

大成深证成份交易型开放式指数证券投资 基金 2021 年中期报告

2021 年 6 月 30 日

基金管理人：大成基金管理有限公司

基金托管人：中国农业银行股份有限公司

送出日期：2021 年 8 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。本中期报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人中国农业银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2021 年 8 月 30 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 2021 年 01 月 01 日起至 06 月 30 日止。

1.2 目录

§ 1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
§ 2 基金简介	5
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人和基金托管人	5
2.4 信息披露方式	6
2.5 其他相关资料	6
§ 3 主要财务指标和基金净值表现	6
3.1 主要会计数据和财务指标	6
3.2 基金净值表现	7
§ 4 管理人报告	8
4.1 基金管理人及基金经理情况	8
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	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	10
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	11
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	11
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	12
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	12
§ 5 托管人报告	12
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	12
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等内容真实、准确和完整发表意见	13
§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）	13
6.1 资产负债表	13
6.2 利润表	14
6.3 所有者权益（基金净值）变动表	15
6.4 报表附注	17
§ 7 投资组合报告	36
7.1 期末基金资产组合情况	36
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	36
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	38
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	52
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 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明	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
§ 8 基金份额持有人信息	54
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	54
8.2 期末上市基金前十名持有人	54
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	55
8.4 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
§ 9 开放式基金份额变动	55
§ 10 重大事件揭示	55
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	59
§ 11 影响投资者决策的其他重要信息	59
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	59
§ 12 备查文件目录	59
12.1 备查文件目录	59
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	大成深证成份交易型开放式指数证券投资基金
基金简称	深证 ETF
场内简称	深证成指 ETF
基金主代码	159943
交易代码	159943
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2015 年 6 月 5 日
基金管理人	大成基金管理有限公司
基金托管人	中国农业银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	7,135,342.00 份
基金合同存续期	不定期
基金份额上市的证券交易所	深圳证券交易所
上市日期	2015 年 7 月 8 日

2.2 基金产品说明

投资目标	紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化。
投资策略	本基金采取完全复制法，即按照标的指数的成份股组成及其权重构建股票投资组合，并根据标的指数成份股及其权重的变动进行相应调整。 当预期成份股发生调整和成份股发生配股、增发、分红等行为时，或因基金的申购和赎回等对本基金跟踪标的指数的效果可能带来影响时，或因某些特殊情况导致流动性不足时，或其他原因导致无法有效复制和跟踪标的指数时，基金管理人可以对投资组合管理进行适当变通和调整，从而使得投资组合紧密地跟踪标的指数。
业绩比较基准	深证成份指数
风险收益特征	本基金为股票型指数基金，属于较高风险、较高预期收益的基金品种，其风险与预期收益高于混合基金、债券基金与货币市场基金。本基金采用完全复制法跟踪标的指数的表现，具有与标的指数、以及标的指数所代表的股票市场相似的风险收益特征。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		大成基金管理有限公司	中国农业银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	赵冰	秦一楠
	联系电话	0755-83183388	010-66060069
	电子邮箱	office@dcfund.com.cn	tgxxpl@abchina.com
客户服务电话		4008885558	95599
传真		0755-83199588	010-68121816
注册地址		深圳市福田区深南大道 7088 号招	北京市东城区建国门内大街 69

	商银行大厦 32 层	号
办公地址	深圳市福田区深南大道 7088 号招商银行大厦 32 层	北京市西城区复兴门内大街 28 号凯晨世贸中心东座 F9
邮政编码	518040	100031
法定代表人	吴庆斌	谷澍

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《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	中国证券登记结算有限责任公司	北京市西城区太平桥大街 17 号

§3 主要财务指标和基金净值表现

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(2021 年 1 月 1 日-2021 年 6 月 30 日)
本期已实现收益	24,915,896.33
本期利润	12,377,985.30
加权平均基金份额本期利润	1.5231
本期加权平均净值利润率	9.21%
本期基金份额净值增长率	8.32%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2021 年 6 月 30 日)
期末可供分配利润	-6,872,385.62
期末可供分配基金份额利润	-0.9631
期末基金资产净值	125,229,140.38
期末基金份额净值	17.551
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2021 年 6 月 30 日)
基金份额累计净值增长率	15.22%

注：1. 本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入(不含公允价值变动收益)扣除相关费用后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

2. 期末可供分配利润，采用期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数(为期末余额，不是当期发生数)。

3. 所述基金业绩指标不包括持有人交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

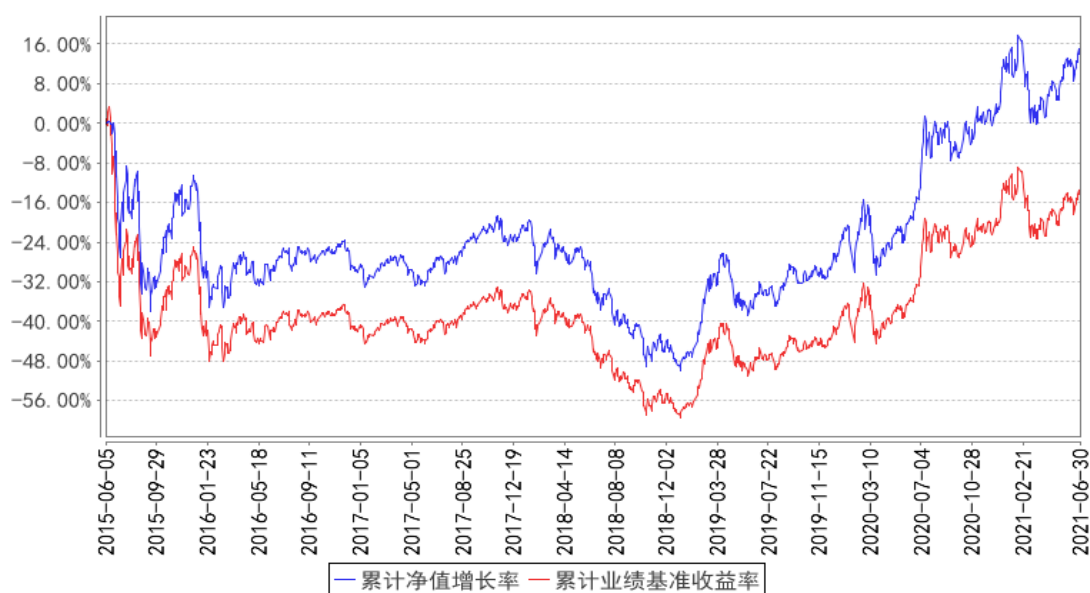
3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去一个月	2.03%	0.99%	1.10%	1.03%	0.93%	-0.04%
过去三个月	12.01%	1.03%	10.04%	1.08%	1.97%	-0.05%
过去六个月	8.32%	1.39%	4.78%	1.44%	3.54%	-0.05%
过去一年	33.59%	1.44%	26.43%	1.48%	7.16%	-0.04%
过去三年	75.14%	1.53%	61.65%	1.56%	13.49%	-0.03%
自基金合同生效起至今	15.22%	1.65%	-13.37%	1.70%	28.59%	-0.05%

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

深证成指ETF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

合基金合同的有关约定。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 2 亿元人民币，注册地广东省深圳市。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%)。主要业务是公募基金的募集、销售和管理，还具有全国社保基金投资管理、基本养老保险投资管理、受托管理保险资金、保险保障基金投资管理、特定客户资产管理和 QDII 业务资格。

经过二十二年的稳健发展，公司形成了强大稳固的综合实力。公司旗下基金产品齐全、风格多样，构建了涵盖股票型基金、混合型基金、指数型基金、债券型基金和货币市场基金的完备产品线。截至 2021 年 6 月 30 日，本基金管理人共管理 9 只 ETF 及 3 只 ETF 联接基金，8 只 QDII 基金及 107 只开放式证券投资基金。

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		
苏 秉 毅	本基金基金经理，数量与指数投资部副总监（主持工作）	2015 年 6 月 5 日	-	17 年	经济学硕士。2004 年 9 月至 2008 年 5 月就职于华夏基金管理有限公司基金运作部。2008 年加入大成基金管理有限公司，曾担任规划发展部高级产品设计师、数量与指数投资部总监助理，现任数量与指数投资部副总监。2012 年 8 月 28 日至 2014 年 1 月 23 日任大成中证 500 沪市交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理。2014 年 1 月 24 日至 2014 年 2 月 17 日任大成健康产业股票型证券投资基金基金经理。2012 年 2 月 9 日至 2014 年 9 月 11 日任深证成长 40 交易型开放式指数证券投资基金及大成深证成长 40 交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理。2012 年 8 月 24 日起任中证 500 沪市交易型开放式指数证券投资基金基金经理。2013 年 1 月 1 日至 2015 年 8 月 25 日任大成沪深 300 指数证券投资基金基金经

					理。2013 年 2 月 7 日起任大成中证 100 交易型开放式指数证券投资基金基金经理。2015 年 6 月 5 日起任大成深证成份交易型开放式指数证券投资基金基金经理。2015 年 6 月 29 日至 2020 年 11 月 13 日任大成中证互联网金融指数分级证券投资基金基金经理。2016 年 3 月 4 日起任大成核心双动力混合型证券投资基金、大成沪深 300 指数证券投资基金基金经理。2018 年 6 月 26 日起任大成景恒混合型证券投资基金基金经理。2021 年 4 月 23 日起任大成智惠量化多策略灵活配置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
刘淼	本基金基金经理助理	2017 年 9 月 14 日	-	13 年	工商管理硕士。2008 年 4 月至 2011 年 5 月就职于招商基金管理有限公司，任基金核算部基金会计。2011 年 5 月加入大成基金管理有限公司，曾担任基金运营部基金会计、股票投资部投委会秘书兼风控员、数量与指数投资部数量分析师、深证成长 40 交易型开放式指数证券投资基金、大成深证成长 40 交易型开放式指数联接基金、大成中证 500 深市交易型开放式指数证券投资基金、大成 MSCI 中国 A 股质优价值 100 交易型开放式指数证券投资基金、大成 MSCI 中国 A 股质优价值 100 交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理助理。2017 年 9 月 14 日起任大成中证 100 交易型开放式指数证券投资基金、中证 500 沪市交易型开放式指数证券投资基金、大成深证成份交易型开放式指数证券投资基金基金经理助理。2020 年 6 月 29 日起任深证成长 40 交易型开放式指数证券投资基金、大成深证成长 40 交易型开放式指数联接基金、大成中证 500 深市交易型开放式指数证券投资基金、大成 MSCI 中国 A 股质优价值 100 交易型开放式指数证券投资基金、大成 MSCI 中国 A 股质优价值 100 交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理。2021 年 4 月 30 日起任大成中证全指医疗保健设备与服务交易型开放式指数证券投资基金基金经理。2021 年 6 月 17 日任大成中证红利指数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。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，但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不存在同日反向交易。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。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

