

# 中庚价值品质一年持有期混合型证券投资基金

## 2021 年年度报告

2021 年 12 月 31 日

基金管理人:中庚基金管理有限公司

基金托管人:平安银行股份有限公司

送出日期:2022 年 03 月 18 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。

基金托管人平安银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2022年03月04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。

本报告期自2021年01月19日（基金合同生效日）起至2021年12月31日止。

## 1.2 目录

§1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
§2 基金简介	5
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人和基金托管人	6
2.4 信息披露方式	6
2.5 其他相关资料	7
§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况	7
3.1 主要会计数据和财务指标	7
3.2 基金净值表现	8
3.3 过去三年基金的利润分配情况	9
§4 管理人报告	9
4.1 基金管理人及基金经理情况	9
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	10
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	11
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明	12
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	13
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况	14
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	15
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	16
4.9 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
§5 托管人报告	16
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	16
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	16
5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见	17
§6 审计报告	17
6.1 审计报告基本信息	17
6.2 审计报告的基本内容	17
§7 年度财务报表	20
7.1 资产负债表	20
7.2 利润表	21
7.3 所有者权益（基金净值）变动表	23
7.4 报表附注	24
§8 投资组合报告	60
8.1 期末基金资产组合情况	60
8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	60
8.3 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	62
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动	68
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	70
8.6 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	70
8.7 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	71
8.8 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	71
8.9 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	71
8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明	71

8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	71
8.12 投资组合报告附注.....	72
§9 基金份额持有人信息.....	73
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	73
9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	73
9.3 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.....	73
§10 开放式基金份额变动.....	73
§11 重大事件揭示.....	74
11.1 基金份额持有人大会决议.....	74
11.2 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.....	74
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	74
11.4 基金投资策略的改变.....	74
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	74
11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况.....	74
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	74
11.8 其他重大事件.....	76
§12 影响投资者决策的其他重要信息.....	79
12.1 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.....	79
12.2 影响投资者决策的其他重要信息.....	79
§13 备查文件目录.....	79
13.1 备查文件目录.....	79
13.2 存放地点.....	80
13.3 查阅方式.....	80

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	中庚价值品质一年持有期混合型证券投资基金
基金简称	中庚价值品质一年持有期混合
基金主代码	011174
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2021年01月19日
基金管理人	中庚基金管理有限公司
基金托管人	平安银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	4,598,348,716.47份
基金合同存续期	不定期

### 2.2 基金产品说明

投资目标	<p>本基金在跟踪研究宏观经济发展趋势基础上，主要采用自下而上的投资方法，以深入的基本面分析为立足点，寻找证券市场中具备投资价值的股票进行组合投资，为基金份额持有人谋求中长期可持续的、超越业绩比较基准的超额收益。</p>
投资策略	<p>资产配置策略：本基金将兼顾市场风险控制和收益获取，在大类资产配置策略方面，从宏观经济环境、市场流动性水平、政策因素、估值水平等方面，采取定性与定量结合的分析方法，对证券市场投资的收益与风险进行综合研判。在保持总体风险水平相对稳定的基础上，采用自上而下的投资理念，对不同类别风险资产基本面的持续跟踪研究，结合证券市场对不同类别风险资产的定价情况，力求寻找符合基金投资目标的资产配置方式。</p> <p>股票投资策略：本基金在选股上遵循价值投资理念。长期来看上市公司的可持续盈利能力和其股票估值具有很强的正相关性。可持续的高盈利能力公司的估值最终会比低盈利能力公司的高，因此通过投资低估值、高盈利能力的股票能够为投资者带来中长期的超额收益。</p>

	其他策略：债券投资策略、股指期货投资策略、股票期权投资策略、资产支持证券投资策略、存托凭证投资策略、投资组合的风险管理策略。
业绩比较基准	中证800指数收益率×50%+中证港股通综合指数（人民币）收益率×25%+中证全债指数收益率×25%
风险收益特征	本基金为混合型基金，其长期平均风险和预期收益水平低于股票型基金，高于债券型基金、货币市场基金。本基金可投资香港联合交易所上市的股票，将面临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	中庚基金管理有限公司	平安银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	崔远洪
	联系电话	021-20639999
	电子邮箱	cuiyuanhong@zgfunds.com.cn
客户服务电话	021-53549999	95511-3
传真	021-20639747	0755-82080387
注册地址	上海市虹口区欧阳路218弄1号420室	广东省深圳市罗湖区深南东路5047号
办公地址	上海市浦东新区陆家嘴环路1318号星展银行大厦703-704	广东省深圳市福田区益田路5023号平安金融中心B座26楼
邮政编码	200120	518001
法定代表人	孟辉	谢永林

### 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》
登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	www.zgfunds.com.cn
基金年度报告备置地点	基金管理人及基金托管人办公场所

## 2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
会计师事务所	普华永道中天会计师事务所 (特殊普通合伙)	中国上海市黄浦区湖滨路202号普华永道中心11楼
注册登记机构	中庚基金管理有限公司	上海市浦东新区陆家嘴环路1318号 星展银行大厦703-704

## § 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

### 3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

<b>3.1.1 期间数据和指标</b>	本期2021年01月19日（基金合同生效日）- 2021年12月31日
本期已实现收益	907,102,152.12
本期利润	894,980,111.00
加权平均基金份额本期利润	0.2631
本期加权平均净值利润率	21.29%
本期基金份额净值增长率	37.02%
<b>3.1.2 期末数据和指标</b>	2021年末
期末可供分配利润	1,364,094,454.99
期末可供分配基金份额利润	0.2966
期末基金资产净值	6,300,837,212.54
期末基金份额净值	1.3702
<b>3.1.3 累计期末指标</b>	2021年末
基金份额累计净值增长率	37.02%

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. 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. 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）。

4. 本基金基金合同于2021年1月19日生效，本报告期不是完整报告期。

### 3.2 基金净值表现

#### 3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	-4.84%	1.38%	-0.32%	0.54%	-4.52%	0.84%
过去六个月	18.69%	1.49%	-5.40%	0.72%	24.09%	0.77%
自基金合同生效起至今	37.02%	1.28%	-6.53%	0.79%	43.55%	0.49%

注：本基金的业绩比较基准为中证800指数收益率×50%+中证港股通综合指数（人民币）收益率×25%+中证全债指数收益率×25%

#### 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

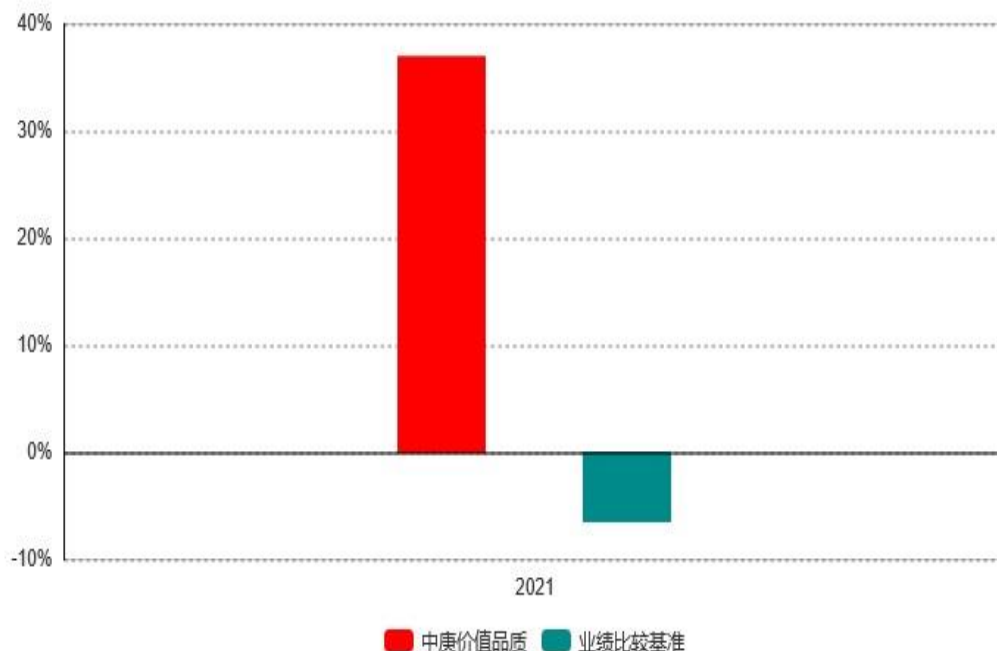


注：1. 本基金基金合同于2021年1月19日生效，截至报告期末本基金基金合同生效未满一年。



2. 根据本基金基金合同规定，本基金自基金合同生效之日起六个月内已使基金的投资组合比例符合基金合同的约定。

### 3.2.3 自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较



注：本基金基金合同于2021年1月19日生效，合同生效当年按实际存续期计算，不按整个自然年度进行折算。

### 3.3 过去三年基金的利润分配情况

本基金基金合同于2021年01月19日生效，自合同生效日至本报告期末未发生利润分配。

## § 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

本基金管理人为中庚基金管理有限公司（以下简称“公司”），于2018年6月经中国证监会核准设立。公司是一家以自然人持股发起设立的公募基金管理公司，注册资本为人民币2亿元，公司注册地为上海。目前，公司股东及其出资比例为：孟辉先生26%，中

庚置业集团有限公司25%，大连汇盛投资有限公司25%，闫焯先生10%，大连海博教育发展有限公司8%，福建海龙威投资发展有限公司4%，福建瑞闽投资有限公司2%。

截至报告期末，公司共管理5只公募基金产品，分别为中庚价值领航混合型证券投资基金、中庚小盘价值股票型证券投资基金、中庚价值灵动灵活配置混合型证券投资基金、中庚价值品质一年持有期混合型证券投资基金、中庚价值先锋股票型证券投资基金，管理资产规模245.55亿元。

#### 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		
丘栋荣	本基金的基金经理；中庚价值领航混合基金、中庚小盘价值股票基金、中庚价值灵动灵活配置混合基金的基金经理；公司副总经理兼首席投资官	2021-01-19	-	14年	丘栋荣先生，副总经理，工商管理硕士，历任群益国际控股有限公司上海代表处研究员、汇丰晋信基金管理有限公司行业研究员、高级研究员、股票投资部总监、总经理助理。现任中庚基金管理有限公司副总经理兼首席投资官。

注：1. 任职日期为本基金基金合同生效日的日期。

2. 证券从业的含义遵从行业协会《证券从业人员资格管理办法》的相关规定。

#### 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》等有关法律法规、《中庚价值品质一年持有期混合型证券投资基金基金合同》、《中庚价值品质一年持有期混合型证券投资基金招募说明书》的规定，本着诚实信用、勤勉尽职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。

本报告期内，基金投资管理符合有关法规和基金合同的规定，没有发生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 公平交易制度和控制方法

根据《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》，本公司制定了《中庚基金管理有限公司公平交易制度》，建立了完整有效的公平交易制度体系，涵盖了产品投资范围内所有证券品种的一二级市场投资管理活动；贯穿了投资研究、投资决策、交易执行、日常监控和报告分析等各个环节。

在投资研究环节，公司建立了资源共享的投资研究信息平台，通过平台规范研究人员的投资建议、研究报告的发布流程，确保各投资组合在获得投资信息和实时投资决策方面享有公平的机会；在交易环节，努力加强交易执行的内部控制，利用恒生系统公平交易功能模块和其它流程控制手段，确保不同组合在一、二级市场对同一证券交易时的公平；在日常监控环节，公司通过实时监控分析、交易监控报告和专项稽核等方式，对投资交易实施全过程监督，严格禁止不同组合间各种可能导致不公平交易和利益输送的反向交易行为；在报告分析环节，公司不断完善和改进公平交易分析的技术手段，并按季度和年度编制公平交易报告，对各组合间的同向/反向交易情况进行事后分析，评估是否存在违背公平交易原则的情况。

#### 4.3.2 公平交易制度的执行情况

本报告期内，公司继续贯彻落实《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》和《中庚基金管理有限公司公平交易制度》等相关监管法规及内部制度，严格规范境内上市证券的一级市场申购和二级市场交易相关的研究分析、投资决策、交易执行、日常监控和报告分析等投资管理环节，实行事前控制、事中监控、事后评估及反馈的流程化管理体系。在制度和实际操作层面确保各组合享有同等交易机会，并保持各组合的独立投资决策权。

事前控制主要包括：1、一级市场，通过恒生系统的线上流程和标准化的线下审批流程，对关联方审核、价格公允性判断及证券公平分配等相关环节进行控制；2、二级市场，通过交易系统的授权管理，对投资标的、交易对手和操作权限进行自动化控制。

事中控制主要包括组合间相同证券的交易方向控制。首先，将主动投资组合的同日反向交易列为禁止行为。其次，对于同日同向交易，通过交易系统对组合间的交易公平性进行自动化处理。

事后评估及反馈主要包括组合间不同时间窗口下（1日、3日、5日）的季度公平性交易分析评估。通过公平交易的事后分析评估系统，对当季度涉及公平性交易的投资行为进行统计分析。若发现异常交易行为，视情况要求相关当事人做出合理性解释，并按法规要求上报监管机构。

本报告期内，公司旗下各基金产品严格遵守公司的公平交易制度，未出现违反公平交易制度的情况。

#### 4.3.3 异常交易行为的专项说明

本报告期内，未发现本基金与本公司管理的其他投资组合之间有导致不公平交易和利益输送的异常交易。

本报告期内，未出现本公司管理的投资组合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证券当日成交量5%的交易。

