

中证 500 沪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

§ 1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
§ 2 基金简介	5
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人和基金托管人	5
2.4 信息披露方式	6
2.5 其他相关资料	6
§ 3 主要财务指标和基金净值表现	6
3.1 主要会计数据和财务指标	6
3.2 基金净值表现	7
§ 4 管理人报告	8
4.1 基金管理人及基金经理情况	8
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	10
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	10
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明	11
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	11
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	12
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	13
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	13
§ 5 托管人报告	13
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	13
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	13
5.3 托管人对本中期报告中财务信息内容的真实、准确和完整发表意见	13
§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）	13
6.1 资产负债表	13
6.2 利润表	15
6.3 净资产（基金净值）变动表	16
6.4 报表附注	19
§ 7 投资组合报告	45
7.1 期末基金资产组合情况	45
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	45
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	47
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	53
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	55
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	55

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	55
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	55
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	55
7.10 本基金投资股指期货的投资政策	55
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	55
7.12 投资组合报告附注	55
§ 8 基金份额持有人信息	56
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	56
8.2 期末上市基金前十名持有人	57
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	57
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	57
§ 9 开放式基金份额变动	57
§ 10 重大事件揭示	58
10.1 基金份额持有人大会决议	58
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	58
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	58
10.4 基金投资策略的改变	58
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	58
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	58
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	58
10.8 其他重大事件	60
§ 11 影响投资者决策的其他重要信息	61
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	61
11.2 影响投资者决策的其他重要信息	61
§ 12 备查文件目录	62
12.1 备查文件目录	62
12.2 存放地点	62
12.3 查阅方式	62

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	中证 500 沪市交易型开放式指数证券投资基金
基金简称	中证 500 沪市 ETF
场内简称	500 沪市 ETF
基金主代码	510440
交易代码	510440
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2012 年 8 月 24 日
基金管理人	大成基金管理有限公司
基金托管人	中国银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	20,058,261.00 份
基金合同存续期	不定期
基金份额上市的证券交易所	上海证券交易所
上市日期	2012 年 10 月 8 日

2.2 基金产品说明

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

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		大成基金管理有限公司	中国银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	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 1236 号大成基金总部大厦 5 层、 27-33 层	北京市西城区复兴门内大街 1 号
办公地址	广东省深圳市南山区海德三道 1236 号大成基金总部大厦 5 层、 27-33 层	北京市西城区复兴门内大街 1 号
邮政编码	518054	100818
法定代表人	吴庆斌	刘连舸

2.4 信息披露方式

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

2.5 其他相关资料

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

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2022 年 1 月 1 日-2022 年 6 月 30 日)
本期已实现收益	361,104.61
本期利润	-3,333,481.43
加权平均基金份额本期利润	-0.1662
本期加权平均净值利润率	-8.05%
本期基金份额净值增长率	-7.17%
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	14,573,059.34
期末可供分配基金份额利润	0.7265
期末基金资产净值	43,098,089.47
期末基金份额净值	2.149
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	114.90%

注：1、本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用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。

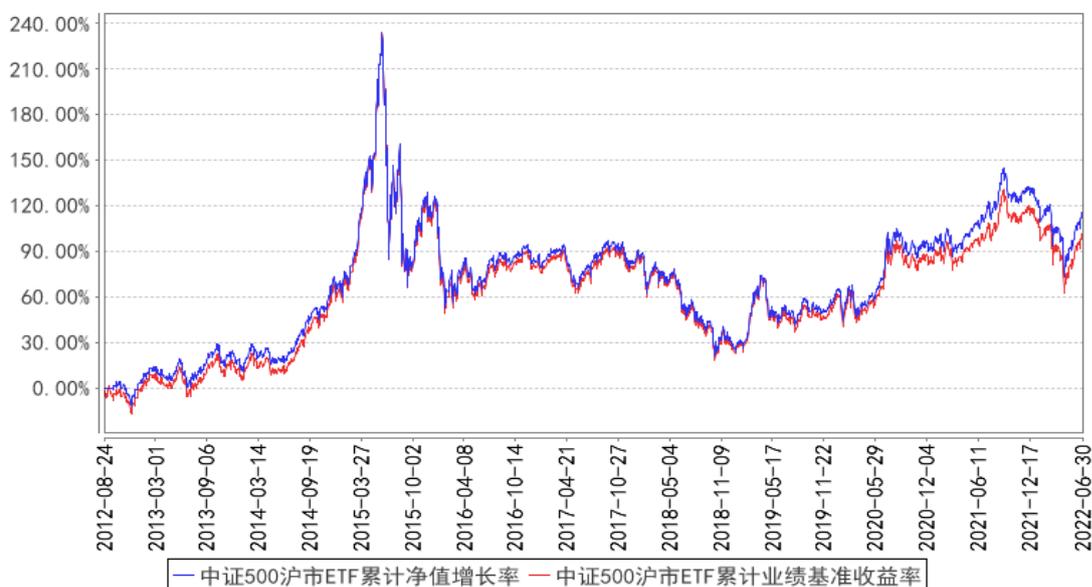
3.2 基金净值表现

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	7.08%	1.07%	6.53%	1.12%	0.55%	-0.05%
过去三个月	5.09%	1.63%	4.16%	1.69%	0.93%	-0.06%
过去六个月	-7.17%	1.52%	-8.27%	1.58%	1.10%	-0.06%
过去一年	0.47%	1.25%	-0.32%	1.30%	0.79%	-0.05%
过去三年	42.41%	1.23%	35.38%	1.26%	7.03%	-0.03%
自基金合同生效起至今	114.90%	1.59%	100.24%	1.62%	14.66%	-0.03%

3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

中证500沪市ETF累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



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

§ 4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

大成基金管理有限公司经中国证监会证监基金字[1999]10 号文批准，于 1999 年 4 月 12 日正式成立，是中国证监会批准成立的首批十家基金管理公司之一，注册资本为 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		
苏秉毅	本基金基金经理，指数与期货投资部副总监	2012 年 8 月 24 日	-	18 年	清华大学经济学硕士。2004 年 9 月至 2008 年 5 月就职于华夏基金管理有限公司基金运作部。2008 年加入大成基金管理有限公司，曾担任规划发展部高级产品设计师、数量与指数投资部总监助理，现任指数与期货投资部副总监。2012 年 8 月 28 日至 2014 年 1 月 23 日任大成中证 500 沪市交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理。2014 年 1 月 24 日至 2014 年 2 月 17 日任大成健康产业股票型证券投资基金基金经理。2012 年 2 月 9 日至 2014 年 9 月 11 日任深证成长 40 交易型开放式指数证券投资基金及大成深证成长 40 交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理。2012 年 8 月 24 日起任中证 500 沪市交易型开放式指数证券投资基金基金经理。2013 年 1 月 1 日至 2015 年 8 月 25 日