上半年，全球宏观经济继续在复苏的轨道上运行，带动大宗商品价格上涨。尽管受疫情影响，商品供需错配的格局短期内难以得到缓解，但通胀还未成为全球投资者关心的焦点。美国十年国债收益率在一季度显著上行后，二季度则震荡下行。全球流动性也较为宽裕，外资持续流入境内市场。而我国控制疫情较为出色，在本轮周期中也先于其它主要经济体复苏。相较于海外的“大放水”，国内的流动性释放较为克制，也在逐步有序退出非常规的宽松政策。

股票市场上半年则经历了较大的转折。从年初到春节前，市场延续了去年的风格，对消费、新能源等“赛道股”的追捧趋于狂热，少数股票快速上涨带领指数冲高。然而春节后，风格剧烈切换。部分白马股快速下跌，而之前受其“虹吸”影响丧失流动性的大量股票反而迎来转机，形成鲜明对比，价值风格重得青睐。进入二季度，市场止跌回稳，指数保持窄幅震荡。而白马股也出现分化，新能源股票高歌猛进，而传统行业龙头则相对表现不佳，成长风格又再占优。上半年市场基准沪深 300 指数上涨 0.24%。

本基金标的指数深成指上涨 4.78%，涨幅高于大盘。上半年，本基金申购赎回和份额交易情况均较为平稳。本基金基本保持满仓运作，严格根据标的指数成分股调整以及权重的变化及时调整投资组合。各项操作与指标均符合基金合同的要求。

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 17.551 元；本报告期基金份额净值增长率为 8.32%，业绩比较基准收益率为 4.78%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望下半年，宏观经济环境面临高度不确定性。新冠疫情反反复复，目前看来很难彻底根除，人类社会需要在抗疫和发展之间取得平衡。无论国内国外，除非放任通胀高企，否则因为疫情而投放的天量流动性终究要回收，如何平稳、有序地退出非常规的货币政策，又将成为各国政府面前的一道难题。而我们还要完成保民生、处置金融风险、科技强国等多重目标，任务更为艰巨。

对于股票市场，我们持总体中性观点。目前市场的估值体系极度分裂，相当多的股票估值处于历史低位，向下空间有限，以上证指数为代表的宽基指数也不会有太大风险。然而，在硬币的另一面，却是部分充满梦想的股票估值远远高于合理水平。这些股票聚集了大量杠杆资金，若出现超预期的利空事件，有可能引发局部剧烈波动，造成阶段性的市场冲击。

组合管理上，我们将严格按照基金合同的相关约定，紧密跟踪标的指数，按照标的指数成分股组成及其权重的变化调整投资组合，努力实现跟踪误差的最小化。

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、研究部、固定收益总部、数量与指数投资部、大类资产配置部、交易管理部、风险管理部、基金运营部、监察稽核部指定人员组成。公司估值委员会的相关成员均具备相应的专业胜任能力和相关工作经历，估值委员会成员中包括五名投资组合经理。

股票投资部、研究部、固定收益总部、数量与指数投资部、大类资产配置部、风险管理部负

责关注相关投资品种的动态，评判基金持有的投资品种是否处于不活跃的交易状态或者最近交易日后经济环境发生了重大变化或证券发行机构发生了影响证券价格的重大事件，从而确定估值日需要进行估值测算或者调整的投资品种；提出合理的数量分析模型对需要进行估值测算或者调整的投资品种进行公允价值定价与计量；定期对估值政策和程序进行评价，以保证其持续适用；交易管理部负责关注相关投资品种的流动性状况，协助反馈其市场交易信息；基金运营部负责日常的基金资产的估值业务，执行基金估值政策，并负责与托管行沟通估值调整事项；监察稽核部负责审核估值政策和程序的一致性，监督估值委员会工作流程中的风险控制，并负责估值调整事项的信息披露工作。

本基金的日常估值程序由基金运营部基金估值核算人员执行，并与托管银行的估值结果核对一致。基金估值政策的议定和修改采用集体讨论机制，投资组合经理作为估值小组成员，对持仓证券的交易情况、信息披露情况保持应有的职业敏感，向估值委员会提供估值参考信息，参与估值政策讨论。对需采用特别估值程序的证券，基金管理人及时启动特别估值程序，由估值委员会讨论议定特别估值方案并与托管行沟通后由基金运营部具体执行。

本基金管理人参与估值流程各方之间不存在任何重大利益冲突。截止报告期末本基金管理人已与中央国债登记结算有限责任公司及中证指数有限公司签署服务协议，由中央国债登记结算有限责任公司按约定提供银行间同业市场的估值数据，由中证指数有限公司按约定提供交易所交易的债券品种的估值数据和流通受限股票的折扣率数据。

4.7 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

在托管本基金的过程中，本基金托管人中国农业银行股份有限公司严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》相关法律法规的规定以及基金合同、托管协议的约定，对本基金基金管理人——大成基金管理有限公司 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日基金的投资运作，进行了认真、独立的会计核算和必要的投资监督，认真履行了托管人的义务，没有从事任何损害基金份额持有人利益的行为。

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

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

5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人认为,大成基金管理有限公司的信息披露事务符合《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》及其他相关法律法规的规定,基金管理人所编制和披露的本基金中期报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告等信息真实、准确、完整,未发现有关损害基金持有人利益的行为。

§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）**6.1 资产负债表**

会计主体：大成深证成份交易型开放式指数证券投资基金

报告截止日：2021 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2021 年 6 月 30 日	上年度末 2020 年 12 月 31 日
资 产：			
银行存款	6.4.3.1	3,029,491.44	2,657,506.24
结算备付金		-	21,531.68
存出保证金		20,969.85	27,191.29
交易性金融资产	6.4.3.2	122,229,956.87	165,833,217.17
其中：股票投资		122,229,956.87	165,833,217.17
基金投资		-	-
债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	6.4.3.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.3.4	-	-
应收证券清算款		144,864.51	871,601.67
应收利息	6.4.3.5	790.26	824.80
应收股利		-	-
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.3.6	-	-
资产总计		125,426,072.93	169,411,872.85
负债和所有者权益	附注号	本期末	上年度末

		2021 年 6 月 30 日	2020 年 12 月 31 日
负 债:			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.3.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		-	2,733.26
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		51,832.94	76,685.75
应付托管费		10,366.61	15,337.18
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.3.7	15,430.44	19,352.46
应交税费		-	22.17
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.3.8	119,302.56	215,000.00
负债合计		196,932.55	329,130.82
所有者权益:			
实收基金	6.4.3.9	108,696,548.55	158,967,244.81
未分配利润	6.4.3.10	16,532,591.83	10,115,497.22
所有者权益合计		125,229,140.38	169,082,742.03
负债和所有者权益总计		125,426,072.93	169,411,872.85

注：报告截止日 2021 年 06 月 30 日，基金份额净值 17.551 元，基金份额总额 7,135,342.00 份。

6.2 利润表

会计主体：大成深证成份交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日
一、收入		12,965,877.25	36,771,206.86
1. 利息收入		17,917.68	16,105.85
其中：存款利息收入	6.4.3.11	17,917.68	16,105.85
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		-	-
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填		25,485,870.60	4,005,468.73

列)			
其中：股票投资收益	6.4.3.12	24,806,413.92	2,104,474.81
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.3.13	-	-
资产支持证券投资收 益		-	-
贵金属投资收益	6.4.3.14	-	-
衍生工具收益	6.4.3.15	-	-
股利收益	6.4.3.16	679,456.68	1,900,993.92
3. 公允价值变动收益（损失 以“-”号填列）	6.4.3.17	-12,537,911.03	32,749,632.28
4. 汇兑收益（损失以“-”号 填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-”号 填列）	6.4.3.18	-	-
减：二、费用		587,891.95	951,267.42
1. 管理人报酬	6.4.6.2.1	334,652.91	606,023.75
2. 托管费	6.4.6.2.2	66,930.60	121,204.79
3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用	6.4.3.19	31,680.88	49,226.28
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支 出		-	-
6. 税金及附加		-	-
7. 其他费用	6.4.3.20	154,627.56	174,812.60
三、利润总额（亏损总额以“-” 号填列）		12,377,985.30	35,819,939.44
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-” 号填列）		12,377,985.30	35,819,939.44

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：大成深证成份交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者 权益（基金净值）	158,967,244.81	10,115,497.22	169,082,742.03
二、本期经营活 动产生的基金净 值变动数（本期	-	12,377,985.30	12,377,985.30

利润)			
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数(净值减少以“-”号填列)	-50,270,696.26	-5,960,890.69	-56,231,586.95
其中:1.基金申购款	-	-	-
2.基金赎回款	-50,270,696.26	-5,960,890.69	-56,231,586.95
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以“-”号填列)	-	-	-
五、期末所有者权益(基金净值)	108,696,548.55	16,532,591.83	125,229,140.38
项目	上年度可比期间 2020年1月1日至2020年6月30日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益(基金净值)	337,199,713.29	-85,580,719.28	251,618,994.01
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	35,819,939.44	35,819,939.44
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数(净值减少以“-”号填列)	-50,270,696.25	10,284,172.45	-39,986,523.80
其中:1.基金申购款	-	-	-
2.基金赎回款	-50,270,696.25	10,284,172.45	-39,986,523.80
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以“-”号填列)	-	-	-
五、期末所有者权益(基金净值)	286,929,017.04	-39,476,607.39	247,452,409.65

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

周立新

刘亚林

基金管理人负责人

主管会计工作负责人

会计机构负责人

6.4 报表附注

6.4.1 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

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。

6.4.2 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2008]1 号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85 号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2015]101 号《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》、财税[2016]36 号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46 号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70 号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、财税[2016]140 号《关于明确金融 房地产开发 教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税[2017]2 号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017]56 号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90 号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1) 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。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，暂适用简易计税方法，按照 3% 的征收率缴纳增值税。对资管产品在 2018 年 1 月 1 日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。

对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，对国债、地方政府债以及金融同业往来利息收入亦免征增值税。资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务，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。资管产品管理人运营资管产品转让 2017 年 12 月 31 日前取得的非货物期货，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非货物期货结算价格作为买入价计算销售额。

(2) 对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，股票的股息、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) 对基金取得的企业债券利息收入，应由发行债券的企业在向基金支付利息时代扣代缴 20% 的个人所得税。对基金从上市公司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，暂减按 50% 计入应纳税所得额；持股期限超过 1 年的，暂免征收个人所得税。对基金持有的上市公司限售股，解禁后取得的股息、红利收入，按照上述规定计算纳税，持股时间自解禁日起计算；解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按 50% 计入应纳税所得额。上述所得统一适用 20% 的税率计征个人所得税。

