

大成中证 100 交易型开放式指数证券投资  
基金  
2023 年中期报告

2023 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：2023 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 2023 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 2023 年 01 月 01 日起至 06 月 30 日止。

## 1.2 目录

|   |           |
|---|-----------|
| <b>§ 1 重要提示及目录</b> .....                      | <b>2</b>  |
| 1.1 重要提示 .....                                | 2         |
| 1.2 目录 .....                                  | 3         |
| <b>§ 2 基金简介</b> .....                         | <b>5</b>  |
| 2.1 基金基本情况 .....                              | 5         |
| 2.2 基金产品说明 .....                              | 5         |
| 2.3 基金管理人和基金托管人 .....                         | 5         |
| 2.4 信息披露方式 .....                              | 6         |
| 2.5 其他相关资料 .....                              | 6         |
| <b>§ 3 主要财务指标和基金净值表现</b> .....                | <b>6</b>  |
| 3.1 主要会计数据和财务指标 .....                         | 6         |
| 3.2 基金净值表现 .....                              | 7         |
| <b>§ 4 管理人报告</b> .....                        | <b>7</b>  |
| 4.1 基金管理人及基金经理情况 .....                        | 7         |
| 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明 .....              | 11        |
| 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明 .....                 | 11        |
| 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        |
| <b>§ 5 托管人报告</b> .....                        | <b>14</b> |
| 5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明 .....                  | 14        |
| 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 ..... | 14        |
| 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 .....      | 14        |
| <b>§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）</b> .....              | <b>14</b> |
| 6.1 资产负债表 .....                               | 14        |
| 6.2 利润表 .....                                 | 15        |
| 6.3 净资产（基金净值）变动表 .....                        | 17        |
| 6.4 报表附注 .....                                | 19        |
| <b>§ 7 投资组合报告</b> .....                       | <b>36</b> |
| 7.1 期末基金资产组合情况 .....                          | 36        |
| 7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合 .....                    | 37        |
| 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 .....       | 38        |
| 7.4 报告期内股票投资组合的重大变动 .....                     | 40        |
| 7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合 .....                    | 42        |
| 7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细 .....      | 42        |
| 7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细 .....   | 42        |
| 7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细 .....   | 42        |

|  |           |
|--|-----------|
| 7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细 ..... | 42        |
| 7.10 本基金投资股指期货的投资政策 .....                | 42        |
| 7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 .....          | 42        |
| 7.12 投资组合报告附注 .....                      | 42        |
| <b>§ 8 基金份额持有人信息 .....</b>               | <b>43</b> |
| 8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....              | 43        |
| 8.2 期末上市基金前十名持有人 .....                   | 43        |
| 8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....           | 44        |
| 8.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况 .....   | 44        |
| <b>§ 9 开放式基金份额变动 .....</b>               | <b>44</b> |
| <b>§ 10 重大事件揭示 .....</b>                 | <b>44</b> |
| 10.1 基金份额持有人大会决议 .....                   | 44        |
| 10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动 .....   | 44        |
| 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....        | 45        |
| 10.4 基金投资策略的改变 .....                     | 45        |
| 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....              | 45        |
| 10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况 .....      | 45        |
| 10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....             | 45        |
| 10.8 其他重大事件 .....                        | 47        |
| <b>§ 11 影响投资者决策的其他重要信息 .....</b>         | <b>48</b> |
| 11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况 ..... | 48        |
| 11.2 影响投资者决策的其他重要信息 .....                | 48        |
| <b>§ 12 备查文件目录 .....</b>                 | <b>48</b> |
| 12.1 备查文件目录 .....                        | 48        |
| 12.2 存放地点 .....                          | 48        |
| 12.3 查阅方式 .....                          | 48        |

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

|              |                         |
|--------------|-------------------------|
| 基金名称         | 大成中证 100 交易型开放式指数证券投资基金 |
| 基金简称         | 大成中证 100ETF             |
| 场内简称         | 中证 100ETF               |
| 基金主代码        | 159923                  |
| 交易代码         | 159923                  |
| 基金运作方式       | 交易型开放式                  |
| 基金合同生效日      | 2013 年 2 月 7 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   | 12,285,812.00 份         |
| 基金合同存续期      | 不定期                     |
| 基金份额上市的证券交易所 | 深圳证券交易所                 |
| 上市日期         | 2013 年 3 月 5 日          |

### 2.2 基金产品说明

|        |   |
|--------|---|
| 投资目标   | 本基金进行被动式指数化投资，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，从而使使得投资组合紧密地跟踪标的指数。 |
| 业绩比较基准 | 中证 100 指数   |
| 风险收益特征 | 本基金为股票型基金，其长期平均风险和预期收益率高于混合型基金、债券型基金、及货币市场基金。本基金为指数型基金，被动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<br>负责人 | 姓名   | 段皓静                  | 许俊                        |
|             | 联系电话 | 0755-83183388        | 010-66596688              |
|             | 电子邮箱 | office@dcfund.com.cn | fxjd_hq@bank-of-china.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<br>1236 号大成基金总部大厦 5 层、<br>27-33 层 | 北京市西城区复兴门内大街 1<br>号 |
| 办公地址  | 广东省深圳市南山区海德三道<br>1236 号大成基金总部大厦 5 层、<br>27-33 层 | 北京市西城区复兴门内大街 1<br>号 |
| 邮政编码  | 518054  | 100818              |
| 法定代表人 | 吴庆斌   | 葛海蛟                 |

## 2.4 信息披露方式

|                     |                   |
|---------------------|-------------------|
| 本基金选定的信息披露报纸名称      | 《中国证券报》           |
| 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 | 中国证券登记结算有限责任<br>公司 | 北京市西城区太平桥大街 17<br>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(2023 年 1 月 1 日-2023 年 6 月 30 日) |
|---------------|-------------------------------------|
| 本期已实现收益       | 34,570.60                           |
| 本期利润          | -75,765.97                          |
| 加权平均基金份额本期利润  | -0.0062                             |
| 本期加权平均净值利润率   | -0.35%                              |
| 本期基金份额净值增长率   | -0.36%                              |
| 3.1.2 期末数据和指标 | 报告期末(2023 年 6 月 30 日)               |
| 期末可供分配利润      | 8,377,984.60                        |
| 期末可供分配基金份额利润  | 0.6819                              |
| 期末基金资产净值      | 20,663,796.60                       |
| 期末基金份额净值      | 1.682                               |
| 3.1.3 累计期末指标  | 报告期末(2023 年 6 月 30 日)               |
| 基金份额累计净值增长率   | 68.20%                              |

