	2.99
13	01951	锦欣生殖	4,001,461	65,258,899.11	2.83
14	300832	新产业	966,147	59,514,655.20	2.58
15	688665	四方光电	316,572	43,101,277.80	1.87
16	600079	人福医药	1,224,040	34,603,610.80	1.50
17	300957	贝泰妮	126,002	34,216,653.69	1.49
18	03690	美团-W	109,375	29,159,203.50	1.27
19	01066	威高股份	1,476,000	22,254,079.45	0.97
20	300363	博腾股份	261,090	21,962,890.80	0.95
21	688029	南微医学	68,663	21,401,570.47	0.93
22	603392	万泰生物	79,860	20,698,114.80	0.90
23	688269	凯立新材	145,327	20,276,023.04	0.88
24	300482	万孚生物	282,960	18,304,682.40	0.79
25	300705	九典制药	457,600	17,411,680.00	0.76
26	01801	信达生物	188,000	14,164,830.67	0.61
27	688276	百克生物	124,162	12,984,861.96	0.56

28	300759	康龙化成	56,300	12,216,537.00	0.53
29	300725	药石科技	72,670	11,547,989.70	0.50
30	300357	我武生物	178,800	11,464,656.00	0.50
31	300529	健帆生物	130,200	11,244,072.00	0.49
32	605369	拱东医疗	84,500	9,719,190.00	0.42
33	300595	欧普康视	92,158	9,542,960.90	0.41
34	300151	昌红科技	306,839	8,266,242.66	0.36
35	600587	新华医疗	336,500	7,621,725.00	0.33
36	688656	浩欧博	81,452	6,057,585.24	0.26
37	02269	药明生物	44,500	5,269,021.79	0.23
38	688690	纳微科技	3,477	277,777.53	0.01
39	300962	中金辐照	5,757	133,773.12	0.01
40	300919	中伟股份	693	112,959.00	0.00
41	300883	龙利得	8,911	108,535.98	0.00
42	688639	华恒生物	2,302	97,328.56	0.00
43	688499	利元亨	2,149	83,488.65	0.00
44	300979	华利集团	946	83,329.40	0.00
45	688217	睿昂基因	1,040	60,736.00	0.00
46	688611	杭州柯林	1,400	59,276.00	0.00
47	688239	航宇科技	4,926	56,550.48	0.00
48	300981	中红医疗	603	54,550.11	0.00
49	688087	英科再生	2,469	54,219.24	0.00
50	301010	晶雪节能	2,172	50,480.96	0.00
51	688655	迅捷兴	3,083	48,618.91	0.00
52	300973	立高食品	393	46,770.60	0.00
53	301020	密封科技	4,210	44,794.40	0.00
54	688597	煜邦电力	3,907	39,695.12	0.00
55	601528	瑞丰银行	2,230	34,721.10	0.00
56	300953	震裕科技	294	29,847.30	0.00
57	300122	智飞生物	158	29,503.34	0.00
58	301021	英诺激光	2,899	27,424.54	0.00
59	300941	创识科技	503	25,271.66	0.00
60	001207	联科科技	682	22,581.02	0.00
61	301009	可靠股份	807	22,541.97	0.00
62	301015	百洋医药	514	20,859.78	0.00
63	300937	药易购	334	18,057.04	0.00
64	300982	苏文电能	370	17,322.28	0.00
65	688226	威腾电气	2,693	17,289.06	0.00
66	300932	三友联众	518	16,437.22	0.00
67	300614	百川畅银	383	16,272.30	0.00
68	300940	南极光	368	16,038.26	0.00
69	300942	易瑞生物	528	15,159.71	0.00

