

大成深证成份交易型开放式指数证券投资 基金 2020 年中期报告

2020 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：2020 年 8 月 28 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 2020 年 8 月 27 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 2020 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	6
§ 4 管理人报告	7
4.1 基金管理人及基金经理情况	7
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	9
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	9
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	10
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	11
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	11
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	12
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	12
§ 5 托管人报告	12
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	12
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	12
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	12
§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）	13
6.1 资产负债表	13
6.2 利润表	14
6.3 所有者权益（基金净值）变动表	15
6.4 报表附注	16
§ 7 投资组合报告	31
7.1 期末基金资产组合情况	31
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	31
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	32
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	44
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	46
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	46

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	46
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	46
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	46
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明	46
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	46
7.12 投资组合报告附注	46
§ 8 基金份额持有人信息	47
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	47
8.2 期末上市基金前十名持有人	48
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	48
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	48
§ 9 开放式基金份额变动	48
§ 10 重大事件揭示	48
10.1 基金份额持有人大会决议	48
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	48
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	49
10.4 基金投资策略的改变	49
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	49
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	49
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	49
10.8 其他重大事件	51
§ 11 影响投资者决策的其他重要信息	52
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	52
11.2 影响投资者决策的其他重要信息	52
§ 12 备查文件目录	52
12.1 备查文件目录	52
12.2 存放地点	53
12.3 查阅方式	53

§ 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 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	18,835,342.00 份
基金合同存续期	不定期
基金份额上市的证券交易所	深圳证券交易所
上市日期	2015 年 7 月 8 日

2.2 基金产品说明

投资目标	紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化。
投资策略	本基金采取完全复制法，即按照标的指数的成份股组成及其权重构建股票投资组合，并根据标的指数成份股及其权重的变动进行相应调整。当预期成份股发生调整和成份股发生配股、增发、分红等行为时，或因基金的申购和赎回等对本基金跟踪标的指数的效果可能带来影响时，或因某些特殊情况导致流动性不足时，或其他原因导致无法有效复制和跟踪标的指数时，基金管理人可以对投资组合管理进行适当变通和调整，从而使得投资组合紧密地跟踪标的指数。
业绩比较基准	深证成份指数
风险收益特征	本基金为股票型指数基金，属于较高风险、较高预期收益的基金品种，其风险与预期收益高于混合基金、债券基金与货币市场基金。本基金采用完全复制法跟踪标的指数的表现，具有与标的指数、以及标的指数所代表的股票市场相似的风险收益特征。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目	基金管理人	基金托管人
名称	大成基金管理有限公司	中国农业银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	赵冰
	联系电话	0755-83183388
	电子邮箱	office@dcfund.com.cn
客户服务电话	4008855558	95599
传真	0755-83199588	010-68121816
注册地址	深圳市福田区深南大道 7088 号招商银行大厦 32 层	北京市东城区建国门内大街 69 号
办公地址	深圳市福田区深南大道 7088 号招商银行大厦 32 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	518040	100031
法定代表人	吴庆斌	周慕冰

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(2020年1月1日-2020年6月30日)
本期已实现收益	3,070,307.16
本期利润	35,819,939.44
加权平均基金份额本期利润	1.7387
本期加权平均净值利润率	14.71%
本期基金份额净值增长率	15.58%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2020年6月30日)
期末可供分配利润	-132,215,261.14
期末可供分配基金份额利润	-7.0195
期末基金资产净值	247,452,409.65
期末基金份额净值	13.138
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2020年6月30日)
基金份额累计净值增长率	-13.75%

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

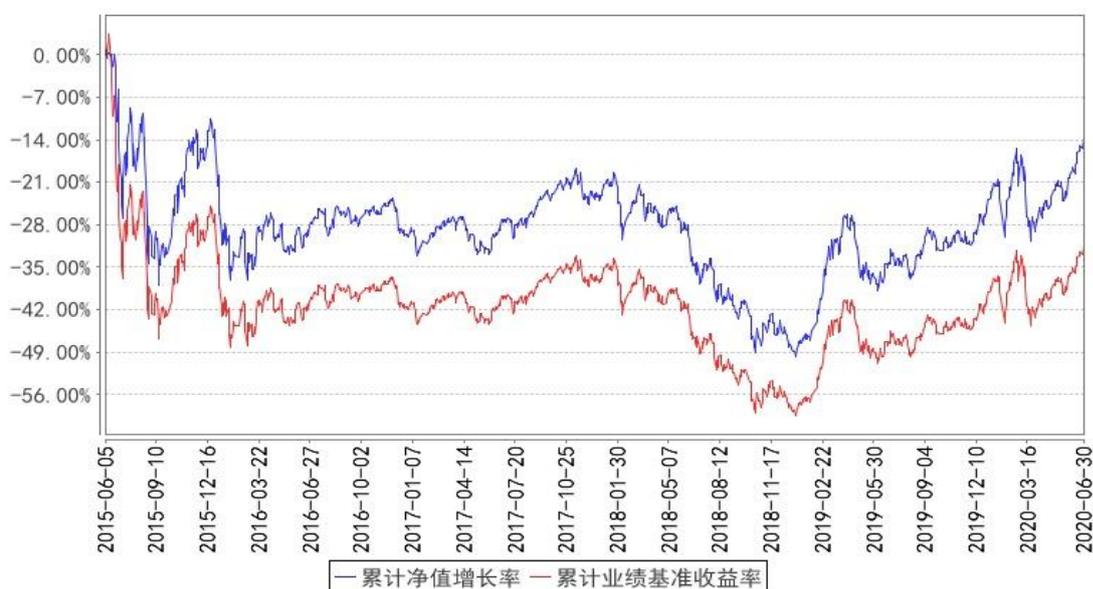
3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

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	11.89%	0.95%	11.60%	0.97%	0.29%	-0.02%
过去三个月	20.95%	1.11%	20.38%	1.13%	0.57%	-0.02%
过去六个月	15.58%	1.80%	14.97%	1.82%	0.61%	-0.02%
过去一年	31.79%	1.45%	30.66%	1.47%	1.13%	-0.02%
过去三年	18.41%	1.44%	13.89%	1.47%	4.52%	-0.03%
自基金合同生效起至今	-13.75%	1.69%	-31.48%	1.75%	17.73%	-0.06%

3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

深证ETF累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：本基金合同规定，基金管理人应当自基金合同生效之日起六个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的有关约定。建仓期结束时，本基金的投资组合比例符合基金合同的约定。

§ 4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

大成基金管理有限公司经中国证监会证监基金字[1999]10号文批准，于1999年4月12日正式成立，是中国证监会批准成立的首批十家基金管理公司之一，注册资本为2亿元人民币，注册地为深圳。目前公司由三家股东组成，分别为中泰信托有限责任公司(50%)、光大证券股份有限公司(25%)、中国银河投资管理有限公司(25%)。主要业务是公募基金的募集、销售和管理，还具有全国社保基金投资管理、基本养老保险投资管理、受托管理保险资金、保险保障基金投资管理、

特定客户资产管理和 QDII 业务资格。

经过二十年的稳健发展，公司形成了强大稳固的综合实力。公司旗下基金产品齐全、风格多样，构建了涵盖股票型基金、混合型基金、指数型基金、债券型基金和货币市场基金的完备产品线。截至 2020 年 6 月 30 日，公司管理公募基金产品数量共 103 只。

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		
苏秉毅	本基金基金经理，数量与指数投资部副总监	2015 年 6 月 5 日	-	16 年	经济学硕士。2004 年 9 月至 2008 年 5 月就职于华夏基金管理有限公司基金运作部。2008 年加入大成基金管理有限公司，曾担任规划发展部高级产品设计师、数量与指数投资部基金经理助理，现任数量与指数投资部副总监。2012 年 8 月 28 日至 2014 年 1 月 23 日任大成中证 500 沪市交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理。2014 年 1 月 24 日至 2014 年 2 月 17 日任大成健康产业股票型证券投资基金基金经理。2012 年 2 月 9 日至 2014 年 9 月 11 日任深证成长 40 交易型开放式指数证券投资基金及大成深证成长 40 交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理。2012 年 8 月 24 日起任中证 500 沪市交易型开放式指数证券投资基金基金经理。2013 年 1 月 1 日至 2015 年 8 月 25 日任大成沪深 300 指数证券投资基金基金经理。2013 年 2 月 7 日起任大成中证 100 交易型开放式指数证券投资基金基金经理。2015 年 6 月 5 日起任大成深证成份交易型开放式指数证券投资基金基金经理。2015 年 6 月 29 日起任大成中证互联网金融指数分级证券投资基金基金经理。2016 年 3 月 4 日起任大成核心双动力混合型证券投资基金、大成沪深 300 指数证券投资基金基金经理。2018 年 6 月 26 日起任大成景恒混合型证券投资基金基金经理。具有基金从业资格。国籍：中国
刘淼	本基金基金经理助理	2017 年 9 月 14 日	-	12 年	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，曾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、深证成长 40 交易型开放式指数证券投资基金、大成深证成长 40 交易型开放式指数联接基金、大成中证 500 深市交易型开放式指数证券投资基金、大成 MSCI 中国 A 股质优价值 100 交易型开放式指数证券投资基金、大成 MSCI 中国 A 股质优价值 100 交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理助理。2017 年 9 月 14 日起任大成中证 100 交易型开放式指数证券投资基金、中证 500 沪市交易型开放式指数证券投资基金、大成深证成份交易型开放式指数证券投资基金基金经理助理。2020 年 6 月 29 日起任深证成长 40 交易型开放式指数证券投资基金、大成深证成长 40 交易型开放式指数联接基金、大成中证 500 深市交易型开放式指数证券投资基金、大成 MSCI 中国 A 股质优价值 100 交易型开放式指数证券投资基金、大成 MSCI 中国 A 股质优价值 100 交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理。具备基金从业资格。国籍：中国
--	--	--	--	--	---

