

# 大成趋势回报灵活配置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

<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 主要财务指标和基金净值表现</b>	<b>6</b>
3.1 主要会计数据和财务指标	6
3.2 基金净值表现	7
<b>§ 4 管理人报告</b>	<b>8</b>
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	10
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	10
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	11
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 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	12
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	13
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	13
<b>§ 5 托管人报告</b>	<b>13</b>
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	13
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	13
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	13
<b>§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）</b>	<b>14</b>
6.1 资产负债表	14
6.2 利润表	15
6.3 净资产（基金净值）变动表	16
6.4 报表附注	20
<b>§ 7 投资组合报告</b>	<b>48</b>
7.1 期末基金资产组合情况	48
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	49
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	49
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	51
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	52
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	52

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 .....	53
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 .....	53
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 .....	53
7.10 本基金投资股指期货的投资政策 .....	53
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 .....	53
7.12 投资组合报告附注 .....	53
<b>§ 8 基金份额持有人信息 .....</b>	<b>55</b>
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....	55
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....	55
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 .....	55
<b>§ 9 开放式基金份额变动 .....</b>	<b>55</b>
<b>§ 10 重大事件揭示 .....</b>	<b>55</b>
10.1 基金份额持有人大会决议 .....	55
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 .....	55
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....	56
10.4 基金投资策略的改变 .....	56
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....	56
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 .....	56
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	56
10.8 其他重大事件 .....	58
<b>§ 11 影响投资者决策的其他重要信息 .....</b>	<b>59</b>
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 .....	59
11.2 影响投资者决策的其他重要信息 .....	60
<b>§ 12 备查文件目录 .....</b>	<b>60</b>
12.1 备查文件目录 .....	60
12.2 存放地点 .....	60
12.3 查阅方式 .....	60

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	大成趋势回报灵活配置混合型证券投资基金
基金简称	大成趋势回报灵活配置混合
基金主代码	002383
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2016 年 3 月 22 日
基金管理人	大成基金管理有限公司
基金托管人	中国银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	185,043,467.00 份
基金合同存续期	不定期

### 2.2 基金产品说明

投资目标	本基金通过灵活的资产配置和主动的投资管理，扩展大类资产配置空间，把握市场运行趋势，在控制风险的前提下为投资者谋求资本的长期增值。
投资策略	本基金的投资策略主要体现在两个方面：一方面对权益类资产及固定收益类资产等不同类别资产的大类配置上，另一方面体现在对单个投资品种的选择上。本基金强调趋势投资，具体可以概括为： 本基金根据对宏观趋势的分析实施大类资产的配置，本基金将在权益类证券投资方面，将对市场趋势进行研判，同时通过对行业发展趋势、公司成长趋势以及股票价格趋势的研究精选个股进行投资；在固定收益类证券投资方面，本基金将通过综合分析市场利率趋势、证券市场走势、资金供求关系流动性风险信用和有政策法规等因素，研判各类属固定收益资产的风险趋势与收益预期，精选个券进行投资。
业绩比较基准	沪深 300 指数收益率*50%+中证综合债券指数收益率*50%
风险收益特征	本基金为混合型基金，基金的风险与预期收益高于债券型和货币市场基金，低于股票型基金，属证券投资基金中的中高风险品种。

### 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	中国银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	段皓静
	联系电话	0755-83183388
	电子邮箱	office@dcfund.com.cn
客户服务电话	4008885558	95566
传真	0755-83199588	010-66594942
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	北京市西城区复兴门内大街 1 号
办公地址	广东省深圳市南山区海德三道	北京市西城区复兴门内大街 1 号

	1236 号大成基金总部大厦 5 层、 27-33 层	
邮政编码	518054	100818
法定代表人	吴庆斌	刘连舸

## 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》
登载基金中期报告正文的管理人互联网网址	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	-22,597,954.27
本期利润	-23,396,739.91
加权平均基金份额本期利润	-0.0814
本期加权平均净值利润率	-6.27%
本期基金份额净值增长率	-4.74%
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	52,676,915.56
期末可供分配基金份额利润	0.2847
期末基金资产净值	237,720,382.56
期末基金份额净值	1.285
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	28.50%

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。

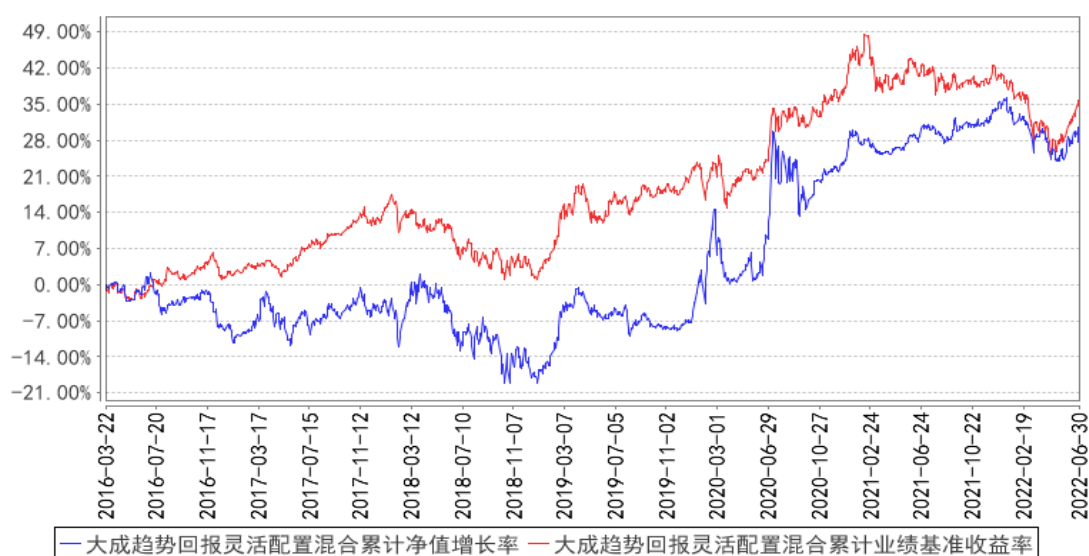
## 3.2 基金净值表现

### 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
过去一个月	2.07%	0.75%	4.74%	0.53%	-2.67%	0.22%
过去三个月	-0.39%	0.61%	3.76%	0.71%	-4.15%	-0.10%
过去六个月	-4.74%	0.57%	-3.56%	0.72%	-1.18%	-0.15%
过去一年	-1.91%	0.47%	-4.67%	0.62%	2.76%	-0.15%
过去三年	36.27%	0.85%	16.95%	0.63%	19.32%	0.22%
自基金合同生效起至今	28.50%	0.88%	35.81%	0.59%	-7.31%	0.29%

