

大成核心价值甄选混合型证券投资基金 2024 年年度报告

2024 年 12 月 31 日

基金管理人：大成基金管理有限公司

基金托管人：中国工商银行股份有限公司

送出日期：2025 年 3 月 31 日

§ 1 重要提示及目录

1.1 重要提示

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

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2025 年 3 月 28 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

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

本报告期自 2024 年 01 月 01 日起至 12 月 31 日止。

1.2 目录

§ 1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
§ 2 基金简介	5
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人及基金托管人	5
2.4 信息披露方式	6
2.5 其他相关资料	6
§ 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况	6
3.1 主要会计数据和财务指标	6
3.2 基金净值表现	7
3.3 过去三年基金的利润分配情况	9
§ 4 管理人报告	10
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	12
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	12
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明	13
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	13
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	14
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	15
4.9 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明	15
§ 5 托管人报告	15
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	15
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	16
5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	16
§ 6 审计报告	16
§ 7 年度财务报表	18
7.1 资产负债表	18
7.2 利润表	19
7.3 净资产变动表	20
7.4 报表附注	22
§ 8 投资组合报告	53
8.1 期末基金资产组合情况	53
8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	54

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	55
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动	61
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	62
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	63
§ 9 基金份额持有人信息	64
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	64
9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	64
9.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况	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
§ 10 开放式基金份额变动	65
§ 11 重大事件揭示	65
11.1 基金份额持有人大会决议	65
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	66
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	66
11.4 基金投资策略的改变	66
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	66
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	66
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	66
11.8 其他重大事件	67
§ 12 影响投资者决策的其他重要信息	69
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	69
12.2 影响投资者决策的其他重要信息	69
§ 13 备查文件目录	69
13.1 备查文件目录	69
13.2 存放地点	69
13.3 查阅方式	69

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	大成核心价值甄选混合型证券投资基金	
基金简称	大成核心价值甄选混合	
基金主代码	010929	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2021 年 3 月 15 日	
基金管理人	大成基金管理有限公司	
基金托管人	中国工商银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	978,878,331.48 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	大成核心价值甄选混合 A	大成核心价值甄选混合 C
下属分级基金的交易代码	010929	010930
报告期末下属分级基金的份额总额	678,960,906.54 份	299,917,424.94 份

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金将以合理价格买入并持有具备核心竞争力、能够持续创造价值的优质企业股票，通过资产配置和个股甄选，在控制风险的前提下，力争为基金份额持有人创造长期稳健的投资回报。
投资策略	本基金的投资策略分为两方面：一方面体现在采取“自上而下”的方式对权益类、固定收益类等不同类别资产进行大类配置；另一方面体现在对单个投资品种的精选上。
业绩比较基准	沪深 300 指数收益率×60%+恒生指数收益率×20%+中债综合全价指数收益率×20%
风险收益特征	本基金是混合型证券投资基金，预期风险和预期收益高于债券型基金和货币市场基金、但低于股票型基金。本基金若投资港股通标的股票，则需承担港股通机制下因投资环境、投资标的、市场制度以及交易规则等差异带来的特有风险。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		大成基金管理有限公司	中国工商银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	段皓静	郭明
	联系电话	0755-83183388	010-66105799
	电子邮箱	office@dcfund.com.cn	custody@icbc.com.cn
客户服务电话		4008885558	95588
传真		0755-83199588	010-66105798
注册地址		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、	北京市西城区复兴门内大街 55 号

	27-33 层	
办公地址	广东省深圳市南山区海德三道 1236 号大成基金总部大厦 5 层、27-33 层	北京市西城区复兴门内大街 55 号
邮政编码	518054	100140
法定代表人	吴庆斌	廖林

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《证券时报》
登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	www.dcfund.com.cn
基金年度报告备置地点	基金管理人及基金托管人住所

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
会计师事务所	安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）	北京市东城区东长安街 1 号东方广场安永大楼 17 层 01-12 室
注册登记机构	大成基金管理有限公司	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、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	2024 年		2023 年		2022 年	
	大成核心价值甄选混合 A	大成核心价值甄选混合 C	大成核心价值甄选混合 A	大成核心价值甄选混合 C	大成核心价值甄选混合 A	大成核心价值甄选混合 C
本期已实现收益	-3,889,085.18	2,123,762.63	12,454,481.90	757,803.80	11,798,819.28	626,286.20
本期利润	121,282,005.41	43,412,239.80	33,215,183.08	1,083,403.78	-145,480,263.45	-15,822,850.65
加权平均基金份额本期利润	0.1662	0.1857	0.0447	0.0129	-0.1573	-0.1834
本期加权平均净值利润率	15.14%	17.19%	4.29%	1.25%	-15.82%	-18.55%
本期基金份额净值增长率	17.47%	16.80%	3.62%	3.00%	-13.09%	-13.61%
3.1.2 期末数据和指标	2024 年末		2023 年末		2022 年末	
期末可供分	62,680,554	20,559,499	13,335,499	134,506.02	-14,303,85	-2,219,826

配利润	. 82	. 01	. 54		8. 72	. 90
期末可供分 配基金份额 利润	0. 0923	0. 0686	0. 0190	0. 0020	-0. 0166	-0. 0272
期末基金资 产净值	812, 720, 69 8. 55	350, 985, 23 3. 53	714, 278, 84 2. 92	66, 558, 528 . 10	848, 644, 89 0. 22	79, 492, 518 . 08
期末基金份 额净值	1. 1970	1. 1703	1. 0190	1. 0020	0. 9834	0. 9728
3. 1. 3 累计 期末指标	2024 年末		2023 年末		2022 年末	
基金份额累 计净值增长 率	19. 70%	17. 03%	1. 90%	0. 20%	-1. 66%	-2. 72%

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

大成核心价值甄选混合 A

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	-0. 38%	0. 97%	-1. 62%	1. 20%	1. 24%	-0. 23%
过去六个月	8. 77%	0. 94%	11. 71%	1. 17%	-2. 94%	-0. 23%
过去一年	17. 47%	0. 82%	13. 96%	0. 98%	3. 51%	-0. 16%
过去三年	5. 79%	0. 89%	-12. 69%	0. 95%	18. 48%	-0. 06%
自基金合同生效 起至今	19. 70%	0. 85%	-17. 66%	0. 92%	37. 36%	-0. 07%

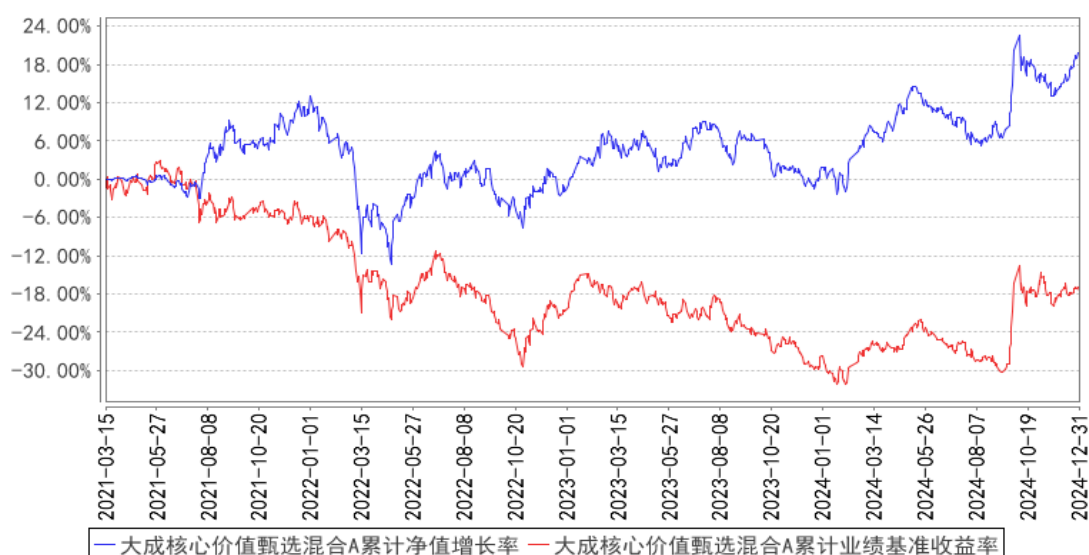
大成核心价值甄选混合 C

阶段	份额净值 增长率①	份额净值增 长率标准差	业绩比较 基准收益	业绩比较基 准收益率标	①－③	②－④
----	--------------	----------------	--------------	----------------	-----	-----

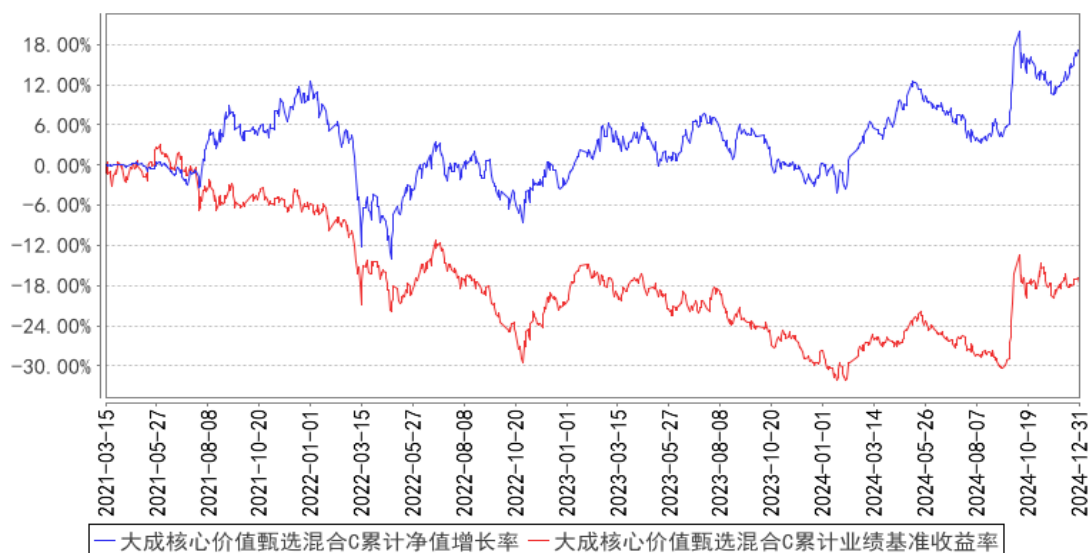
		②	率③	准差④		
过去三个月	-0.52%	0.97%	-1.62%	1.20%	1.10%	-0.23%
过去六个月	8.45%	0.94%	11.71%	1.17%	-3.26%	-0.23%
过去一年	16.80%	0.82%	13.96%	0.98%	2.84%	-0.16%
过去三年	3.93%	0.89%	-12.69%	0.95%	16.62%	-0.06%
自基金合同生效 起至今	17.03%	0.85%	-17.66%	0.92%	34.69%	-0.07%