注：1、任职日期、离任日期为本基金管理人作出决定之日。

2、证券从业年限的计算标准遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.1.3 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理同时管理的产品情况

无。

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

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

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

报告期内，基金管理人严格执行了公平交易的原则和制度。基金管理人运用统计分析方法和工具，对旗下所有投资组合间连续 4 个季度的日内、3 日内及 5 日内股票及债券交易同向交易价差进行分析。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市场因素（如个股当日价格振幅较高）及组合经理交易时机选择，即投资组合成交时间不一

致以及成交价格的日内较大变动导致个别些组合间的成交价格差异较大，但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，基金管理人旗下所有投资组合未发现存在异常交易行为。主动投资组合间股票交易存在 1 笔同日反向交易，原因为组合流动性需要。主动型投资组合与指数型投资组合之间或指数型投资组合之间存在股票同日反向交易，但不存在参与交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量超过该股当日成交量 5% 的情形；主动投资组合间债券交易存在 1 笔同日反向交易，原因为组合流动性需要。投资组合间相邻交易日反向交易的市场成交比例、成交均价等交易结果数据表明该类交易不对市场产生重大影响，无异常。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

上半年，由于史无前例的疫情，宏观经济运行偏离了既有轨道，外部环境也面临巨大变局。尽管疫情已经得到一定控制，但短时间内仍无法根治，持续影响社会运作。巨震之下，保障民生、维持社会稳定是政府的首要目标，宽松的货币政策和积极的财政政策成为必然选择。相对于国内形势，海外疫情更为严重，世界格局也发生了一定程度的变化。

股票市场同样波动极大。以春节前后新冠肺炎的爆发为转折点，节后市场一度暴跌，相关部门及时出手，股市从流动性危机的边缘被挽救回来，并在流动性和情绪驱动下走出一波反弹行情。三月份海外疫情进一步蔓延并引发了各类资产的史诗级波动，也导致了 A 股产生系统性调整，随后市场利空出尽站稳，并走出了一波可观的普涨行情。

经过反复剧烈波动，上半年市场基准沪深 300 指数小幅上涨 1.64%。行业和风格分化较大，机构持仓较为集中的板块优势明显。成长风格大幅领先价值风格，创业板指成为上半年表现最为优异的主流宽基指数。在行业板块方面，医药生物一枝独秀，消费、科技依然表现较好，“赛道”优势淋漓尽致；而采掘、银行等传统行业则表现较弱。

本基金标的指数深成指上涨 14.97%，涨幅高于大盘。上半年，本基金申购赎回和份额交易情况均较为平稳。本基金基本保持满仓运作，严格根据标的指数成分股调整以及权重的变化及时调整投资组合。各项操作与指标均符合基金合同的要求。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末本基金份额净值为 13.138 元；本报告期基金份额净值增长率为 15.58%，业绩比较基准收益率为 14.97%。

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，宏观经济局面依然严峻。新冠疫情已经给世界经济带来了巨大的损失，在短期内也难以看到问题解决的曙光。雪上加霜的是，由此引起的全球范围社会撕裂，形成了经济复苏的巨大障碍。

对于股票市场，我们持总体中性、略偏乐观的观点。尽管基本面并不理想，股票市场走势却并不仅仅反映当前经济形势，有望展现出更强的韧性。近年来，股票市场得到国家层面前所未有的重视，在当前局面下有望成为支持经济、发展科技、推动改革的抓手。在监管部门的呵护下，股市下半年有望继续平稳运行，系统性大幅上涨或下跌的可能性都较小，且不乏结构性的机会，风格切换可能较为频繁。

另一方面，即便市场平稳运行，也不排除会有阶段性、局部回撤。当前部分股票估值已非常高，连乐观的未来增长预期也不足以支撑其估值水平，若出现流动性边际收紧等利空，股价开始回归合理区间的话，跌幅将相当可观。此外，国际形势不稳，我们也要警惕小概率高烈度风险事件的发生，不可过度乐观。

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

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本基金管理人指导基金估值业务的领导小组为公司估值委员会，公司估值委员会主要负责估值政策和估值程序的制定、修订以及执行情况的监督。估值委员会由股票投资部、研究部、固定收益总部、数量与指数投资部、大类资产配置部、交易管理部、风险管理部、基金运营部、监察稽核部指定人员组成。公司估值委员会的相关成员均具备相应的专业胜任能力和相关工作经历，估值委员会成员中包括五名投资组合经理。

股票投资部、研究部、固定收益总部、数量与指数投资部、大类资产配置部、风险管理部负责关注相关投资品种的动态，评判基金持有的投资品种是否处于不活跃的交易状态或者最近交易日后经济环境发生了重大变化或证券发行机构发生了影响证券价格的重大事件，从而确定估值日需要进行估值测算或者调整的投资品种；提出合理的数量分析模型对需要进行估值测算或者调整的投资品种进行公允价值定价与计量；定期对估值政策和程序进行评价，以保证其持续适用；交易管理部负责关注相关投资品种的流动性状况，协助反馈其市场交易信息；基金运营部负责日常的基金资产的估值业务，执行基金估值政策，并负责与托管行沟通估值调整事项；监察稽核部负责审核估值政策和程序的一致性，监督估值委员会工作流程中的风险控制，并负责估值调整事项的信息披露工作。

本基金的日常估值程序由基金运营部基金估值核算人员执行，并与托管银行的估值结果核对一致。基金估值政策的议定和修改采用集体讨论机制，投资组合经理作为估值小组成员，对持仓证券的交易情况、信息披露情况保持应有的职业敏感，向估值委员会提供估值参考信息，参与估值政策讨论。对需采用特别估值程序的证券，基金管理人及时启动特别估值程序，由估值委员会讨论议定特别估值方案并与托管行沟通后由基金运营部具体执行。

本基金管理人参与估值流程各方之间不存在任何重大利益冲突。截止报告期末本基金管理人已与中央国债登记结算有限责任公司及中证指数有限公司签署服务协议，由中央国债登记结算有限责任公司按约定提供银行间同业市场的估值数据，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《证券投资基金法》相关法律法规的规定以及基金合同、托管协议的约定，对本基金基金管理人一大成基金管理有限公司 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日基金的投资运作，进行了认真、独立的会计核算和必要的投资监督，认真履行了托管人的义务，没有从事任何损害基金份额持有人利益的行为。

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

本托管人认为，大成基金管理有限公司在本基金的投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支及利润分配等问题上，不存在损害基金份额持有人利益的行为；在报告期内，严格遵守了《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：2020 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2020 年 6 月 30 日	上年度末 2019 年 12 月 31 日
资产：			
银行存款	6.4.3.1	5,826,243.14	4,014,489.42
结算备付金		20,006.17	4,189.15
存出保证金		10,521.60	2,157.21
交易性金融资产	6.4.3.2	241,660,275.40	247,854,013.90
其中：股票投资		241,660,275.40	247,854,013.90
基金投资		-	-
债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	6.4.3.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.3.4	-	-
应收证券清算款		204,275.56	-
应收利息	6.4.3.5	1,048.34	971.95
应收股利		-	-
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.3.6	-	-
资产总计		247,722,370.21	251,875,821.63
负债和所有者权益	附注号	本期末 2020 年 6 月 30 日	上年度末 2019 年 12 月 31 日
负债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.3.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		-	-
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		99,228.62	104,275.04
应付托管费		19,845.77	20,855.01
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.3.7	26,378.57	21,697.57

应交税费		-	-
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.3.8	124,507.60	110,000.00
负债合计		269,960.56	256,827.62
所有者权益：			
实收基金	6.4.3.9	286,929,017.04	337,199,713.29
未分配利润	6.4.3.10	-39,476,607.39	-85,580,719.28
所有者权益合计		247,452,409.65	251,618,994.01
负债和所有者权益总计		247,722,370.21	251,875,821.63

注：报告截止日 2020 年 06 月 30 日，基金份额净值 13.138 元，基金份额总额 18,835,342.00 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：2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期	上年度可比期间
		2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日	2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日
一、收入		36,771,206.86	59,122,767.85
1. 利息收入		16,105.85	12,283.17
其中：存款利息收入	6.4.3.11	16,105.85	12,283.17
债券利息收入		-	-
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	-
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		4,005,468.73	-23,355,568.40
其中：股票投资收益	6.4.3.12	2,104,474.81	-25,469,155.57
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.3.13	-	-
资产支持证券投资收益		-	-
贵金属投资收益	6.4.3.14	-	-
衍生工具收益	6.4.3.15	-	-
股利收益	6.4.3.16	1,900,993.92	2,113,587.17
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.3.17	32,749,632.28	82,466,158.08
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.3.18	-	-105.00

列)			
减：二、费用		951,267.42	1,012,958.84
1. 管理人报酬	6.4.6.2.1	606,023.75	598,270.28
2. 托管费	6.4.6.2.2	121,204.79	119,654.04
3. 销售服务费	6.4.6.2.3	-	-
4. 交易费用	6.4.3.19	49,226.28	76,084.73
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 税金及附加		-	-
7. 其他费用	6.4.3.20	174,812.60	218,949.79
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		35,819,939.44	58,109,809.01
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		35,819,939.44	58,109,809.01

