

大成行业轮动混合型证券投资基金 2022 年中期报告

2022 年 6 月 30 日

基金管理人：大成基金管理有限公司

基金托管人：中国农业银行股份有限公司

送出日期：2022 年 8 月 30 日

§ 1 重要提示及目录

1.1 重要提示

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

基金托管人中国农业银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2022 年 8 月 29 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告财务资料未经审计。

本报告期自 2022 年 01 月 01 日起至 06 月 30 日止。

1.2 目录

§ 1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
§ 2 基金简介	5
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人和基金托管人	5
2.4 信息披露方式	6
2.5 其他相关资料	6
§ 3 主要财务指标和基金净值表现	6
3.1 主要会计数据和财务指标	6
3.2 基金净值表现	6
§ 4 管理人报告	8
4.1 基金管理人及基金经理情况	8
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	12
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	12
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	13
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	14
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	14
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	15
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明	15
§ 5 托管人报告	15
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 托管人对本中期报告中财务信息内容的真实、准确和完整发表意见	15
§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）	16
6.1 资产负债表	16
6.2 利润表	17
6.3 净资产（基金净值）变动表	19
6.4 报表附注	22
§ 7 投资组合报告	47
7.1 期末基金资产组合情况	47
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	47
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细	48
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	57
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	59
7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细	60

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细	60
7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细	60
7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细	60
7.10 本基金投资股指期货的投资政策	60
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	60
7.12 投资组合报告附注	60
§ 8 基金份额持有人信息	61
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	61
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	61
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况	61
§ 9 开放式基金份额变动	62
§ 10 重大事件揭示	62
10.1 基金份额持有人大会决议	62
10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动	62
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	62
10.4 基金投资策略的改变	62
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	63
10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况	63
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	63
10.8 其他重大事件	65
§ 11 影响投资者决策的其他重要信息	66
11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况	66
11.2 影响投资者决策的其他重要信息	66
§ 12 备查文件目录	66
12.1 备查文件目录	66
12.2 存放地点	66
12.3 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	43,046,193.80 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	段皓静	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		广东省深圳市南山区海德三道 1236 号大成基金总部大厦 5 层、 27-33 层	北京市东城区建国门内大街 69 号
办公地址		广东省深圳市南山区海德三道 1236 号大成基金总部大厦 5 层、 27-33 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		518054	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》
登载基金中期报告正文的管理人互联网网址	http://www.dcfund.com.cn
基金中期报告备置地点	基金管理人及基金托管人住所

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	大成基金管理有限公司	广东省深圳市南山区海德三道1236号大成基金总部大厦5层、27-33层

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2022年1月1日-2022年6月30日)
本期已实现收益	-11,523,223.85
本期利润	-22,701,705.12
加权平均基金份额本期利润	-0.4642
本期加权平均净值利润率	-14.69%
本期基金份额净值增长率	-12.56%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2022年6月30日)
期末可供分配利润	99,823,912.83
期末可供分配基金份额利润	2.3190
期末基金资产净值	142,987,312.67
期末基金份额净值	3.322
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2022年6月30日)
基金份额累计净值增长率	232.20%

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)扣除相关费用和信用减值损失后的余额，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

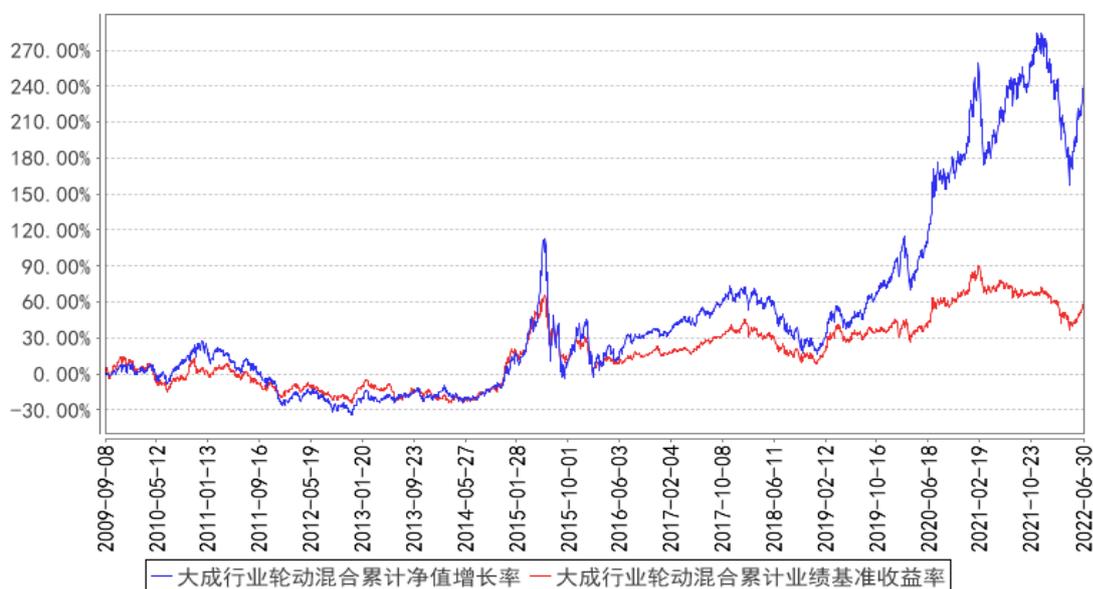
3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

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
----	----------	-------------	------------	---------------	-----	-----

过去一个月	9.17%	1.62%	7.65%	0.86%	1.52%	0.76%
过去三个月	9.53%	1.88%	5.26%	1.14%	4.27%	0.74%
过去六个月	-12.56%	1.80%	-6.92%	1.16%	-5.64%	0.64%
过去一年	-2.24%	1.56%	-10.37%	1.00%	8.13%	0.56%
过去三年	125.83%	1.53%	17.55%	1.01%	108.28%	0.52%
自基金合同生效起至今	232.20%	1.63%	57.27%	1.15%	174.93%	0.48%

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。

§ 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 23 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	-	18 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 日至 2022 年 6 月 22 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 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，固定收益总部副总监	2020 年 7 月 6 日	-	14 年	<p>美国德克萨斯 A&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、固定收益总部总监助理，现任固定收益总部副总监。2018 年 3 月 12 日起任大成策略回报混合型证券投资基金、大成创新成长混合型证券投资基金（LOF）、大成积极成长混合型证券投资基金、大成精选增值混合型证券投资基金、大成景阳领先混合型证券投资基金、大成竞争优势混合型证券投资基金、大成蓝筹稳健证券投资基金、大成优选混合型证券投资基金（LOF）基金经理助理。2020 年 7 月 1 日起任大成价值增长证券投资基金、大成多策略灵活配置混合型证券投资基金（LOF）、大成一带一路灵活配置混合型证券投资基金、大成内需增长混合型证券投资基金、大成睿景灵活配置混合型证券投资基金、大成盛世精选灵活配置混合型证券投资基金、大成国企改革灵活配置混合型证券投资基金、大成行业轮动混合型证券投资基金、大成灵活配置混合型证券投资基金、大成产业升级股票型证券投资基金（LOF）、大成健康产业混合型证券投资基金、大成正向回报灵活配置混合型证券投资基金、大成国家安全主题灵活配置混合型证券投资基金、大成新锐产业混合型证券投资基金、大成消费主题混合型证券投资基金基金经理助理。2020 年 11 月 6 日起任大成科技消费股票型证券投资基金、大成科创主题 3 年封闭运作灵活配置混合型证券投资基金、大成中小盘混合型证券投资基金（LOF）、大成睿享混合型证券投资基金、大成行业先锋混合型证券投资基金基金经理助理。2021 年 2 月 1 日起任大成企业能力驱动混合型证券投资基金、大成优选升级一年持有期混合型证券投资基金、大成成长进取混合型证券投资基金基金经理助理。2021 年 2 月 22 日起任大成恒享春晓一年定期开放混合型证券投资基金基金经理助理。2021 年 4 月 19 日起任大成民稳增长混合型证券投资基金基金经理助理。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。2022 年 4</p>
--	--	--	--	---

				<p>月 15 日起任大成汇享一年持有期混合型证券投资基金基金经理助理。2022 年 4 月 21 日起任大成聚优成长混合型证券投资基金、大成新能源混合型发起式证券投资基金、大成致远优势一年持有期混合型证券投资基金、大成景气精选六个月持有期混合型证券投资基金、大成核心趋势混合型证券投资基金、大成创新趋势混合型证券投资基金基金经理助理。2017 年 5 月 8 日起任大成景尚灵活配置混合型证券投资基金、大成景兴信用债债券型证券投资基金基金经理。2017 年 5 月 8 日至 2019 年 10 月 31 日任大成景荣债券型证券投资基金（原大成景荣保本混合型证券投资基金转型）基金经理。2017 年 5 月 31 日至 2020 年 10 月 20 日任大成惠裕定期开放纯债债券型证券投资基金基金经理。2017 年 6 月 2 日至 2018 年 11 月 19 日任大成景禄灵活配置混合型证券投资基金基金经理。2017 年 6 月 2 日至 2018 年 12 月 8 日任大成景源灵活配置混合型证券投资基金基金经理。2017 年 6 月 2 日至 2019 年 6 月 15 日任大成景秀灵活配置混合型证券投资基金基金经理。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</p>
--	--	--	--	---

					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 日起任大成安享得利六个月持有期混合型证券投资基金基金经理。2022 年 3 月 11 日起任大成民享安盈一年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	-	7 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