3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

大成核心价值甄选混合A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



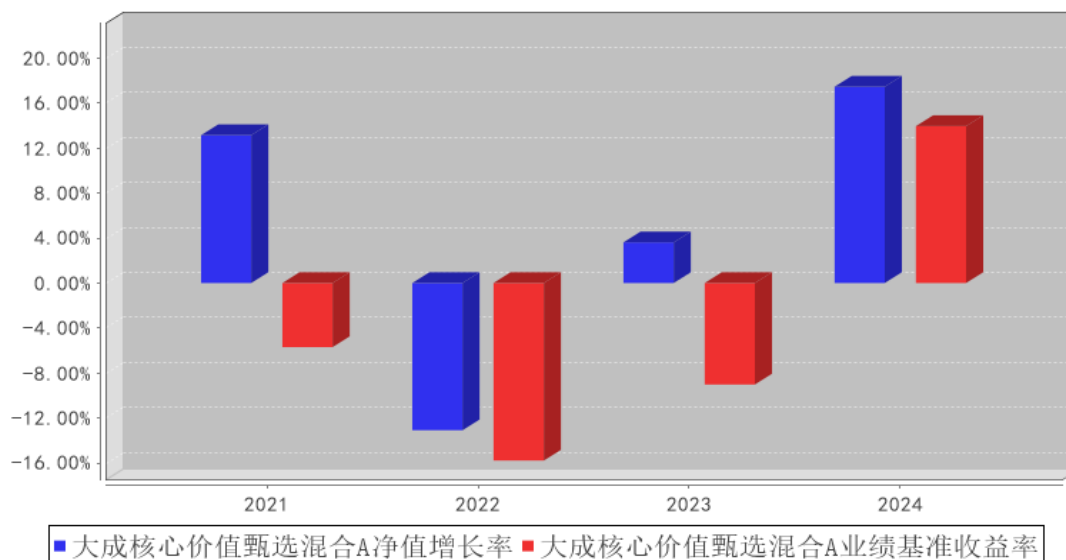
大成核心价值甄选混合C累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



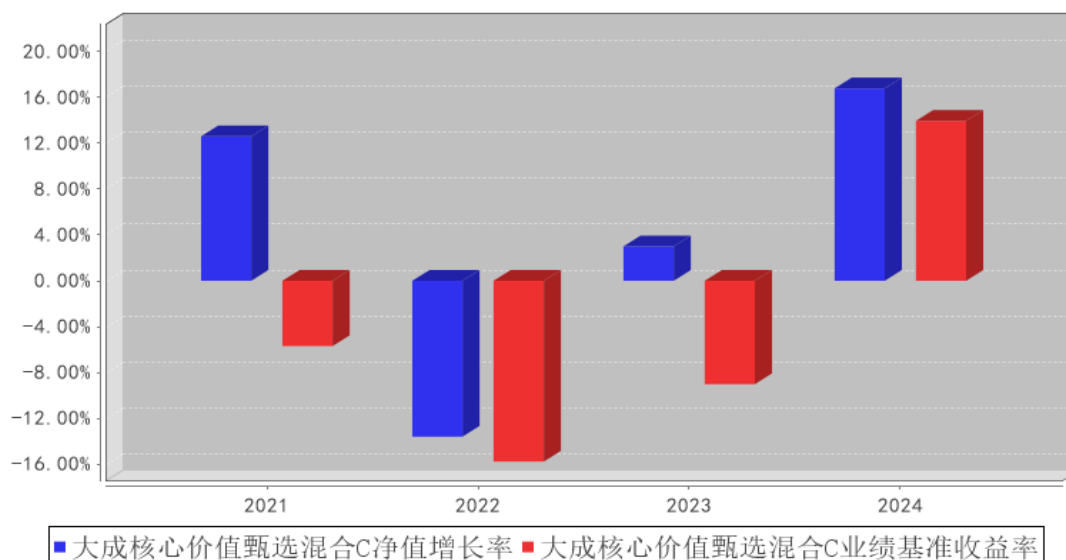
注：本基金合同规定，基金管理人应当自基金合同生效之日起六个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的约定。建仓期结束时，本基金的投资组合比例符合基金合同的约定。

3.2.3 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

大成核心价值甄选混合A基金每年净值增长率与同期业绩比较基准收益率的对比图



大成核心价值甄选混合C基金每年净值增长率与同期业绩比较基准收益率的对比图



注：合同生效当年按实际存续期计算，不按整个自然年度进行折算。

3.3 过去三年基金的利润分配情况

无。

§ 4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

大成基金管理有限公司成立于 1999 年 4 月 12 日，注册资本人民币 2 亿元，是中国首批获准成立的“老十家”基金管理公司之一。公司总部位于深圳，同时设置了北方、华东和南方营销总部，在北京、上海等地开设有 5 家分公司。2009 年，公司在香港设立大成国际资产管理有限公司，大力拓展国际业务；2013 年，设立大成创新资本管理有限公司，开拓专户及专项管理业务。

公司业务资质齐全，全面覆盖公募基金、机构投资、海外投资、财富管理、养老金管理等业务，还受全国社会保障基金理事会委托管理部分社保基金和基本养老保险基金。旗下大成国际资产管理公司具备 QFII、RQFII 等资格，是首批首家完成备案的能够提供港股通投资顾问服务的香港机构。

历经二十余年的磨砺和沉淀，大成基金形成了以长期投资能力为核心的竞争优势，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。公司目前已形成权益投资、固收投资、指数与期货投资、跨境投资、混合资产投资、大类资产配置六大投资团队，全面覆盖各类投资领域，综合实力不断提升，各项业务迅猛发展，管理资产种类位居同业前列。

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		
刘旭	本基金基金经理，股票投资部总监、董事总经理	2021 年 3 月 15 日	—	13 年	厦门大学管理学硕士。2009 年至 2010 年在毕马威华振会计师事务所任审计师。2011 年 2 月至 2013 年 5 月任广发证券研究所研究员。2013 年 5 月加入大成基金管理有限公司，曾担任研究部研究员、基金经理助理、股票投资部副总监，现任股票投资部总监、董事总经理。2015 年 7 月 29 日起任大成高新技术产业股票型证券投资基金基金经理。2016 年 8 月 20 日至 2021 年 3 月 17 日任大成创新成长混合型证券投资基金 (LOF) 基金经理。2019 年 12 月 24 日起任大成优势企业混合型证券投资基金基金经理。2020 年 6 月 5 日至 2024 年 7 月 3 日任大成睿裕六个月持有期股票型证券投资基金基金经理。2020 年 8 月 11 日起任大成睿鑫股票型证券投资基金基金经理。2021 年 3 月 15 日起任大成核心价值

					甄选混合型证券投资基金基金经理。2022 年 6 月 7 日起任大成匠心卓越三年持有期混合型证券投资基金基金经理。2023 年 1 月 18 日起任大成慧心优选一年持有期混合型证券投资基金基金经理。2023 年 12 月 1 日起任大成至信回报三年定期开放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
郑欣	本基金基金经理助理	2023 年 4 月 26 日	2024 年 11 月 29 日	8 年	CFA，厦门大学经济学硕士。2016 年 7 月至 2019 年 6 月任第一创业证券资产管理部研究员。2019 年 7 月加入大成基金管理有限公司，现任固定收益总部研究部研究主管兼基金经理。2021 年 11 月 26 日至 2024 年 12 月 31 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。2022 年 2 月 25 日起任大成惠享一年定期开放债券型发起式证券投资基金基金经理。2022 年 7 月 14 日起任大成景乐纯债债券型证券投资基金、大成景泰纯债债券型证券投资基金基金经理。2023 年 10 月 27 日起任大成景悦中短债债券型证券投资基金基金经理。2024 年 1 月 17 日起任大成惠福纯债债券型证券投资基金基金经理。具备基金从业资格。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中国证监会《证券基金经营机构董事、监事、高级管理人员及从业人员监督管理办法》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

姓名	产品类型	产品数量（只）	资产净值（元）	任职时间
刘旭	公募基金	7	20,564,964,907.79	2015 年 7 月 29 日
	私募资产管理计划	2	1,241,548,711.52	2024 年 6 月 28 日
	其他组合	5	18,154,085,127.84	2018 年 8 月 1 日
	合计	14	39,960,598,747.15	-

注：本报告期内，刘旭已于 2024 年 7 月 3 日离任其管理的 1 只公募基金。

4.1.4 基金经理薪酬机制

本基金基金经理的薪酬激励不与私募资产管理计划浮动管理费直接挂钩，会以产品业绩表现作为考核依据。基金经理薪酬激励以中长期业绩为依据，同时参考业绩基准完成情况，按 3 年递

延发放。

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

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

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度和控制方法

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

4.3.2 公平交易制度的执行情况

报告期内，公司严格执行了公平交易的原则和制度。公司运用统计分析方法和工具，对旗下所有投资组合连续 4 个季度的日内、3 日内、5 日内及 10 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，同时结合交易价差专项统计分析，未发现违反公平交易原则的异常情况。

4.3.2.1 增加执行的基金经理公平交易制度执行情况及公平交易管理情况

公司严格执行公平交易制度控制要求，确保不同投资组合在研究、交易、分配等各环节得到公平对待。报告期内，兼任基金经理管理的公私募组合间未发现违反公平交易原则的异常情况。

4.3.3 异常交易行为的专项说明

报告期内，公司旗下所有投资组合未发现存在异常交易行为。公司旗下所有投资组合参与的交易所公开竞价交易中，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的 5% 的交易共 3 次，为完全按照指数的构成比例进行投资的组合和其他组合发生的反向交易。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

感谢持有人又一年的陪伴。

2024 年沪深 300 涨幅 14.68%，中证 800 涨幅 12.20%，虽然资本市场年中经历了较大波动，但全年看仍然是个不错回报的年份。上市公司在 2024 年的业绩增长承受了较大压力，所以截止 24 年末，资本市场综合估值水平较年初有所提高，无论是红利属性还是科技属性标的。这既是对过去悲观预期的一些修复，也是对未来估值继续提升可能性的一定程度的透支。

本基金 A 份额在 2024 年的回报为 17.47%，跑赢业绩基准和沪深 300。业绩在年度之间会存在波动，但本基金管理人每年的基础性工作并无不同——不断积累对事物发展规律的认知，不断积累商业案例常识，以期能够提高对未来的预测能力。随着本基金规模的持续增长，上述能力的建立变得至关重要。在未来很多年里，本基金管理人都会持续努力去做好这一件事情。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末大成核心价值甄选混合 A 的基金份额净值为 1.1970 元，本报告期基金份额净值增长率为 17.47%，同期业绩比较基准收益率为 13.96%；截至本报告期末大成核心价值甄选混合 C 的基金份额净值为 1.1703 元，本报告期基金份额净值增长率为 16.80%，同期业绩比较基准收益率为 13.96%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

近年来，关于中国经济未来前景如何存在不同声音，我们对中国未来资本市场的机会持有乐观态度。改革开放以来四十年，中国传统经济体系已经形成了巨大的体量，构筑量的阶段已经基本结束。但随着新技术的涌现，和新一代企业家的逐步进入，巨大体量的传统经济里面有很大的提效空间，也有很多在发展量的阶段没有解决的痛点会在下一个阶段去完善。我们观察到一批 70 后 80 后年轻企业家已经在逐渐利用更先进的理念和更科学的工具去做实现这样的产业愿景，这将成为未来十年资本市场机会的涌现之地。另一方面，外部世界也在发生改变——二战之后建立的单极世界秩序在逐步演变，未来我们可能会面对一个更加多极化的世界。在这样一个世界中，相关中国优秀企业一定会扮演更加重要的角色。以上这些都是我们未来着重关注的机会，当然，也会仔细分辨机会中孕育的风险。

我们会继续兢兢业业如履薄冰，努力为持有人带来长期可持续回报，这是我们不变的初心。

4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

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

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

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

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

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

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

4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本基金管理人指导基金估值业务的领导小组为公司估值委员会，公司估值委员会主要负责估值政策和估值程序的制定、修订以及执行情况的监督。估值委员会由公司分管领导、各投研部门、

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。

各投研部门、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，并负责与托管人沟通估值调整事项；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，并与托管人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人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。

4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金管理人严格按照本基金基金合同的规定进行收益分配。本报告期内本基金无收益分配事项。

4.9 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

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

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

本报告期内，本基金的管理人——大成基金管理有限公司在本基金的投资运作、基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格计算、基金费用开支等问题上，托管人未发现损害基金份额持有人利益的行为。

5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见

本托管人依法对大成基金管理有限公司编制和披露的本基金 2024 年年度报告中财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容进行了核查，以上内容真实、准确和完整。