### 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

大成趋势回报灵活配置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		
黄万青	本基金基金经理	2020 年 4 月 30 日	-	26 年	中国人民大学经济学硕士。曾任职于大鹏证券有限责任公司。1999 年 5 月加入大成基金管理有限公司，曾担任研究部研究员、固定收益部高级研究员。2010 年 4 月 7 日至 2013 年 3 月 7 日任景宏证券投资基金基金经理。2011 年 7 月 13 日至 2013 年 3 月 7 日任大成行业轮动股票型证券投资基金基金经理。2011 年 3 月 8 日至 2011 年 6 月 5 日任大成积极成长股票型证券投资基金基金经理。2011 年 3 月 8 日至 2011 年 6 月 5 日任大成策略回报股票型证券投资基金基金经理。2015 年 4 月 28 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。2015 年 11 月 30 日至 2017 年 3 月 18 日任大成景辉灵活配置混合型证券投资基金基金经理。2016 年 5 月 25 日至 2020 年 12 月 4 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。2016 年 8 月 6 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。2016年9月20日至2018年10月20日任大成景穗灵活配置混合型证券投资基金基金经理。2016年9月29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1月25日起任大成景润灵活配置混合型证券投资基金基金经理。2017年3月18日至2018年11月9日任大成景鹏灵活配置混合型证券投资基金基金经理。2019年6月21日至2020年5月21日任大成景益平稳收益混合型证券投资基金基金经理。2019年6月21日起任大成景禄灵活配置混合型证券投资基金基金经理。2019年7月18日至2020年9月18日任大成惠福纯债债券型证券投资基金基金经理。2020年4月30日起任大成趋势回报灵活配置混合型证券投资基金基金经理。2020年12月4日起任大成动态量化配置策略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
李富强	本基金基金经理	2020年10月29日	-	8年	北京大学经济学硕士。2009年7月至2013年12月任中国银行间市场交易商协会市场创新部高级助理。2014年1月至2017年7月任北信瑞丰基金管理有限公司固定收益部基金经理。2017年7月加入大成基金管理有限公司，任职于固定收益总部。2018年7月16日至2019年3月9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。2018年7月16日至2019年3月2日任大成景利混合型证券投资基金基金经理。2018年7月16日至2020年3月11日任大成景益平稳收益混合型证券投资基金基金经理。2018年7月16日至2019年9月29日任大成景丰债券型证券投资基金（LOF）基金经理。2018年7月16日至2020年8月12日任大成安汇金融债债券型证券投资基金（转型前大成月月盈短期理财债券型证券投资基金）。2018年7月16日起任大成可转债增强债券型证券投资基金基金经理。2018年7月16日至2020年12月18日任大成景盛一年定期开放债券型证券投资基金基金经理。2018年11月16日起任大成景禄灵活配置混合型证券投资基金基金经理。2019年6月12日

					起任大成景润灵活配置混合型证券投资基金基金经理。2019 年 9 月 26 日至 2020 年 11 月 3 日任大成中债 1-3 年国开行债券指数证券投资基金基金经理。2019 年 11 月 25 日起任大成通嘉三年定期开放债券型证券投资基金基金经理。2019 年 12 月 9 日起任大成惠嘉一年定期开放债券型证券投资基金基金经理。2020 年 6 月 22 日起任大成惠兴一年定期开放债券型发起式证券投资基金基金经理。2020 年 10 月 29 日起任大成趋势回报灵活配置混合型证券投资基金基金经理。2020 年 12 月 2 日至 2021 年 12 月 7 日任大成景荣债券型证券投资基金基金经理。2020 年 12 月 18 日起任大成动态量化配置策略混合型证券投资基金基金经理。2021 年 4 月 8 日至 2022 年 5 月 23 日任大成惠恒一年定期开放债券型发起式证券投资基金基金经理。2021 年 4 月 13 日至 2022 年 5 月 23 日任大成惠泽一年定期开放债券型发起式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

股票市场方面，疫情反复是影响 2022 年上半年 A 股市场的主要因素。今年 3、4 月份由于上海和北京疫情加重，经济复苏受阻，A 股出现大幅的下跌，4 月底，国内稳增长政策全面刺激，上海、北京的疫情也得到有效控制，复工复产全面展开，市场信心开始恢复，外资也大举买入。到 6 月底，市场基本反弹到 3 月份下跌前的水平，电力设备、汽车、有色、军工是这轮反弹的主力。上半年，上证指数跌 6.63%，沪深 300 指数跌 9.22%，创业板跌 15.41%，科创 50 跌 20.92%，成长受到较大的压制。从行业上看，煤炭是唯一上涨的板块，半年涨 31.38%，电子、计算机、传媒、军工跌幅居前，都在 20% 以上的跌幅。操作上，本基金上半年仓位较高，重点配置的 TMT 行业在上半年总体落后，净值不尽人意。

债券市场方面，2022 年上半年债市处于窄幅区间波动。一月初在宽货币预期的推动下，债市收益率下探新低。2 月公布的一月社融数据增速大超预期，债市收益率开始反弹。进入 3 月由于新型冠状病毒的快速传播部分城市开始封城，市场对经济增长压力的担忧重新回归，债券情绪重归看多。四月和五月先后受到上海、北京等地疫情影响，经济增长压力增大，央行极力保持流动性宽松，银行间 DR001 加权长期保持低位。与此同时，中央和各地稳增长保就业的各项政策先后出台，经济未来改善的预期也有所增强。虽然上半年美国加息的情绪较为浓厚，但国内债市仍“以我为主”的思路在运行，收到外部环境影响较小。2022 年二季度受资金面宽松影响，债市短端收益率下行幅度较大，中长端收益率窄幅波动。具体来看，二季度末相较去年末末，1 年期国开债下行 30bp，3 年期上行 3bp，5 年期上行 1bp，7 年期上行 11bp，10 年期下行 3bp。2022 年上半年，本基金严控信用风险，根据市场机会灵活调整基金组合久期，进行波动操作为主，增强组合收益。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末本基金份额净值为 1.285 元；本报告期基金份额净值增长率为-4.74%，业绩比较基准收益率为-3.56%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

股票市场方面，展望 2022 年下半年，市场总体是震荡格局，指数波动会加大，指数趋势上涨的空间受到国内外经济增长不确定的制约，但下行风险不会出现今年 3、4 月份那种恐慌。从宏观层面来看，国内稳增长政策对 A 股相对有利，国内基本面是弱复苏+温和通胀+流动性宽裕的组合，外部环境则是美债利率见顶回落+大宗商品价格下跌，这对股票市场有支撑，但股票市场经过 4 月 27 日以来的反弹，估值已经有一定幅度的提升，如果要进一步反弹，需要看到业绩持续的改善。操作上，我们控制好仓位，行业配置相对看好调整后的新能源赛道以及确定性相对较高的食品饮料、医药板块。

债券市场方面，展望 2022 年下半年，受疫情边际缓解以及前期稳增长相关政策的左右影响，下半年经济增速将有所修复，但房地产行业特别是民企房地产商在“保交房”压力仍大，与房地产相关的上游供应商以及购房者也会受到较大影响，房地产投资增速很难反弹，对经济形成较为明显的拖累，下半年经济增长仍有隐忧。货币政策保持宽松的格局很难发生大幅改变，债市的市场环境仍较为友好，下半年债市区间震荡的概率加大，高杠杆并结合市场情况进行波段操作应为较好的策略。

#### 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

本报告期内，中国银行股份有限公司（以下称“本托管人”）在大成趋势回报灵活配置混合型证券投资基金（以下称“本基金”）的托管过程中，严格遵守《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有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了应尽的义务。

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

本报告期内，本托管人根据《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，对本基金管理人的投资运作进行了必要的监督，对基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算以及基金费用开支等方面进行了认真地复核，未发现本基金管理人存在损害基金份额持有人利益的行为。