### 4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

#### 4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2021年经济基本面见顶后逐步回落，至四季度较为悲观，全年看疫情错位和市场表现分化是最显著的两点特征。权益资产表现看，一方面，盈利增长驱动市场表现，紧信用局面下压抑估值，部分抱团行业年初切换后即陷入落寞，叠加中小市值企业的盈利相对更好，国证2000、中证1000及可转债等均表现强势。另一方面，受损和受益行业表现迥异，涨价盈利齐飞导致周期股涨幅巨大，而受损疫情、涨价及政策的中下游消费、成长行业表现较差。成长板块中持续高景气和政策支持的新能源相关行业，继续高歌猛进。港股受到经济预期下行、疫情侵扰、政策压制、海外流动性趋紧等多重压力压制，全年基本单边下行，表现惨淡。

估值方面，2021年上市公司整体盈利大幅度修复和10年国债收益率显著下行，整体估值水平自年初的高位消化至历史中性水平，中证800股权风险溢价从去年年末的-0.65倍标准差回升至0.19倍标准差。我们2020年末认为市场的核心矛盾在于极致的分化，结构性的高估和低估并存，2021年市场有一定程度的修正，但此矛盾仍最为突出。因此，2021年本基金产品基于低估值价值投资策略，从资产配置、行业配置和个股组合等多方面构建高性价比投资组合。

1、基于股权风险溢价的资产配置策略，本基金报告期内维持了对权益资产较高的配置比例，其中港股配置比例也维持在本基金合同约定区间内的较高水平。

2、从行业和个股层面持续优化组合，自下而上积极配置低风险、低估值、持续成长的公司，同时行业风险和风格风险相对分散。本基金重点配置了煤炭、化工、金融、地产、电子、金属加工、医药等行业相关个股。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末中庚价值品质一年持有期混合基金份额净值为1.3702元，本报告期内，基金份额净值增长率为37.02%，同期业绩比较基准收益率为-6.53%。

#### 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2022年，三重压力（需求收缩、供给冲击、预期转弱）的基础共识，对经济基本面的担心是持续的，聚焦以内为主的经济政策，实现经济目标需合力，上半年靠前发力的基建和受益海外及价格的出口托底经济，之后需要政策加码地产反弹和消费复苏。总体上，政策积极则经济动能恢复，经济基本面风险将降低，应更积极看待经济。

2022年初，市场承受较大压力，权益资产快速调整释放风险，另一面是风高浪急，权益资产获得更高的隐含回报水平。从风险溢价的角度看，权益资产隐含回报水平在提升，目前中证800的风险溢价已经接近于历史净值水平上方的0.5倍标准差的水平，市场整体的风险溢价水平是有吸引力的。但市场核心矛盾不是整体的高估或者低估，而是内部的结构分化仍非常激烈，结构性高估和低估仍并存，像一些传统行业和领域的估值水平仍处于历史最便宜的10%以下分位值，而以大盘成长股为核心的高估值股票即便过去一年调整了，但绝对估值水平高，仍处于历史90%以上分位值。这种结构性矛盾的存在，其中某些定价有其合理性，但我们更关注那些低估值中不合理的部分，当这些定价相对应的基本面的风险、风险大小和 risk 的变化，这种变化本身会带来可能的机会。低估值且低风险或者边际变好，甚至在政策等催化下盈利还能够获得很好的成长性，那么就有可能获取非常大的超额回报。

本基金后市投资思路上，我们坚持低估值价值投资理念，通过精选基本面风险降低、盈利增长积极、估值便宜的个股，以此构建高性价比的投资组合，力争获得可持续的超额收益。

具体而言，本基金重点关注的投资方向来自四个方面：

1、大盘价值股中的金融、地产等。配置逻辑在于：金融板块中，我们看好与制造业产业链相关、服务于实体经济、有独特竞争优势的区域性银行股，这类银行经营稳健、基本面风险较小、估值极低、成长性较高。地产类公司则集中于具有高信用、低融资成本优势的央企龙头公司，我们认为房地产长期需求仍在，系统性风险在下降，随着政策风险的缓释和经营风险的暴露，该类公司抗风险能力更强，外延扩张可能性高，并且估值极低情况下，未来房地产市场至平稳后，仍有较好的回报潜力。

2、能源、资源类公司。配置的逻辑主要在于：（1）政策将持续纠偏，认识到追求经济整体的稳健增长即追求能源、资源增长，经济缓步降速的过程中，需求仍是长期且持续增长的。（2）从严重过剩到供给侧改革，市场出清情况较好，但国内外诸多商品长期资本开支不足，供给收缩情况比较严重，供给弹性不足，供给恢复非一朝一夕，落实到真实有效的供给增长往往体现为短缺导致的价格中枢上行。（3）中长期来看，环保和碳中和因素影响下，中期的供给约束和边际成本会上升，商品价格中枢不可避免的抬升，且新应用不断拓展，导致存量资产价值显著提升。从市场定价和估值来看，这类公司视为周期类资产，估值极低、现金流好、资本开支少、分红收益率较高、现价对应的预期回报率高。我们希望买到存量资产里最具竞争力、最有价值、进入壁垒非常高的

能源、资源类公司，而不是仅依赖于判断价格趋势。因此，碳中和背景下，我们继续看好能源、资源类存量优质资产的投资价值。

3、中小盘价值和成长股。包括：（1）广义制造业中具备独特竞争优势的细分龙头企业。既包括看似传统的制造业，更包括新材料、零部件、元器件等具有技术工艺壁垒的制造业。疫情以来中国制造业链连接和网络优势愈发显著，人才、市场、品类和稳定性促使企业积累、突破、切入、应用，中国制造业优质产能的优势进一步拉大，竞争优势的确立和深化仍在进行，而这有望使得制造业的盈利能力和质量都将提升。因此，广义制造业中挖掘高性价比公司仍大有可为。我们坚持三条标准，即需求增长、供给收缩、细分行业龙头，比如化工、有色金属加工、机械加工、轻工、风电制造等，可以挖掘出真正的低估值小盘价值股和小盘成长股。（2）估值较低，且受益于后疫情时代线下消费需求逐步复苏的公司，如商贸零售、纺织服装、交通运输等行业中的部分个股。

4、港股中的大盘价值股、部分成长性较好的公司和部分互联网股。看好的原因有三点：（1）港股的价值股基本上都是龙头企业或者央企，这些资产质量非常高、最能承受基本面压力，因此风险较小，同时盈利能力风险小且具有一定的成长性。比如电信运营商、地产、银行、保险、能源、煤炭的龙头公司，都是中国经济体中最好的、最中坚的力量。港股中部分成长性公司，虽然商业模式比较简单，但业务扎实，前景广阔，如制药、原料药、消费类的医药公司。港股的互联网股业务是深深嵌入中国经济中的，格局清晰但其核心业务壁垒仍较为坚实。（2）价格较低或价格出清彻底。港股的价值股对应的在A股中的价值股很便宜，但是在港股更便宜，同时对应的分红收益率保持着非常高的水平。港股的互联网股承受各种压力聚集，定价估值降至低估水平。（3）交易上风险释放较为充分，交易并不拥挤。随着基本面、监管层面和流动性压力的逐步缓释，港股值得关注。

#### 4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

2021年度，根据《中华人民共和国证券投资基金法》及相关法律法规的要求，本基金管理人恪尽职守，勤勉尽责，依法履行基金管理人的职责，有效组织开展对基金运作的内部监察稽核，落实风险控制，强化监察稽核职能，确保基金管理业务运作的安全、规范，保护基金投资人的合法权益。本报告期内，本基金管理人内部有关本基金的监察稽核工作主要包括以下方面：

##### （一）完善规章制度，建立健全公司内控体系

本报告期内，公司结合新法规的实施、新的监管要求和公司业务发展实际，对《中庚基金管理有限公司计算机安全管理制度》、《中庚基金管理有限公司投资者适当性管理办法》等多项管理制度进行了修订完善，同时通过组织全员培训、合规检查等方式予以落实。进一步明确了内部控制和风险管理责任，完善了公司内部控制体系和风险管理体制，为切实维护基金持有人利益奠定了坚实的基础。

## （二）有效落实投资风控合规管理，保障基金合法合规运作

本报告期内，公司严格执行合规审查流程，落实事前事中事后的全流程风控管理，重点加强对信用风险、流动性风险等风险的管理。同时进一步加大合规和风险管控力度和深度，积极做好关联交易管理、公平交易及异常交易管控、防控内幕信息和非公开性信息流转、防范利益冲突和利益输送、人员执业行为管理工作，有效落实好公司投资业务的合规和风险管控工作，保障基金运作合法合规、风险可控。

## （三）全面开展合规检查工作，强化公司内部控制

公司以法律法规和公司各项制度为依据，根据年度合规检查计划及监管机构要求，对基金运作和公司经营所涉及的各个环节实施了严格的合规检查工作。通过对基金投资、销售、运营、信息技术等各部门的内部控制关键点进行定期和不定期的系统检查与评估，及时发现并整改风险点，促进公司内部控制制度有效执行。

## （四）积极开展合规培训，提高员工合规意识

公司及时跟踪各类监管新规的发布，通过对各类监管新规的解读和学习，保持对监管动态的敏感度，保障公司合法合规开展业务。同时，公司通过公网资料学习、邮件自学、部门培训、全员培训和合规测试等方式对公司员工开展合规培训，提高了员工合规知识水平和合规管理技能，有效提升员工的合规意识。

### 4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

为合理、公允地对基金所投资品种进行估值，保护基金份额持有人利益，本公司设立估值委员会，专门负责基金估值工作，直接向公司管理层负责，在确定公司旗下基金的估值方法、估值模型选择、估值模型假设及估值政策和程序的建立等方面为公司管理层提供参考意见，为业务部门的操作提供指导意见并对执行情况进行监督。估值委员会由督察长、首席投资官、基金运营部负责人、投资部负责人、监察稽核部内审经理组成，当发现可能需要对某只证券重新估值的情形，估值委员会成员或基金经理可提请召开估值委员会，讨论估值方法的调整。估值委员会成员均具有10年以上专业工作经验，具备良好的专业知识和专业技能，充分理解各种估值方法和估值技术。估值委员会的职责主要包括有：

（一）负责建立、健全公司的估值政策和估值程序；

（二）负责参照估值模型和行业惯例，选定与市场环境相适应的估值方法；

（三）负责在经济环境发生重大变化或证券发行机构发生影响证券价格的重大事件等情形下，确定合理的估值方法，组织估值调整；

（四）负责研究中国证券投资基金业协会估值核算工作小组发布的各类估值指引，评估指引实施后对估值的影响及估值系统改造的可行性；

（五）对直接选取第三方估值机构提供的证券估值价格的，负责评估第三方估值机构的估值质量，对估值价格进行校验，确定更能体现公允价值的估值价格；

(六) 当发生估值调整时, 负责发布相关公告, 充分披露确定公允价值的依据、方法、估值价格等信息;

(七) 当本公司所管理的证券投资基金前一估值日基金资产净值50%以上的资产出现无可参考的活跃市场价格且采用估值技术仍导致公允价值存在重大不确定性时, 负责决定是否暂停基金估值;

(八) 当本公司所管理的证券投资基金发生大额申购或赎回情形时, 负责决定是否启用摆动定价机制, 摆动定价机制的处理原则与操作规范由中国证券投资基金业协会另行制定。

参与估值流程的各方还包括托管人和会计师事务所。托管人根据法律法规要求对基金估值及净值计算履行复核责任, 当存有异议时, 托管人有责任要求基金管理公司作出合理解释, 通过积极商讨达成一致意见。会计师事务所对估值委员会采用的相关估值模型、假设及参数的适当性发表审核意见并出具报告。上述参与估值流程各方之间不存在任何重大利益冲突。

本基金管理人已与中债金融估值中心有限公司及中证指数有限公司签署服务协议, 由中债金融估值中心有限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。

#### 4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金本报告期内未进行利润分配, 但符合基金合同规定。

#### 4.9 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

本报告期内, 本基金不存在连续二十个工作日基金份额持有人数量不满二百人或者基金资产净值低于五千万的情形。

### § 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, 平安银行股份有限公司在本基金的托管过程中, 严格遵守了《证券投资基金法》、基金合同、托管协议和其他有关规定, 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, 本托管人按照国家有关规定、基金合同、托管协议和其他有关规定, 对本基金的基金资产净值计算、基金费用开支等方面进行了认真的复核, 对本基金的投资运作方面进行了监督, 未发现基金管理人有关损害基金份额持有人利益的行为。



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

本报告期，本托管人复核的财务指标、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真实、准确、完整。

## § 6 审计报告

### 6.1 审计报告基本信息

财务报表是否经过审计	是
审计意见类型	标准无保留意见
审计报告编号	普华永道中天审字(2022)第22935号

### 6.2 审计报告的基本内容

审计报告标题	审计报告
审计报告收件人	中庚价值品质一年持有期混合型证券投资基金全体基金份额持有人
审计意见	(一) 我们审计的内容 我们审计了中庚价值品质一年持有期混合型证券投资基金(以下简称“中庚价值品质一年持有期混合基金”)的财务报表,包括2021年12月31日的资产负债表,2021年1月19日(基金合同生效日)至2021年12月31日止期间的利润表和所有者权益(基金净值)变动表以及财务报表附注。(二) 我们的意见 我们认为,后附的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则和在财务报表附注中所列示的中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制,公允反映了中庚价值品质一年持有期混合基金2021年12月31日的财务状况以及2021年1月19日(基金合同生效日)至2021年12月31日止期间的经营成果和基金净值变动情况。
形成审计意见的基础	我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。审计报告的“注册会计师对财务报