§ 6 审计报告

审计报告标题	审计报告
审计报告收件人	大成核心价值甄选混合型证券投资基金全体基金份额持有人
审计意见	我们审计了大成核心价值甄选混合型证券投资基金的财务报表，包括 2024 年 12 月 31 日的资产负债表，2024 年度的利润表、净资产变动表以及相关财务报表附注。 我们认为，后附的大成核心价值甄选混合型证券投资基金的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则的规定编制，公允反映了大成核心价值甄选混合型证券投资基金 2024 年 12 月 31 日的财务状况以及 2024 年度的经营成果和净资产变动情况。
形成审计意见的基础	我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。审计报告的“注册会计师对财务报表审计的责任”部分进一步阐述了我们在这些准则下的责任。按照中国注册会计师职业道德守则，我们独立于大成核心价值甄选混合型证券投资基金，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。
其他信息	大成核心价值甄选混合型证券投资基金管理层对其他信息负责。其他信息包括年度报告中涵盖的信息，但不包括财务报表和我们的审计报告。 我们对财务报表发表的审计意见不涵盖其他信息，我们也不对其他信息发表任何形式的鉴证结论。 结合我们对财务报表的审计，我们的责任是阅读其他信息，在此过程中，考虑其他信息是否与财务报表或我们在审计过程中了解到的情况存在重大不一致或者似乎存在重大错报。 基于我们已执行的工作，如果我们确定其他信息存在重大错报，我们应当报告该事实。在这方面，我们无任何事项需要报告。

管理层和治理层对财务报表的责任	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。 在编制财务报表时，管理层负责评估大成核心价值甄选混合型证券投资基金的持续经营能力，披露与持续经营相关的事项（如适用），并运用持续经营假设，除非计划进行清算、终止运营或别无其他现实的选择。 治理层负责监督大成核心价值甄选混合型证券投资基金的财务报告过程。
注册会计师对财务报表审计的责任	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。 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： （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。 （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。 （3）评价管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计及相关披露的合理性。 （4）对管理层使用持续经营假设的恰当性得出结论。同时，根据获取的审计证据，就可能导致对大成核心价值甄选混合型证券投资基金持续经营能力产生重大疑虑的事项或情况是否存在重大不确定性得出结论。如果我们得出结论认为存在重大不确定性，审计准则要求我们在审计报告中提请报表使用者注意财务报表中的相关披露；如果披露不充分，我们应当发表非无保留意见。我们的结论基于截至审计报告日可获得的信息。然而，未来的事项或情况可能导致大成核心价值甄选混合型证券投资基金不能持续经营。 （5）评价财务报表的总体列报（包括披露）、结构和内容，并评价财务报表是否公允反映相关交易和事项。 我们与治理层就计划的审计范围、时间安排和重大审计发现等事项进行沟通，包括沟通我们在审计中识别出的值得关注的内部控制缺陷。
会计师事务所的名称	安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）
注册会计师的姓名	高鹤 林恩丽
会计师事务所的地址	北京市东城区东长安街1号东方广场安永大楼17层01-12室

审计报告日期	2025 年 3 月 28 日
--------	-----------------

§ 7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体：大成核心价值甄选混合型证券投资基金

报告截止日：2024 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2024 年 12 月 31 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
资 产：			
货币资金	7.4.7.1	371,129,157.08	175,455,478.87
结算备付金		-	-
存出保证金		44,986.90	47,199.73
交易性金融资产	7.4.7.2	797,065,200.66	606,789,377.24
其中：股票投资		797,065,200.66	606,789,377.24
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		2,406,436.52	37,035.70
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.8	-	-
资产总计		1,170,645,781.16	782,329,091.54
负债和净资产	附注号	本期末 2024 年 12 月 31 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
负 债：			
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		127.85	2.41

应付赎回款		5,245,082.62	268,755.15
应付管理人报酬		1,099,013.11	783,850.34
应付托管费		183,168.89	130,641.74
应付销售服务费		133,274.61	33,276.05
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	279,182.00	275,194.83
负债合计		6,939,849.08	1,491,720.52
净资产：			
实收基金	7.4.7.10	978,878,331.48	767,367,365.46
未分配利润	7.4.7.12	184,827,600.60	13,470,005.56
净资产合计		1,163,705,932.08	780,837,371.02
负债和净资产总计		1,170,645,781.16	782,329,091.54

注：报告截止日 2024 年 12 月 31 日，基金份额总额 978,878,331.48 份，其中大成核心价值甄选混合 A 基金份额总额为 678,960,906.54 份，基金份额净值 1.1970 元。大成核心价值甄选混合 C 基金份额总额为 299,917,424.94 份，基金份额净值 1.1703 元。

7.2 利润表

会计主体：大成核心价值甄选混合型证券投资基金

本报告期：2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日
一、营业总收入		181,144,525.11	48,739,631.99
1. 利息收入		1,173,432.39	698,471.90
其中：存款利息收入	7.4.7.13	1,173,432.39	698,471.90
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		-	-
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		12,847,702.82	26,823,115.30
其中：股票投资收益	7.4.7.14	-17,783,086.96	5,366,575.37
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.15	-	-
资产支持证券投资	7.4.7.16	-	-
收益		-	-

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	30,630,789.78	21,456,539.93
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	166,459,567.76	21,086,301.16
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	663,822.14	131,743.63
减：二、营业总支出		16,450,279.90	14,441,045.13
1. 管理人报酬	7.4.10.2.1	12,619,919.42	11,743,827.27
其中：暂估管理人报酬		-	-
2. 托管费	7.4.10.2.2	2,103,319.89	1,957,304.63
3. 销售服务费	7.4.10.2.3	1,505,113.30	520,885.66
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		-	-
8. 其他费用	7.4.7.23	221,927.29	219,027.57
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		164,694,245.21	34,298,586.86
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		164,694,245.21	34,298,586.86
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		164,694,245.21	34,298,586.86

7.3 净资产变动表

会计主体：大成核心价值甄选混合型证券投资基金

本报告期：2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 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	767,367,365.46	-	13,470,005.56	780,837,371.02
二、本期期初净资产	767,367,365.46	-	13,470,005.56	780,837,371.02
三、本期增减变	211,510,966.02	-	171,357,595.04	382,868,561.06

动额(减少以“-”号填列)				
(一)、综合收益总额	-	-	164,694,245.21	164,694,245.21
(二)、本期基金份额交易产生的净资产变动数(净资产减少以“-”号填列)	211,510,966.02	-	6,663,349.83	218,174,315.85
其中：1. 基金申购款	971,158,563.08	-	94,434,424.68	1,065,592,987.76
2. 基金赎回款	-759,647,597.06	-	-87,771,074.85	-847,418,671.91
(三)、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动(净资产减少以“-”号填列)	-	-	-	-
四、本期期末净资产	978,878,331.48	-	184,827,600.60	1,163,705,932.08
项目	上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 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	944,661,093.92	-	-16,523,685.62	928,137,408.30
二、本期期初净资产	944,661,093.92	-	-16,523,685.62	928,137,408.30
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	-177,293,728.46	-	29,993,691.18	-147,300,037.28
(一)、综合收益总额	-	-	34,298,586.86	34,298,586.86
(二)、本期基金份额交易产生的净资产变动数(净资产减少以“-”号填列)	-177,293,728.46	-	-4,304,895.68	-181,598,624.14
其中：1. 基金申购款	169,995,271.37	-	10,789,012.03	180,784,283.40
2. 基金赎回款	-347,288,999.8	-	-15,093,907.71	-362,382,907.54

回款	3			
(三)、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动（净资产减少以“-”号填列）	-	-	-	-
四、本期期末净资产	767,367,365.46	-	13,470,005.56	780,837,371.02

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.4 财务报表由下列负责人签署：

<u>谭晓冈</u>	<u>范瑛</u>	<u>梁靖</u>
基金管理人负责人	主管会计工作负责人	会计机构负责人

7.4 报表附注

7.4.1 基金基本情况

大成核心价值甄选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[2020]2710 号文《关于准予大成核心价值甄选混合型证券投资基金注册的批复》注册，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《大成核心价值甄选混合型证券投资基金基金合同》作为发起人于 2021 年 2 月 26 日至 2021 年 3 月 11 日向社会公开募集，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（2021）验字第 60469430_H05 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 2021 年 3 月 15 日正式生效。本基金为契约型开放式，存续期限不定。本基金的基金管理人为大成基金管理有限公司，注册登记机构为大成基金管理有限公司，基金托管人为中国工商银行股份有限公司（简称“中国工商银行”）。

本基金的投资范围主要为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、创业板及其他中国证监会允许基金投资的股票）、存托凭证、内地与香港股票市场交易互联互通机制下允许投资的规定范围内的香港联合交易所上市的股票（简称“港股通标的股票”）、债券（包括国债、央行票据、金融债券、企业债券、公司债券、中期票据、短期融资券、超短期融资券、公开发行的次级债券、政府支持机构债、政府支持债券、地方政府债、可转换债券及其他中国证监会允许投资的债券）、资产支持证券、债券回购、同业存单、银行存款（包括协议存款、定期存款等）、货币市场工具、股指期货、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。本基金的投资组合比例为：本基金投资于股票、存托凭证的比例为基金资产的 60%-95%（港股通标的股票投资比例不超过本基金股票资产的 50%）；本基金每个交易日日终在扣除股指期货合约和国债期货合约需缴纳的交易保证金后，应当保持不低于基金资产净值 5% 的现金或到期日在一年以内的政府债券，其中，现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。如法律法规或监管机构变更投资品种的投资比例限制，基金管理人在履行适当程序后，可以调整上述投资品种的投资比例。

本基金的业绩比较基准为：沪深 300 指数收益率×60%+恒生指数收益率×20%+中债综合全价指数收益率×20%。

本财务报表由本基金的基金管理人大成基金管理有限公司于 2025 年 3 月 28 日批准报出。

7.4.2 会计报表的编制基础

本财务报表系按照财政部颁布的《企业会计准则——基本准则》以及其后颁布及修订的具体会计准则、解释以及《资产管理产品相关会计处理规定》和其他相关规定（统称“企业会计准则”）编制，同时，在信息披露和估值方面，也参考了中国证监会颁布的《中国证券监督管理委员会关于证券投资基金估值业务的指导意见》、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》、《证券投资基金信息披露内容与格式准则》第 2 号《年度报告的内容与格式》、《证券投资基金信息披露编报规则》第 3 号《会计报表附注的编制及披露》、《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号〈年度报告和中期报告〉》以及中国证监会和中国证券投资基金业协会颁布的其他相关规定。

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金 2024 年 12 月 31 日的财务状况以及 2024 年度的经营成果和净资产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

本基金会计年度为公历 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

7.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

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

（1）金融资产分类

本基金的金融资产于初始确认时根据管理金融资产的业务模式和金融资产的合同现金流量特征分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、以摊余成本计量的金融资产。

（2）金融负债分类

本基金的金融负债于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债、以摊余成本计量的金融负债。

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

本基金于成为金融工具合同的一方时确认一项金融资产或金融负债。

划分为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和金融负债，以及不作为有效套期工具的衍生工具，按照取得时的公允价值作为初始确认金额，相关的交易费用在发生时计入当期损益。

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

公允价值，是指市场参与者在计量日发生的有序交易中，出售一项资产所能收到或者转移一项负债所需支付的价格。本基金以公允价值计量相关资产或负债，假定出售资产或者转移负债的有序交易在相关资产或负债的主要市场进行；不存在主要市场的，本基金假定该交易在相关资产或负债的最有利市场进行。主要市场（或最有利市场）是本基金在计量日能够进入的交易市场。本基金采用市场参与者在对该资产或负债定价时为实现其经济利益最大化所使用的假设。

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

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

本基金持有的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按如下原则确定公允价值并进行估值：

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

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

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

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

(4) 如有新增事项，按国家最新规定估值。

7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

当本基金具有抵销已确认金融资产和金融负债的法定权利，且该种法定权利现在是可执行的，同时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时，金融资产和金融负债以相互抵销后的金额在资产负债表内列示。除此以外，金融资产和金融负债在资产负债表内分别列示，不予相互抵销。

