大成深证成份交易型开放式指数证券投资基金
2025 年中期报告

2025 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：2025 年 8 月 29 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 2025 年 08 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。

本报告财务资料未经审计。

本报告期自 2025 年 01 月 01 日起至 06 月 30 日止。

1.2 目录

§1 重要提示及目录 2
1.1 重要提示 2
1.2 目录 3
§2 基金简介 5
2.1 基金基本情况 5
2.2 基金产品说明 5
2.3 基金管理人和基金托管人 5
2.4 信息披露方式 6
2.5 其他相关资料 6
§3 主要财务指标和基金净值表现 6
3.1 主要会计数据和财务指标 6
3.2 基金净值表现 7
§4 管理人报告 7
4.1 基金管理人及基金经理情况 7
4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明 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 14
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明 14
§5 托管人报告 14
5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明 14
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、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） 15
6.1 资产负债表 15
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 41
7.1 期末基金资产组合情况 41
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合 41
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细 43
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动 55
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合 56
7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细 57

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细 57
7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细 57
7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细 57
7.10 本基金投资股指期货的投资政策 57
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 57
7.12 投资组合报告附注 57
§8 基金份额持有人信息 58
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 58
8.2 期末上市基金前十名持有人 58
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 59
8.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况 59
§9 开放式基金份额变动 59
§10 重大事件揭示 59
10.1 基金份额持有人大会决议 59
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 59
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 60
10.4 基金投资策略的改变 60
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 60
10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况 60
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 60
10.8 其他重大事件 62
§11 影响投资者决策的其他重要信息 64
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 64
11.2 影响投资者决策的其他重要信息 64
§12 备查文件目录 64
12.1 备查文件目录 64
12.2 存放地点 64
12.3 查阅方式 64

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	大成深证成份交易型开放式指数证券投资基金
基金简称	深证 ETF
场内简称	深证成指 ETF
基金主代码	159943
交易代码	159943
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2015 年 6 月 5 日
基金管理人	大成基金管理有限公司
基金托管人	中国农业银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	164,229,922.00 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》
登载基金中期报告正文的管理人互联网网址	www.dcfund.com.cn
基金中期报告备置地点	基金管理人及基金托管人住所

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	中国证券登记结算有限责任公司	北京市西城区太平桥大街 17 号

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2025 年 1 月 1 日-2025 年 6 月 30 日)
本期已实现收益	10,301,351.30
本期利润	7,309,272.42
加权平均基金份额本期利润	0.0391
本期加权平均净值利润率	3.55%
本期基金份额净值增长率	2.03%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2025 年 6 月 30 日)
期末可供分配利润	-25,585,645.04
期末可供分配基金份额利润	-0.1558
期末基金资产净值	186,121,721.58
期末基金份额净值	1.1333
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2025 年 6 月 30 日)
基金份额累计净值增长率	-12.08%

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）。

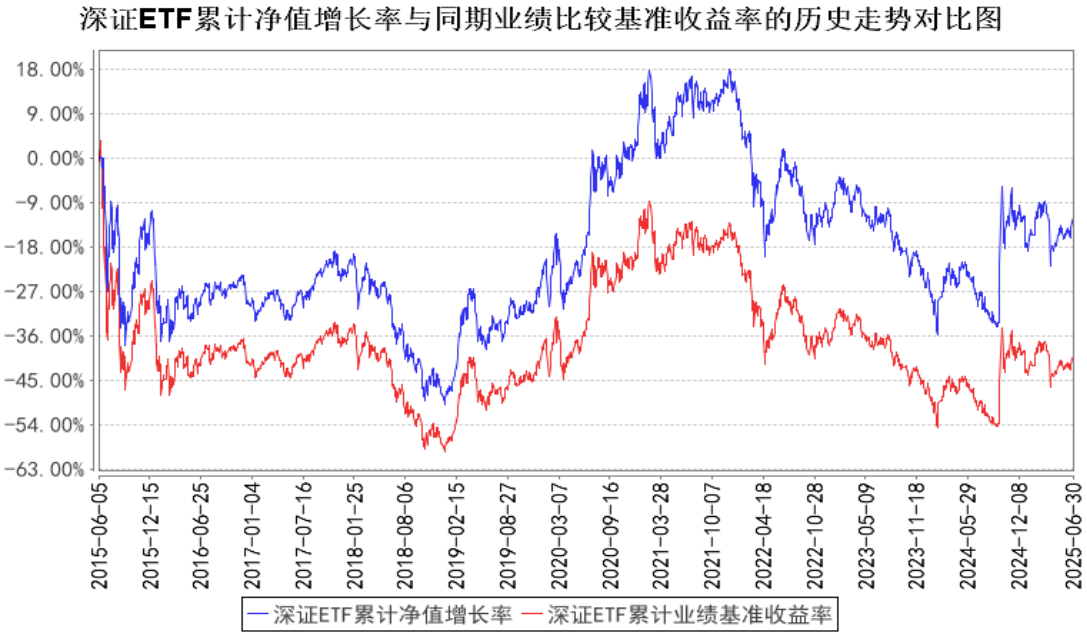
3、所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

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	4.70%	0.78%	4.23%	0.80%	0.47%	-0.02%
过去三个月	0.70%	1.49%	-0.37%	1.52%	1.07%	-0.03%
过去六个月	2.03%	1.36%	0.48%	1.39%	1.55%	-0.03%
过去一年	21.53%	1.79%	18.27%	1.82%	3.26%	-0.03%
过去三年	-13.02%	1.37%	-18.85%	1.40%	5.83%	-0.03%
自基金合同生效起至今	-12.08%	1.54%	-40.20%	1.59%	28.12%	-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。

§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；

2013 年，设立大成创新资本管理有限公司。

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	-	17 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 日至 2025 年 7 月 29 日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 日至 2025 年 3 月 17 日任大成中证 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）基金经理。2021 年 9 月 2 日起任大成深证成份交易型开放式指数证券投资基金基金经理。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 日至 2025 年 3 月 17 日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 日至 2025 年 7 月 29 日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 日至 2025 年 7 月 29 日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。2025 年 4 月 2 日起任大成深证 100 交易型开放式指数证券投资基金基金经理。2025 年 4 月 23 日起任大成中证全指自由现金流交易型开放式指数证券投资基金基金经理。2025 年 7 月 2 日起任大成中证全指自由现金流交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金基金经理。2025 年 7 月 16 日起担任大成创业板人工智能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
李淏	本基金基	2024 年 4	-	9 年	美国纽约大学理学硕士。2016 年 5 月加入

玮	金经理助理	月 15 日			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。2025 年 4 月 2 日起任大成深证 100 交易型开放式指数证券投资基金基金经理助理。2025 年 4 月 23 日起任大成中证全指自由现金流交易型开放式指数证券投资基金基金经理助理。2025 年 7 月 2 日起任大成中证全指自由现金流交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金基金经理助理。2025 年 7 月 16 日起担任大成创业板人工智能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

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。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

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

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

报告期内，公司严格执行了公平交易的原则和制度。公司运用统计分析方法和工具，对旗下所有投资组合间连续 4 个季度的日内、3 日内、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，面对外部诸多不确定性因素，国内经济实现稳中有进。GDP 同比增长 5.3%，较去年同期提高 0.3%，并为下半年打下良好基础。同时，随着经济转型的不断推进，新动能占比在提高，主要发展引擎逐渐向制造业和出口切换。运行节奏上，一季度形成良好开局，二季度继续保持韧性，出口高于市场预期。截至 6 月 30 日，A 股整体呈 N 型走势，主要指数收益震荡向上。其中，沪深 300 涨 0.03%；中证 500 涨 3.31%；创业板指涨 0.53%，中证 1000 涨 6.69%。行业上（中信一

