

# 大成深证成份交易型开放式指数证券投资 基金 2022 年年度报告

2022 年 12 月 31 日

基金管理人：大成基金管理有限公司

基金托管人：中国农业银行股份有限公司

送出日期：2023 年 3 月 30 日

## § 1 重要提示及目录

### 1.1 重要提示

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

基金托管人中国农业银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2023 年 03 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。

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

本报告期自 2022 年 01 月 01 日起至 12 月 31 日止。

## 1.2 目录

<b>§ 1 重要提示及目录</b>	<b>2</b>
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
<b>§ 2 基金简介</b>	<b>5</b>
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人和基金托管人	5
2.4 信息披露方式	6
2.5 其他相关资料	6
<b>§ 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况</b>	<b>6</b>
3.1 主要会计数据和财务指标	6
3.2 基金净值表现	7
3.3 过去三年基金的利润分配情况	8
<b>§ 4 管理人报告</b>	<b>9</b>
4.1 基金管理人及基金经理情况	9
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	12
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	12
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明	13
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	14
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况	14
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	15
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	16
4.9 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明	16
<b>§ 5 托管人报告</b>	<b>16</b>
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	16
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	16
5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	16
<b>§ 6 审计报告</b>	<b>17</b>
<b>§ 7 年度财务报表</b>	<b>19</b>
7.1 资产负债表	19
7.2 利润表	20
7.3 净资产（基金净值）变动表	21
7.4 报表附注	24
<b>§ 8 投资组合报告</b>	<b>57</b>
8.1 期末基金资产组合情况	57
8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	57

8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细 .....	59
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动 .....	71
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合 .....	72
8.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细 .....	73
8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细 .....	73
8.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细 .....	73
8.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细 .....	73
8.10 本基金投资股指期货的投资政策 .....	73
8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 .....	73
8.12 投资组合报告附注 .....	73
<b>§ 9 基金份额持有人信息 .....</b>	<b>74</b>
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....	74
9.2 期末上市基金前十名持有人 .....	74
9.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....	75
9.4 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 .....	75
9.5 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理本人及其直系亲属持有本人管理的产品情况 .....	75
<b>§ 10 开放式基金份额变动 .....</b>	<b>75</b>
<b>§ 11 重大事件揭示 .....</b>	<b>75</b>
11.1 基金份额持有人大会决议 .....	75
11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动 .....	75
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....	76
11.4 基金投资策略的改变 .....	76
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....	76
11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况 .....	76
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	77
11.8 其他重大事件 .....	79
<b>§ 12 影响投资者决策的其他重要信息 .....</b>	<b>80</b>
12.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况 .....	80
12.2 影响投资者决策的其他重要信息 .....	80
<b>§ 13 备查文件目录 .....</b>	<b>81</b>
13.1 备查文件目录 .....	81
13.2 存放地点 .....	81
13.3 查阅方式 .....	81

## § 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	86,229,922.00 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
	联系电话	0755-83183388
	电子邮箱	office@dcfund.com.cn
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 1236 号大成基金总部大厦 5 层、	北京市东城区建国门内大街 69 号

	27-33 层	
办公地址	广东省深圳市南山区海德三道 1236 号大成基金总部大厦 5 层、 27-33 层	北京市西城区复兴门内大街 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》
登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	www.dcfund.com.cn
基金年度报告备置地点	基金管理人及基金托管人住所

## 2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
会计师事务所	普华永道中天会计师事务所 (特殊普通合伙)	上海市浦东新区东育路 588 号前滩中心 42 楼
注册登记机构	中国证券登记结算有限责任公 司	北京市西城区太平桥大街 17 号

## § 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

### 3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间 数据和指标	2022 年	2021 年	2020 年
本期已实现 收益	1,068,722.02	37,876,872.98	46,867,287.39
本期利润	-25,445,009.24	12,499,252.62	85,697,223.38
加权平均基 金份额本期 利润	-0.3366	0.5753	4.8799
本期加权平 均净值利润 率	-27.81%	10.06%	37.07%
本期基金份 额净值增长 率	-24.33%	8.52%	42.54%
3.1.2 期末 数据和指标	2022 年末	2021 年末	2020 年末
期末可供分 配利润	-14,103,353.51	5,844,301.16	-40,829,315.05
期末可供分 配基金份额 利润	-0.1636	0.0820	-3.9126
期末基金资	97,054,890.31	105,984,256.93	169,082,742.03

产净值			
期末基金份额净值	1.126	1.488	16.203
3.1.3 累计期末指标	2022 年末	2021 年末	2020 年末
基金份额累计净值增长率	-12.64%	15.44%	6.37%

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。

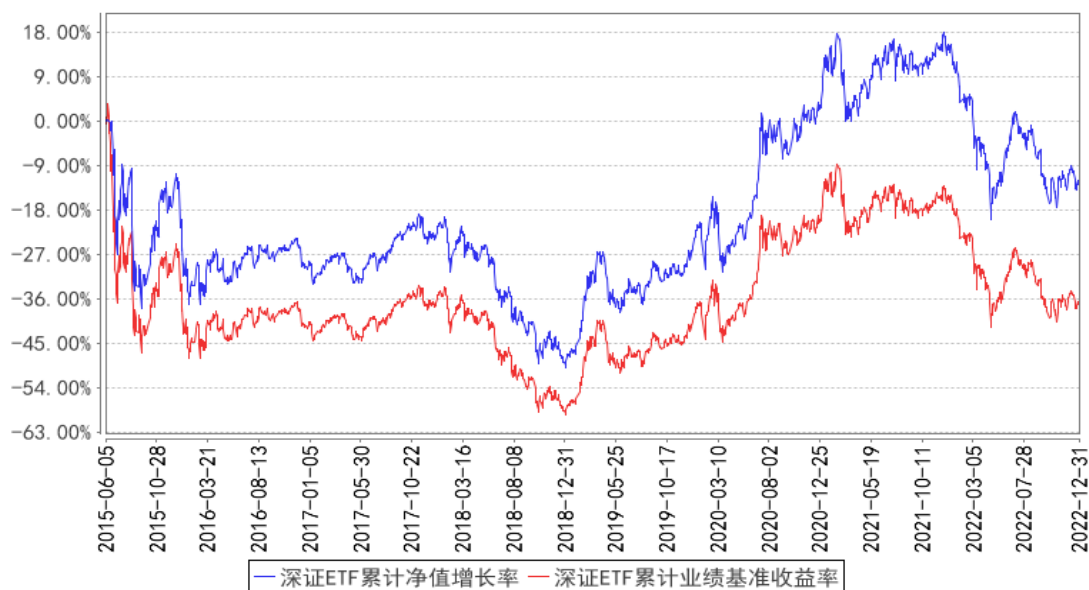
## 3.2 基金净值表现

### 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
过去三个月	2.18%	1.24%	2.20%	1.29%	-0.02%	-0.05%
过去六个月	-13.58%	1.15%	-14.58%	1.20%	1.00%	-0.05%
过去一年	-24.33%	1.41%	-25.85%	1.46%	1.52%	-0.05%
过去三年	17.06%	1.44%	5.61%	1.47%	11.45%	-0.03%
过去五年	13.58%	1.45%	-0.22%	1.48%	13.80%	-0.03%
自基金合同生效起至今	-12.64%	1.59%	-37.06%	1.64%	24.42%	-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

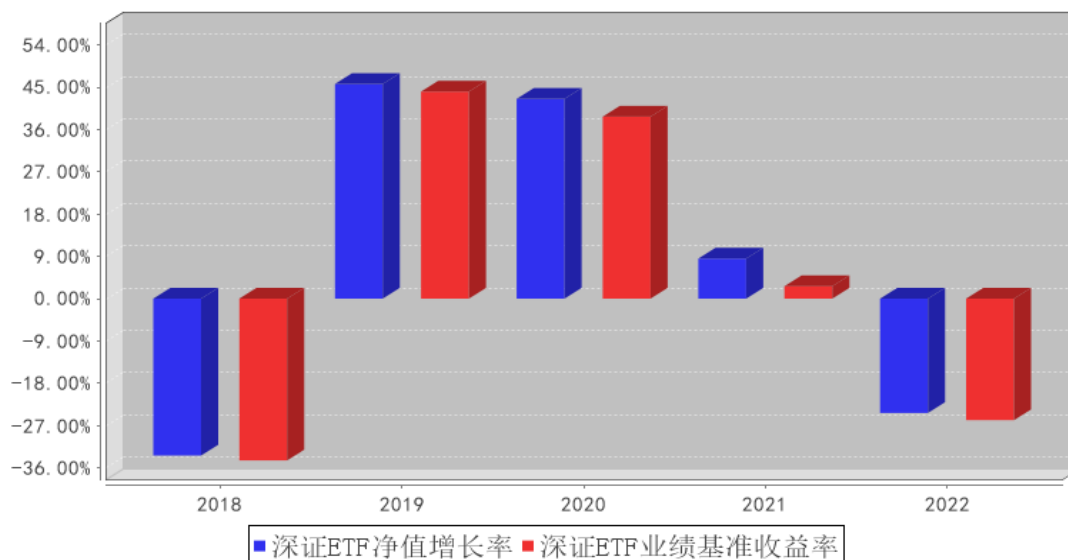
深证ETF累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



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。

### 3.2.3 过去五年基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

深证ETF基金每年净值增长率与同期业绩比较基准收益率的对比图



### 3.3 过去三年基金的利润分配情况

无。



## § 4 管理人报告

### 4.1 基金管理人及基金经理情况

#### 4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

大成基金管理有限公司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。

历经二十多年的发展，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		
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

					<p>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 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。2020 年 6 月 29 日至 2022 年 11 月 30 日任大成中证 500 深市交易型开放式指数证券投资基金基金经理。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 日至 2022 年 12 月 8 日任中证 500 沪市交易型开放式指数证券投资基金基金经理。2021 年 9 月 2 日起任大成中证 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。2022 年 10 月 13 日起任大成动态量化配置策略混合型证券投资基金基金经理。具备基金从业资格。国籍：中国</p>
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	<p>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 日至 2022 年 12 月 8 日任中证 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</p>

					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
王宁	本基金基金经理助理	2022 年 8 月 1 日	-	4 年	法国雷恩高等商学院管理学硕士。2017 年 6 月至 2018 年 10 月任平安道远投资管理（上海）有限公司企划财务部企划财务。2018 年 11 月至 2022 年 7 月任平安基金管理有限公司 ETF 指数投资部指数研究员、基金经理助理。2022 年 7 月加入大成基金管理有限公司，现任指数与期货投资部基金经理助理。2022 年 8 月 1 日至 2022 年 11 月 30 日任大成中证 500 深市交易型开放式指数证券投资基金基金经理助理。2022 年 8 月 1 日至 2022 年 12 月 8 日任中证 500 沪市交易型开放式指数证券投资基金基金经理助理。2022 年 8 月 1 日起任大成有色金属期货交易型开放式指数证券投资基金、大成上海金交易型开放式证券投资基金、大成有色金属期货交易型开放式指数证券投资基金联接基金、大成绝对收益策略混合型发起式证券投资基金、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、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、深证成长 40 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、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、大成深证成长 40 交易型开放式指数证券投资基金联接基金、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。具备基金从业资格。国籍：中国
刘旺	本基金基	2022 年	-	4 年	香港中文大学理学（金融工程）硕士。2018

