

大成沪深 300 指数增强型发起式证券投资 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：中国工商银行股份有限公司

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。

基金托管人中国工商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	9
4.1 基金管理人及基金经理情况	9
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	12
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	20
§ 7 投资组合报告	47
7.1 期末基金资产组合情况	47
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	48
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	49
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	52
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	53
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	53

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	53
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	53
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	53
7.10 本基金投资股指期货的投资政策	53
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	54
7.12 投资组合报告附注	54
§ 8 基金份额持有人信息	55
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	55
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	56
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况	56
8.4 发起式基金发起资金持有份额情况	56
§ 9 开放式基金份额变动	57
§ 10 重大事件揭示	57
10.1 基金份额持有人大会决议	57
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	57
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	59
§ 11 影响投资者决策的其他重要信息	60
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	60
11.2 影响投资者决策的其他重要信息	60
§ 12 备查文件目录	60
12.1 备查文件目录	60
12.2 存放地点	60
12.3 查阅方式	60

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	大成沪深 300 指数增强型发起式证券投资基金	
基金简称	大成沪深 300 增强发起式	
基金主代码	010908	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2021 年 2 月 23 日	
基金管理人	大成基金管理有限公司	
基金托管人	中国工商银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	236,971,131.39 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	大成沪深 300 增强发起式 A	大成沪深 300 增强发起式 C
下属分级基金的交易代码	010908	010909
报告期末下属分级基金的份额总额	95,460,934.24 份	141,510,197.15 份

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金为增强型股票指数基金，在力求对标的指数进行有效跟踪的基础上，力争实现超越目标指数的投资收益，谋求基金资产的长期增值。本基金力争使日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.5%，年化跟踪误差不超过 8.0%。
投资策略	本基金在指数化投资的基础上通过数量化模型进行投资组合优化，在控制与业绩比较基准偏离风险的前提下，力争获得超越标的指数的投资收益。
业绩比较基准	沪深 300 指数收益率×95%+银行活期存款利率(税后)×5%
风险收益特征	本基金是股票型基金，其预期风险与预期收益高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。

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	中国工商银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	段皓静
	联系电话	0755-83183388
	电子邮箱	office@dcfund.com.cn
客户服务电话	4008885558	95588
传真	0755-83199588	010-66105798
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 55 号
办公地址	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 55

	1236 号大成基金总部大厦 5 层、 27-33 层	号
邮政编码	518054	100140
法定代表人	吴庆斌	陈四清

2.4 信息披露方式

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

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	大成基金管理有限公司	广东省深圳市南山区海德三道 1236 号大成基金总部大厦 5 层、 27-33 层

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据 和指标	报告期(2022 年 01 月 01 日-2022 年 06 月 30 日)	
	大成沪深 300 增强发起式 A	大成沪深 300 增强发起式 C
本期已实现收益	-13,752,705.16	-22,313,604.11
本期利润	-5,240,990.86	-13,325,712.82
加权平均基金份额 本期利润	-0.0547	-0.0801
本期加权平均净 值利润率	-6.38%	-9.33%
本期基金份额净 值增长率	-5.72%	-5.90%
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	-15,590,173.91	-23,719,051.81
期末可供分配基 金份额利润	-0.1633	-0.1676
期末基金资产净 值	85,459,782.70	125,999,868.18

期末基金份额净值	0.8952	0.8904
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	-10.48%	-10.96%

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交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

大成沪深 300 增强发起式 A

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去一个月	11.65%	1.00%	9.12%	1.02%	2.53%	-0.02%
过去三个月	5.63%	1.36%	5.93%	1.36%	-0.30%	0.00%
过去六个月	-5.72%	1.35%	-8.72%	1.38%	3.00%	-0.03%
过去一年	-10.63%	1.17%	-13.40%	1.18%	2.77%	-0.01%
自基金合同生效起至今	-10.48%	1.04%	-18.86%	1.18%	8.38%	-0.14%

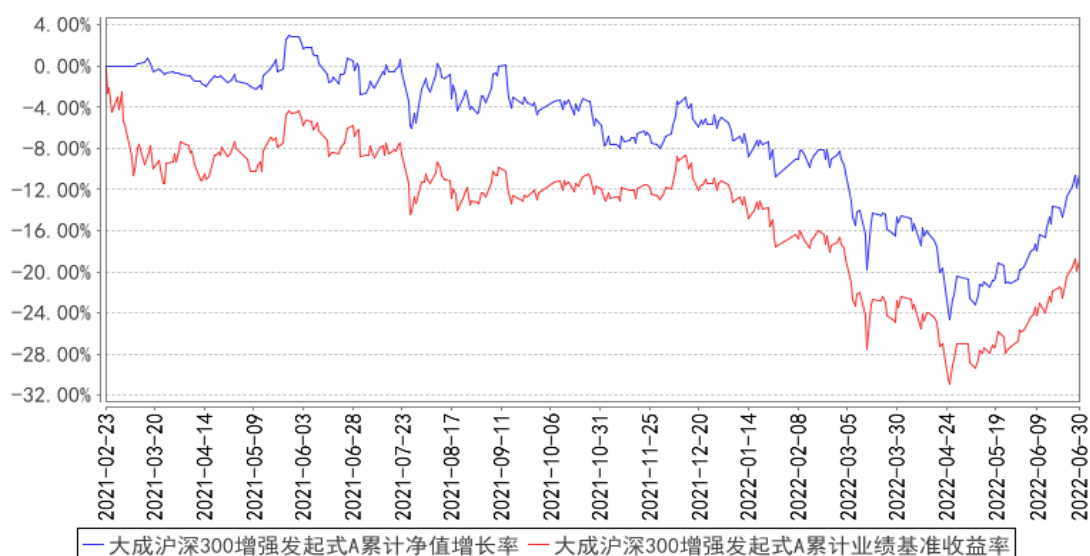
大成沪深 300 增强发起式 C

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
----	----------	-------------	------------	---------------	-----	-----