级），综合金融、有色金属、银行涨幅领先；煤炭、房地产、食品饮料表现萎靡。风格上，小盘、成长明显占优。

报告期内，对股票市场影响较大的三个因素是国内 AI 技术的突破、中美对等关税问题和股市微观流动性变化。阶段表现上，A 股自开年后至 3 月中旬整体上行，科技板块表现更佳。当时，市场总体宏观环境相对比较稳定。数据显示出经济有边际改善的部分，也有尚待面对的问题；中美关系处于相较于去年相对缓和的状态。此时，DeepSeek 大模型横空出世，以高性能、低成本的特性获得国内及海外资金的高度关注，并带动科技板块的价值重估。 三月下旬后，在主题交易集中度较高、海外相关板块调整以及情绪回落的影响下，市场整体走弱。随后，美国对等关税问题在四月初对市场形成更大的冲击。成长和小盘风格由于前期上涨较为充分且对股市微观流动性变化更为敏感，相对跌幅更大。面对这种情况，政策端迅速打出“组合拳”。既有以汇金为代表的国家队增持 ETF 发挥类“平准基金”作用，又有一些上市公司宣布增持和回购；长线机制下，金融监管总局也发布了上调保险资金权益类资产比例相关通知，真金白银的支持稳定资本市场。五一后，中美双方高层对关税问题进行持续谈判，国新办在政策上的也提前应对，均释放出稳经济和稳市场的积极信号。多重提振下，A 股走出 V 型反转，很快修复关税冲击所造成的缺口。此后，市场进入震荡格局，但收益中枢有所上移。六月下旬，中东地缘事件缓和，美国通胀预期较此前有所下降，全球流动性改善，权益资产价格普遍上涨。在资金面驱动下，小盘和主题投资再度表现活跃，走强幅度略超预期。

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 1.1333 元；本报告期基金份额净值增长率为 2.03%，业绩比较基准收益率为 0.48%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望下半年，宏观经济继续平稳运行。结构上，由于美国关税政策给外需带来不确定性，因此，内需拉动是稳增长的重要路径。消费作为扩内需的关键，上半年在补贴政策推动下，成为经济增长主要支撑项。下半年，由于基数的升高，社零同比增速或边际放缓，但向下幅度有限。投资方面，制造业延续强势增长态势，保持对固定资产投资的高贡献率；基建可能成为另一个经济

增长的关键，在专项债、特别国债带动下具备向上空间，或有所回升；地产止跌回稳的基础尚不牢固，复苏面临挑战，尽管降幅收窄，也仍将会是拖累项。出口方面，贸易主体的多元化将形成支撑，但跟上半年相比，可能面临一定压力。货币政策将继续保持“适度宽松”的原则，呵护流动性的稳定。财政政策支持力度加大，或根据经济运行情况及外部环境变化适时出台增量政策。价格端，CPI 温和回升，PPI 有望在反内卷政策及能源价格企稳的传导下降幅收窄，有助于企业盈利的改善。

对于股票市场而言，下半年外部环境风险仍存，但内部具备确认性。一方面，经济保持韧性，企业盈利触底改善，为股价表现提供基础。另一方面，政策端储备尚留有余地，足以应对潜在的极端事件。整体上，宏观层面 “下有支撑”的预期较为充分。此外，微观流动性改善是今年以来更应被关注到的亮点之一。伴随市场上行，全 A 股日均成交金额中枢从年初的万亿左右增加至年中 1.5 万亿，说明资金逐渐形成正反馈。资金来源即包括持续赚钱效应下较去年更为活跃的个人投资者，也包括像险资等中长期资金，结构较为健康。尽管后续我们仍需要面对内生增长压力、对等关税问题和时有发生的地缘政治事件，但是我们认为下半年总体机会大于风险，市场或将呈现出震荡向上的行情特征，而阶段性的调整蓄势则带来中长期配置机会。

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。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

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

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

无。

§5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

在托管本基金的过程中，本基金托管人中国农业银行股份有限公司严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》相关法律法规的规定以及基金合同、托管协议的约定，对本基金基金管理人—大成基金管理有限公司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：2025 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2025 年 6 月 30 日	上年度末 2024 年 12 月 31 日
资 产：			
货币资金	6.4.7.1	2,157,760.21	3,830,193.16
结算备付金		7,546.96	85.56
存出保证金		91,573.44	91,441.04
交易性金融资产	6.4.7.2	184,169,377.46	222,129,476.91
其中：股票投资		184,162,176.99	222,107,013.44
基金投资		-	-
债券投资		7,200.47	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	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		-	14,926.61
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		186,426,258.07	226,066,123.28
负债和净资产	**附注号**	**本期末 2025 年 6 月 30 日**	**上年度末 2024 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		113,072.55	4,770.31
应付赎回款		-	-

应付管理人报酬		77,834.26	98,437.48
应付托管费		15,566.84	19,687.48
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	98,062.84	203,789.55
负债合计		304,536.49	326,684.82
净资产：			
实收基金	6.4.7.10	211,707,366.62	261,981,928.04
未分配利润	6.4.7.12	-25,585,645.04	-36,242,489.58
净资产合计		186,121,721.58	225,739,438.46
负债和净资产总计		186,426,258.07	226,066,123.28

注： 报告截止日 2025 年 06 月 30 日，基金份额净值 1.1333 元，基金份额总额 164,229,922.00 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：2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日
一、营业总收入		8,020,160.48	-7,541,150.51
1.利息收入		8,847.11	10,712.25
其中：存款利息收入	6.4.7.13	8,847.11	10,712.25
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）		11,105,874.50	-5,308,816.68
其中：股票投资收益	6.4.7.14	8,989,230.92	-7,309,845.33
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.15	21,076.64	-
资产支持证券投资收益	6.4.7.16	-	-
贵金属投资收益	6.4.7.17	-	-
衍生工具收益	6.4.7.18	-	-

股利收益	6.4.7.19	2,095,566.94	2,001,028.65
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	-2,992,078.88	-2,247,214.78
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	-102,482.25	4,168.70
减：二、营业总支出		710,888.06	651,423.86
1．管理人报酬	6.4.10.2.1	512,304.63	409,663.46
其中：暂估管理人报酬		-	-
2．托管费	6.4.10.2.2	102,461.01	81,932.80
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		0.02	-
8．其他费用	6.4.7.23	96,122.40	159,827.60
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		7,309,272.42	-8,192,574.37
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		7,309,272.42	-8,192,574.37
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		7,309,272.42	-8,192,574.37

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：2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 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	261,981,928.04	-	-36,242,489.58	225,739,438.46
二、本期期初净资产	261,981,928.04	-	-36,242,489.58	225,739,438.46
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-50,274,561.42	-	10,656,844.54	-39,617,716.88

（一）、综合收益总额	-	-	7,309,272.42	7,309,272.42
（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）	-50,274,561.42	-	3,347,572.12	-46,926,989.30
其中：1.基金申购款	139,221,862.32	-	-24,307,507.45	114,914,354.87
2.基金赎回款	-189,496,423.74	-	27,655,079.57	-161,841,344.17
（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	211,707,366.62	-	-25,585,645.04	186,121,721.58

项目	上年度可比期间 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	-123,752,766.52	-	31,574,452.99	-92,178,313.53
（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

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 2025 年 8 月 28 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、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 2025 年 6 月 30 日的财务状况以及自 2025 年 1 月 1 日起至 2025 年 6 月 30 日止期间的经营成果和净资产变动情况等有关信息。

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

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

无。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

无。

6.4.5.3 差错更正的说明

无。

6.4.6 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。

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 2025 年 6 月 30 日

活期存款	2,157,760.21
等于：本金	2,157,459.36
加：应计利息	300.85
减：坏账准备	-
定期存款	-
等于：本金	-
加：应计利息	-
减：坏账准备	-
其中：存款期限 1 个月以内	-
存款期限 1-3 个月	-
存款期限 3 个月以上	-
其他存款	-
等于：本金	-
加：应计利息	-
减：坏账准备	-
合计	2,157,760.21

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末 2025 年 6 月 30 日			
		成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票		173,251,721.76	-	184,162,176.99	10,910,455.23
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-	-
债券	交易所市场	7,200.00	0.47	7,200.47	0.00
	银行间市场	-	-	-	-
	合计	7,200.00	0.47	7,200.47	0.00
资产支持证券		-	-	-	-
基金		-	-	-	-
其他		-	-	-	-
合计		173,258,921.76	0.47	184,169,377.46	10,910,455.23

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 2025 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	2,255.44

其中：交易所市场	2,255.44
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用	81,822.86
应付指数使用费	13,984.54
合计	98,062.84

