

# 大成行业轮动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：中国农业银行股份有限公司

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。

基金托管人中国农业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	13
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	13
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明	14
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	15
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况	15
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	16
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	17
4.9 管理人对会计师事务所出具非标准审计报告所涉相关事项的说明	17
4.10 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明	17
<b>§ 5 托管人报告</b>	<b>17</b>
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	17
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	17
5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	17
<b>§ 6 审计报告</b>	<b>18</b>
<b>§ 7 年度财务报表</b>	<b>19</b>
7.1 资产负债表	19
7.2 利润表	21
7.3 所有者权益（基金净值）变动表	22
7.4 报表附注	23
<b>§ 8 投资组合报告</b>	<b>46</b>
8.1 期末基金资产组合情况	46

8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合 .....	47
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 .....	47
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动 .....	56
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合 .....	59
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 .....	60
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 .....	60
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 .....	60
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 .....	60
8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明 .....	60
8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 .....	60
8.12 投资组合报告附注 .....	60
<b>§ 9 基金份额持有人信息 .....</b>	<b>61</b>
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....	61
9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....	61
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 .....	61
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 .....	62
<b>§ 10 开放式基金份额变动 .....</b>	<b>62</b>
<b>§ 11 重大事件揭示 .....</b>	<b>62</b>
11.1 基金份额持有人大会决议 .....	62
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 .....	62
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....	62
11.4 基金投资策略的改变 .....	62
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....	63
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 .....	63
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	63
11.8 其他重大事件 .....	65
<b>§ 12 影响投资者决策的其他重要信息 .....</b>	<b>67</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 .....	67
12.2 影响投资者决策的其他重要信息 .....	67
<b>§ 13 备查文件目录 .....</b>	<b>67</b>
13.1 备查文件目录 .....	67
13.2 存放地点 .....	67
13.3 查阅方式 .....	67

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	大成行业轮动混合型证券投资基金
基金简称	大成行业轮动混合
基金主代码	090009
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2009 年 9 月 8 日
基金管理人	大成基金管理有限公司
基金托管人	中国农业银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	44,921,810.66 份
基金合同存续期	不定期

### 2.2 基金产品说明

投资目标	利用行业轮动效应，优化行业配置，获取超额投资收益，实现基金资产长期稳健增值。
投资策略	本基金将重点围绕我国经济周期动力机制与发展规律，研究我国国民经济发展过程中的结构化特征，捕捉行业轮动效应下的投资机会，自上而下的实施大类资产间的战略配置和股票类别间的战术配置，精选优质行业的优质股票，获取超额投资收益，实现基金资产的长期稳健增值。
业绩比较基准	80%×沪深 300 指数+20%×中证综合债券指数
风险收益特征	本基金为混合型基金，属于证券投资基金中预期风险和预期收益适中的品种，其预期风险和预期收益低于股票型基金，高于债券型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	中国农业银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	赵冰	秦一楠
	联系电话	0755-83183388	010-66060069
	电子邮箱	office@dcfund.com.cn	tgxxpl@abchina.com
客户服务电话		4008885558	95599
传真		0755-83199588	010-68121816
注册地址		深圳市福田区深南大道 7088 号招商银行大厦 32 层	北京市东城区建国门内大街 69 号
办公地址		深圳市福田区深南大道 7088 号招商银行大厦 32 层	北京市西城区复兴门内大街 28 号凯晨世贸中心东座 F9
邮政编码		518040	100031
法定代表人		吴庆斌	谷澍

### 2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《上海证券报》
登载基金年度报告正文的管理人互联网网	<a href="http://www.dcfund.com.cn">http://www.dcfund.com.cn</a>

址	
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	44,339,832.62	64,167,085.75	20,152,727.13
本期利润	33,128,065.84	74,533,445.40	59,805,492.08
加权平均基金份额本期利润	0.7143	1.1815	0.6434
本期加权平均净值利润率	21.54%	51.50%	42.48%
本期基金份额净值增长率	23.63%	66.29%	53.23%
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	114,772,874.57	79,761,095.04	45,097,447.18
期末可供分配基金份额利润	2.5549	1.5894	0.5591
期末基金资产净值	170,641,261.15	154,207,898.01	149,072,053.84
期末基金份额净值	3.799	3.073	1.848
3.1.3 累计期末指标	2021 年末	2020 年末	2019 年末
基金份额	279.90%	207.30%	84.80%

累计净值 增长率			
-------------	--	--	--

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。

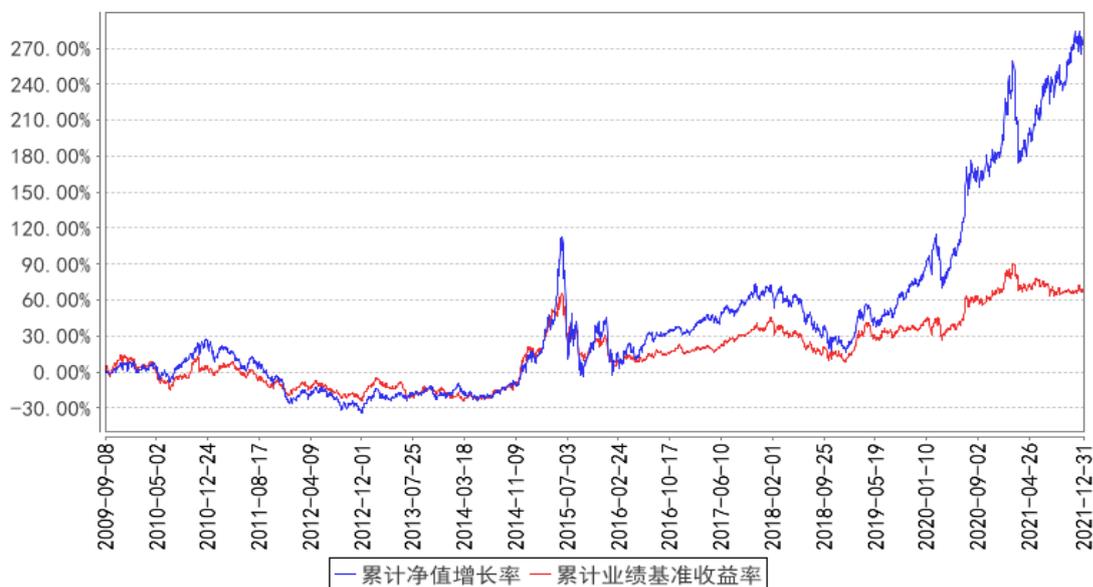
### 3.2 基金净值表现

#### 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	11.21%	1.09%	1.50%	0.63%	9.71%	0.46%
过去六个月	11.80%	1.29%	-3.70%	0.82%	15.50 %	0.47%
过去一年	23.63%	1.51%	-2.94%	0.94%	26.57 %	0.57%
过去三年	215.01%	1.48%	53.94%	1.03%	161.07 %	0.45%
过去五年	185.64%	1.38%	45.67%	0.96%	139.97 %	0.42%
自基金合同生效起 至今	279.90%	1.62%	68.97%	1.15%	210.93 %	0.47%

### 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

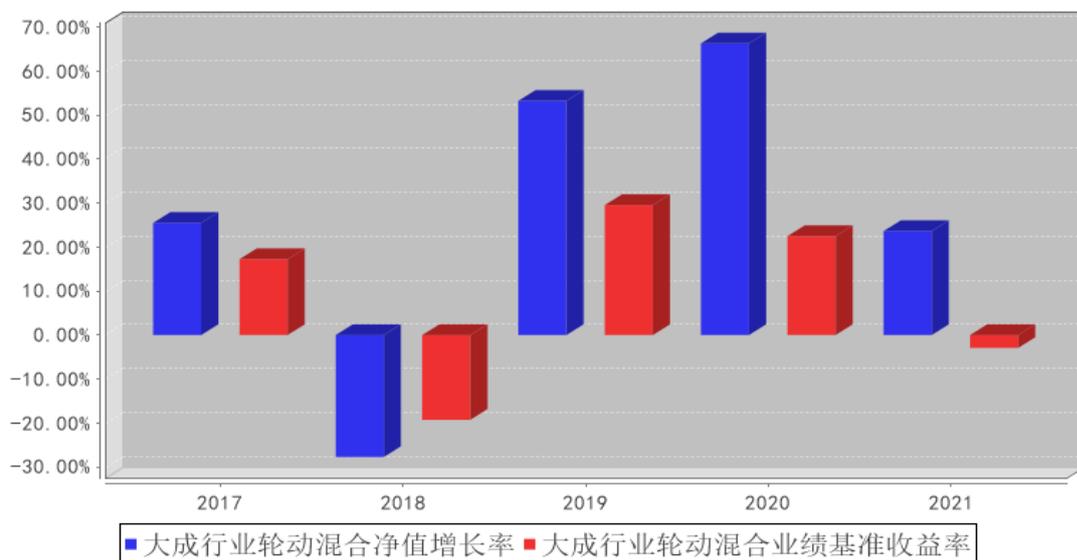
大成行业轮动混合累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：本基金合同规定，基金管理人应当自基金合同生效之日起六个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的约定。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。