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

本报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告（注：财务会计报告中的“金

融工具风险及管理”、“关联方承销证券”、“关联方证券出借”部分未在托管人复核范围内)、投资组合报告等数据真实、准确和完整。

## § 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：大成趋势回报灵活配置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
<b>资产：</b>			
银行存款	6.4.7.1	852,274.07	1,777,944.07
结算备付金		2,679,993.59	1,420,765.02
存出保证金		952,965.90	152,496.17
交易性金融资产	6.4.7.2	248,834,304.23	409,919,105.30
其中：股票投资		59,907,000.10	128,603,122.85
基金投资		-	-
债券投资		188,927,304.13	281,315,982.45
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	-	43,700,000.00
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		17,369,033.02	8,056,854.63
应收股利		-	-
应收申购款		1,527.44	459.08
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.8	-	5,712,230.68
资产总计		270,690,098.25	470,739,854.95
<b>负债和净资产</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2022 年 6 月 30 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	6.4.7.3	-	-

卖出回购金融资产款		32,064,423.67	-
应付清算款		-	6,233,183.54
应付赎回款		396.72	23.63
应付管理人报酬		143,322.14	225,288.85
应付托管费		35,830.53	56,322.19
应付销售服务费		-	-
应付投资顾问费		-	-
应交税费		8,164.10	25,215.98
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.9	717,578.53	622,115.67
负债合计		32,969,715.69	7,162,149.86
<b>净资产：</b>			
实收基金	6.4.7.10	185,043,467.00	343,518,813.47
其他综合收益	6.4.7.11	-	-
未分配利润	6.4.7.12	52,676,915.56	120,058,891.62
净资产合计		237,720,382.56	463,577,705.09
负债和净资产总计		270,690,098.25	470,739,854.95

注：报告截止日 2022 年 06 月 30 日，基金份额净值 1.285 元，基金份额总额 185,043,467.00 份。

## 6.2 利润表

会计主体：大成趋势回报灵活配置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
<b>一、营业总收入</b>		-21,790,867.78	33,916,181.69
1. 利息收入		329,065.12	10,622,743.59
其中：存款利息收入	6.4.7.13	40,694.02	37,559.18
债券利息收入		-	10,360,814.49
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		288,371.10	224,369.92
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		-21,629,212.71	32,892,267.86
其中：股票投资收益	6.4.7.14	-25,050,205.65	31,636,745.42
基金投资收益		-	-

债券投资收益	6.4.7.15	3,161,620.15	-96,851.20
资产支持证券投资收益	6.4.7.16	-	-
贵金属投资收益	6.4.7.17	-	-
衍生工具收益	6.4.7.18	-336,872.21	-
股利收益	6.4.7.19	596,245.00	1,352,373.64
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	-798,785.64	-9,700,883.80
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	308,065.45	102,054.04
<b>减：二、营业总支出</b>		1,605,872.13	4,279,615.70
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	1,116,909.63	2,107,803.87
2. 托管费	6.4.10.2.2	279,227.42	526,950.97
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	-	-
4. 投资顾问费		-	-
5. 利息支出		74,145.65	119,053.26
其中：卖出回购金融资产支出		74,145.65	119,053.26
6. 信用减值损失	6.4.7.22	-	-
7. 税金及附加		11,463.00	29,987.62
8. 其他费用	6.4.7.23	124,126.43	1,495,819.98
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		-23,396,739.91	29,636,565.99
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		-23,396,739.91	29,636,565.99
<b>五、其他综合收益的税后净额</b>		-	-
<b>六、综合收益总额</b>		-23,396,739.91	29,636,565.99

### 6.3 净资产（基金净值）变动表

会计主体：大成趋势回报灵活配置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	343,518,813.47	-	120,058,891.62	463,577,705.09



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、本期末期初净资产(基金净值)	343,518,813.47	-	120,058,891.62	463,577,705.09
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	-158,475,346.47	-	-67,381,976.06	-225,857,322.53
(一)、综合收益总额	-	-	-23,396,739.91	-23,396,739.91
(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)	-158,475,346.47	-	-43,985,236.15	-202,460,582.62
其中:1.基金申购款	39,602,580.23	-	11,372,501.25	50,975,081.48
2.基金赎回款	-198,077,926.70	-	-55,357,737.40	-253,435,664.10
(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)	185,043,467.00	-	52,676,915.56	237,720,382.56
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)	578,790,182.67	-	147,511,380.29	726,301,562.96
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)	578,790,182.67	-	147,511,380.29	726,301,562.96
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	-5,033,540.06	-	30,436,937.34	25,403,397.28
(一)、综合收益总额	-	-	29,636,565.99	29,636,565.99
(二)、	-5,033,540.06	-	800,371.35	-4,233,168.71

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）				
其中：1. 基金申购款	59,698,500.28	-	17,988,259.10	77,686,759.38
2. 基金赎回款	-64,732,040.34	-	-17,187,887.75	-81,919,928.09
（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、本期末净资产（基金净值）	573,756,642.61	-	177,948,317.63	751,704,960.24

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：

谭晓冈

范瑛

孙蕊

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

大成趋势回报灵活配置混合型证券投资基金（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”）证监许可[2015]3006 号文“关于准予大成趋势回报灵活配置混合型证券投资基金注册的批复”的核准，由大成基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《大成趋势回报灵活配置混合型证券投资基金基金合同》作为发起人向社会公开募集，募集期结束经安永华明会计师事务所验证并出具安永华明(2016)验字第 60469430\_H02 号验资报告后，向中国证监会报送基金备案材料。基金合同于 2016 年 3 月 22 日生效。本基金为契约型开放式，存续期限不定。本基金募集期间为 2016 年 2 月 29 日至 2016 年 3 月 18 日，首次发售募集的有效认购资金扣除认购费后的净认购金额为人民币 334,498,286.64 元，折合 334,498,286.64 份基金份额；有效认购资金在首次发售募集期内产生的利息为人民币 97,436.00 元，折合 97,436.00 份基金份额；以上收到的资金共计人民币 334,595,722.64 元，折合 334,595,722.64 份基金份额。本基金的基金管理人为大成基金管理有限公司，注册登记机构为本基金管理人，基金托管人为中国银行股份有限公司（以下简称“中国银行”）。本基金的投资对象是具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的股票（包括主板、中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票）、债券等固定收益类投资工具（包括国债、央行票据、金融债、企业债、公司债、次级债、地方政府债券、中期票据、可转换债券（含分离交易可转债）、中小企业私募债、短期融资券、资产支持证券、债券回购、货币市场工具等）、股指期货、国债期货、权证、银行存款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。本基金的投资组合比例为：股票等权益类资产占基金资产的比例为 0-95%；在任何交易日日终持有的融资买入股票与其他有价证券市值之和，不得超过基金资产净值的 95%；债券、货币市场工具、银行存款等固定收益类资产占基金资产比例不低于 5%；每个交易日日终在扣除股指期货和国债期货合约需缴纳的交易保证金后，现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%。本基金的业绩比较基准为沪深 300 指数收益率 x50%+中证综合债券指数收益率 x50%。

### 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》、《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

除下文中涉及的变更外，本基金本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。

##### 6.4.4.1 金融资产和金融负债的分类

###### 新金融工具准则

金融工具，是指形成一方的金融资产并形成其他方的金融负债或权益工具的合同。当本基金成为金融工具合同的一方时，确认相关的金融资产或金融负债。

###### (1) 金融资产

金融资产于初始确认时分类为：以摊余成本计量的金融资产、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公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。金融资产的分类取决于本基金管理金融资产的商业模式和金融资产的合同现金流量特征。本基金现无金融资产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。

