

大成绝对收益策略混合型发起式证券投资 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：中国农业银行股份有限公司

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。

基金托管人中国农业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

§ 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	11
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	12
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	12
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	13
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	13
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	14
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	14
§ 5 托管人报告	14
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真实、准确和完整发表意见	14
§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）	14
6.1 资产负债表	14
6.2 利润表	16
6.3 净资产（基金净值）变动表	17
6.4 报表附注	19
§ 7 投资组合报告	41
7.1 期末基金资产组合情况	41
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	41
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	42
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	51
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	52
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	53
7.12 市场中性策略执行情况	53
7.13 投资组合报告附注	53
§ 8 基金份额持有人信息	54
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	54
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	55
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	55
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	56
§ 10 重大事件揭示	56
10.1 基金份额持有人大会决议	56
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	56
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	57
10.4 基金投资策略的改变	57
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	57
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	57
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	57
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	61
§ 12 备查文件目录	61
12.1 备查文件目录	61
12.2 存放地点	61
12.3 查阅方式	61

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	大成绝对收益策略混合型发起式证券投资基金	
基金简称	大成绝对收益策略混合型发起式	
基金主代码	001791	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2015 年 9 月 23 日	
基金管理人	大成基金管理有限公司	
基金托管人	中国农业银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	64,478,744.57 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	大成绝对收益混合发起 A	大成绝对收益混合发起 C
下属分级基金的交易代码	001791	001792
报告期末下属分级基金的份额总额	13,841,576.07 份	50,637,168.50 份

2.2 基金产品说明

投资目标	灵活配置股票和债券等各类资产的比例，优选量化投资策略进行投资，在有效控制风险的基础上，运用股指期货等工具对冲市场风险，寻求基金资产的长期稳健增值。
投资策略	<p>本基金采用多种绝对收益策略，剥离系统性风险，力争实现稳定的绝对回报。</p> <p>1、Alpha 对冲策略 本基金通过持续、科学、系统、深入的研究构建多头股票组合，并匹配合适的空头工具，剥离系统性风险。</p> <p>2、其他绝对收益策略 本基金主要采用事件驱动、股指期货套利的对冲策略来捕捉绝对收益机会。同时，本基金根据市场情况的变化，灵活运用其他绝对收益策略（如统计套利策略、定向增发套利策略、大宗交易套利、并购套利策略等）策略提高资本的利用率，从而提高绝对收益，达到投资策略的多元化以进一步降低本基金收益的波动。</p>
业绩比较基准	中国人民银行公布的一年期定期存款基准利率（税后）
风险收益特征	本基金具有低波动率、低下方风险的特点，并且运用股指期货对冲投资组合的系统性风险，其预期收益及风险水平低于股票型基金，但高于债券型基金，属于中低风险水平的基金。

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	中国农业银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	段皓静	秦一楠
	联系电话	0755-83183388	010-66060069

电子邮箱	office@dcfund.com.cn	tgxxpl@abchina.com
客户服务电话	4008885558	95599
传真	0755-83199588	010-68121816
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	北京市东城区建国门内大街 69 号
办公地址	广东省深圳市南山区海德三道 1236 号大成基金总部大厦 5 层、27-33 层	北京市西城区复兴门内大街 28 号凯晨世贸中心东座 F9
邮政编码	518054	100031
法定代表人	吴庆斌	谷澍

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	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(2023 年 1 月 1 日-2023 年 6 月 30 日)	
	大成绝对收益混合发起 A	大成绝对收益混合发起 C
本期已实现收益	-458,763.27	-767,311.87
本期利润	-77,062.03	-84,120.94
加权平均基金份额本期利润	-0.0056	-0.0035
本期加权平均净值利润率	-0.66%	-0.44%
本期基金份额净值增长率	-0.60%	-1.14%
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	-2,356,509.09	-11,129,344.42
期末可供分配基金份额利润	-0.1702	-0.2198
期末基金资产净值	11,485,066.98	39,507,824.08
期末基金份额净值	0.830	0.780
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	-17.00%	-22.00%

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

大成绝对收益混合发起 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	-0.60%	0.25%	0.11%	0.00%	-0.71%	0.25%
过去三个月	-0.72%	0.27%	0.34%	0.00%	-1.06%	0.27%
过去六个月	-0.60%	0.24%	0.67%	0.00%	-1.27%	0.24%
过去一年	-1.78%	0.23%	1.36%	0.00%	-3.14%	0.23%
过去三年	-17.82%	0.32%	4.20%	0.00%	-22.02%	0.32%
自基金合同生效起至今	-17.00%	0.27%	11.68%	0.00%	-28.68%	0.27%

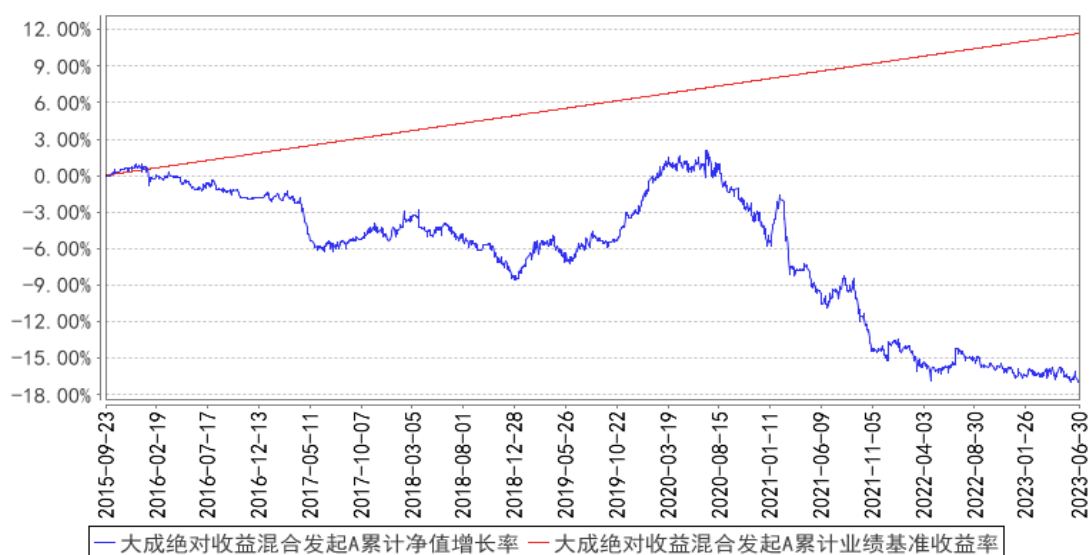
大成绝对收益混合发起 C

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

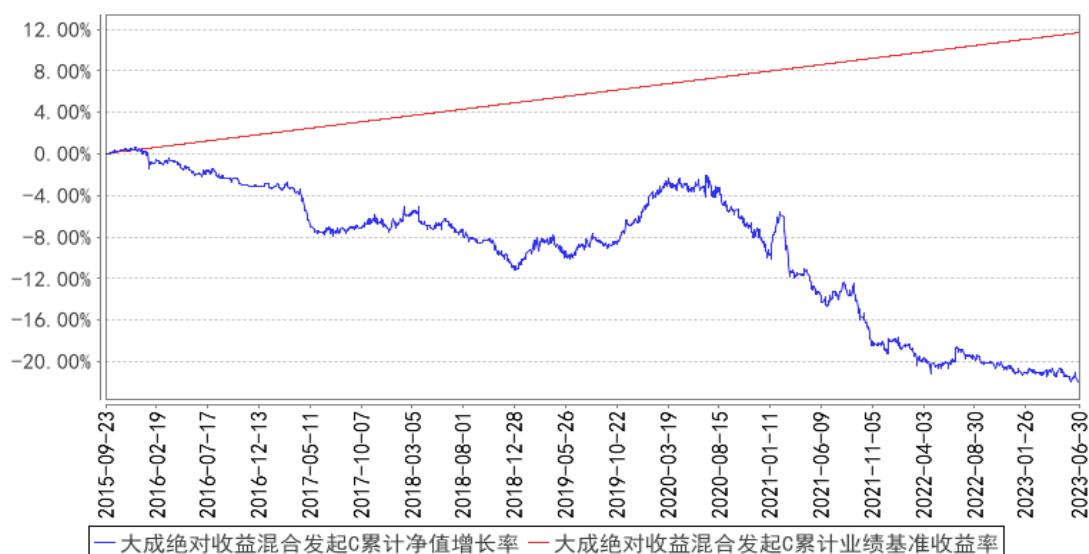
	率①	准差②	率③	④		
过去一个月	-0.76%	0.24%	0.11%	0.00%	-0.87%	0.24%
过去三个月	-1.02%	0.26%	0.34%	0.00%	-1.36%	0.26%
过去六个月	-1.14%	0.23%	0.67%	0.00%	-1.81%	0.23%
过去一年	-2.50%	0.23%	1.36%	0.00%	-3.86%	0.23%
过去三年	-19.50%	0.32%	4.20%	0.00%	- 23.70%	0.32%
自基金合同生效 起至今	-22.00%	0.27%	11.68%	0.00%	- 33.68%	0.27%