70	300968	格林精密	1,220	14,941.74	0.00
71	300955	嘉亨家化	314	14,830.88	0.00
72	300996	普联软件	310	14,068.34	0.00
73	301013	利和兴	504	13,986.51	0.00
74	001208	华菱线缆	1,754	13,558.42	0.00
75	300997	欢乐家	979	13,067.16	0.00
76	300922	天秦装备	363	12,643.29	0.00
77	300966	共同药业	358	12,311.56	0.00
78	603171	税友股份	637	12,230.40	0.00
79	301016	雷尔伟	347	12,175.58	0.00
80	300918	南山智尚	1,126	11,721.66	0.00
81	300933	中辰股份	1,117	11,662.18	0.00
82	301002	崧盛股份	201	11,581.62	0.00
83	605289	罗曼股份	379	10,930.36	0.00
84	300958	建工修复	393	10,879.74	0.00
85	300917	特发服务	393	10,870.38	0.00
86	300952	恒辉安防	398	10,840.48	0.00
87	300986	志特新材	332	10,808.84	0.00
88	300956	英力股份	407	10,548.12	0.00
89	605259	绿田机械	295	10,516.75	0.00
90	300993	玉马遮阳	497	10,079.55	0.00
91	300945	曼卡龙	531	10,073.73	0.00
92	300961	深水海纳	436	9,727.10	0.00
93	300991	创益通	335	9,662.50	0.00
94	301011	华立科技	250	9,424.50	0.00
95	300978	东箭科技	630	8,741.53	0.00
96	300926	博俊科技	384	8,534.80	0.00
97	00388	香港交易所	22	8,471.91	0.00
98	605162	新中港	1,377	8,358.39	0.00
99	300927	江天化学	263	7,928.72	0.00
100	300943	春晖智控	342	7,925.10	0.00
101	300963	中洲特材	330	7,821.67	0.00
102	300960	通业科技	332	7,806.84	0.00
103	300971	博亚精工	245	6,931.05	0.00
104	300992	泰福泵业	298	6,885.42	0.00
105	300975	商络电子	517	6,872.51	0.00
106	300967	晓鸣股份	561	6,749.88	0.00
107	300929	华骐环保	227	6,732.05	0.00
108	300995	奇德新材	209	5,008.52	0.00
109	301012	扬电科技	191	4,854.16	0.00
110	301007	德迈仕	322	4,766.15	0.00
111	605011	杭州热电	525	4,662.00	0.00

112	300998	宁波方正	203	4,347.24	0.00
113	000739	普洛药业	20	588.00	0.00

注：截至报告期末，本基金投资的一家公司发行的证券迈瑞医疗（300760.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	00700	腾讯控股	268,542,922.04	4.45
2	600519	贵州茅台	214,534,574.60	3.55
3	00388	香港交易所	126,618,881.93	2.10
4	01951	锦欣生殖	119,167,984.89	1.97
5	600036	招商银行	109,039,028.76	1.81
6	000568	泸州老窖	103,799,548.77	1.72
7	300059	东方财富	103,142,553.69	1.71
8	002466	天齐锂业	87,789,857.26	1.45
9	300601	康泰生物	80,127,020.55	1.33
10	00688	中国海外发展	77,220,993.14	1.28
11	06969	思摩尔国际	75,868,484.90	1.26
12	00981	中芯国际	75,412,010.61	1.25
13	06690	海尔智家	71,791,589.91	1.19
14	002304	洋河股份	70,915,928.55	1.17
15	600893	航发动力	70,527,598.21	1.17
16	300832	新产业	66,438,425.01	1.10
17	300395	菲利华	60,811,210.88	1.01
18	601567	三星医疗	53,993,041.84	0.89
19	000738	航发控制	44,304,575.85	0.73
20	688665	四方光电	44,097,514.09	0.73

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	600519	贵州茅台	325,029,030.33	5.38
2	300122	智飞生物	235,617,757.66	3.90
3	002352	顺丰控股	219,833,882.05	3.64
4	00175	吉利汽车	195,317,165.98	3.24
5	603259	药明康德	188,298,722.95	3.12
6	300059	东方财富	186,870,907.30	3.10
7	002624	完美世界	186,566,395.45	3.09