7.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行的基金份额总额所对应的金额。由于申购和赎回引起的实收基金变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日确认。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

7.4.4.8 损益平准金

损益平准金包括已实现平准金和未实现平准金。已实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现损益占净资产比例计算的金额。未实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未实现损益占净资产比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日确认，并于期末全额转入未分配利润/(累计

亏损)。

7.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

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

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

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

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

7.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬和托管费等费用按照权责发生制原则, 在本基金接受相关服务的期间计入当期损益。

以摊余成本计量的金融负债在持有期间确认的利息支出按实际利率法计算, 实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

7.4.4.11 基金的收益分配政策

本基金同一类别的每一基金份额享有同等分配权。本基金收益以现金形式分配, 但基金份额持有人可选择现金红利或将现金红利按分红除权日的基金份额净值自动转为基金份额进行再投资。若期末未分配利润中的未实现部分为正数, 包括基金经营活动产生的未实现损益以及基金份额交易产生的未实现平准金等, 则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润中的已实现部分; 若期末未分配利润的未实现部分为负数, 则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润, 即已实现部分相抵未实现部分后的余额。基金收益分配后任一类基金份额净值不能低于面值, 即基金收益分配基准日的任一类基金份额净值减去该类每单位基金份额收益分配金额后不能低于面值。

经宣告的拟分配基金收益于分红除权日从净资产转出。

7.4.4.12 外币交易

外币交易按交易发生日的即期汇率将外币金额折算为人民币入账。

以公允价值计量的外币非货币性项目，于估值日采用估值日的即期汇率折算为人民币，所产生的折算差额直接计入公允价值变动损益科目。

7.4.4.13 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并披露分部信息。经营分部是指本基金内同时满足下列条件的组成部分：

(1) 该组成部分能够在日常活动中产生收入、发生费用。

(2) 本基金的基金管理人能够定期评价该组成部分的经营成果，以决定向其配置资源、评价其业绩。

(3) 本基金能够取得该组成部分的财务状况、经营成果和现金流量等有关会计信息。

如果两个或多个经营分部具有相似的经济特征，并且满足一定条件的，则合并为一个经营分部。本基金目前以一个单一的经营分部运作，不需要披露分部信息。

7.4.4.14 其他重要的会计政策和会计估计

无。

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

无。

7.4.5.2 会计估计变更的说明

无。

7.4.5.3 差错更正的说明

无。

7.4.6 税项

(1) 增值税及附加

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征增值税试点的通知》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]46号文《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》的规定，金融机构开展的质押式买入返售金融商品业务及持有政策性金融债券取得的利息收入属于金融同业往来利息收入。

根据财政部、国家税务总局财税[2016]70 号文《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》的规定，金融机构开展的买断式买入返售金融商品业务、同业存款、同业存单以及持有金融债券取得的利息收入属于金融同业往来利息收入。

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，本基金运营过程中发生的增值税应税行为，以本基金的基金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，证券投资基金的基金管理人运营证券投资基金过程中发生的增值税应税行为，暂适用简易计税方法，按照 3% 的征收率缴纳增值税。对证券投资基金在 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，已纳税额从证券投资基金的基金管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。增值税应税行为的销售额根据财政部、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》的规定确定。

增值税附加税包括城市维护建设税、教育费附加和地方教育附加，以实际缴纳的增值税税额为计税依据，分别按 7%、3% 和 2% 的比例缴纳城市维护建设税、教育费附加和地方教育附加。

（2）企业所得税

根据财政部、国家税务总局财税[2004]78 号文《关于证券投资基金税收政策的通知》的规定，自 2004 年 1 月 1 日起，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、债券的差价收入，继续免征企业所得税。

根据财政部、国家税务总局财税[2008]1 号文《关于企业所得税若干优惠政策的通知》的规定，对证券投资基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股权的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

（3）个人所得税

根据财政部、国家税务总局财税[2008]132 号文《财政部、国家税务总局关于储蓄存款利息所得有关个人所得税政策的通知》的规定，自 2008 年 10 月 9 日起，对储蓄存款利息所得暂免征收个人所得税。

根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2012]85 号文《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》的规定，自 2013 年 1 月 1 日起，（如有）证券投资基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，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，暂减按 25%计入应纳税所得额。上述所得统一适用 20%的税率计征个人所得税。

根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2015]101 号文《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》的规定，自 2015 年 9 月 8 日起，（如有）证券投资基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，持股期限超过 1 年的，股息红利所得暂免征收个人所得税。

（4）印花税

经国务院批准，财政部、国家税务总局研究决定，自 2008 年 4 月 24 日起，调整证券（股票）交易印花税税率，由原先的 3‰调整为 1‰，自 2008 年 9 月 19 日起，调整由出让方按证券（股票）交易印花税税率缴纳印花税，受让方不再征收，税率不变；根据财政部、税务总局公告 2023 年第 39 号《关于减半征收证券交易印花税的公告》的规定，自 2023 年 8 月 28 日起，证券交易印花税实施减半征收。

（5）境外投资

本基金运作过程中如有涉及的境外投资的税项问题，根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2014]81 号文《关于沪港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》、财税[2016]127 号文《关于深港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》及其他境内外相关税务法规的规定和实务操作执行。

7.4.7 重要财务报表项目的说明

7.4.7.1 货币资金

单位：人民币元

项目	本期末 2024 年 12 月 31 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
活期存款	371,129,157.08	175,455,478.87
等于：本金	371,093,756.46	175,438,328.37
加：应计利息	35,400.62	17,150.50
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	371, 129, 157. 08	175, 455, 478. 87

7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末 2024 年 12 月 31 日			
		成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票		669, 826, 744. 19	-	797, 065, 200. 66	127, 238, 456. 47
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		669, 826, 744. 19	-	797, 065, 200. 66	127, 238, 456. 47
项目		上年度末 2023 年 12 月 31 日			
		成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票		646, 010, 488. 53	-	606, 789, 377. 24	-39, 221, 111. 29
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		646, 010, 488. 53	-	606, 789, 377. 24	-39, 221, 111. 29

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

无。

7.4.7.3.2 期末基金持有的期货合约情况

无。

7.4.7.3.3 期末基金持有的黄金衍生品情况

无。

7.4.7.4 买入返售金融资产

7.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

无。

7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

无。

7.4.7.4.3 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

无。

7.4.7.5.2 债权投资减值准备计提情况

无。

7.4.7.6 其他债权投资

7.4.7.6.1 其他债权投资情况

无。

7.4.7.6.2 其他债权投资减值准备计提情况

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

无。

7.4.7.7.2 报告期末其他权益工具投资情况

无。

7.4.7.8 其他资产

无。

7.4.7.9 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2024 年 12 月 31 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
应付券商交易单元保证金	-	-
应付赎回费	291.57	4.93

应付证券出借违约金	-	-
应付交易费用	84,390.43	65,189.90
其中：交易所市场	84,390.43	65,189.90
银行间市场	-	-
应付利息	-	-
预提费用	194,500.00	210,000.00
合计	279,182.00	275,194.83

7.4.7.10 实收基金

金额单位：人民币元

大成核心价值甄选混合 A

项目	本期	
	2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	700,943,343.38	700,943,343.38
本期申购	351,967,878.69	351,967,878.69
本期赎回（以“-”号填列）	-373,950,315.53	-373,950,315.53
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	678,960,906.54	678,960,906.54

大成核心价值甄选混合 C

项目	本期	
	2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	66,424,022.08	66,424,022.08
本期申购	619,190,684.39	619,190,684.39
本期赎回（以“-”号填列）	-385,697,281.53	-385,697,281.53
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	299,917,424.94	299,917,424.94

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

7.4.7.11 其他综合收益

无。

7.4.7.12 未分配利润

单位：人民币元

大成核心价值甄选混合 A

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	69,548,263.74	-56,212,764.20	13,335,499.54

本期期初	69,548,263.74	-56,212,764.20	13,335,499.54
本期利润	-3,889,085.18	125,171,090.59	121,282,005.41
本期基金份额交易产生的变动数	-2,978,623.74	2,120,910.80	-857,712.94
其中：基金申购款	29,872,804.84	15,556,876.83	45,429,681.67
基金赎回款	-32,851,428.58	-13,435,966.03	-46,287,394.61
本期已分配利润	-	-	-
本期末	62,680,554.82	71,079,237.19	133,759,792.01

大成核心价值甄选混合 C

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	5,427,179.01	-5,292,672.99	134,506.02
本期期初	5,427,179.01	-5,292,672.99	134,506.02
本期利润	2,123,762.63	41,288,477.17	43,412,239.80
本期基金份额交易产生的变动数	13,008,557.37	-5,487,494.60	7,521,062.77
其中：基金申购款	40,711,008.75	8,293,734.26	49,004,743.01
基金赎回款	-27,702,451.38	-13,781,228.86	-41,483,680.24
本期已分配利润	-	-	-
本期末	20,559,499.01	30,508,309.58	51,067,808.59

7.4.7.13 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年12月31日	上年度可比期间 2023年1月1日至2023年12月31日
活期存款利息收入	1,168,445.43	694,745.37
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	4,518.11	2,824.41
其他	468.85	902.12
合计	1,173,432.39	698,471.90

7.4.7.14 股票投资收益

7.4.7.14.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年12月31日	上年度可比期间 2023年1月1日至2023年12月31日
股票投资收益——买卖股票差价收入	-17,783,086.96	5,366,575.37
股票投资收益——赎回差价收入	-	-
股票投资收益——申购	-	-

差价收入		
股票投资收益——证券 出借差价收入	—	—
合计	-17,783,086.96	5,366,575.37

7.4.7.14.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日
卖出股票成交总额	230,454,020.39	474,536,801.22
减：卖出股票成本 总额	247,634,248.03	467,979,147.03
减：交易费用	602,859.32	1,191,078.82
买卖股票差价收入	-17,783,086.96	5,366,575.37

7.4.7.14.3 股票投资收益——证券出借差价收入

无。

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

无。

7.4.7.15.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

无。

7.4.7.15.3 债券投资收益——赎回差价收入

无。

7.4.7.15.4 债券投资收益——申购差价收入

无。

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

无。

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

无。

7.4.7.16.3 资产支持证券投资收益——赎回差价收入

无。

7.4.7.16.4 资产支持证券投资收益——申购差价收入

无。

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

无。

7.4.7.17.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

无。

7.4.7.17.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

无。

7.4.7.17.4 贵金属投资收益——申购差价收入

无。

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

无。

7.4.7.18.2 衍生工具收益——其他投资收益

无。

7.4.7.19 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日
股票投资产生的股利收益	30,630,789.78	21,456,539.93
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	30,630,789.78	21,456,539.93

7.4.7.20 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日
------	--	---

1. 交易性金融资产	166,459,567.76	21,086,301.16
股票投资	166,459,567.76	21,086,301.16
债券投资	—	—
资产支持证券投资	—	—
基金投资	—	—
贵金属投资	—	—
其他	—	—
2. 衍生工具	—	—
权证投资	—	—
3. 其他	—	—
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税	—	—
合计	166,459,567.76	21,086,301.16

7.4.7.21 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日
基金赎回费收入	646,372.22	128,887.08
基金转换费收入	17,449.92	2,856.55
合计	663,822.14	131,743.63

7.4.7.22 信用减值损失

无。

7.4.7.23 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日
审计费用	70,000.00	90,000.00
信息披露费	120,000.00	120,000.00
证券出借违约金	—	—
深港通证券组合费	4,500.16	345.68
银行划款手续费	9,427.13	8,681.89
账户维护费	18,000.00	—
合计	221,927.29	219,027.57

