

大成深证成份交易型开放式指数证券投资 基金 2023 年中期报告

2023 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：2023 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 2023 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 2023 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	7
4.1 基金管理人及基金经理情况	7
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	11
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	11
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	12
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	13
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	13
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	14
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	14
§ 5 托管人报告	14
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	14
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	14
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	14
§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）	15
6.1 资产负债表	15
6.2 利润表	16
6.3 净资产（基金净值）变动表	17
6.4 报表附注	19
§ 7 投资组合报告	41
7.1 期末基金资产组合情况	41
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	41
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	43
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	55
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	56
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	57
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	57
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	57

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	57
7.10 本基金投资股指期货的投资政策	57
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	57
7.12 投资组合报告附注	57
§ 8 基金份额持有人信息	58
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	58
8.2 期末上市基金前十名持有人	59
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	59
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	59
§ 9 开放式基金份额变动	59
§ 10 重大事件揭示	60
10.1 基金份额持有人大会决议	60
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	60
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	60
10.4 基金投资策略的改变	60
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	60
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	60
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	60
10.8 其他重大事件	62
§ 11 影响投资者决策的其他重要信息	63
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	63
11.2 影响投资者决策的其他重要信息	63
§ 12 备查文件目录	64
12.1 备查文件目录	64
12.2 存放地点	64
12.3 查阅方式	64

§ 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	95,229,922.00 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 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(2023 年 1 月 1 日-2023 年 6 月 30 日)
本期已实现收益	2,627,169.37
本期利润	1,270,982.07
加权平均基金份额本期利润	0.0140
本期加权平均净值利润率	1.20%
本期基金份额净值增长率	0.80%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2023 年 6 月 30 日)
期末可供分配利润	-14,686,644.76
期末可供分配基金份额利润	-0.1542
期末基金资产净值	108,073,420.95
期末基金份额净值	1.135
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2023 年 6 月 30 日)
基金份额累计净值增长率	-11.94%

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

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

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

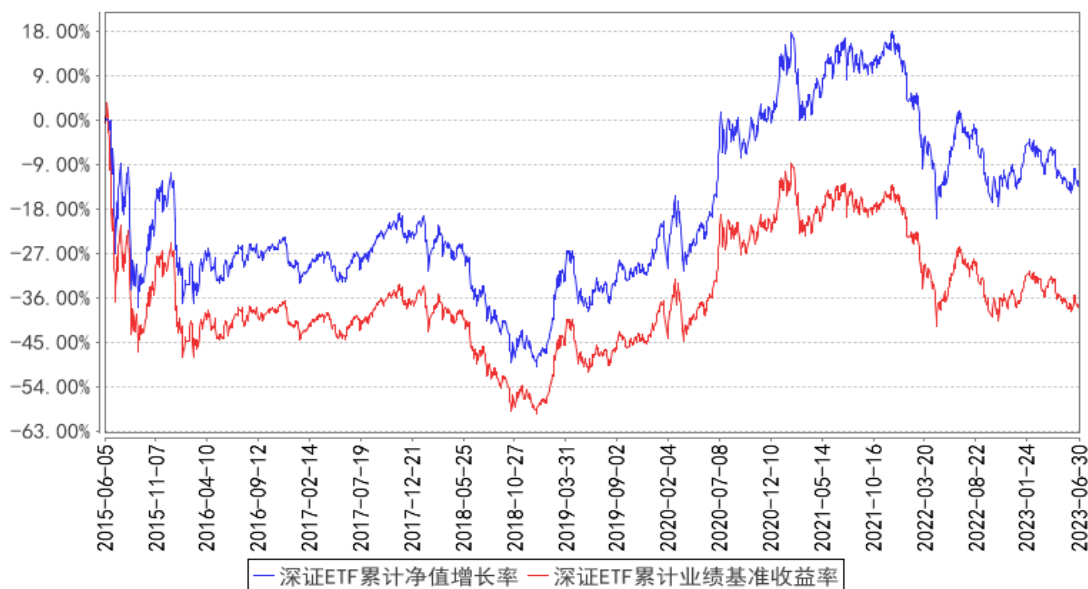
3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	2.62%	1.04%	2.16%	1.06%	0.46%	-0.02%
过去三个月	-5.10%	0.88%	-5.97%	0.90%	0.87%	-0.02%
过去六个月	0.80%	0.88%	0.10%	0.90%	0.70%	-0.02%
过去一年	-12.89%	1.03%	-14.50%	1.06%	1.61%	-0.03%
过去三年	2.09%	1.29%	-8.05%	1.33%	10.14%	-0.04%
自基金合同生效起至今	-11.94%	1.55%	-36.99%	1.60%	25.05%	-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。

§ 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

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 24 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	-	15 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。2020 年 6 月 29 日至 2023 年 5 月 30 日任大成 MSCI 中国 A 股质优价值 100 交易型开放式指数证券投资基金基金经理。2020 年 6 月 29 日至 2023 年 6 月 14 日任大成 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

					<p>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。2023 年 3 月 20 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基金经理。2023 年 4 月 14 日起任大成沪深 300 指数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	本基金经理，混合资产投资部副总监	2015 年 6 月 5 日	2023 年 4 月 10 日	19 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、指数与期货投资部副总监，现任混合资产投资部副总监。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 日至 2023 年 3 月 20 日任大成中证 100 交易型开放式指数证券投资基金基金经理。2015 年 6 月 5 日至 2023 年 4 月 10 日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 日至 2023 年 4 月 19 日任大成沪深 300 指数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 日至 2023 年 7 月 13 日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。2023 年 4</p>

					月 25 日起任大成卓享一年持有期混合型证券投资基金基金经理。2023 年 8 月 1 日起任大成中证 1000 指数增强型发起式证券投资基金基金经理。具有基金从业资格。国籍：中国
刘旺	本基金基金经理助理	2022 年 12 月 19 日	-	5 年	香港中文大学理学(金融工程)硕士。2018 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 日至 2023 年 6 月 14 日任大成上海金交易型开放式证券投资基金基金经理助理。2022 年 12 月 19 日至 2023 年 8 月 3 日任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、大成智惠量化多策略灵活配置混合型证券投资基金基金经理助理。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
王宁宁	本基金基金经理助理	2022 年 8 月 1 日	-	5 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 2023 年 6 月 14 日任大成上海金交易型开放式证券投资基金基金经理助理。2022 年 8 月 1 日至 2023 年 5 月 30 日任大成 MSCI 中国 A 股质优价值 100 交易型开放式指数证券投资基金基金经理助理。2022 年 8 月 1 日至 2023 年 6 月 14 日任大成 MSCI 中国 A 股质

					<p>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。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、中证 500 沪市交易型开放式指数证券投资基金、大成中证 500 深市交易型开放式指数证券投资基金、大成深证成份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基金经理助理。具备基金从业资格。国籍：中国</p>
--	--	--	--	--	---

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，公司严格执行了公平交易的原则和制度。公司运用统计分析方法和工具，对旗下所有投资组合间连续 4 个季度的日内、3 日内及 5 日内股票及债券交易同向交易价差进行分析，针对同一基金经理管理的多个投资组合及公私募兼任基金经理管理的多个投资组合的投资交易行为加强了公平交易监测与分析，包括对不同时间窗下（同日、3 日、5 日、10 日）反向交易和同向交易价差监控的分析。分析结果表明：债券交易同向交易频率较低；部分股票同向交易溢价率较大主要来源于投资策略差异、市场因素（如个股当日价格振幅较高）及组合经理交易时机选择，即投资组合成交时间不一致以及成交价格的日内较大变动导致个别些组合间的成交价格差异较大，

同时结合交易价差专项统计分析，未发现违反公平交易原则的异常情况。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

报告期内，公司旗下所有投资组合未发现存在异常交易行为。公司旗下所有投资组合参与的交易公开竞价，未发生成交较少的单边交易量超过该股当日成交量 5% 的股票同日反向交易；主动投资组合间债券交易存在 1 笔同日反向交易，原因为流动性需要。投资组合间相邻交易日反向交易的市场成交比例、成交均价等交易结果数据表明该类交易不对市场产生重大影响，无异常。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