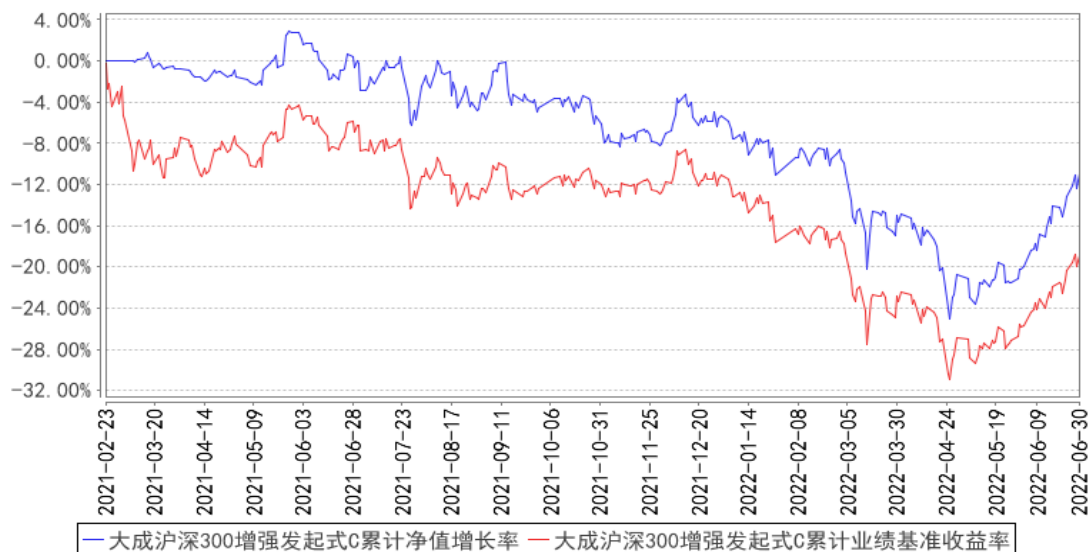
过去一个月	11.62%	1.00%	9.12%	1.02%	2.50%	-0.02%
过去三个月	5.54%	1.36%	5.93%	1.36%	-0.39%	0.00%
过去六个月	-5.90%	1.35%	-8.72%	1.38%	2.82%	-0.03%
过去一年	-10.99%	1.17%	-13.40%	1.18%	2.41%	-0.01%
自基金合同生效起 至今	-10.96%	1.04%	-18.86%	1.18%	7.90%	-0.14%

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

大成沪深300增强发起式A累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



大成沪深300增强发起式C累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势图



注：本基金合同规定，基金管理人应当自基金合同生效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		
夏高	本基金基	2021年2	-	11年	清华大学工学博士。2011年1月至2012

	金经理	月 23 日			<p>年 5 月就职于博时基金管理有限公司，任股票投资部投资分析员。2012 年 7 月加入大成基金管理有限公司，曾担任数量与指数投资部高级数量分析师、基金经理助理，现任指数与期货投资部总监助理。2014 年 12 月 6 日起任大成中证红利指数证券投资基金基金经理。2015 年 6 月 29 日至 2020 年 11 月 13 日担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 2 月 3 日起任大成中证 360 互联网+大数据 100 指数型证券投资基金基金经理。2017 年 3 月 21 日至 2021 年 4 月 27 日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。2020 年 9 月 18 日起任大成动态量化配置策略混合型证券投资基金、大成绝对收益策略混合型发起式证券投资基金基金经理。2021 年 2 月 23 日起任大成沪深 300 指数增强型发起式证券投资基金基金经理。2021 年 4 月 29 日至 2022 年 5 月 26 日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。具有基金从业资格。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

今年上半年，A 股市场呈现下跌后见底上涨的走势。一月份，受到市场和政策调整的影响，医药、传媒、电子、机械、汽车和军工等行业领跌，而估值较低的银行、房地产、保险、交通运输和建筑等行业相对抗跌。二月份，市场开启下跌后的反弹，有色金属、煤炭、石化、化工和电力等上游行业涨幅较大，家电、证券、传媒、食品饮料等行业相对落后。三月份，受到俄乌冲突、美国加息预期和疫情等因素的影响，市场转跌，电子、消费者服务、有色金属、家电和汽车等行业跌幅较大，而煤炭、房地产、农林牧渔和医药等行业不跌反涨。四月份，受到疫情和经济放缓等因素的影响，A 股市场大幅下跌，计算机、新能源、传媒、轻工、机械和医药等行业领跌，而食品饮料、消费者服务、家电、交通运输和建筑等行业相对抗跌。五月份，疫情形势明朗和好转，叠加经济激励政策广泛出台，市场开启触底后的回升，汽车、石化、新能源、机械和国防军工等行业涨幅较大，房地产、银行、保险和证券等行业相对落后。六月份，市场继续强劲回升，消费者服务、新能源、汽车、食品饮料和家电等行业领涨，而石化、电力、建筑、商贸零售和煤炭等行业落后。整体来看，今年上半年，上证指数下跌 6.63%，沪深 300 指数下跌 9.22%。本基金按照价值、成长、盈利、盈利增长和低波动等风格进行较为均衡的配置，在上半年的市场中超越了业绩比较基准，取得了一定的超额收益。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末大成沪深 300 增强发起式 A 的基金份额净值为 0.8952 元，本报告期基金份额净值增长率为-5.72%，同期业绩比较基准收益率为-8.72%；截至本报告期末大成沪深 300 增强发

起式 C 的基金份额净值为 0.8904 元，本报告期基金份额净值增长率为-5.90%，同期业绩比较基准收益率为-8.72%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

2022 年下半年，在总结上半年经验的基础上，我国将进一步加大对内改革、对外开放的力度。稳增长政策持续发力，财政政策和货币政策提供托底支持，宏观经济将走出上半年低迷的状态，进入持续向好的趋势。下半年，人民群众的消费力度将好于上半年，消费对经济的拉动效应将更加有力。为了提高经济发展的质量，国家将会持续加大科技投入，增强国家的长期竞争力。基于以上因素，我们认为下半年 A 股市场将有若干重要的投资机会值得把握。本基金将坚持量化选股模型，持续挖掘、灵活运用有效的选股因子，并采用风险模型、组合优化等方法严格控制风险暴露，努力实现对业绩比较基准进行增强的投资目标。

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

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

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

无。

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内，本基金托管人在对本基金的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他法律法规和基金合同的有关规定，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

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，本基金的管理人——大成基金管理有限公司在本基金的投资运作、基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格计算、基金费用开支等问题上，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

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

本托管人依法对大成基金管理有限公司编制和披露的本基金 2022 年中期报告中财务指标、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进行了核查，以上内容真实、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：大成沪深 300 指数增强型发起式证券投资基金

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	13,576,891.39	25,335,102.27
结算备付金		1,790,982.91	13,472,605.40
存出保证金		345,114.96	2,540,563.53
交易性金融资产	6.4.7.2	196,586,089.00	259,752,423.21
其中：股票投资		196,586,089.00	259,752,423.21
基金投资		-	-
债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
其他投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
债权投资	6.4.7.5	-	-
其中：债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
其他投资		-	-
其他债权投资	6.4.7.6	-	-
其他权益工具投资	6.4.7.7	-	-
应收清算款		-	72,214.69
应收股利		-	-
应收申购款		203,780.06	728,106.84
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.8	-	2,666.61
资产总计		212,502,858.32	301,903,682.55
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		-	-
应付赎回款		307,999.32	1,084,063.94
应付管理人报酬		132,161.87	206,629.58
应付托管费		24,780.34	38,743.05
应付销售服务费		39,498.37	71,797.56
应付投资顾问费		-	-
应交税费		-	1,347.38
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.9	538,767.54	463,418.19
负债合计		1,043,207.44	1,865,999.70
净资产：			

