

# 中证 500 沪市交易型开放式指数证券投资 基金 2021 年中期报告

2021 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：2021 年 8 月 31 日

## § 1 重要提示及目录

### 1.1 重要提示

基金管理人的董事会、董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带的法律责任。本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 2021 年 8 月 30 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 2021 年 01 月 01 日起至 06 月 30 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 主要财务指标和基金净值表现</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	7
<b>§ 4 管理人报告</b>	<b>8</b>
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	10
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	11
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	11
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	12
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明	12
<b>§ 5 托管人报告</b>	<b>12</b>
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内容的真实、准确和完整发表意见	13
<b>§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）</b>	<b>13</b>
6.1 资产负债表	13
6.2 利润表	14
6.3 所有者权益（基金净值）变动表	15
6.4 报表附注	17
<b>§ 7 投资组合报告</b>	<b>33</b>
7.1 期末基金资产组合情况	33
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	33
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	35
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	41
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	42
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	42

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 .....	43
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 .....	43
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 .....	43
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明 .....	43
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 .....	43
7.12 投资组合报告附注 .....	43
<b>§ 8 基金份额持有人信息 .....</b>	<b>44</b>
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....	44
8.2 期末上市基金前十名持有人 .....	44
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....	45
8.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况 .....	45
<b>§ 9 开放式基金份额变动 .....</b>	<b>45</b>
<b>§ 10 重大事件揭示 .....</b>	<b>45</b>
10.1 基金份额持有人大会决议 .....	45
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 .....	45
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....	45
10.4 基金投资策略的改变 .....	45
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....	46
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 .....	46
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	46
10.8 其他重大事件 .....	48
<b>§ 11 影响投资者决策的其他重要信息 .....</b>	<b>49</b>
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 .....	49
11.2 影响投资者决策的其他重要信息 .....	49
<b>§ 12 备查文件目录 .....</b>	<b>49</b>
12.1 备查文件目录 .....	49
12.2 存放地点 .....	49
12.3 查阅方式 .....	49

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	中证 500 沪市交易型开放式指数证券投资基金
基金简称	中证 500 沪市 ETF
场内简称	500 沪市 ETF
基金主代码	510440
交易代码	510440
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2012 年 8 月 24 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	20,058,261.00 份
基金合同存续期	不定期
基金份额上市的证券交易所	上海证券交易所
上市日期	2012 年 10 月 8 日

### 2.2 基金产品说明

投资目标	紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化。
投资策略	本基金为被动式指数基金，采取完全复制法，即按照标的指数的成份股组成及其权重构建股票投资组合，并根据标的指数成份股及其权重的变动进行相应调整。当预期成份股发生调整和成份股发生配股、增发、分红等行为时，或因基金的申购和赎回等对本基金跟踪标的指数的效果可能带来影响时，或因某些特殊情况导致流动性不足时，或其他原因导致无法有效复制和跟踪标的指数时，基金管理人可以对投资组合管理进行适当变通和调整，从而使得投资组合紧密地跟踪标的指数。
业绩比较基准	本基金的业绩比较基准为标的指数。本基金标的指数为中证 500 沪市指数（代码：000802）
风险收益特征	本基金为股票基金，属于较高风险、较高预期收益的基金品种，其风险与预期收益高于混合基金、债券基金与货币市场基金。本基金为指数型基金，采用完全复制法跟踪标的指数的表现，具有与标的指数、以及标的指数所代表的股票市场相似的风险收益特征。

### 2.3 基金管理人和基金托管人

项目	基金管理人	基金托管人
名称	大成基金管理有限公司	中国银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	赵冰
	联系电话	0755-83183388
	电子邮箱	office@dcfund.com.cn
客户服务电话	4008885558	95566
传真	0755-83199588	010-66594942

注册地址	深圳市福田区深南大道 7088 号招商银行大厦 32 层	北京市西城区复兴门内大街 1 号
办公地址	深圳市福田区深南大道 7088 号招商银行大厦 32 层	北京市西城区复兴门内大街 1 号
邮政编码	518040	100818
法定代表人	吴庆斌	刘连舸

## 2.4 信息披露方式

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

## 2.5 其他相关资料

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

## § 3 主要财务指标和基金净值表现

### 3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2021年1月1日-2021年6月30日)
本期已实现收益	2,924,133.67
本期利润	3,897,432.07
加权平均基金份额本期利润	0.1898
本期加权平均净值利润率	9.51%
本期基金份额净值增长率	9.58%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2021年6月30日)
期末可供分配利润	11,232,861.52
期末可供分配基金份额利润	0.5600
期末基金资产净值	42,895,657.51
期末基金份额净值	2.139
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2021年6月30日)
基金份额累计净值增长率	113.90%

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

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

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

### 3.2 基金净值表现

#### 3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	2.59%	0.64%	1.53%	0.63%	1.06%	0.01%
过去三个月	11.00%	0.63%	9.07%	0.64%	1.93%	-0.01%
过去六个月	9.58%	0.96%	7.59%	0.98%	1.99%	-0.02%
过去一年	22.93%	1.15%	19.41%	1.17%	3.52%	-0.02%
过去三年	37.73%	1.37%	31.57%	1.39%	6.16%	-0.02%
自基金合同生效起至今	113.90%	1.62%	100.88%	1.65%	13.02%	-0.03%

#### 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

中证500沪市ETF累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：本基金合同规定，基金管理人应当自基金合同生效之日起六个月内使基金的投资组合比例符

合基金合同的约定。建仓期结束时，本基金的投资组合比例符合基金合同的约定。

## § 4 管理人报告

### 4.1 基金管理人及基金经理情况

#### 4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

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

经过二十二年的稳健发展，公司形成了强大稳固的综合实力。公司旗下基金产品齐全、风格多样，构建了涵盖股票型基金、混合型基金、指数型基金、债券型基金和货币市场基金的完备产品线。截至 2021 年 6 月 30 日，本基金管理人共管理 9 只 ETF 及 3 只 ETF 联接基金，8 只 QDII 基金及 107 只开放式证券投资基金。

#### 4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
苏秉毅	本基金基金经理，数量与指数投资部副总监（主持工作）	2012 年 8 月 24 日	-	17 年	经济学硕士。2004 年 9 月至 2008 年 5 月就职于华夏基金管理有限公司基金运作部。2008 年加入大成基金管理有限公司，曾担任规划发展部高级产品设计师、数量与指数投资部总监助理，现任数量与指数投资部副总监。2012 年 8 月 28 日至 2014 年 1 月 23 日任大成中证 500 沪市交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理。2014 年 1 月 24 日至 2014 年 2 月 17 日任大成健康产业股票型证券投资基金基金经理。2012 年 2 月 9 日至 2014 年 9 月 11 日任深证成长 40 交易型开放式指数证券投资基金及大成深证成长 40 交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理。2012 年 8 月 24 日起任中证 500 沪市交易型开放式指数证券投资基金基金经理。2013 年 1 月 1 日至 2015 年 8 月 25 日任大成沪深 300 指数证券投资基金基金经理。



