

# 国都聚成混合型证券投资基金 2022 年年度报告

2022 年 12 月 31 日

基金管理人：国都证券股份有限公司

基金托管人：兴业银行股份有限公司

送出日期：2023 年 3 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及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。

基金托管人兴业银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2023 年 3 月 24 日复核了本报告中的财务指标、净值表现和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。

本报告中财务资料经审计，信永中和会计师事务所（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 2022 年 1 月 1 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	6
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>7</b>
3.1 主要会计数据和财务指标	7
3.2 基金净值表现	7
3.3 其他指标	9
3.4 过去三年基金的利润分配情况	9
<b>§ 4 管理人报告</b>	<b>10</b>
4.1 基金管理人及基金经理情况	10
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	11
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	11
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明	12
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	12
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况	14
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	15
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	16
4.9 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明	16
<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的真实、准确和完整发表意见	17
<b>§ 6 审计报告</b>	<b>18</b>
6.1 审计报告基本信息	18
6.2 审计报告的基本内容	18
<b>§ 7 年度财务报表</b>	<b>21</b>
7.1 资产负债表	21
7.2 利润表	22
7.3 净资产（基金净值）变动表	23
7.4 报表附注	25
<b>§ 8 投资组合报告</b>	<b>57</b>
8.1 期末基金资产组合情况	57
8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	57
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	58
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动	59
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	63

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 .....	63
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 .....	63
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 .....	63
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 .....	63
8.10 本基金投资股指期货的投资政策 .....	63
8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 .....	63
8.12 投资组合报告附注 .....	64
<b>§ 9 基金份额持有人信息 .....</b>	<b>65</b>
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....	65
9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....	65
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的情况 .....	65
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 .....	65
<b>§ 10 开放式基金份额变动 .....</b>	<b>66</b>
<b>§ 11 重大事件揭示 .....</b>	<b>67</b>
11.1 基金份额持有人大会决议 .....	67
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 .....	67
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....	69
11.4 基金投资策略的改变 .....	69
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....	69
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 .....	69
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	69
11.8 其他重大事件 .....	70
<b>§ 12 影响投资者决策的其他重要信息 .....</b>	<b>73</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 .....	73
12.2 影响投资者决策的其他重要信息 .....	73
<b>§ 13 备查文件目录 .....</b>	<b>74</b>
13.1 备查文件目录 .....	74
13.2 存放地点 .....	74
13.3 查阅方式 .....	74

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	国都聚成混合型证券投资基金
基金简称	国都聚成
场内简称	-
基金主代码	011389
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2021年3月25日
基金管理人	国都证券股份有限公司
基金托管人	兴业银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	57,215,197.33份
基金合同存续期	不定期
基金份额上市的证券交易所	-
上市日期	-

### 2.2 基金产品说明

投资目标	通过积极主动投资管理，在严格控制投资风险的前提下，争取通过挖掘市场的投资机会来获得较为稳健的投资收益，力争实现超越业绩比较基准的收益，追求基金资产的长期投资回报。
投资策略	本基金将在基金合同约定的投资范围内，立足宏观经济和货币政策走势研究，通过综合分析国内外宏观经济态势、行业情况、利率走势、收益率曲线变化趋势和信用风险变化等因素，并结合各类资产在特定经济形势下的估值水平和预期风险收益特征，决定基金的资产配置比例。
业绩比较基准	本基金的业绩比较基准为：沪深 300 指数收益率 × 60% + 中债综合全价（总值）指数收益率 × 40%
风险收益特征	本基金为混合型基金，其长期平均预期风险和预期收益率低于股票型基金，高于债券型基金及货币市场基金。

### 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		国都证券股份有限公司	兴业银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	李昭	龚小武
	联系电话	010-84183229	021-52629999-212056
	电子邮箱	lizhao@guodu.com	gongxiaowu@cib.com.cn
客户服务电话		400-818-8118	95561
传真		010-84183311	021-62159217

注册地址	北京市东城区东直门南大街 3 号国华投资大厦 9、10 层	福建省福州市台江区江滨中大道 398 号兴业银行大厦
办公地址	北京市东城区东直门南大街 3 号国华投资大厦 9、10 层	上海市浦东新区银城路 167 号兴业大厦 4 楼
邮政编码	100007	200120
法定代表人	翁振杰	吕家进

## 2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	中国证券报
登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	www.guodu.com
基金年度报告备置地点	本基金管理人及本基金托管人住所

## 2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
会计师事务所	信永中和会计师事务所（特殊普通合伙）	北京市东城区朝阳门北大街 8 号富华大厦 A 座 9 层
注册登记机构	中国证券登记结算有限责任公司	北京市西城区太平桥大街 17 号

### § 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	2022 年	2021 年 3 月 25 日 (基金合同生效 日)-2021 年 12 月 31 日	2020 年
本期已实现收益	-14,607,628.54	-13,490,039.48	-
本期利润	-16,658,272.56	-11,538,826.47	-
加权平均基金份额本期 利润	-0.2630	-0.1036	-
本期加权平均净值利润 率	-37.20%	-10.92%	-
本期基金份额净值增长 率	-29.43%	-13.07%	-
3.1.2 期末数据和指标	2022 年末	2021 年末	2020 年末
期末可供分配利润	-22,636,412.12	-11,536,349.72	-
期末可供分配基金份额 利润	-0.3956	-0.1663	-
期末基金资产净值	35,101,446.74	60,292,546.62	-
期末基金份额净值	0.6135	0.8693	-
3.1.3 累计期末指标	2022 年末	2021 年末	2020 年末
基金份额累计净值增长 率	-38.65%	-13.07%	-

注：1. 本期已实现收益指本期利息收入、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损益。

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. 所述期末基金业绩指标不包含持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

#### 3.2 基金净值表现

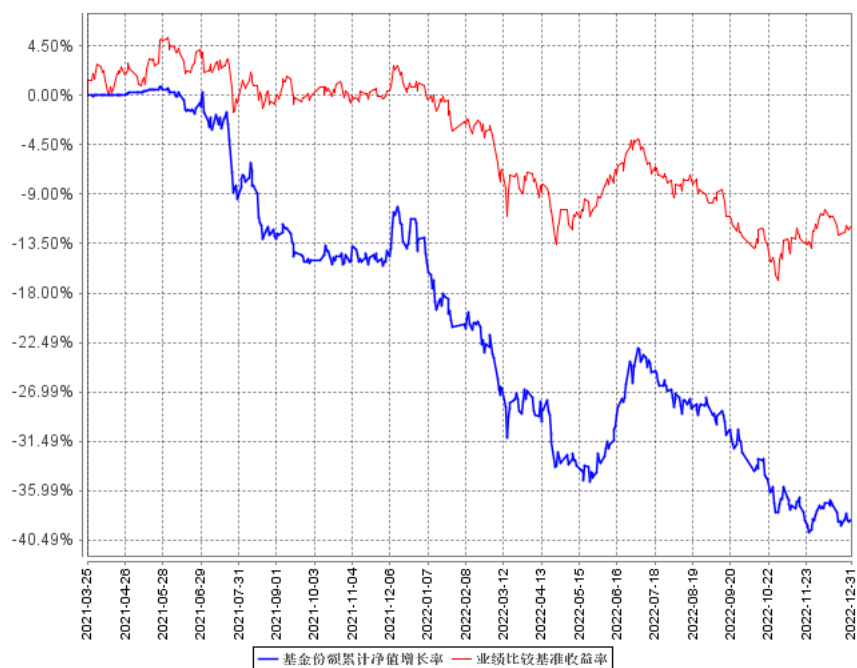
##### 3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	份额净值 增长率①	份额净 值增长 率标准 差②	业绩比较 基准收益 率③	业绩比较 基准收益 率标准差 ④	①—③	②—④
过去三个 月	-9.08%	0.91%	0.93%	0.77%	-10.01%	0.14%

过去六个月	-18.66%	0.86%	-8.22%	0.66%	-10.44%	0.20%
过去一年	-29.43%	1.08%	-13.01%	0.77%	-16.42%	0.31%
自基金合同生效起至今	-38.65%	0.94%	-12.01%	0.70%	-26.64%	0.24%

### 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

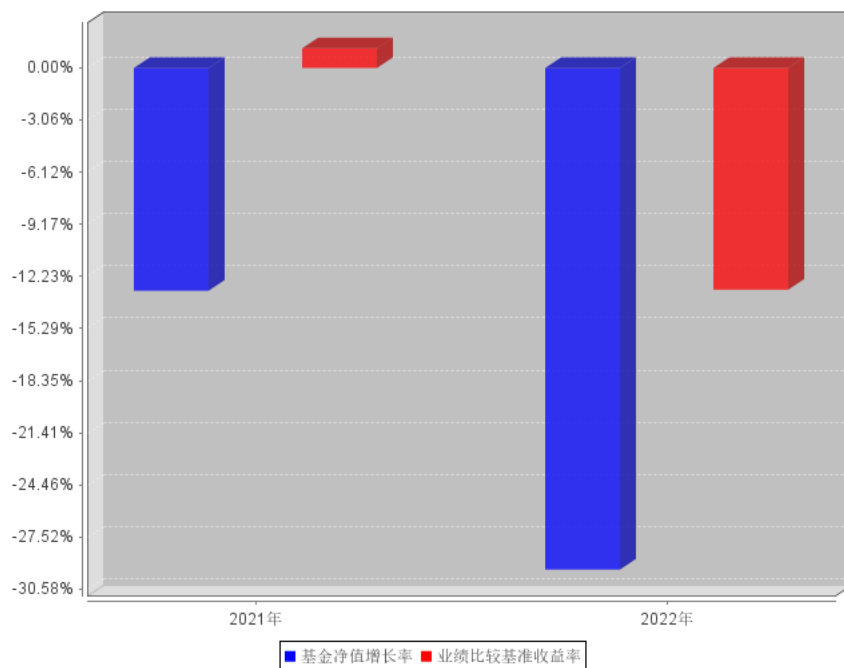
基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图





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

自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的对比图



### 3.3 其他指标

注：无

### 3.4 过去三年基金的利润分配情况

注：本基金基金合同自 2021 年 3 月 25 日起生效，基金合同生效以来未发生利润分配，符合相关法规及基金合同的规定。

## § 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

国都证券股份有限公司（以下简称“国都证券”）是由国都证券有限责任公司整体变更而来。国都证券有限责任公司是经中国证监会批准，在中诚信托有限责任公司和北京国际信托有限公司原有证券业务整合的基础上，吸收其他股东出资，于 2001 年 12 月 28 日成立的综合性证券公司，注册地为北京。2015 年 6 月 23 日公司组织形式由有限责任公司整体变更为股份有限公司，公司正式更名为“国都证券股份有限公司”。目前，注册资本为人民币 5,830,000,009 元。

2014 年 8 月 19 日，经中国证监会批准，公司获准开展公募基金管理业务资格，截至 2022 年 12 月 31 日，本公司管理 3 只开放式证券投资基金——国都创新驱动灵活配置混合型证券投资基金、国都多策略混合型证券投资基金、国都聚成混合型证券投资基金。（本公司管理的国都量化精选混合型证券投资基金自 2022 年 11 月 25 日起进入清算程序，于 2022 年 12 月 8 日完成清算。）

#### 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		
尹德才	基金经 理	2021年3月 25日	2022年9月6日	9年	历任天相投资顾问有限公司证券部研究员；国都证券研究所化工行业研究员、基金管理部高级行业研究员、基金经理助理、基金经理、公募证券投资基金管理业务投资决策委员会成员。
廖晓东	基金管 理部董 事总 理	2021年3月 25日	-	21年	历任中煤信托投资有限责任公司证券总部项目经理；国都证券研究所副总经理、证券投资部总经理、研究所所长、基金管理部总经理。现任国都证券股份有

					限公司基金管理部 董事总经理、公募证 券投资基金管理业 务投资决策委员会 主席、基金经理。
--	--	--	--	--	---

#### 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

注：无

#### 4.1.4 基金经理薪酬机制

公司制定了完备的薪酬制度，能够有效履行对基金经理的各项薪酬管理工作，亦符合监管要求。

#### 4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》等有关法律法规的规定和《国都聚成混合型证券投资基金基金合同》等有关法律文件的约定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在严格控制风险的基础上，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。本基金无违法、违规行为。本基金投资运作符合有关法律法规的规定及基金合同的约定。

