

# 大成核心双动力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：大成基金管理有限公司

基金托管人：中国工商银行股份有限公司

送出日期：2022 年 3 月 29 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。本年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2022 年 03 月 28 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。

本报告财务资料已经审计。安永华明会计师事务所(特殊普通合伙)为本基金出具了无保留意见的审计报告，请投资者注意阅读。

本报告期自 2021 年 01 月 01 日起至 12 月 31 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 .....	5
2.5 其他相关资料 .....	6
<b>§ 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况</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
3.3 过去三年基金的利润分配情况 .....	8
<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 .....	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 .....	12
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况 .....	13
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明 .....	14
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明 .....	14
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 .....	15
<b>§ 5 托管人报告</b> .....	<b>15</b>
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明 .....	15
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明 .....	15
5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见 .....	15
<b>§ 6 审计报告</b> .....	<b>15</b>
<b>§ 7 年度财务报表</b> .....	<b>17</b>
7.1 资产负债表 .....	17
7.2 利润表 .....	18
7.3 所有者权益（基金净值）变动表 .....	19
7.4 报表附注 .....	21
<b>§ 8 投资组合报告</b> .....	<b>42</b>
8.1 期末基金资产组合情况 .....	42
8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合 .....	43
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 .....	44
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动 .....	50
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合 .....	52

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 .....	52
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 .....	52
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 .....	52
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 .....	52
8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明 .....	52
8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 .....	52
8.12 投资组合报告附注 .....	52
<b>§ 9 基金份额持有人信息 .....</b>	<b>54</b>
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....	54
9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....	54
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 .....	54
9.4 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理本人及其直系亲属持有本人管理的产品情况 .....	54
<b>§ 10 开放式基金份额变动 .....</b>	<b>54</b>
<b>§ 11 重大事件揭示 .....</b>	<b>55</b>
11.1 基金份额持有人大会决议 .....	55
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 .....	55
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....	55
11.4 基金投资策略的改变 .....	55
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....	55
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 .....	55
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	56
11.8 其他重大事件 .....	57
<b>§ 12 影响投资者决策的其他重要信息 .....</b>	<b>58</b>
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 .....	58
12.2 影响投资者决策的其他重要信息 .....	59
<b>§ 13 备查文件目录 .....</b>	<b>59</b>
13.1 备查文件目录 .....	59
13.2 存放地点 .....	59
13.3 查阅方式 .....	59

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	大成核心双动力混合型证券投资基金
基金简称	大成核心双动力混合
基金主代码	090011
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2010 年 6 月 22 日
基金管理人	大成基金管理有限公司
基金托管人	中国工商银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	21,081,096.46 份
基金合同存续期	不定期

### 2.2 基金产品说明

投资目标	以稳健的投资策略为主，采用合理的方法适当提升风险收益水平，力争获取超越业绩比较基准的中长期投资收益
投资策略	本基金采用自上而下的方式实施大类资产间的战略配置，并采用“核心-双卫星”策略管理股票资产。
业绩比较基准	75%×沪深 300 指数+25%×中证综合债券指数
风险收益特征	本基金是主动投资的混合基金，预期风险收益水平低于股票基金，高于债券基金和货币市场基金。

### 2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		大成基金管理有限公司	中国工商银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	赵冰	郭明
	联系电话	0755-83183388	010-66105799
	电子邮箱	office@dcfund.com.cn	custody@icbc.com.cn
客户服务电话		4008885558	95588
传真		0755-83199588	010-66105798
注册地址		深圳市福田区深南大道 7088 号招商银行大厦 32 层	北京市西城区复兴门内大街 55 号
办公地址		深圳市福田区深南大道 7088 号招商银行大厦 32 层	北京市西城区复兴门内大街 55 号
邮政编码		518040	100140
法定代表人		吴庆斌	陈四清

### 2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《证券时报》
登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	www.dcfund.com.cn
基金年度报告备置地点	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
会计师事务所	安永华明会计师事务所(特殊普通合伙)	北京市东城区东长安街1号东方广场安永大楼17层01-12室
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、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

3.1.1 期间数据和指标	2021 年	2020 年	2019 年
本期已实现收益	19,557,185.86	47,381,468.38	14,705,968.30
本期利润	1,888,285.14	53,232,342.13	32,078,384.65
加权平均基金份额本期利润	0.0518	0.4565	0.3209
本期加权平均净值利润率	3.22%	35.50%	32.41%
本期基金份额净值增长率	3.56%	37.91%	39.78%
3.1.2 期末数据和指标	2021 年末	2020 年末	2019 年末
期末可供分配利润	12,665,693.14	62,786,957.89	11,306,943.00
期末可供分配基金份额利润	0.6008	0.5460	0.1149
期末基金资产净值	33,746,789.60	177,790,754.38	110,315,549.39
期末基金份额净值	1.601	1.546	1.121
3.1.3 累计期末指标	2021 年末	2020 年末	2019 年末
基金份额累计净值增长率	160.22%	151.28%	82.20%

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。

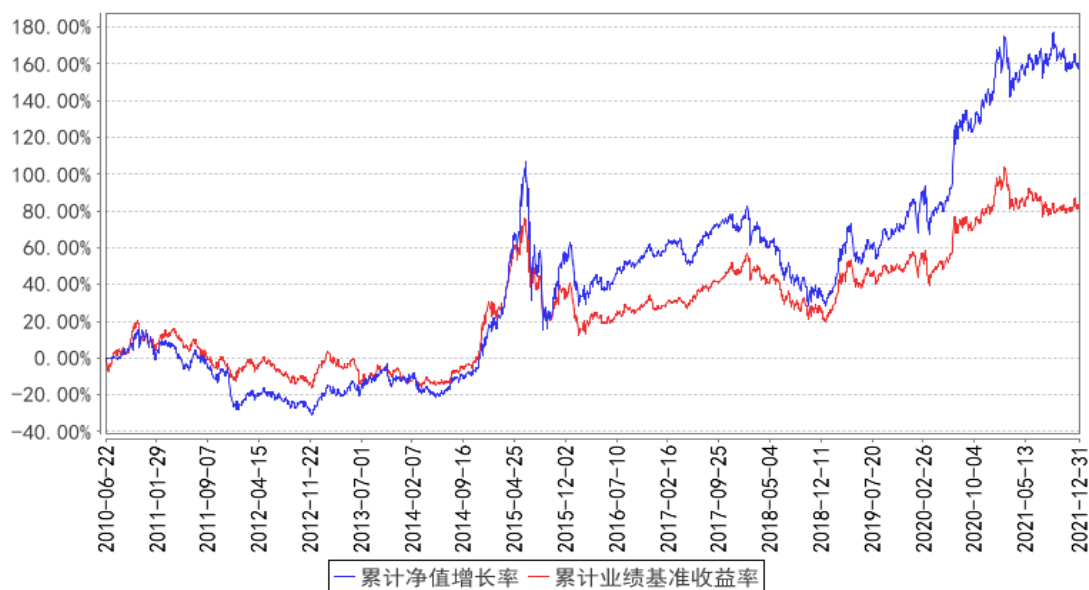
### 3.2 基金净值表现

#### 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

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	-1.54%	0.63%	1.49%	0.59%	-3.03%	0.04%
过去六个月	-1.72%	0.80%	-3.28%	0.77%	1.56%	0.03%
过去一年	3.56%	0.98%	-2.39%	0.88%	5.95%	0.10%
过去三年	99.63%	1.11%	51.38%	0.96%	48.25%	0.15%
过去五年	67.67%	1.05%	44.62%	0.90%	23.05%	0.15%
自基金合同生效起至今	160.22%	1.27%	83.08%	1.07%	77.14%	0.20%

### 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

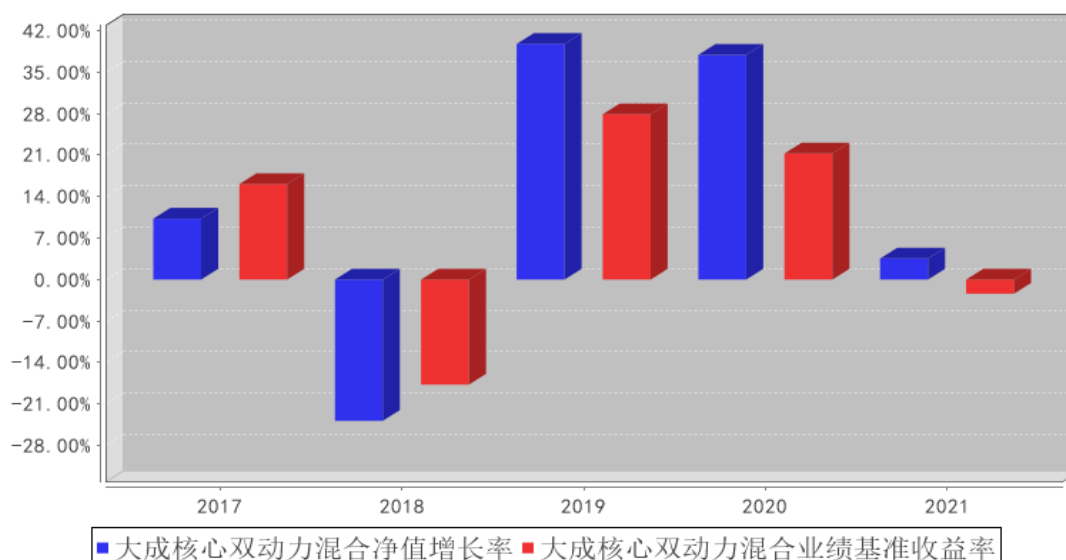
大成核心双动力混合累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：1、按基金合同规定，本基金自基金合同生效之日起 6 个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的约定。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。2、本基金于 2015 年 7 月 22 日由大成核心双动力股票型证券投资基金更名为大成核心双动力混合型证券投资基金。

### 3.2.3 过去五年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

大成核心双动力混合基金每年净值增长率与同期业绩比较基准收益率的对比图



注：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

无。



## § 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，注册资本为 2 亿元人民币，注册地为深圳。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%)。公司业务资质齐全，是全国同时具有境内、境外社保基金管理人资格和基本养老保险基金管理人资格的四家基金公司之一，全面涵盖公募基金、机构投资、海外投资、财富管理、养老金管理、私募股权投资等业务，旗下大成国际资产管理公司具备 QFII、RQFII 等资格。

