

大成中证 500 深市交易型开放式指数证券  
投资基金  
2022 年中期报告

2022 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：2022 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 2022 年 8 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 2022 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	9
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	9
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明	10
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	11
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	11
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	12
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明	12
<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	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
<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 净资产（基金净值）变动表	15
6.4 报表附注	19
<b>§ 7 投资组合报告</b>	<b>41</b>
7.1 期末基金资产组合情况	41
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	42
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	43
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	49
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	50
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	50

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 .....	51
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 .....	51
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 .....	51
7.10 本基金投资股指期货的投资政策 .....	51
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 .....	51
7.12 投资组合报告附注 .....	51
<b>§ 8 基金份额持有人信息 .....</b>	<b>52</b>
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....	52
8.2 期末上市基金前十名持有人 .....	52
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....	53
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 .....	53
<b>§ 9 开放式基金份额变动 .....</b>	<b>53</b>
<b>§ 10 重大事件揭示 .....</b>	<b>53</b>
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
<b>§ 11 影响投资者决策的其他重要信息 .....</b>	<b>56</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 .....	56
11.2 影响投资者决策的其他重要信息 .....	57
<b>§ 12 备查文件目录 .....</b>	<b>57</b>
12.1 备查文件目录 .....	57
12.2 存放地点 .....	57
12.3 查阅方式 .....	57

## § 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	段皓静	许俊
	联系电话	0755-83183388	95566
	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		广东省深圳市南山区海德三道	北京市西城区复兴门内大街 1 号

	1236 号大成基金总部大厦 5 层、27-33 层	
办公地址	广东省深圳市南山区海德三道 1236 号大成基金总部大厦 5 层、27-33 层	北京市西城区复兴门内大街 1 号
邮政编码	518054	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(2022 年 1 月 1 日-2022 年 6 月 30 日)
本期已实现收益	-333,097.80
本期利润	-6,416,323.46
加权平均基金份额本期利润	-0.3055
本期加权平均净值利润率	-17.71%
本期基金份额净值增长率	-15.34%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2022 年 6 月 30 日)
期末可供分配利润	11,744,296.64
期末可供分配基金份额利润	0.5461
期末基金资产净值	37,134,860.04
期末基金份额净值	1.727
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2022 年 6 月 30 日)
基金份额累计净值增长率	46.30%

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。

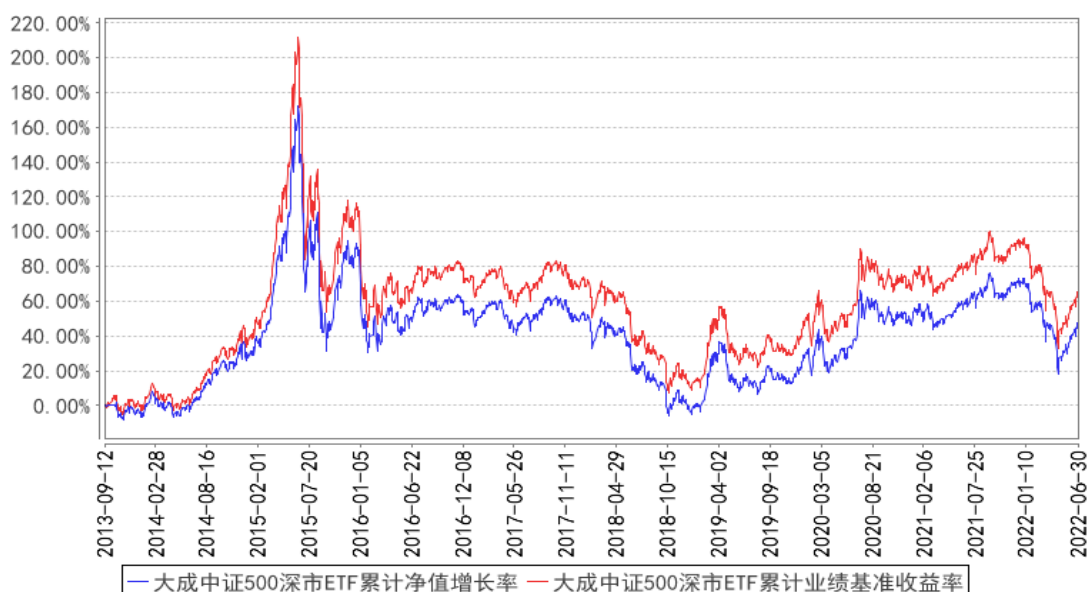
## 3.2 基金净值表现

### 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

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	7.87%	1.08%	7.73%	1.11%	0.14%	-0.03%
过去三个月	0.64%	1.77%	-0.15%	1.83%	0.79%	-0.06%
过去六个月	-15.34%	1.66%	-16.28%	1.70%	0.94%	-0.04%
过去一年	-9.01%	1.34%	-9.89%	1.38%	0.88%	-0.04%
过去三年	28.31%	1.41%	25.43%	1.44%	2.88%	-0.03%
自基金合同生效起至今	46.30%	1.65%	63.88%	1.67%	-17.58%	-0.02%

### 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，注册资本为 2 亿元人民币，注册地为深圳。目前公司由三家股东组成，分别为中泰信托有限责任公司(50%)、光大证券股份有限公司(25%)、中国银河投资管理有限公司(25%)。公司业务资质齐全，是全国同时具有境内、境外社保基金管理人资格和基本养老保险基金管理人资格的四家基金公司之一，全面涵盖公募基金、机构投资、海外投资、财富管理、养老金管理、私募股权投资等业务，旗下大成国际资产管理公司具备 QFII、RQFII 等资格。

历经 23 年的发展，大成基金形成了以长期投资能力为核心竞争优势，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。目前已形成权益、固定收益、量化投资、商品期货、境外投资、大类资产配置等六大投资团队，全面覆盖各类投资领域。

#### 4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
刘淼	本基金基金经理	2020 年 6 月 29 日	-	14 年	北京大学工商管理硕士。2008 年 4 月至 2011 年 5 月就职于招商基金管理有限公司，任基金核算部基金会计。2011 年 5 月加入大成基金管理有限公司，先后担任基金运营部基金会计、股票投资部投委会秘书兼风控员、数量与指数投资部数量分析师、指数与期货投资部基金经理、指数与期货投资部总监助理；曾担任深证成长 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助理。2017 年 9 月 14 日至 2021 年 9 月 1 日任大成中证 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



					<p>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 日起任大成中证红利指数证券投资基金基金经理。2021 年 9 月 2 日起任中证 500 沪市交易型开放式指数证券投资基金、大成中证 100 交易型开放式指数证券投资基金、大成深证成份交易型开放式指数证券投资基金基金经理。2022 年 6 月 28 日起任大成中证电池主题指数型发起式证券投资基金基金经理。2022 年 7 月 13 日起任大成中证上海环交所碳中和交易型开放式指数证券投资基金基金经理。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，针对同一基金经理管理的多个投资组合及私募兼任基金经理管理的多个投资组合的投资交易行为加强了公平交易监测与分析，包括对不同时间窗下（同日、3 日、5 日、10 日）