					<p>理。2013 年 2 月 7 日起任大成中证 100 交易型开放式指数证券投资基金基金经理。2015 年 6 月 5 日起任大成深证成份交易型开放式指数证券投资基金基金经理。2015 年 6 月 29 日至 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 日起任大成核心双动力混合型证券投资基金、大成沪深 300 指数证券投资基金基金经理。2018 年 6 月 26 日起任大成景恒混合型证券投资基金基金经理。2021 年 4 月 23 日起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。具有基金从业资格。国籍：中国</p>
刘淼	本基金基金经理助理	2017 年 9 月 14 日	-	13 年	<p>工商管理硕士。2008 年 4 月至 2011 年 5 月就职于招商基金管理有限公司，任基金核算部基金会计。2011 年 5 月加入大成基金管理有限公司，曾担任基金运营部基金会计、股票投资部投委会秘书兼风控员、数量与指数投资部数量分析师、深证成长 40 交易型开放式指数证券投资基金、大成深证成长 40 交易型开放式指数联接基金、大成中证 500 深市交易型开放式指数证券投资基金、大成 MSCI 中国 A 股质优价值 100 交易型开放式指数证券投资基金、大成 MSCI 中国 A 股质优价值 100 交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理助理。2017 年 9 月 14 日起任大成中证 100 交易型开放式指数证券投资基金、中证 500 沪市交易型开放式指数证券投资基金、大成深证成份交易型开放式指数证券投资基金基金经理助理。2020 年 6 月 29 日起任深证成长 40 交易型开放式指数证券投资基金、大成深证成长 40 交易型开放式指数联接基金、大成中证 500 深市交易型开放式指数证券投资基金、大成 MSCI 中国 A 股质优价值 100 交易型开放式指数证券投资基金、大成 MSCI 中国 A 股质优价值 100 交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理。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 日任大成中证红利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>

注：1、任职日期、离任日期为本基金管理人作出决定之日。

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

#### 4.1.3 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理同时管理的产品情况

无

#### 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

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

#### 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

##### 4.3.1 公平交易制度的执行情况

报告期内，基金管理人严格执行了公平交易的原则和制度。基金管理人运用统计分析方法和工具，对旗下所有投资组合间连续 4 个季度的日内、3 日内及 5 日内股票及债券交易同向交易价差进行分析。分析结果表明：债券交易同向交易频率较低；部分股票同向交易溢价率较大主要来源于市场因素（如个股当日价格振幅较高）及组合经理交易时机选择，即投资组合成交时间不一致以及成交价格的日内较大变动导致个别些组合间的成交价格差异较大，但结合交易价差专项统计分析，未发现违反公平交易原则的异常情况。

##### 4.3.2 异常交易行为的专项说明

报告期内，基金管理人旗下所有投资组合未发现存在异常交易行为。主动投资组合间股票交易不存在同日反向交易。主动型投资组合与指数型投资组合之间或指数型投资组合之间存在股票同日反向交易，但不存在参与交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量超过该股当日成交量 5% 的情形；主动投资组合间债券交易存在 2 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

上半年，全球宏观经济继续在复苏的轨道上运行，带动大宗商品价格上涨。尽管受疫情影响，商品供需错配的格局短期内难以得到缓解，但通胀还未成为全球投资者关心的焦点。美国十年国债收益率在一季度显著上行后，二季度则震荡下行。全球流动性也较为宽裕，外资持续流入境内市场。而我国控制疫情较为出色，在本轮周期中也先于其它主要经济体复苏。相较于海外的“大放水”，国内的流动性释放较为克制，也在逐步有序退出非常规的宽松政策。

股票市场上半年则经历了较大的转折。从年初到春节前，市场延续了去年的风格，对消费、新能源等“赛道股”的追捧趋于狂热，少数股票快速上涨带领指数冲高。然而春节后，风格剧烈切换。部分白马股快速下跌，而之前受其“虹吸”影响丧失流动性的大量股票反而迎来转机，形成鲜明对比，价值风格重得青睐。进入二季度，市场止跌回稳，指数保持窄幅震荡。而白马股也出现分化，新能源股票高歌猛进，而传统行业龙头则相对表现不佳，成长风格又再占优。上半年市场基准沪深 300 指数上涨 0.24%。

本基金标的指数中证 500 沪市指数上涨 7.59%，涨幅高于大盘。上半年，本基金申购赎回和份额交易情况均较为平稳。本基金基本保持满仓运作，严格根据标的指数成分股调整以及权重的变化及时调整投资组合。各项操作与指标均符合基金合同的要求。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末本基金份额净值为 2.139 元；本报告期基金份额净值增长率为 9.58%，业绩比较基准收益率为 7.59%。

#### 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，宏观经济环境面临高度不确定性。新冠疫情反反复复，目前看来很难彻底根除，人类社会需要在抗疫和发展之间取得平衡。无论国内国外，除非放任通胀高企，否则因为疫情而投放的天量流动性终究要回收，如何平稳、有序地退出非常规的货币政策，又将成为各国政府面前的一道难题。而我们还要完成保民生、处置金融风险、科技强国等多重目标，任务更为艰巨。

对于股票市场，我们持总体中性观点。目前市场的估值体系极度分裂，相当多的股票估值处于历史低位，向下空间有限，以上证指数为代表的宽基指数也不会有太大风险。然而，在硬币的另一面，却是部分充满梦想的股票估值远远高于合理水平。这些股票聚集了大量杠杆资金，若出现超预期的利空事件，有可能引发局部剧烈波动，造成阶段性的市场冲击。

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

#### 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

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

股票投资部、研究部、固定收益总部、数量与指数投资部、大类资产配置部、风险管理部负

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

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

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

#### 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金管理人将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

本基金在本报告期内，曾出现了连续 60 个工作日资产净值低于五千万元的情形。我公司已根据法律法规及基金合同要求拟定相关应对方案上报中国证券监督管理委员会。

## § 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”）在中证 500 沪市交易型开放式指数证券投资基金（以下称“本基金”）的托管过程中，严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》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《中华人民共和国证券投资基金法》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：中证 500 沪市交易型开放式指数证券投资基金

报告截止日：2021 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2021 年 6 月 30 日	上年度末 2020 年 12 月 31 日
<b>资产：</b>			
银行存款	6.4.3.1	1,412,090.70	752,922.09
结算备付金		-	-
存出保证金		527.55	39.24
交易性金融资产	6.4.3.2	41,557,260.48	38,528,903.22
其中：股票投资		41,557,260.48	38,528,903.22
基金投资		-	-
债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	6.4.3.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.3.4	-	-
应收证券清算款		-	8,751.96
应收利息	6.4.3.5	118.48	96.76
应收股利		-	-
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.3.6	-	-
资产总计		42,969,997.21	39,290,713.27
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2021 年 6 月 30 日</b>	<b>上年度末 2020 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	6.4.3.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		-	-
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		17,356.73	16,405.67
应付托管费		3,471.37	3,281.11
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.3.7	12,708.21	12,536.63
应交税费		-	-
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.3.8	40,803.39	102,905.70
负债合计		74,339.70	135,129.11
<b>所有者权益:</b>			
实收基金	6.4.3.9	20,058,261.00	20,058,261.00
未分配利润	6.4.3.10	22,837,396.51	19,097,323.16
所有者权益合计		42,895,657.51	39,155,584.16
负债和所有者权益总计		42,969,997.21	39,290,713.27