实收基金	6.4.7.10	236,971,131.39	316,759,421.92
其他综合收益	6.4.7.11	-	-
未分配利润	6.4.7.12	-25,511,480.51	-16,721,739.07
净资产合计		211,459,650.88	300,037,682.85
负债和净资产总计		212,502,858.32	301,903,682.55

注：1、报告截止日 2022 年 06 月 30 日，基金份额总额 236,971,131.39 份，其中大成沪深 300 增强发起式 A 基金份额总额为 95,460,934.24 份，基金份额净值 0.8952 元。大成沪深 300 增强发起式 C 基金份额总额为 141,510,197.15 份，基金份额净值 0.8904 元。

2、以上比较数据已根据本年《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〉》中的资产负债表格式的要求进行列示：上年末资产负债表中“应收利息”与“其他资产”项目的“本期末”余额合并列示在本期末资产负债表中“其他资产”项目的“上年度末”余额，上年末资产负债表中“应付交易费用”、“应付利息”与“其他负债”科目的“本期末”余额合并列示在本期末资产负债表“其他负债”项目的“上年度末”余额。

6.2 利润表

会计主体：大成沪深 300 指数增强型发起式证券投资基金

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 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2021 年 2 月 23 日（基金合 同生效日）至 2021 年 6 月 30 日
一、营业总收入		-17,089,427.56	2,710,795.51
1. 利息收入		66,344.69	832,323.16
其中：存款利息收入	6.4.7.13	65,040.98	153,976.86
债券利息收入		-	80,755.69
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	597,590.61
证券出借利息收入		1,303.71	-
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		-34,657,204.70	2,760,439.93
其中：股票投资收益	6.4.7.14	-34,632,609.99	-1,357,043.60
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.15	65,322.56	-2,559.56
资产支持证券投资收益	6.4.7.16	-	-
贵金属投资收益	6.4.7.17	-	-

衍生工具收益	6.4.7.18	-2,138,952.51	1,686,403.40
股利收益	6.4.7.19	2,049,035.24	2,433,639.69
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	17,499,605.59	-892,239.11
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	1,826.86	10,271.53
减：二、营业总支出		1,477,276.12	2,674,318.21
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	894,896.49	998,243.69
2. 托管费	6.4.10.2.2	167,793.06	187,170.66
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	284,284.61	346,481.52
4. 投资顾问费		-	-
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 信用减值损失	6.4.7.22	-	-
7. 税金及附加		0.13	6,071.05
8. 其他费用	6.4.7.23	130,301.83	1,136,351.29
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-18,566,703.68	36,477.30
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-18,566,703.68	36,477.30
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		-18,566,703.68	36,477.30

注：以上比较数据已根据本年《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〉》中的利润表格式的要求进行列示；上年度可比期间利润表中“交易费用”项目与“其他费用”项目的“本期”金额合并列示在本期利润表中“其他费用”项目的“上年度可比期间”金额。

6.3 净资产（基金净值）变动表

会计主体：大成沪深 300 指数增强型发起式证券投资基金

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	316,759,421.92	-	-16,721,739.07	300,037,682.85

期末净资产(基金净值)				
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)	316,759,421.92	-	-16,721,739.07	300,037,682.85
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	-79,788,290.53	-	-8,789,741.44	-88,578,031.97
(一)、综合收益总额	-	-	-18,566,703.68	-18,566,703.68
(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)	-79,788,290.53	-	9,776,962.24	-70,011,328.29
其中:1.基金申购款	60,712,552.05	-	-8,309,730.21	52,402,821.84
2.基金赎回款	-140,500,842.58	-	18,086,692.45	-122,414,150.13
(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)	236,971,131.39	-	-25,511,480.51	211,459,650.88
项目	上年度可比期间 2021年2月23日(基金合同生效日)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)	430,353,939.83	-	-	430,353,939.83
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)	430,353,939.83	-	-	430,353,939.83
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	-135,239,606.84	-	216,736.00	-135,022,870.84
(一)、综合收益总额	-	-	36,477.30	36,477.30
(二)、	-135,239,606.84	-	180,258.70	-135,059,348.14

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	48,194,602.96	-	-263,796.87	47,930,806.09
2. 基金赎回款	-183,434,209.80	-	444,055.57	-182,990,154.23
（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）	295,114,332.99	-	216,736.00	295,331,068.99

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

大成沪深 300 指数增强型发起式证券投资基金（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[2020]3164 号文《关于核准大成沪深 300 指数增强型发起式证券投资基金募集的批复》的核准，由基金管理人大成基金管理有限公司向社会公开发行募集，基金合同于 2021 年 2 月 23 日正式生效，首次设立募集规模为 430,353,939.83 基金份额。本基金为契约型开放式，存续期限不定。本基金的基金管理人为大成基金管理有限公司，注册登记机构为大成基金管理有限公司，基金托管人为中国工商银行股份有限公司（简称“中国工商银行”）。

设立时，本基金已收到的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 430,279,875.57 元，折合 430,279,875.57 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 74,064.26 元，折合 74,064.26 份基金份额。其中 A 类份额已收到的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 117,807,591.59 元，折合 117,807,591.59 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 39,819.19 元，折合 39,819.19 份基金份额；C 类份额已收到的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 312,472,283.98 元，折合 312,472,283.98 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 34,245.07 元，折合 34,245.07 份基金份额。以上收到的实收基金共计人民币 430,353,939.83 元，折合 430,353,939.83 份基金份额。

本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的股票（包括中小板、创业板及其他依法发行上市的股票）、债券（包括国债、央行票据、金融债券、企业债券、公司债券、中期票据、短期融资券、超短期融资券、公开发行的次级债券、政府支持机构债券、政府支持债券、地方政府债券、可转换债券及其他经中国证监会允许投资的债券）、资产支持证券、衍生工具（包括股指期货、国债期货、股票期权等）、货币市场工具、同业存单、债券回购、银行存款以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具。本基金可以根据有关法律法规的规定参与融资及转融通证券出借业务。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。

本基金的投资组合比例为：本基金股票资产投资比例不低于基金资产的 80%，其中投资于标的指数成份股和备选成份股的资产不低于非现金基金资产的 80%；每个交易日日终在扣除股指期货、国债期货、股票期权合约需缴纳的交易保证金后，保持不低于基金资产净值 5% 的现金或到期日在一年以内的政府债券，其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。如法律法

规或中国证监会变更投资品种的投资比例限制，基金管理人在履行适当程序后，可以调整上述投资品种的投资比例。

本基金的业绩比较为：沪深 300 指数收益率 \times 95%+银行活期存款利率(税后) \times 5%。

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

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 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。

1、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。

（1）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；

（2）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。

2、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的有关过去事项、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。

