

# 大成沪深 300 指数证券投资基金 2025 年中期报告

2025 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：2025 年 8 月 29 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 2025 年 08 月 28 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 2025 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>10</b> |
| 4.1 基金管理人及基金经理情况                        | 10        |
| 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明              | 14        |
| 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明                 | 14        |
| 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             | 15        |
| 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望             | 16        |
| 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明                | 17        |
| 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明                 | 17        |
| 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       | 18        |
| <b>§ 5 托管人报告</b>                        | <b>18</b> |
| 5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明                  | 18        |
| 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 | 18        |
| 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       | 18        |
| <b>§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）</b>              | <b>18</b> |
| 6.1 资产负债表                               | 18        |
| 6.2 利润表                                 | 20        |
| 6.3 净资产变动表                              | 21        |
| 6.4 报表附注                                | 23        |
| <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                    | 48        |
| 7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细       | 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 ..... | 59        |
| 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 ..... | 59        |
| 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 .....    | 59        |
| 7.10 本基金投资股指期货的投资政策 .....                   | 59        |
| 7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 .....             | 59        |
| 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 .....              | 61        |
| 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 .....      | 61        |
| <b>§ 9 开放式基金份额变动 .....</b>                  | <b>62</b> |
| <b>§ 10 重大事件揭示 .....</b>                    | <b>62</b> |
| 10.1 基金份额持有人大会决议 .....                      | 62        |
| 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 .....      | 62        |
| 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 .....         | 63        |
| 10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....                | 63        |
| 10.8 其他重大事件 .....                           | 65        |
| <b>§ 11 影响投资者决策的其他重要信息 .....</b>            | <b>66</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 .....    | 66        |
| 11.2 影响投资者决策的其他重要信息 .....                   | 66        |
| <b>§ 12 备查文件目录 .....</b>                    | <b>66</b> |
| 12.1 备查文件目录 .....                           | 66        |
| 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      | 1,138,126,211.04 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   | 大成沪深 300 指数 Y |
| 下属分级基金的交易代码     | 519300             | 007096          | 022973        |
| 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 | 1,119,486,327.73 份 | 17,938,356.54 份 | 701,526.77 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、 | 北京市东城区建国门内大街 69 号  |

|       |                                          |                              |
|-------|------------------------------------------|------------------------------|
|       | 27-33 层                                  |                              |
| 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                         |
| 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 |

注：本基金 A 类基金份额和 C 类基金份额的注册登记机构为中国证券登记结算有限责任公司，Y 类基金份额的注册登记机构为大成基金管理有限公司。

### § 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(2025 年 1 月 1 日 - 2025 年 6 月 30 日) |               |               |
|---------------|---------------------------------------|---------------|---------------|
|               | 大成沪深 300 指数 A                         | 大成沪深 300 指数 C | 大成沪深 300 指数 Y |
| 本期已实现收益       | 970,894.67                            | 79,044.65     | 1,120.31      |
| 本期利润          | 13,202,466.13                         | -149,521.53   | 24,921.13     |
| 加权平均基金份额本期利润  | 0.0116                                | -0.0035       | 0.0490        |
| 本期加权平均净值利润    | 1.17%                                 | -0.36%        | 4.93%         |

|               |                       |               |            |
|---------------|-----------------------|---------------|------------|
| 率             |                       |               |            |
| 本期基金份额净值增长率   | 1.18%                 | 1.11%         | 1.40%      |
| 3.1.2 期末数据和指标 | 报告期末(2025 年 6 月 30 日) |               |            |
| 期末可供分配利润      | 16,855,351.87         | 206,942.34    | 14,821.03  |
| 期末可供分配基金份额利润  | 0.0151                | 0.0115        | 0.0211     |
| 期末基金资产净值      | 1,136,341,679.60      | 18,145,298.88 | 716,347.80 |
| 期末基金份额净值      | 1.0151                | 1.0115        | 1.0211     |
| 3.1.3 累计期末指标  | 报告期末(2025 年 6 月 30 日) |               |            |
| 基金份额累计净值增长率   | 255.75%               | 21.22%        | 2.09%      |

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 | 3.11%    | 0.55%       | 2.50%      | 0.58%         | 0.61% | -0.03% |

|                |         |       |         |       |        |        |
|----------------|---------|-------|---------|-------|--------|--------|
| 过去三个月          | 2.13%   | 1.04% | 1.25%   | 1.10% | 0.88%  | -0.06% |
| 过去六个月          | 1.18%   | 0.96% | 0.03%   | 1.02% | 1.15%  | -0.06% |
| 过去一年           | 14.58%  | 1.27% | 13.71%  | 1.38% | 0.87%  | -0.11% |
| 过去三年           | -6.17%  | 1.02% | -12.24% | 1.10% | 6.07%  | -0.08% |
| 自基金合同生效起<br>至今 | 255.75% | 1.52% | 256.78% | 1.62% | -1.03% | -0.10% |