### 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

大成行业轮动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



### 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		
王磊	本基金基金经理	2015 年 12 月 14 日	-	17 年	中国人民银行研究生部经济学硕士。2003 年 5 月至 2012 年 10 月曾任证券时报社公司新闻部记者、世纪证券投资银行部业务董事、国信证券经济研究所分析师及资产管理总部专户投资经理、中银基金管理有限公司专户理财部投资经理及总监（主持工作）。2012 年 11 月加入大成基金管理有限公司，曾担任社保基金及机构投资部投资经理、固定收益总部基金经理、股票投资部基金经理，现任股票投资部总监助理。2013 年 6 月 7 日至 2015 年 7 月 15 日任大成强化收益债券型证券投资基金基金经理。2015 年 7 月 16 日到 2016 年 3 月 25 日任大成强化收益定期开放债券型证券投资基金基金经理。2013 年 7 月 17 日到 2016 年 3 月 25 日任大成景恒保本混合型证券投资基金基金经理。2013 年 11 月 9 日到 2016 年 3 月 25 日任大成可转债增强债券型证券投资基金基金经理。2014 年 6 月 26 到 2016 年 3 月 25 日任大成景益平稳收益混合型证

					<p>券投资基金基金经理。2014 年 9 月 3 日至 2016 年 3 月 23 日任大成景丰债券型证券投资基金 (LOF) 基金经理。2014 年 12 月 9 日至 2016 年 3 月 25 日任大成景利混合型证券投资基金基金经理。2015 年 12 月 14 日起任大成行业轮动混合型证券投资基金基金经理。2016 年 11 月 11 日起担任大成景尚灵活配置混合型证券投资基金基金经理。2017 年 6 月 9 日起任大成积极成长混合型证券投资基金基金经理。2017 年 6 月 9 日起任大成灵活配置混合型证券投资基金基金经理。2017 年 9 月 21 日至 2019 年 1 月 9 日任大成国企改革灵活配置混合型证券投资基金基金经理。2017 年 12 月 1 日至 2020 年 10 月 30 日任大成财富管理 2020 生命周期证券投资基金基金经理。2020 年 3 月 5 日至 2021 年 12 月 1 日任大成恒享混合型证券投资基金基金经理。2020 年 3 月 31 日起任大成民稳增长混合型证券投资基金基金经理。2020 年 4 月 26 日起任大成景瑞稳健配置混合型证券投资基金基金经理。2020 年 9 月 3 日至 2021 年 9 月 17 日任大成汇享一年持有期混合型证券投资基金基金经理。2020 年 9 月 23 日至 2021 年 12 月 1 日任大成尊享 18 个月定期开放混合型证券投资基金基金经理。2020 年 11 月 16 日起任大成卓享一年持有期混合型证券投资基金基金经理。2020 年 11 月 18 日起任大成丰享回报混合型证券投资基金基金经理。2021 年 2 月 9 日起任大成恒享春晓一年定期开放混合型证券投资基金基金经理。2021 年 4 月 22 日起任大成安享得利六个月持有期混合型证券投资基金基金经理。具有基金从业资格。国籍：中国</p>
孙丹	本基金基金经理助理	2020 年 7 月 6 日	-	13 年	<p>美国德克萨斯 A&amp;M 大学经济学硕士。2008 年至 2012 年任景顺长城产品开发部产品经理。2012 年至 2014 年任华夏基金机构债券投资部研究员。2014 年 5 月加入大成基金管理有限公司，曾担任固定收益总部信用策略及宏观利率研究员、大成景辉灵活配置混合型证券投资基金、大成景荣保本混合型证券投资基金、大成景兴信用债债券型证券投资基金、大成景秀灵活配置混合型证券投资基金、大成景源灵活配置</p>

				<p>混合型证券投资基金基金经理助理，现任固定收益总部总监助理。2018 年 3 月 12 日起任大成策略回报混合型证券投资基金、大成创新成长混合型证券投资基金（LOF）、大成积极成长混合型证券投资基金、大成精选增值混合型证券投资基金、大成景阳领先混合型证券投资基金、大成竞争优势混合型证券投资基金、大成蓝筹稳健证券投资基金、大成优选混合型证券投资基金（LOF）基金经理助理。2020 年 7 月 1 日起任大成价值增长证券投资基金、大成多策略灵活配置混合型证券投资基金（LOF）、大成一带一路灵活配置混合型证券投资基金、大成内需增长混合型证券投资基金、大成睿景灵活配置混合型证券投资基金、大成盛世精选灵活配置混合型证券投资基金、大成国企改革灵活配置混合型证券投资基金、大成行业轮动混合型证券投资基金、大成灵活配置混合型证券投资基金、大成产业升级股票型证券投资基金（LOF）、大成健康产业混合型证券投资基金、大成正向回报灵活配置混合型证券投资基金、大成国家安全主题灵活配置混合型证券投资基金、大成新锐产业混合型证券投资基金、大成消费主题混合型证券投资基金基金经理助理。2020 年 11 月 6 日起任大成科技消费股票型证券投资基金、大成科创主题 3 年封闭运作灵活配置混合型证券投资基金（LOF）、大成睿享混合型证券投资基金、大成行业先锋混合型证券投资基金基金经理助理。2021 年 2 月 1 日起任大成企业能力驱动混合型证券投资基金、大成优选升级一年持有期混合型证券投资基金、大成成长进取混合型证券投资基金基金经理助理。2021 年 2 月 22 日起任大成恒享春晓一年定期开放混合型证券投资基金基金经理助理。2021 年 4 月 19 日起任大成民稳增长混合型证券投资基金基金经理助理。2021 年 4 月 19 日至 2021 年 8 月 4 日任大成恒享混合型证券投资基金基金经理助理。2021 年 7 月 29 日起任大成产业趋势混合型证券投资基金、大成投资严选六个月持有期混合型证券投资基金基金经理助理。2017 年 5 月 8 日起任大成景</p>
--	--	--	--	---

				<p>尚灵活配置混合型证券投资基金、大成景兴信用债债券型证券投资基金基金经理。</p> <p>2017 年 5 月 8 日至 2019 年 10 月 31 日任大成景荣债券型证券投资基金（原大成景荣保本混合型证券投资基金转型）基金经理。2017 年 5 月 31 日至 2020 年 10 月 20 日任大成惠裕定期开放纯债债券型证券投资基金基金经理。2017 年 6 月 2 日至 2018 年 11 月 19 日任大成景禄灵活配置混合型证券投资基金基金经理。2017 年 6 月 2 日至 2018 年 12 月 8 日任大成景源灵活配置混合型证券投资基金基金经理。2017 年 6 月 2 日至 2019 年 6 月 15 日任大成景秀灵活配置混合型证券投资基金。2017 年 6 月 6 日至 2019 年 9 月 29 日任大成惠明定期开放纯债债券型证券投资基金基金经理。2018 年 3 月 14 日至 2018 年 11 月 30 日任大成景辉灵活配置混合型证券投资基金基金经理。2018 年 3 月 14 日至 2018 年 11 月 30 日任大成景沛灵活配置混合型证券投资基金基金经理。2018 年 3 月 14 日至 2018 年 7 月 20 日任大成景裕灵活配置混合型证券投资基金基金经理。2018 年 3 月 14 日起任大成财富管理 2020 生命周期证券投资基金基金经理。2019 年 7 月 31 日至 2020 年 5 月 23 日任大成景丰债券型证券投资基金（LOF）基金经理。2020 年 2 月 27 日至 2021 年 4 月 13 日任大成景泰纯债债券型证券投资基金基金经理。2020 年 3 月 5 日至 2021 年 4 月 14 日任大成恒享混合型证券投资基金基金经理。2020 年 3 月 31 日至 2021 年 4 月 14 日任大成民稳增长混合型证券投资基金基金经理。2020 年 4 月 26 日起任大成景瑞稳健配置混合型证券投资基金基金经理。2020 年 8 月 21 日至 2021 年 5 月 18 日任大成景和债券型证券投资基金基金经理。2020 年 9 月 3 日至 2021 年 11 月 26 日任大成汇享一年持有期混合型证券投资基金基金经理。2020 年 9 月 23 日起任大成尊享 18 个月定期开放混合型证券投资基金基金经理。2020 年 11 月 16 日起任大成卓享一年持有期混合型证券投资基金基金经理。2020 年 11 月 18 日起任大成丰享回报混合型证券投资基金基金经理。2021 年 4 月 22 日起任大成安</p>
--	--	--	--	--