上半年，宏观政策维持宽松状态，国内经济整体处于复苏通道中，内外部没有重大风险扰动，市场环境相对好于 2022 年。分子端，由于“疤痕效应”存在，经济在脉冲式修复后，内生动能放缓，复苏进程与预期存在差距。在此背景下，A 股伴随着对经济发展预期的变化而上下波动，报告期内呈现先扬后抑的特征。

主要指数方面，沪深 300 微跌 0.75%；中证 500 涨 2.29%；创业板指跌 5.61%，中证 1000 涨 5.10%。主题或行业方面，存量博弈局面使得分化非常严重。基本上只有以“人工智能”带动的 TMT 行情和“中特估”是为数不多表现强势的主题。行业上，通信、传媒、计算机涨幅居前；而消费者服务、房地产、综合金融则表现不佳。风格上，小盘、价值相对占优。

阶段表现上，年初伊始，基于对经济的乐观展望，A 股延续了去年底启动的修复行情继续反弹。三月份以后，市场对后续复苏强度的判断产生分歧并影响了投资方向与风格。主力逐渐定价弱复苏，在流动性宽松的推动下，交易方向转为成长，TMT 大幅跑赢。四、五月份，由于内外去库存共振，各类经济活动走弱，叠加海外方面，美联储紧缩预期的反复也一定程度上影响国内，因此，股票市场普遍下跌。偏股型主动基金陆续回吐年内收益，两大投资主线也出现明显回调。直至 6 月上旬后，经济边际偏弱强化了对政策放松的期待，市场情绪逐渐被修正，主要指数涨跌互现。

本基金标的指数为深证成份指数。深证成份指数由深圳证券交易所市值大、流动性好的 500 只 A 股组成，定位于深交所标尺指数，反映深交所多层次市场的整体表现。本基金采取完全复制法进行投资，即原则上按照标的指数的成份股及其权重构建基金股票投资组合，并根据标的指数成份股及其权重的变动而进行相应调整。

运作层面上，本基金在报告期内基本保持满仓，并根据标的指数成份股调整以及权重的变化及时调整投资组合。各项操作和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 1.135 元；本报告期基金份额净值增长率为 0.80%，业绩比较基准收益率为 0.10%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

目前，各项数据显示国内经济虽然呈现偏弱的状态，但已具备初步筑底企稳迹象。根据政治局会议精神，后续稳增长政策在托底基础上，力度或将较前期边际提升。在此背景下，我们认为经济在度过二季度的相对低位后，下半年趋势有望转好。结构上，改善项一是来自于消费，尽管消费的复苏仍需时间但可选消费修复空间比较大；二是基建上半年高开低走，下半年财政政策力度有望加大，关注政策性开发性金融工具落地情况；三是制造业投资降幅收窄。从库存的角度，下半年部分行业进入去库存后半段，年底或进入主动补库存周期。

对于股票市场而言，经济是今年主导市场最重要的变量之一。未来，经济企稳回升与流动性偏宽松的组环境对股市较为友好。企业盈利预计也将伴随经济复苏而逐步回升。目前，A 股估值处于相对低位，修复空间较大。我们认为市场在下半年震荡筑底后，中枢有望上行。

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、混合资产投资部、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八名投资组合经理。

股票投资部、固定收益总部、混合资产投资部、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 2023 年 1 月 1 日至 2023 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的真实、准确和完整发表意见

本托管人认为，大成基金管理有限公司的信息披露事务符合《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》及其他相关法律法规的规定，基金管理人所编制和披露的本基金中期报告中的财务

指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告等信息真实、准确、完整，未发现有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：2023 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2023 年 6 月 30 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
资产：			
银行存款	6.4.7.1	2,195,541.10	3,417,635.54
结算备付金		29,105.57	-
存出保证金		12,998.26	5,798.31
交易性金融资产	6.4.7.2	106,085,411.30	94,615,200.83
其中：股票投资		106,056,648.92	94,615,200.83
基金投资		-	-
债券投资		28,762.38	-
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		-	44,046.57
应收股利		-	-
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.8	-	-
资产总计		108,323,056.23	98,082,681.25
负债和净资产	附注号	本期末 2023 年 6 月 30 日	上年度末 2022 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		30,454.87	764,118.97
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		47,545.05	40,491.16
应付托管费		9,508.99	8,098.23
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	162,126.37	215,082.58
负债合计		249,635.28	1,027,790.94
净资产：			
实收基金	6.4.7.10	122,760,065.71	111,158,243.82
其他综合收益	6.4.7.11	-	-
未分配利润	6.4.7.12	-14,686,644.76	-14,103,353.51
净资产合计		108,073,420.95	97,054,890.31
负债和净资产总计		108,323,056.23	98,082,681.25

注：报告截止日 2023 年 06 月 30 日，基金份额净值 1.135 元，基金份额总额 95,229,922.00 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：2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
一、营业总收入		1,720,842.73	-12,432,703.59
1. 利息收入		9,369.08	8,991.68
其中：存款利息收入	6.4.7.13	9,369.08	8,991.68
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）		3,056,264.68	1,394,497.45
其中：股票投资收益	6.4.7.14	1,969,964.23	642,025.48
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.15	6,949.39	16,128.51
资产支持证券投资	6.4.7.16	-	-

收益			
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	1,079,351.06	736,343.46
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	-1,356,187.30	-13,836,464.72
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	11,396.27	272.00
减：二、营业总支出		449,860.66	426,586.44
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	262,569.95	226,640.75
2. 托管费	6.4.10.2.2	52,513.94	45,328.13
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	134,776.77	154,617.56
三、利润总额（亏损总额 以“-”号填列）		1,270,982.07	-12,859,290.03
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-” 号填列）		1,270,982.07	-12,859,290.03
五、其他综合收益的税后 净额		-	-
六、综合收益总额		1,270,982.07	-12,859,290.03

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：2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 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）	111,158,243.82	-	-14,103,353.51	97,054,890.31

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)	111,158,243.82	-	-14,103,353.51	97,054,890.31
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	11,601,821.89	-	-583,291.25	11,018,530.64
(一)、综合收益总额	-	-	1,270,982.07	1,270,982.07
(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)	11,601,821.89	-	-1,854,273.32	9,747,548.57
其中：1. 基金申购款	54,141,835.36	-	-5,896,868.50	48,244,966.86
2. 基金赎回款	-42,540,013.47	-	4,042,595.18	-38,497,418.29
(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)	122,760,065.71	-	-14,686,644.76	108,073,420.95
项目	上年度可比期间			
	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	91,821,874.07	-	14,162,382.86	105,984,256.93

资产(基金净值)				
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

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、《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 6.4.4 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。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金于 2023 年 6 月 30 日的财务状况以及自 2023 年 1 月 1 日起至 2023 年 6 月 30 日止期间的经营成果和净值变动情况。

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

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

6.4.5 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

本基金本报告期未发生会计政策变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

6.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无重大会计差错更正。

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[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。

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 2023 年 6 月 30 日
活期存款	2,195,541.10
等于：本金	2,195,176.10
加：应计利息	365.00
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	2,195,541.10

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2023年6月30日				
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动	
股票	104,170,965.25	-	106,056,648.92	1,885,683.67	
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	-	
债券	交易所市场	26,900.00	4.99	28,762.38	1,857.39
	银行间市场	-	-	-	-
	合计	26,900.00	4.99	28,762.38	1,857.39
资产支持证券	-	-	-	-	
基金	-	-	-	-	
其他	-	-	-	-	
合计	104,197,865.25	4.99	106,085,411.30	1,887,541.06	

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 2023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	6,747.20
其中：交易所市场	6,747.20
银行间市场	-
应付利息	-
应退退补款	5,912.40
预提费用	114,466.77
应付指数使用费	35,000.00
合计	162,126.37

6.4.7.10 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	86,229,922.00	111,158,243.82
本期申购	42,000,000.00	54,141,835.36
本期赎回（以“-”号填列）	-33,000,000.00	-42,540,013.47
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	95,229,922.00	122,760,065.71

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
上年度末	8,427,735.39	-22,531,088.90	-14,103,353.51
本期利润	2,627,169.37	-1,356,187.30	1,270,982.07
本期基金份额交易产生的变动数	1,058,420.67	-2,912,693.99	-1,854,273.32
其中：基金申购款	4,827,399.64	-10,724,268.14	-5,896,868.50
基金赎回款	-3,768,978.97	7,811,574.15	4,042,595.18
本期已分配利润	-	-	-
本期末	12,113,325.43	-26,799,970.19	-14,686,644.76

