

# 大成沪深 300 指数证券投资基金 2023 年年度报告

2023 年 12 月 31 日

基金管理人：大成基金管理有限公司

基金托管人：中国农业银行股份有限公司

送出日期：2024 年 3 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。本年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人中国农业银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2024 年 03 月 28 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

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

本报告期自 2023 年 01 月 01 日起至 12 月 31 日止。

## 1.2 目录

<b>§ 1 重要提示及目录</b>	<b>2</b>
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
<b>§ 2 基金简介</b>	<b>5</b>
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
<b>§ 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况</b>	<b>6</b>
3.1 主要会计数据和财务指标	6
3.2 基金净值表现	8
3.3 过去三年基金的利润分配情况	10
<b>§ 4 管理人报告</b>	<b>11</b>
4.1 基金管理人及基金经理情况	11
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	14
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	14
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	15
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	16
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况	17
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	18
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	19
4.9 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明	19
<b>§ 5 托管人报告</b>	<b>19</b>
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	19
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	19
5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见	19
<b>§ 6 审计报告</b>	<b>19</b>
<b>§ 7 年度财务报表</b>	<b>21</b>
7.1 资产负债表	21
7.2 利润表	22
7.3 净资产变动表	24
7.4 报表附注	25
<b>§ 8 投资组合报告</b>	<b>62</b>
8.1 期末基金资产组合情况	62
8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	62

8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细 .....	64
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动 .....	72
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合 .....	74
8.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细 .....	74
8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细 .....	74
8.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细 .....	74
8.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细 .....	74
8.10 本基金投资股指期货的投资政策 .....	74
8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 .....	75
8.12 投资组合报告附注 .....	75
<b>§ 9 基金份额持有人信息 .....</b>	<b>76</b>
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....	76
9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....	76
9.3 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 .....	77
9.4 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理本人及其直系亲属持有本人管理的产品情况 .....	77
<b>§ 10 开放式基金份额变动 .....</b>	<b>77</b>
<b>§ 11 重大事件揭示 .....</b>	<b>77</b>
11.1 基金份额持有人大会决议 .....	77
11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动 .....	78
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....	78
11.4 基金投资策略的改变 .....	78
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....	78
11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况 .....	78
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	79
11.8 其他重大事件 .....	81
<b>§ 12 影响投资者决策的其他重要信息 .....</b>	<b>85</b>
12.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况 .....	85
12.2 影响投资者决策的其他重要信息 .....	86
<b>§ 13 备查文件目录 .....</b>	<b>86</b>
13.1 备查文件目录 .....	86
13.2 存放地点 .....	86
13.3 查阅方式 .....	86

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	大成沪深 300 指数证券投资基金	
基金简称	大成沪深 300 指数	
基金主代码	519300	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2006 年 4 月 6 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	1,336,505,917.87 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	大成沪深 300 指数 A	大成沪深 300 指数 C
下属分级基金的交易代码	519300	007096
下属分级基金的前端交易代码	519300	-
下属分级基金的后端交易代码	519301	-
报告期末下属分级基金的份额总额	1,197,094,801.21 份	139,411,116.66 份

### 2.2 基金产品说明

投资目标	通过严格的投资程序约束和数量化风险管理手段，实现指数投资偏离度和跟踪误差的最小化。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 0.35%，年跟踪误差不超过 4%。
投资策略	本基金采用被动式指数投资策略。原则上，股票投资组合的构建主要按照标的指数的成份股组成及其权重来拟合、复制标的指数，并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。
业绩比较基准	沪深 300 指数
风险收益特征	本基金为指数基金，是风险中等、获得证券市场平均收益率的产品。

### 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
	联系电话	0755-83183388
	电子邮箱	office@dcfund.com.cn
客户服务电话	4008885558	95599
传真	0755-83199588	010-68121816
注册地址	广东省深圳市南山区海德三道 1236 号大成基金总部大厦 5 层、	北京市东城区建国门内大街 69 号

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

## 2.4 信息披露方式

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

## 2.5 其他相关资料

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

## § 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

### 3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间 数据 和指 标	2023 年		2022 年		2021 年	
	大成沪深 300 指数 A	大成沪深 300 指 数 C	大成沪深 300 指数 A	大成沪深 300 指 数 C	大成沪深 300 指数 A	大成
本期 已实 现收 益	-45,136,276.77	-10,234,601.05	720,552.01	-654,986.79	254,359,314.95	5
本期 利润	-101,844,526.30	-12,675,727.42	-250,471,267.45	-15,642,888.94	-12,437,676.85	1,2
加权 平均 基金 份额 本期 利润	-0.0851	-0.1605	-0.2107	-0.3575	-0.0098	
本期 加权 平均 净值	-8.85%	-17.16%	-20.86%	-34.99%	-0.82%	

利润率						
本期基金份额净值增长率	-8.99%	-9.06%	-18.28%	-18.35%	-1.31%	
3.1.2 期末数据和指标	2023 年末		2022 年末		2021 年末	
期末可供分配利润	-149,230,931.55	-17,983,381.88	-46,103,540.03	-5,010,898.59	205,953,244.02	26,000,000.00
期末可供分配基金份额利润	-0.1247	-0.1290	-0.0382	-0.0422	0.1769	0.1769
期末基金资产净值	1,047,863,869.66	121,427,734.78	1,160,550,285.14	113,799,371.53	1,370,163,979.21	176,300,000.00
期末基金份额净值	0.8753	0.8710	0.9618	0.9578	1.1769	1.1769
3.1.3 累计期末指标	2023 年末		2022 年末		2021 年末	
基金份额累计净值增长率	205.69%	4.34%	235.90%	14.73%	311.02%	311.02%

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

大成沪深 300 指数 A

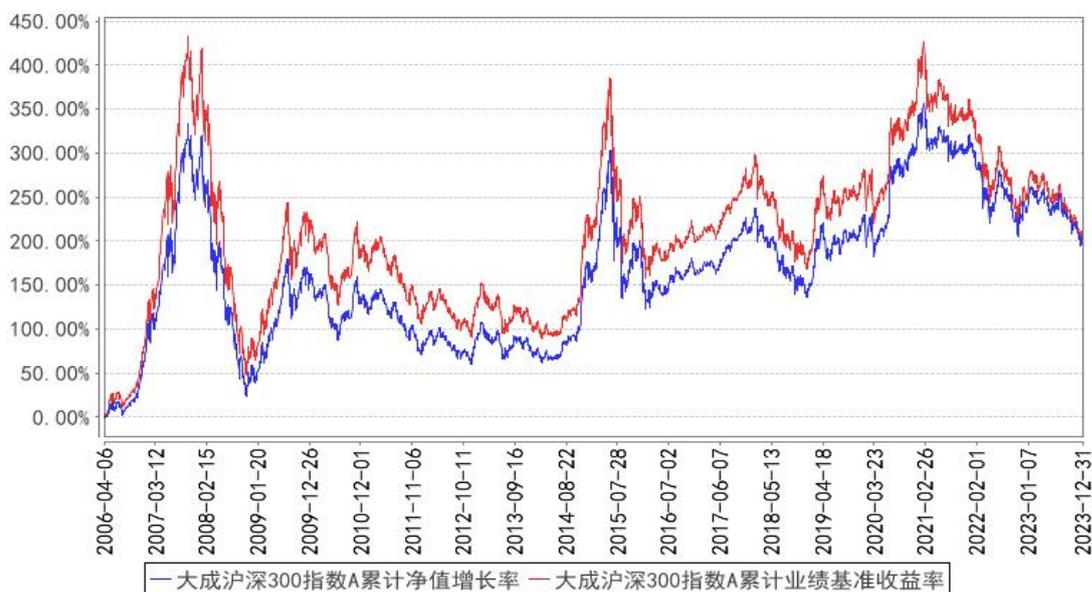
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去三个月	-6.52%	0.74%	-7.00%	0.79%	0.48%	-0.05%
过去六个月	-9.24%	0.80%	-10.71%	0.85%	1.47%	-0.05%
过去一年	-8.99%	0.79%	-11.38%	0.85%	2.39%	-0.06%
过去三年	-26.60%	1.01%	-34.16%	1.11%	7.56%	-0.10%
过去五年	27.46%	1.12%	13.97%	1.21%	13.49%	-0.09%
自基金合同生效起至今	205.69%	1.55%	211.00%	1.64%	-5.31%	-0.09%

大成沪深 300 指数 C

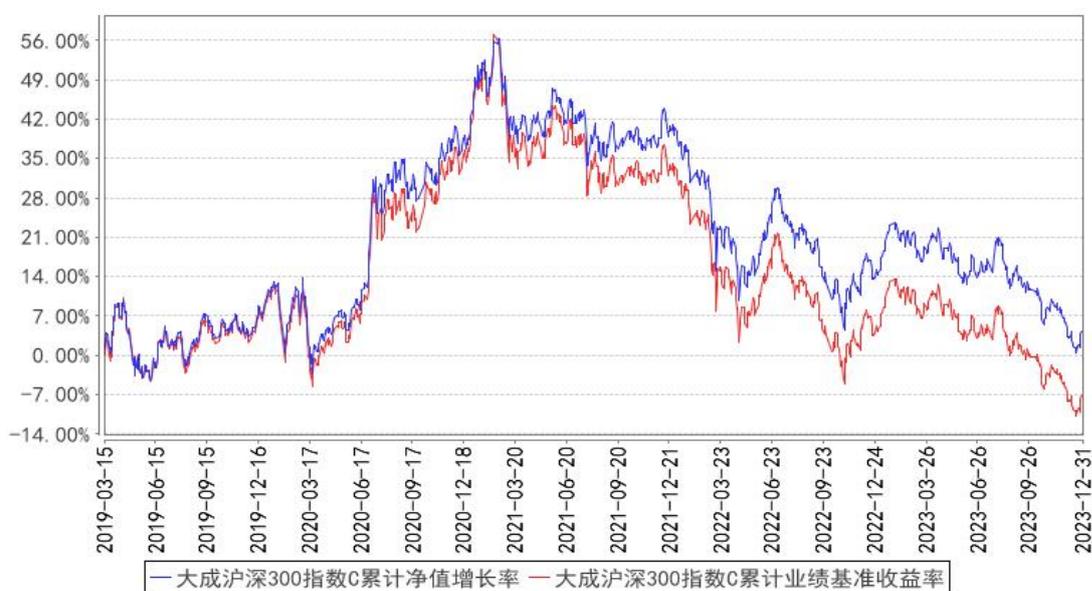
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去三个月	-6.54%	0.74%	-7.00%	0.79%	0.46%	-0.05%
过去六个月	-9.28%	0.80%	-10.71%	0.85%	1.43%	-0.05%
过去一年	-9.06%	0.79%	-11.38%	0.85%	2.32%	-0.06%
过去三年	-26.79%	1.01%	-34.16%	1.11%	7.37%	-0.10%
自基金合同生效起至今	4.34%	1.10%	-7.23%	1.20%	11.57%	-0.10%

### 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

大成沪深300指数A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



大成沪深300指数C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

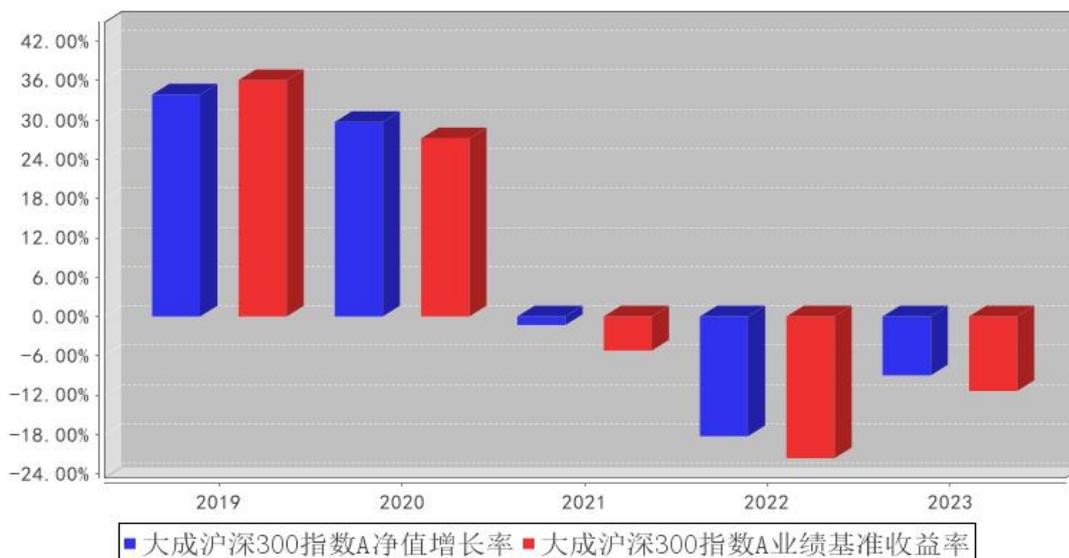


注：1、本基金合同规定，基金管理人应当自基金合同生效之日起六个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的约定。建仓期结束时，本基金的投资组合比例符合基金合同的约定。

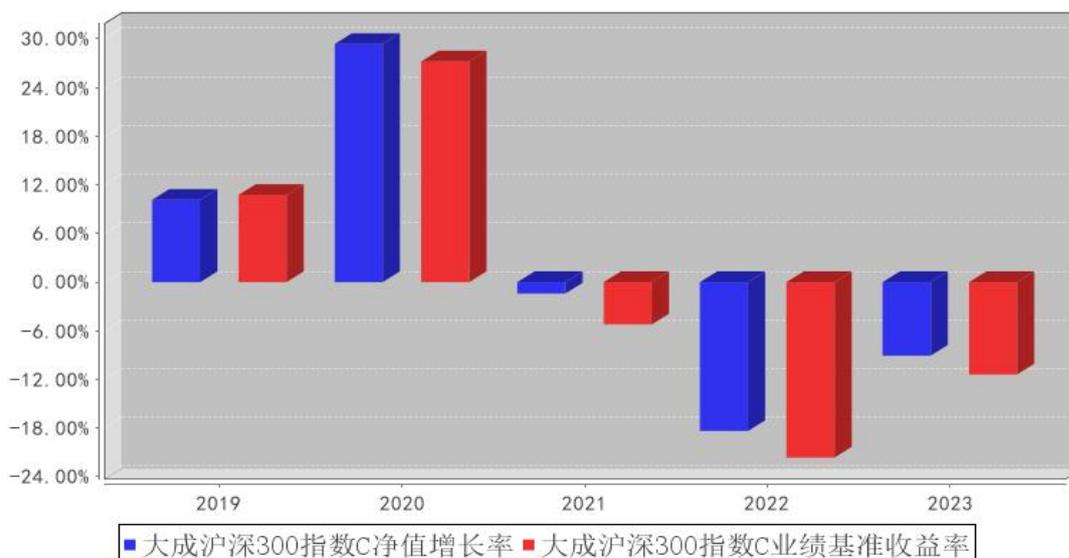
2、本基金自 2019 年 3 月 8 日起增设 C 类基金份额类别，C 类的净值增长率和业绩比较基准收益率自 2019 年 3 月 15 日有份额之日开始计算。

## 3.2.3 过去五年基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

大成沪深300指数A基金每年净值增长率与同期业绩比较基准收益率的对比图



大成沪深300指数C基金每年净值增长率与同期业绩比较基准收益率的对比图



注：合同生效当年按实际存续期计算，不按整个自然年度进行折算。

## 3.3 过去三年基金的利润分配情况

单位：人民币元

大成沪深 300 指数 A

年度	每 10 份基金份额分红数	现金形式发放总额	再投资形式发放总额	年度利润分配合计	备注
2023 年	-	-	-	-	-
2022 年	-	-	-	-	-
2021 年	1.8500	126,800,341.62	111,194,204.82	237,994,546.44	-
合计	1.8500	126,800,341.62	111,194,204.82	237,994,546.44	-

		62	82	44	
大成沪深 300 指数 C					
年度	每 10 份基金份额分红数	现金形式发放总额	再投资形式发放总额	年度利润分配合计	备注
2023 年	-	-	-	-	-
2022 年	-	-	-	-	-
2021 年	1.8230	328,705.30	30,251.71	358,957.01	-
合计	1.8230	328,705.30	30,251.71	358,957.01	-

## § 4 管理人报告

### 4.1 基金管理人及基金经理情况

#### 4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

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

公司业务资质齐全，全面覆盖公募基金、机构投资、海外投资、财富管理、养老金管理等业务，还受全国社会保障基金理事会委托管理部分社保基金和基本养老保险基金。旗下大成国际资产管理有限公司具备 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	2023 年 4 月 14 日	-	15 年	北京大学工商管理硕士。2008 年 4 月至 2011 年 5 月就职于招商基金管理有限公司，任基金核算部基金会计。2011 年 5 月加入大成基金管理有限公司，先后担任基金运营部基金会计、股票投资部投委会秘书兼风控员、数量与指数投资部数量分析师、指数与期货投资部基金经理、指数与期货投资部总监助理。2020 年 6 月 29 日