#### 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

本基金管理人根据《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》等法规制定了《国都证券股份有限公司公募证券投资基金业务公平交易管理办法》。通过制定科学合理的投资决策体系、交易执行规范及对公平交易的监控与报告、相关信息披露等手段，确保各投资组合享有公平的投资决策机会，建立公平交易的制度环境。

##### 4.3.2 公平交易制度的执行情况

本报告期内，本基金管理人严格执行《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》，完善相应制度及流程，通过系统和人工等各种方式在各业务环节严格控制交易公平执行，公平对待旗下管理的所有基金和投资组合。

##### 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

本报告期内，未发现本基金存在可能导致不公平交易和利益输送的异常交易行为。

本报告期内，未出现涉及本基金的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量 5% 的情况。

## 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

受国内外多重不利因素交替共振影响，2022 年 A 股市场普遍下跌，市场修复反弹的窗口期较为短暂，仅 5、6 两个月市场呈现大面积反弹走势，A 股市场全年整体表现不佳。

国内方面，疫情多点爆发及反复成为影响经济不及预期的主要因素。上半年第一次疫情高峰对主要一线城市和长江、珠江三角洲等经济发达地区影响较大，而岁末的第二次疫情高峰又一次使得宏观经济降档慢行至 2023 年初，这两次疫情高峰导致国内经济出现了累计超一个季度的空窗期，阻碍了经济正常化节奏，对年内经济运行构成了实质性冲击。A 股市场悲观情绪被不断放大，促发了市场趋势性下跌。

国外方面，为应对持续的通胀压力，各国央行采取了更为激进的货币政策，全球主要经济体流动性持续收紧，冲击经济复苏预期，未来经济可能出现衰退已成为共识，全球资本市场避险情绪不断强化。此外，俄乌冲突的爆发和持续严重影响了全球大宗商品的供给格局，西方主导的经济及科技脱钩对全球供应链产生持续消极影响，持续多年的全球化面临进一步倒退的风险。外部环境的诸多不利因素影响中国的经济运行，致使 A 股市场进一步承压。

本基金偏重于消费类资产，2022 年度主要配置于食品饮料及疫情受损行业，然而本基金对市场运行节奏及配置资产因风险偏好变化的影响认识不足，对疫情的反复缺乏较为充分的估计，因配置行业及公司表现不佳致使全年净值回撤较大。

### 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 0.6135 元；本报告期基金份额净值增长率为-29.43%，业绩比较基准收益率为-13.01%。

## 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 2023 年，影响经济复苏步伐的制约因素将逐步有所缓解，金融市场风险偏好将逐步回升，A 股市场将迎来较为有利的运行环境。

首先，外部环境压力在 2023 年将会有不同程度的缓和。一是发达国家持续的紧缩政策将

达到阶段性目标，通胀将得到有效控制，西方主要经济体将步入短周期的温和型衰退。二是俄乌两国在持续战损压力下，双方实质上均存有和谈的需求，预计在条件成熟时俄乌局势有望迈向缓和，全球地缘政治风险进一步恶化的势头或将得到遏制，全球产业链格局得以重构并步入正轨。此外，持续多年的疫情将因病毒毒性弱化及应对方案更为有效，全球经济互联将实质重启。总体上看，困扰全球经济及金融市场的三大主要利空因素的边际效应逐步减弱，宏观经济开始进入修复期，资本市场也逐步进入探底回升的阶段。全球资本市场风险偏好将在 2023 年有望明显提升。

其次，国内经济已度过近年来的最差时段，经济底已基本得以确认，预计 2023 年经济整体有望好于 2022 年。随着国内防疫政策和措施持续优化及疫情的缓解，稳增长将成为政策的优先项，2022 年以来的稳增长措施将在 2023 年发力见效，整体经济环境将继续保持宽松，消费场景逐步打开并恢复至正常水平，地产下行风险边际改善，经济增长潜力得以发挥。观察国内工业企业运行情况，预计始于 2022 年 4 月的去库存周期有望于 2023 年上半年逐步见底。因此，中国经济将逐步摆脱困境，2023 年国内整体经济大概率有望明显优于 2022 年，成为“二十大”后经济高质量开局之年。相应的，处于估值洼地的 A 股市场具有极高的性价比。

第三，A 股市场将走出存量博弈的格局，并将逐步吸引资本回归。2022 年，由于资本市场风险偏好低迷、美债收益率大幅上行、人民币持续贬值，外资流入显著放缓。2023 年，预计上述因素将有望不同程度缓解，外资流入规模也将明显回升。一方面，美联储加息的次数及幅度接近尾声，美债利率快速上行逐渐过去、人民币贬值压力缓解且步入升值通道，中美利差收窄，资金流出势头将明显减弱。另一方面，随着中国防疫政策优化、消费持续回升及稳增长政策持续发力，中国经济重启增长有望催化外资加速回流。中国资本市场将迎来更为友好的运行环境，中国资产将体现出更优的性价比，对外资形成较强的吸引力。

此外，随着资本市场的向好，预计包括公募基金在内的资产管理机构募集规模大幅回落的势头将得到遏制，且有望逐步回暖，成为 A 股市场增量资金的重要来源。

当然，2023 年中国经济面临出口转弱、消费信心恢复尚需时日等问题，但在政策的强力加持下，随着经济中各种互动步入正轨，总体上经济向好趋势是明确的，这是 A 股市场的强有力基本面支撑。截至 2022 年 12 月 30 日，以 PE 衡量的估值水平来看，上证综指为 12.3 倍、创业板指 PE 为 38.9 倍，A 股市场处于高性价比的历史底部区域。预计 2023 年 A 股市场将迎来明确的修复行情。节奏上，预计一季度有望迎来一轮明显的反弹行情。考虑到可能存在的不确定因素及经济复苏的证实证伪过程，市场信心完全恢复尚需时日，市场运行趋势

可能存在反复。预计较为明确的趋势将形成于二季度末至三季度之间，届时 A 股市场将迎来一轮较好的投资机会。我们继续认为能够产生超额收益的投资机会来自于能够创造增量的行业及公司：

一是消费领域。消费是一个永远值得深度挖掘的方向，主要得益于庞大的人口基数、经济的强韧性、持续的增长潜力及可见的消费升级场景。当前，随着疫情逐渐得以控制，一些被限制的消费场景会陆续甚至快速解禁，后疫情时代的相关行业及公司，诸如机场、航空、养殖及食品饮料、餐饮及旅游休闲等将迎来修复性机会；其次，随着全年经济复苏的明确，消费类资产下半年会明显好于上半年。可关注养殖类，主要是生猪养殖，核心逻辑来自于产能去化、周期拐点临近及价格传导的正常化。同时，比较清晰的还有中国的老龄化，在一些常规需求的下降的同时，也会带来受益老龄化的特定机会，如医药、保健、护理，比如家用护理机器人未来或成为爆款需求。

二是品牌化经营。随着新技术的运用，企业管理和经营理念的创新升级，中国企业将走上品牌高端化之路。这一势头在基本消费品中已逐渐崭露头角。品牌化标志着相关产业及公司可以享受更高的毛利率和净利率，从而具有更强的赚钱能力，相关行业及公司存在长期战略投资机会。方向是国内崛起的优质品牌，逐渐成为跨国、跨区域性品牌或全球性品牌。

三是具有竞争优势的制造业，重点在新能源汽车产业链、半导体及化工新材料等领域。比如，中国企业在电动车产业链相对于燃油车具有明显的优势，未来必将诞生举足轻重的行业巨头。作为战略性产业，电动车推动了智能化的快速发展，其中智能座舱、多屏合一、自动驾驶、自动泊车、辅助巡航等细分行业以及相应的配套领域产生了持续的增量机会，诸如 Sic 等新型半导体因技术升级演进机会明显。同样的机会也产生于高压快充，底盘、铸造工艺变革中。

四是“双碳”背景下的能源变革机遇。“碳中和”是全球的共识，“双碳”的推进对中国未来 10-20 年的产业结构将产生深远的影响，主要特征表现为能源消费方式的变革。其中，产业本身及相应的产业升级将产生持续、创新的投资机会。此外，随着新应用场景出现及伴生的新消费方式的不断演进，相关产业将内涵更为广阔的增量价值。可见的机会在于，风电光伏等新能源投资和运营将有重大的发展；电力体系将重构，稳定性的电力将有价值重估的机会；电力系统中的关键材料和关键零部件，将显著受益于电气化增速的提升。

#### 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，公司坚持保障基金份额持有人利益的原则，高度重视基金的合规运作和风

险管理。公司加强合规培训，注重培育合规文化体系；不断完善内部控制制度和业务流程，完善制度体系；加强监察稽核工作，强化合规与风险管理。具体包括以下方面：

(1) 强化合规培训，培育合规文化体系。公司积极推动合规文化建设，培育合规文化体系，防控重大合规风险。公司内控部门及时传达与基金业务相关的法律法规，通过法规培训、风险案例学习和测试等多种形式，提高员工合规及风控意识，公司内部控制和风险管理基础得到夯实和优化。

(2) 加强制度建设，完善制度体系。公司根据法律法规等规范性文件，制定了较为完善的内部管理制度。本报告期内，公司根据业务需要及新近出台或修订的法律法规，对规章制度体系进行了进一步完善。公司对原有制度进行了修订，内容涵盖人员管理、薪酬管理、个人信息保护、基金业务管理等方面。

(3) 加强监察稽核工作，强化合规与风险管理。公司重视监察稽核工作，不断提高和完善监察稽核工作的深度和广度，对投资、销售、后台运营和其他业务进行核查。内控部门积极开展合规检查，对基金产品文件、基金营销、信息披露、新产品设计开发、制度建设、合同管理等进行事前合规审核；加强事前防范、事中及事后风险监控管理，保障基金运作所涉及的各个环节能够按照法律法规、基金合同和公司制度执行。

本报告期内，基金运作合法合规，未发生重大风险事件。

#### 4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本报告期内，本基金管理人严格遵守《企业会计准则》、《证券投资基金会计核算业务指引》以及中国证监会相关规定和基金合同的约定，对基金所持有的投资品种进行估值，本基金托管人根据法律法规要求履行估值及净值计算的复核责任。基金份额净值由基金管理人完成估值后，经基金托管人复核无误后由基金管理人对外公布。

为了向基金投资人提供更好的证券投资管理服务，本基金管理人对估值和定价过程进行了严格的控制。本基金管理人在充分衡量市场风险、信用风险、流动性风险、货币风险、衍生工具和结构性产品等影响估值和定价因素的基础上，确定本基金管理人采用的估值政策。本基金管理人的估值人员均具有专业会计学习经历，具有基金从业人员资格，同时，根据公司制定的相关制度，估值工作决策会议成员中不包括基金经理。本报告期内，参与估值流程各方之间不存在任何重大利益冲突。本基金管理人已与中央国债登记结算有限责任公司、中证指数有限公司签署服务协议，由其按约定提供相关债券品种、流通受限股票的估值参考数据。

#### 4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本报告期内本基金未实施利润分配，符合相关法规及基金合同的规定。

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

报告期内，本基金出现连续六十个工作日基金资产净值低于五千万元的情形；截至本报告期末，本基金资产净值仍低于五千万元。本基金管理人已按法规要求向监管机关报送解决方案。

本基金于本报告期内召开了基金份额持有人大会，并在 2022 年 12 月 5 日表决通过了《关于国都聚成混合型证券投资基金持续运作的议案》，本次持有人大会决议生效后，本基金持续运作，运作方式不发生改变，仍为契约型开放式，并继续现有投资策略，推进平稳运作。



## § 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

报告期内,本托管人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定,诚信、尽责地履行了基金托管人义务,不存在损害本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

报告期内,本托管人根据国家有关法律法规、基金合同和托管协议的规定,对基金管理人在本基金的投资运作、基金资产净值的计算、基金收益的计算、基金费用开支等方面进行了必要的监督、复核和审查,未发现其存在任何损害本基金份额持有人利益的行为;基金管理人在报告期内,严格遵守了《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

本托管人认真复核了本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、投资组合报告等内容,认为其真实、准确和完整,不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

