

大成深证成份交易型开放式指数证券投资
基金
2024 年中期报告

2024 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：2024 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 2024 年 08 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 2024 年 01 月 01 日起至 06 月 30 日止。

1.2 目录

§ 1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
§ 2 基金简介	5
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人和基金托管人	5
2.4 信息披露方式	6
2.5 其他相关资料	6
§ 3 主要财务指标和基金净值表现	6
3.1 主要会计数据和财务指标	6
3.2 基金净值表现	7
§ 4 管理人报告	8
4.1 基金管理人及基金经理情况	8
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	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	11
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	12
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	13
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的真实、准确和完整发表意见	14
§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）	14
6.1 资产负债表	14
6.2 利润表	16
6.3 净资产变动表	17
6.4 报表附注	19
§ 7 投资组合报告	38
7.1 期末基金资产组合情况	38
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	39
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	41
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	53
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	54
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	54
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	54
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	54

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	54
7.10 本基金投资股指期货的投资政策	54
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	55
7.12 投资组合报告附注	55
§ 8 基金份额持有人信息	56
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	56
8.2 期末上市基金前十名持有人	56
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	57
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	57
§ 9 开放式基金份额变动	57
§ 10 重大事件揭示	57
10.1 基金份额持有人大会决议	57
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	57
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	57
10.4 基金投资策略的改变	57
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	58
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	58
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	58
10.8 其他重大事件	60
§ 11 影响投资者决策的其他重要信息	61
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	61
11.2 影响投资者决策的其他重要信息	61
§ 12 备查文件目录	61
12.1 备查文件目录	61
12.2 存放地点	61
12.3 查阅方式	61

§ 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	197,229,922.00 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	<p>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。</p> <p>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。</p>
业绩比较基准	深证成份指数收益率
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	任航
	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、27-33层	北京市东城区建国门内大街69号
办公地址	广东省深圳市南山区海德三道1236号大成基金总部大厦5层、27-33层	北京市西城区复兴门内大街28号凯晨世贸中心东座F9
邮政编码	518054	100031
法定代表人	吴庆斌	谷澍

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《中国证券报》
登载基金中期报告正文的基金管理人互联网网址	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(2024年1月1日-2024年6月30日)
本期已实现收益	-5,945,359.59
本期利润	-8,192,574.37
加权平均基金份额本期利润	-0.0479
本期加权平均净值利润率	-4.99%
本期基金份额净值增长率	-5.71%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2024年6月30日)
期末可供分配利润	-70,330,976.53
期末可供分配基金份额利润	-0.3566
期末基金资产净值	183,916,403.62
期末基金份额净值	0.9325
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2024年6月30日)
基金份额累计净值增长率	-27.65%

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。

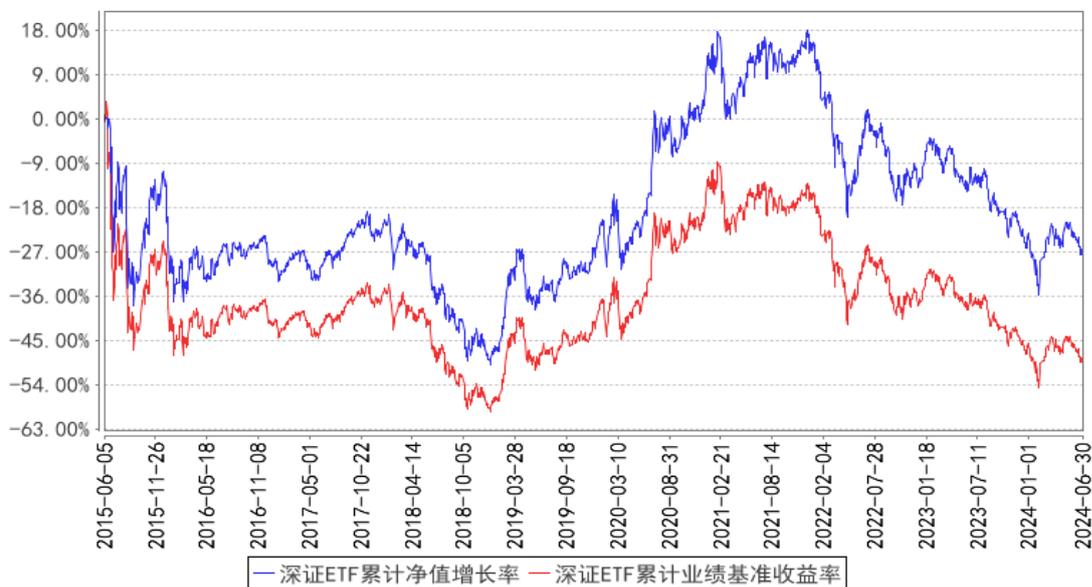
3.2 基金净值表现

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	-4.87%	0.83%	-5.51%	0.86%	0.64%	-0.03%
过去三个月	-4.55%	1.09%	-5.87%	1.11%	1.32%	-0.02%
过去六个月	-5.71%	1.37%	-7.10%	1.40%	1.39%	-0.03%
过去一年	-17.84%	1.17%	-19.75%	1.19%	1.91%	-0.02%
过去三年	-37.21%	1.20%	-41.64%	1.23%	4.43%	-0.03%
自基金合同生效起至今	-27.65%	1.52%	-49.44%	1.56%	21.79%	-0.04%

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

公司业务资质齐全，全面覆盖公募基金、机构投资、海外投资、财富管理、养老金管理等业务，还受全国社会保障基金理事会委托管理部分社保基金和基本养老保险基金。旗下大成国际资产管理公司具备 QFII、RQFII 等资格，是首批首家完成备案的能够提供港股通投资顾问服务的香港机构。历经二十余年的磨砺和沉淀，大成基金形成了以长期投资能力为核心的竞争优势，打造了一支具有良好职业素养和丰富经验的资产管理队伍。公司目前已形成权益投资、固收投资、指数与期货投资、跨境投资、混合资产投资、大类资产配置六大投资团队，全面覆盖各类投资领域，综合实力不断提升，各项业务迅猛发展，管理资产种类位居同业前列。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
刘淼	本基金基金经理	2021 年 9 月 2 日	-	16 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

					<p>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 日至 2023 年 10 月 20 日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。2024 年 3 月 6 日起任大成中证 A50 交易型开放式指数证券投资基金基金经理。2024 年 4 月 8 日起任大成中证红利低波动 100 交易型开放式指数证券投资基金基金经理。2024 年 4 月 23 日起任大成中证 A50 交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理。2024 年 5 月 24 日起任大成中证芯片产业指数型发起式证券投资基金基金经理。2024 年 5 月 28 日起任大成中证工程机械主题交易型开放式指数证券投资基金基金经理。具备基金从业资格。国籍：中国</p>
李湔玮	本基金基金经理助理	2024 年 4 月 15 日	-	8 年	<p>美国纽约大学理学硕士。2016 年 5 月加入大成基金管理有限公司，曾担任数量与指数投资部研究员、指数与期货投资部投资经理，现任指数与期货投资部基金经理助理。2024 年 4 月 15 日起任大成中证 A50 交易型开放式指数证券投资基金、大成中证红利低波动 100 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、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、大成中证上海环交所碳中和交</p>

					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、大成沪深 300 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、大成中证 100 交易型开放式指数证券投资基金基金经理助理。2024 年 4 月 23 日起任大成中证 A50 交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理助理。具有基金从业资格。国籍：中国
王宁宁	本基金基金经理助理	2022 年 8 月 1 日	2024 年 1 月 8 日	6 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 月至 2024 年 1 月任大成基金管理有限公司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 日至 2024 年 1 月 8 日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
--	--	--	--	--	-----------------------------

注：1、任职日期、离任日期为本基金管理人作出决定之日。

2、证券从业年限的计算标准遵从中国证监会《证券投资基金经营机构董事、监事、高级管理人员及从业人员监督管理办法》的相关规定。

4.1.3 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理同时管理的产品情况

无。

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

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

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

报告期内，公司严格执行了公平交易的原则和制度。公司运用统计分析方法和工具，对旗下所有投资组合连续 4 个季度的日内、3 日内、5 日内及 10 日内股票及债券交易同向交易价差进行分析，针对同一基金经理管理的多个投资组合及公私募兼任基金经理管理的多个投资组合的投资交易行为加强了公平交易监测与分析，包括对不同时间窗下（同日、3 日、5 日、10 日）反向交易和同向交易价差监控的分析。分析结果表明：债券交易同向交易频率较低；部分股票同向交易溢价率较大主要来源于投资策略差异、市场因素（如个股当日价格振幅较高）及组合经理交易时机选择，同时结合交易价差专项统计分析，未发现违反公平交易原则的异常情况。

