

大成中证 500 深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

§ 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	9
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	10
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	11
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	12
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明	12
§ 5 托管人报告	12
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	12
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	12
5.3 托管人对本中期报告中财务信息内容的真实、准确和完整发表意见	12
§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）	12
6.1 资产负债表	12
6.2 利润表	14
6.3 所有者权益（基金净值）变动表	15
6.4 报表附注	16
§ 7 投资组合报告	32
7.1 期末基金资产组合情况	32
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	32
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	34
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	40
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	41
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	41

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	41
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	42
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	42
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明	42
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	42
7.12 投资组合报告附注	42
§ 8 基金份额持有人信息	43
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	43
8.2 期末上市基金前十名持有人	43
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	44
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	44
§ 9 开放式基金份额变动	44
§ 10 重大事件揭示	44
10.1 基金份额持有人大会决议	44
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	44
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	44
10.4 基金投资策略的改变	44
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	45
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	45
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	45
10.8 其他重大事件	47
§ 11 影响投资者决策的其他重要信息	48
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	48
11.2 影响投资者决策的其他重要信息	48
§ 12 备查文件目录	48
12.1 备查文件目录	48
12.2 存放地点	48
12.3 查阅方式	49

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	大成中证 500 深市交易型开放式指数证券投资基金
基金简称	大成中证 500 深市 ETF
场内简称	中证 500 深 ETF
基金主代码	159932
交易代码	159932
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2013 年 9 月 12 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	21,507,615.00 份
基金合同存续期	不定期
基金份额上市的证券交易所	深圳证券交易所
上市日期	2013 年 10 月 9 日

2.2 基金产品说明

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

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		大成基金管理有限公司	中国银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	赵冰	许俊
	联系电话	0755-83183388	010-66594319
	电子邮箱	office@dcfund.com.cn	fcid@bankofchina.com
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	北京市西城区复兴门内大街 1 号

	商银行大厦 32 层	
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	《证券日报》
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	1,905,736.27
本期利润	2,524,256.35
加权平均基金份额本期利润	0.1156
本期加权平均净值利润率	6.41%
本期基金份额净值增长率	6.93%
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	15,420,301.34
期末可供分配基金份额利润	0.7170
期末基金资产净值	40,810,864.75
期末基金份额净值	1.898
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	60.78%

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. 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. 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）。