					<p>至 2023 年 5 月 30 日任大成 MSCI 中国 A 股质优价值 100 交易型开放式指数证券投资基金基金经理。2020 年 6 月 29 日至 2023 年 6 月 14 日任大成 MSCI 中国 A 股质优价值 100 交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理。2020 年 6 月 29 日起任深证成长 40 交易型开放式指数证券投资基金、大成深证成长 40 交易型开放式指数联接基金基金经理。2020 年 6 月 29 日至 2022 年 11 月 30 日任大成中证 500 深市交易型开放式指数证券投资基金基金经理。2021 年 4 月 30 日起任大成中证全指医疗保健设备与服务交易型开放式指数证券投资基金基金经理。2021 年 6 月 17 日起任大成中证红利指数证券投资基金基金经理。2021 年 9 月 2 日至 2022 年 12 月 8 日任中证 500 沪市交易型开放式指数证券投资基金基金经理。2021 年 9 月 2 日起任大成中证 100 交易型开放式指数证券投资基金、大成深证成份交易型开放式指数证券投资基金基金经理。2022 年 6 月 28 日起任大成中证电池主题指数型发起式证券投资基金基金经理。2022 年 7 月 13 日起任大成中证上海环交所碳中和交易型开放式指数证券投资基金基金经理。2022 年 10 月 13 日至 2023 年 10 月 20 日任大成动态量化配置策略混合型证券投资基金基金经理。2023 年 3 月 20 日起任大成有色金属期货交易型开放式指数证券投资基金、大成有色金属期货交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理。2023 年 4 月 14 日起任大成沪深 300 指数证券投资基金基金经理。具备基金从业资格。国籍：中国</p>
李绍	本基金基金经理， 指数与期货投资部 总监	2023 年 4 月 14 日	-	23 年	<p>东北财经大学经济学硕士。曾先后任职于大连商品交易所、中国金融期货交易所和中国期货市场监控中心，曾负责中国证监会期货市场运行监测监控系统建设，获证券期货科技进步评比一等奖；主持编制发布中国商品期货指数、农产品期货指数等系列指数。2015 年 5 月加入大成基金管理有限公司，现任指数与期货投资部总监。2019 年 10 月 24 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基金经理。2019 年 10 月 30 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联接</p>

					基金基金经理。2021 年 10 月 21 日起任大成绝对收益策略混合型发起式证券投资基金基金经理。2022 年 3 月 18 日至 2023 年 6 月 14 日任大成上海金交易型开放式证券投资基金基金经理。2023 年 3 月 20 日起任大成中证红利指数证券投资基金、大成中证全指医疗保健设备与服务交易型开放式指数证券投资基金、大成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。2023 年 4 月 14 日起任大成沪深 300 指数证券投资基金基金经理。具有基金从业资格。国籍：中国
刘旺	本基金基金经理助理	2022 年 12 月 19 日	2023 年 12 月 13 日	5 年	香港中文大学理学（金融工程）硕士。2018 年 5 月加入大成基金管理有限公司，曾担任指数与期货投资部研究员兼基金经理助理，现任指数与期货投资部基金经理。2024 年 1 月 2 日起任大成沪深 300 指数增强型发起式证券投资基金基金经理。具备基金从业资格。国籍：中国
苏秉毅	本基金基金经理，混合资产投资部副总监	2016 年 3 月 4 日	2023 年 4 月 19 日	19 年	清华大学经济学硕士。2004 年 9 月至 2008 年 5 月就职于华夏基金管理有限公司基金运作部。2008 年加入大成基金管理有限公司，曾担任规划发展部高级产品设计师、数量与指数投资部总监助理、指数与期货投资部副总监，现任混合资产投资部副总监。2012 年 8 月 28 日至 2014 年 1 月 23 日任大成中证 500 沪市交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理。2014 年 1 月 24 日至 2014 年 2 月 17 日任大成健康产业股票型证券投资基金基金经理。2012 年 2 月 9 日至 2014 年 9 月 11 日任深证成长 40 交易型开放式指数证券投资基金及大成深证成长 40 交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理。2012 年 8 月 24 日至 2022 年 12 月 8 日任中证 500 沪市交易型开放式指数证券投资基金基金经理。2013 年 1 月 1 日至 2015 年 8 月 25 日任大成沪深 300 指数证券投资基金基金经理。2013 年 2 月 7 日至 2023 年 3 月 20 日任大成中证 100 交易型开放式指数证券投资基金基金经理。2015 年 6 月 5 日至 2023 年 4 月 10 日任大成深证成份交易型开放式指数证券投资基金基金经理。2015 年 6 月 29 日至 2020 年 11 月 13 日任大成中证互联网金融指数分级证券投资基金基金经

					理。2016 年 3 月 4 日至 2023 年 4 月 19 日任大成沪深 300 指数证券投资基金基金经理。2016 年 3 月 4 日起任大成核心双动力混合型证券投资基金基金经理。2018 年 6 月 26 日起任大成景恒混合型证券投资基金基金经理。2021 年 4 月 23 日至 2023 年 7 月 13 日任大成智惠量化多策略灵活配置混合型证券投资基金基金经理。2023 年 4 月 25 日起任大成卓享一年持有期混合型证券投资基金基金经理。2023 年 8 月 1 日起任大成中证 1000 指数增强型发起式证券投资基金基金经理。2024 年 1 月 29 日起任大成丰享回报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
--	--	--	--	--	--

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。

#### 4.1.4 基金经理薪酬机制

无。

### 4.2 管理人对报告期内本基金运作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 公平交易制度和控制方法

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

### 4.3.2 公平交易制度的执行情况

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

#### 4.3.2.1 增加执行的基金经理公平交易制度执行情况及公平交易管理情况

无。

### 4.3.3 异常交易行为的专项说明

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

## 4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

### 4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2023 年，国内经济总体在复苏通道中，GDP 同比 5.2%，实现全年增长目标。不过，由于“有效需求不足”、“部分行业产能过剩”和“社会预期偏弱”等问题的存在，修复过程呈现出“波浪式发展”的态势。从年初脉冲修复到二季度增长环比放缓，从三季度企稳改善到四季度的回踩，股票市场始终伴随经济预期与现实变化而上下波动。报告期内，A 股市场先扬后抑，整体表现不佳。

主要指数方面，沪深 300 跌 11.38%；中证 500 跌 7.42%；创业板指跌 19.41%，中证 1000 跌 6.28%。行业上（中信一级），通信、传媒、煤炭涨幅领先；消费者服务、房地产、电力设备及新能源表现萎靡。主题方面，红利策略整体上贯穿全年；人工智能在上半年表现颇为强势。风格上，小盘、价值相对占优。

阶段表现上，开年伊始，基于对经济的乐观预期，A 股延续了 2022 年底启动的修复行情继续反弹。三月份以后，市场对于后续复苏强度的判断产生了分歧并影响投资方向与风格。主力逐渐定价弱复苏，叠加流动性宽松以及 CHATGPT 为代表的人工智能出现了比较明显的技术进步，交易

方向顺势转向成长，TMT 大幅跑赢。五月份，内部与外部去库存共振，各类经济活动走弱；海外方面，美联储紧缩预期反复，影响国内。因此，股票市场开始普遍下跌，偏股型主动基金陆续回吐年内收益，上半年表现强势的“人工智能”与“中特估”两大投资主线也出现明显回调。直至 7 月份，经济偏弱反而强化了市场对政策放松的期待，资产价格开始伴随政策预期波动。也正如市场所希望的，稳增长政策及活跃资本市场的各项政策在这段时间陆续加码，实际出台的力度较此前预期边际有所提升。这对市场情绪起到提振作用，尤其是基本面受益的房地产、大金融等，在情绪带动下反弹强劲。8 月份以后，国内经济总体企稳，但弹性走弱，结构上面临需求不足的问题。政策上，重要会议基调积极但出台力度相对克制。海外方面，美债收益率经历冲高见顶后逐渐回落的过程。在此背景下，股票市场信心缺乏，A 股走势逐渐低颓。尽管美债收益率回落理应对股票估值的压制作用边际缓和，但因未与分子端形成合力，所以，只有对贴现率更为敏感的小盘股阶段性表现较好。而大盘蓝筹则完全没有演绎分母端改善所带来的变化，在四季度一度出现超跌情况。

本基金标的指数为沪深 300 指数。沪深 300 指数由沪深市场中规模大、流动性好的最具代表性的 300 只证券组成，反映沪深市场上市公司证券的整体表现。本基金采取完全复制法进行投资，即原则上按照标的指数的成份股及其权重构建基金股票投资组合，并根据标的指数成份股及其权重的变动而进行相应调整。

运作层面上，本基金在报告期内基本保持满仓，并根据标的指数成份股调整以及权重的变化及时调整投资组合。各项操作和指标均符合基金合同的要求。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末大成沪深 300 指数 A 的基金份额净值为 0.8753 元，本报告期基金份额净值增长率为-8.99%，同期业绩比较基准收益率为-11.38%；截至本报告期末大成沪深 300 指数 C 的基金份额净值为 0.8710 元，本报告期基金份额净值增长率为-9.06%，同期业绩比较基准收益率为-11.38%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

去年，国内经济缓步复苏。在曲折前进的过程中，经济和市场所面临的各种问题和挑战不会因为跨越了“2024”这个自然年度而消失。不过，时间也带给我们一些变化和空间。

展望 2024 年，宏观经济继续平稳修复。结构上，投资增长的主要支撑是基建和制造业。去年，基建投资增长基数比较高，今年在财政大力支持下应能继续保持；制造业增长依靠内部与外部库存周期共振带动。房地产投资仍是拖累项，不过预计在政策托举下降幅会有所收窄。消费增长则将伴随着向常态化水平靠拢而保持韧性。出口方面，美国库存周期将切换至补库存阶段，叠加一

带一路等新兴国家的出口拉动作为新增长点，增速有望回正。货币政策总量稳中偏松，在“灵活适度”的准则下与财政政策协同。财政政策适度加力，赤字率或保持较高水平。价格端，预计 CPI 和 PPI 以前低后高形态温和增长，助力名义 GDP 增速回升。

对于股票市场而言，2024 年开局市场仍在反映对于经济内外部挑战的担忧，惯性地放大利空因素并形成负反馈。实际上，今年市场环境较 2023 年将会有所改善。首先，经济继续温和复苏，名义 GDP 回升助力企业盈利修复，这是改善投资预期或者信心的基础。其次，美联储加息周期结束，美债收益率大概率会下行，美元走弱。因此，外部环境对 A 股的制约将会一定程度减弱，同时也为国内货币政策打开空间。第三，政策工具箱空间比较丰富，并将继续发力托底经济，包括前期政策的落地执行、防范化解地产风险和重点产业的支持等。最后，股票经过多轮调整，当前配置性价比提高。综上，2024 年股票市场表现应好于去年。同时，由于经济增长或更重结构，A 股也将呈现结构性行情。

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

#### 4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

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

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

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

（三）日常监察和专项监察相结合，确保监察稽核的有效性和深入性。本年度，公司继续对本基金销售、宣传等方面的材料、协议及其他法律资料等进行了严格审查，对本基金各项投资比例、投资权限、基金交易、股票投资限制、股票库维护等方面进行实时监控，同时，还专门针对

基金投资交易（包括公平交易、转债投资、投资权限、投资比例、流动性风险、基金重仓股等）、基金运营（基金头寸、基金结算、登记清算等）、网上交易、基金销售等进行专项监察。通过日常监察，保证了公司监察的全面性、实时性，通过专项监察，及时发现并纠正了业务中的潜在风险，加强了业务部门和人员的风险意识，从而较好地预防了风险的发生。

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

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

#### 4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本基金管理人指导基金估值业务的领导小组为公司估值委员会，公司估值委员会主要负责估值政策和估值程序的制定、修订以及执行情况的监督。估值委员会由公司各投研部门、交易管理部、风险管理部、监察稽核部、基金运营部指定人员组成。公司估值委员会的相关成员均具备相应的专业胜任能力和相关工作经历，估值委员会成员中包括八名投资组合经理。

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

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

本基金管理人参与估值流程各方之间不存在任何重大利益冲突。截止报告期末本基金管理人已与中央国债登记结算有限责任公司及中证指数有限公司签署服务协议，由中央国债登记结算有

限责任公司按约定提供银行间交易的债券品种的估值数据，由中证指数有限公司按约定提供交易所交易的债券品种的估值数据和流通受限股票的折扣率数据。

#### 4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

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

#### 4.9 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

无。

## § 5 托管人报告

### 5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

在托管本基金的过程中，本基金托管人中国农业银行股份有限公司严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》相关法律法规的规定以及基金合同、托管协议的约定，对本基金基金管理人—大成基金管理有限公司 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日基金的投资运作，进行了认真、独立的会计核算和必要的投资监督，认真履行了托管人的义务，没有从事任何损害基金份额持有人利益的行为。

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

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

### 5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

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

## § 6 审计报告

审计报告标题	审计报告
审计报告收件人	大成沪深 300 指数证券投资基金全体基金份额持有人
审计意见	我们审计了大成沪深 300 指数证券投资基金（以下简称“大

	<p>成沪深 300 指数基金”) 的财务报表, 包括 2023 年 12 月 31 日的资产负债表, 2023 年度的利润表、净资产变动表以及相关财务报表附注。我们认为, 后附的大成沪深 300 指数基金的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则的规定编制, 公允反映了大成沪深 300 指数基金 2023 年 12 月 31 日的财务状况以及 2023 年度的经营成果和净资产变动情况。</p>
形成审计意见的基础	<p>我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。审计报告的“注册会计师对财务报表审计的责任”部分进一步阐述了我们在这些准则下的责任。按照中国注册会计师职业道德守则, 我们独立于大成沪深 300 指数基金, 并履行了职业道德方面的其他责任。我们相信, 我们获取的审计证据是充分、适当的, 为发表审计意见提供了基础。</p>
其他信息	<p>大成沪深 300 指数基金管理层对其他信息负责。其他信息包括年度报告中涵盖的信息, 但不包括财务报表和我们的审计报告。我们对财务报表发表的审计意见不涵盖其他信息, 我们也不对其他信息发表任何形式的鉴证结论。结合我们对财务报表的审计, 我们的责任是阅读其他信息, 在此过程中, 考虑其他信息是否与财务报表或我们在审计过程中了解到的情况存在重大不一致或者似乎存在重大错报。基于我们已执行的工作, 如果我们确定其他信息存在重大错报, 我们应当报告该事实。在这方面, 我们无任何事项需要报告。</p>
管理层和治理层对财务报表的责任	<p>管理层负责按照企业会计准则的规定编制财务报表, 使其实现公允反映, 并设计、执行和维护必要的内部控制, 以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。在编制财务报表时, 管理层负责评估大成沪深 300 指数基金的持续经营能力, 披露与持续经营相关的事项(如适用), 并运用持续经营假设, 除非计划进行清算、终止运营或别无其他现实的选择。治理层负责监督大成沪深 300 指数基金的财务报告过程。</p>
注册会计师对财务报表审计的责任	<p>我们的目标是对财务报表整体是否不存在由于舞弊或错误导致的重大错报获取合理保证, 并出具包含审计意见的审计报告。合理保证是高水平的保证, 但并不能保证按照审计准则执行的审计在某一重大错报存在时总能发现。错报可能由于舞弊或错误导致, 如果合理预期错报单独或汇总起来可能影响财务报表使用者依据财务报表作出的经济决策, 则通常认为错报是重大的。在按照审计准则执行审计工作的过程中, 我们运用职业判断, 并保持职业怀疑。同时, 我们也执行以下工作: (1) 识别和评估由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险, 设计和实施审计程序以应对这些风险, 并获取充分、适当的审计证据, 作为发表审计意见的基础。由于舞弊可能涉及串通、伪造、故意遗漏、虚假陈述或凌驾于内部控制之上, 未能发现由于舞弊导致的重大错报的风险高于未能发现由于错误导致的重大错报的风险。(2) 了解与审计相关的内部控制, 以设计恰当的审计程序, 但目的并非对内部控制的有效性发表意见。(3) 评价管理层选用会计政</p>