历经 22 年的发展，大成基金形成了以长期投资能力为核心竞争优势，打造了一支具有良好职业素养和丰富经验的资产管理队伍。目前已形成权益、固定收益、量化投资、商品期货、境外投资、大类资产配置等六大投资团队，全面覆盖各类投资领域。

#### 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		
苏毅	本基金基金经理，指数与期货投资部副总监	2016 年 3 月 4 日	-	17 年	清华大学经济学硕士。2004 年 9 月至 2008 年 5 月就职于华夏基金管理有限公司基金运作部。2008 年加入大成基金管理有限公司，曾担任规划发展部高级产品设计师、数量与指数投资部总监助理，现任指数与期货投资部副总监。2012 年 8 月 28 日至 2014 年 1 月 23 日任大成中证 500 沪市交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理。2014 年 1 月 24 日至 2014 年 2 月 17 日任大成健康产业股票型证券投资基金基金经理。2012 年 2 月 9 日至 2014 年 9 月 11 日任深证成长 40 交易型开放式指数证券投资基金及大成深证成长 40 交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理。2012 年 8 月 24 日起任中证 500 沪市交易型开放式指数证券投资基金基金经理。2013 年 1 月 1 日至 2015 年 8 月 25 日任大成沪深 300 指数证券投资基金基金经理。2013 年 2 月 7 日起任大成中证 100 交易型开放式指数证券投资基金基金经理。

					2015年6月5日起任大成深证成份交易型开放式指数证券投资基金基金经理。2015年6月29日至2020年11月13日任大成中证互联网金融指数分级证券投资基金基金经理。2016年3月4日起任大成核心双动力混合型证券投资基金、大成沪深300指数证券投资基金基金经理。2018年6月26日起任大成景恒混合型证券投资基金基金经理。2021年4月23日起任大成智慧量化多策略灵活配置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
张钟玉	本基金基金经理	2015年2月28日	2021年9月2日	11年	美国华盛顿大学会计学硕士。2010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、数量与指数投资部数量分析师、基金经理助理、基金经理。2015年2月28日至2021年9月2日任大成核心双动力混合型证券投资基金基金经理（更名前为大成核心双动力股票型证券投资基金）。2015年5月23日至2021年9月2日任深证成长40交易型开放式指数证券投资基金、大成深证成长40交易型开放式指数证券投资基金联接基金、大成中证500深市交易型开放式指数证券投资基金基金经理。2015年8月26日至2021年9月2日任大成沪深300指数证券投资基金基金经理。2019年9月26日至2021年9月2日任大成MSCI中国A股质优价值100交易型开放式指数证券投资基金、大成MSCI中国A股质优价值100交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理。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

#### 4.1.4 基金经理薪酬机制

无

#### 4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

报告期内，本基金管理人严格遵守《证券法》、《证券投资基金法》等有关法律法规及基金合同、基金招募说明书等有关基金法律文件的规定，以取信于市场、取信于社会投资公众为宗旨，

本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在规范基金运作和严格控制投资风险的前提下，为基金份额持有人谋求最大利益，无损害基金份额持有人利益的行为。

### 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

#### 4.3.1 公平交易制度和控制方法

根据《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》的规定，公司制订了《大成基金管理有限公司公平交易制度》、《大成基金管理有限公司异常交易监控与报告制度》。公司旗下投资组合严格按照制度的规定，参与股票、债券的一级市场申购、二级市场交易等投资管理活动，内容包括授权、研究分析、投资决策、交易执行、业绩评估等与投资活动相关的各个环节。研究部负责提供投资研究支持，投资部门负责投资决策，交易管理部负责实施交易并实时监控，监察稽核部负责事前监督、事中检查和事后稽核，风险管理部负责对交易情况进行合理性分析，通过多部门的协作互控，保证了公平交易的可操作、可稽核和可持续。

#### 4.3.2 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，针对同一基金经理管理的多个投资组合及公私募兼任基金经理管理的多个投资组合的投资交易行为加强了公平交易监测与分析，包括对不同时间窗下（同日、3 日、5 日、10 日）反向交易和同向交易价差监控的分析。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投资策略差异、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，同时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。

##### 4.3.2.1 增加执行的基金经理公平交易制度执行情况及公平交易管理情况

无。

#### 4.3.3 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存在 4 笔同日反向交易，原因为流动性需要或合规比例调整。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 11 笔同日反向交易，原因为流动性需要或合规比例调整。投资组合间相邻交易日反向交易的市场成交比例、成交均价等交易结果数据表明该类交易不对市场产生重大影响，无异常。

## 4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

### 4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2021 年，全球宏观经济逐渐步入“滞胀”的格局。受疫情影响，经济复苏的脚步连连受挫。与此同时，各国央行大宽松的后遗症开始显现，加上供需错配、清洁能源对传统能源的压制等原因，商品价格一路走高，通货膨胀来势汹汹。作为全球资产配置锚，美国十年国债收益率也逐渐走高。尽管我国控制疫情较为出色，流动性释放也较为克制，但受输入性通胀和内外需不振影响，滞胀的阴霾仍挥之不去。

在经济基本面和流动性都不太友好的情况下，A 股市场今年经历了较大的转折。从年初到春节前，市场延续了去年的风格，对消费、新能源等“赛道股”的追捧趋于狂热，少数股票快速上涨带领指数冲高。然而春节后，在美债收益率走高的刺激下，风格剧烈切换。机构重仓股普遍快速下跌，而之前受其“虹吸”影响丧失流动性的大量股票反而迎来转机，形成鲜明对比，价值风格重得青睐。之后市场止跌回稳，指数保持窄幅震荡，但内部结构分化严重，板块走势差异极大。新能源、周期、元宇宙先后成为市场热点，而春节前风光无限的消费类板块则表现欠佳。从市值维度来看，小市值风格优势明显，沪深 300 指数本年度下跌 5.20%，中证 500、中证 1000 指数则分别上涨 15.58% 和 20.52%。

本基金本年度的策略和上年度大体保持一致，基于基金契约，精选沪深 300 成分股，并同时控制行业暴露，构建了核心组合；同时选择业绩持续增长、估值合理的成长股作为进攻组合。总体而言，净值表现和中证 800 指数相关性较高。

四季度，出于对部分高估值股票的担忧，基金从防御的角度出发，加大了金融股的配置，略偏向于大盘价值风格。

本年度基金份额净值上涨 3.56%，领先于上证 50、沪深 300、中证 800 等大盘宽基指数。

### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末本基金份额净值为 1.601 元；本报告期基金份额净值增长率为 3.56%，业绩比较基准收益率为-2.39%。

## 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望明年，宏观经济环境形势依然严峻。虽然人类抗疫的方式可能即将常态化，但其对经济发展的负面影响非常深远，短时间难以消除。而各国的宽松政策刺激效果已越来越小，反而通胀愈演愈烈，很难逃出滞胀的困局。相对而言，我国政策空间较大，稳增长箭在弦上，但也很难再走强刺激的老路，更多只是托底，来争取时间完成经济转型。

对于股票市场，我们持中性观点。经过调整后，估值体系分裂程度有所收敛，但仍未回到

合理区间。潜在入市资金不少，市场流动性相对宽裕，以上证指数为代表的宽基指数总体估值不高，下行风险不大。但许多过去几年由于正反馈机制累积了巨大涨幅的股票才刚刚开始回调，正在开启另一个方向的正反馈，有可能形成局部冲击。若风险得到充分释放，在各方面利好共振之下，股市有可能迎来一波修复行情。

本基金明年将继续保持现有投资风格，投资策略本年度大体保持一致。基于基金契约，精选沪深 300 成分股，并同时控制行业暴露，构建核心组合；在此之外，基于量化模型和主观研判，构建卫星组合，获取一定的进攻弹性。

#### 4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

本报告期内，依据相关的法律法规、基金合同以及内部监察稽核制度，本基金管理人对本基金运作、内部管理、制度执行及遵纪守法情况进行了监察稽核。内部监察稽核的重点是：国家法律法规及行业监管规则的执行情况；基金合同的遵守情况；内部规章制度的执行情况；资讯管制和保密工作落实情况；员工职业操守规范情况，目的是规范基金财产的运作，防范和控制投资风险，确保经营业务的稳健运行和受托资产的安全完整，维护本基金份额持有人的合法权益。

（一）根据最新的法律法规、规章、规范性文件，本基金管理人及时制定了相应的公司制度，并对现有制度进行不断修订和完善，确保本基金管理人内控制度的适时性、全面性和合法合规性。同时，为保障制度的适时性，避免部分内控制度、业务规则与业务发展不相适应，报告期内本基金管理人组织各部门对内部管理制度作了进一步梳理和完善。

（二）全面加强风险监控，不断提高基金业务风险管理水平。为督促各部门完善并落实各项内控措施，公司严格执行风险控制管理员制度，健全内控工作协调机制及监督机制，并进一步加强投资风险量化评价能力及事前风险防范能力，有效防范相关业务风险。同时，公司严格执行投资报备制度，建立了基金从业人员证券投资管理监控信息系统，将投资报备工作纳入常态。

（三）日常监察和专项监察相结合，确保监察稽核的有效性和深入性。本年度，公司继续对本基金销售、宣传等方面的材料、协议及其他法律资料等进行了严格审查，对本基金各项投资比例、投资权限、基金交易、股票投资限制、股票库维护等方面进行实时监控，同时，还专门针对基金投资交易（包括公平交易、转债投资、投资权限、投资比例、流动性风险、基金重仓股等）、基金运营（基金头寸、基金结算、登记清算等）、网上交易、基金销售等进行专项监察。通过日常监察，保证了公司监察的全面性、实时性，通过专项监察，及时发现并纠正了业务中的潜在风险，加强了业务部门和人员的风险意识，从而较好地预防了风险的发生。