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。

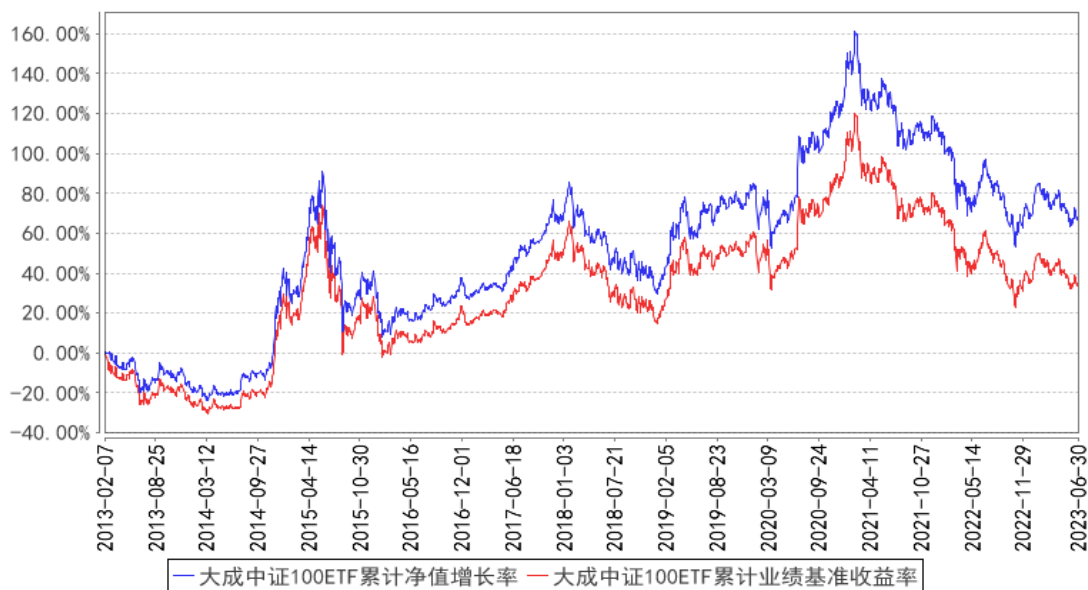
## 3.2 基金净值表现

### 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      | 2.81%    | 0.93%       | 1.96%      | 0.94%         | 0.85%  | -0.01% |
| 过去三个月      | -4.76%   | 0.86%       | -5.85%     | 0.87%         | 1.09%  | -0.01% |
| 过去六个月      | -0.36%   | 0.88%       | -1.26%     | 0.90%         | 0.90%  | -0.02% |
| 过去一年       | -14.36%  | 1.03%       | -16.29%    | 1.06%         | 1.93%  | -0.03% |
| 过去三年       | -6.40%   | 1.20%       | -12.10%    | 1.23%         | 5.70%  | -0.03% |
| 自基金合同生效起至今 | 68.20%   | 1.39%       | 34.53%     | 1.42%         | 33.67% | -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

大成中证100ETF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有关约定。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

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 24 年的发展，大成基金形成了以长期投资能力为核心竞争优势，打造了一支具有良好职业素养和丰富经验的资产管理队伍。目前已形成权益、固定收益、量化投资、商品期货、境外投资、大类资产配置等六大投资团队，全面覆盖各类投资领域。

#### 4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

| 姓名 | 职务      | 任本基金的基金经理（助理）期限 |      | 证券从业年限 | 说明   |
|----|---------|-----------------|------|--------|--|
|    |         | 任职日期            | 离任日期 |        |  |
| 刘淼 | 本基金基金经理 | 2021 年 9 月 2 日  | -    | 15 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。2020 年 6 月 29 日至 2023 年 5 月 30 日任大成 MSCI 中国 A 股质优价值 100 交易型开放式指数证券投资基金基金经理。2020 年 6 月 29 日至 2023 年 6 月 14 日任大成 MSCI 中国 A 股质优价值 100 交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理。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基金经理。2020 年 6 月 29 日至 2022 年 11 月 30 日任大成中证 500 深市交易型开放式指数证券投资基金基金经理。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 日至 2022 年 12 月 8 日任中证 500 沪市交易型开放式指数证券投资基金基金经理。2021 年 9 月 2 日起任大成中证 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 |



|     |                    |                |                 |      |  |
|-----|--------------------|----------------|-----------------|------|--|
|     |                    |                |                 |      | <p>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。2022 年 10 月 13 日起任大成动态量化配置策略混合型证券投资基金基金经理。2023 年 3 月 20 日起任大成有色金属期货交易型开放式指数证券投资基金、大成有色金属期货交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理。2023 年 4 月 14 日起任大成沪深 300 指数证券投资基金基金经理。具备基金从业资格。国籍：中国</p>   |
| 苏秉毅 | 本基金基金经理，混合资产投资部副总监 | 2013 年 2 月 7 日 | 2023 年 3 月 20 日 | 19 年 | <p>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、指数与期货投资部副总监，现任混合资产投资部副总监。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 日至 2022 年 12 月 8 日任中证 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 日至 2023 年 3 月 20 日任大成中证 100 交易型开放式指数证券投资基金基金经理。2015 年 6 月 5 日至 2023 年 4 月 10 日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 日至 2023 年 4 月 19 日任大成沪深 300 指数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 日至 2023 年 7 月 13 日任</p> |

|     |           |                |   |     |   |
|-----|-----------|----------------|---|-----|---|
|     |           |                |   |     | 大成智惠量化多策略灵活配置混合型证券投资基金基金经理。2023 年 4 月 25 日起任大成卓享一年持有期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   |
| 王宁宁 | 本基金基金经理助理 | 2022 年 8 月 1 日 | - | 5 年 | 法国雷恩高等商学院管理学硕士。2017 年 6 月至 2018 年 10 月任平安道远投资管理（上海）有限公司企划财务部企划财务。2018 年 11 月至 2022 年 7 月任平安基金管理有限公司 ETF 指数投资部指数研究员、基金经理助理。2022 年 7 月加入大成基金管理有限公司，现任指数与期货投资部基金经理助理。2022 年 8 月 1 日至 2023 年 6 月 14 日任大成上海金交易型开放式证券投资基金基金经理助理。2022 年 8 月 1 日至 2023 年 5 月 30 日任大成 MSCI 中国 A 股质优价值 100 交易型开放式指数证券投资基金基金经理助理。2022 年 8 月 1 日至 2023 年 6 月 14 日任大成 MSCI 中国 A 股质优价值 100 交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理助理。2022 年 8 月 1 日起任大成有色金属期货交易型开放式指数证券投资基金、大成有色金属期货交易型开放式指数证券投资基金联接基金、大成绝对收益策略混合型发起式证券投资基金、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、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、深证成长 40 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、中证 500 沪市交易型开放式指数证券投资基金、大成中证 500 深市交易型开放式指数证券投资基金、大成深证成份交易型开放式指数证券投资基金、大成深证成长 40 交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理助理。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，公司严格执行了公平交易的原则和制度。公司运用统计分析方法和工具，对旗下所有投资组合连续 4 个季度的日内、3 日内及 5 日内股票及债券交易同向交易价差进行分析，针对同一基金经理管理的多个投资组合及公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，公司旗下所有投资组合未发现存在异常交易行为。公司旗下所有投资组合参与的交易公开竞价，未发生成交较少的单边交易量超过该股当日成交量 5% 的股票同日反向交易；主动投资组合间债券交易存在 1 笔同日反向交易，原因为流动性需要。投资组合间相邻交易日反向交易的市场成交比例、成交均价等交易结果数据表明该类交易不对市场产生重大影响，无异常。

## 4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

### 4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

上半年，宏观政策维持宽松状态，国内经济整体处于复苏通道中，内外部没有重大风险扰动，市场环境相对好于 2022 年。分子端，由于“疤痕效应”存在，经济在脉冲式修复后，内生动能放缓，复苏进程与预期存在差距。在此背景下，A 股伴随着对经济发展预期的变化而上下波动，报告期内呈现先扬后抑的特征。

主要指数方面，沪深 300 微跌 0.75%；中证 500 涨 2.29%；创业板指跌 5.61%，中证 1000 涨 5.10%。主题或行业方面，存量博弈局面使得分化非常严重。基本上只有以“人工智能”带动的 TMT 行情和“中特估”是为数不多表现强势的主题。行业上，通信、传媒、计算机涨幅居前；而消费者服务、房地产、综合金融则表现不佳。风格上，小盘、价值相对占优。

