

大成深证成份交易型开放式指数证券投资 基金 2022 年中期报告

2022 年 6 月 30 日

基金管理人：大成基金管理有限公司

基金托管人：中国农业银行股份有限公司

送出日期：2022 年 8 月 30 日

§ 1 重要提示及目录

1.1 重要提示

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

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

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

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

本报告财务资料未经审计。

本报告期自 2022 年 01 月 01 日起至 06 月 30 日止。

1.2 目录

§1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
§2 基金简介	5
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人和基金托管人	5
2.4 信息披露方式	6
2.5 其他相关资料	6
§3 主要财务指标和基金净值表现	6
3.1 主要会计数据和财务指标	6
3.2 基金净值表现	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	11
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	11
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	12
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	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	13
§5 托管人报告	13
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	13
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	13
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、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	15
6.3 净资产（基金净值）变动表	16
6.4 报表附注	19
§7 投资组合报告	46
7.1 期末基金资产组合情况	46
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	46
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细	48
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	60
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	62
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	62
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	62
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	62

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	62
7.10 本基金投资股指期货的投资政策	62
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	62
7.12 投资组合报告附注	63
§ 8 基金份额持有人信息	64
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	64
8.2 期末上市基金前十名持有人	64
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	64
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	64
§ 9 开放式基金份额变动	65
§ 10 重大事件揭示	65
10.1 基金份额持有人大会决议	65
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	65
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	65
10.4 基金投资策略的改变	65
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	66
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	66
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	66
10.8 其他重大事件	68
§ 11 影响投资者决策的其他重要信息	69
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	69
11.2 影响投资者决策的其他重要信息	69
§ 12 备查文件目录	69
12.1 备查文件目录	69
12.2 存放地点	69
12.3 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	71,229,922.00 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	段皓静	秦一楠
	联系电话	0755-83183388	010-66060069
	电子邮箱	office@dcfund.com.cn	tgxxpl@abchina.com
客户服务电话		4008885558	95599
传真		0755-83199588	010-68121816
注册地址		广东省深圳市南山区海德三道	北京市东城区建国门内大街 69

	1236 号大成基金总部大厦 5 层、27-33 层	号
办公地址	广东省深圳市南山区海德三道 1236 号大成基金总部大厦 5 层、27-33 层	北京市西城区复兴门内大街 28 号凯晨世贸中心东座 F9
邮政编码	518054	100031
法定代表人	吴庆斌	谷澍

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《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(2022 年 1 月 1 日-2022 年 6 月 30 日)
本期已实现收益	977,174.69
本期利润	-12,859,290.03
加权平均基金份额本期利润	-0.1761
本期加权平均净值利润率	-14.09%
本期基金份额净值增长率	-12.43%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2022 年 6 月 30 日)
期末可供分配利润	966,446.88
期末可供分配基金份额利润	0.0136
期末基金资产净值	92,788,320.93
期末基金份额净值	1.303
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2022 年 6 月 30 日)
基金份额累计净值增长率	1.09%

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

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

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

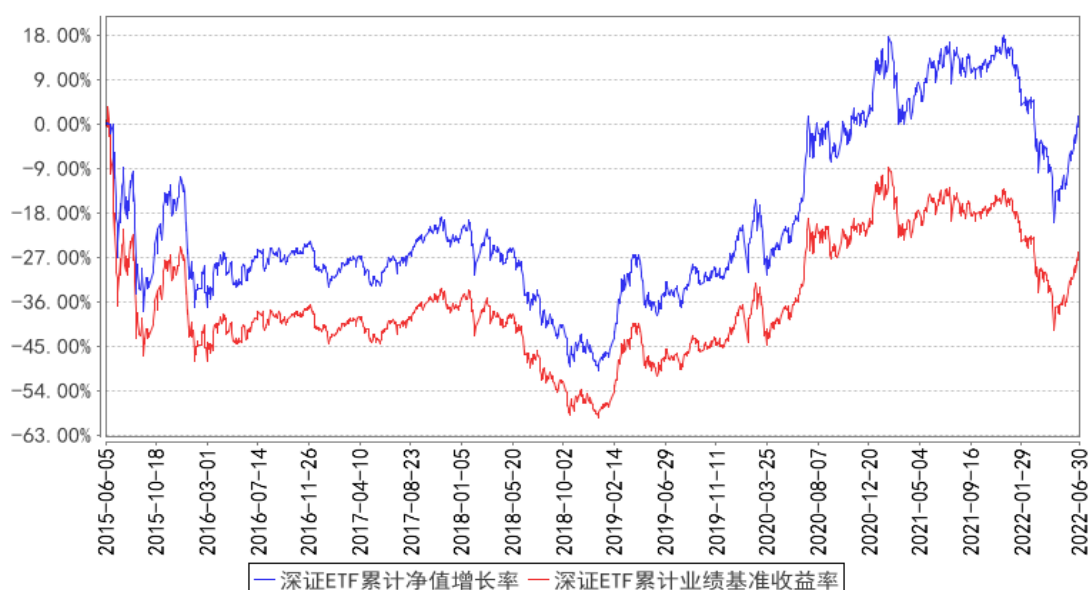
3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去一个月	11.75%	1.25%	11.87%	1.28%	-0.12%	-0.03%
过去三个月	6.89%	1.72%	6.42%	1.77%	0.47%	-0.05%
过去六个月	-12.43%	1.65%	-13.20%	1.70%	0.77%	-0.05%
过去一年	-12.27%	1.37%	-14.94%	1.41%	2.67%	-0.04%
过去三年	54.46%	1.42%	40.51%	1.45%	13.95%	-0.03%
自基金合同生效起至今	1.09%	1.61%	-26.31%	1.67%	27.40%	-0.06%

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，注册资本为 2 亿元人民币，注册地为深圳。目前公司由三家股东组成，分别为中泰信托有限责任公司(50%)、光大证券股份有限公司(25%)、中国银河投资管理有限公司(25%)。公司业务资质齐全，是全国同时具有境内、境外社保基金管理人资格和基本养老保险基金管理人资格的四家基金公司之一，全面涵盖公募基金、机构投资、海外投资、财富管理、养老金管理、私募股权投资等业务，旗下大成国际资产管理公司具备 QFII、RQFII 等资格。

历经 23 年的发展，大成基金形成了以长期投资能力为核心竞争优势，打造了一支具有良好职业素养和丰富经验的资产管理队伍。目前已形成权益、固定收益、量化投资、商品期货、境外投资、大类资产配置等六大投资团队，全面覆盖各类投资领域。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理 (助理) 期限		证券从 业年限	说明
		任职日期	离任日期		
苏 秉 毅	本基金基金 经理， 指数与期 货投资部 副总监	2015 年 6 月 5 日	-	18 年	清华大学经济学硕士。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，现任指数与期货投资部副总监。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 日起任大成智慧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	2021 年 9 月 2 日	-	14 年	北京大学工商管理硕士。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，先后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、指数与期货投资部基金经理、指数与期货投资部总监助理；曾担任深证成长 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助理。2017 年 9 月 14 日至 2021 年 9 月 1 日任大成中证 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 日起任大成中证红利指数证券投资基金基金经理。2021 年 9 月 2 日起任中证 500 沪市交易型开放式指数

					证券投资基金、大成中证 100 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。2022 年 6 月 28 日起任大成中证电池主题指数型发起式证券投资基金基金经理。2022 年 7 月 13 日起任大成中证上海环交所碳中和交易型开放式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遵规守信情况的说明

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，针对同一基金经理管理的多个投资组合及公私募兼任基金经理管理的多个投资组合的投资交易行为加强了公平交易监测与分析，包括对不同时间窗下（同日、3 日、5 日、10 日）反向交易和同向交易价差监控的分析。分析结果表明：债券交易同向交易频率较低；部分股票同向交易溢价率较大主要来源于投资策略差异、市场因素（如个股当日价格振幅较高）及组合经理交易时机选择，即投资组合成交时间不一致以及成交价格的日内较大变动导致个别些组合间的成交价格差异较大，同时结合交易价差专项统计分析，未发现违反公平交易原则的异常情况。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

报告期内，基金管理人旗下所有投资组合未发现存在异常交易行为。主动投资组合间股票交易存在 1 笔同日反向交易，原因为投资策略需要。主动型投资组合与指数型投资组合之间或指数型投资组合之间存在股票同日反向交易，但不存在参与交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量超过该股当日成交量 5% 的情形；主动投资组合间债券交易存在 2 笔同日反向交易，原

因为流动性需要或合规比例调整。投资组合间相邻交易日反向交易的市场成交比例、成交均价等交易结果数据表明该类交易不对市场产生重大影响，无异常。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

上半年，无论是全球地缘政治，还是资本市场表现，都确实实地出现了起伏。在互联网时代，我们目睹一场大国参与的地缘政治冲突，并且转入旷日持久的拉锯。能源短缺问题进一步激化，全球通胀高企，但经济环境依然不好，未来进入衰退的可能性正在上升。国内制定的经济增长目标也受到了广泛关注。

资本市场的动荡，也成为了时代的注脚。大宗商品价格在供给不足和需求衰退的逻辑交织中巨幅震荡。以美股为首，境外主要股票市场跌幅较大。A股市场也经历了近年罕有的波动。年初，地缘政治冲突等因素以及对环境的担忧导致了外资撤离，股票下跌又引发了更多资金触及止损条件被动卖出，形成正反馈效应，而疫情的反复又进一步打击了投资者的信心，市场流动性非常脆弱，无力承接卖压，大体处于单边下跌状态，直至四月底阶段性出清止跌。随后的五六月份，市场反身向上，走出一波持续性较好的反弹行情。上半年沪深 300 指数下跌 9.22%。市场风格出现了较大的转折，在前四个月的下跌中，价值风格表现出了良好的防御属性，领先于成长风格，而在市场止跌回升后，则是进攻属性较强的成长股引领反弹。

本基金标的指数深成指下跌 13.20%。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 1.303 元；本报告期基金份额净值增长率为-12.43%，业绩比较基准收益率为-13.20%。