（四）加强了对投资管理人员通讯工具在交易时间的集中管理，定期或不定期对投资管理人员的网络即时通讯记录、电话录音等进行抽查，有效的防范了各种形式的利益输送行为。

(五) 以多种方式加强合规教育与培训, 提高全公司的合规守法意识。及时向全公司传达与基金相关的法律法规, 并要求公司各部门贯彻到日常工作中。公司监察稽核部通过解答各业务部门提出的法律问题, 提供法律依据, 对于较为重大疑难法律事项及时咨询公司外部律师或监管部门, 避免了业务发展中的盲目性, 及时防范风险, 维护了基金份额持有人的利益。

#### 4.7 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、权益专户投资部、指数与期货投资部、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、权益专户投资部、指数与期货投资部、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。

#### 4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

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。

#### 4.9 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

本基金在本报告期内，曾出现了连续 60 个工作日资产净值低于五千万元的情形。我公司已根据法律法规及基金合同要求拟定相关应对方案上报中国证券监督管理委员会。

## § 5 托管人报告

### 5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

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

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

本报告期内，大成核心双动力混合型证券投资基金的管理人——大成基金管理有限公司在大成核心双动力混合型证券投资基金的投资运作、基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格计算、基金费用开支等问题上，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。本报告期内，大成核心双动力混合型证券投资基金未进行利润分配。

### 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

本托管人依法对大成基金管理有限公司编制和披露的大成核心双动力混合型证券投资基金 2021 年年度报告中财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容进行了核查，以上内容真实、准确和完整。

## § 6 审计报告

审计报告标题	审计报告
审计报告收件人	大成核心双动力混合型证券投资基金全体基金份额持有人
审计意见	<p>我们审计了大成核心双动力混合型证券投资基金的（以下简称“大成核心双动力混合基金”）财务报表，包括 2021 年 12 月 31 日的资产负债表，2021 年度的利润表、所有者权益（基金净值）变动表以及相关财务报表附注。</p> <p>我们认为，后附的大成核心双动力混合基金的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则的规定编制，公允反映了大成核心双动力混合基金 2021 年 12 月 31 日的财务状况以及 2021 年度的经营成果和净值变动情况。</p>
形成审计意见的基础	<p>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。按照中国注册会计师职业道德守则，我们独立于大成核心双动力混合基金，并履行</p>

	<p>了职业道德方面的其他责任。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。</p>
其他信息	<p>大成核心双动力混合基金管理层对其他信息负责。其他信息包括年度报告中涵盖的信息，但不包括财务报表和我们的审计报告。</p> <p>我们对财务报表发表的审计意见不涵盖其他信息，我们也不对其他信息发表任何形式的鉴证结论。</p> <p>结合我们对财务报表的审计，我们的责任是阅读其他信息，在此过程中，考虑其他信息是否与财务报表或我们在审计过程中了解到的情况存在重大不一致或者似乎存在重大错报。</p> <p>基于我们已执行的工作，如果我们确定其他信息存在重大错报，我们应当报告该事实。在这方面，我们无任何事项需要报告。</p>
管理层和治理层对财务报表的责任	<p>管理层负责按照企业会计准则的规定编制财务报表，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。</p> <p>在编制财务报表时，管理层负责评估大成核心双动力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，除非计划进行清算、终止运营或别无其他现实的选择。</p> <p>治理层负责监督大成核心双动力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。</p> <p>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，我们也执行以下工作：</p> <p>（1）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。</p> <p>（2）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。</p> <p>（3）评价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。</p> <p>（4）对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，就可能导致对大成核心双动力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</p>



	<p>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大成核心双动力混合基金不能持续经营。</p> <p>(5) 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	安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）	
注册会计师的姓名	昌华	吴嘉欣
会计师事务所的地址	北京市东城区东长安街1号东方广场安永大楼17层01-12室	
审计报告日期	2022年3月28日	

## § 7 年度财务报表

### 7.1 资产负债表

会计主体：大成核心双动力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	上年度末 2020年12月31日
<b>资产：</b>			
银行存款	7.4.7.1	5,587,311.23	22,906,397.91
结算备付金		138,474.36	-
存出保证金		5,319.13	62,621.81
交易性金融资产	7.4.7.2	28,174,533.74	155,059,972.54
其中：股票投资		28,174,533.74	155,059,972.54
基金投资		-	-
债券投资		-	-
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	-	-
应收证券清算款		37,772.27	451,855.42
应收利息	7.4.7.5	772.26	2,264.79
应收股利		-	-
应收申购款		980.37	5,284.01
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.6	-	-
资产总计		33,945,163.36	178,488,396.48

负债和所有者权益	附注号	本期末 2021 年 12 月 31 日	上年度末 2020 年 12 月 31 日
<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		5,598.38	178,316.54
应付管理人报酬		43,227.16	219,528.16
应付托管费		7,204.52	36,588.02
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	7.4.7.7	77,329.07	77,582.76
应交税费		-	-
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.8	65,014.63	185,626.62
负债合计		198,373.76	697,642.10
<b>所有者权益:</b>			
实收基金	7.4.7.9	21,081,096.46	115,003,796.49
未分配利润	7.4.7.10	12,665,693.14	62,786,957.89
所有者权益合计		33,746,789.60	177,790,754.38
负债和所有者权益总计		33,945,163.36	178,488,396.48

注：报告截止日 2021 年 12 月 31 日，基金份额净值 1.601 元，基金份额总额 21,081,096.46 份。

## 7.2 利润表

会计主体：大成核心双动力混合型证券投资基金

本报告期：2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期	上年度可比期间
		2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日	2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日
一、收入		4,120,988.79	57,416,955.03
1. 利息收入		30,345.97	98,547.74
其中：存款利息收入	7.4.7.11	30,342.66	98,547.74
债券利息收入		3.31	-
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	-
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-

2. 投资收益（损失以“-”填列）		21,507,701.58	51,357,624.22
其中：股票投资收益	7.4.7.12	20,883,163.48	48,701,063.30
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.13	5,674.09	-
资产支持证券投资		-	-
收益		-	-
贵金属投资收益	7.4.7.14	-	-
衍生工具收益	7.4.7.15	-	-
股利收益	7.4.7.16	618,864.01	2,656,560.92
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.17	-17,668,900.72	5,850,873.75
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.18	251,841.96	109,909.32
减：二、费用		2,232,703.65	4,184,612.90
1. 管理人报酬	7.4.10.2.1	895,278.21	2,233,468.53
2. 托管费	7.4.10.2.2	149,212.98	372,244.72
3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用	7.4.7.19	999,803.58	1,389,887.67
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 税金及附加		-	-
7. 其他费用	7.4.7.20	188,408.88	189,011.98
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		1,888,285.14	53,232,342.13
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		1,888,285.14	53,232,342.13

### 7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：大成核心双动力混合型证券投资基金

本报告期：2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 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）	115,003,796.49	62,786,957.89	177,790,754.38
二、本期经营活动产生的基金净	-	1,888,285.14	1,888,285.14

值变动数（本期利润）			
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	-93,922,700.03	-52,009,549.89	-145,932,249.92
其中：1. 基金申购款	38,727,965.63	24,208,536.27	62,936,501.90
2. 基金赎回款	-132,650,665.66	-76,218,086.16	-208,868,751.82
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）	21,081,096.46	12,665,693.14	33,746,789.60
项目	上年度可比期间 2020年1月1日至2020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）	98,448,114.79	11,867,434.60	110,315,549.39
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	53,232,342.13	53,232,342.13
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）	16,555,681.70	-2,312,818.84	14,242,862.86
其中：1. 基金申购款	141,806,689.01	40,476,659.76	182,283,348.77
2. 基金赎回款	-125,251,007.31	-42,789,478.60	-168,040,485.91
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	115,003,796.49	62,786,957.89	177,790,754.38

权益(基金净值)			
----------	--	--	--

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：

<u>谭晓冈</u>	<u>温智敏</u>	<u>刘亚林</u>
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

大成核心双动力混合型证券投资基金(原名大成核心双动力股票型证券投资基金,以下简称“本基金”),系经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监基金字[2010]591号文《关于核准大成核心双动力股票型证券投资基金募集的批复》的核准,由基金管理人大成基金管理有限公司向社会公开发行募集,基金合同于2010年6月22日正式生效,首次设立募集规模为1,173,262,454.69份基金份额。本基金为契约型开放式,存续期限不定。本基金的基金管理人为大成基金管理有限公司,注册登记机构为大成基金管理有限公司,基金托管人为中国工商银行股份有限公司(简称“中国工商银行”)。

根据中国证监会2014年7月7日颁布的《公开募集证券投资基金运作管理办法》的有关规定,经与本基金托管人中国工商银行协商一致,自2015年7月22日起本基金名称变更为“大成核心双动力混合型证券投资基金”;基金简称变更为“大成核心双动力混合”;基金类别变更为“混合型”。上述事项已报中国证监会备案。

本基金的投资对象为具有较好流动性的金融工具,包括国内依法发行交易的股票、债券、权证及法律、法规或监管机构允许基金投资的其他金融工具。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种,基金管理人在履行适当程序后,可以将其纳入投资范围。本基金是混合型基金,对股票类资产的投资比例不低于基金资产的60%,在满足股票投资比例要求的基础上,可以投资于非股票类金融工具。本基金股票资产、存托凭证占基金资产的比例范围为60%-95%;权证不超过基金资产净值的3%;固定收益类证券和现金投资比例范围为基金资产的5%-40%;现金

(不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等)或到期日在一年以内的政府债券的比例不低于基金资产净值的5%。因基金规模或市场变化等因素导致投资组合不符合上述规定的,基金管理人应在合理的期限内调整基金的投资组合,以符合上述比例限定。法律法规另有规定时,从其规定。如法律法规或监管机构以后允许本基金投资其他品种,基金管理人在履行适当程序后,可以将其纳入投资范围,并可依据届时有效的法律法规适时合理地调整投资范围。本基金的业绩比较基准为:沪深300指数×75%+中证综合债券指数×25%。