###### 债务工具

本基金持有的债务工具是指从发行方角度分析符合金融负债定义的工具，分别采用以下两种方式进行计量：

###### 以摊余成本计量：

本基金管理以摊余成本计量的金融资产的商业模式为以收取合同现金流量为目标，且以摊余成本计量的金融资产的合同现金流量特征与基本借贷安排相一致，即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。本基金持有的以摊余成本计量的金融资产主要为银行存款、买入返售金融资产和其他各类应收款项等。

以公允价值计量且其变动计入当期损益：

本基金将持有的未划分为以摊余成本计量的债务工具，以公允价值计量且其变动计入当期损益。本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产主要为债券投资和基金投资，在资产负债表中以交易性金融资产列示。

#### 权益工具

权益工具是指从发行方角度分析符合权益定义的工具。本基金将对其没有控制、共同控制和重大影响的权益工具(主要为股票投资)按照公允价值计量且其变动计入当期损益，在资产负债表中列示为交易性金融资产。

#### (2) 金融负债

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

#### (3) 衍生金融工具

本基金将持有的衍生金融工具以公允价值计量且其变动计入当期损益，在资产负债表中列示为衍生金融资产/负债。

原金融工具准则(截至 2021 年 12 月 31 日前适用的原金融工具准则) 本基金于 2022 年 1 月 1 日起执行新金融工具准则，但选择不重述比较信息。因此，比较信息继续适用本基金以前年度的如下会计政策。

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

本基金目前以交易目的持有的股票投资、基金投资、债券投资和衍生工具分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。除衍生工具所产生的金融资产在资产负债表中以衍生金融资产列示外，以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在资产负债表中以交易性金融资产列示。

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

(2) 金融负债的分类 金融负债于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益

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

#### 6.4.4.2. 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

新金融工具准则 金融资产或金融负债在初始确认时以公允价值计量。对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和金融负债，相关交易费用计入当期损益；对于支付的价款中包含的债券起息日或上次除息日至购买日止的利息，确认为应计利息，包含在交易性金融资产的账面价值中。对于其他类别的金融资产和金融负债，相关交易费用计入初始确认金额。

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

本基金对于以摊余成本计量的金融资产，以预期信用损失为基础确认损失准备。

本基金考虑有关过去事项、当前状况以及对未来经济状况的预测等合理且有依据的信息，以发生违约的风险为权重，计算合同应收的现金流量与预期能收到的现金流量之间差额的现值的概率加权金额，确认预期信用损失。

于每个资产负债表日，本基金对于处于不同阶段的金融工具的预期信用损失分别进行计量。金融工具自初始确认后信用风险未显著增加的，处于第一阶段，本基金按照未来 12 个月内的预期信用损失计量损失准备；金融工具自初始确认后信用风险已显著增加但尚未发生信用减值的，处于第二阶段，本基金按照该工具整个存续期的预期信用损失计量损失准备；金融工具自初始确认后已经发生信用减值的，处于第三阶段，本基金按照该工具整个存续期的预期信用损失计量损失准备。

对于在资产负债表日具有较低信用风险的金融工具，本基金假设其信用风险自初始确认后并未显著增加，认定为处于第一阶段的金融工具，按照未来 12 个月内的预期信用损失计量损失准备。

本基金对于处于第一阶段和第二阶段的金融工具，按照其未扣除减值准备的账面余额和实际利率计算利息收入。对于处于第三阶段的金融工具，按照其账面余额减已计提减值准备后的摊余成本和实际利率计算利息收入。

对于其他各类应收款项，无论是否存在重大融资成分，本基金均按照整个存续期的预期信用损失计量损失准备。

本基金将计提或转回的损失准备计入当期损益。

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

险和报酬，但是放弃了对该金融资产控制。

金融资产终止确认时，其账面价值与收到的对价的差额，计入当期损益。

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

原金融工具准则(截至 2021 年 12 月 31 日前适用的原金融工具准则) 本基金于 2022 年 1 月 1 日起执行新金融工具准则，但选择不重述比较信息。因此，比较信息继续适用本基金以前年度的如下会计政策。

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

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

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

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

#### 6.4.4.3 收入/(损失)的确认和计量 新金融工具准则

股票投资在持有期间应取得的现金股利扣除由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额确认为投资收益。债券投资在持有期间应取得的按票面利率(对于贴现债为按发行价计算的利率)或合同利率计算的利息扣除在适用情况下由债券发行企业代扣代缴的个人所得税及由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为投资收益。基金投资在持有期间应取得的红利于除权日确认为投资收益。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在持有期间的公允价值变动确认为公允价值变动损益；于处置时，其处置价格与初始确认金额之间的差额扣除相关交易费用及在适用情况下由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为投资收益，其中包括从公允价值变动损益结转的公允价值累计变动额。

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



按直线法计算。

原金融工具准则(截至 2021 年 12 月 31 日前适用的原金融工具准则) 本基金于 2022 年 1 月 1 日起执行新金融工具准则, 但选择不重述比较信息。因此, 比较信息继续适用本基金以前年度的如下会计政策。

股票投资在持有期间应取得的现金股利扣除股票交易所在地适用的预缴所得税后的净额确认为投资收益。债券投资在持有期间应取得的按票面利率或者发行价计算的利息扣除在适用情况下由债券发行企业代扣代缴的个人所得税及由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为利息收入。基金投资在持有期间应取得的红利于除权日确认为投资收益。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在持有期间的公允价值变动确认为公允价值变动损益; 于处置时, 其处置价格与初始确认金额之间的差额扣除在适用情况下由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为投资收益, 其中包括从公允价值变动损益结转的公允价值累计变动额。

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

## 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

款”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 1,777,944.07

重分类：转入自应收利息 203.12

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 1,778,147.19

##### 结算备付金

2021 年 12 月 31 日，按原金融工具准则列示的余额 1,420,765.02

重分类：转入自应收利息 639.30

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 1,421,404.32

##### 存出保证金

2021 年 12 月 31 日，按原金融工具准则列示的余额 152,496.17

重分类：转入自应收利息 68.60

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 152,564.77

##### 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 409,919,105.30

重分类：转入自应收利息 5,737,300.15

2022 年 1 月 1 日，按新金融工具准则列示的余额 415,656,405.45

##### 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 43,700,000.00

重分类：转入自应收利息 -25,980.49

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 43,674,019.51

##### 应收利息

2021 年 12 月 31 日，按原金融工具准则列示的余额 5,712,230.68

重分类：转出至银行存款 -203.12

重分类：转出至结算备付金 -639.30

重分类：转出至存出保证金 -68.60

重分类：转出至交易性金融资产 -5,737,300.15

重分类：转出至买入返售金融资产 25,980.49

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 459.08

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 459.08

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

#### 6.4.6 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。

股权分置改革过程中因非流通股股东向流通股股东支付对价而发生的股权转让，暂免征收印

花税。

## 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。

股权分置改革中非流通股股东通过对价方式向流通股股东支付的股份、现金等收入，暂免征收流通股股东应缴纳的企业所得税。

## 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。

股权分置改革中非流通股股东通过对价方式向流通股股东支付的股份、现金等收入，暂免征收流通股股东应缴纳的个人所得税。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	852,274.07
等于：本金	851,552.80
加：应计利息	721.27
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	852,274.07