反向交易和同向交易价差监控的分析。分析结果表明：债券交易同向交易频率较低；部分股票同向交易溢价率较大主要来源于投资策略差异、市场因素（如个股当日价格振幅较高）及组合经理交易时机选择，即投资组合成交时间不一致以及成交价格的日内较大变动导致个别些组合间的成交价格差异较大，同时结合交易价差专项统计分析，未发现违反公平交易原则的异常情况。

### 4.3.2 异常交易行为的专项说明

报告期内，基金管理人旗下所有投资组合未发现存在异常交易行为。主动投资组合间股票交易存在 1 笔同日反向交易，原因为投资策略需要。主动型投资组合与指数型投资组合之间或指数型投资组合之间存在股票同日反向交易，但不存在参与交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量超过该股当日成交量 5% 的情形；主动投资组合间债券交易存在 2 笔同日反向交易，原因为流动性需要或合规比例调整。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

报告期内，A 股市场受一系列事件扰动，整体跌幅较大。主要指数方面，沪深 300 跌 9.22%；中证 500 跌 12.30%；创业板指跌 15.41%。行业上（中信分类），煤炭、消费者服务、交通运输录得正收益；而电子、传媒、综合金融则表现不佳。风格上，价值总体优于成长。

年初伊始，伴随着对国内经济压力的担忧及美债收益率上行的压制，A 股市场普遍调整，尤以高估值热门赛道为甚。春节后，“稳增长”板块继负面情绪一定程度的释放出现小幅反弹。然而，市场在二月下旬受外围地缘冲突影响，风险偏好再度下降。直至三月中，国务院金融稳定发展委员会召开专题会议释放积极信号，市场进入为期一个月左右的修复整理期，“稳增长”和“通胀”相关主题投资超额收益显著。四月中，部分地区疫情扩散，国内经济增长节奏被打乱，叠加海外货币紧缩、美股连续下跌，A 股市场重回一季度的调整状态。至当月 26 日，主流宽基指数均创阶段性新低。此后，在流动性宽松、疫情缓解和国内外经济周期错位等因素带动下，A 股市场对前期的超跌予以修正、持续反弹，同时表现出强烈的“以我为主”的特征。结构上，新能源有关的各细分板块表现突出，势头最为强劲。

本基金标的指数为中证 500 深市指数。中证 500 深市指数由中证 500 指数样本股中所有深市股票构成。本基金主要采取完全复制法，即按照标的指数的成份股及其权重构建基金股票投资组合，并根据标的指数成份股及其权重的变动而进行相应调整。

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

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末本基金份额净值为 1.727 元；本报告期基金份额净值增长率为-15.34%，业绩比较基准收益率为-16.28%。

#### 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，我们认为在稳增长政策密集落地的背景下国内经济整体趋势向好。节奏上，考虑到与疫情防控的平衡，复苏不会一蹴而就，尚需一些信心和耐心。结构上，因海外通胀韧性较强拖累出口，复苏或将由内需主导，消费的恢复则可能相对靠后一些。流动性方面，依旧保持充裕，但进一步宽松的概率较小。对于股票市场而言，由于上半年，内外部经济压力、突发地缘“黑天鹅”和疫情反复等因素在不同时间段对股市形成冲击，导致投资者对影响股市的短期因素反映过度，形成超跌。5-6 月份，市场对于二季度经济预期比较充分，相对来说宏观环境波动较小，流动性推升成长板块修复。下半年，经济复苏的节奏和持续性可能仍会影响市场的波动和风格。但伴随不利影响的钝化、经济活力的提升，投资终将回归到寻找中长期能兑现的确定性上来。整体上，市场评估 A 股市场下半年或将保持震荡向上的格局。

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、固定收益总部、研究部、指数与期货投资部、大类资产配置部、权益专户投资部、国际业务部、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七名投资组合经理。

股票投资部、固定收益总部、研究部、指数与期货投资部、大类资产配置部、权益专户投资部、国际业务部、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：2022 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2022 年 6 月 30 日	上年度末 2021 年 12 月 31 日
<b>资产：</b>			
银行存款	6.4.7.1	1,403,841.24	1,098,942.69
结算备付金		-	-
存出保证金		115.22	72.80
交易性金融资产	6.4.7.2	35,849,497.11	40,832,341.28
其中：股票投资		35,816,217.98	40,832,341.28
基金投资		-	-
债券投资		33,279.13	-
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		-	-
应收股利		-	-
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.8	-	129.98
资产总计		37,253,453.57	41,931,486.75
<b>负债和净资产</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2022 年 6 月 30 日</b>	<b>上年度末 2021 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	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-

应付清算款		-	-
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		14,712.64	18,096.56
应付托管费		2,942.55	3,619.29
应付销售服务费		-	-
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	100,938.34	81,818.05
负债合计		118,593.53	103,533.90
<b>净资产：</b>			
实收基金	6.4.7.10	25,390,563.40	24,210,025.09
其他综合收益	6.4.7.11	-	-
未分配利润	6.4.7.12	11,744,296.64	17,617,927.76
净资产合计		37,134,860.04	41,827,952.85
负债和净资产总计		37,253,453.57	41,931,486.75

注：报告截止日 2022 年 06 月 30 日，基金份额净值 1.727 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：2022 年 1 月 1 日至 2022 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
		2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日	2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
<b>一、营业总收入</b>		-6,268,177.48	2,698,663.33
1. 利息收入		1,980.41	1,374.39
其中：存款利息收入	6.4.7.13	1,980.41	1,374.39
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）		-186,932.23	2,080,480.86
其中：股票投资收益	6.4.7.14	-540,517.26	1,782,364.19
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.15	1,404.66	-
资产支持证券投资	6.4.7.16	-	-
收益		-	-

贵金属投资收益	6.4.7.17	-	-
衍生工具收益	6.4.7.18	-	-
股利收益	6.4.7.19	352,180.37	298,116.67
以摊余成本计量的金融资产终止确认产生的收益		-	-
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	-6,083,225.66	618,520.08
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.21	-	-1,712.00
<b>减：二、营业总支出</b>		148,145.98	174,406.98
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	89,939.50	97,493.53
2. 托管费	6.4.10.2.2	17,987.94	19,498.69
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	-	-
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		-	-
8. 其他费用	6.4.7.23	40,218.54	57,414.76
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		-6,416,323.46	2,524,256.35
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		-6,416,323.46	2,524,256.35
<b>五、其他综合收益的税后净额</b>		-	-
<b>六、综合收益总额</b>		-6,416,323.46	2,524,256.35