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

大成绝对收益混合发起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



大成绝对收益混合发起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		
李绍	本基金基	2021年	-	23年	东北财经大学经济学硕士。曾先后任职于

	金经理， 指数与期 货投资部 总监	10 月 21 日			大连商品交易所、中国金融期货交易所和中国期货市场监控中心，曾负责中国证监会期货市场运行监测监控系统建设，获证券期货科技进步评比一等奖；主持编制发布中国商品期货指数、农产品期货指数等系列指数。2015 年 5 月加入大成基金管理有限公司，现任指数与期货投资部总监。2019 年 10 月 24 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基金经理。2019 年 10 月 30 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联接基金基金经理。2021 年 10 月 21 日起任大成绝对收益策略混合型发起式证券投资基金基金经理。2022 年 3 月 18 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。2023 年 3 月 20 日起任大成中证红利指数证券投资基金、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、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。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。具有基金从业资格。国籍：中国
刘旺	本基金基 金经理助 理	2022 年 12 月 19 日	—	5 年	香港中文大学理学(金融工程)硕士。2018 年 5 月加入大成基金管理有限公司，现任指数与期货投资部研究员兼基金经理助理。2022 年 12 月 19 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 12 月 19 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、大成沪深 300 指数证券投资基金、大成景恒混合型证券投资基金、大成核心双动力混合型证券投资基金、大成智惠量化多策略灵活配置混合型证券投资基金、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、大成深证成长 40 交易型开放式指数证券投资基金、大成深证成长 40 交易型开放式指数证券投资基金联接基金、大成深证成份交易型开放式指数证券

					投资基金、大成中证电池主题指数型发起式证券投资基金、大成动态量化配置策略混合型证券投资基金基金经理助理。具备基金从业资格。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 MSCI 中国 A 股质优价值 100 交易型开放式指数证券投资基金、大成深证成长 40 交易型开放式指数证券投资基金联接基金、大成 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。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所公开竞价，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

2023 年上半年，股票权益市场整体呈现先扬后抑走势，且大小票市值股票表现差异较大，人工智能、传媒等中小市值股票表现抢眼，新能源则成为上半年最差资产之一，整体看，上半年沪深 300 指数下跌 0.75%，上证 50 指数下跌 5.43%，中证 500 指数上涨 2.29%，中证 1000 指数上涨 5.10%。

本基金在上半年将股票多头主要配置于上证 50 成份股和中证 1000 成份股，增加了配置切换的频率，增配了部分小市值股票，并选择合适股指期货合约进行对冲配置，确保投资比例符合合同约定。同时，利用量化模型对股指期货对冲头寸中基于合约月间价差、品种价差进行了部分套利交易。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末大成绝对收益混合发起 A 的基金份额净值为 0.830 元，本报告期基金份额净值增长率为-0.60%，同期业绩比较基准收益率为 0.67%；截至本报告期末大成绝对收益混合发起 C

的基金份额净值为 0.780 元，本报告期基金份额净值增长率为-1.14%，同期业绩比较基准收益率为 0.67%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

2023 年上半年是我国全面走出疫情、社会经济活动全面恢复正常的新起点。期间国际政治、经济形势异常复杂，每一个身处其中的人都能从各自工作、生活和学习中感受到时代巨变带来的影响。国内股票权益市场上半年先扬后抑的走势较好诠释了相关信息。市场在期待有更多的政策来进一步确立信心，相信随着下半年国家相关政策的逐渐调整和落实到位，能逐渐提升整体信心，从而在目前指数点位下，让我们对后市逐渐乐观起来。

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

在托管本基金的过程中，本基金托管人中国农业银行股份有限公司严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》相关法律法规的规定以及基金合同、托管协议的约定，对本基金基金管理人——大成基金管理有限公司 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日基金的投资运作，进行了认真、独立的会计核算和必要的投资监督，认真履行了托管人的义务，没有从事任何损害基金份额持有人利益的行为。

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

本托管人认为，大成基金管理有限公司在本基金的投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支及利润分配等问题上，不存在损害基金份额持有人利益的行为；在报告期内，严格遵守了《中华人民共和国证券投资基金法》等有关法律法规，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真实、准确和完整发表意见

本托管人认为，大成基金管理有限公司的信息披露事务符合《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》及其他相关法律法规的规定，基金管理人所编制和披露的本基金中期报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告等信息真实、准确、完整，未发现有关损害基金持有人利益的行为。

§ 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：大成绝对收益策略混合型发起式证券投资基金

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 2023 年 6 月 30 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
资 产：			
银行存款	6.4.7.1	5,820,846.21	4,926,962.40
结算备付金		23,909,399.71	37,753,194.20
存出保证金		2,038,571.04	1,622,424.20
交易性金融资产	6.4.7.2	20,272,798.95	15,485,254.60
其中：股票投资		20,272,798.95	15,485,254.60
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		-	56,678.04
应收股利		-	-
应收申购款		1,249.38	1,610.00
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.8	-	-
资产总计		52,042,865.29	59,846,123.44
负债和净资产	附注号	本期末 2023 年 6 月 30 日	上年度末 2022 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		782,617.81	240,333.84
应付赎回款		-	9,850.03
应付管理人报酬		37,034.93	42,008.05
应付托管费		6,172.44	7,001.33
应付销售服务费		12,169.97	14,440.05
应付投资顾问费		-	-
应交税费		1,149.98	-

应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.9	210,829.10	106,498.97
负债合计		1,049,974.23	420,132.27
净资产：			
实收基金	6.4.7.10	64,478,744.57	74,520,775.29
其他综合收益	6.4.7.11	-	-
未分配利润	6.4.7.12	-13,485,853.51	-15,094,784.12
净资产合计		50,992,891.06	59,425,991.17
负债和净资产总计		52,042,865.29	59,846,123.44

注：报告截止日 2023 年 06 月 30 日，基金份额总额 64,478,744.57 份，其中大成绝对收益混合发起 A 基金份额总额为 13,841,576.07 份，基金份额净值 0.830 元。大成绝对收益混合发起 C 基金份额总额为 50,637,168.50 份，基金份额净值 0.780 元。

6.2 利润表

会计主体：大成绝对收益策略混合型发起式证券投资基金

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 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
一、营业总收入		212,566.71	-103,124.94
1. 利息收入		82,531.64	48,778.60
其中：存款利息收入	6.4.7.13	82,531.64	48,778.60
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）		-1,120,929.68	1,174,972.47
其中：股票投资收益	6.4.7.14	-1,364,683.57	-78,003.25
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.15	311.21	5,689.68
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	28,006.26	1,120,925.63
股利收益	6.4.7.19	215,436.42	126,360.41

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	1,064,892.17	-1,403,099.92
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	186,072.58	76,223.91
减：二、营业总支出		373,749.68	184,979.31
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	228,633.04	116,124.21
2. 托管费	6.4.10.2.2	38,105.47	19,354.05
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	75,844.50	14,615.95
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		123.21	4,794.31
8. 其他费用	6.4.7.23	31,043.46	30,090.79
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-161,182.97	-288,104.25
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-161,182.97	-288,104.25
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		-161,182.97	-288,104.25