	金经理助理	12 月 19 日			年 5 月加入大成基金管理有限公司，现任指数与期货投资部研究员兼基金经理助理。2022 年 12 月 19 日起任大成有色金属期货交易型开放式指数证券投资基金、大成有色金属期货交易型开放式指数证券投资基金联接基金、大成上海金交易型开放式证券投资基金、大成绝对收益策略混合型发起式证券投资基金、大成沪深 300 指数证券投资基金、大成景恒混合型证券投资基金、大成核心双动力混合型证券投资基金、大成智慧量化多策略灵活配置混合型证券投资基金、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、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、大成深证成长 40 交易型开放式指数证券投资基金、大成深证成长 40 交易型开放式指数证券投资基金联接基金、大成深证成份交易型开放式指数证券投资基金、大成中证电池主题指数型发起式证券投资基金、大成动态量化配置策略混合型证券投资基金基金经理助理。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

#### 4.1.4 基金经理薪酬机制

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 公平交易制度和控制方法

根据《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》的规定，公司制订了《大成基金管理有限公司公平交易制度》、《大成基金管理有限公司异常交易监控与报告制度》。公司旗下投资组合

严格按照制度的规定，参与股票、债券的一级市场申购、二级市场交易等投资管理活动，内容包括授权、研究分析、投资决策、交易执行、业绩评估等与投资活动相关的各个环节。研究部负责提供投资研究支持，投资部门负责投资决策，交易管理部负责实施交易并实时监控，监察稽核部负责事前监督、事中检查和事后稽核，风险管理部负责对交易情况进行合理性分析，通过多部门的协作互控，保证了公平交易的可操作、可稽核和可持续。

#### 4.3.2 公平交易制度的执行情况

报告期内，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，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。

##### 4.3.2.1 增加执行的基金经理公平交易制度执行情况及公平交易管理情况

无。

#### 4.3.3 异常交易行为的专项说明

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 8 笔同日反向交易，原因为流动性需要或投资策略需要。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 4 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

无论国际地缘政治，还是国际宏观经济、资本市场，2022 都是跌宕起伏的一年。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。迫于通胀压力，美联储鹰派尽显，美元指数和美债收益率一路走高。

资本市场的动荡，也成为了时代的注脚。以美股为首，境外主要股票市场一度跌幅巨大。A 股市场也经历了一定程度的波动。上半年，国际地缘政治冲突等因素导致了外资撤离，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，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，直至出清止跌。阶段性反弹后，类似的剧本在下半年又再上演，虽然烈度有所不及，但还是有一定的相似之处。总体来说，在几波下跌中，价值风格表现出了良好的防御属性，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 25.86%。本年度，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 1.126 元；本报告期基金份额净值增长率为-24.33%，业绩比较基准收益率为-25.85%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望明年，经济完全复苏尚需时日，宏观经济环境大概率将有所改善。通胀水平对货币政策影响有限，预计市场流动性仍将维持较为宽松的状态。

对于股票市场，经济弱复苏和流动性宽松的组合较为友好。上市公司基本面在边际上持续改善，将有效提振投资者信心，宏观经济在短期内也不会过热到促使货币政策转向。经过之前的调整，大量股票目前处于中长期的低位区间，未来估值修复的空间较大。

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 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

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

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

（二）全面加强风险监控，不断提高基金业务风险管理水平。为督促各部门完善并落实各项内控措施，公司严格执行风险控制管理员制度，健全内控工作协调机制及监督机制，并进一步加

强投资风险量化评价能力及事前风险防范能力，有效防范相关业务风险。同时，公司严格执行投资报备制度，建立了基金从业人员证券投资管理监控信息系统，将投资报备工作纳入常态。

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

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

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

#### 4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

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

#### 4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

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

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

无。

### § 5 托管人报告

#### 5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

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一大成基金管理有限公司 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 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 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人认为，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年度报告中的财务



指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告等信息真实、准确、完整，未发现有关损害基金持有人利益的行为。

## § 6 审计报告

审计报告标题	审计报告
审计报告收件人	大成深证成份交易型开放式指数证券投资基金全体基金份额持有人
审计意见	<p>(一)我们审计的内容</p> <p>我们审计了大成深证成份交易型开放式指数证券投资基金(以下简称“大成深证ETF”)的财务报表,包括2022年12月31日的资产负债表,2022年度的利润表和净资产(基金净值)变动表以及财务报表附注。</p> <p>(二)我们的意见</p> <p>我们认为,后附的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则和在财务报表附注中所列示的中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制,公允反映了大成深证ETF2022年12月31日的财务状况以及2022年度的经营成果和净资产变动情况。</p>
形成审计意见的基础	<p>我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。审计报告的“注册会计师对财务报表审计的责任”部分进一步阐述了我们在这些准则下的责任。我们相信,我们获取的审计证据是充分、适当的,为发表审计意见提供了基础。</p> <p>按照中国注册会计师职业道德守则,我们独立于大成深证ETF,并履行了职业道德方面的其他责任。</p>
其他信息	<p>大成深证ETF基金的基金管理人大成基金管理有限公司(以下简称“基金管理人”)管理层对其他信息负责。其他信息包括大成深证ETF基金2022年年度报告中涵盖的信息,但不包括财务报表和我们的审计报告。</p> <p>我们对财务报表发表的审计意见不涵盖其他信息,我们也不对其他信息发表任何形式的鉴证结论。</p> <p>结合我们对财务报表的审计,我们的责任是阅读其他信息,在此过程中,考虑其他信息是否与财务报表或我们在审计过程中了解到的情况存在重大不一致或者似乎存在重大错报。基于我们已经执行的工作,如果我们确定其他信息存在重大错报,我们应当报告该事实。在这方面,我们无任何事项需要报告。</p>
管理层和治理层对财务报表的责任	大成深证ETF的基金管理人大成基金管理有限公司(以下简称“基金管理人”)管理层负责按照企业会计准则和中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制财务报表,使其实现公允反映,并设计、执行和维

	<p>护必要的内部控制，以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。</p> <p>在编制财务报表时，基金管理人管理层负责评估大成深证 ETF 的持续经营能力，披露与持续经营相关的事项(如适用)，并运用持续经营假设，除非基金管理人管理层计划清算大成深证 ETF、终止运营或别无其他现实的选择。</p> <p>基金管理人治理层负责监督大成深证 ETF 的财务报告过程。</p>
注册会计师对财务报表审计的责任	<p>我们的目标是对财务报表整体是否不存在由于舞弊或错误导致的重大错报获取合理保证，并出具包含审计意见的审计报告。合理保证是高水平的保证，但并不能保证按照审计准则执行的审计在某一重大错报存在时总能发现。错报可能由于舞弊或错误导致，如果合理预期错报单独或汇总起来可能影响财务报表使用者依据财务报表作出的经济决策，则通常认为错报是重大的。</p> <p>在按照审计准则执行审计工作的过程中，我们运用职业判断，并保持职业怀疑。同时，我们也执行以下工作：</p> <p>(一) 识别和评估由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险；设计和实施审计程序以应对这些风险，并获取充分、适当的审计证据，作为发表审计意见的基础。由于舞弊可能涉及串通、伪造、故意遗漏、虚假陈述或凌驾于内部控制之上，未能发现由于舞弊导致的重大错报的风险高于未能发现由于错误导致的重大错报的风险。</p> <p>(二) 了解与审计相关的内部控制，以设计恰当的审计程序，但目的并非对内部控制的有效性发表意见。</p> <p>(三) 评价基金管理人管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计及相关披露的合理性。</p> <p>(四) 对基金管理人管理层使用持续经营假设的恰当性得出结论。同时，根据获取的审计证据，就可能对大成深证 ETF 持续经营能力产生重大疑虑的事项或情况是否存在重大不确定性得出结论。如果我们得出结论认为存在重大不确定性，审计准则要求我们在审计报告中提请报表使用者注意财务报表中的相关披露；如果披露不充分，我们应当发表非无保留意见。我们的结论基于截至审计报告日可获得的信息。然而，未来的事项或情况可能导致大成深证 ETF 不能持续经营。</p> <p>(五) 评价财务报表的总体列报(包括披露)、结构和内容，并评价财务报表是否公允反映相关交易和事项。</p> <p>我们与基金管理人治理层就计划的审计范围、时间安排和重大审计发现等事项进行沟通，包括沟通我们在审计中识别出的值得关注的内部控制缺陷。</p>
会计师事务所的名称	普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）
注册会计师的姓名	陈熹   徐翹楚
会计师事务所的地址	上海市浦东新区东育路 588 号前滩中心 42 楼
审计报告日期	2023 年 3 月 29 日

## § 7 年度财务报表

## 7.1 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 12 月 31 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2022 年 12 月 31 日	上年度末 2021 年 12 月 31 日
<b>资产：</b>			
银行存款	7.4.7.1	3,417,635.54	2,297,461.46
结算备付金		-	-
存出保证金		5,798.31	11,909.15
交易性金融资产	7.4.7.2	94,615,200.83	103,943,556.40
其中：股票投资		94,615,200.83	103,894,931.45
基金投资		-	-
债券投资		-	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	7.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	-	-
债权投资	7.4.7.5	-	-
其中：债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
其他投资		-	-
其他债权投资	7.4.7.6	-	-
其他权益工具投资	7.4.7.7	-	-
应收清算款		44,046.57	-
应收股利		-	-
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.8	-	588.28
资产总计		98,082,681.25	106,253,515.29
<b>负债和净资产</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2022 年 12 月 31 日</b>	<b>上年度末 2021 年 12 月 31 日</b>
<b>负债：</b>			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	7.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付清算款		764,118.97	-
应付赎回款		-	-

应付管理人报酬		40,491.16	45,878.68
应付托管费		8,098.23	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	7.4.7.9	215,082.58	214,203.94
负债合计		1,027,790.94	269,258.36
<b>净资产：</b>			
实收基金	7.4.7.10	111,158,243.82	91,821,874.07
其他综合收益	7.4.7.11	-	-
未分配利润	7.4.7.12	-14,103,353.51	14,162,382.86
净资产合计		97,054,890.31	105,984,256.93
负债和净资产总计		98,082,681.25	106,253,515.29

注：报告截止日 2022 年 12 月 31 日，基金份额净值 1.126 元，基金份额总额 86,229,922.00 份。

## 7.2 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 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日
<b>一、营业总收入</b>		-24,585,950.71	13,612,284.42
1. 利息收入		20,725.50	34,320.46
其中：存款利息收入	7.4.7.13	20,725.50	34,304.36
债券利息收入		-	16.10
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）		1,903,879.85	38,985,496.02
其中：股票投资收益	7.4.7.14	736,755.69	37,665,573.27
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.15	37,459.47	10,493.30
资产支持证券投资	7.4.7.16	-	-
收益		-	-
贵金属投资收益	7.4.7.17	-	-
衍生工具收益	7.4.7.18	-	-

股利收益	7.4.7.19	1,129,664.69	1,309,429.45
以摊余成本计量的金融资产终止确认产生的收益		-	-
其他投资收益		-	-
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.20	-26,513,731.26	-25,377,620.36
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.21	3,175.20	-29,911.70
<b>减：二、营业总支出</b>		859,058.53	1,113,031.80
1. 管理人报酬	7.4.10.2.1	457,211.26	623,563.19
2. 托管费	7.4.10.2.2	91,442.27	124,712.62
3. 销售服务费	7.4.10.2.3	-	-
4. 投资顾问费		-	-
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 信用减值损失	7.4.7.22	-	-
7. 税金及附加		-	0.02
8. 其他费用	7.4.7.23	310,405.00	364,755.97
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		-25,445,009.24	12,499,252.62
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		-25,445,009.24	12,499,252.62
<b>五、其他综合收益的税后净额</b>		-	-
<b>六、综合收益总额</b>		-25,445,009.24	12,499,252.62