### 6.3 净资产（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：2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 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（基金净值）	24,210,025.09	-	17,617,927.76	41,827,952.85

加:会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期末期初净资产(基金净值)	24,210,025.09	-	17,617,927.76	41,827,952.85
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	1,180,538.31	-	-5,873,631.12	-4,693,092.81
(一)、综合收益总额	-	-	-6,416,323.46	-6,416,323.46
(二)、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	-	542,692.34	1,723,230.65
其中:1.基金申购款	1,180,538.31	-	542,692.34	1,723,230.65
2.基金赎回款	-	-	-	-
(三)、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)				
(四)、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期末净资产(基金净值)	25,390,563.40	-	11,744,296.64	37,134,860.04
项目	上年度可比期间 2021 年 1 月 1 日至 2021 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(基金净值)	25,390,563.41	-	12,782,880.04	38,173,443.45
加:会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产(基金净值)	25,390,563.41	-	12,782,880.04	38,173,443.45
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	-	-	2,637,421.30	2,637,421.30
(一)、综合收益总额	-	-	2,524,256.35	2,524,256.35
(二)、本期基金份额交易产	-	-	113,164.95	113,164.95

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	2,361,076.62	-	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
（三）、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）	-	-	-	-
（四）、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期末净资产（基金净值）	25,390,563.41	-	15,420,301.34	40,810,864.75

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

基金管理人负责人

范瑛

主管会计工作负责人

孙蕊

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 500 深市交易型开放式指数证券投资基金（以下简称“本基金”），系经中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）证监许可[2013]780 号文“关于核准大成中证 500 深市交易型开放式指数证券投资基金募集的批复”的核准，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 500 深市交易型开放式指数证券投资基金基金合同》作为发起人向社会公开募集，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(2013)验字第 60469430\_H12 号验资报告后，向中国证监会报送基金备案材料。基金合同于 2013 年 9 月 12 日生效。本基金为交易型开放式，存续期限不定。

本基金募集期间为 2013 年 8 月 19 日至 2013 年 9 月 6 日，首次发售募集的有效认购资金扣除认购费后的净认购金额为人民币 333,486,098.00 元，折合 333,486,098.00 份基金份额；有效认购资金在首次发售募集期内产生的利息为人民币 22,864.00 元，折合 22,864.00 份基金份额；以上收到的资金共计人民币 333,508,962.00 元，折合 333,508,962.00 份基金份额。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”）。

本基金主要投资于标的指数成份股和备选成份股，本基金还可投资于国内依法发行上市的非标的指数成份股（包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票）、存托凭证、新股、债券（含中期票据）、货币市场工具、银行存款、权证、股指期货、资产支持证券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（但须符合中国证监会的相关规定）。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。本基金投资于标的指数成份股和备选成份股的资产比例不低于非现金基金资产的 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。

本基金的业绩比较基准为标的指数，本基金标的指数为中证 500 深市价格指数（代码：399802）。

### 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、解释以及其他相关规定（以下合称“企业会计准则”）编制，同时，对于在具体会计核算和信息披露方面，也参考了中国证券投资基金业协会修订并发布的《证券投资基金会计核算业务指引》、中国证监会制定的《中国证券监督管理委员会关于证券投资基金估值业务的指导意见》、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》、《证券投资基金信息披露内容与格式准则》第 2 号《年度报告的内容与格式》、《证券投资基金信息披露编报规则》第 3 号《会计报表附注的

编制及披露》、《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号〈年度报告和中期报告〉》及其他中国证监会及中国证券投资基金业协会颁布的相关规定。

根据《公开募集证券投资基金运作管理办法》的相关规定，开放式基金在基金合同生效后，连续 60 个工作日出现基金份额持有人数量不满 200 人或者基金资产净值低于 5,000 万元情形的，基金管理人应当向中国证监会报告并提出解决方案，如转换运作方式、与其他基金合并或者终止基金合同等，并召开基金份额持有人大会进行表决。于 2021 年 12 月 31 日，本基金出现连续 60 个工作日基金资产净值低于 5,000 万元的情形，本基金的基金管理人已向中国证监会报告并在评估后继续处理方案，故本财务报表仍以持续经营为基础编制。

#### 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 2022 年 6 月 30 日的财务状况以及自 2022 年 1 月 1 日起至 2022 年 6 月 30 日止期间的经营成果和净值变动情况。

#### 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

除下述变更后的会计政策外，本基金报告期所采用的其他会计政策、会计估计与最近一期年度会计报表所采用的会计政策、会计估计一致。

##### 一、金融资产和金融负债的分类

金融工具是指形成本基金的金融资产（或负债），并形成其他单位的金融负债（或资产）或权益工具的合同。

##### （3）金融资产分类

本基金的金融资产于初始确认时根据管理金融资产的业务模式和金融资产的合同现金流量特征分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、以摊余成本计量的金融资产；

##### （4）金融负债分类

除了由于金融资产转移不符合终止确认条件或继续涉入被转移金融资产所形成的金融负债以外，本基金的金融负债于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债、以摊余成本计量的金融负债。

##### 二、金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

本基金于成为金融工具合同的一方时确认一项金融资产或金融负债。

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

划分为以摊余成本计量的金融资产和金融负债，按照取得时的公允价值作为初始确认金额，

相关交易费用计入其初始确认金额。

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

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

本基金以预期信用损失为基础，对以摊余成本计量的金融资产进行减值处理并确认损失准备。对于不含重大融资成分的应收款项，本基金运用简化计量方法，按照相当于整个存续期内的预期信用损失金额计量损失准备。除上述采用简化计量方法以外的金融资产，本基金在每个估值日评估其信用风险自初始确认后是否已经显著增加，如果信用风险自初始确认后未显著增加，处于第一阶段，本基金按照相当于未来 12 个月内预期信用损失的金额计量损失准备，并按照账面余额和实际利率计算利息收入；如果信用风险自初始确认后已显著增加但尚未发生信用减值的，处于第二阶段，本基金按照相当于整个存续期内预期信用损失的金额计量损失准备，并按照账面余额和实际利率计算利息收入；如果初始确认后发生信用减值的，处于第三阶段，本基金按照相当于整个存续期内预期信用损失的金额计量损失准备，并按照摊余成本和实际利率计算利息收入。

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

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

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

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

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

本基金已将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方的，终止确认该金融资产；保留了金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬的，不终止确认该金融资产；本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬的，分别下列情况处理：放弃了对该金融资

产控制的，终止确认该金融资产并确认产生的资产和负债；未放弃对该金融资产控制的，按照其继续涉入所转移金融资产的程度确认有关金融资产，并相应确认有关负债。

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

### 三、收入/（损失）的确认和计量

（4）对于以摊余成本计量的金融资产，采用实际利率法计算的利息扣除在适用情况下的相关税费后的净额确认利息收入，计入当期损益。处置时，其处置价格扣除相关交易费用后的净额与账面价值之间的差额确认为投资收益。