8	002304	洋河股份	171,767,060.32	2.85
9	000860	顺鑫农业	165,170,098.74	2.74
10	00700	腾讯控股	160,715,522.60	2.66
11	300699	光威复材	147,181,227.31	2.44
12	000547	航天发展	142,700,990.79	2.36
13	002025	航天电器	130,777,420.12	2.17
14	601877	正泰电器	129,845,604.33	2.15
15	000636	风华高科	128,719,858.68	2.13
16	002049	紫光国微	127,652,790.74	2.11
17	000738	航发控制	127,484,459.34	2.11
18	06098	碧桂园服务	125,881,554.15	2.09
19	002466	天齐锂业	117,017,348.85	1.94
20	03690	美团-W	116,647,027.21	1.93

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	2,316,966,571.41
卖出股票收入（成交）总额	4,827,587,198.57

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

#### 7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	5,613,593.04	0.24
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	5,613,593.04	0.24

#### 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	123111	东财转3	34,978	5,119,380.08	0.22

2	123109	昌红转债	4,232	494,212.96	0.02
---	--------	------	-------	------------	------

#### 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。

##### 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	1,198,201.00
2	应收证券清算款	119,075,690.47
3	应收股利	69,414.40
4	应收利息	37,646.87
5	应收申购款	1,314,240.57
6	其他应收款	-

7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	121,695,193.31

#### 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(%)
大成科技消费股票A	26,649	56,917.55	1,780,927.84	0.12	1,515,014,813.68	99.88
大成科技消费股票C	108,247	5,367.17	-	-	580,979,674.06	100.00
合计	134,896	15,551.06	1,780,927.84	0.08	2,095,994,487.74	99.92

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	大成科技消费股票 A	321,962.34	0.0212
	大成科技消费股票 C	74,426.76	0.0128
	合计	396,389.10	0.0189

## 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	大成科技消费股票 A	10~50
	大成科技消费股票 C	0~10
	合计	10~50
本基金基金经理持有本开放式基金	大成科技消费股票 A	0~10
	大成科技消费股票 C	0
	合计	0~10

## § 9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	大成科技消费股票 A	大成科技消费股票 C
基金合同生效日 (2020 年 7 月 16 日) 基金份额总额	6,284,698,804.81	1,968,472,972.41
本报告期期初基金份额总额	4,568,679,239.00	971,237,383.27
本报告期基金总申购份额	105,863,877.11	237,445,224.36
减：本报告期基金总赎回份额	3,157,747,374.59	627,702,933.57
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	1,516,795,741.52	580,979,674.06

## § 10 重大事件揭示

### 10.1 基金份额持有人大会决议

无。

### 10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

一、基金管理人的重大人事变动

基金管理人报告期内无重大人事变动。

二、基金托管人的基金托管部门的重大人事变动

本报告期内，无涉及本基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动。

### 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

无。

### 10.4 基金投资策略的改变

本基金投资策略在本报告期内没有重大改变。

### 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金聘任的为本基金审计的会计师事务所为普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙），该事务所自基金合同生效日起为本基金提供审计服务至今。

### 10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，基金管理人、托管人的托管业务部门及其相关高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