## 7.4.2 会计报表的编制基础

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

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

## 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于 2021 年 12 月 31 日的财务状况以及 2021 年度的经营成果和净值变动情况。

## 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。

### 7.4.4.2 记账本位币

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

### 7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

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

#### （1）金融资产分类

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

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

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

#### （2）金融负债分类

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

本基金目前持有的金融负债划分为其他金融负债。

#### 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

##### 初始确认

本基金于成为金融工具合同的一方时确认一项金融资产或金融负债，按照取得时的公允价值作为初始确认金额。划分为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产取得时发生的相关交易费用计入当期损益；应收款项及其他金融负债的相关交易费用计入初始确认金额。

##### 后续计量

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

##### 终止确认

当收取该金融资产现金流量的合同权利终止，或该金融资产已转移，且符合金融资产转移的终止确认条件的，金融资产将终止确认；

当金融负债的现时义务全部或部分已经解除的，该金融负债或其一部分将终止确认；

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

##### 金融资产转移

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

#### 7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

公允价值，是指市场参与者在计量日发生的有序交易中，出售一项资产所能收到或者转移一项负债所需支付的价格。本基金以公允价值计量相关资产或负债，假定出售资产或者转移负债的有序交易在相关资产或负债的主要市场进行；不存在主要市场的，本基金假定该交易在相关资产

或负债的最有利市场进行。主要市场(或最有利市场)是本基金在计量日能够进入的交易市场。本基金采用市场参与者在对该资产或负债定价时为实现其经济利益最大化所使用的假设。

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

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

本基金持有的股票投资、债券投资和权证投资等投资按如下原则确定公允价值并进行估值：

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

与上述投资品种相同，但具有不同特征的，应以相同资产或负债的公允价值为基础，并在估值技术中考虑不同特征因素的影响。特征是指对资产出售或使用的限制等，如果该限制是针对资产持有者的，那么在估值技术中不应将该限制作为特征考虑。此外，基金管理人不应考虑因大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价。

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

(3) 如有确凿证据表明按上述方法进行估值不能客观反映其公允价值的，基金管理人可根据具体情况与基金托管人商定后，按最能反映公允价值的方法估值；

(4) 如有新增事项，按国家最新规定估值。

#### 7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

当本基金同时满足下列条件时，金融资产和金融负债以相互抵销后的净额在资产负债表内列示：

具有抵销已确认金额的法定权利，且该种法定权利是当前可执行的；计划以净额结算，或同时变现该金融资产和清偿该金融负债。

#### 7.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行的基金份额总额所对应的金额。由于申购和赎回引起的实收基金份额变



动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日确认。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

#### 7.4.4.8 损益平准金

损益平准金包括已实现损益平准金和未实现损益平准金。已实现损益平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现收益/（损失）占基金净值比例计算的金额。未实现损益平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未实现利得/（损失）占基金净值比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日确认。未实现损益平准金与已实现损益平准金均在“损益平准金”科目中核算，并于期末全额转入“未分配利润/（累计亏损）”。

#### 7.4.4.9 收入/（损失）的确认和计量

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

（2）债券利息收入按债券票面价值与票面利率或内含票面利率计算的金额扣除应由债券发行企业代扣代缴的个人所得税及应由管理人缴纳的增值税后的净额确认，在债券实际持有期内逐日计提；

（3）资产支持证券利息收入按证券票面价值与票面利率计算的金额，扣除应由资产支持证券发行企业代扣代缴的个人所得税及应由管理人缴纳的增值税后的净额确认，在证券实际持有期内逐日计提；

（4）买入返售金融资产收入，按买入返售金融资产的成本及实际利率（当实际利率与合同利率差异较小时，也可以用合同利率），在回购期内逐日计提；

（5）股票投资收益/（损失）于卖出股票成交日确认，并按卖出股票成交金额与其成本的差额入账；

（6）债券投资收益/（损失）于成交日确认，并按成交总额与其成本、应收利息的差额入账；

（7）衍生工具收益/（损失）于卖出权证成交日确认，并按卖出权证成交金额与其成本的差额扣除应由基金管理人缴纳的增值税后的净额入账；

（8）股利收益于除息日确认，并按上市公司宣告的分红派息比例计算的金额扣除应由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额入账；

（9）公允价值变动收益/（损失）系本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债等公允价值变动形成的应计入当期

损益的利得或损失；

(10) 其他收入在经济利益很可能流入从而导致资产增加或者负债减少、且经济利益的流入额能够可靠计量时确认。

#### 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等费用在费用涵盖期间按基金合同或相关公告约定的费率和计算方法逐日确认。

其他金融负债在持有期间确认的利息支出按实际利率计算，当实际利率与合同利率差异较小时，也可以用合同利率计算。

#### 7.4.4.11 基金的收益分配政策

(1) 在符合有关基金分红条件的前提下，本基金每年收益分配次数最多为 6 次，每次收益分配比例不得低于收益分配基准日可供分配利润的 20%，若《基金合同》生效不满 3 个月可不进行收益分配。

(2) 本基金收益分配方式分两种：现金分红与红利再投资，投资者可选择现金红利或将现金红利自动转为基金份额进行再投资；若投资者不选择，本基金默认的收益分配方式是现金分红。

(3) 基金红利发放日距离收益分配基准日（即可供分配利润计算截止日）的时间不得超过 15 个工作日。

(4) 每一基金份额享有同等分配权。

(5) 法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

#### 7.4.4.12 分部报告

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

#### 7.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计

本基金本报告期间无需要说明的其他重要会计政策和会计估计事项。

### 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重大会计差错更正。

## 7.4.6 税项

### 1、印花税

证券（股票）交易印花税税率为 1%，由出让方缴纳。2、增值税、企业所得税

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

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

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

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

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

### 3、个人所得税

个人所得税税率为 20%。

基金取得的股票的股息、红利收入、债券的利息收入及储蓄利息收入，由上市公司、债券发

行企业及金融机构在向基金派发股息、红利收入、债券的利息收入及储蓄利息收入时代扣代缴个人所得税。

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

#### 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	上年度末 2020 年 12 月 31 日
活期存款	5,587,311.23	22,906,397.91
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	5,587,311.23	22,906,397.91

##### 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	28,711,037.62	28,174,533.74	-536,503.88
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	-	-
	银行间市场	-	-
	合计	-	-
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	28,711,037.62	28,174,533.74	-536,503.88
项目	上年度末 2020 年 12 月 31 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	137,927,575.70	155,059,972.54	17,132,396.84

贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	-	-
	银行间市场	-	-
	合计	-	-
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	137,927,575.70	155,059,972.54	17,132,396.84

#### 7.4.7.3 衍生金融资产/负债

无。

#### 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

无。

##### 7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

无。

#### 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	上年度末 2020年12月31日
应收活期存款利息	705.43	2,234.46
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	62.30	-
应收债券利息	-	-
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	2.13	2.13
应收黄金合约拆借孳息	-	-
应收出借证券利息	-	-
其他	2.40	28.20
合计	772.26	2,264.79

#### 7.4.7.6 其他资产

无。

#### 7.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2021年12月31日	上年度末 2020年12月31日
交易所市场应付交易费用	77,329.07	77,582.76

银行间市场应付交易费用	-	-
合计	77,329.07	77,582.76

#### 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	上年度末 2020年12月31日
应付券商交易单元保证金	-	-
应付赎回费	14.63	626.62
应付证券出借违约金	-	-
预提费用	65,000.00	185,000.00
合计	65,014.63	185,626.62

#### 7.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年12月31日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	115,003,796.49	115,003,796.49
本期申购	38,727,965.63	38,727,965.63
本期赎回（以“-”号填列）	-132,650,665.66	-132,650,665.66
- 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	21,081,096.46	21,081,096.46

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)。

#### 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
上年度末	65,440,872.31	-2,653,914.42	62,786,957.89
本期利润	19,557,185.86	-17,668,900.72	1,888,285.14
本期基金份额交易产生的变动数	-67,322,263.64	15,312,713.75	-52,009,549.89
其中：基金申购款	25,262,150.70	-1,053,614.43	24,208,536.27
基金赎回款	-92,584,414.34	16,366,328.18	-76,218,086.16
本期已分配利润	-	-	-
本期末	17,675,794.53	-5,010,101.39	12,665,693.14

#### 7.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年12月31日	上年度可比期间 2020年1月1日至2020年12月31日

活期存款利息收入	26,975.97	91,813.84
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	2,782.91	6,092.55
其他	583.78	641.35
合计	30,342.66	98,547.74

#### 7.4.7.12 股票投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年12月31日	上年度可比期间 2020年1月1日至2020年12月31日
卖出股票成交总额	375,912,875.11	453,828,733.51
减：卖出股票成本总额	355,029,711.63	405,127,670.21
买卖股票差价收入	20,883,163.48	48,701,063.30

#### 7.4.7.13 债券投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年12月31日	上年度可比期间 2020年1月1日至2020年12月31日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	30,077.40	-
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	24,400.00	-
减：应收利息总额	3.31	-
买卖债券差价收入	5,674.09	-

#### 7.4.7.14 贵金属投资收益

无。

#### 7.4.7.15 衍生工具收益

无。

#### 7.4.7.16 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年12月31日	上年度可比期间 2020年1月1日至2020年12月31日
股票投资产生的股利收益	618,864.01	2,656,560.92

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	618,864.01	2,656,560.92

## 7.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2021年1月1日至2021年 12月31日	上年度可比期间 2020年1月1日至2020 年12月31日
1. 交易性金融资产	-17,668,900.72	5,850,873.75
股票投资	-17,668,900.72	5,850,873.75
债券投资	-	-
资产支持证券投资	-	-
基金投资	-	-
贵金属投资	-	-
其他	-	-
2. 衍生工具	-	-
权证投资	-	-
3. 其他	-	-
减：应税金融商品公允价值 变动产生的预估增值税	-	-
合计	-17,668,900.72	5,850,873.75

## 7.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年12月 31日	上年度可比期间 2020年1月1日至2020年 12月31日
基金赎回费收入	251,563.42	101,935.26
基金转换费收入	278.54	7,974.06
合计	251,841.96	109,909.32

注：(1)本基金的赎回费率按持有期间递减，不低于赎回费总额的25%归入基金资产。(2)本基金的转换费由申购补差费和转出基金的赎回费两部分构成，其中转出基金的赎回费总额的25%归入转出基金的基金资产。