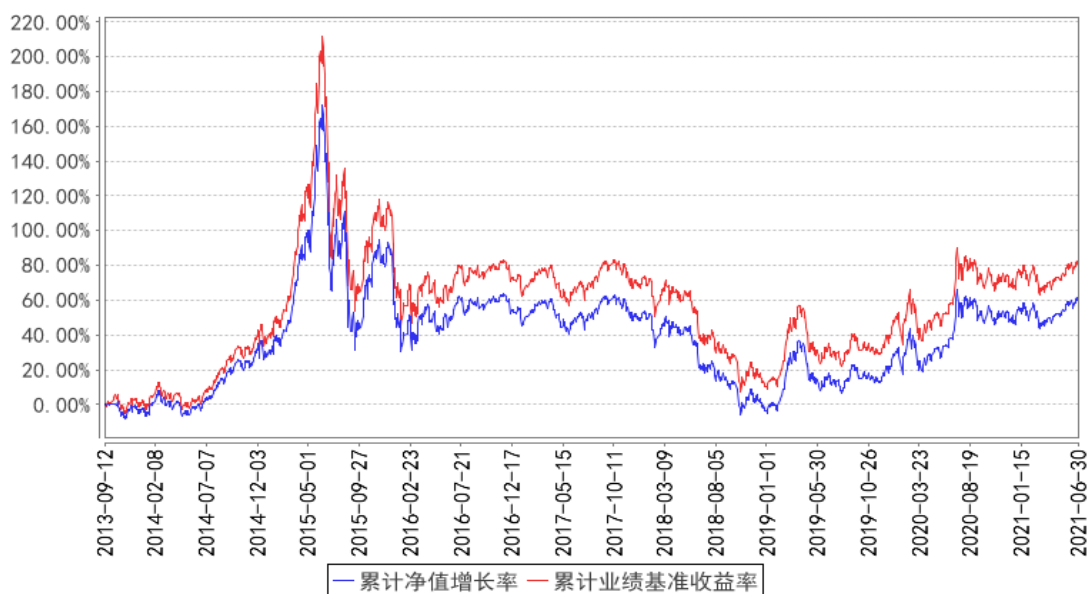
3.2 基金净值表现

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	1.06%	0.84%	0.85%	0.85%	0.21%	-0.01%
过去三个月	9.08%	0.73%	8.67%	0.75%	0.41%	-0.02%
过去六个月	6.93%	1.01%	6.34%	1.03%	0.59%	-0.02%
过去一年	14.61%	1.31%	13.42%	1.33%	1.19%	-0.02%
过去三年	30.45%	1.55%	29.72%	1.57%	0.73%	-0.02%
自基金合同生效起至今	60.78%	1.69%	81.86%	1.70%	-21.08%	-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500深市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		
张钟玉	本基金基金经理	2015年5月23日	-	11年	会计学硕士。2010年7月加入大成基金管理有限公司，曾担任研究部研究员、数量与指数投资部数量分析师、基金经理助理。2015年2月28日起任大成核心双动力混合型证券投资基金基金经理（更名前为大成核心双动力股票型证券投资基金）。2015年5月23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交易型开放式指数证券投资基金联接基金、大成中证500深市交易型开放式指数证券投资基金基金经理。2015年8月26日起任大成沪深300指数证券投资基金基金经理。2019年9月26日起任大成MSCI中国A股质优价值100交易型开放式指数证券投资基金、大成MSCI中国A股质优价值100交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理。具有基金从业资格。国籍：中国

刘淼	本基金基金经理	2020 年 6 月 29 日	-	13 年	工商管理硕士。2008 年 4 月至 2011 年 5 月就职于招商基金管理有限公司，任基金核算部基金会计。2011 年 5 月加入大成基金管理有限公司，曾担任基金运营部基金会计、股票投资部投委会秘书兼风控员、数量与指数投资部数量分析师、深证成长 40 交易型开放式指数证券投资基金、大成深证成长 40 交易型开放式指数联接基金、大成中证 500 深市交易型开放式指数证券投资基金、大成 MSCI 中国 A 股质优价值 100 交易型开放式指数证券投资基金、大成 MSCI 中国 A 股质优价值 100 交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理助理。2017 年 9 月 14 日起任大成中证 100 交易型开放式指数证券投资基金、中证 500 沪市交易型开放式指数证券投资基金、大成深证成份交易型开放式指数证券投资基金基金经理助理。2020 年 6 月 29 日起任深证成长 40 交易型开放式指数证券投资基金、大成深证成长 40 交易型开放式指数联接基金、大成中证 500 深市交易型开放式指数证券投资基金、大成 MSCI 中国 A 股质优价值 100 交易型开放式指数证券投资基金、大成 MSCI 中国 A 股质优价值 100 交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理。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
----	---------	-----------------	---	------	--

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

2021 年上半年国内经济延续新冠疫情后的复苏态势，一季度 GDP 同比增长 18.3%，二季度 GDP 同比增长 7.9%，经济逐渐由强劲反弹过渡到平稳复苏阶段，经济增速放缓，重新回到长期结构优化轨道。上半年 A 股板块轮动，分化剧烈，PPI 上涨推动的顺周期行情和光伏、新能源汽车、芯片等热点板块是上半年的投资热点。上半年沪深 300 上涨 0.2%，创业板上涨 17.2%，中小盘股票表现明显好于大盘股。行业方面，基础化工、钢铁、煤炭和新能源涨幅居前，地产、军工、家电和非银行金融跌幅较大。

报告期内本基金基本保持高仓位运作，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。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末本基金份额净值为 1.898 元；本报告期基金份额净值增长率为 6.93%，业绩比较基准收益率为 6.34%。

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 2021 下半年，经济恢复性增长高点已过，经济增速趋于下行，国内经济的重点将回到疫

情前的调结构上。地产高压政策持续，投资增长受限，随国外疫情好转生产恢复，出口也将下行，消费有望随国内服务性行业复苏进一步增长。虽然下半年经济承压，但 PPI 仍处高位的环境下，货币政策放松幅度可能有限，A 股行情仍以结构性为主。一方面，我国经济在本次疫情中表现出来的良好韧性，不断吸引海外资本投资，利好各行业内具有长期竞争优势的龙头白马。另一方面，碳中和、新能源、高端制造等赛道成长空间大，值得长期关注，但需警惕短期板块估值过高的回调风险。

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”）在大成中证 500 深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《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遵规守信、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”部分未在本托管人复核范围内）、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 500 深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	上年度末
-----	-----	-----	------

		2021 年 6 月 30 日	2020 年 12 月 31 日
资产：			
银行存款	6.4.7.1	1,156,321.42	694,050.30
结算备付金		-	-
存出保证金		109.64	284.75
交易性金融资产	6.4.7.2	39,724,674.76	37,578,344.60
其中：股票投资		39,724,674.76	37,578,344.60
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	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
应收证券清算款		-	-
应收利息	6.4.7.5	100.24	67.63
应收股利		-	-
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		40,881,206.06	38,272,747.28
负债和所有者权益	附注号	本期末 2021 年 6 月 30 日	上年度末 2020 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		-	-
应付证券清算款		-	-
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		16,552.00	16,433.18
应付托管费		3,310.39	3,286.62
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	9,917.14	6,597.55
应交税费		-	-
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	40,561.78	72,986.48
负债合计		70,341.31	99,303.83
所有者权益：			
实收基金	6.4.7.9	25,390,563.41	25,390,563.41
未分配利润	6.4.7.10	15,420,301.34	12,782,880.04
所有者权益合计		40,810,864.75	38,173,443.45