阶段表现上，年初伊始，基于对经济的乐观展望，A 股延续了去年底启动的修复行情继续反弹。三月份以后，市场对后续复苏强度的判断产生分歧并影响了投资方向与风格。主力逐渐定价弱复苏，在流动性宽松的推动下，交易方向转为成长，TMT 大幅跑赢。四、五月份，由于内外去库存共振，各类经济活动走弱，叠加海外方面，美联储紧缩预期的反复也一定程度上影响国内，因此，股票市场普遍下跌。偏股型主动基金陆续回吐年内收益，两大投资主线也出现明显回调。直至 6 月上旬后，经济边际偏弱强化了对政策放松的期待，市场情绪逐渐被修正，主要指数涨跌互现。

本基金标的指数为中证 100 指数。中证 100 指数从沪深市场中选取 100 只市值较大、流动性较好且具有行业代表性的上市公司证券作为指数样本，以反映沪深市场核心龙头上市公司证券的整体表现。本基金采取完全复制法进行投资，即原则上按照标的指数的成份股及其权重构建基金股票投资组合，并根据标的指数成份股及其权重的变动而进行相应调整。

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

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末本基金份额净值为 1.682 元；本报告期基金份额净值增长率为-0.36%，业绩比较基准收益率为-1.26%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

目前，各项数据显示国内经济虽然呈现偏弱的状态，但已具备初步筑底企稳迹象。根据政治局会议精神，后续稳增长政策在托底基础上，力度或将较前期边际提升。在此背景下，我们认为经济在度过二季度的相对低位后，下半年趋势有望转好。结构上，改善项一是来自于消费，尽管消费的复苏仍需时间但可选消费修复空间比较大；二是基建上半年高开低走，下半年财政政策力度有望加大，关注政策性开发性金融工具落地情况；三是制造业投资降幅收窄。从库存的角度，下半年部分行业进入去库存后半段，年底或进入主动补库存周期。

对于股票市场而言，经济是今年主导市场最重要的变量之一。未来，经济企稳回升与流动性偏宽松的组合环境对股市较为友好。企业盈利预计也将伴随经济复苏而逐步回升。目前，A 股估值处于相对低位，修复空间较大。我们认为市场在下半年震荡筑底后，中枢有望上行。

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，按照标的指数成份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、混合资产投资部、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八名投资组合经理。

股票投资部、固定收益总部、混合资产投资部、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

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”）在对大成中证 100 交易型开放式指数证券投资基金（以下称“本基金”）的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了应尽的义务。

### 5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

本报告期内，本托管人根据《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，对本基金管理人的投资运作进行了必要的监督，对基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算以及基金费用开支等方面进行了认真地复核，未发现本基金管理人存在损害基金份额持有人利益的行为。

### 5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告（注：财务会计报告中的“金融工具风险及管理”、“关联方承销证券”、“关联方证券出借”部分未在本托管人复核范围内）、投资组合报告等数据真实、准确和完整。

## § 6 半年度财务会计报告（未经审计）

### 6.1 资产负债表

会计主体：大成中证 100 交易型开放式指数证券投资基金

报告截止日：2023 年 6 月 30 日

单位：人民币元

| 资产         | 附注号     | 本期末<br>2023 年 6 月 30 日 | 上年度末<br>2022 年 12 月 31 日 |
|------------|---------|------------------------|--------------------------|
| <b>资产：</b> |         |                        |                          |
| 银行存款       | 6.4.7.1 | 409,419.19             | 522,833.00               |
| 结算备付金      |         | -                      | -                        |
| 存出保证金      |         | 193.65                 | 1,230.37                 |
| 交易性金融资产    | 6.4.7.2 | 20,286,892.99          | 20,268,861.89            |
| 其中：股票投资    |         | 20,286,892.99          | 20,268,861.89            |
| 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         |            | -                         | -                           |
| 应收股利          |            | -                         | -                           |
| 应收申购款         |            | -                         | -                           |
| 递延所得税资产       |            | -                         | -                           |
| 其他资产          | 6.4.7.8    | -                         | -                           |
| 资产总计          |            | 20,696,505.83             | 20,792,925.26               |
| <b>负债和净资产</b> | <b>附注号</b> | <b>本期末<br/>2023年6月30日</b> | <b>上年度末<br/>2022年12月31日</b> |
| <b>负 债：</b>   |            |                           |                             |
| 短期借款          |            | -                         | -                           |
| 交易性金融负债       |            | -                         | -                           |
| 衍生金融负债        | 6.4.7.3    | -                         | -                           |
| 卖出回购金融资产款     |            | -                         | -                           |
| 应付清算款         |            | -                         | -                           |
| 应付赎回款         |            | -                         | -                           |
| 应付管理人报酬       |            | 8,477.37                  | 8,894.28                    |
| 应付托管费         |            | 1,695.49                  | 1,778.88                    |
| 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    | 22,536.37                 | 42,689.53                   |
| 负债合计          |            | 32,709.23                 | 53,362.69                   |
| <b>净资产：</b>   |            |                           |                             |
| 实收基金          | 6.4.7.10   | 12,285,812.00             | 12,285,812.00               |
| 其他综合收益        | 6.4.7.11   | -                         | -                           |
| 未分配利润         | 6.4.7.12   | 8,377,984.60              | 8,453,750.57                |
| 净资产合计         |            | 20,663,796.60             | 20,739,562.57               |
| 负债和净资产总计      |            | 20,696,505.83             | 20,792,925.26               |

注：报告截止日 2023 年 06 月 30 日，基金份额净值 1.682 元，基金份额总额 12,285,812.00 份。

## 6.2 利润表

会计主体：大成中证 100 交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日

单位：人民币元

| 项目                     | 附注号        | 本期<br>2023 年 1 月 1 日至 2023<br>年 6 月 30 日 | 上年度可比期间<br>2022 年 1 月 1 日至 2022<br>年 6 月 30 日 |
|------------------------|------------|--|---|
| <b>一、营业总收入</b>         |            | 11,414.14                                | -1,642,053.59                                 |
| 1. 利息收入                |            | 898.05                                   | 1,190.15                                      |
| 其中：存款利息收入              | 6.4.7.13   | 898.05                                   | 1,190.15                                      |
| 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）      |            | 120,852.66                               | -1,285,119.91                                 |
| 其中：股票投资收益              | 6.4.7.14   | -129,740.73                              | -1,485,502.50                                 |
| 基金投资收益                 |            | -  | -   |
| 债券投资收益                 | 6.4.7.15   | -  | 8,875.32                                      |
| 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   | 250,593.39                               | 191,507.27                                    |
| 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   | -110,336.57                              | -358,123.83                                   |
| 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   | -  | -   |
| <b>减：二、营业总支出</b>       |            | 87,180.11                                | 84,960.21                                     |
| 1. 管理人报酬               | 6.4.10.2.1 | 53,332.79                                | 51,555.16                                     |
| 2. 托管费                 | 6.4.10.2.2 | 10,666.55                                | 10,311.02                                     |
| 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 | 23,180.77  | 23,094.03     |
| <b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b> |          | -75,765.97 | -1,727,013.80 |
| 减：所得税费用                    |          | -          | -             |
| <b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>   |          | -75,765.97 | -1,727,013.80 |
| <b>五、其他综合收益的税后净额</b>       |          | -          | -             |
| <b>六、综合收益总额</b>            |          | -75,765.97 | -1,727,013.80 |