注：报告截止日 2021 年 06 月 30 日，基金份额净值 2.139 元，基金份额总额 20,058,261.00 份。

## 6.2 利润表

会计主体：中证 500 沪市交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期	上年度可比期间
		2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日	2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日
一、收入		4,081,910.33	3,378,962.41
1. 利息收入		1,765.27	1,920.52
其中：存款利息收入	6.4.3.11	1,765.27	1,920.52
债券利息收入		-	-
资产支持证券利息收 入		-	-
买入返售金融资产收 入		-	-
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填 列）		3,111,226.66	1,761,298.09

其中：股票投资收益	6.4.3.12	2,708,963.38	1,467,098.58
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.3.13	-	-
资产支持证券投资收 益	6	-	-
贵金属投资收益	6.4.3.14	-	-
衍生工具收益	6.4.3.15	-	-
股利收益	6.4.3.16	402,263.28	294,199.51
3. 公允价值变动收益（损失 以“-”号填列）	6.4.3.17	973,298.40	1,615,743.80
4. 汇兑收益（损失以“-”号 填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-”号 填列）	6.4.3.18	-4,380.00	-
减：二、费用		184,478.26	172,807.25
1. 管理人报酬	6.4.6.2.1	101,521.76	87,573.19
2. 托管费	6.4.6.2.2	20,304.42	17,514.62
3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用	6.4.3.19	21,718.69	12,618.91
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支 出		-	-
6. 税金及附加		-	-
7. 其他费用	6.4.3.20	40,933.39	55,100.53
三、利润总额（亏损总额以“-” 号填列）		3,897,432.07	3,206,155.16
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-” 号填列）		3,897,432.07	3,206,155.16

### 6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：中证 500 沪市交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者 权益（基金净值）	20,058,261.00	19,097,323.16	39,155,584.16
二、本期经营活 动产生的基金净 值变动数（本期 利润）	-	3,897,432.07	3,897,432.07

三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	-	-157,358.72	-157,358.72
其中：1. 基金申购款	3,000,000.00	2,909,390.19	5,909,390.19
2. 基金赎回款	-3,000,000.00	-3,066,748.91	-6,066,748.91
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-	-
五、期末所有者权益（基金净值）	20,058,261.00	22,837,396.51	42,895,657.51
项目	上年度可比期间 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	22,058,261.00	13,109,012.58	35,167,273.58
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	3,206,155.16	3,206,155.16
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	-	-	-
其中：1. 基金申购款	-	-	-
2. 基金赎回款	-	-	-
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-	-
五、期末所有者权益（基金净值）	22,058,261.00	16,315,167.74	38,373,428.74



报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署：

谭晓冈

周立新

刘亚林

基金管理人负责人

主管会计工作负责人

会计机构负责人

## 6.4 报表附注

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

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

### 6.4.2 税项

#### 1、印花税

证券（股票）交易印花税税率为 1%，由出让方缴纳。

股权分置改革过程中因非流通股股东向流通股股东支付对价而发生的股权转让，暂免征收印花

#### 2、增值税、企业所得税

自根据财政部、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]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，资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人；

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，自 2018 年 1 月 1 日起，资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为（以下简称“资管产品运营业务”），暂适用简易计税方法，按照 3% 的征收率缴纳增值税，资管产品管理人未分别核算资管产品运营业务和其他业务的销售额和增值税应纳税额的除外。资管产品管理人可选择分别或汇总核算资管产品运营业务销售额和增值税应纳税额。对资管产品在 2018 年 1 月 1 日前运营过程中发生的增值税应税行为，未缴纳增值税的，不再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从资管产品管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。

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，提供贷款服务，以 2018 年 1 月 1 日起产生的利息及利息性质的收入为销售额；

转让 2017 年 12 月 31 日前取得的股票（不包括限售股）、债券、基金、非货物期货，可以选择按照实际买入价计算销售额，或者以 2017 年最后一个交易日的股票收盘价（2017 年最后一个交易日处于停牌期间的股票，为停牌前最后一个交易日收盘价）、债券估值（中债金融估值中心有限公司或中证指数有限公司提供的债券估值）、基金份额净值、非货物期货结算价格作为买入价计算销售额。

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。

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。

### 3、个人所得税

个人所得税税率为 20%。

基金取得的股票的股息、红利收入、债券的利息收入及储蓄利息收入，由上市公司、债券发行企业及金融机构在向基金派发股息、红利收入、债券的利息收入及储蓄利息收入时代扣代缴个人所得税。

基金从上市公司分配取得的股息红利所得，持股期限在 1 个月以内（含 1 个月）的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在 1 个月以上至 1 年（含 1 年）的，减按 50% 计入应纳税所得额；持股期限超过 1 年的，暂免征收个人所得税。

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。

暂免征收储蓄存款利息所得个人所得税。

## 6.4.3 重要财务报表项目的说明

### 6.4.3.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 6 月 30 日
活期存款	1,412,090.70
定期存款	-
其中：存款期限 1 个月以内	-
存款期限 1-3 个月	-
存款期限 3 个月以上	-
其他存款	-
合计	1,412,090.70

### 6.4.3.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 6 月 30 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	38,472,889.80	41,557,260.48	3,084,370.68
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	38,472,889.80	41,557,260.48	3,084,370.68

注：此处的股票投资项含可退替代款估值增值。

### 6.4.3.3 衍生金融资产/负债

无。

### 6.4.3.4 买入返售金融资产

#### 6.4.3.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

无。

#### 6.4.3.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

无。

### 6.4.3.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 6 月 30 日
应收活期存款利息	118.30
应收定期存款利息	-
应收其他存款利息	-
应收结算备付金利息	-
应收债券利息	-
应收资产支持证券利息	-
应收买入返售证券利息	-
应收申购款利息	-

应收黄金合约拆借孳息	-
应收出借证券利息	-
其他	0.18
合计	118.48

#### 6.4.3.6 其他资产

无。

#### 6.4.3.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 6 月 30 日
交易所市场应付交易费用	12,708.21
银行间市场应付交易费用	-
合计	12,708.21

#### 6.4.3.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2021 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	-
预提费用	34,712.18
应付指数使用费	6,091.21
合计	40,803.39

#### 6.4.3.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	20,058,261.00	20,058,261.00
本期申购	3,000,000.00	3,000,000.00
本期赎回（以“-”号填列）	-3,000,000.00	-3,000,000.00
- 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	20,058,261.00	20,058,261.00

注：申购含红利再投份额(如有)。

#### 6.4.3.10 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	8,330,378.42	10,766,944.74	19,097,323.16
本期利润	2,924,133.67	973,298.40	3,897,432.07
本期基金份额交易产生的变动数	-21,650.57	-135,708.15	-157,358.72
其中：基金申购款	1,256,791.88	1,652,598.31	2,909,390.19
基金赎回款	-1,278,442.45	-1,788,306.46	-3,066,748.91
本期已分配利润	-	-	-
本期末	11,232,861.52	11,604,534.99	22,837,396.51

#### 6.4.3.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月30日
活期存款利息收入	1,695.47
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	67.15
其他	2.65
合计	1,765.27