	策的恰当性和作出会计估计及相关披露的合理性。（4）对管理层使用持续经营假设的恰当性得出结论。同时，根据获取的审计证据，就可能导致对大成沪深 300 指数基金持续经营能力产生重大疑虑的事项或情况是否存在重大不确定性得出结论。如果我们得出结论认为存在重大不确定性，审计准则要求我们在审计报告中提请报表使用者注意财务报表中的相关披露；如果披露不充分，我们应当发表非无保留意见。我们的结论基于截至审计报告日可获得的信息。然而，未来的事项或情况可能导致大成沪深 300 指数基金不能持续经营。（5）评价财务报表的总体列报（包括披露）、结构和内容，并评价财务报表是否公允反映相关交易和事项。我们与治理层就计划的审计范围、时间安排和重大审计发现等事项进行沟通，包括沟通我们在审计中识别出的值得关注的内部控制缺陷。	
会计师事务所的名称	安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）	
注册会计师的姓名	昌华	林恩丽
会计师事务所的地址	北京市东城区东长安街 1 号东方广场安永大楼 17 层 01-12 室	
审计报告日期	2024 年 3 月 28 日	

## § 7 年度财务报表

### 7.1 资产负债表

会计主体：大成沪深 300 指数证券投资基金

报告截止日：2023 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2023 年 12 月 31 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
<b>资产：</b>			
货币资金	7.4.7.1	18,227,157.70	75,477,619.90
结算备付金		205,379.80	12,202.98
存出保证金		244,185.70	42,838.74
交易性金融资产	7.4.7.2	1,150,709,941.68	1,230,691,352.83
其中：股票投资		1,099,536,513.65	1,179,351,202.15
基金投资		-	-
债券投资		51,173,428.03	51,340,150.68
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
其他投资		-	-
衍生金融资产	7.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	-	-
债权投资	7.4.7.5	-	-
其中：债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-

其他投资		-	-
其他债权投资	7.4.7.6	-	-
其他权益工具投资	7.4.7.7	-	-
应收清算款		540,250.79	-
应收股利		-	-
应收申购款		858,972.14	473,991.51
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.8	33,491.90	-
资产总计		1,170,819,379.71	1,306,698,005.96
<b>负债和净资产</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2023年12月31日</b>	<b>上年度末 2022年12月31日</b>
<b>负 债:</b>			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	7.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付清算款		-	30,846,786.77
应付赎回款		296,963.05	135,621.98
应付管理人报酬		733,499.62	778,620.36
应付托管费		146,699.90	155,724.08
应付销售服务费		10,123.05	4,670.08
应付投资顾问费		-	-
应交税费		4,891.05	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.9	335,598.60	426,926.02
负债合计		1,527,775.27	32,348,349.29
<b>净资产:</b>			
实收基金	7.4.7.10	1,336,505,917.87	1,325,464,095.29
未分配利润	7.4.7.12	-167,214,313.43	-51,114,438.62
净资产合计		1,169,291,604.44	1,274,349,656.67
负债和净资产总计		1,170,819,379.71	1,306,698,005.96

注：报告截止日 2023 年 12 月 31 日，基金份额总额 1,336,505,917.87 份，其中，A 类基金份额净值 0.8753 元，基金份额 1,197,094,801.21 份；C 类基金份额净值 0.8710 元，基金份额 139,411,116.66 份。

## 7.2 利润表

会计主体：大成沪深 300 指数证券投资基金

本报告期：2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期	上年度可比期间
		2023 年 1 月 1 日至 2023 年	2022 年 1 月 1 日至 2022 年

		12月31日	12月31日
<b>一、营业总收入</b>		-103,176,182.65	-254,554,005.93
1. 利息收入		543,552.21	330,598.54
其中：存款利息收入	7.4.7.13	291,675.95	330,598.54
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		251,876.26	-
2. 投资收益(损失以“-”填列)		-45,295,159.73	11,026,414.20
其中：股票投资收益	7.4.7.14	-74,381,509.50	-16,545,562.59
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.15	1,063,517.17	1,458,643.76
资产支持证券投资	7.4.7.16	-	-
收益			
贵金属投资收益	7.4.7.17	-	-
衍生工具收益	7.4.7.18	-	-
股利收益	7.4.7.19	28,022,832.60	26,113,333.03
其他投资收益		-	-
3. 公允价值变动收益(损失以“-”号填列)	7.4.7.20	-59,149,375.90	-266,179,721.61
4. 汇兑收益(损失以“-”号填列)		-	-
5. 其他收入(损失以“-”号填列)	7.4.7.21	724,800.77	268,702.94
<b>减：二、营业总支出</b>		11,344,071.07	11,560,150.46
1. 管理人报酬	7.4.10.2.1	9,187,668.83	9,365,162.12
其中：暂估管理人报酬		-	-
2. 托管费	7.4.10.2.2	1,837,533.71	1,873,032.47
3. 销售服务费	7.4.10.2.3	72,085.75	46,692.33
4. 投资顾问费		-	-
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 信用减值损失	7.4.7.22	-	-
7. 税金及附加		906.83	-
8. 其他费用	7.4.7.23	245,875.95	275,263.54
<b>三、利润总额(亏损总额以“-”号填列)</b>		-114,520,253.72	-266,114,156.39
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润(净亏损以“-”号填列)</b>		-114,520,253.72	-266,114,156.39

五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		-114,520,253.72	-266,114,156.39

### 7.3 净资产变动表

会计主体：大成沪深 300 指数证券投资基金

本报告期：2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	1,325,464,095.29	-	-51,114,438.62	1,274,349,656.67
二、本期期初净资产	1,325,464,095.29	-	-51,114,438.62	1,274,349,656.67
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	11,041,822.58	-	-116,099,874.81	-105,058,052.23
(一)、综合收益总额	-	-	-114,520,253.72	-114,520,253.72
(二)、本期基金份额交易产生的净资产变动数(净资产减少以“-”号填列)	11,041,822.58	-	-1,579,621.09	9,462,201.49
其中：1. 基金申购款	911,906,172.90	-	-41,042,529.74	870,863,643.16
2. 基金赎回款	-900,864,350.32	-	39,462,908.65	-861,401,441.67
(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	1,336,505,917.87	-	-167,214,313.43	1,169,291,604.44
项目	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日			

	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	1,314,564,650.68	-	231,966,096.76	1,546,530,747.44
二、本期期初净资产	1,314,564,650.68	-	231,966,096.76	1,546,530,747.44
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	10,899,444.61	-	-283,080,535.38	-272,181,090.77
(一)、综合收益总额	-	-	-266,114,156.39	-266,114,156.39
(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)	10,899,444.61	-	-16,966,378.99	-6,066,934.38
其中：1. 基金申购款	396,945,179.63	-	-8,555,111.20	388,390,068.43
2. 基金赎回款	-386,045,735.02	-	-8,411,267.79	-394,457,002.81
(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	1,325,464,095.29	-	-51,114,438.62	1,274,349,656.67

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.4 财务报表由下列负责人签署：

谭晓冈

范瑛

梁靖

基金管理人负责人

主管会计工作负责人

会计机构负责人

## 7.4 报表附注

### 7.4.1 基金基本情况

大成沪深 300 指数证券投资基金（以下简称“本基金”），系经中国证券监督管理委员会（以

下简称“中国证监会”)证监基金字[2006]24号文《关于同意大成沪深 300 指数证券投资基金募集的批复》的核准,由基金管理人大成基金管理有限公司向社会公开发行募集,基金合同于 2006 年 4 月 6 日正式生效。本基金为契约型开放式,存续期限不定。本基金的基金管理人为大成基金管理有限公司,注册登记机构为中国证券登记结算有限责任公司,基金托管人为中国农业银行股份有限公司(简称“中国农业银行”)。

根据《关于大成沪深 300 指数证券投资基金增设 C 类基金份额并相应修订基金合同和托管协议的公告》自 2019 年 3 月 11 日起,对本基金增设 C 类基金份额类别,并对本基金的基金合同、托管协议作出相应修改。

本基金 A 类、B 类和 C 类基金份额分别设置代码。由于基金费用的不同,本基金 A 类基金份额、B 类基金份额和 C 类基金份额将分别计算基金份额净值。C 类基金份额的管理费率、托管费率与 A 类基金份额及 B 类基金份额相同。A 类份额与 B 类份额收取申购费、不收取销售服务费, C 类基金份额的销售服务费按前一日 C 类基金资产净值的 0.10% 年费计提、不收取申购费用,但对持有期限少于 30 日的本类别基金份额的赎回收取赎回费。

本基金主要投资于具有良好流动性的金融工具,包括沪深 300 指数成份股(含存托凭证)、备选成份股(含存托凭证)、新股(一级市场初次发行或增发)、存托凭证等,现金(不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等)或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金财产净值的 5%。本基金还可以投资于法律法规及中国证监会允许基金投资的其他金融工具。待金融衍生产品推出后,本基金可以依照法律法规或监管机构的规定运用金融衍生产品进行风险管理。本基金跟踪标的指数的投资组合资产原则上不低于基金财产净值的 90%。除非法律法规另有规定,本基金的股票投资比例可以提高到基金财产净值的 100%。本基金的业绩比较基准为:沪深 300 指数。

本财务报表已于 2024 年 3 月 28 日经本基金的基金管理人批准报出。

#### 7.4.2 会计报表的编制基础

本财务报表系按照财政部颁布的《企业会计准则——基本准则》以及其后颁布及修订的具体会计准则、应用指南、解释以及《资产管理产品相关会计处理规定》和其他相关规定(统称“企业会计准则”)编制,同时,在信息披露和估值方面,也参考了中国证监会颁布的《中国证券监督管理委员会关于证券投资基金估值业务的指导意见》、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》、《证券投资基金信息披露内容与格式准则》第 2 号《年度报告的内容与格式》、《证券投资基金信息披露编报规则》第 3 号《会计报表附注的编制及披露》、《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号〈年度报告和中期报告〉》以及中国证监会和中国证券投资基金业协会颁布的其他相关规定。本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

### 7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金于 2023 年 12 月 31 日的财务状况以及 2023 年度的经营成果和净资产变动情况。

### 7.4.4 重要会计政策和会计估计

#### 7.4.4.1 会计年度

本基金会计年度采用公历年度，即每年 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

#### 7.4.4.2 记账本位币

本基金记账本位币和编制本财务报表所采用的货币均为人民币。除有特别说明外，均以人民币元为单位表示。

#### 7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

金融工具是指形成本基金的金融资产（或负债），并形成其他单位的金融负债（或资产）或权益工具的合同。（1）金融资产分类 本基金的金融资产于初始确认时根据管理金融资产的业务模式和金融资产的合同现金流量特征分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、以摊余成本计量的金融资产。（2）金融负债分类 本基金的金融负债于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债、以摊余成本计量的金融负债。

#### 7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

本基金于成为金融工具合同的一方时确认一项金融资产或金融负债。

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

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

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

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

本基金以预期信用损失为基础，对以摊余成本计量的金融资产进行减值处理并确认损失准备。对于不含重大融资成分的应收款项，本基金运用简化计量方法，按照相当于整个存续期内的预期信用损失金额计量损失准备。除上述采用简化计量方法以外的金融资产，本基金在每个估值日评估其信用风险自初始确认后是否已经显著增加，如果信用风险自初始确认后未显著增加，处于第

一阶段，本基金按照相当于未来 12 个月内预期信用损失的金额计量损失准备，并按照账面余额和实际利率计算利息收入；如果信用风险自初始确认后已显著增加但尚未发生信用减值的，处于第二阶段，本基金按照相当于整个存续期内预期信用损失的金额计量损失准备，并按照账面余额和实际利率计算利息收入；如果初始确认后发生信用减值的，处于第三阶段，本基金按照相当于整个存续期内预期信用损失的金额计量损失准备，并按照摊余成本和实际利率计算利息收入。

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

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

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

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

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

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

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

#### 7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

公允价值，是指市场参与者在计量日发生的有序交易中，出售一项资产所能收到或者转移一项负债所需支付的价格。本基金以公允价值计量相关资产或负债，假定出售资产或者转移负债的

有序交易在相关资产或负债的主要市场进行；不存在主要市场的，本基金假定该交易在相关资产或负债的最有利市场进行。主要市场（或最有利市场）是本基金在计量日能够进入的交易市场。本基金采用市场参与者在对该资产或负债定价时为实现其经济利益最大化所使用的假设。在财务报表中以公允价值计量或披露的资产和负债，根据对公允价值计量整体而言具有重要意义的最低层次输入值，确定所属的公允价值层次：第一层次输入值，在计量日能够取得的相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价；第二层次输入值，除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值；第三层次输入值，相关资产或负债的不可观察输入值。每个资产负债表日，本基金对在财务报表中确认的持续以公允价值计量的资产和负债进行重新评估，以确定是否在公允价值计量层次之间发生转换。本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和金融负债按如下原则确定公允价值并进行估值：（1）存在活跃市场的金融工具，按照估值日能够取得的相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价作为公允价值；估值日无报价且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，应采用最近交易日的报价确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的报价不能真实反映公允价值的，应对报价进行调整，确定公允价值。与上述投资品种相同，但具有不同特征的，应以相同资产或负债的公允价值为基础，并在估值技术中考虑不同特征因素的影响。特征是指对资产出售或使用的限制等，如果该限制是针对资产持有者的，那么在估值技术中不应将该限制作为特征考虑。此外，基金管理人不应考虑因大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价。（2）不存在活跃市场的金融工具，应采用在当前情况下适用并且有足够可利用数据和其他信息支持的估值技术确定公允价值。采用估值技术确定公允价值时，应优先使用可观察输入值，只有在无法取得相关资产或负债可观察输入值或取得不切实可行的情况下，才使用不可观察输入值。（3）如有确凿证据表明按上述方法进行估值不能客观反映其公允价值的，基金管理人可根据具体情况与基金托管人商定后，按最能反映公允价值的方法估值。（4）如有新增事项，按国家最新规定估值。

#### 7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

当本基金具有抵销已确认金融资产和金融负债的法定权利，且该种法定权利现在是可执行的，同时本基金计划以净额结算或同时变现该金融资产和清偿该金融负债时，金融资产和金融负债以相互抵销后的金额在资产负债表内列示。除此以外，金融资产和金融负债在资产负债表内分别列示，不予相互抵销。

#### 7.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行的基金份额总额所对应的金额。由于申购和赎回引起的实收基金份额变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日确认。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转

入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

#### 7.4.4.8 损益平准金

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

#### 7.4.4.9 收入/（损失）的确认和计量

（1）对于以摊余成本计量的金融资产，采用实际利率法计算的利息扣除在适用情况下的相关税费后的净额确认利息收入，计入当期损益。处置时，其处置价格扣除相关交易费用后的净额与账面价值之间的差额确认为投资收益。（2）对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和金融负债，相关交易费用直接计入投资收益。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产为债权投资的，在持有期间将按票面或合同利率计算的利息收入扣除在适用情况下的相关税费后的净额计入投资收益，扣除该部分利息后的公允价值变动额计入公允价值变动损益；除上述之外的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和金融负债的公允价值变动形成的应计入当期损益的利得或损失扣除在适用情况下预估的增值税费后的净额计入公允价值变动损益。处置时，其处置价格与初始确认金额之间的差额扣除相关交易费用及在适用情况下的相关税费后的净额确认为投资收益。本基金在同时符合下列条件时确认股利收入并计入当期损益：1）基金收取股利的权利已经确立；2）与股利相关的经济利益很可能流入企业；3）股利的金额能够可靠计量。（3）其他收入在经济利益很可能流入从而导致资产增加或者负债减少、且经济利益的流入额能够可靠计量时确认。

#### 7.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬和托管费等费用按照权责发生制原则，在本基金接受相关服务的期间计入当期损益。以摊余成本计量的金融负债在持有期间确认的利息支出按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

#### 7.4.4.11 基金的收益分配政策

（1）基金收益分配应当采用现金方式。基金份额持有人可以事先选择将所获分配的现金收益，按照基金合同有关基金份额申购的约定转为基金份额；基金份额持有人事先未做出选择，基金管理人应当支付现金；本基金默认的分红方式为现金分红；（2）由于本基金 A 类基金份额、B 类

基金份额不收取销售服务费，C 类基金份额收取销售服务费，各基金份额类别对应的可供分配利润有所不同，本基金同一类别每一基金份额享有同等分配权；（3）基金当期收益先弥补上期亏损后，方可进行当期收益分配；（4）基金当期出现亏损，则可不进行收益分配；（5）基金收益分配后每基金份额净值不能低于面值；（6）在符合有关基金分红条件的前提下，基金收益分配每年不超过 6 次，成立不满 3 个月，收益可不分配；（7）基金年度收益分配比例不低于基金年度已实现收益的 50%；（8）法律法规或监管机构另有规定的从其规定。

#### 7.4.4.12 分部报告

无。

#### 7.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计

无。

#### 7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

##### 7.4.5.1 会计政策变更的说明

无。

##### 7.4.5.2 会计估计变更的说明

无。

##### 7.4.5.3 差错更正的说明

无。

#### 7.4.6 税项

##### （1）印花税

证券（股票）交易印花税税率为 1%，由出让方缴纳。自 2023 年 8 月 28 日起，证券交易印花税实施减半征收。

##### （2）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费附加，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费附加。

