大成深证成份交易型开放式指数证券投资基金
2024 年年度报告

2024 年 12 月 31 日

基金管理人：大成基金管理有限公司

基金托管人：中国农业银行股份有限公司

送出日期：2025 年 3 月 31 日

§1 重要提示及目录

1.1 重要提示

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

基金托管人中国农业银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2025 年 3 月 28 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

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

本报告期自 2024 年 01 月 01 日起至 12 月 31 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、基金净值表现及利润分配情况 6

3.1 主要会计数据和财务指标 6
3.2 基金净值表现 7
3.3 过去三年基金的利润分配情况 8

§4 管理人报告 9

4.1 基金管理人及基金经理情况 9
4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明 12
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明 12
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明 13
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望 14
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况 15
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明 16
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明 16
4.9 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明 17

§5 托管人报告 17

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明 17
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 17
5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见 17

§6 审计报告 17

§7 年度财务报表 19

7.1 资产负债表 19
7.2 利润表 20
7.3 净资产变动表 22
7.4 报表附注 23

§8 投资组合报告 52

8.1 期末基金资产组合情况 52
8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合 52

8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细 54
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动 66
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合 67
8.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细 68
8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细 68
8.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细 68
8.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细 68
8.10 本基金投资股指期货的投资政策 68
8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 68
8.12 投资组合报告附注 68

§9 基金份额持有人信息 69

9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 69
9.2 期末上市基金前十名持有人 69
9.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 70
9.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况 70
9.5 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理本人及其直系亲属持有本人管理的产品情况 70

§10 开放式基金份额变动 70

§11 重大事件揭示 70

11.1 基金份额持有人大会决议 70
11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动 71
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 71
11.4 基金投资策略的改变 71
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 71
11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况 71
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 71
11.8 其他重大事件 73

§12 影响投资者决策的其他重要信息 75

12.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况 75
12.2 影响投资者决策的其他重要信息 75

§13 备查文件目录 75

13.1 备查文件目录 75
13.2 存放地点 76
13.3 查阅方式 76

§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	203,229,922.00 份
基金合同存续期	不定期
基金份额上市的证券交易所	深圳证券交易所
上市日期	2015 年 7 月 8 日

2.2 基金产品说明

投资目标	紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化。
投资策略	本基金采取完全复制法，即按照标的指数的成份股组成及其权重构建股票投资组合，并根据标的指数成份股及其权重的变动进行相应调整。 当预期成份股发生调整和成份股发生配股、增发、分红等行为时，或因基金的申购和赎回等对本基金跟踪标的指数的效果可能带来影响时，或因某些特殊情况导致流动性不足时，或其他原因导致无法有效复制和跟踪标的指数时，基金管理人可以对投资组合管理进行适当变通和调整，从而使得投资组合紧密地跟踪标的指数。
业绩比较基准	深证成份指数收益率
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、	北京市东城区建国门内大街 69 号

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

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《中国证券报》
登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	www.dcfund.com.cn
基金年度报告备置地点	基金管理人及基金托管人住所

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
会计师事务所	安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）	北京市东城区东长安街 1 号东方广场安永大楼 17 层 01-12 室
注册登记机构	中国证券登记结算有限责任公司	北京市西城区太平桥大街 17 号

§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	2024 年	2023 年	2022 年
本期已实现收益	6,469,628.05	-160,833.58	1,068,722.02
本期利润	34,771,970.53	-17,804,370.31	-25,445,009.24
加权平均基金份额本期利润	0.1750	-0.1539	-0.3366
本期加权平均净值利润率	17.72%	-14.07%	-27.81%
本期基金份额净值增长率	12.32%	-12.17%	-24.33%
3.1.2 期末数据和指标	2024 年末	2023 年末	2022 年末
期末可供分配利润	-36,242,489.58	-48,347,315.60	-14,103,353.51
期末可供	-0.1783	-0.2999	-0.1636

分配基金份额利润			
期末基金资产净值	225,739,438.46	159,492,777.09	97,054,890.31
期末基金份额净值	1.1108	0.9890	1.1260
3.1.3 累计期末指标	2024 年末	2023 年末	2022 年末
基金份额累计净值增长率	-13.82%	-23.27%	-12.64%

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

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

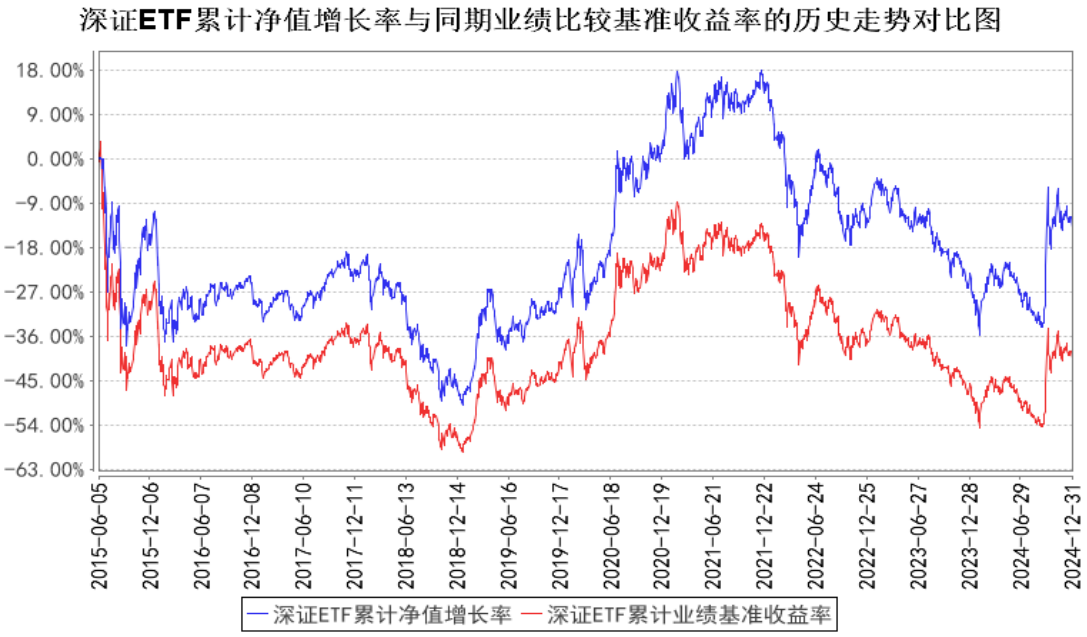
3、所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

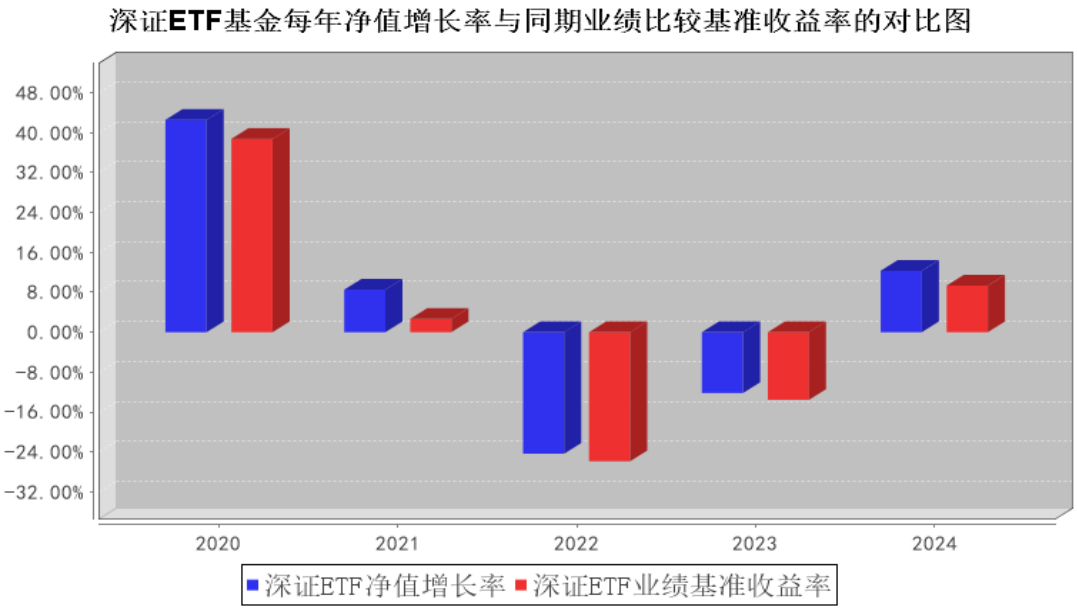
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①－③	②－④
过去三个月	-0.40%	2.22%	-1.09%	2.27%	0.69%	-0.05%
过去六个月	19.12%	2.11%	17.70%	2.15%	1.42%	-0.04%
过去一年	12.32%	1.79%	9.34%	1.82%	2.98%	-0.03%
过去三年	-25.35%	1.42%	-29.90%	1.45%	4.55%	-0.03%
过去五年	15.48%	1.43%	-0.15%	1.46%	15.63%	-0.03%
自基金合同生效起至今	-13.82%	1.55%	-40.49%	1.60%	26.67%	-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



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。

3.2.3 过去五年基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较



注：合同生效当年按实际存续期计算，不按整个自然年度进行折算。

3.3 过去三年基金的利润分配情况

无。

§4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

大成基金管理有限公司成立于 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 A100 交易型开放式指数证券投资基金（更名前为大成中证 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 日至 2025 年 2 月 18 日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 日至 2025 年 2 月 18 日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。2024 年 11 月 12 日起任大成中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金（更名前为大成中证 A500 指数型发起式证券投资基金）基金经理。2024 年 11 月 22 日起任大成中证 A500 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
李渌玮	本基金基金经理助	2024 年 4 月 15 日	-	8 年	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

	理				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 A100 交易型开放式指数证券投资基金（更名前为更名前为大成中证 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。2024 年 8 月 8 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、大成中证芯片产业指数型发起式证券投资基金、大成中证红利指数证券投资基金基金经理助理。2024 年 11 月 12 日起担任大成中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金（更名前为大成中证 A500 指数型发起式证券投资基金）基金经理助理。2024 年 11 月 22 日起担任大成中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金基金经理助理。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。

4.1.4 基金经理薪酬机制

无。

4.2 管理人对报告期内本基金运作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 公平交易制度和控制方法

根据《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》的规定，公司制订了《大成基金管理

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

4.3.2 公平交易制度的执行情况

报告期内，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、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。

4.3.2.1 增加执行的基金经理公平交易制度执行情况及公平交易管理情况

无。

4.3.3 异常交易行为的专项说明

报告期内，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所公开竞价交易中，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的 5%的交易共 3 次，为完全按照指数的构成比例进行投资的组合和其他组合发生的反向交易。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

2024 年，国内经济稳步发展，全年修复呈 U 型走势，GDP 同比增长 5%，完成既定目标。节奏上，一、四季度经济增长超预期上升，二、三季度相对回落。结构上，出口、制造业投资为主要支撑；地产仍是拖累项。报告期内，国内股票市场整体上涨。主要指数方面，沪深 300 涨 14.68%；中证 500 涨 5.46%；创业板指涨 13.23%，中证 1000 涨 1.2%。行业上（中信一级），银行、非银行金融、家电涨幅领先；综合、医药、农林牧渔表现萎靡。风格上，大盘明显占优。

阶段表现上，年初继续定价有效需求不足和美国降息预期修正，市场只有高股息依然坚挺，

其余板块均表现不佳，小市值跌幅较大。春节前一周，以汇金、证金为代表的机构陆续增持 ETF 改善微观流动性，叠加监管机构强化管理，资金和情绪共同推动股票市场大反攻。前期下跌较多的小市值风格反弹幅度更大。在修复达到一定程度后，部分资金获利了结，叠加季报披露，四月份起，市场进入震荡整理区间。这个期间，伴随新国九条、房地产重磅政策等陆续出台等，占优风格逐渐向大市值切换。五月下旬至九月中上旬，由于市场预期较弱，A 股持续下跌。财报密集披露之际，部分上市公司业绩不够理想，在整体风险偏好较低的背景下股价出现提前或过度反应，进一步拖累市场表现。到 9 月中下旬，美联储降息打开政策空间。国新办召开新闻发布会，央行联合证监会、金融监管总局出台了若干金融举措，聚焦于货币政策、资本市场、房地产等多个被高度关心与关注的领域。超预期政策组合拳既表明态度和决心，也大幅提振了投资者信心和情绪。紧跟着，政治局会议也提出多项和资本市场有关的政策。市场因而得到快速修复，反弹空间被打开。四季度，在走完国庆后的短暂消化期，市场重新回到由流动性和情绪主导的行情修复阶段。这段时间，市场也经历国内、国外重要事项从预期到落地到验证的过程，A 股整体在预期与基本面的博弈中震荡上行。