#### 6.4.3.12 股票投资收益

##### 6.4.3.12.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月30日
股票投资收益——买卖股票差价收入	2,214,240.92
股票投资收益——赎回差价收入	494,722.46
股票投资收益——申购差价收入	-
股票投资收益——证券出借差价收入	-
合计	2,708,963.38

##### 6.4.3.12.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月30日
卖出股票成交总额	7,422,020.03
减：卖出股票成本总额	5,207,779.11
买卖股票差价收入	2,214,240.92

### 6.4.3.12.3 股票投资收益——赎回差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月30日
赎回基金份额对价总额	6,066,748.91
减：现金支付赎回款总额	-377,820.09
减：赎回股票成本总额	5,949,846.54
赎回差价收入	494,722.46

### 6.4.3.12.4 股票投资收益——申购差价收入

无。

### 6.4.3.12.5 股票投资收益——证券出借差价收入

无。

### 6.4.3.13 债券投资收益

无。

### 6.4.3.14 贵金属投资收益

无。

### 6.4.3.15 衍生工具收益

#### 6.4.3.15.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

无。

#### 6.4.3.15.2 衍生工具收益——其他投资收益

无。

### 6.4.3.16 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月30日
股票投资产生的股利收益	402,263.28
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	402,263.28

#### 6.4.3.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
1. 交易性金融资产	973,298.40
股票投资	973,298.40
债券投资	-
资产支持证券投资	-
基金投资	-
贵金属投资	-
其他	-
2. 衍生工具	-
权证投资	-
3. 其他	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税	-
合计	973,298.40

#### 6.4.3.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
基金赎回费收入	-
替代损益	-4,380.00
合计	-4,380.00

注：替代损益收入是指投资者采用可以现金替代方式申购本基金时，补入被替代股票的实际买入成本与申购确认日估值的差额，或强制退款的被替代股票在强制退款计算日与申购确认日估值的差额。

#### 6.4.3.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
交易所市场交易费用	21,718.69
银行间市场交易费用	-
合计	21,718.69

#### 6.4.3.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
审计费用	9,916.99

信息披露费	24,795.19
证券出借违约金	-
银行划款手续费	130.00
指数使用费	6,091.21
合计	40,933.39

注：指数使用费为支付标的指数供应商的标的指数许可使用费，按前一日基金资产净值的 0.03% 的年费率计提，逐日累计，按季支付。本基金当季日均基金资产净值大于 5000 万元时，指数许可使用费收取下限调整为每季度人民币 3.5 万元；本基金当季日均基金资产净值小于或等于 5000 万元时，指数许可使用费收取不设下限金额。

#### 6.4.4 或有事项、资产负债表日后事项的说明

##### 6.4.4.1 或有事项

无。

##### 6.4.4.2 资产负债表日后事项

无。

#### 6.4.5 关联方关系

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

本基金本报告期存在控制关系或者其他重大利害关系的关联方未发生变化。

##### 6.4.5.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
大成基金管理有限公司（“大成基金”）	基金管理人、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

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。

#### 6.4.6 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

##### 6.4.6.1 通过关联方交易单元进行的交易

###### 6.4.6.1.1 股票交易

无。

###### 6.4.6.1.2 债券交易

无。

###### 6.4.6.1.3 债券回购交易

无。



#### 6.4.6.1.4 权证交易

无。

#### 6.4.6.1.5 应支付关联方的佣金

无。

#### 6.4.6.2 关联方报酬

##### 6.4.6.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	101,521.76	87,573.19
其中：支付销售机构的客户维护费	-	-

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 0.5% 的年费率计提。

计算方法如下：

$$H = E \times 0.5\% / \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日基金资产净值

##### 6.4.6.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	20,304.42	17,514.62

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 0.1% 年费率计提。

计算方法如下：

$$H = E \times 0.1\% / \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

#### 6.4.6.3 与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易

无。

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

无。

#### 6.4.6.5 各关联方投资本基金的情况

##### 6.4.6.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

份额单位：份

项目	本期	上年度可比期间
	2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日	2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日
基金合同生效日（2012 年 8 月 24 日）持有的基金份额	0.00	-
报告期初持有的基金份额	17,000,000.00	17,000,000.00
报告期间申购/买入总份额	0.00	-
报告期间因拆分变动份额	0.00	-
减：报告期间赎回/卖出总份额	0.00	-
报告期末持有的基金份额	17,000,000.00	17,000,000.00
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	84.75%	77.07%

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。

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

无。

#### 6.4.6.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期		上年度可比期间	
	2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日		2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国银行	1,412,090.70	1,695.47	990,568.06	1,863.36

注：本基金由基金托管人保管的银行存款，按银行约定利率计息。

#### 6.4.6.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

无。

#### 6.4.6.8 其他关联交易事项的说明

无。

#### 6.4.7 利润分配情况

无。

#### 6.4.8 期末(2021年6月30日)本基金持有的流通受限证券

##### 6.4.8.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

无。

##### 6.4.8.2 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
600460	士兰微	2021年6月30日	重大事项	56.35	2021年7月1日	59.49	11,300	140,030.46	636,755.00	-
600811	东方集团	2021年6月30日	重大事项	3.05	2021年7月14日	3.36	42,570	213,283.41	129,838.50	-

注：本基金截至本期末止持有以上因公布的重大事项可能产生重大影响而被暂时停牌的股票，该类股票将在所公布事项的重大影响消除后，经交易所批准复牌。

##### 6.4.8.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

###### 6.4.8.3.1 银行间市场债券正回购

无。

###### 6.4.8.3.2 交易所市场债券正回购

无。

##### 6.4.8.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

无。

#### 6.4.9 金融工具风险及管理

##### 6.4.9.1 风险管理政策和组织架构

本基金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。本基金以拟合、跟踪中证 500 沪市指数为原则,通过被动式指数化投资方法,力求为投资者提供一个管理透明且成本较低的标的指数投资工具。

本基金为被动式指数基金,采取完全复制法,即按照标的指数的成份股组成及其权重构建股票投资组合,并根据标的指数成份股及其权重的变动进行相应调整。当预期成份股发生调整和成份股发生配股、增发、分红等行为时,或因基金的申购和赎回等对本基金跟踪标的指数的效果可能带来影响时,或因某些特殊情况导致流动性不足时,或其他原因导致无法有效复制和跟踪标的指数时,基金管理人可以对投资组合管理进行适当变通和调整,从而使得投资组合紧密地跟踪标的指数。本基金可投资股指期货和其他经中国证监会允许的衍生金融产品,如权证以及其他与标的指数或标的指数成份股、备选成份股相关的衍生工具。本基金投资股指期货将根据风险管理的原则,以套期保值为目的,力争利用股指期货的杠杆作用,降低股票仓位频繁调整的交易成本和跟踪误差,达到有效跟踪标的指数的目的。在正常市场情况下,本基金的风险控制目标是追求日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.2%,年跟踪误差不超过 2%。如因标的指数编制规则调整等其他原因,导致基金跟踪偏离度和跟踪误差超过了上述范围,基金管理人应采取合理措施,避免跟踪偏离度和跟踪误差的进一步扩大。