（5）对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和金融负债，相关交易费用直接计入投资收益。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产为债权投资的，在持有期间将按票面或合同利率计算的利息收入扣除在适用情况下的相关税费后的净额计入投资收益，扣除该部分利息后的公允价值变动额计入公允价值变动损益；除上述之外的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和金融负债的公允价值变动形成的应计入当期损益的利得或损失扣除在适用情况下预估的增值税费后的净额计入公允价值变动损益。处置时，其处置价格与初始确认金额之间的差额扣除相关交易费用及在适用情况下的相关税费后的净额确认为投资收益。

本基金在同时符合下列条件时确认股利收入并计入当期损益：1）基金收取股利的权利已经确立；2）与股利相关的经济利益很可能流入企业；3）股利的金额能够可靠计量。

（6）其他收入在经济利益很可能流入从而导致资产增加或者负债减少、且经济利益的流入额能够可靠计量时确认。

## 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

#### 新金融工具准则

根据《企业会计准则第 22 号——金融工具确认和计量》、《企业会计准则第 23 号——金融资产转移》、《企业会计准则第 24 号——套期会计》、《企业会计准则第 37 号——金融工具列报》（统称“新金融工具准则”）、《关于进一步贯彻落实新金融工具相关会计准则的通知》的规定和相关法规的要求，本基金自 2022 年 1 月 1 日开始按照新金融工具准则进行会计处理，根据衔接规定，对可比期间信息不予调整，首日执行新金融工具准则与现行准则的差异追溯调整本报告期期初未分配利润。

新金融工具准则改变了金融资产的分类和计量方式，确定了三个主要的计量类别：摊余成本；以公允价值计量且其变动计入其他综合收益；以公允价值计量且其变动计入当期损益。本基金考虑自身业务模式，以及金融资产的合同现金流特征进行上述分类。

新金融工具准则要求金融资产减值计量由“已发生损失模型”改为“预期信用损失模型”，适用于以摊余成本计量的金融资产。金融资产减值计量的变更对于本基金的影响不重大。

本基金将基于实际利率法计提的金融工具的利息包含在相应金融工具的账面余额中，并反映在相关“银行存款”、“结算备付金”、“存出保证金”、“买入返售金融资产”、“卖出回购金融资产款”等项目中，不单独列示“应收利息”项目或“应付利息”项目。

在首次执行日，原金融资产账面价值调整为按照修订后金融工具确认和计量准则的规定进行分类和计量的新金融资产账面价值的调节表：

#### 账面价值

##### 银行存款

2021 年 12 月 31 日，按原金融工具准则列示的余额 1,098,942.69

重分类：转入自应收利息 129.80

重新计量：预期信用损失准备 -

2022 年 1 月 1 日，按新金融工具准则列示的余额 1,099,072.49

##### 结算备付金

2021 年 12 月 31 日，按原金融工具准则列示的余额 -

重分类：转入自应收利息 0.18

重新计量：预期信用损失准备 -

2022 年 1 月 1 日，按新金融工具准则列示的余额 0.18

##### 存出保证金

2021 年 12 月 31 日，按原金融工具准则列示的余额 72.80

重分类：转入自应收利息 -

重新计量：预期信用损失准备 -

2022 年 1 月 1 日，按新金融工具准则列示的余额 72.80

##### 交易性金融资产

2021 年 12 月 31 日，按原金融工具准则列示的余额 40,832,341.28

重分类：转入自应收利息 -

2022 年 1 月 1 日，按新金融工具准则列示的余额 40,832,341.28

## 买入返售金融资产

2021 年 12 月 31 日, 按原金融工具准则列示的余额 -

重分类: 转入自应收利息 -

重新计量: 预期信用损失准备 -

2022 年 1 月 1 日, 按新金融工具准则列示的余额 -

## 应收利息

2021 年 12 月 31 日, 按原金融工具准则列示的余额 129.98

重分类: 转出至银行存款 -129.80

重分类: 转出至结算备付金 -0.18

重分类: 转出至存出保证金 -

重分类: 转出至交易性金融资产 -

重分类: 转出至买入返售金融资产 -

重分类: 转出至应收申购款 -

重分类: 转出至其他资产 -

2022 年 1 月 1 日, 按新金融工具准则列示的余额 不适用

## 应收申购款

2021 年 12 月 31 日, 按原金融工具准则列示的余额 -

重分类: 转入自应收利息 -

重新计量: 预期信用损失准备 -

2022 年 1 月 1 日, 按新金融工具准则列示的余额 -

## 其他资产

2021 年 12 月 31 日, 按原金融工具准则列示的余额 -

重分类: 转入自应收利息 -

重新计量: 预期信用损失准备 -

2022 年 1 月 1 日, 按新金融工具准则列示的余额 -

## 卖出回购金融资产款

2021 年 12 月 31 日, 按原金融工具准则列示的余额 -

重分类: 转入自应付利息 -

2022 年 1 月 1 日, 按新金融工具准则列示的余额 -

## 应付利息



2021 年 12 月 31 日，按原金融工具准则列示的余额 -

重分类：转出至卖出回购金融资产款 -

2022 年 1 月 1 日，按新金融工具准则列示的余额 不适用

#### 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。

##### 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。

### 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。

## 6.4.7 重要财务报表项目的说明

### 6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2022 年 6 月 30 日
活期存款	1,403,841.24
等于：本金	1,403,722.65
加：应计利息	118.59
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	1,403,841.24

### 6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2022 年 6 月 30 日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	38,704,454.88	-	35,816,217.98	-2,888,236.90

贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	-	
债券	交易所市场	26,700.00	10.88	33,279.13	6,568.25
	银行间市场	-	-	-	-
	合计	26,700.00	10.88	33,279.13	6,568.25
资产支持证券	-	-	-	-	
基金	-	-	-	-	
其他	-	-	-	-	
合计	38,731,154.88	10.88	35,849,497.11	-2,881,668.65	

#### 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

无。

##### 6.4.7.3.2 期末基金持有的期货合约情况

无。

##### 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 2022 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	7,642.95
其中：交易所市场	7,642.95
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用	84,712.18
应付指数使用费	8,583.21
合计	100,938.34

## 6.4.7.10 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	20,507,615.00	24,210,025.09
本期申购	1,000,000.00	1,180,538.31
本期赎回（以“-”号填列）	-	-
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	21,507,615.00	25,390,563.40