## 7.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年12月 31日	上年度可比期间 2020年1月1日至2020年12月31日
交易所市场交易费用	999,803.58	1,389,887.67
银行间市场交易费用	-	-



合计	999,803.58	1,389,887.67
----	------------	--------------

#### 7.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2021年1月1日至2021年12月31日	2020年1月1日至2020年12月31日
审计费用	65,000.00	65,000.00
信息披露费	120,000.00	120,000.00
证券出借违约金	-	-
银行划款手续费	3,408.88	4,011.98
合计	188,408.88	189,011.98

#### 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

无。

##### 7.4.8.2 资产负债表日后事项

无。

#### 7.4.9 关联方关系

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、基金销售机构、注册登记机构
中国工商银行股份有限公司（“中国工商银行”）	基金托管人、基金销售机构
中泰信托有限责任公司	基金管理人的股东
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
中国银河投资管理有限公司	基金管理人的股东
大成国际资产管理有限公司（“大成国际”）	基金管理人的子公司
大成创新资本管理有限公司（“大成创新资本”）	基金管理人的合营企业

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。

#### 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		上年度可比期间	
	2021年1月1日至2021年12月31日		2020年1月1日至2020年12月31日	
	成交金额	占当期股票成交总额的比例(%)	成交金额	占当期股票成交总额的比例(%)
光大证券	89,624,768.75	14.47	2,312,476.54	0.26

## 7.4.10.1.2 债券交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2021年1月1日至2021年12月31日		上年度可比期间 2020年1月1日至2020年12月31日	
	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 成交总额的比例 (%)
光大证券	14,791.10	49.18	-	-

## 7.4.10.1.3 债券回购交易

无。

## 7.4.10.1.4 权证交易

无。

## 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1月1日至2021年12月31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	81,675.28	14.47	29,569.29	38.24
关联方名称	上年度可比期间 2020年1月1日至2020年12月31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	2,107.39	0.26	-	-

注：(1)上述佣金按市场佣金率计算，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1月1日至2021年12月31日	上年度可比期间 2020年1月1日至2020年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	895,278.21	2,233,468.53

其中：支付销售机构的客户维护费	196,656.45	193,131.17
-----------------	------------	------------

注： 基金管理费每日计提，按月支付。基金管理费按前一日的基金资产净值的 1.5%的年费率计提。计算方法如下： $H=E \times 1.5\% / \text{当年天数}$  H 为每日应支付的基金管理费 E 为前一日的基金资产净值

#### 7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日	2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的托管费	149,212.98	372,244.72

注： 基金托管费每日计提，按月支付。基金托管费按前一日的基金资产净值的 0.25%的年费率计提。计算方法如下： $H=E \times 0.25\% / \text{当年天数}$  H 为每日应支付的基金托管费 E 为前一日的基金资产净值

#### 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

无。

#### 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

无。

##### 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

无。

#### 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

无。

##### 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

无。

## 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1月1日至2021年12月31日		上年度可比期间 2020年1月1日至2020年12月31日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国工商银行	5,587,311.23	26,975.97	22,906,397.91	91,813.84

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。

## 7.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

无。

## 7.4.10.8 其他关联交易事项的说明

无。

## 7.4.11 利润分配情况

无。

## 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
001234	泰慕士	2021年12月31日	2022年1月11日	新股未上市	16.53	16.53	175	2,892.75	2,892.75	-
600941	中国移动	2021年12月27日	2022年1月5日	新股未上市	57.58	57.58	1,000	57,580.00	57,580.00	-

注：1. 根据《上海证券交易所科创板股票公开发行自律委员会促进科创板初期企业平稳发行行业倡导建议》，本基金获配的科创板股票如经抽签方式确定需要锁定的，锁定期限为自发行人股票上市之日起6个月。根据《上海证券交易所科创板上市公司股东以向特定机构投资者询价转让和配售方式减持股份实施细则》，基金通过询价转让受让的股份，在受让后6个月内不得转让。

2. 根据《深圳证券交易所创业板首次公开发行证券发行与承销业务实施细则》，发行人和主承销商可以采用摇号限售方式或比例限售方式，安排基金通过网下发行获配的部分创业板股票设置不低于6个月的限售期。

3. 基金可使用以基金名义开设的股票账户，选择网上或者网下一种方式进行新股申购。其中

基金参与网下申购获得的新股或作为战略投资者参与配售获得的新股，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。

#### 7.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金截至本期末止持有以上因公布的重大事项可能产生重大影响而被暂时停牌的股票，该类股票将在所公布事项的重大影响消除后，经交易所批准复牌。

#### 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

无。

##### 7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

无。

#### 7.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

无。

### 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

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

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

本基金的基金管理人对于金融工具的风险管理方法主要是通过定性分析和定量分析的方法去估测各种风险产生的可能损失。从定性分析的角度出发，判断风险损失的严重程度和出现同类风险损失的频度。而从定量分析的角度出发，根据本基金的投资目标，结合基金资产所运用金融工具特征通过特定的风险量化指标、模型，日常的量化报告，确定风险损失的限度和相应置信程度，

及时可靠地对各种风险进行监督、检查和评估，并通过相应决策，将风险控制在可承受的范围内。

#### 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，导致基金资产损失和收益变化的风险。

本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的活期银行存款存放在本基金的托管行中国工商银行，因而与银行存款相关的信用风险不重大。本基金在交易所进行的交易均以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，违约风险可能性很小；在银行间同业市场进行交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式进行限制以控制相应的信用风险。

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

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

#### 7.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指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。

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

本基金主要投资于交易所及银行间市场内交易的证券，除在附注“期末本基金持有的流通受限证券”中列示的部分基金资产流通暂时受限制外（如有），其余均能及时变现。此外，本基金可

通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券资产的公允价值。除附注“期末债券正回购交易中作为抵押的债券”中列示的卖出回购金融资产款余额（如有）将在 1 个月内到期且计息外，本基金于资产负债表日所持有的金融负债的合同约定剩余到期日均为一年以内且一般不计息，可赎回基金份额净值无固定到期日且不计息，因此账面余额一般即为未折现的合约到期现金流量。本报告期内，本基金未发生重大流动性风险事件。

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

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

本基金持有及承担的大部分金融资产和金融负债不计息，因此本基金的收入及经营活动的现金流量在很大程度上独立于市场利率变化。本基金持有的利率敏感性资产主要为银行存款、结算备付金、债券投资、资产支持证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 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	5,587,311.23	-	-	-	5,587,311.23
结算备付金	138,474.36	-	-	-	138,474.36
存出保证金	5,319.13	-	-	-	5,319.13
交易性金融资产	-	-	-	28,174,533.74	28,174,533.74
应收利息	-	-	-	772.26	772.26
应收申购款	-	-	-	980.37	980.37
应收证券清算款	-	-	-	37,772.27	37,772.27
资产总计	5,731,104.72	-	-	28,214,058.64	33,945,163.36
负债					
应付赎回款	-	-	-	5,598.38	5,598.38
应付管理人报酬	-	-	-	43,227.16	43,227.16
应付托管费	-	-	-	7,204.52	7,204.52
应付交易费用	-	-	-	77,329.07	77,329.07

其他负债	-	-	-	65,014.63	65,014.63
负债总计	-	-	-	198,373.76	198,373.76
利率敏感度缺口	5,731,104.72	-	-	28,015,684.88	33,746,789.60
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	22,906,397.91	-	-	-	22,906,397.91
存出保证金	62,621.81	-	-	-	62,621.81
交易性金融资产	-	-	-	155,059,972.54	155,059,972.54
应收利息	-	-	-	2,264.79	2,264.79
应收申购款	-	-	-	5,284.01	5,284.01
应收证券清算款	-	-	-	451,855.42	451,855.42
资产总计	22,969,019.72	-	-	155,519,376.76	178,488,396.48
负债					
应付赎回款	-	-	-	178,316.54	178,316.54
应付管理人报酬	-	-	-	219,528.16	219,528.16
应付托管费	-	-	-	36,588.02	36,588.02
应付交易费用	-	-	-	77,582.76	77,582.76
其他负债	-	-	-	185,626.62	185,626.62
负债总计	-	-	-	697,642.10	697,642.10
利率敏感度缺口	22,969,019.72	-	-	154,821,734.66	177,790,754.38

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

于本期末，本基金未持有交易性债券投资，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)。

#### 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。本基金持有的金融工具以人民币计价，因此无重大外汇风险。

#### 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，采用“自上而下、自下而上”相结合的积极主动的投资策略，通过对作为新兴生产力代表的新锐产业的内外部环境条件、政策导向、科技进步等各方面的分析，结合证券市场运行情况，做出资产配置及组合构建的决定；通过对单



个证券的定性分析及定量分析，选择符合基金合同约定范围的投资品种进行投资。本基金的基金管理人定期结合宏观及微观环境的变化，对投资策略、资产配置、投资组合进行修正，来主动应对可能发生的市场价格风险。

本基金的投资范围为：股票资产占基金资产的比例范围为 60%-95%，其中权证不超过基金资产净值的 3%。固定收益类证券和现金投资比例范围为基金资产的 5%-40%。其中，资产支持证券投资比例范围为基金资产净值的 0-20%，现金或到期日在一年以内的政府债券的比例不低于基金资产净值的 5%。

#### 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		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	28,174,533.74	83.49	155,059,972.54	87.21
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	28,174,533.74	83.49	155,059,972.54	87.21

#### 7.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除业绩比较基准以外的其他市场变量保持不变		
相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）		
	本期末（2021年12月31日）	上年度末（2020年12月31日）	
分析	业绩比较基准上升 5%	1,763,142.41	10,327,094.67
	业绩比较基准下降 5%	-1,763,142.41	-10,327,094.67

#### 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. 承诺事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的承诺事项。