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

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

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

报告期内，基金管理人严格执行了公平交易的原则和制度。基金管理人运用统计分析方法和工具，对旗下所有投资组合间连续 4 个季度的日内、3 日内及 5 日内股票及债券交易同向交易价差进行分析，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 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 1 笔同日反向交易，原因为投资策略需要。主动型投资组合与指数型投资组合之间或指数型投资组合之间存在股票同日反向交易，但不存在参与交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量超过该股当日成交量 5% 的情形；主动投资组合间债券交易存在 2 笔同日反向交易，原因为流动性需要或合规比例调整。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

2022 年上半年是国际宏观环境极其复杂的一个时期。地缘政治冲突的爆发，对全球的经济造成了严重的挑战。由于俄罗斯是重要的大宗商品出口国，这次战争对相关商品，特别是能源价格造成了巨大的扰动。欧洲由于极度依赖俄罗斯的能源供应，能源价格的飙涨对欧洲的经济造成了巨大影响，推高了欧洲整体的通胀水平。同时，美国的通胀水平也出现了极强的上升趋势，美联储由此开启了加息周期，造成全球部分大宗商品价格出现下跌，全球金融市场也出现了大幅扰动。

在我国国内，上半年有较大的经济下行压力。在这种经济形势下，我国积极开启了相关的刺激政策，特别是针对新能源汽车和光伏行业的政策，有力的刺激了相关行业的健康发展，同时对提升我国的产业结构、实现碳中和的目标，有着深远的积极意义。

从 A 股表现看，从年初到 4 月底，由于受到地缘政治冲突的影响，我国的 A 股市场整体呈现一个下跌的趋势。在此期间，受益于全球能源价格上升的煤炭等相关行业指数表现较好。在 4 月底之后，受益于国家相关行业刺激政策，特别是新能源行业表现较好。

虽然 4 月底 A 股市场有所回暖，但从上半年整体的市场指数看，绝大多数的市场指数在上半年仍然是一个亏损的状态。

在 2022 年上半年，本产品增加了能源、TMT 和消费的配置，但新能源配置比例相对偏低，虽然躲过了新能源行业前期的下跌，但也错过了其后期的上涨，产品上半年表现不佳。

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 3.322 元；本报告期基金份额净值增长率为-12.56%，业绩比较基准收益率为-6.92%。

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 年下半年，地缘政治冲突长期化的可能性在加大，国际政治经济形势仍然具有较大的不确定性。对于国内情况而言，业内分析仍将出台积极的刺激政策来稳定经济。对应到 A 股市场，结构性行情可能持续，新能源行业在经历了前期的上涨之后，有可能将迎来震荡，但有较大概率仍然是市场的主线。

我们非常感谢基金份额持有人的信任和支持，我们将按照本基金合同和风险收益特征的要求，严格控制投资风险，积极进行资产配置，适时调整组合结构，研究新的投资品种和挖掘投资机会，力争获得与基金风险特征一致的收益回报给投资者。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本基金管理人指导基金估值业务的领导小组为公司估值委员会，公司估值委员会主要负责估值政策和估值程序的制定、修订以及执行情况的监督。估值委员会由股票投资部、固定收益总部、研究部、指数与期货投资部、大类资产配置部、权益专户投资部、国际业务部、交易管理部、风险管理部、监察稽核部、基金运营部指定人员组成。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七名投资组合经理。

股票投资部、固定收益总部、研究部、指数与期货投资部、大类资产配置部、权益专户投资部、国际业务部、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交易的债券品种的估值数据，由中证指数有限公司按约定提供交易所交易的债券品种的估值数据和流通受限股票的折扣率数据。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金管理人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。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

无。

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

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 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 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 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见

本托管人认为，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中期报告中的财务指标、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 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：大成行业轮动混合型证券投资基金

报告截止日：2022 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2022 年 6 月 30 日	上年度末 2021 年 12 月 31 日
资产：			
银行存款	6.4.7.1	14,080,973.40	20,911,560.89
结算备付金		458,313.26	559,253.30
存出保证金		74,218.52	86,188.88
交易性金融资产	6.4.7.2	127,300,628.75	153,276,923.46
其中：股票投资		126,658,889.61	153,038,125.92
基金投资		-	-
债券投资		641,739.14	238,797.54
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
其他投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
债权投资	6.4.7.5	-	-
其中：债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
其他投资		-	-
其他债权投资	6.4.7.6	-	-
其他权益工具投资	6.4.7.7	-	-
应收清算款		22,342,679.20	-
应收股利		-	-
应收申购款		100,166.24	26,501.18
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.8	-	4,109.64
资产总计		164,356,979.37	174,864,537.35
负债和净资产	附注号	本期末 2022 年 6 月 30 日	上年度末 2021 年 12 月 31 日
负债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付清算款		-	3,393,997.01
应付赎回款		20,470,965.67	82,860.82

应付管理人报酬		194,722.10	215,084.28
应付托管费		32,453.68	35,847.38
应付销售服务费		-	-
应付投资顾问费		-	-
应交税费		2.09	0.69
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.9	671,523.16	495,486.02
负债合计		21,369,666.70	4,223,276.20
净资产：			
实收基金	6.4.7.10	43,046,193.80	44,921,810.66
其他综合收益	6.4.7.11	-	-
未分配利润	6.4.7.12	99,941,118.87	125,719,450.49
净资产合计		142,987,312.67	170,641,261.15
负债和净资产总计		164,356,979.37	174,864,537.35

注：1、报告截止日 2022 年 06 月 30 日，基金份额净值 3.322 元，基金份额总额 43,046,193.80 份。

2、以下比较数据已根据本年《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号〈年度报告和中期报告〉》中的资产负债表格式的要求进行列示：上年末资产负债表中“应收利息”与“其他资产”项目的“本期末”余额合并列示在本期末资产负债表中“其他资产”项目的“上年度末”余额，上年末资产负债表中“应付交易费用”、“应付利息”与“其他负债”科目的“本期末”余额合并列示在本期末资产负债表“其他负债”项目的“上年度末”余额。

6.2 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：2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期	上年度可比期间
		2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日	2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
一、营业总收入		-21,261,385.27	17,252,533.43
1. 利息收入		76,702.27	100,616.66
其中：存款利息收入	6.4.7.13	76,702.27	100,571.97
债券利息收入		-	44.69
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）		-10,207,025.90	17,450,549.99
其中：股票投资收益	6.4.7.14	-11,081,223.09	17,031,911.13
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.15	139,318.59	-
资产支持证券投资	6.4.7.16	-	-
收益			
贵金属投资收益	6.4.7.17	-	-
衍生工具收益	6.4.7.18	-	-
股利收益	6.4.7.19	734,878.60	418,638.86
以摊余成本计量的金融资产终止确认产生的收益		-	-
其他投资收益		-	-
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.20	-11,178,481.27	-319,581.60
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.21	47,419.63	20,948.38
减：二、营业总支出		1,440,319.85	2,075,336.24
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	1,146,911.85	1,105,918.75
2. 托管费	6.4.10.2.2	191,151.93	184,319.74
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	-	-
4. 投资顾问费		-	-
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 信用减值损失	6.4.7.22	-	-
7. 税金及附加		1.17	0.19
8. 其他费用	6.4.7.23	102,254.90	785,097.56
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-22,701,705.12	15,177,197.19
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-22,701,705.12	15,177,197.19
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		-22,701,705.12	15,177,197.19

注：以下比较数据已根据本年《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和中期报告>》中的利润表格式的要求进行列示：上年度可比期间利润表中“交易费用”项目与“其他费用”项目的“本期”金额合并列示在本期利润表中“其他费用”项目的“上年度可比期间”金额。

6.3 净资产（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：2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产(基金净值)	44,921,810.66	-	125,719,450.49	170,641,261.15
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产(基金净值)	44,921,810.66	-	125,719,450.49	170,641,261.15
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	-1,875,616.86	-	-25,778,331.62	-27,653,948.48
(一)、综合收益总额	-	-	-22,701,705.12	-22,701,705.12
(二)、本期基金份额交易产生的基金净值变动数(净值减少以“-”号填列)	-1,875,616.86	-	-3,076,626.50	-4,952,243.36
其中：1. 基金申	11,757,739.02	-	27,113,598.51	38,871,337.53

购款				
2. 基金赎回款	-13,633,355.88	-	-30,190,225.01	-43,823,580.89
(三)、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)	-	-	-	-
(四)、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期末净资产(基金净值)	43,046,193.80	-	99,941,118.87	142,987,312.67
项目	上年度可比期间 2021年1月1日至2021年6月30日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产(基金净值)	50,184,698.40	-	104,023,199.61	154,207,898.01
加:会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期初净资产(基金净值)	50,184,698.40	-	104,023,199.61	154,207,898.01

三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	-3,912,672.16	-	6,923,599.56	3,010,927.40
(一)、综合收益总额	-	-	15,177,197.19	15,177,197.19
(二)、本期基金份额交易产生的基金净值变动数(净值减少以“-”号填列)	-3,912,672.16	-	-8,253,597.63	-12,166,269.79
其中:1.基金申购款	6,312,366.84	-	14,030,003.15	20,342,369.99
2.基金赎回款	-10,225,039.00	-	-22,283,600.78	-32,508,639.78
(三)、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)	-	-	-	-
(四)、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资产(基	46,272,026.24	-	110,946,799.17	157,218,825.41

金净值)				
------	--	--	--	--

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署：

<u>谭晓冈</u>	<u>范瑛</u>	<u>孙蕊</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

6.4 报表附注

6.4.1 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%×沪深300指数+20%×中证综合债券指数。