	<p>表审计的责任”部分进一步阐述了我们在这些准则下的责任。我们相信，我们获取的审计证据是充分、适当的，为发表审计意见提供了基础。按照中国注册会计师职业道德守则，我们独立于中庚价值品质一年持有期混合基金，并履行了职业道德方面的其他责任。</p>
强调事项	无
其他事项	无
其他信息	无
管理层和治理层对财务报表的责任	<p>中庚价值品质一年持有期混合基金的基金管理人中庚基金管理有限公司(以下简称“基金管理人”)管理层负责按照企业会计准则和中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制财务报表，使其实现公允反映，并设计、执行和维护必要的内部控制，以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。在编制财务报表时，基金管理人管理层负责评估中庚价值品质一年持有期混合基金的持续经营能力，披露与持续经营相关的事项(如适用)，并运用持续经营假设，除非基金管理人管理层计划清算中庚价值品质一年持有期混合基金、终止运营或别无其他现实的选择。基金管理人治理层负责监督中庚价值品质一年持有期混合基金的财务报告过程。</p>
注册会计师对财务报表审计的责任	<p>我们的目标是对财务报表整体是否不存在由于舞弊或错误导致的重大错报获取合理保证，并出具包含审计意见的审计报告。合理保证是高水平的保证，但并不能保证按照审计准则执行的审计在某一重大错报存在时总能发现。错报可能由于舞弊或错误导致，如果合理预期错报单独或汇总起来可能影响财务报表使用者依据财务报表作出的经济决策，则通常认为错报是重大的。在按照审计准则执行审计工作的过程中，我们运用职业判断，并保持职业怀疑。同时，我们也执行</p>

	<p>以下工作：（一）识别和评估由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险；设计和实施审计程序以应对这些风险，并获取充分、适当的审计证据，作为发表审计意见的基础。由于舞弊可能涉及串通、伪造、故意遗漏、虚假陈述或凌驾于内部控制之上，未能发现由于舞弊导致的重大错报的风险高于未能发现由于错误导致的重大错报的风险。（二）了解与审计相关的内部控制，以设计恰当的审计程序，但目的并非对内部控制的有效性发表意见。（三）评价基金管理人管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计及相关披露的合理性。（四）对基金管理人管理层使用持续经营假设的恰当性得出结论。同时，根据获取的审计证据，就可能导致对中庚价值品质一年持有期混合基金持续经营能力产生重大疑虑的事项或情况是否存在重大不确定性得出结论。如果我们得出结论认为存在重大不确定性，审计准则要求我们在审计报告中提请报表使用者注意财务报表中的相关披露；如果披露不充分，我们应当发表非无保留意见。我们的结论基于截至审计报告日可获得的信息。然而，未来的事项或情况可能导致中庚价值品质一年持有期混合基金不能持续经营。（五）评价财务报表的总体列报（包括披露）、结构和内容，并评价财务报表是否公允反映相关交易和事项。我们与基金管理人治理层就计划的审计范围、时间安排和重大审计发现等事项进行沟通，包括沟通我们在审计中识别出的值得关注的内部控制缺陷。</p>
会计师事务所的名称	普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）
注册会计师的姓名	薛竞、陈轶杰
会计师事务所的地址	中国上海市黄浦区湖滨路202号普华永道中心11楼
审计报告日期	2022-03-09

## § 7 年度财务报表

## 7.1 资产负债表

会计主体：中庚价值品质一年持有期混合型证券投资基金

报告截止日：2021年12月31日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2021年12月31日
<b>资产：</b>		
银行存款	7.4.7.1	61,395,102.62
结算备付金		-
存出保证金		-
交易性金融资产	7.4.7.2	6,144,105,342.71
其中：股票投资		5,840,982,022.71
基金投资		-
债券投资		303,123,320.00
资产支持证券投资		-
贵金属投资		-
衍生金融资产	7.4.7.3	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	98,800,988.00
应收证券清算款		-
应收利息	7.4.7.5	6,057,778.61
应收股利		-
应收申购款		-
递延所得税资产		-
其他资产	7.4.7.6	-
资产总计		6,310,359,211.94
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2021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	7.4.7.3	-
卖出回购金融资产款		-
应付证券清算款		-
应付赎回款		-
应付管理人报酬		7,955,976.51
应付托管费		1,325,996.07
应付销售服务费		-
应付交易费用	7.4.7.7	-
应交税费		26.82
应付利息		-
应付利润		-
递延所得税负债		-
其他负债	7.4.7.8	240,000.00
负债合计		9,521,999.40
<b>所有者权益：</b>		
实收基金	7.4.7.9	4,598,348,716.47
未分配利润	7.4.7.10	1,702,488,496.07
所有者权益合计		6,300,837,212.54
负债和所有者权益总计		6,310,359,211.94

注：1. 报告截止日2021年12月31日，基金份额净值1.3702元，基金份额总额4,598,348,716.47份。

2. 本基金合同生效日为2021年01月19日，本期财务报表的实际编制期间为2021年01月19日至2021年12月31日。截至报告期末本基金合同生效未满一年，本报告期的财务报表及报表附注均无同期对比数据。

3. 银行存款中包含存放在证券经纪商基金专用证券账户的证券交易结算资金。

## 7.2 利润表

会计主体：中庚价值品质一年持有期混合型证券投资基金

本报告期：2021年01月19日（基金合同生效日）至2021年12月31日

单位：人民币元

项目	附注号	本期
----	-----	----

		2021年01月19日（基金合同生效日）至2021年12月31日
<b>一、收入</b>		987,850,556.64
1. 利息收入		7,517,706.32
其中：存款利息收入	7.4.7.11	808,863.13
债券利息收入		4,468,725.50
资产支持证券利息收入		-
买入返售金融资产收入		2,240,117.69
证券出借利息收入		-
其他利息收入		-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		992,454,891.44
其中：股票投资收益	7.4.7.12	871,156,852.14
基金投资收益		-
债券投资收益	7.4.7.13	15,501,826.35
资产支持证券投资收益	7.4.7.13.3	-
贵金属投资收益		-
衍生工具收益	7.4.7.14	-
股利收益	7.4.7.15	105,796,212.95
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.16	-12,122,041.12
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.17	-
<b>减：二、费用</b>		92,870,445.64
1. 管理人报酬	7.4.10.2.1	59,999,137.50
2. 托管费	7.4.10.2.2	9,999,856.25
3. 销售服务费		-
4. 交易费用	7.4.7.18	22,621,807.51
5. 利息支出		-
其中：卖出回购金融资产支出		-
6. 税金及附加		644.38

7. 其他费用	7. 4. 7. 19	249,000.00
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		894,980,111.00
减：所得税费用		-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		894,980,111.00

### 7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：中庚价值品质一年持有期混合型证券投资基金

本报告期：2021年01月19日（基金合同生效日）至2021年12月31日

单位：人民币元

项 目	本期 2021年01月19日（基金合同生效日）至2021年12月31日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	2,795,108,650.56	-	2,795,108,650.56
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	894,980,111.00	894,980,111.00
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	1,803,240,065.91	807,508,385.07	2,610,748,450.98
其中：1. 基金申购款	1,803,240,065.91	807,508,385.07	2,610,748,450.98
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）	4, 598, 348, 716. 47	1, 702, 488, 496. 07	6, 300, 837, 212. 54
-----------------	----------------------	----------------------	----------------------

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告7.1至7.4财务报表由下列负责人签署：

孟辉

孟辉

欧晔

基金管理人负责人

主管会计工作负责人

会计机构负责人

## 7.4 报表附注

### 7.4.1 基金基本情况

中庚价值品质一年持有期混合型证券投资基金(以下简称“本基金”)经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2020]3648号《关于准予中庚价值品质一年持有期混合型证券投资基金注册的批复》核准,由中庚基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《中庚价值品质一年持有期混合型证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式,存续期限不定,首次设立募集不包括认购资金利息共募集2,794,716,661.46元,业经普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)普华永道中天验字(2021)第0069号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《中庚价值品质一年持有期混合型证券投资基金基金合同》于2021年1月19日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为2,795,108,650.56份基金份额,其中认购资金利息折合391,989.10份基金份额。本基金的基金管理人为中庚基金管理有限公司,基金托管人为平安银行股份有限公司。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《中庚价值品质一年持有期混合型证券投资基金基金合同》的有关规定,本基金的投资范围包括国内依法发行或上市的股票(包括主板、中小板、创业板及其他经中国证监会核准或注册上市的股票)、存托凭证、港股通标的股票、债券(包括国债、央行票据、金融债券、企业债券、公司债券、中期票据、短期融资券、超短期融资券、次级债券、政府支持机构债券、政府支持债券、地方政府债券、可转换债券)、资产支持证券、债券回购、银行存款(包括协议存款、定期存款及其他银行存款)、同业存单、货币市场工具、股指期货、股票期权以及经中国证监会允许基金投资的其他金融工具,但需符合中国证监会的相关规定。本基金股票、存托凭证投资占基金资产的比例范围为60%-95%(其中投资于港股通标的股票的比例占股票资产的0%-50%)。本基金每个交易日日终在扣除股指期货及股票期权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%的现金或者到期日在一年以内的政府债券,其中,现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。本基金的业绩比较基



准为：中证800指数收益率×50%+中证港股通综合指数（人民币）收益率×25%+中证全债指数收益率×25%。

本财务报表由本基金的基金管理人中庚基金管理有限公司于审计报告日批准报出。

#### 7.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于2006年2月15日及以后期间颁布的《企业会计准则—基本准则》、各项具体会计准则及相关规定(以下合称“企业会计准则”)、中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露XBRL模板第3号<年度报告和中期报告>》、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《中庚价值品质一年持有期混合型证券投资基金基金合同》和在财务报表附注7.4.4所列示的中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

本财务报表以持续经营为基础编制。

#### 7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金本报告期末的财务状况以及本报告期间的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

#### 7.4.4 重要会计政策和会计估计

##### 7.4.4.1 会计年度

本基金会计年度为公历1月1日起至12月31日止。本期财务报表的实际编制期间为2021年1月19日（基金合同生效日）至2021年12月31日。

##### 7.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

##### 7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

###### (1) 金融资产的分类

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

本基金目前以交易目的持有的股票投资、债券投资、资产支持证券投资和衍生工具分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。除衍生工具所产生的金融资

产在资产负债表中以衍生金融资产列示外，以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在资产负债表中以交易性金融资产列示。

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

#### (2) 金融负债的分类

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

#### 7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

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

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

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

金融资产终止确认时，其账面价值与收到的对价的差额，计入当期损益。

当金融负债的现时义务全部或部分已经解除时，终止确认该金融负债或义务已解除的部分。终止确认部分的账面价值与支付的对价之间的差额，计入当期损益。

#### 7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

本基金持有的股票投资、债券投资、资产支持证券投资和衍生工具按如下原则确定公允价值并进行估值：

(1)存在活跃市场的金融工具按其估值日的市场交易价格确定公允价值；估值日无交易且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，按最近交易日的市场交易价格确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的市场交易价格不能真实反映公允价值的，应对市场交易价格进行调整，确定公允价值。与上述投资品种相同，但具有不同特征的，应以相同资产或负债的公允价值为基础，并在估值技术中考虑不同特征

因素的影响。特征是指对资产出售或使用的限制等，如果该限制是针对资产持有者的，那么在估值技术中不应将该限制作为特征考虑。此外，基金管理人不应考虑因大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价。

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

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

#### 7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

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

#### 7.4.4.7 实收基金

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

#### 7.4.4.8 损益平准金

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

#### 7.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

股票投资在持有期间应取得的现金股利扣除由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额确认为投资收益。债券投资在持有期间应取得的按票面利率或者发行价计算的利息扣除在适用情况下由债券发行企业代扣代缴的个人所得税及由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为利息收入。资产支持证券在持有期间收到的款项，根据资产支持证券的预计收益率区分属于资产支持证券投资本金部分和投资收益部分，将本金部分冲减

资产支持证券投资成本，并将投资收益部分扣除在适用情况下由基金管理人缴纳的增值稅后的净额确认为利息收入。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在持有期间的公允价值变动确认为公允价值变动损益；于处置时，其处置价格与初始确认金额之间的差额确认为投资收益，其中包括从公允价值变动损益结转的公允价值累计变动额。

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

#### 7.4.4.10 费用的确认和计量

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

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

#### 7.4.4.11 基金的收益分配政策

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

经宣告的拟分配基金收益于分红除权日从所有者权益转出。

#### 7.4.4.12 外币交易

外币交易按交易发生日的即期汇率将外币金额折算为人民币入账。

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

#### 7.4.4.13 分部报告

本基金以内部组织结构、管理要求、内部报告制度为依据确定经营分部，以经营分部为基础确定报告分部并披露分部信息。

经营分部是指本基金内同时满足下列条件的组成部分：(1)该组成部分能够在日常活动中产生收入、发生费用；(2)本基金的基金管理人能够定期评价该组成部分的经营成果，以决定向其配置资源、评价其业绩；(3)本基金能够取得该组成部分的财务状况、

