

大成中证 1000 指数增强型发起式证券投资
基金
2024 年中期报告

2024 年 6 月 30 日

基金管理人：大成基金管理有限公司

基金托管人：中国银行股份有限公司

送出日期：2024 年 8 月 30 日

§ 1 重要提示及目录

1.1 重要提示

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

基金托管人中国银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2024 年 08 月 29 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告财务资料未经审计。

本报告期自 2024 年 01 月 01 日起至 06 月 30 日止。

1.2 目录

§ 1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
§ 2 基金简介	5
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人和基金托管人	5
2.4 信息披露方式	6
2.5 其他相关资料	6
§ 3 主要财务指标和基金净值表现	6
3.1 主要会计数据和财务指标	6
3.2 基金净值表现	7
§ 4 管理人报告	8
4.1 基金管理人及基金经理情况	8
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	10
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	10
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明	11
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	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	13
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	13
§ 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 净资产变动表	15
6.4 报表附注	16
§ 7 投资组合报告	39
7.1 期末基金资产组合情况	39
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	39
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细	41
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	48
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	49
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	49
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	49
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	50

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	50
7.10 本基金投资股指期货的投资政策	50
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	50
7.12 投资组合报告附注	50
§ 8 基金份额持有人信息	51
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	51
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	52
8.3 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	52
8.4 发起式基金发起资金持有份额情况	52
§ 9 开放式基金份额变动	53
§ 10 重大事件揭示	53
10.1 基金份额持有人大会决议	53
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	53
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	54
10.4 基金投资策略的改变	54
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	54
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	54
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	54
10.8 其他重大事件	56
§ 11 影响投资者决策的其他重要信息	57
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	57
11.2 影响投资者决策的其他重要信息	57
§ 12 备查文件目录	57
12.1 备查文件目录	57
12.2 存放地点	57
12.3 查阅方式	58

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	大成中证 1000 指数增强型发起式证券投资基金	
基金简称	大成中证 1000 指数增强发起式	
基金主代码	018661	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2023 年 8 月 1 日	
基金管理人	大成基金管理有限公司	
基金托管人	中国银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	120,568,383.47 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	大成中证 1000 指数增强发起式 A	大成中证 1000 指数增强发起式 C
下属分级基金的交易代码	018661	018662
报告期末下属分级基金的份额总额	98,258,365.90 份	22,310,017.57 份

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金为增强型股票指数基金，力争在对标的指数进行有效跟踪的基础上，实现超越目标指数的投资收益，谋求基金资产的长期增值。本基金力争使日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.5%，年化跟踪误差不超过 7.75%。
投资策略	本基金在指数化投资的基础上通过数量化模型进行投资组合优化，在控制与业绩比较基准偏离风险的前提下，力争获得超越标的指数的投资收益。
业绩比较基准	中证 1000 指数收益率×95%+银行活期存款利率(税后)×5%
风险收益特征	本基金是股票型基金，其预期风险与预期收益高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。本基金主要投资于标的指数成份股及备选成份股，具有与标的指数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	中国银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	段皓静	许俊
	联系电话	0755-83183388	010-66596688
	电子邮箱	office@dcfund.com.cn	fxjd_hq@bank-of-china.com
客户服务电话		4008885558	95566
传真		0755-83199588	010-66594942
注册地址		广东省深圳市南山区海德三道 1236 号大成基金总部大厦 5 层、27-33 层	北京市西城区复兴门内大街 1 号

办公地址	广东省深圳市南山区海德三道 1236 号大成基金总部大厦 5 层、 27-33 层	北京市西城区复兴门内大街 1 号
邮政编码	518054	100818
法定代表人	吴庆斌	葛海蛟

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《上海证券报》
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	大成基金管理有限公司	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

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数 据和指标	报告期(2024 年 1 月 1 日-2024 年 6 月 30 日)	
	大成中证 1000 指数增强发起式 A	大成中证 1000 指数增强发起式 C
本期已实现收益	-5,341,665.62	-1,083,450.63
本期利润	-17,513,975.93	-3,403,249.33
加权平均基金份 额本期利润	-0.1675	-0.1399
本期加权平均净 值利润率	-19.19%	-16.06%
本期基金份额净 值增长率	-16.60%	-16.77%
3.1.2 期末数 据和指标	报告期末(2024 年 6 月 30 日)	
期末可供分配利 润	-19,711,791.30	-4,541,676.83
期末可供分配基 金份额利润	-0.2006	-0.2036

期末基金资产净值	78,546,574.60	17,768,340.74
期末基金份额净值	0.7994	0.7964
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2024年6月30日)	
基金份额累计净值增长率	-20.06%	-20.36%

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

大成中证 1000 指数增强发起式 A

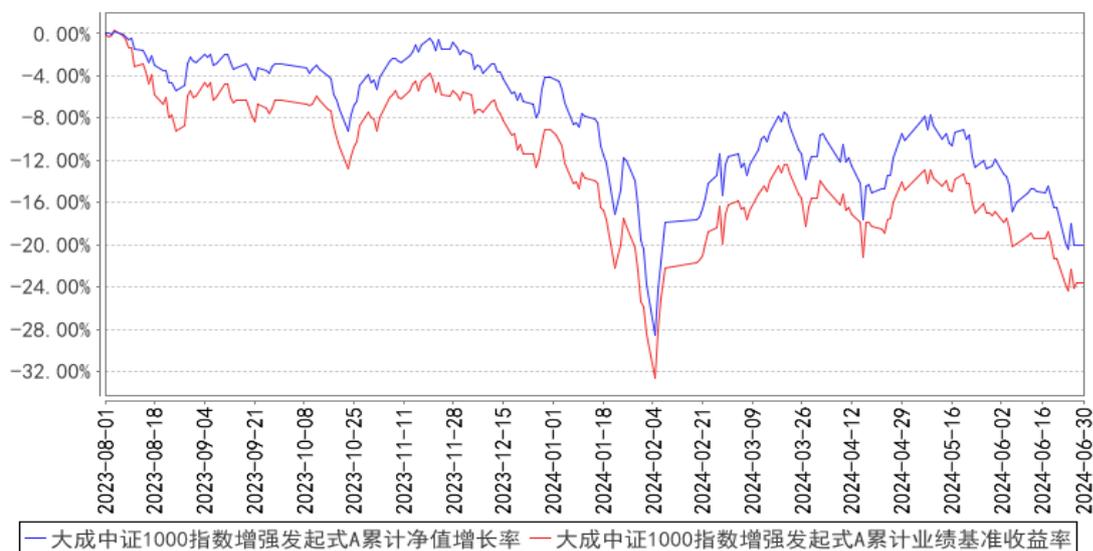
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	-9.19%	1.50%	-8.15%	1.36%	-1.04%	0.14%
过去三个月	-9.46%	1.54%	-9.51%	1.42%	0.05%	0.12%
过去六个月	-16.60%	1.93%	-15.97%	1.87%	-0.63%	0.06%
自基金合同生效起至今	-20.06%	1.51%	-23.66%	1.52%	3.60%	-0.01%

大成中证 1000 指数增强发起式 C

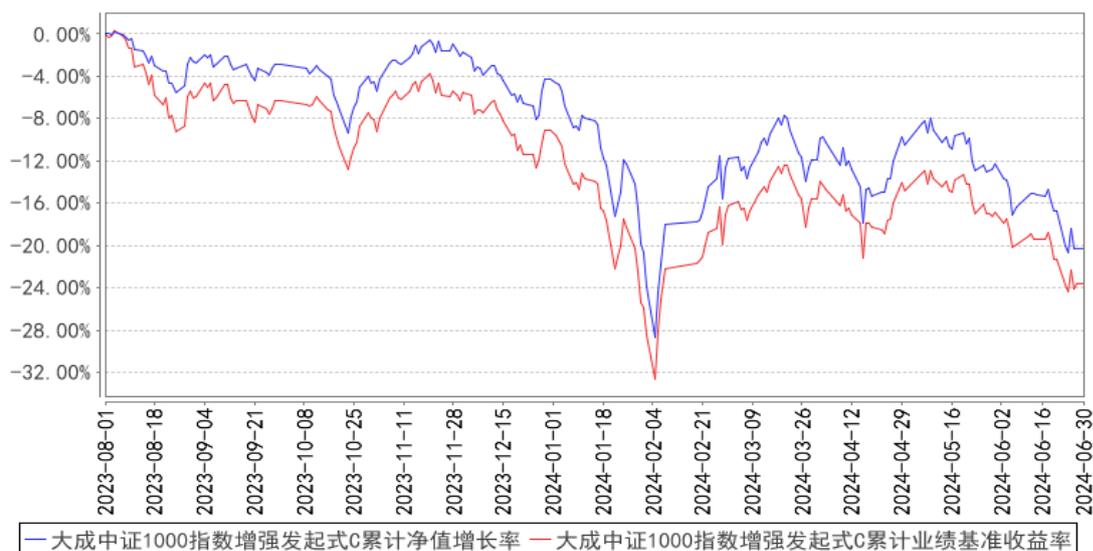
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	-9.22%	1.51%	-8.15%	1.36%	-1.07%	0.15%
过去三个月	-9.55%	1.54%	-9.51%	1.42%	-0.04%	0.12%
过去六个月	-16.77%	1.93%	-15.97%	1.87%	-0.80%	0.06%
自基金合同生效起至今	-20.36%	1.51%	-23.66%	1.52%	3.30%	-0.01%