6.4.2 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。

6.4.3 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 2022 年 6 月 30 日的财务状况以及自 2022 年 1 月 1 日起至 2022 年 6 月 30 日止期间的经营成果和净值变动情况。

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

除下述变更后的会计政策外，本基金报告期所采用的其他会计政策、会计估计与最近一期年度会计报表所采用的会计政策、会计估计一致。

1、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根据管理金融资产的业务模式和金融资产的合同现金流量特征分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、以摊余成本计量的金融资产；

（2）金融负债分类

除了由于金融资产转移不符合终止确认条件或继续涉入被转移金融资产所形成的金融负债以外，本基金的金融负债于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债、以摊余成本计量的金融负债。

2、金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

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。

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和金融负债，以及不作为有效套期工具的衍生工具，按照取得时的公允价值作为初始确认金额，相关的交易费用在发生时计入当期损益。

划分为以摊余成本计量的金融资产和金融负债，按照取得时的公允价值作为初始确认金额，相关交易费用计入其初始确认金额。

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，采用公允价值进行后续计量，所有

公允价值变动计入当期损益。

对于以摊余成本计量的金融资产，采用实际利率法确认利息收入，其终止确认、修改或减值产生的利得或损失，均计入当期损益。

本基金以预期信用损失为基础，对以摊余成本计量的金融资产进行减值处理并确认损失准备。对于不含重大融资成分的应收款项，本基金运用简化计量方法，按照相当于整个存续期内的预期信用损失金额计量损失准备。除上述采用简化计量方法以外的金融资产，本基金在每个估值日评估其信用风险自初始确认后是否已经显著增加，如果信用风险自初始确认后未显著增加，处于第一阶段，本基金按照相当于未来 12 个月内预期信用损失的金额计量损失准备，并按照账面余额和实际利率计算利息收入；如果信用风险自初始确认后已显著增加但尚未发生信用减值的，处于第二阶段，本基金按照相当于整个存续期内预期信用损失的金额计量损失准备，并按照账面余额和实际利率计算利息收入；如果初始确认后发生信用减值的，处于第三阶段，本基金按照相当于整个存续期内预期信用损失的金额计量损失准备，并按照摊余成本和实际利率计算利息收入。

本基金在每个估值日评估相关金融工具的信用风险自初始确认后是否已显著增加。本基金以单项金融工具或者具有相似信用风险特征的金融工具组合为基础，通过比较金融工具在估值日发生违约的风险与在初始确认日发生违约的风险，以确定金融工具预计存续期内发生违约风险的变化情况。

本基金计量金融工具预期信用损失的方法反映的因素包括：通过评价一系列可能的结果而确定的无偏概率加权平均金额、货币时间价值，以及在估值日无须付出不必要的额外成本或努力即可获得的有关过去事项、当前状况以及未来经济状况预测的合理且有依据的信息。

当对金融资产预期未来现金流量具有不利影响的一项或多项事件发生时，该金融资产成为已发生信用减值的金融资产。

当本基金不再合理预期能够全部或部分收回金融资产合同现金流量时，本基金直接减记该金融资产的账面余额。

当收取该金融资产现金流量的合同权利终止，或该收取金融资产现金流量的权利已转移，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。

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。

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债（含交易性金融负债和衍生金融负债），按照公允价值进行后续计量，所有公允价值变动均计入当期损益。对于以摊余成本计量的金融负债，采用实际利率法，按照摊余成本进行后续计量。如果金融负债的责任已履行、撤销或届满，则对金融负债进行终止确认。

3、收入/（损失）的确认和计量

（1）对于以摊余成本计量的金融资产，采用实际利率法计算的利息扣除在适用情况下的相关税费后的净额确认利息收入，计入当期损益。处置时，其处置价格扣除相关交易费用后的净额与账面价值之间的差额确认为投资收益。

（2）对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和金融负债，相关交易费用直接计入投资收益。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产为债权投资的，在持有期间将按票面或合同利率计算的利息收入扣除在适用情况下的相关税费后的净额计入投资收益，扣除该部分利息后的公允价值变动额计入公允价值变动损益；除上述之外的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和金融负债的公允价值变动形成的应计入当期损益的利得或损失扣除在适用情况下预估的增值税费后的净额计入公允价值变动损益。处置时，其处置价格与初始确认金额之间的差额扣除相关交易费用及在适用情况下的相关税费后的净额确认为投资收益。

本基金在同时符合下列条件时确认股利收入并计入当期损益：1）基金收取股利的权利已经确立；2）与股利相关的经济利益很可能流入企业；3）股利的金额能够可靠计量。

（3）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。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 会计政策变更的说明

新金融工具准则

根据《企业会计准则第 22 号——金融工具确认和计量》、《企业会计准则第 23 号——金融资产转移》、《企业会计准则第 24 号——套期会计》、《企业会计准则第 37 号——金融工具列报》（统称“新金融工具准则”）、《关于进一步贯彻落实新金融工具相关会计准则的通知》的规定和相关法规的要求，本基金自 2022 年 1 月 1 日开始按照新金融工具准则进行会计处理，根据衔接规定，对可比期间信息不予调整，首日执行新金融工具准则与现行准则的差异追溯调整本报告期期初未分配利润。

新金融工具准则改变了金融资产的分类和计量方式，确定了三个主要的计量类别：摊余成本；以公允价值计量且其变动计入其他综合收益；以公允价值计量且其变动计入当期损益。本基金考

虑自身业务模式，以及金融资产的合同现金流特征进行上述分类。

新金融工具准则要求金融资产减值计量由“已发生损失模型”改为“预期信用损失模型”，适用于以摊余成本计量的金融资产。金融资产减值计量的变更对于本基金的影响不重大。

本基金将基于实际利率法计提的金融工具的利息包含在相应金融工具的账面余额中，并反映在相关“银行存款”、“结算备付金”、“存出保证金”、“买入返售金融资产”、“卖出回购金融资产”等项目中，不单独列示“应收利息”项目或“应付利息”项目。

在首次执行日，原金融资产账面价值调整为按照修订后金融工具确认和计量准则的规定进行分类和计量的新金融资产账面价值的调节表：

账面价值

银行存款

2021 年 12 月 31 日，按原金融工具准则列示的余额 20,911,560.89

重分类：转入自应收利息 3,660.90

重新计量：预期信用损失准备 -

2022 年 1 月 1 日，按新金融工具准则列示的余额 20,915,221.79

结算备付金

2021 年 12 月 31 日，按原金融工具准则列示的余额 559,253.30

重分类：转入自应收利息 251.60

重新计量：预期信用损失准备 -

2022 年 1 月 1 日，按新金融工具准则列示的余额 559,504.90

存出保证金

2021 年 12 月 31 日，按原金融工具准则列示的余额 86,188.88

重分类：转入自应收利息 38.80

重新计量：预期信用损失准备 -

2022 年 1 月 1 日，按新金融工具准则列示的余额 86,227.68

交易性金融资产

2021 年 12 月 31 日，按原金融工具准则列示的余额 153,276,923.46

重分类：转入自应收利息 158.34

2022 年 1 月 1 日，按新金融工具准则列示的余额 153,277,081.80

买入返售金融资产

2021 年 12 月 31 日，按原金融工具准则列示的余额 -

重分类：转入自应收利息 -

重新计量：预期信用损失准备 -

2022 年 1 月 1 日，按新金融工具准则列示的余额 -

应收利息

2021 年 12 月 31 日，按原金融工具准则列示的余额 4,109.64

重分类：转出至银行存款 -3,660.90

重分类：转出至结算备付金 -251.60

重分类：转出至存出保证金 -38.80

重分类：转出至交易性金融资产 -158.34

重分类：转出至买入返售金融资产 -

重分类：转出至应收申购款 -

重分类：转出至其他资产 -

2022 年 1 月 1 日，按新金融工具准则列示的余额 不适用

应收申购款

2021 年 12 月 31 日，按原金融工具准则列示的余额 26,501.18

重分类：转入自应收利息 -

重新计量：预期信用损失准备 -

2022 年 1 月 1 日，按新金融工具准则列示的余额 26,501.18

其他资产

2021 年 12 月 31 日，按原金融工具准则列示的余额 -

重分类：转入自应收利息 -

重新计量：预期信用损失准备 -

2022 年 1 月 1 日，按新金融工具准则列示的余额 -

卖出回购金融资产款

2021 年 12 月 31 日，按原金融工具准则列示的余额 -

重分类：转入自应付利息 -

2022 年 1 月 1 日，按新金融工具准则列示的余额 -

应付利息

2021 年 12 月 31 日，按原金融工具准则列示的余额 -

重分类：转出至卖出回购金融资产款 -

2022 年 1 月 1 日，按新金融工具准则列示的余额 不适用

6.4.5.2 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。

6.4.5.3 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。

6.4.6 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。

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2022 年 6 月 30 日
活期存款	14,080,973.40
等于：本金	14,078,177.08
加：应计利息	2,796.32
减：坏账准备	-
定期存款	-
等于：本金	-
加：应计利息	-
减：坏账准备	-
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	-
等于：本金	-
加：应计利息	-
减：坏账准备	-
合计	14,080,973.40

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2022 年 6 月 30 日				
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动	
股票	115,628,283.22	-	126,658,889.61	11,030,606.39	
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	-	
债券	交易所市场	484,500.00	256.70	641,739.14	156,982.44
	银行间市场	-	-	-	-
	合计	484,500.00	256.70	641,739.14	156,982.44
资产支持证券	-	-	-	-	
基金	-	-	-	-	
其他	-	-	-	-	
合计	116,112,783.22	256.70	127,300,628.75	11,187,588.83	