经营成果和现金流量等有关会计信息。如果两个或多个经营分部具有相似的经济特征，并且满足一定条件的，则合并为一个经营分部。

本基金目前以一个单一的经营分部运作，不需要披露分部信息。

#### 7.4.4.14 其他重要的会计政策和会计估计

根据本基金的估值原则和中国证监会允许的基金行业估值实务操作，本基金确定以下类别股票投资和债券投资的公允价值时采用的估值方法及其关键假设如下：

(1) 对于证券交易所上市的股票和债券，若出现重大事项停牌或交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)等情况，本基金根据中国证监会公告[2017]13号《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》，根据具体情况采用《关于发布中基协(AMAC)基金行业股票估值指数的通知》提供的指数收益法、市盈率法、现金流量折现法等估值技术进行估值。

(2) 对于在锁定期内的非公开发行股票、首次公开发行股票时公司股东公开发售股份、通过大宗交易取得的带限售期的股票等流通受限股票，根据中国基金业协会中基协发[2017]6号《关于发布〈证券投资基金投资流通受限股票估值指引(试行)〉的通知》之附件《证券投资基金投资流通受限股票估值指引(试行)》(以下简称“指引”)，按估值日在证券交易所上市交易的同一股票的公允价值扣除中证指数有限公司根据指引所独立提供的该流通受限股票剩余限售期对应的流动性折扣后的价值进行估值。

(3) 对于在证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券、可交换债券和私募债券除外)及在银行间同业市场交易的固定收益品种，根据中国证监会公告[2017]13号《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》及《中国证券投资基金业协会估值核算工作小组关于2015年1季度固定收益品种的估值处理标准》采用估值技术确定公允价值。本基金持有的证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券、可交换债券和私募债券除外)，按照中证指数有限公司所独立提供的估值结果确定公允价值。本基金持有的银行间同业市场固定收益品种按照中债金融估值中心有限公司所独立提供的估值结果确定公允价值。

#### 7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

##### 7.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期未发生会计政策变更。

##### 7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

##### 7.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

#### 7.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2008]1号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[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]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[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[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。

对基金通过沪港通/深港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。基金通过沪港通/深港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。基金通过沪港通/深港通买卖、继承、赠与与联交所上市股票，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。

#### 7.4.7 重要财务报表项目的说明

##### 7.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末	
	2021年12月31日	
活期存款	37,058,436.49	
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	24,336,666.13	
合计	61,395,102.62	

注：其他存款本期末余额为存放在证券经纪商基金专用证券账户的证券交易结算资金。

##### 7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末			
	2021年12月31日			
	成本	公允价值	公允价值变动	
股票	5,855,185,856.56	5,840,982,022.71	-14,203,833.85	
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	
债券	交易所市场	301,041,527.27	303,123,320.00	2,081,792.73
	银行间市场	-	-	-
	合计	301,041,527.27	303,123,320.00	2,081,792.73
资产支持证券	-	-	-	

基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	6,156,227,383.83	6,144,105,342.71	-12,122,041.12

#### 7.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末未持有衍生金融资产/负债。

#### 7.4.7.4 买入返售金融资产

##### 7.4.7.4.1 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12月31日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	98,800,988.00	-
银行间市场	-	-
合计	98,800,988.00	-

##### 7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末未持有买断式逆回购交易中取得的债券。

#### 7.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2021年12月31日
应收活期存款利息	15,214.89
应收定期存款利息	-
应收其他存款利息	9,462.63
应收结算备付金利息	-
应收债券利息	6,033,101.09
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	-
合计	6,057,778.61

注：应收其他存款利息本期末余额为存放在证券经纪商基金专用证券账户的证券交易结算资金所产生的应收利息。

#### 7.4.7.6 其他资产

本基金本报告期末未持有其他资产。

#### 7.4.7.7 应付交易费用

本基金本报告期末无应付交易费用。

#### 7.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2021年12月31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	-
应付审计费	120,000.00
应付信息披露费	120,000.00
合计	240,000.00

#### 7.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2021年01月19日（基金合同生效日）至2021年12月31日	
	基金份额（份）	账面金额
基金合同生效日	2,795,108,650.56	2,795,108,650.56
本期申购	1,803,240,065.91	1,803,240,065.91

本期赎回（以“-”号填列）	-	-
本期末	4,598,348,716.47	4,598,348,716.47

注：1. 总申购份额含红利再投、转换入份额，总赎回份额含转换出份额。

2. 本基金自2021年1月11日至2021年1月15日止期间公开发售，共募集有效净认购资金人民币2,794,716,661.46元。根据《中庚价值品质一年持有期混合型证券投资基金招募说明书》的规定，本基金设立募集期内认购资金产生的利息收入人民币391,989.10元在本基金成立后，折算为391,989.10份基金份额，划入基金份额持有人账户。

3. 根据《中庚价值品质一年持有期混合型证券投资基金招募说明书》及《中庚价值品质一年持有期混合型证券投资基金开放日常申购、赎回、定期定额投资业务的公告》的相关规定，本基金于2021年1月19日（基金合同生效日）至2021年4月15日止期间暂不向投资人开放基金交易。申购业务自2021年4月16日起开始办理，赎回业务自2022年1月19日起开始办理。

#### 7.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
基金合同生效日	-	-	-
本期利润	907,102,152.12	-12,122,041.12	894,980,111.00
本期基金份额交易产生的变动数	456,992,302.87	350,516,082.20	807,508,385.07
其中：基金申购款	456,992,302.87	350,516,082.20	807,508,385.07
基金赎回款	-	-	-
本期已分配利润	-	-	-
本期末	1,364,094,454.99	338,394,041.08	1,702,488,496.07

#### 7.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2021年01月19日（基金合同生效日）至2021年12月31日
活期存款利息收入	363,949.42
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	444,913.71

结算备付金利息收入	-
其他	-
合计	808,863.13

注：其他存款利息收入为存放在证券经纪商基金专用证券账户的证券交易结算资金产生的利息收入。

#### 7.4.7.12 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2021年01月19日（基金合同生效日）至2021年12月31日
卖出股票成交总额	5,042,253,762.82
减：卖出股票成本总额	4,171,096,910.68
买卖股票差价收入	871,156,852.14

#### 7.4.7.13 债券投资收益

##### 7.4.7.13.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2021年01月19日（基金合同生效日）至2021年12月31日
债券投资收益——买卖债券（、债转股及债券到期兑付）差价收入	15,501,826.35
债券投资收益——赎回差价收入	-
债券投资收益——申购差价收入	-
合计	15,501,826.35

##### 7.4.7.13.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期
----	----

	2021年01月19日（基金合同生效日）至2021年12月31日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	491,830,780.53
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	469,766,313.35
减：应收利息总额	6,562,640.83
买卖债券差价收入	15,501,826.35

#### 7.4.7.13.3 资产支持证券投资收益

本基金本报告期无资产支持证券投资收益。

#### 7.4.7.14 衍生工具收益

##### 7.4.7.14.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

本基金本报告期无买卖权证差价收入。

##### 7.4.7.14.2 衍生工具收益——其他投资收益

本基金本报告期无股指期货投资收益等其他投资收益。

#### 7.4.7.15 股利收益

单位：人民币元

项目	本期
	2021年01月19日（基金合同生效日）至2021年12月31日
股票投资产生的股利收益	105,796,212.95
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	105,796,212.95

#### 7.4.7.16 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期
------	----

	2021年01月19日（基金合同生效日）至2021年12月31日
1. 交易性金融资产	-12,122,041.12
——股票投资	-14,203,833.85
——债券投资	2,081,792.73
——资产支持证券投资	-
——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	-12,122,041.12

#### 7.4.7.17 其他收入

本基金本报告期内无其他收入。

#### 7.4.7.18 交易费用

单位：人民币元

项目	本期
	2021年01月19日（基金合同生效日）至2021年12月31日
交易所市场交易费用	22,621,807.51
银行间市场交易费用	-
合计	22,621,807.51

#### 7.4.7.19 其他费用

单位：人民币元

项目	本期
	2021年01月19日（基金合同生效日）至2021年12月31日

审计费用	120,000.00
信息披露费	120,000.00
证券出借违约金	-
中债登账户维护费	9,000.00
合计	249,000.00

#### 7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

##### 7.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金无需作披露的或有事项。

##### 7.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表批准报出日，本基金无需披露的资产负债表日后事项。

#### 7.4.9 关联方关系

关联方名称	与本基金的关系
中庚基金管理有限公司(“中庚基金”)	基金管理人、基金销售机构、基金注册登记机构
平安银行股份有限公司(“平安银行”)	基金托管人、基金销售机构
平安证券股份有限公司(“平安证券”)	基金托管人重大关联机构、基金销售机构、基金证券经纪商
孟辉	基金管理人的股东
中庚置业集团有限公司	基金管理人的股东
大连汇盛投资有限公司	基金管理人的股东
闫忻	基金管理人的股东
大连海博教育发展有限公司	基金管理人的股东
福建海龙威投资发展有限公司	基金管理人的股东
福建瑞闽投资有限公司	基金管理人的股东

注：下述关联方交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

#### 7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

##### 7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

###### 7.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2021年01月19日（基金合同生效日）至2021年12月31日	
	成交金额	占当期股票成交总额的比例
平安证券股份有限公司（“平安证券”）	11,423,076,172.88	76.26%

## 7.4.10.1.2 权证交易

本基金本报告期内未通过关联方交易单元进行权证交易。

## 7.4.10.1.3 债券交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2021年01月19日（基金合同生效日）至2021年12月31日	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例
平安证券	889,430,079.60	86.41%

## 7.4.10.1.4 债券回购交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2021年01月19日（基金合同生效日）至2021年12月31日	
	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例
平安证券	12,911,900,000.00	91.92%

## 7.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2021年01月19日（基金合同生效日）至2021年12月31日			
	当期佣金	占当期佣金总	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总

		量的比 例		额的比例
平安证券	8,363,087.90	76.27%	-	-

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，以扣除证券公司需承担的费用后的净额列示。

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。

#### 7.4.10.2 关联方报酬

##### 7.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2021年01月19日（基金合同生效日）至2021年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	59,999,137.50
其中：支付销售机构的客户维护费	28,305,080.93

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

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

H为每日应计提的基金管理费

E为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金管理人于次月前5个工作日内向基金托管人发送基金管理费划款指令，基金托管人复核后从基金财产中一次性支付给基金管理人。若遇法定节假日、公休日等，支付日期顺延。

##### 7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2021年01月19日（基金合同生效日）至2021年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	9,999,856.25

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

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



H为每日应计提的基金托管费

E为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金管理人于次月前5个工作日内向基金托管人发送基金托管费划款指令，基金托管人复核后从基金财产中一次性支取。若遇法定节假日、公休日等，支付日期顺延。

#### 7.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金本报告期未发生与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。

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

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

本基金本报告期未发生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。

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

本基金本报告期未发生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。

#### 7.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

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

份额单位：份

项目	本期 2021年01月19日（基金合同生效日）至2021年12月31日
基金合同生效日（2021年01月19日）持有的基金份额	10,001,333.33
报告期初持有的基金份额	10,001,333.33
报告期间申购/买入总份额	0.00
报告期间因拆分变动份额	0.00
减：报告期间赎回/卖出总份额	0.00
报告期末持有的基金份额	10,001,333.33
报告期末持有的基金份额占基金总份额比	0.22%

例	
---	--

- 注：1. 如果本报告期间发生转换入、红利再投业务，则总申购份额中包含该业务；  
2. 如果本报告期间发生转换出业务，则总赎回份额中包含该业务；  
3. 上述认购交易为2021年1月11日通过直销柜台申请，按照申请金额匹配费率，对应的认购费率为每笔1000元。

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

份额单位：份

关联方名称	本期末 2021年12月31日	
	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例
孟辉	988,375.62	0.02%

注：上述关联方投资本基金适用的认购、申购、赎回费率按照本基金招募说明书的费率执行。

#### 7.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2021年01月19日（基金合同生效日）至2021年12月31日	
	期末余额	当期利息收入
平安银行-托管户	37,058,436.49	363,949.42
平安证券-证券资金户	3,022,835.54	293,227.35

注：1. 本基金托管户的银行存款由基金托管人平安银行股份有限公司存放在平安银行上海分行，按银行同业活期存款协议约定利率计息。

2. 本基金证券资金户的存款为本基金存放于平安证券股份有限公司基金专用证券账户中的证券交易结算资金，按协议约定利率计息。

#### 7.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

金额单位：人民币元

本期
----

2021年01月19日（基金合同生效日）至2021年12月31日					
关联方名称	证券代码	证券名称	发行方式	基金在承销期内买入	
				数量（单位：张/股）	总金额
平安证券	605011	杭州热电	公开发行	525	3,239.25
平安证券	605162	新中港	公开发行	1,377	8,358.39
平安证券	301039	中集车辆	公开发行	20,640	143,654.40