### （3）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[2005]103 号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》的规定，股权分置改革中非流通股股东通过对价方式向流通股股东支付的股份、现金等收入，暂免征收流通股股东应缴纳的企业所得税。

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。

### （4）个人所得税

根据财政部、国家税务总局财税[2005]103 号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》的规定，股权分置改革中非流通股股东通过对价方式向流通股股东支付的股份、现金等收入，暂免征收流通股股东应缴纳的个人所得税。

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，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，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。

#### 7.4.7 重要财务报表项目的说明

##### 7.4.7.1 货币资金

单位：人民币元

项目	本期末 2023年12月31日	上年度末 2022年12月31日
活期存款	18,227,157.70	75,477,619.90
等于：本金	18,223,287.12	75,469,480.86
加：应计利息	3,870.58	8,139.04
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	18,227,157.70	75,477,619.90

##### 7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2023年12月31日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动

股票		1,289,433,629.76	-	1,099,536,513.65	-189,897,116.11
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-	-
债券	交易所市场	1,000,820.00	14,097.26	1,014,197.26	-720.00
	银行间市场	50,191,900.00	104,230.77	50,159,230.77	-136,900.00
	合计	51,192,720.00	118,328.03	51,173,428.03	-137,620.00
资产支持证券		-	-	-	-
基金		-	-	-	-
其他		-	-	-	-
合计		1,340,626,349.76	118,328.03	1,150,709,941.68	-190,034,736.11
项目	上年度末 2022 年 12 月 31 日				
		成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票		1,310,014,892.36	-	1,179,351,202.15	-130,663,690.21
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-	-
债券	交易所市场	-	-	-	-
	银行间市场	50,316,670.00	1,245,150.68	51,340,150.68	-221,670.00
	合计	50,316,670.00	1,245,150.68	51,340,150.68	-221,670.00
资产支持证券		-	-	-	-
基金		-	-	-	-
其他		-	-	-	-
合计		1,360,331,562.36	1,245,150.68	1,230,691,352.83	-130,885,360.21

#### 7.4.7.3 衍生金融资产/负债

##### 7.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

无。

##### 7.4.7.3.2 期末基金持有的期货合约情况

无。

##### 7.4.7.3.3 期末基金持有的黄金衍生品情况

无。

#### 7.4.7.4 买入返售金融资产

##### 7.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

无。

**7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券**

无。

**7.4.7.4.3 按预期信用损失一般模型计提减值准备的说明**

无。

**7.4.7.5 债权投资****7.4.7.5.1 债权投资情况**

无。

**7.4.7.5.2 债权投资减值准备计提情况**

无。

**7.4.7.6 其他债权投资****7.4.7.6.1 其他债权投资情况**

无。

**7.4.7.6.2 其他债权投资减值准备计提情况**

无。

**7.4.7.7 其他权益工具投资****7.4.7.7.1 其他权益工具投资情况**

无。

**7.4.7.7.2 报告期末其他权益工具投资情况**

无。

**7.4.7.8 其他资产**

单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 12 月 31 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
应收利息	-	-
其他应收款	33,491.90	-
待摊费用	-	-
合计	33,491.90	-

**7.4.7.9 其他负债**

单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 12 月 31 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
应付券商交易单元保证金	-	-
应付赎回费	541.33	915.40
应付证券出借违约金	-	-

应付交易费用	110,557.27	171,510.62
其中：交易所市场	110,557.27	171,510.62
银行间市场	-	-
应付利息	-	-
预提费用	224,500.00	254,500.00
合计	335,598.60	426,926.02

#### 7.4.7.10 实收基金

金额单位：人民币元

##### 大成沪深 300 指数 A

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	1,206,653,825.17	1,206,653,825.17
本期申购	129,512,001.57	129,512,001.57
本期赎回（以“-”号填列）	-139,071,025.53	-139,071,025.53
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	1,197,094,801.21	1,197,094,801.21

##### 大成沪深 300 指数 C

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	118,810,270.12	118,810,270.12
本期申购	782,394,171.33	782,394,171.33
本期赎回（以“-”号填列）	-761,793,324.79	-761,793,324.79
基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算调整	-	-
本期申购	-	-
本期赎回（以“-”号填列）	-	-
本期末	139,411,116.66	139,411,116.66

注：本基金申购含红利再投份额（如有）、转换入份额（如有）、级别调整入份额（如有）；赎回含转出份额（如有）。

#### 7.4.7.11 其他综合收益

无。

#### 7.4.7.12 未分配利润

单位：人民币元

##### 大成沪深 300 指数 A

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	805,022,725.37	-851,126,265.40	-46,103,540.03

本期期初	805,022,725.37	-851,126,265.40	-46,103,540.03
本期利润	-45,136,276.77	-56,708,249.53	-101,844,526.30
本期基金份额交易产生的变动数	-6,442,854.32	5,159,989.10	-1,282,865.22
其中：基金申购款	84,894,762.95	-90,184,336.75	-5,289,573.80
基金赎回款	-91,337,617.27	95,344,325.85	4,006,708.58
本期已分配利润	-	-	-
本期末	753,443,594.28	-902,674,525.83	-149,230,931.55

## 大成沪深 300 指数 C

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	78,599,282.48	-83,610,181.07	-5,010,898.59
本期期初	78,599,282.48	-83,610,181.07	-5,010,898.59
本期利润	-10,234,601.05	-2,441,126.37	-12,675,727.42
本期基金份额交易产生的变动数	18,524,732.99	-18,821,488.86	-296,755.87
其中：基金申购款	517,154,644.48	-552,907,600.42	-35,752,955.94
基金赎回款	-498,629,911.49	534,086,111.56	35,456,200.07
本期已分配利润	-	-	-
本期末	86,889,414.42	-104,872,796.30	-17,983,381.88

## 7.4.7.13 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年12月31日	上年度可比期间 2022年1月1日至2022年12月31日
活期存款利息收入	267,072.06	311,411.92
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	7,360.77	7,128.25
其他	17,243.12	12,058.37
合计	291,675.95	330,598.54

## 7.4.7.14 股票投资收益

## 7.4.7.14.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年12月31日	上年度可比期间 2022年1月1日至2022年12月31日
股票投资收益——买卖股票差价收入	-74,381,509.50	-16,545,562.59
股票投资收益——赎回差价收入	-	-
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	-74,381,509.50	-16,545,562.59

#### 7.4.7.14.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年12月31日	上年度可比期间 2022年1月1日至2022年12月31日
卖出股票成交总额	708,197,804.02	470,868,741.12
减：卖出股票成本总额	780,933,144.38	486,087,540.57
减：交易费用	1,646,169.14	1,326,763.14
买卖股票差价收入	-74,381,509.50	-16,545,562.59

#### 7.4.7.14.3 股票投资收益——证券出借差价收入

无。

#### 7.4.7.15 债券投资收益

##### 7.4.7.15.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年12月31日	上年度可比期间 2022年1月1日至2022年12月31日
债券投资收益——利息收入	1,389,382.17	1,442,420.81
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	-325,865.00	16,222.95
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	1,063,517.17	1,458,643.76

##### 7.4.7.15.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
----	----	---------

	2023年1月1日至2023年12月31日	2022年1月1日至2022年12月31日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	58,577,065.90	53,326,935.89
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	57,322,410.00	51,983,550.00
减：应计利息总额	1,580,095.90	1,326,735.89
减：交易费用	425.00	427.05
买卖债券差价收入	-325,865.00	16,222.95

#### 7.4.7.15.3 债券投资收益——赎回差价收入

无。

#### 7.4.7.15.4 债券投资收益——申购差价收入

无。

#### 7.4.7.16 资产支持证券投资收益

##### 7.4.7.16.1 资产支持证券投资收益项目构成

无。

##### 7.4.7.16.2 资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入

无。

##### 7.4.7.16.3 资产支持证券投资收益——赎回差价收入

无。

##### 7.4.7.16.4 资产支持证券投资收益——申购差价收入

无。

#### 7.4.7.17 贵金属投资收益

##### 7.4.7.17.1 贵金属投资收益项目构成

无。

##### 7.4.7.17.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

无。

##### 7.4.7.17.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

无。

##### 7.4.7.17.4 贵金属投资收益——申购差价收入

无。

## 7.4.7.18 衍生工具收益

## 7.4.7.18.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

无。

## 7.4.7.18.2 衍生工具收益——其他投资收益

无。

## 7.4.7.19 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年12月 31日	上年度可比期间 2022年1月1日至2022年12月 31日
股票投资产生的股利收益	28,022,832.60	26,113,333.03
其中：证券出借权益补偿收入	3,570.00	-
基金投资产生的股利收益	-	-
合计	28,022,832.60	26,113,333.03

## 7.4.7.20 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2023年1月1日至2023年 12月31日	上年度可比期间 2022年1月1日至2022 年12月31日
1. 交易性金融资产	-59,149,375.90	-266,179,721.61
股票投资	-59,233,425.90	-265,896,201.61
债券投资	84,050.00	-283,520.00
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	-59,149,375.90	-266,179,721.61

## 7.4.7.21 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年12月 31日	上年度可比期间 2022年1月1日至2022 年12月31日
基金赎回费收入	724,800.77	268,702.94

合计	724,800.77	268,702.94
----	------------	------------

注：本基金的赎回费率按持有期间递减，其中 A 类、B 类将不低于 25% 的赎回费用归入基金资产；C 类赎回费用将全额计入基金财产。

#### 7.4.7.22 信用减值损失

无。

#### 7.4.7.23 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日
审计费用	100,000.00	130,000.00
信息披露费	120,000.00	120,000.00
证券出借违约金	-	-
银行划款手续费	7,875.95	7,263.54
账户维护费	18,000.00	18,000.00
合计	245,875.95	275,263.54

#### 7.4.7.24 分部报告

无。

#### 7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

##### 7.4.8.1 或有事项

无。

##### 7.4.8.2 资产负债表日后事项

无。

#### 7.4.9 关联方关系

关联方名称	与本基金的关系
大成基金管理有限公司（“大成基金”）	基金管理人、基金销售机构
中国农业银行股份有限公司（“中国农业银行”）	基金托管人、基金销售机构
中泰信托有限责任公司	基金管理人的股东
光大证券股份有限公司（“光大证券”）	基金管理人的股东、基金销售机构
中国银河投资管理有限公司	基金管理人的股东
大成国际资产管理有限公司（“大成国际”）	基金管理人的子公司
大成创新资本管理有限公司（“大成创新资本”）	基金管理人的合营企业

注：以下关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

## 7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

## 7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

## 7.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2023年1月1日至2023年12月31日		上年度可比期间 2022年1月1日至2022年12月31日	
	成交金额	占当期股票 成交总额的比 例 (%)	成交金额	占当期股票 成交总额的比 例 (%)
光大证券	979,068,973.19	67.52	972,028,075.58	99.97

## 7.4.10.1.2 债券交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2023年1月1日至2023年12月31日		上年度可比期间 2022年1月1日至2022年12月31日	
	成交金额	占当期债券 成交总额的比 例 (%)	成交金额	占当期债券 成交总额的比 例 (%)
光大证券	9,006,100.00	60.03	2,000,200.00	100.00

## 7.4.10.1.3 债券回购交易

无。

## 7.4.10.1.4 权证交易

无。

## 7.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2023年1月1日至2023年12月31日			
	当期 佣金	占当期佣金总量 的比例 (%)	期末应付佣金余 额	占期末应付佣金 总额的比例 (%)
光大证券	715,653.86	65.20	110,557.27	100.00
关联方名称	上年度可比期间 2022年1月1日至2022年12月31日			
	当期 佣金	占当期佣金总量 的比例 (%)	期末应付佣金余 额	占期末应付佣金 总额的比例 (%)
光大证券	698,792.40	99.96	171,510.62	100.00

注：(1) 上述佣金按市场佣金率计算，以扣除由中国证券登记结算有限责任公司收取证管费和经手费后的净额列示。

(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。

#### 7.4.10.2 关联方报酬

##### 7.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日	2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的管理费	9,187,668.83	9,365,162.12
其中：应支付销售机构的客户维护费	2,536,431.12	2,534,432.87
应支付基金管理人的净管理费	6,651,237.71	6,830,729.25

注：基金管理费每日计提，按月支付。基金管理费按前一日的基金资产净值的 0.75% 年费率计提。

计算方法如下：

$$H = E \times 0.75\% / \text{当年天数}$$

H 为每日应支付的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

##### 7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日	2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的托管费	1,837,533.71	1,873,032.47

注：基金托管费每日计提，按月支付。基金托管费按前一日的基金资产净值的 0.15% 年费率计提。

计算方法如下：

$$H = E \times 0.15\% / \text{当年天数}$$

H 为每日应支付的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

##### 7.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期		
	2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	大成沪深 300 指数 A	大成沪深 300 指数 C	合计
大成基金	-	35,100.76	35,100.76
合计	-	35,100.76	35,100.76

获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	大成沪深 300 指数 A	大成沪深 300 指数 C	合计
大成基金	-	39,846.59	39,846.59
合计	-	39,846.59	39,846.59

注：本基金 A 类及 B 类基金份额不收取销售服务费，C 类份额的销售服务费按前一日 C 类基金份额基金资产净值的 0.10% 年费率计提。计算方法为：

$$H = E \times 0.10\% / \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的销售服务费

E 为前一日的基金资产净值

#### 7.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

无。

#### 7.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

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

无。

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

无。

#### 7.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

##### 7.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用自有资金投资本基金的情况

无。

##### 7.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

无。

#### 7.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日		上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国农业银行	18,227,157.70	267,072.06	75,477,619.90	311,411.92

注：本基金由基金托管人保管的银行存款，按银行约定利率计息。

## 7.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

无。

## 7.4.10.8 其他关联交易事项的说明

无。

## 7.4.11 利润分配情况

无。

## 7.4.12 期末（2023 年 12 月 31 日）本基金持有的流通受限证券

## 7.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

7.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	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
001239	永达股份	2023年12月4日	6个月	新股锁定	12.05	19.92	189	2,277.45	3,764.88	-
001306	夏厦精密	2023年11月9日	6个月	新股锁定	53.63	75.36	64	3,432.32	4,823.04	-
001326	联域股份	2023年11月1日	6个月	新股锁定	41.18	48.64	99	4,076.82	4,815.36	-
001358	兴欣新材	2023年12月14日	6个月	新股锁定	41.00	44.16	87	3,567.00	3,841.92	-
301251	威尔高	2023年8月30日	6个月	新股锁定	28.88	34.59	321	9,270.48	11,103.39	-
301261	恒工精密	2023年6月29日	6个月	新股锁定	36.90	50.85	198	7,306.20	10,068.30	-
301371	敷尔佳	2023年7月24日	6个月	新股锁定	55.68	37.58	564	31,403.52	21,195.12	-

		日								
301381	赛维时代	2023年7月5日	6个月	新股锁定	20.45	29.69	571	11,676.95	16,952.99	-
301413	安培龙	2023年12月11日	6个月	新股锁定	33.25	58.19	164	5,453.00	9,543.16	-
301418	协昌科技	2023年8月10日	6个月	新股锁定	51.88	50.20	189	9,805.32	9,487.80	-
301421	波长光电	2023年8月16日	6个月	新股锁定	29.38	59.37	332	9,754.16	19,710.84	-
301459	丰茂股份	2023年12月6日	6个月	新股锁定	31.90	39.84	208	6,635.20	8,286.72	-
301468	博盈特焊	2023年7月12日	6个月	新股锁定	47.58	30.22	598	28,452.84	18,071.56	-
301487	盟固利	2023年8月1日	6个月	新股锁定	5.32	40.96	867	4,612.44	35,512.32	-
301489	思泉新材	2023年10月16日	6个月	新股锁定	41.66	64.11	128	5,332.48	8,206.08	-
301498	乖宝宠物	2023年8月9日	6个月	新股锁定	39.99	38.81	554	22,154.46	21,500.74	-
301505	苏州规划	2023年7月12日	6个月	新股锁定	26.35	35.81	194	5,111.90	6,947.14	-
301507	民生健	2023年8月24日	6个月	新股锁定	10.00	15.85	851	8,510.00	13,488.35	-

	康	日								
301509	金凯生科	2023年7月26日	6个月	新股锁定	56.56	62.23	266	15,044.96	16,553.18	-
301511	德福科技	2023年8月8日	6个月	新股锁定	28.00	22.67	982	27,496.00	22,261.94	-
301516	中远通	2023年12月1日	6个月	新股锁定	6.87	15.51	604	4,149.48	9,368.04	-
301517	陕西华达	2023年10月9日	6个月	新股锁定	26.87	43.69	185	4,970.95	8,082.65	-
301525	儒竞科技	2023年8月23日	6个月	新股锁定	99.57	81.46	266	26,485.62	21,668.36	-
301528	多浦乐	2023年8月17日	6个月	新股锁定	71.80	68.91	148	10,626.40	10,198.68	-
301529	福赛科技	2023年8月31日	6个月	新股锁定	36.60	37.88	182	6,661.20	6,894.16	-
301548	崇德科技	2023年9月11日	6个月	新股锁定	66.80	58.99	136	9,084.80	8,022.64	-
301558	三态股份	2023年9月21日	6个月	新股锁定	7.33	13.40	1,458	10,687.14	19,537.20	-
301559	中集环科	2023年9月26日	6个月	新股锁定	24.22	18.24	1,315	31,849.30	23,985.60	-
301566	达利凯	2023年12月22日	6个月	新股锁定	8.90	22.14	576	5,126.40	12,752.64	-

