

# 大成沪深 300 指数证券投资基金 2024 年中期报告

2024 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：2024 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 2024 年 08 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 2024 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>9</b>
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	12
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	14
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	15
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	15
<b>§ 5 托管人报告</b>	<b>15</b>
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	15
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	15
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	15
<b>§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）</b>	<b>15</b>
6.1 资产负债表	15
6.2 利润表	17
6.3 净资产变动表	18
6.4 报表附注	20
<b>§ 7 投资组合报告</b>	<b>48</b>
7.1 期末基金资产组合情况	48
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	49
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	50
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	58
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	59
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	59
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	60
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	60

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 .....	60
7.10 本基金投资股指期货的投资政策 .....	60
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 .....	60
7.12 投资组合报告附注 .....	60
<b>§ 8 基金份额持有人信息 .....</b>	<b>61</b>
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....	61
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....	62
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 .....	62
<b>§ 9 开放式基金份额变动 .....</b>	<b>63</b>
<b>§ 10 重大事件揭示 .....</b>	<b>63</b>
10.1 基金份额持有人大会决议 .....	63
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 .....	63
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....	63
10.4 基金投资策略的改变 .....	63
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....	63
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 .....	64
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	64
10.8 其他重大事件 .....	66
<b>§ 11 影响投资者决策的其他重要信息 .....</b>	<b>67</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 .....	67
11.2 影响投资者决策的其他重要信息 .....	67
<b>§ 12 备查文件目录 .....</b>	<b>67</b>
12.1 备查文件目录 .....	67
12.2 存放地点 .....	67
12.3 查阅方式 .....	67

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	大成沪深 300 指数证券投资基金	
基金简称	大成沪深 300 指数	
基金主代码	519300	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2006 年 4 月 6 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	1,284,060,778.78 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	大成沪深 300 指数 A	大成沪深 300 指数 C
下属分级基金的交易代码	519300	007096
下属分级基金的前端交易代码	519300	-
下属分级基金的后端交易代码	519301	-
报告期末下属分级基金的份额总额	1,195,053,384.29 份	89,007,394.49 份

### 2.2 基金产品说明

投资目标	通过严格的投资程序约束和数量化风险管理手段，实现指数投资偏离度和跟踪误差的最小化。在正常市场情况下，本基金日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.35%，年跟踪误差不超过 4%。
投资策略	本基金采用被动式指数投资策略。原则上，股票投资组合的构建主要按照标的指数的成份股组成及其权重来拟合、复制标的指数，并原则上根据标的指数成份股及其权重的变动而进行相应调整。
业绩比较基准	沪深 300 指数
风险收益特征	本基金为指数基金，是风险中等、获得证券市场平均收益率的产品。

### 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	任航
	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	中国证券登记结算有限责任公司	北京市西城区太平桥大街 17 号

## § 3 主要财务指标和基金净值表现

### 3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数 据和指标	报告期(2024 年 1 月 1 日-2024 年 6 月 30 日)	
	大成沪深 300 指数 A	大成沪深 300 指数 C
本期已实现收益	-6,605,918.21	-656,699.90
本期利润	16,926,358.23	3,053,635.17
加权平均基金份 额本期利润	0.0141	0.0271
本期加权平均净 值利润率	1.58%	3.07%
本期基金份额净 值增长率	1.57%	1.52%
3.1.2 期末数 据和指标	报告期末(2024 年 6 月 30 日)	
期末可供分配利 润	-132,593,310.64	-10,306,373.47

期末可供分配基金份额利润	-0.1110	-0.1158
期末基金资产净值	1,062,460,073.65	78,701,021.02
期末基金份额净值	0.8890	0.8842
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2024年6月30日)	
基金份额累计净值增长率	210.48%	5.92%

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

大成沪深 300 指数 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	-2.49%	0.45%	-3.30%	0.48%	0.81%	-0.03%
过去三个月	-1.19%	0.71%	-2.14%	0.76%	0.95%	-0.05%
过去六个月	1.57%	0.84%	0.89%	0.90%	0.68%	-0.06%
过去一年	-7.82%	0.82%	-9.91%	0.87%	2.09%	-0.05%
过去三年	-26.72%	0.97%	-33.74%	1.05%	7.02%	-0.08%
自基金合同生效起至今	210.48%	1.54%	213.77%	1.63%	-3.29%	-0.09%

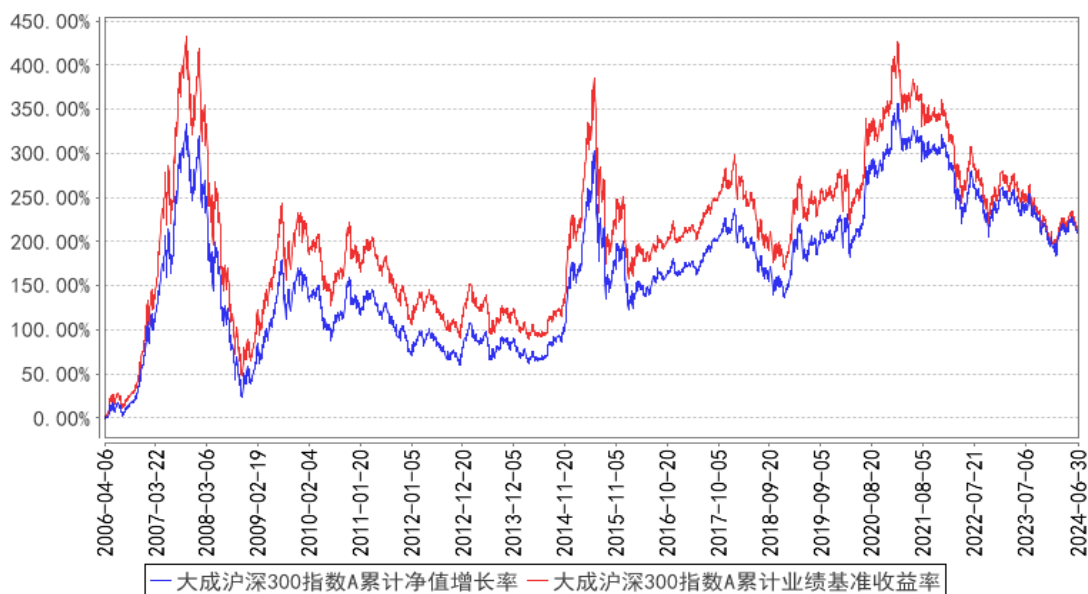
大成沪深 300 指数 C

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	-2.49%	0.45%	-3.30%	0.48%	0.81%	-0.03%
过去三个月	-1.21%	0.71%	-2.14%	0.76%	0.93%	-0.05%

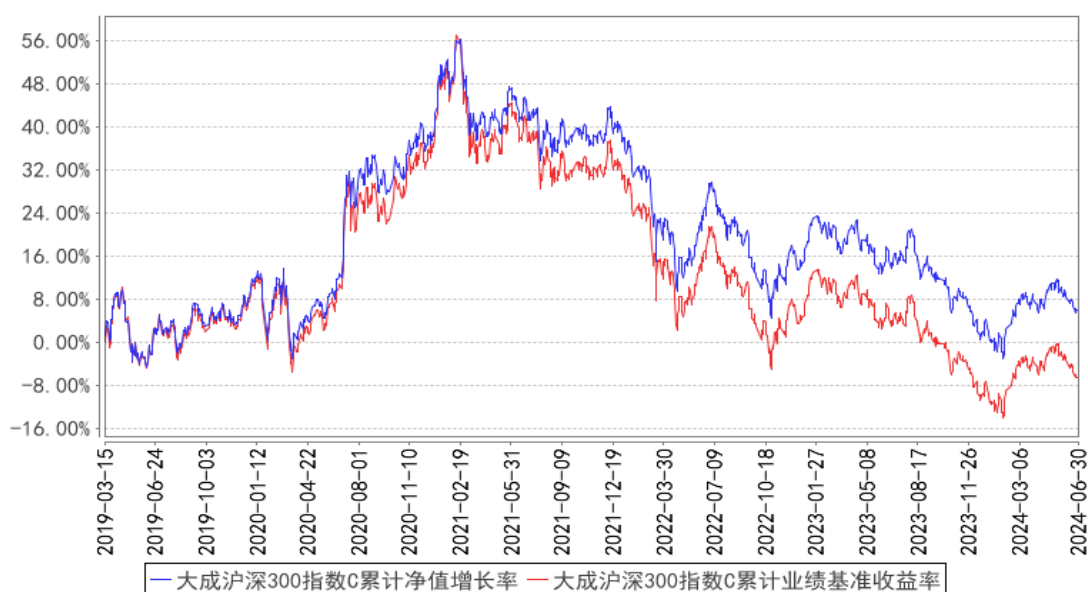
过去六个月	1.52%	0.84%	0.89%	0.90%	0.63%	-0.06%
过去一年	-7.91%	0.82%	-9.91%	0.87%	2.00%	-0.05%
过去三年	-26.91%	0.97%	-33.74%	1.05%	6.83%	-0.08%
自基金合同生效 起至今	5.92%	1.08%	-6.40%	1.17%	12.32%	-0.09%

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

大成沪深300指数A累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



大成沪深300指数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：1、本基金合同规定，基金管理人应当自基金合同生效之日起六个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的约定。建仓期结束时，本基金的投资组合比例符合基金合同的约定。



2、本基金自 2019 年 3 月 8 日起增设 C 类基金份额类别，C 类的净值增长率和业绩比较基准收益率自 2019 年 3 月 15 日有份额之日开始计算。

## § 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成立于 1999 年 4 月 12 日，注册资本人民币 2 亿元，是中国首批获准成立的“老十家”基金管理公司之一。公司总部位于深圳，同时设置了北方、华东和南方营销总部，在北京、上海等地开设有 5 家分公司。2009 年，公司在香港设立大成国际资产管理有限公司，大力拓展国际业务；2013 年，设立大成创新资本管理有限公司，开拓专户及专项管理业务。公司业务资质齐全，全面覆盖公募基金、机构投资、海外投资、财富管理、养老金管理等业务，还受全国社会保障基金理事会委托管理部分社保基金和基本养老保险基金。旗下大成国际资产管理公司具备 QFII、RQFII 等资格，是首批首家完成备案的能够提供港股通投资顾问服务的香港机构。历经二十余年的磨砺和沉淀，大成基金形成了以长期投资能力为核心的竞争优势，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。公司目前已形成权益投资、固收投资、指数与期货投资、跨境投资、混合资产投资、大类资产配置六大投资团队，全面覆盖各类投资领域，综合实力不断提升，各项业务迅猛发展，管理资产种类位居同业前列。

#### 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	2023 年 4 月 14 日	-	16 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

					<p>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 日至 2023 年 10 月 20 日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。2024 年 3 月 6 日起任大成中证 A50 交易型开放式指数证券投资基金基金经理。2024 年 4 月 8 日起任大成中证红利低波动 100 交易型开放式指数证券投资基金基金经理。2024 年 4 月 23 日起任大成中证 A50 交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理。2024 年 5 月 24 日起任大成中证芯片产业指数型发起式证券投资基金基金经理。2024 年 5 月 28 日起任大成中证工程机械主题交易型开放式指数证券投资基金基金经理。具备基金从业资格。国籍：中国</p>
李绍	本基金基金经理，指数与期货投资部总监	2023 年 4 月 14 日	-	24 年	<p>东北财经大学经济学硕士。曾先后任职于大连商品交易所、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</p>