### 6.3 净资产（基金净值）变动表

会计主体：大成中证 100 交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日

单位：人民币元

| 项目                                  | 本期<br>2023 年 1 月 1 日至 2023 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)                     | 12,285,812.00                         | -      | 8,453,750.57 | 20,739,562.57 |
| 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)                     | 12,285,812.00                         | -      | 8,453,750.57 | 20,739,562.57 |
| 三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)                | -                                     | -      | -75,765.97   | -75,765.97    |
| (一)、综合收益总额                          | -                                     | -      | -75,765.97   | -75,765.97    |
| (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                             | -                                     | -      | -            | -             |

|  |  |        |               |               |
|--|--|--------|---------------|---------------|
| 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、本期期末净资产(基金净值)                          | 12,285,812.00                              | -      | 8,377,984.60  | 20,663,796.60 |
| 项目                                       | 上年度可比期间<br>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)                          | 11,285,812.00                              | -      | 12,772,897.18 | 24,058,709.18 |
| 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)                          | 11,285,812.00                              | -      | 12,772,897.18 | 24,058,709.18 |
| 三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)                     | -  | -      | -1,896,012.77 | -1,896,012.77 |
| (一)、综合收益总额                               | -  | -      | -1,727,013.80 | -1,727,013.80 |
| (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)      | -  | -      | -168,998.97   | -168,998.97   |
| 其中: 1. 基金申购款                             | 1,000,000.00                               | -      | 962,766.93    | 1,962,766.93  |
| 2. 基金赎回款                                 | -1,000,000.00                              | -      | -1,131,765.90 | -2,131,765.90 |
| (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)  | 11,285,812.00 | - | 10,876,884.41 | 22,162,696.41 |

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：

|            |           |           |
|------------|-----------|-----------|
| <u>谭晓冈</u> | <u>范瑛</u> | <u>孙蕊</u> |
| 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

大成中证 100 交易型开放式指数证券投资基金(以下简称“本基金”)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]1699 号《关于核准大成中证 100 交易型开放式指数证券投资基金募集的批复》核准,由大成基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《大成中证 100 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为交易型开放式,存续期限不定,首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币 399,268,419.00 元(含募集股票市值),业经普华永道中天会计师事务所有限公司普华永道中天验字(2013)第 042 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《大成中证 100 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》于 2013 年 2 月 7 日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为 399,285,812.00 份基金份额,其中认购资金利息折合 17,393.00 份基金份额。本基金的基金管理人为大成基金管理有限公司,基金托管人为中国银行股份有限公司。

经深圳证券交易所(以下简称“深交所”)深证上[2013]71 号文审核同意,本基金 399,285,812.00 份基金份额于 2013 年 3 月 5 日在深交所挂牌交易。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《大成中证 100 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》的有关规定,本基金以标的指数中证 100 指数成份股(含存托凭证)、备选成份股(含存托凭证)为主要投资对象;此外,为更好地实现投资目标,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。本基金投资标的指数成份股(含存托凭证)及备选成份股(含存托凭证)的比例不低于基金资产净值的 90%。在正常市场情况下,本基金日均跟踪偏

离度(剔除成份股分红因素)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 100 指数。

#### 6.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于 2006 年 2 月 15 日及以后期间颁布的《企业会计准则—基本准则》、各项具体会计准则、《资产管理产品相关会计处理规定》及其他相关规定(以下合称“企业会计准则”)、中国证监会颁布的《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>》、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《大成中证 100 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》和在财务报表附注 6.4.4 所列示的中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

本财务报表以持续经营为基础编制。

#### 6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金于 2023 年 6 月 30 日的财务状况以及自 2023 年 1 月 1 日起至 2023 年 6 月 30 日止期间的经营成果和净值变动情况。

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

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

#### 6.4.5 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

本基金本报告期未发生会计政策变更。

##### 6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

##### 6.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无重大会计差错更正。

#### 6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128 号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2008]1 号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85 号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2015]101 号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2016]36 号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46 号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70 号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、财税[2016]140 号《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》、财税[2017]2 号《关于资管产品增值

税政策有关问题的补充通知》、财税[2017]56 号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90 号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1) 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。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，暂适用简易计税方法，按照 3% 的征收率缴纳增值税。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。

对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，对国债、地方政府债以及金融同业往来利息收入亦免征增值税。资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务，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。资管产品管理人运营资管产品转让 2017 年 12 月 31 日前取得的非货物期货，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非货物期货结算价格作为买入价计算销售额。

(2) 对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，股票的股息、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) 对基金取得的企业债券利息收入，应由发行债券的企业在向基金支付利息时代扣代缴 20% 的个人所得税。对基金从上市公司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，暂减按 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。对基金持有的上市公司限售股，解禁后取得的股息、红利收入，按照上述规定计算纳税，持股时间自解禁日起计算；解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按 50% 计入应纳税所得额。上述所得统一适用 20% 的税率计征个人所得税。

(4) 基金卖出股票按 0.1% 的税率缴纳股票交易印花税，买入股票不征收股票交易印花税。

(5) 本基金的城市维护建设税、教育费附加和地方教育附加等税费按照实际缴纳增值税额的适用比例计算缴纳。

## 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<br>2023 年 6 月 30 日 |
|--------|------------------------|
| 活期存款   | 409,419.19             |
| 等于：本金  | 409,370.13             |
| 加：应计利息 | 49.06                  |

|                |            |
|----------------|------------|
| 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             | 409,419.19 |

#### 6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

| 项目                | 本期末<br>2023 年 6 月 30 日 |      |               |               |
|-------------------|------------------------|------|---------------|---------------|
|                   | 成本                     | 应计利息 | 公允价值          | 公允价值变动        |
| 股票                | 24,671,132.60          | -    | 20,286,892.99 | -4,384,239.61 |
| 贵金属投资-金交所<br>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                | 24,671,132.60          | -    | 20,286,892.99 | -4,384,239.61 |

#### 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<br>2023 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      | 1,119.39               |
| 其中：交易所市场    | 1,119.39               |
| 银行间市场       | -                      |
| 应付利息        | -                      |
| 预提费用        | 19,835.79              |
| 应付指数使用费     | 1,581.19               |

|    |           |
|----|-----------|
| 合计 | 22,536.37 |
|----|-----------|

#### 6.4.7.10 实收基金

金额单位：人民币元

| 项目            | 本期<br>2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日 |               |
|---------------|---------------------------------------|---------------|
|               | 基金份额（份）                               | 账面金额          |
| 上年度末          | 12,285,812.00                         | 12,285,812.00 |
| 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           | 12,285,812.00                         | 12,285,812.00 |

#### 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      |
|----------------|---------------|---------------|--------------|
| 上年度末           | 11,822,923.83 | -3,369,173.26 | 8,453,750.57 |
| 本期利润           | 34,570.60     | -110,336.57   | -75,765.97   |
| 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            | 11,857,494.43 | -3,479,509.83 | 8,377,984.60 |

#### 6.4.7.13 存款利息收入

单位：人民币元

| 项目        | 本期<br>2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日 |        |
|-----------|---------------------------------------|--------|
|           | 活期存款利息收入                              | 888.76 |
| 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 | 7.76                                  |        |
| 其他        | 1.53                                  |        |
| 合计        | 898.05                                |        |

#### 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<br>2023年1月1日至2023年6月30日 |
|------------------|----------------------------|
| 股票投资收益——买卖股票差价收入 | -129,740.73                |
| 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               | -129,740.73                |

#### 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<br>2023年1月1日至2023年6月30日 |
|------------|----------------------------|
| 卖出股票成交总额   | 662,828.00                 |
| 减：卖出股票成本总额 | 790,664.33                 |
| 减：交易费用     | 1,904.40                   |
| 买卖股票差价收入   | -129,740.73                |