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

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
本期期初	30,804,229.37	-13,186,301.61	17,617,927.76
本期利润	-333,097.80	-6,083,225.66	-6,416,323.46
本期基金份额交易产生的变动数	1,500,148.00	-957,455.66	542,692.34
其中：基金申购款	1,500,148.00	-957,455.66	542,692.34
基金赎回款	-	-	-
本期已分配利润	-	-	-
本期末	31,971,279.57	-20,226,982.93	11,744,296.64

## 6.4.7.13 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
	活期存款利息收入
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	74.71
其他	0.95
合计	1,980.41

## 6.4.7.14 股票投资收益

单位：人民币元

项目	本期
----	----

	2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
卖出股票成交总额	5,432,077.23
减：卖出股票成本总额	5,958,631.63
减：交易费用	13,962.86
买卖股票差价收入	-540,517.26

#### 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 2022年1月1日至2022年6月30日
债券投资收益——利息收入	11.46
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	1,393.20
债券投资收益——赎回差价收入	-
债券投资收益——申购差价收入	-
合计	1,404.66

##### 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 2022年1月1日至2022年6月30日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	5,394.00
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	4,000.00
减：应计利息总额	0.58
减：交易费用	0.22
买卖债券差价收入	1,393.20

#### 6.4.7.16 资产支持证券投资收益

无。

#### 6.4.7.17 贵金属投资收益

无。

#### 6.4.7.18 衍生工具收益

无。

## 6.4.7.19 股利收益

单位：人民币元

项目	本期
	2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
股票投资产生的股利收益	352,180.37
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	352,180.37

## 6.4.7.20 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期
	2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
1. 交易性金融资产	-6,083,225.66
股票投资	-6,089,793.91
债券投资	6,568.25
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	-6,083,225.66

## 6.4.7.21 其他收入

无。

## 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
	2022 年 1 月 1 日至 2022 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	110.00

指数使用费	5,396.36
合计	40,218.54

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。

#### 6.4.8 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。

##### 6.4.9.2 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
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。

#### 6.4.10 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 2022年1月1日至2022年6月30日		上年度可比期间 2021年1月1日至2021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	10,663,280.22	100.00	11,024,711.55	100.00

###### 6.4.10.1.2 债券交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2022年1月1日至2022年6月30日		上年度可比期间 2021年1月1日至2021年6月30日	
	成交金额	占当期债券 成交总额的比例 (%)	成交金额	占当期债券 成交总额的比例 (%)
光大证券	5,394.00	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 2022年1月1日至2022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	7,690.46	100.00	7,642.95	100.00
关联方名称	上年度可比期间 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

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 2022年1月1日至2022年6 月30日	上年度可比期间 2021年1月1日至2021年 6月30日
	当期发生的基金应支付的管理费	89,939.50
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 0.50% 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

#### 6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	17,987.94	19,498.69

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

#### 6.4.10.2.3 销售服务费

无。

#### 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自有资金投资本基金的情况

份额单位：份

项目	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2021 年 1 月 1 日至 2021 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	-	-
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。

#### 6.4.10.5.2 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 2022年1月1日至2022年6月30日		上年度可比期间 2021年1月1日至2021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	1,403,841.24	1,904.75	1,156,321.42	1,335.22

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(2022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

6.4.12.1.2 受限证券类别：债券										
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：张)	期末成本总额	期末估值总额	备注
127064	杭氧转债	2022年5月19日	1-6个月(含)	新债未上市	100.00	100.02	52	5,200.00	5,200.98	-

#### 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
002670	国盛金控	2022年6月1日	重大事项	9.60	2022年07月14日	9.99	14,340	163,572.48	137,664.00	-

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。

#### 6.4.12.3 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。

#### 6.4.13.2 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以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，违约风险可能性很小；在银行间同业市场进行交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式进行限制以控制相应的信用风险。

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

于本期末，本基金持有的除国债、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 0.09%(上年度末：无)。

#### 6.4.13.3 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。

##### 6.4.13.3.1 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%。

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。

##### 6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2022 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	1,403,841.24	-	-	-	1,403,841.24
存出保证金	115.22	-	-	-	115.22

交易性金融资产	-	-	33,279.13	35,816,217.98	35,849,497.11
资产总计	1,403,956.46	-	33,279.13	35,816,217.98	37,253,453.57
负债					
应付管理人报酬	-	-	-	14,712.64	14,712.64
应付托管费	-	-	-	2,942.55	2,942.55
其他负债	-	-	-	100,938.34	100,938.34
负债总计	-	-	-	118,593.53	118,593.53
利率敏感度缺口	1,403,956.46	-	33,279.13	35,697,624.45	37,134,860.04
上年度末 2021 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	1,098,942.69	-	-	-	1,098,942.69
存出保证金	72.80	-	-	-	72.80
交易性金融资产	-	-	-	40,832,341.28	40,832,341.28
其他资产	-	-	-	129.98	129.98
资产总计	1,099,015.49	-	-	40,832,471.26	41,931,486.75
负债					
应付管理人报酬	-	-	-	18,096.56	18,096.56
应付托管费	-	-	-	3,619.29	3,619.29
其他负债	-	-	-	81,818.05	81,818.05
负债总计	-	-	-	103,533.90	103,533.90
利率敏感度缺口	1,099,015.49	-	-	40,728,937.36	41,827,952.85

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。

#### 6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

于本期末，本基金持有的交易性债券投资公允价值占基金资产净值的比例为 0.09%(上年度末：无)，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)。

#### 6.4.13.4.2 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。

#### 6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2022年6月30日		上年度末 2021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	35,816,217.98	96.45	40,832,341.28	97.62
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	35,816,217.98	96.45	40,832,341.28	97.62

#### 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		
	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（2022年6月30日）	上年度末（2021年12月31日）
分析	业绩比较基准上升 5%	1,804,445.28	2,035,694.33
	业绩比较基准下降 5%	-1,804,445.28	-2,035,694.33

#### 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 2022 年 6 月 30 日	上年度末 2021 年 12 月 31 日
第一层次	35,706,632.13	40,828,671.62
第二层次	142,864.98	3,669.66
第三层次	-	-
合计	35,849,497.11	40,832,341.28

##### 6.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

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

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	35,816,217.98	96.14
	其中：股票	35,816,217.98	96.14
2	基金投资	-	-

3	固定收益投资	33,279.13	0.09
	其中：债券	33,279.13	0.09
	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	1,403,841.24	3.77
8	其他各项资产	115.22	0.00
9	合计	37,253,453.57	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	482,440.00	1.30
B	采矿业	1,027,990.76	2.77
C	制造业	23,596,119.85	63.54
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	552,606.00	1.49
E	建筑业	78,232.00	0.21
F	批发和零售业	428,692.70	1.15
G	交通运输、仓储和邮政业	308,032.00	0.83
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	2,866,175.78	7.72
J	金融业	2,524,342.29	6.80
K	房地产业	917,118.00	2.47
L	租赁和商务服务业	694,363.00	1.87
M	科学研究和技术服务业	683,563.00	1.84
N	水利、环境和公共设施管理业	317,968.80	0.86
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	166,074.00	0.45
R	文化、体育和娱乐业	770,228.00	2.07
S	综合	402,271.80	1.08
	合计	35,816,217.98	96.45