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：大成深证成份交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	337,199,713.29	-85,580,719.28	251,618,994.01
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	35,819,939.44	35,819,939.44
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	-50,270,696.25	10,284,172.45	-39,986,523.80
其中：1. 基金申购款	-	-	-
2. 基金赎回款	-50,270,696.25	10,284,172.45	-39,986,523.80
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-	-
五、期末所有者权益（基金净值）	286,929,017.04	-39,476,607.39	247,452,409.65
项目	上年度可比期间 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金	405,750,662.71	-197,909,206.48	207,841,456.23

净值)			
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	58,109,809.01	58,109,809.01
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数(净值减少以“-”号填列)	-36,560,506.36	12,216,623.46	-24,343,882.90
其中: 1. 基金申购款	-	-	-
2. 基金赎回款	-36,560,506.36	12,216,623.46	-24,343,882.90
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以“-”号填列)	-	-	-
五、期末所有者权益(基金净值)	369,190,156.35	-127,582,774.01	241,607,382.34

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

周立新

刘亚林

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 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。

6.4.2 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2008]1号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2015]101号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2016]36号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、财税[2016]140号《关于明确金融房地产开发教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税[2017]2号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017]56号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》及其他相关财税法规和实务操作,主要税项列示如下:

(1) 资管产品运营过程中发生的增值税应税行为,以资管产品管理人为增值税纳税人。资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为,暂适用简易计税方法,按照3%的征收率

缴纳增值税。对资管产品在 2018 年 1 月 1 日前运营过程中发生的增值税应税行为，未缴纳增值税的，不再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从资管产品管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。

对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税，对国债、地方政府债以及金融同业往来利息收入亦免征增值税。资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务，以 2018 年 1 月 1 日起产生的利息及利息性质的收入为销售额。资管产品管理人运营资管产品转让 2017 年 12 月 31 日前取得的非货物期货，可以选择按照实际买入价计算销售额，或者以 2017 年最后一个交易日的非货物期货结算价格作为买入价计算销售额。

(2) 对基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股票的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

(3) 对基金取得的企业债券利息收入，应由发行债券的企业在向基金支付利息时代扣代缴 20% 的个人所得税。对基金从上市公司取得的股息红利所得，持股期限在 1 个月以内(含 1 个月)的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在 1 个月以上至 1 年(含 1 年)的，暂减按 50% 计入应纳税所得额；持股期限超过 1 年的，暂免征收个人所得税。对基金持有的上市公司限售股，解禁后取得的股息、红利收入，按照上述规定计算纳税，持股时间自解禁日起计算；解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按 50% 计入应纳税所得额。上述所得统一适用 20% 的税率计征个人所得税。

(4) 基金卖出股票按 0.1% 的税率缴纳股票交易印花税，买入股票不征收股票交易印花税。

(5) 本基金的城市维护建设税、教育费附加和地方教育附加等税费按照实际缴纳增值税额的适用比例计算缴纳。

6.4.3 重要财务报表项目的说明

6.4.3.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2020 年 6 月 30 日
活期存款	5,826,243.14
定期存款	-
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	-
合计	5,826,243.14

6.4.3.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2020 年 6 月 30 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	192,605,499.13	241,660,275.40	49,054,776.27
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	192,605,499.13	241,660,275.40	49,054,776.27

6.4.3.3 衍生金融资产/负债

无。

6.4.3.4 买入返售金融资产

6.4.3.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

无。

6.4.3.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

无。

6.4.3.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2020 年 6 月 30 日
应收活期存款利息	1,026.21
应收定期存款利息	-
应收其他存款利息	-
应收结算备付金利息	17.90
应收债券利息	-
应收资产支持证券利息	-
应收买入返售证券利息	-
应收申购款利息	-
应收黄金合约拆借孳息	-
应收出借证券利息	-
其他	4.23
合计	1,048.34

6.4.3.6 其他资产

无。

6.4.3.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2020年6月30日
交易所市场应付交易费用	26,378.57
银行间市场应付交易费用	-
合计	26,378.57

6.4.3.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2020年6月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	-
预提费用	89,507.60
应付指数使用费	35,000.00
合计	124,507.60

6.4.3.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	22,135,342.00	337,199,713.29
本期申购	-	-
本期赎回（以“-”号填列）	-3,300,000.00	-50,270,696.25
- 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	18,835,342.00	286,929,017.04

注：申购含红利再投份额(如有)。

6.4.3.10 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	-158,671,072.64	73,090,353.36	-85,580,719.28
本期利润	3,070,307.16	32,749,632.28	35,819,939.44
本期基金份额交易产生的变动数	23,385,504.34	-13,101,331.89	10,284,172.45
其中：基金申购款	-	-	-

基金赎回款	23,385,504.34	-13,101,331.89	10,284,172.45
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-132,215,261.14	92,738,653.75	-39,476,607.39

6.4.3.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年6月30日
活期存款利息收入	15,776.93
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	271.77
其他	57.15
合计	16,105.85

6.4.3.12 股票投资收益

6.4.3.12.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年6月30日
股票投资收益——买卖股票差价收入	-3,615,305.80
股票投资收益——赎回差价收入	5,719,780.61
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	2,104,474.81

6.4.3.12.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年6月30日
卖出股票成交总额	16,275,835.68
减：卖出股票成本总额	19,891,141.48
买卖股票差价收入	-3,615,305.80

6.4.3.12.3 股票投资收益——赎回差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年6月30日
赎回基金份额对价总额	39,986,523.80
减：现金支付赎回款总额	-2,138,516.20
减：赎回股票成本总额	36,405,259.39
赎回差价收入	5,719,780.61

6.4.3.13 债券投资收益

无。

6.4.3.14 贵金属投资收益

无。

6.4.3.15 衍生工具收益

无。

6.4.3.16 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年6月30日
股票投资产生的股利收益	1,900,993.92
基金投资产生的股利收益	-
合计	1,900,993.92

6.4.3.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2020年1月1日至2020年6月30日
1. 交易性金融资产	32,749,632.28
股票投资	32,749,632.28
债券投资	-
资产支持证券投资	-
基金投资	-
贵金属投资	-
其他	-
2. 衍生工具	-
权证投资	-
3. 其他	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税	-
合计	32,749,632.28

6.4.3.18 其他收入

无。

6.4.3.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期
----	----

	2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日
交易所市场交易费用	49,226.28
银行间市场交易费用	-
合计	49,226.28

6.4.3.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日
审计费用	29,835.26
信息披露费	59,672.34
银行划款手续费	305.00
指数使用费	85,000.00
合计	174,812.60

注：指数使用费为支付标的指数供应商的标的指数许可使用费，按前一日基金资产净值的 0.03% 的年费率计提，逐日累计，按季支付。当季日均基金资产净值大于 5000 万元时，指数许可使用费收取下限为每季度人民币 35000 元；当季日均基金资产净值小于或等于 5000 万元时，指数许可使用费收取不设下限金额

6.4.4 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.4.1 或有事项

无。

6.4.4.2 资产负债表日后事项

无。

6.4.5 关联方关系

6.4.5.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

本基金本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

6.4.5.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

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

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.6 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.6.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.6.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2020年1月1日至2020年6月30日		上年度可比期间 2019年1月1日至2019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	-	-	50,743,185.55	99.23

6.4.6.1.2 债券交易

无。

6.4.6.1.3 债券回购交易

无。

6.4.6.1.4 权证交易

无。

6.4.6.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2020年1月1日至2020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	-	-	-	-
关联方名称	上年度可比期间 2019年1月1日至2019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	46,244.38	99.23	20,507.20	98.28

注：1. 上述佣金参考市场价格经本基金的基金管理人与对方协商确定，以扣除由中国证券登记结算有限责任公司收取的证管费和经手费的净额列示。

2. 该类佣金协议的服务范围还包括佣金收取方为本基金提供的证券投资研究成果和市场信息服务等。

6.4.6.2 关联方报酬

6.4.6.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	606,023.75	598,270.28
其中：支付销售机构的客户维护费	-	-

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

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

6.4.6.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	121,204.79	119,654.04

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

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

6.4.6.3 与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易

无。

6.4.6.4 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

6.4.6.4.1 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。

6.4.6.4.2 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。

6.4.6.5 各关联方投资本基金的情况

6.4.6.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

无。

6.4.6.5.2 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。

6.4.6.6 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		上年度可比期间	
	2020年1月1日至2020年6月30日		2019年1月1日至2019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	5,826,243.14	15,776.93	2,787,777.94	12,029.75

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。

6.4.6.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

无。

6.4.6.8 其他关联交易事项的说明

无。

6.4.7 利润分配情况

无。

6.4.8 期末(2020年6月30日)本基金持有的流通受限证券

6.4.8.1 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

6.4.8.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	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
002500	山西证券	2020年6月29日	2020年7月10日	配股未上市	5.00	6.54	12,480	62,400.00	81,619.20	-
300840	酷特智能	2020年6月30日	2020年7月8日	新股未上市	5.94	5.94	1,185	7,038.90	7,038.90	-
300843	胜蓝股份	2020年6月23日	2020年7月2日	新股未上市	10.01	10.01	751	7,517.51	7,517.51	-
300845	捷安高科	2020年6月24日	2020年7月3日	新股未上市	17.63	17.63	470	8,286.10	8,286.10	-
300846	首都在	2020年	2020年	新股未	3.37	3.37	1,131	3,811.47	3,811.47	-