4.3.2 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。公司旗下投资组合间存在证券同日反向交易，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证券当日成交量 5% 的情形。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，国内经济处于结构转型中，GDP 同比增长 5%，达到年初制定的目标。由于旧动能房地产持续在调整，主要发展引擎向制造业和出口切换，经济运行呈现供给强于需求的特征。节奏上，二季度增速较一季度有所回落，修复过程“波浪式发展”。报告期内，A 股市场整体呈现震荡

态势，主要指数表现分化明显。其中，沪深 300 涨 0.89%；中证 500 跌 8.96%；创业板指跌 10.99%，中证 1000 跌 16.84%。行业上（中信一级），银行、煤炭、石油石化涨幅领先；综合、消费者服务、计算机现萎靡。主题方面，红利策略整体上依然跑赢市场。风格上，大盘、价值明显占优。

阶段表现上，市场在年初继续反映上年底的逻辑，定价国内有效需求不足和美国降息预期修正。除高股息表现坚挺外，其余股票资产普遍调整。此后，市场下跌又引发生品敲入、量化策略清盘等其他连锁反应，下跌趋势加强，尤其是小市值风格跌幅较大。节前一周，以汇金、证金为代表的机构陆续增持 ETF 改善微观流动性。同时，监管机构强化对量化私募管理，政策上更新转融通规则。在大资金和情绪的带动下，股票市场整体进入反攻区间。相对来说，前期跌幅大的板块反弹幅度也更大。市场在修复一定程度后，部分资金获利了结，叠加季报披露，市场整体调整，小微盘再次受创。四月中旬起，新国九条、房地产重磅政策等陆续出台；外资上调 A 股的评级展望，叠加海外股市波动放大，资金分流向境内。在政策呵护与流动性改善的推动下，使市场阶段性回暖，风格逐渐向大市值切换。五月下旬至半年度末，由于连续两个月的经济数据显示出复苏动能较一季度放缓，市场再次进入震荡调整区间。

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市场中市值大、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 0.9325 元；本报告期基金份额净值增长率为-5.71%，业绩比较基准收益率为-7.10%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望下半年，宏观环境或将进一步改善。结构上，支撑项是基建和制造业。制造业增长在内外部库存周期共振下继续回升。基建投资增长在政府债发行提速下持平或小幅加快。房地产虽然上半年降幅有所收窄，但仍是拖累项，下半年政策发力诉求上升。消费伴随“以旧换新”等政策落地或好于上半年。出口方面，美国经济和大选结果都可能形成干扰，但总体上全球库存周期回补，且我国与新兴经济体合作加深，增长或保持韧性。货币政策在兼顾多目标的前提下中性偏松；财政政策适度加力。价格端，预计 CPI 和 PPI 温和回升。

对于股票市场而言，目前 A 股再次回到较低位置，在宏观环境有望改善的背景下，我们认为

机会大于风险，调整蓄势带来中长期配置机会。下半年，可能对股市形成催化的因素主要是政策加码和物价回升带动的企业盈利改善。风格上，前期表现较好红利股或龙头股均具备高质量、高现金流特征。这类股票在经济总量受限情况下具备经营优势，业绩韧性强，投资确定性高；而伴随经济复苏，它们的盈利水平边际变化更明显，估值修复更快。

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。估值委员会由公司各投研部门、交易管理部、风险管理部、监察稽核部、基金运营部指定人员组成。公司估值委员会的相关成员均具备相应的专业胜任能力和相关工作经历，估值委员会成员中包括八名投资组合经理。

各投研部门、风险管理部负责关注相关投资品种的动态，评判基金持有的投资品种是否处于不活跃的交易状态或者最近交易日后经济环境发生了重大变化或证券发行机构发生了影响证券价格的重大事件，从而确定估值日需要进行估值测算或者调整的投资品种；提出合理的数量分析模型对需要进行估值测算或者调整的投资品种进行公允价值定价与计量；定期对估值政策和程序进行评价，以保证其持续适用；交易管理部负责关注相关投资品种的流动性状况，协助反馈其市场交易信息；基金运营部负责日常的基金资产的估值业务，执行基金估值政策，并负责与托管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一大成基金管理有限公司 2024 年 1 月 1 日至 2024 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：2024 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2024 年 6 月 30 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
资产：			
货币资金	6.4.7.1	3,436,678.20	2,513,014.36
结算备付金		2.17	8,477.84

存出保证金		59,790.28	40,379.13
交易性金融资产	6.4.7.2	180,653,801.78	157,064,193.71
其中：股票投资		180,653,801.78	157,064,193.71
基金投资		-	-
债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
其他投资		-	-
衍生金融资产	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		-	111,573.01
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		184,150,272.43	159,737,638.05
负债和净资产	附注号	本期末 2024年6月30日	上年度末 2023年12月31日
负 债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付清算款		19,973.21	-
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		73,497.18	64,364.04
应付托管费		14,699.47	12,872.81
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	125,698.95	167,624.11
负债合计		233,868.81	244,860.96
净资产：			
实收基金	6.4.7.10	254,247,380.15	207,840,092.69
未分配利润	6.4.7.12	-70,330,976.53	-48,347,315.60
净资产合计		183,916,403.62	159,492,777.09

负债和净资产总计		184,150,272.43	159,737,638.05
----------	--	----------------	----------------

注：报告截止日 2024 年 06 月 30 日，基金份额净值 0.9325 元，基金份额总额 197,229,922.00 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：2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
一、营业总收入		-7,541,150.51	1,720,842.73
1. 利息收入		10,712.25	9,369.08
其中：存款利息收入	6.4.7.13	10,712.25	9,369.08
债券利息收入		-	-
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	-
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		-5,308,816.68	3,056,264.68
其中：股票投资收益	6.4.7.14	-7,309,845.33	1,969,964.23
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.15	-	6,949.39
资产支持证券投资	6.4.7.16	-	-
贵金属投资收益	6.4.7.17	-	-
衍生工具收益	6.4.7.18	-	-
股利收益	6.4.7.19	2,001,028.65	1,079,351.06
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	-2,247,214.78	-1,356,187.30
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	4,168.70	11,396.27
减：二、营业总支出		651,423.86	449,860.66
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	409,663.46	262,569.95
其中：暂估管理人报酬		-	-
2. 托管费	6.4.10.2.2	81,932.80	52,513.94
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	159,827.60	134,776.77
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-8,192,574.37	1,270,982.07
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-8,192,574.37	1,270,982.07
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		-8,192,574.37	1,270,982.07

6.3 净资产变动表

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：2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 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	207,840,092.69	-	-48,347,315.60	159,492,777.09
二、本期期初净资产	207,840,092.69	-	-48,347,315.60	159,492,777.09
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	46,407,287.46	-	-21,983,660.93	24,423,626.53
（一）、综合收益总额	-	-	-8,192,574.37	-8,192,574.37
（二）、本期基金份额交易产生的净资产变动数（净资产减少以“-”号填列）	46,407,287.46	-	-13,791,086.56	32,616,200.90
其中：1. 基金申购款	170,160,053.98	-	-45,365,539.55	124,794,514.43
2. 基金赎回款	-	-	31,574,452.99	-92,178,313.53
123,752,766.52				
（三）、本期向基金份额持有人分	-	-	-	-

配利润产生的净资产变动（净资产减少以“-”号填列）				
四、本期期末净资产	254,247,380.15	-	-70,330,976.53	183,916,403.62
项目	上年度可比期间 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	111,158,243.82	-	-14,103,353.51	97,054,890.31
二、本期期初净资产	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净资产变动数（净资产减少以“-”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净资产变动（净资产减少以“-”号填列）	-	-	-	-
四、本期期末净资产	122,760,065.71	-	-14,686,644.76	108,073,420.95

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

梁靖

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《关于准予大成深证成份交易型开放式指数证券投资基金注册的批复》注册,由大成基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《大成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:深证成份指数收益率。