### 7.3 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 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产(基金净值)	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、本期末期初净资产(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)	19,336,369.75	-	-28,265,736.37	-8,929,366.62
(一)、综合收益总额	-	-	-25,445,009.24	-25,445,009.24
(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)	19,336,369.75	-	-2,820,727.13	16,515,642.62
其中:1.基金申购款	34,805,465.57	-	-4,026,584.00	30,778,881.57
2.基金赎回款	-15,469,095.82	-	1,205,856.87	-14,263,238.95
(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、本期末净资产(基金净值)	111,158,243.82	-	-14,103,353.51	97,054,890.31
项目	上年度可比期间 2021年1月1日至2021年12月31日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产(基金净值)	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)	-67,145,370.74	-	4,046,885.64	-63,098,485.10
(一)、综合收益总额	-	-	12,499,252.62	12,499,252.62
(二)、本期基金份额交易产生的基金净值	-67,145,370.74	-	-8,452,366.98	-75,597,737.72

变动数 (净值 减少以 “-”号 填列)				
其中:1. 基金申 购款	13,710,189.89	-	1,538,135.08	15,248,324.97
2 .基金赎 回款	-80,855,560.63	-	-9,990,502.06	-90,846,062.69
(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)	91,821,874.07	-	14,162,382.86	105,984,256.93

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.4 财务报表由下列负责人签署：

谭晓冈

基金管理人负责人

范瑛

主管会计工作负责人

孙蕊

会计机构负责人

## 7.4 报表附注

### 7.4.1 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



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。

本财务报表由本基金的基金管理人大成基金管理有限公司于2023年3月29日批准报出。

#### 7.4.2 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、《资产管理产品相关会计处理规定》及其他相关规定(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 7.4.4 所列示的中国证监会、中国基金业协会发布的有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。

### 7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2022 年度财务报表符合企业会计准则的要求,真实、完整地反映了本基金 2022 年 12 月 31 日的财务状况以及 2022 年度的经营成果和净资产变动情况等有关信息。

### 7.4.4 重要会计政策和会计估计

#### 7.4.4.1 会计年度

本基金会计年度为公历 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

#### 7.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

#### 7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

##### 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和资产支持证券投资，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、资产支持证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。

#### 7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

##### 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和资产支持证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。

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和资产支持证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。

#### 7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

本基金持有的股票投资、债券投资、资产支持证券投资和衍生工具按如下原则确定公允价值并进行估值：

(1) 存在活跃市场的金融工具按其估值日的市场交易价格确定公允价值；估值日无交易且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，按最近交易日的市场交易价格确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的市场交易价格不能真实反映公允价值的，应对市场交易价格进行调整，确定公允价值。与上述投资品种相同，但具有不同特征的，应以相同资产或负债的公允价值为基础，并在估值技术中考虑不同特征因素的影响。特征是指对资产出售或使用的限制等，如果该限制是针对资产持有者的，那么在估值技术中不应将该限制作为特征考虑。此外，基金管理人不应考虑因大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价。

(2) 当金融工具不存在活跃市场，采用在当前情况下适用并且有足够可利用数据和其他信息

支持的估值技术确定公允价值。采用估值技术时，优先使用可观察输入值，只有在无法取得相关资产或负债可观察输入值或取得不切实可行的情况下，才可以使用不可观察输入值。

(3) 如经济环境发生重大变化或证券发行人发生影响金融工具价格的重大事件，应对估值进行调整并确定公允价值。

#### 7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

本基金持有的资产和承担的负债基本为金融资产和金融负债。当本基金 1) 具有抵销已确认金额的法定权利且该种法定权利现在是可执行的；且 2) 交易双方准备按净额结算时，金融资产与金融负债按抵销后的净额在资产负债表中列示。

#### 7.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行基金份额所募集的总金额在扣除损益平准金分摊部分后的余额。由于基金份额拆分引起的实收基金份额变动于基金份额拆分日根据拆分前的基金份额数及确定的拆分比例计算认列。由于基金份额折算引起的实收基金份额变动于基金份额折算日根据折算前的基金份额数及确定的折算比例计算认列。由于申购和赎回引起的实收基金变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日认列。

#### 7.4.4.8 损益平准金

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

#### 7.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

##### 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。债券投资和资产支持证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和资产支持证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扣除按票面利率(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后的净额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。债券投资和资产支持证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和资产支持证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。

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。

#### 7.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬和托管费在费用涵盖期间按基金合同约定的费率和计算方法确认。

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

#### 7.4.4.11 基金的收益分配政策

每一基金份额享有同等分配权。本基金收益以现金形式分配。当基金份额净值增长率超过标的指数同期增长率达到 1%以上时，基金管理人可进行收益分配。在符合有关基金分红条件的前提下，本基金每年收益分配次数最多为 12 次，每次分配比例不得低于收益分配基准日每份基金份额可供分配利润的 10%；若基金合同生效不满 3 个月，可不进行收益分配。

经宣告的拟分配基金收益于分红除权日从净资产转出。

#### 7.4.4.12 分部报告

本基金以内部组织结构、管理要求、内部报告制度为依据确定经营分部，以经营分部为基础确定报告分部并披露分部信息。经营分部是指本基金内同时满足下列条件的组成部分：(1) 该组成部分能够在日常活动中产生收入、发生费用；(2) 本基金的基金管理人能够定期评价该组成部

分的经营成果，以决定向其配置资源、评价其业绩；(3) 本基金能够取得该组成部分的财务状况、经营成果和现金流量等有关会计信息。如果两个或多个经营分部具有相似的经济特征，并且满足一定条件的，则合并为一个经营分部。

本基金目前以一个单一的经营分部运作，不需要披露分部信息。

#### 7.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计

根据本基金的估值原则和中国证监会允许的基金行业估值实务操作，本基金确定以下类别股票投资、债券投资和资产支持证券投资的公允价值时采用的估值方法及其关键假设如下：

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

(2) 对于在锁定期内的非公开发行股票、首次公开发行股票时公司股东公开发售股份、通过大宗交易取得的带限售期的股票等流通受限股票，根据中国基金业协会中基协发[2017]6号《关于发布〈证券投资基金投资流通受限股票估值指引(试行)〉的通知》之附件《证券投资基金投资流通受限股票估值指引(试行)》(以下简称“指引”)，按估值日在证券交易所上市交易的同一股票的公允价值扣除中证指数有限公司根据指引所独立提供的该流通受限股票剩余限售期对应的流动性折扣后的价值进行估值。

(3) 对于在证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券、可交换债券和私募债券除外)及在银行间同业市场交易的固定收益品种，根据中国证监会公告[2017]13号《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》及《中国证券投资基金业协会估值核算工作小组关于2015年1季度固定收益品种的估值处理标准》采用估值技术确定公允价值。本基金持有的证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券、可交换债券和私募债券除外)，按照中证指数有限公司所独立提供的估值结果确定公允价值。本基金持有的银行间同业市场固定收益品种按照中债金融估值中心有限公司所独立提供的估值结果确定公允价值。

#### 7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

##### 7.4.5.1 会计政策变更的说明

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，财政部于 2022 年颁布了《关于印发《资产管理产品相关会计处理规定》的通知》(财会[2022]14 号)，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 2022 年度财务报表，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如下：

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 元。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。

(ii) 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) 《资产管理产品相关会计处理规定》

根据《资产管理产品相关会计处理规定》，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。

#### 7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期末未发生会计估计变更。

#### 7.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

#### 7.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[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附加等税费按照实际缴纳增值税额的适用比例计算缴纳。

#### 7.4.7 重要财务报表项目的说明

##### 7.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2022 年 12 月 31 日	上年度末 2021 年 12 月 31 日
活期存款	3,417,635.54	2,297,461.46
等于：本金	3,416,952.20	2,297,461.46
加：应计利息	683.34	-
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	3,417,635.54	2,297,461.46

##### 7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2022 年 12 月 31 日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	91,371,472.47	-	94,615,200.83	3,243,728.36
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		91,371,472.47	-	94,615,200.83	3,243,728.36
项目	上年度末 2021 年 12 月 31 日				
		成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票		74,149,996.78	-	103,894,931.45	29,744,934.67
贵金属投资-金交所 黄金合约		-	-	-	-
债券	交易所市场	36,100.00	-	48,624.95	12,524.95
	银行间市场	-	-	-	-
	合计	36,100.00	-	48,624.95	12,524.95
资产支持证券		-	-	-	-
基金		-	-	-	-
其他		-	-	-	-
合计		74,186,096.78	-	103,943,556.40	29,757,459.62

#### 7.4.7.3 衍生金融资产/负债

##### 7.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

无。

##### 7.4.7.3.2 期末基金持有的期货合约情况

无。

##### 7.4.7.3.3 期末基金持有的黄金衍生品情况

无。

#### 7.4.7.4 买入返售金融资产

##### 7.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

无。

##### 7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

无。

##### 7.4.7.4.3 按预期信用损失一般模型计提减值准备的说明

无。

#### 7.4.7.5 债权投资

##### 7.4.7.5.1 债权投资情况

无。

## 7.4.7.5.2 债权投资减值准备计提情况

无。

## 7.4.7.6 其他债权投资

## 7.4.7.6.1 其他债权投资情况

无。

## 7.4.7.6.2 其他债权投资减值准备计提情况

无。

## 7.4.7.7 其他权益工具投资

## 7.4.7.7.1 其他权益工具投资情况

无。

## 7.4.7.7.2 报告期末其他权益工具投资情况

无。

## 7.4.7.8 其他资产

单位：人民币元

项目	本期末 2022 年 12 月 31 日	上年度末 2021 年 12 月 31 日
应收利息	-	588.28
其他应收款	-	-
待摊费用	-	-
合计	-	588.28

## 7.4.7.9 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2022 年 12 月 31 日	上年度末 2021 年 12 月 31 日
应付券商交易单元保证金	-	-
应付赎回费	-	-
应付证券出借违约金	-	-
应付交易费用	6,194.68	9,203.94
其中：交易所市场	6,194.68	9,203.94
银行间市场	-	-
应付利息	-	-
预提费用	170,000.00	170,000.00
应付指数使用费	35,000.00	35,000.00
可退替代款	3,887.90	-

合计	215,082.58	214,203.94
----	------------	------------

## 7.4.7.10 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年12月31日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	71,229,922.00	91,821,874.07
本期申购	27,000,000.00	34,805,465.57
本期赎回（以“-”号填列）	-12,000,000.00	-15,469,095.82
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	86,229,922.00	111,158,243.82

注：申购含红利再投份额(如有)。

## 7.4.7.11 其他综合收益

无。

## 7.4.7.12 未分配利润

单位：人民币元

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	1,068,722.02	-26,513,731.26	-25,445,009.24
本期基金份额交易产生的变动数	1,514,712.21	-4,335,439.34	-2,820,727.13
其中：基金申购款	2,610,894.51	-6,637,478.51	-4,026,584.00
基金赎回款	-1,096,182.30	2,302,039.17	1,205,856.87
本期已分配利润	-	-	-
本期末	8,427,735.39	-22,531,088.90	-14,103,353.51

## 7.4.7.13 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12月31日	上年度可比期间 2021年1月1日至2021年12月31日
	活期存款利息收入	20,458.82
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	148.53	594.78
其他	118.15	333.08
合计	20,725.50	34,304.36

## 7.4.7.14 股票投资收益

## 7.4.7.14.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年12月31日	上年度可比期间 2021年1月1日至2021年12月31日
股票投资收益——买卖股票差价收入	-675,359.97	6,817,297.61
股票投资收益——赎回差价收入	1,412,115.66	30,848,275.66
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	736,755.69	37,665,573.27