6.4.7.13 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期
	2023年1月1日至2023年6月30日
活期存款利息收入	9,222.76
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	70.08
其他	76.24
合计	9,369.08

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
	2023年1月1日至2023年6月30日
股票投资收益——买卖股票差价收入	-358,008.64
股票投资收益——赎回差价收入	2,327,972.87
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	1,969,964.23

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
	2023年1月1日至2023年6月30日

卖出股票成交总额	4,778,627.34
减：卖出股票成本总额	5,123,713.82
减：交易费用	12,922.16
买卖股票差价收入	-358,008.64

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 2023年1月1日至2023年6月30日
赎回基金份额对价总额	38,497,418.29
减：现金支付赎回款总额	221,749.29
减：赎回股票成本总额	35,947,696.13
减：交易费用	-
赎回差价收入	2,327,972.87

6.4.7.14.4 股票投资收益——申购差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年6月30日
申购基金份额总额	42,000,000.00
减：现金支付申购款总额	42,000,000.00
减：申购股票成本总额	-
减：交易费用	-
申购差价收入	-

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 2023年1月1日至2023年6月30日
债券投资收益——利息收入	8.49
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	6,940.90
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	6,949.39

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 2023年1月1日至2023年6月30日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总	33,645.75

额	
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	26,700.00
减：应计利息总额	3.50
减：交易费用	1.35
买卖债券差价收入	6,940.90

6.4.7.15.3 债券投资收益——赎回差价收入

无。

6.4.7.15.4 债券投资收益——申购差价收入

无。

6.4.7.16 资产支持证券投资收益

6.4.7.16.1 资产支持证券投资收益项目构成

无。

6.4.7.16.2 资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入

无。

6.4.7.16.3 资产支持证券投资收益——赎回差价收入

无。

6.4.7.16.4 资产支持证券投资收益——申购差价收入

无。

6.4.7.17 贵金属投资收益

6.4.7.17.1 贵金属投资收益项目构成

无。

6.4.7.17.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

无。

6.4.7.17.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

无。

6.4.7.17.4 贵金属投资收益——申购差价收入

无。

6.4.7.18 衍生工具收益

6.4.7.18.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

无。

6.4.7.18.2 衍生工具收益——其他投资收益

无。

6.4.7.19 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年6月30日
股票投资产生的股利收益	1,079,351.06
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	1,079,351.06

6.4.7.20 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2023年1月1日至2023年6月30日
1. 交易性金融资产	-1,356,187.30
股票投资	-1,358,044.69
债券投资	1,857.39
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	-1,356,187.30

6.4.7.21 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年6月30日
基金赎回费收入	-
替代损益	11,396.27
合计	11,396.27

注：替代损益是指投资者采用可以现金替代或退补现金替代方式申购(赎回)本基金时，补入(卖出)被替代成分证券的实际买入成本(实际卖出金额)与申购(赎回)确认日估值的差额或强制退款的被替代成分证券在强制退款计算日与申购(赎回)确认日估值的差额。

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 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
审计费用	24,795.19
信息披露费	39,671.58
证券出借违约金	-
银行划款手续费	310.00
指数使用费	70,000.00
合计	134,776.77

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。

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 2023年1月1日至2023年6月30日		上年度可比期间 2022年1月1日至2022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	10,179,908.98	100.00	8,192,248.33	100.00

6.4.10.1.2 债券交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2023年1月1日至2023年6月30日		上年度可比期间 2022年1月1日至2022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	33,645.75	100.00	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 2023年1月1日至2023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	7,342.69	100.00	6,747.20	100.00
关联方名称	上年度可比期间 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

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 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	262,569.95	226,640.75
其中：支付销售机构的客户维护费	-	-

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

日管理人报酬=前一日基金资产净值 × 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 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	52,513.94	45,328.13

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。

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 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国农业银行	2,195,541.10	9,222.76	2,667,103.98	8,822.22

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 2023 年 1 月 1 日至 2023 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：股/张）	总金额
-	-	-	-	-	-
上年度可比期间 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：股/张）	总金额
光大证券	001268	联合精密	网下发行	409	7,873.25

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（2023 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
001328	登康口腔	2023 年 3 月 29 日	6 个月	新股锁定	20.68	25.49	46	951.28	1,172.54	-
001360	南矿集团	2023 年 3 月 31 日	6 个月	新股锁定	15.38	14.87	68	1,045.84	1,011.16	-
001367	海森药业	2023 年 3 月 30 日	6 个月	新股锁定	44.48	39.48	23	1,023.04	908.04	-

300804	广康生化	2023年6月15日	6个月	新股锁定	42.45	32.97	99	4,202.55	3,264.03	-
301170	锡南科技	2023年6月16日	6个月	新股锁定	34.00	34.93	88	2,992.00	3,073.84	-
301232	飞沃科技	2023年6月8日	6个月	新股锁定	72.50	58.42	54	3,915.00	3,154.68	-
301260	格力博	2023年1月20日	6个月	新股锁定	30.85	23.63	173	5,337.05	4,087.99	-
301261	恒工精密	2023年6月29日	1个月内(含)	新股未上市	36.90	36.90	789	29,114.10	29,114.10	-
301281	科源制药	2023年3月28日	6个月	新股锁定	44.18	25.10	111	3,490.22	2,786.10	科源制药于2023年5月26日每10股送4股
301293	三博脑科	2023年4月25日	6个月	新股锁定	29.60	71.42	100	2,960.00	7,142.00	-
301303	真兰仪表	2023年2月13日	6个月	新股锁定	26.80	22.32	180	4,824.00	4,017.60	-
301307	美利信	2023年4月14日	6个月	新股锁定	32.34	31.86	124	4,010.16	3,950.64	-
301310	鑫宏业	2023年5月26日	6个月	新股锁定	67.28	65.43	83	5,584.24	5,430.69	-
301315	威士顿	2023年6月13日	6个月	新股锁定	32.29	51.12	99	3,196.71	5,060.88	-
301317	鑫磊股份	2023年1月12日	6个月	新股锁定	20.67	26.17	198	4,092.66	5,181.66	-
301322	绿通科技	2023年2月27日	6个月	新股锁定	131.11	53.24	48	4,195.52	2,555.52	绿通科技于2023年5月25日每10股送5股
301325	曼恩斯特	2023年5月4日	6个月	新股锁定	76.80	107.95	55	4,224.00	5,937.25	-

301332	德尔玛	2023年5月9日	6个月	新股锁定	14.81	13.73	233	3,450.73	3,199.09	-
301337	亚华电子	2023年5月16日	6个月	新股锁定	32.60	30.37	87	2,836.20	2,642.19	-
301345	涛涛车业	2023年3月10日	6个月	新股锁定	73.45	46.64	37	2,717.65	1,725.68	-
301358	湖南裕能	2023年2月1日	6个月	新股锁定	23.77	42.89	145	3,446.65	6,219.05	-
301387	光大同创	2023年4月10日	6个月	新股锁定	58.32	45.36	72	4,199.04	3,265.92	-
301428	世纪恒通	2023年5月10日	6个月	新股锁定	26.35	30.60	89	2,345.15	2,723.40	-
301429	森泰股份	2023年4月10日	6个月	新股锁定	28.75	21.02	172	4,945.00	3,615.44	-
301439	泓淋电力	2023年3月10日	6个月	新股锁定	19.99	16.90	149	2,978.51	2,518.10	-

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
127086	恒邦转债	2023年6月12日	1个月内(含)	新债未上市	100.00	100.01	168	16,800.00	16,801.40	-

注：1. 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。

2. 基金持有的股票在流通受限期内，如获得股票红利、送股、转增股、配股的，则此新增股票的流通受限期和估值价格与相应原股票一致。

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
300346	南大	2023	重大事	34.39	2023	35.60	4,380	137,132.37	150,628.20	-

	光电	年 6 月 26 日	项		年 7 月 6 日					
--	----	------------------	---	--	-----------------	--	--	--	--	--

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

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，将风险控制在可承受的范围内。

6.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息等情况，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股份有限公司，因而与银行存款相关的信用风险不重大。本基金在交易所进行的交易均以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，违约风险可能性很小；在银行间同业市场进行交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式进行限制以控制相应的信用风险。