负债和所有者权益总计		40,881,206.06	38,272,747.28
------------	--	---------------	---------------

注：报告截止日 2021 年 06 月 30 日，基金份额净值 1.898 元，基金份额总额 21,507,615.00 份。

6.2 利润表

会计主体：大成中证 500 深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		2,698,663.33	4,954,166.56
1. 利息收入		1,374.39	1,617.94
其中：存款利息收入	6.4.7.11	1,374.39	1,617.94
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）		2,080,480.86	618,371.04
其中：股票投资收益	6.4.7.12	1,782,364.19	389,585.85
基金投资收益	-	-	-
债券投资收益	6.4.7.13	-	-
资产支持证券投资收益		-	-
贵金属投资收益	6.4.7.14	-	-
衍生工具收益	6.4.7.15	-	-
股利收益	6.4.7.16	298,116.67	228,785.19
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	618,520.08	4,327,727.58
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.18	-1,712.00	6,450.00
减：二、费用		174,406.98	163,686.47
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	97,493.53	83,964.90
2. 托管费	6.4.10.2.2	19,498.69	16,793.00
3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用	6.4.7.19	16,727.98	22,953.13
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	6.4.7.20	40,686.78	39,975.44
三、利润总额(亏损总额以“-”号填列)		2,524,256.35	4,790,480.09
减: 所得税费用		-	-
四、净利润(净亏损以“-”号填列)		2,524,256.35	4,790,480.09

6.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体: 大成中证 500 深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)	25,390,563.41	12,782,880.04	38,173,443.45
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	2,524,256.35	2,524,256.35
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)	-	113,164.95	113,164.95
其中: 1. 基金申购款	2,361,076.62	1,226,729.51	3,587,806.13
2. 基金赎回款	-2,361,076.62	-1,113,564.56	-3,474,641.18
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)	25,390,563.41	15,420,301.34	40,810,864.75
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)	26,571,101.72	5,878,710.50	32,449,812.22
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	4,790,480.09	4,790,480.09
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)	-1,180,538.31	-435,660.05	-1,616,198.36
其中：1. 基金申购款	5,902,691.54	1,746,629.90	7,649,321.44
2. 基金赎回款	-7,083,229.85	-2,182,289.95	-9,265,519.80
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以“-”号填列)	-	-	-
五、期末所有者权益(基金净值)	25,390,563.41	10,233,530.54	35,624,093.95

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。

2. 增值税、企业所得税

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

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、地方政府债券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。

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。

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	1,156,321.42
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	1,156,321.42

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	36,832,634.18	39,724,674.76	2,892,040.58
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	36,832,634.18	39,724,674.76	2,892,040.58

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	100.24
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	-
合计	100.24

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	9,917.14
银行间市场应付交易费用	-
合计	9,917.14

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	5,849.60
合计	40,561.78

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	21,507,615.00	25,390,563.41
本期申购	2,000,000.00	2,361,076.62
本期赎回（以“-”号填列）	-2,000,000.00	-2,361,076.62
本期末	21,507,615.00	25,390,563.41

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)。

6.4.3.10 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	27,909,085.83	-15,126,205.79	12,782,880.04
本期利润	1,905,736.27	618,520.08	2,524,256.35
本期基金份额交易产生的变动数	323.25	112,841.70	113,164.95
其中：基金申购款	2,594,951.13	-1,368,221.62	1,226,729.51
基金赎回款	-2,594,627.88	1,481,063.32	-1,113,564.56
本期已分配利润	-	-	-
本期末	29,815,145.35	-14,394,844.01	15,420,301.34

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	1,335.22
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	37.82
其他	1.35
合计	1,374.39

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	1,661,121.56
股票投资收益——赎回差价收入	121,242.63
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	1,782,364.19

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	5,703,923.69
减：卖出股票成本总额	4,042,802.13
买卖股票差价收入	1,661,121.56

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	3,474,641.18
减：现金支付赎回款总额	-89,119.82
减：赎回股票成本总额	3,442,518.37
赎回差价收入	121,242.63

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

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	298,116.67
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	298,116.67

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	618,520.08
股票投资	618,520.08
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	618,520.08

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	-1,712.00
合计	-1,712.00

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	16,727.98
银行间市场交易费用	-
合计	16,727.98

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	125.00
指数使用费	5,849.60
合计	40,686.78

注：指数许可使用基点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。

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

本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

6.4.5.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
大成基金管理有限公司（“大成基金”）	基金管理人
中国银行股份有限公司（“中国银行”）	基金托管人
光大证券股份有限公司（“光大证券”）	基金管理人的股东、基金申赎代办券商

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

金额单位：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	
	成交金额	占当期股票 成交总额的比例 (%)	成交金额	占当期股票 成交总额的比例(%)
光大证券	11,024,711.55	100.00	15,210,184.09	100.00