3、收入/（损失）的确认和计量

（1）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。

（2）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。

（3）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 25,335,102.27

重分类：转入自应收利息 2,378.11

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 25,337,480.38

结算备付金

2021 年 12 月 31 日，按原金融工具准则列示的余额 13,472,605.40

重分类：转入自应收利息 268.00

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 13,472,873.40

存出保证金

2021 年 12 月 31 日，按原金融工具准则列示的余额 2,540,563.53

重分类：转入自应收利息 20.50

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 2,540,584.03

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 259,752,423.21

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 259,752,423.21

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 2,666.61

重分类：转出至银行存款 -2,378.11

重分类：转出至结算备付金 -268.00

重分类：转出至存出保证金 -20.50

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 728,106.84

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 728,106.84

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

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。金融机构开展的质押式买入返售金融商品业务、买断式买入返售金融商品业务、同业存款、同业存单以及持有金融债券取得的利息收入属于金融同业往来利息收入。

根据财政部、国家税务总局财税[2016]140 号文《关于明确金融、房地产开发、教育辅助服务等增值税政策的通知》的规定，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。

增值税附加税包括城市维护建设税、教育费附加和地方教育费附加，以实际缴纳的增值税税额为计税依据，分别按 7%、3%和 2%的比例缴纳城市维护建设税、教育费附加和地方教育费附加。根据上海市虹口区税务局规定，地方教育费附加的税率为 2019 年 7 月 1 日起由之前的 1%调整为 2%。

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	13,576,891.39
等于：本金	13,575,676.92
加：应计利息	1,214.47
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	13,576,891.39

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	186,830,412.17	-	196,586,089.00	9,755,676.83
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	186,830,412.17	-	196,586,089.00	9,755,676.83

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

6.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

单位：人民币元

项目	本期末 2022年6月30日			备注
	合同/名义 金额	公允价值		
		资产	负债	
利率衍生 工具	-	-	-	
货币衍生 工具	-	-	-	
权益衍生 工具	2,575,200.00	-	-	
其中：股指期 货投资	2,575,200.00	-	-	
其他衍生 工具	-	-	-	
合计	2,575,200.00	-	-	

注：衍生金融资产项下的权益衍生工具为股指期货投资，净额为 0。在当日无负债结算制度下，结算准备金已包括所持股指期货合约产生的持仓损益，则衍生金融资产项下的股指期货投资与相

关的期货暂收款(结算所得的持仓损益)之间按抵销后的净额为 0。

6.4.7.3.2 期末基金持有的期货合约情况

单位：人民币元

代码	名称	持仓量(买/卖)	合约市值	公允价值变动
IF2207	IF2207	2.00	2,683,920.00	108,720.00
合计				108,720.00
减：可抵销期货暂收款				108,720.00
净额				-

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	26.55
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	307,660.04
其中：交易所市场	307,660.04
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用	198,719.55
应付指数使用费	32,361.40
合计	538,767.54

6.4.7.10 实收基金

金额单位：人民币元

大成沪深 300 增强发起式 A

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	96,699,660.15	96,699,660.15
本期申购	4,785,108.12	4,785,108.12
本期赎回（以“-”号填列）	-6,023,834.03	-6,023,834.03
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	95,460,934.24	95,460,934.24

大成沪深 300 增强发起式 C

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	220,059,761.77	220,059,761.77
本期申购	55,927,443.93	55,927,443.93
本期赎回（以“-”号填列）	-134,477,008.55	-134,477,008.55
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	141,510,197.15	141,510,197.15

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

6.4.7.11 其他综合收益

无。

6.4.7.12 未分配利润

单位：人民币元

大成沪深 300 增强发起式 A

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
本期期初	-1,904,089.24	-2,982,712.77	-4,886,802.01
本期利润	-13,752,705.16	8,511,714.30	-5,240,990.86
本期基金份额交易产生的变动数	66,620.49	60,020.84	126,641.33
其中：基金申购款	-357,644.98	-352,551.82	-710,196.80
基金赎回款	424,265.47	412,572.66	836,838.13
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-15,590,173.91	5,589,022.37	-10,001,151.54

大成沪深 300 增强发起式 C

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
本期期初	-5,051,339.79	-6,783,597.27	-11,834,937.06
本期利润	-22,313,604.11	8,987,891.29	-13,325,712.82
本期基金份额交易产生的变动数	3,645,892.09	6,004,428.82	9,650,320.91
其中：基金申购款	-3,752,876.54	-3,846,656.87	-7,599,533.41
基金赎回款	7,398,768.63	9,851,085.69	17,249,854.32
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-23,719,051.81	8,208,722.84	-15,510,328.97

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	32,877.75
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	31,873.09
其他	290.14
合计	65,040.98

6.4.7.14 股票投资收益

6.4.7.14.1 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	377,766,774.63
减：卖出股票成本总额	411,449,749.37
减：交易费用	949,635.25
买卖股票差价收入	-34,632,609.99

6.4.7.14.2 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	26.50
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	65,296.06
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	65,322.56

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	274,323.80

减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	209,000.00
减：应计利息总额	27.45
减：交易费用	0.29
买卖债券差价收入	65,296.06

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

单位：人民币元

项目	本期收益金额 2022年1月1日至2022年6月30日
股指期货投资收益	-2,138,952.51

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	2,049,035.24
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	2,049,035.24

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	17,870,377.36
股票投资	17,870,377.36
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	-370,771.77
权证投资	-
期货投资	-370,771.77
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	17,499,605.59

6.4.7.21 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
基金赎回费收入	1,822.38
基金转换费收入	4.48
合计	1,826.86

注：1. 本基金的赎回费率按持有期间递减，不低于赎回费总额的 25% 归入基金资产。

2. 本基金的转换费由申购补差费和转出基金的赎回费两部分构成，其中转出基金的不低于赎回费的 25% 归入转出基金的基金资产。

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	34,712.18
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
银行划款手续费	2,582.28
账户维护费	13,500.00
指数使用费	20,000.00
合计	130,301.83

6.4.7.24 分部报告

无。

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 或有事项

无。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

无。

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

本基金本报告期存在控制关系或者其他重大利害关系的关联方未发生变化。

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

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

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易**6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易****6.4.10.1.1 股票交易**

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2022年1月1日至2022年6月30日		上年度可比期间 2021年2月23日(基金合同生效日) 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	266,707,268.10	37.95	330,063,464.50	42.73

6.4.10.1.2 债券交易

无。

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	191,436.55	37.97	125,087.30	40.66
关联方名称	上年度可比期间 2021年2月23日（基金合同生效日）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	300,786.41	42.73	300,786.41	51.34

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，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2月23日（基金合同生效日）至2021年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	894,896.49	998,243.69
其中：支付销售机构的客户维护费	332,503.61	426,614.19

注：支付基金管理人大成基金的管理人报酬按前一日基金资产净值 0.80% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

$$\text{日管理人报酬} = \text{前一日基金资产净值} \times 0.80\% / \text{当年天数}。$$

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2月23日（基金合同生效日）至2021年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	167,793.06	187,170.66