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

#### 6.4.9.2 信用风险

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

本基金主要投资于标的指数成份股和备选成份股，且通过分散化投资以分散信用风险。本基金投资权证，在任何交易日买入的总金额，不超过上一交易日基金资产净值的 0.5%，基金持有的全部权证的市值不超过基金资产净值的 3%，本基金管理人管理的全部基金持有同一权证的比例不超过该权证的 10%。本基金投资于标的指数成份股和备选成份股的资产比例不低于基金资产净值的 90%。在任何交易日日终，持有的买入股指期货合约价值，不得超过基金资产净值的 10%。

本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的银行存款存放在本基金的托管行中国银行，因而与银行存款相关的信用风险不重大。本基金在交易所进行的交易均与中国证券登记结算有限责任公司完成证券交收和款项清算，因此违约风险发生的可能性很小；基金在进行银行间同业市场交易前均对交易对手进行信用评估，以控制相应的信用风险。

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

于本期末，本基金持有的除国债、央行票据和政策性金融债以外的债券占基金资产净值的比例为 0.00% (上年度末：0.00%)。

#### 6.4.9.3 流动性风险

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

##### 6.4.9.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

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

#### 6.4.9.4 市场风险

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

##### 6.4.9.4.1 利率风险

利率风险是指金融工具的公允价值或现金流量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。本基金持有的生息资产主要为银行存款、结算备付金、债券投资、资产支持证券投资及买入返售金融资产等。

##### 6.4.9.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2021 年 6 月 30 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	1,412,090.70	-	-	-	1,412,090.70
存出保证金	527.55	-	-	-	527.55
交易性金融资产	-	-	-	41,557,260.48	41,557,260.48
应收利息	-	-	-	118.48	118.48
资产总计	1,412,618.25	-	-	41,557,378.96	42,969,997.21
负债					
应付管理人报酬	-	-	-	17,356.73	17,356.73
应付托管费	-	-	-	3,471.37	3,471.37

应付交易费用	-	-	-	12,708.21	12,708.21
其他负债	-	-	-	40,803.39	40,803.39
负债总计	-	-	-	74,339.70	74,339.70
利率敏感度缺口	1,412,618.25	-	-	41,483,039.26	42,895,657.51
上年度末 2020 年 12 月 31 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	752,922.09	-	-	-	752,922.09
存出保证金	39.24	-	-	-	39.24
交易性金融资产	-	-	-	38,528,903.22	38,528,903.22
应收利息	-	-	-	96.76	96.76
应收证券清算款	-	-	-	8,751.96	8,751.96
资产总计	752,961.33	-	-	38,537,751.94	39,290,713.27
负债					
应付管理人报酬	-	-	-	16,405.67	16,405.67
应付托管费	-	-	-	3,281.11	3,281.11
应付交易费用	-	-	-	12,536.63	12,536.63
其他负债	-	-	-	102,905.70	102,905.70
负债总计	-	-	-	135,129.11	135,129.11
利率敏感度缺口	752,961.33	-	-	38,402,622.83	39,155,584.16

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

#### 6.4.9.4.1.2 利率风险的敏感性分析

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

#### 6.4.9.4.2 外汇风险

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

#### 6.4.9.4.3 其他价格风险

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

本基金为被动式指数基金，采取完全复制法，即按照标的指数的成份股组成及其权重构建股票投资组合，并根据标的指数成份股及其权重的变动进行相应调整。投资于标的指数成份股和备

选成份股的资产比例不低于基金资产净值的 90%，权证、股指期货及其他金融工具的投资比例依照法律法规或监管机构的规定执行。

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。

#### 6.4.9.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 6 月 30 日		上年度末 2020 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	41,557,260.48	96.88	38,528,903.22	98.40
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	41,557,260.48	96.88	38,528,903.22	98.40

#### 6.4.9.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除业绩比较基准以外的其他市场变量保持不变		
	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2021 年 6 月 30 日）	上年度末（2020 年 12 月 31 日）
分析	业绩比较基准上升 5%	2,091,035.83	1,926,083.74
	业绩比较基准下降 5%	-2,091,035.83	-1,926,083.74

#### 6.4.10 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

无。



## § 7 投资组合报告

### 7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	41,557,260.48	96.71
	其中：股票	41,557,260.48	96.71
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	1,412,090.70	3.29
8	其他各项资产	646.03	0.00
9	合计	42,969,997.21	100.00

### 7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

#### 7.2.1 报告期末指数投资按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值 (元)	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	277,806.00	0.65
B	采矿业	2,006,270.00	4.68
C	制造业	24,031,294.09	56.02
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	1,408,840.10	3.28
E	建筑业	1,249,433.22	2.91
F	批发和零售业	2,213,607.57	5.16
G	交通运输、仓储和邮政业	1,441,141.59	3.36
H	住宿和餐饮业	454,156.00	1.06
I	信息传输、软件和信息技术服务业	2,846,151.20	6.64
J	金融业	2,935,510.22	6.84
K	房地产业	1,577,729.06	3.68
L	租赁和商务服务业	266,495.00	0.62
M	科学研究和技术服务业	117,504.00	0.27
N	水利、环境和公共	240,881.13	0.56

	设施管理业		
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	53,621.04	0.13
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	306,502.00	0.71
S	综合	96,957.06	0.23
	合计	41,523,899.28	96.80

### 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	-	-
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	2,983.68	0.01
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	7,084.80	0.02
J	金融业	23,292.72	0.05
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	33,361.20	0.08

### 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	603486	科沃斯	3,360	766,348.80	1.79
2	600089	特变电工	51,500	661,775.00	1.54
3	600460	士兰微	11,300	636,755.00	1.48
4	601233	桐昆股份	21,800	525,162.00	1.22
5	688029	南微医学	1,600	498,704.00	1.16
6	600885	宏发股份	7,280	456,456.00	1.06
7	603444	吉比特	800	424,000.00	0.99
8	601636	旗滨集团	21,900	406,464.00	0.95
9	600733	北汽蓝谷	29,200	393,616.00	0.92
10	600884	杉杉股份	16,386	382,121.52	0.89
11	603737	三棵树	2,100	369,600.00	0.86
12	600219	南山铝业	99,500	358,200.00	0.84
13	601127	小康股份	5,300	353,351.00	0.82
14	600779	水井坊	2,700	341,145.00	0.80
15	603589	口子窖	5,000	338,450.00	0.79
16	601099	太平洋	97,700	331,203.00	0.77
17	601168	西部矿业	27,300	325,689.00	0.76
18	600704	物产中大	41,300	325,031.00	0.76
19	603893	瑞芯微	2,300	320,758.00	0.75
20	600739	辽宁成大	15,400	320,474.00	0.75
21	600563	法拉电子	2,003	317,195.08	0.74
22	688099	晶晨股份	2,800	314,160.00	0.73
23	688002	睿创微纳	3,100	309,473.00	0.72
24	600392	盛和资源	17,613	305,761.68	0.71
25	600486	扬农化工	2,700	301,779.00	0.70
26	600699	均胜电子	11,820	301,646.40	0.70
27	600862	中航高科	9,700	298,566.00	0.70
28	601117	中国化学	33,600	294,336.00	0.69
29	600315	上海家化	4,860	292,280.40	0.68
30	600754	锦江酒店	5,000	284,750.00	0.66
31	600201	生物股份	16,166	282,096.70	0.66
32	600068	葛洲坝	37,600	281,624.00	0.66
33	603605	珀莱雅	1,400	275,394.00	0.64
34	603290	斯达半导	800	256,000.00	0.60
35	601997	贵阳银行	35,700	255,612.00	0.60
36	600549	厦门钨业	12,200	254,126.00	0.59
37	600171	上海贝岭	8,203	249,617.29	0.58