					享得利六个月持有期混合型证券投资基金基金经理。具有基金从业资格。国籍：中国
郭玮 羚	本基金基金经理	2021 年 1 月 26 日	-	6 年	对外经济贸易大学金融硕士。2015 年 7 月加入大成基金管理有限公司，先后担任研究部研究员、基金经理助理、基金经理，期间曾担任大成积极成长混合型证券投资基金、大成灵活配置混合型证券投资基金、大成行业轮动混合型证券投资基金基金经理助理。2021 年 1 月 26 日起任大成科技创新混合型证券投资基金、大成行业轮动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
郭玮 羚	本基金基金经理助理	2020 年 3 月 2 日	2021 年 1 月 26 日	6 年	对外经济贸易大学金融硕士。2015 年 7 月加入大成基金管理有限公司，先后担任研究部研究员、基金经理助理、基金经理，期间曾担任大成积极成长混合型证券投资基金、大成灵活配置混合型证券投资基金、大成行业轮动混合型证券投资基金基金经理助理。2021 年 1 月 26 日起任大成科技创新混合型证券投资基金、大成行业轮动混合型证券投资基金基金经理。具有基金从业资格。国籍：中国

注：1、任职日期、离任日期为本基金管理人作出决定之日。

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

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

无

#### 4.1.4 基金经理薪酬机制

无

#### 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

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

#### 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

##### 4.3.1 公平交易制度和控制方法

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，新冠疫情仍然在全球呈现高发的态势，这对全球经济的正常运行产生了较大的扰动。但由于我国仍然是疫情防控中表现最佳的经济体，因此全球其他地区对我国的产品有较大的需求，我国的出口仍然保持了较高的水平。同时，作为全球最大的经济体之一，我国的进口也相应增加，为全球经济注入了动力。

同时，在国内的经济方面，我国仍然致力于经济的长期的高质量可持续发展。我国坚持了新

能源作为经济发展的驱动力,对应的是新能源汽车和光伏产业,在 2021 年出现了较大幅度的增长。同时,我国也坚持了碳中和能耗双控措施,限制了部分高耗能和高污染行业的盲目扩张。

对应到整个的 A 股市场,2021 年,新能源汽车和光伏产业,以及电力设备板块仍然表现较好。同时,由于能耗双控叠加需求增加的因素,部分周期品价格也出现了较大幅度的上涨,其对应的上市公司股价同样表现较好。从 2021 年全年看,煤炭、钢铁、有色和基础化工等行业指数均出现了大幅上涨。

由于受到估值较高和需求扰动的影响,2021 年,消费品的表现较为不佳。医疗整体板块受到集采等因素的影响,也表现不佳。银行、非银、地产和家电等板块走势也较为一般。

2021 年,本产品适当增加了新能源产业相关板块的配置,获得了一定收益。

#### 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 3.799 元;本报告期基金份额净值增长率为 23.63%,业绩比较基准收益率为-2.94%。

#### 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,A 股市场仍然将受到国际宏观经济和国内宏观经济的影响,不确定的扰动因素仍然较多,A 股可能出现一个较为分化的行情。相对来说,我们较为看好受益于国内政策影响的基建相关板块、受益于苹果新产品周期的电子板块,以及全球经济恢复正常后能够受益的免税和旅游相关板块。同时,估值合理的品牌消费品和新能源板块,也是我们重点关注的方向。

#### 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、制度执行及遵规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

本基金管理人将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 管理人对会计师事务所出具非标准审计报告所涉相关事项的说明

无。

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

无。

## § 5 托管人报告

### 5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

在托管本基金的过程中，本基金托管人中国农业银行股份有限公司严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》相关法律法规的规定以及基金合同、托管协议的约定，对本基金基金管理人——大成基金管理有限公司 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日基金的投资运作，进行了认真、独立的会计核算和必要的投资监督，认真履行了托管人的义务，没有从事任何损害基金份额持有人利益的行为。

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

本托管人认为，大成基金管理有限公司在本基金的投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支及利润分配等问题上，不存在损害基金份额持有人利益的行为；在报告期内，严格遵守了《中华人民共和国证券投资基金法》等有关法律法规，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

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

本托管人认为，大成基金管理有限公司的信息披露事务符合《公开募集证券投资基金信息披

露管理办法》及其他相关法律法规的规定，基金管理人所编制和披露的本基金年度报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告等信息真实、准确、完整，未发现有损害基金持有人利益的行为。

## § 6 审计报告

审计报告标题	审计报告
审计报告收件人	大成行业轮动混合型证券投资基金全体基金份额持有人
审计意见	<p>我们审计了大成行业轮动混合型证券投资基金的财务报表（以下简称“大成行业轮动混合基金”），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，后附的大成行业轮动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，公允反映了大成行业轮动混合基金 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，我们独立于大成行业轮动混合基金，并履行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>
强调事项	无。
其他事项	无。
其他信息	<p>大成行业轮动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。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行业轮动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行业轮动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	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

任	<p>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，就可能导致对大成行业轮动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大成行业轮动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。</p> <p>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：大成行业轮动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	上年度末
----	-----	-----	------

		2021 年 12 月 31 日	2020 年 12 月 31 日
<b>资产：</b>			
银行存款	7.4.7.1	20,911,560.89	25,547,393.98
结算备付金		559,253.30	298,345.98
存出保证金		86,188.88	86,196.63
交易性金融资产	7.4.7.2	153,276,923.46	135,594,844.75
其中：股票投资		153,038,125.92	135,594,844.75
基金投资		-	-
债券投资		238,797.54	-
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		-	-
应收利息	7.4.7.5	4,109.64	8,326.91
应收股利		-	-
应收申购款		26,501.18	38,263.86
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.6	-	-
资产总计		174,864,537.35	161,573,372.11
<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>上年度末 2020 年 12 月 31 日</b>
<b>负 债：</b>			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	7.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		3,393,997.01	6,042,234.62
应付赎回款		82,860.82	685,553.16
应付管理人报酬		215,084.28	188,605.94
应付托管费		35,847.38	31,434.32
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	7.4.7.7	315,188.49	236,739.74
应交税费		0.69	-
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.8	180,297.53	180,906.32
负债合计		4,223,276.20	7,365,474.10
<b>所有者权益：</b>			
实收基金	7.4.7.9	44,921,810.66	50,184,698.40
未分配利润	7.4.7.10	125,719,450.49	104,023,199.61
所有者权益合计		170,641,261.15	154,207,898.01

负债和所有者权益总计		174,864,537.35	161,573,372.11
------------	--	----------------	----------------

注：报告截止日 2021 年 12 月 31 日，基金份额净值人民币 3.7986 元，基金份额总额 44,921,810.66 份。

## 7.2 利润表

会计主体：大成行业轮动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		37,861,034.68	79,114,152.97
1. 利息收入		168,531.76	143,233.51
其中：存款利息收入	7.4.7.11	168,286.97	143,159.27
债券利息收入		244.79	74.24
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）		48,865,784.69	68,533,792.68
其中：股票投资收益	7.4.7.12	48,184,131.11	67,451,578.93
基金投资收益	-	-	-
债券投资收益	7.4.7.13	87,883.27	47,575.25
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	593,770.31	1,034,638.50
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.17	-11,211,766.78	10,366,359.65
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	38,485.01	70,767.13
减：二、费用		4,732,968.84	4,580,707.57
1. 管理人报酬	7.4.10.2.1	2,307,901.27	2,171,086.35
2. 托管费	7.4.10.2.2	384,650.15	361,847.79
3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用	7.4.7.19	1,833,232.57	1,840,004.77

5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 税金及附加		0.88	0.25
7. 其他费用	7.4.7.20	207,183.97	207,768.41
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		33,128,065.84	74,533,445.40
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		33,128,065.84	74,533,445.40

### 7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：大成行业轮动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）	50,184,698.40	104,023,199.61	154,207,898.01
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	33,128,065.84	33,128,065.84
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）	-5,262,887.74	-11,431,814.96	-16,694,702.70
其中：1. 基金申购款	11,612,752.45	27,581,964.57	39,194,717.02
2. 基金赎回款	-16,875,640.19	-39,013,779.53	-55,889,419.72
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）	44,921,810.66	125,719,450.49	170,641,261.15
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)	80,655,810.21	68,416,243.63	149,072,053.84
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	74,533,445.40	74,533,445.40
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)	-30,471,111.81	-38,926,489.42	-69,397,601.23
其中：1. 基金申购款	25,588,064.56	34,155,106.56	59,743,171.12
2. 基金赎回款	-56,059,176.37	-73,081,595.98	-129,140,772.35
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)	50,184,698.40	104,023,199.61	154,207,898.01

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：

谭晓冈

温智敏

刘亚林

基金管理人负责人

主管会计工作负责人

会计机构负责人

## 7.4 报表附注

### 7.4.1 基金基本情况

大成行业轮动混合型证券投资基金(原名大成行业轮动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[2009]664号文《关于核准大成行业轮动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人募集,基金合同于2009年9月8日正式生效,首次设立募集规模为3,086,196,884.20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,基金托管人为中国农业银行股份有限公司(简称“中国农业银行”)。

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农业银行股份有限公司协商一致，自 2015 年 7 月 3 日起本基金名称变更为“大成行业轮动混合型证券投资基金”；基金简称变更为“大成行业轮动混合”；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。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。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%。