##### 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	57,417,140.01	-	59,907,000.10	2,489,860.09
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	-
债券	58,783,170.40	963,852.61	59,509,053.61	-237,969.40
交易所市场				

	银行间市场	127,544,051.46	2,049,650.52	129,418,250.52	-175,451.46
	合计	186,327,221.86	3,013,503.13	188,927,304.13	-413,420.86
	资产支持证券	-	-	-	-
	基金	-	-	-	-
	其他	-	-	-	-
	合计	243,744,361.87	3,013,503.13	248,834,304.23	2,076,439.23

#### 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

单位：人民币元

项目	本期末 2022年6月30日			
	合同/名义 金额	公允价值		备注
		资产	负债	
利率衍生工具	-43,231,850.00	-	-	
其中：国债期货投资	-43,231,850.00	-	-	
货币衍生工具	-	-	-	
权益衍生工具	-	-	-	
其他衍生工具	-	-	-	
合计	-43,231,850.00	-	-	

注：衍生金融资产项下的利率衍生工具为国债期货投资，净额为 0。在当日无负债结算制度下，结算准备金已包括所持商品期货合约产生的持仓损益，则衍生金融资产项下的国债期货投资与相关的期货暂收款（结算所得的持仓损益）之间按抵销后的净额为 0。

##### 6.4.7.3.2 期末基金持有的期货合约情况

单位：人民币元

代码	名称	持仓量（买/卖）	合约市值	公允价值变动
T2209	T2209	-43.00	-42,995,700.00	236,150.00
合计				236,150.00
减：可抵销期货暂收款				236,150.00
净额				-

##### 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	0.15
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	609,099.43
其中：交易所市场	605,815.32
银行间市场	3,284.11
应付利息	-
预提费用	108,478.95
合计	717,578.53

## 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	343,518,813.47	343,518,813.47
本期申购	39,602,580.23	39,602,580.23
本期赎回（以“-”号填列）	-198,077,926.70	-198,077,926.70
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	185,043,467.00	185,043,467.00

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	122,620,662.64	-2,561,771.02	120,058,891.62
本期利润	-22,597,954.27	-798,785.64	-23,396,739.91
本期基金份额交易产生的变动数	-47,291,288.31	3,306,052.16	-43,985,236.15



其中：基金申购款	12,607,757.54	-1,235,256.29	11,372,501.25
基金赎回款	-59,899,045.85	4,541,308.45	-55,357,737.40
本期已分配利润	-	-	-
本期末	52,731,420.06	-54,504.50	52,676,915.56

#### 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	7,656.75
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	32,142.15
其他	895.12
合计	40,694.02

#### 6.4.7.14 股票投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年6月30日
卖出股票成交总额	535,133,750.62
减：卖出股票成本总额	558,622,234.10
减：交易费用	1,561,722.17
买卖股票差价收入	-25,050,205.65

#### 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	4,433,674.86
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	-1,272,054.71
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	3,161,620.15

##### 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	353,378,657.66
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成	347,079,890.86

本总额	
减：应计利息总额	7,567,578.12
减：交易费用	3,243.39
买卖债券差价收入	-1,272,054.71

#### 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

##### 6.4.7.18.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

无。

##### 6.4.7.18.2 衍生工具收益——其他投资收益

单位：人民币元

项目	本期收益金额 2022年1月1日至2022年6月30日
国债期货投资收益	-336,872.21

#### 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	596,245.00
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	596,245.00

#### 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	-1,034,935.64
股票投资	-1,579,145.40
债券投资	544,209.76
资产支持证券投资	-
基金投资	-
贵金属投资	-

其他	-
2. 衍生工具	236,150.00
权证投资	-
期货投资	236,150.00
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	-798,785.64

#### 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	302,825.72
基金转换费收入	5,239.73
合计	308,065.45

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

2. 本基金的转换费由申购补差费和转出基金的赎回费两部分构成，其中转出基金的不低于赎回费的 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	39,671.58
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
银行划款手续费	6,047.48
账户维护费	18,600.00
其他	300.00
合计	124,126.43

#### 6.4.7.24 分部报告

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

#### 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

本基金的基金管理人于 2022 年 8 月 18 日宣告 2022 年度第 1 次分红，向截至 2022 年 8 月 22 日止在本基金注册登记人大成基金管理有限公司登记在册的全体持有人，按每 10 份基金份额派发红利 1.90 元。

#### 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
中国银行股份有限公司（“中国银行”）	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
中银国际证券股份有限公司（“中银国际”）	基金托管人的关联子公司

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	15,165,615.70	1.48	21,089,269.38	2.40

###### 6.4.10.1.2 债券交易

无。

###### 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	13,822.47	1.48	-	-
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	19,219.91	2.40	-	-

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	1,116,909.63	2,107,803.87
其中：支付销售机构的客户维护费	64,641.03	15,180.33

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 1.50% 的年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 1.50\% / \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日基金资产净值

## 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	279,227.42	526,950.97

注：基金托管费每日计提，按月支付。基金托管人的基金托管费按前一日的基金资产净值的 0.25% 年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 0.25\% / \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金托管费

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自有资金投资本基金的情况

份额单位：份

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
基金合同生效日(2016年3月22日)持有的基金份额	-	-
报告期初持有的基金份额	9,331,939.48	9,331,939.48
报告期间申购/买入总份额	0.00	0.00
报告期间因拆分变动份额	-	0.00
减: 报告期间赎回/卖出总份额	0.00	0.00
报告期末持有的基金份额	9,331,939.48	9,331,939.48
报告期末持有的基金份额 占基金总份额比例	5.04%	1.63%

注：基金管理人大成基金投资本基金适用的交易费率与本基金法律文件规定一致。

#### 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
中国银行	852,274.07	7,656.75	1,606,395.94	7,420.55

注：本基金的银行存款由基金托管人中国银行保管，并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
中银国际	600938	中国海油	网下发行	120,005	1,296,054.00
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	期末成本总额	期末估值总额	备注

							位：股)			
301117	佳缘科技	2022年 1月7日	6个月	新股锁定	46.80	54.44	262	12,261.60	14,263.28	-
301148	嘉戎技术	2022年 4月14日	6个月	新股锁定	38.39	23.90	445	17,083.55	10,635.50	-
301150	中一科技	2022年 4月14日	6个月	新股锁定	163.56	82.76	164	17,828.04	13,572.64	-
301162	国能日新	2022年 4月19日	6个月	新股锁定	45.13	54.11	334	15,073.42	18,072.74	-
301163	宏德股份	2022年 4月11日	6个月	新股锁定	26.27	32.33	277	7,276.79	8,955.41	-
301196	唯科科技	2022年 1月4日	6个月	新股锁定	64.08	37.52	149	9,547.92	5,590.48	-
301200	大族数控	2022年 2月18日	6个月	新股锁定	76.56	51.92	252	19,293.12	13,083.84	-
301207	华兰疫苗	2022年 2月10日	6个月	新股锁定	56.88	56.42	239	13,594.32	13,484.38	-
301216	万凯新材	2022年 3月21日	6个月	新股锁定	35.68	29.84	514	18,339.52	15,337.76	-
301217	铜冠铜箔	2022年 1月20日	6个月	新股锁定	17.27	14.83	1,371	23,677.17	20,331.93	-
301219	腾远钴业	2022年 3月10日	6个月	新股锁定	173.98	87.82	130	12,526.56	11,416.60	-
301222	浙江恒威	2022年 3月2日	6个月	新股锁定	33.98	28.96	332	11,281.36	9,614.72	-
301228	实朴检测	2022年 1月21日	6个月	新股锁定	20.08	20.34	373	7,489.84	7,586.82	-
301248	杰创智能	2022年 4月13日	6个月	新股锁定	39.07	29.87	437	17,073.59	13,053.19	-
301258	富士	2022年	6个月	新股锁	48.30	41.68	280	13,524.00	11,670.40	-