6.3 净资产（基金净值）变动表

会计主体：大成绝对收益策略混合型发起式证券投资基金

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 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）	74,520,775.29	-	-15,094,784.12	59,425,991.17
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)	74,520,775.29	-	-15,094,784.12	59,425,991.17
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	-10,042,030.72	-	1,608,930.61	-8,433,100.11
(一)、综合收益总额	-	-	-161,182.97	-161,182.97
(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)	-10,042,030.72	-	1,770,113.58	-8,271,917.14
其中：1. 基金申购款	38,160,803.81	-	-8,299,309.55	29,861,494.26
2. 基金赎回款	-48,202,834.53	-	10,069,423.13	-38,133,411.40
(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)	64,478,744.57	-	-13,485,853.51	50,992,891.06
项目	上年度可比期间 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)	36,962,866.74	-	-6,060,821.71	30,902,045.03
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)	36,962,866.74	-	-6,060,821.71	30,902,045.03
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	43,411,807.95	-	-9,375,472.14	34,036,335.81

(一)、综合收益总额	-	-	-288,104.25	-288,104.25
(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)	43,411,807.95	-	-9,087,367.89	34,324,440.06
其中：1. 基金申购款	63,029,878.44	-	-12,589,498.02	50,440,380.42
2. 基金赎回款	-19,618,070.49	-	3,502,130.13	-16,115,940.36
(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)	80,374,674.69	-	-15,436,293.85	64,938,380.84

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

大成绝对收益策略混合型发起式证券投资基金(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[2015]第 938 号《关于核准大成绝对收益策略混合型发起式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《大成绝对收益策略混合型发起式证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式，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 306,733,002.85 元，业经普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)普华永道中天验字(2015)第 1141 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《大成绝对收益策略混合型发起式证券投资基金基金合同》于 2015 年 9 月 23 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 306,779,340.95 份基金份额，其

中认购资金利息折合 46,338.10 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，基金托管人为中国农业银行股份有限公司。

根据《大成绝对收益策略混合型发起式证券投资基金基金合同》和《大成绝对收益策略混合型发起式证券投资基金基金招募说明书》的规定，大成绝对收益基金根据认购费、申购费和销售服务费收取方式的不同，将基金份额分为不同的类别。在投资者认购、申购时收取前端认购、申购费的，称为 A 类基金份额；不收取认购、申购费，从该类别基金资产中计提销售服务费的基金份额，称为 C 类基金份额。由于基金费用的不同，本基金 A 类基金份额和 C 类基金份额将分别计算基金份额净值和基金份额累计净值。投资者可自行选择认购、申购的基金份额类别。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《大成绝对收益策略混合型发起式证券投资基金基金合同》的规定，本基金投资于依法发行或上市的股票、债券等金融工具及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具，包括：股票（包含中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票）、存托凭证、股指期货、权证，债券（国债、金融债、企业（公司）债、次级债、可转换债券（含分离交易可转债）、中小企业私募债、央行票据、短期融资券、超短期融资券、中期票据等）、资产支持证券、债券回购、银行存款等，以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具（但须符合中国证监会的相关规定）。本基金的投资组合比例为：本基金权益类空头头寸的价值占本基金权益类多头头寸的价值的比例范围在 80%-120%之间（权益类空头头寸的价值是指融券卖出的股票和存托凭证市值、卖出股指期货的合约价值及卖出其他权益类衍生工具的合约价值的合计值；权益类多头头寸的价值是指买入持有的股票和存托凭证市值、买入股指期货的合约价值及买入其他权益类衍生工具的合约价值的合计）；每个交易日日终，持有的买入期货合约价值和有价证券市值之和，不得超过基金资产净值的 95%；在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，基金保留的现金（不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等）或到期日在一年以内的政府债券的比例合计不低于基金资产净值的 5%。本基金的业绩比较基准为：中国人民银行公布的一年期定期存款基准利率（税后）。

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》、《大成绝对收益策略混合型发起式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 2023 年 6 月 30 日
活期存款	5,820,846.21
等于：本金	5,819,829.18
加：应计利息	1,017.03
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	5,820,846.21

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 6 月 30 日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	20,383,854.78	-	20,272,798.95	-111,055.83
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	20,383,854.78	-	20,272,798.95	-111,055.83

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 2023 年 6 月 30 日			
	合同/名义 金额	公允价值		备注
		资产	负债	
利率衍生工具	-	-	-	-
货币衍生工具	-	-	-	-
权益衍生工具	-16,894,915.11	-	-	-
其中： 股指期货投资	-16,894,915.11	-	-	-
其他衍生工具	-	-	-	-
合计	-16,894,915.11	-	-	-

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/	合约市值	公允价值变动
----	----	--------	------	--------

		卖)		
IH2309	IH2309	-12.00	-8,959,680.00	135,695.11
IM2309	IM2309	-6.00	-7,843,680.00	-44,140.00
合计				91,555.11
减:可抵销期货 暂收款				91,555.11
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 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	146,493.31
其中：交易所市场	146,493.31
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用	64,335.79
合计	210,829.10

6.4.7.10 实收基金

金额单位：人民币元

大成绝对收益混合发起 A

项目	本期 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	13,949,089.84	13,949,089.84
本期申购	90,838.93	90,838.93
本期赎回（以“-”号填列）	-198,352.70	-198,352.70
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	13,841,576.07	13,841,576.07

大成绝对收益混合发起 C

项目	本期 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	60,571,685.45	60,571,685.45
本期申购	38,069,964.88	38,069,964.88
本期赎回（以“-”号填列）	-48,004,481.83	-48,004,481.83
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	50,637,168.50	50,637,168.50

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

大成绝对收益混合发起 A

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-1,153,738.76	-1,143,427.36	-2,297,166.12
本期利润	-458,763.27	381,701.24	-77,062.03
本期基金份额交易产生的变动数	10,742.10	6,976.96	17,719.06
其中：基金申购款	-8,235.74	-6,401.27	-14,637.01
基金赎回款	18,977.84	13,378.23	32,356.07
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-1,601,759.93	-754,749.16	-2,356,509.09

大成绝对收益混合发起 C

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-8,128,846.51	-4,668,771.49	-12,797,618.00
本期利润	-767,311.87	683,190.93	-84,120.94
本期基金份额交易产生的变动数	357,959.73	1,394,434.79	1,752,394.52
其中：基金申购款	-6,358,006.96	-1,926,665.58	-8,284,672.54
基金赎回款	6,715,966.69	3,321,100.37	10,037,067.06
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-8,538,198.65	-2,591,145.77	-11,129,344.42

6.4.7.13 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	29,255.07
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	53,159.76
其他	116.81
合计	82,531.64

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 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	-1,364,683.57

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	-1,364,683.57

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 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
卖出股票成交总额	128,260,186.78
减：卖出股票成本总额	129,235,218.36
减：交易费用	389,651.99
买卖股票差价收入	-1,364,683.57

6.4.7.14.3 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 2023年1月1日至2023年6月30日
债券投资收益——利息收入	0.41
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	310.80
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	311.21

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 2023年1月1日至2023年6月30日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	2,311.30
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	2,000.00
减：应计利息总额	0.41
减：交易费用	0.09
买卖债券差价收入	310.80

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

单位：人民币元

项目	本期收益金额
	2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
股指期货投资收益	28,006.26

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	215,436.42
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	215,436.42

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	871,544.65
股票投资	871,544.65
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	193,347.52
权证投资	—
期货投资	193,347.52
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	1,064,892.17

6.4.7.21 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
基金赎回费收入	186,069.70
基金转换费收入	2.88
合计	186,072.58

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
----	----

	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	2,207.67
账户维护费	9,000.00
合计	31,043.46

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
中国农业银行股份有限公司(“中国农业银行”)	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 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 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	54,416,052.64	20.82	2,497,609.00	95.81

6.4.10.1.2 债券交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日	
	成交金额	占当期债券 成交总额的比例 (%)	成交金额	占当期债券 成交总额的比例 (%)
光大证券	-	-	24,689.70	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 2023 年 1 月 1 日至 2023 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	50,135.88	20.82	47,365.74	32.33
关联方名称	上年度可比期间 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	2,285.24	95.82	939.25	97.66