## 7.4.7.14.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年12月31日	上年度可比期间 2021年1月1日至2021年12月31日
卖出股票成交总额	9,568,107.27	17,898,769.46
减：卖出股票成本总额	10,219,817.53	11,081,471.85
减：交易费用	23,649.71	-
买卖股票差价收入	-675,359.97	6,817,297.61

## 7.4.7.14.3 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12月31日	上年度可比期间 2021年1月1日至2021年12月31日
赎回基金份额对价总额	14,263,238.95	90,846,062.69
减：现金支付赎回款总额	248,019.95	-4,814,025.31
减：赎回股票成本总额	12,603,103.34	64,811,812.34
减：交易费用	-	-
赎回差价收入	1,412,115.66	30,848,275.66

## 7.4.7.14.4 股票投资收益——申购差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年12月 31日	上年度可比期间 2021年1月1日至2021年 12月31日
申购基金份额总额	27,000,000.00	-
减：现金支付申购款总额	27,000,000.00	-
减：申购股票成本总额	-	-
减：交易费用	-	-
申购差价收入	-	-

## 7.4.7.14.5 股票投资收益——证券出借差价收入

无。

## 7.4.7.15 债券投资收益

## 7.4.7.15.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年12月31 日	上年度可比期间 2021年1月1日至2021年12月31 日
债券投资收益——利息收入	31.42	-
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	37,428.05	10,493.30
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	37,459.47	10,493.30

## 7.4.7.15.2 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12月31 日	上年度可比期间 2021年1月1日至2021年12月31 日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	138,074.71	51,799.89
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	100,600.00	41,300.00
减：应计利息总额	41.11	6.59
减：交易费用	5.55	-



买卖债券差价收入	37,428.05	10,493.30
----------	-----------	-----------

#### 7.4.7.15.3 债券投资收益——赎回差价收入

无。

#### 7.4.7.15.4 债券投资收益——申购差价收入

无。

#### 7.4.7.16 资产支持证券投资收益

##### 7.4.7.16.1 资产支持证券投资收益项目构成

无。

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

无。

##### 7.4.7.16.3 资产支持证券投资收益——赎回差价收入

无。

##### 7.4.7.16.4 资产支持证券投资收益——申购差价收入

无。

#### 7.4.7.17 贵金属投资收益

##### 7.4.7.17.1 贵金属投资收益项目构成

无。

##### 7.4.7.17.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

无。

##### 7.4.7.17.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

无。

##### 7.4.7.17.4 贵金属投资收益——申购差价收入

无。

## 7.4.7.18 衍生工具收益

## 7.4.7.18.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

无。

## 7.4.7.18.2 衍生工具收益——其他投资收益

无。

## 7.4.7.19 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年12月 31日	上年度可比期间 2021年1月1日至2021年12月 31日
股票投资产生的股利收益	1,129,664.69	1,309,429.45
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	1,129,664.69	1,309,429.45

## 7.4.7.20 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2022年1月1日至2022年 12月31日	上年度可比期间 2021年1月1日至2021 年12月31日
1. 交易性金融资产	-26,513,731.26	-25,377,620.36
股票投资	-26,501,206.31	-25,390,145.31
债券投资	-12,524.95	12,524.95
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	-26,513,731.26	-25,377,620.36

## 7.4.7.21 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年12月	上年度可比期间 2021年1月1日至2021

	31 日	年 12 月 31 日
基金赎回费收入	-	-
替代损益	3,175.20	-29,911.70
合计	3,175.20	-29,911.70

注：替代损益是指投资者采用可以现金替代方式申购本基金时，补入被替代股票的实际买入成本与申购确认日估值的差额，或强制退款的被替代股票在强制退款计算日与申购确认日估值的差额。

#### 7.4.7.22 信用减值损失

无。

#### 7.4.7.23 其他费用

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日	2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日
审计费用	50,000.00	50,000.00
信息披露费	120,000.00	120,000.00
证券出借违约金	-	-
银行划款手续费	395.00	435.00
指数使用费	140,000.00	140,000.00
其他	10.00	-
交易费用	-	54,320.97
合计	310,405.00	364,755.97

注：指数使用费为支付标的指数供应商的标的指数许可使用费，按前一日基金资产净值的 0.03% 的年费率计提，逐日累计，按季支付。本基金当季日均基金资产净值大于 5,000 万元时，标的指数许可使用费收取下限为每季度人民币 3.5 万元，不足 3.5 万元时按照 3.5 万元收取；本基金当季日均基金资产净值小于或等于 5,000 万元时，标的指数许可使用费收取不设下限金额。

#### 7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

##### 7.4.8.1 或有事项

无。

##### 7.4.8.2 资产负债表日后事项

无。

#### 7.4.9 关联方关系

关联方名称	与本基金的关系
大成基金管理有限公司（“大成基金”）	基金管理人
中国农业银行股份有限公司（“中国农业银行”）	基金托管人
中泰信托有限责任公司	基金管理人的股东
光大证券股份有限公司（“光大证券”）	基金管理人的股东、基金销售机构

中国银河投资管理有限公司	基金管理人的股东
大成国际资产管理有限公司（“大成国际”）	基金管理人的子公司
大成创新资本管理有限公司（“大成创新资本”）	基金管理人的合营企业

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

#### 7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

##### 7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

###### 7.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2022年1月1日至2022年12月31日		上年度可比期间 2021年1月1日至2021年12月31日	
	成交金额	占当期股票 成交总额的比例 (%)	成交金额	占当期股票 成交总额的比例 (%)
光大证券	17,600,929.77	100.00	29,197,809.21	75.52

###### 7.4.10.1.2 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12月31日		上年度可比期间 2021年1月1日至2021年12月31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	138,074.71	100.00	51,799.89	100.00

###### 7.4.10.1.3 债券回购交易

无。

###### 7.4.10.1.4 权证交易

无。

###### 7.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2022年1月1日至2022年12月31日			
	当期 佣金	占当期佣金总量 的比例 (%)	期末应付佣金余 额	占期末应付佣金 总额的比例 (%)
光大证券	12,685.35	100.00	6,194.68	100.00
关联方名称	上年度可比期间 2021年1月1日至2021年12月31日			

	当期 佣金	占当期佣金总量 的比例 (%)	期末应付佣金余 额	占期末应付佣金 总额的比例 (%)
光大证券	24,232.57	73.46	9,203.94	100.00

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。

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。

#### 7.4.10.2 关联方报酬

##### 7.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年12 月31日	上年度可比期间 2021年1月1日至2021年 12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	457,211.26	623,563.19
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 × 0.50% / 当年天数。

##### 7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年12 月31日	上年度可比期间 2021年1月1日至2021年 12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	91,442.27	124,712.62

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 × 0.10% / 当年天数。

#### 7.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易

无。

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

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

无。

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

无。

## 7.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

## 7.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

无。

## 7.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

无。

## 7.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2022年1月1日至2022年12月31日		上年度可比期间 2021年1月1日至2021年12月31日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国农业银行	3,417,635.54	20,458.82	2,297,461.46	33,376.50

注：本基金由基金托管人保管的银行存款，按银行约定利率计息。

## 7.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

金额单位：人民币元

本期 2022年1月1日至2022年12月31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	7,873.25
上年度可比期间 2021年1月1日至2021年12月31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
-	-	-	-	-	-

## 7.4.10.8 其他关联交易事项的说明

无。

## 7.4.11 利润分配情况

无。

## 7.4.12 期末（2022年12月31日）本基金持有的流通受限证券

## 7.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

7.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券	证券	成功	受限期	流通受限	认购	期末估	数量	期末	期末估值	备注

代码	名称	认购日		类型	价格	值单价	(单 位: 股)	成本总额	总额	
301095	广立微	2022年 7月28 日	6个月	新股锁定	58.00	86.49	64	3,712.00	5,535.36	-
301139	元道通 信	2022年 6月30 日	6个月	新股锁定	38.46	25.31	108	4,153.68	2,733.48	-
301165	锐捷网 络	2022年 11月14 日	6个月	新股锁定	32.38	31.61	104	3,367.52	3,287.44	-
301195	北路智 控	2022年 7月25 日	6个月	新股锁定	71.17	73.04	55	3,914.35	4,017.20	-
301223	中荣股 份	2022年 10月13 日	6个月	新股锁定	26.28	18.13	148	3,889.44	2,683.24	-
301267	华夏眼 科	2022年 10月26 日	6个月	新股锁定	50.88	66.20	67	3,408.96	4,435.40	-
301269	华大九 天	2022年 7月21 日	6个月	新股锁定	32.69	87.94	92	3,007.48	8,090.48	-
301270	汉仪股 份	2022年 8月19 日	6个月	新股锁定	25.68	28.37	87	2,234.16	2,468.19	-
301273	瑞晨环 保	2022年 10月11 日	6个月	新股锁定	37.89	37.79	83	3,144.87	3,136.57	-
301282	金禄电 子	2022年 8月18 日	6个月	新股锁定	30.38	25.25	87	2,643.06	2,196.75	-
301308	江波龙	2022年 7月27 日	6个月	新股锁定	55.67	56.72	82	4,564.94	4,651.04	-
301309	万得凯	2022年 9月8日	6个月	新股锁定	39.00	24.46	55	2,145.00	1,345.30	-
301313	凡拓数 创	2022年 9月22 日	6个月	新股锁定	25.25	29.14	96	2,424.00	2,797.44	-
301316	慧博云 通	2022年 9月29 日	6个月	新股锁定	7.60	14.32	211	1,603.60	3,021.52	-
301319	唯特偶	2022年	6个月	新股锁定	47.75	53.27	40	1,910.00	2,130.80	-

		9月22日								
301327	华宝新能	2022年9月8日	6个月	新股锁定	237.50	176.97	378,787.50	6,547.89		-
301330	熵基科技	2022年8月10日	6个月	新股锁定	43.32	31.31	1084,678.56	3,381.48		-
301356	天振股份	2022年11月3日	6个月	新股锁定	63.00	43.33	744,662.00	3,206.42		-
301363	美好医疗	2022年9月28日	6个月	新股锁定	30.66	37.85	932,851.38	3,520.05		-
301366	一博科技	2022年9月19日	6个月	新股锁定	65.35	45.09	533,463.55	2,389.77		-
301367	怡和嘉业	2022年10月21日	6个月	新股锁定	119.88	175.78	263,116.88	4,570.28		-
301377	鼎泰高科	2022年11月11日	6个月	新股锁定	22.88	17.63	1543,523.52	2,715.02		-
301389	隆扬电子	2022年10月18日	6个月	新股锁定	22.50	17.16	1463,285.00	2,505.36		-
301391	卡莱特	2022年11月24日	6个月	新股锁定	96.00	80.97	403,840.00	3,238.80		-
301396	宏景科技	2022年11月4日	6个月	新股锁定	40.13	31.90	1014,053.13	3,221.90		-
301398	星源卓镁	2022年12月8日	6个月	新股锁定	34.40	28.94	1073,680.80	3,096.58		-

注：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。

#### 7.4.12.2 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	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日	复牌开盘单价	数量(股)	期末成本总额	期末估值总额	备注



	称				期					
300850	新强联	2022年12月30日	重大事项	53.28	2023年01月10日	56.88	1,400	114,052.00	74,592.00	-

#### 7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

##### 7.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

无。

##### 7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

无。

#### 7.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

无。

#### 7.4.13 金融工具风险及管理

##### 7.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金是指数型基金，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。

#### 7.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息等情况，导致基金资产损失和收益变化的风险。

本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的银行存款存放在本基金的托管人中国农业银行，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，本基金无债券投资和资产支持证券投资(上年度末：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和资产支持证券占基金资产净值的比例为 0.05%)。