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

大成中证1000指数增强发起式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



大成中证1000指数增强发起式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、本基金合同生效日为 2023 年 8 月 1 日，截止报告期末本基金合同生效未满一年。

2、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约定。建仓期结束时，本基金的投资组合比例符合基金合同的约定。

§ 4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

大成基金管理有限公司成立于 1999 年 4 月 12 日，注册资本人民币 2 亿元，是中国首批获准

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

公司业务资质齐全，全面覆盖公募基金、机构投资、海外投资、财富管理、养老金管理等业务，还受全国社会保障基金理事会委托管理部分社保基金和基本养老保险基金。旗下大成国际资产管理公司具备 QFII、RQFII 等资格，是首批首家完成备案的能够提供港股通投资顾问服务的香港机构。

历经二十余年的磨砺和沉淀，大成基金形成了以长期投资能力为核心的竞争优势，打造了一支具有良好职业素养和丰富经验的资产管理队伍。公司目前已形成权益投资、固收投资、指数与期货投资、跨境投资、混合资产投资、大类资产配置六大投资团队，全面覆盖各类投资领域，综合实力不断提升，各项业务迅猛发展，管理资产种类位居同业前列。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
苏秉毅	本基金基金经理，混合资产投资部副总监	2023 年 8 月 1 日	-	20 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中国证监会《证券基金经营机构董事、监事、高级管理人员及从业人员监督管理办法》的相关规定。

4.1.3 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理同时管理的产品情况

无。

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

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

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

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

4.3.2 异常交易行为的专项说明

报告期内，公司旗下所有投资组合未发现存在异常交易行为。公司旗下投资组合间存在证券同日反向交易，但不存在参与交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量 5% 的情形。投资组合间相邻交易日反向交易的市场成交比例、成交均价等交易结果数据表明该类交易不对市场产生重大影响，无异常。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

上半年，宏观经济运行趋势没有太大改变。投资者风险偏好持续下降，防御风格优势凸显，十年期、三十年期国债期货均创出历史新高。上半年沪深 300 指数微涨 0.89%，而沪深两市股票涨幅中位数约为-23%，中证 2000 指数收益也与此大致相当。高股息风格继续挑起支撑指数的大梁，中证红利指数逆势上涨 7.75%。

本基金保持高仓位运作，组合内绝大多数股票均为中证 1000 成分股，没有在市值因子过多暴露。同时，基于均值回归的理念，高配了反转因子。总体而言，上半年市场环境偏分化，动量效应显著，对反转因子并不友好。

上半年基金 A 类份额净值下跌 16.60%，跌幅和中证 1000 指数相当。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末大成中证 1000 指数增强发起式 A 的基金份额净值为 0.7994 元，本报告期基金份额净值增长率为-16.60%，同期业绩比较基准收益率为-15.97%；截至本报告期末大成中证 1000 指数增强发起式 C 的基金份额净值为 0.7964 元，本报告期基金份额净值增长率为-16.77%，同期业绩比较基准收益率为-15.97%。

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，宏观经济不确定性仍存。股票市场当前的风险偏好水平已经对宏观经济和管理措施充分定价，若政策层面能释放超预期的信号，则投资者的信心有望得到修复。

本基金将继续按照基金合同约定，保持较高仓位运作，力争在控制跟踪误差的前提下尽量获得超额收益。

组合管理上，我们坚持主观研判和量化模型相结合的方式不变。下半年，除了贯穿始终的反转因子外，我们还将适当放大中证 1000 指数内部的科技行业敞口。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

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

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

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

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

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

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

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

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

无。

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内，中国银行股份有限公司（以下称“本托管人”）在大成中证 1000 指数增强型发起式证券投资基金（以下称“本基金”）的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职

尽责地履行了应尽的义务。

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

本报告期内，本托管人根据《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，对本基金管理人的投资运作进行了必要的监督，对基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算以及基金费用开支等方面进行了认真地复核，未发现本基金管理人存在损害基金份额持有人利益的行为。

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

本报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告（注：财务会计报告中的“金融工具风险及管理”、“关联方承销证券”、“关联方证券出借”部分未在托管人复核范围内）、投资组合报告等数据真实、准确和完整。

§ 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：大成中证 1000 指数增强型发起式证券投资基金

报告截止日：2024 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2024 年 6 月 30 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
资产：			
货币资金	6.4.7.1	7,055,267.19	9,951,181.64
结算备付金		5,053,343.98	13,333,491.79
存出保证金		1,070,671.13	1,620,870.19
交易性金融资产	6.4.7.2	82,113,151.61	117,016,286.27
其中：股票投资		82,113,151.61	117,016,286.27
基金投资		-	-
债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
其他投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
债权投资	6.4.7.5	-	-
其中：债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
其他投资		-	-
其他债权投资	6.4.7.6	-	-

其他权益工具投资	6.4.7.7	-	-
应收清算款		1,324,389.49	498,963.38
应收股利		-	-
应收申购款		32,056.38	21,675.88
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.8	-	-
资产总计		96,648,879.78	142,442,469.15
负债和净资产	附注号	本期末 2024年6月30日	上年度末 2023年12月31日
负债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付清算款		-	434,080.47
应付赎回款		15,673.32	111,844.83
应付管理人报酬		84,274.05	123,099.36
应付托管费		15,169.35	22,157.90
应付销售服务费		6,139.74	8,221.82
应付投资顾问费		-	-
应交税费		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.9	212,707.98	311,622.47
负债合计		333,964.44	1,011,026.85
净资产：			
实收基金	6.4.7.10	120,568,383.47	147,600,219.03
未分配利润	6.4.7.12	-24,253,468.13	-6,168,776.73
净资产合计		96,314,915.34	141,431,442.30
负债和净资产总计		96,648,879.78	142,442,469.15

注：报告截止日 2024 年 06 月 30 日，基金份额总额 120,568,383.47 份，其中大成中证 1000 指数增强发起式 A 基金份额总额为 98,258,365.90 份，基金份额净值 0.7994 元。大成中证 1000 指数增强发起式 C 基金份额总额为 22,310,017.57 份，基金份额净值 0.7964 元。

6.2 利润表

会计主体：大成中证 1000 指数增强型发起式证券投资基金

本报告期：2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2024年1月1日至2024年6 月30日
一、营业总收入		-20,132,890.97

1. 利息收入		58,125.25
其中：存款利息收入	6.4.7.13	58,125.25
债券利息收入		-
资产支持证券利息收入		-
买入返售金融资产收入		-
其他利息收入		-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		-5,715,801.38
其中：股票投资收益	6.4.7.14	-5,080,724.71
基金投资收益		-
债券投资收益	6.4.7.15	15,484.29
资产支持证券投资收益	6.4.7.16	-
贵金属投资收益	6.4.7.17	-
衍生工具收益	6.4.7.18	-1,408,576.62
股利收益	6.4.7.19	758,015.66
其他投资收益		-
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.20	-14,492,109.01
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.21	16,894.17
减：二、营业总支出		784,334.29
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	559,372.60
其中：暂估管理人报酬		-
2. 托管费	6.4.10.2.2	100,687.12
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	42,163.52
4. 投资顾问费		-
5. 利息支出		-
其中：卖出回购金融资产支出		-
6. 信用减值损失	6.4.7.22	-
7. 税金及附加		0.11
8. 其他费用	6.4.7.23	82,110.94
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-20,917,225.26
减：所得税费用		-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-20,917,225.26
五、其他综合收益的税后净额		-
六、综合收益总额		-20,917,225.26

6.3 净资产变动表

会计主体：大成中证 1000 指数增强型发起式证券投资基金

本报告期：2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	147,600,219.03	-	-6,168,776.73	141,431,442.30
二、本期期初净资产	147,600,219.03	-	-6,168,776.73	141,431,442.30
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	-27,031,835.56	-	-18,084,691.40	-45,116,526.96
(一)、综合收益总额	-	-	-20,917,225.26	-20,917,225.26
(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)	-27,031,835.56	-	2,832,533.86	-24,199,301.70
其中：1. 基金申购款	30,026,448.29	-	-3,816,641.35	26,209,806.94
2. 基金赎回款	-57,058,283.85	-	6,649,175.21	-50,409,108.64
(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	120,568,383.47	-	-24,253,468.13	96,314,915.34