## § 6 审计报告

### 6.1 审计报告基本信息

财务报表是否经过审计	是
审计意见类型	标准无保留意见
审计报告编号	XYZH/2023BJAB2B0131

### 6.2 审计报告的基本内容

审计报告标题	审计报告
审计报告收件人	国都聚成混合型证券投资基金全体持有人
审计意见	<p>我们审计了国都聚成混合型证券投资基金（以下简称聚成基金）财务报表，包括 2022 年 12 月 31 日的资产负债表，2022 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，公允反映了聚成基金 2022 年 12 月 31 日的财务状况以及 2022 年度的经营成果和所有者权益（基金净值）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，我们独立于聚成基金，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	无。
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，管理层负责评估聚成基金的持续经营能</p>

	<p>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，除非管理层计划清算聚成基金、终止运营或别无其他现实的选择。</p> <p>治理层负责监督聚成基金的财务报告过程。</p>
<p>注册会计师对财务报表审计的责任</p>	<p>我们的目标是对财务报表整体是否不存在由于舞弊或错误导致的重大错报获取合理保证，并出具包含审计意见的审计报告。合理保证是高水平的保证，但并不能保证按照审计准则执行的审计在某一重大错报存在时总能发现。错报可能由于舞弊或错误导致，如果合理预期错报单独或汇总起来可能影响财务报表使用者依据财务报表作出的经济决策，则通常认为错报是重大的。</p> <p>在按照审计准则执行审计工作的过程中，我们运用职业判断，并保持职业怀疑。同时，我们也执行以下工作：</p> <p>（1）识别和评估由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险，设计和实施审计程序以应对这些风险，并获取充分、适当的审计证据，作为发表审计意见的基础。由于舞弊可能涉及串通、伪造、故意遗漏、虚假陈述或凌驾于内部控制之上，未能发现由于舞弊导致的重大错报的风险高于未能发现由于错误导致的重大错报的风险。</p> <p>（2）了解与审计相关的内部控制，以设计恰当的审计程序，但目的并非对内部控制的有效性发表意见。</p> <p>（3）评价管理人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）对管理人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，就可能导致对聚成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</p>

	<p>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聚成基金不能持续经营。</p> <p>(5) 评价财务报表的总体列报、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>我们与治理层就聚成基金的审计范围、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	信永中和会计师事务所(特殊普通合伙)	
注册会计师的姓名	颜凡清	齐晓瑞
会计师事务所的地址	北京市东城区朝阳门北大街 8 号富华大厦 A 座 9 层	
审计报告日期	2023 年 3 月 17 日	

## § 7 年度财务报表

## 7.1 资产负债表

会计主体：国都聚成混合型证券投资基金

报告截止日：2022 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2022 年 12 月 31 日	上年度末 2021 年 12 月 31 日
<b>资产：</b>			
银行存款	7.4.7.1	7,238,638.10	9,296,276.54
结算备付金		209,933.65	210,981.09
存出保证金		26,852.84	48,022.02
交易性金融资产	7.4.7.2	28,520,066.00	50,994,112.00
其中：股票投资		28,520,066.00	50,994,112.00
基金投资		-	-
债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
其他投资		-	-
衍生金融资产	7.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	-	-
债权投资	7.4.7.5	-	-
其中：债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
其他投资		-	-
其他债权投资	7.4.7.6	-	-
其他权益工具投资	7.4.7.7	-	-
应收清算款		-	-
应收股利		-	-
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.8	-	1,152.66
资产总计		35,995,490.59	60,550,544.31
<b>负债和净资产</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2022 年 12 月 31 日</b>	<b>上年度末 2021 年 12 月 31 日</b>
<b>负债：</b>			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	7.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付清算款		708,515.34	-

应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		45,380.70	77,820.09
应付托管费		3,025.40	5,188.01
应付销售服务费		-	-
应付投资顾问费		-	-
应交税费		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.9	137,122.41	174,989.59
负债合计		894,043.85	257,997.69
<b>净资产：</b>			
实收基金	7.4.7.10	57,215,197.33	69,360,002.81
其他综合收益	7.4.7.11	-	-
未分配利润	7.4.7.12	-22,113,750.59	-9,067,456.19
净资产合计		35,101,446.74	60,292,546.62
负债和净资产总计		35,995,490.59	60,550,544.31

注：报告截止日 2022 年 12 月 31 日，基金份额净值 0.6135 元，基金份额总额 57,215,197.33 份。

## 7.2 利润表

会计主体：国都聚成混合型证券投资基金

本报告期：2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2021 年 3 月 25 日(基 金合同生效日)至 2021 年 12 月 31 日
<b>一、营业总收入</b>		-15,807,719.65	-9,641,293.70
1. 利息收入		55,797.34	680,028.42
其中：存款利息收入	7.4.7.13	35,736.98	140,245.21
债券利息收入		-	-
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		20,060.36	539,783.21
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		-13,816,937.82	-13,020,027.17
其中：股票投资收益	7.4.7.14	-14,211,487.39	-13,195,638.88
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.15	-	-
资产支持证券投资收益	7.4.7.16	-	-

贵金属投资收益	7.4.7.17	-	-
衍生工具收益	7.4.7.18	-	-
股利收益	7.4.7.19	394,549.57	175,611.71
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）	7.4.7.20	-2,050,644.02	1,951,213.01
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.21	4,064.85	747,492.04
<b>减：二、营业总支出</b>		850,552.91	1,897,532.77
1. 管理人报酬	7.4.10.2.1	675,197.50	1,216,696.81
2. 托管费	7.4.10.2.2	45,013.18	81,113.18
3. 销售服务费	7.4.10.2.3	-	-
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	7.4.7.22	-	-
7. 税金及附加		72.23	1,943.24
8. 其他费用	7.4.7.23	130,270.00	597,779.54
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		-16,658,272.56	-11,538,826.47
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		-16,658,272.56	-11,538,826.47
<b>五、其他综合收益的税后净额</b>		-	-
<b>六、综合收益总额</b>		-16,658,272.56	-11,538,826.47

### 7.3 净资产（基金净值）变动表

会计主体：国都聚成混合型证券投资基金

本报告期：2022年1月1日至2022年12月31日

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年12月31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）	69,360,002.81	-	-9,067,456.19	60,292,546.62
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）	69,360,002.81	-	-9,067,456.19	60,292,546.62
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-12,144,805.48	-	-13,046,294.40	-25,191,099.88
（一）、综合收益总额	-	-	-16,658,272.56	-16,658,272.56
（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）	-12,144,805.48	-	3,611,978.16	-8,532,827.32
其中：1. 基金申购款	279,142.87	-	-80,455.29	198,687.58
2. 基金赎回款	-12,423,948.35	-	3,692,433.45	-8,731,514.90
（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（基金净值）	57,215,197.33	-	-22,113,750.59	35,101,446.74
项目	上年度可比期间 2021年3月25日(基金合同生效日)至2021年12月31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）	-	-	-	-
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）	276,496,226.65	-	-	276,496,226.65
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-	-	-9,067,456.19	-
（一）、综合收益总额	-	-	-11,538,826.47	-11,538,826.47
（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）	207,136,223.84	-	2,471,370.28	204,664,853.56
其中：1. 基金申购款	4,812,169.87	-	-56,827.34	4,755,342.53
2. 基金赎回款	211,948,393.71	-	2,528,197.62	209,420,196.09
（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（基金净值）	69,360,002.81	-	-9,067,456.19	60,292,546.62

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：

          翁振杰  封欣  陈蕾            
 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

国都聚成混合型证券投资基金（以下简称“本基金”）于 2020 年 8 月 6 日经中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）《关于准予国都聚成混合型证券投资基金注册

的批复》证监许可[2020]1694 号文核准注册,于 2021 年 02 月 05 日开始募集,募集期不超过三个月,本基金提前结束募集,截止日为 2021 年 3 月 22 日(含)。本基金为混合型证券投资基金,首次设立募集不包括认购资金利息共募集 276,455,017.96 元人民币,并经中准会计师事务所(特殊普通合伙)“中准验字[2021]第 0069 号”验资报告验证。经向中国证监会备案,《国都聚成混合型证券投资基金基金合同》于 2021 年 3 月 25 日正式生效。

基金合同生效日的基金份额总额为 276,496,226.65 份基金单位,其中认购资金利息折合 41,208.69 份基金单位。

本基金管理人为国都证券股份有限公司,基金托管人为兴业银行股份有限公司。根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《国都聚成混合型证券投资基金基金合同》的有关规定,本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具,具体为股票(包括中小板、创业板及其他依法发行、上市的股票)、股指期货、债券(包括国债、央行票据、金融债券、地方政府债券、企业债券、公司债券、短期融资券、超短期融资券、中期票据、次级债券、可转换债券)、同业存单、债券回购、银行存款(包括协议存款、定期存款、通知存款)、资产支持证券、国债期货以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具(但须符合中国证监会的相关规定)。

如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种,基金管理人在履行适当程序后,可以将其纳入投资范围。

#### 7.4.2 会计报表的编制基础

本基金财务报表以持续经营假设为基础,按照财政部颁布的《企业会计准则》、应用指南、解释及其他相关规定并参照中国证券投资基金业协会颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和中期报告>》等相关法规规定进行确认和计量,基于下述主要会计政策和会计估计进行财务报表编制。

#### 7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2022 年度的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 2022 年 12 月 31 日的财务状况以及 2022 年度的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

## 7.4.4 重要会计政策和会计估计

### 7.4.4.1 会计年度

本基金会计年度采用公历年度，即每年 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

### 7.4.4.2 记账本位币

本基金记账本位币和编制本财务报表所采用的货币均为人民币。

### 7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

#### (a) 金融资产的分类

本基金的金融工具包括股票投资、债券投资、资产支持证券投资、买入返售金融资产、卖出回购金融资产款等。

本基金通常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，在初始确认时将金融资产分为不同类别：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其他综合收益的金融资产及以摊余成本计量的金融资产。

除非本基金改变管理金融资产的业务模式，在此情形下，所有受影响的相关金融资产在业务模式发生变更后的首个报告期间的第一天进行重分类，否则金融资产在初始确认后不得进行重分类。

本基金将同时符合下列条件且未被指定为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，分类为以摊余成本计量的金融资产：

- 本基金管理该金融资产的业务模式是以收取合同现金流量为目标；
- 该金融资产的合同条款规定，在特定日期产生的现金流量，仅为对本金和以未偿付本金金额为基础的利息的支付。

除上述以摊余成本计量的金融资产外，本基金将其余所有的金融资产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。本基金现无分类为以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产。

管理金融资产的业务模式，是指本基金如何管理金融资产以产生现金流量。业务模式决定本基金所管理金融资产现金流量的来源是收取合同现金流量、出售金融资产还是两者兼有。本基金以客观事实为依据、以关键管理人员决定的对金融资产进行管理的特定业务目标为基础，确定管理金融资产的业务模式。

本基金对金融资产的合同现金流量特征进行评估，以确定相关金融资产在特定日期产生的合同现金流量是否仅为对本金和以未偿付本金金额为基础的利息的支付。其中，本金是指

金融资产在初始确认时的公允价值；利息包括对货币时间价值、与特定时期未偿付本金金额相关的信用风险、以及其他基本借贷风险、成本和利润的对价。此外，本基金对可能导致金融资产合同现金流量的时间分布或金额发生变更的合同条款进行评估，以确定其是否满足上述合同现金流量特征的要求。

#### (b) 金融负债的分类

本基金将金融负债分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债及以摊余成本计量的金融负债。

##### - 以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债

该类金融负债包括交易性金融负债（含属于金融负债的衍生工具）和指定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

初始确认后，对于该类金融负债采用实际利率法以摊余成本计量。

#### 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

##### (a) 金融工具的初始确认

金融资产和金融负债在本基金成为相关金融工具合同条款的一方时，于资产负债表内确认。

在初始确认时，金融资产及金融负债均以公允价值计量。对于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，相关交易费用直接计入当期损益；对于其他类别的金融资产或金融负债，相关交易费用计入初始确认金额。

##### (b) 金融工具的后续计量

##### - 以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产

初始确认后，对于该类金融资产以公允价值进行后续计量，产生的利得或损失（包括利息和股利收入）计入当期损益，除非该金融资产属于套期关系的一部分。

##### - 以摊余成本计量的金融资产

初始确认后，对于该类金融资产采用实际利率法以摊余成本计量。以摊余成本计量且不属于任何套期关系的一部分的金融资产所产生的利得或损失，在终止确认、重分类、按照实际利率法摊销或确认减值时，计入当期损益。