	线	6月22日	7月1日	上市						
300847	中船汉光	2020年6月29日	2020年7月9日	新股未上市	6.94	6.94	1,421	9,861.74	9,861.74	-

注：基金可使用以基金名义开设的股票账户，选择网上或者网下一种方式进行新股申购。其中基金作为一般法人或战略投资者认购的新股，根据基金与上市公司所签订申购协议的规定，在新股上市后的约定期限内不能自由转让。

6.4.8.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

无。

6.4.8.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

无。

6.4.8.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

无。

6.4.9 金融工具风险及管理

6.4.9.1 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。

6.4.9.2 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行中国农业银行，因而与银行存款相关的信用风险不重大。本基金在交易所进行的交易均以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，违约风险可能性很小；在银行间同业市场进行交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式进行限制以控制相应的信用风险。

本基金的基金管理人建立了信用风险管理流程，通过对投资品种信用等级评估来控制证券发行人的信用风险，且通过分散化投资以分散信用风险。

于本期末，本基金无债券投资(上年度末：同)。

6.4.9.3 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。

6.4.9.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》及《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》等有关法规的要求建立健全开放式基金流动性风险管理的内部控制体系，审慎评估各类资产的流动性，针对性制定流动性风险管理措施，对本基金组合资产的流动性风险进行管理。本基金的基金管理人采用监控基金组合资产持仓集中度指标、逆回购交易的到期日与交易对手的集中度、流动性受限资产比例、基金组合资产中 7 个工作日可变现资产的可变现价值以及压力测试等方式防范流动性风险。并于开放日对本基金的申购赎回情况进行监控，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配，确保本基金资产的变现能力与投资者赎回

需求的匹配与平衡。本基金的基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。于本期末，本基金持有的流动性受限资产的估值占基金资产净值的比例未超过 15%。

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

6.4.9.4 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。

6.4.9.4.1 利率风险

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

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

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

6.4.9.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2020 年 6 月 30 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	5,826,243.14	-	-	-	5,826,243.14
结算备付金	20,006.17	-	-	-	20,006.17
存出保证金	10,521.60	-	-	-	10,521.60
交易性金融资产	-	-	-	-241,660,275.40	241,660,275.40
应收利息	-	-	-	1,048.34	1,048.34

应收证券清算款	-	-	-	204,275.56	204,275.56
资产总计	5,856,770.91	-	-	-241,865,599.30	247,722,370.21
负债					
应付管理人报酬	-	-	-	99,228.62	99,228.62
应付托管费	-	-	-	19,845.77	19,845.77
应付交易费用	-	-	-	26,378.57	26,378.57
其他负债	-	-	-	124,507.60	124,507.60
负债总计	-	-	-	269,960.56	269,960.56
利率敏感度缺口	5,856,770.91	-	-	-241,595,638.74	247,452,409.65
上年度末 2019 年 12 月 31 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	4,014,489.42	-	-	-	4,014,489.42
结算备付金	4,189.15	-	-	-	4,189.15
存出保证金	2,157.21	-	-	-	2,157.21
交易性金融资产	-	-	-	-247,854,013.90	247,854,013.90
应收利息	-	-	-	971.95	971.95
资产总计	4,020,835.78	-	-	-247,854,985.85	251,875,821.63
负债					
应付管理人报酬	-	-	-	104,275.04	104,275.04
应付托管费	-	-	-	20,855.01	20,855.01
应付交易费用	-	-	-	21,697.57	21,697.57
其他负债	-	-	-	110,000.00	110,000.00
负债总计	-	-	-	256,827.62	256,827.62
利率敏感度缺口	4,020,835.78	-	-	-247,598,158.23	251,618,994.01

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

6.4.9.4.1.2 利率风险的敏感性分析

于本期末，本基金未持有交易性债券投资（上年度末：同），因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响（上年度末：同）。

6.4.9.4.2 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。

6.4.9.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市的股票和债券，所

面临的其他价格风险来源于单个证券发行主体自身经营情况或特殊事项的影响，也可能来源于证券市场整体波动的影响。

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

6.4.9.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2020年6月30日		上年度末 2019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	241,660,275.40	97.66	247,854,013.90	98.50
交易性金融资产—基金投资	—	—	—	—
交易性金融资产—债券投资	—	—	—	—
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	241,660,275.40	97.66	247,854,013.90	98.50

6.4.9.4.3.2 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		
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 (2020年6月30日)	上年度末 (2019年12月31日)	
分析	1. 业绩比较基准上升 5%	12,180,000.00	12,390,000.00
	2. 业绩比较基准下降 5%	-12,180,000.00	-12,390,000.00

6.4.10 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

无。

§ 7 投资组合报告

7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	241,660,275.40	97.55
	其中：股票	241,660,275.40	97.55
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	5,846,249.31	2.36
8	其他各项资产	215,845.50	0.09
9	合计	247,722,370.21	100.00

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	7,241,228.70	2.93
B	采矿业	1,641,693.18	0.66
C	制造业	158,926,023.31	64.22
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	1,312,964.60	0.53
E	建筑业	663,654.86	0.27
F	批发和零售业	3,384,342.00	1.37
G	交通运输、仓储和邮政业	3,194,527.05	1.29
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	24,631,716.91	9.95
J	金融业	16,816,532.97	6.80
K	房地产业	9,081,340.97	3.67
L	租赁和商务服务业	3,452,147.86	1.40
M	科学研究和技术服务业	1,940,985.00	0.78
N	水利、环境和公共设施管理业	827,457.86	0.33
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	452,325.00	0.18
Q	卫生和社会工作	4,667,261.59	1.89
R	文化、体育和娱乐业	2,911,125.76	1.18
S	综合	451,642.72	0.18
	合计	241,596,970.34	97.63

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	51,207.49	0.02
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	12,097.57	0.00
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	63,305.06	0.03

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	000858	五粮液	45,400	7,768,848.00	3.14
2	000333	美的集团	125,307	7,492,105.53	3.03
3	000651	格力电器	123,000	6,958,110.00	2.81
4	002475	立讯精密	108,046	5,548,162.10	2.24
5	000002	万科A	157,500	4,117,050.00	1.66
6	300750	宁德时代	21,000	3,661,560.00	1.48
7	002714	牧原股份	39,604	3,247,528.00	1.31
8	000725	京东方A	685,500	3,201,285.00	1.29
9	300760	迈瑞医疗	10,400	3,179,280.00	1.28
10	000661	长春高新	7,260	3,160,278.00	1.28
11	300059	东方财富	153,972	3,110,234.40	1.26
12	000001	平安银行	221,500	2,835,200.00	1.15
13	300498	温氏股份	124,305	2,709,849.00	1.10

14	002415	海康威视	89,225	2,707,978.75	1.09
15	000063	中兴通讯	64,600	2,592,398.00	1.05
16	000100	TCL 科技	305,000	1,891,000.00	0.76
17	300015	爱尔眼科	43,303	1,881,515.35	0.76
18	002352	顺丰控股	33,500	1,832,450.00	0.74
19	002142	宁波银行	67,788	1,780,790.76	0.72
20	000568	泸州老窖	19,400	1,767,728.00	0.71
21	300142	沃森生物	33,700	1,764,532.00	0.71
22	002241	歌尔股份	54,100	1,588,376.00	0.64
23	300782	卓胜微	3,860	1,566,272.20	0.63
24	000876	新 希 望	52,500	1,564,500.00	0.63
25	000338	潍柴动力	113,300	1,554,476.00	0.63
26	002027	分众传媒	277,688	1,546,722.16	0.63
27	002230	科大讯飞	40,675	1,522,465.25	0.62
28	002594	比亚迪	20,900	1,500,620.00	0.61
29	002304	洋河股份	14,062	1,478,478.68	0.60
30	002410	广联达	20,900	1,456,730.00	0.59
31	002555	三七互娱	29,700	1,389,960.00	0.56
32	300122	智飞生物	13,600	1,362,040.00	0.55
33	300347	泰格医药	13,250	1,349,910.00	0.55
34	002007	华兰生物	26,460	1,325,910.60	0.54
35	300014	亿纬锂能	27,631	1,322,143.35	0.53
36	001979	招商蛇口	78,701	1,293,844.44	0.52
37	300601	康泰生物	7,600	1,232,416.00	0.50
38	000166	申万宏源	231,060	1,166,853.00	0.47
39	300136	信维通信	20,820	1,103,876.40	0.45
40	300124	汇川技术	28,394	1,078,688.06	0.44
41	000538	云南白药	11,400	1,069,434.00	0.43
42	000776	广发证券	74,100	1,046,292.00	0.42
43	300003	乐普医疗	28,426	1,038,117.52	0.42
44	002460	赣锋锂业	19,350	1,036,579.50	0.42
45	002129	中环股份	46,100	1,035,406.00	0.42
46	002271	东方雨虹	24,402	991,453.26	0.40
47	000895	双汇发展	21,500	990,935.00	0.40
48	000977	浪潮信息	24,953	977,658.54	0.40
49	300413	芒果超媒	14,830	966,916.00	0.39
50	300253	卫宁健康	41,747	957,676.18	0.39
51	002371	北方华创	5,500	940,005.00	0.38
52	000938	紫光股份	21,848	939,027.04	0.38
53	002127	南极电商	44,350	938,889.50	0.38
54	002044	美年健康	64,204	925,179.64	0.37
55	002050	三花智控	42,100	921,990.00	0.37