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

范瑛

梁靖

基金管理人负责人

主管会计工作负责人

会计机构负责人

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

大成中证 1000 指数增强型发起式证券投资基金（以下简称“本基金”）经中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）证监许可【2023】1137 号文《关于准予大成中证 1000 指数增

强型发起式证券投资基金注册的批复》注册，由大成基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《大成中证 1000 指数增强型发起式证券投资基金基金合同》于 2023 年 7 月 17 日至 2023 年 7 月 28 日向社会公开募集，募集期结束经安永华明会计师事务所验证并出具安永华明（2023）验字第 60469430_H06 号验资报告。向中国证监会报送基金备案材料后，基金合同于 2023 年 8 月 1 日生效。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，注册登记机构为本基金管理人，基金托管人为中国银行股份有限公司（以下简称“中国银行”）。

本基金投资范围主要为标的指数成份股及备选成份股（含存托凭证，下同），此外，为更好地实现投资目标，本基金可少量投资于部分非成份股（包含创业板、科创板及其他经中国证监会核准或注册上市的股票及存托凭证）、债券（包括国债、央行票据、金融债券、企业债券、公司债券、中期票据、短期融资券、超短期融资券、次级债券、政府支持机构债券、政府支持债券、地方政府债券、可转换债券（含分离交易可转债）、可交换公司债券及其他经中国证监会允许投资的债券）、资产支持证券、债券回购、同业存单、银行存款（包括协议存款、定期存款及其他银行存款）、货币市场工具、股指期货、国债期货、股票期权、现金以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具。本基金可以根据有关法律法规的规定参与融资及转融通证券出借业务。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。

本基金的投资组合比例为：股票（含存托凭证）资产投资比例不低于基金资产的 80%，其中投资于标的指数成份股及其备选成份股的比例不低于非现金基金资产的 80%；每个交易日日终在扣除股指期货、国债期货、股票期权合约需缴纳的交易保证金后，保持不低于基金资产净值 5% 的现金或到期日在一年以内的政府债券，其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。股指期货、国债期货、股票期权及其他金融工具的投资比例符合法律法规和监管机构的规定。如法律法规或中国证监会变更投资品种的投资比例限制，基金管理人在履行适当程序后，可以调整上述投资品种的投资比例。

本基金的业绩比较基准为中证 1000 指数收益率 \times 95%+银行活期存款利率（税后） \times 5%。

本财务报表已于 2024 年 8 月 29 日经本基金的基金管理人批准报出。

6.4.2 会计报表的编制基础

本财务报表系按照财政部颁布的《企业会计准则——基本准则》以及其后颁布及修订的具体会计准则、应用指南、解释以及《资产管理产品相关会计处理规定》和其他相关规定（统称“企业会计准则”）编制，同时，在信息披露和估值方面，也参考了中国证监会颁布的《中国证券监督

管理委员会关于证券投资基金估值业务的指导意见》、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》、《证券投资基金信息披露内容与格式准则》第 3 号《半年度报告的内容与格式》、《证券投资基金信息披露编报规则》第 3 号《会计报表附注的编制及披露》、《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号〈年度报告和中期报告〉》以及中国证监会和中国证券投资基金业协会颁布的其他相关规定。

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金于 2024 年 06 月 30 日的财务状况以及自 2024 年 01 月 01 日起至 2024 年 06 月 30 日止期间的经营成果和净资产变动情况等有关信息。

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

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期未发生会计政策变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

6.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

6.4.6 税项

(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。

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 货币资金

单位：人民币元

项目	本期末 2024 年 6 月 30 日
活期存款	7,055,267.19
等于：本金	7,054,633.41
加：应计利息	633.78
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	7,055,267.19

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2024 年 6 月 30 日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动

股票	101,547,229.53	-	82,113,151.61	-19,434,077.92
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	101,547,229.53	-	82,113,151.61	-19,434,077.92

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

6.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

单位：人民币元

项目	本期末 2024年6月30日			
	合同/名义 金额	公允价值		备注
		资产	负债	
利率衍生工具	-	-	-	-
货币衍生工具	-	-	-	-
权益衍生工具	9,323,755.56	-	-	-
其中： 股指期货投资	9,323,755.56	-	-	-
其他衍生工具	-	-	-	-
合计	9,323,755.56	-	-	-

6.4.7.3.2 期末基金持有的期货合约情况

单位：人民币元

代码	名称	持仓量（买/卖）	合约市值	公允价值变动
IM2407	IM2407	8.00	7,772,800.00	-589,155.56
IM2408	IM2408	1.00	963,720.00	1,920.00
合计				-587,235.56
减：可抵销期货暂收款				-587,235.56
净额				0.00

注：1、买入持仓量以正数表示，卖出持仓量以负数表示；

2、期货投资采用当日无负债结算制度，结算准备金已包括所持期货合约产生的持仓损益，因此衍

生金融工具项下的期货投资与相关的期货暂收款（结算所得的持仓损益）之间按抵销后的净额为 0。

6.4.7.3.3 期末基金持有的黄金衍生品情况

无。

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

无。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

无。

6.4.7.4.3 按预期信用损失一般模型计提减值准备的说明

无。

6.4.7.5 债权投资

6.4.7.5.1 债权投资情况

无。

6.4.7.5.2 债权投资减值准备计提情况

无。

6.4.7.6 其他债权投资

6.4.7.6.1 其他债权投资情况

无。

6.4.7.6.2 其他债权投资减值准备计提情况

无。

6.4.7.7 其他权益工具投资

6.4.7.7.1 其他权益工具投资情况

无。

6.4.7.7.2 报告期末其他权益工具投资情况

无。

6.4.7.8 其他资产

无。

6.4.7.9 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2024 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	-
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	133,144.86
其中：交易所市场	133,144.86
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用	79,563.12
合计	212,707.98

6.4.7.10 实收基金

金额单位：人民币元

大成中证 1000 指数增强发起式 A

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	122,787,366.39	122,787,366.39
本期申购	2,781,314.25	2,781,314.25
本期赎回（以“-”号填列）	-27,310,314.74	-27,310,314.74
基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算调整	-	-
本期申购	-	-
本期赎回（以“-”号填列）	-	-
本期末	98,258,365.90	98,258,365.90

大成中证 1000 指数增强发起式 C

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	24,812,852.64	24,812,852.64
本期申购	27,245,134.04	27,245,134.04
本期赎回（以“-”号填列）	-29,747,969.11	-29,747,969.11
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	22,310,017.57	22,310,017.57

注：申购含红利再投份额（如有）、转换入份额（如有）；赎回含转换出份额（如有）。

6.4.7.11 其他综合收益

无。

6.4.7.12 未分配利润

单位：人民币元

大成中证 1000 指数增强发起式 A

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-1,240,762.49	-3,857,992.22	-5,098,754.71
本期期初	-1,240,762.49	-3,857,992.22	-5,098,754.71
本期利润	-5,341,665.62	-12,172,310.31	-17,513,975.93
本期基金份额交易产生的变动数	987,386.77	1,913,552.57	2,900,939.34
其中：基金申购款	-103,410.72	-247,619.95	-351,030.67
基金赎回款	1,090,797.49	2,161,172.52	3,251,970.01
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-5,595,041.34	-14,116,749.96	-19,711,791.30

大成中证 1000 指数增强发起式 C

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-290,489.67	-779,532.35	-1,070,022.02
本期期初	-290,489.67	-779,532.35	-1,070,022.02
本期利润	-1,083,450.63	-2,319,798.70	-3,403,249.33
本期基金份额交易产生的变动数	30,287.21	-98,692.69	-68,405.48
其中：基金申购款	-1,756,061.10	-1,709,549.58	-3,465,610.68
基金赎回款	1,786,348.31	1,610,856.89	3,397,205.20
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-1,343,653.09	-3,198,023.74	-4,541,676.83

6.4.7.13 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年6月30日
活期存款利息收入	16,541.53
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	-
结算备付金利息收入	41,232.62
其他	351.10
合计	58,125.25

6.4.7.14 股票投资收益

6.4.7.14.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年6月30日
股票投资收益——买卖股票差价收入	-5,080,724.71
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	-5,080,724.71

6.4.7.14.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年6月30日
卖出股票成交总额	229,113,026.45
减：卖出股票成本总额	233,711,267.82
减：交易费用	482,483.34
买卖股票差价收入	-5,080,724.71