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2024年8月29日批准报出。

6.4.2 会计报表的编制基础

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

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

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 2024 年 06 月 30 日的财务状况以及自 2024 年 01 月 01 日起至 2024 年 06 月 30 日止期间的经营成果和净资产变动情况等有关信息。

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

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须说明的会计差错更正。

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。根据财政部、国家税务总局公告2023年第39号《关于减半征收证券交易印花税的公告》，自2023年8月28日起，证券交易印花税实施减半征收。

(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 货币资金

单位：人民币元

项目	本期末 2024年6月30日
----	-------------------

活期存款	3,436,678.20
等于：本金	3,435,862.75
加：应计利息	815.45
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	3,436,678.20

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2024 年 6 月 30 日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	197,300,824.93	-	180,653,801.78	-16,647,023.15
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	197,300,824.93	-	180,653,801.78	-16,647,023.15

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 2024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	1,191.35

其中：交易所市场	1,191.35
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用	89,507.60
应付指数使用费	35,000.00
合计	125,698.95

6.4.7.10 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	161,229,922.00	207,840,092.69
本期申购	132,000,000.00	170,160,053.98
本期赎回（以“-”号填列）	-96,000,000.00	-123,752,766.52
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	197,229,922.00	254,247,380.15

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	17,775,435.86	-66,122,751.46	-48,347,315.60
本期期初	17,775,435.86	-66,122,751.46	-48,347,315.60
本期利润	-5,945,359.59	-2,247,214.78	-8,192,574.37
本期基金份额交易产生的变动数	3,277,798.00	-17,068,884.56	-13,791,086.56
其中：基金申购款	11,390,656.40	-56,756,195.95	-45,365,539.55
基金赎回款	-8,112,858.40	39,687,311.39	31,574,452.99
本期已分配利润	-	-	-
本期末	15,107,874.27	-85,438,850.80	-70,330,976.53

6.4.7.13 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年6月30日
	活期存款利息收入
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	161.09
其他	385.63
合计	10,712.25

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 2024年1月1日至2024年6月30日
股票投资收益——买卖股票差价收入	-811,273.29
股票投资收益——赎回差价收入	-6,498,572.04
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	-7,309,845.33

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 2024年1月1日至2024年6月30日
卖出股票成交总额	10,059,056.97
减：卖出股票成本总额	10,859,767.31
减：交易费用	10,562.95
买卖股票差价收入	-811,273.29

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 2024年1月1日至2024年6月30日
赎回基金份额对价总额	92,178,313.53
减：现金支付赎回款总额	558,806.53
减：赎回股票成本总额	98,118,079.04
减：交易费用	-
赎回差价收入	-6,498,572.04

6.4.7.14.4 股票投资收益——申购差价收入

无。

6.4.7.14.5 股票投资收益——证券出借差价收入

无。

6.4.7.15 债券投资收益

6.4.7.15.1 债券投资收益项目构成

无。

6.4.7.15.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

无。

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 2024年1月1日至2024年6月30日
股票投资产生的股利收益	2,001,028.65
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	2,001,028.65

6.4.7.20 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2024年1月1日至2024年6月30日
1. 交易性金融资产	-2,247,214.78
股票投资	-2,247,214.78
债券投资	-
资产支持证券投资	-
基金投资	-
贵金属投资	-
其他	-
2. 衍生工具	-
权证投资	-
3. 其他	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税	-
合计	-2,247,214.78

6.4.7.21 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年6月30日
基金赎回费收入	-
替代损益	4,168.70
合计	4,168.70

注：替代损益（如有）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	
	2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日	
审计费用	29,835.26	
信息披露费	59,672.34	
证券出借违约金	-	
银行划款手续费	320.00	
指数使用费	70,000.00	
合计	159,827.60	

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者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		上年度可比期间	
	2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日		2023 年 1 月 1 日至 2023 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	19,307,983.95	89.10	10,179,908.98	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 2024年1月1日至2024年6月 30日		上年度可比期间 2023年1月1日至2023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

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 2024年1月1日至2024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	1,931.20	46.61	1,191.35	100.00
关联方名称	上年度可比期间 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

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。

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 2024年1月1日至2024年6 月30日	上年度可比期间 2023年1月1日至2023 年6月30日
	当期发生的基金应支付的管理费	409,663.46

其中:应支付销售机构的客户维护费	3,362.12	-
应支付基金管理人的净管理费	406,301.34	262,569.95

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:

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

6.4.10.2.2 基金托管费

单位:人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年6 月30日	上年度可比期间 2023年1月1日至2023 年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	81,932.80	52,513.94

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:

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

6.4.10.2.3 销售服务费

无。

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

无。

6.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

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

无。

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

无。

6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

无。

6.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

无。

6.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位:人民币元

关联方名称	本期 2024年1月1日至2024年6月 30日		上年度可比期间 2023年1月1日至2023年6月30日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国农业银行	3,436,678.20	10,165.53	2,195,541.10	9,222.76

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

无。

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（2024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
001359	平安电工	2024年3月19日	6个月	新股锁定	17.39	20.60	113	1,965.07	2,327.80	-
001379	腾达科技	2024年1月11日	6个月	新股锁定	16.98	13.48	110	1,867.80	1,482.80	-
301392	汇成真空	2024年5月28日	6个月	新股锁定	12.20	41.66	219	2,671.80	9,123.54	-
301502	华阳智能	2024年1月26日	6个月	新股锁定	28.01	37.83	121	3,389.21	4,577.43	-
301536	星辰科	2024年3月20日	6个月	新股锁定	16.16	32.27	317	5,122.72	10,229.59	-

	技	日								
301538	骏鼎达	2024年3月13日	6个月	新股锁定	-	91.24	33	-	3,010.92	转增股
301538	骏鼎达	2024年3月13日	6个月	新股锁定	55.82	91.24	84	4,688.88	7,664.16	-
301539	宏鑫科技	2024年4月3日	6个月	新股锁定	10.64	19.82	350	3,724.00	6,937.00	-
301565	中仑新材	2024年6月13日	6个月	新股锁定	11.88	18.98	356	4,229.28	6,756.88	-
301566	达利凯普	2023年12月22日	6个月	新股锁定	8.90	16.97	444	3,951.60	7,534.68	-
301588	美新科技	2024年3月6日	6个月	新股锁定	14.50	21.25	257	3,726.50	5,461.25	-
301589	诺瓦星云	2024年2月1日	6个月	新股锁定	-	188.01	126	-	23,689.26	转增股
301589	诺瓦星云	2024年2月1日	6个月	新股锁定	126.89	188.01	158	20,048.62	29,705.58	-
301591	肯特股份	2024年2月20日	6个月	新股锁定	19.43	36.98	216	4,196.88	7,987.68	-

注：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中需要限售的部分或作为战略投资者参与配售获得的新股，在新股上市后的约定期限内不能自由转让；基金参与网上申购获配的新股，从新股获配日至新股上市日之间不能自由转让。

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

无。

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同责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息等情况，导致基金资产损失和收益变化的风险。

本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的银行存款存放在本基金的托管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，本基金无债券投资(上年度末：同)。

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，约定在非正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。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2024 年 6 月 30 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
货币资金	3,436,678.20	-	-	-	3,436,678.20
结算备付金	2.17	-	-	-	2.17
存出保证金	59,790.28	-	-	-	59,790.28
交易性金融资产	-	-	-	180,653,801.78	180,653,801.78
资产总计	3,496,470.65	-	-	180,653,801.78	184,150,272.43

负债					
应付管理人报酬	-	-	-	73,497.18	73,497.18
应付托管费	-	-	-	14,699.47	14,699.47
应付清算款	-	-	-	19,973.21	19,973.21
其他负债	-	-	-	125,698.95	125,698.95
负债总计	-	-	-	233,868.81	233,868.81
利率敏感度缺口	3,496,470.65	-	-	-180,419,932.97	183,916,403.62
上年度末 2023 年 12 月 31 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
货币资金	2,513,014.36	-	-	-	2,513,014.36
结算备付金	8,477.84	-	-	-	8,477.84
存出保证金	40,379.13	-	-	-	40,379.13
交易性金融资产	-	-	-	-157,064,193.71	157,064,193.71
应收清算款	-	-	-	111,573.01	111,573.01
资产总计	2,561,871.33	-	-	-157,175,766.72	159,737,638.05
负债					
应付管理人报酬	-	-	-	64,364.04	64,364.04
应付托管费	-	-	-	12,872.81	12,872.81
其他负债	-	-	-	167,624.11	167,624.11
负债总计	-	-	-	244,860.96	244,860.96
利率敏感度缺口	2,561,871.33	-	-	-156,930,905.76	159,492,777.09