	莱	3月21日		定							
301268	铭利达	2022年3月29日	6个月	新股锁定	28.50	34.87	440	12,540.00	15,342.80	-	
301279	金道科技	2022年4月6日	6个月	新股锁定	31.20	22.81	296	9,235.20	6,751.76	-	
301288	清研环境	2022年4月14日	6个月	新股锁定	19.09	19.98	452	8,628.68	9,030.96	-	
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	-	

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。本基金参与网下申购获得的新股，在新股上市之前及上市之后的约定期限(若有)内不得转让；本基金参与网上申购获得的新股，在新股上市之前不得转让。

#### 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

截至本报告期末，本基金从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额 32,064,423.67，是以如下债券作为抵押：

金额单位：人民币元

债券代码	债券名称	回购到期日	期末估值单价	数量（张）	期末估值总额
101754069	17 恒健	2022 年 7 月 1	104.60	52,000	5,439,453.59

	MTN002	日			
102101795	21 宝钢 MTN001(可 持续挂钩)	2022 年 7 月 1 日	102.77	180,000	18,499,125.70
102280425	22 华能 MTN002	2022 年 7 月 1 日	100.82	107,000	10,787,818.56
合计				339,000	34,726,397.85

#### 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。本基金的活期银行存款存放在本基金的托管行中国银行，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。

本基金债券投资的信用评级情况按《中国人民银行信用评级管理指导意见》设定的标准统计及汇总。

#### 6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2022年6月30日	上年度末 2021年12月31日
A-1	-	-
A-1 以下	-	-
未评级	28,552,404.84	7,325,196.90
合计	28,552,404.84	7,325,196.90

注：未评级债券为国债、短期融资券。

#### 6.4.13.2.2 按短期信用评级列示的同业存单投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2022年6月30日	上年度末 2021年12月31日
A-1	-	-
A-1 以下	-	-
未评级	49,343,796.05	29,220,000.00
合计	49,343,796.05	29,220,000.00

#### 6.4.13.2.3 按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2022年6月30日	上年度末 2021年12月31日
AAA	111,031,103.24	225,090,817.75
AAA 以下	-	-
未评级	-	19,679,967.80
合计	111,031,103.24	244,770,785.55

注：未评级债券为国债。

### 6.4.13.3 流动性风险

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

#### 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%，且本基金组合资产中 7 个工作日可变现资产未超过最近工作日确认的净赎回金额。

本基金主要投资于交易所及银行间市场内交易的证券，除在附注“期末本基金持有的流通受限证券”中列示的部分基金资产流通暂时受限制外（如有），其余均能及时变现。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券资产的公允价值。除附注“期末债券正回购交易中作为抵押的债券”中列示的卖出回购金融资产款余额（如有）将在 1 个月内到期且计息外，本基金于资产负债表日所持有的金融负债的合同约定剩余到期日均为一年以内且一般不计息，可赎回基金份额净值无固定到期日且不计息，因此账面余额一般即为未折现的合约到期现金流量。本报告期内，本基金未发生重大流动性风险事件。

### 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、存出保证金等。

#### 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	852,274.07	-	-	-	852,274.07
结算备付金	2,679,993.59	-	-	-	2,679,993.59
存出保证金	93,051.90	-	-	859,914.00	952,965.90
交易性金融资产	119,481,056.24	69,446,247.89	-	59,907,000.10	248,834,304.23
应收申购款	-	-	-	1,527.44	1,527.44
应收清算款	-	-	-	17,369,033.02	17,369,033.02
资产总计	123,106,375.80	69,446,247.89	-	78,137,474.56	270,690,098.25
负债					
应付赎回款	-	-	-	396.72	396.72
应付管理人报酬	-	-	-	143,322.14	143,322.14
应付托管费	-	-	-	35,830.53	35,830.53
卖出回购金融资产款	32,064,423.67	-	-	-	32,064,423.67
应交税费	-	-	-	8,164.10	8,164.10
其他负债	-	-	-	717,578.53	717,578.53
负债总计	32,064,423.67	-	-	905,292.02	32,969,715.69
利率敏感度缺口	91,041,952.13	69,446,247.89	-	77,232,182.54	237,720,382.56
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	1,777,944.07	-	-	-	1,777,944.07
结算备付金	1,420,765.02	-	-	-	1,420,765.02
存出保证金	152,496.17	-	-	-	152,496.17
交易性金融资产	200,139,564.70	80,291,000.00	885,417.75	128,603,122.85	409,919,105.30
买入返售金融资产	43,700,000.00	-	-	-	43,700,000.00
应收申购款	-	-	-	459.08	459.08
应收证券清算款	-	-	-	8,056,854.63	8,056,854.63
其他资产	-	-	-	5,712,230.68	5,712,230.68
资产总计	247,190,769.96	80,291,000.00	885,417.75	142,372,667.24	470,739,854.95
负债					

应付赎回款	-	-	-	23.63	23.63
应付管理人报酬	-	-	-	225,288.85	225,288.85
应付托管费	-	-	-	56,322.19	56,322.19
应付证券清算款	-	-	-	6,233,183.54	6,233,183.54
应交税费	-	-	-	25,215.98	25,215.98
其他负债	-	-	-	622,115.67	622,115.67
负债总计	-	-	-	7,162,149.86	7,162,149.86
利率敏感度缺口	247,190,769.96	80,291,000.00	885,417.75	135,210,517.38	463,577,705.09

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

#### 6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	除市场利率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	利率下降 25 个基点	467,602.55	207,742.89
	利率上升 25 个基点	-464,429.20	-207,314.60

#### 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均以人民币计价，因此无重大外汇风险。

#### 6.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险主要为市场价格风险，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其他价格风险，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。

本基金的投资范围为：股票等权益类资产占基金资产的比例为 0-95%；在任何交易日日终持有的融资买入股票与其他有价证券市值之和，不得超过基金资产净值的 95%；债券、货币市场工具、银行存款等固定收益类资产占基金资产比例不低于 5%；每个交易日日终在扣除股指期货和国债期货合约需缴纳的交易保证金后，现金或者到期日在一年以内的政府债券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	59,907,000.10	25.20	128,603,122.85	27.74
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	59,907,000.10	25.20	128,603,122.85	27.74

#### 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%	7,037,439.11	9,355,357.39
	业绩比较基准下降 5%	-7,037,439.11	-9,355,357.39

#### 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	58,356,901.45	127,441,242.75
第二层次	188,927,304.13	282,477,862.55
第三层次	1,550,098.65	-
合计	248,834,304.23	409,919,105.30