##### 7.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

无。

##### 7.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

无。

##### 7.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

无。

##### 7.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

无。

##### 7.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

无。

#### 7.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

无。

#### 7.4.13.3 流动性风险

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

##### 7.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

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

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

#### 7.4.13.4 市场风险

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

#### 7.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指金融工具的公允价值或未来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和存出保证金等。

##### 7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2022 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	3,417,635.54	-	-	-	3,417,635.54
存出保证金	5,798.31	-	-	-	5,798.31
交易性金融资产	-	-	-	94,615,200.83	94,615,200.83
应收清算款	-	-	-	44,046.57	44,046.57
资产总计	3,423,433.85	-	-	94,659,247.40	98,082,681.25
负债					
应付管理人报酬	-	-	-	40,491.16	40,491.16
应付托管费	-	-	-	8,098.23	8,098.23
应付清算款	-	-	-	764,118.97	764,118.97
其他负债	-	-	-	215,082.58	215,082.58
负债总计	-	-	-	1,027,790.94	1,027,790.94
利率敏感度缺口	3,423,433.85	-	-	93,631,456.46	97,054,890.31
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。

#### 7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

于本期末，本基金未持有交易性债券投资和资产支持证券投资(上年度末：本基金持有的交易性债券投资和资产支持证券投资公允价值占基金净资产的比例为 0.05%)，因此市场利率的变动对于本基金净资产无重大影响(上年度末：同)。

#### 7.4.13.4.2 外汇风险

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

#### 7.4.13.4.3 其他价格风险

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。

#### 7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2022年12月31日		上年度末 2021年12月31日	
	公允价值	占基金资产净值 比例(%)	公允价值	占基金资产净值 比例(%)
交易性金融资产—股票投资	94,615,200.83	97.49	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	94,615,200.83	97.49	103,894,931.45	98.03

#### 7.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除业绩比较基准以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2022年12月31日）	上年度末（2021年12月31日）
	1. 业绩比较基准上升5%	4,707,618.57	5,119,034.89
	2. 业绩比较基准下降5%	-4,707,618.57	-5,119,034.89

#### 7.4.14 公允价值

##### 7.4.14.1 金融工具公允价值计量的方法

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

第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

##### 7.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

###### 7.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2022年12月31日	上年度末 2021年12月31日
第一层次	94,449,685.07	103,638,857.85
第二层次	74,592.00	304,698.55
第三层次	90,923.76	-
合计	94,615,200.83	103,943,556.40

## 7.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

本基金以导致各层次之间转换的事项发生日为确认各层次之间转换的时点。

对于证券交易所上市的股票和债券，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，确定相关股票和债券的公允价值应属第二层次还是第三层次。

## 7.4.14.2.3 第三层次公允价值余额及变动情况

## 7.4.14.2.3.1 第三层次公允价值余额及变动情况

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年12月31日		
	交易性金融资产		合计
	债券投资	股票投资	
期初余额	-	-	-
当期购买	-	-	-
当期出售/结算	-	-	-
转入第三层次	-	181,737.56	181,737.56
转出第三层次	-	65,477.90	65,477.90
当期利得或损失总额	-	-25,335.90	-25,335.90
其中：计入损益的利得或损失	-	-25,335.90	-25,335.90
计入其他综合收益的利得或损失	-	-	-
期末余额	-	90,923.76	90,923.76
期末仍持有的第三层次金融资产计入本期损益的未实现利得或损失的变动——公允价值变动损益	-	-1,141.62	-1,141.62
项目	上年度可比同期 2021年1月1日至2021年12月31日		
	交易性金融资产		合计
	债券投资	股票投资	
期初余额	-	-	-
当期购买	-	-	-
当期出售/结算	-	-	-

转入第三层次	-	-	-
转出第三层次	-	-	-
当期利得或损失总额	-	-	-
其中：计入损益的利得或损失	-	-	-
计入其他综合收益的利得或损失	-	-	-
期末余额	-	-	-
期末仍持有的第三层次金融资产计入本期损益的未实现利得或损失的变动——公允价值变动损益	-	-	-

注：于本期末，本基金持有的第三层次的交易性金融资产均为证券交易所上市交易但尚在限售期内的股票投资。于本年度，本基金从第三层次转出的交易性金融资产均为限售期结束可正常交易的股票投资。

计入损益的利得或损失分别计入利润表中的公允价值变动损益、投资收益等项目。

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

单位：人民币元

项目	本期末公允价值	采用的估值技术	不可观察输入值		
			名称	范围/加权平均值	与公允价值之间的关系
证券交易所上市但尚在限售期内的股票	90,923.76	平均价格亚式期权模型	预期波动率	0.1891-2.4756	负相关
项目	上年度末公允价值	采用的估值技术	不可观察输入值		
			名称	范围/加权平均值	与公允价值之间的关系
-	-	-	-	-	-

#### 7.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

于本期末，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产(上年度末：同)。

#### 7.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

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

#### 7.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

- (1) 基金申购款



于本年度，本基金申购基金份额的对价总额为 30,778,881.57 元(上年度可比期间：15,248,324.97 元)，其中包括以股票支付的申购款 30,143,040.00 元和以现金支付的申购款 635,841.57 元(上年度可比期间：其中包括以股票支付的申购款 15,635,800.00 元和以现金结算的申购款净额-387,475.03 元)。

(2) 除基金申购款外，截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

## § 8 投资组合报告

### 8.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	94,615,200.83	96.46
	其中：股票	94,615,200.83	96.46
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	3,417,635.54	3.48
8	其他各项资产	49,844.88	0.05
9	合计	98,082,681.25	100.00

### 8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

#### 8.2.1 报告期末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	2,368,429.25	2.44
B	采矿业	1,072,866.98	1.11
C	制造业	70,085,069.02	72.21
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	974,429.40	1.00
E	建筑业	125,560.55	0.13
F	批发和零售业	737,973.45	0.76
G	交通运输、仓储和邮政业	1,517,181.02	1.56
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	4,189,099.73	4.32

J	金融业	6,817,462.77	7.02
K	房地产业	1,896,536.39	1.95
L	租赁和商务服务业	1,007,805.29	1.04
M	科学研究和技术服务业	1,294,694.00	1.33
N	水利、环境和公共设施管理业	256,929.62	0.26
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	66,209.00	0.07
Q	卫生和社会工作	1,190,049.58	1.23
R	文化、体育和娱乐业	681,500.98	0.70
S	综合	173,757.48	0.18
	合计	94,455,554.51	97.32

### 8.2.2 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	123,325.35	0.13
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	31,885.57	0.03
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	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	4,435.40	0.00
R	文化、体育和娱乐业	-	-

S	综合	-	-
	合计	159,646.32	0.16

### 8.2.3 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

无。

### 8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

#### 8.3.1 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	10,600	4,170,252.00	4.30
2	000858	五粮液	15,500	2,800,695.00	2.89
3	000333	美的集团	41,507	2,150,062.60	2.22
4	002594	比亚迪	7,400	1,901,578.00	1.96
5	300059	东方财富	88,515	1,717,191.00	1.77
6	000568	泸州老窖	6,300	1,412,964.00	1.46
7	000651	格力电器	38,100	1,231,392.00	1.27
8	002475	立讯精密	38,646	1,227,010.50	1.26
9	300760	迈瑞医疗	3,800	1,200,686.00	1.24
10	002415	海康威视	33,025	1,145,307.00	1.18
11	300124	汇川技术	15,591	1,083,574.50	1.12
12	002352	顺丰控股	18,500	1,068,560.00	1.10
13	002714	牧原股份	20,806	1,014,292.50	1.05
14	002142	宁波银行	30,217	980,541.65	1.01
15	300274	阳光电源	8,580	959,244.00	0.99
16	000002	万科 A	52,500	955,500.00	0.98
17	000001	平安银行	72,300	951,468.00	0.98
18	300014	亿纬锂能	10,631	934,464.90	0.96
19	000725	京东方 A	268,300	906,854.00	0.93
20	300498	温氏股份	44,005	863,818.15	0.89
21	002304	洋河股份	5,162	828,501.00	0.85
22	300015	爱尔眼科	25,510	792,595.70	0.82
23	002129	TCL 中环	20,100	756,966.00	0.78
24	002049	紫光国微	5,580	735,555.60	0.76
25	000063	中兴通讯	26,300	680,118.00	0.70
26	000792	盐湖股份	29,800	676,162.00	0.70
27	002466	天齐锂业	8,500	671,415.00	0.69
28	002460	赣锋锂业	9,590	666,600.90	0.69
29	002812	恩捷股份	4,470	586,866.30	0.60
30	002027	分众传媒	86,288	576,403.84	0.59
31	300122	智飞生物	6,400	562,112.00	0.58
32	300142	沃森生物	13,900	558,641.00	0.58
33	002271	东方雨虹	16,253	545,613.21	0.56

34	002459	晶澳科技	8,780	527,590.20	0.54
35	002410	广联达	8,400	503,580.00	0.52
36	002371	北方华创	2,200	495,660.00	0.51
37	300347	泰格医药	4,650	487,320.00	0.50
38	002230	科大讯飞	14,775	485,063.25	0.50
39	300896	爱美客	800	453,080.00	0.47
40	002709	天赐材料	10,292	451,407.12	0.47
41	000338	潍柴动力	44,000	447,920.00	0.46
42	000625	长安汽车	35,314	434,715.34	0.45
43	000661	长春高新	2,560	426,112.00	0.44
44	002311	海大集团	6,580	406,183.40	0.42
45	002179	中航光电	6,965	402,298.40	0.41
46	000100	TCL 科技	107,500	399,900.00	0.41
47	002180	纳思达	7,000	363,230.00	0.37
48	000733	振华科技	3,100	354,113.00	0.36
49	002241	歌尔股份	20,900	351,747.00	0.36
50	000776	广发证券	22,600	350,074.00	0.36
51	000166	申万宏源	87,860	349,682.80	0.36
52	300661	圣邦股份	2,025	349,515.00	0.36
53	300450	先导智能	8,500	342,125.00	0.35
54	002050	三花智控	16,000	339,520.00	0.35
55	001979	招商蛇口	26,501	334,707.63	0.34
56	300316	晶盛机电	5,180	329,240.80	0.34
57	002493	荣盛石化	26,225	322,567.50	0.33
58	000596	古井贡酒	1,200	320,280.00	0.33
59	300408	三环集团	10,300	316,313.00	0.33
60	000538	云南白药	5,760	313,113.60	0.32
61	300751	迈为股份	740	304,761.60	0.31
62	300782	卓胜微	2,653	303,237.90	0.31
63	000963	华东医药	6,395	299,286.00	0.31
64	300759	康龙化成	4,400	299,200.00	0.31
65	002648	卫星化学	18,462	286,161.00	0.29
66	002340	格林美	38,420	285,460.60	0.29
67	000768	中航西飞	11,100	282,495.00	0.29
68	300763	锦浪科技	1,540	277,277.00	0.29
69	000799	酒鬼酒	2,000	275,880.00	0.28
70	002821	凯莱英	1,840	272,320.00	0.28
71	300496	中科创达	2,700	270,810.00	0.28
72	300012	华测检测	12,100	269,830.00	0.28
73	002384	东山精密	10,900	269,557.00	0.28
74	000938	紫光股份	13,147	256,497.97	0.26
75	002001	新和成	13,517	253,443.75	0.26
76	002202	金风科技	22,536	247,896.00	0.26