- 以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债

初始确认后，对于该类金融负债以公允价值进行后续计量，除与套期会计有关外，产生的利得或损失（包括利息费用）计入当期损益。

- 以摊余成本计量的金融负债

初始确认后，对于该类金融负债采用实际利率法以摊余成本计量。

#### (c) 金融工具的终止确认

满足下列条件之一时，本基金终止确认该金融资产：

- 收取该金融资产现金流量的合同权利终止；
- 该金融资产已转移，且本基金将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转

入方；

- 该金融资产已转移，虽然本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬，但是放弃了对该金融资产控制。

金融资产整体转移满足终止确认条件的，本基金将下列两项金额的差额计入当期损益：

- 所转移金融资产在终止确认日的账面价值；
- 因转移金融资产而收到的对价。

金融负债（或其一部分）的现时义务已经解除的，本基金终止确认该金融负债（或部分金融负债）。

#### (d) 金融工具的减值

本基金以预期信用损失为基础，对下列项目进行减值会计处理并确认损失准备：

- 以摊余成本计量的金融资产

本基金持有的其他以公允价值计量的金融资产不适用预期信用损失模型。

#### 预期信用损失的计量

预期信用损失，是指以发生违约的风险为权重的金融工具信用损失的加权平均值。信用损失，是指本基金按照原实际利率折现的、根据合同应收的所有合同现金流量与预期收取的所有现金流量之间的差额，即全部现金短缺的现值。

在计量预期信用损失时，本基金需考虑的最长期限为面临信用风险的最长合同期限（包括考虑续约选择权）。

整个存续期预期信用损失,是指因金融工具整个预计存续期内所有可能发生的违约事件而导致的预期信用损失。

未来 12 个月内预期信用损失,是指因资产负债表日后 12 个月内(若金融工具的预计存续期少于 12 个月,则为预计存续期)可能发生的金融工具违约事件而导致的预期信用损失,是整个存续期预期信用损失的一部分。

本基金对满足下列情形的金融工具按照相当于未来 12 个月内预期信用损失的金额计量其损失准备,对其他金融工具按照相当于整个存续期内预期信用损失的金额计量其损失准备:

- 该金融工具在资产负债表日只具有较低的信用风险;
- 该金融工具的信用风险自初始确认后并未显著增加。

#### 预期信用损失准备的列报

为反映金融工具的信用风险自初始确认后的变化,本基金在每个资产负债表日重新计量预期信用损失,由此形成的损失准备的增加或转回金额,应当作为减值损失或利得计入当期损益。对于以摊余成本计量的金融资产,损失准备抵减该金融资产在资产负债表中列示的账面价值。

#### 核销

如果本基金不再合理预期金融资产合同现金流量能够全部或部分收回,则直接减记该金融资产的账面余额。这种减记构成相关金融资产的终止确认。这种情况通常发生在本基金确定债务人没有资产或收入来源可产生足够的现金流量以偿还将被减记的金额。但是,被减记的金融资产仍可能受到本基金催收到期款项相关执行活动的影响。

已减记的金融资产以后又收回的,作为减值损失的转回计入收回当期的损益。

#### 7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

除特别声明外,本基金按下述原则计量公允价值:

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。

本基金在确定相关金融资产和金融负债的公允价值时,根据企业会计准则的规定采用在当前情况下适用并且有足够可利用数据和其他信息支持的估值技术。

存在活跃市场且能够获取相同资产或负债报价的金融工具，在估值日有报价的，除会计准则规定的情况外，将该报价不加调整地应用于该资产或负债的公允价值计量；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，对报价进行调整，确定公允价值。与上述金融工具相同，但具有不同特征的，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，本基金不考虑因其大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价。

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

如经济环境发生重大变化或证券发行人发生影响证券价格的重大事件，参考类似金融工具的现行市价及重大变化等因素，对估值进行调整并确定公允价值。

#### 7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

金融资产和金融负债在资产负债表内分别列示，没有相互抵销。但是，同时满足下列条件的，以相互抵销后的净额在资产负债表内列示：

- 本基金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；
- 本基金计划以净额结算，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认列。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

#### 7.4.4.8 损益平准金

损益平准金核算在基金份额发生变动时，申购、赎回、转入、转出及红利再投资等款项中包含的未分配利润和公允价值变动损益，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根据交易申请日申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现损益占基金净值比例计算的金额。未实现损益平准金指根据交易申请日申购或赎回款项中包含的按

累计未分配的未实现损益占基金净值比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日进行确认和计量，并于会计期末全额转入未分配利润。

#### 7.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

##### 利息收入

存款利息收入是按借出货币资金的时间和实际利率计算确定。

买入返售金融资产在资金实际占用期间内按实际利率法逐日确认为利息收入。

##### 投资收益

股票投资收益、债券投资收益、资产支持证券投资收益和衍生工具收益按相关金融资产于处置日成交金额与其初始计量金额的差额确认，处置时产生的交易费用计入投资收益。

股利收益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确认。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的债券投资，在其持有期间，按票面金额和票面利率计算的利息计入投资收益。

##### 公允价值变动收益

公允价值变动收益核算基金持有的采用公允价值模式计量的以公允价值计量且变动计入当期损益的金融资产、衍生金融资产、以公允价值计量且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。不包括本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的债权投资在持有期间按票面利率计算的利息。

#### 7.4.4.10 费用的确认和计量

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

本基金的利息支出按资金的本金和适用利率逐日计提。

卖出回购金融资产款在资金实际占用期间按实际利率法逐日确认为利息支出。

本基金的其他费用如无需在收益期内预提或分摊，则于发生时直接计入基金损益；如需采用预提或待摊的方法，预提或待摊时计入基金损益。

#### 7.4.4.11 基金的收益分配政策

本基金收益分配应遵循下列原则：1、在符合有关基金分红条件的前提下，本基金每年



收益分配次数最多为 6 次，每次收益分配比例不得低于收益分配基准日每份基金份额可供分配利润的 20%，若《基金合同》生效不满 3 个月可不进行收益分配；2、本基金收益分配方式分两种：现金分红与红利再投资，投资者可选择现金红利或将现金红利自动转为基金份额进行再投资；若投资者不选择，本基金默认的收益分配方式是现金分红；3、基金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、在不违反法律法规且对基金份额持有人利益无实质不利影响的前提下，基金管理人可调整基金收益的分配原则和支付方式，不需召开基金份额持有人大会审议；6、法律法规或监管机构另有规定的，从其规定。

#### 7.4.4.12 分部报告

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

本基金目前以一个经营分部运作，不需要进行分部报告的披露。

#### 7.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计

编制财务报表时，本基金需要运用估计和假设，这些估计和假设会对会计政策的应用及资产、负债、收入和支出的金额产生影响。实际情况可能与这些估计不同。本基金对估计涉及的关键假设和不确定因素的判断进行持续评估，会计估计变更的影响在变更当期和未来期间予以确认。

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

对于在发行时明确一定期限限售期的股票，包括但不限于非公开发行股票、首次公开发行股票时公司股东公开发售股份、通过大宗交易取得的带限售期的股票等，不包括停牌、新发行未上市、回购交易中的质押券等流通受限股票，根据中基协发[2017]6号《关于发布〈证券投资基金投资流通受限股票估值指引（试行）〉的通知》，在估值日按照流通受限股票计算公式确定估值日流通受限股票的价值。

根据《中国证券投资基金业协会估值核算工作小组关于 2015 年 1 季度固定收益品种的

估值处理标准》（以下简称“估值处理标准”），在上海证券交易所、深圳证券交易所及银行间同业市场上市交易或挂牌转让的固定收益品种（估值处理标准另有规定的除外），采用第三方估值机构提供的价格数据进行估值。

#### 7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

##### 7.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金自 2022 年度起执行了财政部发布的《企业会计准则第 22 号——金融工具确认和计量(修订)》、《企业会计准则第 23 号——金融资产转移(修订)》、《企业会计准则第 24 号——套期会计(修订)》及《企业会计准则第 37 号——金融工具列报(修订)》(统称“新金融工具准则”)和 2022 年中国证监会发布的修订的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号〈年度报告和中期报告〉》。

###### (a) 新金融工具准则

根据财政部发布的新金融工具准则相关衔接规定，以及财政部、中国银行保险监督管理委员会于 2020 年 12 月 30 日发布的《关于进一步贯彻落实新金融工具相关会计准则的通知》，本基金应当自 2022 年 1 月 1 日起执行新金融工具准则。

新金融工具准则修订了财政部于 2006 年颁布的《企业会计准则第 22 号——金融工具确认和计量》、《企业会计准则第 23 号——金融资产转移》和《企业会计准则第 24 号——套期保值》以及财政部于 2014 年修订的《企业会计准则第 37 号——金融工具列报》(统称“原金融工具准则”)。

新金融工具准则将金融资产划分为三个基本分类：(1) 以摊余成本计量的金融资产；(2) 以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产；及(3) 以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。在新金融工具准则下，金融资产的分类是基于本基金管理金融资产业务模式及该资产合同现金流量特征而确定。新金融工具准则取消了原金融工具准则中规定的持有至到期投资、贷款和应收款项及可供出售金融资产三个分类类别。根据新金融工具准则，嵌入衍生工具不再从金融资产的主合同中分拆出来，而是将混合金融工具整体适用关于金融资产分类的相关规定。

新金融工具准则以“预期信用损失”模型替代了原金融工具准则中的“已发生损失”模型。“预期信用损失”模型要求持续评估金融资产的信用风险，因此在新金融工具准则下，本基金信用损失的确认时点早于原金融工具准则。

本基金按照新金融工具准则的衔接规定，对新金融工具准则施行日（即 2022 年 1 月 1

日)未终止确认的金融工具的分类和计量(含减值)进行追溯调整。本基金未调整比较财务报表数据,将金融工具的原账面价值和在新金融工具准则施行日的新账面价值之间的差额计入 2022 年年初留存收益。

执行新金融工具准则对本基金资产负债表的影响汇总如下:

金融工具的分类影响

以摊余成本计量的金融资产

于 2021 年 12 月 31 日,本基金按照原金融工具准则以摊余成本计量的金融资产为银行存款、结算备付金、存出保证金和应收利息,对应的账面价值分别为人民币 9,296,276.54 元、210,981.09 元、48,022.02 元和 1,152.66 元。

于 2022 年 1 月 1 日,本基金按照新金融工具准则以摊余成本计量的金融资产为银行存款、结算备付金和存出保证金,对应的账面价值分别为人民币 9,297,301.05 元、211,085.48 元和 48,045.78 元。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产

于 2021 年 12 月 31 日,本基金按照原金融工具准则以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产为交易性金融资产,对应的账面价值为人民币 50,994,112.00 元。

于 2022 年 1 月 1 日,本基金按照新金融工具准则以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产为交易性金融资产,对应的账面价值为人民币 50,994,112.00 元。

以摊余成本计量的金融负债

于 2021 年 12 月 31 日,本基金按照原金融工具准则以摊余成本计量的金融负债为应付管理人报酬、应付托管费、应付交易费用和其他负债,对应的账面价值分别为人民币 77,820.09 元、5,188.01 元、39,989.59 元和 135,000.00 元。

于 2022 年 1 月 1 日,本基金按照新金融工具准则以摊余成本计量的金融负债为应付管理人报酬、应付托管费和其他负债,对应的账面价值分别为人民币 77,820.09 元、5,188.01 元和 174,989.59 元。

于 2021 年 12 月 31 日,本基金持有的银行存款、结算备付金、存出保证金、交易性金融资产、买入返售金融资产和卖出回购金融资产款等对应的应计利息余额均列示在应收利息或应付利息科目中。于 2022 年 1 月 1 日,本基金按照新金融工具准则,将上述应计利息分别转入银行存款、结算备付金、存出保证金、交易性金融资产、买入返售金融资产和卖出回

购金融资产款等科目项下列示，无期初留存收益影响。

(b) 修订的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和中期报告>》

本基金根据修订的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和中期报告>》编制财务报表时，调整了部分财务报表科目的列报和披露，未对财务报表列报和披露产生重大影响。