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，各项操作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 1.1108 元；本报告期基金份额净值增长率为 12.32%，业绩比较基准收益率为 9.34%。

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 2025 年，宏观经济继续稳中有进。结构上，由于强调内需拉动，消费在政策支持下逐步回暖，或接棒出口成为今年主要支撑项。投资方面，制造业投资在结构调整基础上小幅放缓；基建投资靠专项债、特别国债、增发国债等支撑，或有所回升；地产投资今年预计降幅收窄，减轻拖累。出口增速具备一定韧性，但长期如果新的海外需求增长点有限，则不确定性增加，可能出现回落。货币政策将转向“适度宽松”，流动性“充裕”，更加重视逆周期调节。财政政策更加积极，赤字率大概率继续提高。价格端，物价的合理回升是今年工作目标之一，CPI 有望温和回升，PPI 降幅收窄，有助于企业盈利的改善。

对于股票市场而言，2025 年外部环境的不确定增加，但国内环境较上年有大幅改善。分子端，

经济继续平稳复苏、基本面渐进修复。这是股市上涨的基础，当然也是一个过程。政策上，宏观基调和方向更加积极有为，主要思路从托底向“着力实现增长稳、稳就业和物价合理回升的优化组合”转向，叠加对资本市场特定支持等，均有利于股票市场表现。微观流动性上，较去年更为活跃的个人投资者和中长期资金的入市有助于改善股市流动性格局。最后，经过多轮调整-反弹-调整-反弹，A 股主要指数目前处于较为合理位置，风险偏好较去年有所提升。综上，2025 年股票市场受益于经济、政策、流动性和情绪的改善，总体或将震荡上行，结构上，各主题交替有所表现。

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

4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

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

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

（二）全面加强风险监控，不断提高基金业务风险管理水平。为督促各部门完善并落实各项内控措施，公司严格执行风险控制管理员制度，健全内控工作协调机制及监督机制，并进一步加强投资风险数量化评价能力及事前风险防范能力，有效防范相关业务风险。同时，公司严格执行投资报备制度，建立了基金从业人员证券投资管理监控信息系统，将投资报备工作纳入常态。

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

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

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

4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

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

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，并负责与托管人沟通估值调整事项；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，并与托管人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人沟通后由基金运营部具体执行。

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

4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

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。

4.9 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

无。

§5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

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

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

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

5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

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

§6 审计报告

审计报告标题	审计报告
审计报告收件人	大成深证成份交易型开放式指数证券投资基金全体基金份额持有人
审计意见	我们审计了大成深证成份交易型开放式指数证券投资基金的财务报表，包括 2024 年 12 月 31 日的资产负债表，2024 年度的利润表、净资产变动表以及相关财务报表附注。 我们认为，后附的大成深证成份交易型开放式指数证券投资基金的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则的规定编制，公允反映了大成深证成份交易型开放式指数证券投资基金 2024 年 12 月 31 日的财务状况以及 2024 年度的经营成果和净资产变动情况。

形成审计意见的基础	我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。审计报告的“注册会计师对财务报表审计的责任”部分进一步阐述了我们在这些准则下的责任。按照中国注册会计师职业道德守则，我们独立于大成深证成份交易型开放式指数证券投资基金，并履行了职业道德方面的其他责任。我们相信，我们获取的审计证据是充分、适当的，为发表审计意见提供了基础。
其他信息	大成深证成份交易型开放式指数证券投资基金管理层对其他信息负责。其他信息包括年度报告中涵盖的信息，但不包括财务报表和我们的审计报告。 我们对财务报表发表的审计意见不涵盖其他信息，我们也不对其他信息发表任何形式的鉴证结论。 结合我们对财务报表的审计，我们的责任是阅读其他信息，在此过程中，考虑其他信息是否与财务报表或我们在审计过程中了解到的情况存在重大不一致或者似乎存在重大错报。 基于我们已执行的工作，如果我们确定其他信息存在重大错报，我们应当报告该事实。在这方面，我们无任何事项需要报告。
管理层和治理层对财务报表的责任	管理层负责按照企业会计准则的规定编制财务报表，使其实现公允反映，并设计、执行和维护必要的内部控制，以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。 在编制财务报表时，管理层负责评估大成深证成份交易型开放式指数证券投资基金的持续经营能力，披露与持续经营相关的事项（如适用），并运用持续经营假设，除非计划进行清算、终止运营或别无其他现实的选择。 治理层负责监督大成深证成份交易型开放式指数证券投资基金的财务报告过程。
注册会计师对财务报表审计的责任	我们的目标是对财务报表整体是否不存在由于舞弊或错误导致的重大错报获取合理保证，并出具包含审计意见的审计报告。合理保证是高水平的保证，但并不能保证按照审计准则执行的审计在某一重大错报存在时总能发现。错报可能由于舞弊或错误导致，如果合理预期错报单独或汇总起来可能影响财务报表使用者依据财务报表作出的经济决策，则通常认为错报是重大的。 在按照审计准则执行审计工作的过程中，我们运用职业判断，并保持职业怀疑。同时，我们也执行以下工作： （1）识别和评估由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险，设计和实施审计程序以应对这些风险，并获取充分、适当的审计证据，作为发表审计意见的基础。由于舞弊可能涉及串通、伪造、故意遗漏、虚假陈述或凌驾于内部控制之上，未能发现由于舞弊导致的重大错报的风险高于未能发现由于错误导致的重大错报的风险。 （2）了解与审计相关的内部控制，以设计恰当的审计程序，但目的并非对内部控制的有效性发表意见。

	（3）评价管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计及相关披露的合理性。 （4）对管理层使用持续经营假设的恰当性得出结论。同时，根据获取的审计证据，就可能导致对大成深证成份交易型开放式指数证券投资基金持续经营能力产生重大疑虑的事项或情况是否存在重大不确定性得出结论。如果我们得出结论认为存在重大不确定性，审计准则要求我们在审计报告中提请报表使用者注意财务报表中的相关披露；如果披露不充分，我们应当发表非无保留意见。我们的结论基于截至审计报告日可获得的信息。然而，未来的事项或情况可能导致大成深证成份交易型开放式指数证券投资基金不能持续经营。 （5）评价财务报表的总体列报（包括披露）、结构和内容，并评价财务报表是否公允反映相关交易和事项。 我们与治理层就计划的审计范围、时间安排和重大审计发现等事项进行沟通，包括沟通我们在审计中识别出的值得关注的内部控制缺陷。
会计师事务所的名称	安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）
注册会计师的姓名	高鹤　　林恩丽
会计师事务所的地址	北京市东城区东长安街 1 号东方广场安永大楼 17 层 01-12 室
审计报告日期	2025 年 3 月 28 日

§7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体：大成深证成份交易型开放式指数证券投资基金

报告截止日：2024 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2024 年 12 月 31 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
资 产：			
货币资金	7.4.7.1	3,830,193.16	2,513,014.36
结算备付金		85.56	8,477.84
存出保证金		91,441.04	40,379.13
交易性金融资产	7.4.7.2	222,129,476.91	157,064,193.71
其中：股票投资		222,107,013.44	157,064,193.71
基金投资		-	-
债券投资		22,463.47	-
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
其他投资		-	-
衍生金融资产	7.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	-	-
债权投资	7.4.7.5	-	-

其中：债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
其他投资		-	-
其他债权投资	7.4.7.6	-	-
其他权益工具投资	7.4.7.7	-	-
应收清算款		14,926.61	111,573.01
应收股利		-	-
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.8	-	-
资产总计		226,066,123.28	159,737,638.05
负债和净资产	**附注号**	**本期末 2024 年 12 月 31 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	7.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付清算款		4,770.31	-
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		98,437.48	64,364.04
应付托管费		19,687.48	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	7.4.7.9	203,789.55	167,624.11
负债合计		326,684.82	244,860.96
净资产：			
实收基金	7.4.7.10	261,981,928.04	207,840,092.69
未分配利润	7.4.7.12	-36,242,489.58	-48,347,315.60
净资产合计		225,739,438.46	159,492,777.09
负债和净资产总计		226,066,123.28	159,737,638.05

注： 报告截止日 2024 年 12 月 31 日，基金份额净值 1.1108 元，基金份额总额 203,229,922.00 份。

7.2 利润表

会计主体：大成深证成份交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期	上年度可比期间

		2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日	2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日
一、营业总收入		36,255,610.22	-16,777,870.68
1.利息收入		29,432.74	18,456.33
其中：存款利息收入	7.4.7.13	29,432.74	18,456.33
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）		7,892,496.30	799,447.30
其中：股票投资收益	7.4.7.14	4,272,073.42	-859,486.29
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.15	3.43	26,414.85
资产支持证券投资收益	7.4.7.16	-	-
贵金属投资收益	7.4.7.17	-	-
衍生工具收益	7.4.7.18	-	-
股利收益	7.4.7.19	3,620,419.45	1,632,518.74
其他投资收益		-	-
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.20	28,302,342.48	-17,643,536.73
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.21	31,338.70	47,762.42
减：二、营业总支出		1,483,639.69	1,026,499.63
1．管理人报酬	7.4.10.2.1	981,853.89	630,053.92
其中：暂估管理人报酬		-	-
2．托管费	7.4.10.2.2	196,370.80	126,010.70
3．销售服务费	7.4.10.2.3	-	-
4．投资顾问费		-	-
5．利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6．信用减值损失	7.4.7.22	-	-
7．税金及附加		-	0.01
8．其他费用	7.4.7.23	305,415.00	270,435.00
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		34,771,970.53	-17,804,370.31
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”		34,771,970.53	-17,804,370.31

号填列）			
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		34,771,970.53	-17,804,370.31

7.3 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 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	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）	54,141,835.35	-	12,104,826.02	66,246,661.37
（一）、综合收益总额	-	-	34,771,970.53	34,771,970.53
（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）	54,141,835.35	-	-22,667,144.51	31,474,690.84
其中：1.基金申购款	409,931,039.14	-	-97,134,399.70	312,796,639.44
2.基金赎回款	-355,789,203.79	-	74,467,255.19	-281,321,948.60
（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	261,981,928.04	-	-36,242,489.58	225,739,438.46
项目	上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	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)	96,681,848.87	-	-34,243,962.09	62,437,886.78
(一)、综合收益总额	-	-	-17,804,370.31	-17,804,370.31
(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)	96,681,848.87	-	-16,439,591.78	80,242,257.09
其中：1.基金申购款	204,965,519.59	-	-32,536,392.43	172,429,127.16
2.基金赎回款	-108,283,670.72	-	16,096,800.65	-92,186,870.07
(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	207,840,092.69	-	-48,347,315.60	159,492,777.09

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.4 财务报表由下列负责人签署：

谭晓冈	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

7.4 报表附注

7.4.1 基金基本情况

大成深证成份交易型开放式指数证券投资基金(以下简称“本基金”)经中国证券监督管理委员会(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 2025 年 3 月 28 日批准报出。

7.4.2 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、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 2 号《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。

7.4.3 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 2024 年 12 月 31 日的财务状况以及 2024 年度的经营成果和净资产变动情况等有关信息。

7.4.4 重要会计政策和会计估计

7.4.4.1 会计年度

本基金会计年度为公历 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

7.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

金融工具是指形成本基金的金融资产（或负债），并形成其他单位的金融负债（或资产）或权益工具的合同。

（1）金融资产分类

本基金的金融资产于初始确认时根据管理金融资产的业务模式和金融资产的合同现金流量特征分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、以摊余成本计量的金融资产。

（2）金融负债分类

本基金的金融负债于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债、以摊余成本计量的金融负债。

7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

本基金于成为金融工具合同的一方时确认一项金融资产或金融负债。

划分为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和金融负债，以及不作为有效套期工具的衍生工具，按照取得时的公允价值作为初始确认金额，相关的交易费用在发生时计入当期损益。

划分为以摊余成本计量的金融资产和金融负债，按照取得时的公允价值作为初始确认金额，相关交易费用计入其初始确认金额。

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，采用公允价值进行后续计量，所有公允价值变动计入当期损益。