77	002601	龙佰集团	12,900	244,068.00	0.25
78	300724	捷佳伟创	2,100	239,442.00	0.25
79	300207	欣旺达	11,300	238,995.00	0.25
80	300003	乐普医疗	10,326	237,188.22	0.24
81	002074	国轩高科	8,190	236,117.70	0.24
82	002385	大北农	26,350	234,515.00	0.24
83	000895	双汇发展	9,000	233,370.00	0.24
84	000876	新希望	18,000	232,380.00	0.24
85	000157	中联重科	42,000	228,480.00	0.24
86	002252	上海莱士	36,020	228,366.80	0.24
87	300454	深信服	2,000	225,100.00	0.23
88	002176	江特电机	12,800	223,360.00	0.23
89	002920	德赛西威	2,100	221,214.00	0.23
90	000425	徐工机械	42,800	216,996.00	0.22
91	002422	科伦药业	8,000	212,880.00	0.22
92	300769	德方纳米	920	211,222.80	0.22
93	300999	金龙鱼	4,800	209,088.00	0.22
94	002736	国信证券	23,400	207,792.00	0.21
95	002405	四维图新	18,650	205,523.00	0.21
96	300438	鹏辉能源	2,600	202,774.00	0.21
97	000786	北新建材	7,800	201,864.00	0.21
98	002966	苏州银行	25,900	201,502.00	0.21
99	002555	三七互娱	11,100	200,910.00	0.21
100	002738	中矿资源	3,000	199,980.00	0.21
101	002497	雅化集团	8,600	199,950.00	0.21
102	002603	以岭药业	6,624	198,455.04	0.20
103	002625	光启技术	11,540	196,410.80	0.20
104	000933	神火股份	13,100	195,976.00	0.20
105	002007	华兰生物	8,660	195,975.80	0.20
106	000301	东方盛虹	14,900	194,296.00	0.20
107	000983	山西焦煤	16,610	193,506.50	0.20
108	000630	铜陵有色	61,700	192,504.00	0.20
109	000807	云铝股份	17,200	191,264.00	0.20
110	002028	思源电气	4,900	187,278.00	0.19
111	300073	当升科技	3,300	186,120.00	0.19
112	000723	美锦能源	20,500	184,910.00	0.19
113	300146	汤臣倍健	8,100	184,842.00	0.19
114	300390	天华超净	3,300	184,404.00	0.19
115	300699	光威复材	2,540	183,515.00	0.19
116	002407	多氟多	5,500	183,260.00	0.19
117	002008	大族激光	7,100	182,115.00	0.19
118	300285	国瓷材料	6,600	181,962.00	0.19
119	300144	宋城演艺	12,451	181,784.60	0.19

120	300568	星源材质	8,542	181,602.92	0.19
121	300395	菲利华	3,300	181,500.00	0.19
122	002185	华天科技	21,774	180,506.46	0.19
123	000977	浪潮信息	8,353	179,756.56	0.19
124	300033	同花顺	1,800	177,498.00	0.18
125	300037	新宙邦	4,060	176,488.20	0.18
126	002756	永兴材料	1,900	175,123.00	0.18
127	300433	蓝思科技	16,559	174,366.27	0.18
128	000831	中国稀土	5,300	174,264.00	0.18
129	000009	中国宝安	14,372	173,757.48	0.18
130	002568	百润股份	4,648	173,649.28	0.18
131	000069	华侨城 A	32,400	172,692.00	0.18
132	000683	远兴能源	21,900	171,696.00	0.18
133	002797	第一创业	30,020	169,012.60	0.17
134	000066	中国长城	16,504	168,340.80	0.17
135	002013	中航机电	16,562	166,448.10	0.17
136	002192	融捷股份	1,700	166,430.00	0.17
137	002236	大华股份	14,500	163,995.00	0.17
138	002223	鱼跃医疗	5,130	163,441.80	0.17
139	000423	东阿阿胶	4,000	162,800.00	0.17
140	002602	世纪华通	42,709	162,721.29	0.17
141	000783	长江证券	30,300	161,499.00	0.17
142	000932	华菱钢铁	34,360	161,492.00	0.17
143	002841	视源股份	2,720	160,588.80	0.17
144	300628	亿联网络	2,650	160,563.50	0.17
145	002120	韵达股份	11,129	160,035.02	0.16
146	300413	芒果超媒	5,330	160,006.60	0.16
147	300601	康泰生物	5,060	159,541.80	0.16
148	003816	中国广核	58,400	157,096.00	0.16
149	002025	航天电器	2,370	157,012.50	0.16
150	300253	卫宁健康	15,047	154,683.16	0.16
151	002439	启明星辰	5,900	153,872.00	0.16
152	000975	银泰黄金	13,877	153,202.08	0.16
153	002138	顺络电子	5,800	151,844.00	0.16
154	002044	美年健康	24,604	150,822.52	0.16
155	000516	国际医学	12,200	149,328.00	0.15
156	300957	贝泰妮	1,000	149,240.00	0.15
157	000999	华润三九	3,182	148,949.42	0.15
158	000629	钒钛股份	31,400	148,522.00	0.15
159	002268	电科网安	4,860	148,375.80	0.15
160	300223	北京君正	2,100	147,924.00	0.15
161	000738	航发控制	5,700	146,148.00	0.15
162	000728	国元证券	22,950	145,273.50	0.15

163	002078	太阳纸业	12,500	144,000.00	0.15
164	000519	中兵红箭	7,200	141,408.00	0.15
165	000998	隆平高科	8,700	139,809.00	0.14
166	300118	东方日升	5,600	138,992.00	0.14
167	300777	中简科技	2,800	137,620.00	0.14
168	002938	鹏鼎控股	5,000	137,200.00	0.14
169	002624	完美世界	10,650	135,468.00	0.14
170	000762	西藏矿业	3,500	135,135.00	0.14
171	002430	杭氧股份	3,400	133,824.00	0.14
172	300595	欧普康视	3,740	133,518.00	0.14
173	300308	中际旭创	4,920	132,987.60	0.14
174	002463	沪电股份	11,150	132,685.00	0.14
175	002532	天山铝业	17,000	131,240.00	0.14
176	002353	杰瑞股份	4,700	131,177.00	0.14
177	002557	洽洽食品	2,600	130,000.00	0.13
178	000408	藏格矿业	5,000	129,850.00	0.13
179	300357	我武生物	2,340	128,934.00	0.13
180	002507	涪陵榨菜	5,000	128,850.00	0.13
181	002739	万达电影	9,200	128,800.00	0.13
182	002294	信立泰	3,900	128,115.00	0.13
183	300054	鼎龙股份	6,000	127,740.00	0.13
184	002056	横店东磁	6,800	127,432.00	0.13
185	002030	达安基因	8,165	127,047.40	0.13
186	002092	中泰化学	17,000	126,820.00	0.13
187	000591	太阳能	17,300	126,809.00	0.13
188	002673	西部证券	20,766	126,464.94	0.13
189	002080	中材科技	5,880	126,008.40	0.13
190	300832	新产业	2,500	125,350.00	0.13
191	300604	长川科技	2,800	124,824.00	0.13
192	000708	中信特钢	7,190	123,380.40	0.13
193	002299	圣农发展	5,200	123,188.00	0.13
194	000818	航锦科技	4,500	123,075.00	0.13
195	002472	双环传动	4,800	122,160.00	0.13
196	000860	顺鑫农业	4,090	121,963.80	0.13
197	002156	通富微电	7,400	121,952.00	0.13
198	002850	科达利	1,000	118,810.00	0.12
199	002465	海格通信	14,600	118,552.00	0.12
200	000988	华工科技	7,200	118,152.00	0.12
201	002273	水晶光电	10,014	118,065.06	0.12
202	002531	天顺风能	7,800	118,014.00	0.12
203	000703	恒逸石化	16,766	117,864.98	0.12
204	000960	锡业股份	8,321	117,326.10	0.12
205	002414	高德红外	10,614	116,754.00	0.12

206	300373	扬杰科技	2,200	115,720.00	0.12
207	300633	开立医疗	2,100	115,143.00	0.12
208	300363	博腾股份	2,800	114,380.00	0.12
209	002916	深南电路	1,584	114,285.60	0.12
210	300136	信维通信	6,920	114,249.20	0.12
211	000155	川能动力	6,400	114,176.00	0.12
212	000739	普洛药业	5,300	114,162.00	0.12
213	300529	健帆生物	3,680	113,969.60	0.12
214	002444	巨星科技	6,000	113,880.00	0.12
215	000623	吉林敖东	7,520	112,724.80	0.12
216	000970	中科三环	8,245	112,461.80	0.12
217	000400	许继电气	5,600	111,832.00	0.12
218	300919	中伟股份	1,700	111,537.00	0.11
219	002865	钧达股份	600	111,060.00	0.11
220	002409	雅克科技	2,200	110,814.00	0.11
221	002262	恩华药业	4,500	110,475.00	0.11
222	000878	云南铜业	9,400	110,450.00	0.11
223	300346	南大光电	3,780	109,809.00	0.11
224	002518	科士达	1,900	109,440.00	0.11
225	002600	领益智造	24,100	109,414.00	0.11
226	002245	蔚蓝锂芯	7,300	108,624.00	0.11
227	300558	贝达药业	2,200	108,394.00	0.11
228	002508	老板电器	3,890	107,986.40	0.11
229	002152	广电运通	10,850	107,849.00	0.11
230	000830	鲁西化工	8,700	107,793.00	0.11
231	002487	大金重工	2,600	107,562.00	0.11
232	000039	中集集团	15,240	107,289.60	0.11
233	000729	燕京啤酒	10,100	107,262.00	0.11
234	300035	中科电气	5,200	107,016.00	0.11
235	002831	裕同科技	3,220	106,485.40	0.11
236	002436	兴森科技	11,000	106,480.00	0.11
237	300474	景嘉微	1,950	106,411.50	0.11
238	000513	丽珠集团	3,267	106,112.16	0.11
239	002372	伟星新材	4,940	105,419.60	0.11
240	000690	宝新能源	16,200	105,300.00	0.11
241	000617	中油资本	18,820	104,827.40	0.11
242	002506	协鑫集成	36,000	104,760.00	0.11
243	300725	药石科技	1,300	104,650.00	0.11
244	000547	航天发展	11,100	104,229.00	0.11
245	002203	海亮股份	9,200	103,960.00	0.11
246	002791	坚朗五金	1,000	103,950.00	0.11
247	300676	华大基因	2,000	103,380.00	0.11
248	300088	长信科技	17,300	103,281.00	0.11



249	002389	航天彩虹	5,000	102,850.00	0.11
250	002683	广东宏大	3,800	102,448.00	0.11
251	002065	东华软件	18,000	101,880.00	0.10
252	300034	钢研高纳	2,200	100,848.00	0.10
253	000750	国海证券	30,065	100,116.45	0.10
254	000887	中鼎股份	6,900	99,843.00	0.10
255	002402	和而泰	6,800	99,144.00	0.10
256	000893	亚钾国际	3,600	97,848.00	0.10
257	002747	埃斯顿	4,500	97,560.00	0.10
258	300244	迪安诊断	3,872	97,303.36	0.10
259	002064	华峰化学	14,300	97,240.00	0.10
260	000877	天山股份	11,400	97,128.00	0.10
261	300296	利亚德	17,050	96,503.00	0.10
262	000636	风华高科	6,500	96,395.00	0.10
263	300017	网宿科技	17,252	96,266.16	0.10
264	000875	吉电股份	15,800	96,222.00	0.10
265	300803	指南针	2,100	96,012.00	0.10
266	002312	川发龙蟒	9,000	94,680.00	0.10
267	002250	联化科技	6,100	94,550.00	0.10
268	300058	蓝色光标	18,719	94,530.95	0.10
269	002936	郑州银行	40,115	94,270.25	0.10
270	002484	江海股份	4,200	93,954.00	0.10
271	002926	华西证券	12,400	93,372.00	0.10
272	002183	怡亚通	14,500	93,235.00	0.10
273	300418	昆仑万维	6,400	92,224.00	0.10
274	300383	光环新网	11,300	92,208.00	0.10
275	002145	中核钛白	14,965	92,184.40	0.09
276	002541	鸿路钢构	3,130	91,677.70	0.09
277	002456	欧菲光	19,400	91,374.00	0.09
278	300775	三角防务	2,400	91,200.00	0.09
279	300298	三诺生物	2,700	91,071.00	0.09
280	002195	二三四五	45,164	90,779.64	0.09
281	300487	蓝晓科技	1,300	90,467.00	0.09
282	002958	青农商行	31,000	89,590.00	0.09
283	300294	博雅生物	2,450	89,572.00	0.09
284	300024	机器人	9,966	89,494.68	0.09
285	300026	红日药业	15,700	89,176.00	0.09
286	002572	索菲亚	4,908	89,129.28	0.09
287	300776	帝尔激光	700	88,200.00	0.09
288	300682	朗新科技	4,000	87,920.00	0.09
289	002212	天融信	8,800	87,912.00	0.09
290	002408	齐翔腾达	12,480	87,859.20	0.09
291	002675	东诚药业	5,300	87,768.00	0.09