##### 2. 其他事项

###### (1) 公允价值

基金管理人已经评估了银行存款、结算备付金、买入返售金融资产、其他应收款项类投资以及其他金融负债因剩余期限不长，公允价值与账面价值相若。

###### 各层次金融工具公允价值

于 2021 年 12 月 31 日，本基金持有的持续以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产中划分为第一层次的余额为人民币 28,114,060.99 元，划分为第二层次的余额为人民币 60,472.75 元，无划分为第三层次的余额（于 2020 年 12 月 31 日，本基金持有的持续以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产中划分为第一层次的余额为人民币 152,494,243.62 元，划分为第二层次的余额为人民币 2,565,728.92 元，无划分为第三层次的余额）。

###### 公允价值所属层次间重大变动

本基金调整公允价值计量层次转换时点的相关会计政策在前后各会计期间保持一致。

对于证券交易所上市的股票和可转换债券，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，本基金不会于停牌日至交易恢复活跃日期间及交易不活跃期间将相关股票和可转换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，确定相关股票和可转换债券公允价值应属第二层次还是第三层次。

###### 第三层次公允价值期初金额和本期变动金额

本基金于本报告期初未持有公允价值划分为第三层次的金融工具；本基金本报告期未发生第三层次公允价值转入转出情况。

(2) 除公允价值外，截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

##### 3. 财务报表的批准

本财务报表已于 2022 年 3 月 28 日经本基金的基金管理人批准。

## § 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	28,174,533.74	83.00
	其中：股票	28,174,533.74	83.00

2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	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	5,725,785.59	16.87
8	其他各项资产	44,844.03	0.13
9	合计	33,945,163.36	100.00

## 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

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	135,712.00	0.40
B	采矿业	597,447.00	1.77
C	制造业	13,143,073.83	38.95
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	272,424.00	0.81
E	建筑业	264,619.00	0.78
F	批发和零售业	213,457.00	0.63
G	交通运输、仓储和邮政业	650,755.80	1.93
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	813,891.36	2.41
J	金融业	11,282,452.75	33.43
K	房地产业	373,167.00	1.11
L	租赁和商务服务业	173,247.00	0.51
M	科学研究和技术服务业	19,808.00	0.06
N	水利、环境和公共设施管理业	56,882.00	0.17
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	118,243.00	0.35
R	文化、体育和娱乐业	59,354.00	0.18
S	综合	-	-
	合计	28,174,533.74	83.49

### 8.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末无沪港通投资。

## 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	600999	招商证券	63,600	1,122,540.00	3.33
2	601688	华泰证券	57,400	1,019,424.00	3.02
3	600036	招商银行	20,600	1,003,426.00	2.97
4	601166	兴业银行	47,900	912,016.00	2.70
5	600030	中信证券	33,600	887,376.00	2.63
6	601328	交通银行	176,100	811,821.00	2.41
7	601658	邮储银行	153,400	782,340.00	2.32
8	600919	江苏银行	133,700	779,471.00	2.31
9	002142	宁波银行	19,140	732,679.20	2.17
10	601838	成都银行	59,800	717,600.00	2.13
11	000001	平安银行	38,400	632,832.00	1.88
12	600926	杭州银行	48,700	624,334.00	1.85
13	600519	贵州茅台	300	615,000.00	1.82
14	002129	中环股份	10,400	434,200.00	1.29
15	601919	中远海控	21,520	402,208.80	1.19
16	300122	智飞生物	3,100	386,260.00	1.14
17	600176	中国巨石	18,759	341,413.80	1.01
18	600779	水井坊	2,800	335,972.00	1.00
19	002466	天齐锂业	3,000	321,000.00	0.95
20	600884	杉杉股份	9,200	301,484.00	0.89
21	600887	伊利股份	6,900	286,074.00	0.85
22	300604	长川科技	4,600	264,500.00	0.78
23	603613	国联股份	2,400	258,000.00	0.76
24	688200	华峰测控	500	255,950.00	0.76
25	603392	万泰生物	1,100	243,650.00	0.72
26	002326	永太科技	4,700	240,687.00	0.71
27	601288	农业银行	80,700	237,258.00	0.70
28	600256	广汇能源	36,000	235,440.00	0.70
29	300316	晶盛机电	3,200	222,400.00	0.66
30	603456	九洲药业	3,900	219,414.00	0.65
31	603986	兆易创新	1,100	193,435.00	0.57
32	300751	迈为股份	300	192,690.00	0.57
33	300037	新宙邦	1,700	192,100.00	0.57
34	300432	富临精工	6,500	191,100.00	0.57
35	603501	韦尔股份	600	186,462.00	0.55
36	600765	中航重机	3,600	181,764.00	0.54
37	601318	中国平安	3,600	181,476.00	0.54
38	300390	天华超净	2,200	178,200.00	0.53

39	000568	泸州老窖	700	177,709.00	0.53
40	300750	宁德时代	300	176,400.00	0.52
41	000651	格力电器	4,600	170,338.00	0.50
42	600809	山西汾酒	520	164,205.60	0.49
43	000725	京东方 A	29,700	149,985.00	0.44
44	300672	国科微	800	148,400.00	0.44
45	601668	中国建筑	28,600	143,000.00	0.42
46	000333	美的集团	1,900	140,239.00	0.42
47	601899	紫金矿业	14,100	136,770.00	0.41
48	603517	绝味食品	2,000	136,660.00	0.40
49	000661	长春高新	500	135,700.00	0.40
50	002049	紫光国微	600	135,000.00	0.40
51	601888	中国中免	600	131,646.00	0.39
52	600438	通威股份	2,900	130,384.00	0.39
53	300124	汇川技术	1,900	130,340.00	0.39
54	002041	登海种业	5,000	128,950.00	0.38
55	000519	中兵红箭	4,800	128,016.00	0.38
56	601601	中国太保	4,600	124,752.00	0.37
57	002539	云图控股	9,200	122,084.00	0.36
58	600104	上汽集团	5,800	119,654.00	0.35
59	000100	TCL 科技	19,200	118,464.00	0.35
60	002311	海大集团	1,600	117,280.00	0.35
61	001979	招商蛇口	8,700	116,058.00	0.34
62	300033	同花顺	800	115,664.00	0.34
63	000858	五粮液	500	111,330.00	0.33
64	600741	华域汽车	3,900	110,370.00	0.33
65	600111	北方稀土	2,400	109,920.00	0.33
66	601138	工业富联	9,000	107,280.00	0.32
67	600089	特变电工	5,000	105,850.00	0.31
68	002601	龙佰集团	3,700	105,783.00	0.31
69	002555	三七互娱	3,900	105,378.00	0.31
70	600018	上港集团	19,200	105,216.00	0.31
71	601128	常熟银行	15,900	105,099.00	0.31
72	600309	万华化学	1,000	101,000.00	0.30
73	002007	华兰生物	3,400	99,076.00	0.29
74	600346	恒力石化	4,300	98,771.00	0.29
75	601881	中国银河	8,800	98,472.00	0.29
76	601012	隆基股份	1,140	98,268.00	0.29
77	601100	恒立液压	1,200	98,160.00	0.29
78	601878	浙商证券	7,400	97,532.00	0.29
79	601225	陕西煤业	7,900	96,380.00	0.29
80	600705	中航产融	24,000	95,280.00	0.28

81	600760	中航沈飞	1,400	95,256.00	0.28
82	600183	生益科技	4,000	94,200.00	0.28
83	000425	徐工机械	15,500	92,845.00	0.28
84	300601	康泰生物	900	88,686.00	0.26
85	603882	金域医学	700	77,959.00	0.23
86	600900	长江电力	3,300	74,910.00	0.22
87	000733	振华科技	600	74,568.00	0.22
88	600803	新奥股份	4,000	73,440.00	0.22
89	300820	英杰电气	800	71,920.00	0.21
90	601155	新城控股	2,400	69,912.00	0.21
91	000063	中兴通讯	2,000	67,000.00	0.20
92	600019	宝钢股份	9,100	65,156.00	0.19
93	000799	酒鬼酒	300	63,750.00	0.19
94	600566	济川药业	2,100	59,514.00	0.18
95	600941	中国移动	1,000	57,580.00	0.17
96	600170	上海建工	15,400	55,440.00	0.16
97	600460	士兰微	1,000	54,200.00	0.16
98	002572	索菲亚	2,400	53,280.00	0.16
99	603260	合盛硅业	400	52,788.00	0.16
100	688099	晶晨股份	400	52,080.00	0.15
101	000625	长安汽车	3,300	50,127.00	0.15
102	601636	旗滨集团	2,900	49,590.00	0.15
103	000581	威孚高科	2,300	49,542.00	0.15
104	600845	宝信软件	800	48,664.00	0.14
105	002648	卫星化学	1,200	48,036.00	0.14
106	002543	万和电气	6,300	47,691.00	0.14
107	000630	铜陵有色	13,700	47,676.00	0.14
108	000988	华工科技	1,700	47,362.00	0.14
109	600329	中新药业	1,500	47,115.00	0.14
110	600862	中航高科	1,300	46,488.00	0.14
111	300418	昆仑万维	2,000	46,300.00	0.14
112	600820	隧道股份	8,600	46,268.00	0.14
113	002212	天融信	2,400	46,008.00	0.14
114	300398	飞凯材料	1,900	45,904.00	0.14
115	600141	兴发集团	1,200	45,456.00	0.13
116	603486	科沃斯	300	45,285.00	0.13
117	002412	汉森制药	7,100	45,085.00	0.13
118	000636	风华高科	1,500	44,700.00	0.13
119	000807	云铝股份	4,000	44,680.00	0.13
120	000039	中集集团	2,600	44,616.00	0.13
121	000623	吉林敖东	2,400	44,328.00	0.13
122	603077	和邦生物	12,800	43,648.00	0.13