6.4.7.10 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	203,229,922.00	261,981,928.04
本期申购	108,000,000.00	139,221,862.32
本期赎回（以“-”号填列）	-147,000,000.00	-189,496,423.74
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	164,229,922.00	211,707,366.62

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	27,060,547.74	-63,303,037.32	-36,242,489.58
本期期初	27,060,547.74	-63,303,037.32	-36,242,489.58
本期利润	10,301,351.30	-2,992,078.88	7,309,272.42
本期基金份额交易产生的变动数	-6,186,780.61	9,534,352.73	3,347,572.12
其中：基金申购款	17,159,198.35	-41,466,705.80	-24,307,507.45
基金赎回款	-23,345,978.96	51,001,058.53	27,655,079.57
本期已分配利润	-	-	-
本期末	31,175,118.43	-56,760,763.47	-25,585,645.04

6.4.7.13 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	8,635.79
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	41.32
其他	170.00
合计	8,847.11

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 2025年1月1日至2025年6月30日
股票投资收益——买卖股票差价收入	1,218,457.50
股票投资收益——赎回差价收入	7,770,773.42
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	8,989,230.92

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 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
卖出股票成交总额	12,521,761.95
减：卖出股票成本总额	11,292,271.13
减：交易费用	11,033.32
买卖股票差价收入	1,218,457.50

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 2025年1月1日至2025年6月30日
赎回基金份额对价总额	161,841,344.17
减：现金支付赎回款总额	-363,644.83
减：赎回股票成本总额	154,434,215.58
减：交易费用	-
赎回差价收入	7,770,773.42

6.4.7.14.4 股票投资收益——申购差价收入

无。

6.4.7.14.5 股票投资收益——证券出借差价收入

无。

6.4.7.15 债券投资收益

6.4.7.15.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期

	2025年1月1日至2025年6月30日
债券投资收益——利息收入	16.12
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	21,060.52
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	21,076.64

6.4.7.15.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2025年1月1日至2025年6月30日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	131,885.11
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	110,800.00
减：应计利息总额	19.31
减：交易费用	5.28
买卖债券差价收入	21,060.52

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 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
股票投资产生的股利收益	2,095,566.94
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	2,095,566.94

6.4.7.20 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
1.交易性金融资产	-2,992,078.88
股票投资	-2,987,418.84
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	-2,992,078.88

6.4.7.21 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
基金赎回费收入	-
替代损益	-102,482.25
合计	-102,482.25

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 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
审计费用	22,315.49
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
银行划款手续费	315.00
指数使用费	13,984.54
合计	96,122.40

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	基金托管人

银行”）	
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 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2024年1月1日至2024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	29,082,997.95	100.00	19,307,983.95	89.10

6.4.10.1.2 债券交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2024年1月1日至2024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	131,885.11	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 2025年1月1日至2025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	2,908.42	100.00	2,255.44	100.00
关联方名称	上年度可比期间 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

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。

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 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	512,304.63	409,663.46
其中：应支付销售机构的客户维护费	114,673.54	3,362.12
应支付基金管理人的净管理费	397,631.09	406,301.34

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

日管理人报酬＝前一日基金资产净值×0.50%/当年天数。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	102,461.01	81,932.80

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

日托管费＝前一日基金资产净值×0.10%/当年天数。

6.4.10.2.3 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 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2024年1月1日至2024年6月30日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国农业银行	2,157,760.21	8,635.79	3,436,678.20	10,165.53

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（2025 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
001335	信	2025	6 个月	新股	12.80	28.05	80	1,024.00	2,244.00	-

	凯科技	年4月2日		锁定						
001356	富岭股份	2025年1月16日	6个月	新股锁定	5.30	14.44	646	3,423.80	9,328.24	-
001382	新亚电缆	2025年3月13日	6个月	新股锁定	7.40	20.21	366	2,708.40	7,396.86	-
001388	信通电子	2025年6月24日	6个月	新股未上市	16.42	16.42	94	1,543.48	1,543.48	-
001388	信通电子	2025年6月24日	1个月内（含）	新股未上市	16.42	16.42	843	13,842.06	13,842.06	-
001390	古麒绒材	2025年5月21日	6个月	新股锁定	12.08	18.12	178	2,150.24	3,225.36	-
001395	亚联机械	2025年1月20日	6个月	新股锁定	19.08	47.25	80	1,526.40	3,780.00	-
301173	毓恬冠佳	2025年2月24日	6个月	新股锁定	28.33	44.98	173	4,901.09	7,781.54	-
301458	钧崴电子	2025年1月2日	6个月	新股锁定	10.40	34.11	701	7,290.40	23,911.11	-
301479	弘景光电	2025年3月6日	6个月	新股锁定	-	77.87	49	-	3,815.63	转增股
301479	弘景光电	2025年3月6日	6个月	新股锁定	41.90	77.87	122	5,111.80	9,500.14	-
301501	恒	2025	6个月	新股	-	45.22	56	-	2,532.32	转增

	鑫生活	年3月11日		锁定						股
301501	恒鑫生活	2025年3月11日	6个月	新股锁定	39.92	45.22	125	4,990.00	5,652.50	-
301535	浙江华远	2025年3月18日	6个月	新股锁定	4.92	18.99	734	3,611.28	13,938.66	-
301560	众捷汽车	2025年4月17日	6个月	新股锁定	16.50	27.45	190	3,135.00	5,215.50	-
301590	优优绿能	2025年5月28日	6个月	新股锁定	89.60	139.48	49	4,390.40	6,834.52	-
301595	太力科技	2025年5月12日	6个月	新股锁定	17.05	29.10	196	3,341.80	5,703.60	-
301601	惠通科技	2025年1月8日	6个月	新股锁定	11.80	33.85	342	4,035.60	11,576.70	-
301602	超研股份	2025年1月15日	6个月	新股锁定	6.70	24.80	658	4,408.60	16,318.40	-
301636	泽润新能	2025年4月30日	6个月	新股锁定	33.06	47.46	128	4,231.68	6,074.88	-
301658	首航新能	2025年3月26日	6个月	新股锁定	11.80	22.98	437	5,156.60	10,042.26	-
301662	宏工科技	2025年4月10日	6个月	新股锁定	26.60	82.50	143	3,803.80	11,797.50	-
301678	新	2025	6个月	新股	12.80	44.54	306	3,916.80	13,629.24	-

	恒汇	年6月13日		锁定						
6.4.12.1.2 受限证券类别：债券										
证券代码	证券名称	成功认购日	受限期	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量（单位：张）	期末成本总额	期末估值总额	备注
123257	安克转债	2025年6月16日	1个月内（含）	新债未上市	100.00	100.01	72	7,200.00	7,200.47	-

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 0.00%(上年度末：0.01%)。

6.4.13.3 流动性风险

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

6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》及《公开募集开放式

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

本基金主要投资于交易所及银行间市场内交易的证券，除在附注“期末本基金持有的流通受限证券”中列示的部分基金资产流通暂时受限制外(如有)，其余均能及时变现。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券资产的公允价值。除附注“期末债券正回购交易中作为抵押的债券”中列示的卖出回购金融资产款余额(如有)将在 1 个月内到期且计息外，本基金于资产负债表日所持有的金融负债的合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。

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 2025 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	2,157,760.21	-	-	-	2,157,760.21
结算备付金	7,546.96	-	-	-	7,546.96
存出保证金	91,573.44	-	-	-	91,573.44
交易性金融资产	-	-	7,200.47	184,162,176.99	184,169,377.46
资产总计	2,256,880.61	-	7,200.47	184,162,176.99	186,426,258.07
负债					
应付管理人报酬	-	-	-	77,834.26	77,834.26
应付托管费	-	-	-	15,566.84	15,566.84
应付清算款	-	-	-	113,072.55	113,072.55
其他负债	-	-	-	98,062.84	98,062.84
负债总计	-	-	-	304,536.49	304,536.49
利率敏感度缺口	2,256,880.61	-	7,200.47	183,857,640.50	186,121,721.58
上年度末 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

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

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

于本期末，本基金持有的交易性债券投资和交易性资产支持证券投资公允价值占净资产的比例为 0.00%(上年度末：0.01%)，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 2025 年 6 月 30 日		上年度末 2024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	184,162,176.99	98.95	222,107,013.44	98.39
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	184,162,176.99	98.95	222,107,013.44	98.39