					任大成沪深 300 指数证券投资基金基金经理。2013 年 2 月 7 日起任大成中证 100 交易型开放式指数证券投资基金基金经理。2015 年 6 月 5 日起任大成深证成份交易型开放式指数证券投资基金基金经理。2015 年 6 月 29 日至 2020 年 11 月 13 日任大成中证互联网金融指数分级证券投资基金基金经理。2016 年 3 月 4 日起任大成核心双动力混合型证券投资基金、大成沪深 300 指数证券投资基金基金经理。2018 年 6 月 26 日起任大成景恒混合型证券投资基金基金经理。2021 年 4 月 23 日起任大成智慧量化多策略灵活配置混合型证券投资基金基金经理。具有基金从业资格。国籍：中国
刘淼	本基金基金经理	2021 年 9 月 2 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 沪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 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 沪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
--	--	--	--	--	---

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

上半年，无论是全球地缘政治，还是资本市场表现，都确实实地出现了起伏。在互联网时代，我们目睹一场大国参与的地缘政治冲突，并且转入旷日持久的拉锯。能源短缺问题进一步激化，全球通胀高企，但经济环境依然不好，未来进入衰退的可能性正在上升。国内制定的经济增长目标也受到了广泛关注。

资本市场的动荡，也成为了时代的注脚。大宗商品价格在供给不足和需求衰退的逻辑交织中巨幅震荡。以美股为首，境外主要股票市场跌幅较大。A 股市场也经历了近年罕有的波动。年初，地缘政治冲突等因素以及对环境的担忧导致了外资撤离，股票下跌又引发了更多资金触及止损条件被动卖出，形成正反馈效应，而疫情的反复又进一步打击了投资者的信心，市场流动性非常脆弱，无力承接卖压，大体处于单边下跌状态，直至四月底阶段性出清止跌。随后的五六月份，市场反身向上，走出一波持续性较好的反弹行情。上半年沪深 300 指数下跌 9.22%。市场风格出现了较大的转折，在前四个月的下跌中，价值风格表现出了良好的防御属性，领先于成长风格，而在市场止跌回升后，则是进攻属性较强的成长股引领反弹。

本基金标的指数中证 500 沪市指数下跌 12.30%。上半年，本基金申购赎回和份额交易情况均较为平稳。本基金基本保持满仓运作，严格根据标的指数成分股调整以及权重的变化及时调整投资组合。各项操作与指标均符合基金合同的要求。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末本基金份额净值为 2.149 元；本报告期基金份额净值增长率为-7.17%，业绩比较基准收益率为-8.27%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望下半年，宏观经济环境形势更为严峻。境外经济体业已走入滞胀的死胡同，衰退的阴影挥之不去，同时因为非经济原因，传统能源资本开支严重受限，供给端难以满足需求，短期内能源问题无解，通胀也就很难抑制住。而内需方面则由于抗疫与经济增长之间的再平衡，也会受到较大影响。

对于下半年的股票市场，我们持相对谨慎的观点。宏观环境不理想，上市公司盈利低于预期

概率偏高。而内外流动性均有可能在某一时刻边际上收紧，成为制约市场的重要因素。五月之后的反弹行情更像是在超跌出清后的自我修复，而非底层逻辑出现根本性改变的反转，在市场情绪修复到位之后，有可能再度陷入调整。特别需要警惕的是，部分“赛道股”的估值又回到了非常高的水平，若流动性环境发生变化，高估值难以为继，有可能迎来堪比一季度的波动。

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”）在中证 500 沪市交易型开放式指数证券投资基金（以下称“本基金”）的托管过程中，严格遵守《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：中证 500 沪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
资产：			
银行存款	6.4.7.1	1,868,782.91	1,387,111.66
结算备付金		-	-

存出保证金		508.37	34.51
交易性金融资产	6.4.7.2	41,303,031.85	45,053,813.79
其中：股票投资		41,303,031.85	45,048,813.79
基金投资		-	-
债券投资		-	5,000.00
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		-	51,114.86
应收股利		-	-
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.8	-	141.84
资产总计		43,172,323.13	46,492,216.66
负债和净资产	附注号	本期末 2022年6月30日	上年度末 2021年12月31日
负债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付清算款		0.12	-
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		17,111.89	19,626.07
应付托管费		3,422.36	3,925.22
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	53,699.29	37,094.47
负债合计		74,233.66	60,645.76
净资产：			
实收基金	6.4.7.10	20,058,261.00	20,058,261.00
其他综合收益	6.4.7.11	-	-
未分配利润	6.4.7.12	23,039,828.47	26,373,309.90

净资产合计		43,098,089.47	46,431,570.90
负债和净资产总计		43,172,323.13	46,492,216.66

注：报告截止日 2022 年 06 月 30 日，基金份额净值 2.149 元，基金份额总额 20,058,261.00 份。

6.2 利润表

会计主体：中证 500 沪市交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：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
一、营业总收入		-3,169,261.27	4,081,910.33
1. 利息收入		2,643.94	1,765.27
其中：存款利息收入	6.4.7.13	2,643.94	1,765.27
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）		522,680.83	3,111,226.66
其中：股票投资收益	6.4.7.14	5,191.00	2,708,963.38
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.15	1,874.20	-
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	515,615.63	402,263.28
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	-3,694,586.04	973,298.40
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	-	-4,380.00
减：二、营业总支出		164,220.16	184,478.26
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	102,687.29	101,521.76
2. 托管费	6.4.10.2.2	20,537.46	20,304.42

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	40,995.41	62,652.08
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-3,333,481.43	3,897,432.07
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-3,333,481.43	3,897,432.07
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		-3,333,481.43	3,897,432.07

6.3 净资产（基金净值）变动表

会计主体：中证 500 沪市交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：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)	20,058,261.00	-	26,373,309.90	46,431,570.90
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)	20,058,261.00	-	26,373,309.90	46,431,570.90
三、本期增减变动额(减少以“-”	-	-	-3,333,481.43	-3,333,481.43

号填列)				
(一)、 综合收 益总额	-	-	-3,333,481.43	-3,333,481.43
(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)	-	-	-	-
其中:1. 基金申 购款	-	-	-	-
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)	20,058,261.00	-	23,039,828.47	43,098,089.47
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)	20,058,261.00	-	19,097,323.16	39,155,584.16
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)	20,058,261.00	-	19,097,323.16	39,155,584.16
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	-	-	3,740,073.35	3,740,073.35
(一)、综合收益总额	-	-	3,897,432.07	3,897,432.07
(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)	-	-	-157,358.72	-157,358.72
其中:1.基金申购款	3,000,000.00	-	2,909,390.19	5,909,390.19
2.基金赎回款	-3,000,000.00	-	-3,066,748.91	-6,066,748.91
(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 期末净 资产(基 金净值)	20,058,261.00	-	22,837,396.51	42,895,657.51

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署：

谭晓冈

范瑛

孙蕊

基金管理人负责人

主管会计工作负责人

会计机构负责人

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

中证 500 沪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【2012】851 号文“关于核准中证 500 沪市交易型开放式指数证券投资基金及其联接基金募集的批复”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《中证 500 沪市交易型开放式指数证券投资基金基金合同》作为发起人于 2012 年 7 月 30 日至 2012 年 8 月 17 日向社会公开募集,募集期结束经安永华明会计师事务所验证并出具安永华明(2012)验字第 60469430_H02 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 2012 年 8 月 24 日生效。本基金为交易型开放式,存续期限不定。