	普	日								
301578	辰 奕 智 能	2023 年 12 月 21 日	6 个月	新股 锁定	48.94	68.32	118	5,774.92	8,061.76	-
601083	锦 江 航 运	2023 年 11 月 28 日	6 个月	新股 锁定	11.25	11.07	1,263	14,208.75	13,981.41	-
601096	宏 盛 华 源	2023 年 12 月 15 日	6 个月	新股 锁定	1.70	4.06	3,918	6,660.60	15,907.08	-
603004	鼎 龙 科 技	2023 年 12 月 20 日	6 个月	新股 锁定	16.80	31.19	195	3,276.00	6,082.05	-
603062	麦 加 芯 彩	2023 年 10 月 31 日	6 个月	新股 锁定	58.08	57.81	126	7,318.08	7,284.06	-
603075	热 威 股 份	2023 年 9 月 1 日	6 个月	新股 锁定	23.10	23.31	182	4,204.20	4,242.42	-
603119	浙 江 荣 泰	2023 年 7 月 21 日	6 个月	新股 锁定	15.32	23.87	226	3,462.32	5,394.62	-
603193	润 本 股 份	2023 年 10 月 9 日	6 个月	新股 锁定	17.38	16.66	303	5,266.14	5,047.98	-
603231	索 宝 蛋 白	2023 年 12 月 6 日	6 个月	新股 锁定	21.29	21.53	161	3,427.69	3,466.33	-
603270	金 帝 股 份	2023 年 8 月 25 日	6 个月	新股 锁定	21.77	29.58	195	4,245.15	5,768.10	-
603273	天 元 智	2023 年 10 月 16	6 个月	新股 锁定	9.50	18.97	178	1,691.00	3,376.66	-

	能	日								
603275	众辰科技	2023年8月16日	6个月	新股锁定	49.97	39.70	193	9,644.21	7,662.10	-
603276	恒兴新材	2023年9月18日	6个月	新股锁定	25.73	24.88	134	3,447.82	3,333.92	-
603296	华勤技术	2023年8月1日	6个月	新股锁定	80.80	77.75	550	44,440.00	42,762.50	-
603373	安邦护卫	2023年12月13日	6个月	新股锁定	19.10	34.75	88	1,680.80	3,058.00	-
688450	光格科技	2023年7月17日	6个月	新股锁定	53.09	36.42	167	8,866.03	6,082.14	-
688549	中巨芯	2023年8月30日	6个月	新股锁定	5.18	8.09	4,294	22,242.92	34,738.46	-
688573	信宇人	2023年8月9日	6个月	新股锁定	23.68	28.80	285	6,748.80	8,208.00	-
688591	泰凌微	2023年8月18日	6个月	新股锁定	24.98	28.02	681	17,011.38	19,081.62	-
688610	埃科光电	2023年7月10日	6个月	新股锁定	73.33	51.00	275	20,165.75	14,025.00	-
688627	精智达	2023年7月11日	6个月	新股锁定	46.77	87.72	222	10,382.94	19,473.84	-
688648	中邮科	2023年11月6日	6个月	新股锁定	15.18	21.43	303	4,599.54	6,493.29	-

	技	日									
688651	盛邦安全	2023年7月19日	6个月	新股锁定	39.90	46.05	178	7,102.20	8,196.90	-	
688652	京仪装备	2023年11月22日	6个月	新股锁定	31.95	52.25	416	13,291.20	21,736.00	-	
688653	康希通信	2023年11月10日	6个月	新股锁定	10.50	15.99	648	6,804.00	10,361.52	-	
688657	浩辰软件	2023年9月25日	6个月	新股锁定	103.40	78.23	101	10,443.40	7,901.23	-	
688702	盛科通信	2023年9月6日	6个月	新股锁定	42.66	48.18	549	23,420.34	26,450.82	-	
688716	中研股份	2023年9月13日	6个月	新股锁定	29.66	36.39	267	7,919.22	9,716.13	-	
688717	艾罗能源	2023年12月26日	6个月	新股未上市	55.66	55.66	11,303	629,124.98	629,124.98	-	
688717	艾罗能源	2023年12月26日	1个月内(含)	新股未上市	55.66	55.66	4,844	269,617.04	269,617.04	-	
688720	艾森股份	2023年11月29日	6个月	新股锁定	28.03	49.84	165	4,624.95	8,223.60	-	

注：1. 根据《上海证券交易所科创板股票公开发行自律委员会促进科创板初期企业平稳发行行业倡导建议》，本基金获配的科创板股票如经抽签方式确定需要锁定的，锁定期限为自发行人股票上市之日起6个月。根据《上海证券交易所科创板上市公司股东以向特定机构投资者询价转让和配售方式减持股份实施细则》，基金通过询价转让受让的股份，在受让后6个月内不得转让。2. 根据《深圳证券交易所创业板首次公开发行证券发行与承销业务实施细则》，发行人和主承销商可以

采用摇号限售方式或比例限售方式，安排基金通过网下发行获配的部分创业板股票设置不低于 6 个月的限售期。 3. 基金可使用以基金名义开设的股票账户，选择网上或者网下一种方式进行新股申购。其中基金参与网下申购获得的新股或作为战略投资者参与配售获得的新股，在新股上市后的约定期限内不能自由转让；基金参与网上申购获配的新股，从新股获配日至新股上市日之间不能自由转让。

#### 7.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

无。

#### 7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

##### 7.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

无。

##### 7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

无。

#### 7.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

金额单位：人民币元

序号	证券代码	证券名称	出借到期日	期末估值单价	数量（单位：股）	期末估值总额
1	000002	万科A	2024年1月9日	10.46	190,000	1,987,400.00
2	000069	华侨城A	2024年1月3日	3.11	69,000	214,590.00
3	000408	藏格矿业	2024年1月8日-2024年1月12日	25.34	13,800	349,692.00
4	000625	长安汽车	2024年1月8日-2024年1月10日	16.83	137,400	2,312,442.00
5	000733	振华科技	2024年1月10日	58.84	10,000	588,400.00
6	000786	北新建材	2024年1月12日	23.36	28,500	665,760.00
7	000800	一汽解放	2024年1月8日	8.50	26,000	221,000.00
8	000877	天山股份	2024年1月10日	6.68	45,000	300,600.00
9	000895	双汇发展	2024年1月11日	26.71	28,000	747,880.00
10	000983	山西焦煤	2024年1月2日-2024年1月2日	9.88	43,000	424,840.00
11	001979	招商蛇口	2024年1月9日-2024年	9.53	101,600	968,248.00

		口	1 月 12 日			0
12	002050	三花智控	2024 年 1 月 5 日	29.40	61,000	1,793,400.00
13	002202	金风科技	2024 年 1 月 2 日-2024 年 1 月 11 日	8.00	45,300	362,400.00
14	002230	科大讯飞	2024 年 1 月 2 日	46.38	2,700	125,226.00
15	002236	大华股份	2024 年 1 月 2 日-2024 年 1 月 12 日	18.45	48,500	894,825.00
16	002271	东方雨虹	2024 年 1 月 2 日-2024 年 1 月 9 日	19.20	34,000	652,800.00
17	002459	晶澳科技	2024 年 1 月 17 日	20.72	7,000	145,040.00
18	002460	赣锋锂业	2024 年 1 月 4 日	42.80	32,000	1,369,600.00
19	002466	天齐锂业	2024 年 1 月 10 日	55.79	28,000	1,562,120.00
20	002493	荣盛石化	2024 年 1 月 2 日-2024 年 1 月 9 日	10.35	85,100	880,785.00
21	002555	三七互娱	2024 年 1 月 9 日	18.81	43,000	808,830.00
22	002709	天赐材料	2024 年 1 月 8 日-2024 年 1 月 10 日	25.08	31,700	795,036.00
23	002736	国信证券	2024 年 1 月 9 日	8.54	7,000	59,780.00
24	002812	恩捷股份	2024 年 1 月 8 日-2024 年 1 月 12 日	56.82	14,500	823,890.00
25	002916	深南电路	2024 年 1 月 8 日	70.99	5,800	411,742.00
26	002920	德赛西威	2024 年 1 月 11 日	129.51	7,000	906,570.00
27	300015	爱尔眼科	2024 年 1 月 10 日	15.82	50,000	791,000.00
28	300661	圣邦股份	2024 年 1 月 2 日	89.01	8,500	756,585.00
29	300763	锦浪科技	2024 年 1 月 2 日	69.90	5,000	349,500.00
30	300957	贝泰妮	2024 年 1 月 8 日	68.17	3,500	238,595.00
31	300979	华利集团	2024 年 1 月 2 日	52.64	2,300	121,072.00
32	600010	宝钢股份	2024 年 1 月 5 日-2024 年 1 月 12 日	1.46	640,000	934,400.00
33	600031	三一重	2024 年 1 月 5 日-2024 年	13.77	160,100	2,204,577

		工	1月11日			.00
34	600039	四川路桥	2024年1月11日	7.49	45,000	337,050.00
35	600104	上汽集团	2024年1月10日	13.53	13,500	182,655.00
36	600111	北方稀土	2024年1月3日	19.34	73,000	1,411,820.00
37	600183	生益科技	2024年1月2日	18.31	6,000	109,860.00
38	600188	兖矿能源	2024年1月5日-2024年1月10日	19.81	37,500	742,875.00
39	600346	恒力石化	2024年1月2日	13.17	20,000	263,400.00
40	600460	士兰微	2024年1月10日	22.83	23,000	525,090.00
41	600489	中金黄金	2024年1月12日	9.96	40,000	398,400.00
42	600732	爱旭股份	2024年1月3日-2024年1月8日	17.64	31,500	555,660.00
43	600741	华域汽车	2024年1月9日	16.28	14,000	227,920.00
44	600745	闻泰科技	2024年1月2日-2024年1月2日	42.31	22,100	935,051.00
45	601006	大秦铁路	2024年1月2日	7.21	1,500	10,815.00
46	601012	隆基绿能	2024年1月9日	22.90	160,000	3,664,000.00
47	601059	信达证券	2024年1月10日	17.99	11,000	197,890.00
48	601111	中国国航	2024年1月2日	7.34	10,000	73,400.00
49	601236	红塔证券	2024年1月2日-2024年1月11日	7.59	44,200	335,478.00
50	601238	广汽集团	2024年1月5日	8.75	62,000	542,500.00
51	601319	中国人保	2024年1月2日	4.84	90,000	435,600.00
52	601360	三六零	2024年1月8日-2024年1月11日	9.01	103,900	936,139.00
53	601615	明阳智能	2024年1月3日-2024年1月4日	12.54	15,000	188,100.00
54	601633	长城汽车	2024年1月2日-2024年1月5日	25.22	33,600	847,392.00
55	601689	拓普集	2024年1月4日	73.50	2,000	147,000.00

		团				0
56	601698	中国卫通	2024 年 1 月 2 日	17.31	11,000	190,410.00
57	601699	潞安环能	2024 年 1 月 12 日	21.91	33,000	723,030.00
58	601799	星宇股份	2024 年 1 月 2 日	131.11	3,500	458,885.00
59	601808	中海油服	2024 年 1 月 2 日	14.62	17,000	248,540.00
60	601865	福莱特	2024 年 1 月 8 日	26.70	15,000	400,500.00
61	601868	中国能建	2024 年 1 月 10 日-2024 年 1 月 11 日	2.10	350,000	735,000.00
62	601872	招商轮船	2024 年 1 月 2 日-2024 年 1 月 10 日	5.88	78,400	460,992.00
63	601878	浙商证券	2024 年 1 月 3 日	10.43	14,800	154,364.00
64	601881	中国银河	2024 年 1 月 10 日	12.05	59,000	710,950.00
65	601901	方正证券	2024 年 1 月 5 日	8.06	120,000	967,200.00
66	601919	中远海控	2024 年 1 月 3 日-2024 年 1 月 4 日	9.58	94,700	907,226.00
67	601995	中金公司	2024 年 1 月 4 日	38.05	26,000	989,300.00
68	603260	合盛硅业	2024 年 1 月 10 日-2024 年 1 月 12 日	51.00	10,300	525,300.00
69	603392	万泰生物	2024 年 1 月 9 日	75.13	9,200	691,196.00
70	603501	韦尔股份	2024 年 1 月 2 日	106.71	6,600	704,286.00
71	603806	福斯特	2024 年 1 月 11 日	24.27	10,000	242,700.00
72	603833	欧派家居	2024 年 1 月 2 日	69.61	5,100	355,011.00
73	603899	晨光股份	2024 年 1 月 4 日	37.55	10,000	375,500.00
74	603986	兆易创新	2024 年 1 月 12 日	92.39	2,800	258,692.00
75	603993	洛阳钼业	2024 年 1 月 4 日	5.20	22,500	117,000.00
76	605117	德业股份	2024 年 1 月 15 日	83.90	4,000	335,600.00
77	605499	东鹏饮	2024 年 1 月 11 日	182.51	1,200	219,012.00

		料				0
78	688041	海光信息	2024 年 1 月 4 日	70.98	22,200	1,575,756.00
79	688187	时代电气	2024 年 1 月 10 日	36.33	7,000	254,310.00
80	688223	晶科能源	2024 年 1 月 2 日-2024 年 1 月 2 日	8.86	56,200	497,932.00
81	688256	寒武纪	2024 年 1 月 2 日	134.96	5,600	755,776.00
82	688303	大全能源	2024 年 1 月 8 日	29.57	18,000	532,260.00
83	688363	华熙生物	2024 年 1 月 12 日	66.93	5,000	334,650.00
合计	-	-	-	-	3,891,200	53,558,098.00

注：出借证券中如有其他流通受限的情况详见本报告“本基金持有的流通受限证券”部分内容。

#### 7.4.13 金融工具风险及管理

##### 7.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金在日常经营活动中由金融工具产生的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金管理人制定了政策和程序来识别及分析这些风险，并设定适当的风险限额及内部控制流程，通过可靠的管理及信息系统持续监控上述各类风险。

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

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

##### 7.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人

出现违约、拒绝支付到期本息等情况，导致基金资产损失和收益变化的风险。

本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的银行存款存放在本基金的托管人中国农业银行股份有限公司，因而与银行存款相关的信用风险不重大。本基金在交易所进行的交易均以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，违约风险可能性很小；在银行间同业市场进行交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式进行限制以控制相应的信用风险。

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

本期末，本基金未持有除国债、央行票据和政策性金融债以外的债券(上年度末：同)。

#### 7.4.13.3 流动性风险

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

##### 7.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《货币市场基金监督管理办法》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流动性受限资产比例、份额持有人集中度、调整平均剩余期限和平均剩余存续期、压力测试等方式防范流动性风险，并于开放日对本基金的申购赎回情况进行监控，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配，确保本基金资产的变现能力与投资者赎回需求的匹配与平衡。本基金的基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款，约定在非正常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。于本期末，本基金持有的流动性受限资产的估值占基金资产净值的比例未超过 15%，且本基金组合资产中 7 个工作日可变现资产未超过最近工作日确认的净赎回金额。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），均能够及时变现。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。本报告期内，本基金未发生重大流动性风险事件。

#### 7.4.13.4 市场风险

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

##### 7.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指金融工具的公允价值或现金流量因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、结算备付金及应收申购款等。

##### 7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2023 年 12 月 31 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
<b>资产</b>					
货币资金	18,227,157.70	-	-	-	18,227,157.70
结算备付金	205,379.80	-	-	-	205,379.80
存出保证金	244,185.70	-	-	-	244,185.70
交易性金融资产	51,173,428.03	-	-	-1,099,536,513.65	1,150,709,941.68
应收申购款	7,293.20	-	-	851,678.94	858,972.14
应收清算款	-	-	-	540,250.79	540,250.79
其他资产	-	-	-	33,491.90	33,491.90
<b>资产总计</b>	<b>69,857,444.43</b>	<b>-</b>	<b>-</b>	<b>-1,100,961,935.28</b>	<b>1,170,819,379.71</b>
<b>负债</b>					
应付赎回款	-	-	-	296,963.05	296,963.05
应付管理人报酬	-	-	-	733,499.62	733,499.62
应付托管费	-	-	-	146,699.90	146,699.90
应付销售服务费	-	-	-	10,123.05	10,123.05
应交税费	-	-	-	4,891.05	4,891.05
其他负债	-	-	-	335,598.60	335,598.60
<b>负债总计</b>	<b>-</b>	<b>-</b>	<b>-</b>	<b>1,527,775.27</b>	<b>1,527,775.27</b>