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

6.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

无。

6.4.7.3.2 期末基金持有的期货合约情况

无。

6.4.7.3.3 期末基金持有的黄金衍生品情况

无。

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

无。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

无。

6.4.7.4.3 按预期信用损失一般模型计提减值准备的说明

无。

6.4.7.5 债权投资

6.4.7.5.1 债权投资情况

无。

6.4.7.5.2 债权投资减值准备计提情况

无。

6.4.7.6 其他债权投资

6.4.7.6.1 其他债权投资情况

无。

6.4.7.6.2 其他债权投资减值准备计提情况

无。

6.4.7.7 其他权益工具投资

6.4.7.7.1 其他权益工具投资情况

无。

6.4.7.7.2 报告期末其他权益工具投资情况

无。

6.4.7.8 其他资产

无。

6.4.7.9 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2022年6月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	76,460.86
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	385,802.15
其中：交易所市场	385,802.15
银行间市场	-

应付利息	-
预提费用	209,260.15
合计	671,523.16

6.4.7.10 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	44,921,810.66	44,921,810.66
本期申购	11,757,739.02	11,757,739.02
本期赎回（以“-”号填列）	-13,633,355.88	-13,633,355.88
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	43,046,193.80	43,046,193.80

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

6.4.7.11 其他综合收益

无。

6.4.7.12 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
本期期初	114,772,874.57	10,946,575.92	125,719,450.49
本期利润	-11,523,223.85	-11,178,481.27	-22,701,705.12
本期基金份额交易产生的变动数	-3,425,737.89	349,111.39	-3,076,626.50
其中：基金申购款	29,612,411.43	-2,498,812.92	27,113,598.51
基金赎回款	-33,038,149.32	2,847,924.31	-30,190,225.01
本期已分配利润	-	-	-
本期末	99,823,912.83	117,206.04	99,941,118.87

6.4.7.13 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年6月30日	
	活期存款利息收入	73,031.42
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	3,032.61	
其他	638.24	
合计	76,702.27	

6.4.7.14 股票投资收益

6.4.7.14.1 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期
	2022年1月1日至2022年6月30日
卖出股票成交总额	320,368,571.88
减：卖出股票成本总额	330,493,696.15
减：交易费用	956,098.82
买卖股票差价收入	-11,081,223.09

6.4.7.14.2 股票投资收益——证券出借差价收入

无。

6.4.7.15 债券投资收益

6.4.7.15.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期
	2022年1月1日至2022年6月30日
债券投资收益——利息收入	361.14
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	138,957.45
债券投资收益——赎回差价收入	-
债券投资收益——申购差价收入	-
合计	139,318.59

6.4.7.15.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期
	2022年1月1日至2022年6月30日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	636,998.40
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	497,800.00
减：应计利息总额	234.49
减：交易费用	6.46
买卖债券差价收入	138,957.45

6.4.7.16 资产支持证券投资收益

无。

6.4.7.17 贵金属投资收益

无。

6.4.7.18 衍生工具收益

无。

6.4.7.19 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年6月30日
股票投资产生的股利收益	734,878.60
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	734,878.60

6.4.7.20 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2022年1月1日至2022年6月30日
1. 交易性金融资产	-11,178,481.27
股票投资	-11,235,466.17
债券投资	56,984.90
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	-11,178,481.27

6.4.7.21 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年6月30日
基金赎回费收入	41,813.81
基金转换费收入	5,605.82
合计	47,419.63

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

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

6.4.7.22 信用减值损失

无。

6.4.7.23 其他费用

单位：人民币元

项目	本期
	2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
审计费用	29,752.78
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
银行划款手续费	3,994.75
账户维护费	9,000.00
合计	102,254.90

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 或有事项

无。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

无。

6.4.9 关联方关系

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

本基金本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
大成基金管理有限公司（“大成基金”）	基金管理人、注册登记机构、基金销售机构
中国农业银行股份有限公司（“中国农业银行”）	基金托管人、基金销售机构
光大证券股份有限公司（“光大证券”）	基金管理人的股东、基金销售机构

注：以下关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2022年1月1日至2022年6月30日		上年度可比期间 2021年1月1日至2021年6月30日	
	成交金额	占当期股票 成交总额的比例 (%)	成交金额	占当期股票 成交总额的比例(%)
光大证券	34,655,425.19	5.48	62,544,095.30	14.12

6.4.10.1.2 债券交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2022年1月1日至2022年6月30日		上年度可比期间 2021年1月1日至2021年6月30日	
	成交金额	占当期债券 成交总额的比例 (%)	成交金额	占当期债券 成交总额的比例 (%)
光大证券	482,443.60	75.74	-	-

6.4.10.1.3 债券回购交易

无。

6.4.10.1.4 权证交易

无。

6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2022年1月1日至2022年6月30日			
	当期 佣金	占当期佣金总量 的比例 (%)	期末应付佣金余 额	占期末应付佣金 总额的比例 (%)
光大证券	31,577.85	5.45	10,305.79	2.67
关联方名称	上年度可比期间 2021年1月1日至2021年6月30日			
	当期 佣金	占当期佣金总量 的比例 (%)	期末应付佣金余 额	占期末应付佣金 总额的比例 (%)
光大证券	57,006.16	14.12	-	-

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。

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	1,146,911.85	1,105,918.75
其中：支付销售机构的客户维护费	343,641.88	311,402.85

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

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	191,151.93	184,319.74

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

6.4.10.2.3 销售服务费

无。

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

无。

6.4.10.4 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

6.4.10.4.1 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。

6.4.10.4.2 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。

6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

无。

6.4.10.5.2 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。

6.4.10.6 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 2022年1月1日至2022年6月30日		上年度可比期间 2021年1月1日至2021年6月30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	14,080,973.40	73,031.42	11,244,875.40	96,990.04

注：本基金由基金托管人保管的银行存款，按银行约定利率计息。

6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

金额单位：人民币元

本期 2022年1月1日至2022年6月30日					
关联方名称	证券代码	证券名称	发行方式	基金在承销期内买入	
				数量（单位：张）	总金额
光大证券	001268	联合精密	网下发行	409	7,873.25
上年度可比期间 2021年1月1日至2021年6月30日					
关联方名称	证券代码	证券名称	发行方式	基金在承销期内买入	
				数量（单位：张）	总金额
-	-	-	-	-	-

6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

无。

6.4.11 利润分配情况

无。

6.4.12 期末(2022 年 6 月 30 日)本基金持有的流通受限证券

6.4.12.1 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

6.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	受限期	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
301117	佳缘科技	2022 年 1 月 7 日	6 个月	新股锁定	46.80	54.44	120	5,616.00	6,532.80	-
301139	元道通信	2022 年 6 月 30 日	1 个月内(含)	新股未上市	38.46	38.46	1,678	64,535.88	64,535.88	-
301139	元道通信	2022 年 6 月 30 日	6 个月	新股锁定	38.46	38.46	187	7,192.02	7,192.02	-
301148	嘉戎技术	2022 年 4 月 14 日	6 个月	新股锁定	38.39	23.90	194	7,447.66	4,636.60	-
301150	中一科技	2022 年 4 月 14 日	6 个月	新股锁定	163.56	82.76	69	7,523.76	5,710.44	2022-6-10 每股送 0.5 股
301153	中科江南	2022 年 5 月 10 日	6 个月	新股锁定	33.68	43.98	135	4,546.80	5,937.30	-
301162	国能日新	2022 年 4 月 19 日	6 个月	新股锁定	45.13	54.11	145	6,543.85	7,845.95	-
301163	宏德股份	2022 年 4 月 11 日	6 个月	新股锁定	26.27	32.33	226	5,937.02	7,306.58	-
301196	唯科科技	2022 年 1 月 4 日	6 个月	新股锁定	64.08	37.52	55	3,524.40	2,063.60	-
301200	大族数控	2022 年 2 月 18 日	6 个月	新股锁定	76.56	51.92	80	6,124.80	4,153.60	-
301207	华兰疫苗	2022 年 2 月 10 日	6 个月	新股锁定	56.88	56.42	80	4,550.40	4,513.60	-
301216	万凯新材	2022 年 3 月 21 日	6 个月	新股锁定	35.68	29.84	187	6,672.16	5,580.08	-

301217	铜冠铜箔	2022年1月20日	6个月	新股锁定	17.27	14.83	469	8,099.63	6,955.27	-
301219	腾远钴业	2022年3月10日	6个月	新股锁定	173.98	87.82	50	4,871.44	4,391.00	2022-5-24 每股送 0.8股
301222	浙江恒威	2022年3月2日	6个月	新股锁定	33.98	28.96	156	5,300.88	4,517.76	-
301228	实朴检测	2022年1月21日	6个月	新股锁定	20.08	20.34	265	5,321.20	5,390.10	-
301248	杰创智能	2022年4月13日	6个月	新股锁定	39.07	29.87	195	7,618.65	5,824.65	-
301258	富士莱	2022年3月21日	6个月	新股锁定	48.30	41.68	100	4,830.00	4,168.00	-
301268	铭利达	2022年3月29日	6个月	新股锁定	28.50	34.87	188	5,358.00	6,555.56	-
301279	金道科技	2022年4月6日	6个月	新股锁定	31.20	22.81	146	4,555.20	3,330.26	-
301288	清研环境	2022年4月14日	6个月	新股锁定	19.09	19.98	333	6,356.97	6,653.34	-
600938	中国海油	2022年4月14日	6个月	新股锁定	10.80	15.86	84,004	907,243.20	1,332,303.44	-
688237	超卓航科	2022年6月24日	1个月内(含)	新股未上市	41.27	41.27	1,379	56,911.33	56,911.33	-
688322	奥比中光	2022年6月30日	1个月内(含)	新股未上市	30.99	30.99	2,361	73,167.39	73,167.39	-