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 （2025 年 6 月 30 日）	上年度末 （2024 年 12 月 31 日 ）
	业绩比较基准上升 5%	9,126,905.24	11,069,615.67

	业绩比较基准下降5%	-9,126,905.24	-11,069,615.67

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 2025 年 6 月 30 日	上年度末 2024 年 12 月 31 日
第一层次	183,966,492.49	221,198,271.49
第二层次	22,586.01	639,114.40
第三层次	180,298.96	292,091.02
合计	184,169,377.46	222,129,476.91

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。

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工具(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。

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	184,162,176.99	98.79
	其中：股票	184,162,176.99	98.79
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	7,200.47	0.00
	其中：债券	7,200.47	0.00
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	2,165,307.17	1.16
8	其他各项资产	91,573.44	0.05
9	合计	186,426,258.07	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	3,633,400.86	1.95
B	采矿业	2,387,215.38	1.28
C	制造业	134,346,845.36	72.18
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	2,297,718.20	1.23
E	建筑业	311,337.00	0.17
F	批发和零售业	1,942,939.20	1.04
G	交通运输、仓储和邮政业	3,051,362.02	1.64
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	12,087,998.00	6.49
J	金融业	15,661,239.01	8.41

K	房地产业	1,517,985.77	0.82
L	租赁和商务服务业	2,442,978.56	1.31
M	科学研究和技术服务业	1,417,177.80	0.76
N	水利、环境和公共设施管理业	370,852.20	0.20
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	227,664.00	0.12
Q	卫生和社会工作	1,136,396.08	0.61
R	文化、体育和娱乐业	1,131,756.65	0.61
S	综合	-	-
	合计	183,964,866.09	98.84

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	183,490.20	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	2,244.00	0.00
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	11,576.70	0.01
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	197,310.90	0.11

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	40,280	10,159,421.60	5.46
2	000333	美的集团	76,807	5,545,465.40	2.98
3	300059	东方财富	195,438	4,520,480.94	2.43
4	002594	比亚迪	13,400	4,447,594.00	2.39
5	000858	五 粮 液	28,400	3,376,760.00	1.81
6	000651	格力电器	67,900	3,050,068.00	1.64
7	002475	立讯精密	72,946	2,530,496.74	1.36
8	000725	京东方 A	517,400	2,064,426.00	1.11
9	300124	汇川技术	30,991	2,001,088.87	1.08
10	002371	北方华创	4,500	1,989,945.00	1.07
11	300308	中际旭创	13,528	1,973,194.08	1.06
12	300760	迈瑞医疗	8,600	1,932,850.00	1.04
13	300502	新易盛	13,765	1,748,430.30	0.94
14	002352	顺丰控股	34,600	1,687,096.00	0.91
15	002714	牧原股份	39,206	1,647,044.06	0.88
16	002415	海康威视	58,950	1,634,683.50	0.88
17	000063	中兴通讯	49,800	1,618,002.00	0.87
18	000001	平安银行	132,300	1,596,861.00	0.86
19	300274	阳光电源	22,912	1,552,746.24	0.83
20	002142	宁波银行	53,417	1,461,489.12	0.79
21	002230	科大讯飞	30,275	1,449,567.00	0.78
22	300498	温氏股份	83,305	1,422,849.40	0.76
23	000568	泸州老窖	11,800	1,338,120.00	0.72
24	300476	胜宏科技	9,600	1,290,048.00	0.69
25	000100	TCL 科技	283,740	1,228,594.20	0.66
26	000338	潍柴动力	79,500	1,222,710.00	0.66
27	002027	分众传媒	157,788	1,151,852.40	0.62
28	000425	徐工机械	129,900	1,009,323.00	0.54
29	000792	盐湖股份	55,900	954,772.00	0.51
30	300014	亿纬锂能	19,731	903,877.11	0.49
31	002463	沪电股份	21,050	896,309.00	0.48
32	002241	歌尔股份	38,200	890,824.00	0.48
33	300033	同花顺	3,200	873,632.00	0.47
34	002050	三花智控	33,000	870,540.00	0.47

35	000625	长安汽车	67,814	865,306.64	0.46
36	002625	光启技术	21,640	865,167.20	0.46
37	300015	爱尔眼科	67,974	848,315.52	0.46
38	000977	浪潮信息	16,153	821,864.64	0.44
39	002384	东山精密	19,800	747,846.00	0.40
40	000776	广发证券	44,100	741,321.00	0.40
41	002179	中航光电	17,924	723,412.64	0.39
42	002311	海大集团	12,280	719,485.20	0.39
43	000938	紫光股份	28,347	680,044.53	0.37
44	300433	蓝思科技	30,359	677,005.70	0.36
45	000002	万　科 A	105,000	674,100.00	0.36
46	002049	紫光国微	10,180	670,454.80	0.36
47	300408	三环集团	19,700	657,980.00	0.35
48	000538	云南白药	11,760	656,090.40	0.35
49	002422	科伦药业	18,100	650,152.00	0.35
50	002028	思源电气	8,900	648,899.00	0.35
51	000166	申万宏源	127,660	640,853.20	0.34
52	000988	华工科技	13,300	625,233.00	0.34
53	002304	洋河股份	9,462	610,772.10	0.33
54	300339	润和软件	12,000	609,960.00	0.33
55	002460	赣锋锂业	17,590	594,014.30	0.32
56	000768	中航西飞	20,300	555,002.00	0.30
57	000157	中联重科	76,400	552,372.00	0.30
58	002074	国轩高科	16,890	548,249.40	0.29
59	300394	天孚通信	6,780	541,315.20	0.29
60	002456	欧菲光	45,500	539,175.00	0.29
61	002966	苏州银行	61,100	536,458.00	0.29
62	002517	恺英网络	27,600	532,956.00	0.29
63	002252	上海莱士	76,620	526,379.40	0.28
64	000807	云铝股份	32,600	520,948.00	0.28
65	002001	新 和 成	24,317	517,222.59	0.28
66	002466	天齐锂业	16,100	515,844.00	0.28
67	301236	软通动力	9,250	505,420.00	0.27
68	000975	山金国际	26,677	505,262.38	0.27
69	002736	国信证券	42,800	493,056.00	0.26
70	000963	华东医药	11,995	484,118.20	0.26
71	300255	常山药业	10,300	480,083.00	0.26
72	002340	格林美	75,420	478,917.00	0.26
73	000408	藏格矿业	11,200	477,904.00	0.26
74	000661	长春高新	4,760	472,096.80	0.25
75	002236	大华股份	29,700	471,636.00	0.25
76	001979	招商蛇口	53,601	470,080.77	0.25
77	002648	卫星化学	27,062	468,984.46	0.25

78	300803	指南针	5,755	464,198.30	0.25
79	000066	中国长城	31,304	463,299.20	0.25
80	002195	岩山科技	82,064	462,020.32	0.25
81	300661	圣邦股份	6,329	460,561.33	0.25
82	002156	通富微电	17,600	450,912.00	0.24
83	300418	昆仑万维	13,400	450,642.00	0.24
84	002558	巨人网络	19,100	449,805.00	0.24
85	300251	光线传媒	21,980	445,534.60	0.24
86	300347	泰格医药	8,250	439,890.00	0.24
87	300450	先导智能	17,300	429,905.00	0.23
88	002797	第一创业	60,620	429,189.60	0.23
89	002920	德赛西威	4,200	428,946.00	0.23
90	300207	欣旺达	21,300	427,278.00	0.23
91	002916	深南电路	3,939	424,663.59	0.23
92	002202	金风科技	40,136	411,394.00	0.22
93	002465	海格通信	29,300	408,442.00	0.22
94	000895	双汇发展	16,700	407,647.00	0.22
95	002185	华天科技	40,174	405,757.40	0.22
96	000933	神火股份	24,200	402,688.00	0.22
97	003816	中国广核	109,100	397,124.00	0.21
98	002555	三七互娱	22,900	395,941.00	0.21
99	302132	中航成飞	4,500	395,730.00	0.21
100	300779	惠城环保	2,200	392,678.00	0.21
101	300896	爱美客	2,240	391,574.40	0.21
102	002601	龙佰集团	24,000	389,040.00	0.21
103	000831	中国稀土	10,700	386,484.00	0.21
104	300866	安克创新	3,380	383,968.00	0.21
105	300782	卓胜微	5,353	382,043.61	0.21
106	300442	润泽科技	7,700	381,381.00	0.20
107	002600	领益智造	44,200	379,678.00	0.20
108	002595	豪迈科技	6,400	379,008.00	0.20
109	002273	水晶光电	18,914	377,712.58	0.20
110	000997	新 大 陆	11,650	377,227.00	0.20
111	002281	光迅科技	7,600	374,832.00	0.20
112	000786	北新建材	14,100	373,368.00	0.20
113	002493	荣盛石化	44,925	371,979.00	0.20
114	300458	全志科技	9,333	370,426.77	0.20
115	000423	东阿阿胶	7,000	366,100.00	0.20
116	300058	蓝色光标	55,586	364,644.16	0.20
117	002532	天山铝业	43,800	363,978.00	0.20
118	300759	康龙化成	14,750	361,965.00	0.19
119	000630	铜陵有色	108,300	361,722.00	0.19
120	300474	景嘉微	4,950	361,350.00	0.19