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，宏观经济环境形势更为严峻。境外经济体业已走入滞涨的死胡同，衰退的阴影挥之不去，同时因为非经济原因，传统能源资本开支严重受限，供给端难以满足需求，短期内能源问题无解，通胀也就很难抑制住。而内需方面则由于抗疫与经济增长之间的再平衡，也会受到较大影响。

对于下半年的股票市场，我们持相对谨慎的观点。宏观环境不理想，上市公司盈利低于预期概率偏高。而内外流动性均有可能在某一时刻边际上收紧，成为制约市场的重要因素。五月之后的反弹行情更像是在超跌出清后的自我修复，而并非底层逻辑出现根本性改变的反转，在市场情

绪修复到位之后，有可能再度陷入调整。特别需要警惕的是，部分“赛道股”的估值又回到了非常高的水平，若流动性环境发生变化，高估值难以为继，有可能迎来堪比一季度的波动。

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、固定收益总部、研究部、指数与期货投资部、大类资产配置部、权益专户投资部、国际业务部、交易管理部、风险管理部、监察稽核部、基金运营部指定人员组成。公司估值委员会的相关成员均具备相应的专业胜任能力和相关工作经历，估值委员会成员中包括七名投资组合经理。

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

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

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

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

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

事项。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

无。

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

在托管本基金的过程中，本基金托管人中国农业银行股份有限公司严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》相关法律法规的规定以及基金合同、托管协议的约定，对本基金基金管理人——大成基金管理有限公司 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日基金的投资运作，进行了认真、独立的会计核算和必要的投资监督，认真履行了托管人的义务，没有从事任何损害基金份额持有人利益的行为。

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

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

5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见

本托管人认为，大成基金管理有限公司的信息披露事务符合《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》及其他相关法律法规的规定，基金管理人所编制和披露的本基金中期报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告等信息真实、准确、完整，未发现有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：2022 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2022 年 6 月 30 日	上年度末 2021 年 12 月 31 日
资 产：			
银行存款	6.4.7.1	2,667,103.98	2,297,461.46
结算备付金		—	—
存出保证金		7,363.29	11,909.15

交易性金融资产	6.4.7.2	90,282,578.24	103,943,556.40
其中：股票投资		90,251,107.88	103,894,931.45
基金投资		-	-
债券投资		31,470.36	48,624.95
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
其他投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
债权投资	6.4.7.5	-	-
其中：债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
其他投资		-	-
其他债权投资	6.4.7.6	-	-
其他权益工具投资	6.4.7.7	-	-
应收清算款		-	-
应收股利		-	-
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.8	-	588.28
资产总计		92,957,045.51	106,253,515.29
负债和净资产	附注号	本期末 2022 年 6 月 30 日	上年度末 2021 年 12 月 31 日
负 债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付清算款		-	-
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		36,736.45	45,878.68
应付托管费		7,347.28	9,175.74
应付销售服务费		-	-
应付投资顾问费		-	-
应交税费		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.9	124,640.85	214,203.94
负债合计		168,724.58	269,258.36
净资产：			
实收基金	6.4.7.10	91,821,874.05	91,821,874.07
其他综合收益	6.4.7.11	-	-
未分配利润	6.4.7.12	966,446.88	14,162,382.86
净资产合计		92,788,320.93	105,984,256.93

负债和净资产总计		92,957,045.51	106,253,515.29
----------	--	---------------	----------------

注：报告截止日 2022 年 06 月 30 日，基金份额净值 1.303 元，基金份额总额 71,229,922.00 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：2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
一、营业总收入		-12,432,703.59	12,965,877.25
1. 利息收入		8,991.68	17,917.68
其中：存款利息收入	6.4.7.13	8,991.68	17,917.68
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“-”填列）		1,394,497.45	25,485,870.60
其中：股票投资收益	6.4.7.14	642,025.48	24,806,413.92
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.15	16,128.51	-
资产支持证券投资收益	6.4.7.16	-	-
贵金属投资收益	6.4.7.17	-	-
衍生工具收益	6.4.7.18	-	-
股利收益	6.4.7.19	736,343.46	679,456.68
以摊余成本计量的金融资产终止确认产生的收益		-	-
其他投资收益		-	-
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.20	-13,836,464.72	-12,537,911.03
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.21	272.00	-
减：二、营业总支出		426,586.44	587,891.95
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	226,640.75	334,652.91
2. 托管费	6.4.10.2.2	45,328.13	66,930.60
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	-	-

4. 投资顾问费		-	-
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 信用减值损失	6.4.7.22	-	-
7. 税金及附加		-	-
8. 其他费用	6.4.7.23	154,617.56	186,308.44
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-12,859,290.03	12,377,985.30
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-12,859,290.03	12,377,985.30
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		-12,859,290.03	12,377,985.30

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

单位：人民币元

项目	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产(基金净值)	91,821,874.07	-	14,162,382.86	105,984,256.93
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产(基金净值)	91,821,874.07	-	14,162,382.86	105,984,256.93
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	-0.02	-	-13,195,935.98	-13,195,936.00

(一)、综合收益总额	-	-	-12,859,290.03	-12,859,290.03
(二)、本期基金份额交易产生的基金净值变动数(净值减少以“-”号填列)	-0.02	-	-336,645.95	-336,645.97
其中:1.基金申购款	11,601,821.85	-	-1,127,190.26	10,474,631.59
2.基金赎回款	-11,601,821.87	-	790,544.31	-10,811,277.56
(三)、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以“-”号填列)	-	-	-	-
(四)、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资产(基金净值)	91,821,874.05	-	966,446.88	92,788,320.93
项目	上年度可比期间 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计

一、上期期末净资产(基金净值)	158,967,244.81	-	10,115,497.22	169,082,742.03
加:会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产(基金净值)	158,967,244.81	-	10,115,497.22	169,082,742.03
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	-50,270,696.26	-	6,417,094.61	-43,853,601.65
(一)、综合收益总额	-	-	12,377,985.30	12,377,985.30
(二)、本期基金份额交易产生的基金净值变动数(净值减少以“-”号填列)	-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
(三)、本期向基金份额持有	-	-	-	-

人分配 利润产 生的基 金净值 变动(净 值减少 以“-” 号填列)				
(四)、 其他综 合收益 结转留 存收益	-	-	-	-
四、本期 期末净 资产(基 金净值)	108,696,548.55	-	16,532,591.83	125,229,140.38

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署：

谭晓冈

范瑛

孙蕊

基金管理人负责人

主管会计工作负责人

会计机构负责人

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

大成深证成份交易型开放式指数证券投资基金(以下简称“本基金”)经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2015]450 号《关于核准大成深证成份交易型开放式指数证券投资基金募集的批复》核准,由大成基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《大成深证成份交易型开放式指数证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型的交易型开放式基金,存续期限不定,首次设立募集不包括认购资金利息共募集 2,384,454,750.00 元(含募集股票市值),业经普华永道中天会计师事务所有限公司普华永道中天验字(2015)第 634 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《大成深证成份交易型开放式指数证券投资基金基金合同》于 2015 年 6 月 5 日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为 2,384,588,069.00 份基金份额,其中认购资金利息折合 133,319.00 元份基金份额。本基金的基金管理人为大成基金管理有限公司,基金托管人为中国农业银行股份有限公司。

经深圳证券交易所(以下简称“深交所”)深证上[2015]330 号文审核同意,本基金于 2015 年

7 月 8 日在深交所挂牌交易。

根据《大成深证成份交易型开放式指数证券投资基金招募说明书》和《关于大成深证成份交易型开放式指数证券投资基金基金折算结果的公告》的有关规定，本基金于 2015 年 6 月 29 日进行了基金份额折算，折算比例为 1: 0.06565125，并于 2015 年 6 月 30 日进行了变更登记。

根据大成基金管理有限公司于 2021 年 10 月 22 日发布的《大成深证成份交易型开放式指数证券投资基金基金份额拆分结果的公告》，本基金于 2021 年 10 月 21 日进行了基金份额拆分并进行了变更登记，拆分比例为 11.817461846。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《大成深证成份交易型开放式指数证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金的投资目标是紧密跟踪标的指数，追求与标的指数相似的投资回报；主要投资范围为标的指数的成份股(含存托凭证)和备选成份股(含存托凭证)，该部分资产比例不低于基金资产净值的 95%；本基金还可投资于国内依法发行上市的非标的指数成份股(包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票)、存托凭证、债券(含中期票据)、货币市场工具、银行存款、权证、股指期货、资产支持证券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)。在正常市场情况下，本基金日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.2%，年跟踪误差不超过 2%。本基金的业绩比较基准为：深证成份指数。

6.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于 2006 年 2 月 15 日及以后期间颁布的《企业会计准则—基本准则》、各项具体会计准则及相关规定(以下合称“企业会计准则”)、中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和中期报告>》、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《大成深证成份交易型开放式指数证券投资基金基金合同》和在财务报表附注 6.4.4 所列示的中国证监会、中国基金业协会发布的相关规定及允许的基金行业实务操作编制。

本财务报表以持续经营为基础编制。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日止期间的 财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金 2022 年 6 月 30 日的财务状况以及 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日止期间的经营成果和净资产变动情况等有关信息。

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

除下文中涉及的变更外，本基金本报告期所采用的其他会计政策、会计估计与最近一期年度会计报表所采用的会计政策、会计估计一致。

6.4.4.1 金融资产和金融负债的分类

新金融工具准则

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

(1) 金融资产

金融资产于初始确认时分类为：以摊余成本计量的金融资产、以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产及以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。金融资产的分类取决于本基金管理金融资产的业务模式和金融资产的合同现金流量特征。本基金现无金融资产分类为以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产。

债务工具

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

以摊余成本计量：

本基金管理以摊余成本计量的金融资产的业务模式为以收取合同现金流量为目标，且以摊余成本计量的金融资产的合同现金流量特征与基本借贷安排相一致，即在特定日期产生的现金流量，仅为对本金和以未偿付本金金额为基础的利息的支付。本基金持有的以摊余成本计量的金融资产主要为银行存款、买入返售金融资产和其他各类应收款项等。