设立时,基金以现金认购方式收到首次募集有效认购资金扣除认购费后的净认购金额为人民币 491,716,000.00 元,折合 491,716,000.00 份基金份额;有效认购资金在划入基金募集专户前产生的利息为人民币 22,800.00 元,折合 22,800.00 份基金份额;以上收到的资金共计人民币 491,738,800.00 元,折合 491,738,800.00 份基金份额。中证 500 沪市交易型开放式指数证券投

资基金募集的由中国证券登记结算有限责任公司上海分公司划转至账号为 D890799184 的中证 500 沪市交易型开放式指数证券投资基金证券账户的有效股票认购数量按认购期最后一日的均价计算的净额为人民币 49,319,461.00 元，折合 49,319,461.00 份基金份额。上述两部分合计折算成基金份额为 541,058,261.00 份。与其投入的实收基金相关的资产总额为人民币 541,058,261.00 元，其中现金人民币 491,738,800.00 元，股票人民币 49,319,461.00 元。本基金的基金管理人为大成基金管理有限公司，注册登记机构为中国证券登记结算有限责任公司，基金托管人为中国银行股份有限公司。（以下简称“中国银行”）

经上海证券交易所（以下简称“上交所”）上证字[2012]67 号文审核同意，本基金于 2012 年 10 月 8 日在上交所挂牌交易。根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《中证 500 沪市交易型开放式指数证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金股票资产跟踪的标的指数为中证 500 沪市指数。本基金主要投资于标的指数成份股（含存托凭证）和备选成份股（含存托凭证），该部分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。本基金可少量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。在正常市场情况下，本基金的风险控制目标是追求日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.2%，年跟踪误差不超过 2%。本基金的业绩比较基准为中证 500 沪市指数。

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

本基金 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日止期间的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 2022 年 6 月 30 日的财务状况以及 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日止期间的经营成果和净资产变动情况等有关信息。

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

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。

6.4.4.1 金融资产和金融负债的分类

新金融工具准则

金融工具，是指形成一方的金融资产并形成其他方的金融负债或权益工具的合同。当本基金成为金融工具合同的一方时，确认相关的金融资产或金融负债。

(1) 金融资产

金融资产于初始确认时分类为：以摊余成本计量的金融资产、以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产及以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。金融资产的分类取决于本基金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。本基金现无金融资产分类为以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产。

债务工具

本基金持有的债务工具是指从发行方角度分析符合金融负债定义的工具，分别采用以下两种方式进行计量：

以摊余成本计量：

本基金管理以摊余成本计量的金融资产的业务模式为以收取合同现金流量为目标，且以摊余成本计量的金融资产的合同现金流量特征与基本借贷安排相一致，即在特定日期产生的现金流量，仅为对本金和以未偿付本金金额为基础的利息的支付。本基金持有的以摊余成本计量的金融资产主要为银行存款、买入返售金融资产和其他各类应收款项等。

以公允价值计量且其变动计入当期损益：

本基金将持有的未划分为以摊余成本计量的债务工具，以公允价值计量且其变动计入当期损

益。本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产主要为债券投资，在资产负债表中以交易性金融资产列示。

权益工具

权益工具是指从发行方角度分析符合权益定义的工具。本基金将对其没有控制、共同控制和重大影响的权益工具(主要为股票投资)按照公允价值计量且其变动计入当期损益，在资产负债表中列示为交易性金融资产。

(2) 金融负债

金融负债于初始确认时分类为以摊余成本计量的金融负债和以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。本基金目前暂无金融负债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。本基金持有的以摊余成本计量的金融负债包括卖出回购金融资产款和其他各类应付款项等。

(3) 衍生金融工具

本基金将持有的衍生金融工具以公允价值计量且其变动计入当期损益，在资产负债表中列示为衍生金融资产/负债。

原金融工具准则(截至 2021 年 12 月 31 日前适用的原金融工具准则)

本基金于 2022 年 1 月 1 日起执行新金融工具准则，但选择不重述比较信息。因此，比较信息继续适用本基金以前年度的如下会计政策。

(1) 金融资产的分类

金融资产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资产、应收款项、可供出售金融资产及持有至到期投资。金融资产的分类取决于本基金对金融资产的持有意图和持有能力。本基金现无金融资产分类为可供出售金融资产及持有至到期投资。

本基金目前以交易目的持有的股票投资、债券投资和衍生工具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。除衍生工具所产生的金融资产在资产负债表中以衍生金融资产列示外，以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在资产负债表中以交易性金融资产列示。

本基金持有的其他金融资产分类为应收款项，包括银行存款、买入返售金融资产和其他各类应收款项等。应收款项是指在活跃市场中没有报价、回收金额固定或可确定的非衍生金融资产。

(2) 金融负债的分类

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及其他金融负债。本基金目前暂无金融负债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。本基金持有的其他金融负债包括卖出回购金融资产款和其他各类应付款项等。

6.4.4.2. 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

新金融工具准则

金融资产或金融负债在初始确认时以公允价值计量。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，相关交易费用计入当期损益；对于支付的价款中包含的债券起息日或上次除息日至购买日止的利息，确认为应计利息，包含在交易性金融资产的账面价值中。对于其他类别的金融资产和金融负债，相关交易费用计入初始确认金额。

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，按照公允价值进行后续计量；对于应收款项和其他金融负债采用实际利率法，以摊余成本进行后续计量。

本基金对于以摊余成本计量的金融资产，以预期信用损失为基础确认损失准备。

本基金考虑有关过去事项、当前状况以及对未来经济状况的预测等合理且有依据的信息，以发生违约的风险为权重，计算合同应收的现金流量与预期能收到的现金流量之间差额的现值的概率加权金额，确认预期信用损失。

于每个资产负债表日，本基金对于处于不同阶段的金融工具的预期信用损失分别进行计量。金融工具自初始确认后信用风险未显著增加的，处于第一阶段，本基金按照未来 12 个月内的预期信用损失计量损失准备；金融工具自初始确认后信用风险已显著增加但尚未发生信用减值的，处于第二阶段，本基金按照该工具整个存续期的预期信用损失计量损失准备；金融工具自初始确认后已经发生信用减值的，处于第三阶段，本基金按照该工具整个存续期的预期信用损失计量损失准备。

对于在资产负债表日具有较低信用风险的金融工具，本基金假设其信用风险自初始确认后并未显著增加，认定为处于第一阶段的金融工具，按照未来 12 个月内的预期信用损失计量损失准备。

本基金对于处于第一阶段和第二阶段的金融工具，按照其未扣除减值准备的账面余额和实际利率计算利息收入。对于处于第三阶段的金融工具，按照其账面余额减已计提减值准备后的摊余成本和实际利率计算利息收入。

对于其他各类应收款项，无论是否存在重大融资成分，本基金均按照整个存续期的预期信用损失计量损失准备。

本基金将计提或转回的损失准备计入当期损益。

金融资产满足下列条件之一的，予以终止确认：(1) 收取该金融资产现金流量的合同权利终止；(2) 该金融资产已转移，且本基金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；或者(3) 该金融资产已转移，虽然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，但是放弃了对该金融资产控制。