121	002294	信立泰	7,600	359,708.00	0.19
122	301269	华大九天	2,900	359,252.00	0.19
123	300454	深信服	3,800	357,884.00	0.19
124	001965	招商公路	29,700	356,400.00	0.19
125	300223	北京君正	5,100	352,920.00	0.19
126	002129	TCL 中环	45,850	352,128.00	0.19
127	002180	纳思达	15,300	350,982.00	0.19
128	002472	双环传动	10,400	348,296.00	0.19
129	300002	神州泰岳	29,500	348,100.00	0.19
130	300122	智飞生物	17,750	347,722.50	0.19
131	300017	网宿科技	32,152	344,669.44	0.19
132	300395	菲利华	6,700	342,370.00	0.18
133	002709	天赐材料	18,792	340,511.04	0.18
134	000783	长江证券	49,100	340,263.00	0.18
135	000034	神州数码	9,000	338,760.00	0.18
136	002223	鱼跃医疗	9,330	332,148.00	0.18
137	002085	万丰奥威	20,856	331,401.84	0.18
138	002078	太阳纸业	24,600	331,116.00	0.18
139	000426	兴业银锡	20,900	330,220.00	0.18
140	002353	杰瑞股份	9,400	329,000.00	0.18
141	000728	国元证券	41,550	327,829.50	0.18
142	002938	鹏鼎控股	10,200	326,706.00	0.18
143	002851	麦格米特	6,500	325,910.00	0.18
144	000766	通化金马	12,700	322,199.00	0.17
145	300024	机器人	18,666	320,681.88	0.17
146	002738	中矿资源	9,880	317,740.80	0.17
147	002850	科达利	2,800	316,876.00	0.17
148	002065	东华软件	33,000	316,800.00	0.17
149	002131	利欧股份	90,234	315,819.00	0.17
150	300115	长盈精密	14,736	315,350.40	0.17
151	000733	振华科技	6,300	315,315.00	0.17
152	300496	中科创达	5,500	314,710.00	0.17
153	002008	大族激光	12,900	314,373.00	0.17
154	300383	光环新网	21,900	313,170.00	0.17
155	000021	深科技	16,666	312,320.84	0.17
156	002271	东方雨虹	28,953	310,665.69	0.17
157	000876	新 希 望	33,100	310,478.00	0.17
158	000999	华润三九	9,916	310,172.48	0.17
159	002436	兴森科技	23,400	309,816.00	0.17
160	300054	鼎龙股份	10,700	306,876.00	0.16
161	000596	古井贡酒	2,300	306,245.00	0.16
162	002128	电投能源	15,400	304,612.00	0.16
163	002138	顺络电子	10,800	303,696.00	0.16

164	002673	西部证券	38,466	303,112.08	0.16
165	300253	卫宁健康	28,447	301,538.20	0.16
166	000301	东方盛虹	36,100	300,713.00	0.16
167	300832	新产业	5,300	300,616.00	0.16
168	300765	新诺威	5,800	299,802.00	0.16
169	002624	完美世界	19,750	299,607.50	0.16
170	000617	中油资本	40,920	298,716.00	0.16
171	002157	正邦科技	109,100	297,843.00	0.16
172	300857	协创数据	3,460	297,767.60	0.16
173	300604	长川科技	6,600	296,406.00	0.16
174	002405	四维图新	34,550	295,057.00	0.16
175	002155	湖南黄金	16,510	294,703.50	0.16
176	002126	银轮股份	12,000	291,360.00	0.16
177	300346	南大光电	9,196	290,961.44	0.16
178	002402	和而泰	12,500	289,625.00	0.16
179	002410	广联达	21,480	288,046.80	0.15
180	000519	中兵红箭	13,100	286,759.00	0.15
181	002821	凯莱英	3,240	285,930.00	0.15
182	300136	信维通信	12,720	284,928.00	0.15
183	002459	晶澳科技	28,232	281,755.36	0.15
184	300073	当升科技	6,400	280,768.00	0.15
185	300142	沃森生物	25,300	278,300.00	0.15
186	002444	巨星科技	10,900	278,059.00	0.15
187	000878	云南铜业	21,500	273,480.00	0.15
188	300627	华测导航	7,780	272,300.00	0.15
189	002837	英维克	9,140	271,549.40	0.15
190	300773	拉卡拉	8,100	270,945.00	0.15
191	000932	华菱钢铁	61,560	270,864.00	0.15
192	300001	特锐德	11,300	270,861.00	0.15
193	002152	广电运通	20,150	270,816.00	0.15
194	002812	恩捷股份	9,170	268,589.30	0.14
195	000750	国海证券	65,065	268,067.80	0.14
196	300459	汤姆猫	47,680	267,008.00	0.14
197	300037	新宙邦	7,560	266,112.00	0.14
198	300699	光威复材	8,384	265,521.28	0.14
199	300003	乐普医疗	19,126	263,556.28	0.14
200	300316	晶盛机电	9,680	262,812.00	0.14
201	300628	亿联网络	7,490	260,352.40	0.14
202	300674	宇信科技	8,580	259,888.20	0.14
203	300999	金龙鱼	8,800	259,864.00	0.14
204	000893	亚钾国际	8,600	259,204.00	0.14
205	002414	高德红外	25,201	258,310.25	0.14
206	300012	华测检测	22,000	257,180.00	0.14

207	002389	航天彩虹	9,900	253,440.00	0.14
208	000983	山西焦煤	39,410	252,224.00	0.14
209	300570	太辰光	2,600	250,588.00	0.13
210	002007	华兰生物	15,860	248,526.20	0.13
211	001696	宗申动力	11,000	246,950.00	0.13
212	300666	江丰电子	3,300	244,530.00	0.13
213	002958	青农商行	67,000	241,870.00	0.13
214	000729	燕京啤酒	18,700	241,791.00	0.13
215	300568	星源材质	19,042	241,452.56	0.13
216	300364	中文在线	9,100	241,150.00	0.13
217	002409	雅克科技	4,400	240,636.00	0.13
218	300757	罗博特科	1,600	239,952.00	0.13
219	000009	中国宝安	26,972	239,511.36	0.13
220	002335	科华数据	5,600	239,008.00	0.13
221	300373	扬杰科技	4,600	238,740.00	0.13
222	000623	吉林敖东	14,020	237,639.00	0.13
223	002044	美年健康	45,604	234,404.56	0.13
224	300558	贝达药业	4,000	231,800.00	0.12
225	000528	柳　　工	24,080	231,408.80	0.12
226	002739	万达电影	20,200	230,886.00	0.12
227	002683	广东宏大	6,800	230,792.00	0.12
228	002139	拓邦股份	16,600	229,246.00	0.12
229	002318	久立特材	9,800	229,222.00	0.12
230	000960	锡业股份	14,921	228,291.30	0.12
231	002607	中公教育	74,400	227,664.00	0.12
232	000039	中集集团	28,840	226,682.40	0.12
233	000887	中鼎股份	12,800	225,152.00	0.12
234	002025	航天电器	4,370	224,661.70	0.12
235	300748	金力永磁	9,396	224,000.64	0.12
236	300724	捷佳伟创	4,100	222,630.00	0.12
237	000738	航发控制	10,700	222,025.00	0.12
238	300100	双林股份	4,700	221,276.00	0.12
239	000400	许继电气	10,100	219,877.00	0.12
240	300919	中伟股份	6,620	217,665.60	0.12
241	002385	大北农	53,650	216,746.00	0.12
242	300144	宋城演艺	25,051	214,186.05	0.12
243	300285	国瓷材料	12,300	213,405.00	0.11
244	300413	芒果超媒	9,730	212,308.60	0.11
245	300672	国科微	2,500	212,300.00	0.11
246	002080	中材科技	10,880	212,160.00	0.11
247	300296	利亚德	34,650	211,365.00	0.11
248	002568	百润股份	8,148	208,670.28	0.11
249	002222	福晶科技	6,100	208,620.00	0.11