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

(5) 本基金的城市维护建设税、教育费附加和地方教育费附加等税费按照实际缴纳增值税额的适用比例计算缴纳。

6.4.3 重要财务报表项目的说明

6.4.3.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 6 月 30 日
活期存款	3,029,491.44
定期存款	—
其中：存款期限 1 个月以内	—
存款期限 1-3 个月	—
存款期限 3 个月以上	—
其他存款	—
合计	3,029,491.44

6.4.3.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 6 月 30 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	79,632,787.92	122,229,956.87	42,597,168.95
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	79,632,787.92	122,229,956.87	42,597,168.95

6.4.3.3 衍生金融资产/负债

无。

6.4.3.4 买入返售金融资产

6.4.3.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

无。

6.4.3.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

无。

6.4.3.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 6 月 30 日
应收活期存款利息	766.16
应收定期存款利息	—
应收其他存款利息	—
应收结算备付金利息	15.64
应收债券利息	—
应收资产支持证券利息	—
应收买入返售证券利息	—
应收申购款利息	—
应收黄金合约拆借孳息	—
应收出借证券利息	—
其他	8.46
合计	790.26

6.4.3.6 其他资产

无。

6.4.3.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 6 月 30 日
交易所市场应付交易费用	15,430.44
银行间市场应付交易费用	—
合计	15,430.44

6.4.3.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	—

应付赎回费	-
应付证券出借违约金	-
预提费用	84,302.56
应付指数使用费	35,000.00
合计	119,302.56

6.4.3.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	10,435,342.00	158,967,244.81
本期申购	-	-
本期赎回（以“-”号填列）	-3,300,000.00	-50,270,696.26
- 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	7,135,342.00	108,696,548.55

注：申购含红利再投份额（如有）。

6.4.3.10 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-40,829,315.05	50,944,812.27	10,115,497.22
本期利润	24,915,896.33	-12,537,911.03	12,377,985.30
本期基金份额交易产生的变动数	9,041,033.10	-15,001,923.79	-5,960,890.69
其中：基金申购款	-	-	-
基金赎回款	9,041,033.10	-15,001,923.79	-5,960,890.69
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-6,872,385.62	23,404,977.45	16,532,591.83

6.4.3.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	17,290.55
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	407.96
其他	219.17
合计	17,917.68

6.4.3.12 股票投资收益

6.4.3.12.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月30日
股票投资收益——买卖股票差价收入	4,381,233.03
股票投资收益——赎回差价收入	20,425,180.89
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	24,806,413.92

6.4.3.12.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月30日
卖出股票成交总额	9,872,856.53
减：卖出股票成本总额	5,491,623.50
买卖股票差价收入	4,381,233.03

6.4.3.12.3 股票投资收益——赎回差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月30日
赎回基金份额对价总额	56,231,586.95
减：现金支付赎回款总额	-3,200,059.05
减：赎回股票成本总额	39,006,465.11
赎回差价收入	20,425,180.89

6.4.3.12.4 股票投资收益——申购差价收入

无。

6.4.3.12.5 股票投资收益——证券出借差价收入

无。

6.4.3.13 债券投资收益

无。

6.4.3.14 贵金属投资收益

无。

6.4.3.15 衍生工具收益

无。

6.4.3.16 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
股票投资产生的股利收益	679,456.68
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	679,456.68

6.4.3.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
1. 交易性金融资产	-12,537,911.03
股票投资	-12,537,911.03
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	-12,537,911.03

6.4.3.18 其他收入

无。

6.4.3.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
交易所市场交易费用	31,680.88

银行间市场交易费用	-
合计	31,680.88

6.4.3.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
审计费用	24,795.19
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
银行划款手续费	325.00
指数使用费	70,000.00
合计	154,627.56

6.4.3.21 分部报告

无。

6.4.4 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.4.1 或有事项

无。

6.4.4.2 资产负债表日后事项

无。

6.4.5 关联方关系

6.4.5.1 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。

6.4.5.2 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
中国农业银行股份有限公司（“中国农业银行”）	基金托管人
光大证券股份有限公司（“光大证券”）	基金管理人的股东、基金销售机构

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.6 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.6.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.6.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2020 年 1 月 1 日至 2020 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	12,210,538.28	56.34	-	-

6.4.6.1.2 债券交易

无。

6.4.6.1.3 债券回购交易

无。

6.4.6.1.4 权证交易

无。

6.4.6.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2021年1月1日至2021年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	11,127.93	55.96	11,127.93	72.12
关联方名称	上年度可比期间 2020年1月1日至2020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	-	-	-	-

注：1. 上述佣金参考市场价格经本基金的基金管理人与对方协商确定，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。

6.4.6.2 关联方报酬

6.4.6.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2021年1月1日至2021年6月	2020年1月1日至2020年

	月 30 日	6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	334,652.91	606,023.75
其中：支付销售机构的客户维护费	-	-

注：支付基金管理人大成基金的管理人报酬按前一日基金资产净值 0.50%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日管理人报酬 = 前一日基金资产净值 $\times$ 0.50% / 当年天数。

6.4.6.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	66,930.60	121,204.79

注：支付基金托管人中国农业银行的托管费按前一日基金资产净值 0.10%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日托管费 = 前一日基金资产净值 $\times$ 0.10% / 当年天数。

6.4.6.3 与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易

无。

6.4.6.4 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

6.4.6.4.1 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。

6.4.6.4.2 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。

6.4.6.5 各关联方投资本基金的情况

6.4.6.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

无。

6.4.6.5.2 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。

6.4.6.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国农业银行	3,029,491.44	17,290.55	5,826,243.14	15,776.93

注：本基金由基金托管人保管的银行存款，按银行约定利率计息。

6.4.6.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

无。

6.4.6.8 其他关联交易事项的说明

无。

6.4.7 利润分配情况

无。

6.4.8 期末(2021 年 6 月 30 日)本基金持有的流通受限证券

6.4.8.1 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

6.4.8.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量(单位：股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
300614	百川畅银	2021 年 5 月 18 日	2021 年 11 月 25 日	新股锁定	9.19	40.38	268	2,462.92	10,821.84	-
300926	博俊科技	2020 年 12 月 29 日	2021 年 7 月 12 日	新股锁定	10.76	22.20	359	3,862.84	7,969.80	-
300927	江天化学	2020 年 12 月 29 日	2021 年 7 月 7 日	新股锁定	13.39	30.10	217	2,905.63	6,531.70	-
300929	华骐环保	2021 年 1 月 12 日	2021 年 7 月 21 日	新股锁定	13.87	29.55	183	2,538.21	5,407.65	-

300932	三友联众	2021 年 1 月 15 日	2021 年 7 月 22 日	新股锁 定	24.69	31.71	315	7,777.35	9,988.65	-
300933	中辰股份	2021 年 1 月 15 日	2021 年 7 月 22 日	新股锁 定	3.37	10.44	1,112	3,747.44	11,609.28	-
300937	药易购	2021 年 1 月 20 日	2021 年 7 月 27 日	新股锁 定	12.25	53.71	244	2,989.00	13,105.24	-
300940	南极光	2021 年 1 月 27 日	2021 年 8 月 3 日	新股锁 定	12.76	43.38	307	3,917.32	13,317.66	-
300941	创识科技	2021 年 2 月 2 日	2021 年 8 月 9 日	新股锁 定	21.31	49.94	193	4,112.83	9,638.42	-
300942	易瑞生物	2021 年 2 月 2 日	2021 年 8 月 9 日	新股锁 定	5.31	28.52	443	2,352.33	12,634.36	-
300943	春晖智控	2021 年 2 月 3 日	2021 年 8 月 10 日	新股锁 定	9.79	23.01	255	2,496.45	5,867.55	-
300945	曼卡龙	2021 年 2 月 3 日	2021 年 8 月 10 日	新股锁 定	4.56	18.88	462	2,106.72	8,722.56	-
300950	德固特	2021 年 2 月 24 日	2021 年 9 月 3 日	新股锁 定	8.41	39.13	219	1,841.79	8,569.47	-
300952	恒辉安防	2021 年 3 月 3 日	2021 年 9 月 13 日	新股锁 定	11.72	27.08	255	2,988.60	6,905.40	-
300953	震裕科技	2021 年 3 月 11 日	2021 年 9 月 22 日	新股锁 定	28.77	99.85	127	3,653.79	12,680.95	-
300955	嘉亨家化	2021 年 3 月 16 日	2021 年 9 月 24 日	新股锁 定	16.53	46.07	148	2,446.44	6,818.36	-
300956	英力股份	2021 年 3 月 16 日	2021 年 9 月 27 日	新股锁 定	12.85	25.80	189	2,428.65	4,876.20	-
300957	贝泰妮	2021 年 3 月 18 日	2021 年 9 月 27 日	新股锁 定	47.33	251.96	82	3,881.06	20,660.72	-
300958	建工修复	2021 年 3 月 18 日	2021 年 9 月 29 日	新股锁 定	8.53	27.22	300	2,559.00	8,166.00	-

		日	日							
300960	通业科技	2021 年 3 月 22 日	2021 年 9 月 29 日	新股锁 定	12.08	23.06	234	2,826.72	5,396.04	-
300961	深水海纳	2021 年 3 月 23 日	2021 年 9 月 30 日	新股锁 定	8.48	22.07	313	2,654.24	6,907.91	-
300962	中金辐照	2021 年 3 月 29 日	2021 年 10 月 11 日	新股锁 定	3.40	16.37	576	1,958.40	9,429.12	-
300963	中洲特材	2021 年 3 月 30 日	2021 年 10 月 11 日	新股锁 定	12.13	22.49	218	2,644.34	4,902.82	-
300966	共同药业	2021 年 3 月 31 日	2021 年 10 月 11 日	新股锁 定	8.24	31.54	286	2,356.64	9,020.44	-
300967	晓鸣股份	2021 年 4 月 2 日	2021 年 10 月 13 日	新股锁 定	4.54	11.54	408	1,852.32	4,708.32	-
300968	格林精密	2021 年 4 月 6 日	2021 年 10 月 15 日	新股锁 定	6.87	12.07	518	3,558.66	6,252.26	-
300971	博亚精工	2021 年 4 月 7 日	2021 年 10 月 15 日	新股锁 定	18.24	28.29	211	3,848.64	5,969.19	-
300973	立高食品	2021 年 4 月 8 日	2021 年 10 月 15 日	新股锁 定	28.28	115.71	102	2,884.56	11,802.42	-
300975	商络电子	2021 年 4 月 14 日	2021 年 10 月 21 日	新股锁 定	5.48	13.03	483	2,646.84	6,293.49	-
300978	东箭科技	2021 年 4 月 15 日	2021 年 10 月 26 日	新股锁 定	8.42	13.60	386	3,250.12	5,249.60	-
300981	中红医疗	2021 年 4 月 19 日	2021 年 10 月 27 日	新股锁 定	48.59	90.39	86	4,178.74	7,773.54	-
300982	苏文电能	2021 年 4 月 19 日	2021 年 10 月 27 日	新股锁 定	15.83	45.29	317	5,018.11	14,356.93	-
300986	志特新材	2021 年 4 月 21 日	2021 年 11 月 1 日	新股锁 定	14.79	30.57	114	1,686.06	3,484.98	-
300991	创益通	2021 年	2021 年	新股锁	13.06	26.51	254	3,317.24	6,733.54	-