6.4.6.1.2 债券交易

无。

6.4.6.1.3 债券回购交易

无。

6.4.6.1.4 权证交易

无。

6.4.6.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2021年1月1日至2021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	10,046.99	100.00	9,917.14	100.00
关联方名称	上年度可比期间 2020年1月1日至2020年6月30日			
	当期 佣金	占当期佣金总量 的比例 (%)	期末应付佣金余 额	占期末应付佣金 总额的比例 (%)
光大证券	13,861.28	100.00	13,294.55	100.00

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

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

6.4.6.2 关联方报酬

6.4.6.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 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	97,493.53	83,964.90
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基金资产净值的 0.50% 的年费率计

提。计算方法如下：

$$H=E \times 0.50\% / \text{当年天数}$$

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	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
当期发生的基金应支付的托管费	19,498.69	16,793.00

注：基金托管费每日计提，按月支付。基金托管人的基金托管费按基金资产净值的 0.10% 年费率

计提。计算方法如下：

$$H=E \times 0.10\% / \text{当年天数}$$

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

6.4.6.2.3 销售服务费

无。

6.4.6.3 与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易

无。

6.4.6.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

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

无。

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

无。

6.4.6.5 各关联方投资本基金的情况

6.4.6.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

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（2013 年 9 月 12 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	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	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	79.04%	79.04%

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	1,156,321.42	1,335.22	632,252.57	1,558.00

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

无。

6.4.8.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

无。

6.4.8.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

无。

6.4.9 金融工具风险及管理

6.4.9.1 风险管理政策和组织架构

本基金是指数型基金，采用完全复制的被动投资策略，跟踪中证 500 深市指数，相对于混合型基金、债券型基金与货币市场基金而言，其风险和收益较高，属于股票型基金中高风险、高收益的产品。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 深市指数为原则，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。

于本期末，本基金无债券投资（上年度末：同）。

6.4.9.3 流动性风险

流动性风险是指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%。

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

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

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

本基金持有的大部分金融资产和金融负债不计息，因此本基金的收入及经营活动的现金流量在很大程度上独立于市场利率变化。本基金持有的利率敏感性资产主要为银行存款、结算备付金、债券投资、资产支持证券投资及买入返售金融资产等。下表统计了本基金交易的利率风险敞口。表中所示为本基金资产及负债的公允价值，并按照合约规定的重新定价日或到期日孰早者进行了分类。

6.4.9.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
-----	-------	-------	-------	-----	----

2021 年 6 月 30 日					
资产					
银行存款	1,156,321.42	-	-	-	1,156,321.42
存出保证金	109.64	-	-	-	109.64
交易性金融资产	-	-	-	39,724,674.76	39,724,674.76
应收利息	-	-	-	100.24	100.24
资产总计	1,156,431.06	-	-	39,724,775.00	40,881,206.06
负债					
应付管理人报酬	-	-	-	16,552.00	16,552.00
应付托管费	-	-	-	3,310.39	3,310.39
应付交易费用	-	-	-	9,917.14	9,917.14
其他负债	-	-	-	40,561.78	40,561.78
负债总计	-	-	-	70,341.31	70,341.31
利率敏感度缺口	1,156,431.06	-	-	39,654,433.69	40,810,864.75
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	694,050.30	-	-	-	694,050.30
存出保证金	284.75	-	-	-	284.75
交易性金融资产	-	-	-	37,578,344.60	37,578,344.60
应收利息	-	-	-	67.63	67.63
资产总计	694,335.05	-	-	37,578,412.23	38,272,747.28
负债					
应付管理人报酬	-	-	-	16,433.18	16,433.18
应付托管费	-	-	-	3,286.62	3,286.62
应付交易费用	-	-	-	6,597.55	6,597.55
其他负债	-	-	-	72,986.48	72,986.48
负债总计	-	-	-	99,303.83	99,303.83
利率敏感度缺口	694,335.05	-	-	37,479,108.40	38,173,443.45

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

6.4.9.4.1.2 利率风险的敏感性分析

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

6.4.9.4.2 外汇风险

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

6.4.9.4.3 其他价格风险

其他价格风险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	39,724,674.76	97.34	37,578,344.60	98.44
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	39,724,674.76	97.34	37,578,344.60	98.44

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%	2,005,733.33	1,875,448.64
	业绩比较基准下降 5%	-2,005,733.33	-1,875,448.64

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	39,724,674.76	97.17
	其中：股票	39,724,674.76	97.17
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	1,156,321.42	2.83
8	其他各项资产	209.88	0.00
9	合计	40,881,206.06	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	497,395.00	1.22
B	采矿业	881,218.24	2.16
C	制造业	27,217,486.85	66.69
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	593,757.00	1.45
E	建筑业	290,176.46	0.71
F	批发和零售业	635,285.80	1.56
G	交通运输、仓储和邮政业	204,744.00	0.50
H	住宿和餐饮业	-	-

I	信息传输、软件和信息技术服务业	3,843,744.28	9.42
J	金融业	1,829,774.48	4.48
K	房地产业	1,091,805.00	2.68
L	租赁和商务服务业	761,166.80	1.87
M	科学研究和技术服务业	91,696.50	0.22
N	水利、环境和公共设施管理业	433,699.80	1.06
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	208,352.00	0.51
R	文化、体育和娱乐业	497,359.00	1.22
S	综合	588,659.40	1.44
	合计	39,666,320.61	97.20