## 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

本基金本报告期末未持有积极投资股票。

## 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	300769	德方纳米	1,200	490,416.00	1.32
2	300012	华测检测	17,800	413,138.00	1.11
3	000009	中国宝安	29,820	402,271.80	1.08
4	002497	雅化集团	12,300	401,595.00	1.08
5	002407	多氟多	8,200	401,062.00	1.08
6	002240	盛新锂能	6,500	392,340.00	1.06
7	002180	纳思达	7,700	389,774.00	1.05
8	300390	天华超净	4,400	384,560.00	1.04
9	002384	东山精密	15,800	362,294.00	0.98
10	300073	当升科技	3,800	343,292.00	0.92
11	002756	永兴材料	2,200	334,862.00	0.90
12	300285	国瓷材料	9,300	334,056.00	0.90
13	000983	山西焦煤	23,700	317,343.00	0.85
14	300037	新宙邦	6,020	316,411.20	0.85
15	002385	大北农	38,300	299,123.00	0.81
16	300363	博腾股份	3,800	296,362.00	0.80
17	002268	卫士通	6,880	295,220.80	0.79
18	000519	中兵红箭	9,733	283,716.95	0.76
19	000630	铜陵有色	85,000	277,100.00	0.75
20	002353	杰瑞股份	6,700	270,010.00	0.73
21	000988	华工科技	11,600	268,772.00	0.72
22	300144	宋城演艺	16,700	256,345.00	0.69
23	002028	思源电气	7,065	251,937.90	0.68
24	002056	横店东磁	9,440	251,292.80	0.68
25	002797	第一创业	38,800	248,708.00	0.67
26	000932	华菱钢铁	47,840	243,505.60	0.66
27	000783	长江证券	41,000	243,130.00	0.65
28	002185	华天科技	25,900	242,942.00	0.65
29	002625	光启技术	13,700	236,599.00	0.64
30	002603	以岭药业	9,700	235,710.00	0.63

31	300146	汤臣倍健	10,800	233,820.00	0.63
32	300724	捷佳伟创	2,600	232,310.00	0.63
33	000830	鲁西化工	13,300	229,957.00	0.62
34	002078	太阳纸业	18,600	228,966.00	0.62
35	002507	涪陵榨菜	6,600	227,832.00	0.61
36	002326	永太科技	6,500	214,045.00	0.58
37	000738	航发控制	7,600	213,560.00	0.58
38	000970	中科三环	11,300	212,214.00	0.57
39	300699	光威复材	3,600	211,932.00	0.57
40	300088	长信科技	28,400	210,728.00	0.57
41	000999	华润三九	4,600	207,000.00	0.56
42	002624	完美世界	14,400	206,928.00	0.56
43	002557	洽洽食品	3,600	204,948.00	0.55
44	002138	顺络电子	7,500	204,375.00	0.55
45	002572	索菲亚	7,400	203,500.00	0.55
46	000998	隆平高科	12,200	203,252.00	0.55
47	002673	西部证券	31,000	202,740.00	0.55
48	002422	科伦药业	10,600	198,220.00	0.53
49	002508	老板电器	5,500	198,165.00	0.53
50	000807	云铝股份	20,000	197,600.00	0.53
51	000039	中集集团	14,260	197,501.00	0.53
52	000831	五矿稀土	6,300	196,875.00	0.53
53	002030	达安基因	11,381	195,639.39	0.53
54	000960	锡业股份	11,600	194,532.00	0.52
55	002465	海格通信	21,300	193,617.00	0.52
56	300676	华大基因	2,700	193,590.00	0.52
57	300357	我武生物	3,700	192,511.00	0.52
58	000629	攀钢钒钛	49,700	188,860.00	0.51
59	300136	信维通信	11,200	188,720.00	0.51
60	000728	国元证券	30,300	188,466.00	0.51
61	300058	蓝色光标	28,800	188,064.00	0.51
62	000975	银泰黄金	19,224	187,241.76	0.50
63	002439	启明星辰	9,200	183,356.00	0.49
64	002409	雅克科技	3,300	183,183.00	0.49
65	300474	景嘉微	2,650	181,233.50	0.49
66	002372	伟星新材	7,420	178,376.80	0.48
67	002273	水晶光电	14,716	178,210.76	0.48
68	002223	鱼跃医疗	6,938	178,029.08	0.48
69	300418	昆仑万维	11,100	177,600.00	0.48
70	000547	航天发展	14,800	176,712.00	0.48
71	002739	万达电影	12,900	176,085.00	0.47
72	002506	协鑫集成	47,300	175,956.00	0.47

73	300308	中际旭创	5,600	173,880.00	0.47
74	300253	卫宁健康	19,800	173,844.00	0.47
75	300296	利亚德	23,500	171,550.00	0.46
76	002092	中泰化学	21,900	169,944.00	0.46
77	000636	风华高科	8,900	167,231.00	0.45
78	002156	通富微电	10,800	166,320.00	0.45
79	300244	迪安诊断	5,340	166,074.00	0.45
80	000887	中鼎股份	9,100	165,984.00	0.45
81	002294	信立泰	5,900	165,790.00	0.45
82	002299	圣农发展	8,600	164,948.00	0.44
83	300558	贝达药业	2,700	164,160.00	0.44
84	300026	红日药业	20,800	160,160.00	0.43
85	002936	郑州银行	59,364	159,689.16	0.43
86	000750	国海证券	43,960	159,574.80	0.43
87	000623	吉林敖东	10,800	159,408.00	0.43
88	002203	海亮股份	13,700	158,235.00	0.43
89	000729	燕京啤酒	16,300	157,458.00	0.42
90	000513	丽珠集团	4,330	156,789.30	0.42
91	002683	广东宏大	5,600	155,848.00	0.42
92	300832	新产业	3,400	153,374.00	0.41
93	300017	网宿科技	28,300	151,688.00	0.41
94	002131	利欧股份	77,988	151,296.72	0.41
95	002444	巨星科技	8,000	150,720.00	0.41
96	300618	寒锐钴业	2,600	150,592.00	0.41
97	002065	东华软件	23,800	150,416.00	0.41
98	300383	光环新网	14,398	150,027.16	0.40
99	002195	二三四五	66,052	148,617.00	0.40
100	002408	齐翔腾达	18,071	146,555.81	0.39
101	000878	云南铜业	12,700	144,653.00	0.39
102	300024	机器人	14,300	144,144.00	0.39
103	000400	许继电气	7,500	144,000.00	0.39
104	000825	太钢不锈	26,300	143,335.00	0.39
105	002500	山西证券	24,880	142,811.20	0.38
106	002926	华西证券	18,200	142,688.00	0.38
107	002373	千方科技	12,800	142,336.00	0.38
108	000050	深天马 A	14,200	141,574.00	0.38
109	000027	深圳能源	22,020	141,148.20	0.38
110	002430	杭氧股份	4,500	140,670.00	0.38
111	000739	普洛药业	6,800	140,352.00	0.38
112	002250	联化科技	8,544	139,865.28	0.38
113	002183	怡亚通	19,300	139,153.00	0.37
114	002212	天融信	13,700	139,055.00	0.37