本基金的业绩比较为： $80\% \times \text{沪深 300 指数} + 20\% \times \text{中证综合债券指数}$ 。

#### 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。本期财务报表的实际编制期间系 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 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

持有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，每次分配比例不得低于收益分配基准日可供分配利润的 10%；并且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）的时间应不超过 15 个工作日；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按除权日的基金份额净值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) 基金收益分配后基金份额净值不能低于面值：即基金收益分配基准日的基金份额净值减去每单位基金份额收益分配金额后不能低于面值。

(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

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

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

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

日前运营过程中发生的增值税应税行为，未缴纳增值税的，不再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从资管产品管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。

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

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

### 3. 个人所得税

个人所得税税率为 20%。

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

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

暂免征收储蓄存款利息所得个人所得税。

## 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	20,911,560.89	25,547,393.98
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	20,911,560.89	25,547,393.98

## 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	130,772,053.36	153,038,125.92	22,266,072.56
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	238,797.54	99,997.54
	银行间市场	-	-
	合计	238,797.54	99,997.54
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	130,910,853.36	153,276,923.46	22,366,070.10
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	102,017,007.87	135,594,844.75	33,577,836.88
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	102,017,007.87	135,594,844.75	33,577,836.88

## 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	3,660.90	8,153.81
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	251.60	134.30
应收债券利息	158.34	-
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	38.80	38.80
合计	4,109.64	8,326.91

## 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	315,188.49	236,739.74
银行间市场应付交易费用	-	-
合计	315,188.49	236,739.74

## 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	297.53	906.32
应付证券出借违约金	-	-
预提费用	180,000.00	180,000.00
合计	180,297.53	180,906.32

## 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	50,184,698.40	50,184,698.40

本期申购	11,612,752.45	11,612,752.45
本期赎回（以“-”号填列）	-16,875,640.19	-16,875,640.19
本期末	44,921,810.66	44,921,810.66

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	79,761,095.04	24,262,104.57	104,023,199.61
本期利润	44,339,832.62	-11,211,766.78	33,128,065.84
本期基金份额交易产生的变动数	-9,328,053.09	-2,103,761.87	-11,431,814.96
其中：基金申购款	22,716,683.46	4,865,281.11	27,581,964.57
基金赎回款	-32,044,736.55	-6,969,042.98	-39,013,779.53
本期已分配利润	-	-	-
本期末	114,772,874.57	10,946,575.92	125,719,450.49

#### 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	159,614.41	135,729.18
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	7,342.78	6,063.35
其他	1,329.78	1,366.74
合计	168,286.97	143,159.27

#### 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	613,504,341.73	632,081,898.62
减：卖出股票成本总额	565,320,210.62	564,630,319.69
买卖股票差价收入	48,184,131.11	67,451,578.93

#### 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	217,977.30	330,651.54

减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	130,000.00	283,000.00
减：应收利息总额	94.03	76.29
买卖债券差价收入	87,883.27	47,575.25

#### 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	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
股票投资产生的股利收益	593,770.31	1,034,638.50
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	593,770.31	1,034,638.50

#### 7.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	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
1. 交易性金融资产	-11,211,766.78	10,366,359.65
股票投资	-11,311,764.32	10,366,359.65
债券投资	99,997.54	-
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	-11,211,766.78	10,366,359.65

## 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	31,899.47	66,024.99
基金转换费收入	6,585.54	4,742.14
合计	38,485.01	70,767.13

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

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

## 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	1,833,232.57	1,840,004.77
银行间市场交易费用	-	-
合计	1,833,232.57	1,840,004.77

## 7.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年12月 31日	上年度可比期间 2020年1月1日至2020年12月31日
审计费用	60,000.00	60,000.00
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	9,183.97	9,768.41
账户维护费	18,000.00	18,000.00
合计	207,183.97	207,768.41

## 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
中国农业银行股份有限公司(“农业银	基金托管人、基金销售机构

行”)	
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 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	235,508,836.72	19.59	89,766,041.50	7.62

###### 7.4.10.1.2 债券交易

无。

###### 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	214,628.03	19.59	157,621.87	50.01
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	81,803.62	7.62	15,615.00	6.60

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	2,307,901.27	2,171,086.35
其中：支付销售机构的客户维护费	707,325.55	570,120.34

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 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托管费	384,650.15	361,847.79

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
中国农业银行	20,911,560.89	159,614.41	25,547,393.98	135,729.18

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	333	5,504.49	5,504.49	-
301078	孩子王	2021 年 9 月 30 日	2022 年 4 月 14 日	新股锁定	5.77	12.14	453	2,613.81	5,499.42	-
301079	邵阳液压	2021 年 10 月 11 日	2022 年 4 月 19 日	新股锁定	11.92	24.82	140	1,668.80	3,474.80	-
301083	百胜智能	2021 年 10 月 13 日	2022 年 4 月 21 日	新股锁定	9.08	14.21	416	3,777.28	5,911.36	-
301088	戎美股份	2021 年 10 月 19 日	2022 年 4 月 28 日	新股锁定	33.16	24.67	125	4,145.00	3,083.75	-
301089	拓新药业	2021 年 10 月 20 日	2022 年 4 月 27 日	新股锁定	19.11	67.93	154	2,942.94	10,461.22	-
301091	深城交	2021 年 10 月 20 日	2022 年 4 月 29 日	新股锁定	36.50	31.31	149	5,438.50	4,665.19	-
301092	争光股份	2021 年 10 月 21 日	2022 年 5 月 5 日	新股锁定	36.31	35.52	97	3,522.07	3,445.44	-
301093	华兰股份	2021 年 10 月 21 日	2022 年 5 月 5 日	新股锁定	58.08	49.85	90	5,227.20	4,486.50	-
301138	华研精机	2021 年 12 月 8 日	2022 年 6 月 15 日	新股锁定	26.17	44.86	156	4,082.52	6,998.16	-
301149	隆华新材	2021 年 11 月 3 日	2022 年 5 月 10 日	新股锁定	10.07	16.76	561	5,649.27	9,402.36	-
301179	泽宇智能	2021 年 12 月 1 日	2022 年 6 月 8 日	新股锁定	43.99	50.77	95	4,179.05	4,823.15	-

301182	凯旺科技	2021年12月16日	2022年6月23日	新股锁定	27.12	30.58	186	5,044.32	5,687.88	-
301188	力诺特玻	2021年11月4日	2022年5月11日	新股锁定	13.00	20.48	440	5,720.00	9,011.20	-
301190	善水科技	2021年12月17日	2022年6月24日	新股锁定	27.85	27.46	156	4,344.60	4,283.76	-
301193	家联科技	2021年12月2日	2022年6月9日	新股锁定	30.73	29.14	149	4,578.77	4,341.86	-
301221	光庭信息	2021年12月15日	2022年6月22日	新股锁定	69.89	88.72	76	5,311.64	6,742.72	-
688038	中科通达	2021年7月5日	2022年1月13日	新股锁定	8.60	18.72	2,132	18,335.20	39,911.04	-
688091	上海谊众	2021年9月1日	2022年3月9日	新股锁定	38.10	42.81	1,054	40,157.40	45,121.74	-
688296	和达科技	2021年7月19日	2022年1月27日	新股锁定	12.46	49.67	766	9,544.36	38,047.22	-
688303	大全能源	2021年7月15日	2022年1月24日	新股锁定	21.49	60.51	3,094	66,490.06	187,217.94	-

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

无。

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

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

于本期末，本基金持有的除国债、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 0.14%（上年度末：0.00%）。

#### 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。

##### 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。于本期末，本基金持有的流动性受限资产的估值占基金资产净值的比例未超过 15%，且本基金组合资产中 7 个工作日可变现资产未超过最近工作日确认的净赎回金额。

本基金主要投资于上市交易的证券，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

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

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

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

##### 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	20,911,560.89	-	-	-	20,911,560.89
结算备付金	559,253.30	-	-	-	559,253.30
存出保证金	86,188.88	-	-	-	86,188.88
交易性金融资产	-	-	238,797.54	153,038,125.92	153,276,923.46
应收利息	-	-	-	4,109.64	4,109.64
应收申购款	-	-	-	26,501.18	26,501.18
资产总计	21,557,003.07	-	238,797.54	153,068,736.74	174,864,537.35
负债					
应付赎回款	-	-	-	82,860.82	82,860.82
应付管理人报酬	-	-	-	215,084.28	215,084.28