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	58,354.15	0.14
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	-	-
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	58,354.15	0.14

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	002709	天赐材料	6,932	738,812.56	1.81
2	000799	酒鬼酒	2,800	715,680.00	1.75
3	000009	中国宝安	32,220	588,659.40	1.44
4	002340	格林美	57,828	540,691.80	1.32
5	002074	国轩高科	12,400	540,144.00	1.32
6	300285	国瓷材料	9,800	477,750.00	1.17
7	300207	欣旺达	13,800	449,328.00	1.10
8	002185	华天科技	27,400	421,686.00	1.03
9	300316	晶盛机电	8,100	409,050.00	1.00
10	300037	新宙邦	3,500	350,350.00	0.86
11	300146	汤臣倍健	10,300	338,870.00	0.83
12	300253	卫宁健康	20,700	336,789.00	0.83
13	002648	卫星石化	8,580	336,250.20	0.82
14	002625	光启技术	15,700	326,717.00	0.80
15	002223	鱼跃医疗	8,538	325,553.94	0.80
16	002353	杰瑞股份	7,200	321,840.00	0.79
17	002138	顺络电子	8,100	314,037.00	0.77
18	000547	航天发展	16,100	303,807.00	0.74
19	002797	第一创业	40,700	290,598.00	0.71
20	300699	光威复材	3,800	288,610.00	0.71
21	000988	华工科技	12,200	286,944.00	0.70
22	002212	天融信	14,400	284,688.00	0.70
23	002444	巨星科技	8,300	282,864.00	0.69
24	002422	科伦药业	13,800	275,310.00	0.67
25	002385	大北农	40,100	272,680.00	0.67
26	000636	风华高科	9,000	271,980.00	0.67
27	000807	云铝股份	22,700	270,130.00	0.66
28	300308	中际旭创	6,900	265,788.00	0.65
29	002439	启明星辰	9,100	263,991.00	0.65

30	002078	太阳纸业	19,700	262,995.00	0.64
31	002030	达安基因	12,281	260,848.44	0.64
32	000830	鲁西化工	13,900	260,347.00	0.64
33	002250	联化科技	9,244	257,907.60	0.63
34	300088	长信科技	30,700	253,582.00	0.62
35	002507	涪陵榨菜	6,700	252,322.00	0.62
36	002180	纳思达	7,800	251,160.00	0.62
37	002013	中航机电	24,300	244,701.00	0.60
38	000039	中集集团	13,360	242,884.80	0.60
39	000630	铜陵有色	89,100	242,352.00	0.59
40	300223	北京君正	2,400	242,208.00	0.59
41	002075	沙钢股份	22,100	241,111.00	0.59
42	000513	丽珠集团	4,730	236,594.60	0.58
43	002028	思源电气	7,665	236,005.35	0.58
44	002127	南极电商	23,800	232,526.00	0.57
45	300001	特锐德	7,600	228,836.00	0.56
46	002511	中顺洁柔	8,200	225,910.00	0.55
47	002273	水晶光电	15,216	223,523.04	0.55
48	300482	万孚生物	3,410	220,592.90	0.54
49	002080	中材科技	8,400	219,828.00	0.54
50	002603	以岭药业	7,500	218,700.00	0.54
51	000021	深科技	11,400	218,196.00	0.53
52	002465	海格通信	23,000	217,580.00	0.53
53	000739	普洛药业	7,400	217,560.00	0.53
54	002299	圣农发展	9,100	217,308.00	0.53
55	300009	安科生物	14,376	214,202.40	0.52
56	002092	中泰化学	20,800	213,616.00	0.52
57	000825	太钢不锈	28,500	213,465.00	0.52
58	300618	寒锐钴业	2,700	212,868.00	0.52
59	000983	山西焦煤	25,600	212,736.00	0.52
60	300357	我武生物	3,300	211,596.00	0.52
61	000050	深天马 A	14,900	211,282.00	0.52
62	300168	万达信息	14,400	210,240.00	0.52
63	300244	迪安诊断	5,440	208,352.00	0.51
64	300463	迈克生物	4,900	206,241.00	0.51
65	000998	隆平高科	12,800	205,312.00	0.50
66	000750	国海证券	47,560	201,654.40	0.49
67	002156	通富微电	8,300	199,532.00	0.49
68	002152	广电运通	15,200	198,056.00	0.49
69	000975	银泰黄金	20,824	198,036.24	0.49
70	002131	利欧股份	84,288	197,233.92	0.48
71	300070	碧水源	26,800	195,908.00	0.48