注：1. 上述佣金参考市场价格经本基金的基金管理人与对方协商确定。

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

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	228,633.04	116,124.21
其中：支付销售机构的客户维护费	15,755.99	16,524.12

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 1.50%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：

日管理人报酬 = 前一日基金资产净值 \times 1.50% / 当年天数。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	38,105.47	19,354.05

注：支付基金托管人中国农业银行的托管费按前一日基金资产净值 0.25% 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 \times 0.25% / 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方名称	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	大成绝对收益混合发起 A	大成绝对收益混合发起 C	合计
大成基金	—	63,855.83	63,855.83
中国农业银行	—	1,744.71	1,744.71
合计	—	65,600.54	65,600.54
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 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		
	大成绝对收益混合发起 A	大成绝对收益混合发起 C	合计
大成基金	—	1,800.76	1,800.76
中国农业银行	—	1,919.65	1,919.65
合计	—	3,720.41	3,720.41

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 0.80%。其计算公式为：

日销售服务费 = 前一日 C 类基金资产净值 \times 0.80% / 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 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
	大成绝对收益混合发起 A	大成绝对收益混合发起 C
基金合同生效日（2015 年 9 月 23 日）持有的基金份额	—	—
报告期初持有的基金份额	10,001,777.95	—
报告期间申购/买入总份额	—	—
报告期间因拆分变动份额	—	—
减：报告期间赎回/卖出总份额	—	—
报告期末持有的基金份额	10,001,777.95	—
报告期末持有的基金份额 占基金总份额比例	15.51%	—
项目	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
	大成绝对收益混合发起 A	大成绝对收益混合发起 C
基金合同生效日（2015 年 9 月 23 日）持有的基金份额	—	—
报告期初持有的基金份额	10,001,777.95	—
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：报告期内赎回/卖出总份额	0.00	—
报告期末持有的基金份额	10,001,777.95	—
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	12.44%	—

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 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日		上年度可比期间 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
中国农业银行	5,820,846.21	29,255.07	5,656,617.46	5,446.23

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

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量（股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
300346	南大光电	2023 年 6 月 26 日	重大事项停牌	34.39	2023 年 7 月 6 日	35.60	800	28,672.00	27,512.00	—

注：本基金截至本期末止持有以上因公布的重大事项可能产生重大影响而被暂时停牌的股票，该

类股票将在所公布事项的重大影响消除后，经交易所批准复牌。

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

无。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

无。

6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

无。

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金在日常经营活动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农业银行股份有限公司，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 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	5,820,846.21	-	-	-	5,820,846.21
结算备付金	23,909,399.71	-	-	-	23,909,399.71
存出保证金	22,167.84	-	-	2,016,403.20	2,038,571.04
交易性金融资产	-	-	-	20,272,798.95	20,272,798.95
应收申购款	-	-	-	1,249.38	1,249.38
资产总计	29,752,413.76	-	-	22,290,451.53	52,042,865.29
负债					
应付管理人报酬	-	-	-	37,034.93	37,034.93
应付托管费	-	-	-	6,172.44	6,172.44
应付清算款	-	-	-	782,617.81	782,617.81
应付销售服务费	-	-	-	12,169.97	12,169.97
应交税费	-	-	-	1,149.98	1,149.98
其他负债	-	-	-	210,829.10	210,829.10
负债总计	-	-	-	1,049,974.23	1,049,974.23
利率敏感度缺口	29,752,413.76	-	-	21,240,477.30	50,992,891.06
上年度末 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	4,926,962.40	-	-	-	4,926,962.40
结算备付金	37,753,194.20	-	-	-	37,753,194.20
存出保证金	2,981.00	-	-	1,619,443.20	1,622,424.20
交易性金融资产	-	-	-	15,485,254.60	15,485,254.60
应收申购款	-	-	-	1,610.00	1,610.00
应收清算款	-	-	-	56,678.04	56,678.04
资产总计	42,683,137.60	-	-	17,162,985.84	59,846,123.44
负债					
应付赎回款	-	-	-	9,850.03	9,850.03
应付管理人报酬	-	-	-	42,008.05	42,008.05
应付托管费	-	-	-	7,001.33	7,001.33
应付清算款	-	-	-	240,333.84	240,333.84
应付销售服务费	-	-	-	14,440.05	14,440.05
其他负债	-	-	-	106,498.97	106,498.97
负债总计	-	-	-	420,132.27	420,132.27
利率敏感度缺口	42,683,137.60	-	-	16,742,853.57	59,425,991.17

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或银行间同业市场交易的股票和债券，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。

本基金的基金管理人在构建和管理投资组合的过程中，采用“自上而下”的策略，通过对宏观经济情况及政策的分析，结合证券市场运行情况，做出资产配置及组合构建的决定；通过对单个证券的定性分析及定量分析，选择符合基金合同约定范围的投资品种进行投资。本基金的基金管理人定期结合宏观及微观环境的变化，对投资策略、资产配置、投资组合进行修正，来主动应对可能发生的市场价格风险。

本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险。本基金权益类空头头寸的价值占本基金权

益类多头头寸的价值的比例范围在 80%-120%之间。每个交易日日终，持有的买入期货合约价值和有价证券市值之和，不得超过基金资产净值的 95%。在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，基金保留的现金（不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等）或到期日在一年以内的政府债券的比例合计不低于基金资产净值的 5%。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 2023 年 6 月 30 日		上年度末 2022 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	20,272,798.95	39.76	15,485,254.60	26.06
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	20,272,798.95	39.76	15,485,254.60	26.06

注：其他包含在期货交易所交易的股指期货投资。在当日无负债结算制度下，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。

6.4.13.4.3.2 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%	165,117.89	356,830.04
	业绩比较基准下降 5%	-165,117.89	-356,830.04

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 2023 年 6 月 30 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
第一层次	20,245,286.95	15,485,254.60
第二层次	27,512.00	—
第三层次	—	—
合计	20,272,798.95	15,485,254.60

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，确定相关股票和债券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

截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

§ 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	20,272,798.95	38.95
	其中：股票	20,272,798.95	38.95
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	29,730,245.92	57.13
8	其他各项资产	2,039,820.42	3.92
9	合计	52,042,865.29	100.00

注：金融衍生品投资项下的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，则金融衍生品投资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。

7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

金额单位：人民币元

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	76,378.00	0.15
B	采矿业	1,133,748.00	2.22
C	制造业	12,895,598.95	25.29
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	811,689.00	1.59
E	建筑业	636,087.00	1.25
F	批发和零售业	151,969.00	0.30
G	交通运输、仓储和邮政业	258,079.00	0.51
H	住宿和餐饮业	—	—
I	信息传输、软件和信息技术服务业	1,088,703.00	2.14
J	金融业	2,309,997.00	4.53

K	房地产业	245,773.00	0.48
L	租赁和商务服务业	232,847.00	0.46
M	科学研究和技术服务业	345,028.00	0.68
N	水利、环境和公共设施管理业	65,452.00	0.13
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	21,450.00	0.04
	合计	20,272,798.95	39.76

7.2.2 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

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	600519	贵州茅台	1,000	1,691,000.00	3.32
2	601166	兴业银行	34,000	532,100.00	1.04
3	600900	长江电力	22,000	485,320.00	0.95
4	600276	恒瑞医药	10,000	479,000.00	0.94
5	601318	中国平安	10,000	464,000.00	0.91
6	600036	招商银行	11,200	366,912.00	0.72
7	600406	国电南瑞	15,040	347,424.00	0.68
8	601668	中国建筑	60,000	344,400.00	0.68
9	600436	片仔癀	1,200	343,632.00	0.67
10	600028	中国石化	50,000	318,000.00	0.62
11	600893	航发动力	7,000	295,820.00	0.58
12	601012	隆基绿能	10,300	295,301.00	0.58
13	600030	中信证券	14,400	284,832.00	0.56
14	688111	金山办公	600	283,332.00	0.56
15	601398	工商银行	57,800	278,596.00	0.55
16	601088	中国神华	8,100	249,075.00	0.49
17	601899	紫金矿业	21,000	238,770.00	0.47
18	600887	伊利股份	8,000	226,560.00	0.44
19	603259	药明康德	3,500	218,085.00	0.43
20	601888	中国中免	1,900	210,007.00	0.41
21	603986	兆易创新	1,800	191,250.00	0.38
22	600690	海尔智家	8,000	187,840.00	0.37
23	600309	万华化学	2,000	175,680.00	0.34
24	600031	三一重工	10,400	172,952.00	0.34
25	603288	海天味业	3,656	171,283.60	0.34