应付托管费	-	-	-	35,847.38	35,847.38
应付证券清算款	-	-	-	3,393,997.01	3,393,997.01
应付交易费用	-	-	-	315,188.49	315,188.49
应交税费	-	-	-	0.69	0.69
其他负债	-	-	-	180,297.53	180,297.53
负债总计	-	-	-	4,223,276.20	4,223,276.20
利率敏感度缺口	21,557,003.07	-	238,797.54	148,845,460.54	170,641,261.15
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	25,547,393.98	-	-	-	25,547,393.98
结算备付金	298,345.98	-	-	-	298,345.98
存出保证金	86,196.63	-	-	-	86,196.63
交易性金融资产	-	-	-	135,594,844.75	135,594,844.75
应收利息	-	-	-	8,326.91	8,326.91
应收申购款	-	-	-	38,263.86	38,263.86
资产总计	25,931,936.59	-	-	135,641,435.52	161,573,372.11
负债					
应付赎回款	-	-	-	685,553.16	685,553.16
应付管理人报酬	-	-	-	188,605.94	188,605.94
应付托管费	-	-	-	31,434.32	31,434.32
应付证券清算款	-	-	-	6,042,234.62	6,042,234.62
应付交易费用	-	-	-	236,739.74	236,739.74
其他负债	-	-	-	180,906.32	180,906.32
负债总计	-	-	-	7,365,474.10	7,365,474.10
利率敏感度缺口	25,931,936.59	-	-	128,275,961.42	154,207,898.01

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，本基金持有的交易性债券投资占基金资产净值的比例为 0.14%(上年度末：未持有)，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的股票，所面临的最大市场价格风险由所持有的金融工具的公允价值决定。本基金通过投资组合的分散化降低市场

价格风险，并且本基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控。

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。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	153,038,125.92	89.68	135,594,844.75	87.93
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	153,038,125.92	89.68	135,594,844.75	87.93

#### 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%	7,675,419.00	9,629,693.61
	业绩比较基准下降 5%	-7,675,419.00	-9,629,693.61

#### 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 152,868,802.26 元，划分为第二层次的余额为人民币 408,121.20 元，无属于第三层次的余额（于 2020 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人民币 132,690,912.58 元，属于第二层次的余额为人民币 2,903,932.17 元，无属于第三层次的余额）。

#### 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归属于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	153,038,125.92	87.52
	其中：股票	153,038,125.92	87.52
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	238,797.54	0.14

	其中：债券	238,797.54	0.14
	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	21,470,814.19	12.28
8	其他各项资产	116,799.70	0.07
9	合计	174,864,537.35	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	37,127.22	0.02
B	采矿业	5,551,836.46	3.25
C	制造业	136,488,280.29	79.99
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	216,965.26	0.13
E	建筑业	45,711.80	0.03
F	批发和零售业	145,400.50	0.09
G	交通运输、仓储和邮政业	149,816.24	0.09
H	住宿和餐饮业	475.80	0.00
I	信息传输、软件和信息技术服务业	3,514,322.61	2.06
J	金融业	1,821,786.22	1.07
K	房地产业	343.65	0.00
L	租赁和商务服务业	19,350.69	0.01
M	科学研究和技术服务业	770,221.91	0.45
N	水利、环境和公共设施管理业	89,936.92	0.05
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	28,585.37	0.02
Q	卫生和社会工作	3,764,306.00	2.21
R	文化、体育和娱乐业	393,658.98	0.23
S	综合	-	-
	合计	153,038,125.92	89.68

### 8.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

无。

### 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	002475	立讯精密	324,700	15,975,240.00	9.36
2	603799	华友钴业	75,300	8,306,343.00	4.87
3	002241	歌尔股份	151,400	8,190,740.00	4.80
4	600519	贵州茅台	3,532	7,240,600.00	4.24
5	300115	长盈精密	330,720	6,561,484.80	3.85
6	600438	通威股份	141,903	6,379,958.88	3.74
7	002824	和胜股份	128,200	5,816,434.00	3.41
8	002876	三利谱	78,900	4,929,672.00	2.89
9	688665	四方光电	27,383	4,907,581.26	2.88
10	603920	世运电路	195,600	4,361,880.00	2.56
11	002008	大族激光	77,280	4,173,120.00	2.45
12	300750	宁德时代	6,800	3,998,400.00	2.34
13	002415	海康威视	73,700	3,855,984.00	2.26
14	002484	江海股份	141,100	3,854,852.00	2.26
15	603882	金域医学	33,800	3,764,306.00	2.21
16	600183	生益科技	146,300	3,445,365.00	2.02
17	601088	中国神华	152,500	3,434,300.00	2.01
18	002402	和而泰	123,400	3,384,862.00	1.98
19	688668	鼎通科技	47,052	3,316,224.96	1.94
20	600584	长电科技	101,500	3,148,530.00	1.85
21	002304	洋河股份	16,300	2,685,099.00	1.57
22	002460	赣锋锂业	17,700	2,528,445.00	1.48
23	002245	蔚蓝锂芯	90,800	2,497,908.00	1.46
24	601126	四方股份	110,200	2,303,180.00	1.35
25	300679	电连技术	43,500	2,283,750.00	1.34
26	603392	万泰生物	10,019	2,219,208.50	1.30
27	002594	比亚迪	8,100	2,171,772.00	1.27
28	601899	紫金矿业	217,224	2,107,072.80	1.23
29	002459	晶澳科技	22,055	2,044,498.50	1.20
30	688639	华恒生物	14,509	1,875,288.25	1.10
31	600845	宝信软件	28,730	1,747,645.90	1.02
32	300059	东方财富	45,300	1,681,083.00	0.99
33	603989	艾华集团	37,000	1,531,800.00	0.90
34	600309	万华化学	13,600	1,373,600.00	0.80
35	688599	天合光能	15,514	1,224,054.60	0.72
36	300331	苏大维格	35,600	1,186,548.00	0.70
37	688777	中控技术	9,645	731,862.60	0.43
38	300552	万集科技	17,900	721,191.00	0.42
39	002916	深南电路	5,800	706,556.00	0.41
40	603063	禾望电气	17,300	697,363.00	0.41
41	603859	能科科技	17,200	682,668.00	0.40

42	688032	禾迈股份	900	633,591.00	0.37
43	002028	思源电气	12,300	605,283.00	0.35
44	300821	东岳硅材	28,600	522,808.00	0.31
45	603626	科森科技	30,800	372,372.00	0.22
46	300251	光线传媒	27,600	354,660.00	0.21
47	688055	龙腾光电	36,922	252,915.70	0.15
48	688608	恒玄科技	704	214,720.00	0.13
49	688303	大全能源	3,094	187,217.94	0.11
50	688676	金盘科技	3,161	103,206.65	0.06
51	688110	东芯股份	2,060	93,070.80	0.05
52	301138	华研精机	1,551	89,163.66	0.05
53	688696	极米科技	143	78,936.00	0.05
54	688528	秦川物联	5,679	74,394.90	0.04
55	688071	华依科技	1,101	72,434.79	0.04
56	688622	禾信仪器	1,204	72,179.80	0.04
57	301221	光庭信息	757	71,757.79	0.04
58	688767	博拓生物	1,012	70,738.80	0.04
59	688687	凯因科技	2,563	70,123.68	0.04
60	688609	九联科技	5,424	68,450.88	0.04
61	688121	卓然股份	1,767	67,941.15	0.04
62	605589	圣泉集团	1,750	67,025.00	0.04
63	601963	重庆银行	7,472	66,500.80	0.04
64	301182	凯旺科技	1,856	65,240.08	0.04
65	688117	圣诺生物	1,672	61,211.92	0.04
66	688355	明志科技	1,806	60,392.64	0.04
67	688551	科威尔	1,032	59,742.48	0.04
68	688161	威高骨科	918	58,494.96	0.03
69	688257	新锐股份	870	57,594.00	0.03
70	688577	浙海德曼	1,036	56,917.84	0.03
71	688697	纽威数控	3,331	56,094.04	0.03
72	688656	浩欧博	877	55,251.00	0.03
73	688578	艾力斯	1,751	52,880.20	0.03
74	301179	泽宇智能	950	52,198.70	0.03
75	688739	成大生物	679	51,692.27	0.03
76	601702	华峰铝业	4,166	51,325.12	0.03
77	688722	同益中	3,687	50,475.03	0.03
78	688336	三生国健	2,687	49,843.85	0.03
79	688260	昀冢科技	2,990	49,813.40	0.03
80	301091	深城交	1,484	48,666.79	0.03
81	600032	浙江新能	3,045	47,075.70	0.03
82	301193	家联科技	1,485	46,893.46	0.03
83	301093	华兰股份	899	46,716.30	0.03