以公允价值计量且其变动计入当期损益：

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

权益工具

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

(2) 金融负债

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

(3) 衍生金融工具

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

原金融工具准则(截至 2021 年 12 月 31 日前适用的原金融工具准则)

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

(1) 金融资产的分类

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

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

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

(2) 金融负债的分类

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

6.4.4.2. 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

新金融工具准则

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

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

本基金对于以摊余成本计量的金融资产，以预期信用损失为基础确认损失准备。

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

率加权金额，确认预期信用损失。

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

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

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

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

本基金将计提或转回的损失准备计入当期损益。

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

金融资产终止确认时，其账面价值与收到的对价的差额，计入当期损益。

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

原金融工具准则(截至 2021 年 12 月 31 日前适用的原金融工具准则)

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

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

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

应收款项和其他金融负债采用实际利率法，以摊余成本进行后续计量。

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

金融资产终止确认时，其账面价值与收到的对价的差额，计入当期损益。

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

6.4.4.3 收入/(损失)的确认和计量

新金融工具准则

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

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

原金融工具准则(截至 2021 年 12 月 31 日前适用的原金融工具准则)

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

股票投资在持有期间应取得的现金股利扣除由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额确认为投资收益。债券投资在持有期间应取得的按票面利率或者发行价计算的利息扣除在适用情况下由债券发行企业代扣代缴的个人所得税及由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为利息收入。

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

本基金参与的转融通证券出借业务，是指基金以一定的费率通过证券交易所综合业务平台向

中国证券金融股份有限公司(以下简称“证金公司”)出借证券,证金公司到期归还所借证券及相应权益补偿并支付费用的业务。由于基金参与转融通证券出借业务不属于实质性证券转让行为,基金保留了出借证券所有权上几乎所有的风险和报酬,故不终止确认该出借证券,仍按原金融资产类别进行后续计量,并将出借证券获得的利息和因借入人未能按期归还产生的罚息确认为利息收入,将出借证券发生除送股、转增股份外其他权益事项时产生的权益补偿收入和采取现金清偿方式下产生的差价收入确认为投资收益。

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

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 会计政策变更的说明

财政部于 2017 年颁布了修订后的《企业会计准则第 22 号——金融工具确认和计量》、《企业会计准则第 23 号——金融资产转移》、《企业会计准则第 24 号——套期会计》及《企业会计准则第 37 号——金融工具列报》(以下合称“新金融工具准则”),财政部、中国银行保险监督管理委员会于 2020 年 12 月 30 日发布了《关于进一步贯彻落实新金融工具相关会计准则的通知》,公募证券投资基金自 2022 年 1 月 1 日起执行新金融工具准则。此外,中国证监会于 2022 年颁布了修订后的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和中期报告>》,本基金的基金管理人已采用上述准则及通知编制本基金财务报表,对本基金财务报表的影响列示如下:

(a) 金融工具

根据新金融工具准则的相关规定,本基金对于首次执行该准则的累积影响数调整 2022 年年初留存收益以及财务报表其他相关项目金额,2021 年度的比较财务报表未重列。于 2021 年 12 月 31 日及 2022 年 1 月 1 日,本基金均没有指定为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。

(i) 于 2022 年 1 月 1 日,本财务报表中金融资产和金融负债按照原金融工具准则和新金融工具准则的规定进行分类和计量的结果对比表:

原金融工具准则下以摊余成本计量的金融资产为银行存款、存出保证金和应收利息,金额分别为 2,297,461.46 元、11,909.15 元和 588.28 元。新金融工具准则下以摊余成本计量的金融资产为银行存款、存出保证金和其他资产-应收利息,金额分别为 2,298,034.65 元、11,914.55 元和 0.00 元。

原金融工具准则下以公允价值计量且其变动计入当期损益计量的金融资产为交易性金融资产,金额为 103,943,556.40 元。新金融工具准则下以公允价值计量且其变动计入当期损益计量的金融资产为交易性金融资产,金额为 103,943,566.09 元。

原金融工具准则下以摊余成本计量的金融负债为应付管理人报酬、应付托管费、应付交易费用和其他负债-其他应付款, 金额分别为 45,878.68 元、9,175.74 元、9,203.94 元和 35,000.00。新金融工具准则下以摊余成本计量的金融负债为应付管理人报酬、应付托管费、其他负债-应付交易费用和其他负债-其他应付款, 金额分别为 45,878.68 元、9,175.74 元、9,203.94 元和 35,000.00 元。

i) 于 2021 年 12 月 31 日, 本基金持有的“银行存款”、“结算备付金”、“存出保证金”、“交易性金融资产”、“买入返售金融资产”、“卖出回购金融资产款”等对应的应计利息余额均列示在“应收利息”或“应付利息”科目中。于 2022 年 1 月 1 日, 本基金根据新金融工具准则下的计量类别, 将上述应计利息分别转入“银行存款”、“结算备付金”、“存出保证金”、“交易性金融资产”、“买入返售金融资产”、“卖出回购金融资产款”等科目项下列示, 无期初留存收益影响。

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

根据中国证监会于 2022 年颁布的修订后的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和中期报告>》, 本基金的基金管理人在编制本财务报表时调整了部分财务报表科目的列报和披露, 这些调整未对本基金财务报表产生重大影响。

6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128 号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[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[2014]81 号《财政部国家税务总局证监会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[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[2014]81 号《财政部国家税务总局证监会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]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，以产生的利息及利息性质的收入为销售额。

(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。

对基金通过港股通投资香港联交所上市 H 股取得的股息红利，H 股公司应向中国证券登记结算有限责任公司(以下简称“中国结算”)提出申请，由中国结算向 H 股公司提供内地个人投资者名册，H 股公司按照 20% 的税率代扣个人所得税。基金通过港股通投资香港联交所上市的非 H 股取得的股息红利，由中国结算按照 20% 的税率代扣个人所得税。

(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。基金通过港股通买卖、继承、赠与联交所上市股票，按照香港特别行政区现行税法规定缴纳印花税。

(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。

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2022 年 6 月 30 日
活期存款	2,667,103.98
等于：本金	2,666,635.03
加：应计利息	468.95
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	2,667,103.98

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末 2022 年 6 月 30 日			
		成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票		74,336,072.00	-	90,251,107.88	15,915,035.88
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-	-
债券	交易所市场	25,500.00	11.34	31,470.36	5,959.02
	银行间市场	-	-	-	-
	合计	25,500.00	11.34	31,470.36	5,959.02
资产支持证券		-	-	-	-
基金		-	-	-	-
其他		-	-	-	-
合计		74,361,572.00	11.34	90,282,578.24	15,920,994.90

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

6.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

无。

6.4.7.3.2 期末基金持有的期货合约情况

无。

6.4.7.3.3 期末基金持有的黄金衍生品情况

无。

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

无。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

无。

6.4.7.4.3 按预期信用损失一般模型计提减值准备的说明

无。

6.4.7.5 债权投资

6.4.7.5.1 债权投资情况

无。

6.4.7.5.2 债权投资减值准备计提情况

无。

6.4.7.6 其他债权投资

6.4.7.6.1 其他债权投资情况

无。

6.4.7.6.2 其他债权投资减值准备计提情况

无。

6.4.7.7 其他权益工具投资

6.4.7.7.1 其他权益工具投资情况

无。

6.4.7.7.2 报告期末其他权益工具投资情况

无。

6.4.7.8 其他资产

无。

6.4.7.9 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2022 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	—
应付赎回费	—
应付证券出借违约金	—
应付交易费用	5,338.29
其中：交易所市场	5,338.29
银行间市场	—
应付利息	—
预提费用	84,302.56
应付指数使用费	35,000.00
合计	124,640.85

6.4.7.10 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	71,229,922.00	91,821,874.07
本期申购	9,000,000.00	11,601,821.85
本期赎回（以“-”号填列）	-9,000,000.00	-11,601,821.87
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	71,229,922.00	91,821,874.05

注：申购含红利再投份额(如有)。

6.4.7.11 其他综合收益

无。

6.4.7.12 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
本期期初	5,844,301.16	8,318,081.70	14,162,382.86
本期利润	977,174.69	-13,836,464.72	-12,859,290.03
本期基金份额交易产生的变动数	-3,411.94	-333,234.01	-336,645.95
其中：基金申购款	783,695.24	-1,910,885.50	-1,127,190.26
基金赎回款	-787,107.18	1,577,651.49	790,544.31
本期已分配利润	—	—	—
本期末	6,818,063.91	-5,851,617.03	966,446.88

6.4.7.13 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	8,822.22
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	103.56
其他	65.90
合计	8,991.68

6.4.7.14 股票投资收益

6.4.7.14.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年6月30日
股票投资收益——买卖股票差价收入	-566,470.18
股票投资收益——赎回差价收入	1,208,495.66
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	642,025.48

6.4.7.14.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
卖出股票成交总额	4,557,120.93
减：卖出股票成本总额	5,112,479.60
减：交易费用	11,111.51
买卖股票差价收入	-566,470.18

6.4.7.14.3 股票投资收益——赎回差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年6月30日
赎回基金份额对价总额	10,811,277.56
减：现金支付赎回款总额	205,508.56
减：赎回股票成本总额	9,397,273.34
减：交易费用	—
赎回差价收入	1,208,495.66

6.4.7.14.4 股票投资收益——申购差价收入

无。

6.4.7.14.5 股票投资收益——证券出借差价收入

无。

6.4.7.15 债券投资收益

6.4.7.15.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年6月30日
债券投资收益——利息收入	18.13
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	16,110.38
债券投资收益——赎回差价收入	—
债券投资收益——申购差价收入	—
合计	16,128.51

6.4.7.15.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年6月30日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	54,929.08
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	38,800.00
减：应计利息总额	16.48
减：交易费用	2.22
买卖债券差价收入	16,110.38

6.4.7.16 资产支持证券投资收益

无。

6.4.7.17 贵金属投资收益

无。

6.4.7.18 衍生工具收益

无

6.4.7.19 股利收益

单位：人民币元

项目	本期
----	----

	2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
股票投资产生的股利收益	736,343.46
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	736,343.46