本基金的基金管理人建立了信用风险管理流程，通过对投资品种信用等级评估来控制证券发行人的信用风险。信用等级评估以内部信用评级为主，外部信用评级为辅。内部债券信用评级主要考察发行人的经营风险、财务风险和流动性风险，以及信用产品的条款和担保人的情况等。此外，本基金的基金管理人根据信用产品的内部评级，通过单只信用产品投资占基金资产净值的比例及占发行量的比例进行控制，通过分散化投资以分散信用风险。

本期末，本基金持有的除国债、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：本基金无债券投资)。

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 2023 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	2,195,541.10	-	-	-	2,195,541.10
结算备付金	29,105.57	-	-	-	29,105.57
存出保证金	12,998.26	-	-	-	12,998.26
交易性金融资产	-	-	28,762.38	106,056,648.92	106,085,411.30
资产总计	2,237,644.93	-	28,762.38	106,056,648.92	108,323,056.23
负债					
应付管理人报酬	-	-	-	47,545.05	47,545.05
应付托管费	-	-	-	9,508.99	9,508.99
应付清算款	-	-	-	30,454.87	30,454.87
其他负债	-	-	-	162,126.37	162,126.37
负债总计	-	-	-	249,635.28	249,635.28
利率敏感度缺口	2,237,644.93	-	28,762.38	105,807,013.64	108,073,420.95
上年度末 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

注：表中所示为本基金资产及负债的账面价值，并按照合同约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 0.03%(上年度末：未持有交易性债券投资)，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)。

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，深证成份指数成份股和备选成份股股票投资比例不低于基金资产净值的 95%。此外，本基金的基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控，定期运用多种定量方法对基金进行风险度量，包括 VaR (Value at Risk) 指标等来测试本基金面临的潜在价格风险，及时可靠地对风险进行跟踪和控制。

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2023年6月30日		上年度末 2022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	106,056,648.92	98.13	94,615,200.83	97.49
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	106,056,648.92	98.13	94,615,200.83	97.49

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		
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（2023年6月30日）	上年度末（2022年12月31日）
	业绩比较基准上升 5%	5,272,655.59	4,707,618.57

	业绩比较基准下降 5%	-5,272,655.59	-4,707,618.57
--	----------------	---------------	---------------

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 2023年6月30日	上年度末 2022年12月31日
第一层次	105,804,224.11	94,449,685.07
第二层次	196,543.70	74,592.00
第三层次	84,643.49	90,923.76
合计	106,085,411.30	94,615,200.83

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，确定相关股票和债券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	106,056,648.92	97.91
	其中：股票	106,056,648.92	97.91
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	28,762.38	0.03
	其中：债券	28,762.38	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	2,224,646.67	2.05
8	其他各项资产	12,998.26	0.01
9	合计	108,323,056.23	100.00

注：上述股票投资金额包括可退替代款估值增值（如有）。

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	2,275,281.85	2.11
B	采矿业	1,064,299.10	0.98
C	制造业	78,468,568.08	72.61
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	1,268,408.60	1.17
E	建筑业	186,322.13	0.17
F	批发和零售业	788,877.85	0.73
G	交通运输、仓储和邮政业	1,402,938.96	1.30
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	7,115,664.56	6.58
J	金融业	7,022,575.54	6.50

K	房地产业	1,538,881.03	1.42
L	租赁和商务服务业	1,170,109.51	1.08
M	科学研究和技术服务业	1,049,877.00	0.97
N	水利、环境和公共设施管理业	293,737.24	0.27
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	191,290.00	0.18
Q	卫生和社会工作	1,094,910.50	1.01
R	文化、体育和娱乐业	799,765.44	0.74
S	综合	178,298.04	0.16
	合计	105,909,805.43	98.00

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	129,275.02	0.12
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	10,426.47	0.01
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	7,142.00	0.01
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-

	合计	146,843.49	0.14
--	----	------------	------

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	22,480	5,143,199.20	4.76
2	000858	五粮液	17,000	2,780,690.00	2.57
3	000333	美的集团	44,907	2,645,920.44	2.45
4	002594	比亚迪	7,700	1,988,679.00	1.84
5	300059	东方财富	114,538	1,626,439.60	1.50
6	000651	格力电器	41,200	1,504,212.00	1.39
7	000568	泸州老窖	7,000	1,466,990.00	1.36
8	002475	立讯精密	41,746	1,354,657.70	1.25
9	300760	迈瑞医疗	4,500	1,349,100.00	1.25
10	000063	中兴通讯	29,000	1,320,660.00	1.22
11	000725	京东方 A	293,800	1,201,642.00	1.11
12	002415	海康威视	35,125	1,162,988.75	1.08
13	002230	科大讯飞	16,375	1,112,845.00	1.03
14	300124	汇川技术	17,291	1,110,255.11	1.03
15	300274	阳光电源	9,280	1,082,326.40	1.00
16	002714	牧原股份	23,006	969,702.90	0.90
17	002352	顺丰控股	21,100	951,399.00	0.88
18	002129	TCL 中环	27,050	898,060.00	0.83
19	300498	温氏股份	48,905	897,406.75	0.83
20	000001	平安银行	78,100	877,063.00	0.81
21	002142	宁波银行	32,717	827,740.10	0.77
22	300308	中际旭创	5,520	813,924.00	0.75
23	000002	万科 A	56,700	794,934.00	0.74
24	002371	北方华创	2,400	762,360.00	0.71
25	002304	洋河股份	5,462	717,433.70	0.66
26	300014	亿纬锂能	11,431	691,575.50	0.64
27	300015	爱尔眼科	36,454	676,221.70	0.63
28	002466	天齐锂业	9,500	664,145.00	0.61
29	000792	盐湖股份	34,200	655,614.00	0.61
30	002460	赣锋锂业	10,490	639,470.40	0.59
31	002027	分众传媒	93,088	633,929.28	0.59
32	000338	潍柴动力	47,500	591,850.00	0.55
33	002459	晶澳科技	14,132	589,304.40	0.55
34	002049	紫光国微	6,080	566,960.00	0.52

35	000100	TCL 科技	133,340	525,359.60	0.49
36	002050	三花智控	17,200	520,472.00	0.48
37	000625	长安汽车	38,814	501,865.02	0.46
38	000938	紫光股份	15,347	488,801.95	0.45
39	002555	三七互娱	14,000	488,320.00	0.45
40	002271	东方雨虹	17,553	478,494.78	0.44
41	002179	中航光电	10,224	463,658.40	0.43
42	300122	智飞生物	10,350	457,470.00	0.42
43	002709	天赐材料	10,892	448,641.48	0.42
44	002812	恩捷股份	4,570	440,319.50	0.41
45	000977	浪潮信息	8,553	414,820.50	0.38
46	002241	歌尔股份	22,800	404,700.00	0.37
47	300896	爱美客	900	400,455.00	0.37
48	300142	沃森生物	15,000	396,750.00	0.37
49	300316	晶盛机电	5,580	395,622.00	0.37
50	002517	恺英网络	24,800	390,352.00	0.36
51	002410	广联达	11,980	389,230.20	0.36
52	300502	新易盛	5,561	377,981.17	0.35
53	000166	申万宏源	81,460	376,345.20	0.35
54	000661	长春高新	2,760	376,188.00	0.35
55	000776	广发证券	25,300	372,163.00	0.34
56	000596	古井贡酒	1,500	371,070.00	0.34
57	002602	世纪华通	48,609	368,942.31	0.34
58	001979	招商蛇口	26,201	341,399.03	0.32
59	002311	海大集团	7,280	340,995.20	0.32
60	300450	先导智能	9,200	332,764.00	0.31
61	300408	三环集团	11,300	331,655.00	0.31
62	000538	云南白药	6,260	328,524.80	0.30
63	002920	德赛西威	2,100	327,201.00	0.30
64	002493	荣盛石化	28,025	326,211.00	0.30
65	000733	振华科技	3,400	325,890.00	0.30
66	002252	上海莱士	43,020	323,080.20	0.30
67	000768	中航西飞	11,900	318,325.00	0.29
68	002236	大华股份	16,100	317,975.00	0.29
69	300347	泰格医药	4,850	313,019.00	0.29
70	000963	华东医药	7,095	307,710.15	0.28
71	000425	徐工机械	45,000	304,650.00	0.28
72	002384	东山精密	11,700	303,030.00	0.28
73	000988	华工科技	7,900	300,279.00	0.28
74	300496	中科创达	3,100	298,685.00	0.28
75	300033	同花顺	1,700	297,976.00	0.28
76	002340	格林美	42,520	293,813.20	0.27
77	300782	卓胜微	2,953	285,348.39	0.26