7.4.7.24 分部报告

无。

7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

7.4.8.1 或有事项

无。

7.4.8.2 资产负债表日后事项

无。

7.4.9 关联方关系

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

注：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

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 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日		上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日	
	成交金额	占当期股票 成交总额的比例（%）	成交金额	占当期股票 成交总额的比例（%）
光大证券	33,140,824.73	6.65	242,661,069.52	32.17

7.4.10.1.2 债券交易

无。

7.4.10.1.3 债券回购交易

无。

7.4.10.1.4 权证交易

无。

7.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日			
	当期 佣金	占当期佣金总量 的比例（%）	期末应付佣金余 额	占期末应付佣金 总额的比例（%）

光大证券	18,155.80	6.17	11,077.69	13.13
关联方名称	上年度可比期间 2023年1月1日至2023年12月31日			
	当期 佣金	占当期佣金总量 的比例（%）	期末应付佣金余 额	占期末应付佣金 总额的比例（%）
光大证券	223,564.03	32.90	-	-

注：1、上述佣金按协议约定的佣金率计算，佣金费率参考市场价格经本基金的基金管理人与对方协商确定；

2、根据《公开募集证券投资基金证券交易费用管理规定》，自 2024 年 7 月 1 日起，基金管理人管理的被动股票型基金的股票交易佣金费率原则上不得超过市场平均股票交易佣金费率，且不得通过交易佣金支付研究服务、流动性服务等其他费用；其他类型基金可以通过交易佣金支付研究服务费用，但股票交易佣金费率原则上不得超过市场平均股票交易佣金费率的两倍，且不得通过交易佣金支付研究服务之外的其他费用。

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 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的管理费	12,619,919.42	11,743,827.27
其中：应支付销售机构的客户维护费	4,146,996.23	4,680,424.49
应支付基金管理人的净管理费	8,472,923.19	7,063,402.78

注：（1）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 1.20%年费率计提。计算方法如下：

$$H=E\times 1.20\%/ \text{当年天数}$$

H 为每日应支付的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

（2）本基金自 2023 年 7 月 10 日起，基金管理费的年费率由 1.50%调整为 1.20%。

7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的托管费	2,103,319.89	1,957,304.63

注：（1）基金托管费每日计提，按月支付。基金托管费按前一日的基金资产净值的 0.20%年费率

计提。计算方法如下：

$$H=E \times 0.20\% / \text{当年天数}$$

H 为每日应支付的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

(2) 本基金自 2023 年 7 月 10 日起，基金托管费的年费率由 0.25% 调整为 0.20%。

7.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	大成核心价值甄选混合 A	大成核心价值甄选混合 C	合计
大成基金	—	670,099.97	670,099.97
光大证券	—	4,664.44	4,664.44
中国工商银行	—	329,087.36	329,087.36
合计	—	1,003,851.77	1,003,851.77
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	大成核心价值甄选混合 A	大成核心价值甄选混合 C	合计
大成基金	—	15,262.24	15,262.24
光大证券	—	6,257.20	6,257.20
中国工商银行	—	51,349.07	51,349.07
合计	—	72,868.51	72,868.51

注：本基金 A 类基金份额不收取销售服务费，C 类基金份额的销售服务付费将专门用于本基金 C 类基金份额的销售与基金份额持有人服务。C 类基金份额的销售服务费按前一日 C 类基金份额基金资产净值的 0.60% 的年费率计提。计算方法如下：

$$H=E \times 0.60\% / \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的销售服务费

E 为前一日的基金资产净值

7.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

无。

7.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

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

无。

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

无。

7.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

7.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

无。

7.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

无。

7.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日		上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国工商银行	371,129,157.08	1,168,445.43	175,455,478.87	694,745.37

注：本基金由基金托管人保管的银行存款，按银行约定利率计息。

7.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

无。

7.4.10.8 其他关联交易事项的说明

无。

7.4.11 利润分配情况

无。

7.4.12 期末（2024 年 12 月 31 日）本基金持有的流通受限证券

7.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

7.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	受限期	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量（单位：股）	期末成本总额	期末估值总额	备注

001279	强邦新材	2024年9月27日	6个月	新股锁定	9.68	27.91	265	2,565.20	7,396.15	-
001391	国货航	2024年12月23日	6个月	新股锁定	2.30	6.80	4,686	10,777.80	31,864.80	-
301522	上大股份	2024年10月9日	6个月	新股锁定	6.88	24.84	816	5,614.08	20,269.44	-
301551	无线传媒	2024年9月19日	6个月	新股锁定	9.40	43.23	652	6,128.80	28,185.96	-
301552	科力装备	2024年7月15日	6个月	新股锁定	30.00	56.87	143	4,290.00	8,132.41	-
301556	托普云农	2024年10月10日	6个月	新股锁定	14.50	59.05	267	3,871.50	15,766.35	-
301571	国科天成	2024年8月14日	6个月	新股锁定	11.14	40.83	350	3,899.00	14,290.50	-
301585	蓝宇股份	2024年12月10日	6个月	新股锁定	23.95	35.85	210	5,029.50	7,528.50	-
301586	佳力奇	2024年8月21日	6个月	新股锁定	18.09	53.14	215	3,889.35	11,425.10	-
301603	乔锋智能	2024年7月3日	6个月	新股锁定	26.50	41.98	233	6,174.50	9,781.34	-
301606	绿联科技	2024年7月17日	6个月	新股锁定	21.21	36.49	396	8,399.16	14,450.04	-
301607	富	2024	6个月	新股	14.00	36.14	257	3,598.00	9,287.98	-

	特科技	年8月28日		锁定						
301608	博实结	2024年7月25日	6个月	新股锁定	44.50	65.38	184	8,188.00	12,029.92	-
301611	珂玛科技	2024年8月7日	6个月	新股锁定	8.00	56.10	804	6,432.00	45,104.40	-
301613	新铝时代	2024年10月18日	6个月	新股锁定	27.70	41.77	276	7,645.20	11,528.52	-
301617	博苑股份	2024年12月3日	6个月	新股锁定	27.76	39.79	253	7,023.28	10,066.87	-
301622	英思特	2024年11月26日	6个月	新股锁定	22.36	44.92	306	6,842.16	13,745.52	-
301626	苏州天脉	2024年10月17日	6个月	新股锁定	21.23	65.78	957	20,317.11	62,951.46	-
301631	壹连科技	2024年11月12日	6个月	新股锁定	72.99	101.96	153	11,167.47	15,599.88	-
603072	天和磁材	2024年12月24日	6个月	新股未上市	12.30	12.30	226	2,779.80	2,779.80	-
603072	天和磁材	2024年12月24日	1个月内(含)	新股未上市	12.30	12.30	2,029	24,956.70	24,956.70	-
603091	众鑫股份	2024年9月10日	6个月	新股锁定	26.50	44.43	94	2,491.00	4,176.42	-
603194	中力	2024年12	6个月	新股锁定	20.32	28.13	291	5,913.12	8,185.83	-

	股份	月 17 日								
603207	小方制药	2024 年 8 月 19 日	6 个月	新股 锁定	12.47	26.65	185	2,306.95	4,930.25	-
603285	键邦股份	2024 年 6 月 28 日	6 个月	新股 锁定	18.65	22.61	129	2,405.85	2,916.69	-
603310	巍华新材	2024 年 8 月 7 日	6 个月	新股 锁定	17.39	17.95	254	4,417.06	4,559.30	-
603350	安乃达	2024 年 6 月 26 日	6 个月	新股 锁定	20.56	36.17	106	2,179.36	3,834.02	-
603391	力聚热能	2024 年 7 月 24 日	6 个月	新股 锁定	40.00	41.35	100	4,000.00	4,135.00	-
603395	红四方	2024 年 11 月 19 日	6 个月	新股 锁定	7.98	35.77	154	1,228.92	5,508.58	-
688449	联芸科技	2024 年 11 月 20 日	6 个月	新股 锁定	11.25	29.44	1,406	15,817.50	41,392.64	-
688615	合合信息	2024 年 9 月 19 日	6 个月	新股 锁定	55.18	165.78	289	15,947.02	47,910.42	-
688708	佳驰科技	2024 年 11 月 27 日	6 个月	新股 锁定	27.08	48.95	780	21,122.40	38,181.00	-
688710	益诺思	2024 年 8 月 27 日	6 个月	新股 锁定	19.06	33.58	332	6,327.92	11,148.56	-
688726	拉普拉斯	2024 年 10 月 22 日	6 个月	新股 锁定	17.58	33.06	979	17,210.82	32,365.74	-

688750	金天钛业	2024年11月12日	6个月	新股锁定	7.16	15.44	1,685	12,064.60	26,016.40	-
--------	------	-------------	-----	------	------	-------	-------	-----------	-----------	---

7.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

无。

7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

无。

7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

无。

7.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

无。

7.4.13 金融工具风险及管理

7.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金在日常经营活动中由金融工具产生的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金管理人制定了政策和程序来识别及分析这些风险，并设定适当的风险限额及内部控制流程，通过可靠的管理及信息系统持续监控上述各类风险。 本基金的基金管理人奉行全面风险管理体系的建设，建立了以由高层监控（合规与风险管理委员会、公司投资风险控制委员会）、专业监控（监察稽核部、风险管理部）、部门互控、岗位自控构成的风险管理架构体系。本基金的基金管理人在董事会下设立合规与风险管理委员会，对公司整体运营风险进行监督，监督风险控制措施的执行。在管理层层面设立投资风险控制委员会，通过定期会议讨论涉及投资风险的重大议题，形成正式决议提交投委会。在业务操作层面，监察稽核部履行合规控制职责，通过定期、不定期检查内控制度的执行情况、对重大风险点以专项稽核的方式确保公司内控制度、流程得到贯彻执行。风险管理部履行风险量化评估分析职责。 本基金的基金管理人对于金融工具的风险管理方法主要是通过定性分析和定量分析的方法去估测各种风险产生的可能损失。从定性分析的角度出发，判断风险损失的严重程度和出现同类风险损失的频度。而从定量分析的角度出发，根据本基金的投资目标，结合基金资产所运用金融工具特征通过特定的风险量化指标、模型，日常的量化报告，确定风险损失的限度和相应置信程度，及时可靠地对各种风险进行监督、检查和评估，并通过相应决策，将风险控制在可承受的范围内。

7.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息等情况，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。本基金的银行存款存放在本基金的托管人中国工商银行股份有限公司，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。信用等级评估以内部信用评级为主，外部信用评级为辅。内部债券信用评级主要考察发行人的经营风险、财务风险和流动性风险，以及信用产品的条款和担保人的情况等。此外，本基金的基金管理人根据信用产品的内部评级，通过单只信用产品投资占基金资产净值的比例及占发行量的比例进行控制，通过分散化投资以分散信用风险。

本期末，本基金无债券投资(上年度末：同)。

7.4.13.3 流动性风险

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

7.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》及《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》等有关法规的要求建立健全开放式基金流动性风险管理的内部控制体系，审慎评估各类资产的流动性，针对性制定流动性风险管理措施，对本基金组合资产的流动性风险进行管理。本基金的基金管理人采用监控基金组合资产持仓集中度指标、逆回购交易的到期日与交易对手的集中度、流动性受限资产比例、基金组合资产中 7 个工作日可变现资产的可变现价值以及压力测试等方式防范流动性风险。并于开放日对本基金的申购赎回情况进行监控，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配，确保本基金资产的变现能力与投资者赎回需求的匹配与平衡。本基金的基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。于本期末，本基金持有的流动性受限资产的估值占基金资产净值的比例未超过 15%。

本基金主要投资于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。

7.4.13.4 市场风险

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动而发生波动的风险，包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

7.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指金融工具的公允价值或现金流量因市场利率变动而发生波动的风险。利率敏感性金融工具均面临由于市场利率上升而导致公允价值下降的风险，其中浮动利率类金融工具还面临每个付息期间结束根据市场利率重新定价时对于未来现金流影响的风险。本基金的基金管理人定期对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控，并通过调整投资组合的久期等方法对上述利率风险进行管理。本基金持有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、存出保证金等。