利率敏感度缺口	69,857,444.43	-	-	-1,099,434,160.01	1,169,291,604.44
上年度末 2022 年 12 月 31 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
货币资金	75,477,619.90	-	-	-	75,477,619.90
结算备付金	12,202.98	-	-	-	12,202.98
存出保证金	42,838.74	-	-	-	42,838.74
交易性金融资产	51,340,150.68	-	-	-1,179,351,202.15	1,230,691,352.83
应收申购款	2,987.84	-	-	471,003.67	473,991.51
资产总计	126,875,800.14	-	-	-1,179,822,205.82	1,306,698,005.96
负债					
应付赎回款	-	-	-	135,621.98	135,621.98
应付管理人报酬	-	-	-	778,620.36	778,620.36
应付托管费	-	-	-	155,724.08	155,724.08
应付清算款	-	-	-	30,846,786.77	30,846,786.77
应付销售服务费	-	-	-	4,670.08	4,670.08
其他负债	-	-	-	426,926.02	426,926.02
负债总计	-	-	-	32,348,349.29	32,348,349.29
利率敏感度缺口	126,875,800.14	-	-	-1,147,473,856.53	1,274,349,656.67

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

#### 7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	除市场利率以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2023 年 12 月 31 日）	上年度末（2022 年 12 月 31 日）
	市场利率上升 25 个基点	-22,723.87	-22,895.32
市场利率下降 25 个基点	22,725.10	22,916.27	

#### 7.4.13.4.2 外汇风险

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

#### 7.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以

外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场交易的股票和债券，所面临的最大市场价格风险由所持有的金融工具的公允价值决定。本基金通过投资组合的分散化降低市场价格风险，并且本基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控。

本基金跟踪标的指数的投资组合的资产原则上不低于基金资产净值的 90%。除非法律法规另有规定，本基金的股票投资比例可以提高到基金资产净值的 100%。现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%。

#### 7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2023年12月31日		上年度末 2022年12月31日	
	公允价值	占基金资产净值 比例（%）	公允价值	占基金资产净值 比例（%）
交易性金融资产—股票投资	1,099,536,513.65	94.03	1,179,351,202.15	92.55
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	1,099,536,513.65	94.03	1,179,351,202.15	92.55

#### 7.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除业绩比较基准以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2023年12月31日）	上年度末（2022年12月31日）
	业绩比较基准上升5%	54,270,772.40	59,323,571.04
	业绩比较基准下降5%	-54,270,772.40	-59,323,571.04

## 7.4.14 公允价值

### 7.4.14.1 金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属的层次，由对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次决定：第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价；第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值；第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

### 7.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

#### 7.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2023 年 12 月 31 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
第一层次	1,097,915,009.29	1,178,578,442.00
第二层次	52,072,170.05	51,340,150.68
第三层次	722,762.34	772,760.15
合计	1,150,709,941.68	1,230,691,352.83

#### 7.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

本基金调整公允价值计量层次转换时点的相关会计政策在前后各会计期间保持一致。

对于公开市场交易的证券等投资，若出现交易不活跃、非公开发行等情况，本基金不会于交易不活跃期间及限售期间将相关投资的公允价值列入第一层次，并根据估值调整中采用的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，确定相关投资的公允价值应属第二层次或第三层次。

#### 7.4.14.2.3 第三层次公允价值余额及变动情况

##### 7.4.14.2.3.1 第三层次公允价值余额及变动情况

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日		
	交易性金融资产		合计
	债券投资	股票投资	
期初余额	-	772,760.15	772,760.15
当期购买	-	-	-
当期出售/结算	-	-	-

转入第三层次	-	2,062,926.05	2,062,926.05
转出第三层次	-	1,902,528.43	1,902,528.43
当期利得或损失总额	-	-210,395.43	-210,395.43
其中：计入损益的利得或损失	-	-210,395.43	-210,395.43
计入其他综合收益的利得或损失	-	-	-
期末余额	-	722,762.34	722,762.34
期末仍持有的第三层次金融资产计入本期损益的未实现利得或损失的变动——公允价值变动损益	-	109,377.20	109,377.20
项目	上年度可比期间 2022年1月1日至2022年12月31日		
	交易性金融资产		合计
	债券投资	股票投资	
期初余额	-	-	-
当期购买	-	-	-
当期出售/结算	-	-	-
转入第三层次	-	2,638,597.46	2,638,597.46
转出第三层次	-	1,896,592.94	1,896,592.94
当期利得或损失总额	-	30,755.63	30,755.63
其中：计入损益的利得或损失	-	30,755.63	30,755.63
计入其他综合收益的利得或损失	-	-	-
期末余额	-	772,760.15	772,760.15
期末仍持有的第三层次金融资产计入本期损益的未实现利得或损失的变动——公允价值变动损益	-	20,546.62	20,546.62

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

单位：人民币元

项目	本期末公允价值	采用的估值技术	不可观察输入值		
			名称	范围/加权平均值	与公允价值之间的关系
流通受限股票	722,762.34	平均价格亚式期权模型	预期波动率	0.1462 至 2.1988	负相关
项目	上年度末公	采用的估值	不可观察输入值		

	允价值	技术	名称	范围/加权平均值	与公允价值之间的关系
流通受限股票	772,760.15	平均价格亚式期权模型	预期波动率	0.1891 至 2.4756	负相关

#### 7.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

本基金本报告期末及上年度末均未持有非持续的以公允价值计量的金融工具。

#### 7.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

本基金持有的不以公允价值计量的金融工具为以摊余成本计量的金融资产和金融负债，这些金融工具因其剩余期限较短，所以其账面价值与公允价值相若。

#### 7.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

## § 8 投资组合报告

### 8.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	1,099,536,513.65	93.91
	其中：股票	1,099,536,513.65	93.91
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	51,173,428.03	4.37
	其中：债券	51,173,428.03	4.37
	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	18,432,537.50	1.57
8	其他各项资产	1,676,900.53	0.14
9	合计	1,170,819,379.71	100.00

### 8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

#### 8.2.1 报告期末指数投资按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值 (元)	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	13,852,550.98	1.18
B	采矿业	52,367,348.48	4.48
C	制造业	601,617,976.56	51.45
D	电力、热力、燃气	36,827,750.54	3.15

	及水生产和供应业		
E	建筑业	22,653,868.09	1.94
F	批发和零售业	3,474,246.80	0.30
G	交通运输、仓储和邮政业	34,324,622.21	2.94
H	住宿和餐饮业	867,100.00	0.07
I	信息传输、软件和信息技术服务业	52,203,063.20	4.46
J	金融业	237,369,456.47	20.30
K	房地产业	14,398,907.60	1.23
L	租赁和商务服务业	9,208,850.86	0.79
M	科学研究和技术服务业	12,890,061.42	1.10
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	4,659,686.08	0.40
R	文化、体育和娱乐业	1,199,520.00	0.10
S	综合	-	-
	合计	1,097,915,009.29	93.90

### 8.2.2 报告期末积极投资按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	1,518,478.67	0.13
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	36,490.19	0.00
G	交通运输、仓储和邮政业	13,981.41	0.00
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	42,548.95	0.00
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	3,058.00	0.00
M	科学研究和技术服	6,947.14	0.00

	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	1,621,504.36	0.14

### 8.2.3 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

无。

### 8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	600519	贵州茅台	39,658	68,449,708.00	5.85
2	601318	中国平安	679,657	27,390,177.10	2.34
3	300750	宁德时代	166,720	27,218,707.20	2.33
4	600036	招商银行	781,842	21,750,844.44	1.86
5	000858	五粮液	122,489	17,186,431.59	1.47
6	000333	美的集团	310,608	16,968,515.04	1.45
7	601166	兴业银行	918,715	14,892,370.15	1.27
8	600900	长江电力	618,162	14,427,901.08	1.23
9	601899	紫金矿业	1,040,349	12,962,748.54	1.11
10	600276	恒瑞医药	282,028	12,756,126.44	1.09
11	600030	中信证券	621,512	12,660,199.44	1.08
12	601398	工商银行	2,523,118	12,060,504.04	1.03
13	601328	交通银行	1,993,408	11,442,161.92	0.98
14	300059	东方财富	808,745	11,354,779.80	0.97
15	002594	比亚迪	57,200	11,325,600.00	0.97
16	300760	迈瑞医疗	38,400	11,159,040.00	0.95
17	002475	立讯精密	316,147	10,891,264.15	0.93
18	600887	伊利股份	402,308	10,761,739.00	0.92
19	603259	药明康德	129,787	9,443,302.12	0.81
20	000725	京东方 A	2,364,963	9,223,355.70	0.79
21	000651	格力电器	284,689	9,158,445.13	0.78
22	600309	万华化学	119,114	9,150,337.48	0.78
23	601012	隆基绿能	382,833	8,766,875.70	0.75
24	300124	汇川技术	134,700	8,504,958.00	0.73

25	000568	泸州老窖	46,600	8,360,972.00	0.72
26	002415	海康威视	235,842	8,188,434.24	0.70
27	600919	江苏银行	1,158,610	7,751,100.90	0.66
28	601816	京沪高铁	1,551,368	7,632,730.56	0.65
29	002714	牧原股份	172,703	7,111,909.54	0.61
30	600809	山西汾酒	30,780	7,101,869.40	0.61
31	601988	中国银行	1,698,740	6,777,972.60	0.58
32	300498	温氏股份	336,024	6,740,641.44	0.58
33	600028	中国石化	1,202,469	6,709,777.02	0.57
34	688981	中芯国际	124,456	6,598,657.12	0.56
35	601088	中国神华	208,446	6,534,782.10	0.56
36	601668	中国建筑	1,324,194	6,369,373.14	0.54
37	002352	顺丰控股	154,800	6,253,920.00	0.53
38	600016	民生银行	1,569,672	5,870,573.28	0.50
39	600837	海通证券	620,493	5,814,019.41	0.50
40	300274	阳光电源	65,798	5,763,246.82	0.49
41	000001	平安银行	613,318	5,759,056.02	0.49
42	600941	中国移动	57,000	5,670,360.00	0.48
43	600406	国电南瑞	253,838	5,665,664.16	0.48
44	000792	盐湖股份	343,300	5,475,635.00	0.47
45	002230	科大讯飞	117,074	5,429,892.12	0.46
46	000063	中兴通讯	201,420	5,333,601.60	0.46
47	601728	中国电信	981,911	5,312,138.51	0.45
48	000625	长安汽车	313,602	5,277,921.66	0.45
49	600050	中国联通	1,203,936	5,273,239.68	0.45
50	601888	中国中免	61,790	5,171,205.10	0.44
51	600031	三一重工	374,806	5,161,078.62	0.44
52	601601	中国太保	215,893	5,133,935.54	0.44
53	601225	陕西煤业	244,864	5,115,208.96	0.44
54	000100	TCL 科技	1,185,814	5,099,000.20	0.44
55	601857	中国石油	716,856	5,061,003.36	0.43
56	002142	宁波银行	250,486	5,037,273.46	0.43
57	600690	海尔智家	239,046	5,019,966.00	0.43
58	600000	浦发银行	742,311	4,914,098.82	0.42
59	603501	韦尔股份	46,045	4,913,461.95	0.42
60	000338	潍柴动力	343,092	4,683,205.80	0.40
61	300015	爱尔眼科	294,544	4,659,686.08	0.40
62	601688	华泰证券	332,375	4,636,631.25	0.40
63	300122	智飞生物	75,733	4,628,043.63	0.40
64	600436	片仔癀	19,011	4,600,471.89	0.39
65	688111	金山办公	14,519	4,590,907.80	0.39
66	601658	邮储银行	1,053,900	4,584,465.00	0.39
67	300308	中际旭创	40,500	4,572,855.00	0.39

68	000002	万 科 A	430,419	4,502,182.74	0.39
69	600048	保利发展	453,087	4,485,561.30	0.38
70	601985	中国核电	596,510	4,473,825.00	0.38
71	600089	特变电工	319,580	4,410,204.00	0.38
72	601211	国泰君安	291,339	4,335,124.32	0.37
73	600438	通威股份	170,700	4,272,621.00	0.37
74	601169	北京银行	936,480	4,242,254.40	0.36
75	601939	建设银行	650,562	4,235,158.62	0.36
76	688012	中微公司	27,312	4,195,123.20	0.36
77	002304	洋河股份	38,015	4,177,848.50	0.36
78	600150	中国船舶	141,600	4,168,704.00	0.36
79	688041	海光信息	58,700	4,166,526.00	0.36
80	002050	三花智控	141,277	4,153,543.80	0.36
81	002371	北方华创	16,700	4,103,357.00	0.35
82	601766	中国中车	769,304	4,046,539.04	0.35
83	002027	分众传媒	638,868	4,037,645.76	0.35
84	603288	海天味业	105,365	3,998,601.75	0.34
85	600104	上汽集团	295,400	3,996,762.00	0.34
86	600905	三峡能源	904,200	3,951,354.00	0.34
87	603986	兆易创新	42,248	3,903,292.72	0.33
88	601919	中远海控	402,919	3,859,964.02	0.33
89	601138	工业富联	251,300	3,799,656.00	0.32
90	600660	福耀玻璃	101,226	3,784,840.14	0.32
91	601229	上海银行	627,911	3,748,628.67	0.32
92	601390	中国中铁	648,145	3,681,463.60	0.31
93	002466	天齐锂业	65,200	3,637,508.00	0.31
94	688271	联影医疗	26,000	3,562,260.00	0.30
95	600585	海螺水泥	151,768	3,423,886.08	0.29
96	601818	光大银行	1,170,600	3,394,740.00	0.29
97	688008	澜起科技	57,630	3,386,338.80	0.29
98	300782	卓胜微	23,720	3,344,520.00	0.29
99	600019	宝钢股份	559,252	3,316,364.36	0.28
100	600999	招商证券	241,239	3,290,499.96	0.28
101	300014	亿纬锂能	77,761	3,281,514.20	0.28
102	002129	TCL 中环	204,625	3,200,335.00	0.27
103	002241	歌尔股份	151,153	3,175,724.53	0.27
104	600893	航发动力	84,269	3,149,975.22	0.27
105	600111	北方稀土	160,154	3,097,378.36	0.26
106	002460	赣锋锂业	71,300	3,051,640.00	0.26
107	601628	中国人寿	104,962	2,975,672.70	0.25
108	601989	中国重工	720,195	2,974,405.35	0.25
109	000661	长春高新	20,400	2,974,320.00	0.25
110	600958	东方证券	341,219	2,968,605.30	0.25

111	600760	中航沈飞	69,718	2,940,705.24	0.25
112	603019	中科曙光	74,168	2,928,894.32	0.25
113	002049	紫光国微	43,080	2,905,746.00	0.25
114	603799	华友钴业	86,430	2,846,139.90	0.24
115	688036	传音控股	20,479	2,834,293.60	0.24
116	601600	中国铝业	501,843	2,830,394.52	0.24
117	601006	大秦铁路	389,057	2,805,100.97	0.24
118	000938	紫光股份	144,795	2,801,783.25	0.24
119	000538	云南白药	56,956	2,799,387.40	0.24
120	000776	广发证券	193,902	2,770,859.58	0.24
121	600938	中国海油	131,900	2,765,943.00	0.24
122	600570	恒生电子	96,053	2,762,484.28	0.24
123	600584	长电科技	90,400	2,699,344.00	0.23
124	002252	上海莱士	335,778	2,686,224.00	0.23
125	601377	兴业证券	453,291	2,660,818.17	0.23
126	601669	中国电建	543,646	2,658,428.94	0.23
127	000166	申万宏源	591,310	2,625,416.40	0.22
128	600547	山东黄金	114,110	2,609,695.70	0.22
129	002179	中航光电	66,808	2,605,512.00	0.22
130	600426	华鲁恒升	93,780	2,587,390.20	0.22
131	600009	上海机场	78,779	2,582,375.62	0.22
132	300408	三环集团	84,532	2,489,467.40	0.21
133	600886	国投电力	188,690	2,486,934.20	0.21
134	000425	徐工机械	448,446	2,448,515.16	0.21
135	002271	东方雨虹	127,500	2,448,000.00	0.21
136	601009	南京银行	326,479	2,409,415.02	0.21
137	601916	浙商银行	951,700	2,398,284.00	0.21
138	000596	古井贡酒	10,300	2,397,840.00	0.21
139	300142	沃森生物	101,800	2,393,318.00	0.20
140	002311	海大集团	52,400	2,353,284.00	0.20
141	600795	国电电力	561,905	2,337,524.80	0.20
142	600085	同仁堂	43,287	2,324,511.90	0.20
143	600745	闻泰科技	54,900	2,322,819.00	0.20
144	603993	洛阳钼业	445,244	2,315,268.80	0.20
145	600588	用友网络	129,811	2,309,337.69	0.20
146	002236	大华股份	124,949	2,305,309.05	0.20
147	000963	华东医药	55,430	2,298,127.80	0.20
148	002920	德赛西威	17,500	2,266,425.00	0.19
149	600015	华夏银行	403,013	2,264,933.06	0.19
150	600926	杭州银行	224,176	2,244,001.76	0.19
151	600845	宝信软件	45,613	2,225,914.40	0.19
152	601186	中国铁建	291,053	2,214,913.33	0.19
153	601995	中金公司	57,800	2,199,290.00	0.19