注：支付基金托管人中国工商银行的托管费按前一日基金资产净值 0.15% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

$$\text{日托管费} = \text{前一日基金资产净值} \times 0.15\% / \text{当年天数}。$$

6.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联	本期
-------------	----

方名称	2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	大成沪深 300 增强发起 式 A	大成沪深 300 增强发起 式 C	合计
大成基金		37,555.25	37,555.25
工商银行		58,611.04	58,611.04
光大证券		17.04	17.04
合计		96,183.33	96,183.33
获得销售服务费的各关联 方名称	上年度可比期间 2021 年 2 月 23 日（基金合同生效日）至 2021 年 6 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	大成沪深 300 增强发起 式 A	大成沪深 300 增强发起 式 C	合计
大成基金		179.57	179.57
工商银行		69,214.49	69,214.49
光大证券		13.98	13.98
合计		69,408.04	69,408.04

注：支付基金销售机构的销售服务费按前一日 C 类基金份额基金资产净值的约定年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付给大成基金，再由大成基金计算并支付给各基金销售机构。C 类基金份额约定的销售服务费年费率分别为 0.40%。其计算公式为：

$$\text{日销售服务费} = \text{前一日 C 类基金资产净值} \times 0.40\% / \text{当年天数}。$$

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	本期
	2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日	2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
	大成沪深 300 增强发起式 A	大成沪深 300 增强发起式 C
基金合同生效日（2021 年 2 月 23 日）持有的基金份额	-	-
报告期初持有的基金份额	10,000,000.00	-
报告期间申购/买入总份额	0.00	-
报告期间因拆分变动份额	-	-
减：报告期间赎回/卖出总份额	0.00	-
报告期末持有的基金份额	10,000,000.00	-
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	4.22%	-
项目	上年度可比期间	上年度可比期间
	2021 年 2 月 23 日（基金合同生效日）至 2021 年 6 月 30 日	2021 年 2 月 23 日（基金合同生效日）至 2021 年 6 月 30 日
	大成沪深 300 增强发起式 A	大成沪深 300 增强发起式 C
基金合同生效日（2021 年 2 月 23 日）持有的基金份额	10,000,000.00	-
报告期初持有的基金份额	-	-
报告期间申购/买入总份额	-	-
报告期间因拆分变动份额	0.00	-
减：报告期间赎回/卖出总份额	0.00	-
报告期末持有的基金份额	10,000,000.00	-
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	3.39%	-

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 2 月 23 日（基金合同生效日）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
中国工商银行	13,576,891.39	32,877.75	19,534,357.42	114,321.35

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

金额单位：人民币元

本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日					
关联方名称	证券代码	证券名称	发行方式	基金在承销期内买入	
				数量（单位：张）	总金额
光大证券	001268	联合精密	网下发行	409	7,873.25
上年度可比期间 2021 年 2 月 23 日（基金合同生效日）至 2021 年 6 月 30 日					
关联方名称	证券代码	证券名称	发行方式	基金在承销期内买入	
				数量（单位：张）	总金额
-	-	-	-	-	-

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

6.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	受限期	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量（单位：股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
301117	佳缘科技	2022 年 1 月 7 日	6 个月	新股锁定	46.80	54.44	225	10,530.00	12,249.00	-
301139	元道通信	2022 年 6 月 30 日	1 个月内（含）	新股未上市	38.46	38.46	2,288	87,996.48	87,996.48	-

301139	元道通信	2022年6月30日	6个月	新股锁定	38.46	38.46	255	9,807.30	9,807.30	-
301148	嘉戎技术	2022年4月14日	6个月	新股锁定	38.39	23.90	290	11,133.10	6,931.00	-
301150	中一科技	2022年4月14日	6个月	新股锁定	163.56	82.76	103	11,285.64	8,524.28	2022-6-10 每股送 0.5股
301153	中科江南	2022年5月10日	6个月	新股锁定	33.68	43.98	244	8,217.92	10,731.12	-
301162	国能日新	2022年4月19日	6个月	新股锁定	45.13	54.11	228	10,289.64	12,337.08	-
301163	宏德股份	2022年4月11日	6个月	新股锁定	26.27	32.33	277	7,276.79	8,955.41	-
301196	唯科科技	2022年1月4日	6个月	新股锁定	64.08	37.52	100	6,408.00	3,752.00	-
301200	大族数控	2022年2月18日	6个月	新股锁定	76.56	51.92	160	12,249.60	8,307.20	-
301207	华兰疫苗	2022年2月10日	6个月	新股锁定	56.88	56.42	143	8,133.84	8,068.06	-
301216	万凯新材	2022年3月21日	6个月	新股锁定	35.68	29.84	276	9,847.68	8,235.84	-
301217	铜冠铜箔	2022年1月20日	6个月	新股锁定	17.27	14.83	914	15,784.78	13,554.62	-
301219	腾远钴业	2022年3月10日	6个月	新股锁定	173.98	87.82	72	6,959.20	6,323.04	2022-5-24 每股送 0.8股
301222	浙江恒威	2022年3月2日	6个月	新股锁定	33.98	28.96	238	8,087.24	6,892.48	-
301228	实朴检测	2022年1月21日	6个月	新股锁定	20.08	20.34	373	7,489.84	7,586.82	-
301248	杰创智能	2022年4月	6个月	新股锁定	39.07	29.87	289	11,291.23	8,632.43	-

		13 日									
301258	富士莱	2022 年 3 月 21 日	6 个月	新股锁定	48.30	41.68	151	7,293.30	6,293.68		-
301268	铭利达	2022 年 3 月 29 日	6 个月	新股锁定	28.50	34.87	293	8,350.50	10,216.91		-
301279	金道科技	2022 年 4 月 6 日	6 个月	新股锁定	31.20	22.81	249	7,768.80	5,679.69		-
301288	清研环境	2022 年 4 月 14 日	6 个月	新股锁定	19.09	19.98	452	8,628.68	9,030.96		-
600938	中国海油	2022 年 4 月 14 日	6 个月	新股锁定	10.80	15.86	84,004	907,243.20	1,332,303.44		-
688237	超卓航科	2022 年 6 月 24 日	1 个月内(含)	新股未上市	41.27	41.27	1,868	77,092.36	77,092.36		-
688322	奥比中光	2022 年 6 月 30 日	1 个月内(含)	新股未上市	30.99	30.99	3,280	101,647.20	101,647.20		-

注：1、根据《上海证券交易所科创板股票公开发行自律委员会促进科创板初期企业平稳发行行业倡导建议》，本基金获配的科创板股票如经抽签方式确定需要锁定的，锁定期限为自发行人股票上市之日起 6 个月。根据《上海证券交易所科创板上市公司股东以向特定机构投资者询价转让和配售方式减持股份实施细则》，基金通过询价转让受让的股份，在受让后 6 个月内不得转让。