84	301190	善水科技	1,554	46,503.36	0.03
85	688395	正弦电气	1,627	46,304.42	0.03
86	600916	中国黄金	3,371	46,283.83	0.03
87	688799	华纳药厂	1,122	46,192.74	0.03
88	601156	东航物流	2,090	45,729.20	0.03
89	688127	蓝特光学	1,987	45,681.13	0.03
90	688618	三旺通信	1,028	45,632.92	0.03
91	003031	中瓷电子	542	45,414.18	0.03
92	688511	天微电子	819	45,364.41	0.03
93	688091	上海谊众	1,054	45,121.74	0.03
94	301079	邵阳液压	1,396	43,352.80	0.03
95	688092	爱科科技	1,137	43,024.08	0.03
96	603324	盛剑环境	732	42,939.12	0.03
97	688226	威腾电气	2,693	42,791.77	0.03
98	688038	中科通达	2,132	39,911.04	0.02
99	688517	金冠电气	2,892	39,446.88	0.02
100	605337	李子园	788	39,163.60	0.02
101	688501	青达环保	1,759	38,557.28	0.02
102	605090	九丰能源	1,090	38,335.30	0.02
103	688681	科汇股份	1,899	38,245.86	0.02
104	688296	和达科技	766	38,047.22	0.02
105	601665	齐鲁银行	6,731	37,558.98	0.02
106	301092	争光股份	969	37,287.76	0.02
107	002993	奥海科技	936	36,859.68	0.02
108	688557	兰剑智能	1,329	36,547.50	0.02
109	605305	中际联合	368	35,434.72	0.02
110	605338	巴比食品	1,012	35,258.08	0.02
111	001213	中铁特货	5,818	35,257.08	0.02
112	688156	路德环境	1,788	34,955.40	0.02
113	688191	智洋创新	1,575	34,807.50	0.02
114	605507	国邦医药	1,202	34,653.66	0.02
115	600563	法拉电子	148	34,395.20	0.02
116	688067	爱威科技	1,208	33,594.48	0.02
117	688701	卓锦股份	2,340	32,572.80	0.02
118	301088	戎美股份	1,250	32,221.25	0.02
119	605399	晨光新材	810	32,165.10	0.02
120	688418	震有科技	2,118	32,151.24	0.02
121	003039	顺控发展	1,024	31,774.72	0.02
122	003012	东鹏控股	2,278	31,254.16	0.02
123	688276	百克生物	445	30,527.00	0.02
124	688737	中自科技	520	30,425.20	0.02
125	601921	浙版传媒	3,154	30,373.02	0.02

126	003040	楚天龙	1,101	28,978.32	0.02
127	605339	南侨食品	864	28,788.48	0.02
128	003038	鑫铂股份	383	28,330.51	0.02
129	605080	浙江自然	374	27,975.20	0.02
130	605020	永和股份	850	26,095.00	0.02
131	001208	华菱线缆	1,754	26,011.82	0.02
132	605077	华康股份	618	25,863.30	0.02
133	001201	东瑞股份	668	25,771.44	0.02
134	001317	三羊马	300	25,722.00	0.02
135	000568	泸州老窖	100	25,387.00	0.01
136	601528	瑞丰银行	2,230	25,154.40	0.01
137	603529	爱玛科技	543	24,744.51	0.01
138	605167	利柏特	2,472	24,349.20	0.01
139	605336	帅丰电器	701	23,904.10	0.01
140	605068	明新旭腾	641	23,172.15	0.01
141	605006	山东玻纤	1,618	22,490.20	0.01
142	603171	税友股份	637	22,422.40	0.01
143	605222	起帆电缆	858	22,299.42	0.01
144	605555	德昌股份	537	21,909.60	0.01
145	605366	宏柏新材	1,588	21,072.76	0.01
146	605268	王力安防	1,642	21,066.86	0.01
147	603216	梦天家居	772	19,523.88	0.01
148	603836	海程邦达	733	19,241.25	0.01
149	603759	海天股份	1,119	19,101.33	0.01
150	603213	镇洋发展	799	18,504.84	0.01
151	003028	振邦智能	432	18,100.80	0.01
152	605286	同力日升	597	17,850.30	0.01
153	605133	嵘泰股份	618	17,742.78	0.01
154	688109	品茗股份	346	17,722.12	0.01
155	003019	宸展光电	601	17,567.23	0.01
156	605056	咸亨国际	934	17,540.52	0.01
157	605368	蓝天燃气	1,204	17,397.80	0.01
158	001215	千味央厨	295	17,171.95	0.01
159	003020	立方制药	374	17,151.64	0.01
160	605050	福然德	1,197	17,033.31	0.01
161	605208	永茂泰	801	16,861.05	0.01
162	002985	北摩高科	139	16,743.94	0.01
163	605389	长龄液压	356	16,575.36	0.01
164	605098	行动教育	289	16,279.37	0.01
165	605169	洪通燃气	950	15,979.00	0.01
166	605018	长华股份	840	15,859.20	0.01
167	605016	百龙创园	445	15,623.95	0.01

168	605277	新亚电子	507	15,448.29	0.01
169	605008	长鸿高科	1,039	15,346.03	0.01
170	001218	丽臣实业	350	15,267.00	0.01
171	003021	兆威机电	191	15,251.35	0.01
172	601279	英利汽车	2,004	15,210.36	0.01
173	605289	罗曼股份	379	15,197.90	0.01
174	605005	合兴股份	634	15,082.86	0.01
175	003029	吉大正元	716	15,071.80	0.01
176	605060	联德股份	883	15,011.00	0.01
177	001207	联科科技	682	14,922.16	0.01
178	001206	依依股份	321	14,894.40	0.01
179	605066	天正电气	1,278	14,850.36	0.01
180	002835	同为股份	1,400	14,686.00	0.01
181	605151	西上海	723	14,676.90	0.01
182	605183	确成股份	741	14,560.65	0.01
183	003013	地铁设计	724	14,537.92	0.01
184	003025	思进智能	427	14,342.93	0.01
185	605179	一鸣食品	939	14,225.85	0.01
186	605116	奥锐特	642	14,136.84	0.01
187	605299	舒华体育	738	14,110.56	0.01
188	001205	盛航股份	577	13,992.25	0.01
189	605058	澳弘电子	548	13,952.08	0.01
190	300850	新强联	78	13,923.78	0.01
191	003037	三和管桩	1,274	13,912.08	0.01
192	605333	沪光股份	670	13,855.60	0.01
193	605007	五洲特纸	598	13,759.98	0.01
194	605218	伟时电子	837	13,718.43	0.01
195	605028	世茂能源	584	13,607.20	0.01
196	605123	派克新材	99	13,584.78	0.01
197	605180	华生科技	384	13,555.20	0.01
198	605566	福莱蒾特	435	13,350.15	0.01
199	001217	华尔泰	686	13,246.66	0.01
200	605599	菜百股份	980	13,190.80	0.01
201	002997	瑞鹄模具	751	13,187.56	0.01
202	603511	爱慕股份	553	13,117.16	0.01
203	605319	无锡振华	764	12,957.44	0.01
204	605196	华通线缆	1,172	12,575.56	0.01
205	003030	祖名股份	480	12,475.20	0.01
206	002996	顺博合金	849	12,420.87	0.01
207	605300	佳禾食品	576	12,401.28	0.01
208	605365	立达信	645	12,364.65	0.01
209	003032	传智教育	586	12,306.00	0.01

210	603112	华翔股份	920	12,144.00	0.01
211	002999	天禾股份	1,726	11,857.62	0.01
212	605069	正和生态	608	11,685.76	0.01
213	002998	优彩资源	1,353	11,635.80	0.01
214	003018	金富科技	1,027	11,348.35	0.01
215	605228	神通科技	1,217	11,281.59	0.01
216	605358	立昂微	93	11,160.93	0.01
217	605488	福莱新材	416	11,119.68	0.01
218	605011	杭州热电	525	11,056.50	0.01
219	001210	金房节能	311	11,037.39	0.01
220	003002	壶化股份	921	10,830.96	0.01
221	605258	协和电子	340	10,822.20	0.01
222	603408	建霖家居	762	10,820.40	0.01
223	605122	四方新材	477	10,804.05	0.01
224	605189	富春染织	423	10,651.14	0.01
225	605580	恒盛能源	654	10,614.42	0.01
226	003027	同兴环保	430	10,517.80	0.01
227	605086	龙高股份	443	10,463.66	0.01
228	301089	拓新药业	154	10,461.22	0.01
229	002001	新和成	334	10,394.08	0.01
230	003001	中岩大地	493	10,141.01	0.01
231	001212	中旗新材	308	9,951.48	0.01
232	605259	绿田机械	295	9,838.25	0.01
233	003036	泰坦股份	776	9,606.88	0.01
234	001288	运机集团	537	9,563.97	0.01
235	605303	园林股份	610	9,540.40	0.01
236	301149	隆华新材	561	9,402.36	0.01
237	605055	迎丰股份	1,147	9,061.30	0.01
238	301188	力诺特玻	440	9,011.20	0.01
239	002407	多氟多	200	8,998.00	0.01
240	605598	上海港湾	553	8,809.29	0.01
241	001209	洪兴股份	321	8,756.88	0.01
242	605138	盛泰集团	723	8,733.84	0.01
243	003041	真爱美家	349	8,690.10	0.01
244	605577	龙版传媒	588	8,625.96	0.01
245	001202	炬申股份	459	8,551.17	0.01
246	003003	天元股份	756	8,391.60	0.00
247	001219	青岛食品	272	8,323.20	0.00
248	003004	声迅股份	306	8,301.78	0.00
249	003033	征和工业	301	8,292.55	0.00
250	605009	豪悦护理	145	7,973.55	0.00
251	003023	彩虹集团	296	7,971.28	0.00