154	601901	方正证券	272,000	2,192,320.00	0.19
155	001979	招商蛇口	229,379	2,185,981.87	0.19
156	002459	晶澳科技	104,476	2,164,742.72	0.19
157	601111	中国国航	294,899	2,164,558.66	0.19
158	000977	浪潮信息	65,188	2,164,241.60	0.19
159	600011	华能国际	278,600	2,145,220.00	0.18
160	600674	川投能源	141,400	2,137,968.00	0.18
161	300033	同花顺	13,600	2,133,432.00	0.18
162	002812	恩捷股份	36,998	2,102,226.36	0.18
163	600010	包钢股份	1,432,856	2,091,969.76	0.18
164	600115	中国东航	539,020	2,091,397.60	0.18
165	600989	宝丰能源	139,400	2,058,938.00	0.18
166	601689	拓普集团	28,000	2,058,000.00	0.18
167	000157	中联重科	313,200	2,045,196.00	0.17
168	601066	中信建投	86,300	2,041,858.00	0.17
169	601360	三六零	225,655	2,033,151.55	0.17
170	600196	复星医药	80,201	2,007,431.03	0.17
171	300896	爱美客	6,800	2,001,444.00	0.17
172	002493	荣盛石化	192,063	1,987,852.05	0.17
173	601633	长城汽车	78,400	1,977,248.00	0.17
174	000768	中航西飞	87,788	1,963,817.56	0.17
175	688599	天合光能	68,693	1,959,811.29	0.17
176	600029	南方航空	340,240	1,959,782.40	0.17
177	603369	今世缘	39,600	1,930,500.00	0.17
178	601100	恒立液压	34,012	1,859,776.16	0.16
179	300496	中科创达	23,200	1,857,392.00	0.16
180	300661	圣邦股份	20,750	1,846,957.50	0.16
181	002555	三七互娱	98,129	1,845,806.49	0.16
182	300316	晶盛机电	41,500	1,829,735.00	0.16
183	600489	中金黄金	183,600	1,828,656.00	0.16
184	300347	泰格医药	33,140	1,821,705.80	0.16
185	002709	天赐材料	72,600	1,820,808.00	0.16
186	002601	龙佰集团	105,918	1,814,375.34	0.16
187	603392	万泰生物	24,123	1,812,360.99	0.15
188	688126	沪硅产业	104,273	1,806,008.36	0.15
189	601881	中国银河	148,245	1,786,352.25	0.15
190	688256	寒武纪	13,200	1,781,472.00	0.15
191	300450	先导智能	69,140	1,769,984.00	0.15
192	000895	双汇发展	65,797	1,757,437.87	0.15
193	600346	恒力石化	133,079	1,752,650.43	0.15
194	002821	凯莱英	15,060	1,748,466.00	0.15
195	601868	中国能建	820,900	1,723,890.00	0.15
196	600188	兖矿能源	87,000	1,723,470.00	0.15

197	601800	中国交建	223,988	1,702,308.80	0.15
198	600600	青岛啤酒	22,600	1,689,350.00	0.14
199	300433	蓝思科技	126,400	1,668,480.00	0.14
200	601699	潞安环能	75,700	1,658,587.00	0.14
201	002001	新和成	97,698	1,656,958.08	0.14
202	002736	国信证券	193,600	1,653,344.00	0.14
203	601336	新华保险	52,825	1,644,442.25	0.14
204	300759	康龙化成	56,075	1,625,053.50	0.14
205	600741	华域汽车	99,355	1,617,499.40	0.14
206	600372	中航机载	122,600	1,615,868.00	0.14
207	000301	东方盛虹	167,700	1,609,920.00	0.14
208	600515	海南机场	434,000	1,605,800.00	0.14
209	002648	卫星化学	106,560	1,571,760.00	0.13
210	601021	春秋航空	31,062	1,559,312.40	0.13
211	003816	中国广核	496,500	1,544,115.00	0.13
212	002007	华兰生物	69,295	1,533,498.35	0.13
213	000786	北新建材	64,300	1,502,048.00	0.13
214	688396	华润微	33,308	1,488,534.52	0.13
215	600176	中国巨石	151,127	1,485,578.41	0.13
216	601117	中国化学	232,300	1,477,428.00	0.13
217	601877	正泰电器	67,879	1,460,077.29	0.12
218	301269	华大九天	13,700	1,450,145.00	0.12
219	002410	广联达	84,440	1,447,301.60	0.12
220	002074	国轩高科	67,300	1,446,950.00	0.12
221	601615	明阳智能	114,600	1,437,084.00	0.12
222	000733	振华科技	24,300	1,429,812.00	0.12
223	002180	纳思达	62,700	1,418,901.00	0.12
224	000983	山西焦煤	143,100	1,413,828.00	0.12
225	002202	金风科技	174,878	1,399,024.00	0.12
226	601618	中国中冶	452,438	1,384,460.28	0.12
227	601878	浙商证券	132,000	1,376,760.00	0.12
228	600183	生益科技	74,400	1,362,264.00	0.12
229	601838	成都银行	120,563	1,357,539.38	0.12
230	600233	圆通速递	108,600	1,334,694.00	0.11
231	000876	新希望	143,133	1,333,999.56	0.11
232	600219	南山铝业	446,900	1,313,886.00	0.11
233	600918	中泰证券	191,000	1,310,260.00	0.11
234	600332	白云山	44,369	1,268,953.40	0.11
235	000408	藏格矿业	49,900	1,264,466.00	0.11
236	300999	金龙鱼	37,600	1,255,088.00	0.11
237	000999	华润三九	25,100	1,248,223.00	0.11
238	601238	广汽集团	139,500	1,220,625.00	0.10
239	600732	爱旭股份	69,180	1,220,335.20	0.10

240	002603	以岭药业	52,800	1,218,096.00	0.10
241	601872	招商轮船	206,336	1,213,255.68	0.10
242	002841	视源股份	26,453	1,210,489.28	0.10
243	600460	士兰微	52,800	1,205,424.00	0.10
244	300413	芒果超媒	47,600	1,199,520.00	0.10
245	688303	大全能源	40,540	1,198,767.80	0.10
246	300223	北京君正	18,400	1,189,560.00	0.10
247	600061	国投资本	175,865	1,185,330.10	0.10
248	601799	星宇股份	9,000	1,179,990.00	0.10
249	601607	上海医药	70,300	1,176,119.00	0.10
250	600362	江西铜业	65,815	1,175,455.90	0.10
251	600023	浙能电力	253,900	1,170,479.00	0.10
252	300454	深信服	16,000	1,156,640.00	0.10
253	603260	合盛硅业	22,600	1,152,600.00	0.10
254	603806	福斯特	46,884	1,137,874.68	0.10
255	300751	迈为股份	8,760	1,134,507.60	0.10
256	601898	中煤能源	116,200	1,125,978.00	0.10
257	603659	璞泰来	53,755	1,125,092.15	0.10
258	688223	晶科能源	125,889	1,115,376.54	0.10
259	300763	锦浪科技	15,400	1,076,460.00	0.09
260	300919	中伟股份	21,400	1,051,382.00	0.09
261	600875	东方电气	70,300	1,027,786.00	0.09
262	600132	重庆啤酒	15,400	1,023,330.00	0.09
263	601998	中信银行	193,084	1,021,414.36	0.09
264	600025	华能水电	114,242	985,908.46	0.08
265	601319	中国人保	203,200	983,488.00	0.08
266	600803	新奥股份	58,400	982,288.00	0.08
267	002938	鹏鼎控股	44,000	982,080.00	0.08
268	603290	斯达半导	5,400	977,400.00	0.08
269	000069	华侨城 A	311,029	967,300.19	0.08
270	601865	福莱特	35,900	958,530.00	0.08
271	300628	亿联网络	32,080	947,964.00	0.08
272	002916	深南电路	12,940	918,610.60	0.08
273	605499	东鹏饮料	5,000	912,550.00	0.08
274	605117	德业股份	10,780	904,442.00	0.08
275	000708	中信特钢	64,100	899,964.00	0.08
276	603899	晨光股份	23,500	882,425.00	0.08
277	600018	上港集团	177,047	867,530.30	0.07
278	600754	锦江酒店	29,000	867,100.00	0.07
279	000617	中油资本	159,000	858,600.00	0.07
280	600039	四川路桥	109,860	822,851.40	0.07
281	688065	凯赛生物	14,708	808,645.84	0.07
282	688363	华熙生物	12,020	804,498.60	0.07

283	603195	公牛集团	8,360	799,634.00	0.07
284	603833	欧派家居	11,485	799,470.85	0.07
285	601236	红塔证券	101,200	768,108.00	0.07
286	300957	贝泰妮	10,900	743,053.00	0.06
287	000877	天山股份	110,300	736,804.00	0.06
288	688561	奇安信	17,388	697,084.92	0.06
289	601698	中国卫通	40,100	694,131.00	0.06
290	601155	新城控股	57,150	652,081.50	0.06
291	600606	绿地控股	269,022	618,750.60	0.05
292	603486	科沃斯	14,700	609,168.00	0.05
293	688187	时代电气	16,358	594,286.14	0.05
294	601808	中海油服	37,100	542,402.00	0.05
295	300979	华利集团	9,500	500,080.00	0.04
296	000800	一汽解放	58,400	496,400.00	0.04
297	601059	信达证券	25,700	462,343.00	0.04
298	001289	龙源电力	9,300	184,233.00	0.02

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	688717	艾罗能源	16,147	898,742.02	0.08
2	603296	华勤技术	550	42,762.50	0.00
3	301487	盟固利	867	35,512.32	0.00
4	688549	中巨芯	4,294	34,738.46	0.00
5	688702	盛科通信	549	26,450.82	0.00
6	301559	中集环科	1,315	23,985.60	0.00
7	301511	德福科技	982	22,261.94	0.00
8	688652	京仪装备	416	21,736.00	0.00
9	301525	儒竞科技	266	21,668.36	0.00
10	301498	乖宝宠物	554	21,500.74	0.00
11	301371	敷尔佳	564	21,195.12	0.00
12	301421	波长光电	332	19,710.84	0.00
13	301558	三态股份	1,458	19,537.20	0.00
14	688627	精智达	222	19,473.84	0.00
15	688591	泰凌微	681	19,081.62	0.00
16	301468	博盈特焊	598	18,071.56	0.00
17	301381	赛维时代	571	16,952.99	0.00
18	301509	金凯生科	266	16,553.18	0.00
19	601096	宏盛华源	3,918	15,907.08	0.00
20	688610	埃科光电	275	14,025.00	0.00
21	601083	锦江航运	1,263	13,981.41	0.00
22	301507	民生健康	851	13,488.35	0.00
23	301566	达利凯普	576	12,752.64	0.00
24	301251	威尔高	321	11,103.39	0.00

25	688653	康希通信	648	10,361.52	0.00
26	301528	多浦乐	148	10,198.68	0.00
27	301261	恒工精密	198	10,068.30	0.00
28	688716	中研股份	267	9,716.13	0.00
29	301413	安培龙	164	9,543.16	0.00
30	301418	协昌科技	189	9,487.80	0.00
31	301516	中远通	604	9,368.04	0.00
32	301459	丰茂股份	208	8,286.72	0.00
33	688720	艾森股份	165	8,223.60	0.00
34	688573	信宇人	285	8,208.00	0.00
35	301489	思泉新材	128	8,206.08	0.00
36	688651	盛邦安全	178	8,196.90	0.00
37	301517	陕西华达	185	8,082.65	0.00
38	301578	辰奕智能	118	8,061.76	0.00
39	301548	崇德科技	136	8,022.64	0.00
40	688657	浩辰软件	101	7,901.23	0.00
41	603275	众辰科技	193	7,662.10	0.00
42	603062	麦加芯彩	126	7,284.06	0.00
43	301505	苏州规划	194	6,947.14	0.00
44	301529	福赛科技	182	6,894.16	0.00
45	688648	中邮科技	303	6,493.29	0.00
46	688450	光格科技	167	6,082.14	0.00
47	603004	鼎龙科技	195	6,082.05	0.00
48	603270	金帝股份	195	5,768.10	0.00
49	603119	浙江荣泰	226	5,394.62	0.00
50	603193	润本股份	303	5,047.98	0.00
51	001306	夏厦精密	64	4,823.04	0.00
52	001326	联域股份	99	4,815.36	0.00
53	603075	热威股份	182	4,242.42	0.00
54	001358	兴欣新材	87	3,841.92	0.00
55	001239	永达股份	189	3,764.88	0.00
56	603231	索宝蛋白	161	3,466.33	0.00
57	603273	天元智能	178	3,376.66	0.00
58	603276	恒兴新材	134	3,333.92	0.00
59	603373	安邦护卫	88	3,058.00	0.00

#### 8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

##### 8.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	600519	贵州茅台	38,758,980.00	3.04
2	300750	宁德时代	27,282,716.40	2.14
3	601318	中国平安	18,883,994.00	1.48

4	600036	招商银行	13,763,623.00	1.08
5	000858	五粮液	10,785,538.00	0.85
6	000333	美的集团	9,852,404.00	0.77
7	601899	紫金矿业	8,404,885.50	0.66
8	002594	比亚迪	8,005,142.00	0.63
9	601166	兴业银行	7,935,197.00	0.62
10	600030	中信证券	7,608,465.00	0.60
11	601398	工商银行	7,503,380.00	0.59
12	300059	东方财富	7,420,811.00	0.58
13	600900	长江电力	7,283,312.00	0.57
14	601328	交通银行	7,181,075.00	0.56
15	300760	迈瑞医疗	6,626,179.00	0.52
16	600276	恒瑞医药	6,382,778.40	0.50
17	600028	中国石化	6,165,830.00	0.48
18	600309	万华化学	6,078,395.80	0.48
19	000568	泸州老窖	5,935,634.00	0.47
20	002415	海康威视	5,866,497.00	0.46

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

#### 8.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	600519	贵州茅台	38,325,959.00	3.01
2	300750	宁德时代	26,614,637.47	2.09
3	601318	中国平安	18,938,957.00	1.49
4	600036	招商银行	14,124,574.00	1.11
5	000858	五粮液	11,021,398.00	0.86
6	000333	美的集团	9,594,337.00	0.75
7	600900	长江电力	9,574,391.00	0.75
8	601988	中国银行	8,623,214.00	0.68
9	601166	兴业银行	8,085,319.00	0.63
10	002594	比亚迪	8,001,604.00	0.63
11	002415	海康威视	7,591,204.00	0.60
12	600030	中信证券	7,460,790.00	0.59
13	300059	东方财富	7,236,613.00	0.57
14	601899	紫金矿业	6,778,328.00	0.53
15	600276	恒瑞医药	6,433,869.51	0.50
16	601012	隆基绿能	6,137,362.00	0.48
17	600309	万华化学	5,968,516.00	0.47
18	601398	工商银行	5,964,858.00	0.47
19	600887	伊利股份	5,922,727.00	0.46
20	000568	泸州老窖	5,870,965.00	0.46

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

#### 8.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	760,351,881.78
卖出股票收入（成交）总额	708,197,804.02

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

#### 8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	1,014,197.26	0.09
2	央行票据	-	-
3	金融债券	50,159,230.77	4.29
	其中：政策性金融债	50,159,230.77	4.29
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）	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	51,173,428.03	4.38

#### 8.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	210213	21 国开 13	500,000	50,159,230.77	4.29
2	019703	23 国债 10	10,000	1,014,197.26	0.09

#### 8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

无。

#### 8.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

无。

#### 8.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

无。

#### 8.10 本基金投资股指期货的投资政策

无。

## 8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

### 8.11.1 本期国债期货投资政策

无。

### 8.11.2 本期国债期货投资评价

无。

## 8.12 投资组合报告附注

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

本基金投资的前十名证券之一招商银行的发行主体招商银行股份有限公司于 2023 年 12 月 13 日因未按规定承担小微企业押品评估费、未按规定承担房屋抵押登记费、未落实价格目录，向小微企业收取委托贷款手续费、小微企业规模划型依据不足等受到国家金融监督管理总局深圳监管局处罚（深金罚决字〔2023〕81 号）。招商银行为本基金跟踪标的指数的成份券。