##### 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

于本期末，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产(上年度末：同)。

##### 6.4.14.4 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。

#### 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	59,907,000.10	22.13
	其中：股票	59,907,000.10	22.13
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	188,927,304.13	69.79
	其中：债券	188,927,304.13	69.79
	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	3,532,267.66	1.30
8	其他各项资产	18,323,526.36	6.77
9	合计	270,690,098.25	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	2,177,638.00	0.92
B	采矿业	1,332,303.44	0.56
C	制造业	45,088,332.13	18.97
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	2,244,510.00	0.94
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	2,592,781.21	1.09
J	金融业	4,409,976.00	1.86
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	2,043,237.00	0.86
M	科学研究和技术服务业	7,586.82	0.00
N	水利、环境和公共设施管理业	10,635.50	0.00
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	59,907,000.10	25.20

### 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	603260	合盛硅业	43,400	5,119,464.00	2.15

2	002466	天齐锂业	37,200	4,642,560.00	1.95
3	603501	韦尔股份	26,400	4,567,992.00	1.92
4	301155	海力风电	48,800	4,440,800.00	1.87
5	600030	中信证券	203,600	4,409,976.00	1.86
6	300750	宁德时代	7,800	4,165,200.00	1.75
7	300613	富瀚微	30,040	2,547,392.00	1.07
8	002245	蔚蓝锂芯	107,100	2,485,791.00	1.05
9	300569	天能重工	205,100	2,358,650.00	0.99
10	603986	兆易创新	15,900	2,261,139.00	0.95
11	002039	黔源电力	153,000	2,244,510.00	0.94
12	300999	金龙鱼	40,800	2,204,016.00	0.93
13	002714	牧原股份	39,400	2,177,638.00	0.92
14	300772	运达股份	85,500	2,175,120.00	0.91
15	603290	斯达半导	5,600	2,161,040.00	0.91
16	300320	海达股份	142,600	2,140,426.00	0.90
17	300058	蓝色光标	312,900	2,043,237.00	0.86
18	300432	富临精工	80,000	1,760,000.00	0.74
19	000876	新希望	114,100	1,745,730.00	0.73
20	600549	厦门钨业	64,200	1,388,004.00	0.58
21	600938	中国海油	84,004	1,332,303.44	0.56
22	300842	帝科股份	21,500	1,281,400.00	0.54
23	601089	福元医药	1,749	36,816.45	0.02
24	301217	铜冠铜箔	1,371	20,331.93	0.01
25	301162	国能日新	334	18,072.74	0.01
26	301268	铭利达	440	15,342.80	0.01
27	301216	万凯新材	514	15,337.76	0.01
28	301117	佳缘科技	262	14,263.28	0.01
29	301150	中一科技	164	13,572.64	0.01
30	301207	华兰疫苗	239	13,484.38	0.01
31	301200	大族数控	252	13,083.84	0.01
32	301248	杰创智能	437	13,053.19	0.01
33	301258	富士莱	280	11,670.40	0.00
34	301219	腾远钴业	130	11,416.60	0.00
35	301148	嘉戎技术	445	10,635.50	0.00
36	301222	浙江恒威	332	9,614.72	0.00
37	301288	清研环境	452	9,030.96	0.00
38	301163	宏德股份	277	8,955.41	0.00
39	301228	实朴检测	373	7,586.82	0.00
40	301279	金道科技	296	6,751.76	0.00
41	301196	唯科科技	149	5,590.48	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	603290	斯达半导	31,558,157.17	6.81
2	603501	韦尔股份	24,608,943.00	5.31
3	603986	兆易创新	24,298,426.00	5.24
4	300750	宁德时代	18,723,988.00	4.04
5	002475	立讯精密	18,001,587.07	3.88
6	300058	蓝色光标	17,017,489.63	3.67
7	600460	士兰微	15,340,871.79	3.31
8	603260	合盛硅业	14,506,428.00	3.13
9	600438	通威股份	13,907,438.70	3.00
10	300782	卓胜微	12,490,151.51	2.69
11	000807	云铝股份	12,065,691.02	2.60
12	600988	赤峰黄金	11,753,318.00	2.54
13	300390	天华超净	10,888,065.00	2.35
14	600801	华新水泥	10,405,583.00	2.24
15	601012	隆基绿能	10,275,048.96	2.22
16	300014	亿纬锂能	8,827,542.56	1.90
17	601169	北京银行	8,566,000.00	1.85
18	002155	湖南黄金	8,452,675.00	1.82
19	600340	华夏幸福	8,122,497.70	1.75
20	603668	天马科技	7,463,495.64	1.61

注：本项中“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	603290	斯达半导	29,119,969.76	6.28
2	002475	立讯精密	25,717,667.96	5.55
3	603501	韦尔股份	22,103,650.64	4.77
4	603986	兆易创新	21,359,119.12	4.61
5	300782	卓胜微	17,938,574.00	3.87
6	600460	士兰微	15,611,917.31	3.37
7	600438	通威股份	15,487,146.00	3.34
8	300750	宁德时代	15,408,349.00	3.32
9	300058	蓝色光标	15,087,463.83	3.25
10	600801	华新水泥	14,045,618.00	3.03
11	600905	三峡能源	13,900,427.00	3.00

12	600988	赤峰黄金	12,583,502.00	2.71
13	002714	牧原股份	11,543,595.34	2.49
14	601012	隆基绿能	11,243,842.34	2.43
15	000807	云铝股份	11,240,960.00	2.42
16	300390	天华超净	11,151,669.00	2.41
17	603260	合盛硅业	10,745,585.00	2.32
18	300014	亿纬锂能	9,312,178.00	2.01
19	601398	工商银行	9,310,000.00	2.01
20	000651	格力电器	8,713,423.00	1.88

注：本项中“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。

#### 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	491,505,256.75
卖出股票收入（成交）总额	535,133,750.62

注：本项中“买入股票的成本（成交）总额”及“卖出股票的收入（成交）总额”均按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

#### 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	18,432,525.39	7.75
2	央行票据	-	-
3	金融债券	20,651,396.72	8.69
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	30,782,975.34	12.95
5	企业短期融资券	10,119,879.45	4.26
6	中期票据	59,596,731.18	25.07
7	可转债（可交换债）	-	-
8	同业存单	49,343,796.05	20.76
9	其他	-	-
10	合计	188,927,304.13	79.47

注：本基金本报告期末未持有债券投资。

#### 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	112217028	22 光大银行 CD028	300,000	29,593,560.16	12.45
2	102280425	22 华能 MTN002	200,000	20,164,146.85	8.48

3	112210057	22 兴业银行 CD057	200,000	19,750,235.89	8.31
4	102101795	21 宝钢 MTN001(可持续 挂钩)	180,000	18,499,125.70	7.78
5	019664	21 国债 16	181,340	18,432,525.39	7.75

注：本基金本报告期末未持有债券投资。

#### 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

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

#### 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

本基金本报告期末未持有贵金属投资。

#### 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

本基金本报告期末未持有权证。

#### 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

为有效控制债券投资的系统性风险，本基金根据风险管理的原则，以套期保值为目的，适度运用国债期货进行投资，提高投资组合的运作效率。

在国债期货投资时，本基金将首先分析国债期货各合约价格与最便宜可交割券的关系，选择定价合理的国债期货合约，其次，考虑国债期货各合约的流动性情况，最终确定与现货组合的合适匹配，以达到风险管理的目标。