252	603806	福斯特	60	7,833.00	0.00
253	605298	必得科技	391	7,397.72	0.00
254	003000	劲仔食品	684	7,394.04	0.00
255	300832	新产业	156	6,871.80	0.00
256	601211	国泰君安	379	6,780.31	0.00
257	300855	图南股份	96	6,767.04	0.00
258	605089	味知香	70	6,639.50	0.00
259	300657	弘信电子	396	6,537.96	0.00
260	301083	百胜智能	416	5,911.36	0.00
261	300884	狄耐克	291	5,593.02	0.00
262	001234	泰慕士	333	5,504.49	0.00
263	301078	孩子王	453	5,499.42	0.00
264	300829	金丹科技	118	5,392.60	0.00
265	603155	新亚强	87	4,707.57	0.00
266	300498	温氏股份	240	4,622.40	0.00
267	600570	恒生电子	70	4,350.50	0.00
268	300856	科思股份	67	4,232.39	0.00
269	300853	申昊科技	101	4,191.50	0.00
270	002982	湘佳股份	81	3,951.99	0.00
271	688700	东威科技	57	3,881.70	0.00
272	002258	利尔化学	94	3,170.62	0.00
273	002987	京北方	98	3,079.16	0.00
274	300858	科拓生物	92	3,054.40	0.00
275	603087	甘李药业	42	2,954.28	0.00
276	002938	鹏鼎控股	68	2,885.24	0.00
277	605296	神农集团	69	2,781.39	0.00
278	300003	乐普医疗	122	2,760.86	0.00
279	601995	中金公司	51	2,500.53	0.00
280	603888	新华网	100	2,376.00	0.00
281	300903	科翔股份	80	2,069.60	0.00
282	002989	中天精装	80	2,023.20	0.00
283	300828	锐新科技	77	2,022.79	0.00
284	300630	普利制药	36	1,981.44	0.00
285	605003	众望布艺	66	1,873.08	0.00
286	688560	明冠新材	54	1,867.86	0.00
287	603565	中谷物流	65	1,845.35	0.00
288	601233	桐昆股份	85	1,800.30	0.00
289	002983	芯瑞达	78	1,767.48	0.00
290	605100	华丰股份	68	1,758.48	0.00
291	300845	捷安高科	70	1,750.70	0.00
292	605136	丽人丽妆	67	1,631.45	0.00
293	002992	宝明科技	119	1,596.98	0.00

294	300843	胜蓝股份	51	1,546.32	0.00
295	603439	贵州三力	97	1,530.66	0.00
296	002986	宇新股份	42	1,511.16	0.00
297	603931	格林达	44	1,452.00	0.00
298	603950	长源东谷	81	1,409.40	0.00
299	605377	华旺科技	70	1,255.80	0.00
300	000786	北新建材	35	1,254.05	0.00
301	002120	韵达股份	60	1,227.60	0.00
302	605118	力鼎光电	67	1,112.20	0.00
303	605155	西大门	50	1,096.00	0.00
304	605177	东亚药业	39	1,077.96	0.00
305	300857	协创数据	34	984.64	0.00
306	300840	酷特智能	85	984.30	0.00
307	002976	瑞玛精密	43	952.45	0.00
308	605186	健麾信息	26	942.76	0.00
309	300849	锦盛新材	72	882.72	0.00
310	600918	中泰证券	87	867.39	0.00
311	605099	共创草坪	24	848.40	0.00
312	003016	欣贺股份	81	844.02	0.00
313	002990	盛视科技	24	828.24	0.00
314	601686	友发集团	74	725.20	0.00
315	605166	聚合顺	41	652.72	0.00
316	605199	葫芦娃	26	647.92	0.00
317	601456	国联证券	43	600.71	0.00
318	605001	威奥股份	69	577.53	0.00
319	600956	新天绿能	33	567.93	0.00
320	605388	均瑶健康	30	545.70	0.00
321	601825	沪农商行	80	540.00	0.00
322	002912	中新赛克	16	529.44	0.00
323	605255	天普股份	30	501.90	0.00
324	603035	常熟汽饰	28	496.16	0.00
325	300833	浩洋股份	6	486.18	0.00
326	605108	同庆楼	26	475.80	0.00
327	300846	首都在线	31	468.72	0.00
328	603212	赛伍技术	15	466.95	0.00
329	600004	白云机场	38	458.28	0.00
330	605318	法狮龙	28	426.72	0.00
331	601778	晶科科技	49	417.97	0.00
332	000630	铜陵有色	100	348.00	0.00
333	002146	荣盛发展	79	343.65	0.00
334	300831	派瑞股份	16	316.00	0.00
335	688036	传音控股	2	313.80	0.00

336	002879	长缆科技	13	306.80	0.00
337	600079	人福医药	11	247.72	0.00
338	605088	冠盛股份	16	232.48	0.00
339	601827	三峰环境	23	205.16	0.00
340	601187	厦门银行	29	200.10	0.00
341	002007	华兰生物	6	174.84	0.00
342	300838	浙江力诺	9	164.34	0.00
343	605158	华达新材	16	122.88	0.00
344	603682	锦和商业	18	109.44	0.00
345	605188	国光连锁	3	23.97	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	603799	华友钴业	15,957,967.82	10.35
2	002475	立讯精密	15,834,019.00	10.27
3	002241	歌尔股份	14,213,031.38	9.22
4	002415	海康威视	13,657,491.00	8.86
5	000858	五粮液	12,585,255.94	8.16
6	002824	和胜股份	10,911,338.05	7.08
7	300059	东方财富	9,945,355.80	6.45
8	002876	三利谱	9,727,885.56	6.31
9	300390	天华超净	9,475,447.92	6.14
10	601888	中国中免	9,156,660.00	5.94
11	002466	天齐锂业	8,480,874.00	5.50
12	300115	长盈精密	8,216,991.60	5.33
13	600031	三一重工	8,177,723.00	5.30
14	688981	中芯国际	7,726,127.39	5.01
15	603986	兆易创新	7,439,323.80	4.82
16	688665	四方光电	7,278,315.22	4.72
17	603690	至纯科技	7,129,300.00	4.62
18	601899	紫金矿业	7,065,587.00	4.58
19	002371	北方华创	7,002,264.00	4.54
20	300122	智飞生物	6,530,692.89	4.23
21	601088	中国神华	6,506,621.00	4.22
22	002487	大金重工	6,432,590.00	4.17
23	688599	天合光能	6,120,798.85	3.97
24	000568	泸州老窖	6,095,783.00	3.95
25	603290	斯达半导	6,029,594.00	3.91
26	000725	京东方 A	6,025,150.00	3.91
27	600141	兴发集团	6,000,167.00	3.89

28	600845	宝信软件	5,909,198.35	3.83
29	600196	复星医药	5,903,058.95	3.83
30	601318	中国平安	5,880,556.00	3.81
31	002304	洋河股份	5,822,390.00	3.78
32	002460	赣锋锂业	5,805,568.00	3.76
33	603806	福斯特	5,758,850.80	3.73
34	600399	抚顺特钢	5,425,592.13	3.52
35	688063	派能科技	5,217,344.94	3.38
36	300274	阳光电源	5,010,151.00	3.25
37	002049	紫光国微	5,006,446.00	3.25
38	600183	生益科技	4,789,492.56	3.11
39	300679	电连技术	4,703,025.00	3.05
40	688303	大全能源	4,569,919.50	2.96
41	000100	TCL 科技	4,469,709.00	2.90
42	600256	广汇能源	4,438,473.00	2.88
43	002402	和而泰	4,377,041.21	2.84
44	603920	世运电路	4,142,745.44	2.69
45	002027	分众传媒	4,123,791.00	2.67
46	603486	科沃斯	3,959,997.70	2.57
47	603985	恒润股份	3,681,489.00	2.39
48	000683	远兴能源	3,645,629.00	2.36
49	603392	万泰生物	3,641,224.00	2.36
50	002920	德赛西威	3,638,859.00	2.36
51	002008	大族激光	3,558,386.00	2.31
52	600754	锦江酒店	3,557,940.00	2.31
53	003022	联泓新科	3,527,330.50	2.29
54	002555	三七互娱	3,497,169.00	2.27
55	601225	陕西煤业	3,406,510.00	2.21
56	600584	长电科技	3,397,915.00	2.20
57	300655	晶瑞电材	3,387,549.35	2.20
58	600732	爱旭股份	3,365,052.00	2.18
59	002484	江海股份	3,358,492.68	2.18
60	000625	长安汽车	3,336,666.80	2.16
61	603993	洛阳钼业	3,335,031.00	2.16
62	300601	康泰生物	3,244,215.00	2.10
63	300433	蓝思科技	3,216,021.00	2.09
64	600418	江淮汽车	3,215,139.00	2.08
65	300207	欣旺达	3,183,877.00	2.06
66	600773	西藏城投	3,138,192.00	2.04
67	600219	南山铝业	3,130,802.00	2.03