对于以摊余成本计量的金融资产，采用实际利率法确认利息收入，其终止确认、修改或减值产生的利得或损失，均计入当期损益。

本基金以预期信用损失为基础，对以摊余成本计量的金融资产进行减值处理并确认损失准备。对于不含重大融资成分的应收款项，本基金运用简化计量方法，按照相当于整个存续期内的预期

信用损失金额计量损失准备。除上述采用简化计量方法以外的金融资产，本基金在每个估值日评估其信用风险自初始确认后是否已经显著增加，如果信用风险自初始确认后未显著增加，处于第一阶段，本基金按照相当于未来 12 个月内预期信用损失的金额计量损失准备，并按照账面余额和实际利率计算利息收入；如果信用风险自初始确认后已显著增加但尚未发生信用减值的，处于第二阶段，本基金按照相当于整个存续期内预期信用损失的金额计量损失准备，并按照账面余额和实际利率计算利息收入；如果初始确认后发生信用减值的，处于第三阶段，本基金按照相当于整个存续期内预期信用损失的金额计量损失准备，并按照摊余成本和实际利率计算利息收入。

本基金在每个估值日评估相关金融工具的信用风险自初始确认后是否已显著增加。本基金以单项金融工具或者具有相似信用风险特征的金融工具组合为基础，通过比较金融工具在估值日发生违约的风险与在初始确认日发生违约的风险，以确定金融工具预计存续期内发生违约风险的变化情况。

本基金计量金融工具预期信用损失的方法反映的因素包括：通过评价一系列可能的结果而确定的无偏概率加权平均金额、货币时间价值，以及在估值日无须付出不必要的额外成本或努力即可获得的有关过去事项、当前状况以及未来经济状况预测的合理且有依据的信息。

当对金融资产预期未来现金流量具有不利影响的一项或多项事件发生时，该金融资产成为已发生信用减值的金融资产。

当本基金不再合理预期能够全部或部分收回金融资产合同现金流量时，本基金直接减记该金融资产的账面余额。

当收取该金融资产现金流量的合同权利终止，或该收取金融资产现金流量的权利已转移，且符合金融资产转移的终止确认条件的，金融资产将终止确认。

本基金已将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方的，终止确认该金融资产；保留了金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬的，不终止确认该金融资产；本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬的，分别下列情况处理：放弃了对该金融资产控制的，终止确认该金融资产并确认产生的资产和负债；未放弃对该金融资产控制的，按照其继续涉入所转移金融资产的程度确认有关金融资产，并相应确认有关负债。

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债（含交易性金融负债和衍生金融负债），按照公允价值进行后续计量，所有公允价值变动均计入当期损益。对于以摊余成本计量的金融负债，采用实际利率法，按照摊余成本进行后续计量。如果金融负债的责任已履行、撤销或届满，则对金融负债进行终止确认。

7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

公允价值，是指市场参与者在计量日发生的有序交易中，出售一项资产所能收到或者转移一项负债所需支付的价格。本基金以公允价值计量相关资产或负债，假定出售资产或者转移负债的有序交易在相关资产或负债的主要市场进行；不存在主要市场的，本基金假定该交易在相关资产或负债的最有利市场进行。主要市场（或最有利市场）是本基金在计量日能够进入的交易市场。本基金采用市场参与者在对该资产或负债定价时为实现其经济利益最大化所使用的假设。

在财务报表中以公允价值计量或披露的资产和负债，根据对公允价值计量整体而言具有重要意义的最低层次输入值，确定所属的公允价值层次：第一层次输入值，在计量日能够取得的相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价；第二层次输入值，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；第三层次输入值，相关资产或负债的不可观察输入值。

每个资产负债表日，本基金对在财务报表中确认的持续以公允价值计量的资产和负债进行重新评估，以确定是否在公允价值计量层次之间发生转换。

本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和金融负债按如下原则确定公允价值并进行估值：

（1）存在活跃市场的金融工具，按照估值日能够取得的相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价作为公允价值；估值日无报价且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，应采用最近交易日的报价确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的报价不能真实反映公允价值的，应对报价进行调整，确定公允价值。

与上述投资品种相同，但具有不同特征的，应以相同资产或负债的公允价值为基础，并在估值技术中考虑不同特征因素的影响。特征是指对资产出售或使用的限制等，如果该限制是针对资产持有者的，那么在估值技术中不应将该限制作为特征考虑。此外，基金管理人不应考虑因大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价。

（2）不存在活跃市场的金融工具，应采用在当前情况下适用并且有足够可利用数据和其他信息支持的估值技术确定公允价值。采用估值技术确定公允价值时，应优先使用可观察输入值，只有在无法取得相关资产或负债可观察输入值或取得不切实可行的情况下，才使用不可观察输入值。

（3）如有确凿证据表明按上述方法进行估值不能客观反映其公允价值的，基金管理人可根据具体情况与基金托管人商定后，按最能反映公允价值的方法估值。

（4）如有新增事项，按国家最新规定估值。

7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

当本基金具有抵销已确认金融资产和金融负债的法定权利，且该种法定权利现在是可执行的，

同时本基金计划以净额结算或同时变现该金融资产和清偿该金融负债时，金融资产和金融负债以相互抵销后的金额在资产负债表内列示。除此以外，金融资产和金融负债在资产负债表内分别列示，不予相互抵销。

7.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行的基金份额总额所对应的金额。由于申购和赎回引起的实收基金变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日确认。由于基金份额拆分引起的实收基金份额变动于基金份额拆分日根据拆分前的基金份额数及确定的拆分比例计算确认。由于基金份额折算引起的实收基金份额变动于基金份额折算日根据折算前的基金份额数及确定的折算比例计算确认。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

7.4.4.8 损益平准金

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

7.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

（1）对于以摊余成本计量的金融资产，采用实际利率法计算的利息扣除在适用情况下的相关税费后的净额确认利息收入，计入当期损益。处置时，其处置价格扣除相关交易费用后的净额与账面价值之间的差额确认为投资收益。

（2）对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和金融负债，相关交易费用直接计入投资收益。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产为债务工具投资的，在持有期间将按票面或合同利率计算的利息收入扣除在适用情况下的相关税费后的净额计入投资收益，扣除该部分利息后的公允价值变动额计入公允价值变动损益；除上述之外的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和金融负债的公允价值变动形成的应计入当期损益的利得或损失计入公允价值变动损益。处置时，其处置价格与初始确认金额之间的差额扣除相关交易费用及在适用情况下的相关税费后的净额确认为投资收益。

本基金在同时符合下列条件时确认股利收入并计入当期损益：1）本基金收取股利的权利已经确立；2）与股利相关的经济利益很可能流入本基金；3）股利的金额能够可靠计量。

（3）其他收入在经济利益很可能流入从而导致资产增加或者负债减少、且经济利益的流入额能够可靠计量时确认。

7.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬和托管费等费用按照权责发生制原则，在本基金接受相关服务的期间计入当期损益。

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

7.4.4.11 基金的收益分配政策

每一基金份额享有同等分配权。本基金收益以现金形式分配。基金收益评价日核定的基金净值率超过标的指数同期增长率达到 1%以上时，本基金的基金管理人可进行收益分配；以使收益分配后基金份额净值增长率尽可能贴近标的指数同期增长率为原则确定收益分配。本基金收益每年最多分配 12 次，收益分配后有可能使除息后的基金份额净值低于面值。

经宣告的拟分配基金收益于分红除权日从净资产转出。

7.4.4.12 外币交易

无。

7.4.4.13 分部报告

本基金以内部组织结构、管理要求、内部报告制度为依据确定经营分部，以经营分部为基础确定报告分部并披露分部信息。经营分部是指本基金内同时满足下列条件的组成部分：

(1)该组成部分能够在日常活动中产生收入、发生费用。

(2)本基金的基金管理人能够定期评价该组成部分的经营成果，以决定向其配置资源、评价其业绩。

(3)本基金能够取得该组成部分的财务状况、经营成果和现金流量等有关会计信息。

如果两个或多个经营分部具有相似的经济特征，并且满足一定条件的，则合并为一个经营分部。本基金目前以一个单一的经营分部运作，不需要披露分部信息。

7.4.4.14 其他重要的会计政策和会计估计

无。

7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

7.4.5.1 会计政策变更的说明

无。

7.4.5.2 会计估计变更的说明

无。

7.4.5.3 差错更正的说明

无。

7.4.6 税项

（1）增值税及附加

根据财政部、国家税务总局财税[2016]36 号文《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》的规定，经国务院批准，自 2016 年 5 月 1 日起在全国范围内全面推开营业税改征增值税试点，金融业纳入试点范围，由缴纳营业税改为缴纳增值税。对证券投资基金（封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金）管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税；国债、地方政府债利息收入以及金融同业往来利息收入免征增值税；存款利息收入不征收增值税。

根据财政部、国家税务总局财税[2016]46 号文《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》的规定，金融机构开展的质押式买入返售金融商品业务及持有政策性金融债券取得的利息收入属于金融同业往来利息收入。

根据财政部、国家税务总局财税[2016]70 号文《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》的规定，金融机构开展的买断式买入返售金融商品业务、同业存款、同业存单以及持有金融债券取得的利息收入属于金融同业往来利息收入。

根据财政部、国家税务总局财税[2016]140 号文《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》的规定，本基金运营过程中发生的增值税应税行为，以本基金的基金管理人为增值税纳税人。

根据财政部、国家税务总局财税[2017]56 号文《关于资管产品增值税有关问题的通知》的规定，证券投资基金的基金管理人运营证券投资基金过程中发生的增值税应税行为，暂适用简易计税方法，按照 3%的征收率缴纳增值税。对证券投资基金在 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，已纳税额从证券投资基金的基金管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。增值税应税行为的销售额根据财政部、国家税务总局财税[2017]90 号文《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》的规定确定。

增值税附加税包括城市维护建设税、教育费附加和地方教育附加，以实际缴纳的增值税税额为计税依据，分别按 7%、3%和 2%的比例缴纳城市维护建设税、教育费附加和地方教育附加。

（2）企业所得税

根据财政部、国家税务总局财税[2004]78 号文《关于证券投资基金税收政策的通知》的规定，自 2004 年 1 月 1 日起，对证券投资基金（封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金）管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入，继续免征企业所得税。

根据财政部、国家税务总局财税[2008]1 号文《关于企业所得税若干优惠政策的通知》的规定，对证券投资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，股权的股息、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）个人所得税

根据财政部、国家税务总局财税[2008]132 号文《财政部、国家税务总局关于储蓄存款利息所得有关个人所得税政策的通知》的规定，自 2008 年 10 月 9 日起，对储蓄存款利息所得暂免征收个人所得税。

根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2012]85 号文《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》的规定，自 2013 年 1 月 1 日起，（如有）证券投资基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，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，暂减按 25%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。

根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2015]101 号文《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》的规定，自 2015 年 9 月 8 日起，（如有）证券投资基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，持股期限超过 1 年的，股息红利所得暂免征收个人所得税。

（4）印花税

经国务院批准，财政部、国家税务总局研究决定，自 2008 年 4 月 24 日起，调整证券（股票）交易印花税税率，由原先的 3‰调整为 1‰，自 2008 年 9 月 19 日起，调整由出让方按证券（股票）交易印花税税率缴纳印花税，受让方不再征收，税率不变； 根据财政部、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》的规定，自 2023 年 8 月 28 日起，证券交易印花税实施减半征收。

（5）境外投资

本基金运作过程中如有涉及的境外投资的税项问题，根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2014]81 号文《关于沪港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》、财税[2016]127 号文《关于深港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》及其他境内外相关税务法规的规定和实务操作执行。

7.4.7 重要财务报表项目的说明

7.4.7.1 货币资金

单位：人民币元

项目	本期末 2024 年 12 月 31 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
活期存款	3,830,193.16	2,513,014.36
等于：本金	3,828,933.66	2,512,522.71
加：应计利息	1,259.50	491.65
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	3,830,193.16	2,513,014.36

7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末 2024 年 12 月 31 日			
		成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票		208,209,139.37	-	222,107,013.44	13,897,874.07
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-	-
债券	交易所市场	17,800.00	3.43	22,463.47	4,660.04
	银行间市场	-	-	-	-
	合计	17,800.00	3.43	22,463.47	4,660.04
资产支持证券		-	-	-	-
基金		-	-	-	-
其他		-	-	-	-
合计		208,226,939.37	3.43	222,129,476.91	13,902,534.11
项目		上年度末 2023 年 12 月 31 日			
		成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票		171,464,002.08	-	157,064,193.71	-14,399,808.37
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		171,464,002.08	-	157,064,193.71	-14,399,808.37