大成沪深 300 指数 C

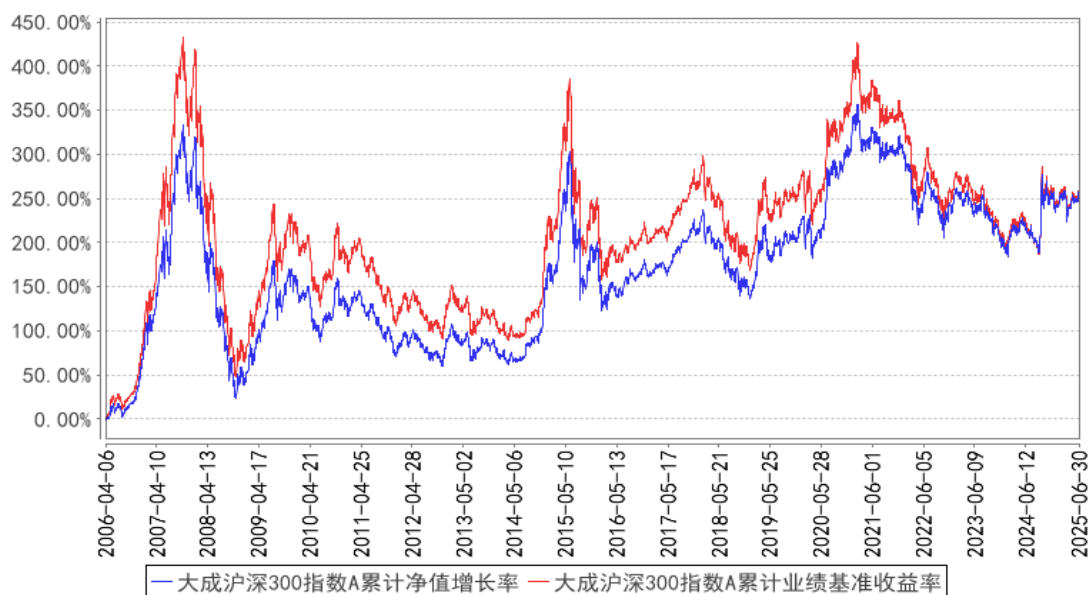
| 阶段             | 份额净值增长率① | 份额净值增长率标准差② | 业绩比较基准收益率③ | 业绩比较基准收益率标准差④ | ①－③    | ②－④    |
|----------------|----------|-------------|------------|---------------|--------|--------|
| 过去一个月          | 3.08%    | 0.56%       | 2.50%      | 0.58%         | 0.58%  | -0.02% |
| 过去三个月          | 2.09%    | 1.04%       | 1.25%      | 1.10%         | 0.84%  | -0.06% |
| 过去六个月          | 1.11%    | 0.96%       | 0.03%      | 1.02%         | 1.08%  | -0.06% |
| 过去一年           | 14.45%   | 1.27%       | 13.71%     | 1.38%         | 0.74%  | -0.11% |
| 过去三年           | -6.44%   | 1.02%       | -12.24%    | 1.10%         | 5.80%  | -0.08% |
| 自基金合同生效起<br>至今 | 21.22%   | 1.11%       | 6.42%      | 1.21%         | 14.80% | -0.10% |