6.4.7.14.3 股票投资收益——证券出借差价收入

无。

6.4.7.15 债券投资收益

6.4.7.15.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年6月30日
债券投资收益——利息收入	30.25
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	15,454.04
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	15,484.29

6.4.7.15.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年6月30日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	230,694.40
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	215,200.00
减：应计利息总额	31.13
减：交易费用	9.23
买卖债券差价收入	15,454.04

6.4.7.15.3 债券投资收益——赎回差价收入

无。

6.4.7.15.4 债券投资收益——申购差价收入

无。

6.4.7.16 资产支持证券投资收益

6.4.7.16.1 资产支持证券投资收益项目构成

无。

6.4.7.16.2 资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入

无。

6.4.7.16.3 资产支持证券投资收益——赎回差价收入

无。

6.4.7.16.4 资产支持证券投资收益——申购差价收入

无。

6.4.7.17 贵金属投资收益

6.4.7.17.1 贵金属投资收益项目构成

无。

6.4.7.17.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

无。

6.4.7.17.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

无。

6.4.7.17.4 贵金属投资收益——申购差价收入

无。

6.4.7.18 衍生工具收益

6.4.7.18.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

无。

6.4.7.18.2 衍生工具收益——其他投资收益

单位：人民币元

项目	本期
	2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日
股指期货投资收益	-1,408,576.62

6.4.7.19 股利收益

单位：人民币元

项目	本期
	2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日
股票投资产生的股利收益	758,015.66
其中：证券出借权益补偿收入	-
基金投资产生的股利收益	-
合计	758,015.66

6.4.7.20 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期
	2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日
1. 交易性金融资产	-14,165,153.45
股票投资	-14,165,153.45
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	-326,955.56
权证投资	-
期货投资	-326,955.56
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	-14,492,109.01

6.4.7.21 其他收入

单位：人民币元

项目	本期
	2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日
基金赎回费收入	1,838.44
基金转换费收入	55.73
其他	15,000.00
合计	16,894.17

6.4.7.22 信用减值损失

无。

6.4.7.23 其他费用

单位：人民币元

项目	本期
	2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日
审计费用	19,890.78
信息披露费	59,672.34

证券出借违约金	-
银行划款手续费	2,547.82
合计	82,110.94

6.4.7.24 分部报告

无。

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 或有事项

无。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

无。

6.4.9 关联方关系

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

本基金本报告期存在控制关系或者其他重大利害关系的关联方未发生变化。

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

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

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2024年1月1日至2024年6月30日	
	成交金额	占当期股票 成交总额的比例(%)
光大证券	369,936,454.08	83.72

6.4.10.1.2 债券交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2024年1月1日至2024年6月30日	
	成交金额	占当期债券 成交总额的比例(%)
光大证券	230,694.40	100.00

6.4.10.1.3 债券回购交易

无。

6.4.10.1.4 权证交易

无。

6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2024年1月1日至2024年6月30日			
	当期 佣金	占当期佣金总量 的比例 (%)	期末应付佣金余 额	占期末应付佣金 总额的比例 (%)
光大证券	272,223.12	80.17	127,305.59	95.61

注：1. 上述佣金参考市场价格经本基金的基金管理人与对方协商确定。

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

6.4.10.2 关联方报酬**6.4.10.2.1 基金管理费**

单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	559,372.60
其中：应支付销售机构的客户维护费	214,011.74
应支付基金管理人的净管理费	345,360.86

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 1.00% 年费率计提。

计算方法如下：

$$H = E \times 1.00\% / \text{当年天数}$$

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

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	100,687.12

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 0.18% 年费率计提。

计算方法如下：

$$H=E \times 0.18\% / \text{当年天数}$$

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

6.4.10.2.3 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 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	大成中证 1000 指数 增强发起式 A	大成中证 1000 指数 增强发起式 C	合计
大成基金	-	420.89	420.89
中国银行	-	10,082.79	10,082.79
合计	-	10,503.68	10,503.68

注：基金销售服务费每日计算，按月支付。本基金 A 类基金份额不收取销售服务费；C 类基金份额的销售服务费按前一日 C 类基金份额基金资产净值的 0.40% 的年费率计提。计算方法如下：

$$H=E \times 0.40\% / \text{当年天数}$$

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

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

无。

6.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

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

无。

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

无。

6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

份额单位：份

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日

	大成中证 1000 指数增强发起式 A	大成中证 1000 指数增强发起式 C
基金合同生效日（2023 年 8 月 1 日）持有的基金份额	10,000,000.00	-
报告期初持有的基金份额	10,000,000.00	-
报告期内申购/买入总份额	-	-
报告期内因拆分变动份额	-	-
减：报告期内赎回/卖出总份额	-	-
报告期末持有的基金份额	10,000,000.00	-
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	8.29%	-

注：基金管理人大成基金投资本基金适用的交易费率与本基金法律文件规定一致。

6.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

无。

6.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日	
	期末余额	当期利息收入
中国银行	7,055,267.19	16,541.53

注：本基金由基金托管人保管的银行存款，按银行约定利率计息。

6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

无。

6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

无。

6.4.11 利润分配情况

无。

6.4.12 期末（2024 年 6 月 30 日）本基金持有的流通受限证券

6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

6.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	受限期	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量（单位：股）	期末成本总额	期末估值总额	备注

601033	永兴股份	2024年1月11日	6个月	新股锁定	16.20	15.96	175	2,835.00	2,793.00	-
603082	北自科技	2024年1月23日	6个月	新股锁定	21.28	29.49	56	1,191.68	1,651.44	-
603285	键邦股份	2024年6月28日	6个月	新股未上市	18.65	18.65	51	951.15	951.15	-
603285	键邦股份	2024年6月28日	1个月内(含)	新股未上市	18.65	18.65	453	8,448.45	8,448.45	-
603312	西典新能	2024年1月4日	6个月	新股锁定	29.02	25.36	50	1,451.00	1,268.00	-
603325	博隆技术	2024年1月3日	6个月	新股锁定	72.46	68.06	20	1,449.20	1,361.20	-
603350	安乃达	2024年6月26日	6个月	新股未上市	20.56	20.56	55	1,130.80	1,130.80	-
603350	安乃达	2024年6月26日	1个月内(含)	新股未上市	20.56	20.56	488	10,033.28	10,033.28	-
603381	永臻股份	2024年6月19日	6个月	新股锁定	23.35	25.13	42	980.70	1,055.46	-
688530	欧莱新材	2024年4月29日	6个月	新股锁定	9.60	16.10	261	2,505.60	4,202.10	-
688692	达梦数据	2024年6月4日	6个月	新股锁定	86.96	174.93	35	3,043.60	6,122.55	-

688709	成都华微	2024年1月31日	6个月	新股锁定	15.69	18.79	220	3,451.80	4,133.80	-
--------	------	------------	-----	------	-------	-------	-----	----------	----------	---

注：基金可使用以基金名义开设的股票账户，选择网上或者网下一种方式进行新股申购。其中基金参与网下申购获得的新股中需要限售的部分或作为战略投资者参与配售获得的新股，在新股上市后的约定期限内不能自由转让；基金参与网上申购获配的新股，从新股获配日至新股上市日之间不能自由转让。

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量(股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
300630	普利制药	2024年5月6日	重大事项停牌	12.35	2024年7月8日	9.88	63,600	1,222,537.00	785,460.00	-

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

无。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

无。

6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

无。

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金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，将风险控制可在承受的范围之内。

6.4.13.2 信用风险

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

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

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

本期末，本基金无债券投资(上年度末：同)。

6.4.13.3 流动性风险

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

6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》及《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》等有关法规的要求建立健全开放式基金流动性风险管理的内

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

6.4.13.4 市场风险

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

6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。利率敏感性金融工具均面临由于市场利率上升而导致公允价值下降的风险，其中浮动利率类金融工具还面临每个付息期间结束根据市场利率重新定价时对于未来现金流影响的风险。本基金的基金管理人定期对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控，并通过调整投资组合的久期等方法对上述利率风险进行管理。本基金持有及承担的大部分金融资产和金融负债不计息，因此本基金的收入及经营活动的现金流量在很大程度上独立于市场利率变化。本基金持有的利率敏感性资产主要为银行存款、结算备付金及存出保证金等。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2024 年 6 月 30 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计