金融资产终止确认时，其账面价值与收到的对价的差额，计入当期损益。

当金融负债的现时义务全部或部分已经解除时，终止确认该金融负债或义务已解除的部分。终止确认部分的账面价值与支付的对价之间的差额，计入当期损益。

原金融工具准则(截至 2021 年 12 月 31 日前适用的原金融工具准则)

本基金于 2022 年 1 月 1 日起执行新金融工具准则，但选择不重述比较信息。因此，比较信息继续适用本基金以前年度的如下会计政策。

金融资产或金融负债于本基金成为金融工具合同的一方时，按公允价值在资产负债表内确认。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，取得时发生的相关交易费用计入当期损益；对于支付的价款中包含的债券起息日或上次除息日至购买日止的利息，单独确认为应收项目。应收款项和其他金融负债的相关交易费用计入初始确认金额。

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，按照公允价值进行后续计量；对于应收款项和其他金融负债采用实际利率法，以摊余成本进行后续计量。

金融资产满足下列条件之一的，予以终止确认：(1) 收取该金融资产现金流量的合同权利终止；(2) 该金融资产已转移，且本基金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；或者(3) 该金融资产已转移，虽然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，但是放弃了对该金融资产控制。

金融资产终止确认时，其账面价值与收到的对价的差额，计入当期损益。

当金融负债的现时义务全部或部分已经解除时，终止确认该金融负债或义务已解除的部分。终止确认部分的账面价值与支付的对价之间的差额，计入当期损益。

6.4.4.3 收入/(损失)的确认和计量

新金融工具准则

股票投资在持有期间应取得的现金股利扣除由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额确认为投资收益。债券投资在持有期间应取得的按票面利率(对于贴现债为按发行价计算的利率)或合同利率计算的利息扣除在适用情况下由债券发行企业代扣代缴的个人所得税及由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为投资收益。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在持有期间的公允价值变动确认为公允价值变动损益；于处置时，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由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为投资收益，其中包括从公允价值变动损益结转的公允价值累计变动额。

应收款项在持有期间确认的利息收入按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

原金融工具准则(截至 2021 年 12 月 31 日前适用的原金融工具准则)

本基金于 2022 年 1 月 1 日起执行新金融工具准则,但选择不重述比较信息。因此,比较信息继续适用本基金以前年度的如下会计政策。

股票投资在持有期间应取得的现金股利扣除由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额确认为投资收益。债券投资在持有期间应取得的按票面利率或者发行价计算的利息扣除在适用情况下由债券发行企业代扣代缴的个人所得税及由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为利息收入。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在持有期间的公允价值变动确认为公允价值变动损益;于处置时,其处置价格与初始确认金额之间的差额扣除在适用情况下由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为投资收益,其中包括从公允价值变动损益结转的公允价值累计变动额。

应收款项在持有期间确认的利息收入按实际利率法计算,实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

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》的规定和相关法律法规的要求,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	1,387,111.66
重分类：转入自应收利息	141.05
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	1,387,252.71
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	-
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	-
存出保证金	
2021年12月31日，按原金融工具准则列示的余额	34.51
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	34.51
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	45,053,813.79
重分类：转入自应收利息	0.79
2022年1月1日，按新金融工具准则列示的余额	45,053,814.58
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	141.84
重分类：转出至银行存款	-141.05
重分类：转出至结算备付金	-
重分类：转出至存出保证金	-
重分类：转出至交易性金融资产	-0.79
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。

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

2、增值税、企业所得税

自根据财政部、国家税务总局财税[2016]36 号文《关于全面推开营业税改增值税试点的通知》的规定，经国务院批准，自 2016 年 5 月 1 日起在全国范围内全面推开营业税改征增值税试点，金融业纳入试点范围，由缴纳营业税改为缴纳增值税。对证券投资基金（封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金）管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税；国债、地方政府债利息收入以及金融同业往来利息收入免征增值税；存款利息收入不征收增值税。

根据财政部、国家税务总局财税[2016]140 号文《关于明确金融、房地产开发、教育辅助服务等增值税政策的通知》的规定，资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人；

根据财政部、国家税务总局财税[2017]56 号文《关于资管产品增值税有关问题的通知》的规定，自 2018 年 1 月 1 日起，资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为（以下简称“资管产品运营业务”），暂适用简易计税方法，按照 3%的征收率缴纳增值税，资管产品管理人未分别核算资管产品运营业务和其他业务的销售额和增值税应纳税额的除外。资管产品管理人可选择分别或汇总核算资管产品运营业务销售额和增值税应纳税额。对资管产品在 2018 年 1 月 1 日前运营过程中发生的增值税应税行为，未缴纳增值税的，不再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从资管产品管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。

根据财政部、国家税务总局财税[2017]90 号文《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政

策的通知》的规定，提供贷款服务，以 2018 年 1 月 1 日起产生的利息及利息性质的收入为销售额；转让 2017 年 12 月 31 日前取得的股票（不包括限售股）、债券、基金、非货物期货，可以选择按照实际买入价计算销售额，或者以 2017 年最后一个交易日的股票收盘价（2017 年最后一个交易日处于停牌期间的股票，为停牌前最后一个交易日收盘价）、债券估值（中债金融估值中心有限公司或中证指数有限公司提供的债券估值）、基金份额净值、非货物期货结算价格作为买入价计算销售额。

证券投资基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股权的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

股权分置改革中非流通股股东通过对价方式向流通股股东支付的股份、现金等收入，暂免征收流通股股东应缴纳的企业所得税。

3、个人所得税

个人所得税税率为 20%。

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

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

股权分置改革中非流通股股东通过对价方式向流通股股东支付的股份、现金等收入，暂免征收流通股股东应缴纳的个人所得税。

暂免征收储蓄存款利息所得个人所得税。

6.4.7 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	1,868,782.91
等于：本金	1,868,626.55
加：应计利息	156.36
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	1,868,782.91

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	41,320,078.38	-	41,303,031.85	-17,046.53
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	41,320,078.38	-	41,303,031.85	-17,046.53

注：此处的股票投资项含可退替代款估值增值。

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	9,373.79
其中：交易所市场	9,373.79
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用	34,712.18
应付指数使用费	9,613.32
合计	53,699.29

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	20,058,261.00	20,058,261.00
本期申购	-	-
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	20,058,261.00	20,058,261.00

注：申购含红利再投份额(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	14,211,954.73	12,161,355.17	26,373,309.90
本期利润	361,104.61	-3,694,586.04	-3,333,481.43
本期基金份额交易	-	-	-

产生的变动数			
其中：基金申购款	-	-	-
基金赎回款	-	-	-
本期已分配利润	-	-	-
本期末	14,573,059.34	8,466,769.13	23,039,828.47

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	2,536.00
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	105.98
其他	1.96
合计	2,643.94

6.4.7.14 股票投资收益

6.4.7.14.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
股票投资收益——买卖股票差价收入	5,191.00
股票投资收益——赎回差价收入	-
股票投资收益——申购差价收入	-
股票投资收益——证券出借差价收入	-
合计	5,191.00