大成沪深 300 指数 Y

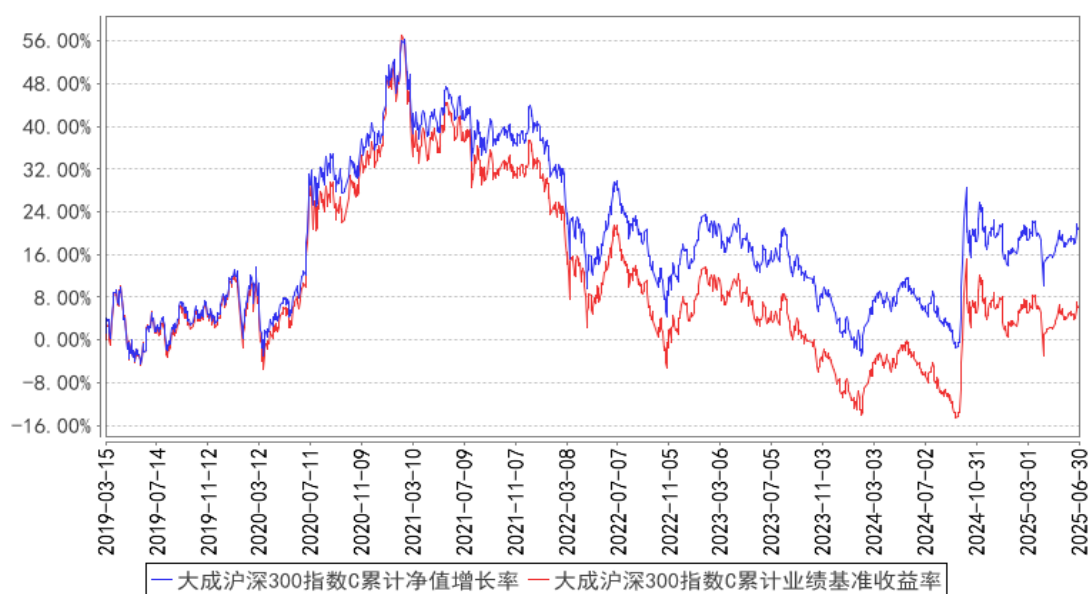
| 阶段             | 份额净值增长率① | 份额净值增长率标准差② | 业绩比较基准收益率③ | 业绩比较基准收益率标准差④ | ①－③   | ②－④    |
|----------------|----------|-------------|------------|---------------|-------|--------|
| 过去一个月          | 3.13%    | 0.55%       | 2.50%      | 0.58%         | 0.63% | -0.03% |
| 过去三个月          | 2.23%    | 1.04%       | 1.25%      | 1.10%         | 0.98% | -0.06% |
| 过去六个月          | 1.40%    | 0.96%       | 0.03%      | 1.02%         | 1.37% | -0.06% |
| 自基金合同生效起<br>至今 | 2.09%    | 0.94%       | 0.62%      | 0.99%         | 1.47% | -0.05% |

### 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

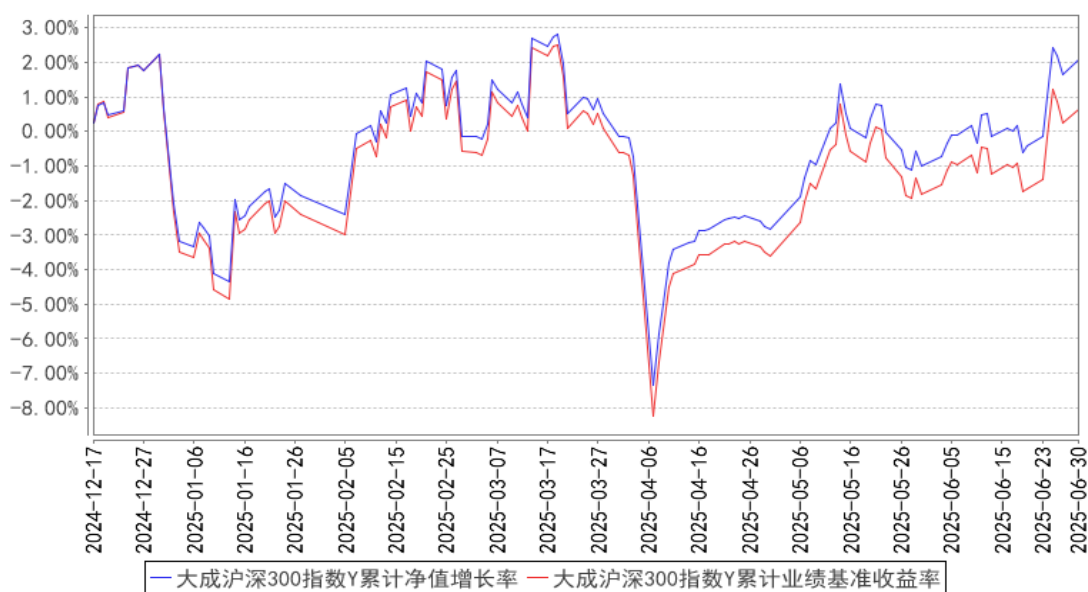
大成沪深300指数A累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



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



大成沪深300指数Y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。

3、本基金自 2024 年 12 月 13 日起增设 Y 类基金份额类别，Y 类的净值增长率和业绩比较基准收益率自 2024 年 12 月 17 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；2013 年，设立大成创新资本管理有限公司。