115	002670	国盛金控	14,340	137,664.00	0.37
116	002958	青农商行	41,200	136,784.00	0.37
117	002985	北摩高科	2,318	135,788.44	0.37
118	300001	特锐德	7,800	135,018.00	0.36
119	000060	中金岭南	30,200	134,692.00	0.36
120	300009	安科生物	13,276	134,220.36	0.36
121	002249	大洋电机	21,848	134,146.72	0.36
122	002152	广电运通	14,400	133,488.00	0.36
123	000778	新兴铸管	27,600	133,032.00	0.36
124	300182	捷成股份	23,800	130,900.00	0.35
125	300070	碧水源	25,100	130,771.00	0.35
126	002831	裕同科技	4,380	129,429.00	0.35
127	300168	万达信息	13,700	129,328.00	0.35
128	002966	苏州银行	21,160	129,076.00	0.35
129	300251	光线传媒	13,600	128,792.00	0.35
130	002191	劲嘉股份	11,900	127,568.00	0.34
131	002128	电投能源	8,900	127,448.00	0.34
132	000401	冀东水泥	12,100	127,292.00	0.34
133	300482	万孚生物	3,110	126,608.10	0.34
134	000997	新大陆	9,526	125,838.46	0.34
135	000021	深科技	10,800	125,712.00	0.34
136	002505	鹏都农牧	36,830	124,853.70	0.34
137	002244	滨江集团	14,400	124,560.00	0.34
138	300677	英科医疗	4,900	124,264.00	0.33
139	002221	东华能源	13,300	123,823.00	0.33
140	000987	越秀金控	17,415	122,427.45	0.33
141	002396	星网锐捷	5,400	122,256.00	0.33
142	002127	南极电商	22,700	121,218.00	0.33
143	002019	亿帆医药	8,600	120,228.00	0.32
144	002155	湖南黄金	9,800	118,972.00	0.32
145	002266	浙富控股	24,820	118,887.80	0.32
146	000930	中粮科技	13,000	117,520.00	0.32
147	000012	南玻 A	15,838	117,517.96	0.32
148	000883	湖北能源	22,800	116,508.00	0.31
149	002153	石基信息	7,320	116,168.40	0.31
150	002124	天邦食品	17,000	114,240.00	0.31
151	000686	东北证券	16,300	113,937.00	0.31
152	002511	中顺洁柔	9,100	113,932.00	0.31
153	000656	金科股份	39,600	113,256.00	0.30
154	000581	威孚高科	5,800	111,650.00	0.30
155	000709	河钢股份	48,900	110,514.00	0.30
156	000690	宝新能源	25,200	110,376.00	0.30

157	002939	长城证券	10,800	109,728.00	0.30
158	300376	易事特	13,400	108,808.00	0.29
159	002701	奥瑞金	20,692	107,598.40	0.29
160	300630	普利制药	3,058	107,488.70	0.29
161	002002	鸿达兴业	28,936	107,352.56	0.29
162	002532	天山铝业	16,200	105,786.00	0.28
163	000598	兴蓉环境	20,700	105,777.00	0.28
164	002595	豪迈科技	4,700	104,998.00	0.28
165	300463	迈克生物	5,000	102,450.00	0.28
166	002004	华邦健康	18,300	102,114.00	0.27
167	002745	木林森	10,300	100,631.00	0.27
168	300115	长盈精密	9,744	100,460.64	0.27
169	002468	申通快递	8,200	97,744.00	0.26
170	002390	信邦制药	14,100	97,431.00	0.26
171	000540	中天金融	48,600	93,798.00	0.25
172	300888	稳健医疗	1,400	93,100.00	0.25
173	000785	居然之家	20,800	92,560.00	0.25
174	002429	兆驰股份	24,100	92,544.00	0.25
175	000089	深圳机场	11,900	91,868.00	0.25
176	300166	东方国信	9,960	91,831.20	0.25
177	000937	冀中能源	12,300	91,758.00	0.25
178	002048	宁波华翔	5,700	91,314.00	0.25
179	002010	传化智联	14,200	91,306.00	0.25
180	000559	万向钱潮	15,300	90,882.00	0.24
181	002368	太极股份	4,724	90,748.04	0.24
182	000898	鞍钢股份	27,700	89,194.00	0.24
183	002690	美亚光电	4,090	88,671.20	0.24
184	300072	海新能科	17,500	88,550.00	0.24
185	001914	招商积余	4,900	88,053.00	0.24
186	002110	三钢闽光	14,200	86,478.00	0.23
187	002281	光迅科技	4,900	86,142.00	0.23
188	002233	塔牌集团	9,700	85,845.00	0.23
189	002705	新宝股份	3,900	85,761.00	0.23
190	000537	广宇发展	6,500	84,435.00	0.23
191	002174	游族网络	8,500	83,045.00	0.22
192	000402	金融街	13,900	82,705.00	0.22
193	300212	易华录	4,680	81,432.00	0.22
194	002416	爱施德	8,620	80,166.00	0.22
195	000990	诚志股份	7,300	79,935.00	0.22
196	000488	晨鸣纸业	14,150	79,806.00	0.21
197	002867	周大生	5,100	79,203.00	0.21
198	000959	首钢股份	16,600	79,016.00	0.21