6.4.7.14.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
卖出股票成交总额	6,628,106.13
减：卖出股票成本总额	6,605,838.77
减：交易费用	17,076.36
买卖股票差价收入	5,191.00

6.4.7.14.3 股票投资收益——赎回差价收入

无。

6.4.7.14.4 股票投资收益——申购差价收入

无。

6.4.7.14.5 股票投资收益——证券出借差价收入

无。

6.4.7.15 债券投资收益

6.4.7.15.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年6月30日
债券投资收益——利息收入	0.16
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	1,874.04
债券投资收益——赎回差价收入	-
债券投资收益——申购差价收入	-
合计	1,874.20

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	6,875.00
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	5,000.00
减：应计利息总额	0.95
减：交易费用	0.01
买卖债券差价收入	1,874.04

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

6.4.7.18.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

无。

6.4.7.18.2 衍生工具收益——其他投资收益

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	515,615.63
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	515,615.63

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	-3,694,586.04
股票投资	-3,694,586.04
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	-3,694,586.04

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	-
存托服务费	2.02
银行划款手续费	120.00
指数使用费	6,161.21
合计	40,995.41

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

6.4.7.24 分部报告

无。

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 或有事项

无。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

无。

6.4.9 关联方关系

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

本基金本报告期存在控制关系或者其他重大利害关系的关联方未发生变化。

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

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

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	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

	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	13,059,781.77	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	6,875.00	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	9,421.32	100.00	9,373.79	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 (%)
-	-	-	-	-

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。

6.4.10.2 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	102,687.29	101,521.76
其中：支付销售机构的客户维护费	-	-

注：基金管理费每日计提，按月支付。基金管理费按前一日的基金资产净值的 0.5% 的年费率计提。

计算方法如下：

$$H = E \times 0.5\% / \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日基金资产净值

6.4.10.2.2 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	20,537.46	20,304.42

注：基金托管费每日计提，按月支付。基金托管费按前一日的基金资产净值的 0.1% 年费率计提。

计算方法如下：

$$H = E \times 0.1\% / \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

6.4.10.2.3 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
	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
基金合同生效日（2012 年 8 月 24 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	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	84.75%	84.75%

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		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	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国银行	1,868,782.91	2,536.00	1,412,090.70	1,695.47

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

无。

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

无。

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

无。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

无。

6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

无。

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

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

本基金的基金管理人奉行全面风险管理体系的建设，建立了以由高层监控(合规与风险管理委员会、公司投资风险控制委员会)、专业监控(监察稽核部、风险管理部)、部门互控、岗位自控构成的风险管理架构体系。本基金的基金管理人在董事会下设立合规与风险管理委员会，对公司整体运营风险进行监督，监督风险控制措施的执行。在管理层层面设立投资风险控制委员会，通过定期会议讨论涉及投资风险的重大议题，形成正式决议提交投委会。在业务操作层面，监察稽核部

履行合规控制职责，通过定期、不定期检查内控制度的执行情况、对重大风险点以专项稽核的方式确保公司内控制度、流程得到贯彻执行。风险管理部履行风险量化评估分析职责。本基金以拟合、跟踪中证 500 沪市指数为原则，通过被动式指数化投资方法，力求为投资者提供一个管理透明且成本较低的标的指数投资工具。

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

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

6.4.13.2 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，导致基金资产损失和收益变化的风险。

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

本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的银行存款

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

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

于本期末，本基金持有的除国债、央行票据和政策性金融债以外的债券占基金资产净值的比例为 0.00% (上年度末：0.01%)。

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%，且本基金组合资产中 7 个工作日可变现资产未超过最近工作日确认的净赎回金额。

本基金主要投资于交易所及银行间市场内交易的证券，除在附注“期末本基金持有的流通受限证券”中列示的部分基金资产流通暂时受限制外（如有），其余均能及时变现。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券资产的公允价值。除附注期末债券正回购交易中作为抵押的债券中列示的卖出回购金融资产款余额（如有）将在 1 个月内到期且计息外，本基金于资产负债表日所持有的金融负债的合同约定剩余到期日均为一年以内且一般不计息，可赎回基金份额净值无固定到期日且不计息，因此账面余额

一般即为未折现的合约到期现金流量。本报告期内，本基金未发生重大流动性风险事件。

6.4.13.4 市场风险

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

6.4.13.4.1 利率风险

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

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

本基金持有的大部分金融资产和金融负债不计息，因此本基金的收入及经营活动的现金流量在很大程度上独立于市场利率变化。本基金持有的生息资产主要为银行存款及存出保证金。

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	1,868,782.91	-	-	-	1,868,782.91
存出保证金	508.37	-	-	-	508.37
交易性金融资产	-	-	-	41,303,031.85	41,303,031.85
资产总计	1,869,291.28	-	-	41,303,031.85	43,172,323.13
负债					
应付管理人报酬	-	-	-	17,111.89	17,111.89
应付托管费	-	-	-	3,422.36	3,422.36
应付清算款	-	-	-	0.12	0.12
其他负债	-	-	-	53,699.29	53,699.29
负债总计	-	-	-	74,233.66	74,233.66
利率敏感度缺口	1,869,291.28	-	-	41,228,798.19	43,098,089.47
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	1,387,111.66	-	-	-	1,387,111.66
存出保证金	34.51	-	-	-	34.51
交易性金融资产	-	-	5,000.00	45,048,813.79	45,053,813.79
应收证券清算款	-	-	-	51,114.86	51,114.86
其他资产	-	-	-	141.84	141.84
资产总计	1,387,146.17	-	5,000.00	45,100,070.49	46,492,216.66
负债					

应付管理人报酬	-	-	-	19,626.07	19,626.07
应付托管费	-	-	-	3,925.22	3,925.22
其他负债	-	-	-	37,094.47	37,094.47
负债总计	-	-	-	60,645.76	60,645.76
利率敏感度缺口	1,387,146.17	-	5,000.00	45,039,424.73	46,431,570.90

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

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

于本期末，本基金未持有交易性债券投资（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）。

6.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基金持有的金融工具均以人民币计价，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	41,303,031.85	95.83	45,048,813.79	97.02
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-

交易性金融资产—贵金属投资	-	-	-	-
衍生金融资产—权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	41,303,031.85	95.83	45,048,813.79	97.02

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%	2,078,720.69	2,249,439.15
	业绩比较基准下降5%	-2,078,720.69	-2,249,439.15

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	41,303,031.85	45,048,813.79
第二层次	-	5,000.00
第三层次	-	-
合计	41,303,031.85	45,053,813.79

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、非公开发售等情况，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

本基金本报告期末及上年度末均未持有非持续的以公允价值计量的金融工具。

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	41,303,031.85	95.67
	其中：股票	41,303,031.85	95.67
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	1,868,782.91	4.33
8	其他各项资产	508.37	0.00
9	合计	43,172,323.13	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	228,792.00	0.53
B	采矿业	2,472,411.00	5.74