#### 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

无。

##### 6.4.7.15.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

无。

##### 6.4.7.15.3 债券投资收益——赎回差价收入

无。

##### 6.4.7.15.4 债券投资收益——申购差价收入

无。

## 6.4.7.16 资产支持证券投资收益

## 6.4.7.16.1 资产支持证券投资收益项目构成

无。

## 6.4.7.16.2 资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入

无。

## 6.4.7.16.3 资产支持证券投资收益——赎回差价收入

无。

## 6.4.7.16.4 资产支持证券投资收益——申购差价收入

无。

## 6.4.7.17 贵金属投资收益

## 6.4.7.17.1 贵金属投资收益项目构成

无。

## 6.4.7.17.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

无。

## 6.4.7.17.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

无。

## 6.4.7.17.4 贵金属投资收益——申购差价收入

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                              |
|---------------|---------------------------------|
|               | 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日 |
| 股票投资产生的股利收益   | 250,593.39                      |
| 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            | 250,593.39                      |

## 6.4.7.20 公允价值变动收益

单位：人民币元

| 项目名称                   | 本期                              |
|------------------------|---------------------------------|
|                        | 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日 |
| 1. 交易性金融资产             | -110,336.57                     |
| 股票投资                   | -110,336.57                     |
| 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                     | -110,336.57                     |

## 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                              |
|---------|---------------------------------|
|         | 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日 |
| 审计费用    | 19,835.79                       |
| 信息披露费   | -                               |
| 证券出借违约金 | -                               |
| 银行划款手续费 | 145.00                          |
| 指数使用费   | 3,199.98                        |
| 合计      | 23,180.77                       |

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。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为每季度人民币 35000 元；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

本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

##### 6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

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

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<br>2023年1月1日至2023年6月<br>30日 |                         | 上年度可比期间<br>2022年1月1日至2022年6月30日 |                         |
|-------|--------------------------------|-------------------------|---------------------------------|-------------------------|
|       | 成交金额                           | 占当期股票<br>成交总额的比<br>例(%) | 成交金额                            | 占当期股票<br>成交总额的比<br>例(%) |
| 光大证券  | 1,551,915.00                   | 100.00                  | 12,540,152.80                   | 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<br>2023年1月1日至2023年6月30<br>日 |                         | 上年度可比期间<br>2022年1月1日至2022年6月30日 |                         |
|-------|--------------------------------|-------------------------|---------------------------------|-------------------------|
|       | 成交金额                           | 占当期债券<br>成交总额的比<br>例(%) | 成交金额                            | 占当期债券<br>成交总额的比<br>例(%) |
| 光大证券  | -                              | -                       | 35,577.81                       | 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<br>2023年1月1日至2023年6月30日      |                    |              |                      |
|-------|---------------------------------|--------------------|--------------|----------------------|
|       | 当期<br>佣金                        | 占当期佣金总量<br>的比例 (%) | 期末应付佣金余<br>额 | 占期末应付佣金<br>总额的比例 (%) |
| 光大证券  | 1,119.39                        | 100.00             | 1,119.39     | 100.00               |
| 关联方名称 | 上年度可比期间<br>2022年1月1日至2022年6月30日 |                    |              |                      |
|       | 当期<br>佣金                        | 占当期佣金总量<br>的比例 (%) | 期末应付佣金余<br>额 | 占期末应付佣金<br>总额的比例 (%) |
| 光大证券  | 9,044.82                        | 100.00             | 9,044.82     | 100.00               |

注：1. 上述佣金参考市场价格经本基金的基金管理人与对方协商确定，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<br>2023年1月1日至2023年6<br>月30日 | 上年度可比期间<br>2022年1月1日至2022<br>年6月30日 |
|---------------------|--------------------------------|-------------------------------------|
| 当期发生的基金应支付的管理费      | 53,332.79                      | 51,555.16                           |
| 其中：支付销售机构的客户维护<br>费 | -                              | -                                   |

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 0.50% 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：

$$\text{日管理人报酬} = \text{前一日基金资产净值} \times 0.50\% / \text{当年天数}。$$

##### 6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

| 项目             | 本期<br>2023年1月1日至2023年6<br>月30日 | 上年度可比期间<br>2022年1月1日至2022<br>年6月30日 |
|----------------|--------------------------------|-------------------------------------|
| 当期发生的基金应支付的托管费 | 10,666.55                      | 10,311.02                           |

注：支付基金托管人中国银行的托管费按前一日基金资产净值 0.10% 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：

日托管费=前一日基金资产净值 × 0.10%/ 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

无。

##### 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<br>2023年1月1日至2023年6月30日 |        | 上年度可比期间<br>2022年1月1日至2022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  | 409,419.19                 | 888.76 | 778,050.43                      | 1,136.27 |

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（2023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

本基金是指数型基金，采用完全复制的被动投资策略，跟踪中证 100 指数，相对于混合型基金、债券型基金与货币市场基金而言，其风险和收益较高，属于股票型基金中高风险、高收益的产品。本基金在日常经营活动中面临的与这些金融工具相关的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。同时，本基金相对于采用抽样复制的指数型基金而言，其风险和收益特征将更能与标的指数保持基本一致。本基金的基金管理人从事风险管理的主要目标是争取将以上风险控制在限定的范围之内，使本基金在风险和收益之间取得最佳的平衡以实现与跟踪指数相同的风险收益目标。

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银行股份有限公司，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。信用等级评估以内部信用评级为主，外部信用评级为辅。内部债券信用评级主要考察发行人的经营风险、财务风险和流动性风险，以及信用产品的条款和担保人的情况等。此外，本基金的基金管理人根据信用产品的内部评级，通过单只信用产品投资占基金资产净值的比例及占发行量的比例进行控制，通过分散化投资以分散信用风险。

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受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。

本基金持有及承担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、结算备付金和存出保证金等。

##### 6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

| 本期末<br>2023 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                   | 409,419.19 | -     | -     | -             | 409,419.19    |
| 存出保证金                  | 193.65     | -     | -     | -             | 193.65        |
| 交易性金融资产                | -          | -     | -     | 20,286,892.99 | 20,286,892.99 |
| 资产总计                   | 409,612.84 | -     | -     | 20,286,892.99 | 20,696,505.83 |
| 负债                     |            |       |       |               |               |
| 应付管理人报酬                | -          | -     | -     | 8,477.37      | 8,477.37      |
| 应付托管费                  | -          | -     | -     | 1,695.49      | 1,695.49      |
| 其他负债                   | -          | -     | -     | 22,536.37     | 22,536.37     |
| 负债总计                   | -          | -     | -     | 32,709.23     | 32,709.23     |
| 利率敏感度缺口                | 409,612.84 | -     | -     | 20,254,183.76 | 20,663,796.60 |

| 上年度末<br>2022 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                     | 522,833.00 | -     | -     | -             | 522,833.00    |
| 存出保证金                    | 1,230.37   | -     | -     | -             | 1,230.37      |
| 交易性金融资产                  | -          | -     | -     | 20,268,861.89 | 20,268,861.89 |
| 资产总计                     | 524,063.37 | -     | -     | 20,268,861.89 | 20,792,925.26 |
| 负债                       |            |       |       |               |               |
| 应付管理人报酬                  | -          | -     | -     | 8,894.28      | 8,894.28      |
| 应付托管费                    | -          | -     | -     | 1,778.88      | 1,778.88      |
| 其他负债                     | -          | -     | -     | 42,689.53     | 42,689.53     |
| 负债总计                     | -          | -     | -     | 53,362.69     | 53,362.69     |
| 利率敏感度缺口                  | 524,063.37 | -     | -     | 20,215,499.20 | 20,739,562.57 |

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。本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无重大外汇风险。