78	300418	昆仑万维	7,000	281,960.00	0.26
79	000157	中联重科	41,500	280,125.00	0.26
80	002180	纳思达	7,900	270,575.00	0.25
81	002422	科伦药业	9,000	267,120.00	0.25
82	002202	金风科技	24,336	258,448.32	0.24
83	000066	中国长城	18,404	254,527.32	0.24
84	002463	沪电股份	12,150	254,421.00	0.24
85	002074	国轩高科	9,190	253,827.80	0.23
86	300003	乐普医疗	11,226	253,819.86	0.23
87	300012	华测检测	13,000	253,500.00	0.23
88	300724	捷佳伟创	2,200	247,170.00	0.23
89	000807	云铝股份	19,300	245,689.00	0.23
90	300751	迈为股份	1,444	244,584.72	0.23
91	000895	双汇发展	9,900	242,451.00	0.22
92	002648	卫星化学	16,062	240,287.52	0.22
93	002028	思源电气	5,100	238,272.00	0.22
94	300454	深信服	2,100	237,825.00	0.22
95	002405	四维图新	20,350	235,653.00	0.22
96	002738	中矿资源	4,580	233,305.20	0.22
97	002601	龙佰集团	14,100	232,650.00	0.22
98	300037	新宙邦	4,460	231,429.40	0.21
99	000876	新希望	19,700	230,096.00	0.21
100	000423	东阿阿胶	4,300	229,835.00	0.21
101	300223	北京君正	2,600	229,606.00	0.21
102	002821	凯莱英	1,940	228,648.40	0.21
103	002156	通富微电	10,000	226,000.00	0.21
104	000301	东方盛虹	19,100	225,762.00	0.21
105	002001	新和成	14,517	223,561.80	0.21
106	300661	圣邦股份	2,722	223,557.86	0.21
107	002736	国信证券	25,400	221,742.00	0.21
108	002185	华天科技	23,874	219,640.80	0.20
109	300146	汤臣倍健	9,100	218,218.00	0.20
110	002436	兴森科技	13,900	215,450.00	0.20
111	000999	华润三九	3,482	211,218.12	0.20
112	002472	双环传动	5,800	210,540.00	0.19
113	300433	蓝思科技	17,859	210,021.84	0.19
114	002007	华兰生物	9,360	209,757.60	0.19
115	300207	欣旺达	12,800	208,896.00	0.19
116	002841	视源股份	3,120	208,540.80	0.19
117	002008	大族激光	7,800	204,360.00	0.19
118	300999	金龙鱼	5,100	203,949.00	0.19
119	000786	北新建材	8,300	203,433.00	0.19
120	300058	蓝色光标	21,019	203,253.73	0.19

121	002558	巨人网络	11,300	202,609.00	0.19
122	300285	国瓷材料	7,300	200,020.00	0.19
123	003816	中国广核	64,300	199,973.00	0.19
124	300413	芒果超媒	5,730	196,023.30	0.18
125	002223	鱼跃医疗	5,430	195,425.70	0.18
126	002624	完美世界	11,550	195,079.50	0.18
127	002385	大北农	29,550	195,030.00	0.18
128	002625	光启技术	12,740	194,412.40	0.18
129	002797	第一创业	33,620	192,306.40	0.18
130	000975	银泰黄金	16,377	191,610.90	0.18
131	300759	康龙化成	5,000	191,400.00	0.18
132	002607	中公教育	40,700	191,290.00	0.18
133	300073	当升科技	3,800	191,254.00	0.18
134	002044	美年健康	26,804	190,576.44	0.18
135	002439	启明星辰	6,400	190,464.00	0.18
136	002966	苏州银行	29,000	189,950.00	0.18
137	300212	易华录	5,700	189,411.00	0.18
138	000799	酒鬼酒	2,100	189,315.00	0.18
139	000783	长江证券	32,600	189,080.00	0.17
140	002603	以岭药业	7,324	188,153.56	0.17
141	300395	菲利华	3,800	186,960.00	0.17
142	300769	德方纳米	1,692	186,509.16	0.17
143	300568	星源材质	10,842	186,373.98	0.17
144	002850	科达利	1,400	185,150.00	0.17
145	000630	铜陵有色	63,700	184,093.00	0.17
146	000933	神火股份	14,000	182,000.00	0.17
147	300024	机器人	10,866	181,136.22	0.17
148	300763	锦浪科技	1,740	181,134.00	0.17
149	002600	领益智造	26,200	181,042.00	0.17
150	300459	汤姆猫	27,580	178,994.20	0.17
151	000009	中国宝安	14,772	178,298.04	0.16
152	000932	华菱钢铁	37,160	177,253.20	0.16
153	300253	卫宁健康	16,247	175,792.54	0.16
154	300474	景嘉微	1,950	175,480.50	0.16
155	002409	雅克科技	2,400	174,912.00	0.16
156	300919	中伟股份	2,900	174,725.00	0.16
157	000591	太阳能	25,700	174,246.00	0.16
158	000723	美锦能源	23,100	174,174.00	0.16
159	000021	深科技	8,666	173,233.34	0.16
160	002568	百润股份	4,748	172,589.80	0.16
161	002407	多氟多	8,620	171,193.20	0.16
162	000683	远兴能源	23,700	170,403.00	0.16
163	002497	雅化集团	9,500	168,910.00	0.16

164	300144	宋城演艺	13,551	168,032.40	0.16
165	002756	永兴材料	2,670	167,168.70	0.15
166	000831	中国稀土	5,600	165,760.00	0.15
167	002176	江特电机	13,900	165,688.00	0.15
168	002865	钧达股份	1,079	164,579.87	0.15
169	002465	海格通信	15,900	164,406.00	0.15
170	300390	天华新能	4,580	163,964.00	0.15
171	000983	山西焦煤	17,810	162,071.00	0.15
172	301269	华大九天	1,300	159,692.00	0.15
173	000728	国元证券	24,450	159,414.00	0.15
174	300832	新产业	2,700	159,300.00	0.15
175	300054	鼎龙股份	6,400	158,272.00	0.15
176	002025	航天电器	2,470	157,586.00	0.15
177	000617	中油资本	21,720	157,035.60	0.15
178	300567	精测电子	1,650	156,997.50	0.15
179	300604	长川科技	3,300	156,717.00	0.15
180	000738	航发控制	6,400	156,160.00	0.14
181	002015	协鑫能科	11,500	154,445.00	0.14
182	000069	华侨城 A	35,100	154,440.00	0.14
183	300628	亿联网络	4,390	153,957.30	0.14
184	300118	东方日升	6,000	153,780.00	0.14
185	000878	云南铜业	13,900	153,595.00	0.14
186	000818	航锦科技	4,600	153,502.00	0.14
187	300136	信维通信	7,620	153,009.60	0.14
188	300487	蓝晓科技	2,450	152,929.00	0.14
189	002368	太极股份	3,711	152,781.87	0.14
190	002078	太阳纸业	14,200	151,798.00	0.14
191	000860	顺鑫农业	4,490	151,268.10	0.14
192	300346	南大光电	4,380	150,628.20	0.14
193	000408	藏格矿业	6,600	148,962.00	0.14
194	000998	隆平高科	9,600	147,360.00	0.14
195	300777	中简科技	3,100	146,506.00	0.14
196	002138	顺络电子	6,100	145,851.00	0.13
197	002673	西部证券	22,866	145,199.10	0.13
198	002262	恩华药业	4,700	144,901.00	0.13
199	002317	众生药业	8,500	144,415.00	0.13
200	002444	巨星科技	6,600	144,408.00	0.13
201	002430	杭氧股份	4,200	144,312.00	0.13
202	002268	电科网安	5,160	143,809.20	0.13
203	000519	中兵红箭	7,900	142,911.00	0.13
204	002281	光迅科技	3,800	140,942.00	0.13
205	002195	二三四五	48,664	140,638.96	0.13
206	002294	信立泰	4,500	140,355.00	0.13