					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。2024 年 3 月 6 日起任大成中证 A50 交易型开放式指数证券投资基金基金经理。2024 年 4 月 8 日起任大成中证红利低波动 100 交易型开放式指数证券投资基金基金经理。具有基金从业资格。国籍：中国
李溟玮	本基金基金经理助理	2024 年 4 月 15 日	-	8 年	美国纽约大学理学硕士。2016 年 5 月加入大成基金管理有限公司，曾担任数量与指数投资部研究员、指数与期货投资部投资经理，现任指数与期货投资部基金经理助理。2024 年 4 月 15 日起任大成中证 A50 交易型开放式指数证券投资基金、大成中证红利低波动 100 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、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、大成沪深 300 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、大成中证 100 交易型开放式指数证券投资基金基金经理助理。2024 年 4 月 23 日起任大成中证 A50 交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经

					理助理。具有基金从业资格。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中国证监会《证券投资基金经营机构董事、监事、高级管理人员及从业人员监督管理办法》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、5 日内及 10 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，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。公司旗下投资组合间存在证券同日反向交易，但不存在参与交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量 5% 的情形。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，国内经济处于结构转型中，GDP 同比增长 5%，达到年初制定的目标。由于旧动能房地产持续在调整，主要发展引擎向制造业和出口切换，经济运行呈现供给强于需求的特征。节奏上，二季度增速较一季度有所回落，修复过程“波浪式发展”。报告期内，A 股市场整体呈现震荡

态势，主要指数表现分化明显。其中，沪深 300 涨 0.89%；中证 500 跌 8.96%；创业板指跌 10.99%，中证 1000 跌 16.84%。行业上（中信一级），银行、煤炭、石油石化涨幅领先；综合、消费者服务、计算机现萎靡。主题方面，红利策略整体上依然跑赢市场。风格上，大盘、价值明显占优。

阶段表现上，市场在年初继续反映上年底的逻辑，定价国内有效需求不足和美国降息预期修正。除高股息表现坚挺外，其余股票资产普遍调整。此后，市场下跌又引发生品敲入、量化策略清盘等其他连锁反应，下跌趋势加强，尤其是小市值风格跌幅较大。节前一周，以汇金、证金为代表的机构陆续增持 ETF 改善微观流动性。同时，监管机构强化对量化私募管理，政策上更新转融通规则。在大资金和情绪的带动下，股票市场整体进入反攻区间。相对来说，前期跌幅大的板块反弹幅度也更大。市场在修复一定程度后，部分资金获利了结，叠加季报披露，市场整体调整，小微盘再次受创。四月中旬起，新国九条、房地产重磅政策等陆续出台；外资上调 A 股的评级展望，叠加海外股市波动放大，资金分流向境内。在政策呵护与流动性改善的推动下，使市场阶段性回暖，风格逐渐向大市值切换。五月下旬至半年度末，由于连续两个月的经济数据显示出复苏动能较一季度放缓，市场再次进入震荡调整区间。

本基金标的指数为沪深 300 指数。沪深 300 指数由沪深市场中规模大、流动性好的最具代表性的 300 只证券组成，反映沪深市场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

截至本报告期末大成沪深 300 指数 A 的基金份额净值为 0.8890 元，本报告期基金份额净值增长率为 1.57%，同期业绩比较基准收益率为 0.89%；截至本报告期末大成沪深 300 指数 C 的基金份额净值为 0.8842 元，本报告期基金份额净值增长率为 1.52%，同期业绩比较基准收益率为 0.89%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望下半年，宏观环境或将进一步改善。结构上，支撑项是基建和制造业。制造业增长在内外部库存周期共振下继续回升。基建投资增长在政府债发行提速下持平或小幅加快。房地产虽然上半年降幅有所收窄，但仍是拖累项，下半年政策发力诉求上升。消费伴随“以旧换新”等政策落地或好于上半年。出口方面，美国经济和大选结果都可能形成干扰，但总体上全球库存周期回补，且我国与新兴经济体合作加深，增长或保持韧性。货币政策在兼顾多目标的前提下中性偏松；财政政策适度加力。价格端，预计 CPI 和 PPI 温和回升。

对于股票市场而言，目前 A 股再次回到较低位置，在宏观环境有望改善的背景下，我们认为机会大于风险，调整蓄势带来中长期配置机会。下半年，可能对股市形成催化的因素主要是政策加码和物价回升带动的企业盈利改善。风格上，前期表现较好红利股或龙头股均具备高质量、高现金流特征。这类股票在经济总量受限情况下具备经营优势，业绩韧性强，投资确定性高；而伴随经济复苏，它们的盈利水平边际变化更明显，估值修复更快。

组合管理上，我们将严格按照基金合同的相关约定，紧密跟踪标的指数，按照标的指数成分股组成及其权重的变化调整投资组合，努力实现跟踪误差的最小化。

#### 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本基金管理人指导基金估值业务的领导小组为公司估值委员会，公司估值委员会主要负责估值政策和估值程序的制定、修订以及执行情况的监督。估值委员会由公司各投研部门、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。

各投研部门、风险管理部负责关注相关投资品种的动态，评判基金持有的投资品种是否处于不活跃的交易状态或者最近交易日后经济环境发生了重大变化或证券发行机构发生了影响证券价格的重大事件，从而确定估值日需要进行估值测算或者调整的投资品种；提出合理的数量分析模型对需要进行估值测算或者调整的投资品种进行公允价值定价与计量；定期对估值政策和程序进行评价，以保证其持续适用；交易管理部负责关注相关投资品种的流动性状况，协助反馈其市场交易信息；基金运营部负责日常的基金资产的估值业务，执行基金估值政策，并负责与托管行沟通估值调整事项；监察稽核部负责审核估值政策和程序的一致性，监督估值委员会工作流程中的风险控制，并负责估值调整事项的信息披露工作。

本基金的日常估值程序由基金运营部基金估值核算人员执行，并与托管银行的估值结果核对一致。基金估值政策的议定和修改采用集体讨论机制，投资组合经理作为估值小组成员，对持仓证券的交易情况、信息披露情况保持应有的职业敏感，向估值委员会提供估值参考信息，参与估值政策讨论。对需采用特别估值程序的证券，基金管理人及时启动特别估值程序，由估值委员会讨论议定特别估值方案并与托管行沟通后由基金运营部具体执行。

本基金管理人参与估值流程各方之间不存在任何重大利益冲突。截止报告期末本基金管理人已与中央国债登记结算有限责任公司及中证指数有限公司签署服务协议，由中央国债登记结算有限责任公司按约定提供银行间交易的债券品种的估值数据，由中证指数有限公司按约定提供交易所交易的债券品种的估值数据和流通受限股票的折扣率数据。

#### 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

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

#### 4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

无。

### § 5 托管人报告

#### 5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

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 2024 年 1 月 1 日至 2024 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的真实、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：大成沪深 300 指数证券投资基金

报告截止日：2024 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2024 年 6 月 30 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
----	-----	------------------------	--------------------------

<b>资产：</b>			
货币资金	6.4.7.1	67,641,518.06	18,227,157.70
结算备付金		26,002.53	205,379.80
存出保证金		18,931.93	244,185.70
交易性金融资产	6.4.7.2	1,076,209,998.24	1,150,709,941.68
其中：股票投资		1,076,209,998.24	1,099,536,513.65
基金投资		-	-
债券投资		-	51,173,428.03
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		-	540,250.79
应收股利		119,655.90	-
应收申购款		346,869.38	858,972.14
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.8	45,622.33	33,491.90
资产总计		1,144,408,598.37	1,170,819,379.71
<b>负债和净资产</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2024年6月30日</b>	<b>上年度末 2023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		1,948,121.91	-
应付赎回款		261,111.85	296,963.05
应付管理人报酬		713,407.93	733,499.62
应付托管费		142,681.57	146,699.90
应付销售服务费		6,608.36	10,123.05
应付投资顾问费		-	-
应交税费		3,682.82	4,891.05
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.9	171,889.26	335,598.60
负债合计		3,247,503.70	1,527,775.27



<b>净资产：</b>			
实收基金	6.4.7.10	1,284,060,778.78	1,336,505,917.87
未分配利润	6.4.7.12	-142,899,684.11	-167,214,313.43
净资产合计		1,141,161,094.67	1,169,291,604.44
负债和净资产总计		1,144,408,598.37	1,170,819,379.71

注：报告截止日 2024 年 06 月 30 日，基金份额总额 1,284,060,778.78 份，其中大成沪深 300 指数 A 基金份额总额为 1,195,053,384.29 份，基金份额净值 0.8890 元。大成沪深 300 指数 C 基金份额总额为 89,007,394.49 份，基金份额净值 0.8842 元。

## 6.2 利润表

会计主体：大成沪深 300 指数证券投资基金

本报告期：2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
<b>一、营业总收入</b>		25,371,363.33	12,953,815.91
1. 利息收入		554,612.43	164,338.56
其中：存款利息收入	6.4.7.13	185,808.62	164,338.56
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		-	-
其他利息收入		368,803.81	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		-2,452,111.95	-1,173,807.33
其中：股票投资收益	6.4.7.14	-14,731,393.95	-14,971,628.62
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.15	48,201.97	357,088.56
资产支持证券投资	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	-	-
股利收益	6.4.7.19	12,231,080.03	13,440,732.73
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	27,242,611.51	13,864,940.53
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	26, 251. 34	98, 344. 15
<b>减：二、营业总支出</b>		5, 391, 369. 93	5, 588, 001. 21
1. 管理人报酬	6. 4. 10. 2. 1	4, 354, 231. 85	4, 544, 145. 80
其中：暂估管理人报酬		-	-
2. 托管费	6. 4. 10. 2. 2	870, 846. 30	908, 829. 14
3. 销售服务费	6. 4. 10. 2. 3	49, 687. 94	13, 650. 55
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		1, 327. 90	-
8. 其他费用	6. 4. 7. 23	115, 275. 94	121, 375. 72
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		19, 979, 993. 40	7, 365, 814. 70
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		19, 979, 993. 40	7, 365, 814. 70
<b>五、其他综合收益的税后净额</b>		-	-
<b>六、综合收益总额</b>		19, 979, 993. 40	7, 365, 814. 70

### 6.3 净资产变动表

会计主体：大成沪深 300 指数证券投资基金

本报告期：2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 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	1, 336, 505, 917. 87	-	- 167, 214, 313. 43	1, 169, 291, 604. 4 4
二、本期期初净资产	1, 336, 505, 917. 87	-	- 167, 214, 313. 43	1, 169, 291, 604. 4 4
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	-52, 445, 139. 09	-	24, 314, 629. 32	-28, 130, 509. 77
（一）、综合收益总额	-	-	19, 979, 993. 40	19, 979, 993. 40
（二）、本期基金份额交易产生的净资产变动数	-52, 445, 139. 09	-	4, 334, 635. 92	-48, 110, 503. 17