		5月12日	11月22日	定						
300992	泰福泵业	2021年5月17日	2021年11月25日	新股锁定	9.36	20.32	200	1,872.00	4,064.00	-
300993	玉马遮阳	2021年5月17日	2021年11月24日	新股锁定	12.10	19.29	295	3,569.50	5,690.55	-
300995	奇德新材	2021年5月17日	2021年11月26日	新股锁定	14.72	23.32	191	2,811.52	4,454.12	-
300996	普联软件	2021年5月26日	2021年12月3日	新股锁定	20.81	42.23	162	3,371.22	6,841.26	-
300997	欢乐家	2021年5月26日	2021年12月2日	新股锁定	4.94	13.05	480	2,371.20	6,264.00	-
300998	宁波方正	2021年5月25日	2021年12月2日	新股锁定	6.02	21.32	201	1,210.02	4,285.32	-
301002	崧盛股份	2021年5月27日	2021年12月7日	新股锁定	18.71	57.62	128	2,394.88	7,375.36	-
301007	德迈仕	2021年6月4日	2021年12月16日	新股锁定	5.29	14.44	303	1,602.87	4,375.32	-
301009	可靠股份	2021年6月8日	2021年12月17日	新股锁定	12.54	27.89	345	4,326.30	9,622.05	-
301010	晶雪节能	2021年6月9日	2021年12月20日	新股锁定	7.83	17.61	218	1,706.94	3,838.98	-
301011	华立科技	2021年6月9日	2021年12月17日	新股锁定	14.20	33.84	175	2,485.00	5,922.00	-
301012	扬电科技	2021年6月15日	2021年12月22日	新股锁定	8.05	24.26	170	1,368.50	4,124.20	-
301013	利和兴	2021年6月21日	2021年12月29日	新股锁定	8.72	27.11	442	3,854.24	11,982.62	-
301015	百洋医药	2021年6月22日	2021年12月30日	新股锁定	7.64	38.83	246	1,879.44	9,552.18	-

301016	雷尔伟	2021 年 6 月 23 日	2021 年 12 月 30 日	新股锁 定	13.75	32.98	130	1,787.50	4,287.40	-
301020	密封科 技	2021 年 6 月 28 日	2021 年 7 月 6 日	新股未 上市	10.64	10.64	3,044	32,388.16	32,388.16	-
301021	英诺激 光	2021 年 6 月 28 日	2021 年 7 月 6 日	新股未 上市	9.46	9.46	2,770	26,204.20	26,204.20	-

注：1. 根据《上海证券交易所科创板股票公开发行自律委员会促进科创板初期企业平稳发行行业倡导建议》，本基金获配的科创板股票如经抽签方式确定需要锁定的，锁定期限为自发行人股票上市之日起 6 个月。根据《上海证券交易所科创板上市公司股东以向特定机构投资者询价转让和配售方式减持股份实施细则》，基金通过询价转让受让的股份，在受让后 6 个月内不得转让。

2. 根据《深圳证券交易所创业板首次公开发行证券发行与承销业务实施细则》，发行人和主承销商可以采用摇号限售方式或比例限售方式，安排基金通过网下发行获配的部分创业板股票设置不低于 6 个月的限售期。

3. 基金可使用以基金名义开设的股票账户，选择网上或者网下一种方式进行新股申购。其中基金参与网下申购获得的新股或作为战略投资者参与配售获得的新股，在新股上市后的约定期限内不能自由转让；基金参与网上申购获配的新股，从新股获配日至新股上市日之间不能自由转让。

6.4.8.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末 估值单 价	复牌日期	复牌 开盘单价	数量 (股)	期末 成本总额	期末 估值总额	备注
002024	苏宁易购	2021 年 06 月 16 日	重大事项	5.59	2021 年 07 月 06 日	6.15	36,000	568,643.33	201,240.00	-

注：本基金截至本期末止持有以上因公布的重大事项可能产生重大影响而被暂时停牌的股票，该类股票将在所公布事项的重大影响消除后，经交易所批准复牌。

6.4.8.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.8.3.1 银行间市场债券正回购

无。

6.4.8.3.2 交易所市场债券正回购

无。

6.4.8.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

无。

6.4.9 金融工具风险及管理

无。

6.4.9.1 风险管理政策和组织架构

本基金是指数型基金，紧密跟踪深证成份指数，具有和标的指数所代表的股票市场相似的风险收益特征，属于证券投资基金中风险较高、收益较高的品种。本基金以标的指数成份股、备选成份股为主要投资对象。本基金采用完全复制法，跟踪深证成份指数，以完全按照标的指数成份股组成及其权重构建基金股票投资组合为原则，进行被动式指数化投资。股票在投资组合中的权重原则上根据标的指数成份股及其权重的变动而进行相应调整。但在因特殊情况（如流动性不足等）导致无法获得足够数量的股票时，基金管理人将搭配使用其他合理方法进行适当的替代，力求与标的指数的跟踪偏离度与跟踪误差的最小化。

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。

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

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

于本期末，本基金无债券投资（上年度末：同）。

6.4.9.3 流动性风险

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

6.4.9.3.1 金融资产和金融负债的到期期限分析

无。

6.4.9.3.2 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。

6.4.9.4 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。

6.4.9.4.1 利率风险

利率风险是指金融工具的公允价值或现金流量受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、结算备付金和存出保证金等。

6.4.9.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2021 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	3,029,491.44	-	-	-	3,029,491.44
存出保证金	20,969.85	-	-	-	20,969.85
交易性金融资产	-	-	-	122,229,956.87	122,229,956.87
应收利息	-	-	-	790.26	790.26
应收证券清算款	-	-	-	144,864.51	144,864.51
资产总计	3,050,461.29	-	-	122,375,611.64	125,426,072.93
负债					
应付管理人报酬	-	-	-	51,832.94	51,832.94

应付托管费	-	-	-	10,366.61	10,366.61
应付交易费用	-	-	-	15,430.44	15,430.44
其他负债	-	-	-	119,302.56	119,302.56
负债总计	-	-	-	196,932.55	196,932.55
利率敏感度缺口	3,050,461.29	-	-	-122,178,679.09	125,229,140.38
上年度末 2020 年 12 月 31 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	2,657,506.24	-	-	-	2,657,506.24
结算备付金	21,531.68	-	-	-	21,531.68
存出保证金	27,191.29	-	-	-	27,191.29
交易性金融资产	-	-	-	165,833,217.17	165,833,217.17
应收利息	-	-	-	824.80	824.80
应收证券清算款	-	-	-	871,601.67	871,601.67
资产总计	2,706,229.21	-	-	166,705,643.64	169,411,872.85
负债					
应付管理人报酬	-	-	-	76,685.75	76,685.75
应付托管费	-	-	-	15,337.18	15,337.18
应付证券清算款	-	-	-	2,733.26	2,733.26
应付交易费用	-	-	-	19,352.46	19,352.46
应交税费	-	-	-	22.17	22.17
其他负债	-	-	-	215,000.00	215,000.00
负债总计	-	-	-	329,130.82	329,130.82
利率敏感度缺口	2,706,229.21	-	-	-166,376,512.82	169,082,742.03

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。

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

6.4.9.4.2 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。本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无重大外汇风险。

6.4.9.4.3 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和债券，所面临的其他价格风险来源于单个证券发行主体自身经营情况或特殊事项的影响，也可能来源于证

券市场整体波动的影响。

本基金采用完全复制法跟踪深证成份指数，以完全按照标的指数成份股组成及其权重构建基金股票投资组合为原则，通过指数化分散投资降低其他价格风险。本基金投资组合中，深证深证成份指数成份股和备选成份股股票投资比例不低于基金资产净值的 95%。此外，本基金的基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控，定期运用多种定量方法对基金进行风险度量，包括 VaR (Value at Risk) 指标等来测试本基金面临的潜在价格风险，及时可靠地对风险进行跟踪和控制。

6.4.9.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 6 月 30 日		上年度末 2020 年 12 月 31 日	
	公允价值	占基金资产净值比例 (%)	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
交易性金融资产—股票投资	122,229,956.87	97.61	165,833,217.17	98.08
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	122,229,956.87	97.61	165,833,217.17	98.08

6.4.9.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除业绩比较基准以外的其他市场变量保持不变		
	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2021 年 6 月 30 日）	上年度末（2020 年 12 月 31 日）
分析	1. 业绩比较基准上升 5%	6,061,027.04	8,312,680.09
	2. 业绩比较基准下降 5%	-6,061,027.04	-8,312,680.09

6.4.10 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	122,229,956.87	97.45
	其中：股票	122,229,956.87	97.45
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	3,029,491.44	2.42
8	其他各项资产	166,624.62	0.13
9	合计	125,426,072.93	100.00

7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 报告期末指数投资按行业分类的境内股票投资组合

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	2,403,339.47	1.92
B	采矿业	694,525.07	0.55
C	制造业	88,096,922.95	70.35
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	772,993.10	0.62
E	建筑业	147,018.96	0.12
F	批发和零售业	1,161,733.70	0.93
G	交通运输、仓储和邮政业	1,414,882.53	1.13
H	住宿和餐饮业	—	—
I	信息传输、软件和信息技术服务业	7,186,102.51	5.74
J	金融业	9,142,386.87	7.30
K	房地产业	3,018,459.54	2.41
L	租赁和商务服务业	1,422,498.53	1.14

M	科学研究和技术服务业	1,181,536.00	0.94
N	水利、环境和公共设施管理业	449,615.09	0.36
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	236,057.00	0.19
Q	卫生和社会工作	3,081,156.90	2.46
R	文化、体育和娱乐业	1,002,568.54	0.80
S	综合	302,770.44	0.24
	合计	121,714,567.20	97.19