56	002456	欧菲光	49,700	913,983.00	0.37
57	002624	完美世界	15,500	893,420.00	0.36
58	002384	东山精密	28,500	853,575.00	0.34
59	002001	新和成	29,215	850,156.50	0.34
60	002311	海大集团	17,780	846,150.20	0.34
61	300433	蓝思科技	29,559	828,834.36	0.33
62	300454	深信服	4,000	823,840.00	0.33
63	002236	大华股份	42,500	816,425.00	0.33
64	000157	中联重科	125,500	806,965.00	0.33
65	002008	大族激光	21,900	787,305.00	0.32
66	002821	凯莱英	3,200	777,600.00	0.31
67	002024	苏宁易购	88,500	776,145.00	0.31
68	002463	沪电股份	30,200	754,396.00	0.30
69	300408	三环集团	27,200	753,440.00	0.30
70	002185	华天科技	55,474	750,563.22	0.30
71	002049	紫光国微	10,100	734,775.00	0.30
72	002439	启明星辰	17,400	732,018.00	0.30
73	300383	光环新网	27,900	727,353.00	0.29
74	000860	顺鑫农业	12,490	711,680.20	0.29
75	002602	世纪华通	46,091	705,653.21	0.29
76	300033	同花顺	5,300	705,324.00	0.29
77	300558	贝达药业	4,900	685,902.00	0.28
78	300012	华测检测	34,600	683,696.00	0.28
79	002841	视源股份	6,820	678,726.40	0.27
80	000783	长江证券	100,200	675,348.00	0.27
81	300661	圣邦股份	2,200	671,110.00	0.27
82	300676	华大基因	4,300	670,413.00	0.27
83	000425	徐工机械	108,900	643,599.00	0.26
84	002202	金风科技	64,236	640,432.92	0.26
85	002916	深南电路	3,784	633,895.68	0.26
86	300529	健帆生物	9,080	631,060.00	0.26
87	002736	国信证券	54,700	618,110.00	0.25
88	002405	四维图新	37,450	617,550.50	0.25
89	000066	中国长城	46,704	616,492.80	0.25
90	002385	大北农	67,550	615,380.50	0.25
91	300144	宋城演艺	35,351	611,572.30	0.25
92	002065	东华软件	48,700	609,724.00	0.25
93	002120	韵达股份	24,829	607,069.05	0.25
94	000768	中航飞机	34,000	603,160.00	0.24
95	300450	先导智能	12,975	599,574.75	0.24
96	002157	正邦科技	33,800	590,824.00	0.24
97	300088	长信科技	52,600	589,120.00	0.24

98	000069	华侨城 A	97,200	589,032.00	0.24
99	002179	中航光电	14,161	580,742.61	0.23
100	000625	长安汽车	52,688	579,568.00	0.23
101	300285	国瓷材料	16,800	562,968.00	0.23
102	002223	鱼跃医疗	15,230	554,372.00	0.22
103	002465	海格通信	42,100	544,774.00	0.22
104	002812	恩捷股份	8,270	544,166.00	0.22
105	002466	天齐锂业	23,549	540,449.55	0.22
106	002212	南洋股份	19,900	528,942.00	0.21
107	002074	国轩高科	19,690	528,479.60	0.21
108	300496	中科创达	6,700	520,590.00	0.21
109	002131	利欧股份	133,834	516,599.24	0.21
110	002493	荣盛石化	41,850	514,755.00	0.21
111	300463	迈克生物	8,800	512,424.00	0.21
112	002075	沙钢股份	40,900	511,250.00	0.21
113	000988	华工科技	20,900	510,587.00	0.21
114	002600	领益智造	48,000	510,240.00	0.21
115	000963	华东医药	19,895	503,343.50	0.20
116	002422	科伦药业	23,600	495,600.00	0.20
117	002340	格林美	99,520	494,614.40	0.20
118	000656	金科股份	60,500	493,680.00	0.20
119	002373	千方科技	20,500	491,795.00	0.20
120	002601	龙鳞佰利	26,400	488,400.00	0.20
121	300212	易华录	8,716	488,096.00	0.20
122	000786	北新建材	22,600	482,058.00	0.19
123	300595	欧普康视	6,900	478,446.00	0.19
124	300315	掌趣科技	64,300	471,319.00	0.19
125	300770	新媒股份	2,100	469,686.00	0.19
126	300207	欣旺达	24,800	468,720.00	0.19
127	000513	丽珠集团	9,667	464,112.67	0.19
128	000750	国海证券	106,865	463,794.10	0.19
129	002507	涪陵榨菜	12,700	457,327.00	0.18
130	002607	中公教育	16,300	452,325.00	0.18
131	000009	中国宝安	53,072	451,642.72	0.18
132	000596	古井贡酒	3,000	450,720.00	0.18
133	300168	万达信息	20,400	450,228.00	0.18
134	300271	华宇软件	15,631	440,950.51	0.18
135	002273	水晶光电	25,514	437,309.96	0.18
136	300482	万孚生物	4,200	436,800.00	0.18
137	002180	纳思达	13,200	434,412.00	0.18
138	002252	上海莱士	51,220	433,321.20	0.18
139	000423	东阿阿胶	12,100	433,301.00	0.18

140	000617	中油资本	41,400	430,146.00	0.17
141	000021	深科技	19,666	429,308.78	0.17
142	002797	第一创业	62,020	429,178.40	0.17
143	300699	光威复材	6,840	429,073.20	0.17
144	002603	以岭药业	13,703	427,396.57	0.17
145	002030	达安基因	15,616	426,004.48	0.17
146	002019	亿帆医药	18,500	424,945.00	0.17
147	002353	杰瑞股份	13,600	421,600.00	0.17
148	000728	国元证券	50,100	420,840.00	0.17
149	002414	高德红外	14,350	420,168.00	0.17
150	002138	顺络电子	16,700	416,665.00	0.17
151	300326	凯利泰	14,300	416,130.00	0.17
152	000961	中南建设	46,750	416,075.00	0.17
153	300024	机器人	30,366	415,103.22	0.17
154	300017	网宿科技	48,252	409,659.48	0.17
155	300357	我武生物	6,540	407,115.00	0.16
156	002156	通富微电	16,100	403,305.00	0.16
157	300009	安科生物	22,455	401,944.50	0.16
158	002709	天赐材料	11,880	401,425.20	0.16
159	000547	航天发展	29,300	400,531.00	0.16
160	300628	亿联网络	5,850	399,321.00	0.16
161	300308	中际旭创	6,320	398,160.00	0.16
162	300058	蓝色光标	50,419	393,268.20	0.16
163	002152	广电运通	30,350	392,729.00	0.16
164	000703	恒逸石化	42,966	392,279.58	0.16
165	002557	洽洽食品	7,200	390,168.00	0.16
166	300316	晶盛机电	15,580	385,449.20	0.16
167	300146	汤臣倍健	19,500	383,955.00	0.16
168	300759	康龙化成	3,900	383,760.00	0.16
169	002511	中顺洁柔	16,900	376,870.00	0.15
170	002146	荣盛发展	46,500	376,650.00	0.15
171	002926	华西证券	35,300	375,239.00	0.15
172	002508	老板电器	11,990	373,008.90	0.15
173	000739	普洛药业	15,900	370,311.00	0.15
174	002673	西部证券	45,366	370,186.56	0.15
175	000401	冀东水泥	23,000	368,920.00	0.15
176	000998	隆平高科	22,000	366,300.00	0.15
177	002299	圣农发展	12,600	365,400.00	0.15
178	002396	星网锐捷	10,200	360,366.00	0.15
179	002572	索菲亚	14,908	360,326.36	0.15
180	002174	游族网络	13,800	359,904.00	0.15
181	002013	中航机电	45,462	359,149.80	0.15

182	000623	吉林敖东	22,820	358,958.60	0.15
183	000050	深天马 A	23,200	356,352.00	0.14
184	300244	迪安诊断	10,072	355,541.60	0.14
185	002250	联化科技	16,200	353,160.00	0.14
186	000975	银泰黄金	22,341	350,306.88	0.14
187	300010	豆神教育	17,861	349,539.77	0.14
188	002436	兴森科技	27,200	348,976.00	0.14
189	002500	山西证券	53,280	348,451.20	0.14
190	300274	阳光电源	24,180	347,950.20	0.14
191	300724	捷佳伟创	3,900	345,267.00	0.14
192	002912	中新赛克	2,100	343,539.00	0.14
193	002938	鹏鼎控股	6,800	340,408.00	0.14
194	002773	康弘药业	6,860	340,256.00	0.14
195	002382	蓝帆医疗	11,300	340,243.00	0.14
196	002078	太阳纸业	35,700	339,864.00	0.14
197	002195	二三四五	120,664	339,065.84	0.14
198	300115	长盈精密	14,680	335,438.00	0.14
199	002683	宏大爆破	9,600	335,040.00	0.14
200	300070	碧水源	40,614	329,785.68	0.13
201	000540	中天金融	101,626	327,235.72	0.13
202	300418	昆仑万维	13,100	326,976.00	0.13
203	002739	万达电影	21,400	326,778.00	0.13
204	300451	创业慧康	17,625	325,886.25	0.13
205	000630	铜陵有色	168,200	324,626.00	0.13
206	002153	石基信息	8,292	323,636.76	0.13
207	300773	拉卡拉	9,300	323,361.00	0.13
208	002690	美亚光电	6,100	320,860.00	0.13
209	300037	新宙邦	5,800	319,348.00	0.13
210	300502	新易盛	5,000	315,600.00	0.13
211	002281	光迅科技	9,600	315,456.00	0.13
212	002268	卫士通	14,760	314,978.40	0.13
213	002402	和而泰	19,300	312,853.00	0.13
214	002387	维信诺	21,800	311,304.00	0.13
215	002123	梦网集团	15,600	308,880.00	0.12
216	000686	东北证券	36,520	308,594.00	0.12
217	000997	新大陆	19,250	307,615.00	0.12
218	300001	特锐德	14,500	303,630.00	0.12
219	300073	当升科技	9,100	300,937.00	0.12
220	300054	鼎龙股份	18,000	298,800.00	0.12
221	300457	赢合科技	9,350	298,078.00	0.12
222	002939	长城证券	24,100	296,912.00	0.12
223	002368	太极股份	6,708	293,072.52	0.12