(净资产减少以“-”号填列)				
其中：1. 基金申购款	64,909,626.80	-	-7,766,752.50	57,142,874.30
2. 基金赎回款	- 117,354,765.89	-	12,101,388.42	-105,253,377.47
(三)、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动(净资产减少以“-”号填列)	-	-	-	-
四、本期期末净资产	1,284,060,778. 78	-	- 142,899,684.11	1,141,161,094.6 7
项目	上年度可比期间 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	1,325,464,095. 29	-	-51,114,438.62	1,274,349,656.6 7
二、本期期初净资产	1,325,464,095. 29	-	-51,114,438.62	1,274,349,656.6 7
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	-64,494,634.94	-	5,928,658.33	-58,565,976.61
(一)、综合收益总额	-	-	7,365,814.70	7,365,814.70
(二)、本期基金份额交易产生的净资产变动数(净资产减少以“-”号填列)	-64,494,634.94	-	-1,437,156.37	-65,931,791.31
其中：1. 基金申购款	127,923,772.61	-	-2,889,093.68	125,034,678.93
2. 基金赎回款	- 192,418,407.55	-	1,451,937.31	-190,966,470.24
(三)、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动(净资产	-	-	-	-

产减少以“-”号填列)				
四、本期期末净资产	1,260,969,460.35	-	-45,185,780.29	1,215,783,680.06

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

梁靖

基金管理人负责人

主管会计工作负责人

会计机构负责人

## 6.4 报表附注

### 6.4.1 基金基本情况

大成沪深 300 指数证券投资基金（以下简称“本基金”），系经中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）证监基金字[2006]24 号文《关于同意大成沪深 300 指数证券投资基金募集的批复》的核准，由基金管理人大成基金管理有限公司向社会公开发行募集，基金合同于 2006 年 4 月 6 日正式生效。本基金为契约型开放式，存续期限不定。本基金的基金管理人为大成基金管理有限公司，注册登记机构为中国证券登记结算有限责任公司，基金托管人为中国农业银行股份有限公司（简称“中国农业银行”）。

根据《关于大成沪深 300 指数证券投资基金增设 C 类基金份额并相应修订基金合同和托管协议的公告》自 2019 年 3 月 11 日起，对本基金增设 C 类基金份额类别，并对本基金的基金合同、托管协议作出相应修改。

本基金 A 类、B 类和 C 类基金份额分别设置代码。由于基金费用的不同，本基金 A 类基金份额、B 类基金份额和 C 类基金份额将分别计算基金份额净值。C 类基金份额的管理费率、托管费率与 A 类基金份额及 B 类基金份额相同。A 类份额与 B 类份额收取申购费、不收取销售服务费，C 类基金份额的销售服务费按前一日 C 类基金资产净值的 0.10% 年费计提、不收取申购费用，但对持有期限少于 30 日的本类别基金份额的赎回收取赎回费。

本基金主要投资于具有良好流动性的金融工具，包括沪深 300 指数成份股（含存托凭证）、备选成份股（含存托凭证）、新股（一级市场初次发行或增发）、存托凭证等，现金（不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等）或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金财产净值的 5%。本基金还可以投资于法律法规及中国证监会允许基金投资的其他金融工具。待金融衍生产品推出后，本基金可以依照法律法规或监管机构的规定运用金融衍生产品进行风险管理。本基金跟踪标

的指数的投资组合资产原则上不低于基金财产净值的 90%。除非法律法规另有规定，本基金的股票投资比例可以提高到基金财产净值的 100%。本基金的业绩比较基准为：沪深 300 指数。

本财务报表已于 2024 年 8 月 29 日经本基金的基金管理人批准报出。

#### 6.4.2 会计报表的编制基础

本财务报表系按照财政部颁布的《企业会计准则——基本准则》以及其后颁布及修订的具体会计准则、应用指南、解释以及《资产管理产品相关会计处理规定》和其他相关规定（统称“企业会计准则”）编制，同时，在信息披露和估值方面，也参考了中国证监会颁布的《中国证券监督管理委员会关于证券投资基金估值业务的指导意见》、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》、《证券投资基金信息披露内容与格式准则》第 3 号《半年度报告的内容与格式》、《证券投资基金信息披露编报规则》第 3 号《会计报表附注的编制及披露》、《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号〈年度报告和中期报告〉》以及中国证监会和中国证券投资基金业协会颁布的其他相关规定。

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

#### 6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本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 2024 年 06 月 30 日的财务状况以及自 2024 年 01 月 01 日起至 2024 年 06 月 30 日止期间的经营成果和净资产变动情况等有关信息。

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

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须说明的会计差错更正。

#### 6.4.6 税项

##### (1) 印花税

证券（股票）交易印花税税率为 1%，由出让方缴纳。自 2023 年 8 月 28 日起，证券交易印花税实施减半征收。

##### (2) 增值税及附加

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

根据财政部、国家税务总局财税[2016]46 号文《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》的规定，金融机构开展的质押式买入返售金融商品业务及持有政策性金融债券取得的利息收入属于金融同业往来利息收入；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]70 号文《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》的规定，金融机构开展的买断式买入返售金融商品业务、同业存款、同业存单以及持有金融债券取得的利息收入属于金融同业往来利息收入；

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

根据财政部、国家税务总局财税[2017]56 号文《关于资管产品增值税有关问题的通知》的规定，证券投资基金的基金管理人运营证券投资基金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。对证券投资基金在 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，已纳税额从证券投资基金的基金管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。增值税应税行为的销售额根据财政部、国家税务总局财税[2017]90 号文《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》的规定确定。

增值税附加税包括城市维护建设税、教育费附加和地方教育费附加，以实际缴纳的增值税税额为计税依据，分别按 7%、3% 和 2% 的比例缴纳城市维护建设税、教育费附加和地方教育费附加。

### （3）企业所得税

根据财政部、国家税务总局财税[2004]78 号文《关于证券投资基金税收政策的通知》的规定，自 2004 年 1 月 1 日起，对证券投资基金（封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金）管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入，继续免征企业所得税。

根据财政部、国家税务总局财税[2005]103 号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》的规定，股权分置改革中非流通股股东通过对价方式向流通股股东支付的股份、现金等收入，暂免征收流通股股东应缴纳的企业所得税。

根据财政部、国家税务总局财税[2008]1 号文《关于企业所得税若干优惠政策的通知》的规

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

#### (4) 个人所得税

根据财政部、国家税务总局财税[2005]103 号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》的规定，股权分置改革中非流通股股东通过对价方式向流通股股东支付的股份、现金等收入，暂免征收流通股股东应缴纳的个人所得税。

根据财政部、国家税务总局财税[2008]132 号文《财政部、国家税务总局关于储蓄存款利息所得有关个人所得税政策的通知》的规定，自 2008 年 10 月 9 日起，对储蓄存款利息所得暂免征收个人所得税。

根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2012]85 号文《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》的规定，自 2013 年 1 月 1 日起，证券投资基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，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，暂减按 25% 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。

根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2015]101 号文《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》的规定，自 2015 年 9 月 8 日起，证券投资基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，持股期限超过 1 年的，股息红利所得暂免征收个人所得税。

### 6.4.7 重要财务报表项目的说明

#### 6.4.7.1 货币资金

单位：人民币元

项目	本期末 2024 年 6 月 30 日
活期存款	67,641,518.06
等于：本金	67,627,859.73
加：应计利息	13,658.33
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	67,641,518.06

#### 6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2024年6月30日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	1,239,002,122.84	-	1,076,209,998.24	- 162,792,124.60
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	1,239,002,122.84	-	1,076,209,998.24	- 162,792,124.60

#### 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

单位：人民币元

项目	本期末 2024 年 6 月 30 日
应收利息	-
其他应收款	45,622.33
待摊费用	-
合计	45,622.33

## 6.4.7.9 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2024 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	274.32
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	62,688.80
其中：交易所市场	62,688.80
银行间市场	-

应付利息	-
预提费用	108,926.14
合计	171,889.26

## 6.4.7.10 实收基金

金额单位：人民币元

## 大成沪深 300 指数 A

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	1,197,094,801.21	1,197,094,801.21
本期申购	51,695,866.72	51,695,866.72
本期赎回（以“-”号填列）	-53,737,283.64	-53,737,283.64
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	1,195,053,384.29	1,195,053,384.29

## 大成沪深 300 指数 C

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	139,411,116.66	139,411,116.66
本期申购	13,213,760.08	13,213,760.08
本期赎回（以“-”号填列）	-63,617,482.25	-63,617,482.25
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	89,007,394.49	89,007,394.49

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

## 6.4.7.11 其他综合收益

无。

## 6.4.7.12 未分配利润

单位：人民币元

## 大成沪深 300 指数 A

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	753,443,594.28	-902,674,525.83	-149,230,931.55
本期期初	753,443,594.28	-902,674,525.83	-149,230,931.55
本期利润	-6,605,918.21	23,532,276.44	16,926,358.23
本期基金份额交易产生的变动数	-1,250,464.92	961,727.60	-288,737.32

其中：基金申购款	32,416,185.53	-38,583,490.16	-6,167,304.63
基金赎回款	-33,666,650.45	39,545,217.76	5,878,567.31
本期已分配利润	-	-	-
本期末	745,587,211.15	-878,180,521.79	-132,593,310.64

## 大成沪深 300 指数 C

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	86,889,414.42	-104,872,796.30	-17,983,381.88
本期期初	86,889,414.42	-104,872,796.30	-17,983,381.88
本期利润	-656,699.90	3,710,335.07	3,053,635.17
本期基金份额交易产生的变动数	-31,283,687.21	35,907,060.45	4,623,373.24
其中：基金申购款	8,197,715.97	-9,797,163.84	-1,599,447.87
基金赎回款	-39,481,403.18	45,704,224.29	6,222,821.11
本期已分配利润	-	-	-
本期末	54,949,027.31	-65,255,400.78	-10,306,373.47

## 6.4.7.13 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年6月30日
活期存款利息收入	184,087.57
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	621.58
其他	1,099.47
合计	185,808.62

## 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 2024年1月1日至2024年6月30日
股票投资收益——买卖股票差价收入	-14,731,393.95
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	-14,731,393.95

## 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
----	----

	2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日
卖出股票成交总额	81,748,199.71
减：卖出股票成本总额	96,331,757.97
减：交易费用	147,835.69
买卖股票差价收入	-14,731,393.95

#### 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 2024年1月1日至2024年6月30日
债券投资收益——利息收入	240,921.97
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	-192,720.00
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	48,201.97

##### 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 2024年1月1日至2024年6月30日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	51,359,250.00
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	51,192,720.00
减：应计利息总额	359,250.00
减：交易费用	-
买卖债券差价收入	-192,720.00

##### 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
	2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日
股票投资产生的股利收益	12,231,080.03
其中：证券出借权益补偿收入	269,411.02
基金投资产生的股利收益	-
合计	12,231,080.03

## 6.4.7.20 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期
	2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日
1. 交易性金融资产	27,242,611.51

股票投资	27,104,991.51
债券投资	137,620.00
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	27,242,611.51

#### 6.4.7.21 其他收入

单位：人民币元

项目	本期
	2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日
基金赎回费收入	26,251.34
合计	26,251.34

#### 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
	2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日
审计费用	44,753.80
信息披露费	59,672.34
证券出借违约金	-
银行划款手续费	1,849.80
账户维护费	9,000.00
合计	115,275.94