26	603501	韦尔股份	1,700	166,668.00	0.33
27	600048	保利发展	11,600	151,148.00	0.30
28	601728	中国电信	26,500	149,195.00	0.29
29	000651	格力电器	4,000	146,040.00	0.29
30	600111	北方稀土	6,000	143,880.00	0.28
31	688599	天合光能	3,300	140,613.00	0.28
32	603260	合盛硅业	2,000	140,040.00	0.27
33	601066	中信建投	5,400	130,680.00	0.26
34	601919	中远海控	13,900	130,660.00	0.26
35	601857	中国石油	17,000	126,990.00	0.25
36	600196	复星医药	4,000	123,600.00	0.24
37	600089	特变电工	5,000	111,450.00	0.22
38	300750	宁德时代	480	109,819.20	0.22
39	600050	中国联通	22,400	107,520.00	0.21
40	601669	中国电建	17,000	97,580.00	0.19
41	601225	陕西煤业	5,200	94,588.00	0.19
42	300037	新宙邦	1,800	93,402.00	0.18
43	601633	长城汽车	3,000	75,510.00	0.15
44	603799	华友钴业	1,540	70,701.40	0.14
45	600905	三峡能源	12,700	68,199.00	0.13
46	600104	上汽集团	4,600	65,182.00	0.13
47	600010	包钢股份	36,000	64,440.00	0.13
48	601688	华泰证券	4,400	60,588.00	0.12
49	300274	阳光电源	500	58,315.00	0.11
50	000977	浪潮信息	1,200	58,200.00	0.11
51	601390	中国中铁	7,600	57,608.00	0.11
52	603112	华翔股份	4,800	56,448.00	0.11
53	000157	中联重科	8,200	55,350.00	0.11
54	600745	闻泰科技	1,100	53,790.00	0.11
55	600886	国投电力	4,000	50,600.00	0.10
56	600438	通威股份	1,400	48,034.00	0.09
57	601628	中国人寿	1,300	45,448.00	0.09
58	002917	金奥博	3,600	44,496.00	0.09
59	600025	华能水电	6,000	42,780.00	0.08
60	000568	泸州老窖	200	41,914.00	0.08
61	600016	民生银行	11,000	41,250.00	0.08
62	000960	锡业股份	2,600	40,430.00	0.08
63	002048	宁波华翔	3,000	40,200.00	0.08
64	002292	奥飞娱乐	4,000	39,920.00	0.08
65	002593	日上集团	10,000	38,700.00	0.08
66	603767	中马传动	2,500	38,650.00	0.08
67	300258	精锻科技	2,600	37,674.00	0.07
68	601238	广汽集团	3,600	37,512.00	0.07

69	600941	中国移动	400	37,320.00	0.07
70	688016	心脉医疗	200	35,976.00	0.07
71	300316	晶盛机电	500	35,450.00	0.07
72	300315	掌趣科技	4,500	35,100.00	0.07
73	301030	仕净科技	500	34,550.00	0.07
74	300751	迈为股份	200	33,876.00	0.07
75	605228	神通科技	3,500	33,495.00	0.07
76	688160	步科股份	400	33,400.00	0.07
77	002050	三花智控	1,100	33,286.00	0.07
78	600963	岳阳林纸	4,500	33,165.00	0.07
79	001696	宗申动力	4,600	32,568.00	0.06
80	600377	宁沪高速	3,300	32,439.00	0.06
81	601698	中国卫通	1,600	31,808.00	0.06
82	301183	东田微	400	31,520.00	0.06
83	000936	华西股份	2,200	30,580.00	0.06
84	600803	新奥股份	1,600	30,368.00	0.06
85	605117	德业股份	200	29,910.00	0.06
86	003035	南网能源	4,200	29,904.00	0.06
87	002548	金新农	3,900	29,874.00	0.06
88	300593	新雷能	1,300	29,783.00	0.06
89	603806	福斯特	800	29,752.00	0.06
90	600326	西藏天路	4,400	29,612.00	0.06
91	002031	巨轮智能	6,600	29,568.00	0.06
92	002283	天润工业	4,600	29,532.00	0.06
93	002338	奥普光电	700	29,505.00	0.06
94	688036	传音控股	200	29,400.00	0.06
95	300498	温氏股份	1,600	29,360.00	0.06
96	300507	苏奥传感	4,500	29,340.00	0.06
97	603308	应流股份	1,600	29,280.00	0.06
98	001259	利仁科技	1,000	29,260.00	0.06
99	300838	浙江力诺	1,600	29,232.00	0.06
100	002475	立讯精密	900	29,205.00	0.06
101	002007	华兰生物	1,300	29,133.00	0.06
102	603611	诺力股份	1,100	28,974.00	0.06
103	600184	光电股份	2,200	28,886.00	0.06
104	001231	农心科技	1,200	28,548.00	0.06
105	300879	大叶股份	1,500	28,545.00	0.06
106	603768	常青股份	1,600	28,432.00	0.06
107	600499	科达制造	2,500	28,400.00	0.06
108	002361	神剑股份	7,000	28,350.00	0.06
108	002446	盛路通信	3,000	28,350.00	0.06
109	605056	咸亨国际	2,000	28,340.00	0.06
110	603178	圣龙股份	2,300	28,336.00	0.06

111	001238	浙江正特	1,200	28,236.00	0.06
112	300484	蓝海华腾	2,000	28,120.00	0.06
113	002003	伟星股份	3,000	28,080.00	0.06
113	603657	春光科技	1,600	28,080.00	0.06
114	603338	浙江鼎力	500	28,005.00	0.05
115	002049	紫光国微	300	27,975.00	0.05
116	002976	瑞玛精密	1,000	27,970.00	0.05
117	002380	科远智慧	1,200	27,960.00	0.05
118	300022	吉峰科技	5,500	27,830.00	0.05
119	002011	盾安环境	2,000	27,660.00	0.05
119	300797	钢研纳克	1,500	27,660.00	0.05
120	300346	南大光电	800	27,512.00	0.05
121	300007	汉威科技	1,300	27,495.00	0.05
122	002295	精艺股份	4,000	27,480.00	0.05
123	002158	汉钟精机	1,100	27,456.00	0.05
124	300652	雷迪克	1,200	27,324.00	0.05
125	002574	明牌珠宝	4,000	27,320.00	0.05
126	001223	欧克科技	300	27,297.00	0.05
127	600312	平高电气	2,200	27,258.00	0.05
128	000685	中山公用	3,600	27,252.00	0.05
129	002318	久立特材	1,600	27,248.00	0.05
130	002179	中航光电	600	27,210.00	0.05
131	301031	中熔电气	200	27,142.00	0.05
132	688155	先惠技术	500	27,130.00	0.05
133	300952	恒辉安防	1,200	27,072.00	0.05
134	300607	拓斯达	1,800	27,054.00	0.05
134	600081	东风科技	1,800	27,054.00	0.05
135	603212	赛伍技术	1,300	27,053.00	0.05
136	688005	容百科技	500	27,010.00	0.05
137	002809	红墙股份	2,500	27,000.00	0.05
138	000860	顺鑫农业	800	26,952.00	0.05
139	000921	海信家电	1,000	26,950.00	0.05
140	300472	新元科技	2,500	26,925.00	0.05
141	002198	嘉应制药	3,000	26,910.00	0.05
142	300138	晨光生物	1,500	26,850.00	0.05
143	688328	深科达	800	26,784.00	0.05
144	688195	腾景科技	500	26,715.00	0.05
145	002483	润邦股份	4,600	26,680.00	0.05
146	002867	周大生	1,500	26,670.00	0.05
147	601989	中国重工	5,500	26,510.00	0.05
148	002985	北摩高科	600	26,472.00	0.05
149	300877	金春股份	1,500	26,460.00	0.05
150	603801	志邦家居	800	26,416.00	0.05