#### 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

本基金本报告期无重大会计差错的内容和更正金额。

#### 7.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税 [2002] 128 号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税 [2004] 78 号文《关于证券投资基金税收政策的通知》、财税 [2012] 85 号文《财政部、国家税务总局、证监会关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税 [2015] 101 号《财政部、国家税务总局、证监会关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、《关于继续实施全国中小企业股份转让系统挂牌公司股息红利差别化个人所得税政策的公告》（财政部、税务总局、证监会公告 2019 年第 78 号）、财税 [2005] 103 号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》、上证交字 [2008] 16 号《关于做好调整证券交易印花税税率相关工作的通知》及深圳证券交易所于 2008 年 9 月 18 日发布的《深圳证券交易所关于做好证券交易印花税征收方式调整工作的通知》、财税 [2008] 1 号文《财政部、国家税务总局关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税 [2016] 36 号文《财政部、国家税务总局关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税 [2016] 46 号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税 [2016] 70 号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、财税 [2016] 140 号文《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》、财税 [2017] 2 号文《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税 [2017] 56 号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税 [2017] 90 号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》及其他相关税务法规和实务操作，本基金适用的主要税项列示如下：

(a) 对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入，暂不征收企业所得税。

(b)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（以下称“营改增”）试点，建筑业、房地产业、金融业、生活服务业等全部营业税纳税人，纳入试点范围，由缴纳营业税改为缴纳增值税。

自 2018 年 1 月 1 日起，资管产品管理人（以下称管理人）运营资管产品提供的贷款服务、发生的部分金融商品转让业务，按照以下规定确定销售额：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。

2018 年 1 月 1 日（含）以后，管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为，以管理人为增值税纳税人，暂适用简易计税方法，按照 3%的征收率缴纳增值税。对资管产品在 2018 年 1 月 1 日以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，已纳税额从管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。

证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券收入取得的金融商品转让收入免征增值税；对国债、地方政府债利息收入以及金融同业往来取得的利息收入免征增值税；同业存款利息收入免征增值税以及一般存款利息收入不征收增值税。

(c)基金作为流通股股东在股权分置改革过程中收到由非流通股股东支付的股份、现金对价，暂免征收印花税、企业所得税和个人所得税。

(d)对基金从上市公司取得的股息、红利所得，由上市公司在向基金支付上述收入时代扣代缴 20%的个人所得税。自 2013 年 1 月 1 日起，对所取得的股息红利收入根据持股期限差别化计算个人所得税的应纳税所得额：持股期限在 1 个月以内（含 1 个月）的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在 1 个月以上至 1 年（含 1 年）的，暂减按 50%计入应纳税所得额；持股期限超过 1 年的，暂免征收个人所得税。对基金持有的上市公司限

售股，解禁后取得的股息、红利收入，按照上述规定计算纳税，持股时间自解禁日起计算；解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按 50% 计入个人所得税应纳税所得额。对基金从全国中小企业股份转让系统公开转让股票的非上市公众公司（“挂牌公司”）取得的股息、红利所得，由挂牌公司代扣代缴 20% 的个人所得税。对所取得的股息红利收入根据持股期限差别化计算个人所得税的应纳税所得额：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，其股息红利所得暂减按 50% 计入应纳税所得额；持股期限超过 1 年的，暂免征收个人所得税。

(e) 基金卖出股票按 0.1% 的税率缴纳股票交易印花税，买入股票不征收股票交易印花税。

(f) 对投资者从证券投资基金分配中取得的收入，暂不征收企业所得税。

(g) 对基金在 2018 年 1 月 1 日（含）以后运营过程中缴纳的增值税，分别按照证券投资基金管理人所在地适用的税率，计算缴纳城市维护建设税、教育费附加和地方教育费附加。

#### 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 2022 年 12 月 31 日	上年度末 2021 年 12 月 31 日
活期存款	7,238,638.10	9,296,276.54
等于：本金	7,237,809.31	9,296,276.54
加：应计利息	828.79	-
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:	7,238,638.10	9,296,276.54
-----	--------------	--------------

#### 7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末 2022年12月31日			
		成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票		28,619,497.01	-	28,520,066.00	-99,431.01
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-	-
债券	交易所市场	-	-	-	-
	银行间市场	-	-	-	-
	合计	-	-	-	-
资产支持证券		-	-	-	-
基金		-	-	-	-
其他		-	-	-	-
合计		28,619,497.01	-	28,520,066.00	-99,431.01
项目		上年度末 2021年12月31日			
		成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票		49,042,898.99	-	50,994,112.00	1,951,213.01
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		49,042,898.99	-	50,994,112.00	1,951,213.01

#### 7.4.7.3 衍生金融资产/负债

##### 7.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

注：本基金本报告期末及上年度末未持有衍生金融资产/负债。

##### 7.4.7.3.2 期末基金持有的期货合约情况

注：本基金本报告期末未持有期货合约。

##### 7.4.7.3.3 期末基金持有的黄金衍生品情况

注：本基金本报告期末未持有黄金衍生品。

**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**

注：本基金本报告期末未持有买入返售金融资产。

**7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券**

注：本基金本报告期末无买断式逆回购余额，故未存在因此取得的债券。

**7.4.7.4.3 按预期信用损失一般模型计提减值准备的说明**

无。

**7.4.7.5 债权投资****7.4.7.5.1 债权投资情况**

注：本基金本报告期末及上年度末无债权投资。

**7.4.7.5.2 债权投资减值准备计提情况**

注：无。

**7.4.7.6 其他债权投资****7.4.7.6.1 其他债权投资情况**

注：本基金本报告期无其他债权投资。

**7.4.7.6.2 其他债权投资减值准备计提情况**

注：无。

**7.4.7.7 其他权益工具投资****7.4.7.7.1 其他权益工具投资情况**

注：本基金本报告期内及上年度末无其他权益工具投资。

**7.4.7.7.2 报告期末其他权益工具投资情况**

注：本基金本报告期末未持有其他权益工具投资。

**7.4.7.8 其他资产**

单位：人民币元

项目	本期末 2022年12月31日	上年度末 2021年12月31日
应收利息	-	1,152.66
其他应收款	-	-
待摊费用	-	-
合计	-	1,152.66



## 7.4.7.9 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2022 年 12 月 31 日	上年度末 2021 年 12 月 31 日
应付券商交易单元保证金	-	-
应付赎回费	-	-
应付证券出借违约金	-	-
应付交易费用	42,122.41	39,989.59
其中：交易所市场	42,122.41	39,989.59
银行间市场	-	-
-	-	-
应付利息	-	-
预提费用	95,000.00	135,000.00
合计	137,122.41	174,989.59

## 7.4.7.10 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 12 月 31 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	69,360,002.81	69,360,002.81
本期申购	279,142.87	279,142.87
本期赎回（以“-”号填列）	-12,423,948.35	-12,423,948.35
- 基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算变动份额	-	-
本期申购	-	-
本期赎回（以“-”号填列）	-	-
本期末	57,215,197.33	57,215,197.33

注：本期申购份额含红利再投、转换入份额，本期赎回份额含转换出份额。

## 7.4.7.11 其他综合收益

注：本基金本报告期末无其他综合收益。

## 7.4.7.12 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	-11,536,349.72	2,468,893.53	-9,067,456.19
本期利润	-14,607,628.54	-2,050,644.02	-16,658,272.56

本期基金份额交易产生的变动数	3,507,566.14	104,412.02	3,611,978.16
其中：基金申购款	-79,560.20	-895.09	-80,455.29
基金赎回款	3,587,126.34	105,307.11	3,692,433.45
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-22,636,412.12	522,661.53	-22,113,750.59

#### 7.4.7.13 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2022年1月1日至2022年12月31日	2021年3月25日(基金合同生效日)至2021年12月31日
活期存款利息收入	32,116.39	114,856.67
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	3,066.69	25,119.95
其他	553.90	268.59
合计	35,736.98	140,245.21

注：“其他”为结算保证金利息收入。

#### 7.4.7.14 股票投资收益

##### 7.4.7.14.1 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2022年1月1日至2022年12月31日	2021年3月25日(基金合同生效日)至2021年12月31日
卖出股票成交总额	186,139,478.03	133,347,122.27
减：卖出股票成本总额	199,799,303.72	146,542,761.15
减：交易费用	551,661.70	-
买卖股票差价收入	-14,211,487.39	-13,195,638.88

#### 7.4.7.15 债券投资收益

##### 7.4.7.15.1 债券投资收益项目构成

注：本基金本报告期无债券投资收益。

##### 7.4.7.15.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

注：本基金本报告期无债券投资收益-买卖债券差价收入

##### 7.4.7.15.3 债券投资收益——赎回差价收入

注：本基金本报告期无债券投资收益-赎回差价收入

##### 7.4.7.15.4 债券投资收益——申购差价收入

注：本基金本报告期无债券投资收益-申购差价收入。

#### 7.4.7.16 资产支持证券投资收益

##### 7.4.7.16.1 资产支持证券投资收益项目构成

注：本基金本报告期内无资产支持证券投资收益。

##### 7.4.7.16.2 资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入

注：本基金本报告期间无买卖资产支持证券差价收入。

##### 7.4.7.16.3 资产支持证券投资收益——赎回差价收入

注：本基金报告期内无资产支持证券投资收益——赎回差价收入。

##### 7.4.7.16.4 资产支持证券投资收益——申购差价收入

注：本基金报告期内无资产支持证券投资收益——申购差价收入。

#### 7.4.7.17 贵金属投资收益

##### 7.4.7.17.1 贵金属投资收益项目构成

注：本基金在本报告期末进行贵金属投资。

##### 7.4.7.17.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

注：本基金在本报告期无买卖贵金属差价收入。

##### 7.4.7.17.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

注：本基金在本报告期无贵金属赎回差价收入。

##### 7.4.7.17.4 贵金属投资收益——申购差价收入

注：本基金在本报告期无贵金属申购差价收入。

## 7.4.7.18 衍生工具收益

## 7.4.7.18.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

注：本基金在本报告期无买卖权证差价收入。

## 7.4.7.18.2 衍生工具收益——其他投资收益

注：本基金本报告期无其他衍生工具投资收益。

## 7.4.7.19 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年 12月31日	上年度可比期间 2021年3月25日(基金合同生 效日)至2021年12月31日
股票投资产生的股利收益	394,549.57	175,611.71
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	394,549.57	175,611.71

## 7.4.7.20 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12月31日	上年度可比期间 2021年3月25日(基金 合同生效日)至2021年12月 31日
1. 交易性金融资产	-2,050,644.02	1,951,213.01
——股票投资	-2,050,644.02	1,951,213.01
——债券投资	-	-
——资产支持证券投资	-	-
——贵金属投资	-	-
——其他	-	-
2. 衍生工具	-	-
——权证投资	-	-
3. 其他	-	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税	-	-
合计	-2,050,644.02	1,951,213.01

#### 7.4.7.21 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年 12月31日	上年度可比期间 2021年3月25日(基金合同生效 日)至2021年12月31日
基金赎回费收入	3,959.17	747,492.04
基金转换收入	105.68	-
合计	4,064.85	747,492.04

#### 7.4.7.22 信用减值损失

注：本基金本报告期无信用减值损失。

#### 7.4.7.23 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022 年12月31日	上年度可比期间 2021年3月25日(基金合 同生效日)至2021年12月31日
审计费用	15,000.00	15,000.00
信息披露费	80,000.00	120,000.00
证券出借违约金	-	-
银行划款手续费	270.00	210.00
律师费用	25,000.00	-
持有人大会费用	10,000.00	-
证券账户开户费	-	400.00
交易费用		462,169.54
合计	130,270.00	597,779.54

#### 7.4.7.24 分部报告

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

本基金目前以一个经营分部运作，不需要进行分部报告的披露。

#### 7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

##### 7.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金未发生需要披露的或有事项。

#### 7.4.8.2 资产负债表日后事项

截至本财务报告批准报出日，本基金未发生需要披露的资产负债表日后事项。

#### 7.4.9 关联方关系

关联方名称	与本基金的关系
国都证券股份有限公司	基金管理人、基金销售机构、基金的证券经纪商
兴业银行股份有限公司	基金托管人、基金销售机构

注：下述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

本报告期的关联方交易主要包括通过关联方交易单元进行的交易、关联方报酬等情况。

##### 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 2022年1月1日至2022年12月31日		上年度可比期间 2021年3月25日(基金合同生效日)至2021年12月31日	
	成交金额	占当期股票成交总额的比例	成交金额	占当期股票成交总额的比例
国都证券股份有限公司	365,515,379.77	100.00%	328,817,954.91	100.00%

###### 7.4.10.1.2 债券交易

注：本报告期及上年度可比区间均未通过关联方交易单元进行涉及支付关联方费用的债券交易。

###### 7.4.10.1.3 债券回购交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2022年1月1日至2022年12月31日		上年度可比期间 2021年3月25日(基金合同生效日)至2021年12月31日	
	回购成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	回购成交金额	占当期债券回购成交总额的比例