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。

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

无。

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

无。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

无。

6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

无。

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 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。

6.4.13.2 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 0.45%（上年度末：0.14%）。

6.4.13.3 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。

6.4.13.3.1 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%。

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。

6.4.13.4 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。

6.4.13.4.1 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。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2022 年 6 月 30 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	14,080,973.40	-	-	-	14,080,973.40
结算备付金	458,313.26	-	-	-	458,313.26
存出保证金	74,218.52	-	-	-	74,218.52

交易性金融资产	-	31,803.80	609,935.34	126,658,889.61	127,300,628.75
应收申购款	-	-	-	100,166.24	100,166.24
应收清算款	-	-	-	22,342,679.20	22,342,679.20
资产总计	14,613,505.18	31,803.80	609,935.34	149,101,735.05	164,356,979.37
负债	-	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	20,470,965.67	20,470,965.67
应付管理人报酬	-	-	-	194,722.10	194,722.10
应付托管费	-	-	-	32,453.68	32,453.68
应交税费	-	-	-	2.09	2.09
其他负债	-	-	-	671,523.16	671,523.16
负债总计	-	-	-	21,369,666.70	21,369,666.70
利率敏感度缺口	14,613,505.18	31,803.80	609,935.34	127,732,068.35	142,987,312.67
上年度末 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
应收申购款	-	-	-	26,501.18	26,501.18
其他资产	-	-	-	4,109.64	4,109.64
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
应交税费	-	-	-	0.69	0.69
其他负债	-	-	-	495,486.02	495,486.02
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

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

6.4.13.4.1.2 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 0.45%（上年度末：0.14%），因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响（上年度末：同）。

6.4.13.4.2 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。

6.4.13.4.3 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%。

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2022年6月30日		上年度末 2021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	126,658,889.61	88.58	153,038,125.92	89.68
交易性金融资产—基金投资	—	—	—	—
交易性金融资产—贵金属投资	—	—	—	—
衍生金融资产—权证投资	—	—	—	—
其他	—	—	—	—
合计	126,658,889.61	88.58	153,038,125.92	89.68

6.4.13.4.3.2 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（2022年6月30日）	上年度末（2021年12月31日）
分析	业绩比较基准上升5%	9,663,445.03	10,679,554.65
	业绩比较基准下降	-9,663,445.03	-10,679,554.65

	5%		
--	----	--	--

6.4.14 公允价值

6.4.14.1 金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属的层次，由对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次决定：第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价；第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值；第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

6.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

6.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2022年6月30日	上年度末 2021年12月31日
第一层次	125,664,452.20	152,868,802.26
第二层次	201,806.62	408,121.20
第三层次	1,434,369.93	-
合计	127,300,628.75	153,276,923.46

6.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

对于公开市场交易的证券、基金等投资，若出现交易不活跃、非公开发行等情况，本基金不会于交易不活跃期间及限售期间将相关投资的公允价值列入第一层次，并根据估值调整中采用的对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次，确定相关投资的公允价值应属第二层次或第三层次。

6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

本基金本报告期末及上年度末均未持有非持续的以公允价值计量的金融工具。

6.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

本基金持有的不以公允价值计量的金融工具为以摊余成本计量的金融资产和金融负债，这些金融工具因其剩余期限较短，所以其账面价值与公允价值相若。

6.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

无。

§ 7 投资组合报告

7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	126,658,889.61	77.06
	其中：股票	126,658,889.61	77.06
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	641,739.14	0.39
	其中：债券	641,739.14	0.39
	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	14,539,286.66	8.85
8	其他各项资产	22,517,063.96	13.70
9	合计	164,356,979.37	100.00

7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	41,700.24	0.03
B	采矿业	6,843,747.88	4.79
C	制造业	103,962,164.56	72.71
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	184,174.10	0.13
E	建筑业	37,666.78	0.03
F	批发和零售业	1,073,845.96	0.75
G	交通运输、仓储和邮政业	3,250,585.50	2.27
H	住宿和餐饮业	613.86	0.00
I	信息传输、软件和信息技术服务业	1,926,252.24	1.35
J	金融业	120,046.15	0.08
K	房地产业	239.37	0.00
L	租赁和商务服务业	34,285.81	0.02
M	科学研究和技术服务业	7,954,894.48	5.56
N	水利、环境和公共设施管理业	88,419.22	0.06
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	19,624.14	0.01

Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	1,120,629.32	0.78
S	综合	-	-
	合计	126,658,889.61	88.58

7.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

无。

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	002475	立讯精密	216,400	7,312,156.00	5.11
2	000858	五粮液	33,500	6,764,655.00	4.73
3	600519	贵州茅台	3,032	6,200,440.00	4.34
4	603259	药明康德	58,100	6,041,819.00	4.23
5	603799	华友钴业	59,320	5,672,178.40	3.97
6	603986	兆易创新	35,505	5,049,166.05	3.53
7	601001	晋控煤业	266,600	4,732,150.00	3.31
8	603501	韦尔股份	23,700	4,100,811.00	2.87
9	688388	嘉元科技	47,933	4,068,073.71	2.85
10	601615	明阳智能	106,300	3,592,940.00	2.51
11	000625	长安汽车	206,960	3,584,547.20	2.51
12	300390	天华超净	39,800	3,478,520.00	2.43
13	002460	赣锋锂业	23,000	3,420,100.00	2.39
14	300750	宁德时代	6,400	3,417,600.00	2.39
15	300363	博腾股份	43,400	3,384,766.00	2.37
16	688668	鼎通科技	47,052	3,309,637.68	2.31
17	300037	新宙邦	60,200	3,164,112.00	2.21
18	601872	招商轮船	539,800	3,109,248.00	2.17
19	688665	四方光电	19,586	2,898,728.00	2.03
20	002594	比亚迪	8,100	2,701,269.00	1.89
21	600438	通威股份	41,903	2,508,313.58	1.75
22	002138	顺络电子	85,700	2,335,325.00	1.63
23	002245	蔚蓝锂芯	90,800	2,107,468.00	1.47
24	300679	电连技术	43,500	1,922,265.00	1.34
25	002824	和胜股份	32,700	1,798,173.00	1.26
26	688778	厦钨新能	15,987	1,782,070.89	1.25
27	300347	泰格医药	15,500	1,773,975.00	1.24
28	688297	中无人机	31,940	1,698,569.20	1.19
29	688167	炬光科技	10,943	1,627,771.25	1.14
30	688012	中微公司	13,797	1,610,799.75	1.13
31	600845	宝信软件	28,730	1,568,658.00	1.10

32	002920	德赛西威	9,500	1,406,000.00	0.98
33	600938	中国海油	84,004	1,332,303.44	0.93
34	002008	大族激光	38,880	1,288,094.40	0.90
35	600399	抚顺特钢	68,600	1,227,940.00	0.86
36	688032	禾迈股份	1,260	1,097,460.00	0.77
37	603989	艾华集团	37,000	1,043,400.00	0.73
38	600546	山煤国际	48,900	951,594.00	0.67
39	688608	恒玄科技	5,886	809,913.60	0.57
40	688686	奥普特	3,122	807,505.30	0.56
41	600338	西藏珠峰	26,800	769,160.00	0.54
42	002459	晶澳科技	8,897	701,973.30	0.49
43	300144	宋城演艺	37,100	569,485.00	0.40
44	002916	深南电路	5,800	543,518.00	0.38
45	300821	东岳硅材	28,600	525,668.00	0.37
46	300251	光线传媒	54,900	519,903.00	0.36
47	603626	科森科技	30,800	228,844.00	0.16
48	688055	龙腾光电	36,922	199,009.58	0.14
49	688091	上海谊众	1,054	168,007.60	0.12
50	603920	世运电路	7,400	128,020.00	0.09
51	301163	宏德股份	2,257	83,286.29	0.06
52	688676	金盘科技	3,161	82,186.00	0.06
53	688110	东芯股份	2,060	78,115.20	0.05
54	688322	奥比中光	2,361	73,167.39	0.05
55	301139	元道通信	1,865	71,727.90	0.05
56	688767	博拓生物	1,012	62,399.92	0.04
57	688722	同益中	3,687	61,720.38	0.04
58	688696	极米科技	200	61,574.00	0.04
59	601963	重庆银行	7,472	59,327.68	0.04
60	688528	秦川物联	5,679	59,231.97	0.04
61	001270	铖昌科技	568	57,481.60	0.04
62	688237	超卓航科	1,379	56,911.33	0.04
63	601702	华峰铝业	4,166	54,991.20	0.04
64	301228	实朴检测	2,646	54,629.18	0.04
65	301091	深城交	1,929	52,661.70	0.04
66	688071	华依科技	1,101	50,910.24	0.04
67	688697	纽威数控	3,331	50,431.34	0.04
68	301221	光庭信息	757	49,076.31	0.03
69	003031	中瓷电子	759	49,031.40	0.03
70	688117	圣诺生物	1,672	48,571.60	0.03
71	688260	昀冢科技	2,990	48,079.20	0.03
72	301222	浙江恒威	1,560	47,732.88	0.03
73	301138	华研精机	1,551	47,693.25	0.03