6.4.7.20 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
1. 交易性金融资产	-13,836,464.72
股票投资	-13,829,898.79
债券投资	-6,565.93
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	-13,836,464.72

6.4.7.21 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
基金赎回费收入	-
替代损益	272.00
合计	272.00

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

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

6.4.7.22 信用减值损失

无。

6.4.7.23 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
----	---------------------------------------

审计费用	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	305.00
指数使用费	70,000.00
其他	10.00
合计	154,617.56

6.4.7.24 分部报告

无。

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 或有事项

无。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

无。

6.4.9 关联方关系

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

本基金本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
大成基金管理有限公司（“大成基金”）	基金管理人
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。

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日	
	成交金额	占当期股票 成交总额的比例 (%)	成交金额	占当期股票 成交总额的比例(%)
光大证券	8,192,248.33	100.00	12,210,538.28	56.34

6.4.10.1.2 债券交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日	
	成交金额	占当期债券 成交总额的比例 (%)	成交金额	占当期债券 成交总额的比例 (%)
光大证券	54,929.08	100.00	-	-

6.4.10.1.3 债券回购交易

无。

6.4.10.1.4 权证交易

无。

6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日			
	当期 佣金	占当期佣金总量 的比例 (%)	期末应付佣金余 额	占期末应付佣金 总额的比例 (%)
光大证券	5,898.75	100.00	5,338.29	100.00
关联方名称	上年度可比期间 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日			
	当期 佣金	占当期佣金总量 的比例 (%)	期末应付佣金余 额	占期末应付佣金 总额的比例 (%)
光大证券	11,127.93	55.96	11,127.93	72.12

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。

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	226,640.75	334,652.91
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。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	45,328.13	66,930.60

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。

6.4.10.2.3 销售服务费

无。

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易

无。

6.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

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

无。

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

无。

6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

无。

6.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

无。

6.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
农业银行	2,667,103.98	8,822.22	-	-
中国农业银行	-	-	3,029,491.44	17,290.55

注：本基金由基金托管人保管的银行存款，按银行约定利率计息。

6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

金额单位：人民币元

本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日					
关联方名称	证券代码	证券名称	发行方式	基金在承销期内买入	
				数量（单位：张）	总金额
光大证券	001268	联合精密	网下发行	409	7873.25
上年度可比期间 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日					
关联方名称	证券代码	证券名称	发行方式	基金在承销期内买入	
				数量（单位：张）	总金额
-	-	-	-	-	-

6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

无。

6.4.11 利润分配情况

无。

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

6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

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

301117	佳缘科技	2022 年 1 月 7 日	6 个月	新股锁定	46.80	54.44	79	3,697.20	4,300.76	-
301139	元道通信	2022 年 6 月 30 日	1 个月内 (含)	新股未上市	38.46	38.46	965	37,113.90	37,113.90	-
301139	元道通信	2022 年 6 月 30 日	6 个月	新股锁定	38.46	38.46	108	4,153.68	4,153.68	-
301148	嘉戎技术	2022 年 4 月 14 日	6 个月	新股锁定	38.39	23.90	110	4,222.90	2,629.00	-
301150	中一科技	2022 年 4 月 14 日	6 个月	新股锁定	163.56	82.76	35	3,761.88	2,896.60	2022-06-10 每股送 0.5 股
301153	中科江南	2022 年 5 月 10 日	6 个月	新股锁定	33.68	43.98	100	3,368.00	4,398.00	-
301162	国能日新	2022 年 4 月 19 日	6 个月	新股锁定	45.13	54.11	89	4,016.57	4,815.79	-
301163	宏德股份	2022 年 4 月 11 日	6 个月	新股锁定	26.27	32.33	129	3,388.83	4,170.57	-
301196	唯科科技	2022 年 1 月 4 日	6 个月	新股锁定	64.08	37.52	36	2,306.88	1,350.72	-
301207	华兰疫苗	2022 年 2 月 10 日	6 个月	新股锁定	56.88	56.42	51	2,900.88	2,877.42	-
301216	万凯新材	2022 年 3 月 21 日	6 个月	新股锁定	35.68	29.84	108	3,853.44	3,222.72	-
301217	铜冠铜箔	2022 年 1 月 20 日	6 个月	新股锁定	17.27	14.83	320	5,526.40	4,745.60	-
301222	浙江恒威	2022 年 3 月 2 日	6 个月	新股锁定	33.98	28.96	94	3,194.12	2,722.24	-
301228	实朴检测	2022 年 1 月 21 日	6 个月	新股锁定	20.08	20.34	182	3,654.56	3,701.88	-
301248	杰创智能	2022 年 4 月 13 日	6 个月	新股锁定	39.07	29.87	112	4,375.84	3,345.44	-

		日								
301258	富士莱	2022 年 3 月 21 日	6 个月	新股锁定	48.30	41.68	59	2,849.70	2,459.12	-
301268	铭利达	2022 年 3 月 29 日	6 个月	新股锁定	28.50	34.87	119	3,391.50	4,149.53	-
301279	金道科技	2022 年 4 月 6 日	6 个月	新股锁定	31.20	22.81	99	3,088.80	2,258.19	-
301288	清研环境	2022 年 4 月 14 日	6 个月	新股锁定	19.09	19.98	192	3,665.28	3,836.16	-

6.4.12.1.2 受限证券类别：债券

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:张)	期末成本总额	期末估值总额	备注
127064	杭氧转债	2022 年 5 月 19 日	1-6 个月(含)	新债未上市	100.00	100.02	36	3,600.00	3,600.68	-

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

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

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

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

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
002670	国盛金控	2022 年 6 月 1 日	重大事项	9.60	2022 年 7 月 14 日	9.99	5,293	60,119.30	50,812.80	-

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。

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

无。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

无。

6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

无。

6.4.13 金融工具风险及管理

无。

6.4.13.1 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，将风险控制在此可承受的范围之内。

6.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合同责任，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。

本期末，本基金持有的除国债、央行票据和政策性金融债以外的债券占基金资产净值的比例为 0.03% (上年度末：无)。

6.4.13.3 流动性风险

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

6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》及《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》等有关法规的要求建立健全开放式基金流动性风险管理的内部控制体系，审慎评估各类资产的流动性，针对性制定流动性风险管理措施，对本基金组合资产的流动性风险进行管理。本基金的基金管理人采用监控基金组合资产持仓集中度指标、逆回购交易的到期日与交易对手的集中度、流动性受限资产比例、基金组合资产中 7 个工作日可变现资产的可变现价值以及压力测试等方式防范流动性风险。并于开放日对本基金的申购赎回情况进行监

控，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配，确保本基金资产的变现能力与投资者赎回需求的匹配与平衡。本基金的基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款，约定在非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。

6.4.13.4 市场风险

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

6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指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。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2022 年 6 月 30 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					

银行存款	2,667,103.98	-	-	-	2,667,103.98
存出保证金	7,363.29	-	-	-	7,363.29
交易性金融资产	-	-	31,470.36	90,251,107.88	90,282,578.24
资产总计	2,674,467.27	-	31,470.36	90,251,107.88	92,957,045.51
负债	-	-	-	-	-
应付管理人报酬	-	-	-	36,736.45	36,736.45
应付托管费	-	-	-	7,347.28	7,347.28
其他负债	-	-	-	124,640.85	124,640.85
负债总计	-	-	-	168,724.58	168,724.58
利率敏感度缺口	2,674,467.27	-	31,470.36	90,082,383.30	92,788,320.93
上年度末 2021 年 12 月 31 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	2,297,461.46	-	-	-	2,297,461.46
存出保证金	11,909.15	-	-	-	11,909.15
交易性金融资产	-	-	48,624.95	103,894,931.45	103,943,556.40
其他资产	-	-	-	588.28	588.28
资产总计	2,309,370.61	-	48,624.95	103,895,519.73	106,253,515.29
负债	-	-	-	-	-
应付管理人报酬	-	-	-	45,878.68	45,878.68
应付托管费	-	-	-	9,175.74	9,175.74
其他负债	-	-	-	214,203.94	214,203.94
负债总计	-	-	-	269,258.36	269,258.36
利率敏感度缺口	2,309,370.61	-	48,624.95	103,626,261.37	105,984,256.93

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

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

于本期末，本基金持有的交易性债券投资公允价值占基金资产净值的比例为 0.03%(上年度末：无)，因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响(上年度末：同)。

6.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无重大外汇风险。

6.4.13.4.3 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（含存托凭证）和备选成份股股票（含存托凭证）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。

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2022 年 6 月 30 日		上年度末 2021 年 12 月 31 日	
	公允价值	占基金资产净值比例 (%)	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
交易性金融资产—股票投资	90,251,107.88	97.27	103,894,931.45	98.03
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	90,251,107.88	97.27	103,894,931.45	98.03

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除业绩比较基准以外的其他市场变量保持不变		
	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2022 年 6 月 30 日）	上年度末（2021 年 12 月 31 日）
分析	1. 业绩比较基准上升 5%	4,519,474.40	5,119,034.89
	2. 业绩比较基准下降 5%	-4,519,474.40	-5,119,034.89

6.4.14 公允价值

6.4.14.1 金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属的层次，由对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次决定：

第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

6.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

6.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2022 年 6 月 30 日	上年度末 2021 年 12 月 31 日
第一层次	90,129,017.44	103,638,857.85
第二层次	95,681.06	304,698.55
第三层次	57,879.74	—
合计	90,282,578.24	103,943,556.40

6.4.14.2.2 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股票和债券，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股票和债券的公允价值列入第一层次；并根据估值调整中采用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度，确定相关股票、债券和基金的公允价值应属第二层次还是第三层次。