国都证券股份有限公司	170,000,000.00	100.00%	3,644,000,000.00	100.00%
------------	----------------	---------	------------------	---------

#### 7.4.10.1.4 权证交易

注：本报告期及上年度可比区间均未通过关联方交易单元进行涉及支付关联方费用的权证交易。

#### 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 2022年1月1日至2022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
国都证券股份有限公司	336,396.66	100.00%	42,122.41	100.00%
关联方名称	上年度可比期间 2021年3月25日(基金合同生效日)至2021年12月31日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例
国都证券股份有限公司	328,232.54	100.00%	39,989.59	100.00%

注：1 上述佣金按市场佣金率计算，扣除证券公司需承担的费用(包括但不限于买(卖)经手费、证券结算风险基金和买(卖)证管费等。

2 关联方符合本基金管理人选择证券经营机构、使用其交易单元作为基金专用交易单元的标准。

#### 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 2022年1月1日至2022年 12月31日	上年度可比期间 2021年3月25日(基金合同生 效日)至2021年12月31日
	当期发生的基金应支付的管理费	675,197.50
其中：支付销售机构的	933.51	1,566.62

客户维护费		
-------	--	--

注：1、本基金的管理费按前一日基金资产净值的 1.5%年费率计提。管理费的计算方法如下：

$$H = E \times 1.5\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付。由基金管理人向基金托管人发送基金管理费划付指令，经基金托管人复核后于次月首日起 5 个工作日内从基金资产中一次性支付给基金管理人。若遇法定节假日、休息日或不可抗力致使无法按时支付的，顺延至最近可支付日支付。

2、实际支付销售机构的客户维护费以本基金管理人和各销售机构对账确认的金额为准。

#### 7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日	2021 年 3 月 25 日(基金合同生效日)至 2021 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的托管费	45,013.18	81,113.18

注：本基金的托管费按前一日基金资产净值的 0.1%的年费率计提。托管费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.1\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付。由基金管理人向基金托管人发送基金托管费划付指令，经基金托管人复核后于次月首日起 5 个工作日内从基金资产中一次性支付给基金托管人。若遇法定节假日、休息日或不可抗力致使无法按时支付的，顺延至最近可支付日支付。

#### 7.4.10.2.3 销售服务费

注：本基金无销售服务费。

#### 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

注：本基金本报告期内未与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易。



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

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

注：本基金本报告期内无与关联方通过约定申报方式进行的适用固定期限费率的证券出借业务。

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

注：本基金本报告期内无与关联方通过约定申报方式进行的适用市场化期限费率的证券出借业务。

#### 7.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

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

注：报告期内基金管理人未运用固有资金投资本基金。

##### 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

注：本基金其他关联方在本报告期末未持有本基金。

##### 7.4.10.5.3 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12月31日		上年度可比期间 2021年3月25日(基金合同生效日)至 2021年12月31日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
兴业银行	7,237,809.31	32,116.39	9,296,276.54	114,856.67

注：本基金的银行存款由基金托管人兴业银行保管，按银行同业利率计息。

#### 7.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

注：本基金在承销期内未参与关联方承销证券。

#### 7.4.10.7 其他关联交易事项的说明

注：本基金本报告期没有需作说明的其他关联交易事项。

#### 7.4.11 利润分配情况

注：本报告期内本基金未实施利润分配，符合相关法规及基金合同的规定。

#### 7.4.12 期末（2022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

注：本基金本报告期末未持有因认购新发/增发而流通受限的证券。

#### 7.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

注：本基金本报告期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

#### 7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

##### 7.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

注：截至本报告期末，本基金未持有在银行间市场正回购交易中作为抵押的债券。

##### 7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

注：截至本报告期末，本基金未持有在交易所市场正回购交易中作为抵押的债券。

#### 7.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

注：本基金本报告期末未参与转融通证券出借业务。

### 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

本基金管理人根据发展战略、经营目标及资本实力制定风险管理政策，确定风险偏好、风险容忍度、风险限额等指标，在确保整体风险可承受的前提下，积极、恰当地管理风险，实现经风险调整后的收益最大化。

本基金管理人风险管理的组织体系由董事会、监事会、经营管理层、各部门、分支机构、子公司和全体工作人员组成。董事会承担公司全面风险管理的最终责任。监事会承担全面风险管理的监督责任。经营管理层对公司全面风险管理承担主要责任。公司各部门、分支机构及子公司负责人承担本部门（分支机构、子公司）风险管理的直接责任。公司全体工作人员对风险管理有效性承担勤勉尽责、审慎防范、及时报告的责任。

董事会及其风险控制委员会负责审批公司风险管理制度、风险管理政策、重大风险处置方案等重大风险管理事项，对公司承担风险的整体情况和风险管理体系的有效性进行监督。

监事会负责监督董事会和经营管理层在风险管理方面的履职尽责情况并督促整改。

经营管理层及其合规与风险管理委员会负责建设公司全面风险管理体系，组织实施董事会通过的风险管理政策，在董事会授权范围内对风险管理重大事项进行决策，向董事会报告风险管理工作和风险承担状况并接受监督。管理层及其下属的专业决策机构具体管理公司各项业务，设定各业务限额和风险限额，确定业务管理和风险控制的制度和措施。首席风险官负责公司全面风险管理工作，并领导风险管理部门的工作。

风险管理部在首席风险官领导下履行公司全面风险管理职责。公司资金管理部门牵头负

责公司流动性风险管理工作，公司相关部门和风险管理部门配合其开展工作。

各业务部门、分支机构、子公司履行本部门（分支机构、子公司）的风险管理工作职责。财务、信息技术、运营、人力资源等职能部门在做好本部门风险管理工作的同时，在各自的专业领域对业务部门进行监督。

公司全体工作人员在执业行为中履行各自的风险管理责任。

#### 7.4.13.2 信用风险

指基金在交易过程发生交收违约，或者基金所投资债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。

##### 7.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

注：本报告期末，本基金未持有债券。

##### 7.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

注：本报告期末，本基金未持有资产支持证券。

##### 7.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

注：本报告期末，本基金未持有同业存单。

##### 7.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

注：本报告期末，本基金未持有债券。

##### 7.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

注：本报告期末，本基金未持有资产支持证券。

##### 7.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

注：本报告期末，本基金未持有同业存单。

#### 7.4.13.3 流动性风险

指基金资产不能迅速转变成现金，或者不能应付可能出现的投资者大额赎回的风险。在开放式基金交易过程中，可能会发生巨额赎回的情形。巨额赎回可能会产生基金仓位调整的困难，导致流动性风险，甚至影响基金份额净值。

##### 7.4.13.3.1 金融资产和金融负债的到期期限分析

注：无。

##### 7.4.13.3.2 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

报告期内，本基金组合资产以现金、股票、7日内到期的国债逆回购等高流动性资产为主，停牌股票等主动投资于流动性受限资产占基金资产净值比例未超过 15%，7 个工作日可

变现资产市值占基金净值的比例维持在 80%以上，可流通股票资产变现天数低于 1 天，单一投资者持有基金份额最高比例不超过 20%。发生巨额赎回，但未发生投资者巨额赎回导致流动性风险的情形。

报告期内，未出现延期支付赎回款的情况及 7 个工作日可变现资产的可变现价值低于每日净赎回金额的情况，未出现可能导致流动性风险的情形，相关流动性监控指标符合《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》。

#### 7.4.13.4 市场风险

证券市场价格因受各种因素的影响而引起的波动，将对本基金资产产生潜在风险，主要包括：

##### 1、政策风险

货币政策、财政政策、产业政策等国家政策的变化对证券市场产生一定的影响，导致证券价格波动而产生风险。

##### 2、经济周期风险

经济运行具有周期性的特点，宏观经济运行状况将对证券市场的收益水平产生影响，基金投资的收益水平也会随之变化，从而产生风险。

##### 3、购买力风险

本基金投资的目的是使基金资产保值增值，如果发生通货膨胀，基金投资于证券所获得的收益可能会被通货膨胀抵消，从而影响基金资产的保值增值。

##### 4、上市公司经营风险

上市公司的经营状况受多种因素影响，如市场、技术、竞争、管理、财务等都会导致公司盈利发生变化，从而导致基金投资收益变化。

#### 7.4.13.4.1 利率风险

金融市场利率波动会导致证券市场的价格和收益率的变动，同时直接影响企业的融资成本和利润水平。基金投资于证券，收益水平会受到利率变化的影响。

##### 7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2022 年 12 月 31 日	1 个月以内	1-3 个月	3 个月- 1 年	1-5 年	5 年以 上	不计息	合计
资产							

银行存款	7,237,809.31	-	-	-	-	828.79	7,238,638.10
结算备付金	209,829.70	-	-	-	-	103.95	209,933.65
存出保证金	26,839.64	-	-	-	-	13.20	26,852.84
交易性金融资产	-	-	-	-	-	-28,520,066.00	28,520,066.00
其他资产	-	-	-	-	-	-	-
资产总计	7,474,478.65	-	-	-	-	-28,521,011.94	35,995,490.59
负债							
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	45,380.70	45,380.70
应付托管费	-	-	-	-	-	3,025.40	3,025.40
其他负债	-	-	-	-	-	845,637.75	845,637.75
负债总计	-	-	-	-	-	894,043.85	894,043.85
利率敏感度缺口	7,474,478.65	-	-	-	-	-27,626,968.09	35,101,446.74
上年度末 2021年12月 31日	1个月以内	1-3个月	3个月-1年	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产							
银行存款	9,296,276.54	-	-	-	-	-	9,296,276.54
结算备付金	210,981.09	-	-	-	-	-	210,981.09
存出保证金	48,022.02	-	-	-	-	-	48,022.02
交易性金融资产	-	-	-	-	-	-50,994,112.00	50,994,112.00
应收利息	-	-	-	-	-	1,152.66	1,152.66
资产总计	9,555,279.65	-	-	-	-	-50,995,264.66	60,550,544.31
负债							
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	77,820.09	77,820.09
应付托管费	-	-	-	-	-	5,188.01	5,188.01
应付交易费用	-	-	-	-	-	39,989.59	39,989.59
其他负债	-	-	-	-	-	135,000.00	135,000.00
负债总计	-	-	-	-	-	257,997.69	257,997.69
利率敏感度缺口	9,555,279.65	-	-	-	-	-50,737,266.97	60,292,546.62

注：上表统计了本基金面临的利率风险敞口，表中所示为本基金资产及交易形成负债的公允价值，并按照合约规定的重新定价日或到期日孰早者进行了分类。

#### 7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

注：本基金本报告期末计息资产仅包括银行存款、结算备付金、存出保证金及部分应收申购款，且均以活期存款利率或相对固定的利率计息；假定利率变动仅影响其未来收益，而对其

本身的公允价值无重大影响,因而在本基金本报告期末未持有其他计息资产/负债的情况下,利率变动对基金资产净值的影响并不显著。

#### 7.4.13.4.2 外汇风险

本基金的所有资产及负债以人民币计价,因此无重大外汇风险。

#### 7.4.13.4.3 其他价格风险

本基金所面临的其他价格风险主要是市场价格风险。市场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。

##### 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 2022年12月31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	28,520,066.00	81.25	50,994,112.00	84.58
交易性金融资产-基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产-债券投资	-	-	-	-
交易性金融资产-贵金属投资	-	-	-	-
衍生金融资产-权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	28,520,066.00	81.25	50,994,112.00	84.58

##### 7.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	根据期末时点本基金股票资产组合相对于沪深300指数的Beta系数计算基金资产变动
	Beta系数以市场过去一年的数据建立回归模型计算得到,对于新股或者股

	票交易不足一年的股票，默认其波动与市场同步		
	假定沪深 300 指数变动 5%，其他市场变量均不发生变化，计算本基金资产净值变动		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2022 年 12 月 31 日）	上年度末（2021 年 12 月 31 日）
	沪深 300 指数下跌 5%	-1,528,093.12	-3,347,567.43
	沪深 300 指数上涨 5%	1,528,093.12	3,347,567.43

#### 7.4.13.4.4 采用风险价值法管理风险

注：本基金在 95%的置信水平，以过去 250 个交易日为风险样本观察期，计算前瞻天数为 1 天的风险价值。本期末本基金风险价值为 636189.87 元，占基金资产净值比例为 1.81%。