### 8.12.2 基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库

本基金投资的前十名股票未超出基金合同规定的备选股票库。

### 8.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	244,185.70
2	应收清算款	540,250.79
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	858,972.14
6	其他应收款	33,491.90
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	1,676,900.53

### 8.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

无。

### 8.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

#### 8.12.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

无。

#### 8.12.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公	占基金资产净	流通受限情况说
----	------	------	----------	--------	---------

			允价值	值比例 (%)	明
1	688717	艾罗能源	898,742.02	0.08	新股未上市
2	603296	华勤技术	42,762.50	0.00	新股锁定
3	301487	盟固利	35,512.32	0.00	新股锁定
4	688549	中巨芯	34,738.46	0.00	新股锁定
5	688702	盛科通信	26,450.82	0.00	新股锁定

### 8.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入原因，分项之和与合计可能有尾差。

## § 9 基金份额持有人信息

### 9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额级别	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 (%)
大成沪深 300 指数 A	77,525	15,441.40	5,782,952.85	0.48	1,191,311,848.36	99.52
大成沪深 300 指数 C	1,774	78,585.75	123,234,726.73	88.40	16,176,389.93	11.60
合计	79,299	16,854.01	129,017,679.58	9.65	1,207,488,238.29	90.35

注：1、上述机构/个人投资者持有份额占总份额比例的计算中，对分级份额，比例的分母采用各自级别的份额，对合计数，比例的分母采用下属分级基金份额的合计数（即期末基金份额总额）。

2、持有人户数为有效户数，即存量份额大于零的账户。

### 9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	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	大成沪深 300 指数 A	54,121.01	0.0045
	大成沪深 300 指数 C	420.64	0.0003
	合计	54,541.65	0.0041

注：上述占基金总份额比例的计算中，对分级份额，比例的分母采用各自级别的份额，对合计数，比例的分母采用下属分级基金份额的合计数（即期末基金份额总额）。

### 9.3 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	份额级别	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	大成沪深 300 指数 A	0~10
	大成沪深 300 指数 C	0
	合计	0~10
本基金基金经理持有本开放式基金	大成沪深 300 指数 A	0
	大成沪深 300 指数 C	0
	合计	0

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

无。

## § 10 开放式基金份额变动

单位：份

项目	大成沪深 300 指数 A	大成沪深 300 指数 C
基金合同生效日 (2006 年 4 月 6 日) 基金份额总额	1,813,356,066.47	-
本报告期期初基金份额总额	1,206,653,825.17	118,810,270.12
本报告期基金总申购份额	129,512,001.57	782,394,171.33
减：本报告期基金总赎回份额	139,071,025.53	761,793,324.79
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	1,197,094,801.21	139,411,116.66

## § 11 重大事件揭示

### 11.1 基金份额持有人大会决议

大成沪深 300 指数证券投资基金基金份额持有人大会以通讯方式自 2023 年 9 月 8 日起至 2023 年 10 月 10 日召开，本次基金份额持有人大会于 2023 年 10 月 12 日决议通过了《关于大成沪深 300 指数证券投资基金修改投资范围并修订基金合同有关事项的议案》，本次大会决议自该日起生效。具体详见 2023 年 10 月 13 日公告。

## 11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

### 一、基金管理人的重大人事变动

根据我司发布的《大成基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告》，经大成基金管理有限公司第八届董事会第二次会议审议通过并履行必要程序，自 2023 年 3 月 25 日起，温智敏先生因个人原因辞去公司副总经理职务。聘请石国武先生担任公司副总经理，任期自公司八届二次董事会决议作出之日起，至本届董事会任期届满之日止。

### 二、基金托管人的基金托管部门的重大人事变动

无。

## 11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内无涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

## 11.4 基金投资策略的改变

本基金投资策略在本报告期内没有重大改变。本基金于 2023 年 10 月 13 日投资范围增加融资及转融通。投资策略增加：5、融资及转融通证券出借业务投资策略。

本基金在参与融资、转融通证券出借业务时将根据风险管理的原则，在法律法规允许的范围和比例内、风险可控的前提下，本着谨慎原则，参与融资和转融通证券出借业务。参与融资业务时，本基金将力争利用融资的杠杆作用，降低因申购造成基金仓位较低带来的跟踪误差，达到有效跟踪标的指数的目的。参与转融通证券出借业务时，本基金将从基金持有的融券标的股票中选择流动性好、交易活跃的股票作为转融通出借交易对象，力争为本基金份额持有人增厚投资收益。

## 11.5 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安永华明会计师事务所（特殊普通合伙），本年度应支付的审计费用为 100,000.00 元整。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。

## 11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

### 11.6.1 管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，基金管理人及其相关高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

### 11.6.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

无。

## 11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

## 11.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例 (%)	佣金	占当期佣金总量的比例 (%)	
光大证券	2	979,068,973.19	67.52	715,653.86	65.20	-
财通证券	1	294,096,034.49	20.28	216,418.72	19.72	本期报告新增 1 个
兴业证券	2	175,886,988.75	12.13	164,621.01	15.00	-
广发证券	1	978,057.40	0.07	915.39	0.08	-
爱建证券	1	-	-	-	-	-
川财证券	1	-	-	-	-	-
第一创业	1	-	-	-	-	-
东北证券	2	-	-	-	-	-
东财证券	1	-	-	-	-	-
东方证券	1	-	-	-	-	-
东吴证券	1	-	-	-	-	-
东兴证券	1	-	-	-	-	-
东亚前海	1	-	-	-	-	-
方正证券	1	-	-	-	-	-
高盛中国 证券	1	-	-	-	-	-
国金证券	2	-	-	-	-	-
国盛证券	1	-	-	-	-	-
国泰君安	3	-	-	-	-	-
国投证券	1	-	-	-	-	-
国信证券	1	-	-	-	-	-
海通证券	1	-	-	-	-	-
红塔证券	1	-	-	-	-	-
华创证券	1	-	-	-	-	-
华泰证券	1	-	-	-	-	-
华西证券	1	-	-	-	-	-
民生证券	1	-	-	-	-	-
南京证券	1	-	-	-	-	-
平安证券	1	-	-	-	-	-
瑞银证券	2	-	-	-	-	-
山西证券	1	-	-	-	-	-

上海证券	1	-	-	-	-	-
申万宏源	1	-	-	-	-	-
申万宏源西部	0	-	-	-	-	本期报告 退租 1 个
世纪证券	1	-	-	-	-	-
天风证券	2	-	-	-	-	-
万和证券	1	-	-	-	-	-
西部证券	1	-	-	-	-	-
湘财证券	1	-	-	-	-	-
信达证券	2	-	-	-	-	-
粤开证券	1	-	-	-	-	-
招商证券	2	-	-	-	-	-
浙商证券	1	-	-	-	-	-
中国银河证券	4	-	-	-	-	-
中金公司	2	-	-	-	-	本期报告 退租 1 个
中泰证券	2	-	-	-	-	-
中信建投证券	2	-	-	-	-	-
中信证券	4	-	-	-	-	-
中银国际证券	1	-	-	-	-	-
中原证券	1	-	-	-	-	-

注：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。

### 11.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

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	9,006,100.00	60.03	-	-	-	-
财通证券	5,997,430.00	39.97	-	-	-	-

### 11.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	关于再次提请投资者及时更新已过期身份证件或者身份证明文件的公告	中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站	2023年12月29日
2	大成基金管理有限公司关于终止和谐保险销售有限公司办理旗下基金相关销售业务的公告	中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站	2023年11月29日
3	大成沪深 300 指数证券投资基金 2023 年第 3 季度报告	中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站	2023年10月25日
4	大成基金管理有限公司关于旗下部分基金增加东方证券股份有限公司为销售机构的公告	中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站	2023年10月16日
5	大成沪深 300 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	2023年10月13日
6	大成沪深 300 指数证券投资基金(C 类份额)基金产品资料概要更新	中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站	2023年10月13日
7	大成沪深 300 指数证券投资基金更新招募说明书	中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站	2023年10月13日
8	大成沪深 300 指数证券投资基金(A 类份额)基金产品资料概要更新	中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站	2023年10月13日
9	大成沪深 300 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	2023年10月13日
10	关于大成沪深 300 指数证券投资基金	中国证监会基金电子披	2023年10月13日

	基金份额持有人大会（二次召开）表决结果暨决议生效公告	露网站、规定报刊及本公司网站	
11	大成沪深 300 指数证券投资基金 C 类份额增加北京雪球基金销售有限公司为代销机构的公告	中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站	2023 年 10 月 10 日
12	大成基金管理有限公司关于以通讯方式二次召开大成沪深 300 指数证券投资基金基金份额持有人大会的第二次提示性公告	中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站	2023 年 9 月 9 日
13	大成基金管理有限公司关于以通讯方式二次召开大成沪深 300 指数证券投资基金基金份额持有人大会的第一次提示性公告	中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站	2023 年 9 月 8 日
14	大成基金管理有限公司关于以通讯方式二次召开大成沪深 300 指数证券投资基金基金份额持有人大会的公告	中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站	2023 年 9 月 7 日
15	大成基金管理有限公司关于终止凤凰金信（海口）基金销售有限公司办理旗下基金相关销售业务的公告	中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站	2023 年 9 月 6 日
16	大成沪深 300 指数证券投资基金 A、C 类份额增加博时财富基金销售有限公司为代销机构的公告	中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站	2023 年 9 月 5 日
17	大成基金管理有限公司关于旗下部分基金增加海通证券股份有限公司为销售机构的公告	中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站	2023 年 8 月 30 日
18	大成沪深 300 指数证券投资基金 2023 年中期报告	中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站	2023 年 8 月 30 日
19	大成沪深 300 指数证券投资基金(A 类份额)基金产品资料概要更新	中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站	2023 年 8 月 26 日
20	大成沪深 300 指数证券投资基金(C 类份额)基金产品资料概要更新	中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站	2023 年 8 月 26 日
21	大成基金管理有限公司关于旗下部分基金增加上海华夏财富投资管理有限公司为销售机构的公告	中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站	2023 年 8 月 22 日
22	大成基金管理有限公司关于旗下部分基金增加海通证券股份有限公司为销售机构的公告	中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站	2023 年 8 月 15 日
23	大成基金管理有限公司关于旗下部分基金增加安信证券股份有限公司为销售机构的公告	中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站	2023 年 8 月 15 日
24	大成基金管理有限公司关于旗下部分	中国证监会基金电子披	2023 年 8 月 11 日

	基金增加南京苏宁基金销售有限公司为销售机构的公告	露网站、规定报刊及本公司网站	
25	大成基金管理有限公司关于旗下部分基金增加上海大智慧基金销售有限公司为销售机构的公告	中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站	2023 年 7 月 25 日
26	大成沪深 300 指数证券投资基金 2023 年第 2 季度报告	中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站	2023 年 7 月 20 日
27	大成基金管理有限公司提醒投资者谨防金融诈骗的公告	中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站	2023 年 7 月 13 日
28	关于大成沪深 300 指数证券投资基金基金份额持有人大会会议情况的公告	中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站	2023 年 7 月 8 日
29	关于再次提请投资者及时更新已过期身份证件或者身份证明文件的公告	中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站	2023 年 6 月 30 日
30	大成基金管理有限公司关于旗下部分基金增加中信证券华南股份有限公司为销售机构的公告	中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站	2023 年 6 月 29 日
31	大成基金管理有限公司关于旗下部分基金增加中信证券股份有限公司为销售机构的公告	中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站	2023 年 6 月 29 日
32	大成基金管理有限公司关于旗下部分基金增加中信期货有限公司为销售机构的公告	中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站	2023 年 6 月 29 日
33	大成基金管理有限公司关于旗下部分基金增加北京新浪仓石基金销售有限公司为销售机构的公告	中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站	2023 年 6 月 29 日
34	大成基金管理有限公司关于旗下部分基金增加中信证券（山东）有限责任公司为销售机构的公告	中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站	2023 年 6 月 29 日
35	大成基金管理有限公司关于以通讯方式召开大成沪深 300 指数证券投资基金基金份额持有人大会的第二次提示性公告	中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站	2023 年 6 月 8 日
36	大成基金管理有限公司关于以通讯方式召开大成沪深 300 指数证券投资基金基金份额持有人大会的第一次提示性公告	中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站	2023 年 6 月 7 日
37	大成基金管理有限公司关于以通讯方式召开大成沪深 300 指数证券投资基金基金份额持有人大会的公告	中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站	2023 年 6 月 6 日
38	大成基金管理有限公司关于旗下部分	中国证监会基金电子披	2023 年 5 月 30 日

	基金增加中国中金财富证券有限公司为销售机构的公告	露网站、规定报刊及本公司网站	
39	大成基金管理有限公司关于旗下部分基金增加上海中欧财富基金销售有限公司为销售机构的公告	中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站	2023 年 5 月 24 日
40	大成基金管理有限公司关于旗下部分基金增加中国工商银行股份有限公司为销售机构的公告	中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站	2023 年 5 月 17 日
41	大成沪深 300 指数证券投资基金更新招募说明书	中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站	2023 年 5 月 6 日
42	大成基金管理有限公司提醒投资者谨防金融诈骗的公告	中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站	2023 年 4 月 27 日
43	大成基金管理有限公司关于旗下部分基金增加上海中欧财富基金销售有限公司为销售机构的公告	中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站	2023 年 4 月 26 日
44	大成基金管理有限公司关于旗下部分基金增加阳光人寿保险股份有限公司为销售机构的公告	中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站	2023 年 4 月 24 日
45	大成沪深 300 指数证券投资基金 2023 年第 1 季度报告	中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站	2023 年 4 月 21 日
46	大成沪深 300 指数证券投资基金更新招募说明书	中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站	2023 年 4 月 21 日
47	大成沪深 300 指数证券投资基金(C 类份额)基金产品资料概要更新	中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站	2023 年 4 月 21 日
48	大成沪深 300 指数证券投资基金(A 类份额)基金产品资料概要更新	中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站	2023 年 4 月 21 日
49	大成沪深 300 指数证券投资基金变更基金经理公告	中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站	2023 年 4 月 20 日
50	大成基金管理有限公司关于旗下部分基金增加阳光人寿保险股份有限公司为销售机构的公告	中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站	2023 年 4 月 19 日
51	大成沪深 300 指数证券投资基金(C 类份额)基金产品资料概要更新	中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站	2023 年 4 月 18 日
52	大成沪深 300 指数证券投资基金(A 类份额)基金产品资料概要更新	中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站	2023 年 4 月 18 日

53	大成沪深 300 指数证券投资基金更新招募说明书	中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站	2023 年 4 月 18 日
54	大成沪深 300 指数证券投资基金增聘基金经理公告	中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站	2023 年 4 月 15 日
55	大成沪深 300 指数证券投资基金 2022 年年度报告	中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站	2023 年 3 月 30 日
56	大成基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告	中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站	2023 年 3 月 27 日
57	大成基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告	中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站	2023 年 3 月 27 日
58	大成基金管理有限公司关于养老金客户通过直销柜台申购旗下基金费率优惠的公告	中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站	2023 年 3 月 24 日
59	大成基金管理有限公司关于旗下部分基金增加兴业证券股份有限公司为销售机构的公告	中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站	2023 年 2 月 27 日
60	大成基金管理有限公司关于旗下部分基金增加国金证券股份有限公司为销售机构的公告	中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站	2023 年 2 月 27 日
61	大成基金管理有限公司关于旗下部分基金增加深圳前海微众银行股份有限公司为销售机构的公告	中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站	2023 年 2 月 23 日
62	大成沪深 300 指数证券投资基金 2022 年第 4 季度报告	中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站	2023 年 1 月 18 日

## § 12 影响投资者决策的其他重要信息

### 12.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过 20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比 (%)
机构	1	20230906-20230908	0.00	418,274,654.26	418,274,654.26	0.00	0.00
产品特有风险							
当基金份额持有人占比过于集中时，可能会因某单一基金份额持有人大额赎回而引发基金净值剧烈波动的风险，甚至有可能引起基金的流动性风险，基金管理人可能无法及时变现基金资产以应							

对基金份额持有人的赎回申请，基金份额持有人可能无法及时赎回持有的全部基金份额。

## 12.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

## § 13 备查文件目录

### 13.1 备查文件目录

- 1、中国证监会批准设立大成沪深 300 指数证券投资基金的文件；
- 2、《大成沪深 300 指数证券投资基金基金合同》；
- 3、《大成沪深 300 指数证券投资基金托管协议》；
- 4、大成基金管理有限公司批准文件、营业执照、公司章程；
- 5、本报告期内在规定报刊上披露的各种公告原稿。

### 13.2 存放地点

备查文件存放在本基金管理人和托管人的住所。

### 13.3 查阅方式

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

大成基金管理有限公司

2024 年 3 月 29 日