#### 7.4.10.8 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期无须作说明的其他关联交易事项。

#### 7.4.11 利润分配情况—按摊余成本法核算的货币市场基金之外的基金

本基金本报告期未进行利润分配。

#### 7.4.12 期末（2021年12月31日）本基金持有的流通受限证券

##### 7.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

7.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量（单位：股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
600941	中国移动	2021-12-24	2022-07-05	新股锁定	57.58	57.58	87,363	5,030.36 1.54	5,030.36 1.54	-
600941	中国移动	2021-12-24	2022-01-05	新股未上市	57.58	57.58	37,440	2,155.79 5.20	2,155.79 5.20	-
601728	中国电信	2021-08-11	2022-02-21	新股锁定	4.53	4.27	394,011	1,784.86 9.83	1,682.42 6.97	-
688082	盛美上海	2021-11-10	2022-05-18	科创板打新限	85.00	114.28	9,337	793,645.00	1,067,032.36	-

				售						
688728	格科微	2021-08-11	2022-02-18	科创板打新限售	14.38	29.31	23,033	331,214.54	675,097.23	-
688778	厦钨新能	2021-07-29	2022-02-07	科创板打新限售	24.50	100.74	5,075	124,337.50	511,255.50	-
688162	巨一科技	2021-11-03	2022-05-10	科创板打新限售	46.00	82.55	5,671	260,866.00	468,141.05	-
688230	芯导科技	2021-11-24	2022-06-01	科创板打新限售	134.81	130.31	2,594	349,697.14	338,024.14	-
688262	国芯科技	2021-12-28	2022-07-06	科创板打新限售	41.98	41.98	7,129	299,275.42	299,275.42	-
688670	金迪克	2021-07-23	2022-02-07	科创板打新限售	55.18	74.11	2,310	127,465.80	171,194.10	-
688296	和达科技	2021-07-19	2022-01-27	科创板打新限售	12.46	49.67	2,173	27,075.58	107,932.91	-
301136	招标股份	2021-12-31	2022-07-11	创业板打新限售	10.52	10.52	7,172	75,449.44	75,449.44	-
3010	可孚	2021	2022	创业	93.0	75.3	848	78,9	63,8	-

87	医疗	-10-15	-04-25	板打 新限售	9	4		40.3 2	88.3 2	
3010 50	雷电 微力	2021 -08- 17	2022 -02- 24	创业 板打 新限售	60.6 4	234. 74	233	14,1 29.1 2	54,6 94.4 2	-
3010 35	润丰 股份	2021 -07- 21	2022 -01- 28	创业 板打 新限售	22.0 4	56.2 8	644	14,1 93.7 6	36,2 44.3 2	-
3010 90	华润 材料	2021 -10- 19	2022 -04- 26	创业 板打 新限售	10.4 5	11.2 2	2,764	28,8 83.8 0	31,0 12.0 8	-
3010 39	中集 车辆	2021 -07- 01	2022 -01- 10	创业 板打 新限售	6.96	12.5 1	2,064	14,3 65.4 4	25,8 20.6 4	-
3010 58	中粮 工科	2021 -09- 01	2022 -03- 09	创业 板打 新限售	3.55	18.2 4	1,386	4,92 0.30	25,2 80.6 4	-
3010 99	雅创 电子	2021 -11- 10	2022 -05- 23	创业 板打 新限售	21.9 9	71.3 6	351	7,71 8.49	25,0 47.3 6	-
3012 21	光庭 信息	2021 -12- 15	2022 -06- 22	创业 板打 新限售	69.8 9	88.7 2	280	19,5 69.2 0	24,8 41.6 0	-
3011 89	奥尼 电子	2021 -12- 21	2022 -06- 28	创业 板打 新限售	66.1 8	56.6 2	435	28,7 88.3 0	24,6 29.7 0	-

				售						
301166	优宁维	2021-12-21	2022-06-28	创业板打新限售	86.06	94.50	253	21,773.18	23,908.50	-
301069	凯盛新材	2021-09-16	2022-03-28	创业板打新限售	5.17	44.21	539	2,786.63	23,829.19	-
301096	百诚医药	2021-12-13	2022-06-20	创业板打新限售	79.60	78.53	272	21,651.20	21,360.16	-
301093	华兰股份	2021-10-21	2022-05-05	创业板打新限售	58.08	49.85	409	23,754.72	20,388.65	-
301082	久盛电气	2021-10-14	2022-04-27	创业板打新限售	15.48	21.53	915	14,164.20	19,699.95	-
300994	久祺股份	2021-08-02	2022-02-14	创业板打新限售	11.90	45.45	420	4,998.00	19,089.00	-
301060	兰卫医学	2021-09-06	2022-03-14	创业板打新限售	4.17	30.94	587	2,447.79	18,161.78	-
301088	戎美股份	2021-10-19	2022-04-28	创业板打新限售	33.16	24.67	704	23,344.64	17,367.68	-
3011	通灵	2021	2022	创业	39.0	52.1	329	12,8	17,1	-

68	股份	-12-02	-06-10	板打 新限售	8	3		57.3 2	50.7 7	
3010 91	深城 交	2021 -10- 20	2022 -04- 29	创业 板打 新限售	36.5 0	31.3 1	524	19,1 26.0 0	16,4 06.4 4	-
3011 79	泽宇 智能	2021 -12- 01	2022 -06- 08	创业 板打 新限售	43.9 9	50.7 7	295	12,9 77.0 5	14,9 77.1 5	-
3010 89	拓新 药业	2021 -10- 20	2022 -04- 27	创业 板打 新限售	19.1 1	67.9 3	220	4,20 4.20	14,9 44.6 0	-
3011 80	万祥 科技	2021 -11- 09	2022 -05- 16	创业 板打 新限售	12.2 0	22.7 2	654	7,97 8.80	14,8 58.8 8	-
3010 46	能辉 科技	2021 -08- 10	2022 -02- 17	创业 板打 新限售	8.34	48.9 9	290	2,41 8.60	14,2 07.1 0	-
3011 11	粤万 年青	2021 -11- 30	2022 -06- 07	创业 板打 新限售	10.4 8	36.6 8	379	3,97 1.92	13,9 01.7 2	-
3011 88	力诺 特玻	2021 -11- 04	2022 -05- 11	创业 板打 新限售	13.0 0	20.4 8	647	8,41 1.00	13,2 50.5 6	-
3011 99	迈赫 股份	2021 -11- 30	2022 -06- 07	创业 板打 新限售	29.2 8	32.0 0	402	11,7 70.5 6	12,8 64.0 0	-

				售						
3010 20	密封 科技	2021 -06- 28	2022 -01- 06	创业 板打 新限 售	10.6 4	30.4 4	421	4,47 9.44	12,8 15.2 4	-
3011 38	华研 精机	2021 -12- 08	2022 -06- 15	创业 板打 新限 售	26.1 7	44.8 6	285	7,45 8.45	12,7 85.1 0	-
3010 26	浩通 科技	2021 -07- 08	2022 -01- 17	创业 板打 新限 售	18.0 3	62.7 3	203	3,66 0.09	12,7 34.1 9	-
3010 21	英诺 激光	2021 -06- 28	2022 -01- 06	创业 板打 新限 售	9.46	41.4 3	290	2,74 3.40	12,0 14.7 0	-
3010 92	争光 股份	2021 -10- 21	2022 -05- 05	创业 板打 新限 售	36.3 1	35.5 2	323	11,7 28.1 3	11,4 72.9 6	-
3010 28	东亚 机械	2021 -07- 12	2022 -01- 20	创业 板打 新限 售	5.31	13.5 0	733	3,89 2.23	9,89 5.50	-
3007 74	倍杰 特	2021 -07- 26	2022 -02- 07	创业 板打 新限 售	4.57	21.0 8	444	2,02 9.08	9,35 9.52	-
3010 40	中环 海陆	2021 -07- 26	2022 -02- 07	创业 板打 新限 售	13.5 7	38.5 1	241	3,27 0.37	9,28 0.91	-
3011	凯旺	2021	2022	创业	27.1	30.5	294	7,97	8,99	-



82	科技	-12-16	-06-23	板打 新限售	2	8		3.28	0.52	
3011 93	家联 科技	2021 -12- 02	2022 -06- 09	创业 板打 新限售	30.7 3	29.1 4	297	9,12 6.81	8,65 4.58	-
3010 52	果麦 文化	2021 -08- 23	2022 -03- 01	创业 板打 新限售	8.11	33.6 4	252	2,04 3.72	8,47 7.28	-
3010 25	读客 文化	2021 -07- 06	2022 -01- 19	创业 板打 新限售	1.55	20.8 8	403	624. 65	8,41 4.64	-
3010 66	万事 利	2021 -09- 13	2022 -03- 22	创业 板打 新限售	5.24	22.8 4	344	1,80 2.56	7,85 6.96	-
3011 98	喜悦 智行	2021 -11- 25	2022 -06- 02	创业 板打 新限售	21.7 6	29.2 0	262	5,70 1.12	7,65 0.40	-
3010 30	仕净 科技	2021 -07- 15	2022 -01- 24	创业 板打 新限售	6.10	31.5 2	242	1,47 6.20	7,62 7.84	-
3010 81	严牌 股份	2021 -10- 13	2022 -04- 20	创业 板打 新限售	12.9 5	17.4 4	403	5,21 8.85	7,02 8.32	-
3010 98	金埔 园林	2021 -11- 04	2022 -05- 12	创业 板打 新限售	12.3 6	22.1 7	307	3,79 4.52	6,80 6.19	-

				售						
301033	迈普医学	2021-07-15	2022-01-26	创业板打新限售	15.14	59.97	108	1,635.12	6,476.76	-
301049	超越科技	2021-08-17	2022-02-24	创业板打新限售	19.34	32.92	196	3,790.64	6,452.32	-
301032	新柴股份	2021-07-15	2022-01-24	创业板打新限售	4.97	12.51	513	2,549.61	6,417.63	-
301056	森赫股份	2021-08-27	2022-03-07	创业板打新限售	3.93	11.09	572	2,247.96	6,343.48	-
301036	双乐股份	2021-07-21	2022-02-07	创业板打新限售	23.38	29.93	205	4,792.90	6,135.65	-
301041	金百泽	2021-08-02	2022-02-11	创业板打新限售	7.31	28.21	215	1,571.65	6,065.15	-
301083	百胜智能	2021-10-13	2022-04-21	创业板打新限售	9.08	14.21	416	3,777.28	5,911.36	-
001234	泰慕士	2021-12-31	2022-01-11	新股未上市	16.53	16.53	333	5,504.49	5,504.49	-
301038	深水规院	2021-07-	2022-02-	创业板打	6.68	20.23	266	1,776.88	5,381.18	-

		22	07	新限售						
3010 27	华蓝 集团	2021 -07- 08	2022 -01- 17	创业 板打 新限 售	11.4 5	16.6 5	286	3,27 4.70	4,76 1.90	-
3010 37	保立 佳	2021 -07- 21	2022 -02- 07	创业 板打 新限 售	14.8 2	24.2 6	193	2,86 0.26	4,68 2.18	-
3010 53	远信 工业	2021 -08- 25	2022 -03- 01	创业 板打 新限 售	11.8 7	28.7 8	155	1,83 9.85	4,46 0.90	-
3010 57	汇隆 新材	2021 -08- 31	2022 -03- 09	创业 板打 新限 售	8.03	19.0 2	218	1,75 0.54	4,14 6.36	-
3010 68	大地 海洋	2021 -09- 16	2022 -03- 28	创业 板打 新限 售	13.9 8	28.3 8	144	2,01 3.12	4,08 6.72	-
3010 79	邵阳 液压	2021 -10- 11	2022 -04- 19	创业 板打 新限 售	11.9 2	24.8 2	140	1,66 8.80	3,47 4.80	-

## 7.4.12.1.2 受限证券类别：债券

证券 代码	证券 名称	成功 认购 日	可流 通日	流通 受限 类型	认购 价格	期末 估值 单价	数量 (单 位：张)	期末 成本 总额	期末 估值 总额	备注
1130 52	兴业 转债	2021 -12- 29	2022 -01- 14	新债 未上 市	100. 00	100. 00	49,300	4,93 0,00 0.00	4,93 0,00 0.00	-

注：1. 根据中国证监会《上市公司证券发行管理办法》、《创业板上市公司证券发行管理暂行办法》以及《上市公司非公开发行股票实施细则》，本基金作为特定投资者所认购的非公开发行股票，自发行结束之日起12个月内不得转让。根据《上市公司股东、董监高减持股份的若干规定》及《深圳/上海证券交易所上市公司股东及董事、监事、高级管理人员减持股份实施细则》，本基金持有的上市公司非公开发行股票，采取集中竞价交易方式的，在任意连续90日内，减持股份的总数不得超过公司股份总数的1%，且自股份解除限售之日起12个月内，通过集中竞价交易减持的数量不得超过本基金持有该次非公开发行股票数量的50%；采取大宗交易方式的，在任意连续90日内，减持股份的总数不得超过公司股份总数的2%。本基金通过大宗交易方式受让的原上市公司大股东减持或者特定股东减持的股份，在受让后6个月内，不得转让所受让的股份。

根据中国证监会《关于修改〈上市公司证券发行管理办法〉的决定》、《关于修改〈创业板上市公司证券发行管理暂行办法〉的决定》以及《关于修改〈上市公司非公开发行股票实施细则〉的决定》，本基金所认购的非公开发行股票，自发行结束之日起6个月内不得转让。此外，本基金减持上述非公开发行股票不适用《上市公司股东、董监高减持股份的若干规定》及《深圳/上海证券交易所上市公司股东及董事、监事、高级管理人员减持股份实施细则》的有关规定。