### 10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

#### 10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单	股票交易	应支付该券商的佣金	备注
------	-----	------	-----------	----

	元数量	成交金额	占当期股票 成交总额的 比例	佣金	占当期佣 金 总量的比 例	
光大证券	2	1,869,347,062.50	26.20%	1,495,479.02	23.85%	-
中金公司	2	1,162,405,953.33	16.29%	1,059,302.52	16.89%	-
华西证券	1	796,271,699.05	11.16%	725,630.45	11.57%	-
长江证券	2	785,369,227.60	11.01%	715,739.18	11.41%	-
招商证券	3	659,345,818.03	9.24%	578,390.55	9.22%	-
东方证券	1	548,849,232.83	7.69%	500,171.84	7.98%	-
华福证券	1	279,019,357.89	3.91%	254,260.98	4.05%	-
中信证券	2	263,847,864.68	3.70%	240,443.45	3.83%	-
广发证券	1	177,663,449.26	2.49%	161,896.84	2.58%	-
中信建投 证券	1	157,325,122.49	2.21%	143,363.71	2.29%	-
安信证券	2	126,987,586.38	1.78%	115,723.58	1.85%	-
海通证券	2	123,752,569.76	1.73%	112,779.15	1.80%	-
华泰证券	2	93,421,940.69	1.31%	85,131.25	1.36%	-
申万宏源	1	90,243,522.47	1.27%	82,242.84	1.31%	-
渤海证券	1	-	-	-	-	-
财信证券	1	-	-	-	-	-
长城证券	1	-	-	-	-	-
东海证券	1	-	-	-	-	-
东吴证券	1	-	-	-	-	-
东兴证券	1	-	-	-	-	-
东莞证券	1	-	-	-	-	-
方正证券	1	-	-	-	-	-
广州证券	1	-	-	-	-	-
国都证券	1	-	-	-	-	-
国海证券	1	-	-	-	-	-
国泰君安	1	-	-	-	-	-

国信证券	1	-	-	-	-	-
恒泰证券	1	-	-	-	-	-
华宝证券	1	-	-	-	-	-
华林证券	1	-	-	-	-	-
华鑫证券	1	-	-	-	-	-
江海证券	1	-	-	-	-	-
开源证券	1	-	-	-	-	-
民生证券	1	-	-	-	-	-
摩根大通	1	-	-	-	-	-
平安证券	1	-	-	-	-	-
太平洋证 券	1	-	-	-	-	-
万联证券	1	-	-	-	-	-
西南证券	1	-	-	-	-	-
湘财证券	1	-	-	-	-	-
中国银河 证券	1	-	-	-	-	-
中金财富	2	-	-	-	-	-

注：1、根据中国证监会颁布的《关于完善证券投资基金交易席位制度有关问题的通知》（证监基金字[2007]48号）的有关规定，本公司制定了租用证券公司交易单元的选择标准和程序。

租用证券公司交易单元的选择标准主要包括：

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

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

2、本报告期内本基金租用证券公司交易单元的变更情况如下：

本报告期内增加交易单元：摩根大通；

本报告期内退租交易单元：中泰证券。

### 10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

无。

### 10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	关于提请投资者及时更新已过期身份证件或者身份证明文件的公告	中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站	2021年6月30日
2	大成基金管理有限公司关于旗下部分基金增加海银基金销售有限公司为销售机构的公告	中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站	2021年5月27日
3	大成基金管理有限公司关于旗下部分基金增加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
4	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
5	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
6	大成科技消费股票型证券投资基金 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
7	大成科技消费股票型证券投资基金 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
8	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
9	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
10	大成科技消费股票型证券投资基金更新招募说明书	中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站	2021年1月28日
11	大成科技消费股票型证券投资基金(C类份额)基金产品资料概要更新	中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站	2021年1月28日
12	大成科技消费股票型证券投资基金(A	中国证监会基金电子披	2021年1月28日



	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	
13	大成科技消费股票型证券投资基金增聘基金经理的公告	中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站	2021 年 1 月 27 日
14	大成科技消费股票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
15	关于大成科技消费股票型证券投资基金 A、C 类份额增加恒泰证券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 1 月 14 日

## § 11 影响投资者决策的其他重要信息

### 11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

无。

### 11.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

## § 12 备查文件目录

### 12.1 备查文件目录

- 1、中国证监会批准设立大成科技消费股票型证券投资基金的文件；
- 2、《大成科技消费股票型证券投资基金基金合同》；
- 3、《大成科技消费股票型证券投资基金托管协议》；
- 4、大成基金管理有限公司批准文件、营业执照、公司章程；
- 5、本报告期内在指定报刊上披露的各种公告原稿。

### 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