6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

于本期末，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产(上年度末：同)。

6.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

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

6.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

无。

§ 7 投资组合报告

7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	90,251,107.88	97.09
	其中：股票	90,251,107.88	97.09
2	基金投资	—	—
3	固定收益投资	31,470.36	0.03
	其中：债券	31,470.36	0.03
	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	2,667,103.98	2.87
8	其他各项资产	7,363.29	0.01
9	合计	92,957,045.51	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	2,116,277.27	2.28
B	采矿业	841,436.28	0.91
C	制造业	67,595,974.48	72.85
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	856,654.40	0.92
E	建筑业	93,064.04	0.10
F	批发和零售业	634,459.40	0.68
G	交通运输、仓储和邮政业	1,220,615.66	1.32
H	住宿和餐饮业	—	—
I	信息传输、软件和信息技术服务业	4,270,853.31	4.60
J	金融业	6,512,133.76	7.02
K	房地产业	1,867,051.23	2.01
L	租赁和商务服务业	893,444.31	0.96
M	科学研究和技术服务业	1,170,460.50	1.26
N	水利、环境和公共	231,404.54	0.25

	设施管理业		
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	60,216.00	0.06
Q	卫生和社会工作	958,662.37	1.03
R	文化、体育和娱乐业	613,245.25	0.66
S	综合	204,670.28	0.22
	合计	90,140,623.08	97.15

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	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	46,026.35	0.05
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
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	58,127.57	0.06
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	3,701.88	0.00
N	水利、环境和公共设施管理业	2,629.00	0.00
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	110,484.80	0.12

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	8,300	4,432,200.00	4.78
2	000858	五粮液	13,100	2,645,283.00	2.85
3	000333	美的集团	35,007	2,114,072.73	2.28
4	002594	比亚迪	6,100	2,034,289.00	2.19
5	300059	东方财富	72,215	1,834,261.00	1.98
6	000568	泸州老窖	5,400	1,331,316.00	1.43
7	000651	格力电器	33,500	1,129,620.00	1.22
8	002475	立讯精密	32,546	1,099,729.34	1.19
9	002415	海康威视	27,925	1,010,885.00	1.09
10	300760	迈瑞医疗	3,200	1,002,240.00	1.08
11	002714	牧原股份	17,606	973,083.62	1.05
12	002129	TCL 中环	16,300	959,907.00	1.03
13	000001	平安银行	61,100	915,278.00	0.99
14	002142	宁波银行	25,517	913,763.77	0.98
15	000002	万科 A	44,300	908,150.00	0.98
16	002812	恩捷股份	3,570	894,106.50	0.96
17	300014	亿纬锂能	9,031	880,522.50	0.95
18	002460	赣锋锂业	5,850	869,895.00	0.94
19	000725	京东方 A	215,800	850,252.00	0.92
20	002466	天齐锂业	6,800	848,640.00	0.91
21	002352	顺丰控股	14,800	825,988.00	0.89
22	300124	汇川技术	12,491	822,782.17	0.89
23	002304	洋河股份	4,362	798,900.30	0.86
24	300015	爱尔眼科	16,557	741,256.89	0.80
25	300498	温氏股份	33,805	719,708.45	0.78
26	300274	阳光电源	7,280	715,260.00	0.77
27	002271	东方雨虹	13,753	707,866.91	0.76
28	000792	盐湖股份	22,000	659,120.00	0.71
29	002049	紫光国微	3,200	607,104.00	0.65
30	300122	智飞生物	5,300	588,353.00	0.63
31	002241	歌尔股份	17,300	581,280.00	0.63
32	300142	沃森生物	11,700	566,163.00	0.61
33	000063	中兴通讯	21,700	554,001.00	0.60
34	002709	天赐材料	8,592	533,219.52	0.57
35	002230	科大讯飞	12,675	522,463.50	0.56
36	002459	晶澳科技	6,580	519,162.00	0.56
37	000625	长安汽车	29,514	511,182.48	0.55

38	000661	长春高新	2,160	504,187.20	0.54
39	002027	分众传媒	72,888	490,536.24	0.53
40	002371	北方华创	1,700	471,104.00	0.51
41	000338	潍柴动力	37,200	463,884.00	0.50
42	300450	先导智能	7,200	454,896.00	0.49
43	000100	TCL 科技	90,800	434,932.00	0.47
44	300347	泰格医药	3,750	429,187.50	0.46
45	300896	爱美客	700	420,007.00	0.45
46	002410	广联达	7,100	386,524.00	0.42
47	000776	广发证券	20,400	381,480.00	0.41
48	000733	振华科技	2,700	367,119.00	0.40
49	002050	三花智控	13,000	357,240.00	0.39
50	002179	中航光电	5,565	352,375.80	0.38
51	002493	荣盛石化	22,225	342,042.75	0.37
52	002311	海大集团	5,680	340,856.80	0.37
53	300769	德方纳米	820	335,117.60	0.36
54	000166	申万宏源	74,260	318,575.40	0.34
55	002821	凯莱英	1,100	317,900.00	0.34
56	000799	酒鬼酒	1,700	315,877.00	0.34
57	002074	国轩高科	6,890	314,184.00	0.34
58	300751	迈为股份	640	314,176.00	0.34
59	300661	圣邦股份	1,725	313,984.50	0.34
60	300782	卓胜微	2,253	304,155.00	0.33
61	000538	云南白药	4,900	295,911.00	0.32
62	002340	格林美	32,420	295,022.00	0.32
63	001979	招商蛇口	21,801	292,787.43	0.32
64	300316	晶盛机电	4,280	289,285.20	0.31
65	300496	中科创达	2,200	287,056.00	0.31
66	000768	中航西飞	9,400	284,726.00	0.31
67	002202	金风科技	19,136	283,212.80	0.31
68	300759	康龙化成	2,900	276,138.00	0.30
69	002920	德赛西威	1,800	266,400.00	0.29
70	002001	新和成	11,617	264,983.77	0.29
71	002176	江特电机	10,400	260,416.00	0.28
72	300390	天华超净	2,900	253,460.00	0.27
73	300207	欣旺达	8,000	252,800.00	0.27
74	000963	华东医药	5,595	252,670.20	0.27
75	000596	古井贡酒	1,000	249,660.00	0.27
76	300408	三环集团	8,200	246,820.00	0.27
77	000786	北新建材	7,100	245,802.00	0.26
78	300073	当升科技	2,700	243,918.00	0.26
79	300763	锦浪科技	1,140	242,820.00	0.26

80	002497	雅化集团	7,300	238,345.00	0.26
81	300012	华测检测	10,200	236,742.00	0.26
82	002405	四维图新	15,450	232,831.50	0.25
83	000876	新希望	15,200	232,560.00	0.25
84	002648	卫星化学	8,959	231,590.15	0.25
85	000895	双汇发展	7,800	228,540.00	0.25
86	002180	纳思达	4,500	227,790.00	0.25
87	002738	中矿资源	2,400	222,264.00	0.24
88	300999	金龙鱼	4,100	221,482.00	0.24
89	000157	中联重科	35,500	218,680.00	0.24
90	002407	多氟多	4,400	215,204.00	0.23
91	002756	永兴材料	1,400	213,094.00	0.23
92	002384	东山精密	9,200	210,956.00	0.23
93	002601	龙佰集团	10,500	210,525.00	0.23
94	000009	中国宝安	15,172	204,670.28	0.22
95	300568	星源材质	7,042	204,499.68	0.22
96	002236	大华股份	12,300	201,966.00	0.22
97	002555	三七互娱	9,500	201,685.00	0.22
98	000938	紫光股份	10,247	198,791.80	0.21
99	300285	国瓷材料	5,500	197,560.00	0.21
100	002008	大族激光	5,900	195,467.00	0.21
101	000425	徐工机械	36,200	195,118.00	0.21
102	000723	美锦能源	15,900	193,980.00	0.21
103	002736	国信证券	20,000	191,400.00	0.21
104	000983	山西焦煤	14,010	187,593.90	0.20
105	000683	远兴能源	17,700	186,027.00	0.20
106	300595	欧普康视	3,240	185,295.60	0.20
107	000977	浪潮信息	6,953	184,115.44	0.20
108	002841	视源股份	2,420	182,274.40	0.20
109	300037	新宙邦	3,460	181,857.60	0.20
110	000301	东方盛虹	10,600	179,246.00	0.19
111	300601	康泰生物	3,960	178,912.80	0.19
112	000069	华侨城 A	27,300	177,177.00	0.19
113	300454	深信服	1,700	176,426.00	0.19
114	300957	贝泰妮	800	174,024.00	0.19
115	002013	中航机电	14,062	173,665.70	0.19
116	002268	卫士通	3,960	169,923.60	0.18
117	002252	上海莱士	28,620	169,716.60	0.18
118	002007	华兰生物	7,360	167,808.00	0.18
119	002385	大北农	21,450	167,524.50	0.18
120	000519	中兵红箭	5,700	166,155.00	0.18
121	002625	光启技术	9,540	164,755.80	0.18

122	002185	华天科技	17,474	163,906.12	0.18
123	300363	博腾股份	2,100	163,779.00	0.18
124	300628	亿联网络	2,150	163,722.50	0.18
125	300144	宋城演艺	10,651	163,492.85	0.18
126	000630	铜陵有色	50,100	163,326.00	0.18
127	000762	西藏矿业	2,900	162,197.00	0.17
128	300529	健帆生物	3,180	161,830.20	0.17
129	300919	中伟股份	1,300	161,070.00	0.17
130	002797	第一创业	24,920	159,737.20	0.17
131	300433	蓝思科技	14,059	155,633.13	0.17
132	002056	横店东磁	5,800	154,396.00	0.17
133	002120	韵达股份	9,029	154,034.74	0.17
134	002353	杰瑞股份	3,800	153,140.00	0.17
135	300003	乐普医疗	8,226	152,756.82	0.16
136	000783	长江证券	25,700	152,401.00	0.16
137	000703	恒逸石化	14,166	148,884.66	0.16
138	300223	北京君正	1,400	148,750.00	0.16
139	002507	涪陵榨菜	4,300	148,436.00	0.16
140	000932	华菱钢铁	29,160	148,424.40	0.16
141	300413	芒果超媒	4,430	147,784.80	0.16
142	300033	同花顺	1,500	144,225.00	0.16
143	002850	科达利	900	143,100.00	0.15
144	300724	捷佳伟创	1,600	142,960.00	0.15
145	002028	思源电气	4,000	142,640.00	0.15
146	002245	蔚蓝锂芯	6,100	141,581.00	0.15
147	000988	华工科技	6,100	141,337.00	0.15
148	002602	世纪华通	29,309	141,269.38	0.15
149	300118	东方日升	4,800	140,784.00	0.15
150	000933	神火股份	10,700	139,956.00	0.15
151	002080	中材科技	5,080	139,700.00	0.15
152	000066	中国长城	12,904	139,621.28	0.15
153	002463	沪电股份	9,450	139,482.00	0.15
154	000831	五矿稀土	4,400	137,500.00	0.15
155	002603	以岭药业	5,624	136,663.20	0.15
156	300146	汤臣倍健	6,300	136,395.00	0.15
157	300373	扬杰科技	1,900	135,375.00	0.15
158	002312	川发龙蟒	7,800	134,628.00	0.15
159	003816	中国广核	47,400	132,720.00	0.14
160	002422	科伦药业	7,000	130,900.00	0.14
161	002138	顺络电子	4,800	130,800.00	0.14
162	002025	航天电器	1,870	130,563.40	0.14
163	000970	中科三环	6,945	130,427.10	0.14