250	300432	富临精工	15,940	208,335.80	0.11
251	300623	捷捷微电	6,950	207,110.00	0.11
252	300682	朗新集团	8,800	206,800.00	0.11
253	300638	广和通	7,160	204,990.80	0.11
254	002841	视源股份	5,920	204,832.00	0.11
255	000513	丽珠集团	5,667	204,238.68	0.11
256	002487	大金重工	6,200	203,980.00	0.11
257	002926	华西证券	22,800	203,832.00	0.11
258	300763	锦浪科技	3,540	203,160.60	0.11
259	000415	渤海租赁	60,800	202,464.00	0.11
260	002407	多氟多	16,420	200,159.80	0.11
261	300777	中简科技	5,500	199,375.00	0.11
262	300487	蓝晓科技	3,950	198,685.00	0.11
263	300088	长信科技	33,000	196,680.00	0.11
264	301358	湖南裕能	6,300	196,497.00	0.11
265	300679	电连技术	4,300	195,134.00	0.10
266	002245	蔚蓝锂芯	15,200	195,016.00	0.10
267	300676	华大基因	3,900	194,103.00	0.10
268	002312	川发龙蟒	16,900	194,012.00	0.10
269	000683	博源化工	40,500	193,995.00	0.10
270	002432	九安医疗	5,300	193,079.00	0.10
271	000723	美锦能源	44,600	192,672.00	0.10
272	002015	协鑫能科	13,700	190,841.00	0.10
273	002151	北斗星通	6,650	190,788.50	0.10
274	002056	横店东磁	13,100	185,365.00	0.10
275	300567	精测电子	3,050	184,860.50	0.10
276	300229	拓尔思	9,900	182,556.00	0.10
277	002497	雅化集团	16,000	182,400.00	0.10
278	000591	太阳能	41,500	182,185.00	0.10
279	002617	露笑科技	23,900	179,967.00	0.10
280	002506	协鑫集成	67,100	179,157.00	0.10
281	000155	川能动力	18,200	178,724.00	0.10
282	000060	中金岭南	39,000	178,620.00	0.10
283	002064	华峰化学	27,000	178,470.00	0.10
284	000818	航锦科技	7,900	177,750.00	0.10
285	000703	恒逸石化	30,166	177,376.08	0.10
286	002756	永兴材料	5,570	176,847.50	0.10
287	002262	恩华药业	8,500	176,630.00	0.09
288	002500	山西证券	30,180	176,251.20	0.09
289	000970	中科三环	14,945	175,902.65	0.09
290	300475	香农芯创	4,900	174,587.00	0.09
291	002203	海亮股份	16,900	174,408.00	0.09
292	000998	隆平高科	17,700	174,345.00	0.09

293	300146	汤臣倍健	15,500	174,220.00	0.09
294	300390	天华新能	9,080	173,155.60	0.09
295	002653	海思科	4,100	173,102.00	0.09
296	002176	江特电机	23,800	172,788.00	0.09
297	002939	长城证券	20,600	172,628.00	0.09
298	000629	钒钛股份	67,400	172,544.00	0.09
299	002603	以岭药业	12,224	172,358.40	0.09
300	002439	启明星辰	10,700	171,093.00	0.09
301	000403	派林生物	9,400	170,422.00	0.09
302	002484	江海股份	8,300	170,067.00	0.09
303	300751	迈为股份	2,444	170,004.64	0.09
304	002423	中粮资本	13,900	169,997.00	0.09
305	000099	中信海直	7,800	169,884.00	0.09
306	000050	深天马 A	19,900	169,548.00	0.09
307	002249	大洋电机	25,700	169,106.00	0.09
308	000958	电投产融	24,600	168,264.00	0.09
309	002984	森麒麟	8,960	168,000.00	0.09
310	000547	航天发展	19,900	167,160.00	0.09
311	000563	陕国投 A	46,800	167,076.00	0.09
312	000921	海信家电	6,500	167,050.00	0.09
313	002244	滨江集团	17,100	166,725.00	0.09
314	000686	东北证券	21,820	166,486.60	0.09
315	000636	风华高科	12,100	166,254.00	0.09
316	002145	中核钛白	39,865	165,439.75	0.09
317	002701	奥瑞金	27,600	164,220.00	0.09
318	002747	埃斯顿	8,100	163,944.00	0.09
319	301078	孩子王	12,500	163,375.00	0.09
320	301536	星宸科技	2,700	162,810.00	0.09
321	000951	中国重汽	9,260	162,790.80	0.09
322	000799	酒鬼酒	3,700	162,763.00	0.09
323	000830	鲁西化工	15,800	162,740.00	0.09
324	300775	三角防务	6,000	161,160.00	0.09
325	300212	易华录	7,400	161,024.00	0.09
326	300677	英科医疗	6,780	160,550.40	0.09
327	002268	电科网安	8,760	160,220.40	0.09
328	002936	郑州银行	76,746	158,096.76	0.08
329	000708	中信特钢	13,290	156,290.40	0.08
330	300438	鹏辉能源	5,600	154,616.00	0.08
331	002507	涪陵榨菜	12,070	154,375.30	0.08
332	000581	威孚高科	8,100	153,414.00	0.08
333	001227	兰州银行	60,800	152,000.00	0.08
334	002373	千方科技	16,300	151,590.00	0.08
335	000875	吉电股份	29,900	151,294.00	0.08

336	002948	青岛银行	30,210	150,445.80	0.08
337	300070	碧水源	33,114	149,013.00	0.08
338	300601	康泰生物	9,760	148,254.40	0.08
339	300735	光弘科技	5,900	148,090.00	0.08
340	002429	兆驰股份	33,800	148,044.00	0.08
341	000559	万向钱潮	19,328	147,859.20	0.08
342	002544	普天科技	6,300	147,735.00	0.08
343	300009	安科生物	17,586	147,194.82	0.08
344	301050	雷电微力	2,760	147,108.00	0.08
345	000598	兴蓉环境	20,400	147,084.00	0.08
346	001389	广合科技	2,500	146,925.00	0.08
347	002221	东华能源	15,200	146,832.00	0.08
348	002019	亿帆医药	11,300	146,787.00	0.08
349	002773	康弘药业	5,060	146,588.20	0.08
350	300529	健帆生物	6,780	146,244.60	0.08
351	300573	兴齐眼药	2,820	146,047.80	0.08
352	002368	太极股份	6,211	145,461.62	0.08
353	002240	盛新锂能	11,200	144,256.00	0.08
354	000422	湖北宜化	12,100	144,232.00	0.08
355	002430	杭氧股份	7,400	143,708.00	0.08
356	002698	博实股份	9,200	142,968.00	0.08
357	000778	新兴铸管	38,400	142,848.00	0.08
358	000737	北方铜业	13,100	142,266.00	0.08
359	301498	乖宝宠物	1,300	142,181.00	0.08
360	002831	裕同科技	6,020	140,988.40	0.08
361	003021	兆威机电	1,300	140,595.00	0.08
362	301308	江波龙	1,600	139,984.00	0.08
363	000062	深圳华强	5,205	139,806.30	0.08
364	300718	长盛轴承	2,000	138,980.00	0.07
365	300910	瑞丰新材	2,400	138,600.00	0.07
366	002508	老板电器	7,290	138,582.90	0.07
367	002675	东诚药业	9,600	138,144.00	0.07
368	300456	赛微电子	8,000	137,520.00	0.07
369	002270	华明装备	8,200	137,268.00	0.07
370	002120	韵达股份	20,429	136,874.30	0.07
371	003031	中瓷电子	2,560	136,217.60	0.07
372	002048	宁波华翔	7,300	134,393.00	0.07
373	000801	四川九洲	8,600	134,332.00	0.07
374	000032	深桑达 A	6,600	133,518.00	0.07
375	300118	东方日升	13,900	133,162.00	0.07
376	000657	中钨高新	11,200	132,832.00	0.07
377	002670	国盛金控	8,793	132,334.65	0.07
378	300979	华利集团	2,500	131,425.00	0.07