7.4.7.3 衍生金融资产/负债

7.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

无。

7.4.7.3.2 期末基金持有的期货合约情况

无。

7.4.7.3.3 期末基金持有的黄金衍生品情况

无。

7.4.7.4 买入返售金融资产

7.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

无。

7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

无。

7.4.7.4.3 按预期信用损失一般模型计提减值准备的说明

无。

7.4.7.5 债权投资

7.4.7.5.1 债权投资情况

无。

7.4.7.5.2 债权投资减值准备计提情况

无。

7.4.7.6 其他债权投资

7.4.7.6.1 其他债权投资情况

无。

7.4.7.6.2 其他债权投资减值准备计提情况

无。

7.4.7.7 其他权益工具投资

7.4.7.7.1 其他权益工具投资情况

无。

7.4.7.7.2 报告期末其他权益工具投资情况

无。

7.4.7.8 其他资产

无。

7.4.7.9 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2024 年 12 月 31 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
应付券商交易单元保证金	-	-
应付赎回费	-	-
应付证券出借违约金	-	-
应付交易费用	1,818.75	2,624.11
其中：交易所市场	1,818.75	2,624.11
银行间市场	-	-
应付利息	-	-
预提费用	165,000.00	130,000.00
应付指数使用费	35,000.00	35,000.00
可退替代款	1,970.80	-
合计	203,789.55	167,624.11

7.4.7.10 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 12 月 31 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	318,000,000.00	409,931,039.14
本期赎回（以“-”号填列）	-276,000,000.00	-355,789,203.79
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	203,229,922.00	261,981,928.04

7.4.7.11 其他综合收益

无。

7.4.7.12 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
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	6,469,628.05	28,302,342.48	34,771,970.53
本期基金份额交易产生的变动数	2,815,483.83	-25,482,628.34	-22,667,144.51
其中：基金申购款	26,353,924.05	-123,488,323.75	-97,134,399.70
基金赎回款	-23,538,440.22	98,005,695.41	74,467,255.19
本期已分配利润	-	-	-
本期末	27,060,547.74	-63,303,037.32	-36,242,489.58

7.4.7.13 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 12 月 31 日	上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日
活期存款利息收入	28,176.42	17,854.28
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	265.38	268.45
其他	990.94	333.60
合计	29,432.74	18,456.33

7.4.7.14 股票投资收益

7.4.7.14.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年12月31日	上年度可比期间 2023年1月1日至2023年12月31日
股票投资收益——买卖股票差价收入	1,639,806.44	-747,396.08
股票投资收益——赎回差价收入	2,632,266.98	-112,090.21
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	4,272,073.42	-859,486.29

7.4.7.14.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日
卖出股票成交总额	22,565,885.83	14,570,485.01
减：卖出股票成本总额	20,904,910.20	15,288,059.48
减：交易费用	21,169.19	29,821.61
买卖股票差价收入	1,639,806.44	-747,396.08

7.4.7.14.3 股票投资收益——赎回差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年12月31日	上年度可比期间 2023年1月1日至2023年12月31日
赎回基金份额对价总额	281,321,948.60	92,186,870.07
减：现金支付赎回款总额	-1,224,344.40	907,033.07
减：赎回股票成本总额	279,914,026.02	91,391,927.21
减：交易费用	-	-
赎回差价收入	2,632,266.98	-112,090.21

7.4.7.14.4 股票投资收益——申购差价收入

无。

7.4.7.14.5 股票投资收益——证券出借差价收入

无。

7.4.7.15 债券投资收益

7.4.7.15.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年12月31日	上年度可比期间 2023年1月1日至2023年12月31日
债券投资收益——利息收入	3.43	21.29
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	-	26,393.56
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	3.43	26,414.85

7.4.7.15.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年12月31日	上年度可比期间 2023年1月1日至2023年12月31日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	-	147,620.97
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	-	121,200.00
减：应计利息总额	-	21.50
减：交易费用	-	5.91
买卖债券差价收入	-	26,393.56

7.4.7.15.3 债券投资收益——赎回差价收入

无。

7.4.7.15.4 债券投资收益——申购差价收入

无。

7.4.7.16 资产支持证券投资收益

7.4.7.16.1 资产支持证券投资收益项目构成

无。

7.4.7.16.2 资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入

无。

7.4.7.16.3 资产支持证券投资收益——赎回差价收入

无。

7.4.7.16.4 资产支持证券投资收益——申购差价收入

无。

7.4.7.17 贵金属投资收益

7.4.7.17.1 贵金属投资收益项目构成

无。

7.4.7.17.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

无。

7.4.7.17.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

无。

7.4.7.17.4 贵金属投资收益——申购差价收入

无。

7.4.7.18 衍生工具收益

7.4.7.18.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

无。

7.4.7.18.2 衍生工具收益——其他投资收益

无。

7.4.7.19 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日
股票投资产生的股利收益	3,620,419.45	1,632,518.74
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	3,620,419.45	1,632,518.74

7.4.7.20 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 12 月 31 日	上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日
1.交易性金融资产	28,302,342.48	-17,643,536.73
股票投资	28,297,682.44	-17,643,536.73
债券投资	4,660.04	-
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	28,302,342.48	-17,643,536.73

7.4.7.21 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日
基金赎回费收入	-	-
替代损益	31,338.70	47,762.42
合计	31,338.70	47,762.42

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。

7.4.7.22 信用减值损失

无。

7.4.7.23 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日
审计费用	45,000.00	50,000.00
信息披露费	120,000.00	80,000.00
证券出借违约金	-	-
银行划款手续费	415.00	435.00
指数使用费	140,000.00	140,000.00
合计	305,415.00	270,435.00

7.4.7.24 分部报告

无。

7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

7.4.8.1 或有事项

无。

7.4.8.2 资产负债表日后事项

无。

7.4.9 关联方关系

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

光大证券股份有限公司(“光大证券”)	基金管理人的股东、基金销售机构
中国银河投资管理有限公司	基金管理人的股东
大成国际资产管理有限公司(“大成国际”)	基金管理人的子公司
大成创新资本管理有限公司(“大成创新资本”)	基金管理人的合营企业

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

7.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日		上年度可比期间 2023年1月1日至2023年12月31日	
	成交金额	占当期股票成交总额的比例（%）	成交金额	占当期股票成交总额的比例（%）
光大证券	45,825,610.17	95.10	27,631,986.34	85.77

7.4.10.1.2 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 12 月 31 日		上年度可比期间 2023年1月1日至2023年12月31日	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例（%）	成交金额	占当期债券成交总额的比例（%）
光大证券	-	-	129,651.95	87.83

7.4.10.1.3 债券回购交易

无。

7.4.10.1.4 权证交易

无。

7.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2024年1月1日至2024年12月31日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例（%）	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例（%）
光大证券	4,583.41	67.45	1,818.75	100.00

关联方名称	上年度可比期间 2023年1月1日至2023年12月31日			
	当期 佣金	占当期佣金总量的比例（%）	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例（%）
光大证券	13,287.59	75.59	2,624.11	100.00

注：1、上述佣金按协议约定的佣金率计算，佣金费率参考市场价格经本基金的基金管理人与对方协商确定；

2、根据《公开募集证券投资基金证券交易费用管理规定》，自 2024 年 7 月 1 日起，基金管理人管理的被动股票型基金的股票交易佣金费率原则上不得超过市场平均股票交易佣金费率，且不得通过交易佣金支付研究服务、流动性服务等其他费用；其他类型基金可以通过交易佣金支付研究服务费用，但股票交易佣金费率原则上不得超过市场平均股票交易佣金费率的两倍，且不得通过交易佣金支付研究服务之外的其他费用。

7.4.10.2 关联方报酬

7.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的管理费	981,853.89	630,053.92
其中：应支付销售机构的客户维护费	61,985.34	-
应支付基金管理人的净管理费	919,868.55	630,053.92

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

日管理人报酬＝前一日基金资产净值×0.50%/当年天数。

7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的托管费	196,370.80	126,010.70

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

日托管费＝前一日基金资产净值×0.10%/当年天数。

7.4.10.2.3 销售服务费

无。

7.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易

无。

7.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

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

无。

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

无。

7.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

7.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

无。

7.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

无。

7.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日		上年度可比期间 2023年1月1日至2023年12月31日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国农业银行	3,830,193.16	28,176.42	2,513,014.36	17,854.28

注：本基金由基金托管人保管的银行存款，按银行约定利率计息。

7.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

无。

7.4.10.8 其他关联交易事项的说明

无。

7.4.11 利润分配情况

无。

7.4.12 期末（2024 年 12 月 31 日）本基金持有的流通受限证券

7.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

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

代码	券名称	认购日	期	受限类型	价格	估值单价	（单位：股）	成本总额	总额	
001279	强邦新材	2024 年 9 月 27 日	6 个月	新股锁定	9.68	27.91	265	2,565.20	7,396.15	-
001391	国货航	2024 年 12 月 23 日	6 个月	新股锁定	2.30	6.80	1,752	4,029.60	11,913.60	-
301522	上大股份	2024 年 10 月 9 日	6 个月	新股锁定	6.88	24.84	816	5,614.08	20,269.44	-
301551	无线传媒	2024 年 9 月 19 日	6 个月	新股锁定	9.40	43.23	652	6,128.80	28,185.96	-
301552	科力装备	2024 年 7 月 15 日	6 个月	新股锁定	30.00	56.87	143	4,290.00	8,132.41	-
301556	托普云农	2024 年 10 月 10 日	6 个月	新股锁定	14.50	59.05	267	3,871.50	15,766.35	-
301571	国科天成	2024 年 8 月 14 日	6 个月	新股锁定	11.14	40.83	350	3,899.00	14,290.50	-
301585	蓝宇股份	2024 年 12 月 10 日	6 个月	新股锁定	23.95	35.85	210	5,029.50	7,528.50	-
301586	佳力奇	2024 年 8 月 21 日	6 个月	新股锁定	18.09	53.14	215	3,889.35	11,425.10	-
301603	乔锋智能	2024 年 7 月 3 日	6 个月	新股锁定	26.50	41.98	156	4,134.00	6,548.88	-
301606	绿联	2024 年 7 月	6 个月	新股锁定	21.21	36.49	235	4,984.35	8,575.15	-

	科技	17 日								
301607	富特科技	2024 年 8 月 28 日	6 个月	新股锁定	14.00	36.14	257	3,598.00	9,287.98	-
301608	博实结	2024 年 7 月 25 日	6 个月	新股锁定	44.50	65.38	114	5,073.00	7,453.32	-
301611	珂玛科技	2024 年 8 月 7 日	6 个月	新股锁定	8.00	56.10	695	5,560.00	38,989.50	-
301617	博苑股份	2024 年 12 月 3 日	6 个月	新股锁定	27.76	39.79	232	6,440.32	9,231.28	-
301622	英思特	2024 年 11 月 26 日	6 个月	新股锁定	22.36	44.92	306	6,842.16	13,745.52	-
301626	苏州天脉	2024 年 10 月 17 日	6 个月	新股锁定	21.23	65.78	957	20,317.11	62,951.46	-
301631	壹连科技	2024 年 11 月 12 日	6 个月	新股锁定	72.99	101.96	102	7,444.98	10,399.92	-

7.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	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
002252	上海莱士	2024 年 12 月 23 日	重大事项停牌	7.22	2025 年 1 月 7 日	6.93	88,520	663,143.23	639,114.40	-

7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

无。

7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

无。

7.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

无。

7.4.13 金融工具风险及管理

7.4.13.1 风险管理政策和组织架构

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

本基金的基金管理人奉行全面风险管理体系的建设，建立了以由高层监控(合规与风险管理委员会、公司投资风险控制委员会)、专业监控(监察稽核部、风险管理部)、部门互控、岗位自控构成的风险管理架构体系。本基金的基金管理人在董事会下设立合规与风险管理委员会，对公司整体运营风险进行监督，监督风险控制措施的执行；在管理层层面设立投资风险控制委员会，通过定期会议讨论涉及投资风险的重大议题，形成正式决议提交投委会；在业务操作层面，监察稽核部履行合规控制职责，通过定期、不定期检查内控制度的执行情况、对重大风险点以专项稽核的方式确保公司内控制度、流程得到贯彻执行。风险管理部履行风险量化评估分析职责。