#### 7.4.14 公允价值

##### 7.4.14.1 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公开报价；

第二层次：使用估值技术，所有对估值结果有重大影响的参数均采用可直接或间接观察的市场信息；

第三层次：使用估值技术，以可观察到的市场数据以外的变量为基础确定的资产或负债的输入值，由于流动性折价为不可观察输入值，本公司使用该流动性折价对可观察的企业价值、税息折旧及摊销前利润乘数进行调整，如果调整对该金融资产的公允价值计量具有重大影响，那么公允价值计量结果应当被划入第三层级的公允价值计量。

##### 7.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

###### 7.4.14.2.1 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 12 月 31 日	上年度末 2021 年 12 月 31 日
第一层次	28,520,066.00	50,994,112.00
第二层次	-	-
第三层次	-	-
合计	28,520,066.00	50,994,112.00

#### 7.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

对于证券交易所上市的股票，若出现重大事项停牌、交易不活跃（包括涨跌停时的交易不活跃）、或属于非公开发行等情况，本基金不会于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间将相关股票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，确定相关股票公允价值应属第二层次还是第三层次。对于在证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种（可转换债券、资产支持证券和私募债券除外），本基金采用第三方估值机构根据《中国证券投资基金业协会估值核算工作小组关于 2015 年 1 季度固定收益品种的估值处理标准》所独立提供的估值结果确定公允价值，并将相关债券的公允价值确定为第二层次。

#### 7.4.14.2.3 第三层次公允价值余额及变动情况

##### 7.4.14.2.3.1 第三层次公允价值余额及变动情况

注：本报告期末及上期末本基金无第三层次公允价值计量的金融工具。

##### 7.4.14.2.3.2 使用重要不可观察输入值的第三层次公允价值计量的情况

注：本报告期末及上年度末本基金无使用重要不可观察输入值的第三层次公允价值计量的情况。

#### 7.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

本报告期末及上年度末本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融工具。

#### 7.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

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

#### 7.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

于 2022 年 12 月 31 日，本基金无有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项。



## § 8 投资组合报告

### 8.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	28,520,066.00	79.23
	其中：股票	28,520,066.00	79.23
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	7,448,571.75	20.69
8	其他各项资产	26,852.84	0.07
9	合计	35,995,490.59	100.00

注：由于计算中四舍五入的原因，本报告分项之和与合计项之间可能存在尾差。

### 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	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	785,200.00	2.24
B	采矿业	1,127,500.00	3.21
C	制造业	18,591,366.00	52.96
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	1,583,700.00	4.51
G	交通运输、仓储和邮政业	3,109,650.00	8.86
H	住宿和餐饮业	1,041,600.00	2.97
I	信息传输、软件和信息技术服务业	1,200,900.00	3.42
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	1,080,150.00	3.08
M	科学研究和技术服务业	-	-

N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	28,520,066.00	81.25

注：以上行业分类以 2022 年 12 月 31 日的证监会行业分类标准为依据。

### 8.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

注：本基金本报告期末未持有港股通股票。

### 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	占基金资产净值比例（%）
1	002594	比亚迪	6,000	1,541,820.00	4.39
2	603027	千禾味业	70,000	1,454,600.00	4.14
3	600519	贵州茅台	800	1,381,600.00	3.94
4	600009	上海机场	20,000	1,154,200.00	3.29
5	000858	五粮液	6,000	1,084,140.00	3.09
6	601888	中国中免	5,000	1,080,150.00	3.08
7	600760	中航沈飞	18,000	1,055,340.00	3.01
8	000970	中科三环	77,000	1,050,280.00	2.99
9	600258	首旅酒店	42,000	1,041,600.00	2.97
10	002415	海康威视	30,000	1,040,400.00	2.96
11	000831	中国稀土	30,000	986,400.00	2.81
11	002149	西部材料	60,000	986,400.00	2.81
12	603517	绝味食品	16,000	977,440.00	2.78
13	002568	百润股份	26,000	971,360.00	2.77
14	601021	春秋航空	15,000	963,750.00	2.75
15	002410	广联达	16,000	959,200.00	2.73
16	002727	一心堂	30,000	945,300.00	2.69
17	300101	振芯科技	35,000	857,500.00	2.44
18	603345	安井食品	5,000	809,400.00	2.31
19	603737	三棵树	7,000	796,810.00	2.27
20	300498	温氏股份	40,000	785,200.00	2.24
21	300776	帝尔激光	6,000	756,000.00	2.15
22	601899	紫金矿业	70,000	700,000.00	1.99

23	002928	华夏航空	50,000	691,500.00	1.97
24	603939	益丰药房	10,000	638,400.00	1.82
25	603317	天味食品	20,000	549,600.00	1.57
26	000568	泸州老窖	2,000	448,560.00	1.28
27	600348	华阳股份	30,000	427,500.00	1.22
28	300119	瑞普生物	18,000	334,980.00	0.95
29	600487	亨通光电	20,000	301,200.00	0.86
30	600004	白云机场	20,000	300,200.00	0.86
31	600588	用友网络	10,000	241,700.00	0.69
32	300274	阳光电源	2,000	223,600.00	0.64
33	300488	恒锋工具	10,000	220,400.00	0.63
34	300920	润阳科技	14,000	217,420.00	0.62
35	603185	上机数控	2,000	211,700.00	0.60
36	002254	泰和新材	8,000	169,680.00	0.48
37	300751	迈为股份	400	164,736.00	0.47

#### 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	300498	温氏股份	4,797,067.00	7.96
2	300751	迈为股份	4,057,900.20	6.73
3	300122	智飞生物	3,993,599.00	6.62
4	603288	海天味业	3,900,716.00	6.47
5	603363	傲农生物	3,826,907.00	6.35
6	000858	五粮液	3,796,507.00	6.30
7	002714	牧原股份	3,271,569.00	5.43
8	002567	唐人神	3,211,844.85	5.33
9	603027	千禾味业	2,688,600.00	4.46
10	688599	天合光能	2,675,795.07	4.44
11	601006	大秦铁路	2,666,000.00	4.42
12	603939	益丰药房	2,633,612.00	4.37
13	600129	太极集团	2,623,254.00	4.35
14	600258	首旅酒店	2,616,166.00	4.34
15	600036	招商银行	2,566,715.00	4.26

16	688111	金山办公	2,444,913.00	4.06
17	601615	明阳智能	2,359,620.00	3.91
18	002727	一心堂	2,345,712.00	3.89
19	002371	北方华创	2,239,762.00	3.71
20	002568	百润股份	2,239,346.00	3.71
21	000651	格力电器	2,181,160.00	3.62
22	000568	泸州老窖	2,148,232.13	3.56
23	600298	安琪酵母	2,104,206.00	3.49
24	603259	药明康德	2,102,004.00	3.49
25	603345	安井食品	2,032,494.00	3.37
26	301071	力量钻石	1,953,671.00	3.24
27	600660	福耀玻璃	1,952,222.00	3.24
28	002078	太阳纸业	1,949,666.00	3.23
29	600031	三一重工	1,902,295.00	3.16
30	300274	阳光电源	1,897,864.00	3.15
31	002594	比亚迪	1,897,335.00	3.15
32	600309	万华化学	1,816,519.00	3.01
33	688305	科德数控	1,780,786.20	2.95
34	300724	捷佳伟创	1,779,093.00	2.95
35	002460	赣锋锂业	1,675,337.00	2.78
36	601888	中国中免	1,591,379.00	2.64
37	603233	大参林	1,563,149.00	2.59
38	688005	容百科技	1,542,023.52	2.56
39	300146	汤臣倍健	1,541,601.00	2.56
40	300761	立华股份	1,470,468.00	2.44
41	002507	涪陵榨菜	1,435,318.00	2.38
42	300841	康华生物	1,415,107.00	2.35
43	002352	顺丰控股	1,412,072.00	2.34
44	600585	海螺水泥	1,397,874.00	2.32
45	605499	东鹏饮料	1,383,350.00	2.29
46	688598	金博股份	1,348,093.16	2.24
47	002001	新和成	1,333,326.00	2.21
48	603737	三棵树	1,306,021.00	2.17
49	300124	汇川技术	1,298,990.00	2.15
50	002410	广联达	1,298,220.00	2.15

51	603658	安图生物	1,294,945.00	2.15
52	002049	紫光国微	1,294,479.00	2.15
53	601398	工商银行	1,289,000.00	2.14
54	002938	鹏鼎控股	1,274,092.00	2.11
55	002511	中顺洁柔	1,218,650.00	2.02
56	600009	上海机场	1,207,439.00	2.00
57	002603	以岭药业	1,206,973.00	2.00

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

#### 8.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 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	000858	五粮液	5,398,442.00	8.95
2	300498	温氏股份	5,091,982.00	8.45
3	002507	涪陵榨菜	4,519,325.00	7.50
4	600298	安琪酵母	4,419,505.00	7.33
5	603027	千禾味业	4,249,511.55	7.05
6	000568	泸州老窖	4,144,577.00	6.87
7	300751	迈为股份	3,964,025.04	6.57
8	603288	海天味业	3,692,300.90	6.12
9	300122	智飞生物	3,678,048.00	6.10
10	002714	牧原股份	3,059,982.70	5.08
11	603363	傲农生物	3,041,222.00	5.04
12	002567	唐人神	3,004,700.00	4.98
13	688599	天合光能	2,859,700.61	4.74
14	600519	贵州茅台	2,778,668.00	4.61
15	600905	三峡能源	2,685,172.00	4.45
16	601615	明阳智能	2,672,064.00	4.43
17	600703	三安光电	2,667,656.00	4.42
18	600129	太极集团	2,661,430.00	4.41
19	601006	大秦铁路	2,640,087.00	4.38
20	002027	分众传媒	2,562,486.40	4.25
21	600690	海尔智家	2,435,405.00	4.04
22	002311	海大集团	2,364,573.00	3.92
23	688111	金山办公	2,334,891.96	3.87

24	300476	胜宏科技	2,260,404.00	3.75
25	600036	招商银行	2,258,779.00	3.75
26	002557	洽洽食品	2,175,105.00	3.61
27	603939	益丰药房	2,127,042.00	3.53
28	000651	格力电器	2,096,067.00	3.48
29	002384	东山精密	1,963,774.00	3.26
30	603259	药明康德	1,938,803.00	3.22
31	600660	福耀玻璃	1,892,271.00	3.14
32	002078	太阳纸业	1,858,679.00	3.08
33	002371	北方华创	1,845,180.00	3.06
34	002202	金风科技	1,830,722.00	3.04
35	301071	力量钻石	1,829,968.00	3.04
36	688305	科德数控	1,823,819.58	3.02
37	002460	赣锋锂业	1,729,840.60	2.87
38	300724	捷佳伟创	1,712,655.00	2.84
39	603233	大参林	1,694,151.68	2.81
40	600309	万华化学	1,681,783.00	2.79
41	300323	华灿光电	1,609,850.00	2.67
42	601669	中国电建	1,565,000.00	2.60
43	600031	三一重工	1,541,000.00	2.56
44	300274	阳光电源	1,537,422.00	2.55
45	603345	安井食品	1,523,637.00	2.53
46	300146	汤臣倍健	1,511,506.00	2.51
47	688598	金博股份	1,497,800.00	2.48
48	600585	海螺水泥	1,433,554.00	2.38
49	600809	山西汾酒	1,422,286.00	2.36
50	002727	一心堂	1,419,471.00	2.35
51	002568	百润股份	1,394,708.00	2.31
52	300841	康华生物	1,390,519.00	2.31
53	300124	汇川技术	1,380,000.00	2.29
54	600258	首旅酒店	1,363,676.00	2.26
55	605499	东鹏饮料	1,334,999.00	2.21
56	688005	容百科技	1,309,060.52	2.17
57	601398	工商银行	1,273,800.00	2.11
58	002049	紫光国微	1,239,864.00	2.06
59	300761	立华股份	1,226,040.00	2.03
60	002001	新和成	1,216,614.00	2.02
61	002352	顺丰控股	1,212,612.00	2.01