379	000682	东方电子	12,800	131,072.00	0.07
380	000762	西藏矿业	6,800	130,424.00	0.07
381	002183	怡 亚 通	28,100	129,541.00	0.07
382	000709	河钢股份	59,700	128,952.00	0.07
383	000739	普洛药业	9,200	128,800.00	0.07
384	002847	盐津铺子	1,600	128,640.00	0.07
385	002299	圣农发展	9,000	128,610.00	0.07
386	300957	贝泰妮	2,900	128,238.00	0.07
387	300457	赢合科技	5,550	127,650.00	0.07
388	000069	华侨城 A	56,300	126,675.00	0.07
389	300294	博雅生物	4,850	126,051.50	0.07
390	000902	新洋丰	9,102	125,880.66	0.07
391	000987	越秀资本	18,335	125,778.10	0.07
392	002572	索菲亚	8,908	124,801.08	0.07
393	300595	欧普康视	8,140	124,297.80	0.07
394	000027	深圳能源	19,440	124,027.20	0.07
395	000555	神州信息	8,700	123,714.00	0.07
396	300034	钢研高纳	7,400	123,062.00	0.07
397	002416	爱施德	10,200	122,604.00	0.07
398	002597	金禾实业	5,200	122,460.00	0.07
399	002003	伟星股份	11,200	122,192.00	0.07
400	000825	太钢不锈	33,900	121,701.00	0.07
401	301301	川宁生物	10,100	121,604.00	0.07
402	300026	红日药业	32,900	121,401.00	0.07
403	000883	湖北能源	26,900	121,319.00	0.07
404	002032	苏 泊 尔	2,300	120,497.00	0.06
405	000800	一汽解放	17,500	120,050.00	0.06
406	300776	帝尔激光	2,240	119,190.40	0.06
407	300888	稳健医疗	2,880	118,368.00	0.06
408	002266	浙富控股	38,040	117,163.20	0.06
409	002906	华阳集团	3,600	117,036.00	0.06
410	301029	怡合达	5,112	116,860.32	0.06
411	000156	华数传媒	14,500	115,130.00	0.06
412	002745	木林森	14,600	115,048.00	0.06
413	000628	高新发展	2,700	114,831.00	0.06
414	000967	盈峰环境	16,500	114,675.00	0.06
415	300747	锐科激光	4,812	113,948.16	0.06
416	002265	建设工业	3,700	113,035.00	0.06
417	000543	皖能电力	15,900	111,300.00	0.06
418	002153	石基信息	12,612	109,219.92	0.06
419	300298	三诺生物	4,800	108,432.00	0.06
420	000429	粤高速 A	8,100	107,973.00	0.06
421	301155	海力风电	1,500	107,850.00	0.06

422	002091	江苏国泰	14,800	107,596.00	0.06
423	300633	开立医疗	3,600	106,992.00	0.06
424	002010	传化智联	18,800	104,904.00	0.06
425	002468	申通快递	9,800	104,762.00	0.06
426	000035	中国天楹	24,400	104,676.00	0.06
427	301219	腾远钴业	1,950	103,584.00	0.06
428	002237	恒邦股份	8,700	102,660.00	0.06
429	002531	天顺风能	14,300	102,102.00	0.05
430	002557	洽洽食品	4,700	101,614.00	0.05
431	000582	北部湾港	12,300	101,475.00	0.05
432	000877	天山股份	21,800	101,152.00	0.05
433	002372	伟星新材	9,740	100,906.40	0.05
434	000088	盐 田 港	22,100	100,113.00	0.05
435	000966	长源电力	22,200	99,900.00	0.05
436	301165	锐捷网络	1,620	99,565.20	0.05
437	001286	陕西能源	11,400	99,180.00	0.05
438	000089	深圳机场	14,300	98,670.00	0.05
439	002541	鸿路钢构	5,830	97,594.20	0.05
440	000810	创维数字	8,200	96,596.00	0.05
441	300482	万孚生物	4,480	95,648.00	0.05
442	000785	居然智家	31,100	94,855.00	0.05
443	002096	易普力	7,500	93,075.00	0.05
444	002865	钧达股份	2,379	92,781.00	0.05
445	000937	冀中能源	16,090	92,517.50	0.05
446	300761	立华股份	4,860	91,319.40	0.05
447	003022	联泓新科	5,690	90,072.70	0.05
448	300357	我武生物	4,340	89,577.60	0.05
449	000537	中绿电	10,600	88,616.00	0.05
450	301091	深城交	3,020	88,304.80	0.05
451	002408	齐翔腾达	19,580	87,718.40	0.05
452	301589	诺瓦星云	600	87,198.00	0.05
453	002608	江苏国信	11,600	85,028.00	0.05
454	000552	甘肃能化	34,400	84,968.00	0.05
455	301095	广立微	1,500	84,360.00	0.05
456	002867	周大生	6,400	84,352.00	0.05
457	002518	科士达	3,700	83,583.00	0.04
458	002832	比音勒芬	5,200	83,460.00	0.04
459	002690	美亚光电	4,900	82,663.00	0.04
460	301039	中集车辆	9,900	80,487.00	0.04
461	001914	招商积余	6,500	80,405.00	0.04
462	000927	中国铁物	30,700	78,899.00	0.04
463	000898	鞍钢股份	33,952	78,768.64	0.04
464	300726	宏达电子	2,200	78,650.00	0.04

465	003035	南网能源	16,500	75,735.00	0.04
466	000935	四川双马	4,100	74,702.00	0.04
467	001872	招商港口	3,700	73,482.00	0.04
468	002925	盈趣科技	4,080	73,358.40	0.04
469	001287	中电港	4,000	73,240.00	0.04
470	000959	首钢股份	21,200	72,080.00	0.04
471	000401	冀东水泥	15,900	69,642.00	0.04
472	000028	国药一致	2,790	69,554.70	0.04
473	002737	葵花药业	4,300	67,596.00	0.04
474	301238	瑞泰新材	3,500	67,270.00	0.04
475	002705	新宝股份	4,500	66,150.00	0.04
476	002461	珠江啤酒	5,700	64,353.00	0.03
477	002320	海峡股份	9,768	63,882.72	0.03
478	002945	华林证券	4,400	63,228.00	0.03
479	002060	广东建工	18,100	62,988.00	0.03
480	001203	大中矿业	6,600	62,370.00	0.03
481	300428	立中集团	3,400	61,948.00	0.03
482	300140	节能环境	10,000	61,700.00	0.03
483	000688	国城矿业	4,600	61,226.00	0.03
484	002498	汉缆股份	18,100	61,178.00	0.03
485	002563	森马服饰	11,400	59,964.00	0.03
486	000539	粤电力 A	13,100	59,474.00	0.03
487	000791	甘肃能源	8,800	56,144.00	0.03
488	301611	珂玛科技	1,000	55,010.00	0.03
489	301267	华厦眼科	2,800	53,676.00	0.03
490	001213	中铁特货	12,500	50,750.00	0.03
491	000567	海德股份	7,800	46,176.00	0.02
492	301207	华兰疫苗	2,400	40,464.00	0.02
493	002901	大博医疗	1,100	39,864.00	0.02
494	301015	百洋医药	1,900	38,114.00	0.02
495	002978	安宁股份	1,200	37,896.00	0.02
496	001289	龙源电力	2,300	37,214.00	0.02
497	301551	无线传媒	700	34,118.00	0.02
498	001308	康冠科技	1,480	33,477.60	0.02
499	301606	绿联科技	600	30,858.00	0.02

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	301458	钧崴电子	701	23,911.11	0.01
2	301602	超研股份	658	16,318.40	0.01
3	001388	信通电子	937	15,385.54	0.01
4	301535	浙江华远	734	13,938.66	0.01
5	301678	新恒汇	306	13,629.24	0.01