292	002597	金禾实业	2,700	87,750.00	0.09
293	002617	露笑科技	9,500	87,685.00	0.09
294	002368	太极股份	3,111	87,512.43	0.09
295	002500	山西证券	16,480	87,344.00	0.09
296	000060	中金岭南	21,300	87,330.00	0.09
297	002706	良信股份	5,960	87,314.00	0.09
298	000021	深科技	8,166	87,294.54	0.09
299	002131	利欧股份	49,134	86,967.18	0.09
300	300748	金力永磁	2,960	86,609.60	0.09
301	300432	富临精工	6,000	86,580.00	0.09
302	300009	安科生物	9,186	85,980.96	0.09
303	000050	深天马 A	9,900	85,734.00	0.09
304	300502	新易盛	3,601	85,523.75	0.09
305	002727	一心堂	2,700	85,077.00	0.09
306	000997	新大陆	6,450	83,914.50	0.09
307	300666	江丰电子	1,200	83,040.00	0.09
308	002155	湖南黄金	6,400	82,880.00	0.09
309	002151	北斗星通	2,950	82,836.00	0.09
310	300567	精测电子	1,650	82,830.00	0.09
311	300001	特锐德	5,400	82,134.00	0.08
312	003022	联泓新科	2,700	81,945.00	0.08
313	000403	派林生物	3,600	81,936.00	0.08
314	000581	威孚高科	4,600	81,558.00	0.08
315	002128	电投能源	6,600	81,444.00	0.08
316	300679	电连技术	2,200	81,400.00	0.08
317	002244	滨江集团	9,200	81,236.00	0.08
318	002595	豪迈科技	3,500	81,025.00	0.08
319	300451	创业慧康	10,192	80,618.72	0.08
320	002153	石基信息	5,340	80,046.60	0.08
321	000825	太钢不锈	18,500	79,920.00	0.08
322	300618	寒锐钴业	1,992	79,779.60	0.08
323	300251	光线传媒	9,180	79,498.80	0.08
324	002558	巨人网络	9,900	78,804.00	0.08
325	002511	中顺洁柔	5,700	78,318.00	0.08
326	000686	东北证券	12,020	78,130.00	0.08
327	002851	麦格米特	3,000	77,880.00	0.08
328	002585	双星新材	6,100	77,775.00	0.08
329	002373	千方科技	8,700	77,604.00	0.08
330	300182	捷成股份	17,334	77,482.98	0.08
331	002124	天邦食品	12,660	77,352.60	0.08
332	002019	亿帆医药	6,300	77,175.00	0.08
333	301050	雷电微力	1,000	77,170.00	0.08
334	300866	安克创新	1,300	77,051.00	0.08

335	000778	新兴铸管	21,000	76,650.00	0.08
336	300458	全志科技	3,764	76,635.04	0.08
337	300773	拉卡拉	4,500	75,960.00	0.08
338	000012	南玻 A	11,239	75,413.69	0.08
339	300677	英科医疗	3,580	75,287.40	0.08
340	000951	中国重汽	5,060	75,090.40	0.08
341	002002	鸿达兴业	23,161	75,041.64	0.08
342	000709	河钢股份	33,100	74,806.00	0.08
343	300850	新强联	1,400	74,592.00	0.08
344	002701	奥瑞金	14,700	74,235.00	0.08
345	300070	碧水源	15,614	73,854.22	0.08
346	002266	浙富控股	18,840	73,664.40	0.08
347	002985	北摩高科	1,630	73,513.00	0.08
348	002127	南极电商	15,150	72,871.50	0.08
349	002396	星网锐捷	3,800	72,808.00	0.08
350	002643	万润股份	4,900	71,834.00	0.07
351	000027	深圳能源	11,240	71,486.40	0.07
352	301035	润丰股份	800	69,680.00	0.07
353	002249	大洋电机	13,600	69,632.00	0.07
354	300115	长盈精密	6,736	69,582.88	0.07
355	300482	万孚生物	2,180	69,476.60	0.07
356	000035	中国天楹	13,700	69,459.00	0.07
357	300737	科顺股份	5,500	69,190.00	0.07
358	300979	华利集团	1,200	68,532.00	0.07
359	000032	深桑达 A	3,400	68,510.00	0.07
360	000401	冀东水泥	8,300	68,309.00	0.07
361	300672	国科微	800	68,040.00	0.07
362	002984	森麒麟	2,200	67,738.00	0.07
363	002091	江苏国泰	7,900	67,150.00	0.07
364	000656	金科股份	35,000	66,850.00	0.07
365	000883	湖北能源	15,800	66,360.00	0.07
366	000785	居然之家	16,200	66,258.00	0.07
367	002607	中公教育	14,300	66,209.00	0.07
368	002505	鹏都农牧	25,530	65,867.40	0.07
369	002939	长城证券	7,900	65,412.00	0.07
370	300623	捷捷微电	3,150	64,953.00	0.07
371	002004	华邦健康	12,700	64,770.00	0.07
372	300476	胜宏科技	5,000	64,700.00	0.07
373	002690	美亚光电	2,700	64,530.00	0.07
374	300888	稳健医疗	900	64,350.00	0.07
375	002839	张家港行	13,780	63,525.80	0.07
376	300861	美畅股份	1,280	62,924.80	0.06
377	000810	创维数字	4,500	62,730.00	0.06

378	300463	迈克生物	3,600	62,280.00	0.06
379	002085	万丰奥威	10,356	61,618.20	0.06
380	300674	宇信科技	4,380	61,539.00	0.06
381	000089	深圳机场	7,800	61,308.00	0.06
382	301155	海力风电	700	61,145.00	0.06
383	000902	新洋丰	5,302	61,026.02	0.06
384	002099	海翔药业	8,600	60,286.00	0.06
385	000930	中粮科技	7,200	60,192.00	0.06
386	300685	艾德生物	2,260	59,777.00	0.06
387	301071	力量钻石	500	59,575.00	0.06
388	002041	登海种业	3,000	59,460.00	0.06
389	300376	易事特	8,700	59,421.00	0.06
390	300747	锐科激光	2,512	59,408.80	0.06
391	002032	苏泊尔	1,200	59,352.00	0.06
392	002191	劲嘉股份	8,200	59,286.00	0.06
393	002221	东华能源	7,600	57,988.00	0.06
394	300973	立高食品	600	57,708.00	0.06
395	300072	海新能科	13,137	57,277.32	0.06
396	000987	越秀资本	9,535	57,114.65	0.06
397	002081	金螳螂	11,763	57,050.55	0.06
398	002429	兆驰股份	16,300	56,887.00	0.06
399	300630	普利制药	2,286	56,372.76	0.06
400	002157	正邦科技	13,300	56,259.00	0.06
401	002745	木林森	6,900	55,959.00	0.06
402	000937	冀中能源	8,790	55,904.40	0.06
403	300459	汤姆猫	17,680	55,692.00	0.06
404	002048	宁波华翔	4,000	55,600.00	0.06
405	001965	招商公路	7,100	55,167.00	0.06
406	000540	中天金融	36,426	55,003.26	0.06
407	002010	传化智联	10,300	55,002.00	0.06
408	002468	申通快递	5,300	54,749.00	0.06
409	000156	华数传媒	7,200	53,928.00	0.06
410	001914	招商积余	3,500	53,830.00	0.06
411	000598	兴蓉环境	11,000	53,790.00	0.06
412	002281	光迅科技	3,400	53,448.00	0.06
413	300671	富满微	1,300	53,131.00	0.05
414	000537	广宇发展	4,000	52,920.00	0.05
415	300171	东富龙	2,200	52,206.00	0.05
416	300457	赢合科技	2,950	52,126.50	0.05
417	000402	金融街	9,900	51,975.00	0.05
418	000800	一汽解放	6,700	51,791.00	0.05
419	000559	万向钱潮	10,628	51,758.36	0.05
420	300456	赛微电子	3,500	51,730.00	0.05

421	002237	恒邦股份	4,900	51,646.00	0.05
422	002948	青岛银行	15,210	51,105.60	0.05
423	000712	锦龙股份	3,900	50,466.00	0.05
424	000528	柳工	8,580	50,450.40	0.05
425	002216	三全食品	2,720	50,347.20	0.05
426	003035	南网能源	8,800	49,896.00	0.05
427	301047	义翘神州	500	49,830.00	0.05
428	002626	金达威	2,400	49,728.00	0.05
429	000415	渤海租赁	22,400	49,504.00	0.05
430	000898	鞍钢股份	18,452	49,266.84	0.05
431	002867	周大生	3,500	49,105.00	0.05
432	300726	宏达电子	1,100	48,554.00	0.05
433	300638	广和通	2,700	48,330.00	0.05
434	003031	中瓷电子	500	48,150.00	0.05
435	300257	开山股份	3,200	48,000.00	0.05
436	002390	信邦制药	10,200	47,940.00	0.05
437	000555	神州信息	4,400	47,388.00	0.05
438	002612	朗姿股份	1,700	47,192.00	0.05
439	300841	康华生物	550	46,541.00	0.05
440	000627	天茂集团	14,700	46,452.00	0.05
441	000563	陕国投 A	15,300	46,359.00	0.05
442	002773	康弘药业	2,860	44,873.40	0.05
443	000935	四川双马	2,100	44,100.00	0.05
444	000921	海信家电	3,300	43,461.00	0.04
445	301029	怡合达	660	43,388.40	0.04
446	002705	新宝股份	2,600	43,290.00	0.04
447	002906	华阳集团	1,300	43,186.00	0.04
448	002110	三钢闽光	9,150	43,005.00	0.04
449	002423	中粮资本	5,900	42,244.00	0.04
450	000927	中国铁物	15,100	42,129.00	0.04
451	300428	立中集团	1,700	42,075.00	0.04
452	001203	大中矿业	3,200	41,376.00	0.04
453	002498	汉缆股份	9,800	40,964.00	0.04
454	000688	国城矿业	2,500	40,525.00	0.04
455	000959	首钢股份	10,700	40,339.00	0.04
456	000685	中山公用	5,700	40,071.00	0.04
457	000539	粤电力 A	7,200	39,960.00	0.04
458	000967	盈峰环境	8,800	39,952.00	0.04
459	002434	万里扬	4,900	39,445.00	0.04
460	000672	上峰水泥	3,680	39,302.40	0.04
461	000990	诚志股份	4,400	38,720.00	0.04
462	002242	九阳股份	2,300	37,904.00	0.04
463	002925	盈趣科技	2,280	37,665.60	0.04