注：“本期累计卖出金额”按卖出成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

#### 8.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	179,375,901.74
卖出股票收入（成交）总额	186,139,478.03

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

#### 8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

注：本基金本报告期末未持有债券。

#### 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

注：本基金本报告期末未持有债券。

#### 8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

注：本基金本报告期末未持有资产支持证券。

#### 8.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

注：本基金报告期末未持有贵金属。

#### 8.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

注：本基金本报告期末未持有权证。

#### 8.10 本基金投资股指期货的投资政策

本基金的股指期货投资以套期保值为主要目的，充分考虑股指期货的收益性、流动性及风险特征，优化资产配置，谨慎投资，以降低投资组合的整体风险，达到套期保值的目标。

#### 8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

##### 8.11.1 本期国债期货投资政策

本基金投资国债期货以套期保值为主要目的，结合国债交易市场和期货市场的收益性、流动性等情况，通过套期保值降低投资组合的整体风险，获取超额收益。

##### 8.11.2 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末未持有国债期货。

## 8.12 投资组合报告附注

### 8.12.1 本基金投资的前十名证券的发行主体本期受到调查以及处罚的情况的说明

本基金投资的前十名证券的发行主体在本报告期内没有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。

### 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情况的说明

本基金没有投资于超出基金合同规定备选库之外的股票。

### 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	26,852.84
2	应收清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	26,852.84

### 8.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注：本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

### 8.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

注：本基金本报告期末前十名股票中未存在流通受限的情况。

### 8.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于计算中四舍五入的原因，本报告分项之和与合计项之间可能存在尾差。



## § 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
525	108,981.32	20,991,471.87	36.69%	36,223,725.46	63.31%

### 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	0.00	0.0000%

注：基金管理人的从业人员，是指在基金管理人负责公募基金管理业务或者实际履行公募基金管理业务相应职责的人员以及可能接触公募基金管理业务未公开信息的人员，不包括与公募基金管理业务不直接相关的其他业务部门以及后台职能部门的工作人员。

### 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的情况

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、基金投资和研发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

注：基金管理人的从业人员，是指在基金管理人负责公募基金管理业务或者实际履行公募基金管理业务相应职责的人员以及可能接触公募基金管理业务未公开信息的人员，不包括与公募基金管理业务不直接相关的其他业务部门以及后台职能部门的工作人员。

### 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

注：公司基金经理不存在兼任私募资产管理计划投资经理的情况。

## § 10 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2021年3月25日）基金份额总额	276,496,226.65
本报告期期初基金份额总额	69,360,002.81
本报告期基金总申购份额	279,142.87
减：本报告期基金总赎回份额	12,423,948.35
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	57,215,197.33

注：总申购份额含红利再投、转换入份额，总赎回份额含转换出份额。

## § 11 重大事件揭示

### 11.1 基金份额持有人大会决议

本基金于 2022 年 11 月 1 日至 2022 年 12 月 4 日期间以通讯方式召开了基金份额持有人大会，大会表决时间于 2022 年 12 月 4 日 17:00 截止，会议审议了《关于国都聚成混合型证券投资基金持续运作的议案》。本次基金份额持有人大会中，基金份额持有人所代表的 29,783,546.27 份有效基金份额参加了此次持有人大会，且其所代表的基金份额占权益登记日基金总份额的 50.26%（权益登记日为 2022 年 10 月 31 日，权益登记日本基金总份额 59,254,275.14 份）符合《基金法》、《运作办法》和《基金合同》的有关持有人大会（通讯方式）的召开条件。参会的基金份额持有人所代表的 29,692,766.53 份基金份额表示同意，占参与投票的基金份额总数的 99.695%；19,842.17 份基金份额表示反对，占参与投票的基金份额总数的 0.067%；70,937.57 份基金份额表示弃权，占参与投票的基金份额总数的 0.238%。上述表决结果中同意票所代表的基金份额达到参加本次大会的基金份额持有人所持基金份额表决权的二分之一以上（含二分之一），符合《基金法》、《运作办法》和《基金合同》的有关规定，会议议案有效通过。本次基金份额持有人大会于 2022 年 12 月 5 日表决通过了《关于国都聚成混合型证券投资基金持续运作的议案》，本次大会决议自该日起生效。基金管理人已于 2022 年 12 月 6 日在指定信息披露媒介及公司网站上就决议生效事项进行了公告。

### 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

基金管理人的重大人事变动：

#### 1、公司层面

公司董事会于 2022 年 2 月 17 日收到原总经理韩本毅先生的辞职申请。按照《国都证券股份有限公司章程》的相关规定，韩本毅先生自 2022 年 2 月 17 日起不再担任公司总经理。

公司于 2022 年 2 月 22 日召开第二届董事会第十一次会议，审议通过《关于提议杨江权代行总经理职责的议案》，决定由公司原副总经理杨江权先生在董事会选聘出新任公司总经理前代为履行总经理职务，期限不超过六个月。

公司监事会于 2022 年 2 月 22 日收到职工代表监事陈跃武先生的辞职申请。按照《国都证券股份有限公司章程》的相关规定，陈跃武先生自 2022 年 2 月 22 日起不再担任公司职工代表监事。

公司董事会于 2022 年 3 月 10 日收到原副总经理谢荣先生的辞职申请。按照《国都证券股份有限公司章程》的相关规定，谢荣先生自 2022 年 3 月 10 日起不再担任公司副总经理。

公司于 2022 年 4 月 12 日召开了 2022 年第一次职工代表大会，补选赵宇先生为公司职工代表监事。

公司于 2022 年 5 月 23 至 30 日召开了第二届董事会第十三次会议。会议决定：1、聘任杨江权先生为公司总经理，同时免去其所担任的公司副总经理职务；2、因公司经营需要，聘任李锐先生为公司副总经理。杨江权先生自 2022 年 5 月起，在国都证券股份有限公司任总经理、财务负责人、代首席信息官。李锐先生自 2022 年 5 月起，在国都证券股份有限公司任副总经理兼固定收益总部总经理。

公司于 2022 年 6 月 21 日召开了 2021 年度股东大会，会议补选了陈春艳女士为公司监事。

2022 年 7 月 29 日，公司董事会收到雷达先生因个人工作安排原因辞去我公司独立董事及董事会薪酬与提名委员会主任委员等职务的辞职报告。根据《国都证券股份有限公司章程》的相关规定，自 2022 年 7 月 29 日起，雷达先生不再担任公司独立董事及董事会薪酬与提名委员会主任委员等职务。

2022 年 8 月 10 日，公司董事会收到周立业先生因工作调动原因辞去我公司董事及董事会审计委员会委员职务的辞职报告，根据相关法律法规和《国都证券股份有限公司章程》的有关规定，自 2022 年 8 月 10 日起，周立业先生不再担任公司董事及董事会审计委员会委员职务。

公司于 2022 年 11 月 3 日召开了 2022 年第一次临时股东大会，会议补选了闫志鹏先生为公司董事，王爱俭女士为公司独立董事。

公司于 2022 年 12 月 13 日召开了第二届董事会第十六次会议，审议通过《关于调整董事会审计委员会成员的议案》，会议决定：1. 增补王爱俭女士、闫志鹏先生为董事会审计委员会委员。2. 由王爱俭女士担任审计委员会主任委员；姜波女士不再担任审计委员会主任委员，仍担任委员。

## 2、基金业务层面

公司基金管理部于 2022 年 6 月 16 日发布《国都证券股份有限公司关于基金高级管理人员任职的公告》，根据公司相关决定，公司于 2022 年 6 月 14 日任命王琦为公司总经理

助理兼基金管理部总经理。

公司基金管理部于 2022 年 11 月 3 日发布《国都证券股份有限公司关于基金高级管理人员变更的公告》，自 2022 年 11 月 1 日起，李立宏不再担任基金管理部副总经理职务。

公司基金管理部于 2022 年 12 月 3 日发布《国都证券股份有限公司关于基金高级管理人员变更的公告》，根据公司相关决定，公司于 2022 年 12 月 1 日决定免去王琦总经理助理兼基金管理部总经理职务，由基金管理部副总经理黄静主持基金管理部工作。

报告期内托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

### 11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内，无涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼；涉及基金管理人的其他未决诉讼均不会对基金管理人日常经营造成重大影响，亦不会对基金管理人履行基金管理职责造成影响。

### 11.4 基金投资策略的改变

本报告期内基金投资策略未发生改变。

### 11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

为本基金进行审计的会计师事务所是信永中和会计师事务所(特殊普通合伙)，自 2021 年 12 月 27 日起服务至今。

### 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

#### 11.6.1 管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

注：报告期内，本基金管理人及其高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

#### 11.6.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

注：报告期内，本基金托管人及其高级管理人员在开展基金托管业务过程中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	佣金	占当期佣金 总量的比例	

			例			
国都证券	2	365,515,379.77	100.00%	336,396.66	100.00%	-

注：1、此处的佣金指通过单一券商的交易单元进行股票、权证等交易（如有）而合计支付该券商的佣金合计，不单指股票交易佣金。

2、本基金本报告期内无新增和剔除席位，与托管在同一托管人的公司其他基金共用交易单元。

### 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
国都证券	-	-	170,000,000.00	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	国都证券股份有限公司关于旗下公开募集证券投资基金执行新金融工具相关会计准则的公告	证监会指定媒体	2022年1月6日
2	国都聚成混合型证券投资基金招募说明书(更新)2022年第1号	证监会指定媒体	2022年1月21日
3	国都聚成混合型证券投资基金2021年第4季度报告	证监会指定媒体	2022年1月24日
4	国都证券股份有限公司高级管理人员辞职公告	证监会指定媒体	2022年2月21日

5	国都聚成混合型证券投资基金 2021 年年度报告	证监会指定媒体	2022 年 3 月 30 日
6	国都聚成混合型证券投资基金 2022 年第 1 季度报告	证监会指定媒体	2022 年 4 月 22 日
7	国都证券股份有限公司基金行业高级管理人员变更公告	证监会指定媒体	2022 年 6 月 16 日
8	国都聚成混合型证券投资基金 2022 年第 2 季度报告	证监会指定媒体	2022 年 7 月 21 日
9	国都聚成混合型证券投资基金 2022 年中期报告	证监会指定媒体	2022 年 8 月 31 日
10	国都聚成混合型证券投资基金基金经理变更的公告	证监会指定媒体	2022 年 9 月 8 日
11	国都聚成混合型证券投资基金招募说明书(更新)2022 年第 2 号	证监会指定媒体	2022 年 9 月 10 日
12	国都聚成混合型证券投资基金基金产品资料概要(更新)	证监会指定媒体	2022 年 9 月 10 日
13	国都证券股份有限公司旗下部分公募基金中期报告更正公告	证监会指定媒体	2022 年 10 月 19 日
14	国都聚成混合型证券投资基金 2022 年第 3 季度报告	证监会指定媒体	2022 年 10 月 26 日
15	国都证券股份有限公司关于以通讯方式召开国都聚成混合型证券投资基金基金份额持有人大会的公告	证监会指定媒体	2022 年 10 月 26 日
16	国都证券股份有限公司关于以通讯方式召开国都聚成混合型证券投资基金基金份额	证监会指定媒体	2022 年 10 月 27 日

	持有人大会的第一次提示性公告		
17	国都证券股份有限公司关于以通讯方式召开国都聚成混合型证券投资基金基金份额持有人大会的第二次提示性公告	证监会指定媒体	2022年10月28日
18	国都证券股份有限公司关于基金高级管理人员变更的公告	证监会指定媒体	2022年11月3日
19	国都证券股份有限公司旗下公募基金代销机构目录（截至2022年11月11日）	证监会指定媒体	2022年11月11日
20	国都证券股份有限公司关于基金高级管理人员变更的公告	证监会指定媒体	2022年12月3日
21	国都证券股份有限公司关于国都聚成混合型证券投资基金基金份额持有人大会表决结果暨决议生效的公告	证监会指定媒体	2022年12月6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

注：本基金本报告期内未出现单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况。

### 12.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

## § 13 备查文件目录

### 13.1 备查文件目录

- 1、《国都聚成混合型证券投资基金招募说明书》
- 2、《国都聚成混合型证券投资基金基金合同》
- 3、《国都聚成混合型证券投资基金托管协议》
- 4、中国证监会要求的其他文件

### 13.2 存放地点

基金管理人和基金托管人的住所，并登载于基金管理人网站 [www.guodu.com](http://www.guodu.com)。

### 13.3 查阅方式

投资者可免费查阅，在支付工本费后，可在合理时间内取得上述文件的复制件或复印件。  
相关公开披露的法律文件，投资者还可在本基金管理人网站（[www.guodu.com](http://www.guodu.com)）查阅。

国都证券股份有限公司

2023 年 3 月 30 日