7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2024 年 12 月 31 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
货币资金	371,129,157.08	-	-	-	371,129,157.08
存出保证金	44,986.90	-	-	-	44,986.90
交易性金融资产	-	-	-	797,065,200.66	797,065,200.66
应收申购款	-	-	-	2,406,436.52	2,406,436.52
资产总计	371,174,143.98	-	-	799,471,637.18	1,170,645,781.16
负债					
应付赎回款	-	-	-	5,245,082.62	5,245,082.62
应付管理人报酬	-	-	-	1,099,013.11	1,099,013.11
应付托管费	-	-	-	183,168.89	183,168.89
应付清算款	-	-	-	127.85	127.85
应付销售服务费	-	-	-	133,274.61	133,274.61
其他负债	-	-	-	279,182.00	279,182.00

负债总计	-	-	-	6,939,849.08	6,939,849.08
利率敏感度缺口	371,174,143.98	-	-	-792,531,788.10	1,163,705,932.08
上年度末 2023 年 12 月 31 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
货币资金	175,455,478.87	-	-	-	175,455,478.87
存出保证金	47,199.73	-	-	-	47,199.73
交易性金融资产	-	-	-	-606,789,377.24	606,789,377.24
应收申购款	-	-	-	37,035.70	37,035.70
资产总计	175,502,678.60	-	-	-606,826,412.94	782,329,091.54
负债					
应付赎回款	-	-	-	268,755.15	268,755.15
应付管理人报酬	-	-	-	783,850.34	783,850.34
应付托管费	-	-	-	130,641.74	130,641.74
应付清算款	-	-	-	2.41	2.41
应付销售服务费	-	-	-	33,276.05	33,276.05
其他负债	-	-	-	275,194.83	275,194.83
负债总计	-	-	-	1,491,720.52	1,491,720.52
利率敏感度缺口	175,502,678.60	-	-	-605,334,692.42	780,837,371.02

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

7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

于本期末，本基金未持有交易性债券投资和交易性资产支持证券投资（上年度末：同），因此市场利率的变动对于本基金净资产无重大影响（上年度末：同）。

7.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基金持有以非记账本位币人民币计价的资产和负债，因此存在相应的外汇风险。本基金管理人每日对本基金的外汇头寸进行监控。

7.4.13.4.2.1 外汇风险敞口

单位：人民币元

项目	本期末 2024 年 12 月 31 日			
	美元 折合人民币 元	港币 折合人民币元	其他币种 折合人民币元	合计
以外币计价的 资产				
交易性金融资产	-	144,170,055.86	-	144,170,055.86

资产合计	-	144,170,055.86	-	144,170,055.86
以外币计价的负债				
负债合计	-	-	-	-
资产负债表外汇风险敞口净额	-	144,170,055.86	-	144,170,055.86
项目	上年度末 2023 年 12 月 31 日			
	美元折合人民币元	港币折合人民币元	其他币种折合人民币元	合计
以外币计价的资产				
交易性金融资产	-	10,974,881.53	-	10,974,881.53
资产合计	-	10,974,881.53	-	10,974,881.53
以外币计价的负债				
负债合计	-	-	-	-
资产负债表外汇风险敞口净额	-	10,974,881.53	-	10,974,881.53

7.4.13.4.2.2 外汇风险的敏感性分析

假设	除汇率以外的其他市场变量保持不变		
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（2024 年 12 月 31 日）	上年度末（2023 年 12 月 31 日）
	所有外币相对人民币升值 5%	7,208,502.79	548,744.08
	所有外币相对人民币贬值 5%	-7,208,502.79	-548,744.08

7.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市的股票，所面临的最大市场价格风险由所持有的金融工具的公允价值决定。本基金通过投资组合的分散化降低市场

价格风险，并且本基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控。 本基金的基金管理人在构建和管理投资组合的过程中，采用“自上而下”的策略，通过对宏观经济情况及政策的分析，结合证券市场运行情况，做出资产配置及组合构建的决定；通过对单个证券的定性分析及定量分析，选择符合基金合同约定范围的投资品种进行投资。本基金的基金管理人定期结合宏观及微观环境的变化，对投资策略、资产配置、投资组合进行修正，来主动应对可能发生的市场价格风险。本基金的投资组合比例为：本基金投资于股票、存托凭证的比例为基金资产的 60%-95%（港股通标的股票投资比例不超过本基金股票资产的 50%）；本基金每个交易日日终在扣除股指期货合约和国债期货合约需缴纳的交易保证金后，应当保持不低于基金资产净值 5%的现金或到期日在一年以内的政府债券，其中，现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。

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 2024 年 12 月 31 日		上年度末 2023 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	797,065,200.66	68.49	606,789,377.24	77.71
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	797,065,200.66	68.49	606,789,377.24	77.71

7.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除业绩比较基准以外的其他市场变量保持不变		
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（2024 年 12 月 31 日）	上年度末（2023 年 12 月 31 日）
	业绩比较基准上升 5%	41,390,260.43	26,659,172.17
	业绩比较基准下降	-41,390,260.43	-26,659,172.17

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

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。

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 2024 年 12 月 31 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
第一层次	796,452,798.17	606,081,750.89
第二层次	27,736.50	—
第三层次	584,665.99	707,626.35
合计	797,065,200.66	606,789,377.24

7.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

本基金以导致各层次之间转换的事项发生日为确认各层次之间转换的时点。

对于证券交易所上市的证券，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证券的公允价值列入第一层次；对于定期开放的基金投资，本基金不会于封闭期将相关基金列入第一层次；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，确定相关投资的公允价值应属第二层次还是第三层次。

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

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日		
	交易性金融资产		合计
	债券投资	股票投资	

期初余额	-	707,626.35	707,626.35
当期购买	-	-	-
当期出售/结算	-	-	-
转入第三层次	-	1,152,513.63	1,152,513.63
转出第三层次	-	698,821.59	698,821.59
当期利得或损失总额	-	-576,652.40	-576,652.40
其中：计入损益的利得或损失	-	-576,652.40	-576,652.40
计入其他综合收益的利得或损失	-	-	-
期末余额	-	584,665.99	584,665.99
期末仍持有的第三层次金融资产计入本期损益的未实现利得或损失的变动——公允价值变动损益	-	339,381.36	339,381.36
项目	上年度可比期间 2023年1月1日至2023年12月31日		
	交易性金融资产		合计
	债券投资	股票投资	
期初余额	-	946,543.21	946,543.21
当期购买	-	-	-
当期出售/结算	-	-	-
转入第三层次	-	2,588,721.66	2,588,721.66
转出第三层次	-	2,581,888.25	2,581,888.25
当期利得或损失总额	-	-245,750.27	-245,750.27
其中：计入损益的利得或损失	-	-245,750.27	-245,750.27
计入其他综合收益的利得或损失	-	-	-
期末余额	-	707,626.35	707,626.35
期末仍持有的第三层次金融资产计入本期损益的未实现利得或损失的变动——公允价值变动损益	-	116,413.05	116,413.05

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

单位：人民币元

项目	本期末公允	采用的估值	不可观察输入值
----	-------	-------	---------

	价值	技术	名称	范围/加权平均值	与公允价值之间的关系
证券交易所上市但尚在限售期内的股票	584,665.99	平均价格亚式期权模型	预期波动率	0.2665-5.7444	负相关
项目	上年度末公允价值	采用的估值技术	不可观察输入值		
			名称	范围/加权平均值	与公允价值之间的关系
证券交易所上市但尚在限售期内的股票	707,626.35	平均价格亚式期权模型	预期波动率	0.1462-2.1988	负相关

7.4.14.3 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工具(上年度末：同)。

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货币资金、应收款项和其他金融负债等，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

截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

§ 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	797,065,200.66	68.09
	其中：股票	797,065,200.66	68.09
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	371,129,157.08	31.70
8	其他各项资产	2,451,423.42	0.21
9	合计	1,170,645,781.16	100.00

注：本基金通过深港通交易机制投资的港股公允价值为 144,170,055.86 元，占期末基金资产净值的比例为 12.39%。

8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

8.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	60,465,383.66	5.20
C	制造业	577,935,312.68	49.66
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	2,317.83	0.00
E	建筑业	1,805.40	0.00
F	批发和零售业	129,419.70	0.01
G	交通运输、仓储和邮政业	9,890,640.68	0.85
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	4,207,585.13	0.36
J	金融业	14,344.36	0.00
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	4,346.76	0.00
M	科学研究和技术服务业	14,233.32	0.00
N	水利、环境和公共设施管理业	5,189.08	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	202,718.88	0.02
R	文化、体育和娱乐业	21,847.32	0.00
S	综合	-	-
	合计	652,895,144.80	56.10

8.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

行业类别	公允价值（人民币）	占基金资产净值比例（%）
通讯	142,312,790.04	12.23
非必需消费品	-	-
必需消费品	-	-
能源	-	-
金融	-	-
房地产	-	-
医疗保健	-	-
工业	1,857,265.82	0.16
材料	-	-
科技	-	-

公用事业	-	-
政府	-	-
合计	144,170,055.86	12.39

注：以上分类采用彭博行业分类标准。

8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	00941	中国移动	1,371,000	97,251,424.34	8.36
2	000651	格力电器	2,073,900	94,258,755.00	8.10
3	002595	豪迈科技	1,822,076	91,449,994.44	7.86
4	000333	美的集团	1,213,312	91,265,328.64	7.84
5	000063	中兴通讯	1,702,057	68,763,102.80	5.91
6	002884	凌霄泵业	3,628,827	66,298,669.29	5.70
7	601225	陕西煤业	2,599,500	60,464,370.00	5.20
8	600352	浙江龙盛	3,416,700	35,157,843.00	3.02
9	600519	贵州茅台	22,500	34,290,000.00	2.95
10	603337	杰克股份	1,100,350	33,516,661.00	2.88
11	00762	中国联通	4,460,000	30,521,722.78	2.62
12	600741	华域汽车	1,031,600	18,166,476.00	1.56
13	00728	中国电信	3,224,000	14,539,642.92	1.25
14	600233	圆通速递	666,400	9,456,216.00	0.81
15	600660	福耀玻璃	136,100	8,492,640.00	0.73
16	000338	潍柴动力	617,400	8,458,380.00	0.73
17	002223	鱼跃医疗	230,400	8,407,296.00	0.72
18	002078	太阳纸业	384,400	5,716,028.00	0.49
19	01199	中远海运港口	436,000	1,857,265.82	0.16
20	688249	晶合集成	48,373	1,129,025.82	0.10
21	688213	思特威	14,046	1,091,655.12	0.09
22	600031	三一重工	54,800	903,104.00	0.08
23	688428	诺诚健华	70,700	868,196.00	0.07
24	301165	锐捷网络	10,209	737,089.80	0.06
25	688271	联影医疗	5,524	698,233.60	0.06
26	688692	达梦数据	1,745	635,947.80	0.05
27	688172	燕东微	30,053	602,562.65	0.05
28	688449	联芸科技	14,052	557,728.82	0.05
29	688031	星环科技	11,693	539,398.09	0.05
30	688382	益方生物	36,208	481,566.40	0.04
31	688708	佳驰科技	7,794	468,139.20	0.04
32	688702	盛科通信	5,488	460,992.00	0.04
33	688326	经纬恒润	5,390	453,299.00	0.04
34	301498	乖宝宠物	5,531	433,187.92	0.04
35	301589	诺瓦星云	2,486	431,569.60	0.04