164	002078	太阳纸业	10,400	128,024.00	0.14
165	000807	云铝股份	12,800	126,464.00	0.14
166	000738	航发控制	4,500	126,450.00	0.14
167	000830	鲁西化工	7,300	126,217.00	0.14
168	000423	东阿阿胶	3,400	125,630.00	0.14
169	000818	航锦科技	3,700	125,430.00	0.14
170	002557	洽洽食品	2,200	125,246.00	0.13
171	002624	完美世界	8,650	124,300.50	0.13
172	000591	太阳能	14,800	123,580.00	0.13
173	000708	中信特钢	6,090	122,713.50	0.13
174	002508	老板电器	3,390	122,141.70	0.13
175	000155	川能动力	5,500	121,825.00	0.13
176	000728	国元证券	19,550	121,601.00	0.13
177	002030	达安基因	7,065	121,447.35	0.13
178	000999	华润三九	2,682	120,690.00	0.13
179	300699	光威复材	2,040	120,094.80	0.13
180	000998	隆平高科	7,200	119,952.00	0.13
181	000960	锡业股份	7,121	119,419.17	0.13
182	002568	百润股份	3,948	118,597.92	0.13
183	002938	鹏鼎控股	3,900	117,819.00	0.13
184	002791	坚朗五金	900	116,748.00	0.13
185	002414	高德红外	9,014	116,010.18	0.13
186	300308	中际旭创	3,720	115,506.00	0.12
187	002673	西部证券	17,566	114,881.64	0.12
188	300676	华大基因	1,600	114,720.00	0.12
189	300346	南大光电	3,180	114,416.40	0.12
190	000039	中集集团	8,160	113,016.00	0.12
191	002572	索菲亚	4,108	112,970.00	0.12
192	002465	海格通信	12,400	112,716.00	0.12
193	002044	美年健康	20,204	112,536.28	0.12
194	002506	协鑫集成	30,200	112,344.00	0.12
195	000547	航天发展	9,400	112,236.00	0.12
196	300253	卫宁健康	12,747	111,918.66	0.12
197	002223	鱼跃医疗	4,330	111,107.80	0.12
198	002402	和而泰	5,800	110,548.00	0.12
199	000975	银泰黄金	11,277	109,837.98	0.12
200	300088	长信科技	14,800	109,816.00	0.12
201	300725	药石科技	1,100	108,889.00	0.12
202	002439	启明星辰	5,400	107,622.00	0.12
203	002531	天顺风能	6,500	107,185.00	0.12
204	000408	藏格矿业	3,200	105,408.00	0.11
205	300244	迪安诊断	3,372	104,869.20	0.11

206	002436	兴森科技	9,300	104,811.00	0.11
207	002456	欧菲光	15,600	104,676.00	0.11
208	300058	蓝色光标	15,919	103,951.07	0.11
209	300604	长川科技	2,300	103,845.00	0.11
210	300054	鼎龙股份	4,900	103,733.00	0.11
211	300776	帝尔激光	600	103,680.00	0.11
212	300558	贝达药业	1,700	103,360.00	0.11
213	300296	利亚德	14,150	103,295.00	0.11
214	002739	万达电影	7,500	102,375.00	0.11
215	002600	领益智造	20,300	101,906.00	0.11
216	002916	深南电路	1,084	101,581.64	0.11
217	300777	中简科技	2,100	101,220.00	0.11
218	000629	攀钢钒钛	26,600	101,080.00	0.11
219	300357	我武生物	1,940	100,938.20	0.11
220	000513	丽珠集团	2,767	100,193.07	0.11
221	300803	指南针	1,700	99,926.00	0.11
222	002597	金禾实业	2,300	99,659.00	0.11
223	002372	伟星新材	4,140	99,525.60	0.11
224	300026	红日药业	12,900	99,330.00	0.11
225	300474	景嘉微	1,450	99,165.50	0.11
226	000887	中鼎股份	5,400	98,496.00	0.11
227	300458	全志科技	3,264	98,213.76	0.11
228	300136	信维通信	5,820	98,067.00	0.11
229	300850	新强联	1,100	97,933.00	0.11
230	300035	中科电气	3,500	97,825.00	0.11
231	300775	三角防务	2,000	96,300.00	0.10
232	000860	顺鑫农业	3,590	96,283.80	0.10
233	002092	中泰化学	12,400	96,224.00	0.10
234	002273	水晶光电	7,914	95,838.54	0.10
235	002065	东华软件	15,000	94,800.00	0.10
236	300832	新产业	2,100	94,731.00	0.10
237	002409	雅克科技	1,700	94,367.00	0.10
238	002156	通富微电	6,100	93,940.00	0.10
239	002936	郑州银行	34,615	93,114.35	0.10
240	300618	寒锐钴业	1,592	92,208.64	0.10
241	000750	国海证券	25,365	92,074.95	0.10
242	000636	风华高科	4,900	92,071.00	0.10
243	002683	广东宏大	3,300	91,839.00	0.10
244	000623	吉林敖东	6,220	91,807.20	0.10
245	000878	云南铜业	8,000	91,120.00	0.10
246	000739	普洛药业	4,400	90,816.00	0.10
247	002430	杭氧股份	2,900	90,654.00	0.10

248	300748	金力永磁	2,460	90,528.00	0.10
249	002585	双星新材	5,000	90,450.00	0.10
250	002145	中核钛白	12,665	90,301.45	0.10
251	000400	许继电气	4,700	90,240.00	0.10
252	002294	信立泰	3,200	89,920.00	0.10
253	300418	昆仑万维	5,600	89,600.00	0.10
254	002617	露笑科技	7,900	89,507.00	0.10
255	002541	鸿路钢构	2,630	87,842.00	0.09
256	002487	大金重工	2,100	87,633.00	0.09
257	000875	吉电股份	12,600	87,570.00	0.09
258	002444	巨星科技	4,600	86,664.00	0.09
259	002064	华峰化学	10,200	86,088.00	0.09
260	000778	新兴铸管	17,800	85,796.00	0.09
261	002195	二三四五	38,064	85,644.00	0.09
262	000825	太钢不锈	15,700	85,565.00	0.09
263	300383	光环新网	8,200	85,444.00	0.09
264	002250	联化科技	5,200	85,124.00	0.09
265	300024	机器人	8,366	84,329.28	0.09
266	002643	万润股份	4,000	83,440.00	0.09
267	300861	美畅股份	900	83,421.00	0.09
268	002831	裕同科技	2,820	83,331.00	0.09
269	002747	埃斯顿	3,400	83,300.00	0.09
270	002926	华西证券	10,600	83,104.00	0.09
271	000729	燕京啤酒	8,600	83,076.00	0.09
272	002183	怡亚通	11,500	82,915.00	0.09
273	000050	深天马 A	8,300	82,751.00	0.09
274	002299	圣农发展	4,300	82,474.00	0.09
275	002373	千方科技	7,400	82,288.00	0.09
276	002958	青农商行	24,700	82,004.00	0.09
277	002706	良信股份	4,960	81,988.80	0.09
278	002966	苏州银行	13,400	81,740.00	0.09
279	300502	新易盛	3,101	81,246.20	0.09
280	002152	广电运通	8,750	81,112.50	0.09
281	002203	海亮股份	7,000	80,850.00	0.09
282	002500	山西证券	14,080	80,819.20	0.09
283	300182	捷成股份	14,634	80,487.00	0.09
284	002151	北斗星通	2,550	80,478.00	0.09
285	300979	华利集团	1,100	80,388.00	0.09
286	002131	利欧股份	41,434	80,381.96	0.09
287	002128	电投能源	5,600	80,192.00	0.09
288	002408	齐翔腾达	9,880	80,126.80	0.09
289	000021	深科技	6,866	79,920.24	0.09