151	688279	峰岹科技	200	26,400.00	0.05
152	002829	星网宇达	600	26,358.00	0.05
153	301298	东利机械	1,600	26,288.00	0.05
154	000541	佛山照明	4,600	26,266.00	0.05
155	600233	圆通速递	1,800	26,208.00	0.05
156	688025	杰普特	300	26,205.00	0.05
157	002008	大族激光	1,000	26,200.00	0.05
157	603617	君禾股份	2,500	26,200.00	0.05
158	002817	黄山胶囊	3,000	26,040.00	0.05
159	000963	华东医药	600	26,022.00	0.05
160	300627	华测导航	800	25,976.00	0.05
161	301050	雷电微力	400	25,972.00	0.05
162	300900	广联航空	900	25,929.00	0.05
163	002611	东方精工	4,500	25,830.00	0.05
164	300515	三德科技	1,600	25,792.00	0.05
165	300417	南华仪器	2,400	25,776.00	0.05
165	300988	津荣天宇	1,200	25,776.00	0.05
166	300827	上能电气	715	25,775.75	0.05
167	300907	康平科技	1,200	25,764.00	0.05
168	300490	华自科技	1,500	25,740.00	0.05
169	600590	泰豪科技	3,600	25,668.00	0.05
170	600215	派斯林	3,000	25,650.00	0.05
171	000599	青岛双星	6,000	25,620.00	0.05
172	002116	中国海诚	2,000	25,560.00	0.05
173	300012	华测检测	1,300	25,350.00	0.05
174	300720	海川智能	2,000	25,300.00	0.05
175	688408	中信博	300	25,299.00	0.05
176	000951	中国重汽	1,500	25,275.00	0.05
177	002705	新宝股份	1,400	25,242.00	0.05
178	688630	芯碁微装	300	25,206.00	0.05
179	002270	华明装备	2,300	25,185.00	0.05
180	000059	华锦股份	4,000	25,160.00	0.05
180	300840	酷特智能	2,000	25,160.00	0.05
181	000534	万泽股份	1,500	25,155.00	0.05
182	605266	健之佳	300	25,149.00	0.05
183	300429	强力新材	2,500	25,050.00	0.05
184	300707	威唐工业	1,600	25,008.00	0.05
185	300501	海顺新材	1,500	24,990.00	0.05
186	000666	经纬纺机	2,500	24,975.00	0.05
187	002129	TCL 中环	750	24,900.00	0.05
187	002951	ST 金时	2,500	24,900.00	0.05
188	601995	中金公司	700	24,864.00	0.05
189	002465	海格通信	2,400	24,816.00	0.05

189	002666	德联集团	4,800	24,816.00	0.05
190	600060	海信视像	1,000	24,750.00	0.05
191	000036	华联控股	6,000	24,720.00	0.05
191	000652	泰达股份	6,000	24,720.00	0.05
191	601799	星宇股份	200	24,720.00	0.05
192	002381	双箭股份	3,200	24,704.00	0.05
193	605058	澳弘电子	1,100	24,695.00	0.05
194	301007	德迈仕	1,600	24,688.00	0.05
195	603056	德邦股份	1,600	24,672.00	0.05
196	603638	艾迪精密	1,200	24,624.00	0.05
197	002151	北斗星通	700	24,612.00	0.05
198	002937	兴瑞科技	1,000	24,600.00	0.05
198	300395	菲利华	500	24,600.00	0.05
198	603098	森特股份	1,200	24,600.00	0.05
199	603169	兰石重装	3,300	24,552.00	0.05
200	002278	神开股份	4,600	24,518.00	0.05
201	300537	广信材料	1,500	24,510.00	0.05
202	600529	山东药玻	900	24,498.00	0.05
203	300694	蠡湖股份	2,300	24,449.00	0.05
204	001226	拓山重工	800	24,400.00	0.05
205	688379	华光新材	1,200	24,372.00	0.05
206	688680	海优新材	200	24,364.00	0.05
207	000930	中粮科技	3,000	24,300.00	0.05
208	603766	隆鑫通用	4,600	24,288.00	0.05
209	603113	金能科技	3,000	24,270.00	0.05
210	003036	泰坦股份	1,800	24,264.00	0.05
211	000968	蓝焰控股	3,200	24,192.00	0.05
212	300403	汉宇集团	2,200	24,178.00	0.05
213	603048	浙江黎明	1,500	24,150.00	0.05
214	300980	祥源新材	1,200	24,132.00	0.05
215	300669	沪宁股份	1,600	24,096.00	0.05
216	603897	长城科技	1,200	24,072.00	0.05
217	002498	汉缆股份	6,000	24,060.00	0.05
217	300259	新天科技	6,000	24,060.00	0.05
218	300489	光智科技	1,300	23,985.00	0.05
219	600458	时代新材	2,000	23,980.00	0.05
220	603586	金麒麟	1,500	23,955.00	0.05
221	301319	唯特偶	400	23,940.00	0.05
222	002906	华阳集团	700	23,933.00	0.05
223	600761	安徽合力	1,200	23,916.00	0.05
224	688092	爱科科技	800	23,896.00	0.05
225	600038	中直股份	600	23,892.00	0.05
226	300293	蓝英装备	2,000	23,840.00	0.05

227	300527	中船应急	2,500	23,750.00	0.05
228	002650	加加食品	6,000	23,700.00	0.05
228	603011	合锻智能	3,000	23,700.00	0.05
229	601956	东贝集团	4,000	23,680.00	0.05
230	002234	民和股份	1,300	23,673.00	0.05
231	603331	百达精工	1,600	23,648.00	0.05
232	002617	露笑科技	3,000	23,640.00	0.05
233	600675	中华企业	8,000	23,600.00	0.05
234	300151	昌红科技	1,300	23,530.00	0.05
235	688559	海目星	500	23,505.00	0.05
236	600356	恒丰纸业	3,000	23,490.00	0.05
237	300424	航新科技	1,600	23,488.00	0.05
238	603917	合力科技	1,000	23,480.00	0.05
239	300876	蒙泰高新	900	23,445.00	0.05
240	300217	东方电热	4,000	23,440.00	0.05
241	603920	世运电路	1,200	23,436.00	0.05
242	002980	华盛昌	700	23,422.00	0.05
243	601001	晋控煤业	2,500	23,400.00	0.05
244	002435	长江健康	4,800	23,376.00	0.05
245	603477	巨星农牧	700	23,345.00	0.05
246	002284	亚太股份	2,600	23,322.00	0.05
247	600933	爱柯迪	1,000	23,290.00	0.05
248	600967	内蒙一机	2,300	23,230.00	0.05
249	688009	中国通号	4,000	23,200.00	0.05
250	603937	丽岛新材	2,000	23,180.00	0.05
251	000561	烽火电子	2,000	23,140.00	0.05
251	603988	中电电机	2,000	23,140.00	0.05
252	603089	正裕工业	2,600	23,114.00	0.05
253	600740	山西焦化	4,500	23,085.00	0.05
254	600085	同仁堂	400	23,024.00	0.05
255	688285	高铁电气	2,300	23,000.00	0.05
256	600435	北方导航	2,000	22,980.00	0.05
257	600523	贵航股份	1,600	22,976.00	0.05
258	688070	纵横股份	500	22,950.00	0.05
259	688033	天宜上佳	1,200	22,944.00	0.04
260	603659	璞泰来	600	22,932.00	0.04
261	002347	泰尔股份	4,000	22,920.00	0.04
262	603200	上海洗霸	1,100	22,913.00	0.04
263	603499	翔港科技	2,400	22,896.00	0.04
264	603569	长久物流	2,000	22,840.00	0.04
265	002249	大洋电机	4,000	22,800.00	0.04
265	600517	国网英大	4,000	22,800.00	0.04
265	600776	东方通信	1,600	22,800.00	0.04