464	002146	荣盛发展	16,900	36,673.00	0.04
465	002670	国盛金控	4,893	36,257.13	0.04
466	000028	国药一致	1,100	36,179.00	0.04
467	002967	广电计量	2,100	35,238.00	0.04
468	000961	中南建设	16,050	35,149.50	0.04
469	300761	立华股份	1,000	34,250.00	0.04
470	300821	东岳硅材	2,900	33,872.00	0.03
471	002653	海思科	1,500	33,375.00	0.03
472	000062	深圳华强	2,705	33,028.05	0.03
473	002563	森马服饰	6,300	33,012.00	0.03
474	000966	长源电力	7,100	32,873.00	0.03
475	301078	孩子王	2,500	32,375.00	0.03
476	002945	华林证券	2,400	31,632.00	0.03
477	002608	江苏国信	5,300	31,588.00	0.03
478	000582	北部湾港	4,200	31,038.00	0.03
479	002399	海普瑞	2,380	30,583.00	0.03
480	002320	海峡股份	5,368	29,524.00	0.03
481	001872	招商港口	2,000	28,720.00	0.03
482	001213	中铁特货	6,500	28,080.00	0.03
483	000553	安道麦 A	3,100	28,055.00	0.03
484	301219	腾远钴业	400	27,572.00	0.03
485	000869	张裕 A	900	27,216.00	0.03
486	000958	电投产融	6,000	26,760.00	0.03
487	002461	珠江啤酒	3,100	24,831.00	0.03
488	301236	软通动力	700	24,626.00	0.03
489	300741	华宝股份	1,000	23,530.00	0.02
490	300894	火星人	800	20,224.00	0.02
491	001289	龙源电力	1,100	20,097.00	0.02
492	002978	安宁股份	600	20,016.00	0.02
493	301177	迪阿股份	300	18,894.00	0.02
494	003039	顺控发展	1,100	18,601.00	0.02
495	001227	兰州银行	4,900	18,473.00	0.02
496	002901	大博医疗	500	17,015.00	0.02
497	301200	大族数控	400	15,680.00	0.02
498	001308	康冠科技	500	15,520.00	0.02
499	301268	铭利达	300	15,063.00	0.02
500	301207	华兰疫苗	300	13,374.00	0.01

### 8.3.2 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	001301	尚太科技	1,164	68,722.56	0.07
2	301269	华大九天	92	8,090.48	0.01
3	301327	华宝新能	37	6,547.89	0.01

4	301095	广立微	64	5,535.36	0.01
5	301308	江波龙	82	4,651.04	0.00
6	301367	怡和嘉业	26	4,570.28	0.00
7	301267	华夏眼科	67	4,435.40	0.00
8	301195	北路智控	55	4,017.20	0.00
9	301363	美好医疗	93	3,520.05	0.00
10	301330	熵基科技	108	3,381.48	0.00
11	301165	锐捷网络	104	3,287.44	0.00
12	301391	卡莱特	40	3,238.80	0.00
13	301396	宏景科技	101	3,221.90	0.00
14	301356	天振股份	74	3,206.42	0.00
15	301273	瑞晨环保	83	3,136.57	0.00
16	301398	星源卓镁	107	3,096.58	0.00
17	301316	慧博云通	211	3,021.52	0.00
18	301313	凡拓数创	96	2,797.44	0.00
19	301139	元道通信	108	2,733.48	0.00
20	301377	鼎泰高科	154	2,715.02	0.00
21	301223	中荣股份	148	2,683.24	0.00
22	301389	隆扬电子	146	2,505.36	0.00
23	301270	汉仪股份	87	2,468.19	0.00
24	301366	一博科技	53	2,389.77	0.00
25	301282	金禄电子	87	2,196.75	0.00
26	301319	唯特偶	40	2,130.80	0.00
27	301309	万得凯	55	1,345.30	0.00

#### 8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

##### 8.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	002466	天齐锂业	861,940.00	0.81
2	002738	中矿资源	220,457.00	0.21
3	300438	鹏辉能源	206,704.00	0.20
4	000792	盐湖股份	202,891.00	0.19
5	300395	菲利华	181,250.00	0.17
6	002192	融捷股份	180,434.00	0.17
7	300363	博腾股份	172,754.00	0.16
8	000519	中兵红箭	166,822.00	0.16
9	000762	西藏矿业	152,199.00	0.14
10	000516	国际医学	147,689.00	0.14
11	000408	藏格矿业	143,289.00	0.14
12	300919	中伟股份	130,754.00	0.12
13	300750	宁德时代	123,360.00	0.12
14	002472	双环传动	119,775.00	0.11

15	300035	中科电气	115,164.00	0.11
16	002865	钧达股份	115,136.00	0.11
17	300850	新强联	114,052.00	0.11
18	300776	帝尔激光	104,997.00	0.10
19	000893	亚钾国际	101,705.00	0.10
20	000636	风华高科	99,954.00	0.09

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

#### 8.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	000858	五粮液	264,795.00	0.25
2	000333	美的集团	172,977.00	0.16
3	000651	格力电器	153,576.00	0.14
4	002594	比亚迪	151,862.00	0.14
5	000002	万科 A	88,227.00	0.08
6	301095	广立微	88,218.60	0.08
7	002415	海康威视	86,318.00	0.08
8	000568	泸州老窖	85,368.00	0.08
9	300212	易华录	83,398.72	0.08
10	000516	国际医学	82,044.00	0.08
11	300379	东方通	80,178.00	0.08
12	301327	华宝新能	77,721.75	0.07
13	002475	立讯精密	76,086.00	0.07
14	300068	南都电源	75,185.00	0.07
15	300315	掌趣科技	74,866.00	0.07
16	002332	仙琚制药	74,620.00	0.07
17	301308	江波龙	65,406.80	0.06
18	002123	梦网科技	64,441.00	0.06
19	002074	国轩高科	64,236.00	0.06
20	000009	中国宝安	62,401.00	0.06

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

#### 8.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	9,901,356.56
卖出股票收入（成交）总额	9,568,107.27

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

#### 8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。



**8.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细**

本基金本报告期末未持有债券。

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

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

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

本基金本报告期末未持有贵金属。

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

本基金本报告期末未持有权证。

**8.10 本基金投资股指期货的投资政策**

无。

**8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明****8.11.1 本期国债期货投资政策**

无。

**8.11.2 本期国债期货投资评价**

无。

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

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

**8.12.2 基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库**

本基金投资的前十名股票未超出基金合同规定的备选股票库。

**8.12.3 期末其他各项资产构成**

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	5,798.31
2	应收清算款	44,046.57
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	49,844.88

## 8.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

无。

## 8.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

## 8.12.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

无。

## 8.12.5.2 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	301269	华大九天	8,090.48	0.01	新股锁定
2	301327	华宝新能	6,547.89	0.01	新股锁定
3	301095	广立微	5,535.36	0.01	新股锁定
4	301308	江波龙	4,651.04	0.00	新股锁定

## 8.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入原因，分项之和与合计可能有尾差。

## § 9 基金份额持有人信息

## 9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

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 (%)
3,522	24,483.23	8,695,119.00	10.08	77,534,803.00	89.92

注：持有人户数为有效户数，即存量份额大于零的账户。

## 9.2 期末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	广发证券股份有限公司	6,034,303.00	7.00
2	中信建投证券股份有限公司	1,857,728.00	2.15
3	刘小彦	1,551,750.00	1.80
4	吕君	1,099,023.00	1.27
5	顾勇	791,450.00	0.92

6	广州市杰泰实业发展有限公司	775,946.00	0.90
7	黄赤锋	771,963.00	0.90
8	李长柱	731,538.00	0.85
9	王仁斌	701,654.00	0.81
10	廖松波	666,400.00	0.77

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。

### 9.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

无。

### 9.4 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

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

无。

## § 10 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	27,000,000.00
减：本报告期基金总赎回份额	12,000,000.00
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	86,229,922.00

## § 11 重大事件揭示

### 11.1 基金份额持有人大会决议

无。

### 11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

一、基金管理人的重大人事变动

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。

3. 大成基金管理有限公司于 2022 年 11 月 26 日召开公司 2022 年第二次临时股东会，审议通过《关于董事会换届选举的议案》，选举吴庆斌、林昌、谭晓冈、杨红、宋立志担任公司第八届董事会董事；选举胡维翊、杨晓帆、卢锋、江涛担任公司第八届董事会独立董事。其中，吴庆斌、林昌、谭晓冈、胡维翊、杨晓帆连任公司董事，李超、郭向东、金李、黄隽不再担任公司董事。

#### 二、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

1、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。

2、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。

### 11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

无。

### 11.4 基金投资策略的改变

本基金投资策略在本报告期内没有重大改变。

### 11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金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)，本年度应支付的审计费用为 50,000.00 元整。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。

### 11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

#### 11.6.1 管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，基金管理人及其相关高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

#### 11.6.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本基金托管人及其高级管理人员在开展基金托管业务过程中无受稽查或处罚等情况。

## 11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

## 11.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例 (%)	佣金	占当期佣金总量的比例 (%)	
光大证券	2	17,600,929.77	100.00	12,685.35	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	1	-	-	-	-	-
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：

- （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。

2. 本报告期内增加交易单元：中信证券、东亚前海、信达证券。本报告期内退租交易单元：广发证券。

### 11.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券	成交金额	占当期债券回购成交总	成交金额	占当期权证
		券				

		成交总额 的比例 (%)		额的比例 (%)		成交总额 的比例 (%)
光大证 券	138,074.71	100.00	-	-	-	-

### 11.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	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 12 月 31 日
2	大成基金管理有限公司关于网上直销系统开展邮储银行支付渠道费率优惠活动的公告	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 12 月 30 日
3	大成深证成份交易型开放式指数证券投资基金 2022 年第 3 季度报告	中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站	2022 年 10 月 26 日
4	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	2022 年 8 月 31 日
5	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	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 8 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	2022 年 8 月 26 日
7	大成基金管理有限公司住所变更公告	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 7 月 30 日
8	大成深证成份交易型开放式指数证券投资基金 2022 年第 2 季度报告	中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站	2022 年 7 月 20 日
9	关于大成深证成份交易型开放式指数证券投资基金增加广发证券股份有限公司为申购赎回代办证券公司的公告	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 7 月 15 日
10	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	2022 年 7 月 2 日
11	关于大成基金旗下部分交易型开放式指数证券投资基金新增申万宏源西部证券有限公司为申购赎回代办证券公司的公告	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 7 月 1 日
12	大成基金管理有限公司关于终止北京晟视天下基金销售有限公司、北京唐鼎耀华基金销售有限公司、北京植信基金销售有限公司办理旗下基金相关	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 7 月 1 日

	销售业务的公告		
13	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 6 月 30 日
14	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 6 月 29 日
15	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 6 月 25 日
16	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 6 月 2 日
17	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 4 月 22 日
18	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 4 月 16 日
19	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 3 月 29 日
20	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 3 月 21 日
21	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 1 月 27 日
22	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 1 月 21 日
23	大成基金管理有限公司关于旗下公开募集证券投资基金执行新金融工具相关会计准则的公告	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 1 月 1 日

## § 12 影响投资者决策的其他重要信息

### 12.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

无。

### 12.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。



## § 13 备查文件目录

### 13.1 备查文件目录

- 1、中国证监会批准设立大成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。

### 13.2 存放地点

备查文件存放于本基金管理人和托管人的住所。

### 13.3 查阅方式

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

大成基金管理有限公司

2023 年 3 月 30 日