#### 6.4.7.24 分部报告

无。

#### 6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

##### 6.4.8.1 或有事项

无。

##### 6.4.8.2 资产负债表日后事项

无。

## 6.4.9 关联方关系

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

本基金本报告期存在控制关系或者其他重大利害关系的关联方未发生变化。

### 6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
大成基金管理有限公司(“大成基金”)	基金管理人、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 2024年1月1日至2024年6月 30日		上年度可比期间 2023年1月1日至2023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	95,387,496.15	75.68	292,748,692.92	100.00

#### 6.4.10.1.2 债券交易

无。

#### 6.4.10.1.3 债券回购交易

无。

#### 6.4.10.1.4 权证交易

无。

#### 6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2024年1月1日至2024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	70,195.05	71.00	59,643.86	95.14
关联方名称	上年度可比期间 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	211,157.30	100.00	125,889.57	100.00

注：1. 上述佣金参考市场价格经本基金的基金管理人与对方协商确定。

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

#### 6.4.10.2 关联方报酬

##### 6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年6月30日	上年度可比期间 2023年1月1日至2023年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	4,354,231.85	4,544,145.80
其中：应支付销售机构的客户维护费	1,224,864.82	1,271,576.80
应支付基金管理人的净管理费	3,129,367.03	3,272,569.00

注：基金管理费每日计提，按月支付。基金管理费按前一日基金资产净值的0.75%年费率计提。

计算方法如下：

$$H = E \times 0.75\% / \text{当年天数}$$

H 为每日应支付的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

##### 6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年6月30日	上年度可比期间 2023年1月1日至2023年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	870,846.30	908,829.14

注：基金托管费每日计提，按月支付。基金托管费按前一日基金资产净值的0.15%年费率计提。

计算方法如下：

$$H = E \times 0.15\% / \text{当年天数}$$

H 为每日应支付的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

##### 6.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

	本期



获得销售服务费的各关联方名称	2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	大成沪深 300 指数 A	大成沪深 300 指数 C	合计
大成基金	-	13,880.96	13,880.96
合计	-	13,880.96	13,880.96
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间		
	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		
	大成沪深 300 指数 A	大成沪深 300 指数 C	合计
大成基金	-	6,467.27	6,467.27
合计	-	6,467.27	6,467.27

注：本基金 A 类基金份额不收取销售服务费，C 类份额的销售服务费按前一日 C 类基金份额基金资产净值的 0.10% 年费率计提。计算方法为：

$$H = E \times 0.10\% / \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的销售服务费

E 为前一日 C 类基金份额的基金资产净值

#### 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 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 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	67,641,518.06	184,087.57	20,653,570.71	162,089.14

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（2024 年 6 月 30 日）本基金持有的流通受限证券

##### 6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

6.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	受限期	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量（单位：股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
001359	平安电工	2024 年 3 月 19 日	6 个月	新股锁定	17.39	20.60	184	3,199.76	3,790.40	-
001379	腾达科技	2024 年 1 月 11 日	6 个月	新股锁定	16.98	13.48	213	3,616.74	2,871.24	-
301392	汇成真空	2024 年 5 月 28 日	6 个月	新股锁定	12.20	41.66	219	2,671.80	9,123.54	-
301502	华阳智能	2024 年 1 月 26 日	6 个月	新股锁定	28.01	37.83	138	3,865.38	5,220.54	-
301536	星	2024	6 个月	新	16.16	32.27	481	7,772.96	15,521.87	-

	宸科技	年 3 月 20 日		股 锁 定						
301538	骏鼎达	2024 年 3 月 13 日	6 个月	新 股 锁 定	-	91.24	43	-	3,923.32	转 增 股
301538	骏鼎达	2024 年 3 月 13 日	6 个月	新 股 锁 定	55.82	91.24	107	5,972.74	9,762.68	-
301539	宏鑫科技	2024 年 4 月 3 日	6 个月	新 股 锁 定	10.64	19.82	361	3,841.04	7,155.02	-
301565	中仑新材	2024 年 6 月 13 日	6 个月	新 股 锁 定	11.88	18.98	711	8,446.68	13,494.78	-
301566	达利凯普	2023 年 12 月 22 日	6 个月	新 股 锁 定	8.90	16.97	576	5,126.40	9,774.72	-
301587	中瑞股份	2024 年 3 月 27 日	6 个月	新 股 锁 定	21.73	25.26	306	6,649.38	7,729.56	-
301588	美新科技	2024 年 3 月 6 日	6 个月	新 股 锁 定	14.50	21.25	257	3,726.50	5,461.25	-
301589	诺瓦星云	2024 年 2 月 1 日	6 个月	新 股 锁 定	-	188.01	553	-	103,969.53	转 增 股
301589	诺瓦星云	2024 年 2 月 1 日	6 个月	新 股 锁 定	126.89	188.01	691	87,680.99	129,914.91	-
301591	肯特股份	2024 年 2 月 20 日	6 个月	新 股 锁 定	19.43	36.98	219	4,255.17	8,098.62	-
601033	永	2024	6 个月	新	16.20	15.96	1,258	20,379.60	20,077.68	-

	兴股份	年 1 月 11 日		股锁定						
603082	北自科技	2024 年 1 月 23 日	6 个月	新股锁定	21.28	29.49	107	2,276.96	3,155.43	-
603285	键邦股份	2024 年 6 月 28 日	6 个月	新股未上市	18.65	18.65	129	2,405.85	2,405.85	-
603285	键邦股份	2024 年 6 月 28 日	1 个月内 (含)	新股未上市	18.65	18.65	1,158	21,596.70	21,596.70	-
603312	西典新能	2024 年 1 月 4 日	6 个月	新股锁定	29.02	25.36	130	3,772.60	3,296.80	-
603325	博隆技术	2024 年 1 月 3 日	6 个月	新股锁定	72.46	68.06	66	4,782.36	4,491.96	-
603341	龙旗科技	2024 年 2 月 23 日	6 个月	新股锁定	26.00	37.49	298	7,748.00	11,172.02	-
603344	星德胜	2024 年 3 月 13 日	6 个月	新股锁定	19.18	22.66	182	3,490.76	4,124.12	-
603350	安乃达	2024 年 6 月 26 日	6 个月	新股未上市	20.56	20.56	106	2,179.36	2,179.36	-
603350	安乃达	2024 年 6 月 26 日	1 个月内 (含)	新股未上市	20.56	20.56	945	19,429.20	19,429.20	-
603381	永	2024	6 个月	新	23.35	25.13	178	4,156.30	4,473.14	-

	臻股份	年 6 月 19 日		股锁定						
688530	欧莱新材	2024 年 4 月 29 日	6 个月	新股锁定	9.60	16.10	344	3,302.40	5,538.40	-
688692	达梦数据	2024 年 6 月 4 日	6 个月	新股锁定	86.96	174.93	175	15,218.00	30,612.75	-
688695	中创股份	2024 年 3 月 6 日	6 个月	新股锁定	22.43	31.55	186	4,171.98	5,868.30	-
688709	成都华微	2024 年 1 月 31 日	6 个月	新股锁定	15.69	18.79	1,045	16,396.05	19,635.55	-
688717	艾罗能源	2023 年 12 月 26 日	6 个月	新股锁定	55.66	47.02	11,303	629,124.98	531,467.06	-

注：基金可使用以基金名义开设的股票账户，选择网上或者网下一种方式进行新股申购。其中基金参与网下申购获得的新股中需要限售的部分或作为战略投资者参与配售获得的新股，在新股上市后的约定期限内不能自由转让；基金参与网上申购获配的新股，从新股获配日至新股上市日之间不能自由转让。

#### 6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

无。

#### 6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

##### 6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

无。

##### 6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

无。

#### 6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

金额单位：人民币元

序号	证券代码	证券名称	出借到期日	期末估值单价	数量（单位：股）	期末估值总额
1	000408	藏格矿业	2024 年 7 月 4 日	24.07	10,000	240,700.00
2	000568	泸州老窖	2024 年 7 月 2 日	143.49	20,100	2,884,149.00
3	000596	古井贡酒	2024 年 7 月 4 日	211.07	2,000	422,140.00
4	000617	中油资本	2024 年 7 月 1 日	5.52	69,000	380,880.00
5	000625	长安汽车	2024 年 7 月 2 日-2024 年 7 月 11 日	13.43	104,000	1,396,720.00
6	000876	新希望	2024 年 7 月 4 日	9.14	20,000	182,800.00
7	000977	浪潮信息	2024 年 7 月 4 日	36.37	4,000	145,480.00
8	000999	华润三九	2024 年 7 月 11 日-2024 年 7 月 11 日	42.58	7,800	332,124.00
9	001289	龙源电力	2024 年 7 月 1 日	17.25	4,100	70,725.00
10	001979	招商蛇口	2024 年 7 月 11 日	8.79	20,000	175,800.00
11	002007	华兰生物	2024 年 7 月 4 日	15.79	10,000	157,900.00
12	002049	紫光国微	2024 年 7 月 2 日-2024 年 7 月 11 日	52.60	12,000	631,200.00
13	002050	三花智控	2024 年 7 月 4 日-2024 年 7 月 11 日	19.08	22,000	419,760.00
14	002074	国轩高科	2024 年 7 月 2 日	19.15	1,000	19,150.00
15	002129	TCL 中环	2024 年 7 月 1 日-2024 年 7 月 2 日	8.65	88,300	763,795.00
16	002179	中航光电	2024 年 7 月 4 日	38.05	10,000	380,500.00
17	002180	纳思达	2024 年 7 月 2 日-2024 年 7 月 10 日	26.42	25,000	660,500.00
18	002230	科大讯飞	2024 年 7 月 4 日-2024 年 7 月 10 日	42.95	12,000	515,400.00
19	002236	大华股份	2024 年 7 月 1 日-2024 年 7 月 11 日	15.46	23,900	369,494.00
20	002304	洋河股份	2024 年 7 月 4 日	80.74	10,000	807,400.00
21	002371	北方华	2024 年 7 月 2 日	319.89	7,200	2,303,208.00

		创				.00
22	002410	广联达	2024 年 7 月 2 日-2024 年 7 月 10 日	9.58	31,000	296,980.00
23	002459	晶澳科技	2024 年 7 月 1 日-2024 年 7 月 11 日	11.20	26,200	293,440.00
24	002460	赣锋锂业	2024 年 7 月 1 日-2024 年 7 月 10 日	28.65	30,000	859,500.00
25	002466	天齐锂业	2024 年 7 月 2 日-2024 年 7 月 11 日	29.91	13,000	388,830.00
26	002493	荣盛石化	2024 年 7 月 2 日	9.66	23,000	222,180.00
27	002555	三七互娱	2024 年 7 月 10 日	13.05	20,000	261,000.00
28	002709	天赐材料	2024 年 7 月 4 日	17.56	2,000	35,120.00
29	002736	国信证券	2024 年 7 月 4 日-2024 年 7 月 11 日	8.69	14,000	121,660.00
30	002812	恩捷股份	2024 年 7 月 2 日	31.65	16,000	506,400.00
31	002821	凯莱英	2024 年 7 月 4 日-2024 年 7 月 11 日	65.80	3,000	197,400.00
32	002920	德赛西威	2024 年 7 月 1 日	87.09	7,600	661,884.00
33	300014	亿纬锂能	2024 年 7 月 10 日-2024 年 7 月 11 日	39.92	11,000	439,120.00
34	300124	汇川技术	2024 年 7 月 2 日	51.30	5,000	256,500.00
35	300142	沃森生物	2024 年 7 月 2 日	11.38	43,000	489,340.00
36	300308	中际旭创	2024 年 7 月 2 日-2024 年 7 月 10 日	137.88	8,000	1,103,040.00
37	300347	泰格医药	2024 年 7 月 4 日	48.60	5,000	243,000.00
38	300413	芒果超媒	2024 年 7 月 2 日	20.90	20,000	418,000.00
39	300496	中科创达	2024 年 7 月 10 日	45.59	4,000	182,360.00
40	300498	温氏股份	2024 年 7 月 10 日	19.82	50,000	991,000.00
41	300751	迈为股份	2024 年 7 月 2 日-2024 年 7 月 10 日	119.48	3,000	358,440.00
42	300759	康龙化成	2024 年 7 月 2 日	18.58	10,000	185,800.00
43	300896	爱美客	2024 年 7 月 10 日	172.10	3,000	516,300.00