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 | —    | 17 年   | 北京大学工商管理硕士。2008 年 4 月至 2011 年 5 月就职于招商基金管理有限公司，任基金核算部基金会计。2011 年 5 月加入大成基金管理有限公司，先后担任基金运营部基金会计、股票投资部投委会秘书兼风控员、数量与指数投资部数量分析师、指数与期货投资部基金经理、指数与期货投资部总监助理。2020 年 6 月 29 日至 2023 年 5 月 30 日任大成 MSCI 中国 A 股质优价值 100 交易型开放式指数证券投资基金基金经理。2020 年 6 月 29 日至 2023 年 6 月 14 日任大成 MSCI 中国 A 股质优价值 100 交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理。2020 年 6 月 29 日起任深证成长 40 交易型开放式指数证券投资基金、大成深证成长 40 交易型开放式指数联接基金基金经理。2020 年 6 月 29 日至 2022 年 11 月 30 日任大成中证 500 深市交易型开放式指数证券投资基金基金经理。2021 年 4 月 30 日至 2025 年 7 月 29 日任大成中证全指医疗保健设备与服务交易型开放式指数证券投资基金基金经理。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 日至 2025 年 3 月 17 日任大成中证 A100 交易型开放式指数证券投资基金（更名前为大成中证 100 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 日至 2025 年 2 月 18 日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 日至 2025 年 3 月 17 日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 |

|             |               |                    |   |     |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                              |
|-------------|---------------|--------------------|---|-----|----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
|             |               |                    |   |     | <p>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 日至 2025 年 7 月 29 日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 日至 2025 年 2 月 18 日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 日至 2025 年 7 月 29 日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。2024 年 11 月 12 日起任大成中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金（更名前为大成中证 A500 指数型发起式证券投资基金）基金经理。2024 年 11 月 22 日起任大成中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金基金经理。2025 年 4 月 2 日起任大成深证 100 交易型开放式指数证券投资基金基金经理。2025 年 4 月 23 日起任大成中证全指自由现金流交易型开放式指数证券投资基金基金经理。2025 年 7 月 2 日起任大成中证全指自由现金流交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金基金经理。2025 年 7 月 16 日起担任大成创业板人工智能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<br>误<br>玮 | 本基金基金<br>经理助理 | 2024 年 4<br>月 15 日 | - | 9 年 | <p>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</p>                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                               |

|     |         |                 |   |      |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                   |
|-----|---------|-----------------|---|------|-----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
|     |         |                 |   |      | <p>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 A100 交易型开放式指数证券投资基金（更名前为更名前为大成中证 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。2024 年 8 月 8 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、大成中证芯片产业指数型发起式证券投资基金、大成中证红利指数证券投资基金基金经理助理。2024 年 11 月 12 日起担任大成中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金（更名前为大成中证 A500 指数型发起式证券投资基金）基金经理助理。2024 年 11 月 22 日起担任大成中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金基金经理助理。2025 年 4 月 2 日起任大成深证 100 交易型开放式指数证券投资基金基金经理助理。2025 年 4 月 23 日起任大成中证全指自由现金流交易型开放式指数证券投资基金基金经理助理。2025 年 7 月 2 日起任大成中证全指自由现金流交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金基金经理助理。2025 年 7 月 16 日起担任大成创业板人工智能交易型开放式指数证券投资基金基金经理助理。具有基金从业资格。国籍：中国</p> |
| 郑少芳 | 本基金基金经理 | 2024 年 12 月 9 日 | — | 15 年 | <p>北京大学医学部理学硕士。2010 年 7 月加入大成基金管理有限公司，曾任研究部研究员、社保及养老投资管理部投资经理、权益专户投资部投资经理、总监助理，现任指数与期货投资部总监助理。2023 年 7 月 5 日起兼任大成智惠量化多策略灵活配置混合型证券投资基金基金经理。2024 年 12 月 9 日起兼任大成沪深 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、大成中证芯片产业指数型发起式证券投资基金基金经理。2025 年 3</p>                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                          |

|  |  |  |  |  |                                                                                                                                                                                                                                        |
|--|--|--|--|--|----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
|  |  |  |  |  | 月 10 日起兼任大成中证 A100 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。2025 年 5 月 27 日起兼任大成北证 50 成份指数型发起式证券投资基金基金经理。2025 年 7 月 25 日起兼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、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

| 姓名  | 产品类型     | 产品数量（只） | 资产净值（元）          | 任职时间            |
|-----|----------|---------|------------------|-----------------|
| 郑少芳 | 公募基金     | 7       | 1,739,590,441.92 | 2023 年 7 月 5 日  |
|     | 私募资产管理计划 | 3       | 2,946,428,451.52 | 2017 年 6 月 14 日 |
|     | 其他组合     | -       | -                | -               |
|     | 合计       | 10      | 4,686,018,893.44 | -               |

注：本报告期内，郑少芳已于 2025 年 3 月 4 日离任其管理的 2 个私募资产管理计划，于 2025 年 4 月 26 日离任其管理的 1 个私募资产管理计划。