290	300671	富满微	1,100	79,266.00	0.09
291	300017	网宿科技	14,752	79,070.72	0.09
292	300009	安科生物	7,786	78,716.46	0.08
293	300677	英科医疗	3,080	78,108.80	0.08
294	000060	中金岭南	17,500	78,050.00	0.08
295	300001	特锐德	4,500	77,895.00	0.08
296	000902	新洋丰	4,602	77,727.78	0.08
297	000617	中油资本	15,920	76,575.20	0.08
298	002212	天融信	7,500	76,125.00	0.08
299	300457	赢合科技	2,650	75,286.50	0.08
300	002396	星网锐捷	3,300	74,712.00	0.08
301	002019	亿帆医药	5,300	74,094.00	0.08
302	300294	博雅生物	2,050	73,697.50	0.08
303	300251	光线传媒	7,780	73,676.60	0.08
304	300666	江丰电子	1,200	73,200.00	0.08
305	300866	安克创新	1,100	72,952.00	0.08
306	002191	劲嘉股份	6,800	72,896.00	0.08
307	002002	鸿达兴业	19,461	72,200.31	0.08
308	002985	北摩高科	1,230	72,053.40	0.08
309	002153	石基信息	4,540	72,049.80	0.08
310	000997	新大陆	5,450	71,994.50	0.08
311	300034	钢研高纳	1,700	71,706.00	0.08
312	002389	航天彩虹	3,900	71,604.00	0.08
312	300476	胜宏科技	3,900	71,604.00	0.08
313	000581	威孚高科	3,700	71,225.00	0.08
314	002091	江苏国泰	6,600	70,950.00	0.08
315	300070	碧水源	13,614	70,928.94	0.08
316	000686	东北证券	10,120	70,738.80	0.08
317	000656	金科股份	24,700	70,642.00	0.08
318	002249	大洋电机	11,500	70,610.00	0.08
319	002505	鹏都农牧	20,630	69,935.70	0.08
320	003022	联泓新科	2,100	69,783.00	0.08
321	000883	湖北能源	13,600	69,496.00	0.07
322	002127	南极电商	12,850	68,619.00	0.07
323	300482	万孚生物	1,680	68,392.80	0.07
324	002244	滨江集团	7,900	68,335.00	0.07
325	002124	天邦食品	10,160	68,275.20	0.07
326	300623	捷捷微电	2,750	68,200.00	0.07
327	002939	长城证券	6,700	68,072.00	0.07
328	000709	河钢股份	30,100	68,026.00	0.07
329	000012	南玻 A	9,139	67,811.38	0.07
330	002558	巨人网络	7,400	67,710.00	0.07

331	002595	豪迈科技	3,000	67,020.00	0.07
332	002155	湖南黄金	5,500	66,770.00	0.07
333	300630	普利制药	1,886	66,292.90	0.07
334	000401	冀东水泥	6,300	66,276.00	0.07
335	002851	麦格米特	2,500	65,650.00	0.07
336	300682	朗新科技	2,600	65,494.00	0.07
337	300298	三诺生物	2,300	64,630.00	0.07
338	002221	东华能源	6,900	64,239.00	0.07
339	000035	中国天楹	12,100	63,525.00	0.07
340	300747	锐科激光	1,625	63,212.50	0.07
341	002701	奥瑞金	12,100	62,920.00	0.07
342	300773	拉卡拉	3,300	62,898.00	0.07
343	300685	艾德生物	1,960	62,720.00	0.07
344	002157	正邦科技	10,300	62,418.00	0.07
345	002032	苏泊尔	1,100	61,974.00	0.07
346	000027	深圳能源	9,640	61,792.40	0.07
347	002839	张家港行	11,680	61,787.20	0.07
348	300315	掌趣科技	18,400	61,456.00	0.07
349	300171	东富龙	1,800	61,038.00	0.07
350	002266	浙富控股	12,740	61,024.60	0.07
351	300376	易事特	7,500	60,900.00	0.07
352	002607	中公教育	10,400	60,216.00	0.06
353	002390	信邦制药	8,700	60,117.00	0.06
354	002511	中顺洁柔	4,800	60,096.00	0.06
355	000690	宝新能源	13,700	60,006.00	0.06
356	002532	天山铝业	9,100	59,423.00	0.06
357	000403	派林生物	2,700	59,292.00	0.06
358	300115	长盈精密	5,736	59,138.16	0.06
359	002004	华邦健康	10,500	58,590.00	0.06
360	300567	精测电子	1,350	58,320.00	0.06
361	300638	广和通	2,200	58,278.00	0.06
362	300451	创业慧康	8,092	58,262.40	0.06
363	300737	科顺股份	4,400	57,992.00	0.06
364	000785	居然之家	12,900	57,405.00	0.06
365	002075	沙钢股份	11,900	57,239.00	0.06
366	300672	国科微	700	57,232.00	0.06
367	300379	东方通	3,240	57,056.40	0.06
368	002675	东诚药业	4,200	56,700.00	0.06
369	000937	冀中能源	7,590	56,621.40	0.06
370	000987	越秀金控	8,035	56,486.05	0.06
371	002332	仙琚制药	5,700	55,974.00	0.06
372	001914	招商积余	3,100	55,707.00	0.06

373	300463	迈克生物	2,700	55,323.00	0.06
374	002010	传化智联	8,600	55,298.00	0.06
375	000930	中粮科技	6,100	55,144.00	0.06
376	000540	中天金融	28,526	55,055.18	0.06
377	300726	宏达电子	900	55,053.00	0.06
378	002123	梦网科技	4,700	54,708.00	0.06
379	002048	宁波华翔	3,400	54,468.00	0.06
380	000800	一汽解放	5,800	54,172.00	0.06
381	300459	汤姆猫	14,580	53,654.40	0.06
382	002468	申通快递	4,500	53,640.00	0.06
383	300072	海新能科	10,537	53,317.22	0.06
384	300888	稳健医疗	800	53,200.00	0.06
385	000559	万向钱潮	8,928	53,032.32	0.06
386	300456	赛微电子	2,900	53,012.00	0.06
387	002429	兆驰股份	13,800	52,992.00	0.06
388	300166	东方国信	5,739	52,913.58	0.06
389	000877	天山股份	4,300	52,890.00	0.06
390	002745	木林森	5,400	52,758.00	0.06
391	002727	一心堂	2,300	52,739.00	0.06
392	300212	易华录	2,999	52,182.60	0.06
393	002368	太极股份	2,711	52,078.31	0.06
394	300841	康华生物	450	51,948.00	0.06
395	000951	中国重汽	3,960	51,440.40	0.06
396	000712	锦龙股份	3,400	51,306.00	0.06
397	002081	金螳螂	10,063	51,120.04	0.06
398	002281	光迅科技	2,900	50,982.00	0.05
399	000089	深圳机场	6,600	50,952.00	0.05
400	002670	国盛金控	5,293	50,812.80	0.05
401	000488	晨鸣纸业	9,000	50,760.00	0.05
402	002041	登海种业	2,400	50,616.00	0.05
403	002099	海翔药业	7,300	50,589.00	0.05
404	000672	上峰水泥	3,180	50,180.40	0.05
405	000898	鞍钢股份	15,552	50,077.44	0.05
406	002626	金达威	2,100	50,064.00	0.05
407	000402	金融街	8,400	49,980.00	0.05
408	002690	美亚光电	2,300	49,864.00	0.05
409	002906	华阳集团	1,100	49,841.00	0.05
410	002984	森麒麟	1,600	49,776.00	0.05
411	300236	上海新阳	1,500	49,650.00	0.05
412	000598	兴蓉环境	9,600	49,056.00	0.05
413	002262	恩华药业	3,600	48,960.00	0.05
414	002705	新宝股份	2,200	48,378.00	0.05

415	002110	三钢闽光	7,850	47,806.50	0.05
416	002233	塔牌集团	5,400	47,790.00	0.05
417	000528	柳工	7,180	46,741.80	0.05
418	300674	宇信科技	2,980	46,726.40	0.05
419	002867	周大生	3,000	46,590.00	0.05
420	002085	万丰奥威	8,656	46,482.72	0.05
421	001965	招商公路	6,000	45,780.00	0.05
422	002216	三全食品	2,320	45,448.80	0.05
423	000156	华数传媒	5,700	45,429.00	0.05
424	002174	游族网络	4,600	44,942.00	0.05
425	002382	蓝帆医疗	4,700	44,885.00	0.05
426	300188	美亚柏科	3,300	44,484.00	0.05
427	003035	南网能源	7,000	44,450.00	0.05
428	000537	广宇发展	3,400	44,166.00	0.05
429	300821	东岳硅材	2,400	44,112.00	0.05
430	002948	青岛银行	12,110	43,838.20	0.05
431	000990	诚志股份	4,000	43,800.00	0.05
432	000935	四川双马	1,800	43,596.00	0.05
433	300369	绿盟科技	4,100	43,132.00	0.05
434	000627	天茂集团	12,500	42,625.00	0.05
435	002387	维信诺	6,300	42,336.00	0.05
436	000032	深桑达 A	2,800	41,944.00	0.05
437	300973	立高食品	400	41,580.00	0.04
438	000959	首钢股份	8,600	40,936.00	0.04
439	000563	陕国投 A	13,000	40,560.00	0.04
440	300257	开山股份	2,700	40,392.00	0.04
441	300761	立华股份	1,000	39,750.00	0.04
442	002612	朗姿股份	1,400	39,592.00	0.04
443	000961	中南建设	12,950	39,497.50	0.04
444	000555	神州信息	3,500	39,480.00	0.04
445	002237	恒邦股份	4,000	39,200.00	0.04
446	300633	开立医疗	1,300	39,039.00	0.04
447	301047	义翘神州	300	38,919.00	0.04
448	002925	盈趣科技	1,780	38,305.60	0.04
449	002146	荣盛发展	12,200	36,966.00	0.04
450	000718	苏宁环球	10,009	36,833.12	0.04
451	002773	康弘药业	2,460	36,752.40	0.04
452	000688	国城矿业	2,300	36,087.00	0.04
453	000967	盈峰环境	7,100	35,926.00	0.04
454	002434	万里扬	4,200	35,910.00	0.04
455	000921	海信家电	2,500	35,450.00	0.04
456	000685	中山公用	4,600	35,328.00	0.04