224	000581	威孚高科	14,100	291,588.00	0.12
225	000413	东旭光电	109,200	291,564.00	0.12
226	002032	苏泊尔	4,100	291,100.00	0.12
227	002958	青农商行	65,500	290,165.00	0.12
228	300226	上海钢联	3,660	287,676.00	0.12
229	001914	招商积余	9,200	282,716.00	0.11
230	002080	中材科技	18,180	281,790.00	0.11
231	300113	顺网科技	11,070	281,178.00	0.11
232	300251	光线传媒	25,680	280,168.80	0.11
233	000999	华润三九	9,582	279,698.58	0.11
234	002081	金螳螂	35,463	278,739.18	0.11
235	002294	信立泰	9,300	275,838.00	0.11
236	002028	思源电气	13,400	274,164.00	0.11
237	300223	北京君正	2,700	272,538.00	0.11
238	300369	绿盟科技	11,700	272,493.00	0.11
239	300296	利亚德	44,850	272,239.50	0.11
240	300567	精测电子	3,850	262,762.50	0.11
241	000878	云南铜业	24,500	259,945.00	0.11
242	002217	合力泰	49,400	259,350.00	0.10
243	000671	阳光城	40,800	258,672.00	0.10
244	000158	常山北明	24,670	257,554.80	0.10
245	300118	东方日升	17,100	256,500.00	0.10
246	002727	一心堂	6,900	256,059.00	0.10
247	002100	天康生物	15,900	255,990.00	0.10
248	300476	胜宏科技	10,600	254,930.00	0.10
249	000735	罗牛山	24,600	251,904.00	0.10
250	002124	天邦股份	19,600	251,860.00	0.10
251	300166	东方国信	20,239	251,165.99	0.10
252	002901	大博医疗	2,100	250,509.00	0.10
253	300348	长亮科技	13,150	249,850.00	0.10
254	002568	百润股份	5,500	249,260.00	0.10
255	300630	普利制药	3,350	247,732.50	0.10
256	300002	神州泰岳	39,718	245,854.42	0.10
257	002056	横店东磁	21,700	244,125.00	0.10
258	000060	中金岭南	65,500	243,660.00	0.10
259	002023	海特高新	15,800	242,846.00	0.10
260	300036	超图软件	9,600	241,728.00	0.10
261	300026	红日药业	43,400	239,568.00	0.10
262	002675	东诚药业	11,400	238,830.00	0.10
263	002151	北斗星通	7,450	238,623.50	0.10
264	000877	天山股份	15,600	235,560.00	0.10
265	002409	雅克科技	4,500	234,765.00	0.09

266	002025	航天电器	6,370	233,014.60	0.09
267	002807	江阴银行	58,720	230,769.60	0.09
268	002233	塔牌集团	19,100	229,773.00	0.09
269	300747	锐科激光	2,100	228,543.00	0.09
270	300379	东方通	5,300	228,059.00	0.09
271	300294	博雅生物	6,050	226,814.50	0.09
272	002262	恩华药业	13,400	225,924.00	0.09
273	002791	坚朗五金	2,400	225,816.00	0.09
274	000800	一汽解放	20,900	224,466.00	0.09
275	002643	万润股份	13,000	223,210.00	0.09
276	000709	河钢股份	109,100	222,564.00	0.09
277	002705	新宝股份	6,100	222,528.00	0.09
278	300188	美亚柏科	11,200	222,096.00	0.09
279	300766	每日互动	5,800	220,748.00	0.09
280	000778	新兴铸管	64,200	220,206.00	0.09
281	300674	宇信科技	5,100	220,065.00	0.09
282	000034	神州数码	9,000	219,060.00	0.09
283	000970	中科三环	22,200	217,116.00	0.09
284	002458	益生股份	14,110	215,459.70	0.09
285	002558	巨人网络	12,300	214,020.00	0.09
286	000729	燕京啤酒	31,200	213,720.00	0.09
287	000960	锡业股份	24,921	213,323.76	0.09
288	000627	天茂集团	40,900	213,089.00	0.09
289	002429	兆驰股份	43,000	212,850.00	0.09
290	002242	九阳股份	5,700	212,439.00	0.09
291	300618	寒锐钴业	3,392	210,371.84	0.09
292	000402	金融街	31,600	209,824.00	0.08
293	002831	裕同科技	7,620	209,626.20	0.08
294	002925	盈趣科技	3,600	208,584.00	0.08
295	000723	美锦能源	33,300	208,458.00	0.08
296	000738	航发控制	15,200	207,480.00	0.08
297	000400	许继电气	15,500	204,600.00	0.08
298	002595	豪迈科技	10,500	204,330.00	0.08
299	000690	宝新能源	43,100	203,432.00	0.08
300	000951	中国重汽	6,500	203,190.00	0.08
301	000710	贝瑞基因	3,400	203,116.00	0.08
302	002920	德赛西威	3,300	202,389.00	0.08
303	002468	申通快递	12,300	201,843.00	0.08
304	002038	双鹭药业	15,750	201,757.50	0.08
305	002099	海翔药业	25,400	200,914.00	0.08
306	002110	三钢闽光	29,750	198,135.00	0.08
307	300078	思创医惠	14,620	197,808.60	0.08

308	000830	鲁西化工	26,500	197,690.00	0.08
309	002648	卫星石化	12,100	196,867.00	0.08
310	002183	怡亚通	36,700	196,712.00	0.08
311	000672	上峰水泥	8,300	195,963.00	0.08
312	002004	华邦健康	36,200	194,756.00	0.08
313	000629	攀钢钒钛	96,400	193,764.00	0.08
314	000681	视觉中国	10,400	193,648.00	0.08
315	002191	劲嘉股份	21,700	193,347.00	0.08
316	002597	金禾实业	8,400	192,948.00	0.08
317	002399	海普瑞	7,680	192,307.20	0.08
318	000983	西山煤电	50,810	190,537.50	0.08
319	002506	协鑫集成	72,700	189,747.00	0.08
320	002085	万丰奥威	29,256	189,578.88	0.08
321	300133	华策影视	26,084	189,109.00	0.08
322	002635	安洁科技	7,550	187,995.00	0.08
323	000825	太钢不锈	56,500	187,580.00	0.08
324	002048	宁波华翔	12,100	186,824.00	0.08
325	300180	华峰超纤	21,753	186,205.68	0.08
326	000564	供销大集	41,100	184,539.00	0.07
327	000089	深圳机场	24,000	183,840.00	0.07
328	000035	中国天楹	35,700	182,070.00	0.07
329	003816	中国广核	61,400	181,744.00	0.07
330	300474	景嘉微	2,700	181,710.00	0.07
331	000831	五矿稀土	15,900	181,578.00	0.07
332	000039	中集集团	25,060	181,183.80	0.07
333	300458	全志科技	4,923	181,166.40	0.07
334	300098	高新兴	29,792	180,539.52	0.07
335	300182	捷成股份	45,234	180,483.66	0.07
336	000591	太阳能	53,300	180,154.00	0.07
337	000598	兴蓉环境	39,100	179,860.00	0.07
338	300324	旋极信息	26,738	178,075.08	0.07
339	300373	扬杰科技	5,300	177,656.00	0.07
340	000967	盈峰环境	21,500	177,375.00	0.07
341	000807	云铝股份	40,600	177,016.00	0.07
342	002092	中泰化学	39,000	176,670.00	0.07
343	002839	张家港行	30,400	175,104.00	0.07
344	300170	汉得信息	18,200	175,084.00	0.07
345	000563	陕国投 A	47,100	174,741.00	0.07
346	002010	传化智联	31,800	172,992.00	0.07
347	002035	华帝股份	17,050	172,716.50	0.07
348	000883	湖北能源	49,000	172,480.00	0.07
349	000932	华菱钢铁	44,760	168,745.20	0.07