7.2.2 报告期末积极投资按行业分类的境内股票投资组合

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	4,708.32	0.00
B	采矿业	-	-
C	制造业	403,095.41	0.32
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	14,356.93	0.01
F	批发和零售业	37,673.47	0.03
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	16,479.68	0.01
J	金融业	-	-
K	房地产业	7,772.46	0.01
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	31,303.40	0.02
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	515,389.67	0.41

7.2.3 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

7.3.1 期末指数投资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	300750	宁德时代	9,800	5,241,040.00	4.19
2	000858	五粮液	16,800	5,004,552.00	4.00
3	000333	美的集团	46,007	3,283,519.59	2.62
4	300059	东方财富	75,046	2,460,758.34	1.97
5	000651	格力电器	44,800	2,334,080.00	1.86
6	002415	海康威视	34,825	2,246,212.50	1.79
7	002594	比亚迪	7,700	1,932,700.00	1.54
8	002475	立讯精密	40,246	1,851,316.00	1.48
9	000001	平安银行	80,100	1,811,862.00	1.45
10	300760	迈瑞医疗	3,700	1,776,185.00	1.42
11	000568	泸州老窖	7,100	1,675,174.00	1.34
12	000725	京东方 A	255,100	1,591,824.00	1.27
13	000002	万科 A	63,600	1,514,316.00	1.21
14	300015	爱尔眼科	21,057	1,494,625.86	1.19
15	002714	牧原股份	21,806	1,326,240.92	1.06
16	002142	宁波银行	29,988	1,168,632.36	0.93
17	300124	汇川技术	15,391	1,142,935.66	0.91
18	300122	智飞生物	6,100	1,139,053.00	0.91
19	300014	亿纬锂能	10,731	1,115,272.83	0.89
20	002304	洋河股份	5,362	1,111,006.40	0.89
21	000661	长春高新	2,760	1,068,120.00	0.85
22	002230	科大讯飞	15,375	1,039,042.50	0.83
23	300274	阳光电源	8,680	998,720.80	0.80
24	002352	顺丰控股	14,700	995,190.00	0.79
25	300347	泰格医药	5,050	976,165.00	0.78
26	002027	分众传媒	97,888	921,126.08	0.74
27	300782	卓胜微	1,708	918,050.00	0.73
28	002241	歌尔股份	21,200	906,088.00	0.72
29	002812	恩捷股份	3,870	905,967.00	0.72
30	300142	沃森生物	14,200	876,140.00	0.70
31	000100	TCL 科技	113,600	869,040.00	0.69
32	002460	赣锋锂业	7,150	865,793.50	0.69
33	000063	中兴通讯	25,600	850,688.00	0.68
34	002271	东方雨虹	14,553	805,071.96	0.64
35	000338	潍柴动力	40,800	729,096.00	0.58
36	002129	中环股份	18,400	710,240.00	0.57
37	300498	温氏股份	45,305	651,032.85	0.52

38	300896	爱美客	800	631,104.00	0.50
39	002049	紫光国微	3,900	601,341.00	0.48
40	300999	金龙鱼	7,000	594,720.00	0.47
41	002709	天赐材料	5,496	585,763.68	0.47
42	002410	广联达	8,500	579,700.00	0.46
43	002371	北方华创	2,000	554,760.00	0.44
44	002311	海大集团	6,780	553,248.00	0.44
45	300450	先导智能	9,100	547,274.00	0.44
46	000538	云南白药	4,600	532,312.00	0.43
47	000799	酒鬼酒	2,000	511,200.00	0.41
48	002821	凯莱英	1,300	484,380.00	0.39
49	000625	长安汽车	17,788	467,468.64	0.37
50	002493	荣盛石化	26,525	458,086.75	0.37
51	300408	三环集团	10,300	436,926.00	0.35
52	300759	康龙化成	2,000	433,980.00	0.35
53	300601	康泰生物	2,900	432,100.00	0.35
54	300496	中科创达	2,700	424,062.00	0.34
55	300595	欧普康视	4,040	418,342.00	0.33
56	002179	中航光电	5,261	415,724.22	0.33
57	300454	深信服	1,600	415,168.00	0.33
58	300413	芒果超媒	6,030	413,658.00	0.33
59	000776	广发证券	26,900	407,266.00	0.33
60	002050	三花智控	16,900	405,262.00	0.32
61	300012	华测检测	12,400	395,312.00	0.32
62	000166	申万宏源	83,560	391,060.80	0.31
63	002841	视源股份	3,120	387,784.80	0.31
64	000157	中联重科	41,300	381,612.00	0.30
65	002074	国轩高科	8,690	378,536.40	0.30
66	002340	格林美	40,420	377,927.00	0.30
67	300751	迈为股份	800	363,760.00	0.29
68	300433	蓝思科技	12,159	357,596.19	0.29
69	002601	龙佰集团	10,300	356,174.00	0.28
70	002001	新 和 成	12,198	349,838.64	0.28
71	000963	华东医药	7,395	340,243.95	0.27
72	300003	乐普医疗	10,426	334,883.12	0.27
73	300285	国瓷材料	6,800	331,500.00	0.26
74	002236	大华股份	15,600	329,160.00	0.26
75	000768	中航西飞	12,300	323,244.00	0.26
76	002008	大族激光	8,000	323,120.00	0.26
77	300529	健帆生物	3,680	317,804.80	0.25
78	300661	圣邦股份	1,250	315,912.50	0.25
79	002568	百润股份	3,320	314,702.80	0.25

80	000786	北新建材	8,000	314,000.00	0.25
81	001979	招商蛇口	28,501	312,085.95	0.25
82	002185	华天科技	19,974	307,399.86	0.25
83	002007	华兰生物	8,360	306,644.80	0.24
84	300207	欣旺达	9,300	302,808.00	0.24
85	000009	中国宝安	16,572	302,770.44	0.24
86	000895	双汇发展	9,300	295,740.00	0.24
87	000876	新希望	20,000	293,400.00	0.23
88	002202	金风科技	23,736	288,629.76	0.23
89	300316	晶盛机电	5,680	286,840.00	0.23
90	000938	紫光股份	12,947	283,280.36	0.23
91	002648	卫星石化	6,860	268,843.40	0.21
92	002736	国信证券	24,700	265,525.00	0.21
93	000301	东方盛虹	12,700	265,430.00	0.21
94	002624	完美世界	11,050	264,205.50	0.21
95	000069	华侨城 A	34,600	257,424.00	0.21
96	000977	浪潮信息	9,053	254,660.89	0.20
97	002555	三七互娱	10,600	254,612.00	0.20
98	000425	徐工机械	39,400	250,978.00	0.20
99	300253	卫宁健康	15,347	249,695.69	0.20
100	000783	长江证券	33,700	246,684.00	0.20
101	300763	锦浪科技	1,360	245,616.00	0.20
102	000066	中国长城	16,704	243,878.40	0.19
103	300037	新宙邦	2,400	240,240.00	0.19
104	000596	古井贡酒	1,000	239,500.00	0.19
105	002607	中公教育	11,300	236,057.00	0.19
106	300136	信维通信	7,620	235,305.60	0.19
107	002625	光启技术	11,140	231,823.40	0.19
108	000516	国际医学	12,300	231,363.00	0.18
109	002384	东山精密	11,100	231,324.00	0.18
110	300146	汤臣倍健	7,000	230,300.00	0.18
111	300558	贝达药业	2,100	227,304.00	0.18
112	002044	美年健康	24,904	226,875.44	0.18
113	300676	华大基因	1,900	225,340.00	0.18
114	002138	顺络电子	5,800	224,866.00	0.18
115	300677	英科医疗	1,800	224,640.00	0.18
116	000547	航天发展	11,900	224,553.00	0.18
117	300144	宋城演艺	13,151	220,936.80	0.18
118	002459	晶澳科技	4,500	220,500.00	0.18
119	002353	杰瑞股份	4,900	219,030.00	0.17
120	002223	鱼跃医疗	5,730	218,484.90	0.17
121	002405	四维图新	14,850	218,295.00	0.17

122	002797	第一创业	30,120	215,056.80	0.17
123	300841	康华生物	800	215,040.00	0.17
124	000988	华工科技	9,100	214,032.00	0.17
125	300628	亿联网络	2,550	213,690.00	0.17
126	000703	恒逸石化	17,366	207,523.70	0.17
127	300033	同花顺	1,800	203,004.00	0.16
128	002414	高德红外	7,310	201,609.80	0.16
129	002024	苏宁易购	36,000	201,240.00	0.16
130	300699	光威复材	2,640	200,508.00	0.16
131	002508	老板电器	4,290	199,485.00	0.16
132	002920	德赛西威	1,800	198,144.00	0.16
133	002602	世纪华通	30,709	197,151.78	0.16
134	002252	上海莱士	26,220	196,387.80	0.16
135	002444	巨星科技	5,700	194,256.00	0.16
136	000860	顺鑫农业	4,590	193,606.20	0.15
137	000728	国元证券	24,250	193,272.50	0.15
138	002030	达安基因	9,065	192,540.60	0.15
139	300073	当升科技	3,400	191,046.00	0.15
140	300725	药石科技	1,200	190,692.00	0.15
141	002013	中航机电	18,862	189,940.34	0.15
142	002600	领益智造	20,600	189,314.00	0.15
143	002180	纳思达	5,800	186,760.00	0.15
144	000807	云铝股份	15,400	183,260.00	0.15
145	002402	和而泰	7,600	182,172.00	0.15
146	002439	启明星辰	6,200	179,862.00	0.14
147	002250	联化科技	6,400	178,560.00	0.14
148	000630	铜陵有色	65,600	178,432.00	0.14
149	000830	鲁西化工	9,500	177,935.00	0.14
150	002497	雅化集团	7,800	177,684.00	0.14
151	002385	大北农	26,050	177,140.00	0.14
152	002156	通富微电	7,300	175,492.00	0.14
153	002078	太阳纸业	13,100	174,885.00	0.14
154	002791	坚朗五金	900	174,645.00	0.14
155	300308	中际旭创	4,520	174,110.40	0.14
156	300724	捷佳伟创	1,500	174,015.00	0.14
157	000739	普洛药业	5,900	173,460.00	0.14
158	000513	丽珠集团	3,467	173,419.34	0.14
159	002507	涪陵榨菜	4,600	173,236.00	0.14
160	002080	中材科技	6,580	172,198.60	0.14
161	000656	金科股份	29,600	171,384.00	0.14
162	002463	沪电股份	11,000	170,170.00	0.14
163	002064	华峰化学	11,900	168,980.00	0.13