38	600177	雅戈尔	37,800	249,102.00	0.58
39	601128	常熟银行	39,300	243,660.00	0.57
40	601005	重庆钢铁	91,000	242,970.00	0.57
41	600316	洪都航空	6,200	238,576.00	0.56
42	600988	赤峰黄金	15,900	238,341.00	0.56
43	600418	江淮汽车	19,000	236,170.00	0.55
44	600516	方大炭素	31,700	235,848.00	0.55
45	600867	通化东宝	19,700	235,218.00	0.55
46	600529	山东药玻	6,900	234,255.00	0.55
47	600879	航天电子	31,142	234,187.84	0.55
48	601689	拓普集团	6,245	233,750.35	0.54
49	600536	中国软件	4,100	233,413.00	0.54
50	600066	宇通客车	18,500	231,065.00	0.54
51	600637	东方明珠	27,900	228,501.00	0.53
52	600166	福田汽车	65,900	227,355.00	0.53
53	600909	华安证券	40,440	225,250.80	0.53
54	600380	健康元	16,222	222,728.06	0.52
55	600369	西南证券	45,200	220,124.00	0.51
56	600487	亨通光电	19,300	220,020.00	0.51
57	600827	百联股份	10,900	219,635.00	0.51
58	688208	道通科技	2,500	217,475.00	0.51
59	600038	中直股份	4,100	216,234.00	0.50
60	600642	申能股份	35,200	216,128.00	0.50
61	601615	明阳智能	13,300	215,327.00	0.50
62	601866	中远海发	56,800	213,000.00	0.50
63	601198	东兴证券	18,800	205,484.00	0.48
64	601699	潞安环能	17,200	203,132.00	0.47
65	600895	张江高科	11,100	202,797.00	0.47
66	603260	合盛硅业	2,600	199,966.00	0.47
67	600153	建发股份	24,600	199,260.00	0.46
68	600271	航天信息	15,200	198,056.00	0.46
69	603156	养元饮品	6,900	197,202.00	0.46
69	603638	艾迪精密	4,600	197,202.00	0.46
70	600998	九州通	12,800	196,736.00	0.46
71	600256	广汇能源	58,000	193,140.00	0.45
72	600535	天士力	13,000	192,530.00	0.45
73	600415	小商品城	37,300	192,095.00	0.45
74	600060	海信视像	11,300	190,970.00	0.45
75	600008	首创环保	63,090	189,900.90	0.44
76	600188	兖州煤业	12,200	187,392.00	0.44
77	600155	华创阳安	17,500	187,250.00	0.44
78	600667	太极实业	20,500	186,550.00	0.43

79	603858	步长制药	8,200	184,418.00	0.43
80	600707	彩虹股份	19,500	183,495.00	0.43
81	600765	中航重机	8,090	183,238.50	0.43
82	600390	五矿资本	30,600	182,988.00	0.43
83	600409	三友化工	17,775	179,705.25	0.42
84	600497	驰宏锌锗	41,500	178,865.00	0.42
85	600208	新潮中宝	58,500	177,840.00	0.41
86	600372	中航电子	10,700	177,085.00	0.41
87	600498	烽火通信	9,300	173,259.00	0.40
88	600141	兴发集团	9,140	172,106.20	0.40
89	600801	华新水泥	9,759	171,465.63	0.40
90	600160	巨化股份	19,320	170,788.80	0.40
91	600170	上海建工	61,800	170,568.00	0.40
92	600511	国药股份	5,144	170,060.64	0.40
93	600875	东方电气	15,500	170,035.00	0.40
94	600258	首旅酒店	7,100	169,406.00	0.39
95	601717	郑煤机	14,500	168,635.00	0.39
96	603866	桃李面包	5,300	165,360.00	0.39
97	600325	华发股份	24,250	163,445.00	0.38
98	603707	健友股份	3,900	162,825.00	0.38
99	600663	陆家嘴	12,000	159,840.00	0.37
100	600567	山鹰国际	46,300	159,735.00	0.37
101	603077	和邦生物	75,965	158,007.20	0.37
102	688321	微芯生物	3,400	157,046.00	0.37
103	600282	南钢股份	44,100	156,996.00	0.37
104	600500	中化国际	19,880	156,256.80	0.36
105	600859	王府井	5,410	156,240.80	0.36
106	688088	虹软科技	2,800	156,100.00	0.36
107	601992	金隅集团	57,900	155,751.00	0.36
108	603225	新凤鸣	7,672	155,741.60	0.36
109	600216	浙江医药	9,700	155,297.00	0.36
110	600528	中铁工业	19,100	154,710.00	0.36
111	603927	中科软	3,600	154,620.00	0.36
112	600732	爱旭股份	11,100	154,512.00	0.36
113	600839	四川长虹	52,800	153,648.00	0.36
114	600737	中粮糖业	15,300	153,153.00	0.36
115	601016	节能风电	40,900	152,966.00	0.36
116	600598	北大荒	10,200	152,592.00	0.36
117	600027	华电国际	44,300	152,392.00	0.36
118	603712	七一二	4,200	151,620.00	0.35
119	603883	老百姓	2,860	150,664.80	0.35
120	600580	卧龙电驱	11,328	150,662.40	0.35

121	603198	迎驾贡酒	3,400	150,620.00	0.35
122	600728	佳都科技	20,100	148,941.00	0.35
123	600808	马钢股份	34,200	146,718.00	0.34
124	601577	长沙银行	16,400	146,616.00	0.34
125	600820	隧道股份	27,000	142,830.00	0.33
126	600755	厦门国贸	16,803	137,952.63	0.32
127	603000	人民网	8,000	137,520.00	0.32
128	600970	中材国际	14,950	137,091.50	0.32
129	600022	山东钢铁	78,330	134,727.60	0.31
130	600037	歌华有线	14,000	134,540.00	0.31
131	601106	中国一重	39,400	133,566.00	0.31
132	600881	亚泰集团	46,500	132,525.00	0.31
133	600398	海澜之家	18,000	130,320.00	0.30
134	600811	东方集团	42,570	129,838.50	0.30
135	603885	吉祥航空	8,500	129,710.00	0.30
136	600803	新奥股份	7,800	128,778.00	0.30
137	600039	四川路桥	20,536	128,760.72	0.30
138	600348	华阳股份	17,300	128,366.00	0.30
139	600782	新钢股份	22,900	127,782.00	0.30
140	601118	海南橡胶	24,600	125,214.00	0.29
141	603568	伟明环保	5,481	125,131.23	0.29
142	603650	彤程新材	2,600	125,060.00	0.29
143	601456	国联证券	8,100	124,740.00	0.29
144	600967	内蒙一机	12,200	123,464.00	0.29
145	600260	凯乐科技	13,869	123,156.72	0.29
146	600410	华胜天成	15,770	122,375.20	0.29
147	600026	中远海能	19,857	122,319.12	0.29
148	600718	东软集团	12,500	122,250.00	0.28
149	601880	辽港股份	71,330	121,974.30	0.28
150	601179	中国西电	29,400	121,128.00	0.28
151	600597	光明乳业	8,400	121,044.00	0.28
152	600908	无锡银行	20,600	119,480.00	0.28
153	600572	康恩贝	26,710	118,592.40	0.28
154	600126	杭钢股份	22,960	117,784.80	0.27
155	600645	中源协和	5,120	117,504.00	0.27
156	600167	联美控股	13,140	117,340.20	0.27
157	600446	金证股份	8,100	116,964.00	0.27
158	600064	南京高科	12,474	115,883.46	0.27
159	601200	上海环境	9,670	115,749.90	0.27
160	600329	中新药业	4,101	115,197.09	0.27
161	600985	淮北矿业	9,400	114,774.00	0.27
162	600158	中体产业	9,701	110,688.41	0.26