350	002237	恒邦股份	12,300	168,141.00	0.07
351	002203	海亮股份	19,200	168,000.00	0.07
352	000555	神州信息	10,900	167,642.00	0.07
353	000012	南玻A	33,239	166,859.78	0.07
354	300633	开立医疗	4,200	166,530.00	0.07
355	300068	南都电源	15,600	166,296.00	0.07
356	300456	赛微电子	6,000	165,720.00	0.07
357	002583	海能达	21,820	165,613.80	0.07
358	002444	巨星科技	13,900	165,132.00	0.07
359	000488	晨鸣纸业	33,100	163,514.00	0.07
360	000528	柳工	25,880	163,302.80	0.07
361	002310	东方园林	33,800	163,254.00	0.07
362	000156	华数传媒	15,000	162,450.00	0.07
363	002407	多氟多	15,200	161,728.00	0.07
364	000839	中信国安	67,600	160,888.00	0.07
365	300038	数知科技	19,700	160,752.00	0.06
366	000078	海王生物	38,250	160,267.50	0.06
367	002216	三全食品	6,700	160,130.00	0.06
368	300783	三只松鼠	2,100	159,558.00	0.06
369	002701	奥瑞金	37,900	158,801.00	0.06
370	002266	浙富控股	40,940	158,437.80	0.06
371	002670	国盛金控	17,293	158,230.95	0.06
372	000559	万向钱潮	32,628	157,919.52	0.06
373	000027	深圳能源	33,940	157,481.60	0.06
374	002640	跨境通	24,200	157,058.00	0.06
375	002440	闰土股份	17,100	156,294.00	0.06
376	002745	木林森	10,100	155,641.00	0.06
377	002155	湖南黄金	19,700	155,236.00	0.06
378	000516	国际医学	38,300	155,115.00	0.06
379	002936	郑州银行	44,950	154,628.00	0.06
380	000415	渤海租赁	51,800	154,364.00	0.06
381	002389	航天彩虹	11,400	153,330.00	0.06
382	000028	国药一致	3,400	153,034.00	0.06
383	300768	迪普科技	3,300	152,757.00	0.06
384	000046	泛海控股	40,500	152,685.00	0.06
385	000712	锦龙股份	12,200	152,500.00	0.06
386	002815	崇达技术	7,500	151,725.00	0.06
387	300459	金科文化	43,880	151,386.00	0.06
388	000930	中粮科技	22,000	150,260.00	0.06
389	000708	中信特钢	8,790	150,221.10	0.06
390	002449	国星光电	12,940	150,104.00	0.06
391	000688	国城矿业	8,100	150,093.00	0.06

392	300339	润和软件	14,400	149,328.00	0.06
393	300666	江丰电子	2,500	149,200.00	0.06
394	000887	中鼎股份	19,000	149,150.00	0.06
395	002372	伟星新材	12,740	148,166.20	0.06
396	000758	中色股份	35,400	147,972.00	0.06
397	000789	万年青	11,390	146,589.30	0.06
398	002505	大康农业	64,530	145,192.50	0.06
399	002244	滨江集团	33,700	143,899.00	0.06
400	000902	新洋丰	16,202	143,225.68	0.06
401	002292	奥飞娱乐	17,000	143,140.00	0.06
402	300085	银之杰	8,877	142,209.54	0.06
403	000898	鞍钢股份	57,952	141,982.40	0.06
404	300775	三角防务	6,500	140,660.00	0.06
405	000826	启迪环境	18,629	138,227.18	0.06
406	002589	瑞康医药	25,780	138,180.80	0.06
407	300777	中简科技	3,800	137,560.00	0.06
408	300053	欧比特	12,600	136,836.00	0.06
409	002002	鸿达兴业	37,861	136,678.21	0.06
410	000650	仁和药业	22,700	136,200.00	0.06
411	002042	华孚时尚	21,800	135,814.00	0.05
412	000301	东方盛虹	24,300	135,108.00	0.05
413	002531	天顺风能	22,500	134,550.00	0.05
414	300602	飞荣达	4,094	134,365.08	0.05
415	002390	信邦制药	29,400	134,064.00	0.05
416	000008	神州高铁	45,400	133,476.00	0.05
417	000031	大悦城	26,000	132,340.00	0.05
418	002430	杭氧股份	9,300	132,060.00	0.05
419	000987	越秀金控	11,250	131,175.00	0.05
420	300072	三聚环保	30,537	130,698.36	0.05
421	002302	西部建设	13,500	129,600.00	0.05
422	000732	泰禾集团	25,300	128,777.00	0.05
423	002091	江苏国泰	21,100	127,655.00	0.05
424	000921	海信家电	10,400	126,464.00	0.05
425	300616	尚品宅配	2,100	126,168.00	0.05
426	002249	大洋电机	34,700	125,267.00	0.05
427	002194	武汉凡谷	6,000	124,200.00	0.05
428	002625	光启技术	17,040	123,540.00	0.05
429	002611	东方精工	26,700	123,087.00	0.05
430	300377	赢时胜	13,050	121,887.00	0.05
431	000933	神火股份	29,300	121,595.00	0.05
432	002064	华峰氨纶	23,900	121,173.00	0.05
433	000685	中山公用	15,700	120,890.00	0.05

434	002376	新北洋	11,800	120,242.00	0.05
435	300748	金力永磁	3,600	120,168.00	0.05
436	002128	露天煤业	15,500	120,125.00	0.05
437	002320	海峡股份	10,912	120,032.00	0.05
438	000810	创维数字	9,900	119,592.00	0.05
439	000560	我爱我家	37,300	119,360.00	0.05
440	002950	奥美医疗	4,200	119,196.00	0.05
441	000676	智度股份	13,880	118,535.20	0.05
442	000683	远兴能源	63,200	117,552.00	0.05
443	000717	韶钢松山	30,900	117,420.00	0.05
444	300735	光弘科技	6,340	116,973.00	0.05
445	002408	齐翔腾达	18,800	116,748.00	0.05
446	002434	万里扬	13,300	115,444.00	0.05
447	002503	搜于特	40,900	114,929.00	0.05
448	300741	华宝股份	3,100	114,328.00	0.05
449	002867	周大生	5,100	113,067.00	0.05
450	002665	首航高科	46,310	112,996.40	0.05
451	002459	晶澳科技	6,000	112,680.00	0.05
452	000718	苏宁环球	36,209	111,885.81	0.05
453	002653	海思科	4,200	111,762.00	0.05
454	000990	诚志股份	8,800	111,672.00	0.05
455	300257	开山股份	8,500	111,095.00	0.04
456	000582	北部湾港	10,300	110,622.00	0.04
457	002596	海南瑞泽	16,600	110,556.00	0.04
458	002563	森马服饰	15,600	109,980.00	0.04
459	002544	杰赛科技	8,123	106,817.45	0.04
460	001965	招商公路	15,200	102,296.00	0.04
461	000059	华锦股份	22,600	102,152.00	0.04
462	002424	贵州百灵	12,200	101,260.00	0.04
463	002419	天虹股份	10,600	101,230.00	0.04
464	000869	张裕A	2,900	99,035.00	0.04
465	000062	深圳华强	6,805	98,944.70	0.04
466	002383	合众思壮	10,100	97,869.00	0.04
467	002491	通鼎互联	18,700	95,744.00	0.04
468	000989	九芝堂	9,300	93,744.00	0.04
469	002737	葵花药业	6,300	92,169.00	0.04
470	002051	中工国际	12,356	89,951.68	0.04
471	002118	紫鑫药业	20,000	88,800.00	0.04
472	002537	海联金汇	14,800	85,988.00	0.03
473	300527	中船应急	9,400	85,258.00	0.03
474	300682	朗新科技	5,000	85,100.00	0.03
475	000600	建投能源	16,700	85,003.00	0.03

476	000553	安道麦 A	9,400	84,788.00	0.03
477	300761	立华股份	2,200	84,788.00	0.03
478	002461	珠江啤酒	8,400	84,168.00	0.03
479	000935	四川双马	6,500	83,460.00	0.03
480	000937	冀中能源	27,390	82,717.80	0.03
481	000959	首钢股份	19,000	81,700.00	0.03
482	000537	广宇发展	11,000	80,300.00	0.03
483	002755	奥赛康	4,000	75,600.00	0.03
484	002061	浙江交科	14,500	75,110.00	0.03
485	002948	青岛银行	14,700	74,823.00	0.03
486	300634	彩讯股份	3,200	71,136.00	0.03
487	002966	苏州银行	8,200	68,716.00	0.03
488	000968	蓝焰控股	8,900	68,085.00	0.03
489	002946	新乳业	3,900	67,665.00	0.03
490	000958	东方能源	16,200	67,392.00	0.03
491	000950	重药控股	12,400	62,496.00	0.03
492	002243	通产丽星	4,300	61,920.00	0.03
493	002961	瑞达期货	2,100	58,065.00	0.02
494	002941	新疆交建	4,000	56,600.00	0.02
495	002818	富森美	4,000	49,200.00	0.02
496	000923	河钢资源	3,300	41,580.00	0.02
497	002423	中粮资本	4,400	38,280.00	0.02
498	001872	招商港口	2,500	36,375.00	0.01
499	002911	佛燃能源	2,100	31,920.00	0.01
500	000785	居然之家	3,600	28,512.00	0.01

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	300824	北鼎股份	1,954	26,789.34	0.01
2	300847	中船汉光	1,421	9,861.74	0.00
3	300845	捷安高科	470	8,286.10	0.00
4	300843	胜蓝股份	751	7,517.51	0.00
5	300840	酷特智能	1,185	7,038.90	0.00
6	300846	首都在线	1,131	3,811.47	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	300782	卓胜微	1,425,535.00	0.57
2	002352	顺丰控股	590,121.00	0.23