6	301479	弘景光电	171	13,315.77	0.01
7	301662	宏工科技	143	11,797.50	0.01
8	301601	惠通科技	342	11,576.70	0.01
9	301658	首航新能	437	10,042.26	0.01
10	001356	富岭股份	646	9,328.24	0.01
11	301501	恒鑫生活	181	8,184.82	0.00
12	301173	毓恬冠佳	173	7,781.54	0.00
13	001382	新亚电缆	366	7,396.86	0.00
14	301590	优优绿能	49	6,834.52	0.00
15	301636	泽润新能	128	6,074.88	0.00
16	301595	太力科技	196	5,703.60	0.00
17	301560	众捷汽车	190	5,215.50	0.00
18	001395	亚联机械	80	3,780.00	0.00
19	001390	古麒绒材	178	3,225.36	0.00
20	001335	信凯科技	80	2,244.00	0.00
21	300861	美畅股份	80	1,626.40	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	300255	常山药业	574,779.00	0.25
2	300750	宁德时代	429,000.00	0.19
3	300779	惠城环保	377,778.00	0.17
4	300760	迈瑞医疗	330,142.00	0.15
5	300033	同花顺	325,799.00	0.14
6	002475	立讯精密	278,986.00	0.12
7	002371	北方华创	263,741.00	0.12
8	002335	科华数据	250,844.00	0.11
9	002594	比亚迪	234,036.00	0.10
10	300570	太辰光	232,927.00	0.10
11	002139	拓邦股份	228,037.00	0.10
12	300100	双林股份	212,055.00	0.09
13	002222	福晶科技	203,967.00	0.09
14	301078	孩子王	172,778.00	0.08
15	002850	科达利	171,535.00	0.08
16	301269	华大九天	160,618.00	0.07
17	000657	中钨高新	141,694.00	0.06
18	300308	中际旭创	140,681.00	0.06
19	000801	四川九洲	140,660.00	0.06
20	003021	兆威机电	140,419.00	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	002594	比亚迪	355,276.00	0.16
2	300750	宁德时代	248,787.00	0.11
3	301458	钧崴电子	236,601.12	0.10
4	300182	捷成股份	212,824.78	0.09
5	301602	超研股份	194,813.80	0.09
6	002317	众生药业	177,010.00	0.08
7	000596	古井贡酒	175,219.00	0.08
8	301535	浙江华远	169,185.80	0.07
9	301601	惠通科技	159,787.75	0.07
10	300896	爱美客	156,050.00	0.07
11	301479	弘景光电	154,703.80	0.07
12	001356	富岭股份	153,587.40	0.07
13	300033	同花顺	148,800.00	0.07
14	301658	首航新能	145,895.00	0.06
15	000690	宝新能源	133,139.00	0.06
16	002371	北方华创	127,800.00	0.06
17	300760	迈瑞医疗	127,717.00	0.06
18	301173	毓恬冠佳	121,680.50	0.05
19	301678	新恒汇	121,316.30	0.05
20	301035	润丰股份	120,574.00	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	17,306,454.10
卖出股票收入（成交）总额	12,521,761.95

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

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）	7,200.47	0.00
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	7,200.47	0.00

7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	123257	安克转债	72	7,200.47	0.00

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

无。

7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

无。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

无。

7.10 本基金投资股指期货的投资政策

无。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.11.1 本期国债期货投资政策

无。

7.11.2 本期国债期货投资评价

无。

7.12 投资组合报告附注

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

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	91,573.44
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	91,573.44

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	301458	钧崴电子	23,911.11	0.01	新股锁定
2	301602	超研股份	16,318.40	0.01	新股锁定
3	001388	信通电子	15,385.54	0.01	新股未上市
4	301535	浙江华远	13,938.66	0.01	新股锁定
5	301678	新恒汇	13,629.24	0.01	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（%）
6,975	23,545.51	14,608,740.00	8.90	149,621,182.00	91.10

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	卢光青	6,669,900.00	4.06
2	中信建投证券股份有限公司	5,174,788.00	3.15
3	广发证券股份有限公司	3,297,463.00	2.01
4	宁波安联国际集装箱储运有限公司	2,361,700.00	1.44
5	蒋子昂	1,830,000.00	1.11
6	刘小彦	1,551,750.00	0.94
7	杨铭	1,502,700.00	0.91
8	陈志伟	1,363,544.00	0.83
9	郭玉清	1,315,800.00	0.80
10	童玲华	1,292,700.00	0.79

注：以上数据由中国证券登记结算有限责任公司提供，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	203,229,922.00
本报告期基金总申购份额	108,000,000.00
减：本报告期基金总赎回份额	147,000,000.00
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	164,229,922.00

§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

2025 年 2 月，中国农业银行总行决定陈振华任托管业务部副总裁。

2025 年 3 月，中国农业银行总行决定常佳任托管业务部副总裁。

2025 年 4 月，中国农业银行总行决定李亚红任托管业务部高级专家。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

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。

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	29,082,997.95	100.00	2,908.42	100.00	-
爱建证券	1	-	-	-	-	-
财通证券	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	-	-	-	-	-
方正证券	1	-	-	-	-	-
高盛中国证券	1	-	-	-	-	-
广发证券	2	-	-	-	-	-
国金证券	2	-	-	-	-	-
国盛证券	1	-	-	-	-	-
国泰海通	4	-	-	-	-	-
国投证券	1	-	-	-	-	-
国信证券	1	-	-	-	-	-
红塔证券	1	-	-	-	-	-
华创证券	1	-	-	-	-	-
华泰证券	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	-	-	-	-	-
天风证券	1	-	-	-	-	-
万和证券	1	-	-	-	-	-
西部证券	1	-	-	-	-	-
信达证券	1	-	-	-	-	-
兴业证券	2	-	-	-	-	-
野村东方国际证券	1	-	-	-	-	新增 1 个
粤开证券	1	-	-	-	-	-
招商证券	2	-	-	-	-	-
浙商证券	1	-	-	-	-	-
中国银河证券	3	-	-	-	-	-
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	-	-	-	-	-

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。

10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例(%)	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例(%)	成交金额	占当期权证成交总额的比例(%)
光大证券	131,885.11	100.00	-	-	-	-

10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	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	2025 年 6 月 30 日
2	大成基金管理有限公司关于再次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	2025 年 6 月 30 日
3	大成基金管理有限公司旗下部分 ETF 基金新增东莞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	2025 年 6 月 9 日
4	大成基金管理有限公司提醒投资者谨防金融诈骗的公告	中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站	2025 年 6 月 6 日
5	大成基金管理有限公司旗下部分 ETF 基金新增东吴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	2025 年 5 月 9 日
6	大成基金管理有限公司旗下部分 ETF 基金新增山西证券股份有限公司、湘财证券股份有限公司、爱建证券有限	中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站	2025 年 5 月 9 日

	责任公司为申购赎回代办证券公司的公告		
7	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	2025 年 4 月 26 日
8	大成深证成份交易型开放式指数证券投资基金 2025 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	2025 年 4 月 22 日
9	大成基金管理有限公司旗下公募基金通过证券公司证券交易及佣金支付情况（2024 年度）	中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站	2025 年 3 月 31 日
10	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	中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站	2025 年 3 月 31 日
11	大成基金管理有限公司旗下部分 ETF 基金新增东北证券股份有限公司、恒泰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	2025 年 3 月 26 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	2025 年 3 月 21 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	2025 年 3 月 21 日
14	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	2025 年 3 月 20 日
15	大成深证成份交易型开放式指数证券投资基金托管协议	中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站	2025 年 3 月 20 日
16	关于大成基金管理有限公司旗下部分指数基金指数使用费调整为基金管理人承担并修订基金合同的公告	中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站	2025 年 3 月 19 日
17	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	2025 年 3 月 7 日
18	大成基金管理有限公司关于旗下部分完全按照指数构成比例投资的基金修订基金合同关联交易限制条款的公告	中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站	2025 年 3 月 5 日
19	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	2025 年 3 月 5 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	中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本	2025 年 3 月 5 日

		公司网站	
21	大成深证成份交易型开放式指数证券投资基金 2024 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	2025 年 1 月 22 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

2025 年 8 月 29 日