163	601598	中国外运	21,500	108,575.00	0.25
164	600517	国网英大	15,600	106,236.00	0.25
165	601975	招商南油	49,500	105,930.00	0.25
166	600195	中牧股份	8,824	105,535.04	0.25
167	600507	方大特钢	15,476	104,927.28	0.24
168	600376	首开股份	18,500	103,600.00	0.24
169	600120	浙江东方	24,134	103,293.52	0.24
170	601333	广深铁路	48,600	103,032.00	0.24
171	600435	北方导航	12,900	102,426.00	0.24
172	601000	唐山港	42,481	102,379.21	0.24
173	601718	际华集团	35,900	101,238.00	0.24
174	600307	酒钢宏兴	43,600	101,152.00	0.24
175	600804	鹏博士	20,600	99,704.00	0.23
176	603228	景旺电子	3,724	97,568.80	0.23
177	600673	东阳光	21,594	96,957.06	0.23
178	600373	中文传媒	9,700	95,642.00	0.22
179	601860	紫金银行	26,300	95,469.00	0.22
180	600056	中国医药	7,708	93,652.20	0.22
181	601608	中信重工	24,900	93,126.00	0.22
182	600582	天地科技	23,800	92,820.00	0.22
183	605358	立昂微	800	92,464.00	0.22
184	600266	城建发展	19,456	92,221.44	0.21
185	600643	爱建集团	13,205	92,170.90	0.21
186	600388	龙净环保	10,800	92,016.00	0.21
187	601098	中南传媒	10,400	91,728.00	0.21
188	601958	金钼股份	13,900	90,072.00	0.21
189	600062	华润双鹤	7,516	89,515.56	0.21
190	601991	大唐发电	33,700	88,968.00	0.21
191	600259	广晟有色	2,600	87,906.00	0.20
192	600959	江苏有线	28,700	87,535.00	0.20
193	600131	国网信通	6,600	87,384.00	0.20
194	600901	江苏租赁	16,600	86,320.00	0.20
195	600928	西安银行	18,500	86,210.00	0.20
196	600649	城投控股	18,100	86,156.00	0.20
197	600094	大名城	22,800	85,956.00	0.20
198	600776	东方通信	6,900	85,560.00	0.20
199	600095	湘财股份	7,300	85,483.00	0.20
200	600006	东风汽车	11,528	84,154.40	0.20
201	600764	中国海防	2,900	82,070.00	0.19
202	600729	重庆百货	2,986	81,965.70	0.19
203	600717	天津港	20,779	81,453.68	0.19
204	600633	浙数文化	11,200	80,416.00	0.19

205	600648	外高桥	5,400	79,812.00	0.19
206	600546	山煤国际	11,000	78,980.00	0.18
207	601611	中国核建	10,900	78,698.00	0.18
208	601928	凤凰传媒	11,000	78,540.00	0.18
209	600556	天下秀	7,400	78,144.00	0.18
210	600021	上海电力	11,300	78,083.00	0.18
211	600863	内蒙华电	33,300	77,589.00	0.18
212	600835	上海机电	4,694	76,277.50	0.18
213	603355	莱克电气	1,200	74,676.00	0.17
214	601828	美凯龙	6,200	74,400.00	0.17
215	600968	海油发展	28,300	73,297.00	0.17
216	600623	华谊集团	8,100	71,361.00	0.17
217	600566	济川药业	3,900	69,810.00	0.16
218	600339	中油工程	24,000	68,160.00	0.16
219	600312	平高电气	11,631	67,925.04	0.16
220	600787	中储股份	12,616	67,243.28	0.16
221	600639	浦东金桥	4,875	66,543.75	0.16
222	600377	宁沪高速	6,800	66,368.00	0.15
223	601969	海南矿业	5,600	65,128.00	0.15
224	600823	世茂股份	16,100	65,044.00	0.15
225	600466	蓝光发展	21,720	64,074.00	0.15
226	603888	新华网	3,000	63,510.00	0.15
227	601778	晶科科技	11,600	63,336.00	0.15
228	603317	天味食品	2,132	62,744.76	0.15
229	603708	家家悦	3,500	60,795.00	0.14
230	603786	科博达	800	60,400.00	0.14
231	601298	青岛港	9,700	59,946.00	0.14
232	603515	欧普照明	2,250	57,757.50	0.13
233	601228	广州港	17,800	56,604.00	0.13
234	600640	号百控股	4,600	56,074.00	0.13
235	600350	山东高速	9,000	55,350.00	0.13
236	601139	深圳燃气	8,300	54,448.00	0.13
237	603377	东方时尚	5,016	53,621.04	0.13
238	600871	石化油服	26,400	52,008.00	0.12
239	603379	三美股份	2,540	47,523.40	0.11
240	603056	德邦股份	4,300	47,257.00	0.11
241	601568	北元集团	5,400	46,224.00	0.11
242	601869	长飞光纤	1,800	43,848.00	0.10
243	601003	柳钢股份	7,400	43,660.00	0.10
244	600657	信达地产	12,300	42,804.00	0.10
245	603983	丸美股份	800	41,688.00	0.10
246	601512	中新集团	4,100	40,836.00	0.10



247	601801	皖新传媒	8,600	40,592.00	0.09
248	601187	厦门银行	4,000	37,920.00	0.09
249	603719	良品铺子	800	36,000.00	0.08
250	600917	重庆燃气	4,300	35,131.00	0.08
251	603868	飞科电器	800	33,648.00	0.08
252	600903	贵州燃气	3,300	30,360.00	0.07
253	600956	新天绿能	2,000	23,420.00	0.05
254	603256	宏和科技	2,500	22,850.00	0.05
255	601068	中铝国际	4,500	15,525.00	0.04

### 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	601528	瑞丰银行	1,496	23,292.72	0.05
2	603171	税友股份	369	7,084.80	0.02
3	605011	杭州热电	336	2,983.68	0.01