2、根据《深圳证券交易所创业板首次公开发行证券发行与承销业务实施细则》，发行人和主承销商可以采用摇号限售方式或比例限售方式，安排基金通过网下发行获配的部分创业板股票设置不低于 6 个月的限售期。

3、基金可使用以基金名义开设的股票账户，选择网上或者网下一种方式进行新股申购。本基金参与网下申购获得的新股，在新股上市之前及上市之后的约定期限(若有)内不得转让；本基金参与网上申购获得的新股，在新股上市之前不得转让。

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人中国工商银行，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，本基金无债券投资(上年度末：同)。

6.4.13.3 流动性风险

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

6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

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

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。本基金持有的利率敏感性资产主要为银行存款、结算备付金及应收申购款等。

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	13,576,891.39	-	-	-	13,576,891.39
结算备付金	1,790,982.91	-	-	-	1,790,982.91
存出保证金	23,044.56	-	-	322,070.40	345,114.96
交易性金融资产	-	-	-	196,586,089.00	196,586,089.00
应收申购款	-	-	-	203,780.06	203,780.06
资产总计	15,390,918.86	-	-	197,111,939.46	212,502,858.32
负债					
应付赎回款	-	-	-	307,999.32	307,999.32
应付管理人报酬	-	-	-	132,161.87	132,161.87
应付托管费	-	-	-	24,780.34	24,780.34
应付销售服务费	-	-	-	39,498.37	39,498.37
其他负债	-	-	-	538,767.54	538,767.54
负债总计	-	-	-	1,043,207.44	1,043,207.44
利率敏感度缺口	15,390,918.86	-	-	196,068,732.02	211,459,650.88
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	25,335,102.27	-	-	-	25,335,102.27
结算备付金	13,472,605.40	-	-	-	13,472,605.40
存出保证金	45,461.13	-	-	2,495,102.40	2,540,563.53
交易性金融资产	-	-	-	259,752,423.21	259,752,423.21

应收申购款	-	-	-	728,106.84	728,106.84
应收证券清算款	-	-	-	72,214.69	72,214.69
其他资产	-	-	-	2,666.61	2,666.61
资产总计	38,853,168.80	-	-	263,050,513.75	301,903,682.55
负债	-	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	1,084,063.94	1,084,063.94
应付管理人报酬	-	-	-	206,629.58	206,629.58
应付托管费	-	-	-	38,743.05	38,743.05
应付销售服务费	-	-	-	71,797.56	71,797.56
应交税费	-	-	-	1,347.38	1,347.38
其他负债	-	-	-	463,418.19	463,418.19
负债总计	-	-	-	1,865,999.70	1,865,999.70
利率敏感度缺口	38,853,168.80	-	-	-261,184,514.05	300,037,682.85

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，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，所面临的最大市场价格风险由所持有的金融工具的公允价值决定。本基金通过投资组合的分散化降低市场价格风险，并且本基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控。

本基金的基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控，定期运用多种定量方法对基金进行风险度量，来测试本基金面临的潜在价格风险，及时可靠地对风险进行跟踪和控制。

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	196,586,089.00	92.97	259,752,423.21	86.57

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	196,586,089.00	92.97	259,752,423.21	86.57

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	基金业绩比较基准上升 5%	10,140,355.93	14,171,490.88
	基金业绩比较基准下降 5%	-10,140,355.93	-14,171,490.88

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	194,814,940.60	256,726,573.55
第二层次	276,543.34	63,084.49

第三层次	1,494,605.06	2,962,765.17
合计	196,586,089.00	259,752,423.21

6.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

本基金以导致各层次之间转换的事项发生日为确认各层次之间转换的时点。

对于证券交易所上市的股票和债券，若出现重大事项停牌、交易不活跃（包括涨跌停时的交易不活跃）、或属于非公开发行等情况，本基金不会于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间将相关股票和债券的公允价值列入第一层次；并根据估值调整中采用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度，确定相关股票、债券和基金的公允价值应属第二层次还是第三层次。

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

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括应收款项和其他金融负债，其账面价值与公允价值相差很小。

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	196,586,089.00	92.51
	其中：股票	196,586,089.00	92.51
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	15,367,874.30	7.23
8	其他各项资产	548,895.02	0.26

9	合计	212,502,858.32	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	-	-
B	采矿业	5,013,581.00	2.37
C	制造业	124,350,048.67	58.81
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	2,175,880.00	1.03
E	建筑业	5,533,864.00	2.62
F	批发和零售业	68,912.00	0.03
G	交通运输、仓储和邮政业	5,360,521.00	2.54
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	7,811,767.00	3.69
J	金融业	39,997,007.00	18.91
K	房地产业	2,006,708.00	0.95
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	2,448,498.00	1.16
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	194,766,786.67	92.11

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	1,332,303.44	0.63
C	制造业	330,727.66	0.16
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	141,753.41	0.07
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	7,586.82	0.00
N	水利、环境和公共设施管理业	6,931.00	0.00
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	1,819,302.33	0.86

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	000568	泸州老窖	47,900	11,809,266.00	5.58
2	603392	万泰生物	63,832	9,913,109.60	4.69
3	002709	天赐材料	143,612	8,912,560.72	4.21
4	603986	兆易创新	54,200	7,707,782.00	3.65
5	600519	贵州茅台	3,300	6,748,500.00	3.19
6	600809	山西汾酒	20,140	6,541,472.00	3.09
7	601288	农业银行	2,165,600	6,540,112.00	3.09
8	601988	中国银行	1,832,000	5,972,320.00	2.82
9	002460	赣锋锂业	38,200	5,680,340.00	2.69
10	601668	中国建筑	1,040,200	5,533,864.00	2.62
11	600089	特变电工	200,000	5,478,000.00	2.59
12	600438	通威股份	88,900	5,321,554.00	2.52
13	002129	TCL 中环	89,500	5,270,655.00	2.49