123	000778	新兴铸管	10,000	43,300.00	0.13
124	600195	中牧股份	3,300	43,131.00	0.13
125	600867	通化东宝	3,900	42,744.00	0.13
126	000830	鲁西化工	2,800	42,728.00	0.13
127	002266	浙富控股	6,000	42,720.00	0.13
128	600348	华阳股份	3,600	42,660.00	0.13
129	002030	达安基因	2,120	42,527.20	0.13
130	600728	佳都科技	5,100	42,483.00	0.13
131	603444	吉比特	100	42,185.00	0.13
132	600704	物产中大	7,100	42,032.00	0.12
133	000565	渝三峡 A	6,300	42,021.00	0.12
134	600211	西藏药业	800	41,888.00	0.12
135	601699	潞安环能	3,700	41,847.00	0.12
136	601615	明阳智能	1,600	41,760.00	0.12
136	603596	伯特利	600	41,760.00	0.12
138	000598	兴蓉环境	6,600	41,712.00	0.12
139	600057	厦门象屿	4,900	41,601.00	0.12
140	002048	宁波华翔	1,900	41,097.00	0.12
141	000686	东北证券	4,600	40,388.00	0.12
142	601866	中远海发	12,400	40,300.00	0.12
143	300244	迪安诊断	1,200	40,284.00	0.12
144	002002	鸿达兴业	6,600	39,996.00	0.12
145	601000	唐山港	14,500	39,875.00	0.12
146	300369	绿盟科技	2,500	39,650.00	0.12
147	000062	深圳华强	2,300	39,629.00	0.12
148	300009	安科生物	3,000	39,270.00	0.12
149	603599	广信股份	1,000	39,000.00	0.12
150	000825	太钢不锈	5,500	38,720.00	0.11
151	688357	建龙微纳	200	38,388.00	0.11
152	603927	中科软	1,401	38,331.36	0.11
153	600064	南京高科	4,100	38,294.00	0.11
154	002180	纳思达	800	38,208.00	0.11
155	000671	阳光城	12,600	38,052.00	0.11
156	000930	中粮科技	3,500	38,045.00	0.11
157	300463	迈克生物	1,300	37,947.00	0.11
158	600956	新天绿能	2,200	37,862.00	0.11
159	000559	万向钱潮	5,900	37,583.00	0.11
160	600808	马钢股份	10,100	37,269.00	0.11
161	600446	金证股份	2,600	37,232.00	0.11
162	600901	江苏租赁	7,295	37,131.55	0.11
163	002815	崇达技术	2,200	37,070.00	0.11
164	600908	无锡银行	6,500	36,855.00	0.11

165	603115	海星股份	1,400	36,680.00	0.11
166	002532	天山铝业	4,500	36,675.00	0.11
167	002415	海康威视	700	36,624.00	0.11
168	002860	星帅尔	1,500	36,600.00	0.11
169	000537	广宇发展	1,500	36,150.00	0.11
170	605066	天正电气	3,100	36,022.00	0.11
171	600373	中文传媒	2,900	35,844.00	0.11
172	603589	口子窖	500	35,435.00	0.11
173	000657	中钨高新	2,200	35,376.00	0.10
174	002396	星网锐捷	1,500	35,355.00	0.10
175	605180	华生科技	1,000	35,300.00	0.10
176	601006	大秦铁路	5,500	35,200.00	0.10
177	002156	通富微电	1,800	34,974.00	0.10
178	688017	绿的谐波	200	34,912.00	0.10
179	300880	迦南智能	1,400	34,580.00	0.10
179	600623	华谊集团	3,800	34,580.00	0.10
181	002553	南方轴承	3,200	34,240.00	0.10
182	601009	南京银行	3,800	34,048.00	0.10
183	002416	爱施德	2,900	33,002.00	0.10
184	600682	南京新百	2,800	32,928.00	0.10
185	300474	景嘉微	200	30,440.00	0.09
186	000959	首钢股份	5,200	29,796.00	0.09
187	000685	中山公用	3,200	28,320.00	0.08
188	600188	兖矿能源	1,200	28,236.00	0.08
189	605117	德业股份	100	27,379.00	0.08
190	002594	比亚迪	100	26,812.00	0.08
191	600271	航天信息	2,000	26,780.00	0.08
192	603868	飞科电器	600	26,052.00	0.08
193	000683	远兴能源	3,500	25,550.00	0.08
194	605358	立昂微	200	24,002.00	0.07
195	600885	宏发股份	300	22,392.00	0.07
196	002233	塔牌集团	2,000	21,160.00	0.06
197	600177	雅戈尔	3,000	20,670.00	0.06
198	002179	中航光电	200	20,112.00	0.06
199	002867	周大生	1,100	19,558.00	0.06
200	600511	国药股份	600	18,918.00	0.06
201	600325	华发股份	3,100	18,662.00	0.06
202	600655	豫园股份	1,800	18,540.00	0.05
203	600487	亨通光电	1,200	18,144.00	0.05
204	002961	瑞达期货	700	17,248.00	0.05
205	002839	张家港行	2,900	16,704.00	0.05
206	000960	锡业股份	800	15,624.00	0.05



207	600276	恒瑞医药	300	15,213.00	0.05
208	603833	欧派家居	100	14,750.00	0.04
209	002460	赣锋锂业	100	14,285.00	0.04
210	603893	瑞芯微	100	13,690.00	0.04
211	601233	桐昆股份	600	12,708.00	0.04
212	601126	四方股份	600	12,540.00	0.04
213	002191	劲嘉股份	800	12,104.00	0.04
214	603259	药明康德	100	11,858.00	0.04
215	603165	荣晟环保	600	11,562.00	0.03
216	002709	天赐材料	100	11,465.00	0.03
217	002088	鲁阳节能	420	10,920.00	0.03
218	002985	北摩高科	90	10,841.40	0.03
219	300582	英飞特	500	10,815.00	0.03
220	002540	亚太科技	1,400	10,780.00	0.03
221	600390	五矿资本	2,000	10,640.00	0.03
222	002100	天康生物	900	9,630.00	0.03
223	600707	彩虹股份	1,400	9,548.00	0.03
224	001296	长江材料	161	9,544.08	0.03
225	002443	金洲管道	1,200	9,492.00	0.03
226	601088	中国神华	400	9,008.00	0.03
227	000030	富奥股份	1,200	8,904.00	0.03
228	601928	凤凰传媒	1,100	8,899.00	0.03
229	002293	罗莱生活	600	8,598.00	0.03
230	600023	浙能电力	2,100	8,484.00	0.03
231	002884	凌霄泵业	300	8,391.00	0.02
232	600475	华光环能	700	8,288.00	0.02
233	600153	建发股份	900	8,163.00	0.02
234	600585	海螺水泥	200	8,060.00	0.02
235	688378	奥来德	100	8,010.00	0.02
236	600548	深高速	800	7,984.00	0.02
237	603458	勘设股份	600	7,950.00	0.02
238	600376	首开股份	1,400	7,924.00	0.02
239	002244	滨江集团	1,700	7,922.00	0.02
240	600729	重庆百货	300	7,806.00	0.02
241	600801	华新水泥	400	7,720.00	0.02
242	000690	宝新能源	1,300	7,696.00	0.02
243	002327	富安娜	900	7,686.00	0.02
244	601098	中南传媒	800	7,656.00	0.02
245	600894	广日股份	1,000	7,540.00	0.02
246	600502	安徽建工	1,800	7,470.00	0.02
247	600643	爱建集团	1,100	7,436.00	0.02
248	000429	粤高速 A	1,000	7,400.00	0.02

249	000789	万年青	600	7,332.00	0.02
250	600449	宁夏建材	600	7,218.00	0.02
251	000656	金科股份	1,600	7,168.00	0.02
252	600971	恒源煤电	1,100	7,106.00	0.02
253	000069	华侨城 A	1,000	7,040.00	0.02
254	600282	南钢股份	1,900	7,030.00	0.02
255	600757	长江传媒	1,300	6,955.00	0.02
256	600377	宁沪高速	800	6,896.00	0.02
257	002157	正邦科技	700	6,762.00	0.02
258	000006	深振业 A	1,500	6,690.00	0.02
259	600066	宇通客车	600	6,612.00	0.02
260	600823	世茂股份	2,000	6,560.00	0.02
261	002146	荣盛发展	1,500	6,525.00	0.02
262	000550	江铃汽车	400	6,524.00	0.02
263	600606	绿地控股	1,500	6,510.00	0.02
264	600755	厦门国贸	900	6,489.00	0.02
265	002381	双箭股份	800	6,464.00	0.02
266	002367	康力电梯	800	6,424.00	0.02
267	000961	中南建设	1,500	6,210.00	0.02
268	600327	大东方	1,000	5,950.00	0.02
269	601886	江河集团	900	5,931.00	0.02
270	002887	绿茵生态	600	5,874.00	0.02
271	603355	莱克电气	200	5,864.00	0.02
272	603156	养元饮品	200	5,682.00	0.02
273	600350	山东高速	1,100	5,676.00	0.02
274	603757	大元泵业	300	5,490.00	0.02
275	002110	三钢闽光	800	5,440.00	0.02
276	002434	万里扬	300	4,422.00	0.01
277	601992	金隅集团	1,300	3,692.00	0.01
278	001234	泰慕士	175	2,892.75	0.01
279	601988	中国银行	200	610.00	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	600276	恒瑞医药	5,783,511.71	3.25
2	300122	智飞生物	5,264,525.00	2.96
3	603501	韦尔股份	5,221,028.00	2.94
4	601919	中远海控	5,196,432.00	2.92
5	002241	歌尔股份	4,872,137.64	2.74
6	601166	兴业银行	4,801,752.00	2.70

7	300124	汇川技术	4,216,069.00	2.37
8	002157	正邦科技	3,867,643.00	2.18
9	000895	双汇发展	3,736,860.00	2.10
10	000001	平安银行	3,691,298.00	2.08
11	600809	山西汾酒	3,479,803.00	1.96
12	002508	老板电器	3,472,338.72	1.95
13	600522	中天科技	3,351,870.00	1.89
14	600887	伊利股份	3,304,098.00	1.86
15	600352	浙江龙盛	3,225,049.00	1.81
16	600900	长江电力	3,158,384.29	1.78
17	002202	金风科技	3,121,972.50	1.76
18	002027	分众传媒	3,070,101.00	1.73
19	600036	招商银行	3,042,149.00	1.71
20	601939	建设银行	2,917,832.00	1.64