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

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

于本期末，本基金未持有交易性债券投资（上年度末：同），因此市场利率的变动对于本基金净资产无重大影响（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 2024年6月30日		上年度末 2023年12月31日	
	公允价值	占基金资产净值 比例 (%)	公允价值	占基金资产净值 比例 (%)
交易性金融资产—股票投资	180,653,801.78	98.23	157,064,193.71	98.48
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	180,653,801.78	98.23	157,064,193.71	98.48

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（2024年6月30日）	上年度末（2023年12月31日）
	业绩比较基准上升 5%	9,023,851.91	7,796,924.60
业绩比较基准下降 5%	-9,023,851.91	-7,796,924.60	

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 2024 年 6 月 30 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
第一层次	180,527,313.21	156,913,993.72
第二层次	-	-
第三层次	126,488.57	150,199.99
合计	180,653,801.78	157,064,193.71

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

截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

§ 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	180,653,801.78	98.10
	其中：股票	180,653,801.78	98.10
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	3,436,680.37	1.87
8	其他各项资产	59,790.28	0.03
9	合计	184,150,272.43	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	4,576,208.10	2.49
B	采矿业	3,194,727.43	1.74
C	制造业	135,704,052.36	73.79
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	2,855,200.00	1.55
E	建筑业	272,171.89	0.15
F	批发和零售业	1,512,953.15	0.82
G	交通运输、仓储和邮政业	2,657,180.34	1.44
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	9,463,731.47	5.15
J	金融业	12,215,752.18	6.64
K	房地产业	1,795,488.79	0.98
L	租赁和商务服务业	1,924,771.26	1.05
M	科学研究和技术服务业	1,385,784.00	0.75
N	水利、环境和公	421,604.26	0.23

	共设施管理业		
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	137,241.00	0.07
Q	卫生和社会工作	1,268,522.80	0.69
R	文化、体育和娱乐业	1,137,848.47	0.62
S	综合	-	-
	合计	180,523,237.50	98.16

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	130,564.28	0.07
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	-	-
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	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	130,564.28	0.07

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	48,180	8,673,845.40	4.72
2	000333	美的集团	91,207	5,882,851.50	3.20
3	000858	五粮液	34,200	4,378,968.00	2.38
4	002594	比亚迪	16,000	4,004,000.00	2.18
5	002475	立讯精密	86,446	3,398,192.26	1.85
6	000651	格力电器	83,500	3,274,870.00	1.78
7	300760	迈瑞医疗	10,000	2,909,100.00	1.58
8	300059	东方财富	234,738	2,478,833.28	1.35
9	000725	京东方 A	596,400	2,439,276.00	1.33
10	300308	中际旭创	16,328	2,251,304.64	1.22
11	002415	海康威视	70,950	2,193,064.50	1.19
12	002714	牧原股份	46,906	2,045,101.60	1.11
13	000568	泸州老窖	14,100	2,023,209.00	1.10
14	300498	温氏股份	101,705	2,015,793.10	1.10
15	300124	汇川技术	36,291	1,861,728.30	1.01
16	002371	北方华创	5,300	1,695,417.00	0.92
17	000063	中兴通讯	59,900	1,675,403.00	0.91
18	300274	阳光电源	26,812	1,663,148.36	0.90
19	000001	平安银行	159,200	1,615,880.00	0.88
20	000338	潍柴动力	95,500	1,550,920.00	0.84
21	002230	科大讯飞	34,875	1,497,881.25	0.81
22	002352	顺丰控股	41,500	1,481,135.00	0.81
23	000100	TCL 科技	341,440	1,475,020.80	0.80
24	002142	宁波银行	64,317	1,418,833.02	0.77
25	000792	盐湖股份	72,800	1,270,360.00	0.69
26	300502	新易盛	11,761	1,241,373.55	0.67
27	002027	分众传媒	189,888	1,150,721.28	0.63
28	000625	长安汽车	80,714	1,083,989.02	0.59
29	000425	徐工机械	144,000	1,029,600.00	0.56
30	300014	亿纬锂能	23,731	947,341.52	0.52
31	002463	沪电股份	25,250	921,625.00	0.50
32	002304	洋河股份	11,262	909,293.88	0.49
33	002241	歌尔股份	45,900	895,509.00	0.49
34	300015	爱尔眼科	81,074	836,683.68	0.45
35	000002	万科 A	115,400	799,722.00	0.43

36	002179	中航光电	20,924	796,158.20	0.43
37	002050	三花智控	38,800	740,304.00	0.40
38	000538	云南白药	14,460	739,629.00	0.40
39	000938	紫光股份	32,747	731,895.45	0.40
40	002028	思源电气	10,700	715,830.00	0.39
41	000166	申万宏源	165,960	715,287.60	0.39
42	000977	浪潮信息	19,553	711,142.61	0.39
43	300408	三环集团	23,700	691,803.00	0.38
44	002311	海大集团	14,680	690,694.00	0.38
45	002252	上海莱士	87,220	682,060.40	0.37
46	300433	蓝思科技	36,459	665,376.75	0.36
47	002422	科伦药业	21,900	664,227.00	0.36
48	000776	广发证券	53,300	648,661.00	0.35
49	000157	中联重科	84,200	646,656.00	0.35
50	002049	紫光国微	12,280	645,928.00	0.35
51	003816	中国广核	131,300	607,919.00	0.33
52	300122	智飞生物	21,350	598,440.50	0.33
53	002460	赣锋锂业	20,790	595,633.50	0.32
54	000933	神火股份	29,000	586,670.00	0.32
55	000768	中航西飞	24,400	586,332.00	0.32
56	002648	卫星化学	32,562	585,464.76	0.32
57	002466	天齐锂业	19,400	580,254.00	0.32
58	002340	格林美	90,820	578,523.40	0.31
59	000596	古井贡酒	2,700	569,889.00	0.31
60	001979	招商蛇口	64,501	566,963.79	0.31
61	002001	新和成	29,017	557,126.40	0.30
62	002236	大华股份	35,300	545,738.00	0.30
63	002601	龙佰集团	29,300	544,101.00	0.30
64	002493	荣盛石化	56,125	542,167.50	0.29
65	000423	东阿阿胶	8,500	532,100.00	0.29
66	000807	云铝股份	39,200	529,592.00	0.29
67	000661	长春高新	5,760	528,595.20	0.29
68	300394	天孚通信	5,800	512,836.00	0.28
69	000786	北新建材	17,200	510,152.00	0.28
70	300418	昆仑万维	15,700	506,168.00	0.28
71	000975	山金国际	30,977	504,615.33	0.27
72	002384	东山精密	23,900	494,730.00	0.27
73	300782	卓胜微	6,353	493,882.22	0.27
74	300347	泰格医药	10,050	488,430.00	0.27
75	000983	山西焦煤	47,310	487,766.10	0.27
76	002129	TCL 中环	55,250	477,912.50	0.26
77	000895	双汇发展	20,100	477,777.00	0.26
78	002938	鹏鼎控股	12,000	477,120.00	0.26