本基金的基金管理人对于金融工具的风险管理方法主要是通过定性分析和定量分析的方法去估测各种风险产生的可能损失。从定性分析的角度出发，判断风险损失的严重程度和出现同类风险损失的频度。而从定量分析的角度出发，根据本基金的投资目标，结合基金资产所运用金融工具特征通过特定的风险量化指标、模型，日常的量化报告，确定风险损失的限度和相应置信程度，及时可靠地对各种风险进行监督、检查和评估，并通过相应决策，将风险控制在可承受的范围内。

7.4.13.2 信用风险

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

本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的银行存款存放在本基金的托管人中国农业银行股份有限公司，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 0.01%(上年度末：本基金无债券投资)。

7.4.13.3 流动性风险

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

7.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

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

本基金主要投资于交易所及银行间市场内交易的证券，除在附注“期末本基金持有的流通受限证券”中列示的部分基金资产流通暂时受限制外(如有)，其余均能及时变现。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券资产的公允价值。除附注“期末债券正回购交易中作为抵押的债券”中列示的卖出回购金融资产款

余额(如有)将在 1 个月内到期且计息外，本基金于资产负债表日所持有的金融负债的合约约定剩余到期日均为一年以内且一般不计息，可赎回基金份额净值无固定到期日且不计息，因此账面余额一般即为未折现的合约到期现金流量。

7.4.13.4 市场风险

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

7.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。利率敏感性金融工具均面临由于市场利率上升而导致公允价值下降的风险，其中浮动利率类金融工具还面临每个付息期间结束根据市场利率重新定价时对于未来现金流影响的风险。

本基金的基金管理人定期对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控，并通过调整投资组合的久期等方法对上述利率风险进行管理。

本基金持有及承担的大部分金融资产和金融负债不计息，因此本基金的收入及经营活动的现金流量在很大程度上独立于市场利率变化。本基金持有的利率敏感性资产主要为银行存款和存出保证金等。

7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2024 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	3,830,193.16	-	-	-	3,830,193.16
结算备付金	85.56	-	-	-	85.56
存出保证金	91,441.04	-	-	-	91,441.04
交易性金融资产	-	-	22,463.47	222,107,013.44	222,129,476.91
应收清算款	-	-	-	14,926.61	14,926.61
资产总计	3,921,719.76	-	22,463.47	222,121,940.05	226,066,123.28
负债					
应付管理人报酬	-	-	-	98,437.48	98,437.48
应付托管费	-	-	-	19,687.48	19,687.48
应付清算款	-	-	-	4,770.31	4,770.31
其他负债	-	-	-	203,789.55	203,789.55
负债总计	-	-	-	326,684.82	326,684.82
利率敏感度缺口	3,921,719.76	-	22,463.47	221,795,255.23	225,739,438.46
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。

7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

于本期末，本基金持有的交易性债券投资和交易性资产支持证券投资公允价值占净资产的比例为 0.01%(上年度末：无)，因此市场利率的变动对于本基金净资产无重大影响(上年度末：同)。

7.4.13.4.2 外汇风险

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

7.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市的股票和债券，所面临的其他价格风险来源于单个证券发行主体自身经营情况或特殊事项的影响，也可能来源于证券市场整体波动的影响。

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

7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2024 年 12 月 31 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	222,107,013.44	98.39	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	222,107,013.44	98.39	157,064,193.71	98.48

7.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除业绩比较基准以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2024 年 12 月 31 日）	上年度末（2023 年 12 月 31 日）
	业绩比较基准上升 5%	11,069,615.67	7,796,924.60
	业绩比较基准下降 5%	-11,069,615.67	-7,796,924.60

7.4.14 公允价值

7.4.14.1 金融工具公允价值计量的方法

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

第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

7.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

7.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2024 年 12 月 31 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
第一层次	221,198,271.49	156,913,993.72
第二层次	639,114.40	-
第三层次	292,091.02	150,199.99
合计	222,129,476.91	157,064,193.71

7.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

本基金以导致各层次之间转换的事项发生日为确认各层次之间转换的时点。

对于证券交易所上市的证券，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证券的公允价值列入第一层次；对于定期开放的基金投资，本基金不会于封闭期将相关基金列入第一层次；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，确定相关投资的公允价值应属第二层次还是第三层次。

7.4.14.2.3 第三层次公允价值余额及变动情况

7.4.14.2.3.1 第三层次公允价值余额及变动情况

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日		
	交易性金融资产		合计
	债券投资	股票投资	
期初余额	-	150,199.99	150,199.99
当期购买	-	-	-
当期出售/结算	-	-	-
转入第三层次	-	490,039.69	490,039.69
转出第三层次	-	174,058.53	174,058.53
当期利得或损失总额	-	-174,090.13	-174,090.13
其中：计入损益的利得或损失	-	-174,090.13	-174,090.13
计入其他综合收益的利得或损失	-	-	-
期末余额	-	292,091.02	292,091.02
期末仍持有的第三层次金融资产计入本期损益的未实现利得或损失的变动—	-	188,380.07	188,380.07

—公允价值变动损益			
项目	上年度可比期间 2023年1月1日至2023年12月31日		
	交易性金融资产		合计
	债券投资	股票投资	
期初余额	-	90,923.76	90,923.76
当期购买	-	-	-
当期出售/结算	-	-	-
转入第三层次	-	291,417.91	291,417.91
转出第三层次	-	193,075.87	193,075.87
当期利得或损失总额	-	-39,065.81	-39,065.81
其中：计入损益的利得或损失	-	-39,065.81	-39,065.81
计入其他综合收益的利得或损失	-	-	-
期末余额	-	150,199.99	150,199.99
期末仍持有的第三层次金融资产计入本期损益的未实现利得或损失的变动——公允价值变动损益	-	50,901.85	50,901.85

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

单位：人民币元

项目	本期末公允价值	采用的估值技术	不可观察输入值		
			名称	范围/加权平均值	与公允价值之间的关系
证券交易所上市但尚在限售期内的股票	292,091.02	平均价格亚式期权模型	预期波动率	0.4607-5.7444	负相关
项目	上年度末公允价值	采用的估值技术	不可观察输入值		
			名称	范围/加权平均值	与公允价值之间的关系
证券交易所上市但尚在限售期内的股票	150,199.99	平均价格亚式期权模型	预期波动率	0.1462-2.1752	负相关

7.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

于本期末，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融工具(上年度末：同)。

7.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

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

7.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

§8 投资组合报告

8.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	222,107,013.44	98.25
	其中：股票	222,107,013.44	98.25
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	22,463.47	0.01
	其中：债券	22,463.47	0.01
	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	3,830,278.72	1.69
8	其他各项资产	106,367.65	0.05
9	合计	226,066,123.28	100.00

注：上述股票投资金额包括可退替代款估值增值（如有）。

8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

8.2.1 报告期末指数投资按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	4,448,401.79	1.97
B	采矿业	2,835,524.69	1.26
C	制造业	162,622,247.52	72.04
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	2,857,877.20	1.27
E	建筑业	532,188.91	0.24
F	批发和零售业	1,905,101.50	0.84
G	交通运输、仓储和邮政业	3,494,813.48	1.55
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和	13,213,478.20	5.85

	信息技术服务业		
J	金融业	19,665,612.80	8.71
K	房地产业	2,075,469.24	0.92
L	租赁和商务服务业	2,953,007.02	1.31
M	科学研究和技术服务业	1,636,679.00	0.73
N	水利、环境和公共设施管理业	494,703.64	0.22
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	313,480.00	0.14
Q	卫生和社会工作	1,432,430.86	0.63
R	文化、体育和娱乐业	1,333,906.57	0.59
S	综合	-	-
	合计	221,814,922.42	98.26

8.2.2 报告期末积极投资按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	236,225.11	0.10
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	11,913.60	0.01
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	43,952.31	0.02
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	292,091.02	0.13

8.2.3 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

无。

8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

8.3.1 期末指数投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	300750	宁德时代	49,680	13,214,880.00	5.85
2	000333	美的集团	94,607	7,116,338.54	3.15
3	300059	东方财富	241,238	6,228,765.16	2.76
4	000858	五 粮 液	35,100	4,915,404.00	2.18
5	002594	比亚迪	16,400	4,635,624.00	2.05
6	000651	格力电器	84,300	3,831,435.00	1.70
7	002475	立讯精密	89,946	3,666,198.96	1.62
8	000725	京东方 A	642,800	2,821,892.00	1.25
9	300760	迈瑞医疗	10,400	2,652,000.00	1.17
10	000063	中兴通讯	61,500	2,484,600.00	1.10
11	002415	海康威视	72,950	2,239,565.00	0.99
12	002371	北方华创	5,500	2,150,500.00	0.95
13	300124	汇川技术	36,091	2,114,210.78	0.94
14	300308	中际旭创	17,028	2,103,128.28	0.93
15	300274	阳光电源	27,912	2,060,742.96	0.91
16	000001	平安银行	163,600	1,914,120.00	0.85
17	002714	牧原股份	48,406	1,860,726.64	0.82
18	000568	泸州老窖	14,500	1,815,400.00	0.80
19	000100	TCL 科技	350,940	1,765,228.20	0.78
20	002230	科大讯飞	35,975	1,738,312.00	0.77
21	300498	温氏股份	104,505	1,725,377.55	0.76
22	002352	顺丰控股	42,600	1,716,780.00	0.76
23	002142	宁波银行	66,117	1,607,304.27	0.71
24	300502	新易盛	12,161	1,405,568.38	0.62
25	002027	分众传媒	195,088	1,371,468.64	0.61
26	000338	潍柴动力	97,800	1,339,860.00	0.59
27	002625	光启技术	26,840	1,282,952.00	0.57
28	000425	徐工机械	161,100	1,277,523.00	0.57
29	002241	歌尔股份	47,800	1,233,718.00	0.55
30	000792	盐湖股份	74,800	1,231,208.00	0.55
31	300014	亿纬锂能	24,431	1,141,904.94	0.51
32	300033	同花顺	3,900	1,121,250.00	0.50

33	000625	长安汽车	82,914	1,107,731.04	0.49
34	300015	爱尔眼科	83,574	1,107,355.50	0.49
35	000977	浪潮信息	19,953	1,035,161.64	0.46
36	002463	沪电股份	25,950	1,028,917.50	0.46
37	002304	洋河股份	11,662	974,126.86	0.43
38	000002	万科 A	129,800	942,348.00	0.42
39	300408	三环集团	24,400	939,644.00	0.42
40	000938	紫光股份	33,647	936,396.01	0.41
41	002050	三花智控	39,500	928,645.00	0.41
42	000166	申万宏源	170,660	913,031.00	0.40
43	000776	广发证券	54,700	886,687.00	0.39
44	000538	云南白药	14,360	860,882.00	0.38
45	002179	中航光电	21,724	853,753.20	0.38
46	300433	蓝思科技	37,659	824,732.10	0.37
47	002049	紫光国微	12,680	816,211.60	0.36
48	002028	思源电气	11,100	806,970.00	0.36
49	002460	赣锋锂业	21,290	745,362.90	0.33
50	300339	润和软件	14,800	740,444.00	0.33
51	002311	海大集团	15,080	739,674.00	0.33
52	002384	东山精密	24,600	718,320.00	0.32
53	000768	中航西飞	25,100	708,824.00	0.31
54	000988	华工科技	16,300	705,790.00	0.31
55	001979	招商蛇口	66,301	678,922.24	0.30
56	002422	科伦药业	22,500	673,425.00	0.30
57	002456	欧菲光	55,100	660,098.00	0.29
58	002466	天齐锂业	19,900	656,700.00	0.29
59	301236	软通动力	11,050	648,745.50	0.29
60	002001	新 和 成	29,417	646,291.49	0.29
61	002252	上海莱士	88,520	639,114.40	0.28
62	000157	中联重科	88,000	636,240.00	0.28
63	002156	通富微电	21,300	629,415.00	0.28
64	002648	卫星化学	33,462	628,750.98	0.28
65	002797	第一创业	74,920	625,582.00	0.28
66	300418	昆仑万维	16,100	619,528.00	0.27
67	002340	格林美	93,320	609,379.60	0.27
68	002736	国信证券	53,000	593,600.00	0.26
69	000661	长春高新	5,960	592,662.40	0.26
70	300782	卓胜微	6,553	587,804.10	0.26
71	002236	大华股份	36,700	587,200.00	0.26
72	300207	欣旺达	26,300	586,753.00	0.26
73	300122	智飞生物	21,950	577,285.00	0.26
74	002185	华天科技	49,674	576,715.14	0.26
75	000066	中国长城	38,804	565,374.28	0.25