207	300866	安克创新	1,600	140,000.00	0.13
208	300438	鹏辉能源	2,900	139,316.00	0.13
209	002152	广电运通	11,850	138,882.00	0.13
210	000513	丽珠集团	3,567	138,791.97	0.13
211	300601	康泰生物	5,460	138,629.40	0.13
212	300699	光威复材	4,484	138,331.40	0.13
213	000400	许继电气	6,000	138,300.00	0.13
214	002065	东华软件	19,500	137,670.00	0.13
215	300595	欧普康视	4,540	137,062.60	0.13
216	002595	豪迈科技	3,900	137,007.00	0.13
217	002056	横店东磁	7,500	136,575.00	0.13
218	300383	光环新网	12,700	136,525.00	0.13
219	000960	锡业股份	8,721	135,611.55	0.13
220	000729	燕京啤酒	10,800	134,676.00	0.12
221	300017	网宿科技	18,752	133,326.72	0.12
222	002080	中材科技	6,480	132,969.60	0.12
223	000629	钒钛股份	33,900	132,549.00	0.12
224	002739	万达电影	10,500	131,670.00	0.12
225	002747	埃斯顿	4,700	131,600.00	0.12
226	002326	永太科技	8,600	131,494.00	0.12
227	000997	新大陆	6,950	131,355.00	0.12
228	002938	鹏鼎控股	5,400	131,166.00	0.12
229	002373	千方科技	9,600	130,944.00	0.12
230	002353	杰瑞股份	5,200	130,676.00	0.12
231	002273	水晶光电	10,914	130,313.16	0.12
232	002507	涪陵榨菜	7,070	129,451.70	0.12
233	000032	深桑达 A	3,900	128,310.00	0.12
234	300476	胜宏科技	5,300	127,783.00	0.12
235	002402	和而泰	7,500	127,350.00	0.12
236	002531	天顺风能	8,300	126,409.00	0.12
237	300676	华大基因	2,100	125,979.00	0.12
238	002456	欧菲光	22,400	125,440.00	0.12
239	000623	吉林敖东	7,820	125,432.80	0.12
240	002203	海亮股份	10,400	124,904.00	0.12
241	002851	麦格米特	3,400	123,998.00	0.11
242	300182	捷成股份	19,634	123,890.54	0.11
243	002683	广东宏大	4,200	123,648.00	0.11
244	000703	恒逸石化	18,166	123,165.48	0.11
245	300001	特锐德	5,900	122,602.00	0.11
246	002131	利欧股份	53,134	122,208.20	0.11
247	000690	宝新能源	17,400	122,148.00	0.11
248	000708	中信特钢	7,690	121,809.60	0.11
249	301236	软通动力	4,450	121,084.50	0.11

250	000547	航天发展	12,100	121,000.00	0.11
251	300633	开立医疗	2,200	119,900.00	0.11
252	300296	利亚德	18,350	119,825.50	0.11
253	002916	深南电路	1,584	119,386.08	0.11
254	000039	中集集团	17,240	118,783.60	0.11
255	000762	西藏矿业	4,000	118,520.00	0.11
256	002120	韵达股份	12,329	117,865.24	0.11
257	002557	洽洽食品	2,800	116,340.00	0.11
258	000516	国际医学	13,800	116,058.00	0.11
259	002506	协鑫集成	39,500	115,735.00	0.11
260	300957	贝泰妮	1,300	115,544.00	0.11
261	002389	航天彩虹	5,200	115,492.00	0.11
262	002414	高德红外	14,748	114,591.96	0.11
263	002151	北斗星通	3,250	114,270.00	0.11
264	300088	长信科技	18,900	113,967.00	0.11
265	002532	天山铝业	19,000	113,810.00	0.11
266	002192	融捷股份	1,700	113,611.00	0.11
267	002092	中泰化学	17,600	113,520.00	0.11
268	300458	全志科技	4,164	113,469.00	0.10
269	002926	华西证券	13,600	113,016.00	0.10
270	000893	亚钾国际	4,900	112,406.00	0.10
271	300251	光线传媒	13,880	112,289.20	0.10
272	000970	中科三环	8,745	112,110.90	0.10
273	300244	迪安诊断	4,372	112,054.36	0.10
274	000636	风华高科	7,300	111,982.00	0.10
275	002372	伟星新材	5,440	111,737.60	0.10
276	002508	老板电器	4,390	111,023.10	0.10
277	300558	贝达药业	2,300	110,469.00	0.10
278	000060	中金岭南	23,200	110,200.00	0.10
279	300456	赛微电子	4,500	110,160.00	0.10
280	002064	华峰化学	16,000	109,760.00	0.10
281	002617	露笑科技	13,900	109,532.00	0.10
282	300682	朗新科技	4,700	109,416.00	0.10
283	000750	国海证券	32,565	109,092.75	0.10
284	002939	长城证券	13,200	107,316.00	0.10
285	300803	指南针	2,200	106,898.00	0.10
286	300910	瑞丰新材	2,100	105,630.00	0.10
287	300373	扬杰科技	2,600	105,482.00	0.10
288	002153	石基信息	7,512	105,168.00	0.10
289	000155	川能动力	7,300	105,120.00	0.10
290	000877	天山股份	12,900	105,006.00	0.10
291	001227	兰州银行	36,200	103,532.00	0.10
292	300748	金力永磁	3,460	103,523.20	0.10

293	002299	圣农发展	5,400	103,410.00	0.10
294	000921	海信家电	3,800	102,410.00	0.09
295	300666	江丰电子	1,500	101,940.00	0.09
296	002541	鸿路钢构	3,530	101,699.30	0.09
297	002500	山西证券	17,880	99,770.40	0.09
298	002936	郑州银行	43,315	99,624.50	0.09
299	000887	中鼎股份	7,600	99,484.00	0.09
300	000739	普洛药业	5,600	99,344.00	0.09
301	002019	亿帆医药	6,800	99,280.00	0.09
302	000050	深天马 A	10,800	99,144.00	0.09
303	300009	安科生物	9,886	98,860.00	0.09
304	300034	钢研高纳	2,500	98,475.00	0.09
305	000830	鲁西化工	9,300	98,208.00	0.09
306	002128	电投能源	7,400	97,828.00	0.09
307	300294	博雅生物	2,650	96,142.00	0.09
308	002484	江海股份	4,500	95,805.00	0.09
309	002145	中核钛白	16,165	95,211.85	0.09
310	002958	青农商行	35,000	95,200.00	0.09
311	002429	兆驰股份	17,300	95,150.00	0.09
312	002396	星网锐捷	4,200	94,878.00	0.09
313	300529	健帆生物	4,080	94,574.40	0.09
314	000875	吉电股份	17,500	94,325.00	0.09
315	002212	天融信	9,700	94,090.00	0.09
316	300776	帝尔激光	1,440	93,456.00	0.09
317	002245	蔚蓝锂芯	8,500	93,075.00	0.09
318	000778	新兴铸管	22,800	93,024.00	0.09
319	300026	红日药业	17,100	92,682.00	0.09
320	000951	中国重汽	5,460	92,001.00	0.09
321	300363	博腾股份	3,100	91,729.00	0.08
322	002706	良信股份	8,060	90,675.00	0.08
323	300451	创业慧康	10,792	90,436.96	0.08
324	002244	滨江集团	10,200	89,964.00	0.08
325	300638	广和通	3,960	89,812.80	0.08
326	300677	英科医疗	4,080	89,760.00	0.08
327	000686	东北证券	12,920	89,664.80	0.08
328	002487	大金重工	2,900	89,436.00	0.08
329	002030	达安基因	8,965	89,381.05	0.08
330	002643	万润股份	5,100	88,791.00	0.08
331	300070	碧水源	16,514	88,515.04	0.08
332	002408	齐翔腾达	13,880	88,415.60	0.08
333	000528	柳 工	11,180	88,322.00	0.08
334	002831	裕同科技	3,620	88,291.80	0.08
335	002155	湖南黄金	7,200	87,840.00	0.08