79	000988	华工科技	15,900	475,887.00	0.26
80	300661	圣邦股份	5,722	473,667.16	0.26
81	000630	铜陵有色	130,300	470,383.00	0.26
82	002180	纳思达	17,600	464,992.00	0.25
83	002156	通富微电	20,400	456,756.00	0.25
84	002271	东方雨虹	36,953	456,000.02	0.25
85	300896	爱美客	2,640	454,344.00	0.25
86	002625	光启技术	26,040	451,794.00	0.25
87	002736	国信证券	51,500	447,535.00	0.24
88	002966	苏州银行	57,200	429,000.00	0.23
89	002223	鱼跃医疗	11,230	422,248.00	0.23
90	000400	许继电气	12,200	419,802.00	0.23
91	002920	德赛西威	4,800	418,032.00	0.23
92	002456	欧菲光	53,300	416,273.00	0.23
93	002078	太阳纸业	29,600	412,920.00	0.22
94	300832	新产业	6,100	411,384.00	0.22
95	000963	华东医药	14,295	397,543.95	0.22
96	002353	杰瑞股份	11,300	396,404.00	0.22
97	002709	天赐材料	22,492	394,959.52	0.21
98	300207	欣旺达	26,000	394,420.00	0.21
99	002185	华天科技	48,374	394,248.10	0.21
100	300033	同花顺	3,800	394,060.00	0.21
101	300573	兴齐眼药	2,400	393,600.00	0.21
102	002074	国轩高科	20,390	390,468.50	0.21
103	002128	电投能源	18,500	390,350.00	0.21
104	002532	天山铝业	48,100	390,091.00	0.21
105	000999	华润三九	9,097	387,350.26	0.21
106	002273	水晶光电	22,614	383,985.72	0.21
107	002459	晶澳科技	33,932	380,038.40	0.21
108	002916	深南电路	3,584	379,079.68	0.21
109	002600	领益智造	53,000	377,360.00	0.21
110	301236	软通动力	10,650	374,986.50	0.20
111	002602	世纪华通	109,209	374,586.87	0.20
112	000301	东方盛虹	46,700	372,199.00	0.20
113	000876	新希望	40,100	366,514.00	0.20
114	002797	第一创业	71,620	364,545.80	0.20
115	002465	海格通信	35,100	363,636.00	0.20
116	002555	三七互娱	27,600	360,180.00	0.20
117	002138	顺络电子	13,000	356,980.00	0.19
118	300476	胜宏科技	11,000	354,860.00	0.19
119	300142	沃森生物	30,600	348,228.00	0.19
120	300003	乐普医疗	23,026	341,705.84	0.19
121	002281	光迅科技	9,100	340,067.00	0.18

122	000408	藏格矿业	14,100	339,387.00	0.18
123	001965	招商公路	28,500	338,010.00	0.18
124	000932	华菱钢铁	75,860	336,059.80	0.18
125	300316	晶盛机电	11,580	332,693.40	0.18
126	000831	中国稀土	13,100	332,085.00	0.18
127	000683	远兴能源	48,000	331,680.00	0.18
128	002202	金风科技	49,136	330,193.92	0.18
129	000878	云南铜业	26,500	330,190.00	0.18
130	000066	中国长城	37,704	329,910.00	0.18
131	300751	迈为股份	2,744	327,853.12	0.18
132	002409	雅克科技	5,200	327,132.00	0.18
133	300759	康龙化成	17,450	324,221.00	0.18
134	002738	中矿资源	12,080	323,744.00	0.18
135	002444	巨星科技	13,100	323,570.00	0.18
136	002008	大族激光	15,500	322,400.00	0.18
137	000039	中集集团	34,740	321,692.40	0.17
138	002517	恺英网络	33,500	319,925.00	0.17
139	300628	亿联网络	8,590	315,854.30	0.17
140	000733	振华科技	7,500	311,475.00	0.17
141	000426	兴业银锡	22,800	309,624.00	0.17
142	000528	柳工	27,580	308,620.20	0.17
143	300450	先导智能	18,400	305,992.00	0.17
144	300017	网宿科技	38,452	303,770.80	0.17
145	000728	国元证券	49,950	302,697.00	0.16
146	002007	华兰生物	19,160	302,536.40	0.16
147	300496	中科创达	6,600	300,894.00	0.16
148	300136	信维通信	15,220	298,007.60	0.16
149	300339	润和软件	14,400	297,648.00	0.16
150	002595	豪迈科技	7,700	293,909.00	0.16
151	300223	北京君正	5,300	293,832.00	0.16
152	002812	恩捷股份	9,270	293,395.50	0.16
153	300054	鼎龙股份	12,900	292,572.00	0.16
154	002436	兴森科技	28,100	289,992.00	0.16
155	300999	金龙鱼	10,600	289,910.00	0.16
156	002085	万丰奥威	21,656	286,725.44	0.16
157	002673	西部证券	46,166	285,767.54	0.16
158	300866	安克创新	3,980	283,415.80	0.15
159	300002	神州泰岳	34,700	281,764.00	0.15
160	300474	景嘉微	4,450	281,373.50	0.15
161	000960	锡业股份	18,121	280,694.29	0.15
162	002739	万达电影	23,100	279,279.00	0.15
163	002155	湖南黄金	15,300	276,930.00	0.15
164	000783	长江证券	57,300	276,759.00	0.15

165	000021	深科技	18,266	276,181.92	0.15
166	002318	久立特材	11,800	275,294.00	0.15
167	002472	双环传动	12,400	273,048.00	0.15
168	002821	凯莱英	4,140	272,412.00	0.15
169	300001	特锐德	13,500	271,620.00	0.15
170	300012	华测检测	26,400	265,584.00	0.14
171	000703	恒逸石化	37,166	263,506.94	0.14
172	000513	丽珠集团	7,067	262,963.07	0.14
173	300285	国瓷材料	14,700	262,395.00	0.14
174	301269	华大九天	3,400	261,970.00	0.14
175	300073	当升科技	7,600	260,756.00	0.14
176	000617	中油资本	47,020	259,550.40	0.14
177	000738	航发控制	12,900	258,903.00	0.14
178	300037	新宙邦	9,060	258,753.60	0.14
179	000009	中国宝安	29,872	256,899.20	0.14
180	002405	四维图新	41,050	255,331.00	0.14
181	300724	捷佳伟创	4,700	253,847.00	0.14
182	002152	广电运通	24,250	253,655.00	0.14
183	300058	蓝色光标	46,519	253,063.36	0.14
184	002850	科达利	3,300	252,054.00	0.14
185	300146	汤臣倍健	18,600	252,030.00	0.14
186	002410	广联达	25,880	247,930.40	0.13
187	002195	岩山科技	98,664	247,646.64	0.13
188	000723	美锦能源	51,700	246,092.00	0.13
189	000766	通化金马	15,200	246,088.00	0.13
190	300395	菲利华	8,000	246,000.00	0.13
191	300919	中伟股份	7,920	245,440.80	0.13
192	300699	光威复材	9,884	245,419.72	0.13
193	300346	南大光电	8,580	245,302.20	0.13
194	300413	芒果超媒	11,730	245,157.00	0.13
195	000921	海信家电	7,600	245,024.00	0.13
196	002984	森麒麟	10,160	244,754.40	0.13
197	002025	航天电器	5,270	244,422.60	0.13
198	300114	中航电测	5,400	244,350.00	0.13
199	002294	信立泰	9,100	242,333.00	0.13
200	002262	恩华药业	10,200	242,148.00	0.13
201	300144	宋城演艺	30,051	241,309.53	0.13
202	002407	多氟多	19,720	241,175.60	0.13
203	300364	中文在线	11,000	237,380.00	0.13
204	301358	湖南裕能	7,500	235,950.00	0.13
205	000591	太阳能	49,800	234,558.00	0.13
206	002176	江特电机	28,600	233,090.00	0.13
207	000519	中兵红箭	15,700	230,319.00	0.13