164	300458	全志科技	1,923	168,570.18	0.13
165	002212	天融信	8,500	168,045.00	0.13
166	000039	中集集团	9,160	166,528.80	0.13
167	002938	鹏鼎控股	4,600	165,048.00	0.13
168	000708	中信特钢	7,890	164,427.60	0.13
169	002456	欧菲光	18,500	164,280.00	0.13
170	002422	科伦药业	8,200	163,590.00	0.13
171	300357	我武生物	2,540	162,864.80	0.13
172	002075	沙钢股份	14,900	162,559.00	0.13
173	002511	中顺洁柔	5,900	162,545.00	0.13
174	002127	南极电商	16,550	161,693.50	0.13
175	300223	北京君正	1,600	161,472.00	0.13
176	003816	中国广核	60,000	160,200.00	0.13
177	002747	埃斯顿	4,100	160,105.00	0.13
178	300001	特锐德	5,300	159,583.00	0.13
179	300088	长信科技	19,200	158,592.00	0.13
180	002603	以岭药业	5,303	154,635.48	0.12
181	000423	东阿阿胶	4,300	154,413.00	0.12
182	002157	正邦科技	12,900	154,155.00	0.12
183	002916	深南电路	1,384	153,803.92	0.12
184	000983	山西焦煤	18,410	152,987.10	0.12
185	300244	迪安诊断	3,972	152,127.60	0.12
186	300463	迈克生物	3,600	151,524.00	0.12
187	000825	太钢不锈	20,200	151,298.00	0.12
188	300383	光环新网	10,500	151,095.00	0.12
189	002028	思源电气	4,900	150,871.00	0.12
190	000021	深科技	7,866	150,555.24	0.12
191	300618	寒锐钴业	1,892	149,165.28	0.12
192	002465	海格通信	15,700	148,522.00	0.12
193	300832	新产业	2,400	147,840.00	0.12
194	300009	安科生物	9,786	145,811.40	0.12
195	002409	雅克科技	1,800	145,800.00	0.12
196	000960	锡业股份	9,021	144,606.63	0.12
197	002092	中泰化学	13,900	142,753.00	0.11
198	002120	韵达股份	10,529	142,457.37	0.11
199	000050	深天马 A	10,000	141,800.00	0.11
200	002673	西部证券	17,166	141,619.50	0.11
201	002152	广电运通	10,850	141,375.50	0.11
202	002706	良信股份	6,260	141,100.40	0.11
203	000750	国海证券	33,265	141,043.60	0.11
204	300115	长盈精密	6,836	140,821.60	0.11
205	000932	华菱钢铁	21,260	140,316.00	0.11

206	002373	千方科技	8,400	140,280.00	0.11
207	002541	鸿路钢构	2,400	140,040.00	0.11
208	002273	水晶光电	9,514	139,760.66	0.11
209	002065	东华软件	17,400	137,982.00	0.11
210	002151	北斗星通	3,150	135,670.50	0.11
211	300070	碧水源	18,514	135,337.34	0.11
212	300866	安克创新	800	133,976.00	0.11
213	000975	银泰黄金	14,077	133,872.27	0.11
214	002299	圣农发展	5,600	133,728.00	0.11
215	300296	利亚德	16,850	131,767.00	0.11
216	000998	隆平高科	8,200	131,528.00	0.11
217	300747	锐科激光	1,150	131,169.00	0.10
218	002572	索菲亚	5,408	130,873.60	0.10
219	300630	普利制药	2,486	130,266.40	0.10
220	000878	云南铜业	10,000	128,300.00	0.10
221	300482	万孚生物	1,980	128,086.20	0.10
222	000723	美锦能源	16,900	127,764.00	0.10
223	002985	北摩高科	1,300	126,750.00	0.10
224	300623	捷捷微电	3,350	126,730.50	0.10
225	002131	利欧股份	54,034	126,439.56	0.10
226	002500	山西证券	18,680	125,342.80	0.10
227	002557	洽洽食品	2,900	124,990.00	0.10
228	300685	艾德生物	1,200	124,896.00	0.10
229	000617	中油资本	20,720	124,734.40	0.10
230	000623	吉林敖东	8,020	124,229.80	0.10
231	000012	南玻A	12,039	123,279.36	0.10
232	002690	美亚光电	2,200	122,672.00	0.10
233	002436	兴森科技	11,100	122,100.00	0.10
234	002926	华西证券	12,600	121,338.00	0.10
235	002626	金达威	2,700	120,690.00	0.10
236	000591	太阳能	19,300	120,239.00	0.10
237	300271	华宇软件	6,231	119,946.75	0.10
238	002019	亿帆医药	6,900	119,025.00	0.10
239	002430	杭氧股份	3,400	117,606.00	0.09
240	000997	新大陆	7,050	116,959.50	0.09
241	000738	航发控制	5,600	116,648.00	0.09
242	300118	东方日升	6,000	116,400.00	0.09
243	300024	机器人	10,866	115,940.22	0.09
244	300058	蓝色光标	19,019	115,064.95	0.09
245	300373	扬杰科技	1,900	115,026.00	0.09
246	002382	蓝帆医疗	5,500	114,675.00	0.09
247	002025	航天电器	2,270	113,885.90	0.09

248	000831	五矿稀土	5,900	113,870.00	0.09
249	002958	青农商行	26,500	113,420.00	0.09
250	002966	苏州银行	15,400	113,190.00	0.09
251	300251	光线传媒	10,380	112,207.80	0.09
252	002294	信立泰	3,400	111,860.00	0.09
253	000027	深圳能源	12,140	111,323.80	0.09
254	002683	宏大爆破	4,000	111,080.00	0.09
255	000686	东北证券	13,020	110,019.00	0.09
256	300379	东方通	3,840	109,401.60	0.09
257	300346	南大光电	2,800	108,304.00	0.09
258	300054	鼎龙股份	5,900	107,675.00	0.09
259	002390	信邦制药	10,200	106,896.00	0.09
260	002123	梦网科技	5,900	106,554.00	0.09
261	002675	东诚药业	5,000	105,350.00	0.08
262	300017	网宿科技	17,952	105,019.20	0.08
263	000581	威孚高科	5,000	104,150.00	0.08
264	002597	金禾实业	3,000	104,100.00	0.08
265	000060	中金岭南	23,000	103,960.00	0.08
266	300418	昆仑万维	6,300	103,194.00	0.08
267	000158	常山北明	8,970	103,065.30	0.08
268	300315	掌趣科技	24,200	102,850.00	0.08
269	002268	卫 士 通	5,260	102,464.80	0.08
270	000961	中南建设	17,250	102,120.00	0.08
271	002372	伟星新材	4,940	102,109.80	0.08
272	300773	拉卡拉	3,600	101,628.00	0.08
273	002831	裕同科技	3,420	101,539.80	0.08
274	002056	横店东磁	7,800	101,400.00	0.08
275	002756	永兴材料	1,700	100,963.00	0.08
276	002081	金 螳 螂	12,663	100,290.96	0.08
277	000540	中天金融	36,526	99,715.98	0.08
278	002174	游族网络	5,800	99,586.00	0.08
279	002429	兆驰股份	16,400	99,548.00	0.08
280	002153	石基信息	4,229	99,423.79	0.08
281	002408	齐翔腾达	8,000	99,360.00	0.08
282	300888	稳健医疗	800	98,896.00	0.08
283	002506	协鑫集成	28,400	98,832.00	0.08
284	000401	冀东水泥	8,000	98,800.00	0.08
285	002595	豪迈科技	3,700	98,790.00	0.08
286	002389	航天彩虹	4,500	98,235.00	0.08
287	300474	景嘉微	1,000	97,920.00	0.08
288	000933	神火股份	10,300	97,335.00	0.08
289	000709	河钢股份	39,500	97,170.00	0.08

290	300212	易华录	3,599	96,849.09	0.08
291	002727	一心堂	2,900	96,019.00	0.08
292	300294	博雅生物	2,650	95,797.50	0.08
293	300775	三角防务	2,500	95,500.00	0.08
294	300182	捷成股份	19,134	95,478.66	0.08
295	300777	中简科技	2,100	94,878.00	0.08
296	002939	长城证券	8,500	94,605.00	0.08
297	002558	巨人网络	7,100	94,430.00	0.08
298	300476	胜宏科技	4,300	93,955.00	0.08
299	002195	二三四五	46,164	93,712.92	0.07
300	002643	万润股份	5,200	92,456.00	0.07
301	300348	长亮科技	5,050	92,415.00	0.07
302	300298	三诺生物	2,900	90,828.00	0.07
303	002851	麦格米特	2,900	90,567.00	0.07
304	000999	华润三九	3,382	90,468.50	0.07
305	300166	东方国信	7,239	89,474.04	0.07
306	002032	苏泊尔	1,400	89,306.00	0.07
307	000902	新洋丰	5,702	89,122.26	0.07
308	002221	东华能源	8,100	88,695.00	0.07
309	000671	阳光城	17,000	88,400.00	0.07
310	002396	星网锐捷	4,100	87,535.00	0.07
311	002745	木林森	6,500	87,100.00	0.07
312	000488	晨鸣纸业	10,700	87,098.00	0.07
313	002146	荣盛发展	15,400	86,856.00	0.07
314	002023	海特高新	5,800	86,536.00	0.07
315	002010	传化智联	11,200	86,352.00	0.07
316	000778	新兴铸管	23,200	86,304.00	0.07
317	000718	苏宁环球	10,409	86,290.61	0.07
318	002191	劲嘉股份	8,100	86,184.00	0.07
319	002281	光迅科技	3,500	86,100.00	0.07
320	000690	宝新能源	16,600	84,826.00	0.07
321	002387	维信诺	8,100	84,483.00	0.07
322	300456	赛微电子	2,800	84,420.00	0.07
323	300502	新易盛	2,701	84,406.25	0.07
324	002332	仙琚制药	6,700	84,018.00	0.07
325	300451	创业慧康	9,492	83,909.28	0.07
326	002048	宁波华翔	4,300	83,850.00	0.07
327	002124	天邦股份	11,960	83,839.60	0.07
328	300567	精测电子	1,350	82,890.00	0.07
329	000800	一汽解放	7,600	82,232.00	0.07
330	000887	中鼎股份	6,800	82,144.00	0.07
331	000729	燕京啤酒	11,300	81,812.00	0.07