36	688726	拉普拉斯	9,785	428,635.74	0.04
37	688472	阿特斯	33,596	421,965.76	0.04
38	001391	国货航	46,851	420,204.45	0.04
39	688515	裕太微	4,183	414,117.00	0.04
40	688549	中巨芯	42,933	365,789.16	0.03
41	603296	华勤技术	5,142	364,824.90	0.03
42	301153	中科江南	12,872	359,643.68	0.03
43	688750	金天钛业	16,845	346,802.00	0.03
44	301200	大族数控	6,567	237,594.06	0.02
45	688652	京仪装备	4,157	204,108.70	0.02
46	301267	华夏眼科	10,647	202,718.88	0.02
47	301622	英思特	3,056	185,015.52	0.02
48	301371	敷尔佳	4,735	178,935.65	0.02
49	301421	波长光电	3,315	177,916.05	0.02
50	301511	德福科技	13,738	172,549.28	0.01
51	601096	宏盛华源	39,171	170,393.85	0.01
52	301559	中集环科	10,816	166,025.60	0.01
53	301565	中仑新材	7,103	152,004.20	0.01
54	301606	绿联科技	3,959	149,131.44	0.01
55	301525	儒竞科技	2,422	144,351.20	0.01
56	301392	汇成真空	2,189	135,192.64	0.01
57	301558	三态股份	14,578	127,703.28	0.01
58	301617	博苑股份	2,524	126,387.49	0.01
59	688410	山外山	10,774	120,237.84	0.01
60	301516	中远通	6,033	116,436.90	0.01
61	301413	安培龙	2,123	113,601.73	0.01
62	301507	民生健康	8,509	107,979.21	0.01
63	603194	中力股份	2,904	101,705.10	0.01
64	301517	陕西华达	1,841	99,469.23	0.01
65	301603	乔锋智能	2,326	99,194.30	0.01
66	301607	富特科技	2,567	96,906.28	0.01
67	301509	金凯生科	3,720	96,273.60	0.01
68	301585	蓝宇股份	2,092	95,304.98	0.01
69	301566	达利凯普	5,755	94,612.20	0.01
70	301459	丰茂股份	2,077	84,139.27	0.01
71	688267	中触媒	3,390	79,665.00	0.01
72	688648	中邮科技	3,025	70,452.25	0.01
73	301626	苏州天脉	957	62,951.46	0.01
74	301418	协昌科技	1,886	62,898.10	0.01
75	301358	湖南裕能	1,380	62,541.60	0.01
76	301309	万得凯	2,271	54,890.07	0.00
77	688615	合合信息	289	47,910.42	0.00
78	301611	珂玛科技	804	45,104.40	0.00

79	603391	力聚热能	991	41,637.19	0.00
80	603381	永臻股份	1,778	38,973.76	0.00
81	603350	安乃达	1,051	38,326.52	0.00
82	835179	凯德石英	1,300	33,072.00	0.00
83	603285	键邦股份	1,287	29,319.09	0.00
84	301551	无线传媒	652	28,185.96	0.00
85	603072	天和磁材	2,255	27,736.50	0.00
86	001308	康冠科技	867	23,842.50	0.00
87	001360	南矿集团	1,762	23,258.40	0.00
88	001330	博纳影业	3,564	21,847.32	0.00
89	301389	隆扬电子	1,290	21,568.80	0.00
90	688591	泰凌微	681	21,383.40	0.00
91	301522	上大股份	816	20,269.44	0.00
92	301556	托普云农	267	15,766.35	0.00
93	301631	壹连科技	153	15,599.88	0.00
94	301335	天元宠物	689	15,502.50	0.00
95	301396	宏景科技	552	15,500.16	0.00
96	301571	国科天成	350	14,290.50	0.00
97	301251	威尔高	407	14,200.23	0.00
98	301391	卡莱特	378	13,989.78	0.00
99	001236	弘业期货	1,399	13,486.36	0.00
100	601083	锦江航运	1,320	12,566.40	0.00
101	301489	思泉新材	178	12,146.72	0.00
102	301608	博实结	184	12,029.92	0.00
103	301613	新铝时代	276	11,528.52	0.00
104	301586	佳力奇	215	11,425.10	0.00
105	688710	益诺思	332	11,148.56	0.00
106	301578	辰奕智能	227	11,088.95	0.00
107	301316	慧博云通	384	9,818.88	0.00
108	301548	崇德科技	219	9,530.88	0.00
109	832419	路斯股份	600	8,760.00	0.00
110	301568	思泰克	256	8,704.00	0.00
111	301269	华大九天	71	8,598.10	0.00
112	688653	康希通信	648	8,229.60	0.00
113	301552	科力装备	143	8,132.41	0.00
114	301117	佳缘科技	262	8,025.06	0.00
115	001279	强邦新材	265	7,396.15	0.00
116	301327	华宝新能	91	6,980.61	0.00
117	301308	江波龙	81	6,966.00	0.00
118	301528	多浦乐	178	6,942.00	0.00
119	603051	鹿山新材	272	6,557.92	0.00
120	688720	艾森股份	165	6,527.40	0.00
121	603395	红四方	154	5,508.58	0.00

122	603325	博隆技术	66	5,221.26	0.00
123	603207	小方制药	185	4,930.25	0.00
124	001336	楚环科技	274	4,816.92	0.00
125	001270	铖昌科技	124	4,724.40	0.00
126	603310	巍华新材	254	4,559.30	0.00
127	688573	信宇人	285	4,443.15	0.00
128	001301	尚太科技	64	4,387.20	0.00
129	603312	西典新能	130	4,196.40	0.00
130	603091	众鑫股份	94	4,176.42	0.00
131	603004	鼎龙科技	195	4,018.95	0.00
132	301221	光庭信息	80	3,886.40	0.00
133	301270	汉仪股份	95	3,395.30	0.00
134	301182	凯旺科技	94	3,276.84	0.00
135	301261	恒工精密	73	3,020.74	0.00
136	603255	鼎际得	89	2,997.52	0.00
137	001239	永达股份	189	2,772.63	0.00
138	001323	慕思股份	73	2,760.13	0.00
139	001358	兴欣新材	122	2,718.16	0.00
140	603231	索宝蛋白	161	2,635.57	0.00
141	603373	安邦护卫	88	2,630.32	0.00
142	301367	怡和嘉业	41	2,583.00	0.00
143	301196	唯科科技	71	2,333.77	0.00
144	301049	超越科技	96	2,304.00	0.00
145	301398	星源卓镁	49	2,273.60	0.00
146	301138	华研精机	85	2,268.65	0.00
147	603281	江瀚新材	88	2,147.20	0.00
148	301319	唯特偶	71	2,070.36	0.00
149	603173	福斯达	88	2,028.40	0.00
150	301377	鼎泰高科	95	2,009.25	0.00
151	001238	浙江正特	74	2,000.22	0.00
152	001367	海森药业	73	1,988.52	0.00
153	301162	国能日新	43	1,956.50	0.00
154	603235	天新药业	72	1,840.32	0.00
155	001269	欧晶科技	64	1,823.36	0.00
156	603097	江苏华辰	77	1,811.04	0.00
157	301046	能辉科技	90	1,805.40	0.00
158	603130	云中马	80	1,772.00	0.00
159	301068	大地海洋	57	1,737.93	0.00
160	001228	永泰运	83	1,716.44	0.00
161	001229	魅视科技	47	1,679.31	0.00
162	301468	博盈特焊	79	1,657.42	0.00
163	301313	凡拓数创	64	1,656.32	0.00
164	603190	亚通精工	70	1,569.40	0.00

165	301072	中捷精工	81	1,534.14	0.00
166	001230	劲旅环境	90	1,492.20	0.00
167	001328	登康口腔	45	1,429.20	0.00
168	301050	雷电微力	27	1,392.66	0.00
169	301163	宏德股份	64	1,352.32	0.00
170	001260	坤泰股份	84	1,333.92	0.00
171	603280	南方路机	63	1,315.44	0.00
172	603211	晋拓股份	87	1,305.00	0.00
173	301330	熵基科技	48	1,290.24	0.00
174	301091	深城交	27	1,288.17	0.00
175	301111	粤万年青	79	1,286.12	0.00
176	603215	比依股份	75	1,276.50	0.00
177	001278	一彬科技	73	1,186.25	0.00
178	301190	善水科技	75	1,184.25	0.00
179	301139	元道通信	51	1,160.25	0.00
180	301066	万事利	82	1,132.42	0.00
181	301059	金三江	92	1,131.60	0.00
182	301279	金道科技	56	1,130.64	0.00
183	301273	瑞晨环保	61	1,115.69	0.00
184	301053	远信工业	55	1,073.05	0.00
185	001266	宏英智能	45	1,042.20	0.00
186	301258	富士莱	42	992.04	0.00
187	603070	万控智造	75	987.00	0.00
188	603057	紫燕食品	49	984.41	0.00
189	001311	多利科技	38	980.02	0.00
190	301148	嘉戎技术	53	969.90	0.00
191	301228	实朴检测	73	965.79	0.00
192	301150	中一科技	45	964.80	0.00
193	001368	通达创智	51	961.86	0.00
194	001299	美能能源	76	945.44	0.00
195	001231	农心科技	55	917.95	0.00
196	001319	铭科精技	36	905.40	0.00
197	603237	五芳斋	49	901.60	0.00
198	301095	广立微	17	885.19	0.00
199	301055	张小泉	55	870.65	0.00
200	601136	首创证券	39	858.00	0.00
201	301063	海锅股份	53	841.64	0.00
202	301180	万祥科技	54	835.38	0.00
203	603282	亚光股份	57	833.34	0.00
204	603153	上海建科	40	830.80	0.00
205	301179	泽宇智能	43	802.81	0.00
206	301079	邵阳液压	52	792.48	0.00
207	601089	福元医药	49	784.00	0.00

208	301223	中荣股份	48	772.80	0.00
209	001322	箭牌家居	95	768.55	0.00
210	001300	三柏硕	63	725.13	0.00
211	301219	腾远钴业	16	723.36	0.00
212	301188	力诺药包	47	705.94	0.00
213	001258	立新能源	88	700.48	0.00
214	301282	金禄电子	33	691.35	0.00
215	601022	宁波远洋	83	666.49	0.00
216	301126	达嘉维康	62	647.28	0.00
217	603170	宝立食品	42	639.24	0.00
218	301078	孩子王	56	637.28	0.00
219	603191	望变电气	49	616.91	0.00
220	301356	天振股份	38	598.88	0.00
221	603272	联翔股份	43	591.68	0.00
222	301056	森赫股份	72	588.96	0.00
223	603065	宿迁联盛	81	588.87	0.00
224	301089	拓新药业	20	563.80	0.00
225	301092	争光股份	23	536.59	0.00
226	001338	永顺泰	49	533.12	0.00
227	603182	嘉华股份	46	529.46	0.00
228	603209	兴通股份	33	527.34	0.00
229	301207	华兰疫苗	30	525.30	0.00
230	301217	铜冠铜箔	44	487.52	0.00
231	001318	阳光乳业	42	477.54	0.00
232	603132	金徽股份	42	471.66	0.00
233	603162	海通发展	50	460.00	0.00
234	001333	光华股份	26	450.06	0.00
235	001339	智微智能	12	439.08	0.00
236	301366	一博科技	10	434.10	0.00
237	301216	万凯新材	42	428.40	0.00
238	603291	联合水务	36	418.68	0.00
239	001314	亿道信息	8	414.80	0.00
240	301048	金鹰重工	43	402.91	0.00
241	300774	倍杰特	44	386.32	0.00
242	301222	浙江恒威	15	381.75	0.00
243	301248	杰创智能	24	381.12	0.00
244	603151	邦基科技	35	350.35	0.00
245	600925	苏能股份	60	318.00	0.00
246	301062	上海艾录	23	301.30	0.00
247	001313	粤海饲料	32	279.68	0.00
248	301118	恒光股份	15	276.15	0.00
249	001331	胜通能源	23	253.23	0.00
250	301288	清研环境	16	245.28	0.00