74	605366	宏柏新材	1,588	47,306.52	0.03
75	688687	凯因科技	2,563	45,262.58	0.03
76	688609	九联科技	5,424	45,236.16	0.03
77	605399	晨光新材	1,053	44,805.15	0.03
78	688127	蓝特光学	1,987	44,628.02	0.03
79	600032	浙江新能	3,045	44,609.25	0.03
80	688161	威高骨科	918	44,238.42	0.03
81	301182	凯旺科技	1,856	44,098.56	0.03
82	688618	三旺通信	1,028	43,525.52	0.03
83	605589	圣泉集团	1,750	43,172.50	0.03
84	688557	兰剑智能	1,329	42,753.93	0.03
85	688577	浙海德曼	1,036	42,538.16	0.03
86	688336	三生国健	2,687	41,755.98	0.03
87	601156	东航物流	2,090	41,382.00	0.03
88	688622	禾信仪器	1,204	41,200.88	0.03
89	688551	科威尔	1,032	40,681.44	0.03
90	301193	家联科技	1,485	40,317.75	0.03
91	603529	爱玛科技	760	39,808.80	0.03
92	600916	中国黄金	3,371	39,440.70	0.03
93	002993	奥海科技	936	38,900.16	0.03
94	301179	泽宇智能	950	38,769.50	0.03
95	688355	明志科技	1,806	38,666.46	0.03
96	688156	路德环境	1,788	38,138.04	0.03
97	688578	艾力斯	1,751	36,946.10	0.03
98	301190	善水科技	1,554	36,876.42	0.03
99	601089	福元医药	1,749	36,816.45	0.03
100	688799	华纳药厂	1,122	36,072.30	0.03
101	301079	邵阳液压	1,396	34,620.80	0.02
102	688739	成大生物	679	34,499.99	0.02
103	688656	浩欧博	877	34,317.01	0.02
104	688395	正弦电气	1,627	34,215.81	0.02
105	688517	金冠电气	2,892	33,662.88	0.02
106	688226	威腾电气	2,693	33,527.85	0.02
107	601665	齐鲁银行	6,731	32,847.28	0.02
108	300760	迈瑞医疗	100	31,320.00	0.02
109	001201	东瑞股份	802	30,941.16	0.02
110	605090	九丰能源	1,526	30,932.02	0.02
111	605338	巴比食品	1,012	30,876.12	0.02
112	688511	天微电子	819	30,663.36	0.02
113	605337	李子园	1,103	30,531.04	0.02
114	301092	争光股份	969	30,484.74	0.02
115	301093	华兰股份	899	30,467.11	0.02

116	600563	法拉电子	148	30,363.68	0.02
117	603324	盛剑环境	732	29,924.16	0.02
118	688038	中科通达	2,132	29,911.96	0.02
119	688276	百克生物	445	29,525.75	0.02
120	688092	爱科科技	1,137	29,289.12	0.02
121	605507	国邦医药	1,202	29,028.30	0.02
122	001213	中铁特货	5,818	28,566.38	0.02
123	001323	慕思股份	573	28,111.38	0.02
124	688701	卓锦股份	2,340	27,658.80	0.02
125	688501	青达环保	1,759	27,071.01	0.02
126	688191	智洋创新	1,575	26,775.00	0.02
127	603191	望变电气	1,149	26,197.20	0.02
128	688681	科汇股份	1,899	25,313.67	0.02
129	001318	阳光乳业	1,142	25,249.62	0.02
130	688067	爱威科技	1,208	25,150.56	0.02
131	003039	顺控发展	1,024	24,729.60	0.02
132	605305	中际联合	508	24,597.36	0.02
133	601921	浙版传媒	3,154	24,538.12	0.02
134	605286	同力日升	597	24,148.65	0.02
135	603206	嘉环科技	1,210	23,353.00	0.02
136	301088	戎美股份	1,250	23,325.00	0.02
137	003038	鑫铂股份	460	23,184.00	0.02
138	003040	楚天龙	1,101	22,636.56	0.02
139	605006	山东玻纤	1,942	22,235.90	0.02
140	605339	南侨食品	864	21,919.68	0.02
141	001208	华菱线缆	1,754	21,784.68	0.02
142	688737	中自科技	520	21,491.60	0.02
143	603051	鹿山新材	272	21,488.00	0.02
144	003028	振邦智能	432	21,107.52	0.01
145	605020	永和股份	850	20,927.00	0.01
146	001228	永泰运	383	20,739.45	0.01
147	605336	帅丰电器	701	20,714.55	0.01
148	688296	和达科技	766	20,107.50	0.01
149	003012	东鹏控股	2,278	19,909.72	0.01
150	688418	震有科技	2,118	19,909.20	0.01
151	605167	利柏特	2,472	19,602.96	0.01
152	605222	起帆电缆	858	19,536.66	0.01
153	835179	凯德石英	900	19,485.00	0.01
154	301089	拓新药业	154	19,345.48	0.01
155	605555	德昌股份	752	19,153.44	0.01
156	605077	华康股份	865	19,073.25	0.01
157	605016	百龙创园	445	18,698.90	0.01

158	605268	王力安防	1,642	18,012.74	0.01
159	601528	瑞丰银行	2,230	17,973.80	0.01
160	603171	税友股份	637	17,823.26	0.01
161	003019	宸展光电	691	17,440.84	0.01
162	605208	永茂泰	1,081	17,112.23	0.01
163	001212	中旗新材	400	16,852.00	0.01
164	605050	福然德	1,197	16,793.91	0.01
165	603759	海天股份	1,656	16,742.16	0.01
166	001215	千味央厨	295	16,605.55	0.01
167	603070	万控智造	775	16,197.50	0.01
168	605060	联德股份	883	16,026.45	0.01
169	001205	盛航股份	808	15,998.40	0.01
170	003037	三和管桩	1,274	15,581.02	0.01
171	605333	沪光股份	670	15,477.00	0.01
172	001319	铭科精技	536	15,474.32	0.01
173	001317	三羊马	300	15,222.00	0.01
174	605368	蓝天燃气	1,204	15,170.40	0.01
175	001313	粤海饲料	1,232	15,104.32	0.01
176	605068	明新旭腾	641	14,967.35	0.01
177	605008	长鸿高科	1,039	14,566.78	0.01
178	605169	洪通燃气	1,292	14,547.92	0.01
179	003029	吉大正元	716	14,534.80	0.01
180	605277	新亚电子	705	14,431.35	0.01
181	605183	确成股份	741	14,301.30	0.01
182	003020	立方制药	486	14,298.12	0.01
183	605056	咸亨国际	934	14,168.78	0.01
184	605133	嵘泰股份	618	14,139.84	0.01
185	605116	奥锐特	642	14,046.96	0.01
186	605123	派克新材	99	13,931.28	0.01
187	301162	国能日新	243	13,847.47	0.01
188	002835	同为股份	1,400	13,846.00	0.01
189	603112	华翔股份	920	13,717.20	0.01
190	601279	英利汽车	2,004	13,687.32	0.01
191	603097	江苏华辰	577	13,617.20	0.01
192	603209	兴通股份	595	13,518.40	0.01
193	603836	海程邦达	733	13,443.22	0.01
194	605389	长龄液压	498	13,341.42	0.01
195	605018	长华股份	840	13,339.20	0.01
196	003030	祖名股份	480	13,324.80	0.01
197	605179	一鸣食品	939	13,277.46	0.01
198	301219	腾远钴业	144	13,084.12	0.01
199	003002	壶化股份	921	12,986.10	0.01

200	002996	顺博合金	849	12,904.80	0.01
201	605151	西上海	723	12,840.48	0.01
202	003025	思进智能	619	12,807.11	0.01
203	002999	天禾股份	1,726	12,634.32	0.01
204	603216	梦天家居	772	12,498.68	0.01
205	001266	宏英智能	247	12,298.13	0.01
206	003013	地铁设计	724	12,206.64	0.01
207	603215	比依股份	575	12,115.25	0.01
208	603213	镇洋发展	799	11,961.03	0.01
209	300850	新强联	133	11,840.99	0.01
210	001218	丽臣实业	490	11,701.20	0.01
211	605028	世茂能源	584	11,639.12	0.01
212	605007	五洲特纸	598	11,625.12	0.01
213	001207	联科科技	682	11,600.82	0.01
214	605066	天正电气	1,278	11,438.10	0.01
215	001268	联合精密	409	11,337.48	0.01
216	605098	行动教育	404	11,215.04	0.01
217	605319	无锡振华	764	11,108.56	0.01
218	605005	合兴股份	634	10,993.56	0.01
219	301117	佳缘科技	196	10,783.48	0.01
220	688109	品茗股份	346	10,691.40	0.01
221	605365	立达信	645	10,687.65	0.01
222	605599	菜百股份	980	10,662.40	0.01
223	001206	依依股份	321	10,641.15	0.01
224	002985	北摩高科	181	10,602.98	0.01
225	605058	澳弘电子	548	10,576.40	0.01
226	605218	伟时电子	837	10,504.35	0.01
227	600460	士兰微	200	10,400.00	0.01
228	300122	智飞生物	90	9,990.90	0.01
229	605598	上海港湾	553	9,987.18	0.01
230	301268	铭利达	276	9,934.76	0.01
231	605566	福莱蒾特	435	9,926.70	0.01
232	002407	多氟多	200	9,782.00	0.01
233	603272	联翔股份	443	9,723.85	0.01
234	603511	爱慕股份	553	9,660.91	0.01
235	002998	优彩资源	1,353	9,619.83	0.01
236	605300	佳禾食品	576	9,578.88	0.01
237	003018	金富科技	1,027	9,499.75	0.01
238	605488	福莱新材	603	9,491.22	0.01
239	605228	神通科技	1,217	9,407.41	0.01
240	605289	罗曼股份	474	9,375.72	0.01
241	605069	正和生态	608	9,326.72	0.01