336	300775	三角防务	2,600	87,828.00	0.08
337	300115	长盈精密	7,336	87,371.76	0.08
338	300674	宇信科技	4,880	86,278.40	0.08
339	002266	浙富控股	20,840	86,069.20	0.08
340	300747	锐科激光	2,812	85,709.76	0.08
341	301050	雷电微力	1,300	84,409.00	0.08
342	002791	坚朗五金	1,300	84,123.00	0.08
343	002518	科士达	2,100	84,021.00	0.08
344	301268	铭利达	2,000	83,740.00	0.08
345	300773	拉卡拉	4,800	83,712.00	0.08
346	002183	怡亚通	16,400	83,640.00	0.08
347	300672	国科微	1,000	83,350.00	0.08
348	002249	大洋电机	14,600	83,220.00	0.08
349	002585	双星新材	6,600	82,896.00	0.08
350	002675	东诚药业	5,600	82,376.00	0.08
351	300357	我武生物	2,440	82,057.20	0.08
352	002572	索菲亚	4,708	82,013.36	0.08
353	000403	派林生物	4,100	81,836.00	0.08
354	000709	河钢股份	35,600	80,456.00	0.07
355	002099	海翔药业	9,300	79,887.00	0.07
356	003031	中瓷电子	600	79,872.00	0.07
357	002727	一心堂	3,000	79,200.00	0.07
358	002312	川发龙蟒	9,700	78,861.00	0.07
359	301035	润丰股份	1,000	78,570.00	0.07
360	000825	太钢不锈	20,200	78,174.00	0.07
361	300979	华利集团	1,600	77,984.00	0.07
362	300432	富临精工	6,700	77,854.00	0.07
363	000810	创维数字	4,800	77,616.00	0.07
364	000883	湖北能源	17,000	77,520.00	0.07
365	300725	药石科技	1,600	77,488.00	0.07
366	000027	深圳能源	11,740	77,366.60	0.07
367	300679	电连技术	2,300	76,015.00	0.07
368	002085	万丰奥威	10,956	75,925.08	0.07
369	300298	三诺生物	2,800	75,712.00	0.07
370	002032	苏泊尔	1,500	75,000.00	0.07
371	000012	南玻 A	12,539	74,732.44	0.07
372	003022	联泓新科	3,000	74,700.00	0.07
373	002690	美亚光电	2,900	74,675.00	0.07
374	002701	奥瑞金	16,500	74,415.00	0.07
375	000581	威孚高科	4,700	74,025.00	0.07
376	002221	东华能源	8,500	73,525.00	0.07
377	001965	招商公路	7,600	72,960.00	0.07
378	002984	森麒麟	2,300	72,358.00	0.07

379	000422	湖北宜化	6,300	72,324.00	0.07
380	002745	木林森	7,700	70,840.00	0.07
381	301155	海力风电	900	69,372.00	0.06
382	002867	周大生	3,900	69,342.00	0.06
383	000401	冀东水泥	9,400	69,278.00	0.06
384	000035	中国天楹	15,100	69,158.00	0.06
385	002511	中顺洁柔	6,200	69,130.00	0.06
386	002250	联化科技	6,600	69,036.00	0.06
387	002004	华邦健康	13,800	69,000.00	0.06
388	000785	居然之家	18,000	68,580.00	0.06
389	300861	美畅股份	1,580	68,524.60	0.06
390	002597	金禾实业	2,900	68,440.00	0.06
391	003035	南网能源	9,600	68,352.00	0.06
392	300888	稳健医疗	1,640	68,338.80	0.06
393	000156	华数传媒	7,800	67,860.00	0.06
394	002985	北摩高科	1,530	67,503.60	0.06
395	300035	中科电气	5,600	67,312.00	0.06
396	000987	越秀资本	10,435	66,262.25	0.06
397	000598	兴蓉环境	12,000	65,160.00	0.06
398	002091	江苏国泰	8,600	64,844.00	0.06
399	300618	寒锐钴业	1,992	64,560.72	0.06
400	300376	易事特	9,600	64,320.00	0.06
401	002124	天邦食品	14,060	63,832.40	0.06
402	002127	南极电商	16,550	63,386.50	0.06
403	000800	一汽解放	7,500	62,775.00	0.06
404	300726	宏达电子	1,400	62,608.00	0.06
405	300623	捷捷微电	3,450	62,514.00	0.06
406	000930	中粮科技	7,700	62,370.00	0.06
407	300463	迈克生物	4,100	61,992.00	0.06
408	000937	冀中能源	9,690	61,822.20	0.06
409	000559	万向钱潮	11,328	61,737.60	0.06
410	002468	申通快递	5,700	61,674.00	0.06
411	301071	力量钻石	1,400	61,600.00	0.06
412	300482	万孚生物	2,280	60,716.40	0.06
413	000028	国药一致	1,390	60,617.90	0.06
414	002773	康弘药业	3,160	60,419.20	0.06
415	000958	电投产融	13,800	59,754.00	0.06
416	300685	艾德生物	2,460	59,679.60	0.06
417	000902	新洋丰	5,802	59,644.56	0.06
418	000555	神州信息	4,800	59,040.00	0.05
419	002048	宁波华翔	4,400	58,960.00	0.05
420	000415	渤海租赁	28,000	58,800.00	0.05
421	001914	招商积余	3,900	58,695.00	0.05

422	002010	传化智联	11,000	58,520.00	0.05
423	000089	深圳机场	8,400	58,380.00	0.05
424	002906	华阳集团	1,700	58,123.00	0.05
425	002081	金螳螂	12,863	58,012.13	0.05
426	300457	赢合科技	3,250	57,395.00	0.05
427	000898	鞍钢股份	20,252	56,300.56	0.05
428	000539	粤电力 A	7,700	56,210.00	0.05
429	002505	鹏都农牧	29,730	56,189.70	0.05
430	300850	新强联	1,500	56,070.00	0.05
431	000712	锦龙股份	4,400	54,912.00	0.05
432	300257	开山股份	3,600	54,612.00	0.05
433	002237	恒邦股份	5,000	54,450.00	0.05
434	300737	科顺股份	5,900	54,044.00	0.05
435	002191	劲嘉股份	8,900	53,578.00	0.05
436	002948	青岛银行	17,110	53,554.30	0.05
437	300171	东富龙	2,300	52,325.00	0.05
438	002423	中粮资本	6,500	52,000.00	0.05
439	002041	登海种业	3,400	51,918.00	0.05
440	301047	义翘神州	600	51,420.00	0.05
441	000563	陕国投 A	16,800	51,240.00	0.05
442	301238	瑞泰新材	2,500	50,850.00	0.05
443	002705	新宝股份	2,800	50,484.00	0.05
444	000537	广宇发展	4,300	50,181.00	0.05
445	000967	盈峰环境	9,900	49,995.00	0.05
446	301029	怡合达	1,112	49,684.16	0.05
447	300841	康华生物	750	49,417.50	0.05
448	000402	金融街	10,900	49,268.00	0.05
449	002626	金达威	2,600	48,854.00	0.05
450	002925	盈趣科技	2,480	48,112.00	0.04
451	000627	天茂集团	16,000	48,000.00	0.04
452	300973	立高食品	700	47,894.00	0.04
453	000927	中国铁物	17,100	47,538.00	0.04
454	002216	三全食品	3,020	47,051.60	0.04
455	301078	孩子王	4,100	46,863.00	0.04
456	300630	普利制药	2,386	46,646.30	0.04
457	002434	万里扬	5,200	46,540.00	0.04
458	002967	广电计量	2,300	46,207.00	0.04
459	000966	长源电力	8,100	45,198.00	0.04
460	002670	国盛金控	5,093	44,716.54	0.04
461	002498	汉缆股份	10,900	43,709.00	0.04
462	002608	江苏国信	5,700	43,149.00	0.04
463	301219	腾远钴业	1,150	42,964.00	0.04
464	000959	首钢股份	12,200	42,700.00	0.04