208	002064	华峰化学	32,100	230,157.00	0.13
209	002385	大北农	59,650	229,652.50	0.12
210	000403	派林生物	8,600	229,276.00	0.12
211	000750	国海证券	78,365	228,042.15	0.12
212	300454	深信服	4,500	227,385.00	0.12
213	300251	光线传媒	26,980	226,901.80	0.12
214	000623	吉林敖东	16,920	226,728.00	0.12
215	002603	以岭药业	14,724	225,718.92	0.12
216	300529	健帆生物	8,280	225,298.80	0.12
217	002558	巨人网络	23,700	223,728.00	0.12
218	002439	启明星辰	12,900	222,654.00	0.12
219	000830	鲁西化工	19,000	220,210.00	0.12
220	300383	光环新网	25,800	218,010.00	0.12
221	000708	中信特钢	15,990	216,984.30	0.12
222	300677	英科医疗	8,080	216,624.80	0.12
223	000818	航锦科技	9,800	216,384.00	0.12
224	002958	青农商行	80,300	215,204.00	0.12
225	300373	扬杰科技	5,500	213,950.00	0.12
226	002756	永兴材料	5,970	213,606.60	0.12
227	300024	机器人	21,766	212,000.84	0.12
228	002044	美年健康	54,904	207,537.12	0.11
229	300604	长川科技	7,600	206,492.00	0.11
230	300567	精测电子	3,650	206,261.50	0.11
231	000034	神州数码	8,900	203,721.00	0.11
232	000629	钒钛股份	81,100	202,750.00	0.11
233	300118	东方日升	16,700	202,070.00	0.11
234	300458	全志科技	8,564	201,339.64	0.11
235	000883	湖北能源	33,200	199,532.00	0.11
236	300775	三角防务	6,500	198,900.00	0.11
237	000060	中金岭南	46,900	198,856.00	0.11
238	002841	视源股份	6,720	198,441.60	0.11
239	000729	燕京啤酒	22,400	197,792.00	0.11
240	300679	电连技术	4,900	197,127.00	0.11
241	300442	润泽科技	8,200	196,390.00	0.11
242	300253	卫宁健康	33,247	196,157.30	0.11
243	002430	杭氧股份	8,800	195,800.00	0.11
244	002429	兆驰股份	40,700	195,767.00	0.11
245	000997	新大陆	14,050	195,435.50	0.11
246	300487	蓝晓科技	4,650	194,184.00	0.11
247	300294	博雅生物	5,850	193,050.00	0.10
248	000799	酒鬼酒	4,400	193,028.00	0.10
249	002508	老板电器	8,690	192,049.00	0.10
250	000875	吉电股份	36,000	191,880.00	0.10

251	002120	韵达股份	24,629	190,628.46	0.10
252	300390	天华新能	11,080	190,354.40	0.10
253	300633	开立医疗	4,800	189,984.00	0.10
254	000636	风华高科	14,500	189,370.00	0.10
255	002056	横店东磁	15,100	188,297.00	0.10
256	300568	星源材质	22,842	187,304.40	0.10
257	000887	中鼎股份	15,300	187,272.00	0.10
258	000998	隆平高科	18,900	185,787.00	0.10
259	002831	裕同科技	7,220	184,759.80	0.10
260	000598	兴蓉环境	24,500	184,240.00	0.10
261	002837	英维克	8,500	181,815.00	0.10
262	002372	伟星新材	11,740	181,030.80	0.10
263	002926	华西证券	27,400	180,566.00	0.10
264	002624	完美世界	23,750	180,500.00	0.10
265	300088	长信科技	38,400	180,480.00	0.10
266	300601	康泰生物	11,560	180,451.60	0.10
267	002065	东华软件	39,700	179,444.00	0.10
268	300009	安科生物	20,986	179,220.44	0.10
269	300765	新诺威	7,100	179,133.00	0.10
270	002414	高德红外	30,401	179,061.89	0.10
271	002851	麦格米特	6,900	178,296.00	0.10
272	300115	长盈精密	14,836	177,883.64	0.10
273	002151	北斗星通	7,350	177,723.00	0.10
274	002936	郑州银行	102,546	177,404.58	0.10
275	002373	千方科技	19,500	176,865.00	0.10
276	300763	锦浪科技	4,240	176,553.60	0.10
277	300979	华利集团	2,900	176,465.00	0.10
278	000690	宝新能源	34,600	176,460.00	0.10
279	002507	涪陵榨菜	14,270	174,807.50	0.10
280	000422	湖北宜化	14,600	174,032.00	0.09
281	002497	雅化集团	19,300	172,156.00	0.09
282	002240	盛新锂能	12,800	171,776.00	0.09
283	002368	太极股份	7,611	171,628.05	0.09
284	002487	大金重工	7,500	171,600.00	0.09
285	300296	利亚德	38,050	171,225.00	0.09
286	300459	汤姆猫	50,480	171,127.20	0.09
287	300803	指南针	4,700	171,127.00	0.09
288	002500	山西证券	36,380	170,986.00	0.09
289	301308	江波龙	1,800	170,532.00	0.09
290	000543	皖能电力	19,200	169,920.00	0.09
291	000027	深圳能源	23,240	169,652.00	0.09
292	002019	亿帆医药	13,700	169,332.00	0.09
293	002683	广东宏大	8,400	169,092.00	0.09

294	002080	中材科技	13,080	168,732.00	0.09
295	002203	海亮股份	21,100	168,378.00	0.09
296	002568	百润股份	9,948	167,424.84	0.09
297	002389	航天彩虹	12,000	166,680.00	0.09
298	002939	长城证券	24,800	166,160.00	0.09
299	001286	陕西能源	14,400	166,032.00	0.09
300	002145	中核钛白	50,265	164,869.20	0.09
301	000893	亚钾国际	10,200	164,832.00	0.09
302	000155	川能动力	15,200	163,704.00	0.09
303	002402	和而泰	15,100	161,721.00	0.09
304	300666	江丰电子	3,400	161,704.00	0.09
305	000951	中国重汽	11,260	161,243.20	0.09
306	000581	威孚高科	9,900	161,172.00	0.09
307	000778	新兴铸管	46,300	161,124.00	0.09
308	002572	索菲亚	10,508	161,087.64	0.09
309	002557	洽洽食品	5,700	160,683.00	0.09
310	300070	碧水源	38,114	159,697.66	0.09
311	000050	深天马 A	21,700	157,976.00	0.09
312	002506	协鑫集成	80,800	156,752.00	0.09
313	300558	贝达药业	4,800	156,240.00	0.08
314	002299	圣农发展	11,400	155,496.00	0.08
315	002131	利欧股份	108,534	155,203.62	0.08
316	000563	陕国投 A	56,300	154,825.00	0.08
317	301301	川宁生物	12,100	154,638.00	0.08
318	300676	华大基因	4,400	154,044.00	0.08
319	002531	天顺风能	17,200	153,768.00	0.08
320	300182	捷成股份	41,234	152,978.14	0.08
321	002268	电科网安	10,660	151,691.80	0.08
322	300735	光弘科技	7,000	151,200.00	0.08
323	000739	普洛药业	11,100	150,627.00	0.08
324	002221	东华能源	18,300	150,243.00	0.08
325	002832	比音勒芬	6,200	149,854.00	0.08
326	300212	易华录	8,900	149,787.00	0.08
327	300456	赛微电子	9,300	147,591.00	0.08
328	300298	三诺生物	5,800	146,972.00	0.08
329	000762	西藏矿业	8,100	146,448.00	0.08
330	300748	金力永磁	11,296	146,396.16	0.08
331	300638	广和通	8,560	146,376.00	0.08
332	000686	东北证券	26,220	146,307.60	0.08
333	002244	滨江集团	20,000	145,200.00	0.08
334	300595	欧普康视	9,240	144,883.20	0.08
335	002653	海思科	4,700	144,290.00	0.08
336	002317	众生药业	12,600	144,018.00	0.08

337	002249	大洋电机	30,400	143,792.00	0.08
338	000547	航天发展	24,400	142,984.00	0.08
339	002675	东诚药业	11,600	142,216.00	0.08
340	300475	香农芯创	4,800	141,936.00	0.08
341	300777	中简科技	6,600	141,900.00	0.08
342	002745	木林森	17,600	141,856.00	0.08
343	000709	河钢股份	73,000	141,620.00	0.08
344	000877	天山股份	26,200	141,480.00	0.08
345	300034	钢研高纳	8,900	141,421.00	0.08
346	002245	蔚蓝锂芯	18,200	141,050.00	0.08
347	002747	埃斯顿	9,900	140,778.00	0.08
348	000035	中国天楹	31,000	140,430.00	0.08
349	000069	华侨城 A	68,800	140,352.00	0.08
350	300229	拓尔思	10,400	139,672.00	0.08
351	002701	奥瑞金	33,400	138,944.00	0.08
352	000825	太钢不锈	40,800	137,904.00	0.07
353	300672	国科微	2,600	137,384.00	0.07
354	000970	中科三环	17,945	137,279.25	0.07
355	002607	中公教育	89,700	137,241.00	0.07
356	002617	露笑科技	28,400	136,320.00	0.07
357	002773	康弘药业	6,260	135,529.00	0.07
358	002698	博实股份	11,000	134,970.00	0.07
359	002312	川发龙蟒	19,900	133,927.00	0.07
360	002408	齐翔腾达	23,580	132,048.00	0.07
361	002015	协鑫能科	16,500	131,340.00	0.07
362	000937	冀中能源	19,590	131,253.00	0.07
363	002032	苏泊尔	2,600	130,260.00	0.07
364	000902	新洋丰	10,902	129,406.74	0.07
365	300623	捷捷微电	7,450	128,885.00	0.07
366	001227	兰州银行	53,900	128,282.00	0.07
367	002484	江海股份	9,500	125,875.00	0.07
368	300438	鹏辉能源	6,800	124,712.00	0.07
369	003031	中瓷电子	2,660	122,998.40	0.07
370	002948	青岛银行	36,310	122,364.70	0.07
371	002266	浙富控股	43,540	121,476.60	0.07
372	002597	金禾实业	6,100	121,329.00	0.07
373	002091	江苏国泰	17,800	121,218.00	0.07
374	002237	恒邦股份	10,500	120,855.00	0.07
375	300957	贝泰妮	2,500	120,800.00	0.07
376	300026	红日药业	39,200	119,560.00	0.07
377	300773	拉卡拉	9,600	119,328.00	0.06
378	002541	鸿路钢构	7,030	119,299.10	0.06
379	300761	立华股份	5,260	119,086.40	0.06