242	605358	立昂微	138	9,298.44	0.01
243	001217	华尔泰	686	9,288.44	0.01
244	605196	华通线缆	1,172	9,235.36	0.01
245	002001	新和成	401	9,146.81	0.01
246	003021	兆威机电	191	9,124.07	0.01
247	003001	中岩大地	493	9,081.06	0.01
248	605138	盛泰集团	723	9,023.04	0.01
249	001234	泰慕士	333	9,017.64	0.01
250	301288	清研环境	430	9,012.38	0.01
251	603408	建霖家居	762	8,915.40	0.01
252	605086	龙高股份	443	8,877.72	0.01
253	605580	恒盛能源	654	8,815.92	0.01
254	605180	华生科技	499	8,677.61	0.01
255	301149	隆华新材	561	8,588.91	0.01
256	605122	四方新材	477	8,586.00	0.01
257	605011	杭州热电	525	8,526.00	0.01
258	605259	绿田机械	295	8,425.20	0.01
259	003032	传智教育	586	8,409.10	0.01
260	001288	运机集团	537	8,382.57	0.01
261	301258	富士莱	192	8,347.56	0.01
262	003036	泰坦股份	776	8,310.96	0.01
263	605258	协和电子	340	8,211.00	0.01
264	001219	青岛食品	354	8,088.90	0.01
265	003033	征和工业	301	8,066.80	0.01
266	605299	舒华体育	738	8,058.96	0.01
267	301216	万凯新材	265	8,040.98	0.01
268	605303	园林股份	610	7,838.50	0.01
269	301188	力诺特玻	440	7,832.00	0.01
270	001210	金房节能	311	7,790.55	0.01
271	605055	迎丰股份	1,147	7,673.43	0.01
272	003027	同兴环保	430	7,503.50	0.01
273	301248	杰创智能	245	7,461.65	0.01
274	603150	万朗磁塑	250	7,442.50	0.01
275	301150	中一科技	85	7,179.08	0.01
276	301217	铜冠铜箔	483	7,168.21	0.01
277	300832	新产业	156	7,037.16	0.00
278	003003	天元股份	756	6,917.40	0.00
279	605298	必得科技	508	6,908.80	0.00
280	001209	洪兴股份	450	6,849.00	0.00
281	001202	炬申股份	459	6,742.71	0.00
282	605577	龙版传媒	588	6,703.20	0.00
283	301078	孩子王	453	6,640.98	0.00

284	003023	彩虹集团	385	6,622.00	0.00
285	003041	真爱美家	419	6,532.21	0.00
286	003004	声迅股份	306	6,383.16	0.00
287	301153	中科江南	141	6,238.44	0.00
288	003000	劲仔食品	684	6,087.60	0.00
289	300855	图南股份	144	6,017.76	0.00
290	301083	百胜智能	416	5,807.36	0.00
291	601211	国泰君安	379	5,760.80	0.00
292	605009	豪悦护理	145	5,637.60	0.00
293	301148	嘉戎技术	232	5,628.40	0.00
294	603806	福斯特	84	5,503.68	0.00
295	301207	华兰疫苗	94	5,345.34	0.00
296	301196	唯科科技	141	5,319.56	0.00
297	301200	大族数控	99	5,179.60	0.00
298	002815	崇达技术	400	5,124.00	0.00
299	300498	温氏股份	240	5,109.60	0.00
300	688700	东威科技	57	4,750.38	0.00
301	605080	浙江自然	74	4,727.86	0.00
302	605089	味知香	70	4,725.70	0.00
303	603155	新亚强	126	4,694.76	0.00
304	300657	弘信电子	396	4,601.52	0.00
305	300856	科思股份	100	4,338.00	0.00
306	300884	狄耐克	407	4,208.38	0.00
307	300829	金丹科技	118	3,825.56	0.00
308	301279	金道科技	158	3,633.02	0.00
309	832419	路斯股份	600	3,390.00	0.00
310	002982	湘佳股份	81	3,335.58	0.00
311	002258	利尔化学	131	3,094.22	0.00
312	600570	恒生电子	70	3,047.80	0.00
313	300853	申昊科技	101	2,949.20	0.00
314	002987	京北方	137	2,713.97	0.00
315	300858	科拓生物	92	2,451.80	0.00
316	605296	神农集团	90	2,313.90	0.00
317	601995	中金公司	51	2,268.99	0.00
318	300003	乐普医疗	122	2,265.54	0.00
319	002938	鹏鼎控股	68	2,054.28	0.00
320	300903	科翔股份	144	2,031.84	0.00
321	603087	甘李药业	42	2,014.74	0.00
322	688639	华恒生物	15	1,975.20	0.00
323	300828	锐新科技	115	1,932.00	0.00
324	688560	明冠新材	54	1,848.96	0.00
325	603888	新华网	100	1,715.00	0.00

326	002992	宝明科技	119	1,714.79	0.00
327	002983	芯瑞达	78	1,601.34	0.00
328	603565	中谷物流	96	1,523.52	0.00
329	605003	众望布艺	66	1,503.48	0.00
330	002986	宇新股份	59	1,385.32	0.00
331	002989	中天精装	96	1,384.32	0.00
332	605100	华丰股份	95	1,372.75	0.00
333	601233	桐昆股份	85	1,349.80	0.00
334	603439	贵州三力	97	1,272.64	0.00
335	300630	普利制药	36	1,265.40	0.00
336	605377	华旺科技	70	1,253.70	0.00
337	603931	格林达	62	1,246.20	0.00
338	000786	北新建材	35	1,211.70	0.00
339	300843	胜蓝股份	51	1,164.84	0.00
340	603950	长源东谷	81	1,154.25	0.00
341	300845	捷安高科	84	1,142.40	0.00
342	605136	丽人丽妆	67	1,059.94	0.00
343	603132	金徽股份	80	1,032.80	0.00
344	605155	西大门	70	1,031.10	0.00
345	002120	韵达股份	60	1,023.60	0.00
346	605118	力鼎光电	67	954.08	0.00
347	002976	瑞玛精密	43	926.22	0.00
348	300849	锦盛新材	72	871.92	0.00
349	605177	东亚药业	39	812.76	0.00
350	605186	健麾信息	26	799.24	0.00
351	300840	酷特智能	85	769.25	0.00
352	300857	协创数据	34	696.66	0.00
353	003016	欣贺股份	81	680.40	0.00
354	002990	盛视科技	24	676.56	0.00
355	600918	中泰证券	87	665.55	0.00
356	605099	共创草坪	24	638.16	0.00
357	605108	同庆楼	26	613.86	0.00
358	600004	白云机场	38	566.58	0.00
359	601686	友发集团	74	565.36	0.00
360	601456	国联证券	43	527.61	0.00
361	605166	聚合顺	41	523.16	0.00
362	300833	浩洋股份	6	522.96	0.00
363	605388	均瑶健康	30	515.10	0.00
364	601825	沪农商行	80	501.60	0.00
365	001308	康冠科技	17	495.89	0.00
366	605255	天普股份	30	493.50	0.00
367	603035	常熟汽饰	28	462.56	0.00

368	605199	葫芦娃	26	458.90	0.00
369	605001	威奥股份	69	442.98	0.00
370	300846	首都在线	31	419.12	0.00
371	605318	法狮龙	28	407.40	0.00
372	600956	新天绿能	33	406.56	0.00
373	603212	赛伍技术	15	399.15	0.00
374	002912	中新赛克	16	394.56	0.00
375	601778	晶科科技	49	264.60	0.00
376	002146	荣盛发展	79	239.37	0.00
377	300831	派瑞股份	16	225.92	0.00
378	601899	紫金矿业	24	223.92	0.00
379	605088	冠盛股份	16	215.68	0.00
380	002879	长缆科技	13	202.54	0.00
381	688036	传音控股	2	178.46	0.00
382	600079	人福医药	11	176.00	0.00
383	601187	厦门银行	29	172.84	0.00
384	601827	三峰环境	23	163.76	0.00
385	300838	浙江力诺	9	137.61	0.00
386	002007	华兰生物	6	136.80	0.00
387	605158	华达新材	16	103.36	0.00
388	603682	锦和商管	18	103.14	0.00
389	605188	国光连锁	3	21.72	0.00

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	603259	药明康德	11,326,446.00	6.64
2	000858	五粮液	9,456,470.00	5.54
3	603986	兆易创新	8,571,758.70	5.02
4	000792	盐湖股份	8,160,274.98	4.78
5	300390	天华超净	8,066,215.00	4.73
6	300363	博腾股份	8,002,918.00	4.69
7	601872	招商轮船	7,898,614.00	4.63
8	300037	新宙邦	7,205,764.20	4.22
9	601001	晋控煤业	7,170,491.20	4.20
10	300760	迈瑞医疗	7,030,098.00	4.12
11	600988	赤峰黄金	6,283,818.00	3.68
12	002460	赣锋锂业	5,760,265.04	3.38
13	601888	中国中免	5,494,209.00	3.22
14	688388	嘉元科技	5,472,417.61	3.21
15	000960	锡业股份	5,314,950.00	3.11