资产					
货币资金	7,055,267.19	-	-	-	7,055,267.19
结算备付金	5,053,343.98	-	-	-	5,053,343.98
存出保证金	22,288.73	-	-	1,048,382.40	1,070,671.13
交易性金融资产	-	-	-	82,113,151.61	82,113,151.61
应收申购款	-	-	-	32,056.38	32,056.38
应收清算款	-	-	-	1,324,389.49	1,324,389.49
资产总计	12,130,899.90	-	-	84,517,979.88	96,648,879.78
负债					
应付赎回款	-	-	-	15,673.32	15,673.32
应付管理人报酬	-	-	-	84,274.05	84,274.05
应付托管费	-	-	-	15,169.35	15,169.35
应付销售服务费	-	-	-	6,139.74	6,139.74
其他负债	-	-	-	212,707.98	212,707.98
负债总计	-	-	-	333,964.44	333,964.44
利率敏感度缺口	12,130,899.90	-	-	84,184,015.44	96,314,915.34
上年度末 2023 年 12 月 31 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
货币资金	9,951,181.64	-	-	-	9,951,181.64
结算备付金	13,333,491.79	-	-	-	13,333,491.79
存出保证金	66,438.19	-	-	1,554,432.00	1,620,870.19
交易性金融资产	-	-	-	117,016,286.27	117,016,286.27
应收申购款	-	-	-	21,675.88	21,675.88
应收清算款	-	-	-	498,963.38	498,963.38
资产总计	23,351,111.62	-	-	119,091,357.53	142,442,469.15
负债					
应付赎回款	-	-	-	111,844.83	111,844.83
应付管理人报酬	-	-	-	123,099.36	123,099.36
应付托管费	-	-	-	22,157.90	22,157.90
应付清算款	-	-	-	434,080.47	434,080.47
应付销售服务费	-	-	-	8,221.82	8,221.82
其他负债	-	-	-	311,622.47	311,622.47
负债总计	-	-	-	1,011,026.85	1,011,026.85
利率敏感度缺口	23,351,111.62	-	-	118,080,330.68	141,431,442.30

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

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

于本期末，本基金未持有交易性债券投资和交易性资产支持证券投资（上年度末：同），因此市场利率的变动对于本基金净资产无重大影响（上年度末：同）。

6.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基金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。

6.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险主要为市场价格风险，市场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其他价格风险，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。

本基金的投资组合比例为：股票（含存托凭证）资产投资比例不低于基金资产的 80%，其中投资于标的指数成份股及其备选成份股的比例不低于非现金基金资产的 80%；每个交易日日终在扣除股指期货、国债期货、股票期权合约需交纳的交易保证金后，保持不低于基金资产净值 5% 的现金或到期日在一年以内的政府债券，其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。股指期货、国债期货、股票期权及其他金融工具的投资比例符合法律法规和监管机构的规定。如法律法规或中国证监会变更投资品种的投资比例限制，基金管理人在履行适当程序后，可以调整上述投资品种的投资比例。

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2024年6月30日		上年度末 2023年12月31日	
	公允价值	占基金资产净值 比例（%）	公允价值	占基金资产净值 比例（%）
交易性金融资产—股票投资	82,113,151.61	85.25	117,016,286.27	82.74
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	82,113,151.61	85.25	117,016,286.27	82.74

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除业绩比较基准以外的其他市场变量保持不变

分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2024 年 6 月 30 日）	上年度末（2023 年 12 月 31 日）
	业绩比较基准上升 5%	4,873,074.81	5,997,771.11
	业绩比较基准下降 5%	-4,873,074.81	-5,997,771.11

6.4.14 公允价值

6.4.14.1 金融工具公允价值计量的方法

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

第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

6.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

6.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2024 年 6 月 30 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
第一层次	81,284,540.38	116,989,287.24
第二层次	806,023.68	-
第三层次	22,587.55	26,999.03
合计	82,113,151.61	117,016,286.27

6.4.14.2.2 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。

6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

于本期末，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产(上年度末：同)。

6.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

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。

6.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

§ 7 投资组合报告**7.1 期末基金资产组合情况**

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	82,113,151.61	84.96
	其中：股票	82,113,151.61	84.96
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	12,108,611.17	12.53
8	其他各项资产	2,427,117.00	2.51
9	合计	96,648,879.78	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	865,096.00	0.90
B	采矿业	1,757,840.00	1.83
C	制造业	49,785,659.71	51.69
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	2,413,153.44	2.51
E	建筑业	1,216,409.00	1.26
F	批发和零售业	3,303,855.00	3.43

G	交通运输、仓储和邮政业	2,952,151.00	3.07
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	5,163,671.04	5.36
J	金融业	2,913,813.60	3.03
K	房地产业	2,215,480.00	2.30
L	租赁和商务服务业	31,960.00	0.03
M	科学研究和技术服务业	752,007.32	0.78
N	水利、环境和公共设施管理业	147,094.00	0.15
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	21,198.00	0.02
R	文化、体育和娱乐业	721,520.00	0.75
S	综合	-	-
	合计	74,260,908.11	77.10

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	7,846,120.95	8.15
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	6,122.55	0.01
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	7,852,243.50	8.15

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	688209	英集芯	140,800	1,747,328.00	1.81
2	300233	金城医药	109,600	1,635,232.00	1.70
3	600267	海正药业	229,000	1,607,580.00	1.67
4	688289	圣湘生物	88,020	1,547,391.60	1.61
5	000968	蓝焰控股	230,100	1,463,436.00	1.52
6	688798	艾为电子	24,020	1,360,012.40	1.41
7	688001	华兴源创	56,400	1,273,512.00	1.32
8	601619	嘉泽新能	418,500	1,268,055.00	1.32
9	688800	瑞可达	43,288	1,215,527.04	1.26
10	002537	海联金汇	230,100	1,189,617.00	1.24
11	688526	科前生物	80,709	1,185,615.21	1.23
12	688321	微芯生物	65,652	1,155,475.20	1.20
13	600340	华夏幸福	1,076,000	1,140,560.00	1.18
14	601375	中原证券	332,600	1,134,166.00	1.18
15	300869	康泰医学	84,900	1,109,643.00	1.15
16	688033	天宜上佳	184,700	1,108,200.00	1.15
17	688167	炬光科技	20,000	1,100,000.00	1.14
18	688380	中微半导	63,600	1,063,392.00	1.10
19	688503	聚和材料	37,200	1,045,320.00	1.09
20	688696	极米科技	12,830	990,989.20	1.03
21	600787	中储股份	195,600	940,836.00	0.98
22	600966	博汇纸业	196,400	938,792.00	0.97

23	605507	国邦医药	54,000	899,100.00	0.93
24	688508	芯朋微	22,635	823,234.95	0.85
25	600058	五矿发展	123,600	815,760.00	0.85
26	688776	国光电气	14,000	775,600.00	0.81
27	688680	海优新材	25,200	724,248.00	0.75
28	002243	力合科创	123,600	683,508.00	0.71
29	603699	纽威股份	39,700	679,664.00	0.71
30	600864	哈投股份	142,800	678,300.00	0.70
31	688131	皓元医药	34,864	666,948.32	0.69
32	600169	太原重工	359,500	657,885.00	0.68
33	002053	云南能投	54,300	656,487.00	0.68
34	300953	震裕科技	11,900	644,980.00	0.67
35	002212	天融信	129,600	631,152.00	0.66
36	300323	华灿光电	142,700	620,745.00	0.64
37	688409	富创精密	16,691	616,565.54	0.64
38	603026	石大胜华	18,200	615,160.00	0.64
39	603162	海通发展	65,720	611,196.00	0.63
40	603906	龙蟠科技	78,300	609,957.00	0.63
41	300679	电连技术	15,100	607,473.00	0.63
42	002928	华夏航空	95,400	604,836.00	0.63
43	603103	横店影视	43,600	603,424.00	0.63
44	601068	中铝国际	142,500	599,925.00	0.62
45	600810	神马股份	96,400	597,680.00	0.62
46	601137	博威合金	39,100	595,884.00	0.62
47	002488	金固股份	135,600	595,284.00	0.62
48	000065	北方国际	57,400	595,238.00	0.62
49	603368	柳药集团	34,000	595,000.00	0.62
50	601886	江河集团	121,500	592,920.00	0.62
51	002891	中宠股份	28,400	592,708.00	0.62
52	603983	丸美股份	21,500	591,895.00	0.61
53	688439	振华风光	8,900	591,405.00	0.61
54	605333	沪光股份	21,200	590,420.00	0.61
55	688127	蓝特光学	32,100	590,319.00	0.61
56	002946	新乳业	67,000	586,920.00	0.61
57	300783	三只松鼠	26,800	586,116.00	0.61
58	000550	江铃汽车	26,900	583,999.00	0.61
59	688368	晶丰明源	10,526	583,140.40	0.61
60	002011	盾安环境	59,300	582,919.00	0.61
61	301316	慧博云通	39,600	581,328.00	0.60
62	603113	金能科技	105,000	574,350.00	0.60
63	002991	甘源食品	9,400	570,110.00	0.59
64	003039	顺控发展	45,400	568,862.00	0.59
65	688515	裕太微	9,800	568,400.00	0.59