14	601728	中国电信	1,394,300	5,200,739.00	2.46
15	601881	中国银河	478,600	4,628,062.00	2.19
16	300316	晶盛机电	64,500	4,359,555.00	2.06
17	002466	天齐锂业	34,700	4,330,560.00	2.05
18	601939	建设银行	705,000	4,272,300.00	2.02
19	600690	海尔智家	146,500	4,022,890.00	1.90
20	300661	圣邦股份	20,550	3,740,511.00	1.77
21	601919	中远海控	265,400	3,689,060.00	1.74
22	601998	中信银行	699,400	3,322,150.00	1.57
23	300450	先导智能	52,100	3,291,678.00	1.56
24	601901	方正证券	474,600	3,184,566.00	1.51
25	601318	中国平安	67,700	3,160,913.00	1.49
26	600176	中国巨石	179,700	3,128,577.00	1.48
27	688981	中芯国际	68,400	3,089,628.00	1.46
28	600030	中信证券	135,800	2,941,428.00	1.39
29	300122	智飞生物	25,200	2,797,452.00	1.32
30	601238	广汽集团	181,300	2,763,012.00	1.31
31	000977	浪潮信息	96,800	2,563,264.00	1.21
32	601838	成都银行	151,100	2,505,238.00	1.18
33	300750	宁德时代	4,600	2,456,400.00	1.16
34	002142	宁波银行	67,900	2,431,499.00	1.15
35	601898	中煤能源	211,700	2,197,446.00	1.04
36	003816	中国广核	777,100	2,175,880.00	1.03
37	000069	华侨城 A	309,200	2,006,708.00	0.95
38	600426	华鲁恒升	65,000	1,898,000.00	0.90
39	600018	上港集团	286,700	1,671,461.00	0.79
40	000876	新希望	103,800	1,588,140.00	0.75
41	603993	洛阳钼业	270,300	1,548,819.00	0.73
42	002555	三七互娱	70,300	1,492,469.00	0.71
43	603259	药明康德	13,200	1,372,668.00	0.65
44	002812	恩捷股份	5,300	1,327,385.00	0.63
45	000725	京东方 A	300,900	1,185,546.00	0.56
46	600028	中国石化	279,700	1,141,176.00	0.54
47	601698	中国卫通	98,900	1,118,559.00	0.53
48	300347	泰格医药	9,400	1,075,830.00	0.51
49	002841	视源股份	13,800	1,039,416.00	0.49
50	300033	同花顺	10,700	1,028,805.00	0.49
51	600741	华域汽车	38,900	894,700.00	0.42
52	688008	澜起科技	14,000	848,120.00	0.40
53	600332	白云山	25,900	818,181.00	0.39
54	603369	今世缘	15,500	790,500.00	0.37
55	000100	TCL 科技	143,000	684,970.00	0.32

56	600019	宝钢股份	89,700	539,994.00	0.26
57	002008	大族激光	16,100	533,393.00	0.25
58	002648	卫星化学	14,151	365,803.35	0.17
59	600219	南山铝业	94,400	348,336.00	0.16
60	600104	上汽集团	17,700	315,237.00	0.15
61	603659	璞泰来	3,600	303,840.00	0.14
62	603833	欧派家居	1,600	241,088.00	0.11
63	600111	北方稀土	5,600	196,896.00	0.09
64	603799	华友钴业	1,500	143,430.00	0.07
65	601857	中国石油	23,800	126,140.00	0.06
66	603019	中科曙光	3,900	113,178.00	0.05
67	600760	中航沈飞	1,800	108,810.00	0.05
68	002311	海大集团	1,200	72,012.00	0.03
69	600655	豫园股份	7,300	68,912.00	0.03
70	300979	华利集团	400	29,232.00	0.01
71	600584	长电科技	1,000	27,000.00	0.01
72	000708	中信特钢	500	10,075.00	0.00
73	601319	中国人保	1,900	9,614.00	0.00

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	600938	中国海油	84,004	1,332,303.44	0.63
2	688322	奥比中光	3,280	101,647.20	0.05
3	301139	元道通信	2,543	97,803.78	0.05
4	688237	超卓航科	1,868	77,092.36	0.04
5	601089	福元医药	1,749	36,816.45	0.02
6	301217	铜冠铜箔	914	13,554.62	0.01
7	301162	国能日新	228	12,337.08	0.01
8	301117	佳缘科技	225	12,249.00	0.01
9	001268	联合精密	409	11,337.48	0.01
10	301153	中科江南	244	10,731.12	0.01
11	301268	铭利达	293	10,216.91	0.00
12	301288	清研环境	452	9,030.96	0.00
13	301163	宏德股份	277	8,955.41	0.00
14	301248	杰创智能	289	8,632.43	0.00
15	301150	中一科技	103	8,524.28	0.00
16	301200	大族数控	160	8,307.20	0.00
17	301216	万凯新材	276	8,235.84	0.00
18	301207	华兰疫苗	143	8,068.06	0.00
19	301228	实朴检测	373	7,586.82	0.00
20	301148	嘉戎技术	290	6,931.00	0.00

21	301222	浙江恒威	238	6,892.48	0.00
22	301219	腾远钴业	72	6,323.04	0.00
23	301258	富士莱	151	6,293.68	0.00
24	301279	金道科技	249	5,679.69	0.00
25	301196	唯科科技	100	3,752.00	0.00

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	000568	泸州老窖	10,103,701.48	3.37
2	002304	洋河股份	8,084,334.00	2.69
3	601229	上海银行	7,918,181.00	2.64
4	601328	交通银行	7,638,967.00	2.55
5	603986	兆易创新	7,451,701.00	2.48
6	600519	贵州茅台	7,258,992.00	2.42
7	300750	宁德时代	7,237,942.00	2.41
8	601288	农业银行	7,069,197.00	2.36
9	603392	万泰生物	6,542,856.00	2.18
10	600919	江苏银行	6,300,825.00	2.10
11	002709	天赐材料	5,756,374.61	1.92
12	300122	智飞生物	5,705,283.48	1.90
13	601939	建设银行	5,631,942.00	1.88
14	600438	通威股份	5,601,167.00	1.87
15	002460	赣锋锂业	5,578,660.00	1.86
16	603486	科沃斯	5,538,362.00	1.85
17	601728	中国电信	5,242,693.00	1.75
18	600690	海尔智家	4,979,061.53	1.66
19	601169	北京银行	4,863,068.00	1.62
20	601336	新华保险	4,831,343.37	1.61

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	600036	招商银行	15,290,146.63	5.10
2	601939	建设银行	12,467,664.00	4.16
3	300750	宁德时代	11,252,480.00	3.75
4	000725	京东方 A	10,560,529.00	3.52
5	600030	中信证券	9,883,240.50	3.29
6	300122	智飞生物	9,439,766.00	3.15
7	603260	合盛硅业	8,979,152.96	2.99

8	002304	洋河股份	8,407,750.65	2.80
9	300033	同花顺	8,124,914.00	2.71
10	600919	江苏银行	8,024,651.00	2.67
11	002129	TCL 中环	7,856,808.00	2.62
12	000100	TCL 科技	7,738,092.00	2.58
13	601229	上海银行	7,683,578.00	2.56
14	601328	交通银行	7,554,319.00	2.52
15	601319	中国人保	7,280,979.00	2.43
16	002001	新和成	6,953,179.40	2.32
17	002064	华峰化学	6,938,607.00	2.31
18	600809	山西汾酒	6,742,177.47	2.25
19	000568	泸州老窖	6,345,041.50	2.11
20	601668	中国建筑	6,299,779.00	2.10

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	330,413,037.80
卖出股票收入（成交）总额	377,766,774.63