2. 基金还可作为特定投资者，认购首次公开发行股票时公司股东公开发售股份，所认购的股份自发行结束之日起12个月内不得转让。

3. 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。

4. 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。

5. 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。其中基金作为一般法人或战略投资者认购的新股，根据基金与上市公司所签订申购协议的规定，在新股上市后的约定期限内不能自由转让；基金参与网上申购获配的新股，从新股获配日至新股上市日之间不能自由转让。

6、基金持有的股票在流通受限期内，如获得股票红利、送股、转增股、配股的，则此新增股票的流通受限期和估值价格与相应原股票一致。

7. 上述可流通日为根据限售起始日期和限售期计算的理论可流通日期，可能与实际流通日期存在差异。

#### 7.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金本报告期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

#### 7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

##### 7.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

本基金本报告期末无从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购金融资产款余额。

##### 7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

本基金本报告期末无从事交易所市场债券正回购交易形成的卖出回购金融资产款余额。

#### 7.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

本基金本报告期末无参与转融通证券出借业务的证券。

#### 7.4.13 金融工具风险及管理

##### 7.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金为偏股混合型基金，其长期平均风险和预期收益水平低于股票型基金，高于债券型基金、货币市场基金。本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具。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争取将以上风险控制在限定的范围之内，使本基金在风险和收益之间取得最佳的平衡以实现“风险和收益相匹配”的风险收益目标。

本基金的基金管理人奉行全面风险管理体系的建设，在董事会下设立风险控制委员会，负责评价公司整体合规管理和内控风险管理等；在公司层面设立合规与风控委员会，负责管理和控制日常经营风险、基金投资风险和其他业务风险。督察长独立行使督察权利，直接对董事会负责，向风险控制委员会提交独立的风险管理报告和风险管理建议；监察稽核部负责建立和完善公司投资风险管理制度与流程，组织实施公司投资风险管理及绩效分析工作，确保公司各类投资风险得到良好监督与控制。

本基金的基金管理人对于金融工具的风险管理主要是通过定性分析和定量分析的方法去评估各种风险可能产生的损失。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的特征，通过特定的风险量化指标、模型，日常的量化报告，确定相应置信程度和风险损失的限度，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。

#### 7.4.13.2 信用风险

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

本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的活期存款和协议存款全部存放在本基金的托管人平安银行股份有限公司或其他具有基金托管资格的银行，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基金证券经纪商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。

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2021年12月31日，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和资产支持证券占基金资产净值的比例为0.22%。

#### 7.4.13.3 流动性风险

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

针对兑付赎回资金的流动性风险，本基金的基金管理人每日对本基金的申购赎回情况进行严密监控并预测流动性需求，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配。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2021年12月31日，本基金所承担的全部金融负债的合约约定到期日均为一个月以内且不计息，可赎回基金份额净值(所有者权益)无固定到期日且不计息，因此账面余额即为未折现的合约到期现金流量。

##### 7.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人在基金运作过程中严格按照《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》等法规的要求对本基金组合资产的流动性风险进行管理，通过独立的风险管理部门对本基金的组合持仓集中度指标、流通受限制的投资品种比例以及组合在短期内变现能力的综合指标等流动性指标进行持续的监测和分析。

本基金投资于一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的10%，且本基金与由本基金的基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司的证券不得超过该证券的10%。本基金与由本基金的基金管理人管理的其他开放式基金共同持有一家上市公司发

行的可流通股股票不得超过该上市公司可流通股股票的15%，本基金与由本基金的基金管理人管理的全部投资组合持有一家上市公司发行的可流通股股票，不得超过该上市公司可流通股股票的30%(完全按照有关指数构成比例进行证券投资的开放式基金及中国证监会认定的特殊投资组合不受该比例限制)。

本基金所持部分证券在证券交易所上市，部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况参见附注7.4.12。本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过基金资产净值的15%。于2021年12月31日，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为0.29%。

本基金的基金管理人每日对基金组合资产中7个工作日可变现资产的可变现价值进行审慎评估与测算，确保每日确认的净赎回申请不得超过7个工作日可变现资产的可变现价值。于2021年12月31日，本基金组合资产中7个工作日可变现资产的账面价值超过经确认的当日净赎回金额。

#### 7.4.13.4 市场风险

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

##### 7.4.13.4.1 利率风险

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

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

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

##### 7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2021年 12月31 日	1个月以内	1-3个月	3个月-1年	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产							
银行存款	61,395,102.62	-	-	-	-	-	61,395,102.62
交易性金融资产	196,599,312.00	-	106,524,008.00	-	-	5,840,982,022.71	6,144,105,342.71

买入返售金融资产	98,800,988.00	-	-	-	-	-	98,800,988.00
应收利息	-	-	-	-	-	6,057,778.61	6,057,778.61
资产总计	356,795,402.62	0.00	106,524,008.00	0.00	0.00	5,847,039,801.32	6,310,359,211.94
负债							
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	7,955,976.51	7,955,976.51
应付托管费	-	-	-	-	-	1,325,996.07	1,325,996.07
应交税费	-	-	-	-	-	26.82	26.82
其他负债	-	-	-	-	-	240,000.00	240,000.00
负债总计	-	-	-	-	-	9,521,999.40	9,521,999.40
利率敏感度缺口	356,795,402.62	0.00	106,524,008.00	0.00	0.00	5,837,517,801.92	6,300,837,212.54

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。

#### 7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

于2021年12月31日，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4.81%，因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响。

#### 7.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基金持有以非记账本位币人民币计价的资产和负债，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。

##### 7.4.13.4.2.1 外汇风险敞口

单位：人民币元

项目	本期末 2021年12月31日			
	美元折合人民币	港币折合人民币	其他币种折合人民币	合计
以外币计价的资产				



交易性金融资产	-	2,743,771,23 0.98	-	2,743,771,23 0.98
资产合计	-	2,743,771,23 0.98	-	2,743,771,23 0.98
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	-	2,743,771,23 0.98	-	2,743,771,23 0.98

#### 7.4.13.4.2.2 外汇风险的敏感性分析

假设	除汇率以外的其他市场变量保持不变。	
分析	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12月31日
	1. 港币对人民币升值5%	137,188,562.00
	2. 港币对人民币贬值5%	-137,188,562.00

#### 7.4.13.4.3 其他价格风险

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

本基金的基金管理人在构建和管理投资组合的过程中，通过对宏观经济情况及政策的分析，结合证券市场运行情况，做出大类资产配置的决定；通过投资组合的分散化降低其他价格风险，本基金持有一家公司发行的证券，其市值不超过基金资产净值的10%，且本基金管理人管理的全部基金持有一家公司发行的证券，不超过该证券的10%；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。

##### 7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2021年12月31日	
	公允价值	占基金资产净值比例(%)
交易性金融资产—股票投资	5,840,982,022.71	92.70
交易性金融资产—基金投资	-	-
交易性金融资产—债券投资	-	-
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	5,840,982,022.71	92.70

#### 7.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	1、基金的市场价格风险主要源于市场的系统性风险，即与基金的贝塔系数紧密相关； 2、以下分析，除业绩比较基准发生变动，其他影响基金资产公允价值的风险变量保持不变。	
分析	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12月31日
	1. 业绩比较基准上升5%	196,326,574.00
	2. 业绩比较基准下降5%	-196,326,574.00

#### 7.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

(1) 公允价值

(a) 金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属的层次，由对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次决定：

第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

(b) 持续的以公允价值计量的金融工具

(i) 各层次金融工具公允价值

于2021年12月31日，本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产中属于第一层次的余额为5,836,716,333.91元，属于第二层次的余额为301,523,418.09元，属于第三层次的余额为5,865,590.71元。

(ii) 公允价值所属层次间的重大变动

本基金以导致各层次之间转换的事项发生日为确认各层次之间转换的时点。

对于证券交易所上市的股票和债券，若出现重大事项停牌、交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)、或属于非公开发行等情况，本基金不会于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间将相关股票和债券的公允价值列入第一层次；并根据估值调整中采用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度，确定相关股票和债券公允价值应属第二层次还是第三层次。

(iii) 第三层次公允价值余额和本期变动金额

于2021年12月31日，本基金持有公允价值归属于第三层次的金融工具5,865,590.71元。于2021年度，本基金购买第三层次金融工具4,321,888.14元，计入当期损益的利得或损失(公允价值变动损益等项目)的金额为1,543,702.57元，2021年12月31日仍持有的第三层次金融工具计入2021年度损益的未实现利得或损失的变动金额(公允价值变动损益)为1,543,702.57元。

于2021年12月31日，上述第三层次金融工具均为股票投资，公允价值为5,865,590.71元，采用平均价格亚式期权模型进行估值，不可观察输入值为预期波动率，与公允价值之间为负相关关系。

(c) 非持续的以公允价值计量的金融工具

于2021年12月31日，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产。

(d) 不以公允价值计量的金融工具

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括应收款项和其他金融负债，其账面价值与公允价值相差很小。

(2) 根据财政部发布的《企业会计准则第22号—金融工具确认和计量》、《企业会计准则第23号—金融资产转移》、《企业会计准则第24号—套期会计》和《企业会计准则第37号—金融工具列报》(以下合称“新金融工具准则”)相关衔接规定，以及财政部、中国银行保险监督管理委员会于2020年12月30日发布的《关于进一步贯彻落实新金融工具相关会计准则的通知》，公募证券投资基金应当自2022年1月1日起执行新金融工具准则。截至2021年12月31日，本基金已完成了执行新金融工具准则对财务报表潜在影响的

评估。鉴于本基金业务的性质，新金融工具准则预期不会对本基金的财务状况和经营成果产生重大影响。

本基金将自2022年1月1日起追溯执行相关新规定，并采用准则允许的实务简便方法，调整期初所有者权益，2021年的比较数据将不作重述。

(3)除公允价值和执行新金融工具准则外，截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

## § 8 投资组合报告

### 8.1 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	5,840,982,022.71	92.56
	其中：股票	5,840,982,022.71	92.56
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	303,123,320.00	4.80
	其中：债券	303,123,320.00	4.80
	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	98,800,988.00	1.57
	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	61,395,102.62	0.97
8	其他各项资产	6,057,778.61	0.10
9	合计	6,310,359,211.94	100.00

注：1. 银行存款中包含存放在证券经纪商基金专用证券账户的证券交易结算资金。

2. 本基金本报告期末持有的港股通股票公允价值为2,743,771,230.98元，占基金净值比例为43.55%。

### 8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

#### 8.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

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	21,051,660.00	0.33
B	采矿业	428,645,188.10	6.80
C	制造业	1,380,165,882.27	21.90
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	26,429,315.13	0.42
E	建筑业	51,217,954.28	0.81
F	批发和零售业	116,866,674.62	1.85
G	交通运输、仓储和邮政业	78,602,722.80	1.25
H	住宿和餐饮业	8,483,331.00	0.13
I	信息传输、软件和信息技术服务业	32,342,649.84	0.51
J	金融业	661,842,005.89	10.50
K	房地产业	56,558,490.28	0.90
L	租赁和商务服务业	81,771,645.90	1.30
M	科学研究和技术服务业	34,193,526.86	0.54
N	水利、环境和公共设施管理业	118,975,173.39	1.89
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	18,161.78	0.00
R	文化、体育和娱乐业	46,409.59	0.00
S	综合	-	-
	合计	3,097,210,791.73	49.16

### 8.2.2 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（%）
基础材料	369,595,188.82	5.87
非日常生活消费品	7,461,254.08	0.12
能源	1,266,477,934.40	20.1

金融	412,633,896.45	6.55
工业	171,075,646.01	2.72
信息技术	9,451,128.96	0.15
电信服务	119,346,192.11	1.89
公用事业	14,882,633.81	0.24
地产业	372,847,356.34	5.92
合计	2,743,771,230.98	43.55

注：以上分类采用全球行业分类标准（GICS）。

### 8.3 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	H01171	兖州煤业股份	45,222,000	573,089,361.60	9.10
2	H00883	中国海洋石油	64,348,000	422,465,726.14	6.70
3	H00688	中国海外发展	24,703,500	372,847,356.34	5.92
4	601128	常熟银行	50,996,137	337,084,465.57	5.35
5	H01378	中国宏桥	41,865,000	281,703,221.52	4.47
6	H01898	中煤能源	69,944,000	257,337,964.80	4.08
7	H06818	中国光大银行	103,004,000	232,436,354.30	3.69
8	601225	陕西煤业	17,672,225	215,601,145.00	3.42
9	002386	天原股份	12,574,653	160,075,332.69	2.54
10	603639	海利尔	5,494,748	137,973,122.28	2.19
11	600123	兰花科创	14,173,830	132,808,787.10	2.11
12	601677	明泰铝业	3,004,300	132,459,587.00	2.10
13	601601	中国太保	4,831,700	131,035,704.00	2.08
14	603323	苏农银行	25,266,872	123,049,666.64	1.95
15	603368	柳药股份	6,133,737	116,786,352.48	1.85
16	H01024	快手-W	1,935,400	114,010,698.03	1.81
17	H02328	中国财险	21,064,000	109,703,671.17	1.74