C	制造业	22,098,864.95	51.28
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	1,890,014.60	4.39
E	建筑业	922,620.58	2.14
F	批发和零售业	2,626,327.88	6.09
G	交通运输、仓储和邮政业	1,822,718.62	4.23
H	住宿和餐饮业	171,120.00	0.40
I	信息传输、软件和信息技术服务业	2,985,047.80	6.93
J	金融业	4,048,636.14	9.39
K	房地产业	916,294.50	2.13
L	租赁和商务服务业	225,330.00	0.52
M	科学研究和技术服务业	227,600.00	0.53
N	水利、环境和公共设施管理业	243,565.17	0.57
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	233,199.00	0.54
S	综合	166,261.06	0.39
	合计	41,278,803.30	95.78

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	24,228.55	0.06
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	24,228.55	0.06

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	600522	中天科技	31,400	725,340.00	1.68
2	601615	明阳智能	19,300	652,340.00	1.51
3	600256	广汇能源	56,200	592,348.00	1.37
4	600096	云天化	14,800	465,904.00	1.08
5	600157	永泰能源	271,400	431,526.00	1.00
6	600141	兴发集团	9,540	419,664.60	0.97
7	600885	宏发股份	9,632	403,099.20	0.94
8	600392	盛和资源	17,213	389,013.80	0.90
9	603613	国联股份	4,350	385,410.00	0.89
10	600563	法拉电子	1,703	349,387.48	0.81
11	600765	中航重机	10,806	347,737.08	0.81
12	600399	抚顺特钢	19,300	345,470.00	0.80
13	600418	江淮汽车	20,100	344,916.00	0.80
14	600233	圆通速递	16,800	342,552.00	0.79
15	601555	东吴证券	48,960	339,292.80	0.79
16	600487	亨通光电	23,100	335,874.00	0.78
17	600732	爱旭股份	10,000	330,200.00	0.77
18	688099	晶晨股份	3,200	323,200.00	0.75
19	603077	和邦生物	75,565	321,906.90	0.75
20	603456	九洲药业	6,200	320,540.00	0.74

21	601058	赛轮轮胎	28,200	317,814.00	0.74
22	600499	科达制造	15,200	313,728.00	0.73
23	600486	扬农化工	2,300	306,544.00	0.71
24	688180	君实生物	4,000	301,360.00	0.70
25	600298	安琪酵母	6,100	297,375.00	0.69
26	688122	西部超导	3,200	295,040.00	0.68
27	601108	财通证券	37,300	293,551.00	0.68
28	603605	珀莱雅	1,760	290,716.80	0.67
29	600862	中航高科	10,300	289,430.00	0.67
30	603345	安井食品	1,700	285,379.00	0.66
31	601077	渝农商行	75,700	280,090.00	0.65
32	601168	西部矿业	23,300	275,639.00	0.64
33	688390	固德威	840	262,928.40	0.61
34	688777	中控技术	3,600	261,936.00	0.61
35	600988	赤峰黄金	16,300	259,985.00	0.60
36	603589	口子窖	4,400	257,884.00	0.60
37	601128	常熟银行	33,500	255,940.00	0.59
38	601162	天风证券	79,600	253,128.00	0.59
39	605117	德业股份	900	251,901.00	0.58
40	601636	旗滨集团	19,700	251,175.00	0.58
41	600521	华海药业	11,000	249,700.00	0.58
42	603517	绝味食品	4,300	248,626.00	0.58
43	603026	石大胜华	1,700	247,095.00	0.57
44	603267	鸿远电子	1,800	241,794.00	0.56
45	600153	建发股份	18,200	237,874.00	0.55
46	600546	山煤国际	12,200	237,412.00	0.55
47	603444	吉比特	600	232,800.00	0.54
48	600039	四川路桥	22,036	232,039.08	0.54
49	601607	上海医药	12,800	231,424.00	0.54
50	600109	国金证券	25,700	231,300.00	0.54
51	601872	招商轮船	39,700	228,672.00	0.53
52	603127	昭衍新药	2,000	227,600.00	0.53
53	600348	华阳股份	14,700	227,262.00	0.53
54	600497	驰宏锌锗	43,600	226,284.00	0.53
54	600705	中航产融	65,400	226,284.00	0.53
55	600177	雅戈尔	34,000	225,420.00	0.52
56	600549	厦门钨业	10,400	224,848.00	0.52
57	600875	东方电气	13,600	223,720.00	0.52
58	603939	益丰药房	4,200	221,886.00	0.51
59	600160	巨化股份	16,520	217,238.00	0.50
60	601699	潞安环能	14,700	214,914.00	0.50
61	601990	南京证券	25,400	211,836.00	0.49

62	600482	中国动力	13,200	207,372.00	0.48
63	600859	王府井	7,810	202,903.80	0.47
64	600536	中国软件	4,940	200,514.60	0.47
65	600143	金发科技	20,700	197,064.00	0.46
66	600704	物产中大	38,100	195,453.00	0.45
67	603198	迎驾贡酒	3,000	195,420.00	0.45
68	601997	贵阳银行	33,600	195,216.00	0.45
69	600739	辽宁成大	13,100	190,998.00	0.44
70	600415	小商品城	33,600	187,152.00	0.43
71	689009	九号公司	4,200	186,900.00	0.43
72	600170	上海建工	61,300	185,739.00	0.43
73	600372	中航电子	9,500	184,205.00	0.43
74	600699	均胜电子	11,720	184,121.20	0.43
75	601577	长沙银行	23,100	183,183.00	0.43
76	600079	人福医药	11,300	180,800.00	0.42
77	600637	东方明珠	25,000	178,750.00	0.41
78	600867	通化东宝	17,200	177,848.00	0.41
79	600315	上海家化	4,160	177,840.00	0.41
80	600985	淮北矿业	12,200	177,632.00	0.41
81	601016	节能风电	36,800	176,640.00	0.41
82	601198	东兴证券	19,800	176,220.00	0.41
83	600026	中远海能	17,057	176,198.81	0.41
84	600236	桂冠电力	28,900	176,001.00	0.41
85	600171	上海贝岭	7,003	175,285.09	0.41
86	600879	航天电子	26,642	172,906.58	0.40
87	600258	首旅酒店	6,900	171,120.00	0.40
88	600642	申能股份	30,100	170,968.00	0.40
89	600038	中直股份	3,700	167,240.00	0.39
90	600673	东阳光	18,494	166,261.06	0.39
91	600529	山东药玻	5,900	164,905.00	0.38
92	600580	卧龙电驱	11,328	163,349.76	0.38
93	600380	健康元	13,222	163,291.70	0.38
94	600801	华新水泥	8,359	163,084.09	0.38
95	601717	郑煤机	11,300	162,833.00	0.38
96	600369	西南证券	40,700	161,579.00	0.37
97	600316	洪都航空	5,300	160,272.00	0.37
98	603568	伟明环保	4,781	159,541.97	0.37
99	688185	康希诺	800	159,264.00	0.37
100	600166	福田汽车	56,200	159,046.00	0.37
101	688521	芯原股份	3,200	158,080.00	0.37
102	600325	华发股份	20,750	157,077.50	0.36
103	600027	华电国际	39,900	156,807.00	0.36