						0
44	300957	贝泰妮	2024 年 7 月 1 日	48.32	4,600	222,272.00
45	301269	华大九天	2024 年 7 月 4 日	77.05	2,000	154,100.00
46	600018	上港集团	2024 年 7 月 2 日	5.78	18,500	106,930.00
47	600031	三一重工	2024 年 7 月 4 日	16.50	50,000	825,000.00
48	600048	保利发展	2024 年 7 月 4 日	8.76	20,000	175,200.00
49	600104	上汽集团	2024 年 7 月 1 日	13.86	50,000	693,000.00
50	600111	北方稀土	2024 年 7 月 1 日-2024 年 7 月 10 日	17.20	54,000	928,800.00
51	600115	中国东航	2024 年 7 月 4 日	4.01	1,000	4,010.00
52	600132	重庆啤酒	2024 年 7 月 4 日	60.70	6,000	364,200.00
53	600219	南山铝业	2024 年 7 月 4 日	3.81	10,000	38,100.00
54	600438	通威股份	2024 年 7 月 4 日-2024 年 7 月 11 日	19.11	26,000	496,860.00
55	600584	长电科技	2024 年 7 月 4 日	31.71	2,000	63,420.00
56	600732	爱旭股份	2024 年 7 月 1 日	9.05	29,900	270,595.00
57	600745	闻泰科技	2024 年 7 月 4 日	28.25	10,000	282,500.00
58	600893	航发动力	2024 年 7 月 1 日	36.55	36,400	1,330,420.00
59	600900	长江电力	2024 年 7 月 11 日	28.92	10,000	289,200.00
60	600905	三峡能源	2024 年 7 月 4 日-2024 年 7 月 11 日	4.36	200,000	872,000.00
61	600938	中国海油	2024 年 7 月 4 日	33.00	5,600	184,800.00
62	601012	隆基绿能	2024 年 7 月 1 日-2024 年 7 月 10 日	14.02	145,800	2,044,116.00
63	601059	信达证券	2024 年 7 月 1 日	14.21	11,700	166,257.00
64	601111	中国国航	2024 年 7 月 4 日-2024 年 7 月 11 日	7.38	19,000	140,220.00
65	601138	工业富	2024 年 7 月 4 日	27.40	20,000	548,000.00



		联				0
66	601238	广汽集团	2024 年 7 月 4 日-2024 年 7 月 11 日	7.74	30,000	232,200.00
67	601319	中国人保	2024 年 7 月 1 日	5.15	12,500	64,375.00
68	601336	新华保险	2024 年 7 月 10 日-2024 年 7 月 11 日	30.03	2,000	60,060.00
69	601360	三六零	2024 年 7 月 1 日-2024 年 7 月 1 日	7.68	97,600	749,568.00
70	601628	中国人寿	2024 年 7 月 11 日	31.05	10,000	310,500.00
71	601633	长城汽车	2024 年 7 月 4 日-2024 年 7 月 10 日	25.30	17,000	430,100.00
72	601689	拓普集团	2024 年 7 月 10 日	53.61	10,000	536,100.00
73	601698	中国卫通	2024 年 7 月 4 日	14.09	10,000	140,900.00
74	601699	潞安环能	2024 年 7 月 2 日	18.13	1,000	18,130.00
75	601808	中海油服	2024 年 7 月 11 日	17.20	6,000	103,200.00
76	601868	中国能建	2024 年 7 月 4 日	2.12	100,000	212,000.00
77	601872	招商轮船	2024 年 7 月 4 日	8.45	13,000	109,850.00
78	601998	中信银行	2024 年 7 月 1 日	6.70	50,000	335,000.00
79	603195	公牛集团	2024 年 7 月 1 日-2024 年 7 月 1 日	77.12	5,220	402,566.40
80	603259	药明康德	2024 年 7 月 4 日	39.19	20,000	783,800.00
81	603260	合盛硅业	2024 年 7 月 1 日	46.71	9,700	453,087.00
82	603392	万泰生物	2024 年 7 月 1 日-2024 年 7 月 10 日	65.88	9,600	632,448.00
83	603799	华友钴业	2024 年 7 月 4 日	22.13	20,000	442,600.00
84	603833	欧派家居	2024 年 7 月 1 日	53.56	5,000	267,800.00
85	603986	兆易创新	2024 年 7 月 4 日	95.62	10,000	956,200.00
86	605117	德业股份	2024 年 7 月 1 日	74.34	6,600	490,644.00
87	605499	东鹏饮	2024 年 7 月 2 日	215.75	2,200	474,650.00

		料				0
88	688012	中微公司	2024 年 7 月 4 日	141.26	2,000	282,520.00
89	688041	海光信息	2024 年 7 月 4 日	70.32	10,000	703,200.00
90	688126	沪硅产业	2024 年 7 月 4 日	13.81	20,000	276,200.00
91	688223	晶科能源	2024 年 7 月 4 日	7.10	20,000	142,000.00
92	688256	寒武纪	2024 年 7 月 4 日	198.67	2,000	397,340.00
93	688271	联影医疗	2024 年 7 月 4 日	109.70	2,000	219,400.00
94	688303	大全能源	2024 年 7 月 10 日	20.39	10,000	203,900.00
95	688363	华熙生物	2024 年 7 月 2 日	56.57	5,200	294,164.00
96	688396	华润微	2024 年 7 月 2 日	37.44	14,400	539,136.00
97	688599	天合光能	2024 年 7 月 1 日	16.92	29,700	502,524.00
合计	-	-	-	-	2,125,420	44,253,281.40

注：出借证券中如有其他流通受限的情况详见本报告“本基金持有的流通受限证券”部分内容。

## 6.4.13 金融工具风险及管理

### 6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

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

本基金的基金管理人奉行全面风险管理体系的建设，建立了以由高层监控（合规与风险管理委员会、公司投资风险控制委员会）、专业监控（监察稽核部、风险管理部）、部门互控、岗位自控构成的风险管理架构体系。本基金的基金管理人在董事会下设立合规与风险管理委员会，对公司整体运营风险进行监督，监督风险控制措施的执行。在管理层层面设立投资风险控制委员会，通过定期会议讨论涉及投资风险的重大议题，形成正式决议提交投委会。在业务操作层面，监察稽核部履行合规控制职责，通过定期、不定期检查内控制度的执行情况、对重大风险点以专项稽核的方式确保公司内控制度、流程得到贯彻执行。风险管理部履行风险量化评估分析职责。

本基金的基金管理人对于金融工具的风险管理方法主要是通过定性分析和定量分析的方法去

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

#### 6.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息等情况，导致基金资产损失和收益变化的风险。

本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的银行存款存放在本基金的托管人中国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：本基金未持有除国债、央行票据和政策性金融债以外的债券）。

#### 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》、《货币市场基金监督管理办法》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流动性受限资产比例、份额持有人集中度、调整平均剩余期限和平均剩余存续期、压力测试等方式防范流动性风险，并于开放日对本基金的申购赎回情况进行监控，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配，确保本基

金资产的变现能力与投资者赎回需求的匹配与平衡。本基金的基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款，约定在非正常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。于本期末，本基金持有的流动性受限资产的估值占基金资产净值的比例未超过 15%，且本基金组合资产中 7 个工作日可变现资产未超过最近工作日确认的净赎回金额。

本基金主要投资于交易所及银行间市场内交易的证券，除在附注“期末本基金持有的流通受限证券”中列示的部分基金资产流通暂时受限制外（如有），均能够及时变现。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，因此账面余额一般为未折现的合约到期现金流量。本报告期内，本基金未发生重大流动性风险事件。

#### 6.4.13.4 市场风险

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

##### 6.4.13.4.1 利率风险

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

本基金的基金管理人定期对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控，并通过调整投资组合的久期等方法对上述利率风险进行管理。本基金持有的大部分金融资产和金融负债不计息，因此本基金的收入及经营活动的现金流量在很大程度上独立于市场利率变化。本基金持有的利率敏感性资产主要为银行存款、结算备付金及应收申购款等。

##### 6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2024 年 6 月 30 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
货币资金	67,641,518.06	-	-	-	67,641,518.06
结算备付金	26,002.53	-	-	-	26,002.53
存出保证金	18,931.93	-	-	-	18,931.93
交易性金融资产	-	-	-	1,076,209,998.24	1,076,209,998.24

应收股利	-	-	-	119,655.90	119,655.90
应收申购款	9,803.56	-	-	337,065.82	346,869.38
其他资产	-	-	-	45,622.33	45,622.33
资产总计	67,696,256.08	-	-	1,076,712,342.29	1,144,408,598.37
负债					
应付赎回款	-	-	-	261,111.85	261,111.85
应付管理人报酬	-	-	-	713,407.93	713,407.93
应付托管费	-	-	-	142,681.57	142,681.57
应付清算款	-	-	-	1,948,121.91	1,948,121.91
应付销售服务费	-	-	-	6,608.36	6,608.36
应交税费	-	-	-	3,682.82	3,682.82
其他负债	-	-	-	171,889.26	171,889.26
负债总计	-	-	-	3,247,503.70	3,247,503.70
利率敏感度缺口	67,696,256.08	-	-	1,073,464,838.59	1,141,161,094.67
上年度末 2023 年 12 月 31 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
货币资金	18,227,157.70	-	-	-	18,227,157.70
结算备付金	205,379.80	-	-	-	205,379.80
存出保证金	244,185.70	-	-	-	244,185.70
交易性金融资产	51,173,428.03	-	-	1,099,536,513.65	1,150,709,941.68
应收申购款	7,293.20	-	-	851,678.94	858,972.14
应收清算款	-	-	-	540,250.79	540,250.79
其他资产	-	-	-	33,491.90	33,491.90
资产总计	69,857,444.43	-	-	1,100,961,935.28	1,170,819,379.71
负债					
应付赎回款	-	-	-	296,963.05	296,963.05
应付管理人报酬	-	-	-	733,499.62	733,499.62
应付托管费	-	-	-	146,699.90	146,699.90
应付销售服务费	-	-	-	10,123.05	10,123.05
应交税费	-	-	-	4,891.05	4,891.05
其他负债	-	-	-	335,598.60	335,598.60
负债总计	-	-	-	1,527,775.27	1,527,775.27
利率敏感度缺口	69,857,444.43	-	-	1,099,434,160.01	1,169,291,604.44

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

假设	除市场利率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（2024年6月30日）	上年度末（2023年12月31日）
	市场利率上升 25 个基点	-	-22,723.87
市场利率下降 25 个基点	-	22,725.10	