注：上述金额均指成交金额（成交单价乘以成交数量），不考虑相关交易费用。

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

无。

7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

无。

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

无。

7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

无。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

无。

7.10 本基金投资股指期货的投资政策

本基金在股指期货投资中将根据风险管理的原则，以套期保值为目的，在风险可控的前提下，

参与股指期货的投资。此外，本基金还将运用股指期货来管理特殊情况下的流动性风险，如预期大额申购赎回、大量分红等。

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

1、本基金投资的前十名证券之一中国银行（601988.SH）的发行主体中国银行股份有限公司于 2022 年 3 月 21 日因不良贷款余额 EAST 数据存在偏差等，受到中国银行保险监督管理委员会处罚（银保监罚决字〔2022〕13 号），于 2022 年 5 月 26 日因理财业务老产品规模在部分时点出现反弹，受到中国银行保险监督管理委员会处罚（银保监罚决字〔2022〕29 号）。中国银行为本基金跟踪标的指数的成份股。

2、本基金投资的前十名证券之一农业银行（601288.SH）的发行主体中国农业银行股份有限公司于 2022 年 3 月 21 日因漏报贷款核销业务 EAST 数据等，受到中国银行保险监督管理委员会处罚（银保监罚决字〔2022〕12 号）。农业银行为本基金跟踪标的指数的成份股。

3、本基金投资的前十名证券之一赣锋锂业（002460.SZ）的发行主体江西赣锋锂业股份有限公司于 2022 年 7 月 4 日公告，公司于 2022 年 7 月 1 日收到中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）《立案告知书》（编号：证监立案字 0252022001 号），因涉嫌 A 股某上市公司股票二级市场内幕交易，根据《中华人民共和国证券法》《中华人民共和国行政处罚法》等法律法规，中国证监会于 2022 年 1 月 24 日决定对公司立案。

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	345,114.96
2	应收清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-

5	应收申购款	203,780.06
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	548,895.02

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值	占基金资产净值比例 (%)	流通受限情况说明
1	600938	中国海油	1,332,303.44	0.63	新股锁定
2	688322	奥比中光	101,647.20	0.05	新股未上市
3	301139	元道通信	97,803.78	0.05	新股未上市
4	688237	超卓航科	77,092.36	0.04	新股未上市

7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入原因，分项之和与合计可能有尾差。

§ 8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额级别	持有人户数 (户)	户均持有的基金份额	持有人结构			
			机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总份额比例 (%)	持有份额	占总份额比例 (%)
大成沪深 300 增强发起式 A	3,860	24,730.81	21,224,718.59	22.23	74,236,215.65	77.77
大成沪深	26,104	5,421.02	3,732,273.73	2.64	137,777,923.42	97.36

300 增强发起式 C						
合计	29,964	7,908.53	24,956,992.32	10.53	212,014,139.07	89.47

注：1、上述机构/个人投资者持有份额占总份额比例的计算中，对分级份额，比例的分母采用各自级别的份额，对合计数，比例的分母采用下属分级基金份额的合计数（即期末基金份额总额）。

2、持有人户数为有效户数，即存量份额大于零的账户。

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数（份）	占基金总份额比例（%）
基金管理人所有从业人员持有本基金	大成沪深 300 增强发起式 A	100.07	0.0001
	大成沪深 300 增强发起式 C	10.00	0.0000
	合计	110.07	0.0000

注：上述占基金总份额比例的计算中，对分级份额，比例的分母采用各自级别的份额，对合计数，比例的分母采用下属分级基金份额的合计数（即期末基金份额总额）。

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

项目	份额级别	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	大成沪深 300 增强发起式 A	0
	大成沪深 300 增强发起式 C	0
	合计	0
本基金基金经理持有本开放式基金	大成沪深 300 增强发起式 A	0
	大成沪深 300 增强发起式 C	0
	合计	0

8.4 发起式基金发起资金持有份额情况

项目	持有份额总数	持有份额占基金总份额比例（%）	发起份额总数	发起份额占基金总份额比例（%）	发起份额承诺持有期限
基金管理人固有资金	10,000,000.00	4.22	10,000,000.00	4.22	3 年
基金管理人高级管理人员	-	-	-	-	-
基金经理等人员	110.07	0.00	-	-	-

基金管理人股东	-	-	-	-	-
其他	-	-	-	-	-
合计	10,000,110.07	4.22	10,000,000.00	4.22	3 年

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	大成沪深 300 增强发起式 A	大成沪深 300 增强发起式 C
基金合同生效日 (2021 年 2 月 23 日) 基金份额总额	117,847,410.78	312,506,529.05
本报告期期初基金份额总额	96,699,660.15	220,059,761.77
本报告期基金总申购份额	4,785,108.12	55,927,443.93
减：本报告期基金总赎回份额	6,023,834.03	134,477,008.55
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	95,460,934.24	141,510,197.15

§ 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

本报告期基金托管人的专门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 (%)	
招商证券	2	436,114,781.91	62.05	312,703.79	62.03	-
光大证券	1	266,707,268.10	37.95	191,436.55	37.97	-
长江证券	1	-	-	-	-	-
东方证券	1	-	-	-	-	-
海通证券	1	-	-	-	-	-
申万宏源	1	-	-	-	-	-
中金公司	1	-	-	-	-	-
中信证券	1	-	-	-	-	-

注：1、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：

- (1) 财务状况良好，最近一年无重大违规行为；
- (2) 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；
- (3) 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；

(4) 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；

(5) 能提供投资组合运作、管理所需的其他券商服务；

(6) 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专用席位。

2、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：

本报告期内退租交易单元：无；

本报告期内新增交易单元：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 (%)
招商证券	274,323.80	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部分基金增加泰信财富基金销售有限公司为销售机构的公告	中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站	2022 年 06 月 28 日
3	大成基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销证券的公告	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 25 日
4	大成基金管理有限公司关于旗下部分基金增加国信证券股份有限公司为销售机构的公告	中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站	2022 年 06 月 01 日
5	大成基金管理有限公司关于旗下部分基金增加招商银行股份有限公司为销售机构的公告	中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站	2022 年 05 月 25 日
6	大成沪深 300 指数增强型发起式证券投资基金 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
7	大成沪深 300 指数增强型发起式证券投资基金 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	2022 年 03 月 29 日

		公司网站	
8	大成沪深 300 指数增强型发起式证券投资基金更新招募说明书	中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站	2022 年 03 月 23 日
9	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
10	大成基金管理有限公司关于旗下部分基金增加中信百信银行股份有限公司为销售机构的公告	中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站	2022 年 01 月 25 日
11	大成沪深 300 指数增强型发起式证券投资基金 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

无。

11.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§ 12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

- 1、中国证监会批准设立大成沪深 300 指数增强型发起式证券投资基金的文件；
- 2、《大成沪深 300 指数增强型发起式证券投资基金基金合同》；
- 3、《大成沪深 300 指数增强型发起式证券投资基金托管协议》；
- 4、大成基金管理有限公司批准文件、营业执照、公司章程；
- 5、本报告期内在规定报刊上披露的各种公告原稿。

12.2 存放地点

备查文件存放在本基金管理人和托管人的住所。

12.3 查阅方式

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

大成基金管理有限公司

2022 年 8 月 30 日