#### 6.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险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。

本基金采用完全复制法跟踪中证 100 指数，以完全按照标的指数成份股组成及其权重构建基金股票投资组合为原则，通过指数化分散投资降低其他价格风险。本基金投资组合中，中证 100 指数成份股和备选成份股股票投资比例不低于基金资产净值的 90%。此外，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，包括 VaR(Value at Risk) 指标等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<br>2023 年 6 月 30 日 |                   | 上年度末<br>2022 年 12 月 31 日 |                   |
|---------------|------------------------|-------------------|--------------------------|-------------------|
|               | 公允价值                   | 占基金资产净值<br>比例 (%) | 公允价值                     | 占基金资产净值<br>比例 (%) |
| 交易性金融资产—股票投资  | 20,286,892.99          | 98.18             | 20,268,861.89            | 97.73             |
| 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            | 20,286,892.99          | 98.18             | 20,268,861.89            | 97.73             |

#### 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 |                             |                        |
|----|----------------------|-----------------------------|------------------------|
| 分析 | 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（2023 年 6 月 30 日）        | 上年度末（2022 年 12 月 31 日） |
|    | 业绩比较基准上升 5%          | 1,016,081.41                | 1,009,618.95           |
|    | 业绩比较基准下降 5%          | -1,016,081.41               | -1,009,618.95          |

#### 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<br>2023 年 6 月 30 日 | 上年度末<br>2022 年 12 月 31 日 |
|---------------|------------------------|--------------------------|
| 第一层次          | 20,286,892.99          | 20,268,861.89            |
| 第二层次          | -                      | -                        |
| 第三层次          | -                      | -                        |
| 合计            | 20,286,892.99          | 20,268,861.89            |

#### 6.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

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<br>(%) |
|----|--------|---------------|------------------|
| 1  | 权益投资   | 20,286,892.99 | 98.02            |
|    | 其中：股票  | 20,286,892.99 | 98.02            |
| 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      | 409,419.19    | 1.98   |
| 8 | 其他各项资产            | 193.65        | 0.00   |
| 9 | 合计                | 20,696,505.83 | 100.00 |

注：上述股票投资金额包括可退替代款估值增值（如有）。

## 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         | 215,808.00    | 1.04         |
| B  | 采矿业              | 1,121,951.73  | 5.43         |
| C  | 制造业              | 12,422,580.73 | 60.12        |
| D  | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | 668,789.02    | 3.24         |
| E  | 建筑业              | 368,632.26    | 1.78         |
| F  | 批发和零售业           | -             | -            |
| G  | 交通运输、仓储和邮政业      | 319,274.00    | 1.55         |
| H  | 住宿和餐饮业           | -             | -            |
| I  | 信息传输、软件和信息技术服务业  | 1,564,062.70  | 7.57         |
| J  | 金融业              | 2,341,627.64  | 11.33        |
| K  | 房地产业             | 427,299.57    | 2.07         |
| L  | 租赁和商务服务业         | 327,363.36    | 1.58         |
| M  | 科学研究和技术服务业       | 301,504.93    | 1.46         |
| 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          | 160,105.05    | 0.77         |
| R  | 文化、体育和娱乐业        | 47,894.00     | 0.23         |
| S  | 综合               | -             | -            |

|  |    |               |       |
|--|----|---------------|-------|
|  | 合计 | 20,286,892.99 | 98.18 |
|--|----|---------------|-------|

## 7.2.2 报告期末积极投资按行业分类的境内股票投资组合

本基金本报告期末未持有积极投资。

## 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<br>(股) | 公允价值 (元)     | 占基金资产净值比例<br>(%) |
|----|--------|--------|-----------|--------------|------------------|
| 1  | 600519 | 贵州茅台   | 1,205     | 2,037,655.00 | 9.86             |
| 2  | 300750 | 宁德时代   | 4,940     | 1,130,222.60 | 5.47             |
| 3  | 601318 | 中国平安   | 20,188    | 936,723.20   | 4.53             |
| 4  | 600036 | 招商银行   | 23,061    | 755,478.36   | 3.66             |
| 5  | 000333 | 美的集团   | 9,117     | 537,173.64   | 2.60             |
| 6  | 002594 | 比亚迪    | 1,662     | 429,244.74   | 2.08             |
| 7  | 600900 | 长江电力   | 18,217    | 401,867.02   | 1.94             |
| 8  | 600276 | 恒瑞医药   | 8,324     | 398,719.60   | 1.93             |
| 9  | 601899 | 紫金矿业   | 30,611    | 348,047.07   | 1.68             |
| 10 | 300059 | 东方财富   | 23,605    | 335,191.00   | 1.62             |
| 11 | 601012 | 隆基绿能   | 11,300    | 323,971.00   | 1.57             |
| 12 | 601398 | 工商银行   | 65,194    | 314,235.08   | 1.52             |
| 13 | 600309 | 万华化学   | 3,500     | 307,440.00   | 1.49             |
| 14 | 000651 | 格力电器   | 8,384     | 306,099.84   | 1.48             |
| 15 | 002475 | 立讯精密   | 9,290     | 301,460.50   | 1.46             |
| 16 | 002415 | 海康威视   | 8,727     | 288,950.97   | 1.40             |
| 17 | 000725 | 京东方 A  | 69,800    | 285,482.00   | 1.38             |
| 18 | 688111 | 金山办公   | 600       | 283,332.00   | 1.37             |
| 19 | 300760 | 迈瑞医疗   | 900       | 269,820.00   | 1.31             |
| 20 | 000063 | 中兴通讯   | 5,904     | 268,868.16   | 1.30             |
| 21 | 603259 | 药明康德   | 3,803     | 236,964.93   | 1.15             |
| 22 | 002230 | 科大讯飞   | 3,400     | 231,064.00   | 1.12             |
| 23 | 600028 | 中国石化   | 35,460    | 225,525.60   | 1.09             |
| 24 | 300124 | 汇川技术   | 3,500     | 224,735.00   | 1.09             |
| 25 | 601668 | 中国建筑   | 38,999    | 223,854.26   | 1.08             |
| 26 | 300274 | 阳光电源   | 1,900     | 221,597.00   | 1.07             |
| 27 | 002714 | 牧原股份   | 5,120     | 215,808.00   | 1.04             |
| 28 | 002352 | 顺丰控股   | 4,600     | 207,414.00   | 1.00             |
| 29 | 002129 | TCL 中环 | 6,000     | 199,200.00   | 0.96             |
| 30 | 601888 | 中国中免   | 1,800     | 198,954.00   | 0.96             |