332	002002	鸿达兴业	20,661	81,197.73	0.06
333	300803	指南针	2,100	81,060.00	0.06
334	002925	盈趣科技	2,080	80,932.80	0.06
335	000883	湖北能源	17,500	80,325.00	0.06
336	300326	凯利泰	5,900	80,181.00	0.06
337	002004	华邦健康	12,900	80,109.00	0.06
338	002847	盐津铺子	800	79,776.00	0.06
339	300369	绿盟科技	5,000	79,750.00	0.06
340	000629	攀钢钒钛	34,800	79,692.00	0.06
341	002563	森马服饰	6,600	78,870.00	0.06
342	002967	广电计量	1,800	78,840.00	0.06
343	002203	海亮股份	7,400	78,736.00	0.06
344	000034	神州数码	3,600	78,660.00	0.06
345	002242	九阳股份	2,400	77,976.00	0.06
346	300748	金力永磁	2,460	77,809.80	0.06
347	300236	上海新阳	1,600	77,664.00	0.06
348	000970	中科三环	8,100	77,355.00	0.06
349	000528	柳 工	9,380	76,916.00	0.06
350	002183	怡 亚 通	13,200	75,636.00	0.06
351	002867	周大生	3,800	75,126.00	0.06
352	002266	浙富控股	15,040	75,049.60	0.06
353	300002	神州泰岳	15,418	74,777.30	0.06
354	300638	广和通	1,600	74,720.00	0.06
355	000877	天山股份	5,700	74,271.00	0.06
356	002099	海翔药业	9,200	74,244.00	0.06
357	002701	奥瑞金	14,400	74,016.00	0.06
358	002262	恩华药业	4,800	73,680.00	0.06
359	002091	江苏国泰	8,000	72,800.00	0.06
360	002936	郑州银行	19,750	72,482.50	0.06
361	002368	太极股份	3,611	72,436.66	0.06
362	000400	许继电气	5,700	72,162.00	0.06
363	000930	中粮科技	8,000	72,080.00	0.06
364	002233	塔牌集团	7,000	71,960.00	0.06
365	000403	派林生物	2,300	71,576.00	0.06
366	300616	尚品宅配	800	70,808.00	0.06
367	002773	康弘药业	3,060	70,777.80	0.06
368	000712	锦龙股份	4,100	70,520.00	0.06
369	300726	宏达电子	1,000	70,490.00	0.06
370	000898	鞍钢股份	15,752	70,096.40	0.06
371	002249	大洋电机	13,300	69,825.00	0.06
372	002110	三钢闽光	10,350	69,759.00	0.06
373	002128	露天煤业	6,700	69,747.00	0.06

374	300188	美亚柏科	4,000	69,600.00	0.06
375	000735	罗牛山	8,800	69,432.00	0.06
376	002670	国盛金控	6,093	69,399.27	0.06
377	300026	红日药业	16,300	69,275.00	0.06
378	300226	上海钢联	1,160	69,078.00	0.06
379	300068	南都电源	6,500	68,900.00	0.06
380	300457	赢合科技	3,450	68,517.00	0.05
381	002531	天顺风能	7,900	68,335.00	0.05
382	000598	兴蓉环境	13,100	68,251.00	0.05
383	002705	新宝股份	2,600	68,250.00	0.05
384	002481	双塔食品	5,900	68,204.00	0.05
385	000987	越秀金控	5,350	67,731.00	0.05
386	000035	中国天楹	14,800	67,488.00	0.05
387	002839	张家港行	12,400	67,456.00	0.05
388	300861	美畅股份	800	67,448.00	0.05
389	300674	宇信科技	3,580	66,910.20	0.05
390	000402	金融街	9,900	66,825.00	0.05
391	300072	三聚环保	11,537	66,222.38	0.05
392	300376	易事特	8,200	65,928.00	0.05
393	001914	招商积余	3,800	65,284.00	0.05
394	000089	深圳机场	8,400	65,268.00	0.05
395	002217	合力泰	18,200	64,974.00	0.05
396	000555	神州信息	4,400	63,668.00	0.05
397	000559	万向钱潮	11,828	62,806.68	0.05
398	000560	我爱我家	13,800	61,686.00	0.05
399	002038	双鹭药业	5,850	61,600.50	0.05
400	000990	诚志股份	4,800	61,104.00	0.05
401	002237	恒邦股份	5,200	59,748.00	0.05
402	300133	华策影视	10,084	59,697.28	0.05
403	300085	银之杰	3,377	59,604.05	0.05
404	000758	中色股份	12,400	58,900.00	0.05
405	002901	大博医疗	800	58,312.00	0.05
406	000681	视觉中国	4,500	58,185.00	0.05
407	000967	盈峰环境	8,400	57,708.00	0.05
408	000672	上峰水泥	3,300	57,684.00	0.05
409	300869	康泰医学	800	56,656.00	0.05
410	002100	天康生物	6,300	56,133.00	0.04
411	000627	天茂集团	15,400	55,748.00	0.04
412	300459	金科文化	17,080	55,168.40	0.04
413	000563	陕国投 A	17,100	55,062.00	0.04
414	002155	湖南黄金	7,100	55,025.00	0.04
415	002458	益生股份	5,510	54,934.70	0.04

416	000951	中国重汽	2,000	54,120.00	0.04
417	300702	天宇股份	1,520	53,838.40	0.04
418	300633	开立医疗	1,700	53,686.00	0.04
419	002959	小熊电器	800	53,152.00	0.04
420	002440	闰土股份	6,000	53,100.00	0.04
421	002085	万丰奥威	9,456	52,953.60	0.04
422	001965	招商公路	7,300	52,706.00	0.04
423	002505	鹏都农牧	23,330	52,259.20	0.04
424	300113	顺网科技	3,970	51,371.80	0.04
425	300180	华峰超纤	10,353	51,247.35	0.04
426	000717	韶钢松山	11,100	50,949.00	0.04
427	300741	华宝股份	1,000	50,720.00	0.04
428	002216	三全食品	3,020	49,739.40	0.04
429	002244	滨江集团	11,700	49,023.00	0.04
430	000921	海信家电	3,400	48,858.00	0.04
431	002424	贵州百灵	6,600	48,576.00	0.04
432	002978	安宁股份	800	48,336.00	0.04
433	000710	贝瑞基因	1,600	48,064.00	0.04
434	002351	漫步者	3,500	47,390.00	0.04
435	000685	中山公用	5,800	47,328.00	0.04
436	300682	朗新科技	2,800	47,096.00	0.04
437	000415	渤海租赁	19,400	46,948.00	0.04
438	002375	亚厦股份	5,900	46,728.00	0.04
439	000789	万年青	3,990	45,645.60	0.04
440	002310	东方园林	13,300	45,353.00	0.04
441	300666	江丰电子	900	44,883.00	0.04
442	000078	海王生物	13,750	44,825.00	0.04
443	300770	新媒股份	920	44,804.00	0.04
444	300257	开山股份	3,100	44,547.00	0.04
445	002434	万里扬	5,400	43,794.00	0.03
446	000156	华数传媒	5,500	42,405.00	0.03
447	000785	居然之家	6,900	41,883.00	0.03
448	300735	光弘科技	3,440	41,830.40	0.03
449	000028	国药一致	1,100	41,624.00	0.03
450	002583	海能达	8,220	41,428.80	0.03
451	002399	海普瑞	2,580	41,099.40	0.03
452	000826	启迪环境	7,629	40,815.15	0.03
453	000062	深圳华强	2,405	40,668.55	0.03
454	002635	安洁科技	2,750	40,232.50	0.03
455	000937	冀中能源	9,990	39,260.70	0.03
456	002468	申通快递	5,100	38,862.00	0.03
457	000959	首钢股份	6,900	38,778.00	0.03

458	002302	西部建设	4,900	38,710.00	0.03
459	002461	珠江啤酒	3,500	38,290.00	0.03
460	002498	汉缆股份	10,600	37,948.00	0.03
461	300783	三只松鼠	800	37,888.00	0.03
462	002918	蒙娜丽莎	1,200	37,668.00	0.03
463	300761	立华股份	1,100	36,443.00	0.03
464	002608	江苏国信	5,500	35,090.00	0.03
465	002815	崇达技术	2,800	34,944.00	0.03
466	002194	武汉凡谷	2,600	34,814.00	0.03
467	000031	大悦城	9,600	34,560.00	0.03
468	002912	中新赛克	840	34,414.80	0.03
469	002532	天山铝业	4,100	34,399.00	0.03
470	000046	泛海控股	14,900	34,270.00	0.03
471	001872	招商港口	2,000	33,840.00	0.03
472	000869	张裕 A	900	33,426.00	0.03
473	000553	安道麦 A	3,600	33,372.00	0.03
474	002320	海峡股份	5,668	33,271.16	0.03
475	000582	北部湾港	4,000	33,200.00	0.03
476	002945	华林证券	2,400	33,168.00	0.03
477	002653	海思科	1,500	32,280.00	0.03
478	000935	四川双马	2,300	31,372.00	0.03
479	300768	迪普科技	800	30,904.00	0.02
480	300602	飞荣达	1,694	30,153.20	0.02
481	002984	森麒麟	800	29,160.00	0.02
482	000600	建投能源	5,800	28,478.00	0.02
483	002948	青岛银行	5,700	28,329.00	0.02
484	000958	东方能源	6,400	28,096.00	0.02
485	300815	玉禾田	800	27,864.00	0.02
486	000539	粤电力 A	7,400	27,824.00	0.02
487	002950	奥美医疗	1,600	26,496.00	0.02
488	002755	奥赛康	1,900	25,821.00	0.02
489	000688	国城矿业	2,900	25,317.00	0.02
490	002419	天虹股份	3,800	24,928.00	0.02
491	002243	力合科创	2,600	24,726.00	0.02
492	000537	广宇发展	4,300	22,489.00	0.02
493	003012	东鹏控股	1,300	21,632.00	0.02
494	002946	新乳业	1,400	21,210.00	0.02
495	000927	中国铁物	5,400	20,088.00	0.02
496	002793	罗欣药业	1,980	19,740.60	0.02
497	002961	瑞达期货	800	17,056.00	0.01
498	002818	富森美	1,300	15,678.00	0.01
499	002423	中粮资本	1,500	13,575.00	0.01