16	002027	分众传媒	5,230,584.00	3.07
17	000063	中兴通讯	5,184,085.00	3.04
18	688012	中微公司	5,082,535.01	2.98
19	601012	隆基绿能	4,961,504.87	2.91
20	603348	文灿股份	4,783,017.00	2.80
21	603392	万泰生物	4,712,389.15	2.76
22	603501	韦尔股份	4,399,667.00	2.58
23	600009	上海机场	4,313,118.00	2.53
24	600150	中国船舶	4,307,197.00	2.52
25	601899	紫金矿业	4,266,015.65	2.50
26	002709	天赐材料	4,265,351.45	2.50
27	601155	新城控股	4,219,118.00	2.47
28	002202	金风科技	3,996,092.00	2.34
29	002756	永兴材料	3,723,452.00	2.18
30	300750	宁德时代	3,668,131.30	2.15
31	301200	大族数控	3,635,374.81	2.13
32	002475	立讯精密	3,605,429.02	2.11
33	000002	万科 A	3,541,437.00	2.08
34	002821	凯莱英	3,462,273.00	2.03
35	688267	中触媒	3,429,555.06	2.01

注：本期累计买入金额指买入成交金额（成交单价乘以成交数量），不考虑相关交易费用。

7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	000792	盐湖股份	7,590,487.65	4.45
2	603392	万泰生物	7,413,129.80	4.34
3	002475	立讯精密	6,947,602.00	4.07
4	601899	紫金矿业	6,890,200.00	4.04
5	300760	迈瑞医疗	6,819,777.00	4.00
6	601888	中国中免	6,236,193.92	3.65
7	600988	赤峰黄金	6,176,298.00	3.62
8	600438	通威股份	6,153,430.00	3.61
9	002241	歌尔股份	5,656,846.00	3.32
10	601872	招商轮船	5,633,058.00	3.30
11	002415	海康威视	5,620,595.16	3.29
12	603259	药明康德	5,552,402.66	3.25
13	000960	锡业股份	5,439,960.00	3.19
14	601012	隆基绿能	5,381,273.98	3.15
15	002824	和胜股份	5,249,169.98	3.08
16	300363	博腾股份	5,215,111.00	3.06
17	000063	中兴通讯	5,073,854.00	2.97

18	002027	分众传媒	4,770,306.00	2.80
19	603348	文灿股份	4,701,396.00	2.76
20	002709	天赐材料	4,666,120.90	2.73
21	002460	赣锋锂业	4,640,369.00	2.72
22	002484	江海股份	4,607,037.00	2.70
23	600150	中国船舶	4,567,603.00	2.68
24	300750	宁德时代	4,519,649.03	2.65
25	300037	新宙邦	4,420,198.48	2.59
26	601088	中国神华	4,411,844.00	2.59
27	300390	天华超净	4,248,547.00	2.49
28	601155	新城控股	4,241,107.00	2.49
29	600009	上海机场	4,130,874.00	2.42
30	002202	金风科技	4,062,034.00	2.38
31	603986	兆易创新	3,629,453.00	2.13
32	600188	兖矿能源	3,546,314.07	2.08
33	002821	凯莱英	3,537,277.00	2.07
34	688777	中控技术	3,520,549.03	2.06
35	688012	中微公司	3,512,614.87	2.06
36	688281	华秦科技	3,451,132.59	2.02
37	603799	华友钴业	3,422,534.00	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。

7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	315,349,926.01
卖出股票收入（成交）总额	320,368,571.88

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。

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	641,739.14	0.45
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	641,739.14	0.45

7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	113641	华友转债	4,140	557,681.48	0.39
2	113056	重银转债	510	51,511.96	0.04
3	127038	国微转债	190	31,803.80	0.02
4	123142	申昊转债	4	488.00	0.00
5	123143	胜蓝转债	1	253.90	0.00

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

无。

7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

无。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

无。

7.10 本基金投资股指期货的投资政策

无。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明**7.11.1 本期国债期货投资政策**

无。

7.11.2 本期国债期货投资评价

无。

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

本基金投资的前十名证券之一重银转债（113056.SH）的发行主体重庆银行股份有限公司于2022年6月8日因未按照规定履行客户身份识别义务等，受到中国人民银行重庆营业管理部处罚（渝银罚〔2022〕7号）。本基金认为，对重庆银行的处罚不会对其投资价值构成实质性负面影响。

7.12.2 基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库

本基金投资的前十名股票未超出基金合同规定的备选股票库

7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	74,218.52
2	应收清算款	22,342,679.20
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	100,166.24
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	22,517,063.96

7.12.4 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	127038	国微转债	31,803.80	0.02

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

无。

7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入原因，分项之和与合计可能有尾差。

§ 8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

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 (%)
8,479	5,076.80	98,876.77	0.23	42,947,317.03	99.77

注：持有人户数为有效户数，即存量份额大于零的账户。

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	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	69,787.10	0.1621

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

项目	持有基金份额总量的数量区间 (万份)
本公司高级管理人员、基金投资和研部	0

门负责人持有本开放式基金	
本基金基金经理持有本开放式基金	0~10

§ 9 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	44,921,810.66
本报告期基金总申购份额	11,757,739.02
减：本报告期基金总赎回份额	13,633,355.88
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	43,046,193.80

§ 10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

无。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

一、基金管理人的重大人事变动

1. 根据我司发布的《大成基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告》，经大成基金管理有限公司第七届董事会第十四次会议审议通过并履行必要程序，自 2022 年 4 月 15 日起，周立新先生因工作安排离任公司副总经理。具体事宜详见公司公告。

2. 根据我司发布的《大成基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告》，经大成基金管理有限公司第七届董事会第十五次会议审议通过并履行必要程序，自 2022 年 6 月 1 日起，赵冰女士担任公司副总经理，段皓静女士担任公司督察长。自同日起赵冰女士离任公司督察长。具体事宜详见公司公告。

二、基金托管人的基金托管部门的重大人事变动

2022 年 3 月，中国农业银行总行决定王霄勇任托管业务部总裁。

2022 年 3 月，中国农业银行总行决定王洪滨任托管业务部高级专家。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

无。

10.4 基金投资策略的改变

本基金投资策略在本报告期内没有重大改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金聘任的为本基金审计的会计师事务所为安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）。该事务所自基金合同生效日起为本基金提供审计服务至今。

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，基金管理人、托管人及其相关高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例 (%)	佣金	占当期佣金总量的比例 (%)	
粤开证券	1	101,942,942.42	16.12	92,910.18	16.02	-
申万宏源	1	69,827,147.31	11.04	64,329.13	11.09	-
中泰证券	2	67,336,796.51	10.65	62,046.41	10.70	-
信达证券	2	65,967,953.32	10.43	60,698.79	10.47	-
国信证券	1	59,787,306.31	9.46	54,478.22	9.40	-
中信建投证券	2	56,259,830.06	8.90	51,436.11	8.87	-
国盛证券	1	49,758,305.15	7.87	45,845.37	7.91	-
华创证券	1	44,841,457.78	7.09	41,313.64	7.13	-
中信证券	4	43,062,587.66	6.81	39,672.69	6.84	-
光大证券	2	34,655,425.19	5.48	31,577.85	5.45	-
瑞银证券	2	23,936,259.88	3.79	21,816.22	3.76	-
招商证券	2	11,023,811.31	1.74	10,154.22	1.75	-
兴业证券	2	3,907,252.08	0.62	3,559.67	0.61	-
爱建证券	1	-	-	-	-	-
安信证券	1	-	-	-	-	-
川财证券	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	-	-	-	-	-
东亚前海	1	-	-	-	-	-
方正证券	1	-	-	-	-	-
高华证券	1	-	-	-	-	-
广发证券	2	-	-	-	-	-
国金证券	2	-	-	-	-	-
国泰君安	3	-	-	-	-	-
海通证券	1	-	-	-	-	-
红塔证券	1	-	-	-	-	-
华泰证券	1	-	-	-	-	-
华西证券	1	-	-	-	-	-
民生证券	1	-	-	-	-	-
南京证券	1	-	-	-	-	-
平安证券	1	-	-	-	-	-
山西证券	1	-	-	-	-	-
上海证券	1	-	-	-	-	-
申万宏源西部	1	-	-	-	-	-
世纪证券	1	-	-	-	-	-
天风证券	2	-	-	-	-	-
万和证券	1	-	-	-	-	-
西部证券	1	-	-	-	-	-
湘财证券	1	-	-	-	-	-
浙商证券	1	-	-	-	-	-
中国银河证券	4	-	-	-	-	-
中金公司	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、东亚前海。

本报告期内退租交易单元：无。

10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例 (%)	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例 (%)	成交金额	占当期权证成交总额的比例 (%)
粤开证券	154,554.80	24.26	-	-	-	-
光大证券	482,443.60	75.74	-	-	-	-

10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	关于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	2022年06月30日
2	大成基金管理有限公司关于旗下部分基金增加泰信财富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	2022年06月28日
3	大成基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销证券的公告	中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站	2022年06月25日
4	大成基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告	中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站	2022年06月02日
5	大成行业轮动混合型证券投资基金 2022 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	2022年04月22日
6	大成基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告	中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本	2022年04月16日

		公司网站	
7	大成行业轮动混合型证券投资基金 2021 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	2022 年 03 月 29 日
8	大成基金管理有限公司关于公司固有资金拟申购旗下偏股型公募基金的公告	中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站	2022 年 01 月 27 日
9	大成基金管理有限公司关于旗下部分基金增加中信百信银行股份有限公司为销售机构的公告	中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站	2022 年 01 月 25 日
10	大成行业轮动混合型证券投资基金 2021 年第 4 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	2022 年 01 月 21 日
11	大成基金管理有限公司关于大成行业轮动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	2022 年 01 月 18 日

§ 11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

无。

11.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§ 12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

- 1、中国证监会批准设立大成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。

12.2 存放地点

备查文件存放在本基金管理人和托管人的住所。

12.3 查阅方式

投资者可在营业时间免费查阅，或登录本基金管理人网站 <http://www.dcfund.com.cn> 进行查阅。

大成基金管理有限公司

2022 年 8 月 30 日