457	002498	汉缆股份	8,300	35,275.00	0.04
458	002242	九阳股份	1,900	34,884.00	0.04
459	002399	海普瑞	1,980	34,808.40	0.04
460	300770	新媒股份	920	34,803.60	0.04
461	000415	渤海租赁	16,000	34,720.00	0.04
462	000927	中国铁物	12,000	34,560.00	0.04
463	002423	中粮资本	5,100	34,221.00	0.04
464	000553	安道麦 A	2,700	32,697.00	0.04
465	002945	华林证券	2,100	32,025.00	0.03
466	000671	阳光城	14,500	31,755.00	0.03
467	300869	康泰医学	1,100	31,086.00	0.03
468	002563	森马服饰	5,200	30,784.00	0.03
469	301050	雷电微力	300	30,468.00	0.03
470	002967	广电计量	1,600	30,304.00	0.03
471	000028	国药一致	1,000	29,790.00	0.03
472	003012	东鹏控股	3,400	29,716.00	0.03
473	000062	深圳华强	2,305	29,273.50	0.03
474	002608	江苏国信	4,500	29,250.00	0.03
475	300702	天宇股份	1,020	28,978.20	0.03
476	002815	崇达技术	2,200	28,182.00	0.03
477	300741	华宝股份	1,000	27,820.00	0.03
478	001203	大中矿业	2,400	27,120.00	0.03
479	002243	力合科创	2,800	27,020.00	0.03
480	000869	张裕 A	900	26,766.00	0.03
481	000966	长源电力	4,400	26,576.00	0.03
482	300894	火星人	700	26,173.00	0.03
483	002320	海峡股份	4,568	25,991.92	0.03
484	000539	粤电力 A	6,100	25,620.00	0.03
485	000582	北部湾港	3,300	25,608.00	0.03
486	301029	怡合达	300	24,450.00	0.03
487	001872	招商港口	1,500	23,400.00	0.03
488	002978	安宁股份	600	23,178.00	0.02
489	002461	珠江啤酒	2,700	22,896.00	0.02
490	000958	电投产融	5,000	22,700.00	0.02
491	001289	龙源电力	1,000	21,760.00	0.02
492	300768	迪普科技	1,250	20,187.50	0.02
493	300783	三只松鼠	800	20,040.00	0.02
494	002653	海思科	1,200	19,332.00	0.02
495	002901	大博医疗	400	15,656.00	0.02
496	001213	中铁特货	3,100	15,221.00	0.02
497	002946	新乳业	1,100	14,289.00	0.02
498	003039	顺控发展	500	12,075.00	0.01

499	301078	孩子王	700	10,262.00	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	301139	元道通信	1,073	41,267.58	0.04
2	001268	联合精密	409	11,337.48	0.01
3	301162	国能日新	89	4,815.79	0.01
4	301217	铜冠铜箔	320	4,745.60	0.01
5	301153	中科江南	100	4,398.00	0.00
6	301117	佳缘科技	79	4,300.76	0.00
7	301163	宏德股份	129	4,170.57	0.00
8	301268	铭利达	119	4,149.53	0.00
9	301288	清研环境	192	3,836.16	0.00
10	301228	实朴检测	182	3,701.88	0.00
11	301248	杰创智能	112	3,345.44	0.00
12	301216	万凯新材	108	3,222.72	0.00
13	301150	中一科技	35	2,896.60	0.00
14	301207	华兰疫苗	51	2,877.42	0.00
15	301222	浙江恒威	94	2,722.24	0.00
16	301148	嘉戎技术	110	2,629.00	0.00
17	301258	富士莱	59	2,459.12	0.00
18	301279	金道科技	99	2,258.19	0.00
19	301196	唯科科技	36	1,350.72	0.00

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例（%）
1	002466	天齐锂业	845,269.00	0.80
2	002738	中矿资源	212,834.00	0.20
3	000519	中兵红箭	164,857.00	0.16
4	300363	博腾股份	164,404.00	0.16
5	000762	西藏矿业	148,032.00	0.14
6	000792	盐湖股份	136,870.00	0.13
7	300919	中伟股份	130,754.00	0.12
8	000408	藏格矿业	113,021.00	0.11
9	300035	中科电气	99,324.00	0.09
10	300850	新强联	95,752.00	0.09
11	000875	吉电股份	94,908.00	0.09
12	002739	万达电影	94,789.00	0.09
13	300776	帝尔激光	92,102.00	0.09

14	000636	风华高科	90,498.00	0.09
15	002487	大金重工	71,632.00	0.07
16	300034	钢研高纳	68,409.00	0.06
17	300957	贝泰妮	59,080.00	0.06
18	002041	登海种业	56,960.00	0.05
19	002352	顺丰控股	55,726.00	0.05
20	002906	华阳集团	55,273.00	0.05

注：

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

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	000858	五粮液	138,567.00	0.13
2	000333	美的集团	96,957.00	0.09
3	000516	国际医学	82,044.00	0.08
4	300068	南都电源	75,185.00	0.07
5	002594	比亚迪	70,580.00	0.07
6	000568	泸州老窖	64,319.00	0.06
7	002024	ST 易购	62,016.00	0.06
8	000651	格力电器	59,318.00	0.06
9	301117	佳缘科技	58,570.80	0.06
10	300498	温氏股份	55,481.00	0.05
11	301228	实朴检测	55,433.73	0.05
12	002074	国轩高科	54,564.00	0.05
13	000758	中色股份	54,463.00	0.05
14	300002	神州泰岳	54,207.18	0.05
15	001227	兰州银行	53,817.12	0.05
16	002217	合力泰	53,508.00	0.05
17	000001	平安银行	53,124.00	0.05
18	301217	铜冠铜箔	52,986.16	0.05
19	301153	中科江南	52,831.59	0.05
20	000002	万科 A	50,721.00	0.05

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

7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	4,434,831.16
卖出股票收入（成交）总额	4,557,120.93

注：上述金额均指成交金额（成交单价乘以成交数量），不考虑相关交易费用。

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	31,470.36	0.03
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	31,470.36	0.03

7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	127058	科伦转债	156	20,372.98	0.02
2	127056	中特转债	63	7,496.70	0.01
3	127064	杭氧转债	36	3,600.68	0.00

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

无。

7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

无。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

无。

7.10 本基金投资股指期货的投资政策

无。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.11.1 本期国债期货投资政策

无。

7.11.2 本期国债期货投资评价

无。

7.12 投资组合报告附注

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

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	7,363.29
2	应收清算款	—
3	应收股利	—
4	应收利息	—
5	应收申购款	—
6	其他应收款	—
7	待摊费用	—
8	其他	—
9	合计	7,363.29

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	301139	元道通信	41,267.58	0.04	新股未上市
2	301162	国能日新	4,815.79	0.01	新股锁定
3	301217	铜冠铜箔	4,745.60	0.01	新股锁定
4	301153	中科江南	4,398.00	0.00	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

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 (%)
3,210	22,190.01	2,150,682.00	3.02	69,079,240.00	96.98

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	刘小彦	1,551,750.00	2.18
2	中信建投证券股份有 限公司	1,374,694.00	1.93
3	吕君	1,099,023.00	1.54
4	顾勇	791,450.00	1.11
5	广州市杰泰实业发展 有限公司	775,946.00	1.09
6	黄赤峰	771,963.00	1.08
7	王仁斌	701,654.00	0.99
8	谢元禄	639,844.00	0.90
9	李长柱	586,938.00	0.82
10	戴济民	432,129.00	0.61

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	71,229,922.00
本报告期基金总申购份额	9,000,000.00
减：本报告期基金总赎回份额	9,000,000.00
本报告期基金拆分变动份额	—
本报告期期末基金份额总额	71,229,922.00

§ 10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

无。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

一、基金管理人的重大人事变动

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

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

二、基金托管人的基金托管部门的重大人事变动

2022 年 3 月，中国农业银行总行决定王霄勇任托管业务部总裁。

2022 年 3 月，中国农业银行总行决定王洪滨任托管业务部高级专家。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

无。

10.4 基金投资策略的改变

本基金投资策略在本报告期内没有重大改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金聘任的为本基金审计的会计师事务所为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	8,192,248.33	100.00	5,898.75	100.00	-
爱建证券	1	-	-	-	-	-
安信证券	1	-	-	-	-	-
川财证券	1	-	-	-	-	-
第一创业	1	-	-	-	-	-
东北证券	2	-	-	-	-	-
东财证券	1	-	-	-	-	-
东方证券	1	-	-	-	-	-
东吴证券	1	-	-	-	-	-
东兴证券	1	-	-	-	-	-
东亚前海	1	-	-	-	-	-
方正证券	1	-	-	-	-	-
高华证券	1	-	-	-	-	-
广发证券	2	-	-	-	-	-
国金证券	2	-	-	-	-	-
国盛证券	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	2	-	-	-	-	-
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	-	-	-	-	-
中信建投证券	2	-	-	-	-	-
中信证券	4	-	-	-	-	-
中银国际证券	1	-	-	-	-	-
中原证券	1	-	-	-	-	-

注：1、根据中国证监会颁布的《关于完善证券投资基金交易席位制度有关问题的通知》（证监基金字[2007]48号）的有关规定，本公司制定了租用证券公司交易单元的选择标准和程序。

租用证券公司交易单元的选择标准主要包括：

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

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

2、本报告期内本基金租用证券公司交易单元的变更情况如下：

本报告期内退租交易单元：无；

本报告期内新增交易单元：中信证券、东亚前海。

10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例(%)	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例(%)	成交金额	占当期权证成交总额的比例(%)
光大证券	54,929.08	100.00	-	-	-	-

10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	关于再次提请投资者及时更新已过期身份证件或者身份证明文件的公告	中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站	2022 年 06 月 30 日
2	关于大成深证成份交易型开放式指数证券投资基金流动性服务商的公告	中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站	2022 年 06 月 29 日
3	大成基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销证券的公告	中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站	2022 年 06 月 25 日
4	大成基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告	中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站	2022 年 06 月 02 日
5	大成深证成份交易型开放式指数证券投资基金 2022 年第 1 季度报告	中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站	2022 年 04 月 22 日
6	大成基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告	中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站	2022 年 04 月 16 日
7	大成深证成份交易型开放式指数证券投资基金 2021 年年度报告	中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站	2022 年 03 月 29 日
8	关于大成深证成份交易型开放式指数证券投资基金流动性服务商的公告	中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站	2022 年 03 月 21 日
9	大成基金管理有限公司关于公司固有资金拟申购旗下偏股型公募基金的公告	中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站	2022 年 01 月 27 日
10	大成深证成份交易型开放式指数证券投资基金 2021 年第 4 季度报告	中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站	2022 年 01 月 21 日

§ 11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

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

2022 年 8 月 30 日