注：于本期末，本基金未持有交易性债券投资和交易性资产支持证券投资（上年度末：4.38%），因此市场利率的变动对于本基金净资产无重大影响。

## 6.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基金持有的金融工具以人民币计价，因此无重大外汇风险。

## 6.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场交易的股票和债券，所面临的最大市场价格风险由所持有的金融工具的公允价值决定。本基金通过投资组合的分散化降低市场价格风险，并且本基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控。

本基金跟踪标的指数的投资组合的资产原则上不低于基金资产净值的 90%。除非法律法规另有规定，本基金的股票投资比例可以提高到基金资产净值的 100%。现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%。

## 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 2024年6月30日		上年度末 2023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	1,076,209,998.24	94.31	1,099,536,513.65	94.03
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	1,076,209,998.24	94.31	1,099,536,513.65	94.03

#### 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（2024年6月30日）	上年度末（2023年12月31日）
	业绩比较基准上升5%	53,565,751.38	54,270,772.40
	业绩比较基准下降5%	-53,565,751.38	-54,270,772.40

#### 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 2024年6月30日	上年度末 2023年12月31日
第一层次	1,075,184,661.94	1,097,915,009.29
第二层次	45,611.11	52,072,170.05
第三层次	979,725.19	722,762.34

合计	1,076,209,998.24	1,150,709,941.68
----	------------------	------------------

#### 6.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

本基金调整公允价值计量层次转换时点的相关会计政策在前后各会计期间保持一致。

对于公开市场交易的证券等投资，若出现交易不活跃、非公开发行等情况，本基金不会于交易不活跃期间及限售期间将相关投资的公允价值列入第一层次，并根据估值调整中采用的对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次，确定相关投资的公允价值应属第二层次或第三层次。

#### 6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

于本期末，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产(上年度末：同)。

#### 6.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

本基金持有的不以公允价值计量的金融工具为以摊余成本计量的金融资产和金融负债，这些金融工具因其剩余期限较短，所以其账面价值与公允价值相若。

#### 6.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

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	1,076,209,998.24	94.04
	其中：股票	1,076,209,998.24	94.04
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	67,667,520.59	5.91
8	其他各项资产	531,079.54	0.05
9	合计	1,144,408,598.37	100.00



## 7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

### 7.2.1 报告期末指数投资按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	13,594,086.48	1.19
B	采矿业	65,488,523.03	5.74
C	制造业	559,975,107.70	49.07
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	50,451,780.95	4.42
E	建筑业	24,049,835.81	2.11
F	批发和零售业	2,765,559.30	0.24
G	交通运输、仓储和邮政业	40,297,289.08	3.53
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	48,583,889.04	4.26
J	金融业	240,005,026.28	21.03
K	房地产业	9,894,591.20	0.87
L	租赁和商务服务业	8,632,780.18	0.76
M	科学研究和技术服务业	8,527,341.03	0.75
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	2,912,758.08	0.26
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	1,075,178,568.16	94.22

### 7.2.2 报告期末积极投资按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	974,871.35	0.09
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-

E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	36,481.05	0.00
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	20,077.68	0.00
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	1,031,430.08	0.09

### 7.2.3 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

无。

### 7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

#### 7.3.1 期末指数投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量 (股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例 (%)
1	600519	贵州茅台	38,058	55,845,928.62	4.89
2	300750	宁德时代	159,820	28,772,394.60	2.52
3	601318	中国平安	651,457	26,944,261.52	2.36
4	600036	招商银行	749,142	25,613,164.98	2.24
5	600900	长江电力	740,462	21,414,161.04	1.88
6	000333	美的集团	295,608	19,066,716.00	1.67
7	601899	紫金矿业	996,949	17,516,393.93	1.53
8	601166	兴业银行	880,215	15,509,388.30	1.36
9	000858	五粮液	117,489	15,043,291.56	1.32
10	601328	交通银行	1,891,608	14,130,311.76	1.24

11	601398	工商银行	2,415,518	13,768,452.60	1.21
12	002594	比亚迪	54,900	13,738,725.00	1.20
13	002475	立讯精密	304,147	11,956,018.57	1.05
14	600030	中信证券	595,712	10,859,829.76	0.95
15	300760	迈瑞医疗	36,800	10,705,488.00	0.94
16	000651	格力电器	272,689	10,694,862.58	0.94
17	600276	恒瑞医药	270,328	10,396,814.88	0.91
18	600887	伊利股份	385,308	9,956,358.72	0.87
19	600309	万华化学	114,014	9,219,172.04	0.81
20	000725	京东方 A	2,236,863	9,148,769.67	0.80
21	601088	中国神华	199,646	8,858,293.02	0.78
22	300059	东方财富	772,245	8,154,907.20	0.71
23	601816	京沪高铁	1,486,168	7,980,722.16	0.70
24	601988	中国银行	1,638,740	7,570,978.80	0.66
25	300308	中际旭创	54,300	7,486,884.00	0.66
26	002714	牧原股份	165,403	7,211,570.80	0.63
27	601857	中国石油	686,056	7,080,097.92	0.62
28	002415	海康威视	225,942	6,983,867.22	0.61
29	601668	中国建筑	1,259,494	6,687,913.14	0.59
30	600919	江苏银行	888,610	6,602,372.30	0.58
31	601138	工业富联	240,400	6,586,960.00	0.58
32	600690	海尔智家	229,146	6,503,163.48	0.57
33	000568	泸州老窖	44,500	6,385,305.00	0.56
34	300498	温氏股份	322,024	6,382,515.68	0.56
35	600809	山西汾酒	29,580	6,237,830.40	0.55
36	002371	北方华创	19,300	6,173,877.00	0.54
37	601985	中国核电	571,510	6,092,296.60	0.53
38	600406	国电南瑞	243,138	6,068,724.48	0.53
39	601225	陕西煤业	234,764	6,049,868.28	0.53
40	603259	药明康德	152,887	5,991,641.53	0.53
41	601919	中远海控	386,219	5,982,532.31	0.52
42	000001	平安银行	587,318	5,961,277.70	0.52
43	600031	三一重工	359,506	5,931,849.00	0.52
44	600941	中国移动	54,700	5,880,250.00	0.52
45	600000	浦发银行	710,711	5,849,151.53	0.51
46	300124	汇川技术	113,500	5,822,550.00	0.51
47	601728	中国电信	939,711	5,779,222.65	0.51
48	601601	中国太保	207,193	5,772,396.98	0.51
49	000792	盐湖股份	328,800	5,737,560.00	0.50
50	600028	中国石化	883,969	5,586,684.08	0.49
51	601766	中国中车	736,204	5,528,892.04	0.48
52	600150	中国船舶	135,400	5,512,134.00	0.48
53	688981	中芯国际	119,478	5,507,935.80	0.48

54	300274	阳光电源	87,877	5,451,010.31	0.48
55	600050	中国联通	1,154,836	5,427,729.20	0.48
56	000063	中兴通讯	193,020	5,398,769.40	0.47
57	000338	潍柴动力	328,492	5,334,710.08	0.47
58	002352	顺丰控股	148,200	5,289,258.00	0.46
59	601169	北京银行	895,780	5,231,355.20	0.46
60	601012	隆基绿能	366,633	5,140,194.66	0.45
61	603501	韦尔股份	51,545	5,122,026.65	0.45
62	601658	邮储银行	1,009,300	5,117,151.00	0.45
63	600837	海通证券	594,793	5,091,428.08	0.45
64	000100	TCL 科技	1,136,614	4,910,172.48	0.43
65	600016	民生银行	1,287,872	4,881,034.88	0.43
66	002230	科大讯飞	111,974	4,809,283.30	0.42
67	601939	建设银行	632,562	4,680,958.80	0.41
68	600660	福耀玻璃	97,026	4,647,545.40	0.41
69	002142	宁波银行	199,886	4,409,485.16	0.39
70	601229	上海银行	602,011	4,370,599.86	0.38
71	600089	特变电工	305,880	4,242,555.60	0.37
72	600938	中国海油	126,700	4,181,100.00	0.37
73	601390	中国中铁	621,745	4,053,777.40	0.36
74	000625	长安汽车	300,402	4,034,398.86	0.35
75	688041	海光信息	56,123	3,946,569.36	0.35
76	601688	华泰证券	316,975	3,927,320.25	0.34
77	600104	上汽集团	280,100	3,882,186.00	0.34
78	603986	兆易创新	40,448	3,867,637.76	0.34
79	600048	保利发展	434,687	3,807,858.12	0.33
80	601006	大秦铁路	531,657	3,806,664.12	0.33
81	600436	片仔癀	18,311	3,793,489.87	0.33
82	601211	国泰君安	279,239	3,783,688.45	0.33
83	600905	三峡能源	865,800	3,774,888.00	0.33
84	688012	中微公司	26,266	3,710,335.16	0.33
85	002027	分众传媒	611,968	3,708,526.08	0.32
86	601888	中国中免	59,090	3,692,534.10	0.32
87	603019	中科曙光	88,668	3,679,722.00	0.32
88	601600	中国铝业	479,943	3,661,965.09	0.32
89	603993	洛阳钼业	427,744	3,635,824.00	0.32
90	601818	光大银行	1,123,600	3,561,812.00	0.31
91	600019	宝钢股份	535,552	3,561,420.80	0.31
92	603288	海天味业	101,065	3,483,710.55	0.31
93	600585	海螺水泥	145,268	3,426,872.12	0.30
94	601989	中国重工	690,095	3,402,168.35	0.30
95	600886	国投电力	180,490	3,292,137.60	0.29
96	601009	南京银行	313,079	3,252,890.81	0.29

97	600795	国电电力	539,805	3,233,431.95	0.28
98	600999	招商证券	230,939	3,212,361.49	0.28
99	688111	金山办公	13,976	3,179,540.00	0.28
100	688008	澜起科技	55,288	3,160,262.08	0.28
101	601628	中国人寿	100,862	3,131,765.10	0.27
102	600438	通威股份	163,500	3,124,485.00	0.27
103	000938	紫光股份	138,595	3,097,598.25	0.27
104	000425	徐工机械	429,146	3,068,393.90	0.27
105	600547	山东黄金	109,410	2,995,645.80	0.26
106	300014	亿纬锂能	74,261	2,964,499.12	0.26
107	600893	航发动力	80,669	2,948,451.95	0.26
108	002304	洋河股份	36,515	2,948,221.10	0.26
109	002179	中航光电	77,008	2,930,154.40	0.26
110	601669	中国电建	521,346	2,914,324.14	0.26
111	300015	爱尔眼科	282,244	2,912,758.08	0.26
112	000002	万科 A	412,019	2,855,291.67	0.25
113	002241	歌尔股份	144,853	2,826,082.03	0.25
114	600926	杭州银行	215,376	2,810,656.80	0.25
115	000538	云南白药	54,056	2,764,964.40	0.24
116	600584	长电科技	86,700	2,749,257.00	0.24
117	600760	中航沈飞	66,718	2,675,391.80	0.23
118	600111	北方稀土	153,154	2,634,248.80	0.23
119	600489	中金黄金	176,000	2,604,800.00	0.23
120	002050	三花智控	135,577	2,586,809.16	0.23
121	600011	华能国际	266,300	2,561,806.00	0.22
122	688256	寒武纪	12,690	2,521,122.30	0.22
123	601916	浙商银行	912,900	2,519,604.00	0.22
124	002252	上海莱士	321,778	2,516,303.96	0.22
125	600958	东方证券	327,919	2,492,184.40	0.22
126	600015	华夏银行	385,313	2,466,003.20	0.22
127	000166	申万宏源	566,110	2,439,934.10	0.21
128	600009	上海机场	75,279	2,427,747.75	0.21
129	600426	华鲁恒升	90,080	2,399,731.20	0.21
130	601901	方正证券	310,400	2,399,392.00	0.21
131	601186	中国铁建	278,553	2,387,199.21	0.21
132	300408	三环集团	81,332	2,374,081.08	0.21
133	002311	海大集团	50,400	2,371,320.00	0.21
134	000157	中联重科	300,700	2,309,376.00	0.20
135	600989	宝丰能源	133,200	2,308,356.00	0.20
136	000776	广发证券	186,502	2,269,729.34	0.20
137	000977	浪潮信息	62,388	2,269,051.56	0.20
138	600674	川投能源	118,000	2,212,500.00	0.19
139	601377	兴业证券	435,791	2,205,102.46	0.19