380	300482	万孚生物	4,880	119,072.00	0.06
381	000800	一汽解放	15,200	119,016.00	0.06
382	300457	赢合科技	6,650	118,569.50	0.06
383	000032	深桑达 A	7,900	118,342.00	0.06
384	300910	瑞丰新材	2,700	118,044.00	0.06
385	000012	南玻 A	23,239	117,124.56	0.06
386	300776	帝尔激光	2,540	116,738.40	0.06
387	301050	雷电微力	2,400	115,584.00	0.06
388	002192	融捷股份	3,800	114,076.00	0.06
389	002048	宁波华翔	8,800	113,872.00	0.06
390	300674	宇信科技	10,180	112,794.40	0.06
391	300769	德方纳米	3,992	112,574.40	0.06
392	002396	星网锐捷	8,400	110,964.00	0.06
393	000089	深圳机场	17,300	110,547.00	0.06
394	002906	华阳集团	4,100	109,716.00	0.06
395	000156	华数传媒	17,400	109,272.00	0.06
396	300244	迪安诊断	8,872	106,464.00	0.06
397	000028	国药一致	3,290	106,036.70	0.06
398	300357	我武生物	5,240	105,952.80	0.06
399	002423	中粮资本	13,900	104,111.00	0.06
400	002643	万润股份	10,400	104,000.00	0.06
401	000987	越秀资本	20,935	103,837.60	0.06
402	000559	万向钱潮	23,228	103,596.88	0.06
403	002212	天融信	21,200	103,244.00	0.06
404	300747	锐科激光	5,812	103,163.00	0.06
405	002865	钧达股份	2,679	102,820.02	0.06
406	002867	周大生	7,800	101,868.00	0.06
407	000429	粤高速 A	9,600	99,936.00	0.05
408	002468	申通快递	11,700	98,280.00	0.05
409	301039	中集车辆	11,400	98,040.00	0.05
410	002326	永太科技	12,500	97,750.00	0.05
411	002690	美亚光电	5,900	97,350.00	0.05
412	002099	海翔药业	19,000	97,090.00	0.05
413	000555	神州信息	10,400	96,928.00	0.05
414	002254	泰和新材	10,800	95,580.00	0.05
415	000785	居然之家	39,300	95,499.00	0.05
416	002183	怡亚通	33,200	94,288.00	0.05
417	002030	达安基因	18,765	93,825.00	0.05
418	002727	一心堂	6,200	93,558.00	0.05
419	000552	甘肃能化	26,800	92,996.00	0.05
420	002608	江苏国信	11,700	90,675.00	0.05
421	300888	稳健医疗	3,580	90,574.00	0.05
422	002670	国盛金控	10,593	89,722.71	0.05

423	300682	朗新集团	10,500	89,355.00	0.05
424	300432	富临精工	13,700	88,228.00	0.05
425	000927	中国铁物	37,000	88,060.00	0.05
426	002010	传化智联	22,900	87,936.00	0.05
427	003035	南网能源	19,900	87,560.00	0.05
428	000958	电投产融	23,800	87,108.00	0.05
429	000898	鞍钢股份	40,952	86,818.24	0.05
430	300171	东富龙	7,300	86,797.00	0.05
431	000810	创维数字	10,100	86,658.00	0.05
432	002153	石基信息	15,112	86,591.76	0.05
433	002511	中顺洁柔	12,300	85,116.00	0.05
434	001872	招商港口	4,400	84,700.00	0.05
435	000967	盈峰环境	19,800	83,754.00	0.05
436	000537	中绿电	8,700	82,911.00	0.05
437	301219	腾远钴业	2,150	82,259.00	0.04
438	003022	联泓新科	5,990	82,122.90	0.04
439	000539	粤电力 A	15,900	80,772.00	0.04
440	000930	中粮科技	16,000	80,480.00	0.04
441	002563	森马服饰	13,800	80,178.00	0.04
442	301035	润丰股份	1,800	80,172.00	0.04
443	002081	金螳螂	26,163	79,273.89	0.04
444	001914	招商积余	7,800	78,156.00	0.04
445	002518	科士达	4,400	77,880.00	0.04
446	300376	ST 易事特	19,400	77,794.00	0.04
447	000401	冀东水泥	19,100	77,546.00	0.04
448	002705	新宝股份	5,500	77,385.00	0.04
449	001203	大中矿业	7,900	75,919.00	0.04
450	300363	博腾股份	6,300	75,285.00	0.04
451	300257	开山股份	7,400	74,740.00	0.04
452	002060	广东建工	21,800	74,556.00	0.04
453	001287	中电港	4,500	74,385.00	0.04
454	300428	立中集团	4,000	74,360.00	0.04
455	000966	长源电力	16,700	73,647.00	0.04
456	002985	北摩高科	3,330	73,359.90	0.04
457	002498	汉缆股份	21,700	71,393.00	0.04
458	301095	广立微	1,700	69,904.00	0.04
459	000959	首钢股份	25,500	69,360.00	0.04
460	000582	北部湾港	9,300	69,192.00	0.04
461	301155	海力风电	1,700	68,391.00	0.04
462	301267	华夏眼科	3,300	68,376.00	0.04
463	002216	三全食品	6,120	67,197.60	0.04
464	301047	义翘神州	1,100	65,945.00	0.04
465	000402	金融街	27,700	65,095.00	0.04

466	000088	盐田港	14,300	64,779.00	0.04
467	002925	盈趣科技	5,080	64,363.60	0.03
468	301029	怡合达	3,212	63,147.92	0.03
469	301238	瑞泰新材	4,200	62,874.00	0.03
470	002320	海峡股份	11,768	60,722.88	0.03
471	002791	坚朗五金	2,300	59,501.00	0.03
472	001213	中铁特货	15,000	59,250.00	0.03
473	002110	三钢闽光	19,850	58,557.50	0.03
474	300861	美畅股份	2,980	57,663.00	0.03
475	300726	宏达电子	2,500	57,000.00	0.03
476	000627	天茂集团	32,500	56,875.00	0.03
477	000935	四川双马	4,700	56,447.00	0.03
478	300850	新强联	3,700	55,574.00	0.03
479	002041	登海种业	6,800	54,944.00	0.03
480	301015	百洋医药	2,300	54,119.00	0.03
481	000062	深圳华强	6,005	53,444.50	0.03
482	002945	华林证券	5,300	52,894.00	0.03
483	000567	海德股份	9,400	52,734.00	0.03
484	000688	国城矿业	5,400	51,408.00	0.03
485	002461	珠江啤酒	6,900	51,198.00	0.03
486	301207	华兰疫苗	2,800	49,476.00	0.03
487	301239	普瑞眼科	1,400	49,462.00	0.03
488	000869	张裕 A	2,200	46,970.00	0.03
489	300821	东岳硅材	6,700	45,828.00	0.02
490	001289	龙源电力	2,600	44,850.00	0.02
491	301498	乖宝宠物	800	43,040.00	0.02
492	301268	铭利达	2,700	41,985.00	0.02
493	301165	锐捷网络	1,400	41,776.00	0.02
494	002978	安宁股份	1,400	39,004.00	0.02
495	001308	康冠科技	1,580	35,550.00	0.02
496	002901	大博医疗	1,300	33,579.00	0.02
497	300140	节能环境	5,400	32,238.00	0.02
498	301487	盟固利	1,200	31,032.00	0.02
499	001322	箭牌家居	3,300	24,123.00	0.01
500	301177	迪阿股份	800	14,880.00	0.01