66	688158	优刻得	55,503	567,795.69	0.59
67	600675	中华企业	227,100	560,937.00	0.58
68	300856	科思股份	17,500	560,175.00	0.58
69	301015	百洋医药	23,600	555,308.00	0.58
70	601718	际华集团	223,600	554,528.00	0.58
71	688147	微导纳米	21,900	545,310.00	0.57
72	688031	星环科技	14,100	517,611.00	0.54
73	688383	新益昌	9,800	510,678.00	0.53
74	603477	巨星农牧	17,600	505,120.00	0.52
75	600783	鲁信创投	54,000	503,820.00	0.52
76	601279	英利汽车	132,900	495,717.00	0.51
77	600797	浙大网新	104,900	485,687.00	0.50
78	688123	聚辰股份	7,900	480,557.00	0.50
79	688389	普门科技	29,200	474,792.00	0.49
80	002135	东南网架	106,500	421,740.00	0.44
81	300065	海兰信	63,600	420,396.00	0.44
82	603666	亿嘉和	25,400	400,812.00	0.42
83	688531	日联科技	8,500	392,360.00	0.41
84	688161	威高骨科	19,594	388,353.08	0.40
85	002534	西子洁能	38,500	385,385.00	0.40
86	600773	西藏城投	36,300	374,616.00	0.39
87	601702	华峰铝业	20,100	367,026.00	0.38
88	300761	立华股份	15,900	359,976.00	0.37
89	688339	亿华通	11,278	338,114.44	0.35
90	603871	嘉友国际	19,100	337,879.00	0.35
91	688128	中国电研	17,800	306,338.00	0.32
92	605222	起帆电缆	15,500	237,770.00	0.25
93	002913	奥士康	8,800	235,928.00	0.24
94	300428	立中集团	10,000	185,900.00	0.19
95	002911	佛燃能源	17,946	164,026.44	0.17
96	688388	嘉元科技	12,200	118,950.00	0.12
97	603567	珍宝岛	10,400	109,512.00	0.11
98	688235	百济神州	900	104,256.00	0.11
99	002782	可立克	9,200	101,936.00	0.11
100	688578	艾力斯	1,500	95,610.00	0.10
101	600575	淮河能源	23,400	91,026.00	0.09
102	002318	久立特材	3,800	88,654.00	0.09
103	600323	瀚蓝环境	4,100	85,690.00	0.09
104	000902	新洋丰	6,300	74,781.00	0.08
105	002807	江阴银行	19,800	74,646.00	0.08
106	002003	伟星股份	5,900	74,045.00	0.08
107	600997	开滦股份	10,700	73,402.00	0.08
108	603323	苏农银行	15,100	72,631.00	0.08

109	600007	中国国贸	3,200	70,272.00	0.07
110	603328	依顿电子	8,900	69,954.00	0.07
111	000029	深深房 A	6,500	69,095.00	0.07
112	002267	陕天然气	9,000	68,040.00	0.07
113	603132	金徽股份	4,900	67,424.00	0.07
114	002048	宁波华翔	5,200	67,288.00	0.07
115	002948	青岛银行	19,900	67,063.00	0.07
116	600163	中闽能源	13,800	66,516.00	0.07
117	600395	盘江股份	11,000	66,110.00	0.07
118	601963	重庆银行	8,500	65,875.00	0.07
119	600908	无锡银行	12,300	65,436.00	0.07
120	000030	富奥股份	13,200	64,812.00	0.07
121	600717	天津港	15,100	64,477.00	0.07
122	002249	大洋电机	13,600	64,328.00	0.07
123	000915	华特达因	2,100	63,336.00	0.07
124	002550	千红制药	11,700	63,063.00	0.07
125	601811	新华文轩	4,500	63,045.00	0.07
126	600710	苏美达	7,700	62,755.00	0.07
127	603008	喜临门	3,600	62,388.00	0.06
128	002839	张家港行	15,400	61,908.00	0.06
129	603299	苏盐井神	6,500	61,750.00	0.06
130	600688	上海石化	23,400	61,074.00	0.06
131	600623	华谊集团	10,400	60,112.00	0.06
132	600618	氯碱化工	6,800	59,704.00	0.06
133	000848	承德露露	7,500	58,950.00	0.06
134	002701	奥瑞金	14,100	58,656.00	0.06
135	603301	振德医疗	2,800	58,408.00	0.06
136	002171	楚江新材	8,800	57,992.00	0.06
137	002034	旺能环境	4,400	57,244.00	0.06
138	002461	珠江啤酒	7,700	57,134.00	0.06
139	002697	红旗连锁	12,300	56,949.00	0.06
140	300702	天宇股份	3,100	55,273.00	0.06
141	300134	大富科技	8,100	55,242.00	0.06
141	603997	继峰股份	5,400	55,242.00	0.06
143	002204	大连重工	12,800	54,656.00	0.06
144	603609	禾丰股份	8,300	54,282.00	0.06
145	601528	瑞丰银行	11,500	54,280.00	0.06
146	002275	桂林三金	4,300	53,363.00	0.06
147	605365	立达信	3,300	52,371.00	0.05
148	001338	永顺泰	5,300	51,940.00	0.05
149	002287	奇正藏药	2,600	50,908.00	0.05
150	300379	东方通	6,200	50,096.00	0.05
151	002291	遥望科技	11,400	49,020.00	0.05

152	000600	建投能源	7,700	48,510.00	0.05
153	603025	大豪科技	3,500	48,370.00	0.05
154	688023	安恒信息	1,200	48,012.00	0.05
155	002453	华软科技	11,100	47,619.00	0.05
156	601918	新集能源	4,800	46,800.00	0.05
157	600643	爱建集团	12,200	45,994.00	0.05
158	000597	东北制药	11,800	45,666.00	0.05
159	601969	海南矿业	7,200	45,648.00	0.05
160	601001	晋控煤业	2,600	42,952.00	0.04
161	002270	华明装备	1,900	42,256.00	0.04
162	601015	陕西黑猫	14,400	40,320.00	0.04
163	000690	宝新能源	7,900	40,290.00	0.04
164	000403	派林生物	1,500	39,990.00	0.04
165	601333	广深铁路	12,300	39,852.00	0.04
166	300294	博雅生物	1,200	39,600.00	0.04
167	600285	羚锐制药	1,600	38,736.00	0.04
168	603393	新天然气	1,100	38,214.00	0.04
169	002332	仙琚制药	3,100	35,371.00	0.04
170	601222	林洋能源	5,600	35,112.00	0.04
171	600461	洪城环境	3,000	34,740.00	0.04
172	600993	马应龙	1,300	34,671.00	0.04
173	600750	江中药业	1,500	34,665.00	0.04
174	600691	阳煤化工	20,200	34,542.00	0.04
175	000581	威孚高科	2,100	34,188.00	0.04
176	000761	本钢板材	13,600	34,136.00	0.04
177	600269	赣粤高速	6,600	34,122.00	0.04
178	601187	厦门银行	6,200	33,046.00	0.03
179	600728	佳都科技	8,900	33,019.00	0.03
180	300298	三诺生物	1,300	32,942.00	0.03
180	600452	涪陵电力	2,600	32,942.00	0.03
182	601860	紫金银行	13,100	32,750.00	0.03
183	002773	康弘药业	1,500	32,475.00	0.03
184	603171	税友股份	1,200	32,448.00	0.03
185	600420	国药现代	3,000	32,040.00	0.03
186	600057	厦门象屿	4,700	31,960.00	0.03
187	002100	天康生物	4,600	31,878.00	0.03
188	002597	金禾实业	1,600	31,824.00	0.03
189	600572	康恩贝	7,100	31,737.00	0.03
190	603358	华达科技	1,100	31,735.00	0.03
191	000035	中国天楹	7,000	31,710.00	0.03
192	603565	中谷物流	3,600	31,464.00	0.03
193	600428	中远海特	5,100	31,212.00	0.03
194	600645	中源协和	1,900	30,590.00	0.03