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，面对外部诸多不确定性因素，国内经济实现稳中有进。GDP 同比增长 5.3%，较去年同期提高 0.3%，并为下半年打下良好基础。同时，随着经济转型的不断推进，新动能占比在提高，主要发展引擎逐渐向制造业和出口切换。运行节奏上，一季度形成良好开局，二季度继续保持韧性，出口高于市场预期。截至 6 月 30 日，A 股整体呈 N 型走势，主要指数收益震荡向上。其中，沪深 300 涨 0.03%；中证 500 涨 3.31%；创业板指涨 0.53%，中证 1000 涨 6.69%。行业上（中信一级），综合金融、有色金属、银行涨幅领先；煤炭、房地产、食品饮料表现萎靡。风格上，小盘、成长明显占优。

报告期内，对股票市场影响较大的三个因素是国内 AI 技术的突破、中美对等关税问题和股市微观流动性变化。阶段表现上，A 股自开年后至 3 月中旬整体上行，科技板块表现更佳。当时，市场总体宏观环境相对比较稳定。数据显示出经济有边际改善的部分，也有尚待面对的问题；中美关系处于相较于去年相对缓和的状态。此时，DeepSeek 大模型横空出世，以高性能、低成本的特性获得国内及海外资金的高度关注，并带动科技板块的价值重估。三月下旬后，在主题交易集中度较高、海外相关板块调整以及情绪回落的影响下，市场整体走弱。随后，美国对等关税问题在四月初对市场形成更大的冲击。成长和小盘风格由于前期上涨较为充分且对股市微观流动性变化更为敏感，相对跌幅更大。面对这种情况，政策端迅速打出“组合拳”。既有以汇金为代表的国家队增持 ETF 发挥类“平准基金”作用，又有一些上市公司宣布增持和回购；长线机制下，金融监管总局也发布了上调保险资金权益类资产比例相关通知，真金白银的支持稳定资本市场。五一后，中美双方高层对关税问题进行持续谈判，国新办在政策上的也提前应对，均释放出稳经济和稳市场的积极信号。多重提振下，A 股走出 V 型反转，很快修复关税冲击所造成的缺口。此后，市场进入震荡格局，但收益中枢有所上移。六月下旬，中东地缘事件缓和，美国通胀预期较此前

有所下降，全球流动性改善，权益资产价格普遍上涨。在资金面驱动下，小盘和主题投资再度表现活跃，走强幅度略超预期。

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，各项操作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 1.0151 元，本报告期基金份额净值增长率为 1.18%，同期业绩比较基准收益率为 0.03%；截至本报告期末大成沪深 300 指数 C 的基金份额净值为 1.0115 元，本报告期基金份额净值增长率为 1.11%，同期业绩比较基准收益率为 0.03%；截至本报告期末大成沪深 300 指数 Y 的基金份额净值为 1.0211 元，本报告期基金份额净值增长率为 1.40%，同期业绩比较基准收益率为 0.03%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望下半年，宏观经济继续平稳运行。结构上，由于美国关税政策给外需带来不确定性，因此，内需拉动是稳增长的重要路径。消费作为扩内需的关键，上半年在补贴政策推动下，成为经济增长主要支撑项。下半年，由于基数的升高，社零同比增速或边际放缓，但向下幅度有限。投资方面，制造业延续强势增长态势，保持对固定资产投资的高贡献率；基建可能成为另一个经济增长的关键，在专项债、特别国债带动下具备向上空间，或有所回升；地产止跌回稳的基础尚不牢固，复苏面临挑战，尽管降幅收窄，也仍将会是拖累项。出口方面，贸易主体的多元化将形成支撑，但跟上半年相比，可能面临一定压力。货币政策将继续保持“适度宽松”的原则，呵护流动性的稳定。财政政策支持力度加大，或根据经济运行情况及外部环境变化适时出台增量政策。价格端，CPI 温和回升，PPI 有望在反内卷政策及能源价格企稳的传导下降幅收窄，有助于企业盈利的改善。

对于股票市场而言，下半年外部环境风险仍存，但内部具备确认性。一方面，经济保持韧性，企业盈利触底改善，为股价表现提供基础。另一方面，政策端储备尚留有余地，足以应对潜在的极端事件。整体上，宏观层面“下有支撑”的预期较为充分。此外，微观流动性改善是今年以来更应被关注到的亮点之一。伴随市场上行，全 A 股日均成交金额中枢从年初的万亿左右增加至年中 1.5 万亿，说明资金逐渐形成正反馈。资金来源即包括持续赚钱效应下较去年更为活跃的个人投资者，也包括像险资等中长期资金，结构较为健康。尽管后续我们仍需要面对内生增长压力、

对等关税问题和时有发生的地缘政治事件，但是我们认为下半年总体机会大于风险，市场或将呈现出震荡向上的行情特征，而阶段性的调整蓄势则带来中长期配置机会。

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。估值委员会由公司分管领导、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。