7.3.2 期末积极投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量 (股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例 (%)
1	301589	诺瓦星云	284	53,394.84	0.03
2	301538	骏鼎达	117	10,675.08	0.01
3	301536	星辰科技	317	10,229.59	0.01
4	301392	汇成真空	219	9,123.54	0.00

5	301591	肯特股份	216	7,987.68	0.00
6	301566	达利凯普	444	7,534.68	0.00
7	301539	宏鑫科技	350	6,937.00	0.00
8	301565	中仑新材	356	6,756.88	0.00
9	301588	美新科技	257	5,461.25	0.00
10	301502	华阳智能	121	4,577.43	0.00
11	301578	辰奕智能	103	4,075.71	0.00
12	001359	平安电工	113	2,327.80	0.00
13	001379	腾达科技	110	1,482.80	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	300750	宁德时代	511,293.00	0.32
2	300339	润和软件	298,333.00	0.19
3	000766	通化金马	257,145.00	0.16
4	002594	比亚迪	246,152.00	0.15
5	000596	古井贡酒	226,523.00	0.14
6	300896	爱美客	222,491.00	0.14
7	301358	湖南裕能	219,800.00	0.14
8	300364	中文在线	207,023.00	0.13
9	300760	迈瑞医疗	200,247.00	0.13
10	002837	英维克	196,490.00	0.12
11	002240	盛新锂能	179,405.00	0.11
12	300475	香农芯创	155,957.00	0.10
13	000543	皖能电力	154,965.00	0.10
14	300751	迈为股份	145,206.00	0.09
15	300735	光弘科技	143,545.00	0.09
16	300573	兴齐眼药	139,059.00	0.09
17	002850	科达利	138,427.00	0.09
18	001965	招商公路	120,991.00	0.08
19	001979	招商蛇口	104,990.00	0.07
20	301301	川宁生物	98,601.00	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	300760	迈瑞医疗	291,387.00	0.18
2	002594	比亚迪	226,827.00	0.14
3	000333	美的集团	158,909.00	0.10

4	300308	中际旭创	149,615.00	0.09
5	301591	肯特股份	147,035.30	0.09
6	301565	中仑新材	146,235.00	0.09
7	301392	汇成真空	139,673.00	0.09
8	002371	北方华创	137,686.00	0.09
9	301539	宏鑫科技	124,843.60	0.08
10	002092	ST 中泰	123,143.00	0.08
11	301536	星宸科技	121,763.20	0.08
12	300033	同花顺	120,504.00	0.08
13	002706	良信股份	116,525.00	0.07
14	002352	顺丰控股	103,781.00	0.07
15	300896	爱美客	100,511.00	0.06
16	000596	古井贡酒	96,323.00	0.06
17	002916	深南电路	94,257.00	0.06
18	002821	凯莱英	92,201.00	0.06
19	301588	美新科技	86,009.98	0.05
20	300059	东方财富	85,929.00	0.05

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	12,007,266.07
卖出股票收入（成交）总额	10,059,056.97

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。

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

无。

7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

无。

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

无。

7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

无。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

无。

7.10 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	59,790.28
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	59,790.28

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	301589	诺瓦星云	53,394.84	0.03	新股锁定
2	301538	骏鼎达	10,675.08	0.01	新股锁定

3	301536	星宸科技	10,229.59	0.01	新股锁定
4	301392	汇成真空	9,123.54	0.00	新股锁定
5	301591	肯特股份	7,987.68	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 (%)
6,681	29,521.02	24,480,981.00	12.41	172,748,941.00	87.59

注：持有人户数为有效户数，即存量份额大于零的账户数。

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	周初春	6,718,500.00	3.41
2	深圳前海信诚中富基金管理有限公司一信诚檀青10号私募证券投资基金	4,383,135.00	2.22
3	广发证券股份有限公司	4,336,711.00	2.20
4	深圳前海信诚中富基金管理有限公司一信诚檀青8号私募证券投资基金	3,969,700.00	2.01
5	宁波安联国际集装箱储运有限公司	2,361,700.00	1.20
6	李长柱	2,181,738.00	1.11
7	中信建投证券股份有限公司	2,058,282.00	1.04
8	华泰证券股份有限公司	1,947,965.00	0.99
9	刘小彦	1,551,750.00	0.79
10	深圳前海信诚中富基金管理有限公司一信诚檀青12号私募证券投资基金	1,363,500.00	0.69

注：以上数据由中国证券登记结算有限公司提供，持有人为场内持有人。

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

无。

8.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

项目	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	0
本基金基金经理持有本开放式基金	0

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2015年6月5日） 基金份额总额	2,384,588,069.00
本报告期期初基金份额总额	161,229,922.00
本报告期基金总申购份额	132,000,000.00
减：本报告期基金总赎回份额	96,000,000.00
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期末基金份额总额	197,229,922.00

§ 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

无。

二、基金托管人的基金托管部门的重大人事变动

无。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内无涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

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	19,307,983.95	89.10	1,931.20	46.61	-
华泰证券	1	2,276,683.48	10.51	2,130.90	51.43	-
天风证券	2	86,559.81	0.40	81.01	1.96	-
爱建证券	1	-	-	-	-	-
财通证券	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	-	-	-	-	-
高盛中国 证券	1	-	-	-	-	-
广发证券	2	-	-	-	-	本期 报告 新增 1个
国金证券	2	-	-	-	-	-
国盛证券	1	-	-	-	-	-

国泰君安	3	-	-	-	-	-
国投证券	1	-	-	-	-	-
国信证券	1	-	-	-	-	-
海通证券	1	-	-	-	-	-
红塔证券	1	-	-	-	-	-
华创证券	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	0	-	-	-	-	本期 报告 退租 1 个
万和证券	1	-	-	-	-	-
西部证券	1	-	-	-	-	-
湘财证券	0	-	-	-	-	本期 报告 退租 1 个
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：本基金采用托管人结算模式，本基金管理人负责选择证券经纪商，租用其交易单元作为本基金的交易单元。证券经纪商的选择标准如下：

（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) 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。

租用交易单元的使用流程为：首先根据证券经纪商选择标准形成《券商服务评价表》，然后根据评分高低进行本基金交易单元选择。

10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

无。

10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	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	2024年6月28日
2	大成基金管理有限公司关于提请投资者及时更新已过期身份证件及其他身份基本信息的公告	中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站	2024年6月28日
3	大成深证成份交易型开放式指数证券投资基金更新招募说明书	中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站	2024年6月26日
4	大成基金管理有限公司关于旗下部分基金调整清算交收条款并修订招募说明书的公告	中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站	2024年6月26日
5	大成基金管理有限公司关于暂停海银基金销售有限公司办理相关销售业务的公告	中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站	2024年6月12日
6	大成深证成份交易型开放式指数证券投资基金 2024 年第 1 季度报告	中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站	2024年4月19日
7	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	2024年4月11日
8	大成深证成份交易型开放式指数证券投资基金托管协议更新	中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站	2024年4月9日
9	大成深证成份交易型开放式指数证券投资基金基金合同	中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站	2024年4月9日

10	大成基金管理有限公司关于调整旗下部分基金基金份额净值的小数点保留位数并相应修订基金合同和托管协议的公告	中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站	2024 年 4 月 9 日
11	大成基金管理有限公司提醒投资者谨防金融诈骗的公告	中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站	2024 年 4 月 2 日
12	大成深证成份交易型开放式指数证券投资基金 2023 年年度报告	中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站	2024 年 3 月 29 日
13	大成基金管理有限公司提醒投资者谨防金融诈骗的公告	中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站	2024 年 1 月 23 日
14	大成深证成份交易型开放式指数证券投资基金 2023 年第 4 季度报告	中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站	2024 年 1 月 19 日

§ 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

备查文件存放在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

2024 年 8 月 30 日