195	300470	中密控股	900	30,429.00	0.03
196	688575	亚辉龙	1,300	30,316.00	0.03
197	300170	汉得信息	4,900	30,086.00	0.03
198	601311	骆驼股份	3,700	29,674.00	0.03
199	600252	中恒集团	13,600	29,512.00	0.03
200	600012	皖通高速	2,100	29,337.00	0.03
201	002214	大立科技	2,600	29,328.00	0.03
202	600037	歌华有线	4,900	29,302.00	0.03
203	600125	铁龙物流	4,900	29,253.00	0.03
204	000028	国药一致	900	29,007.00	0.03
205	600586	金晶科技	5,000	29,000.00	0.03
206	002354	天娱数科	9,600	28,704.00	0.03
207	600480	凌云股份	2,900	28,507.00	0.03
208	600158	中体产业	3,700	28,453.00	0.03
209	003006	百亚股份	1,200	28,440.00	0.03
210	600017	日照港	10,600	28,302.00	0.03
211	002583	海能达	6,900	28,083.00	0.03
212	002737	葵花药业	1,200	28,056.00	0.03
213	000488	晨鸣纸业	8,100	28,026.00	0.03
214	601326	秦港股份	8,800	27,896.00	0.03
215	002154	报喜鸟	5,100	27,744.00	0.03
216	002467	二六三	8,200	27,388.00	0.03
217	002567	唐人神	5,100	27,336.00	0.03
218	002097	山河智能	4,500	27,135.00	0.03
219	000088	盐田港	5,900	26,727.00	0.03
220	300663	科蓝软件	2,700	26,649.00	0.03
221	600757	长江传媒	3,300	26,598.00	0.03
222	600458	时代新材	2,600	26,260.00	0.03
223	603730	岱美股份	2,600	25,844.00	0.03
224	600874	创业环保	4,600	25,714.00	0.03
225	300369	绿盟科技	5,000	25,550.00	0.03
226	600508	上海能源	1,800	25,470.00	0.03
226	688598	金博股份	900	25,470.00	0.03
228	600110	诺德股份	8,300	25,315.00	0.03
229	300363	博腾股份	2,100	25,095.00	0.03
230	300085	银之杰	3,100	25,048.00	0.03
231	603348	文灿股份	900	24,921.00	0.03
232	603733	仙鹤股份	1,400	24,612.00	0.03
233	003040	楚天龙	2,000	24,600.00	0.03
234	603229	奥翔药业	2,400	24,120.00	0.03
235	601908	京运通	9,500	24,035.00	0.02
236	002250	联化科技	5,000	24,000.00	0.02
237	603989	艾华集团	1,700	23,902.00	0.02

238	000567	海德股份	4,260	23,898.60	0.02
239	002320	海峡股份	4,600	23,736.00	0.02
240	002163	海南发展	4,300	23,564.00	0.02
241	002646	天佑德酒	2,300	23,529.00	0.02
242	002612	朗姿股份	1,700	23,494.00	0.02
243	000869	张裕 A	1,100	23,485.00	0.02
244	688707	振华新材	2,400	23,376.00	0.02
245	603566	普莱柯	1,700	23,086.00	0.02
246	002088	鲁阳节能	1,900	22,971.00	0.02
247	688326	经纬恒润	400	22,932.00	0.02
248	301327	华宝新能	400	22,920.00	0.02
249	002068	黑猫股份	3,200	22,720.00	0.02
250	603985	恒润股份	1,900	22,610.00	0.02
251	688091	上海谊众	1,000	22,590.00	0.02
252	603281	江瀚新材	1,000	22,450.00	0.02
253	688336	三生国健	1,100	22,385.00	0.02
254	688105	诺唯赞	1,100	22,011.00	0.02
255	603877	太平鸟	1,600	21,968.00	0.02
256	600610	中毅达	5,500	21,890.00	0.02
257	000813	德展健康	10,500	21,840.00	0.02
258	300887	谱尼测试	2,900	21,460.00	0.02
259	603170	宝立食品	1,800	21,384.00	0.02
260	301239	普瑞眼科	600	21,198.00	0.02
261	688177	百奥泰	1,000	21,120.00	0.02
262	002549	凯美特气	4,100	20,951.00	0.02
263	688202	美迪西	800	20,840.00	0.02
264	301089	拓新药业	700	20,769.00	0.02
265	688315	诺禾致源	1,900	20,748.00	0.02
266	688185	康希诺	500	20,545.00	0.02
267	603057	紫燕食品	1,300	19,916.00	0.02
268	603489	八方股份	700	18,886.00	0.02
269	603915	国茂股份	1,800	18,522.00	0.02
270	603123	翠微股份	1,300	7,722.00	0.01
271	600559	老白干酒	400	7,272.00	0.01
272	601200	上海环境	700	5,950.00	0.01
273	600963	岳阳林纸	1,500	5,505.00	0.01
274	301180	万祥科技	200	3,128.00	0.00
275	601033	永兴股份	175	2,793.00	0.00

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	688275	万润新能	51,555	1,516,748.10	1.57

2	002440	闰土股份	223,600	1,214,148.00	1.26
3	688356	键凯科技	17,945	1,054,807.10	1.10
4	688733	壹石通	61,574	920,531.30	0.96
5	688330	宏力达	39,197	799,226.83	0.83
6	300630	普利制药	63,600	785,460.00	0.82
7	688660	电气风电	205,149	590,829.12	0.61
8	688148	芳源股份	123,600	520,356.00	0.54
9	688277	天智航	52,943	409,778.82	0.43
10	603350	安乃达	543	11,164.08	0.01
11	603285	键邦股份	504	9,399.60	0.01
12	688692	达梦数据	35	6,122.55	0.01
13	688530	欧莱新材	261	4,202.10	0.00
14	688709	成都华微	220	4,133.80	0.00
15	603082	北自科技	56	1,651.44	0.00
16	603325	博隆技术	20	1,361.20	0.00
17	603312	西典新能	50	1,268.00	0.00
18	603381	永臻股份	42	1,055.46	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	603666	亿嘉和	3,502,338.00	2.48
2	688033	天宜上佳	3,082,900.94	2.18
3	600966	博汇纸业	2,859,669.23	2.02
4	688680	海优新材	2,750,220.80	1.94
5	688776	国光电气	2,520,317.69	1.78
6	300630	普利制药	2,437,579.00	1.72
7	000881	中广核技	1,978,371.00	1.40
8	000829	天音控股	1,966,575.00	1.39
9	603063	禾望电气	1,858,827.00	1.31
10	688800	瑞可达	1,847,201.37	1.31
11	000550	江铃汽车	1,814,888.00	1.28
12	300860	锋尚文化	1,786,863.20	1.26
13	600266	城建发展	1,710,805.00	1.21
14	603132	金徽股份	1,704,861.00	1.21
15	688167	炬光科技	1,701,544.68	1.20
16	000065	北方国际	1,693,301.00	1.20
17	301376	致欧科技	1,692,576.61	1.20
18	688209	英集芯	1,657,586.97	1.17
19	300856	科思股份	1,648,690.00	1.17
20	603162	海通发展	1,587,010.12	1.12

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

7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	603666	亿嘉和	3,716,353.48	2.63
2	688680	海优新材	3,492,576.38	2.47
3	000881	中广核技	2,899,789.00	2.05
4	300860	锋尚文化	2,723,812.32	1.93
5	002378	章源钨业	2,710,342.00	1.92
6	600098	广州发展	2,696,462.00	1.91
7	000528	柳工	2,588,440.00	1.83
8	603132	金徽股份	2,547,783.00	1.80
9	002171	楚江新材	2,427,687.00	1.72
10	000950	重药控股	2,322,642.00	1.64
11	002847	盐津铺子	2,302,075.00	1.63
12	601801	皖新传媒	2,296,598.00	1.62
13	300856	科思股份	2,232,312.00	1.58
14	688408	中信博	2,180,625.02	1.54
15	000829	天音控股	2,170,869.00	1.53
16	600675	中华企业	2,164,086.00	1.53
17	688776	国光电气	2,060,365.56	1.46
18	603323	苏农银行	2,045,581.00	1.45
19	601019	山东出版	2,018,028.00	1.43
20	003012	东鹏控股	1,942,884.00	1.37

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

7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	212,973,286.61
卖出股票收入（成交）总额	229,113,026.45

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

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

无。

7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

无。

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

无。

7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

无。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

无。

7.10 本基金投资股指期货的投资政策

本基金投资股指期货将以投资组合避险和有效管理为目的，通过套期保值策略，对冲系统性风险，应对组合构建与调整中的流动性风险，力求风险收益的优化。

套期保值实质上是利用股指期货多空双向和杠杆放大的交易功能，改变投资组合的 beta，以达到适度增强收益或控制风险的目的。为此，套期保值策略分为多头套期保值和空头套期保值。

多头保值策略是指基于股市将要上涨的预期或建仓要求，需要在未来买入现货股票，为了控制股票买入成本而预先买入股指期货合约的操作；空头套期保值是指卖出期货合约来对冲股市系统性风险，控制与回避持有股票的风险的操作。