266	603688	石英股份	200	22,768.00	0.04
267	300062	中能电气	3,300	22,605.00	0.04
268	300923	研奥股份	1,000	22,600.00	0.04
269	300307	慈星股份	3,300	22,539.00	0.04
270	301008	宏昌科技	800	22,504.00	0.04
271	300084	海默科技	3,600	22,500.00	0.04
272	300905	宝丽迪	1,200	22,464.00	0.04
273	603656	泰禾智能	1,600	22,448.00	0.04
274	000589	贵州轮胎	4,000	22,400.00	0.04
274	301059	金三江	1,600	22,400.00	0.04
274	600846	同济科技	2,000	22,400.00	0.04
275	605336	帅丰电器	1,300	22,360.00	0.04
276	605090	九丰能源	1,000	22,330.00	0.04
277	301028	东亚机械	2,000	22,300.00	0.04
278	605167	利柏特	2,300	22,264.00	0.04
279	601808	中海油服	1,600	22,208.00	0.04
280	688633	星球石墨	500	22,195.00	0.04
281	300611	美力科技	2,300	22,172.00	0.04
282	600741	华域汽车	1,200	22,152.00	0.04
283	001202	炬申股份	1,500	22,140.00	0.04
284	002600	领益智造	3,200	22,112.00	0.04
285	600066	宇通客车	1,500	22,110.00	0.04
286	688091	上海谊众	300	22,089.00	0.04
287	301163	宏德股份	700	22,085.00	0.04
288	002452	长高电新	3,000	22,080.00	0.04
289	600284	浦东建设	3,600	22,032.00	0.04
290	000828	东莞控股	2,400	21,960.00	0.04
291	300040	九洲集团	3,500	21,945.00	0.04
292	300819	聚杰微纤	1,600	21,936.00	0.04
293	001211	双枪科技	1,000	21,930.00	0.04
294	002796	世嘉科技	1,800	21,906.00	0.04
295	002945	华林证券	1,600	21,888.00	0.04
296	603067	振华股份	1,800	21,870.00	0.04
297	002632	道明光学	3,000	21,840.00	0.04
297	300123	亚光科技	3,000	21,840.00	0.04
298	002043	兔宝宝	2,000	21,820.00	0.04
299	000559	万向钱潮	4,000	21,800.00	0.04
300	003816	中国广核	7,000	21,770.00	0.04
301	688287	观典防务	1,500	21,765.00	0.04
302	600133	东湖高新	3,300	21,747.00	0.04
303	002530	金财互联	2,400	21,744.00	0.04
304	603615	茶花股份	2,300	21,712.00	0.04
305	688596	正帆科技	500	21,650.00	0.04

306	603677	奇精机械	1,600	21,648.00	0.04
307	301233	盛帮股份	500	21,635.00	0.04
308	002810	山东赫达	1,200	21,600.00	0.04
308	601968	宝钢包装	3,000	21,600.00	0.04
309	688793	倍轻松	400	21,560.00	0.04
310	603588	高能环境	2,300	21,551.00	0.04
311	002012	凯恩股份	3,300	21,483.00	0.04
312	603393	新天然气	800	21,472.00	0.04
313	600805	悦达投资	5,000	21,450.00	0.04
314	301156	美农生物	900	21,438.00	0.04
315	002900	哈三联	1,600	21,392.00	0.04
316	300410	正业科技	2,500	21,275.00	0.04
317	688556	高测股份	400	21,256.00	0.04
318	688367	工大高科	1,200	21,216.00	0.04
319	300329	海伦钢琴	3,000	21,210.00	0.04
320	300855	图南股份	600	21,192.00	0.04
321	002686	亿利达	3,000	21,150.00	0.04
322	300173	福能东方	4,500	21,105.00	0.04
323	002300	太阳电缆	2,400	21,096.00	0.04
324	600302	标准股份	4,000	21,080.00	0.04
325	600416	湘电股份	1,100	20,999.00	0.04
326	300631	久吾高科	600	20,988.00	0.04
326	600292	远达环保	3,600	20,988.00	0.04
327	688239	航宇科技	300	20,985.00	0.04
328	601369	陕鼓动力	2,300	20,953.00	0.04
329	600956	新天绿能	2,400	20,928.00	0.04
330	600468	百利电气	4,000	20,920.00	0.04
331	603421	鼎信通讯	2,000	20,900.00	0.04
332	300195	长荣股份	3,300	20,724.00	0.04
333	600821	金开新能	3,000	20,670.00	0.04
334	600791	京能置业	4,500	20,655.00	0.04
335	300283	温州宏丰	3,500	20,650.00	0.04
336	603261	立航科技	600	20,640.00	0.04
337	600572	康恩贝	3,000	20,550.00	0.04
338	688297	中无人机	400	20,516.00	0.04
339	600151	航天机电	2,300	20,493.00	0.04
340	603216	梦天家居	1,500	20,445.00	0.04
341	600166	福田汽车	6,000	20,400.00	0.04
342	688799	华纳药厂	500	20,310.00	0.04
343	600192	长城电工	3,500	20,265.00	0.04
344	601700	风范股份	3,800	20,178.00	0.04
345	603929	亚翔集成	1,200	20,160.00	0.04
346	603057	紫燕食品	800	20,104.00	0.04

347	688093	世华科技	1,000	20,060.00	0.04
348	301072	中捷精工	800	20,040.00	0.04
349	603071	物产环能	1,200	19,908.00	0.04
350	600169	太原重工	8,000	19,840.00	0.04
351	603286	日盈电子	1,000	19,750.00	0.04
352	600172	黄河旋风	4,600	19,688.00	0.04
353	600480	凌云股份	2,500	19,650.00	0.04
354	603321	梅轮电梯	2,500	19,475.00	0.04
355	688628	优利德	400	19,436.00	0.04
356	600877	电科芯片	1,300	19,422.00	0.04
357	688237	超卓航科	400	19,312.00	0.04
358	603087	甘李药业	500	19,250.00	0.04
359	601163	三角轮胎	1,200	19,044.00	0.04
360	603558	健盛集团	2,300	18,998.00	0.04
361	603628	清源股份	1,200	18,996.00	0.04
362	688286	敏芯股份	300	18,894.00	0.04
363	600688	上海石化	6,000	18,660.00	0.04
364	600320	振华重工	5,000	18,650.00	0.04
365	002708	光洋股份	2,400	18,384.00	0.04
366	688772	珠海冠宇	900	18,135.00	0.04
367	002139	拓邦股份	1,200	15,660.00	0.03
368	601918	新集能源	3,300	14,025.00	0.03
369	600837	海通证券	1,200	11,064.00	0.02
370	688472	阿特斯	300	5,508.00	0.01

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	600519	贵州茅台	2,074,416.00	3.49
2	600036	招商银行	866,827.00	1.46
3	600276	恒瑞医药	844,116.00	1.42
4	601398	工商银行	821,676.00	1.38
5	601318	中国平安	735,352.00	1.24
6	600900	长江电力	630,219.00	1.06
7	603501	韦尔股份	623,439.00	1.05
8	600436	片仔癀	573,455.00	0.96
9	600406	国电南瑞	571,096.00	0.96
10	601166	兴业银行	560,754.00	0.94
11	600893	航发动力	546,451.00	0.92
12	600887	伊利股份	538,048.00	0.91
13	600809	山西汾酒	534,881.00	0.90
14	600028	中国石化	508,123.00	0.86

15	600030	中信证券	503,719.00	0.85
16	601668	中国建筑	483,220.00	0.81
17	600309	万华化学	478,460.00	0.81
18	603379	三美股份	422,446.60	0.71
19	603259	药明康德	395,779.00	0.67
20	600060	海信视像	381,774.00	0.64

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	600519	贵州茅台	1,366,445.00	2.30
2	601318	中国平安	1,114,258.00	1.88
3	600036	招商银行	1,110,775.00	1.87
4	601398	工商银行	780,202.00	1.31
5	600276	恒瑞医药	632,748.00	1.06
6	603501	韦尔股份	631,009.40	1.06
7	600309	万华化学	536,737.00	0.90
8	600809	山西汾酒	498,223.00	0.84
9	600887	伊利股份	483,603.00	0.81
10	601601	中国太保	425,792.00	0.72
11	603379	三美股份	424,383.00	0.71
12	600690	海尔智家	420,942.00	0.71
13	600900	长江电力	404,300.00	0.68
14	600060	海信视像	402,305.00	0.68
15	600436	片仔癀	395,376.00	0.67
16	600030	中信证券	376,694.00	0.63
17	601166	兴业银行	330,999.00	0.56
18	601668	中国建筑	321,260.00	0.54
19	600048	保利发展	318,195.00	0.54
20	600010	宝钢股份	292,800.00	0.49