18	603809	豪能股份	4,752,720	97,763,450.40	1.55
19	600855	航天长峰	5,493,171	95,471,311.98	1.52
20	600566	济川药业	3,146,332	89,167,048.88	1.42
21	603995	甬金股份	1,529,500	88,496,870.00	1.40
22	H00257	光大环境	16,916,000	86,579,065.22	1.37
23	002111	威海广泰	6,991,686	85,578,236.64	1.36
24	300280	紫天科技	2,466,611	81,768,154.65	1.30
25	603301	振德医疗	1,278,813	65,692,623.81	1.04
26	600323	瀚蓝环境	2,995,923	62,854,464.54	1.00
27	H01330	绿色动力环保	18,793,000	61,614,278.77	0.98
28	603871	嘉友国际	2,667,081	55,475,284.80	0.88
29	002648	卫星化学	1,309,500	52,419,285.00	0.83
30	600970	中材国际	4,480,003	51,206,434.29	0.81
31	600383	金地集团	3,864,324	50,120,282.28	0.80
32	002034	旺能环境	2,814,703	48,609,920.81	0.77
33	H00826	天工国际	11,688,000	45,582,638.98	0.72
34	000059	华锦股份	5,960,558	43,392,862.24	0.69
35	600711	盛屯矿业	4,016,900	43,101,337.00	0.68
36	601658	邮储银行	7,990,200	40,750,020.00	0.65
37	603600	永艺股份	3,162,760	39,060,086.00	0.62
38	300233	金城医药	1,287,731	37,460,094.79	0.59
39	002949	华阳国际	1,859,600	34,030,680.00	0.54
40	H00743	亚洲水泥(中国)	8,030,000	32,695,333.44	0.52
41	601838	成都银行	2,487,700	29,852,400.00	0.47
42	002105	信隆健康	2,892,296	28,894,037.04	0.46
43	000425	徐工机械	4,640,600	27,797,194.00	0.44
44	601388	怡球资源	5,853,500	26,048,075.00	0.41
45	300196	长海股份	1,444,900	25,329,097.00	0.40
46	002745	木林森	1,522,980	23,042,687.40	0.37
47	H00390	中国中铁	6,793,000	22,882,302.02	0.36
48	H03958	东方证券	4,127,600	22,475,673.56	0.36

49	605186	健麾信息	616,900	22,368,794.00	0.36
50	000885	城发环境	2,096,571	22,223,652.60	0.35
51	603351	威尔药业	485,100	19,001,367.00	0.30
52	H01788	国泰君安国际	20,865,000	18,423,961.92	0.29
53	002777	久远银海	652,800	18,049,920.00	0.29
54	H01776	广发证券	1,291,200	15,687,480.88	0.25
55	601699	潞安环能	1,331,900	15,063,789.00	0.24
56	603477	巨星农牧	953,400	14,777,700.00	0.23
57	688128	中国电研	492,521	14,558,920.76	0.23
58	002327	富安娜	1,663,000	14,202,020.00	0.23
59	601101	昊华能源	1,658,100	12,269,940.00	0.19
60	H00371	北控水务集团	4,436,000	10,989,427.01	0.17
61	H06066	中信建投证券	1,550,000	10,809,898.40	0.17
62	002039	黔源电力	475,500	10,023,540.00	0.16
63	002106	莱宝高科	869,000	10,002,190.00	0.16
64	600256	广汇能源	1,498,500	9,800,190.00	0.16
65	H03323	中国建材	1,230,000	9,613,994.88	0.15
66	600461	洪城环境	1,176,500	9,588,475.00	0.15
67	H00639	首钢资源	4,400,000	9,497,241.60	0.15
68	H03969	中国通号	4,056,000	9,451,128.96	0.15
69	300703	创源股份	745,025	8,485,834.75	0.13
70	605108	同庆楼	463,570	8,483,331.00	0.13
71	H02678	天虹纺织	886,000	7,461,254.08	0.12
72	600308	华泰股份	1,181,700	7,314,723.00	0.12
73	600941	中国移动	124,803	7,186,156.74	0.11
74	000826	启迪环境	1,595,980	7,102,111.00	0.11
75	600905	三峡能源	907,763	6,817,300.13	0.11
76	000656	金科股份	1,437,100	6,438,208.00	0.10
77	600975	新五丰	924,000	6,273,960.00	0.10
78	603678	火炬电子	60,018	4,540,361.70	0.07
79	002624	完美世界	201,358	4,089,580.98	0.06



80	H02883	中海油田服务	732,000	4,087,640.26	0.06
81	H02380	中国电力	907,000	3,893,206.80	0.06
82	603113	金能科技	229,600	3,742,480.00	0.06
83	002014	永新股份	428,650	3,677,817.00	0.06
84	H00302	中手游	1,442,000	3,654,835.52	0.06
85	002139	拓邦股份	189,425	3,540,353.25	0.06
86	H06886	HTSC	283,000	3,003,322.78	0.05
87	603890	春秋电子	165,378	2,186,297.16	0.03
88	002943	宇晶股份	33,800	1,891,110.00	0.03
89	601728	中国电信	394,011	1,682,426.97	0.03
90	H00700	腾讯控股	4,500	1,680,658.56	0.03
91	688082	盛美上海	9,337	1,067,032.36	0.02
92	603518	锦泓集团	79,800	963,186.00	0.02
93	002928	华夏航空	71,729	903,785.40	0.01
94	688232	新点软件	18,893	820,900.85	0.01
95	688020	方邦股份	8,563	780,517.45	0.01
96	300119	瑞普生物	30,900	745,308.00	0.01
97	000683	远兴能源	92,800	677,440.00	0.01
98	688728	格科微	23,033	675,097.23	0.01
99	688778	厦钨新能	5,075	511,255.50	0.01
100	688162	巨一科技	5,671	468,141.05	0.01
101	603558	健盛集团	39,600	466,488.00	0.01
102	603588	高能环境	22,360	392,865.20	0.01
103	688230	芯导科技	2,594	338,024.14	0.01
104	688262	国芯科技	7,129	299,275.42	0.00
105	688269	凯立新材	1,941	242,625.00	0.00
106	603277	银都股份	11,700	216,450.00	0.00
107	300994	久祺股份	4,195	198,854.50	0.00
108	688670	金迪克	2,310	171,194.10	0.00
109	688121	卓然股份	3,681	141,534.45	0.00
110	688345	博力威	2,332	138,987.20	0.00

111	688236	春立医疗	4,052	110,984.28	0.00
112	688296	和达科技	2,173	107,932.91	0.00
113	H01398	工商银行	26,000	93,533.44	0.00
114	301136	招标股份	7,172	75,449.44	0.00
115	600927	永安期货	1,859	69,749.68	0.00
116	688109	品茗股份	1,301	66,637.22	0.00
117	301087	可孚医疗	848	63,888.32	0.00
118	301050	雷电微力	233	54,694.42	0.00
119	301035	润丰股份	644	36,244.32	0.00
120	301090	华润材料	2,764	31,012.08	0.00
121	603230	内蒙新华	1,141	29,517.67	0.00
122	301039	中集车辆	2,064	25,820.64	0.00
123	301058	中粮工科	1,386	25,280.64	0.00
124	301099	雅创电子	351	25,047.36	0.00
125	301221	光庭信息	280	24,841.60	0.00
126	301189	C奥尼	435	24,629.70	0.00
127	301166	C优宁维	253	23,908.50	0.00
128	301069	凯盛新材	539	23,829.19	0.00
129	301096	百诚医药	272	21,360.16	0.00
130	301093	华兰股份	409	20,388.65	0.00
131	301082	久盛电气	915	19,699.95	0.00
132	001296	长江材料	310	18,376.80	0.00
133	301060	兰卫医学	587	18,161.78	0.00
134	301088	戎美股份	704	17,367.68	0.00
135	301168	通灵股份	329	17,150.77	0.00
136	301091	深城交	524	16,406.44	0.00
137	301179	泽宇智能	295	14,977.15	0.00
138	301089	拓新药业	220	14,944.60	0.00
139	301180	万祥科技	654	14,858.88	0.00
140	301046	能辉科技	290	14,207.10	0.00
141	301015	百洋医药	462	13,998.60	0.00

142	301111	粤万年青	379	13,901.72	0.00
143	301188	力诺特玻	647	13,250.56	0.00
144	301199	迈赫股份	402	12,864.00	0.00
145	301020	密封科技	421	12,815.24	0.00
146	301138	华研精机	285	12,785.10	0.00
147	301026	浩通科技	203	12,734.19	0.00
148	301013	利和兴	471	12,104.70	0.00
149	301021	英诺激光	290	12,014.70	0.00
150	301092	争光股份	323	11,472.96	0.00
151	301028	东亚机械	733	9,895.50	0.00
152	300774	倍杰特	444	9,359.52	0.00
153	301040	中环海陆	241	9,280.91	0.00
154	301182	凯旺科技	294	8,990.52	0.00
155	301193	家联科技	297	8,654.58	0.00
156	301052	果麦文化	252	8,477.28	0.00
157	301025	读客文化	403	8,414.64	0.00
158	301066	万事利	344	7,856.96	0.00
159	301198	喜悦智行	262	7,650.40	0.00
160	301030	仕净科技	242	7,627.84	0.00
161	301016	雷尔伟	275	7,128.00	0.00
162	301081	严牌股份	403	7,028.32	0.00
163	301098	金埔园林	307	6,806.19	0.00
164	301033	迈普医学	108	6,476.76	0.00
165	301049	超越科技	196	6,452.32	0.00
166	301032	新柴股份	513	6,417.63	0.00
167	301056	森赫股份	572	6,343.48	0.00
168	301036	双乐股份	205	6,135.65	0.00
169	301041	金百泽	215	6,065.15	0.00
170	301083	百胜智能	416	5,911.36	0.00
171	001234	泰慕士	333	5,504.49	0.00
172	301038	深水规院	266	5,381.18	0.00

173	301027	华蓝集团	286	4,761.90	0.00
174	603176	N汇通	1,924	4,713.80	0.00
175	301037	保立佳	193	4,682.18	0.00
176	301053	远信工业	155	4,460.90	0.00
177	301057	汇隆新材	218	4,146.36	0.00
178	301068	大地海洋	144	4,086.72	0.00
179	603836	海程邦达	133	3,491.25	0.00
180	301079	邵阳液压	140	3,474.80	0.00
181	605339	南侨食品	64	2,132.48	0.00
182	301007	德迈仕	3	59.76	0.00

#### 8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

##### 8.4.1 累计买入金额超出期末基金资产净值2%或前20名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期末基金资产净值比例 (%)
1	H01171	兖矿能源	719,899,039.86	11.43
2	601225	陕西煤业	696,382,341.67	11.05
3	H00883	中国海洋石油	544,313,896.46	8.64
4	H00688	中国海外发展	506,294,850.32	8.04
5	H01898	中煤能源	385,239,724.76	6.11
6	H01378	中国宏桥	380,570,041.96	6.04
7	600048	保利发展	372,628,179.07	5.91
8	601128	常熟银行	337,173,009.99	5.35
9	H06818	中国光大银行	289,021,652.54	4.59
10	H00941	中国移动	251,896,032.23	4.00
11	601601	中国太保	214,187,042.39	3.40
12	002386	天原股份	207,463,584.53	3.29
13	H01024	快手-W	182,890,516.03	2.90

14	002111	威海广泰	176,355,381.09	2.80
15	600123	兰花科创	175,406,470.99	2.78
16	000683	远兴能源	171,226,229.40	2.72
17	H01398	工商银行	149,472,041.33	2.37
18	H02328	中国财险	149,270,539.94	2.37
19	603639	海利尔	145,012,251.05	2.30
20	H00189	东岳集团	137,067,104.08	2.18
21	603368	柳药股份	131,857,504.19	2.09

注：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。

#### 8.4.2 累计卖出金额超出期末基金资产净值2%或前20名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期末基金资产净值比例 (%)
1	600048	保利发展	426,434,396.72	6.77
2	000683	远兴能源	363,544,367.46	5.77
3	601225	陕西煤业	359,874,319.56	5.71
4	H01171	兖矿能源	326,436,418.15	5.18
5	300671	富满微	284,482,060.42	4.51
6	H00189	东岳集团	249,791,960.27	3.96
7	H00941	中国移动	247,476,309.70	3.93
8	600328	中盐化工	161,726,288.12	2.57
9	603979	金诚信	156,755,998.40	2.49
10	H01398	工商银行	151,293,884.08	2.40
11	H00688	中国海外发展	136,056,771.30	2.16
12	002139	拓邦股份	124,983,054.63	1.98
13	600256	广汇能源	119,418,920.48	1.90
14	002386	天原股份	110,705,855.00	1.76
15	002111	威海广泰	103,097,728.76	1.64
16	601601	中国太保	94,579,392.12	1.50

17	H00883	中国海洋 石油	92,355,465.88	1.47
18	000671	阳光城	76,834,204.27	1.22
19	300382	斯莱克	76,541,363.34	1.21
20	600096	云天化	74,007,658.96	1.17

注：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。

#### 8.4.3 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	10,026,282,767.24
卖出股票收入（成交）总额	5,042,253,762.82

注：买入股票成本、卖出股票收入均按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

#### 8.5 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	289,027,032.00	4.59
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)	14,096,288.00	0.22
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	303,123,320.00	4.81