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，并负责与托管人沟通估值调整事项；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，并与托管人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人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，大成沪深 300 指数 A 已分配利润 3,929,576.49 元，每十份基金份额分红 0.0339 元；大成沪深 300 指数 C 已分配利润 25,173.18 元，每十份基金份额分红 0.0042 元；符合基金合同规定的分红比例。

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报告期内基金的投资运作，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：2025 年 6 月 30 日

单位：人民币元

| 资 产     | 附注号     | 本期末<br>2025 年 6 月 30 日 | 上年度末<br>2024 年 12 月 31 日 |
|---------|---------|------------------------|--------------------------|
| 资 产：    |         |                        |                          |
| 货币资金    | 6.4.7.1 | 66,507,988.45          | 59,743,996.66            |
| 结算备付金   |         | 82,731.36              | 27,420.39                |
| 存出保证金   |         | 24,856.49              | 119,468.87               |
| 交易性金融资产 | 6.4.7.2 | 1,089,970,119.68       | 1,165,579,460.95         |
| 其中：股票投资 |         | 1,089,970,119.68       | 1,152,942,481.66         |
| 基金投资    |         | —                      | —                        |

|               |            |                                |                                  |
|---------------|------------|--------------------------------|----------------------------------|
| 债券投资          |            | -                              | 12,636,979.29                    |
| 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         |            | 31,373.51                      | -                                |
| 应收股利          |            | -                              | -                                |
| 应收申购款         |            | 204,568.25                     | 583,067.14                       |
| 递延所得税资产       |            | -                              | -                                |
| 其他资产          | 6.4.7.8    | -                              | -                                |
| 资产总计          |            | 1,156,821,637.74               | 1,226,053,414.01                 |
| <b>负债和净资产</b> | <b>附注号</b> | <b>本期末<br/>2025 年 6 月 30 日</b> | <b>上年度末<br/>2024 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         |            | 20.40                          | 1,065,217.34                     |
| 应付赎回款         |            | 642,697.85                     | 1,105,749.82                     |
| 应付管理人报酬       |            | 705,885.19                     | 781,797.08                       |
| 应付托管费         |            | 141,177.08                     | 156,359.39                       |
| 应付销售服务费       |            | 1,884.27                       | 4,821.37                         |
| 应付投资顾问费       |            | -                              | -                                |
| 应交税费          |            | -                              | -                                |
| 应付利润          |            | -                              | -                                |
| 递延所得税负债       |            | -                              | -                                |
| 其他负债          | 6.4.7.9    | 126,646.67                     | 284,449.19                       |
| 负债合计          |            | 1,618,311.46                   | 3,398,394.19                     |
| <b>净资产：</b>   |            |                                |                                  |
| 实收基金          | 6.4.7.10   | 1,138,126,211.04               | 1,214,768,621.14                 |
| 未分配利润         | 6.4.7.12   | 17,077,115.24                  | 7,886,398.68                     |
| 净资产合计         |            | 1,155,203,326.28               | 1,222,655,019.82                 |
| 负债和净资产总计      |            | 1,156,821,637.74               | 1,226,053,414.01                 |

注： 报告截止日 2025 年 06 月 30 日，基金份额总额 1,138,126,211.04 份。其中大成沪深 300 指数 A 类基金份额总额为 1,119,486,327.73 份，基金份额净值 1.0151 元；大成沪深 300 指数 C 类

基金份额总额为 17,938,356.54 份，基金份额净值 1.0115 元；大成沪深 300 指数 Y 类基金份额总额为 701,526.77 份，基金份额净值 1.0211 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：2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日