76	300347	泰格医药	10,350	565,317.00	0.25
77	300442	润泽科技	10,800	561,168.00	0.25
78	003816	中国广核	134,900	557,137.00	0.25
79	002920	德赛西威	5,000	550,550.00	0.24
80	000423	东阿阿胶	8,700	545,664.00	0.24
81	000807	云铝股份	40,300	545,259.00	0.24
82	002180	纳思达	19,200	540,864.00	0.24
83	300394	天孚通信	5,900	539,024.00	0.24
84	000786	北新建材	17,700	536,487.00	0.24
85	000895	双汇发展	20,600	534,776.00	0.24
86	002601	龙佰集团	29,600	523,032.00	0.23
87	002202	金风科技	50,436	521,003.88	0.23
88	002273	水晶光电	23,314	518,037.08	0.23
89	001965	招商公路	36,700	511,965.00	0.23
90	000963	华东医药	14,695	508,447.00	0.23
91	000975	山金国际	32,977	506,856.49	0.22
92	002129	TCL 中环	56,850	504,259.50	0.22
93	000933	神火股份	29,800	503,620.00	0.22
94	002493	荣盛石化	55,125	498,881.25	0.22
95	002966	苏州银行	60,900	493,899.00	0.22
96	002851	麦格米特	8,000	491,680.00	0.22
97	002085	万丰奥威	25,756	488,076.20	0.22
98	000596	古井贡酒	2,800	485,240.00	0.21
99	002281	光迅科技	9,300	485,181.00	0.21
100	300661	圣邦股份	5,922	484,301.16	0.21
101	300896	爱美客	2,640	481,800.00	0.21
102	300476	胜宏科技	11,400	479,826.00	0.21
103	002459	晶澳科技	34,832	478,940.00	0.21
104	002271	东方雨虹	36,753	477,053.94	0.21
105	002916	深南电路	3,784	473,000.00	0.21
106	300803	指南针	4,900	470,155.00	0.21
107	002517	恺英网络	34,400	468,184.00	0.21
108	002938	鹏鼎控股	12,600	459,648.00	0.20
109	002078	太阳纸业	30,700	456,509.00	0.20
110	300759	康龙化成	17,750	456,175.00	0.20
111	300058	蓝色光标	49,119	455,824.32	0.20
112	002709	天赐材料	23,092	455,374.24	0.20
113	300474	景嘉微	4,850	453,426.50	0.20
114	002074	国轩高科	21,190	449,651.80	0.20
115	300832	新产业	6,300	446,355.00	0.20
116	002555	三七互娱	28,300	442,612.00	0.20
117	002600	领益智造	54,500	436,000.00	0.19
118	002738	中矿资源	12,280	435,940.00	0.19

119	002444	巨星科技	13,400	433,490.00	0.19
120	000630	铜陵有色	133,900	432,497.00	0.19
121	000728	国元证券	51,350	429,286.00	0.19
122	002353	杰瑞股份	11,600	429,084.00	0.19
123	300757	罗博特科	1,900	428,108.00	0.19
124	300450	先导智能	21,300	426,426.00	0.19
125	002532	天山铝业	54,100	425,767.00	0.19
126	301269	华大九天	3,500	423,850.00	0.19
127	002223	鱼跃医疗	11,530	420,729.70	0.19
128	300017	网宿科技	39,652	419,121.64	0.19
129	002138	顺络电子	13,300	418,684.00	0.19
130	000999	华润三九	9,397	416,662.98	0.18
131	300002	神州泰岳	35,600	412,604.00	0.18
132	002405	四维图新	42,650	411,146.00	0.18
133	300024	机器人	22,866	410,444.70	0.18
134	300223	北京君正	6,000	409,200.00	0.18
135	300866	安克创新	4,180	408,135.20	0.18
136	300496	中科创达	6,800	405,008.00	0.18
137	002195	岩山科技	101,464	402,812.08	0.18
138	000783	长江证券	58,900	401,698.00	0.18
139	000983	山西焦煤	48,610	400,546.40	0.18
140	000408	藏格矿业	14,400	399,312.00	0.18
141	002008	大族激光	15,900	397,500.00	0.18
142	300136	信维通信	15,620	397,372.80	0.18
143	002595	豪迈科技	7,900	396,501.00	0.18
144	002465	海格通信	36,100	396,378.00	0.18
145	300114	中航电测	5,500	394,790.00	0.17
146	000301	东方盛虹	48,000	394,080.00	0.17
147	002472	双环传动	12,700	388,874.00	0.17
148	002673	西部证券	47,466	386,847.90	0.17
149	300383	光环新网	26,500	386,635.00	0.17
150	300316	晶盛机电	11,980	382,162.00	0.17
151	002157	正邦科技	130,600	381,352.00	0.17
152	300142	沃森生物	31,300	378,104.00	0.17
153	002128	电投能源	19,100	373,978.00	0.17
154	000831	中国稀土	13,200	370,260.00	0.16
155	000876	新希望	40,900	367,282.00	0.16
156	300346	南大光电	9,480	365,833.20	0.16
157	002812	恩捷股份	11,370	363,726.30	0.16
158	300999	金龙鱼	11,000	358,710.00	0.16
159	000021	深科技	18,766	357,679.96	0.16
160	300699	光威复材	10,184	352,875.60	0.16
161	300037	新宙邦	9,360	350,438.40	0.16

162	000528	柳工	28,980	349,498.80	0.15
163	301358	湖南裕能	7,700	348,964.00	0.15
164	002837	英维克	8,600	347,440.00	0.15
165	300054	鼎龙股份	13,300	346,066.00	0.15
166	002131	利欧股份	111,634	344,949.06	0.15
167	000750	国海证券	80,465	344,390.20	0.15
168	300604	长川科技	7,800	344,214.00	0.15
169	000400	许继电气	12,500	344,125.00	0.15
170	300458	全志科技	8,864	343,568.64	0.15
171	300628	亿联网络	8,890	343,154.00	0.15
172	001696	宗申动力	13,600	338,640.00	0.15
173	300012	华测检测	27,100	336,853.00	0.15
174	000617	中油资本	48,720	335,680.80	0.15
175	002850	科达利	3,400	332,112.00	0.15
176	002007	华兰生物	19,660	331,271.00	0.15
177	002821	凯莱英	4,340	330,230.60	0.15
178	000733	振华科技	7,700	324,709.00	0.14
179	000878	云南铜业	26,600	324,254.00	0.14
180	300413	芒果超媒	12,030	323,486.70	0.14
181	000034	神州数码	9,200	322,460.00	0.14
182	300724	捷佳伟创	5,100	322,371.00	0.14
183	002436	兴森科技	28,900	321,079.00	0.14
184	300073	当升科技	7,800	314,184.00	0.14
185	000932	华菱钢铁	75,160	314,168.80	0.14
186	002607	中公教育	92,200	313,480.00	0.14
187	002409	雅克科技	5,400	312,930.00	0.14
188	002410	广联达	26,580	312,580.80	0.14
189	300459	汤姆猫	54,080	310,419.20	0.14
190	300857	协创数据	2,900	309,981.00	0.14
191	300395	菲利华	8,200	308,402.00	0.14
192	300001	特锐德	13,900	305,105.00	0.14
193	300679	电连技术	5,100	304,470.00	0.13
194	000623	吉林敖东	17,420	300,843.40	0.13
195	002558	巨人网络	23,600	299,484.00	0.13
196	300751	迈为股份	2,844	299,046.60	0.13
197	002065	东华软件	40,800	296,208.00	0.13
198	000738	航发控制	13,300	295,792.00	0.13
199	002312	川发龙蟒	20,400	295,188.00	0.13
200	300919	中伟股份	8,120	293,294.40	0.13
201	300623	捷捷微电	8,550	292,068.00	0.13
202	002152	广电运通	24,950	290,917.00	0.13
203	300144	宋城演艺	31,051	288,463.79	0.13
204	000997	新 大 陆	14,450	288,277.50	0.13

205	002739	万达电影	23,700	287,718.00	0.13
206	002294	信立泰	9,300	287,649.00	0.13
207	002318	久立特材	12,200	285,602.00	0.13
208	000415	渤海租赁	75,100	283,127.00	0.13
209	000009	中国宝安	30,772	281,563.80	0.12
210	002568	百润股份	10,048	281,444.48	0.12
211	300627	华测导航	6,700	280,060.00	0.12
212	000683	远兴能源	50,100	280,059.00	0.12
213	300666	江丰电子	4,000	277,800.00	0.12
214	300364	中文在线	11,300	277,189.00	0.12
215	002402	和而泰	15,300	277,083.00	0.12
216	002126	银轮股份	14,800	277,056.00	0.12
217	000039	中集集团	35,640	276,922.80	0.12
218	000729	燕京啤酒	23,000	276,920.00	0.12
219	002064	华峰化学	33,400	273,212.00	0.12
220	000513	丽珠集团	7,167	272,346.00	0.12
221	002624	完美世界	26,350	272,195.50	0.12
222	002841	视源股份	7,320	270,181.20	0.12
223	300454	深信服	4,700	269,780.00	0.12
224	300558	贝达药业	5,000	269,650.00	0.12
225	300003	乐普医疗	23,726	269,052.84	0.12
226	002984	森麒麟	10,860	267,807.60	0.12
227	002385	大北农	61,350	265,645.50	0.12
228	300763	锦浪科技	4,340	265,043.80	0.12
229	000426	兴业银锡	23,600	262,432.00	0.12
230	000960	锡业股份	18,621	261,252.63	0.12
231	002025	航天电器	5,370	260,767.20	0.12
232	300088	长信科技	39,600	258,984.00	0.11
233	002044	美年健康	56,304	258,435.36	0.11
234	300390	天华新能	11,180	257,699.00	0.11
235	300285	国瓷材料	15,100	257,304.00	0.11
236	000799	酒鬼酒	4,600	255,852.00	0.11
237	002262	恩华药业	10,500	255,675.00	0.11
238	300296	利亚德	39,050	251,482.00	0.11
239	002958	青农商行	82,500	250,800.00	0.11
240	000099	中信海直	9,500	250,420.00	0.11
241	002432	九安医疗	6,100	248,758.00	0.11
242	300182	捷成股份	42,334	248,500.58	0.11
243	300253	卫宁健康	34,647	248,072.52	0.11
244	002155	湖南黄金	15,700	246,961.00	0.11
245	300529	健帆生物	8,380	245,869.20	0.11
246	300115	长盈精密	15,136	245,808.64	0.11
247	000766	通化金马	15,600	244,920.00	0.11

248	000591	太阳能	51,300	244,188.00	0.11
249	002407	多氟多	20,320	243,840.00	0.11
250	300373	扬杰科技	5,600	243,712.00	0.11
251	002603	以岭药业	15,124	242,135.24	0.11
252	002429	兆驰股份	41,800	241,604.00	0.11
253	000723	美锦能源	53,300	240,383.00	0.11
254	000629	钒钛股份	83,400	240,192.00	0.11
255	000703	恒逸石化	38,166	239,682.48	0.11
256	002500	山西证券	37,380	234,746.40	0.10
257	300567	精测电子	3,650	234,695.00	0.10
258	002926	华西证券	28,100	233,511.00	0.10
259	000519	中兵红箭	16,100	232,645.00	0.10
260	300487	蓝晓科技	4,850	232,169.50	0.10
261	300251	光线传媒	24,580	232,035.20	0.10
262	002414	高德红外	31,201	231,823.43	0.10
263	002203	海亮股份	21,500	231,125.00	0.10
264	002497	雅化集团	19,700	230,490.00	0.10
265	300146	汤臣倍健	19,100	230,155.00	0.10
266	002756	永兴材料	6,070	228,960.40	0.10
267	300568	星源材质	23,542	228,828.24	0.10
268	000921	海信家电	7,900	228,310.00	0.10
269	300979	华利集团	2,900	228,085.00	0.10
270	000830	鲁西化工	19,500	227,955.00	0.10
271	002683	广东宏大	8,600	227,728.00	0.10
272	000060	中金岭南	48,200	226,058.00	0.10
273	300229	拓尔思	10,700	224,058.00	0.10
274	002617	露笑科技	29,100	222,615.00	0.10
275	002389	航天彩虹	12,300	222,015.00	0.10
276	002506	协鑫集成	82,900	221,343.00	0.10
277	002151	北斗星通	8,250	218,955.00	0.10
278	002176	江特电机	29,400	217,854.00	0.10
279	000050	深天马 A	24,000	216,720.00	0.10
280	300432	富临精工	14,000	215,320.00	0.10
281	000998	隆平高科	19,200	214,464.00	0.10
282	002145	中核钛白	50,565	214,395.60	0.09
283	000636	风华高科	14,900	213,815.00	0.09
284	000686	东北证券	26,920	213,744.80	0.09
285	300212	易华录	9,100	212,940.00	0.09
286	000628	高新发展	3,400	211,786.00	0.09
287	000893	亚钾国际	10,500	211,680.00	0.09
288	002439	启明星辰	13,300	210,406.00	0.09
289	300677	英科医疗	8,280	209,318.40	0.09
290	300748	金力永磁	11,696	209,124.48	0.09