3	002714	牧原股份	582,749.00	0.23
4	002841	视源股份	479,354.00	0.19
5	000617	中油资本	413,599.00	0.16
6	300326	凯利泰	401,367.00	0.16
7	000895	双汇发展	392,058.00	0.16
8	000002	万科A	375,744.00	0.15
9	002683	宏大爆破	359,286.00	0.14
10	002436	兴森科技	340,472.00	0.14
11	002250	联化科技	313,943.00	0.12
12	001914	招商积余	298,592.00	0.12
13	300223	北京君正	291,890.00	0.12
14	300502	新易盛	268,730.40	0.11
15	002675	东诚药业	248,867.00	0.10
16	002568	百润股份	248,210.00	0.10
17	002958	青农商行	243,754.00	0.10
18	002120	韵达股份	240,918.13	0.10
19	300661	圣邦股份	238,792.00	0.09
20	002100	天康生物	235,881.00	0.09

注：买入金额按成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

7.4.2 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	300661	圣邦股份	700,179.00	0.28
2	000858	五粮液	525,506.94	0.21
3	000333	美的集团	502,402.00	0.20
4	000001	平安银行	303,264.00	0.12
5	000651	格力电器	242,814.00	0.10
6	002415	海康威视	197,976.00	0.08
7	300059	东方财富	196,895.00	0.08
8	000568	泸州老窖	170,042.00	0.07
9	300203	聚光科技	163,515.00	0.06
10	002912	中新赛克	160,949.00	0.06
11	002421	达实智能	160,628.90	0.06
12	300770	新媒股份	159,490.00	0.06
13	002304	洋河股份	156,145.00	0.06
14	000006	深振业A	152,231.41	0.06
15	000901	航天科技	144,759.88	0.06
16	300832	新产业	139,891.37	0.06
17	002610	爱康科技	137,286.00	0.05
18	000848	承德露露	132,692.80	0.05
19	002475	立讯精密	131,976.00	0.05

20	300498	温氏股份	129,442.00	0.05
----	--------	------	------------	------

注：卖出金额按成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

7.4.3 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	17,353,030.09
卖出股票收入（成交）总额	16,275,835.68

注：买入股票成本、卖出股票收入均按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

无。

7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

无。

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

无。

7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

无。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

无。

7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

无。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

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	10,521.60
2	应收证券清算款	204,275.56
3	应收股利	-
4	应收利息	1,048.34
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	215,845.50

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	300847	中船汉光	9,861.74	0.00	新股流通受限
2	300845	捷安高科	8,286.10	0.00	新股流通受限
3	300843	胜蓝股份	7,517.51	0.00	新股流通受限
4	300840	酷特智能	7,038.90	0.00	新股流通受限

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 (%)
5,767	3,266.06	299,168.00	1.59	18,536,174.00	98.41

注：持有人户数为有效户数，即存量份额大于零的账户。

8.2 期末上市基金前十名持有人

序号	持有人名称	持有份额（份）	占上市总份额比例（%）
1	常州对外贸易有限公司	200,360.00	1.06
2	林莹	197,096.00	1.05
3	贺雅宁	196,965.00	1.05
4	谢元禄	131,444.00	0.70
5	刘小彦	131,310.00	0.70
6	张凤生	131,304.00	0.70
7	李平	128,625.00	0.68
8	万宏	100,052.00	0.53
9	吴晓彤	97,087.00	0.52
10	吕君	93,000.00	0.49

注：以上数据由中国证券登记结算有限公司提供，持有人为场内持有人。

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	持有份额总数（份）	占基金总份额比例（%）
基金管理人所有从业人员持有本基金	0	0

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	22,135,342.00
本报告期基金总申购份额	-
减：本报告期基金总赎回份额	3,300,000.00
本报告期基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-
本报告期末基金份额总额	18,835,342.00

§ 10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

无。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

一、基金管理人的重大人事变动

无。

二、基金托管人的基金托管部门的重大人事变动

无。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

无。

10.4 基金投资策略的改变

本基金投资策略在本报告期内没有重大改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金聘任的为本基金审计的会计师事务所为普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)，该事务所自基金合同生效日起为本基金提供审计服务至今。

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，基金管理人、托管人及其相关高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

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	
国泰君安	2	32,948,519.85	100.00%	30,027.79	100.00%	-
爱建证券	1	-	-	-	-	-
安信证券	1	-	-	-	-	-
川财证券	1	-	-	-	-	-
第一创业	1	-	-	-	-	-
东北证券	2	-	-	-	-	-
东方证券	1	-	-	-	-	-
东吴证券	1	-	-	-	-	-
东兴证券	1	-	-	-	-	-
方正证券	1	-	-	-	-	-
高华证券	1	-	-	-	-	-

光大证券	2	-	-	-	-	-
广发证券	2	-	-	-	-	-
国金证券	2	-	-	-	-	-
国盛证券	1	-	-	-	-	-
国信证券	1	-	-	-	-	-
海通证券	1	-	-	-	-	-
宏源证券	1	-	-	-	-	-
红塔证券	1	-	-	-	-	-
华创证券	1	-	-	-	-	-
华泰证券	1	-	-	-	-	-
华西证券	1	-	-	-	-	-
联讯证券	1	-	-	-	-	-
民生证券	1	-	-	-	-	-
南京证券	1	-	-	-	-	-
平安证券	1	-	-	-	-	-
瑞银证券	2	-	-	-	-	-
山西证券	1	-	-	-	-	-
上海证券	1	-	-	-	-	-
申万宏源	1	-	-	-	-	-
世纪证券	1	-	-	-	-	-
天风证券	2	-	-	-	-	-
万和证券	1	-	-	-	-	-
西部证券	1	-	-	-	-	-
西藏东财	1	-	-	-	-	-
湘财证券	1	-	-	-	-	-
信达证券	1	-	-	-	-	-
兴业证券	2	-	-	-	-	-
招商证券	2	-	-	-	-	-
浙商证券	1	-	-	-	-	-

中国银河证 券	4	-	-	-	-	-
中金公司	3	-	-	-	-	-
中泰证券	2	-	-	-	-	-
中信建投证 券	2	-	-	-	-	-
中信证券	2	-	-	-	-	-
中银国际证 券	1	-	-	-	-	-
中原证券	1	-	-	-	-	-

注：根据中国证监会颁布的《关于完善证券投资基金交易席位制度有关问题的通知》（证监基金字[2007]48号）的有关规定，本公司制定了租用证券公司交易单元的选择标准和程序。租用证券公司交易单元的选择标准主要包括：

- （一）财务状况良好，最近一年无重大违规行为；
- （二）经营行为规范，内控制度健全，能满足各投资组合运作的保密性要求；
- （三）研究实力较强，能提供包括研究报告、路演服务、协助进行上市公司调研等研究服务；
- （四）具备各投资组合运作所需的高效、安全的通讯条件，有足够的交易和清算能力，满足各投资组合证券交易需要；
- （五）能提供投资组合运作、管理所需的其他券商服务；
- （六）相关基金合同、资产管理合同以及法律法规规定的其他条件。租用证券公司交易单元的程序：首先根据租用证券公司交易单元的选择标准形成《券商服务评价表》，然后根据评分高低进行选择基金交易单元。

本报告期内本基金租用证券公司交易单元的变更情况如下：

本报告期内本基金新增交易单元：无。

本报告期内本基金退租交易单元：长城证券。

10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

无。

10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	大成深证成份交易型开放式指数证券投资基金 2019 年年度报告	中国证券报、中国证监会基金电子披露网站及本公司网站	2020 年 4 月 29 日

2	大成基金管理有限公司关于终止泰诚财富基金销售（大连）有限公司办理相关销售业务的公告	中国证券报、中国证监会基金电子披露网站及本公司网站	2020 年 4 月 25 日
3	大成深证成份交易型开放式指数证券投资基金 2020 年第 1 季度报告	中国证券报、中国证监会基金电子披露网站及本公司网站	2020 年 4 月 22 日
4	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及摘要	中国证券报、中国证监会基金电子披露网站及本公司网站	2020 年 3 月 28 日
5	关于调整大成深证成份交易型开放式指数证券投资基金指数许可使用费收取下限的公告	中国证券报、中国证监会基金电子披露网站及本公司网站	2020 年 3 月 28 日
6	大成基金管理有限公司关于延迟披露旗下公募基金 2019 年年度报告的公告	中国证券报、中国证监会基金电子披露网站及本公司网站	2020 年 3 月 25 日
7	大成基金管理有限公司关于注销南京分公司的公告	中国证券报、中国证监会基金电子披露网站及本公司网站	2020 年 3 月 21 日
8	大成基金管理有限公司关于注销青岛分公司的公告	中国证券报、中国证监会基金电子披露网站及本公司网站	2020 年 2 月 29 日
9	大成基金管理有限公司关于 APP 交易平台汇款交易费率优惠的公告	中国证券报、中国证监会基金电子披露网站及本公司网站	2020 年 2 月 26 日
10	大成基金管理有限公司关于 2020 年春节假期延长期间调整公司公募基金开放时间等相关事宜的公告	中国证券报、中国证监会基金电子披露网站及本公司网站	2020 年 1 月 30 日
11	大成深证成份交易型开放式指数证券投资基金 2019 年第 4 季度报告	中国证券报、中国证监会基金电子披露网站及本公司网站	2020 年 1 月 17 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、本报告期内在指定报刊上披露的各种公告原稿。

12.2 存放地点

备查文件存放于本基金管理人和托管人的住所。

12.3 查阅方式

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

大成基金管理有限公司

2020 年 8 月 28 日