72	000723	美锦能源	25,900	195,804.00	0.48
73	000932	华菱钢铁	29,640	195,624.00	0.48
74	300271	华宇软件	10,100	194,425.00	0.48
75	000960	锡业股份	12,100	193,963.00	0.48
76	002572	索菲亚	8,000	193,600.00	0.47
77	300296	利亚德	24,600	192,372.00	0.47
78	002373	千方科技	11,500	192,050.00	0.47
79	002690	美亚光电	3,400	189,584.00	0.46
80	300383	光环新网	13,098	188,480.22	0.46
81	300474	景嘉微	1,900	186,048.00	0.46
82	002926	华西证券	19,100	183,933.00	0.45
83	000623	吉林敖东	11,700	181,233.00	0.44
84	002500	山西证券	26,880	180,364.80	0.44
85	300115	长盈精密	8,744	180,126.40	0.44
86	002065	东华软件	22,700	180,011.00	0.44
87	000012	南玻 A	17,138	175,493.12	0.43
88	002294	信立泰	5,300	174,370.00	0.43
89	300630	普利制药	3,258	170,719.20	0.42
90	300418	昆仑万维	10,300	168,714.00	0.41
91	300024	机器人	15,600	166,452.00	0.41
92	002670	国盛金控	14,540	165,610.60	0.41
93	002557	洽洽食品	3,800	163,780.00	0.40
94	002372	伟星新材	7,920	163,706.40	0.40
95	000027	深圳能源	17,820	163,409.40	0.40
96	002382	蓝帆医疗	7,700	160,545.00	0.39
97	002019	亿帆医药	9,300	160,425.00	0.39
98	000878	云南铜业	12,400	159,092.00	0.39
99	002683	宏大爆破	5,700	158,289.00	0.39
100	002221	东华能源	14,400	157,680.00	0.39
101	000718	苏宁环球	18,900	156,681.00	0.38
102	300251	光线传媒	14,200	153,502.00	0.38
103	000997	新大陆	9,226	153,059.34	0.38
104	002390	信邦制药	14,600	153,008.00	0.37
105	002174	游族网络	8,900	152,813.00	0.37
106	002966	苏州银行	20,700	152,145.00	0.37
107	300058	蓝色光标	24,900	150,645.00	0.37
108	000738	航发控制	7,200	149,976.00	0.37
109	002146	荣盛发展	26,300	148,332.00	0.36
110	000401	冀东水泥	12,000	148,200.00	0.36
111	002506	协鑫集成	42,500	147,900.00	0.36
112	000686	东北证券	17,500	147,875.00	0.36
113	300315	掌趣科技	34,500	146,625.00	0.36

114	002268	卫 士 通	7,480	145,710.40	0.36
115	002408	齐翔腾达	11,694	145,239.48	0.36
116	002195	二 三 四 五	71,352	144,844.56	0.35
117	002958	青农商行	33,700	144,236.00	0.35
118	300017	网宿科技	24,500	143,325.00	0.35
119	000540	中天金融	52,200	142,506.00	0.35
120	000060	中金岭南	31,200	141,024.00	0.35
121	002831	裕同科技	4,680	138,949.20	0.34
122	000158	常山北明	12,000	137,880.00	0.34
123	002429	兆驰股份	22,600	137,182.00	0.34
124	000961	中南建设	22,900	135,568.00	0.33
125	002056	横店东磁	10,340	134,420.00	0.33
126	300212	易华录	4,980	134,011.80	0.33
127	000898	鞍钢股份	30,000	133,500.00	0.33
127	002595	豪迈科技	5,000	133,500.00	0.33
128	002081	金 螳 螂	16,800	133,056.00	0.33
129	002191	劲嘉股份	12,400	131,936.00	0.32
130	000581	威孚高科	6,300	131,229.00	0.32
131	000999	华润三九	4,900	131,075.00	0.32
132	002203	海亮股份	12,300	130,872.00	0.32
133	000709	河钢股份	52,700	129,642.00	0.32
134	000671	阳 光 城	24,900	129,480.00	0.32
135	300182	捷成股份	25,700	128,243.00	0.31
136	002281	光迅科技	5,200	127,920.00	0.31
137	000729	燕京啤酒	17,600	127,424.00	0.31
138	002242	九阳股份	3,900	126,711.00	0.31
139	002010	传化智联	16,400	126,444.00	0.31
140	000930	中粮科技	14,000	126,140.00	0.31
141	300166	东方国信	10,160	125,577.60	0.31
142	000488	晨鸣纸业	15,350	124,949.00	0.31
143	002124	天邦股份	17,800	124,778.00	0.31
144	002004	华邦健康	19,800	122,958.00	0.30
145	002048	宁波华翔	6,300	122,850.00	0.30
146	002745	木林森	9,100	121,940.00	0.30
147	002396	星网锐捷	5,700	121,695.00	0.30
148	002387	维信诺	11,600	120,988.00	0.30
149	002563	森马服饰	10,100	120,695.00	0.30
150	000629	攀钢钒钛	51,900	118,851.00	0.29
151	300002	神州泰岳	24,500	118,825.00	0.29
152	000598	兴蓉环境	22,400	116,704.00	0.29
153	002925	盈趣科技	2,960	115,173.60	0.28
154	000883	湖北能源	24,400	111,996.00	0.27