|    |        |        |        |            |      |
|----|--------|--------|--------|------------|------|
| 31 | 000792 | 盐湖股份   | 10,100 | 193,617.00 | 0.94 |
| 32 | 601088 | 中国神华   | 6,155  | 189,266.25 | 0.92 |
| 33 | 600031 | 三一重工   | 11,100 | 184,593.00 | 0.89 |
| 34 | 688981 | 中芯国际   | 3,600  | 181,872.00 | 0.88 |
| 35 | 000002 | 万科 A   | 12,642 | 177,240.84 | 0.86 |
| 36 | 600048 | 保利发展   | 13,391 | 174,484.73 | 0.84 |
| 37 | 600436 | 片仔癀    | 600    | 171,816.00 | 0.83 |
| 38 | 600406 | 国电南瑞   | 7,434  | 171,725.40 | 0.83 |
| 39 | 600438 | 通威股份   | 5,000  | 171,550.00 | 0.83 |
| 40 | 600050 | 中国联通   | 35,491 | 170,356.80 | 0.82 |
| 41 | 600690 | 海尔智家   | 7,000  | 164,360.00 | 0.80 |
| 42 | 601728 | 中国电信   | 28,900 | 162,707.00 | 0.79 |
| 43 | 600089 | 特变电工   | 7,200  | 160,488.00 | 0.78 |
| 44 | 300015 | 爱尔眼科   | 8,631  | 160,105.05 | 0.77 |
| 45 | 002371 | 北方华创   | 500    | 158,825.00 | 0.77 |
| 46 | 600941 | 中国移动   | 1,700  | 158,610.00 | 0.77 |
| 47 | 601857 | 中国石油   | 21,123 | 157,788.81 | 0.76 |
| 48 | 603501 | 韦尔股份   | 1,515  | 148,530.60 | 0.72 |
| 49 | 601766 | 中国中车   | 22,663 | 147,309.50 | 0.71 |
| 50 | 601390 | 中国中铁   | 19,100 | 144,778.00 | 0.70 |
| 51 | 600905 | 三峡能源   | 26,600 | 142,842.00 | 0.69 |
| 52 | 300014 | 亿纬锂能   | 2,300  | 139,150.00 | 0.67 |
| 53 | 000938 | 紫光股份   | 4,300  | 136,955.00 | 0.66 |
| 54 | 002466 | 天齐锂业   | 1,900  | 132,829.00 | 0.64 |
| 55 | 601225 | 陕西煤业   | 7,200  | 130,968.00 | 0.63 |
| 56 | 002027 | 分众传媒   | 18,856 | 128,409.36 | 0.62 |
| 57 | 002460 | 赣锋锂业   | 2,100  | 128,016.00 | 0.62 |
| 58 | 603986 | 兆易创新   | 1,200  | 127,500.00 | 0.62 |
| 59 | 000338 | 潍柴动力   | 10,100 | 125,846.00 | 0.61 |
| 60 | 600570 | 恒生电子   | 2,830  | 125,340.70 | 0.61 |
| 61 | 601985 | 中国核电   | 17,600 | 124,080.00 | 0.60 |
| 62 | 002049 | 紫光国微   | 1,220  | 113,765.00 | 0.55 |
| 63 | 600111 | 北方稀土   | 4,700  | 112,706.00 | 0.55 |
| 64 | 601919 | 中远海控   | 11,900 | 111,860.00 | 0.54 |
| 65 | 603799 | 华友钴业   | 2,400  | 110,184.00 | 0.53 |
| 66 | 000100 | TCL 科技 | 27,950 | 110,123.00 | 0.53 |
| 67 | 002812 | 恩捷股份   | 1,100  | 105,985.00 | 0.51 |
| 68 | 600893 | 航发动力   | 2,500  | 105,650.00 | 0.51 |
| 69 | 600585 | 海螺水泥   | 4,448  | 105,595.52 | 0.51 |
| 70 | 002271 | 东方雨虹   | 3,800  | 103,588.00 | 0.50 |
| 71 | 002555 | 三七互娱   | 2,900  | 101,152.00 | 0.49 |
| 72 | 300122 | 智飞生物   | 2,250  | 99,450.00  | 0.48 |
| 73 | 600019 | 宝钢股份   | 16,598 | 93,280.76  | 0.45 |

|     |        |      |        |           |      |
|-----|--------|------|--------|-----------|------|
| 74  | 002709 | 天赐材料 | 2,100  | 86,499.00 | 0.42 |
| 75  | 600426 | 华鲁恒升 | 2,800  | 85,764.00 | 0.42 |
| 76  | 688599 | 天合光能 | 2,000  | 85,220.00 | 0.41 |
| 77  | 002410 | 广联达  | 2,520  | 81,874.80 | 0.40 |
| 78  | 000661 | 长春高新 | 600    | 81,780.00 | 0.40 |
| 79  | 601600 | 中国铝业 | 14,800 | 81,252.00 | 0.39 |
| 80  | 002241 | 歌尔股份 | 4,500  | 79,875.00 | 0.39 |
| 81  | 300142 | 沃森生物 | 3,000  | 79,350.00 | 0.38 |
| 82  | 600745 | 闻泰科技 | 1,600  | 78,240.00 | 0.38 |
| 83  | 600588 | 用友网络 | 3,800  | 77,900.00 | 0.38 |
| 84  | 001979 | 招商蛇口 | 5,800  | 75,574.00 | 0.37 |
| 85  | 600010 | 包钢股份 | 42,200 | 75,538.00 | 0.37 |
| 86  | 300450 | 先导智能 | 2,000  | 72,340.00 | 0.35 |
| 87  | 603993 | 洛阳钼业 | 13,200 | 70,356.00 | 0.34 |
| 88  | 002493 | 荣盛石化 | 5,600  | 65,184.00 | 0.32 |
| 89  | 300347 | 泰格医药 | 1,000  | 64,540.00 | 0.31 |
| 90  | 600176 | 中国巨石 | 4,500  | 63,720.00 | 0.31 |
| 91  | 000301 | 东方盛虹 | 4,900  | 57,918.00 | 0.28 |
| 92  | 600346 | 恒力石化 | 3,900  | 55,887.00 | 0.27 |
| 93  | 300661 | 圣邦股份 | 650    | 53,384.50 | 0.26 |
| 94  | 600989 | 宝丰能源 | 4,100  | 51,701.00 | 0.25 |
| 95  | 603260 | 合盛硅业 | 700    | 49,014.00 | 0.24 |
| 96  | 300413 | 芒果超媒 | 1,400  | 47,894.00 | 0.23 |
| 97  | 002648 | 卫星化学 | 3,120  | 46,675.20 | 0.23 |
| 98  | 002601 | 龙佰集团 | 2,700  | 44,550.00 | 0.22 |
| 99  | 300628 | 亿联网络 | 980    | 34,368.60 | 0.17 |
| 100 | 000708 | 中信特钢 | 1,900  | 30,096.00 | 0.15 |

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

#### 7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

##### 7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

| 序号 | 股票代码   | 股票名称 | 本期累计买入金额   | 占期初基金资产净值比例(%) |
|----|--------|------|------------|----------------|
| 1  | 688111 | 金山办公 | 285,114.00 | 1.37           |
| 2  | 688599 | 天合光能 | 77,020.00  | 0.37           |
| 3  | 600941 | 中国移动 | 69,109.00  | 0.33           |
| 4  | 600028 | 中国石化 | 67,762.00  | 0.33           |
| 5  | 600905 | 三峡能源 | 56,051.00  | 0.27           |
| 6  | 601899 | 紫金矿业 | 39,166.00  | 0.19           |
| 7  | 300750 | 宁德时代 | 22,607.00  | 0.11           |
| 8  | 601857 | 中国石油 | 21,598.00  | 0.10           |



|    |        |      |           |      |
|----|--------|------|-----------|------|
| 9  | 000938 | 紫光股份 | 19,449.00 | 0.09 |
| 10 | 603501 | 韦尔股份 | 19,176.00 | 0.09 |
| 11 | 000301 | 东方盛虹 | 14,727.00 | 0.07 |
| 12 | 600111 | 北方稀土 | 14,339.00 | 0.07 |
| 13 | 603260 | 合盛硅业 | 14,019.00 | 0.07 |
| 14 | 601318 | 中国平安 | 13,902.00 | 0.07 |
| 15 | 002555 | 三七互娱 | 10,203.00 | 0.05 |
| 16 | 002812 | 恩捷股份 | 9,942.00  | 0.05 |
| 17 | 688249 | 晶合集成 | 9,930.00  | 0.05 |
| 18 | 600745 | 闻泰科技 | 9,910.00  | 0.05 |
| 19 | 600036 | 招商银行 | 9,870.00  | 0.05 |
| 20 | 301355 | 南王科技 | 8,775.00  | 0.04 |