单位：人民币元

| 项 目                    | 附注号        | 本期<br>2025 年 1 月 1 日至 2025<br>年 6 月 30 日 | 上年度可比期间<br>2024 年 1 月 1 日至 2024<br>年 6 月 30 日 |
|------------------------|------------|------------------------------------------|-----------------------------------------------|
| 一、营业总收入                |            | 18,437,735.21                            | 25,371,363.33                                 |
| 1. 利息收入                |            | 177,488.16                               | 554,612.43                                    |
| 其中：存款利息收入              | 6.4.7.13   | 177,488.16                               | 185,808.62                                    |
| 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）      |            | 6,197,165.89                             | -2,452,111.95                                 |
| 其中：股票投资收益              | 6.4.7.14   | -8,536,353.39                            | -14,731,393.95                                |
| 基金投资收益                 |            | -                                        | -                                             |
| 债券投资收益                 | 6.4.7.15   | -11,671.29                               | 48,201.97                                     |
| 资产支持证券投资               | 6.4.7.16   | -                                        | -                                             |
| 收益                     |            |                                          |                                               |
| 贵金属投资收益                | 6.4.7.17   | -                                        | -                                             |
| 衍生工具收益                 | 6.4.7.18   | -                                        | -                                             |
| 股利收益                   | 6.4.7.19   | 14,745,190.57                            | 12,231,080.03                                 |
| 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   | 12,026,806.10                            | 27,242,611.51                                 |
| 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   | 36,275.06                                | 26,251.34                                     |
| 减：二、营业总支出              |            | 5,359,869.48                             | 5,391,369.93                                  |
| 1. 管理人报酬               | 6.4.10.2.1 | 4,360,769.98                             | 4,354,231.85                                  |
| 其中：暂估管理人报酬             |            | -                                        | -                                             |
| 2. 托管费                 | 6.4.10.2.2 | 872,153.98                               | 870,846.30                                    |
| 3. 销售服务费               | 6.4.10.2.3 | 20,932.98                                | 49,687.94                                     |
| 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 | 106, 012. 54     | 115, 275. 94     |
| 三、利润总额（亏损总额以“-”号填列） |             | 13, 077, 865. 73 | 19, 979, 993. 40 |
| 减：所得税费用             |             | -                | -                |
| 四、净利润（净亏损以“-”号填列）   |             | 13, 077, 865. 73 | 19, 979, 993. 40 |
| 五、其他综合收益的税后净额       |             | -                | -                |
| 六、综合收益总额            |             | 13, 077, 865. 73 | 19, 979, 993. 40 |

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：2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日

单位：人民币元

| 项目                                  | 本期<br>2025 年 1 月 1 日至 2025 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, 214, 768, 621. 14                  | -      | 7, 886, 398. 68  | 1, 222, 655, 019. 82 |
| 二、本期期初净资产                           | 1, 214, 768, 621. 14                  | -      | 7, 886, 398. 68  | 1, 222, 655, 019. 82 |
| 三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）                | -76, 642, 410. 10                     | -      | 9, 190, 716. 56  | -67, 451, 693. 54    |
| （一）、综合收益总额                          | -                                     | -      | 13, 077, 865. 73 | 13, 077, 865. 73     |
| （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） | -76, 642, 410. 10                     | -      | 67, 600. 50      | -76, 574, 809. 60    |
| 其中：1. 基金申购款                         | 52, 702, 361. 34                      | -      | -1, 102, 008. 24 | 51, 600, 353. 10     |
| 2. 基金赎回款                            | -129, 344, 771. 44                    | -      | 1, 169, 608. 74  | -128, 175, 162. 70   |
| （三）、本期向基金份额持有人分                     | -                                     | -      | -3, 954, 749. 67 | -3, 954, 749. 67     |

|                                          |                                            |        |                 |                  |
|------------------------------------------|--------------------------------------------|--------|-----------------|------------------|
| 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                                | 1,138,126,211.04                           | -      | 17,077,115.24   | 1,155,203,326.28 |
| 项目                                       | 上年度可比期间<br>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 | 1,169,291,604.44 |
| 二、本期期初净资产                                | 1,336,505,917.87                           | -      | -167,214,313.43 | 1,169,291,604.44 |
| 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（净资产减少以“-”号填列）      | -52,445,139.09                             | -      | 4,334,635.92    | -48,110,503.17   |
| 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 | 1,141,161,094.67 |

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,基金合同生效日的基金份额总额为 1,813,356,066.47 份基金份额,本基金为契约型开放式,存续期限不定。本基金的基金管理人为大成基金管理有限公司,A 类基金份额和 B 类基金份额的注册登记机构为中国证券登记结算有限责任公司,Y 类基金份额的注册登记机构为大成基金管理有限公司,基金托管人为中国农业银行股份有限公司。

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。

根据《关于大成沪深 300 指数证券投资基金增设 Y 类基金份额并相应修订基金合同和托管协议的公告》自 2024 年 12 月 13 日起,对本基金增设 Y 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、C 类基金份额和 Y 类基金份额将分别计算基金份额净值。A 类基金份额、B 类基金份额和 C 类基金份额的管理费率、托管费率相同,Y 类基金份额管理费率与托管费率按照 A 类基金份额、B 类基金份额、C 类基金份额的五折设置。

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,Y 类基金份额不收取销售服务费,可以豁免申购限制和申购费等销售费用(法定应当收取并计入基金资产的费用除外),可以对管理费和托管费实施一定的费率优惠。

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 指数收益率。

本财务报表由本基金的基金管理人大成基金管理有限公司于 2025 年 8 月 28 日批准报出。

#### 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、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 2025 年 6 月 30 日的财务状况以及自 2025 年 1 月 1 日起至 2025 年 6 月 30 日止期间的经营成果和净资产变动情况等有关信息。