155	000690	宝新能源	21,800	111,398.00	0.27
156	000778	新兴铸管	29,900	111,228.00	0.27
157	000887	中鼎股份	9,200	111,136.00	0.27
158	002002	鸿达兴业	27,736	109,002.48	0.27
159	002867	周大生	5,400	106,758.00	0.26
160	002183	怡亚通	18,600	106,578.00	0.26
161	000528	柳工	12,920	105,944.00	0.26
162	002701	奥瑞金	20,492	105,328.88	0.26
163	002249	大洋电机	20,048	105,252.00	0.26
164	002705	新宝股份	4,000	105,000.00	0.26
165	002085	万丰奥威	18,500	103,600.00	0.25
166	000877	天山股份	7,940	103,458.20	0.25
167	002110	三钢闽光	15,300	103,122.00	0.25
168	000970	中科三环	10,700	102,185.00	0.25
169	000402	金融街	15,000	101,250.00	0.25
170	300072	三聚环保	17,600	101,024.00	0.25
171	002266	浙富控股	20,120	100,398.80	0.25
172	000089	深圳机场	12,800	99,456.00	0.24
173	002368	太极股份	4,924	98,775.44	0.24
174	002128	露天煤业	9,300	96,813.00	0.24
175	000990	诚志股份	7,600	96,748.00	0.24
176	000400	许继电气	7,600	96,216.00	0.24
177	300026	红日药业	22,500	95,625.00	0.23
178	000519	中兵红箭	8,733	93,617.76	0.23
179	002985	北摩高科	960	93,600.00	0.23
180	300376	易事特	11,600	93,264.00	0.23
181	002233	塔牌集团	9,000	92,520.00	0.23
182	003035	南网能源	9,225	91,696.50	0.22
183	000959	首钢股份	16,300	91,606.00	0.22
184	001914	招商积余	5,300	91,054.00	0.22
185	000090	天健集团	16,382	90,592.46	0.22
186	000685	中山公用	11,060	90,249.60	0.22
187	000559	万向钱潮	16,500	87,615.00	0.21
188	002505	鹏都农牧	38,630	86,531.20	0.21
189	002440	闰土股份	9,750	86,287.50	0.21
190	002839	张家港行	15,800	85,952.00	0.21
191	300133	华策影视	14,200	84,064.00	0.21
192	000967	盈峰环境	11,900	81,753.00	0.20
193	000758	中色股份	17,200	81,700.00	0.20
194	002155	湖南黄金	10,500	81,375.00	0.20
195	002038	双鹭药业	7,700	81,081.00	0.20
196	002936	郑州银行	21,940	80,519.80	0.20

197	000563	陕国投 A	24,854	80,029.88	0.20
198	002416	爱施德	7,820	78,434.60	0.19
199	000681	视觉中国	6,000	77,580.00	0.19
200	003022	联泓新科	2,500	76,750.00	0.19
201	300113	顺网科技	5,900	76,346.00	0.19
202	300741	华宝股份	1,500	76,080.00	0.19
203	002399	海普瑞	4,700	74,871.00	0.18
204	000415	渤海租赁	30,900	74,778.00	0.18
205	002458	益生股份	7,500	74,775.00	0.18
206	300180	华峰超纤	15,000	74,250.00	0.18
207	000028	国药一致	1,900	71,896.00	0.18
208	002317	众生药业	8,200	70,602.00	0.17
209	000717	韶钢松山	15,100	69,309.00	0.17
210	300257	开山股份	4,800	68,976.00	0.17
211	002434	万里扬	8,400	68,124.00	0.17
212	000501	鄂武商 A	5,778	67,602.60	0.17
213	000078	海王生物	20,600	67,156.00	0.16
214	000062	深圳华强	3,940	66,625.40	0.16
215	002375	亚厦股份	8,400	66,528.00	0.16
216	002244	滨江集团	15,600	65,364.00	0.16
217	002424	贵州百灵	8,800	64,768.00	0.16
218	000869	张裕 A	1,700	63,138.00	0.15
219	002901	大博医疗	800	58,312.00	0.14
220	000031	大悦城	16,100	57,960.00	0.14
220	002583	海能达	11,500	57,960.00	0.14
221	002468	申通快递	7,600	57,912.00	0.14
222	000826	启迪环境	10,400	55,640.00	0.14
223	002815	崇达技术	4,400	54,912.00	0.13
224	000156	华数传媒	7,000	53,970.00	0.13
225	000937	冀中能源	13,300	52,269.00	0.13
226	002532	天山铝业	6,200	52,018.00	0.13
227	000813	德展健康	11,300	51,302.00	0.13
228	002635	安洁科技	3,500	51,205.00	0.13
229	002948	青岛银行	10,300	51,191.00	0.13
230	000553	安道麦 A	5,500	50,985.00	0.12
231	002302	西部建设	6,400	50,560.00	0.12
232	300010	豆神教育	8,700	49,329.00	0.12
233	001872	招商港口	2,800	47,376.00	0.12
234	000061	农产品	8,500	46,920.00	0.11
235	002653	海思科	2,100	45,192.00	0.11
236	000046	泛海控股	19,500	44,850.00	0.11
237	002419	天虹股份	6,000	39,360.00	0.10