291	002939	长城证券	25,500	209,100.00	0.09
292	002507	涪陵榨菜	14,770	208,700.10	0.09
293	000563	陕国投 A	57,900	206,124.00	0.09
294	300118	东方日升	17,200	206,056.00	0.09
295	000887	中鼎股份	15,700	205,984.00	0.09
296	300601	康泰生物	11,960	205,114.00	0.09
297	300674	宇信科技	10,480	204,569.60	0.09
298	300070	碧水源	40,414	204,494.84	0.09
299	300735	光弘科技	7,300	204,327.00	0.09
300	002373	千方科技	20,100	203,814.00	0.09
301	002936	郑州银行	96,646	202,956.60	0.09
302	002831	裕同科技	7,420	201,082.00	0.09
303	002245	蔚蓝锂芯	18,800	200,972.00	0.09
304	000875	吉电股份	38,200	200,932.00	0.09
305	002056	横店东磁	15,500	200,880.00	0.09
306	000951	中国重汽	11,660	197,986.80	0.09
307	002423	中粮资本	14,700	196,833.00	0.09
308	300438	鹏辉能源	7,000	196,770.00	0.09
309	300777	中简科技	6,900	195,201.00	0.09
310	002003	伟星股份	13,700	194,129.00	0.09
311	002701	奥瑞金	34,100	193,347.00	0.09
312	300676	华大基因	4,600	193,062.00	0.09
313	000818	航锦科技	10,100	192,910.00	0.09
314	002698	博实股份	11,300	192,100.00	0.09
315	000598	兴蓉环境	25,300	192,027.00	0.09
316	002430	杭氧股份	8,800	191,840.00	0.08
317	300765	新诺威	7,200	191,448.00	0.08
318	000970	中科三环	18,445	191,274.65	0.08
319	002120	韵达股份	25,429	191,226.08	0.08
320	002572	索菲亚	11,108	190,835.44	0.08
321	000581	威孚高科	10,100	190,688.00	0.08
322	002508	老板电器	8,890	190,512.70	0.08
323	002240	盛新锂能	13,800	190,164.00	0.08
324	002747	埃斯顿	10,200	188,700.00	0.08
325	000739	普洛药业	11,600	188,616.00	0.08
326	000422	湖北宜化	14,900	188,038.00	0.08
327	000069	华侨城 A	70,400	187,968.00	0.08
328	300009	安科生物	21,686	187,367.04	0.08
329	000403	派林生物	8,800	185,944.00	0.08
330	000708	中信特钢	16,290	185,868.90	0.08
331	002368	太极股份	7,811	184,964.48	0.08
332	002249	大洋电机	31,500	184,905.00	0.08
333	000958	电投产融	29,600	184,408.00	0.08

334	300294	博雅生物	6,050	183,194.00	0.08
335	002484	江海股份	10,400	182,832.00	0.08
336	000778	新兴铸管	47,600	182,784.00	0.08
337	002244	滨江集团	21,100	181,671.00	0.08
338	000547	航天发展	24,700	180,557.00	0.08
339	300672	国科微	2,700	180,225.00	0.08
340	002268	电科网安	11,060	179,725.00	0.08
341	300595	欧普康视	9,440	178,888.00	0.08
342	301050	雷电微力	3,460	178,466.80	0.08
343	000762	西藏矿业	8,300	178,450.00	0.08
344	002221	东华能源	18,800	178,412.00	0.08
345	300638	广和通	8,760	176,514.00	0.08
346	300773	拉卡拉	9,900	175,230.00	0.08
347	002080	中材科技	13,380	175,010.40	0.08
348	300573	兴齐眼药	2,500	174,450.00	0.08
349	002270	华明装备	10,200	172,278.00	0.08
350	002557	洽洽食品	5,900	171,395.00	0.08
351	000883	湖北能源	34,100	169,818.00	0.08
352	000682	东方电子	15,700	168,147.00	0.07
353	300475	香农芯创	5,900	168,091.00	0.07
354	300775	三角防务	6,700	167,031.00	0.07
355	300456	赛微电子	9,700	166,646.00	0.07
356	002653	海思科	5,000	166,250.00	0.07
357	000709	河钢股份	75,000	165,750.00	0.07
358	000810	创维数字	10,400	165,568.00	0.07
359	000155	川能动力	15,400	164,472.00	0.07
360	301308	江波龙	1,900	163,400.00	0.07
361	002544	普天科技	7,600	162,868.00	0.07
362	002299	圣农发展	11,200	162,176.00	0.07
363	300776	帝尔激光	2,540	161,493.20	0.07
364	000690	宝新能源	35,500	159,040.00	0.07
365	002317	众生药业	13,000	157,950.00	0.07
366	002745	木林森	18,100	157,832.00	0.07
367	002487	大金重工	7,700	157,773.00	0.07
368	000627	天茂集团	33,400	155,978.00	0.07
369	000543	皖能电力	19,700	155,827.00	0.07
370	000027	深圳能源	23,940	155,131.20	0.07
371	300298	三诺生物	6,000	154,860.00	0.07
372	000987	越秀资本	22,035	154,685.70	0.07
373	300769	德方纳米	4,192	154,600.96	0.07
374	300026	红日药业	40,500	153,495.00	0.07
375	002372	伟星新材	12,140	153,328.20	0.07
376	002183	怡 亚 通	34,100	153,109.00	0.07

377	000877	天山股份	26,900	152,254.00	0.07
378	300888	稳健医疗	3,580	150,646.40	0.07
379	000035	中国天楹	30,800	149,996.00	0.07
380	003031	中瓷电子	2,860	149,835.40	0.07
381	002019	亿帆医药	13,900	149,008.00	0.07
382	000429	粤高速 A	10,100	148,470.00	0.07
383	000559	万向钱潮	23,928	147,157.20	0.07
384	301301	川宁生物	12,400	147,064.00	0.07
385	000825	太钢不锈	41,900	145,812.00	0.06
386	002675	东诚药业	11,900	145,418.00	0.06
387	002948	青岛银行	37,310	144,762.80	0.06
388	002597	金禾实业	6,300	143,829.00	0.06
389	002032	苏 泊 尔	2,700	143,667.00	0.06
390	000062	深圳华强	6,405	143,472.00	0.06
391	000032	深桑达 A	8,100	142,884.00	0.06
392	002670	国盛金控	10,893	142,589.37	0.06
393	002865	钧达股份	2,779	142,006.90	0.06
394	300034	钢研高纳	9,100	141,960.00	0.06
395	000902	新洋丰	10,802	140,858.08	0.06
396	002266	浙富控股	44,940	140,212.80	0.06
397	002531	天顺风能	17,700	140,007.00	0.06
398	000785	居然智家	39,000	139,230.00	0.06
399	001286	陕西能源	14,800	137,344.00	0.06
400	002832	比音勒芬	6,400	137,024.00	0.06
401	001227	兰州银行	55,300	136,038.00	0.06
402	002091	江苏国泰	18,400	134,688.00	0.06
403	300910	瑞丰新材	2,800	133,252.00	0.06
404	300633	开立医疗	4,500	132,255.00	0.06
405	002906	华阳集团	4,300	132,225.00	0.06
406	002015	协鑫能科	17,000	131,920.00	0.06
407	300682	朗新集团	10,800	131,760.00	0.06
408	002541	鸿路钢构	7,230	129,633.90	0.06
409	002643	万润股份	10,800	129,600.00	0.06
410	300457	赢合科技	6,750	129,195.00	0.06
411	000156	华数传媒	17,900	128,880.00	0.06
412	000800	一汽解放	15,600	127,920.00	0.06
413	000937	冀中能源	20,190	127,600.80	0.06
414	002773	康弘药业	6,460	126,616.00	0.06
415	002408	齐翔腾达	24,880	125,146.40	0.06
416	000012	南玻 A	23,539	124,285.92	0.06
417	301029	怡合达	5,012	123,896.64	0.05
418	000089	深圳机场	17,800	122,642.00	0.05
419	002468	申通快递	12,100	122,573.00	0.05

420	000582	北部湾港	15,500	122,140.00	0.05
421	000555	神州信息	10,800	120,960.00	0.05
422	300957	贝泰妮	2,800	119,532.00	0.05
423	000537	中绿电	13,100	119,472.00	0.05
424	000552	甘肃能化	42,400	116,600.00	0.05
425	300747	锐科激光	6,012	115,189.92	0.05
426	002867	周大生	7,900	114,787.00	0.05
427	002048	宁波华翔	9,000	113,580.00	0.05
428	300482	万孚生物	4,980	111,601.80	0.05
429	002153	石基信息	15,512	110,755.68	0.05
430	002237	恒邦股份	10,800	109,080.00	0.05
431	301039	中集车辆	12,000	108,600.00	0.05
432	300357	我武生物	5,340	108,508.80	0.05
433	002737	葵花药业	5,200	106,548.00	0.05
434	002010	传化智联	23,200	105,096.00	0.05
435	300761	立华股份	5,360	104,305.60	0.05
436	002518	科士达	4,600	103,638.00	0.05
437	000401	冀东水泥	19,600	102,508.00	0.05
438	000967	盈峰环境	20,400	101,388.00	0.04
439	002099	海翔药业	19,600	101,136.00	0.04
440	301165	锐捷网络	1,400	101,080.00	0.04
441	000898	鞍钢股份	42,052	100,924.80	0.04
442	000927	中国铁物	38,100	100,203.00	0.04
443	002563	森马服饰	14,200	99,684.00	0.04
444	300171	东富龙	7,500	99,600.00	0.04
445	000028	国药一致	3,390	99,157.50	0.04
446	301219	腾远钴业	2,150	97,201.50	0.04
447	002081	金 螳 螂	26,863	95,900.91	0.04
448	001287	中电港	4,700	95,457.00	0.04
449	001872	招商港口	4,600	94,162.00	0.04
450	301498	乖宝宠物	1,200	93,984.00	0.04
451	301095	广立微	1,800	93,726.00	0.04
452	000737	北方铜业	11,800	92,040.00	0.04
453	000930	中粮科技	16,500	91,575.00	0.04
454	301155	海力风电	1,700	90,627.00	0.04
455	002690	美亚光电	6,000	88,920.00	0.04
456	002608	江苏国信	11,500	88,205.00	0.04
457	301035	润丰股份	1,800	87,696.00	0.04
458	003035	南网能源	20,400	85,272.00	0.04
459	003022	联泓新科	6,190	85,236.30	0.04
460	002511	中顺洁柔	12,500	85,125.00	0.04
461	001914	招商积余	8,000	84,560.00	0.04
462	002945	华林证券	5,500	84,315.00	0.04