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	601888	中国中免	15,269,546.00	9.90
2	300059	东方财富	13,716,408.00	8.89
3	688036	传音控股	13,268,615.44	8.60
4	300390	天华超净	12,341,079.00	8.00
5	000858	五粮液	10,885,903.64	7.06
6	603882	金域医学	10,768,673.00	6.98
7	002415	海康威视	9,622,272.00	6.24
8	002824	和胜股份	9,120,106.50	5.91
9	688599	天合光能	8,885,494.67	5.76
10	603392	万泰生物	8,423,944.00	5.46
11	002371	北方华创	7,870,013.00	5.10
12	600031	三一重工	7,759,270.00	5.03
13	603986	兆易创新	7,753,344.14	5.03
14	002049	紫光国微	7,746,808.00	5.02
15	002487	大金重工	7,732,558.00	5.01
16	688981	中芯国际	7,647,564.54	4.96
17	601012	隆基股份	7,560,715.12	4.90
18	002241	歌尔股份	7,454,514.00	4.83
19	600141	兴发集团	7,265,929.00	4.71
20	603806	福斯特	7,260,421.20	4.71
21	600519	贵州茅台	7,029,587.88	4.56
22	600732	爱旭股份	7,022,073.00	4.55
23	603690	至纯科技	6,803,900.12	4.41
24	002466	天齐锂业	6,630,843.34	4.30
25	603799	华友钴业	6,544,776.55	4.24
26	600196	复星医药	6,476,235.00	4.20
27	600438	通威股份	6,358,556.00	4.12
28	000725	京东方 A	6,265,546.00	4.06
29	601877	正泰电器	6,226,602.00	4.04
30	300122	智飞生物	6,175,819.00	4.00
31	000568	泸州老窖	6,098,358.93	3.95
32	603290	斯达半导	5,979,735.00	3.88
33	601318	中国平安	5,831,030.00	3.78
34	688063	派能科技	5,775,522.68	3.75
35	688665	四方光电	5,746,154.34	3.73
36	002812	恩捷股份	5,647,841.00	3.66
37	600256	广汇能源	5,628,046.00	3.65
38	600399	抚顺特钢	5,454,885.00	3.54
39	601899	紫金矿业	5,427,153.00	3.52

40	300496	中科创达	5,374,891.00	3.49
41	688390	固德威	5,362,760.07	3.48
42	002876	三利谱	5,222,370.16	3.39
43	600079	人福医药	5,086,233.16	3.30
44	002179	中航光电	4,946,452.00	3.21
45	688303	大全能源	4,800,748.49	3.11
46	003022	联泓新科	4,695,969.40	3.05
47	000100	TCL 科技	4,561,821.48	2.96
48	600845	宝信软件	4,514,026.57	2.93
49	300454	深信服	4,182,996.00	2.71
50	600754	锦江酒店	4,054,327.00	2.63
51	000603	盛达资源	3,973,214.71	2.58
52	603486	科沃斯	3,947,430.00	2.56
53	002027	分众传媒	3,903,881.36	2.53
54	000683	远兴能源	3,835,739.70	2.49
55	002920	德赛西威	3,808,497.54	2.47
56	688208	道通科技	3,577,854.51	2.32
57	002555	三七互娱	3,550,742.40	2.30
58	600219	南山铝业	3,542,821.00	2.30
59	002304	洋河股份	3,525,228.00	2.29
60	603985	恒润股份	3,455,633.00	2.24
61	300679	电连技术	3,299,791.00	2.14
62	300655	晶瑞电材	3,295,155.17	2.14
63	300274	阳光电源	3,254,538.00	2.11
64	002460	赣锋锂业	3,233,483.29	2.10
65	688536	思瑞浦	3,202,765.61	2.08
66	002036	联创电子	3,118,301.00	2.02
67	002410	广联达	3,117,986.00	2.02
68	300433	蓝思科技	3,112,686.00	2.02
69	600745	闻泰科技	3,094,641.66	2.01

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	594,075,256.11
卖出股票收入（成交）总额	613,504,341.73

注：上述金额均指成交金额（成交单价乘以成交数量），不考虑相关交易费用。

#### 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	-	-

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）	238,797.54	0.14
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	238,797.54	0.14

### 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	123111	东财转 3	1,198	201,479.64	0.12
2	127038	国微转债	190	37,317.90	0.02

### 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

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收到公开谴责、处罚的情形

#### 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	86,188.88
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	4,109.64
5	应收申购款	26,501.18
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	116,799.70

#### 8.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

金额单位:人民币元

序号	债券代码	债券名称	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
1	123111	东财转 3	201,479.64	0.12
2	127038	国微转债	37,317.90	0.02

#### 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 (%)
8,504	5,282.43	98,820.23	0.22	44,822,990.43	99.78

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	69,784.62	0.1553

#### 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

本基金基金经理持有本开放式基金	0~10
-----------------	------

#### 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（2009 年 9 月 8 日）基金份额总额	3,086,196,884.20
本报告期期初基金份额总额	50,184,698.40
本报告期基金总申购份额	11,612,752.45
减：本报告期基金总赎回份额	16,875,640.19
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	44,921,810.66

### § 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

1. 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。

2. 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

2021 年 5 月, 中国农业银行总行决定谭敦宇任托管业务部总裁。

2021 年 8 月, 中国农业银行总行决定王霄勇任托管业务部副总裁。

#### 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 6 万元整。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	
华西证券	1	242,835,016.72	20.20%	221,283.45	20.20%	-
光大证券	2	235,508,836.72	19.59%	214,628.03	19.59%	-
兴业证券	2	172,908,862.60	14.39%	157,566.62	14.39%	-
国信证券	1	123,928,507.07	10.31%	112,931.88	10.31%	-
浙商证券	1	87,535,391.10	7.28%	79,781.11	7.28%	-
天风证券	2	86,292,546.90	7.18%	78,640.90	7.18%	-
川财证券	1	85,271,326.46	7.09%	77,708.56	7.09%	-
中泰证券	2	71,577,834.62	5.96%	65,220.86	5.95%	-
安信证券	1	65,982,055.05	5.49%	60,128.20	5.49%	-
招商证券	2	30,106,600.05	2.50%	27,436.52	2.50%	-
爱建证券	1	-	-	-	-	-
第一创业	1	-	-	-	-	-
东北证券	2	-	-	-	-	-
东财证券	1	-	-	-	-	-
东方证券	1	-	-	-	-	-
东吴证券	1	-	-	-	-	-
东兴证券	1	-	-	-	-	-
方正证券	1	-	-	-	-	-

高华证券	1	-	-	-	-	-
广发证券	2	-	-	-	-	-
国金证券	2	-	-	-	-	-
国盛证券	1	-	-	-	-	-
国泰君安	3	-	-	-	-	-
海通证券	1	-	-	-	-	-
红塔证券	1	-	-	-	-	-
华创证券	1	-	-	-	-	-
华泰证券	1	-	-	-	-	-
民生证券	1	-	-	-	-	-
南京证券	1	-	-	-	-	-
平安证券	1	-	-	-	-	-
瑞银证券	2	-	-	-	-	-
山西证券	1	-	-	-	-	-
上海证券	1	-	-	-	-	-
申万宏源	1	-	-	-	-	-
申万宏源 西部	1	-	-	-	-	-
世纪证券	1	-	-	-	-	-
万和证券	1	-	-	-	-	-
西部证券	1	-	-	-	-	-
湘财证券	1	-	-	-	-	-
信达证券	1	-	-	-	-	-
粤开证券	1	-	-	-	-	-
中国银河 证券	4	-	-	-	-	-
中金公司	3	-	-	-	-	-
中信建投 证券	2	-	-	-	-	-
中信证券	3	-	-	-	-	-
中银国际 证券	1	-	-	-	-	-
中原证券	1	-	-	-	-	-

注：1、租用券商专用交易单元的选择标准和程序：

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

租用证券公司交易单元的选择标准主要包括：

- （1）财务状况良好，最近一年无重大违规行为；
- （2）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；
- （3）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；

(4) 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；

(5) 能提供投资组合运作、管理所需的其他券商服务；

(6) 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专用席位。

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：

本报告期内新增交易单元：中信证券。

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
兴业证券	217,977.30	100.00%	-	-	-	-

### 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	大成行业轮动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	大成行业轮动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10月08日
6	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
7	大成行业轮动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	2021年08月31日

		公司网站	
8	大成行业轮动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
9	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
10	大成行业轮动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
11	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
12	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
13	大成行业轮动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
14	大成行业轮动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
15	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
16	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
17	大成行业轮动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 01 月 28 日
18	大成行业轮动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 01 月 28 日
19	大成行业轮动混合型证券投资基金增聘基金经理的公告	中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站	2021 年 01 月 27 日
20	大成行业轮动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

## § 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

无。

### 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行业轮动股票型证券投资基金的文件；
- 2、《大成行业轮动混合型证券投资基金基金合同》；
- 3、《大成行业轮动混合型证券投资基金托管协议》；
- 4、《大成行业轮动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