104	600909	华安证券	34,440	156,702.00	0.36
105	601005	重庆钢铁	81,900	156,429.00	0.36
106	600008	首创环保	53,890	156,281.00	0.36
107	688256	寒武纪	2,400	155,280.00	0.36
108	600820	隧道股份	25,300	154,836.00	0.36
109	603218	日月股份	6,000	152,400.00	0.35
110	600848	上海临港	11,000	149,160.00	0.35
111	600271	航天信息	13,600	148,784.00	0.35
112	600118	中国卫星	7,300	146,584.00	0.34
113	600863	内蒙华电	39,900	145,635.00	0.34
114	601866	中远海发	48,500	145,500.00	0.34
115	600208	新潮中宝	52,600	145,176.00	0.34
116	601992	金隅集团	51,000	141,270.00	0.33
117	600066	宇通客车	16,300	140,995.00	0.33
118	603156	养元饮品	6,200	140,864.00	0.33
119	603858	步长制药	7,000	137,970.00	0.32
120	603233	大参林	4,400	137,720.00	0.32
121	600056	中国医药	9,251	137,099.82	0.32
122	600998	九州通	11,500	136,965.00	0.32
123	688009	中国通号	29,700	134,541.00	0.31
124	600390	五矿资本	27,500	134,475.00	0.31
125	600970	中材国际	13,850	134,206.50	0.31
126	600667	太极实业	18,100	133,578.00	0.31
127	603658	安图生物	2,700	132,003.00	0.31
128	603885	吉祥航空	7,300	131,327.00	0.30
129	600062	华润双鹤	5,116	131,276.56	0.30
130	600528	中铁工业	16,300	131,215.00	0.30
131	688002	睿创微纳	3,300	131,076.00	0.30
132	600827	百联股份	9,900	130,779.00	0.30
133	600839	四川长虹	45,100	129,888.00	0.30
134	600297	广汇汽车	49,500	129,195.00	0.30
135	603707	健友股份	4,570	128,874.00	0.30
136	600598	北大荒	8,700	128,412.00	0.30
137	600498	烽火通信	8,800	127,424.00	0.30
138	600201	生物股份	13,866	127,012.56	0.29
139	600155	华创阳安	14,900	126,352.00	0.29
140	600511	国药股份	4,644	124,366.32	0.29
141	600409	三友化工	15,175	124,283.25	0.29
142	600021	上海电力	12,100	124,025.00	0.29
143	688188	柏楚电子	560	123,222.40	0.29
144	600718	东软集团	10,700	123,157.00	0.29
145	600259	广晟有色	2,400	121,560.00	0.28

146	600755	厦门国贸	16,203	121,522.50	0.28
147	600060	海信视像	9,600	120,000.00	0.28
148	603712	七一二	3,800	119,700.00	0.28
149	600566	济川药业	4,400	119,504.00	0.28
150	600282	南钢股份	37,700	118,755.00	0.28
151	600895	张江高科	9,500	118,275.00	0.27
152	600782	新钢股份	23,400	117,936.00	0.27
153	601880	辽港股份	69,130	117,521.00	0.27
154	601179	中国西电	25,100	117,468.00	0.27
155	600535	天士力	11,100	116,661.00	0.27
156	600022	山东钢铁	66,930	116,458.20	0.27
157	600064	南京高科	10,574	116,314.00	0.27
158	688208	道通科技	3,500	115,220.00	0.27
159	600216	浙江医药	8,300	113,295.00	0.26
160	600500	中化国际	16,980	112,917.00	0.26
161	600808	马钢股份	29,600	112,184.00	0.26
162	600959	江苏有线	34,400	112,144.00	0.26
163	688006	杭可科技	1,600	112,096.00	0.26
164	600663	陆家嘴	10,800	111,888.00	0.26
165	600037	歌华有线	11,900	111,741.00	0.26
166	600728	佳都科技	17,200	111,112.00	0.26
167	600567	山鹰国际	39,500	109,415.00	0.25
168	603866	桃李面包	6,600	109,230.00	0.25
169	600517	国网英大	21,000	108,990.00	0.25
170	603225	新凤鸣	9,372	108,152.88	0.25
171	601456	国联证券	8,800	107,976.00	0.25
172	601778	晶科科技	19,900	107,460.00	0.25
173	688289	圣湘生物	3,568	105,648.48	0.25
174	601958	金钼股份	11,900	105,196.00	0.24
175	603927	中科软	4,440	103,540.80	0.24
176	601106	中国一重	33,600	103,152.00	0.24
177	600597	光明乳业	8,100	102,303.00	0.24
178	600572	康恩贝	22,810	101,048.30	0.23
179	601118	海南橡胶	21,000	100,380.00	0.23
180	601718	际华集团	32,300	100,130.00	0.23
181	600507	方大特钢	14,276	99,789.24	0.23
182	603883	老百姓	2,938	99,539.44	0.23
183	600737	中粮糖业	13,100	98,512.00	0.23
184	600582	天地科技	20,300	97,034.00	0.23
185	601860	紫金银行	33,600	96,432.00	0.22
186	600967	内蒙一机	10,500	95,760.00	0.22
187	600435	北方导航	11,000	94,820.00	0.22

188	600398	海澜之家	19,900	94,525.00	0.22
189	601000	唐山港	36,281	93,604.98	0.22
190	600195	中牧股份	7,524	92,244.24	0.21
191	601333	广深铁路	41,500	90,470.00	0.21
192	600329	达仁堂	3,601	88,512.58	0.21
193	600811	东方集团	31,270	88,494.10	0.21
194	600764	中国海防	3,500	88,340.00	0.20
195	600871	石化油服	46,700	88,263.00	0.20
196	601568	北元集团	13,720	86,984.80	0.20
197	603638	艾迪精密	4,200	86,100.00	0.20
198	688321	微芯生物	3,400	85,646.00	0.20
199	600556	天下秀	10,400	85,592.00	0.20
200	688029	南微医学	980	85,456.00	0.20
201	600120	浙江东方	21,234	85,148.34	0.20
202	600126	杭钢股份	16,560	84,787.20	0.20
203	600167	联美控股	11,240	84,187.60	0.20
204	600446	金证股份	8,100	84,078.00	0.20
205	601200	上海环境	8,270	84,023.20	0.19
206	601098	中南传媒	8,800	83,072.00	0.19
207	600373	中文传媒	8,300	82,917.00	0.19
208	600707	彩虹股份	17,600	82,368.00	0.19
209	601611	中国核建	9,800	82,222.00	0.19
210	601608	中信重工	21,300	80,727.00	0.19
211	603317	天味食品	2,832	80,627.04	0.19
212	600131	国网信通	5,900	79,355.00	0.18
213	688088	虹软科技	2,500	78,975.00	0.18
214	600376	首开股份	15,800	77,578.00	0.18
215	603000	人民网	6,800	76,160.00	0.18
216	600095	湘财股份	9,900	76,131.00	0.18
217	600901	江苏租赁	14,700	75,411.00	0.17
218	601598	中国外运	19,300	74,884.00	0.17
219	600307	酒钢宏兴	38,300	74,302.00	0.17
220	600006	东风汽车	9,828	74,201.40	0.17
221	601991	大唐发电	30,400	73,872.00	0.17
222	603228	景旺电子	3,124	72,882.92	0.17
223	601187	厦门银行	12,200	72,712.00	0.17
224	600623	华谊集团	8,700	72,210.00	0.17
225	600906	财达证券	8,000	71,920.00	0.17
226	603650	彤程新材	2,200	71,676.00	0.17
227	600717	天津港	17,679	70,892.79	0.16
228	601928	凤凰传媒	9,400	67,210.00	0.16
229	600968	海油发展	24,900	64,242.00	0.15