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。

#### 8.4.2 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	601166	兴业银行	8,308,735.00	4.67
2	600036	招商银行	7,647,771.00	4.30
3	000333	美的集团	6,843,450.89	3.85
4	002415	海康威视	6,811,358.00	3.83
5	601939	建设银行	6,785,847.00	3.82
6	300059	东方财富	6,577,884.37	3.70
7	000858	五粮液	5,889,929.65	3.31
8	600519	贵州茅台	5,862,234.00	3.30
9	601318	中国平安	5,861,188.15	3.30
10	000895	双汇发展	5,834,618.00	3.28
11	000661	长春高新	5,695,163.00	3.20
12	002202	金风科技	5,610,684.25	3.16
13	300122	智飞生物	5,317,089.00	2.99
14	603501	韦尔股份	5,273,985.00	2.97
15	600276	恒瑞医药	5,075,620.86	2.85
16	601009	南京银行	5,037,426.00	2.83
17	601899	紫金矿业	4,945,575.00	2.78
18	600104	上汽集团	4,831,874.00	2.72
19	000157	中联重科	4,738,757.00	2.67
20	000776	广发证券	4,664,481.00	2.62
21	000166	申万宏源	4,641,069.00	2.61
22	601919	中远海控	4,629,148.96	2.60
23	002241	歌尔股份	4,407,725.08	2.48

24	601985	中国核电	4,364,539.67	2.45
25	603259	药明康德	4,299,198.98	2.42
26	600048	保利发展	4,113,897.00	2.31
27	300124	汇川技术	3,818,336.90	2.15
28	600352	浙江龙盛	3,605,240.00	2.03

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。

#### 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	245,813,173.55
卖出股票收入（成交）总额	375,912,875.11

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

无。

#### 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

无。

#### 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

无。

#### 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

无。

#### 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

无。

#### 8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

无。

#### 8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

无。

#### 8.12 投资组合报告附注

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

1. 本基金投资的前十名证券之一招商银行（600036.SH）的发行主体招商银行股份有限公司于

2021 年 5 月 17 日因为同业投资提供第三方信用担保、为非保本理财产品出具保本承诺，部分未按规定计提风险加权资产等，受到中国银行保险监督管理委员会处罚（银保监罚决字（2021）16 号）。本基金认为，对招商银行的处罚不会对其投资价值构成实质性负面影响。

2. 本基金投资的前十名证券之一邮储银行（601658.SH）的发行主体中国邮政储蓄银行股份有限公司于 2021 年 6 月 22 日因违规向部分客户收取唯一账户年费和小额账户管理费等，受到中国银行保险监督管理委员会处罚（银保监罚决字（2021）23 号），于 2021 年 8 月 13 日因违反账户管理相关规定，受到中国人民银行处罚（银罚字（2021）16 号）。本基金认为，对邮储银行的处罚不会对其投资价值构成实质性负面影响。

3. 本基金投资的前十名证券之一交通银行（601328.SH）的发行主体交通银行股份有限公司于 2021 年 7 月 13 日因理财业务和同业业务制度不健全等，受到中国银行保险监督管理委员会处罚（银保监罚决字（2021）28 号），于 2021 年 8 月 13 日因违反信用信息采集、提供、查询及相关管理规定，受到中国人民银行处罚（银罚字（2021）23 号）。本基金认为，对交通银行的处罚不会对其投资价值构成实质性负面影响。

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

5. 本基金投资的前十名证券之一宁波银行（002142.SZ）的发行主体宁波银行股份有限公司于 2021 年 12 月 29 日因信用卡业务管理不到位，受到宁波银保监局处罚（甬银保监罚决字（2021）81 号）。本基金认为，对宁波银行的处罚不会对其投资价值构成实质性负面影响。

## 8.12.2 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。

## 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	5,319.13
2	应收证券清算款	37,772.27
3	应收股利	-
4	应收利息	772.26
5	应收申购款	980.37
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	44,844.03

## 8.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

无。

## 8.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

无。

## 8.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入原因，分项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 (%)
2,223	9,483.17	49,539.74	0.23	21,031,556.72	99.77

注：持有人户数为有效户数，即存量份额大于零的账户。

## 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	1,202.81	0.0057

## 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	0~10
本基金基金经理持有本开放式基金	0

## 9.4 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理本人及其直系亲属持有本人管理的产品情况

无。

## § 10 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日 (2010 年 6 月 22 日) 基金份额总额	1,173,262,454.69
-------------------------------------	------------------

本报告期期初基金份额总额	115,003,796.49
本报告期基金总申购份额	38,727,965.63
减：本报告期基金总赎回份额	132,650,665.66
本报告期基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-
本报告期期末基金份额总额	21,081,096.46

## § 11 重大事件揭示

### 11.1 基金份额持有人大会决议

无。

### 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

#### 一、基金管理人的重大人事变动

- 2021 年 9 月 3 日, 经大成基金管理有限公司 2021 年第四次临时股东会审议通过, 选举陈勇先生担任公司股东监事, 许国平先生不再担任公司股东监事。
- 2021 年 9 月 3 日, 经大成基金管理有限公司第七届监事会第六次会议审议通过, 选举陈勇先生担任公司第七届监事会监事会主席。

#### 二、基金托管人的基金托管部门的重大人事变动

中国工商银行股份有限公司（以下简称“本公司”）根据工作需要, 任命刘彤女士担任本公司资产托管部总经理, 全面主持资产托管部相关工作。刘彤女士的托管人高级管理人员任职信息已经在中国证券投资基金业协会备案。李勇先生不再担任本公司资产托管部总经理职务。

### 11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

无。

### 11.4 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。

### 11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金聘任的为本基金审计的会计师事务所为安永华明会计师事务所(特殊普通合伙), 本年度应支付的审计费用为 65,000.00 元整。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。

### 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, 基金管理人、托管人及其相关高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

## 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

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
申万宏源	1	189,807,561.38	30.65%	172,972.56	30.65%	-
长江证券	1	167,241,223.18	27.00%	152,405.05	27.00%	-
东方证券	1	162,919,314.87	26.31%	148,471.59	26.31%	-
光大证券	1	89,624,768.75	14.47%	81,675.28	14.47%	-
中信证券	1	9,704,907.23	1.57%	8,843.79	1.57%	-
海通证券	1	-	-	-	-	-
招商证券	2	-	-	-	-	-
中金公司	1	-	-	-	-	-

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：招商证券、中金公司

本报告期内退租交易单元：无

### 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	
	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
东方证券	15,286.30	50.82%	-	-	-	-
光大证券	14,791.10	49.18%	-	-	-	-

### 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	关于再次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 12 月 31 日
2	关于旗下部分公开募集证券投资基金可投资北京证券交易所股票及相关风险提示的公告	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 11 月 16 日
3	关于终止晋城银行股份有限公司办理本公司旗下基金销售业务的公告	中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站	2021 年 11 月 12 日
4	大成核心双动力混合型证券投资基金 2021 年第 3 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 10 月 27 日
5	大成核心双动力混合型证券投资基金更新招募说明书	中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站	2021 年 09 月 06 日
6	大成核心双动力混合型证券投资基金基金产品资料概要更新	中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站	2021 年 09 月 06 日
7	大成核心双动力混合型证券投资基金基金经理变更公告	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 09 月 03 日
8	大成核心双动力混合型证券投资基金 2021 年中期报告	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 08 月 31 日
9	大成基金管理有限公司旗下 122 只公募基金 2021 年中期报告提示性公告	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 08 月 31 日
10	大成核心双动力混合型证券投资基金基金产品资料概要更新	中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站	2021 年 08 月 27 日
11	大成基金管理有限公司关于变更分红方式业务规则的公告	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 08 月 14 日
12	大成核心双动力混合型证券投资基金更新招募说明书	中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本	2021 年 07 月 22 日

		公司网站	
13	大成核心双动力混合型证券投资基金 2021 年第 2 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 07 月 21 日
14	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 06 月 30 日
15	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 05 月 27 日
16	大成基金管理有限公司关于旗下部分基金增加腾安基金销售（深圳）有限公司为销售机构的公告	中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站	2021 年 05 月 18 日
17	大成核心双动力混合型证券投资基金 2021 年第 1 季度报告	中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站	2021 年 04 月 22 日
18	大成核心双动力混合型证券投资基金 2020 年年度报告	中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站	2021 年 03 月 30 日
19	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 03 月 23 日
20	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 03 月 11 日
21	大成基金管理有限公司关于大成核心双动力混合型证券投资基金开展赎回费率优惠活动的公告	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 03 月 10 日
22	大成基金管理有限公司关于基金经理张钟玉女士恢复履行职务的公告	中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站	2021 年 01 月 25 日
23	大成核心双动力混合型证券投资基金第四季度报告	中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站	2021 年 01 月 22 日
24	大成基金管理有限公司大成核心双动力混合型证券投资基金开展赎回费率优惠活动的公告	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 01 月 08 日

## § 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

投资者类	报告期内持有基金份额变化情况	报告期末持有基金情况
------	----------------	------------

别	序号	持有基金份额比例达到或者超过20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比(%)
机构	1	20210107-20210308	22,058,088.24	-	22,058,088.24	-	-
	2	20210107-20210108	21,738,405.80	-	21,738,405.80	-	-
	3	20210311-20210311	10,683,048.43	-	10,683,048.43	-	-
产品特有风险							
当基金份额持有人占比过于集中时，可能会因某单一基金份额持有人大额赎回而引发基金净值剧烈波动的风险，甚至有可能引起基金的流动性风险，基金管理人可能无法及时变现基金资产以应对基金份额持有人的赎回申请，基金份额持有人可能无法及时赎回持有的全部基金份额。							

## 12.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

## § 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大成核心双动力股票型证券投资基金的文件；
- 2、《大成核心双动力混合型证券投资基金基金合同》；
- 3、《大成核心双动力混合型证券投资基金基金托管协议》；
- 4、《大成核心双动力股票型证券投资基金变更基金名称、基金类别以及修订基金合同部分条款的公告》；
- 5、大成基金管理有限公司批准文件、营业执照、公司章程；
- 6、本报告期内在规定报刊上披露的各种公告原稿。

### 13.2 存放地点

备查文件存放在本基金管理人和托管人的住所。

### 13.3 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

2022 年 3 月 29 日