140	003816	中国广核	476,200	2,204,806.00	0.19
141	300433	蓝思科技	120,700	2,202,775.00	0.19
142	688271	联影医疗	19,886	2,181,494.20	0.19
143	002049	紫光国微	41,180	2,166,068.00	0.19
144	002001	新和成	112,298	2,156,121.60	0.19
145	000596	古井贡酒	9,900	2,089,593.00	0.18
146	688036	传音控股	27,186	2,080,816.44	0.18
147	601111	中国国航	281,799	2,079,676.62	0.18
148	600115	中国东航	518,020	2,077,260.20	0.18
149	300122	智飞生物	72,433	2,030,296.99	0.18
150	000768	中航西飞	84,288	2,025,440.64	0.18
151	002460	赣锋锂业	68,400	1,959,660.00	0.17
152	001979	招商蛇口	219,379	1,928,341.41	0.17
153	601800	中国交建	215,388	1,925,568.72	0.17
154	600010	包钢股份	1,374,156	1,923,818.40	0.17
155	600029	南方航空	326,340	1,922,142.60	0.17
156	601633	长城汽车	75,300	1,905,090.00	0.17
157	600188	兖矿能源	83,400	1,895,682.00	0.17
158	002601	龙佰集团	101,118	1,877,761.26	0.16
159	002466	天齐锂业	62,600	1,872,366.00	0.16
160	002236	大华股份	119,649	1,849,773.54	0.16
161	002648	卫星化学	101,960	1,833,240.80	0.16
162	601117	中国化学	221,900	1,828,456.00	0.16
163	000786	北新建材	61,400	1,821,124.00	0.16
164	603799	华友钴业	82,130	1,817,536.90	0.16
165	000661	长春高新	19,600	1,798,692.00	0.16
166	600346	恒力石化	127,779	1,782,517.05	0.16
167	002493	荣盛石化	183,863	1,776,116.58	0.16
168	000983	山西焦煤	171,800	1,771,258.00	0.16
169	300782	卓胜微	22,620	1,758,478.80	0.15
170	603369	今世缘	38,000	1,755,600.00	0.15
171	601838	成都银行	115,463	1,753,882.97	0.15
172	600372	中航机载	146,500	1,753,605.00	0.15
173	600161	天坛生物	71,800	1,751,920.00	0.15
174	600023	浙能电力	243,500	1,731,285.00	0.15
175	688223	晶科能源	242,242	1,719,918.20	0.15
176	600196	复星医药	77,001	1,704,802.14	0.15
177	000807	云铝股份	125,900	1,700,909.00	0.15
178	002129	TCL 中环	195,625	1,692,156.25	0.15
179	300418	昆仑万维	52,200	1,682,928.00	0.15
180	002938	鹏鼎控股	42,200	1,677,872.00	0.15
181	600845	宝信软件	52,356	1,671,727.08	0.15
182	601021	春秋航空	29,662	1,670,860.46	0.15

183	601872	招商轮船	197,236	1,666,644.20	0.15
184	601868	中国能建	784,900	1,663,988.00	0.15
185	601995	中金公司	56,100	1,661,121.00	0.15
186	601360	三六零	216,055	1,659,302.40	0.15
187	300661	圣邦股份	19,950	1,651,461.00	0.14
188	600233	圆通速递	104,300	1,632,295.00	0.14
189	600570	恒生电子	91,753	1,620,357.98	0.14
190	600219	南山铝业	425,200	1,620,012.00	0.14
191	600176	中国巨石	145,427	1,606,968.35	0.14
192	002736	国信证券	184,700	1,605,043.00	0.14
193	601066	中信建投	83,200	1,600,768.00	0.14
194	600085	同仁堂	41,587	1,589,039.27	0.14
195	002180	纳思达	60,000	1,585,200.00	0.14
196	605499	东鹏饮料	7,300	1,574,975.00	0.14
197	300896	爱美客	9,140	1,572,994.00	0.14
198	600600	青岛啤酒	21,500	1,564,555.00	0.14
199	600741	华域汽车	95,455	1,563,552.90	0.14
200	300347	泰格医药	31,540	1,532,844.00	0.13
201	601336	新华保险	50,525	1,517,265.75	0.13
202	603392	万泰生物	23,023	1,516,755.24	0.13
203	601881	中国银河	139,645	1,516,544.70	0.13
204	601100	恒立液压	32,512	1,514,408.96	0.13
205	600183	生益科技	71,600	1,507,896.00	0.13
206	601689	拓普集团	28,100	1,506,441.00	0.13
207	002271	东方雨虹	122,000	1,505,480.00	0.13
208	000895	双汇发展	62,897	1,495,061.69	0.13
209	600745	闻泰科技	52,700	1,488,775.00	0.13
210	600362	江西铜业	62,815	1,487,459.20	0.13
211	000963	华东医药	53,130	1,477,545.30	0.13
212	001965	招商公路	123,900	1,469,454.00	0.13
213	002920	德赛西威	16,800	1,463,112.00	0.13
214	600027	华电国际	206,100	1,430,334.00	0.13
215	601898	中煤能源	110,800	1,382,784.00	0.12
216	688126	沪硅产业	99,840	1,378,790.40	0.12
217	300033	同花顺	13,000	1,348,100.00	0.12
218	601878	浙商证券	125,700	1,347,504.00	0.12
219	002459	晶澳科技	120,176	1,345,971.20	0.12
220	601618	中国中冶	432,238	1,339,937.80	0.12
221	000999	华润三九	31,050	1,322,109.00	0.12
222	002916	深南电路	12,440	1,315,778.80	0.12
223	600026	中远海能	84,200	1,314,362.00	0.12
224	601699	潞安环能	72,400	1,312,612.00	0.12
225	600515	海南机场	415,000	1,303,100.00	0.11

226	601607	上海医药	67,400	1,288,014.00	0.11
227	300832	新产业	19,000	1,281,360.00	0.11
228	000301	东方盛虹	160,100	1,275,997.00	0.11
229	000876	新希望	137,533	1,257,051.62	0.11
230	600039	四川路桥	158,260	1,248,671.40	0.11
231	600332	白云山	42,569	1,248,548.77	0.11
232	601998	中信银行	185,984	1,246,092.80	0.11
233	600875	东方电气	67,300	1,241,685.00	0.11
234	600588	用友网络	124,111	1,241,110.00	0.11
235	601877	正泰电器	65,079	1,240,405.74	0.11
236	002074	国轩高科	64,600	1,237,090.00	0.11
237	600415	小商品城	166,000	1,231,720.00	0.11
238	002555	三七互娱	93,929	1,225,773.45	0.11
239	002709	天赐材料	69,700	1,223,932.00	0.11
240	688396	华润微	31,924	1,195,234.56	0.10
241	600025	华能水电	108,942	1,174,394.76	0.10
242	600803	新奥股份	56,300	1,171,040.00	0.10
243	000408	藏格矿业	47,900	1,152,953.00	0.10
244	300316	晶盛机电	39,700	1,140,581.00	0.10
245	300223	北京君正	20,400	1,130,976.00	0.10
246	300628	亿联网络	30,680	1,128,103.60	0.10
247	002812	恩捷股份	35,498	1,123,511.70	0.10
248	688599	天合光能	65,846	1,114,114.32	0.10
249	300142	沃森生物	97,100	1,104,998.00	0.10
250	300450	先导智能	66,340	1,103,234.20	0.10
251	605117	德业股份	14,572	1,083,282.48	0.09
252	600460	士兰微	60,500	1,059,355.00	0.09
253	002007	华兰生物	66,395	1,048,377.05	0.09
254	600918	中泰证券	184,400	1,045,548.00	0.09
255	601238	广汽集团	134,100	1,037,934.00	0.09
256	301269	华大九天	13,200	1,017,060.00	0.09
257	300496	中科创达	22,300	1,016,657.00	0.09
258	300751	迈为股份	8,460	1,010,800.80	0.09
259	603260	合盛硅业	21,500	1,004,265.00	0.09
260	300759	康龙化成	53,975	1,002,855.50	0.09
261	601319	中国人保	193,300	995,495.00	0.09
262	300999	金龙鱼	36,200	990,070.00	0.09
263	600018	上港集团	169,147	977,669.66	0.09
264	000733	振华科技	23,500	975,955.00	0.09
265	601799	星宇股份	8,700	974,748.00	0.09
266	600061	国投资本	171,265	967,647.25	0.08
267	002821	凯莱英	14,460	951,468.00	0.08
268	300413	芒果超媒	45,300	946,770.00	0.08



269	688009	中国通号	156,603	939,618.00	0.08
270	603806	福斯特	63,178	928,716.60	0.08
271	601865	福莱特	46,100	926,610.00	0.08
272	601059	信达证券	65,100	925,071.00	0.08
273	603659	璞泰来	64,755	914,988.15	0.08
274	603195	公牛集团	11,732	904,771.84	0.08
275	600132	重庆啤酒	14,700	892,290.00	0.08
276	300919	中伟股份	28,420	880,735.80	0.08
277	000617	中油资本	153,000	844,560.00	0.07
278	000708	中信特钢	61,100	829,127.00	0.07
279	688303	大全能源	38,887	792,905.93	0.07
280	688187	时代电气	15,737	777,093.06	0.07
281	002603	以岭药业	50,600	775,698.00	0.07
282	300454	深信服	15,300	773,109.00	0.07
283	002410	广联达	80,640	772,531.20	0.07
284	002841	视源股份	25,453	751,627.09	0.07
285	300442	润泽科技	31,300	749,635.00	0.07
286	603899	晨光股份	22,400	700,672.00	0.06
287	688363	华熙生物	11,736	663,905.52	0.06
288	601236	红塔证券	99,600	639,432.00	0.06
289	601808	中海油服	35,900	617,480.00	0.05
290	600732	爱旭股份	66,480	601,644.00	0.05
291	603833	欧派家居	11,085	593,712.60	0.05
292	300979	华利集团	9,200	559,820.00	0.05
293	601698	中国卫通	38,400	541,056.00	0.05
294	300957	贝泰妮	10,300	497,696.00	0.04
295	688082	盛美上海	5,300	447,903.00	0.04
296	000800	一汽解放	56,200	440,046.00	0.04
297	603296	华勤技术	5,600	309,288.00	0.03
298	001289	龙源电力	9,200	158,700.00	0.01