230	600648	外高桥	4,600	62,560.00	0.15
231	600787	中储股份	10,716	60,974.04	0.14
232	600928	西安银行	16,400	60,188.00	0.14
233	601969	海南矿业	7,000	60,130.00	0.14
234	600339	中油工程	20,400	58,956.00	0.14
235	601228	广州港	15,200	55,784.00	0.13
236	688819	天能股份	1,600	55,328.00	0.13
237	600835	上海机电	3,994	54,837.62	0.13
238	600377	宁沪高速	6,100	52,277.00	0.12
239	603379	三美股份	2,340	52,065.00	0.12
240	603056	德邦股份	3,800	51,034.00	0.12
241	601139	深圳燃气	7,100	49,274.00	0.11
242	600299	安迪苏	5,000	47,900.00	0.11
243	601298	青岛港	8,600	47,042.00	0.11
244	601869	长飞光纤	1,500	46,380.00	0.11
245	603868	飞科电器	600	45,450.00	0.11
246	601156	东航物流	2,200	43,560.00	0.10
247	600823	世茂股份	13,700	40,826.00	0.09
248	600350	山东高速	7,700	40,425.00	0.09
249	600927	永安期货	1,900	38,323.00	0.09
250	601828	美凯龙	6,300	38,178.00	0.09
251	603355	莱克电气	1,480	37,340.40	0.09
252	603786	科博达	600	36,942.00	0.09
253	603515	欧普照明	1,950	34,027.50	0.08
254	601665	齐鲁银行	6,200	30,256.00	0.07
255	603719	良品铺子	1,000	28,630.00	0.07
256	601003	柳钢股份	6,300	25,515.00	0.06
257	600956	新天绿能	1,800	22,176.00	0.05
258	603983	丸美股份	700	18,760.00	0.04
259	600917	重庆燃气	2,100	15,162.00	0.04

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	601089	福元医药	1,151	24,228.55	0.06

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	600096	云天化	485,753.00	1.05
2	688180	君实生物	334,702.19	0.72

3	601058	赛轮轮胎	312,440.00	0.67
4	688122	西部超导	292,676.80	0.63
5	601108	财通证券	286,853.70	0.62
6	688777	中控技术	286,785.62	0.62
7	600499	科达制造	258,047.00	0.56
8	601162	天风证券	253,928.00	0.55
9	603345	安井食品	234,976.00	0.51
10	689009	九号公司	233,876.08	0.50
11	601607	上海医药	228,390.00	0.49
12	600109	国金证券	222,909.00	0.48
13	603026	石大胜华	214,110.00	0.46
14	601990	南京证券	207,264.00	0.45
15	603517	绝味食品	197,858.00	0.43
16	603939	益丰药房	197,582.00	0.43
17	600143	金发科技	190,291.00	0.41
18	605117	德业股份	186,094.00	0.40
19	688390	固德威	179,520.99	0.39
20	600079	人福医药	179,257.00	0.39

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	600188	兖矿能源	492,203.00	1.06
2	600884	杉杉股份	378,198.42	0.81
3	601117	中国化学	371,613.00	0.80
4	601689	拓普集团	363,120.50	0.78
5	688005	容百科技	359,010.25	0.77
6	605358	立昂微	302,599.16	0.65
7	600754	锦江酒店	288,758.00	0.62
8	603290	斯达半导	234,223.00	0.50
9	600733	北汽蓝谷	231,267.00	0.50
10	688536	思瑞浦	221,860.00	0.48
11	600516	方大炭素	209,466.00	0.45
12	600803	新奥股份	193,164.00	0.42
13	601975	招商南油	175,938.00	0.38
14	603893	瑞芯微	171,771.00	0.37
15	688065	凯赛生物	166,050.43	0.36
16	600908	无锡银行	106,805.00	0.23
17	600643	爱建集团	78,062.45	0.17
18	600158	中体产业	77,040.03	0.17
19	600266	城建发展	69,812.08	0.15

20	600649	城投控股	68,970.00	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	6,554,642.87
卖出股票收入（成交）总额	6,628,106.13

注：上述金额均指成交金额（成交单价乘以成交数量），不考虑相关交易费用。

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

无。

7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

无。

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

无。

7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

无。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

7.10 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

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	508.37
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	508.37

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 (%)
400	50,145.65	17,080,818.00	85.16	2,977,443.00	14.84

注：持有人户数为有效户数，即存量份额大于零的账户。

8.2 期末上市基金前十名持有人

序号	持有人名称	持有份额 (份)	占上市总份额比例 (%)
1	大成基金管理有限公司	17,000,000.00	84.75
2	钱中明	445,600.00	2.22
3	何治国	198,500.00	0.99
4	陈建仁	176,600.00	0.88
5	吴方庆	97,401.00	0.49
6	刘聪	92,000.00	0.46
7	贺顺龙	90,000.00	0.45
8	中国银河证券股份有限公司	80,318.00	0.40
9	陶旭骏	77,100.00	0.38
10	吴炳芬	67,253.00	0.34

注：以上数据由中国证券登记结算有限公司提供，持有人为场内持有人。

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

无。

8.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

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

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日 (2012 年 8 月 24 日) 基金份额总额	541,058,261.00
本报告期期初基金份额总额	20,058,261.00
本报告期基金总申购份额	-
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	20,058,261.00

§ 10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

无。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

一、基金管理人的重大人事变动

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

本报告期内，无涉及本基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

无。

10.4 基金投资策略的改变

本基金投资策略在本报告期内没有重大改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

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

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，基金管理人、托管人的托管业务部门及其相关高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元	股票交易	应支付该券商的佣金	备注
------	------	------	-----------	----

	数量	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	13,059,781.77	100.00	9,421.32	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

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	6,875.00	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旗下管理的上海证券交易所上市ETF实施申赎业务多码合一的公告	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18日
3	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	2022年06月02日

		公司网站	
4	中证 500 沪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
5	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
6	中证 500 沪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
7	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
8	中证 500 沪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
9	大成基金管理有限公司关于旗下中证 500 沪市交易型开放式指数证券投资基金变更申赎简称的公告	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 14 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	20220101-20220630	17,000,000.00	0.00	0.00	17,000,000.00	84.75

产品特有风险

当基金份额持有人占比过于集中时，可能会因某单一基金份额持有人大额赎回而引发基金净值剧烈波动的风险，甚至有可能引起基金的流动性风险，基金管理人可能无法及时变现基金资产以应对基金份额持有人的赎回申请，基金份额持有人可能无法及时赎回持有的全部基金份额。

11.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§ 12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

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

12.2 存放地点

备查文件存放在本基金管理人和托管人的住所。

12.3 查阅方式

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

大成基金管理有限公司

2022 年 8 月 30 日