500	002911	佛燃能源	970	9,108.30	0.01
-----	--------	------	-----	----------	------

7.3.2 期末积极投资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	301020	密封科技	3,044	32,388.16	0.03
2	300919	中伟股份	180	29,340.00	0.02
3	301021	英诺激光	2,770	26,204.20	0.02
4	300957	贝泰妮	82	20,660.72	0.02
5	300982	苏文电能	317	14,356.93	0.01
6	001208	华菱线缆	1,754	13,558.42	0.01
7	300940	南极光	307	13,317.66	0.01
8	300937	药易购	244	13,105.24	0.01
9	300953	震裕科技	127	12,680.95	0.01
10	300942	易瑞生物	443	12,634.36	0.01
11	301013	利和兴	442	11,982.62	0.01
12	300973	立高食品	102	11,802.42	0.01
13	300933	中辰股份	1,112	11,609.28	0.01
14	300918	南山智尚	1,045	10,878.45	0.01
15	300614	百川畅银	268	10,821.84	0.01
16	300922	天秦装备	287	9,996.21	0.01
17	300932	三友联众	315	9,988.65	0.01
18	300941	创识科技	193	9,638.42	0.01
19	301009	可靠股份	345	9,622.05	0.01
20	301015	百洋医药	246	9,552.18	0.01
21	300962	中金辐照	576	9,429.12	0.01
22	300966	共同药业	286	9,020.44	0.01
23	300945	曼卡龙	462	8,722.56	0.01
24	300950	德固特	219	8,569.47	0.01
25	300958	建工修复	300	8,166.00	0.01
26	300926	博俊科技	359	7,969.80	0.01
27	300981	中红医疗	86	7,773.54	0.01
28	300917	特发服务	281	7,772.46	0.01
29	301002	崧盛股份	128	7,375.36	0.01
30	300961	深水海纳	313	6,907.91	0.01
31	300952	恒辉安防	255	6,905.40	0.01
32	300996	普联软件	162	6,841.26	0.01
33	300955	嘉亨家化	148	6,818.36	0.01
34	300991	创益通	254	6,733.54	0.01
35	300927	江天化学	217	6,531.70	0.01
36	300975	商络电子	483	6,293.49	0.01
37	300997	欢乐家	480	6,264.00	0.01
38	300968	格林精密	518	6,252.26	0.00

39	300971	博亚精工	211	5,969.19	0.00
40	301011	华立科技	175	5,922.00	0.00
41	300943	春晖智控	255	5,867.55	0.00
42	300993	玉马遮阳	295	5,690.55	0.00
43	300929	华骐环保	183	5,407.65	0.00
44	300960	通业科技	234	5,396.04	0.00
45	300978	东箭科技	386	5,249.60	0.00
46	300963	中洲特材	218	4,902.82	0.00
47	300956	英力股份	189	4,876.20	0.00
48	300967	晓鸣股份	408	4,708.32	0.00
49	300995	奇德新材	191	4,454.12	0.00
50	301007	德迈仕	303	4,375.32	0.00
51	301016	雷尔伟	130	4,287.40	0.00
52	300998	宁波方正	201	4,285.32	0.00
53	301012	扬电科技	170	4,124.20	0.00
54	300992	泰福泵业	200	4,064.00	0.00
55	301010	晶雪节能	218	3,838.98	0.00
56	300986	志特新材	114	3,484.98	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	300896	爱美客	572,301.00	0.34
2	000799	酒鬼酒	527,396.00	0.31
3	300782	卓胜微	399,024.00	0.24
4	300999	金龙鱼	392,637.00	0.23
5	300750	宁德时代	391,109.00	0.23
6	300751	迈为股份	319,971.00	0.19
7	300841	康华生物	277,653.00	0.16
8	000516	国际医学	253,625.00	0.15
9	002821	凯莱英	224,632.00	0.13
10	002415	海康威视	197,047.00	0.12
11	002497	雅化集团	196,961.00	0.12
12	000596	古井贡酒	192,058.00	0.11
13	300763	锦浪科技	169,284.00	0.10
14	300760	迈瑞医疗	167,274.00	0.10
15	300661	圣邦股份	166,065.00	0.10
16	300832	新产业	165,473.00	0.10
17	002747	埃斯顿	142,691.00	0.08
18	300866	安克创新	137,895.00	0.08
19	002920	德赛西威	134,166.00	0.08
20	002607	中公教育	124,929.00	0.07

注：买入金额按成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

7.4.2 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	300751	迈为股份	329,420.00	0.19
2	300940	南极光	258,036.00	0.15
3	300339	润和软件	256,853.00	0.15
4	002709	天赐材料	225,076.00	0.13
5	300888	稳健医疗	189,877.40	0.11
6	300932	三友联众	154,526.86	0.09
7	300958	建工修复	148,922.90	0.09
8	300942	易瑞生物	139,714.10	0.08
9	301013	利和兴	139,230.00	0.08
10	300962	中金辐照	133,672.23	0.08
11	300997	欢乐家	132,522.06	0.08
12	003035	南网能源	129,983.96	0.08
13	300957	贝泰妮	128,315.70	0.08
14	300933	中辰股份	127,472.15	0.08
15	002594	比亚迪	127,320.00	0.08
16	300991	创益通	125,114.85	0.07
17	300967	晓鸣股份	118,201.36	0.07
18	300968	格林精密	117,405.85	0.07
19	300975	商络电子	117,369.00	0.07
20	300952	恒辉安防	117,140.00	0.07

注：卖出金额按成交金额（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	13,432,739.34
卖出股票收入（成交）总额	9,872,856.53

注：买入股票成本、卖出股票收入均按买卖成交金额（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

无。

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

无。

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

无。

7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

无。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

无。

7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

无。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

无。

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

本基金投资的前十名证券的发行主体本期未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。

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	20,969.85
2	应收证券清算款	144,864.51
3	应收股利	—
4	应收利息	790.26
5	应收申购款	—
6	其他应收款	—
7	待摊费用	—
8	其他	—
9	合计	166,624.62

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

7.12.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

无。

7.12.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值	占基金资产净值比例 (%)	流通受限情况说明
1	301020	密封科技	32,388.16	0.03	新股未上市
2	300919	中伟股份	29,340.00	0.02	新股锁定
3	301021	英诺激光	26,204.20	0.02	新股未上市
4	300957	贝泰妮	20,660.72	0.02	新股锁定
5	300982	苏文电能	14,356.93	0.01	新股锁定

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

8.1.1 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 (%)
2,969	2,403.28	84,049.00	1.18	7,051,293.00	98.82

注：持有人户数为有效户数，即存量份额大于零的账户。

8.2 期末上市基金前十名持有人

序号	持有人名称	持有份额 (份)	占上市总份额比例 (%)
1	吴晓彤	149,216.00	2.09
2	刘小彦	131,310.00	1.84
3	吕君	93,000.00	1.30

4	张凤生	69,000.00	0.97
5	顾勇	66,973.00	0.94
6	广州市杰泰实业发展有限公司	65,661.00	0.92
7	黄赤峰	65,324.00	0.92
8	谢元禄	64,144.00	0.90
9	王仁斌	57,225.00	0.80
10	甘琳	37,100.00	0.52

注：以上数据由中国证券登记结算有限公司提供，持有人为场内持有人。

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

无。

8.4 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（2015年6月5日）基金份额总额	2,384,588,069.00
本报告期期初基金份额总额	10,435,342.00
本报告期基金总申购份额	—
减：本报告期基金总赎回份额	3,300,000.00
本报告期基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	—
本报告期期末基金份额总额	7,135,342.00

§ 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

基金管理人报告期内无重大人事变动。

二、基金托管人的基金托管部门的重大人事变动

2021 年 5 月，中国农业银行总行决定谭敦宇任托管业务部总裁。

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普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)，该事务所自基金合同生效日起为本基金提供审计服务至今。

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，基金管理人、托管人及其相关高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
光大证券	2	12,210,538.28	56.34%	11,127.93	55.96%	-
中信建投证券	2	9,462,445.25	43.66%	8,756.81	44.04%	-
爱建证券	1	-	-	-	-	-
安信证券	1	-	-	-	-	-
川财证券	1	-	-	-	-	-
第一创业	1	-	-	-	-	-
东北证券	2	-	-	-	-	-
东财证券	1	-	-	-	-	-
东方证券	1	-	-	-	-	-
东吴证券	1	-	-	-	-	-
东兴证券	1	-	-	-	-	-

方正证券	1	-	-	-	-	-
高华证券	1	-	-	-	-	-
广发证券	2	-	-	-	-	-
国金证券	2	-	-	-	-	-
国盛证券	1	-	-	-	-	-
国泰君安	3	-	-	-	-	-
国信证券	1	-	-	-	-	-
海通证券	1	-	-	-	-	-
红塔证券	1	-	-	-	-	-
华创证券	1	-	-	-	-	-
华泰证券	1	-	-	-	-	-
华西证券	1	-	-	-	-	-
民生证券	1	-	-	-	-	-
南京证券	1	-	-	-	-	-
平安证券	1	-	-	-	-	-
瑞银证券	2	-	-	-	-	-
山西证券	1	-	-	-	-	-
上海证券	1	-	-	-	-	-
申万宏源	1	-	-	-	-	-
申万宏源西 部	1	-	-	-	-	-
世纪证券	1	-	-	-	-	-
天风证券	2	-	-	-	-	-
万和证券	1	-	-	-	-	-
西部证券	1	-	-	-	-	-
湘财证券	1	-	-	-	-	-
信达证券	1	-	-	-	-	-
兴业证券	2	-	-	-	-	-
粤开证券	1	-	-	-	-	-

招商证券	2	-	-	-	-	-
浙商证券	1	-	-	-	-	-
中国银河证券	4	-	-	-	-	-
中金公司	3	-	-	-	-	-
中泰证券	2	-	-	-	-	-
中信证券	2	-	-	-	-	-
中银国际证券	1	-	-	-	-	-
中原证券	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[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。

本报告期内本基金租用证券公司交易单元的变更情况如下：

本报告期内本基金新增交易单元：无。

本报告期内本基金退租交易单元：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

无。

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	关于提请投资者及时更新已过期身份证件或者身份证明文件的公告	中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站	2021 年 6 月 30 日
2	大成深证成份交易型开放式指数证券投资基金第一季度报告	中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站	2021 年 4 月 22 日
3	大成深证成份交易型开放式指数证券投资基金更新招募说明书	中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站	2021 年 3 月 30 日
4	大成深证成份交易型开放式指数证券投资基金基金产品资料概要更新	中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站	2021 年 3 月 30 日
5	大成深证成份交易型开放式指数证券投资基金 2020 年年度报告	中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站	2021 年 3 月 30 日
6	大成深证成份交易型开放式指数证券投资基金基金合同	中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站	2021 年 3 月 30 日
7	大成基金管理有限公司提醒投资者谨防金融诈骗的公告	中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站	2021 年 3 月 23 日
8	大成深证成份交易型开放式指数证券投资基金第四季度报告	中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站	2021 年 1 月 22 日

§ 11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

无。

11.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§ 12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

- 1、中国证监会批准设立大成深证成份交易型开放式指数证券投资基金的文件；
- 2、《大成深证成份交易型开放式指数证券投资基金基金合同》；

- 3、《大成深证成份交易型开放式指数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

备查文件存放于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

2021 年 8 月 31 日