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量 (股)	公允价值 (元)	占基金资产净值比例 (%)
1	688717	艾罗能源	11,303	531,467.06	0.05
2	301589	诺瓦星云	1,244	233,884.44	0.02
3	688692	达梦数据	175	30,612.75	0.00
4	603285	键邦股份	1,287	24,002.55	0.00
5	603350	安乃达	1,051	21,608.56	0.00
6	601033	永兴股份	1,258	20,077.68	0.00
7	688709	成都华微	1,045	19,635.55	0.00
8	301536	星辰科技	481	15,521.87	0.00
9	301538	骏鼎达	150	13,686.00	0.00

10	301565	中仑新材	711	13,494.78	0.00
11	603341	龙旗科技	298	11,172.02	0.00
12	301566	达利凯普	576	9,774.72	0.00
13	301392	汇成真空	219	9,123.54	0.00
14	301591	肯特股份	219	8,098.62	0.00
15	301587	中瑞股份	306	7,729.56	0.00
16	301539	宏鑫科技	361	7,155.02	0.00
17	301578	辰奕智能	154	6,093.78	0.00
18	688695	中创股份	186	5,868.30	0.00
19	688530	欧莱新材	344	5,538.40	0.00
20	301588	美新科技	257	5,461.25	0.00
21	301502	华阳智能	138	5,220.54	0.00
22	603325	博隆技术	66	4,491.96	0.00
23	603381	永臻股份	178	4,473.14	0.00
24	603344	星德胜	182	4,124.12	0.00
25	001359	平安电工	184	3,790.40	0.00
26	603312	西典新能	130	3,296.80	0.00
27	603082	北自科技	107	3,155.43	0.00
28	001379	腾达科技	213	2,871.24	0.00

#### 7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	600900	长江电力	4,292,026.00	0.37
2	601998	中信银行	2,006,736.00	0.17
3	600161	天坛生物	1,911,849.00	0.16
4	000807	云铝股份	1,853,476.00	0.16
5	300418	昆仑万维	1,806,618.00	0.15
6	600027	华电国际	1,492,822.00	0.13
7	001965	招商公路	1,458,301.00	0.12
8	600026	中远海能	1,423,242.00	0.12
9	300832	新产业	1,421,085.00	0.12
10	600415	小商品城	1,395,171.00	0.12
11	603259	药明康德	1,324,868.00	0.11
12	601006	大秦铁路	1,128,045.00	0.10
13	688223	晶科能源	1,065,725.03	0.09
14	002371	北方华创	1,048,484.00	0.09
15	688009	中国通号	927,684.75	0.08
16	300442	润泽科技	908,699.00	0.08
17	600519	贵州茅台	793,581.00	0.07
18	603501	韦尔股份	782,363.00	0.07
19	603019	中科曙光	739,199.00	0.06

20	601059	信达证券	626,255.00	0.05
----	--------	------	------------	------

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	3,512,249.00	0.30
2	600919	江苏银行	2,128,719.00	0.18
3	600028	中国石化	2,044,305.00	0.17
4	601998	中信银行	1,836,179.00	0.16
5	300750	宁德时代	1,686,762.00	0.14
6	601318	中国平安	1,548,684.00	0.13
7	600036	招商银行	1,371,979.00	0.12
8	002202	金风科技	1,310,644.66	0.11
9	300124	汇川技术	1,279,442.00	0.11
10	601615	明阳智能	1,208,721.00	0.10
11	000333	美的集团	1,207,965.00	0.10
12	002142	宁波银行	1,185,064.00	0.10
13	600016	民生银行	1,148,378.00	0.10
14	000858	五粮液	975,295.00	0.08
15	601899	紫金矿业	924,165.00	0.08
16	601166	兴业银行	824,550.00	0.07
17	601328	交通银行	794,027.00	0.07
18	300763	锦浪科技	793,761.00	0.07
19	600754	锦江酒店	763,604.00	0.07
20	600900	长江电力	741,337.00	0.06

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	45,900,251.05
卖出股票收入（成交）总额	81,748,199.71

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

1、本基金投资的前十名证券之一交通银行的发行主体交通银行股份有限公司于 2024 年 6 月 3 日因安全测试存在薄弱环节、运行管理存在漏洞、数据安全管理制度不足、灾备管理不足等受到国家金融监督管理总局处罚（金罚决字（2024）29 号）。交通银行为本基金跟踪标的指数的成分券。

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 2023 年 12 月 13 日因未按规定承担小微企业押品评估费、未按规定承担房屋抵押登记费、未落实价格目录，向小微企业收取委托贷款手续费、小微企业规模划型依据不足等受到国家金融监督管理总局深圳监管局处罚（深金罚决字（2023）81 号）；于 2023 年 6 月 24 日因招商银行理财业务存在未能有效穿透识别底层资产、信息披露不规范等受到国家金融监督管理总局处罚（金罚决字（2024）30 号）。招商银行为本基金跟踪标的指数的成分券。

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	18,931.93
2	应收清算款	-

3	应收股利	119,655.90
4	应收利息	-
5	应收申购款	346,869.38
6	其他应收款	45,622.33
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	531,079.54

#### 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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值	占基金资产净值比例 (%)	流通受限情况说明
1	600900	长江电力	289,200.00	0.03	转融通流通受限

##### 7.12.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值	占基金资产净值比例 (%)	流通受限情况说明
1	688717	艾罗能源	531,467.06	0.05	新股锁定
2	301589	诺瓦星云	233,884.44	0.02	新股锁定
3	688692	达梦数据	30,612.75	0.00	新股锁定
4	603285	键邦股份	24,002.55	0.00	新股未上市
5	603350	安乃达	21,608.56	0.00	新股未上市

#### 7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入原因，分项之和与合计可能有尾差。

## § 8 基金份额持有人信息

### 8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额级别	持有人户数	户均持有的基金份额	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 (%)
大成沪深 300 指数 A	77,982	15,324.73	5,782,952.85	0.48	1,189,270,431.44	99.52
大成沪深 300 指数 C	2,558	34,795.70	71,704,195.64	80.56	17,303,198.85	19.44
合计	80,540	15,943.14	77,487,148.49	6.03	1,206,573,630.29	93.97

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

2、持有人户数为有效户数，即存量份额大于零的账户。

## 8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数（份）	占基金总份额比例 (%)
基金管 理人 所 有 从 业 人 员 持 有 本 基 金	大成沪深 300 指数 A	62,898.28	0.0053
	大成沪深 300 指数 C	420.64	0.0005
	合计	63,318.92	0.0049

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

## 8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

项目	份额级别	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人 员、基金投资和研 究 部 门 负 责 人 持 有 本 开 放 式 基 金	大成沪深 300 指数 A	0~10
	大成沪深 300 指数 C	0
	合计	0~10
本基金基金经理持有 本开放式基金	大成沪深 300 指数 A	0
	大成沪深 300 指数 C	0
	合计	0

## § 9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	大成沪深 300 指数 A	大成沪深 300 指数 C
基金合同生效日 (2006 年 4 月 6 日) 基金份额总额	1,813,356,066.47	-
本报告期初基金 份额总额	1,197,094,801.21	139,411,116.66
本报告期基金总申 购份额	51,695,866.72	13,213,760.08
减: 本报告期基金 总赎回份额	53,737,283.64	63,617,482.25
本报告期基金拆分 变动份额	-	-
本报告期期末基金 份额总额	1,195,053,384.29	89,007,394.49

## § 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

无。

二、基金托管人的基金托管部门的重大人事变动

无。

### 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内无涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

### 10.4 基金投资策略的改变

本基金投资策略在本报告期内没有重大改变。

### 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

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

## 10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

## 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	95,387,496.15	75.68	70,195.05	71.00	-
国投证券	1	17,310,430.65	13.73	16,199.04	16.38	-
天风证券	2	9,831,845.26	7.80	9,199.93	9.30	-
国泰君安	3	3,253,397.93	2.58	3,044.94	3.08	-
华泰证券	1	249,180.27	0.20	233.22	0.24	-
爱建证券	1	-	-	-	-	-
财通证券	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	-	-	-	-	-
东吴证券	1	-	-	-	-	-
东兴证券	1	-	-	-	-	-
东亚前海	1	-	-	-	-	-
方正证券	1	-	-	-	-	-
高盛中国 证券	1	-	-	-	-	-
广发证券	2	-	-	-	-	本期 报告 新增 1个
国金证券	2	-	-	-	-	-
国盛证券	1	-	-	-	-	-
国信证券	1	-	-	-	-	-



海通证券	1	-	-	-	-	-
红塔证券	1	-	-	-	-	-
华创证券	1	-	-	-	-	-
华西证券	1	-	-	-	-	-
民生证券	1	-	-	-	-	-
南京证券	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	0	-	-	-	-	本期 报告 退租 1 个
万和证券	1	-	-	-	-	-
西部证券	1	-	-	-	-	-
湘财证券	0	-	-	-	-	本期 报告 退租 1 个
信达证券	2	-	-	-	-	-
兴业证券	2	-	-	-	-	-
粤开证券	1	-	-	-	-	-
招商证券	2	-	-	-	-	-
浙商证券	1	-	-	-	-	-
中国银河 证券	4	-	-	-	-	-
中金公司	2	-	-	-	-	-
中泰证券	2	-	-	-	-	-
中信建投 证券	2	-	-	-	-	-
中信证券	4	-	-	-	-	-
中银国际 证券	1	-	-	-	-	-
中原证券	1	-	-	-	-	-

注：本基金采用托管人结算模式，本基金管理人负责选择证券经纪商，租用其交易单元作为本基金的交易单元。证券经纪商的选择标准如下：

- （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）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。

租用交易单元的使用流程为：首先根据证券经纪商选择标准形成《券商服务评价表》，然后根据评分高低进行本基金交易单元选择。

### 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	大成沪深 300 指数证券投资基金(C 类份额)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	2024 年 6 月 28 日
2	大成沪深 300 指数证券投资基金(A 类份额)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	2024 年 6 月 28 日
3	大成基金管理有限公司关于提请投资者及时更新已过期身份证件及其他身份基本信息的公告	中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站	2024 年 6 月 28 日
4	大成沪深 300 指数证券投资基金 C 类份额增加国联证券股份有限公司为代销机构的公告	中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站	2024 年 6 月 20 日
5	大成基金管理有限公司关于暂停海银基金销售有限公司办理相关销售业务的公告	中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站	2024 年 6 月 12 日
6	大成沪深 300 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	2024 年 5 月 6 日
7	大成沪深 300 指数证券投资基金 2024 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	2024 年 4 月 19 日
8	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	2024 年 4 月 2 日
9	大成沪深 300 指数证券投资基金 2023 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	2024 年 3 月 29 日
10	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	2024 年 1 月 23 日

11	大成沪深 300 指数证券投资基金 2023 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	2024 年 1 月 19 日
----	-------------------------------------	--------------------------	-----------------

## § 11 影响投资者决策的其他重要信息

### 11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

无。

### 11.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

## § 12 备查文件目录

### 12.1 备查文件目录

- 1、中国证监会批准设立大成沪深 300 指数证券投资基金的文件；
- 2、《大成沪深 300 指数证券投资基金基金合同》；
- 3、《大成沪深 300 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

2024 年 8 月 30 日