251	301381	赛维时代	10	227.60	0.00
252	301083	百胜智能	16	225.12	0.00
253	301057	汇隆新材	18	225.00	0.00
254	601121	宝地矿业	32	224.00	0.00
255	301093	华兰股份	9	214.20	0.00
256	301036	双乐股份	5	196.00	0.00
257	603206	嘉环科技	10	173.80	0.00
258	001298	好上好	6	150.30	0.00
259	688403	汇成股份	16	143.36	0.00
260	301149	隆华新材	14	138.46	0.00
261	301268	铭利达	7	116.06	0.00
262	301296	新巨丰	11	111.65	0.00
263	301088	戎美股份	4	53.96	0.00
264	300854	中兰环保	3	36.66	0.00

注：对于同时在 A+H 股上市的股票（如有），合并计算公允价值参与排序，并按照不同股票分别披露。

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	00941	中国移动	96,517,115.04	12.36
2	600519	贵州茅台	47,973,421.00	6.14
3	00762	中国联通	27,468,116.05	3.52
4	000333	美的集团	19,998,648.00	2.56
5	600741	华域汽车	14,997,987.00	1.92
6	00728	中国电信	13,677,172.57	1.75
7	000338	潍柴动力	7,997,825.00	1.02
8	002223	鱼跃医疗	7,689,870.00	0.98
9	600233	圆通速递	7,676,667.00	0.98
10	600660	福耀玻璃	5,997,059.00	0.77
11	002078	太阳纸业	4,999,842.00	0.64
12	600352	浙江龙盛	4,990,482.00	0.64
13	02319	蒙牛乳业	4,604,677.41	0.59
14	603279	景津装备	2,997,446.00	0.38
15	688708	佳驰科技	211,061.52	0.03
16	301589	诺瓦星云	175,235.09	0.02
17	688726	拉普拉斯	172,020.30	0.02
18	688709	成都华微	163,929.12	0.02
19	688615	合合信息	158,973.58	0.02
20	688449	联芸科技	158,085.00	0.02

注：1. 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。

2. 对于同时在 A+H 股上市的股票（如有），合并计算公允价值参与排序，并按照不同股票分别披露。

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	600941	中国移动	36,758,173.22	4.71
1	00941	中国移动	451,655.38	0.06
2	600031	三一重工	35,438,541.92	4.54
3	603337	杰克股份	23,996,588.00	3.07
4	603989	艾华集团	22,995,426.54	2.94
5	600519	贵州茅台	22,279,706.00	2.85
6	002484	江海股份	21,753,357.00	2.79
7	603279	景津装备	17,124,010.40	2.19
8	601225	陕西煤业	12,531,907.71	1.60
9	603187	海容冷链	11,356,414.20	1.45
10	01919	中远海控	8,847,642.73	1.13
11	02319	蒙牛乳业	5,987,169.80	0.77
12	688615	合合信息	520,414.64	0.07
13	688361	中科飞测	494,316.28	0.06
14	301551	无线传媒	387,592.56	0.05
15	688469	芯联集成	381,932.03	0.05
16	301522	上大股份	310,994.50	0.04
17	301487	盟固利	255,341.14	0.03
18	301626	苏州天脉	249,502.86	0.03
19	688709	成都华微	213,067.73	0.03
20	301536	星辰科技	210,314.85	0.03

注：1. 本期累计卖出金额指卖出成交金额（成交单价乘以成交数量），不考虑相关交易费用。

2. 对于同时在 A+H 股上市的股票（如有），合并计算公允价值参与排序，并按照不同股票分别披露。

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	271,450,503.69
卖出股票收入（成交）总额	230,454,020.39

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。

8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

无。

8.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

无。

8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

无。

8.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

无。

8.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

无。

8.10 本基金投资股指期货的投资政策

无。

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

无。

8.11.2 本期国债期货投资评价

无。

8.12 投资组合报告附注

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

本基金投资的前十名证券的发行主体本期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

本基金投资的前十名股票未超出基金合同规定的备选股票库。

8.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	44,986.90
2	应收清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	2,406,436.52
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	2,451,423.42

8.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

无。

8.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

无。

8.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入原因，分项之和与合计可能有尾差。

§ 9 基金份额持有人信息

9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额级别	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（%）
大成核心价值甄选混合 A	11,015	61,639.66	166,313,445.84	24.50	512,647,460.70	75.50
大成核心价值甄选混合 C	6,231	48,133.11	114,640,443.32	38.22	185,276,981.62	61.78
合计	17,246	56,759.73	280,953,889.16	28.70	697,924,442.32	71.30

注：1、上述机构/个人投资者持有份额占总份额比例的计算中，对分级份额，比例的分母采用各自级别的份额，对合计数，比例的分母采用下属分级基金份额的合计数（即期末基金份额总额）。

2、持有人户数为有效户数，即存量份额大于零的账户。

9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	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	大成核心价值甄选混合 A	425,825.81	0.0627
	大成核心价值甄选混合 C	9,331.66	0.0031
	合计	435,157.47	0.0445

注：上述占基金总份额比例的计算中，对分级份额，比例的分母采用各自级别的份额，对合计数，比例的分母采用下属分级基金份额的合计数（即期末基金份额总额）。

9.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

项目	份额级别	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	大成核心价值甄选混合 A	10~50
	大成核心价值甄选混合 C	0
	合计	10~50
本基金基金经理持有本开放式基金	大成核心价值甄选混合 A	0
	大成核心价值甄选混合 C	0
	合计	0

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

基金经理姓名	产品类型	持有本人管理的产品份额总量的数量区间（万份）
刘旭	公募基金	>100
	私募资产管理计划	0
	合计	>100

§ 10 开放式基金份额变动

单位：份

项目	大成核心价值甄选混合 A	大成核心价值甄选混合 C
基金合同生效日 （2021 年 3 月 15 日） 基金份额总额	2,928,418,149.91	299,236,878.64
本报告期期初基金份额总额	700,943,343.38	66,424,022.08
本报告期基金总申购份额	351,967,878.69	619,190,684.39
减：本报告期基金总赎回份额	373,950,315.53	385,697,281.53
本报告期基金拆分变动份额	—	—
本报告期期末基金份额总额	678,960,906.54	299,917,424.94

§ 11 重大事件揭示

11.1 基金份额持有人大会决议

无。

11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

一、基金管理人的重大人事变动

2024 年 10 月 10 日，公司召开大成基金管理有限公司 2024 年第一次临时股东会，会议审议通过《关于卢锋先生辞去公司第八届董事会独立董事职务的议案》，同意卢锋先生自股东会决议作出之日起辞去公司第八届董事会独立董事及董事会下属审计委员会主任委员、合规与风险管理委员会委员、战略与提名薪酬考核委员会委员职务，不再履行上述职责。

二、基金托管人的基金托管部门的重大人事变动

本报告期基金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

本报告期内无涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

11.4 基金投资策略的改变

本基金投资策略在本报告期内没有重大改变。

11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金自基金合同生效日起聘请安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）为本基金提供审计服务至今，本年度应支付的审计费用为 70,000.00 元。

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

本报告期内，基金管理人及其相关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

本报告期内托管人及其高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

11.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例 (%)	佣金	占当期佣金总量的比例 (%)	
广发证券	1	148,705,906.25	29.86	67,809.89	23.04	新增 1 个
长江证券	1	133,004,928.59	26.71	106,787.54	36.28	—
东方证券	1	113,349,618.82	22.76	51,687.44	17.56	—

申万宏源	1	42,116,335.58	8.46	32,097.83	10.91	-
光大证券	1	33,140,824.73	6.65	18,155.80	6.17	-
中信建投证券	2	13,665,900.66	2.74	10,932.73	3.71	新增2个
招商证券	2	11,995,480.00	2.41	5,469.94	1.86	-
中信证券	2	1,620,145.94	0.33	1,192.23	0.41	-
海通证券	1	441,207.89	0.09	201.20	0.07	-
国信证券	1	-	-	-	-	新增1个
华泰证券	1	-	-	-	-	新增1个
汇丰前海证券	1	-	-	-	-	新增1个
中金公司	1	-	-	-	-	-

注：本基金采用托管人结算模式，本基金管理人负责选择证券经纪商，租用其交易单元作为本基金的交易单元。证券经纪商的选择标准和流程如下：

（一）筛选标准

大成基金管理有限公司（以下简称“公司”）严格按照《公开募集证券投资基金证券交易费用管理规定》要求制定了证券公司筛选标准，建立了证券公司尽职调查、证券公司负面筛查、备选池筛选机制，选择财务状况良好，经营行为规范，合规风控能力和交易、研究等服务能力较强的证券公司参与证券交易。

（二）筛选流程

1、经公司尽调符合条件的证券公司进入备选池，由股票投委会以公平、公正、公开为原则，结合定性及定量办法科学评估证券公司研究服务能力，形成证券公司白名单，并定期及不定期进行动态调整。

2、公司按照白名单与证券公司进行协议签署。

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

无。

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	大成基金管理有限公司关于提请投资者及时更新已过期身份证件及其他身份基本信息的公告	中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站	2024 年 12 月 31 日
2	大成基金管理有限公司提醒投资者谨	中国证监会基金电子披	2024 年 12 月 12 日

	防金融诈骗的公告	露网站、规定报刊及本公司网站	
3	大成基金管理有限公司关于暂停武汉佰崧基金销售有限公司办理相关销售业务的公告	中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站	2024 年 10 月 28 日
4	大成核心价值甄选混合型证券投资基金 2024 年第 3 季度报告	中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站	2024 年 10 月 25 日
5	大成核心价值甄选混合型证券投资基金 2024 年中期报告	中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站	2024 年 8 月 30 日
6	大成核心价值甄选混合型证券投资基金 2024 年第 2 季度报告	中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站	2024 年 7 月 19 日
7	大成核心价值甄选混合型证券投资基金 (C 类份额) 基金产品资料概要更新	中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站	2024 年 6 月 28 日
8	大成核心价值甄选混合型证券投资基金 (A 类份额) 基金产品资料概要更新	中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站	2024 年 6 月 28 日
9	大成基金管理有限公司关于提请投资者及时更新已过期身份证件及其他身份基本信息的公告	中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站	2024 年 6 月 28 日
10	大成基金管理有限公司关于暂停海银基金销售有限公司办理相关销售业务的公告	中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站	2024 年 6 月 12 日
11	大成核心价值甄选混合型证券投资基金 A、C 类份额增加中国人寿保险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	2024 年 5 月 17 日
12	大成基金管理有限公司关于旗下部分基金增加新华信通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	2024 年 4 月 26 日
13	大成核心价值甄选混合型证券投资基金 2024 年第 1 季度报告	中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站	2024 年 4 月 19 日
14	大成核心价值甄选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	2024 年 4 月 15 日
15	大成基金管理有限公司提醒投资者谨防金融诈骗的公告	中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站	2024 年 4 月 2 日
16	大成核心价值甄选混合型证券投资基金 2023 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	2024 年 3 月 29 日

17	大成基金管理有限公司提醒投资者谨防金融诈骗的公告	中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站	2024 年 1 月 23 日
18	大成核心价值甄选混合型证券投资基金 2023 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	2024 年 1 月 19 日
19	大成基金管理有限公司关于旗下部分基金增加长沙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	2024 年 1 月 3 日

§ 12 影响投资者决策的其他重要信息

12.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

无。

12.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§ 13 备查文件目录

13.1 备查文件目录

- 1、中国证监会批准设立大成核心价值甄选混合型证券投资基金的文件；
- 2、《大成核心价值甄选混合型证券投资基金基金合同》；
- 3、《大成核心价值甄选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。

13.2 存放地点

备查文件存放在本基金管理人和托管人的住所。

13.3 查阅方式

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

大成基金管理有限公司

2025 年 3 月 31 日