基金管理人依据对股市未来趋势的研判、本基金的风险收益目标以及投资组合的构成，决定是否对现有股票组合进行套期保值以及采用何种套期保值策略。

在构建套期保值组合过程中，基金管理人通过对股票组合的结构分析，分离组合的系统性风险（beta）及非系统性风险。基金管理人将关注股票组合 beta 值的易变性以及股指期货与指数之间基差波动对套期保值策略的干扰，通过大量数据分析与量化建模，确立最优套保比率。

在套期保值过程中，基金管理人将不断精细和不断修正套保策略，动态管理套期保值组合。主要工作包括，基于合理的保证金管理策略严格进行保证金管理；对投资组合 beta 系数的实时监控，全程评估套期保值的效果和基差风险，当组合 beta 值超过事先设定的 beta 容忍度时，需要对套期保值组合进行及时调整；进行股指期货合约的提前平仓或展期决策管理。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.11.1 本期国债期货投资政策

无。

7.11.2 本期国债期货投资评价

无。

7.12 投资组合报告附注

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

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

7.12.2 基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库

本基金投资的前十名股票未超出基金合同规定的备选股票库。

7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	1,070,671.13
2	应收清算款	1,324,389.49
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	32,056.38
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	2,427,117.00

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

无。

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

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 (%)
大成中证 1000 指数 增强发起 式 A	586	167,676.39	14,921,069.95	15.19	83,337,295.95	84.81

大成中证 1000 指数增强发起式 C	323	69,071.26	-	-	22,310,017.57	100.00
合计	909	132,638.49	14,921,069.95	12.38	105,647,313.52	87.62

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。

8.2 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	大成中证 1000 指数增强发起式 A	117,694.88	0.1198
	大成中证 1000 指数增强发起式 C	10,005.40	0.0448
	合计	127,700.28	0.1059

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）。

8.3 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、基金投资和相关部门负责人持有本开放式基金	大成中证 1000 指数增强发起式 A	0~10
	大成中证 1000 指数增强发起式 C	0
	合计	0~10
本基金基金经理持有本开放式基金	大成中证 1000 指数增强发起式 A	10~50
	大成中证 1000 指数增强发起式 C	0
	合计	10~50

8.4 发起式基金发起资金持有份额情况

项目	持有份额总数	持有份额占基金总份额比例（%）	发起份额总数	发起份额占基金总份额比例（%）	发起份额承诺持有期限
基金管理人固有资产	10,000,000.00	8.29	10,000,000.00	8.29	3 年

金					
基金管理人高级管理人员	10,000.00	0.01	-	-	-
基金经理等人员	117,700.28	0.10	-	-	-
基金管理人股东	-	-	-	-	-
其他	-	-	-	-	-
合计	10,127,700.28	8.40	10,000,000.00	8.29	3 年

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	大成中证 1000 指数增强发起式 A	大成中证 1000 指数增强发起式 C
基金合同生效日 (2023 年 8 月 1 日) 基金份额总额	139,582,526.63	34,859,923.41
本报告期期初基金份额总额	122,787,366.39	24,812,852.64
本报告期基金总申购份额	2,781,314.25	27,245,134.04
减：本报告期基金总赎回份额	27,310,314.74	29,747,969.11
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	98,258,365.90	22,310,017.57

§ 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

本报告期内，经中国银行股份有限公司研究决定，郭德秋先生不再担任中国银行股份有限公司托管业务部总经理职务。上述人事变动已按相关规定备案、公告。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内无涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

10.4 基金投资策略的改变

本基金投资策略在本报告期内没有重大改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金聘任的为本基金审计的会计师事务所为安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）。该事务所自基金合同生效日起为本基金提供审计服务至今。

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

10.6.1 管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，基金管理人及其相关高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

10.6.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，本基金托管人的托管业务部门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 (%)	
光大证券	2	369,936,454.08	83.72	272,223.12	80.17	-
中信建投证券	1	44,381,625.83	10.04	41,540.87	12.23	-
国投证券	2	20,636,466.10	4.67	19,312.36	5.69	-
中信证券	3	6,239,876.14	1.41	5,839.27	1.72	-
东方证券	1	703,345.00	0.16	657.83	0.19	-
财信证券	1	-	-	-	-	-
长城证券	1	-	-	-	-	-
长江证券	2	-	-	-	-	-
德邦证券	1	-	-	-	-	本期报告新增1个
东海证券	1	-	-	-	-	-
东吴证券	2	-	-	-	-	-

东兴证券	1	-	-	-	-	-
东莞证券	1	-	-	-	-	-
方正证券	1	-	-	-	-	-
广发证券	1	-	-	-	-	-
国都证券	1	-	-	-	-	-
国海证券	1	-	-	-	-	-
国泰君安	1	-	-	-	-	-
国信证券	1	-	-	-	-	-
海通证券	3	-	-	-	-	本期 报告 新增 1 个
恒泰证券	1	-	-	-	-	-
华宝证券	1	-	-	-	-	-
华福证券	1	-	-	-	-	-
华林证券	1	-	-	-	-	-
华泰证券	1	-	-	-	-	-
华西证券	1	-	-	-	-	-
华源证券	1	-	-	-	-	本期 报告 新增 1 个
华鑫证券	1	-	-	-	-	-
江海证券	1	-	-	-	-	-
开源证券	1	-	-	-	-	-
民生证券	1	-	-	-	-	-
摩根大通	1	-	-	-	-	-
平安证券	1	-	-	-	-	-
申万宏源	1	-	-	-	-	-
太平洋证 券	1	-	-	-	-	-
万联证券	1	-	-	-	-	-
西部证券	1	-	-	-	-	-
西南证券	1	-	-	-	-	-
湘财证券	1	-	-	-	-	-
招商证券	3	-	-	-	-	-
中国银河 证券	1	-	-	-	-	-
中金财富	2	-	-	-	-	-
中金公司	2	-	-	-	-	-
中信证券 华南	0	-	-	-	-	本期 报告 退租 1 个

中邮证券	2	-	-	-	-	-
------	---	---	---	---	---	---

注：本基金采用托管人结算模式，本基金管理人负责选择证券经纪商，租用其交易单元作为本基金的交易单元。证券经纪商的选择标准如下：

- （一）财务状况良好，最近一年无重大违规行为；
- （二）经营行为规范，内控制度健全，能满足各投资组合运作的保密性要求；
- （三）研究实力较强，能提供包括研究报告、路演服务、协助进行上市公司调研等研究服务；
- （四）具备各投资组合运作所需的高效、安全的通讯条件，有足够的交易和清算能力，满足各投资组合证券交易需要；
- （五）相关基金合同、资产管理合同以及法律法规规定的其他条件。

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

10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

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	230,694.40	100.00	-	-	-	-

10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	大成中证 1000 指数增强型发起式证券投资基金(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	2024 年 6 月 28 日
2	大成中证 1000 指数增强型发起式证券投资基金(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	2024 年 6 月 28 日
3	大成基金管理有限公司关于提请投资者及时更新已过期身份证件及其他身份基本信息公告	中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站	2024 年 6 月 28 日
4	大成基金管理有限公司关于旗下部分基金增加上海万得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	2024 年 6 月 13 日
5	大成基金管理有限公司关于暂停海	中国证监会基金电子披	2024 年 6 月 12 日

	银基金销售有限公司办理相关销售业务的公告	露网站、规定报刊及本公司网站	
6	大成中证 1000 指数增强型发起式证券投资基金 2024 年第 1 季度报告	中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站	2024 年 4 月 19 日
7	大成基金管理有限公司提醒投资者谨防金融诈骗的公告	中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站	2024 年 4 月 2 日
8	大成中证 1000 指数增强型发起式证券投资基金 2023 年年度报告	中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站	2024 年 3 月 29 日
9	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	2024 年 3 月 18 日
10	大成基金管理有限公司提醒投资者谨防金融诈骗的公告	中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站	2024 年 1 月 23 日
11	大成中证 1000 指数增强型发起式证券投资基金 2023 年第 4 季度报告	中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站	2024 年 1 月 19 日

§ 11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

无。

11.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§ 12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

- 1、中国证监会批准设立大成中证 1000 指数增强型发起式证券投资基金的文件；
- 2、《大成中证 1000 指数增强型发起式证券投资基金基金合同》；
- 3、《大成中证 1000 指数增强型发起式证券投资基金托管协议》；
- 4、大成基金管理有限公司批准文件、营业执照、公司章程；
- 5、本报告期内在规定报刊上披露的各种公告原稿。

12.2 存放地点

备查文件存放在本基金管理人和托管人的住所。

12.3 查阅方式

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

大成基金管理有限公司

2024 年 8 月 30 日