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	133,151,218.06
卖出股票收入（成交）总额	128,260,186.78

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

现阶段本基金将利用股指期货剥离多头股票部分的系统性风险。基金经理根据市场的变化、现货市场与期货市场的相关性等因素，计算需要用到的期货合约数量，对这个数量进行动态跟踪与测算，并进行适时灵活调整。同时，综合考虑各个月份期货合约之间的定价关系、套利机会、流动性以及保证金要求等因素，在各个月份期货合约之间进行动态配置，通过空头部分的优化创造额外收益。随着监管的放开及其他工具流动性增强，我们会优选空头工具，采用最优的多头系统性风险剥离方式。

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 市场中性策略执行情况

截至本报告期末，本基金持有股票资产 20,272,798.95 元，占基金资产净值的比例为 39.76%；运用股指期货进行对冲的空头合约市值 16,803,360.00 元，占基金资产净值的比例为 32.95%，空头合约市值占股票资产的比例为 82.89%。本报告期内，本基金执行市场中性策略的投资收益为-1,336,677.31 元，公允价值变动损益为 1,064,892.17 元。

7.13 投资组合报告附注

7.13.1 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兴业银行的发行主体兴业银行股份有限公司于 2022 年 9 月 9 日因债券承销业务严重违反审慎经营规则，受到中国银行保险监督管理委员会处罚（银保监罚决字〔2022〕41 号），于 2022 年 9 月 28 日因老产品规模在部分时点出现反弹等，受到中国银行

保险监督管理委员会处罚（银保监罚决字〔2022〕50 号）。本基金认为，对兴业银行的处罚不会对其投资价值构成实质性负面影响。

2、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）。本基金认为，对招商银行的处罚不会对其投资价值构成实质性负面影响。

7.13.2 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。

7.13.3 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	2,038,571.04
2	应收清算款	—
3	应收股利	—
4	应收利息	—
5	应收申购款	1,249.38
6	其他应收款	—
7	待摊费用	—
8	其他	—
9	合计	2,039,820.42

7.13.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

无。

7.13.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

无。

7.13.6 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	户均持有的基金份额	持有人结构	
			机构投资者	个人投资者

	(户)		持有份额	占总份 额比例 (%)	持有份额	占总 份额 比例 (%)
大成绝对 收益混合 发起 A	457	30,287.91	10,100,649.95	72.97	3,740,926.12	27.03
大成绝对 收益混合 发起 C	655	77,308.65	46,942,480.91	92.70	3,694,687.59	7.30
合计	1,112	57,984.48	57,043,130.86	88.47	7,435,613.71	11.53

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	大成绝对收益混合发起 A	—	—
	大成绝对收益混合发起 C	189,873.42	0.3750
	合计	189,873.42	0.2945

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	大成绝对收益混合发起 A	0
	大成绝对收益混合发起 C	10~50
	合计	10~50
本基金基金经理持有本 开放式基金	大成绝对收益混合发起 A	0
	大成绝对收益混合发起 C	10~50
	合计	10~50

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	10,001,777.95	15.51	10,001,777.95	15.51	3 年
基金管理人高级管理人员	—	—	—	—	—
基金经理等人员	189,873.42	0.29	—	—	—
基金管理人股东	—	—	—	—	—
其他	—	—	—	—	—
合计	10,191,651.37	15.81	10,001,777.95	15.51	3 年

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	大成绝对收益混合发起 A	大成绝对收益混合发起 C
基金合同生效日 (2015 年 9 月 23 日) 基金份额总额	117,403,940.78	189,375,400.17
本报告期期初基金份额总额	13,949,089.84	60,571,685.45
本报告期基金总申购份额	90,838.93	38,069,964.88
减：本报告期基金总赎回份额	198,352.70	48,004,481.83
本报告期基金拆分变动份额	—	—
本报告期期末基金份额总额	13,841,576.07	50,637,168.50

§ 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

无。

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	54,416,052.64	20.82	50,135.88	20.82	-
南京证券	1	49,545,373.30	18.96	45,646.58	18.95	-
粤开证券	1	43,872,681.83	16.79	40,423.03	16.79	-
中信证券	4	36,484,535.61	13.96	33,614.74	13.96	-

招商证券	2	28,372,468.31	10.86	26,140.68	10.86	-
东吴证券	1	26,427,158.50	10.11	24,349.07	10.11	-
国金证券	2	13,549,528.82	5.18	12,483.19	5.18	-
中泰证券	2	8,708,915.83	3.33	8,023.31	3.33	-
爱建证券	1	-	-	-	-	-
安信证券	1	-	-	-	-	-
川财证券	1	-	-	-	-	-
第一创业	1	-	-	-	-	-
东北证券	2	-	-	-	-	-
东财证券	1	-	-	-	-	-
东方证券	1	-	-	-	-	-
东兴证券	1	-	-	-	-	-
东亚前海	1	-	-	-	-	-
方正证券	1	-	-	-	-	-
高华证券	1	-	-	-	-	-
广发证券	1	-	-	-	-	-
国盛证券	1	-	-	-	-	-
国泰君安	3	-	-	-	-	-
国信证券	1	-	-	-	-	-
海通证券	1	-	-	-	-	-
红塔证券	1	-	-	-	-	-
华创证券	1	-	-	-	-	-
华泰证券	1	-	-	-	-	-
华西证券	1	-	-	-	-	-
民生证券	1	-	-	-	-	-
平安证券	1	-	-	-	-	-
瑞银证券	2	-	-	-	-	-
山西证券	1	-	-	-	-	-
上海证券	1	-	-	-	-	-
申万宏源	1	-	-	-	-	-
世纪证券	1	-	-	-	-	-
天风证券	2	-	-	-	-	-
万和证券	1	-	-	-	-	-
西部证券	1	-	-	-	-	-
湘财证券	1	-	-	-	-	-
信达证券	2	-	-	-	-	-
兴业证券	2	-	-	-	-	-
浙商证券	1	-	-	-	-	-
中国银河证券	4	-	-	-	-	-

中金公司	2	-	-	-	-	-
中信建投证券	2	-	-	-	-	-
中银国际证券	1	-	-	-	-	-
中原证券	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：

本报告期内新增交易单元：无；

本报告期内退租交易单元：申万宏源西部、中金公司。

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	2,311.30	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	中国证监会基金电子披	2023年6月30日

	期身份证件或者身份证明文件的公告	露网站、规定报刊及本公司网站	
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	大成基金管理有限公司关于旗下部分基金增加上海中欧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	2023 年 4 月 26 日
4	大成绝对收益策略混合型发起式证券投资基金 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
5	大成绝对收益策略混合型发起式证券投资基金 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
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
8	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
9	大成基金管理有限公司关于旗下部分基金增加玄元保险代理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	2023 年 3 月 10 日
10	大成绝对收益策略混合型发起式证券投资基金 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

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过 20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比(%)
机构	1	20230101-20230104	19,011,406.84	8,905,852.42	27,917,259.26	0.00	0.00
	2	20230105-20230628	10,001,777.95	0.00	0.00	10,001,777.95	15.51
	3	20230101-20230630	18,773,466.83	0.00	0.00	18,773,466.83	29.12

	4	20230101- 20230630	19,035,53 2.99	28,169, 014.08	19,035,53 2.99	28,169,014.08	43.69
产品特有风险							
当基金份额持有人占比过于集中时，可能会因某单一基金份额持有人大额赎回而引发基金净值剧烈波动的风险，甚至有可能引起基金的流动性风险，基金管理人可能无法及时变现基金资产以应对基金份额持有人的赎回申请，基金份额持有人可能无法及时赎回持有的全部基金份额。							

11.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§ 12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

- 1、中国证监会批准设立大成绝对收益策略混合型发起式证券投资基金的文件；
- 2、《大成绝对收益策略混合型发起式证券投资基金基金合同》；
- 3、《大成绝对收益策略混合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

2023 年 8 月 30 日