465	002110	三钢闽光	10,050	42,411.00	0.04
466	001203	大中矿业	3,800	42,218.00	0.04
467	002563	森马服饰	6,700	41,674.00	0.04
468	300761	立华股份	2,260	41,651.80	0.04
469	301095	广立微	500	41,325.00	0.04
470	301308	江波龙	400	40,704.00	0.04
471	000688	国城矿业	2,600	39,442.00	0.04
472	300428	立中集团	1,700	39,202.00	0.04
473	000990	诚志股份	5,100	38,862.00	0.04
474	002612	朗姿股份	1,600	38,048.00	0.04
475	002653	海思科	1,600	37,760.00	0.03
476	000935	四川双马	2,200	37,048.00	0.03
477	000869	张裕 A	1,200	36,792.00	0.03
478	000582	北部湾港	4,800	36,480.00	0.03
479	000672	上峰水泥	3,980	36,337.40	0.03
480	001872	招商港口	2,100	36,267.00	0.03
481	002242	九阳股份	2,400	35,880.00	0.03
482	300894	火星人	1,400	35,756.00	0.03
483	002945	华林证券	2,600	35,568.00	0.03
484	002320	海峡股份	5,768	34,838.72	0.03
485	000062	深圳华强	2,905	33,175.10	0.03
486	001213	中铁特货	7,500	33,075.00	0.03
487	001289	龙源电力	1,400	31,500.00	0.03
488	300821	东岳硅材	3,100	30,194.00	0.03
489	002461	珠江啤酒	3,400	29,954.00	0.03
490	000553	安道麦 A	3,400	28,696.00	0.03
491	002399	海普瑞	2,480	28,445.60	0.03
492	300741	华宝股份	1,300	27,846.00	0.03
493	001322	箭牌家居	1,600	26,784.00	0.02
494	301207	华兰疫苗	800	26,608.00	0.02
495	002978	安宁股份	800	25,688.00	0.02
496	003039	顺控发展	1,300	22,048.00	0.02
497	001308	康冠科技	780	21,418.80	0.02
498	301200	大族数控	500	19,940.00	0.02
499	301177	迪阿股份	500	19,215.00	0.02
500	002901	大博医疗	600	18,648.00	0.02

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	301387	光大同创	712	34,837.12	0.03
2	301261	恒工精密	789	29,114.10	0.03
3	301293	三博脑科	100	7,142.00	0.01
4	301358	湖南裕能	145	6,219.05	0.01

5	301325	曼恩斯特	55	5,937.25	0.01
6	301310	鑫宏业	83	5,430.69	0.01
7	301317	鑫磊股份	198	5,181.66	0.00
8	301315	威士顿	99	5,060.88	0.00
9	301260	格力博	173	4,087.99	0.00
10	301303	真兰仪表	180	4,017.60	0.00
11	301307	美利信	124	3,950.64	0.00
12	301429	森泰股份	172	3,615.44	0.00
13	300804	广康生化	99	3,264.03	0.00
14	301332	德尔玛	233	3,199.09	0.00
15	301232	飞沃科技	54	3,154.68	0.00
16	301170	锡南科技	88	3,073.84	0.00
17	301281	科源制药	111	2,786.10	0.00
18	301428	世纪恒通	89	2,723.40	0.00
19	301337	亚华电子	87	2,642.19	0.00
20	301322	绿通科技	48	2,555.52	0.00
21	301439	泓淋电力	149	2,518.10	0.00
22	301345	涛涛车业	37	1,725.68	0.00
23	301309	万得凯	55	1,514.70	0.00
24	001328	登康口腔	46	1,172.54	0.00
25	001360	南矿集团	68	1,011.16	0.00
26	001367	海森药业	23	908.04	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	002517	恺英网络	457,962.00	0.47
2	300750	宁德时代	266,903.00	0.28
3	300212	易华录	226,292.00	0.23
4	002015	协鑫能科	171,544.00	0.18
5	301269	华大九天	162,674.00	0.17
6	002317	众生药业	159,997.00	0.16
7	300760	迈瑞医疗	150,570.00	0.16
8	002607	中公教育	139,461.00	0.14
9	002326	永太科技	138,103.00	0.14
10	300910	瑞丰新材	123,404.00	0.13
11	301236	软通动力	117,366.00	0.12
12	001227	兰州银行	100,069.00	0.10
13	000776	广发证券	96,642.00	0.10
14	000596	古井贡酒	84,489.00	0.09
15	000422	湖北宜化	81,445.00	0.08
16	301268	铭利达	70,084.00	0.07

17	300919	中伟股份	63,118.00	0.07
18	300459	汤姆猫	62,263.00	0.06
19	002555	三七互娱	61,632.00	0.06
20	300769	德方纳米	56,274.00	0.06

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。

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	002013	中航机电	171,803.96	0.18
2	002594	比亚迪	154,022.00	0.16
3	000858	五粮液	117,772.00	0.12
4	002648	卫星化学	83,172.00	0.09
5	001301	尚太科技	82,178.40	0.08
6	000166	申万宏源	80,380.00	0.08
7	300033	同花顺	74,681.00	0.08
8	002839	张家港行	74,495.80	0.08
9	002415	海康威视	71,909.00	0.07
10	301358	湖南裕能	67,388.90	0.07
11	002002	鸿达兴业	62,986.59	0.06
12	300671	富满微	61,384.00	0.06
13	000333	美的集团	61,204.00	0.06
14	301260	格力博	58,858.70	0.06
15	300072	海新能科	58,746.87	0.06
16	300059	东方财富	57,868.00	0.06
17	301303	真兰仪表	56,376.11	0.06
18	000651	格力电器	54,038.00	0.06
19	002390	信邦制药	54,030.00	0.06
20	301315	威士顿	53,791.64	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。

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	6,329,768.73
卖出股票收入（成交）总额	4,778,627.34

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）	28,762.38	0.03
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	28,762.38	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	127086	恒邦转债	168	16,801.40	0.02
2	127085	韵达转债	101	11,960.98	0.01

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

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。

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	12,998.26
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	12,998.26

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	301261	恒工精密	29,114.10	0.03	新股未上市
2	301293	三博脑科	7,142.00	0.01	新股锁定
3	301358	湖南裕能	6,219.05	0.01	新股锁定
4	301325	曼恩斯特	5,937.25	0.01	新股锁定
5	301387	光大同创	3,265.92	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 (%)

4,432	21,486.90	5,120,225.00	5.38	90,109,697.00	94.62
-------	-----------	--------------	------	---------------	-------

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	中信建投证券股份有限公司	2,091,231.00	2.20
2	刘小彦	1,551,750.00	1.63
3	广发证券股份有限公司	1,443,806.00	1.52
4	李长柱	1,040,338.00	1.09
5	戴济民	832,129.00	0.87
6	顾勇	791,450.00	0.83
7	广州市杰泰实业发展有限公司	775,946.00	0.81
8	黄赤峰	771,963.00	0.81
9	王仁斌	701,654.00	0.74
10	谢元禄	639,844.00	0.67

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、基金投资和研发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	86,229,922.00
本报告期基金总申购份额	42,000,000.00
减：本报告期基金总赎回份额	33,000,000.00
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	95,229,922.00

§ 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

经大成基金管理有限公司第八届董事会第二次会议审议通过，自 2023 年 3 月 25 日起，温智敏先生不再担任公司副总经理职务；聘请石国武先生担任公司副总经理，任期自 2023 年 3 月 25 日起，至公司第八届董事会任期届满之日止。具体详见我司发布的《大成基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告》。

二、基金托管人的基金托管部门的重大人事变动

本报告期内，基金托管人的基金托管部门无重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内，无涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。

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

10.6.1 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。

10.6.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

无。

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	10,179,908.98	100.00	7,342.69	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	-	-	-	-	-
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	2	-	-	-	-	-

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、租用券商专用交易单元的选择标准和程序：

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、本报告期内本基金租用证券公司交易单元的变更情况如下：

本基金本报告期内新增交易单元：无，退租交易单元：中金公司、申万宏源西部。

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	33,645.75	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	2023年6月30日

		公司网站	
2	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	2023 年 4 月 27 日
3	大成深证成份交易型开放式指数证券投资基金 2023 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	2023 年 4 月 21 日
4	大成深证成份交易型开放式指数证券投资基金基金产品资料概要更新	中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站	2023 年 4 月 12 日
5	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	2023 年 4 月 12 日
6	大成深证成份交易型开放式指数证券投资基金变更基金经理公告	中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站	2023 年 4 月 11 日
7	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	中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站	2023 年 3 月 30 日
8	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	2023 年 3 月 27 日
9	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	2023 年 3 月 27 日
10	大成基金管理有限公司关于养老金客户通过直销柜台申购旗下基金费率优惠的公告	中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站	2023 年 3 月 24 日
11	大成深证成份交易型开放式指数证券投资基金 2022 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	2023 年 1 月 18 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

2023年8月30日