注：本项中“本期累计买入金额”按买入成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

#### 7.4.2 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  | 600900 | 长江电力 | 76,296.00 | 0.37           |
| 2  | 300782 | 卓胜微  | 76,137.00 | 0.37           |
| 3  | 300750 | 宁德时代 | 42,478.00 | 0.20           |
| 4  | 600219 | 南山铝业 | 41,230.00 | 0.20           |
| 5  | 002594 | 比亚迪  | 26,076.00 | 0.13           |
| 6  | 601318 | 中国平安 | 24,703.00 | 0.12           |
| 7  | 600036 | 招商银行 | 20,196.00 | 0.10           |
| 8  | 000661 | 长春高新 | 13,743.00 | 0.07           |
| 9  | 001979 | 招商蛇口 | 12,132.00 | 0.06           |
| 10 | 000333 | 美的集团 | 11,488.00 | 0.06           |
| 11 | 688981 | 中芯国际 | 10,576.00 | 0.05           |
| 12 | 300274 | 阳光电源 | 10,464.00 | 0.05           |
| 13 | 603986 | 兆易创新 | 10,235.00 | 0.05           |
| 14 | 688249 | 晶合集成 | 9,935.00  | 0.05           |
| 15 | 301355 | 南王科技 | 9,710.00  | 0.05           |
| 16 | 002415 | 海康威视 | 9,504.00  | 0.05           |
| 17 | 688472 | 阿特斯  | 9,071.00  | 0.04           |
| 18 | 600276 | 恒瑞医药 | 8,958.00  | 0.04           |
| 19 | 002049 | 紫光国微 | 8,626.00  | 0.04           |
| 20 | 300059 | 东方财富 | 8,484.00  | 0.04           |

注：本项中“本期累计卖出金额”按卖出成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

### 7.4.3 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 | 919,032.00 |
| 卖出股票收入（成交）总额 | 662,828.00 |

注：本项中“买入股票的成本(成交)总额”及“卖出股票的收入(成交)总额”均按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

### 7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

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

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

本基金投资的前十名证券之一招商银行的发行主体招商银行股份有限公司于 2022 年 8 月 31 日因违反账户管理规定等，受到中国人民银行处罚（银罚决字（2022）1 号），于 2022 年 9 月 9 日因个人经营贷款挪用至房地产市场等，受到中国银行保险监督管理委员会处罚（银保监罚决字（2022）48 号）。招商银行为本基金跟踪标的指数的成份券。

#### 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 | 193.65 |
| 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    | 193.65 |

## 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<br>(户) | 户均持有的<br>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<br>例 (%) | 持有份额          | 占总份额比<br>例 (%) |
| 1,245        | 9,868.12      | 1,291,414.00 | 10.51          | 10,994,398.00 | 89.49          |

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  | 中信建投证券股份有<br>限公司 | 1,272,414.00 | 10.36        |
| 2  | 杜登刚              | 1,149,000.00 | 9.35         |

|    |     |            |      |
|----|-----|------------|------|
| 3  | 吴迅磊 | 467,300.00 | 3.80 |
| 4  | 韩悦  | 261,400.00 | 2.13 |
| 5  | 唐维维 | 198,005.00 | 1.61 |
| 6  | 曾雪艳 | 194,200.00 | 1.58 |
| 7  | 王曙光 | 174,400.00 | 1.42 |
| 8  | 朱冠卿 | 153,001.00 | 1.25 |
| 9  | 王亚丽 | 127,100.00 | 1.03 |
| 10 | 钱俊  | 122,400.00 | 1.00 |

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<br>究部门负责人持有本开放式基金 | 0                 |
| 本基金基金经理持有本开放式基金                    | 0                 |

## § 9 开放式基金份额变动

单位：份

|                              |                |
|------------------------------|----------------|
| 基金合同生效日（2013年2月7日）<br>基金份额总额 | 399,285,812.00 |
| 本报告期期初基金份额总额                 | 12,285,812.00  |
| 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                 | 12,285,812.00  |

## § 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

经大成基金管理有限公司第八届董事会第二次会议审议通过，自 2023 年 3 月 25 日起，温智敏先生不再担任公司副总经理职务；聘请石国武先生担任公司副总经理，任期自 2023 年 3 月 25 日起，至公司第八届董事会任期届满之日止。具体详见我司发布的《大成基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告》。

## 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，基金托管人的基金托管部门无重大人事变动。

### 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内，无涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。

### 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普华永道中天会计师事务所(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

#### 10.6.1 管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，基金管理人及其相关高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

#### 10.6.2 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，本基金托管人的托管业务部门及其相关高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

### 10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

#### 10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

| 券商名称 | 交易单元数量 | 股票交易         |                  | 应支付该券商的佣金 |                | 备注 |
|------|--------|--------------|------------------|-----------|----------------|----|
|      |        | 成交金额         | 占当期股票成交总额的比例 (%) | 佣金        | 占当期佣金总量的比例 (%) |    |
| 光大证券 | 2      | 1,551,915.00 | 100.00           | 1,119.39  | 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 | 2      | -            | -                | -         | -              | -  |
| 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 | - | - | - | - | - |
| 平安证券   | 1 | - | - | - | - | - |
| 申万宏源   | 1 | - | - | - | - | - |
| 太平洋证券  | 1 | - | - | - | - | - |
| 万联证券   | 1 | - | - | - | - | - |
| 西部证券   | 1 | - | - | - | - | - |
| 西南证券   | 1 | - | - | - | - | - |
| 湘财证券   | 1 | - | - | - | - | - |
| 招商证券   | 3 | - | - | - | - | - |
| 银河证券   | 1 | - | - | - | - | - |
| 摩根大通   | 1 | - | - | - | - | - |
| 中金财富   | 2 | - | - | - | - | - |
| 中金公司   | 2 | - | - | - | - | - |
| 中信建投证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 中信证券   | 3 | - | - | - | - | - |
| 中信证券华南 | 1 | - | - | - | - | - |
| 中邮证券   | 2 | - | - | - | - | - |

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：

- （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。

2、报告期内租用交易单元变更情况, 新增交易单元: 中邮证券、东吴证券、西部证券。退租交易单元: 无。

### 10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

无。

### 10.8 其他重大事件

| 序号 | 公告事项                                   | 法定披露方式                   | 法定披露日期          |
|----|--|--------------------------|-----------------|
| 1  | 关于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 | 2023 年 6 月 30 日 |
| 2  | 大成基金管理有限公司提醒投资者谨防金融诈骗的公告               | 中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站 | 2023 年 4 月 27 日 |
| 3  | 大成中证 100 交易型开放式指数证券投资基金 2023 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 | 2023 年 4 月 21 日 |
| 4  | 大成中证 100 交易型开放式指数证券投资基金 2022 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 | 2023 年 3 月 30 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 | 2023 年 3 月 27 日 |
| 6  | 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 | 2023 年 3 月 27 日 |
| 7  | 大成基金管理有限公司关于养老金客户通过直销柜台申购旗下基金费率优惠的公告   | 中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站 | 2023 年 3 月 24 日 |
| 8  | 大成中证 100 交易型开放式指数证券投资基金基金产品资料概要更新      | 中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站 | 2023 年 3 月 22 日 |
| 9  | 大成中证 100 交易型开放式指数证券投资基金更新招募说明书         | 中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站 | 2023 年 3 月 22 日 |

|    |  |                          |                 |
|----|--|--------------------------|-----------------|
| 10 | 大成中证 100 交易型开放式指数证券投资基金变更基金经理公告        | 中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站 | 2023 年 3 月 21 日 |
| 11 | 大成中证 100 交易型开放式指数证券投资基金更新招募说明书         | 中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站 | 2023 年 3 月 7 日  |
| 12 | 大成中证 100 交易型开放式指数证券投资基金 2022 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 | 2023 年 1 月 18 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中证 100 交易型开放式指数证券投资基金的文件；
- 2、《大成中证 100 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》；
- 3、《大成中证 100 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

2023 年 8 月 30 日