##### 7.11.2 本期国债期货投资评价

为有效控制债券投资的系统性风险，本基金根据风险管理的原则，以套期保值为目的，适度运用国债期货进行投资，提高投资组合的运作效率。本期本组合结合债市波动环境，伺机通过套保交易降低了由于债市波动造成的净值回撤，提高净值的稳定性。

#### 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

1、本基金投资的前十名证券之一 22 兴业银行 CD057（112210057.IB）的发行主体兴业银行股份有限公司于 2021 年 8 月 13 日因违反信用信息采集、提供、查询及相关管理规定，受到中国人民银行处罚（银罚字〔2021〕26 号），于 2022 年 3 月 21 日因漏报贸易融资业务 EAST 数据等，

受到中国银行保险监督管理委员会处罚（银保监罚决字（2022）22 号）。本基金认为，对兴业银行的处罚不会对其投资价值构成实质性负面影响。

2、本基金投资的前十名证券之一 22 光大银行 CD028（112217028.IB）的发行主体中国光大银行股份有限公司于 2022 年 3 月 21 日因逾期 90 天以上贷款余额 EAST 数据存在偏差等，受到中国银行保险监督管理委员会处罚（银保监罚决字（2022）18 号），于 2022 年 5 月 24 日因理财业务存在老产品规模在部分时点出现反弹等，受到中国银行保险监督管理委员会处罚（银保监罚决字（2022）31 号）。本基金认为，对光大银行的处罚不会对其投资价值构成实质性负面影响。

3、本基金投资的前十名证券之一 19 杭州银行债（1920045.IB）的发行主体杭州银行股份有限公司于 2022 年 5 月 23 日因未按规定履行客户身份识别义务，受到中国人民银行杭州中心支行处罚（杭银处罚字(2022)30 号）。本基金认为，对杭州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	952,965.90
2	应收清算款	17,369,033.02
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	1,527.44
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	18,323,526.36

#### 7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

无。

#### 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 (%)
754	245,415.74	178,513,076.33	96.47	6,530,390.67	3.53

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	161,414.51	0.0872

### 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 究部门负责人持有本开放式基金	0
本基金基金经理持有本开放式基金	0

## § 9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日 (2016 年 3 月 22 日) 基金份额总额	334,595,722.64
本报告期期初基金份额总额	343,518,813.47
本报告期基金总申购份额	39,602,580.23
减：本报告期基金总赎回份额	198,077,926.70
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	185,043,467.00

## § 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

无

### 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、托管人的托管业务部门及其相关高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

### 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 (%)	
长江证券	2	385,576,083.06	37.74	352,041.41	37.65	-
东莞证券	1	265,413,371.70	25.98	243,084.10	26.00	-
中金公司	2	171,840,991.74	16.82	157,226.63	16.82	-
中信证券	2	118,871,264.36	11.64	109,515.81	11.71	-
华泰证券	1	41,122,897.19	4.03	37,716.85	4.03	-



华福证券	1	17,595,241.50	1.72	16,032.88	1.71	-
光大证券	2	15,165,615.70	1.48	13,822.47	1.48	-
国海证券	1	6,055,197.78	0.59	5,578.30	0.60	-
安信证券	2	-	-	-	-	-
渤海证券	1	-	-	-	-	-
财信证券	1	-	-	-	-	-
长城证券	1	-	-	-	-	-
东方证券	1	-	-	-	-	-
东海证券	1	-	-	-	-	-
东吴证券	1	-	-	-	-	-
东兴证券	1	-	-	-	-	-
方正证券	1	-	-	-	-	-
广发证券	1	-	-	-	-	-
国都证券	1	-	-	-	-	-
国泰君安	1	-	-	-	-	-
国信证券	1	-	-	-	-	-
海通证券	2	-	-	-	-	-
恒泰证券	1	-	-	-	-	-
华宝证券	1	-	-	-	-	-
华林证券	1	-	-	-	-	-
华西证券	1	-	-	-	-	-
华鑫证券	1	-	-	-	-	-
江海证券	1	-	-	-	-	-
开源证券	1	-	-	-	-	-
民生证券	1	-	-	-	-	-
摩根大通	1	-	-	-	-	-
平安证券	1	-	-	-	-	-
申万宏源	1	-	-	-	-	-
太平洋证券	1	-	-	-	-	-
万联证券	1	-	-	-	-	-
西南证券	1	-	-	-	-	-
湘财证券	1	-	-	-	-	-
招商证券	3	-	-	-	-	-
中国银河证券	1	-	-	-	-	-
中金财富	2	-	-	-	-	-
中信建投证券	1	-	-	-	-	-
中信证券华南	1	-	-	-	-	-

注：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  
第 57 页 共 60 页

[2007]48 号) 的有关规定, 本公司制定了租用证券公司交易单元的选择标准和程序。租用证券公司交易单元的选择标准主要包括:

- (一) 财务状况良好, 最近一年无重大违规行为;
- (二) 经营行为规范, 内控制度健全, 能满足各投资组合运作的保密性要求;
- (三) 研究实力较强, 能提供包括研究报告、路演服务、协助进行上市公司调研等研究服务;
- (四) 具备各投资组合运作所需的高效、安全的通讯条件, 有足够的交易和清算能力, 满足各投资组合证券交易需要;
- (五) 能提供投资组合运作、管理所需的其他券商服务;
- (六) 相关基金合同、资产管理合同以及法律法规规定的其他条件。

租用证券公司交易单元的程序: 首先根据租用证券公司交易单元的选择标准形成《券商服务评价表》, 然后根据评分高低进行选择基金交易单元。

本报告期内新增交易单元: 无。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 (%)
长江证券	158,765,575.20	99.49	2,588,800,000.00	86.63	-	-
中金公司	807,504.32	0.51	-	-	-	-
中信证券	-	-	286,500,000.00	9.59	-	-
华福证券	-	-	112,900,000.00	3.78	-	-

### 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	大成趋势回报灵活配置混合型证券投资基金更新招募说明书	中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站	2022 年 04 月 22 日
4	大成趋势回报灵活配置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	2022 年 04 月 22 日

		公司网站	
5	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 04 月 16 日
6	大成趋势回报灵活配置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
7	大成基金管理有限公司关于旗下部分基金增加申万宏源西部证券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 03 月 25 日
8	大成基金管理有限公司关于旗下部分基金增加诺亚正行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 03 月 11 日
9	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
10	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
11	大成趋势回报灵活配置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 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

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过 20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比 (%)
机构	1	20220101-20220413	75,687,204.54	0.00	75,687,204.54	0.00	0.00
	2	20220101-20220630	83,332,500.00	0.00	40,000,000.00	43,332,500.00	23.42
	3	20220101-20220630	99,999,375.00	0.00	0.00	99,999,375.00	54.04
产品特有风险							
当基金份额持有人占比过于集中时，可能会因某单一基金份额持有人大额赎回而引发基金净值剧烈波动的风险，甚至有可能引起基金的流动性风险，基金管理人可能无法及时变现基金资产以应对基金份额持有人的赎回申请，基金份额持有人可能无法及时赎回持有的全部基金份额。							

## 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趋势回报灵活配置混合型证券投资基金的文件；
- 2、《大成趋势回报灵活配置混合型证券投资基金基金合同》；
- 3、《大成趋势回报灵活配置混合型证券投资基金托管协议》；
- 4、大成基金管理有限公司批准文件、营业执照、公司章程；
- 5、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