463	002925	盈趣科技	5,280	82,684.80	0.04
464	002705	新宝股份	5,500	82,500.00	0.04
465	002727	一心堂	6,300	82,026.00	0.04
466	000966	长源电力	17,200	81,700.00	0.04
467	002060	广东建工	22,300	81,618.00	0.04
468	300726	宏达电子	2,600	80,860.00	0.04
469	000959	首钢股份	26,200	79,910.00	0.04
470	002320	海峡股份	12,068	79,045.40	0.04
471	002498	汉缆股份	22,300	75,597.00	0.03
472	002216	三全食品	6,220	74,640.00	0.03
473	301487	盟固利	3,500	74,445.00	0.03
474	000539	粤电力 A	16,300	73,839.00	0.03
475	300140	节能环境	12,200	73,078.00	0.03
476	300821	东岳硅材	9,400	72,944.00	0.03
477	000088	盐 田 港	14,700	71,589.00	0.03
478	002461	珠江啤酒	7,100	70,219.00	0.03
479	001203	大中矿业	8,100	70,146.00	0.03
480	000935	四川双马	4,800	69,504.00	0.03
481	301589	诺瓦星云	400	69,440.00	0.03
482	300257	开山股份	7,600	69,312.00	0.03
483	301238	瑞泰新材	4,400	68,904.00	0.03
484	300428	立中集团	4,200	68,460.00	0.03
485	301267	华厦眼科	3,500	66,640.00	0.03
486	000688	国城矿业	5,600	66,584.00	0.03
487	000567	海德股份	9,600	65,568.00	0.03
488	301536	星宸科技	800	63,920.00	0.03
489	001213	中铁特货	15,300	63,801.00	0.03
490	300861	美畅股份	3,080	61,446.00	0.03
491	002096	易普力	5,000	59,400.00	0.03
492	301015	百洋医药	2,400	58,104.00	0.03
493	002791	坚朗五金	2,300	52,302.00	0.02
494	000869	张 裕 A	2,200	51,018.00	0.02
495	301207	华兰疫苗	2,800	49,028.00	0.02
496	001308	康冠科技	1,580	43,450.00	0.02
497	001289	龙源电力	2,700	42,417.00	0.02
498	001389	广合科技	800	40,240.00	0.02
499	002901	大博医疗	1,300	40,092.00	0.02
500	002978	安宁股份	1,400	39,788.00	0.02

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	301626	苏州天脉	957	62,951.46	0.03
2	301611	珂玛科技	695	38,989.50	0.02

3	301551	无线传媒	652	28,185.96	0.01
4	301522	上大股份	816	20,269.44	0.01
5	301556	托普云农	267	15,766.35	0.01
6	301571	国科天成	350	14,290.50	0.01
7	301622	英思特	306	13,745.52	0.01
8	001391	国货航	1,752	11,913.60	0.01
9	301586	佳力奇	215	11,425.10	0.01
10	301631	壹连科技	102	10,399.92	0.00
11	301607	富特科技	257	9,287.98	0.00
12	301617	博苑股份	232	9,231.28	0.00
13	301606	绿联科技	235	8,575.15	0.00
14	301552	科力装备	143	8,132.41	0.00
15	301585	蓝宇股份	210	7,528.50	0.00
16	301608	博实结	114	7,453.32	0.00
17	001279	强邦新材	265	7,396.15	0.00
18	301603	乔锋智能	156	6,548.88	0.00

8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

8.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	300750	宁德时代	808,055.00	0.51
2	002594	比亚迪	781,379.00	0.49
3	002157	正邦科技	404,511.00	0.25
4	300757	罗博特科	374,974.00	0.24
5	001696	宗申动力	371,489.00	0.23
6	300760	迈瑞医疗	366,551.00	0.23
7	300339	润和软件	359,248.00	0.23
8	000596	古井贡酒	357,188.00	0.22
9	300896	爱美客	325,243.00	0.20
10	000415	渤海租赁	300,100.00	0.19
11	300857	协创数据	298,531.00	0.19
12	300627	华测导航	275,390.00	0.17
13	000766	通化金马	267,265.00	0.17
14	002432	九安医疗	258,781.00	0.16
15	000099	中信海直	254,551.00	0.16
16	300033	同花顺	254,077.00	0.16
17	002126	银轮股份	253,905.00	0.16
18	000333	美的集团	234,136.00	0.15
19	301358	湖南裕能	232,253.00	0.15
20	000858	五 粮 液	228,675.00	0.14

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

8.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	301522	上大股份	590,068.10	0.37
2	002602	ST 华通	518,585.03	0.33
3	300760	迈瑞医疗	447,373.00	0.28
4	001279	强邦新材	418,708.29	0.26
5	301556	托普云农	338,876.52	0.21
6	301626	苏州天脉	299,199.67	0.19
7	000333	美的集团	269,552.00	0.17
8	002371	北方华创	233,396.00	0.15
9	000858	五 粮 液	231,676.00	0.15
10	002594	比亚迪	226,827.00	0.14
11	300896	爱美客	222,481.00	0.14
12	000651	格力电器	221,627.00	0.14
13	300308	中际旭创	218,399.00	0.14
14	300750	宁德时代	214,434.00	0.13
15	000596	古井贡酒	214,389.00	0.13
16	301611	珂玛科技	212,064.90	0.13
17	300124	汇川技术	206,298.00	0.13
18	002192	融捷股份	191,770.00	0.12
19	301551	无线传媒	187,061.60	0.12
20	301617	博苑股份	181,877.04	0.11

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

8.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	26,917,884.38
卖出股票收入（成交）总额	22,565,885.83

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

8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

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）	22,463.47	0.01
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	22,463.47	0.01

8.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

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	127107	领益转债	178	22,463.47	0.01

8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

无。

8.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

无。

8.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

无。

8.10 本基金投资股指期货的投资政策

无。

8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

8.11.1 本期国债期货投资政策

无。

8.11.2 本期国债期货投资评价

无。

8.12 投资组合报告附注

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

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

8.12.2 基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库

本基金投资的前十名股票未超出基金合同规定的备选股票库。

8.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	91,441.04
2	应收清算款	14,926.61

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	106,367.65

8.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

无。

8.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

8.12.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

无。

8.12.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值	占基金资产净值比例（%）	流通受限情况说明
1	301626	苏州天脉	62,951.46	0.03	新股锁定
2	301611	珂玛科技	38,989.50	0.02	新股锁定
3	301551	无线传媒	28,185.96	0.01	新股锁定
4	301522	上大股份	20,269.44	0.01	新股锁定
5	301556	托普云农	15,766.35	0.01	新股锁定

8.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入原因，分项之和与合计可能有尾差。

§9 基金份额持有人信息

9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

持有人户数（户）	户均持有的基金份额	持有人结构			
		机构投资者		个人投资者	
		持有份额	占总份额比例（%）	持有份额	占总份额比例（%）
8,132	24,991.38	19,510,935.00	9.60	183,718,987.00	90.40

注：持有人户数为有效户数，即存量份额大于零的账户数。

9.2 期末上市基金前十名持有人

序号	持有人名称	持有份额（份）	占上市总份额比例（%）

1	胡雷	9,656,400.00	4.75
2	卢光青	6,169,900.00	3.04
3	广发证券股份有限公司	4,454,154.00	2.19
4	中信建投证券股份有限公司	3,507,481.00	1.73
5	杨志远	3,021,300.00	1.49
6	王小林	2,611,800.00	1.29
7	宁波安联国际集装箱储运有限公司	2,361,700.00	1.16
8	吴少平	2,119,200.00	1.04
9	伍琼	1,679,600.00	0.83
10	刘小彦	1,551,750.00	0.76

注：以上数据由中国证券登记结算有限公司提供，持有人为场内持有人。

9.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

无。

9.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

项目	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和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

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

无。

§10 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2015 年 6 月 5 日）基金份额总额	2,384,588,069.00
本报告期期初基金份额总额	161,229,922.00
本报告期基金总申购份额	318,000,000.00
减：本报告期基金总赎回份额	276,000,000.00
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	203,229,922.00

§11 重大事件揭示

11.1 基金份额持有人大会决议

无。

11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

一、基金管理人的重大人事变动

2024 年 10 月 10 日，公司召开大成基金管理有限公司 2024 年第一次临时股东会，会议审议通过《关于卢锋先生辞去公司第八届董事会独立董事职务的议案》，同意卢锋先生自股东会决议作出之日起辞去公司第八届董事会独立董事及董事会下属审计委员会主任委员、合规与风险管理委员会委员、战略与提名薪酬考核委员会委员职务，不再履行上述职责。

二、基金托管人的基金托管部门的重大人事变动

无。

11.3 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。

11.4 基金投资策略的改变

本基金投资策略在本报告期内没有重大改变。

11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金自基金合同生效日起聘请普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）为本基金提供审计服务，自 2024 年 12 月 11 日起，改聘安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）为本基金提供审计服务至今，本年度应支付的审计费用为 45,000.00 元。

11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

11.6.1 管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，基金管理人及其相关高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

11.6.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

无。

11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

11.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例(%)	佣金	占当期佣金总量的比例(%)	
光大证券	2	45,825,610.17	95.10	4,583.41	67.45	-
华泰证券	1	2,276,683.48	4.72	2,130.90	31.36	-
天风证券	1	86,559.81	0.18	81.01	1.19	退租

						1 个
爱建证券	1	-	-	-	-	-
财通证券	1	-	-	-	-	-
川财证券	0	-	-	-	-	退租 1 个
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	0	-	-	-	-	退租 1 个
方正证券	1	-	-	-	-	-
高盛中国证券	1	-	-	-	-	-
广发证券	2	-	-	-	-	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	0	-	-	-	-	退租 1 个
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	-	-	-	-	退租 1 个
万和证券	1	-	-	-	-	-
西部证券	1	-	-	-	-	-
湘财证券	0	-	-	-	-	退租 1 个
信达证券	1	-	-	-	-	退租 1 个
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	3	-	-	-	-	退租 1 个
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	0	-	-	-	-	退租 1 个

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和流程如下:

（一）筛选标准

大成基金管理有限公司（以下简称“公司”）严格按照《公开募集证券投资基金证券交易费用管理规定》要求制定了证券公司筛选标准，建立了证券公司尽职调查、证券公司负面筛查、备选池筛选机制，选择财务状况良好，经营行为规范，合规风控能力和交易、研究等服务能力较强的证券公司参与证券交易。

（二）筛选流程

1、经公司尽调符合条件的证券公司进入备选池，由股票投委会以公平、公正、公开为原则，结合定性及定量办法科学评估证券公司研究服务能力，形成证券公司白名单，并定期及不定期进行动态调整。

2、公司按照白名单与证券公司进行协议签署。

11.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

无。

11.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	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 12 月 31 日
2	大成基金管理有限公司旗下部分 ETF 基金新增东兴证券股份有限公司为申购赎回代办证券公司的公告	中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站	2024 年 12 月 24 日
3	关于大成基金旗下部分交易型开放式	中国证监会基金电子披	2024 年 12 月 23 日

	指数证券投资基金增加长城证券股份有限公司为申购赎回代办证券公司的公告	露网站、规定报刊及本公司网站	
4	大成基金管理有限公司关于旗下部分基金改聘会计师事务所的公告	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 12 月 12 日
5	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 12 月 12 日
6	大成基金管理有限公司关于暂停武汉佰鲲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 10 月 28 日
7	大成深证成份交易型开放式指数证券投资基金 2024 年第 3 季度报告	中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站	2024 年 10 月 25 日
8	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	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 8 月 30 日
9	大成基金管理有限公司旗下部分 ETF 基金新增平安证券股份有限公司为申购赎回代办证券公司的公告	中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站	2024 年 7 月 30 日
10	大成深证成份交易型开放式指数证券投资基金 2024 年第 2 季度报告	中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站	2024 年 7 月 19 日
11	大成基金管理有限公司旗下部分 ETF 基金新增联储证券股份有限公司为申购赎回代办证券公司的公告	中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站	2024 年 7 月 17 日
12	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 7 月 5 日
13	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
14	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
15	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
16	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
17	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	中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本	2024 年 6 月 12 日

	的公告	公司网站	
18	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
19	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
20	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
21	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
22	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
23	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
24	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
25	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
26	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

§12 影响投资者决策的其他重要信息

12.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

无。

12.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§13 备查文件目录

13.1 备查文件目录

1、中国证监会批准设立大成深证成份交易型开放式指数证券投资基金的文件；

2、《大成深证成份交易型开放式指数证券投资基金基金合同》；

3、《大成深证成份交易型开放式指数证券投资基金托管协议》；

4、大成基金管理有限公司批准文件、营业执照、公司章程；

5、本报告期内在规定报刊上披露的各种公告原稿。

13.2 存放地点

备查文件存放在本基金管理人和托管人的住所。

13.3 查阅方式

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

大成基金管理有限公司

2025 年 3 月 31 日