### 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	601636	旗滨集团	392,511.00	1.00
2	600177	雅戈尔	275,184.00	0.70
3	600068	葛洲坝	259,064.00	0.66
4	600536	中国软件	255,274.00	0.65
5	600988	赤峰黄金	253,128.00	0.65
6	600066	宇通客车	234,950.00	0.60
7	600637	东方明珠	234,360.00	0.60
8	601117	中国化学	232,176.00	0.59
9	600369	西南证券	224,644.00	0.57
10	600487	亨通光电	220,205.00	0.56
11	688208	道通科技	219,009.56	0.56
12	600998	九州通	208,128.00	0.53
13	601198	东兴证券	200,972.00	0.51
14	600271	航天信息	198,946.00	0.51
15	603893	瑞芯微	193,826.00	0.50
16	603156	养元饮品	190,051.00	0.49
17	600390	五矿资本	186,966.00	0.48
18	600208	新湖中宝	180,765.00	0.46
19	600498	烽火通信	169,725.00	0.43
20	603707	健友股份	168,590.00	0.43

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	600426	华鲁恒升	720,892.15	1.84
2	600132	重庆啤酒	613,193.00	1.57
3	603882	金域医学	562,823.00	1.44
4	600143	金发科技	528,617.00	1.35
5	603806	福斯特	476,076.85	1.22
6	601799	星宇股份	447,734.00	1.14
7	601966	玲珑轮胎	419,574.00	1.07
8	600079	人福医药	404,242.00	1.03
9	603345	安井食品	401,778.00	1.03
10	603816	顾家家居	349,396.80	0.89
11	600515	*ST 基础	180,452.00	0.46
12	603338	浙江鼎力	166,089.60	0.42
13	600273	嘉化能源	124,362.00	0.32
14	600338	西藏珠峰	88,322.20	0.23
15	600675	中华企业	85,542.00	0.22
16	601865	福莱特	85,135.00	0.22
17	600073	上海梅林	79,498.20	0.20
18	600869	远东股份	71,315.20	0.18
19	600906	财达证券	70,665.56	0.18
20	600277	亿利洁能	65,325.00	0.17

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	7,228,523.51
卖出股票收入（成交）总额	7,422,020.03

注：上述金额均指成交金额（成交单价乘以成交数量），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**

本基金本报告期末未持有权证。

**7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明**

无。

**7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明**

无。

**7.12 投资组合报告附注**

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

本基金投资的前十名证券的发行主体本期未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	527.55
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	118.48
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	646.03

**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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值	占基金资产净值比例 (%)	流通受限情况说明
1	600460	士兰微	636,755.00	1.48	重大事项停牌

#### 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

#### 8.1.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

持有人户数 (户)	户均持有的 基金份额	持有人结构			
		机构投资者		个人投资者	
		持有份额	占总份额比例 (%)	持有份额	占总份额比例 (%)
389	51,563.65	17,080,818.00	85.16	2,977,443.00	14.84

注：持有人户数为有效户数，即存量份额大于零的账户。

### 8.2 期末上市基金前十名持有人

序号	持有人名称	持有份额 (份)	占上市总份额比例 (%)
1	大成基金管理有限公司	17,000,000.00	84.75
2	钱中明	684,400.00	3.41
3	何治国	198,500.00	0.99
4	张文勇	188,200.00	0.94
5	贺顺龙	90,000.00	0.45
6	中国银河证券股份有限公司	80,318.00	0.40
7	吴炳芬	67,253.00	0.34
8	赵玲	60,400.00	0.30
9	江元浩	58,300.00	0.29
10	崔君	40,696.00	0.20

注：以上数据由中国证券登记结算有限公司提供，持有人为场内持有人。

### 8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

无。

### 8.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

项目	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和研 究部门负责人持有本开放式基金	0
本基金基金经理持有本开放式基金	0

## § 9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2012年8月24日） 基金份额总额	541,058,261.00
本报告期期初基金份额总额	20,058,261.00
本报告期基金总申购份额	3,000,000.00
减：本报告期基金总赎回份额	3,000,000.00
本报告期基金拆分变动份额（份额减少 以“-”填列）	-
本报告期期末基金份额总额	20,058,261.00

## § 10 重大事件揭示

### 10.1 基金份额持有人大会决议

无。

### 10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

一、基金管理人的重大人事变动

基金管理人报告期内无重大人事变动。

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，无涉及本基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动。

### 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

无。

### 10.4 基金投资策略的改变

本基金投资策略在本报告期内没有重大改变。

### 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金聘任的为本基金审计的会计师事务所为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

本报告期内，基金管理人、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	
长江证券	2	14,296,347.59	100.00%	13,027.86	100.00%	-
安信证券	2	-	-	-	-	-
渤海证券	1	-	-	-	-	-
财信证券	1	-	-	-	-	-
长城证券	1	-	-	-	-	-
东方证券	1	-	-	-	-	-
东海证券	1	-	-	-	-	-
东吴证券	1	-	-	-	-	-
东兴证券	1	-	-	-	-	-
东莞证券	1	-	-	-	-	-
方正证券	1	-	-	-	-	-
光大证券	2	-	-	-	-	-
广发证券	1	-	-	-	-	-
广州证券	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	2	-	-	-	-	-
恒泰证券	1	-	-	-	-	-
华宝证券	1	-	-	-	-	-
华福证券	1	-	-	-	-	-
华林证券	1	-	-	-	-	-
华泰证券	2	-	-	-	-	-
华西证券	1	-	-	-	-	-
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	-	-	-	-	-
中信建投证 券	1	-	-	-	-	-
中信证券	2	-	-	-	-	-

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

公司交易单元的选择标准主要包括：

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

租用证券公司交易单元的程序：首先根据租用证券公司交易单元的选择标准形成《券商服务评价表》，然后根据评分高低进行选择基金交易单元。

本报告期内本基金新增席位：摩根大通。本报告期内本基金退租席位：中泰证券。

#### 10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

无。

#### 10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	关于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	2021 年 6 月 30 日
2	中证 500 沪市交易型开放式指数证券投资基金 2021 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	2021 年 4 月 22 日
3	中证 500 沪市交易型开放式指数证券投资基金更新招募说明书	中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站	2021 年 3 月 30 日
4	中证 500 沪市交易型开放式指数证券投资基金基金产品资料概要更新	中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站	2021 年 3 月 30 日
5	中证 500 沪市交易型开放式指数证券投资基金 2020 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	2021 年 3 月 30 日
6	中证 500 沪市交易型开放式指数证券投资基金基金合同	中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站	2021 年 3 月 30 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	2021 年 3 月 23 日
8	中证 500 沪市交易型开放式指数证券	中国证监会基金电子披	2021 年 1 月 22 日



投资基金第四季度报告	露网站、规定报刊及本公司网站
------------	----------------

## § 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

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	20210101-20210630	17,000,000.00	-	-	17,000,000.00	84.75
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。							

### 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中证 500 沪市交易型开放式指数证券投资基金的文件；
- 2、《中证 500 沪市交易型开放式指数证券投资基金基金合同》；
- 3、《中证 500 沪市交易型开放式指数证券投资基金托管协议》；
- 4、大成基金管理有限公司批准文件、营业执照、公司章程；
- 5、本报告期内在规定报刊上披露的各种公告原稿。

### 12.2 存放地点

备查文件存放在本基金管理人和托管人的住所。

### 12.3 查阅方式

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

大成基金管理有限公司

2021 年 8 月 31 日