199	000685	中山公用	10,260	78,796.80	0.21
200	002925	盈趣科技	3,660	78,763.20	0.21
201	002382	蓝帆医疗	8,200	78,310.00	0.21
202	002081	金螳螂	15,400	78,232.00	0.21
203	000156	华数传媒	9,800	78,106.00	0.21
204	000158	常山北明	12,900	77,400.00	0.21
205	002399	海普瑞	4,400	77,352.00	0.21
206	003035	南网能源	12,100	76,835.00	0.21
207	001965	招商公路	10,000	76,300.00	0.21
208	002146	荣盛发展	25,100	76,053.00	0.20
209	000528	柳工	11,320	73,693.20	0.20
210	000563	陕国投 A	22,854	71,304.48	0.19
211	002387	维信诺	10,300	69,216.00	0.19
212	300257	开山股份	4,600	68,816.00	0.19
213	000967	盈峰环境	13,500	68,310.00	0.18
214	002948	青岛银行	18,810	68,092.20	0.18
215	000961	中南建设	22,100	67,405.00	0.18
216	002242	九阳股份	3,600	66,096.00	0.18
217	002423	中粮资本	9,800	65,758.00	0.18
218	002434	万里扬	7,600	64,980.00	0.17
219	000718	苏宁环球	17,500	64,400.00	0.17
220	000671	阳光城	28,700	62,853.00	0.17
221	000415	渤海租赁	28,600	62,062.00	0.17
222	000553	安道麦 A	5,100	61,761.00	0.17
223	000031	大悦城	14,900	59,600.00	0.16
224	002563	森马服饰	9,400	55,648.00	0.15
225	000028	国药一致	1,800	53,622.00	0.14
226	002815	崇达技术	4,100	52,521.00	0.14
227	300869	康泰医学	1,800	50,868.00	0.14
228	000717	韶钢松山	14,000	49,000.00	0.13
229	002945	华林证券	3,200	48,800.00	0.13
230	000869	张裕 A	1,600	47,584.00	0.13
231	000062	深圳华强	3,640	46,228.00	0.12
232	001872	招商港口	2,700	42,120.00	0.11
233	300741	华宝股份	1,500	41,730.00	0.11
234	002653	海思科	2,500	40,275.00	0.11
235	001227	兰州银行	6,700	32,964.00	0.09
236	001203	大中矿业	2,600	29,380.00	0.08
237	002946	新乳业	2,000	25,980.00	0.07
238	002901	大博医疗	600	23,484.00	0.06



## 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

无。

## 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	300769	德方纳米	464,144.00	1.11
2	300012	华测检测	403,707.00	0.97
3	002497	雅化集团	399,388.00	0.95
4	002240	盛新锂能	388,627.99	0.93
5	300390	天华超净	336,448.00	0.80
6	002407	多氟多	334,296.00	0.80
7	300073	当升科技	318,176.00	0.76
8	002756	永兴材料	303,872.00	0.73
9	000783	长江证券	241,080.00	0.58
10	002625	光启技术	221,034.00	0.53
11	300144	宋城演艺	204,489.00	0.49
12	000831	五矿稀土	204,208.00	0.49
13	002624	完美世界	197,720.00	0.47
14	002326	永太科技	196,879.00	0.47
15	300676	华大基因	179,845.00	0.43
16	300832	新产业	137,125.00	0.33
17	300558	贝达药业	132,047.00	0.32
18	300677	英科医疗	117,404.00	0.28
19	000785	居然之家	91,520.00	0.22
20	300888	稳健医疗	90,182.00	0.22

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	000733	振华科技	514,333.65	1.23
2	002340	格林美	489,003.80	1.17
3	300751	迈为股份	424,403.00	1.01
4	000723	美锦能源	365,594.00	0.87
5	002013	中航机电	304,725.00	0.73
6	300763	锦浪科技	292,574.00	0.70
7	300223	北京君正	219,482.03	0.52
8	002080	中材科技	198,254.00	0.47
9	300315	掌趣科技	118,881.00	0.28

10	000090	天健集团	105,369.82	0.25
11	002075	沙钢股份	105,178.00	0.25
12	002085	万丰奥威	94,713.00	0.23
13	002440	闰土股份	89,923.50	0.21
14	003022	联泓新科	88,378.00	0.21
15	000758	中色股份	87,039.00	0.21
16	000877	天山股份	83,466.60	0.20
17	002038	双鹭药业	81,496.00	0.19
18	300271	华宇软件	72,491.00	0.17
19	002458	益生股份	64,188.00	0.15
20	002424	贵州百灵	62,946.00	0.15

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	5,306,820.24
卖出股票收入（成交）总额	5,432,077.23

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

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	33,279.13	0.09
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	33,279.13	0.09

#### 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

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	127058	科伦转债	215	28,078.15	0.08
2	127064	杭氧转债	52	5,200.98	0.01

**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**

无。

**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**

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收到公开谴责、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	115.22
2	应收清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	115.22

## 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

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 (%)
566	37,999.32	17,088,900.00	79.46	4,418,715.00	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	钱中明	530,100.00	2.46
3	陈建仁	272,735.00	1.27
4	肖斌	160,000.00	0.74
5	康虎彪	152,900.00	0.71
6	黎彩贞	130,087.00	0.60
7	朱晓燕	122,200.00	0.57
8	陶旭骏	104,899.00	0.49
9	黄连财	101,666.00	0.47
10	邢秋珍	98,400.00	0.46

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	20,507,615.00
本报告期基金总申购份额	1,000,000.00
减：本报告期基金总赎回份额	-
本报告期基金拆分变动份额	-
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

1. 根据我司发布的《大成基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告》，经大成基金管理有限公司第七届董事会第十四次会议审议通过并履行必要程序，自 2022 年 4 月 15 日起，周立新先生因工作安排离任公司副总经理。具体事宜详见公司公告。

2. 根据我司发布的《大成基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告》，经大成基金管理有限公司第七届董事会第十五次会议审议通过并履行必要程序，自 2022 年 6 月 1 日起，赵冰女士担任公司副总经理，段皓静女士担任公司督察长。自同日起赵冰女士离任公司督察长。具体事宜详见公司公告。

#### 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	10,663,280.22	100.00	7,690.46	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	-	-	-	-	-
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	1	-	-	-	-	-
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	-	-	-	-	-
中信证券 华南	1	-	-	-	-	-

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

租用证券公司交易单元的选择标准主要包括：

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

租用证券公司交易单元的程序：首先根据租用证券公司交易单元的选择标准形成《券商服务

评价表》，然后根据评分高低进行选择基金交易单元。

本报告期内本基金租用证券公司交易单元的变更情况如下：本报告期内增加交易单元：无。  
本报告期内退租交易单元：无。

### 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	5,394.00	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	关于再次提请投资者及时更新已过期身份证件或者身份证明文件的公告	中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站	2022 年 06 月 30 日
2	大成基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告	中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站	2022 年 06 月 02 日
3	大成中证 500 深市交易型开放式指数证券投资基金 2022 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	2022 年 04 月 22 日
4	大成基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告	中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站	2022 年 04 月 16 日
5	大成中证 500 深市交易型开放式指数证券投资基金 2021 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	2022 年 03 月 29 日
6	大成基金管理有限公司关于公司固有资金拟申购旗下偏股型公募基金的公告	中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站	2022 年 01 月 27 日
7	大成中证 500 深市交易型开放式指数证券投资基金 2021 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	2022 年 01 月 21 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	报告期内持有基金份额变化情况	报告期末持有基金情况



别	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	20220101-20220630	17,000,000.00	0.00	0.00	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

2022 年 8 月 30 日