238	000537	广宇发展	7,000	36,610.00	0.09
239	002946	新乳业	2,100	31,815.00	0.08
240	000732	泰禾集团	12,500	27,000.00	0.07
241	002818	富森美	1,930	23,275.80	0.06
242	002423	中粮资本	2,300	20,815.00	0.05

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	003040	楚天龙	914	27,785.60	0.07
2	001207	联科科技	443	14,667.73	0.04
3	001208	华菱线缆	1,204	9,306.92	0.02
4	003041	真爱美家	233	6,593.90	0.02

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	000799	酒鬼酒	689,632.00	1.81
2	300253	卫宁健康	328,523.00	0.86
3	300037	新宙邦	324,387.00	0.85
4	002439	启明星辰	271,774.00	0.71
5	002422	科伦药业	271,461.00	0.71
6	300308	中际旭创	270,915.00	0.71
7	002127	南极电商	215,866.00	0.57
8	002180	纳思达	198,966.00	0.52
9	300383	光环新网	197,452.86	0.52
10	000723	美锦能源	187,257.00	0.49
11	002065	东华软件	183,870.00	0.48
12	002146	荣盛发展	157,537.00	0.41
13	300251	光线传媒	156,822.00	0.41
14	002958	青农商行	145,584.00	0.38
15	000961	中南建设	139,232.00	0.36
16	000671	阳光城	127,488.00	0.33
17	002340	格林美	88,984.00	0.23
18	300741	华宝股份	71,661.00	0.19
19	003022	联泓新科	68,875.00	0.18
20	002625	光启技术	67,732.00	0.18

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	300274	阳光电源	1,248,348.40	3.27
2	300012	华测检测	639,876.00	1.68
3	300595	欧普康视	561,315.20	1.47
4	300496	中科创达	523,187.00	1.37
5	002568	百润股份	397,480.00	1.04
6	002791	坚朗五金	289,295.00	0.76
7	002920	德赛西威	220,627.00	0.58
8	002064	华峰化学	218,578.00	0.57
9	000301	东方盛虹	205,477.00	0.54
10	002807	江阴银行	107,993.00	0.28
11	002217	合力泰	86,715.00	0.23
12	300459	金科文化	77,872.80	0.20
13	000564	*ST 大集	69,300.00	0.18
14	300324	旋极信息	61,364.16	0.16
15	002589	瑞康医药	60,469.50	0.16
16	300134	大富科技	56,998.40	0.15
17	002544	杰赛科技	56,760.00	0.15
18	000543	皖能电力	53,940.60	0.14
19	000008	神州高铁	53,436.00	0.14
20	300357	我武生物	48,620.00	0.13

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	5,394,701.58
卖出股票收入（成交）总额	5,703,923.69

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

无。

7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

无。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

无。

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

本基金投资的前十名证券的发行主体本期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	109.64
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	100.24
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	209.88

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

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 (%)
460	46,755.68	17,089,300.00	79.46	4,418,315.00	20.54

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	79.04
2	陈建仁	763,241.00	3.55
3	钱中明	519,300.00	2.41
4	邢秋珍	267,987.00	1.25
5	刘秀媛	250,000.00	1.16
6	康虎彪	150,000.00	0.70
7	黄连财	101,666.00	0.47
8	深圳市天鸿房地产经纪有限公司	88,800.00	0.41
9	王捷飞	84,728.00	0.39
10	叶子瑜	77,300.00	0.36

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（2013 年 9 月 12 日） 基金份额总额	333,508,962.00
本报告期期初基金份额总额	21,507,615.00
本报告期基金总申购份额	2,000,000.00
减：本报告期基金总赎回份额	2,000,000.00
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	21,507,615.00

§ 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

基金托管人的基金托管部门无重大人事变动。

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	
光大证券	2	11,024,711.55	100.00%	10,046.99	100.00%	-
安信证券	2	-	-	-	-	-
渤海证券	1	-	-	-	-	-
财信证券	1	-	-	-	-	-
长城证券	1	-	-	-	-	-
长江证券	2	-	-	-	-	-
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	-	-	-	-	-
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	大成中证 500 深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	大成中证 500 深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	大成中证 500 深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	大成中证 500 深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	大成中证 500 深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	大成基金管理有限公司关于基金经理张钟玉女士恢复履行职务的公告	中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站	2021 年 1 月 25 日
9	大成中证 500 深市交易型开放式指数证券投资基金第四季度报告	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 1 月 22 日

§ 11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

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	79.04

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大成中证 500 深市交易型开放式指数证券投资基金的文件；
- 2、《大成中证 500 深市交易型开放式指数证券投资基金基金合同》；
- 3、《大成中证 500 深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