#### 8.6 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	019649	21国债01	1,965,600	196,599,312.00	3.12
2	019654	21国债06	924,000	92,427,720.00	1.47
3	113636	甬金转债	65,600	9,166,288.00	0.15
4	113052	兴业转债	49,300	4,930,000.00	0.08

注：本基金本报告期末仅持有上述债券。

#### 8.7 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

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

#### 8.8 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

本基金本报告期末未持有贵金属。

#### 8.9 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

本基金本报告期末未持有权证。

#### 8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

##### 8.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有股指期货。

##### 8.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金在进行股指期货投资时，将根据风险管理原则，以套期保值为主要目的。通过对证券市场和期货市场运行趋势的研究，结合股指期货的定价模型寻求其合理的估值水平，采用流动性好、交易活跃的合约品种，与现货资产进行匹配，通过多头或空头套期保值等策略进行套期保值操作，以达到降低投资组合整体风险的目的。

本基金还将充分考虑股指期货的收益性、流动性及风险性特征，运用股指期货对冲市场系统性风险、大额申购赎回等特殊情形下的流动性风险。

#### 8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

本基金本报告期末未投资国债期货。

## 8.12 投资组合报告附注

8.12.1 本基金投资的股票常熟银行发行主体江苏常熟农村商业银行股份有限公司在报告编制日前一年内，被中国银保监会处罚共计3次，罚款金额共计人民币95万元。主要违规事实包括：贷后管理严重违反审慎经营规则，以及个人贷款业务管理不到位。

在上述公告公布后，本基金管理人对该公司进行了深入了解和分析，认为上述处罚不会对常熟银行（601128.SH）的投资价值构成实质性的负面影响，因此本基金管理人对该上市公司的投资判断未发生改变。

本基金投资的股票中国光大银行发行主体中国光大银行股份有限公司在报告编制日前一年内，被中国银保监会处罚共计47次，罚款金额共计人民币2566万元。主要违规事实包括：贷前调查不到位导致贷款形成不良，贷款业务严重违反审慎经营规则，以及贷后管理不尽职等。

在上述公告公布后，本基金管理人对该公司进行了深入了解和分析，认为上述处罚不会对中国光大银行（6818.HK）的投资价值构成实质性的负面影响，因此本基金管理人对该上市公司的投资判断未发生改变。

其余八名证券的发行主体本报告期内没有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。

8.12.2 本基金投资的前十名股票没有超出基金合同规定的备选股票库。

### 8.12.3 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	-
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	6,057,778.61
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	6,057,778.61

### 8.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细



本基金本报告期末未持有可转换债券。

### 8.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

### 8.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，分项目之和与合计可能有尾差。

## § 9 基金份额持有人信息

### 9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

持有人 户数 (户)	户均持有的 基金份额	持有人结构			
		机构投资者		个人投资者	
		持有份额	占总份 额比例	持有份额	占总份 额比例
59,281	77,568.68	79,495,265.99	1.73%	4,518,853,450.48	98.27%

### 9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	持有份额总数（份）	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	29,156,089.34	0.63%

### 9.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

项目	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和研 究部门负责人持有本开放式基金	>100
本基金基金经理持有本开放式基金	>100

注：本基金的基金经理为本公司高级管理人员，上述统计数据有重合部分。

## § 10 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日(2021年01月19日)基金份额总额	2,795,108,650.56
基金合同生效日起至报告期期末基金总申购份额	1,803,240,065.91

减：基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回份额	-
基金合同生效日起至报告期期末基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	4,598,348,716.47

注：总申购份额含红利再投、转换入份额，总赎回份额含转换出份额。

## § 11 重大事件揭示

### 11.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内本基金无基金份额持有人大会决议。

### 11.2 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

本报告期内本基金管理人无重大人事变动。

2021年1月26日，根据工作安排，陈正涛先生不再担任平安银行股份有限公司资产托管事业部总裁。2021年2月26日，平安银行股份有限公司任命黄伟先生担任资产托管事业部副总裁（主持工作）。

### 11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内未发生涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。

### 11.4 基金投资策略的改变

本报告期内本基金投资策略未改变。

### 11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金自基金合同生效以来聘请普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)提供审计服务，本报告年度的应付审计费用为120,000.00元。

### 11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内本基金管理人、本基金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。

### 11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

#### 11.7.1 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	交	股票交易	应支付该券商的佣金	备
----	---	------	-----------	---

名称	易单元数量	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	注
长江证券	2	3,555,496,021.78	23.74%	2,601,487.00	23.73%	-
平安证券	2	11,423,076,172.88	76.26%	8,363,087.90	76.27%	-

注：1. 根据《关于新设公募基金管理人证券交易模式转换有关事项的通知》（证监办发[2019]14号）的有关规定，基金产品管理人可选择一家或多家证券公司开展证券交易，并可免于执行《关于完善证券投资基金交易席位制度有关问题的通知》第二条“一家基金管理公司通过一家证券公司的交易席位买卖证券的年交易佣金，不得超过其当年所有基金买卖证券交易佣金的30%”的分仓规定。

2. 本基金管理人选择财务状况良好、经营行为规范、研究实力较强、能满足公募基金采用券商交易模式进行证券交易和结算需要的证券公司作为本基金的证券经纪商。

3. 本基金管理人与选择的证券经纪商、本基金的托管人签订证券经纪服务协议，对账户管理、资金存管、交易执行、交易管理、佣金收取、清算交收、违约责任等作出约定。

4. 报告期内，本基金新增长江证券的专用交易单元进行场内证券交易。

5. 本基金选择的证券经纪商平安证券、长江证券与本公司不存在关联关系。

6. 按照本基金分别与平安证券、长江证券签订的经纪服务协议，本基金通过其提供的交易单元进行股票交易的佣金费率为0.08%，进行债券交易的佣金费率为0.02%，实际支付的佣金已扣除由经纪服务商承担的费用，在进行交易结算时逐笔直接扣除。本基金通过其提供的交易单元进行港股通股票交易的佣金费率为0.07%，在进行交易结算时逐笔直接扣除。

#### 11.7.2 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		基金交易	
	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	成交金额	占当期基金成交总额的比例
长江证券	139,826,629.67	13.59%	1,135,200,000.00	8.08%	-	-	-	-

平安 证券	889,430,0 79.60	86.4 1%	12,911,900, 000.00	91.9 2%	-	-	-	-
----------	--------------------	------------	-----------------------	------------	---	---	---	---

### 11.8 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	中庚基金管理有限公司关于自有资金及拟任基金经理认购旗下基金相关事宜的公告	上海证券报、证券时报、中国证监会基金信息披露规定网站	2021-01-12
2	中庚价值品质一年持有期混合型证券投资基金基金合同生效公告	中国证券报、证券时报、中国证监会基金信息披露规定网站	2021-01-20
3	中庚基金管理有限公司关于增加宜信普泽（北京）基金销售有限公司为旗下开放式证券投资基金销售机构的公告	上海证券报、证券时报、中国证券报、中国证监会基金信息披露规定网站	2021-03-13
4	中庚基金管理有限公司关于旗下开放式基金在直销中心渠道面向养老金客户开展特定申购费率优惠活动的公告	上海证券报、证券时报、中国证券报、中国证监会基金信息披露规定网站	2021-03-25
5	中庚价值品质一年持有期混合型证券投资基金开放日常申购、赎回、定期定额投资业务公告	上海证券报、中国证券报、中国证监会基金信息披露规定网站	2021-04-14
6	关于中庚价值品质一年持有期混合型证券投资基金2021年非港股通交易日暂停申购（含定期定额申购）、赎回等业务的公告	上海证券报、中国证券报、中国证监会基金信息披露规定网站	2021-04-15
7	中庚基金管理有限公司旗下全部基金2021年第一季度报告提示性公告	上海证券报、证券时报、中国证券报	2021-04-15
8	中庚价值品质一年持有期混	中国证监会基金信息披露规	2021-04-15

	合型证券投资基金2021年第1季度报告	定网站	
9	中庚基金管理有限公司关于提醒投资者及时更新已过期身份证件及完善身份信息资料的公告	上海证券报、证券时报、中国证券报、中国证监会基金信息披露规定网站	2021-06-22
10	中庚基金管理有限公司关于增加嘉实财富管理有限公司为旗下开放式证券投资基金销售机构的公告	上海证券报、证券时报、中国证券报、中国证监会基金信息披露规定网站	2021-06-23
11	中庚基金管理有限公司关于旗下证券投资基金关联交易公告	证券时报、中国证券报、中国证监会基金信息披露规定网站	2021-06-23
12	中庚基金管理有限公司关于旗下证券投资基金关联交易公告	证券时报、中国证券报、中国证监会基金信息披露规定网站	2021-06-30
13	中庚基金管理有限公司关于旗下证券投资基金关联交易公告	证券时报、中国证券报、中国证监会基金信息披露规定网站	2021-07-02
14	中庚基金管理有限公司关于增加宁波银行股份有限公司为旗下开放式证券投资基金销售机构的公告	上海证券报、证券时报、中国证券报、中国证监会基金信息披露规定网站	2021-07-09
15	中庚基金管理有限公司旗下全部基金2021年第二季度报告提示性公告	上海证券报、证券时报、中国证券报	2021-07-15
16	中庚价值品质一年持有期混合型证券投资基金2021年第2季度报告	中国证监会基金信息披露规定网站	2021-07-15
17	中庚基金管理有限公司旗下全部基金2021年中期报告提示性公告	上海证券报、证券时报、中国证券报	2021-08-18
18	中庚价值品质一年持有期混	中国证监会基金信息披露规	2021-08-18

	合型证券投资基金2021年中期报告	定网站	
19	关于中庚价值品质一年持有期混合型证券投资基金规模控制的公告	上海证券报、中国证券报、中国证监会基金信息披露规定网站	2021-09-04
20	中庚基金管理有限公司关于旗下基金在宁波银行股份有限公司销售渠道的说明	上海证券报、证券时报、中国证券报、中国证监会基金信息披露规定网站	2021-09-07
21	中庚价值品质一年持有期混合型证券投资基金暂停申购（含定期定额投资）公告	上海证券报、中国证券报、中国证监会基金信息披露规定网站	2021-09-11
22	关于中庚价值品质一年持有期混合型证券投资基金暂停申购（含定期定额投资）的提示性公告	中国证券报、中国证监会基金信息披露规定网站	2021-09-15
23	中庚基金管理有限公司关于增加中信建投证券股份有限公司、国信证券股份有限公司为旗下基金销售机构的公告	上海证券报、证券时报、中国证券报、证券日报、中国证监会基金信息披露规定网站	2021-09-29
24	中庚价值品质一年持有期混合型证券投资基金基金产品资料概要更新	中国证监会基金信息披露规定网站	2021-10-14
25	中庚价值品质一年持有期混合型证券投资基金更新招募说明书（2021年第1号）	中国证监会基金信息披露规定网站	2021-10-14
26	中庚基金管理有限公司旗下全部基金2021年第三季度报告提示性公告	上海证券报、证券时报、中国证券报、证券日报	2021-10-21
27	中庚价值品质一年持有期混合型证券投资基金2021年第三季度报告	中国证监会基金信息披露规定网站	2021-10-21
28	中庚基金管理有限公司关于	上海证券报、证券时报、中	2021-12-01

	提醒投资者及时更新已过期身份证件及完善身份信息资料的公告	国证券报、证券日报、中国证监会基金信息披露规定网站	
29	中庚基金管理有限公司关于开通旗下部分基金转换业务的公告	上海证券报、证券时报、中国证券报、证券日报、中国证监会基金信息披露规定网站	2021-12-17
30	中庚基金管理有限公司关于增加旗下证券投资基金销售机构的公告	上海证券报、证券时报、中国证券报、证券日报、中国证监会基金信息披露规定网站	2021-12-29
31	中庚基金管理有限公司关于旗下部分基金2021年岁末及2022年非港股通交易日暂停申购（含定期定额申购）、赎回、转换等业务的公告	上海证券报、中国证券报、中国证监会基金信息披露规定网站	2021-12-29

## § 12 影响投资者决策的其他重要信息

### 12.1 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

本基金本报告期内未出现单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况。

### 12.2 影响投资者决策的其他重要信息

本基金本报告期内未发生影响投资者决策的其他重要信息。

## § 13 备查文件目录

### 13.1 备查文件目录

1. 中国证监会批准设立中庚价值品质一年持有期混合型证券投资基金的文件
2. 中庚价值品质一年持有期混合型证券投资基金基金合同
3. 中庚价值品质一年持有期混合型证券投资基金招募说明书
4. 中庚价值品质一年持有期混合型证券投资基金托管协议
5. 中庚价值品质一年持有期混合型证券投资基金基金产品资料概要
6. 中庚基金管理有限公司业务资格批复、营业执照和公司章程

7. 报告期内中庚价值品质一年持有期混合型证券投资基金在指定报刊上披露的各项公告

8. 中国证监会要求的其他文件

### 13.2 存放地点

上海市浦东新区陆家嘴环路1318号星展银行大厦703-704

### 13.3 查阅方式

投资者可于本基金管理人办公时间预约查阅。

投资者对本报告书如有疑问，可咨询本基金管理人。

客服电话：021-53549999

公司网址：[www.zgfunds.com.cn](http://www.zgfunds.com.cn)

中庚基金管理有限公司

二〇二二年三月十八日