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

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

无。

##### 6.4.5.2 会计估计变更的说明

无。

##### 6.4.5.3 差错更正的说明

无。

#### 6.4.6 税项

##### （1）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征增值税试点的通知》

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附加。

## （2）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[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。

## （3）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，（如有）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，（如有）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。

（4）印花税

经国务院批准，财政部、国家税务总局研究决定，自 2008 年 4 月 24 日起，调整证券（股票）交易印花税税率，由原先的 3‰调整为 1‰，自 2008 年 9 月 19 日起，调整由出让方按证券（股票）交易印花税税率缴纳印花税，受让方不再征收，税率不变； 根据财政部、税务总局公告 2023 年第 39 号《关于减半征收证券交易印花税的公告》的规定，自 2023 年 8 月 28 日起，证券交易印花税实施减半征收。

（5）境外投资

本基金运作过程中如有涉及的境外投资的税项问题，根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2014]81 号文《关于沪港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》、财税[2016]127 号文《关于深港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》及其他境内外相关税务法规的规定和实务操作执行。

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<br>2025 年 6 月 30 日 |
|--------|------------------------|
| 活期存款   | 66,507,988.45          |
| 等于：本金  | 66,501,599.08          |
| 加：应计利息 | 6,389.37               |
| 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             | 66,507,988.45 |

#### 6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

| 项目                | 本期末<br>2025 年 6 月 30 日 |      |                  |              |
|-------------------|------------------------|------|------------------|--------------|
|                   | 成本                     | 应计利息 | 公允价值             | 公允价值变动       |
| 股票                | 1,085,473,759.22       | -    | 1,089,970,119.68 | 4,496,360.46 |
| 贵金属投资-金交所<br>黄金合约 | -                      | -    | -                | -            |
| 债券                | 交易所市场                  | -    | -                | -            |
|                   | 银行间市场                  | -    | -                | -            |
|                   | 合计                     | -    | -                | -            |
| 资产支持证券            | -                      | -    | -                | -            |
| 基金                | -                      | -    | -                | -            |
| 其他                | -                      | -    | -                | -            |
| 合计                | 1,085,473,759.22       | -    | 1,089,970,119.68 | 4,496,360.46 |

#### 6.4.7.3 衍生金融资产/负债

##### 6.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

无。

##### 6.4.7.3.2 期末基金持有的期货合约情况

无。

##### 6.4.7.3.3 期末基金持有的黄金衍生品情况

无。

#### 6.4.7.4 买入返售金融资产

##### 6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

无。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

无。

6.4.7.4.3 按预期信用损失一般模型计提减值准备的说明

无。

6.4.7.5 债权投资

6.4.7.5.1 债权投资情况

无。

6.4.7.5.2 债权投资减值准备计提情况

无。

6.4.7.6 其他债权投资

6.4.7.6.1 其他债权投资情况

无。

6.4.7.6.2 其他债权投资减值准备计提情况

无。

6.4.7.7 其他权益工具投资

6.4.7.7.1 其他权益工具投资情况

无。

6.4.7.7.2 报告期末其他权益工具投资情况

无。

6.4.7.8 其他资产

无。

6.4.7.9 其他负债

单位：人民币元

| 项目          | 本期末<br>2025 年 6 月 30 日 |
|-------------|------------------------|
| 应付券商交易单元保证金 | -                      |
| 应付赎回费       | 274.75                 |
| 应付证券出借违约金   | -                      |
| 应付交易费用      | 27,652.37              |
| 其中：交易所市场    | 27,652.37              |
| 银行间市场       | -                      |
| 应付利息        | -                      |
| 预提费用        | 98,719.55              |
| 合计          | 126,646.67             |

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                              |                  |
|---------------|---------------------------------|------------------|
|               | 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日 |                  |
|               | 基金份额（份）                         | 账面金额             |
| 上年度末          | 1,157,434,712.70                | 1,157,434,712.70 |
| 本期申购          | 42,527,586.00                   | 42,527,586.00    |
| 本期赎回（以“-”号填列） | -80,475,970.97                  | -80,475,970.97   |
| 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           | 1,119,486,327.73                | 1,119,486,327.73 |

大成沪深 300 指数 C

| 项目            | 本期                              |                |
|---------------|---------------------------------|----------------|
|               | 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日 |                |
|               | 基金份额（份）                         | 账面金额           |
| 上年度末          | 57,201,162.56                   | 57,201,162.56  |
| 本期申购          | 9,515,916.03                    | 9,515,916.03   |
| 本期赎回（以“-”号填列） | -48,778,722.05                  | -48,778,722.05 |
| 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           | 17,938,356.54                   | 17,938,356.54  |

大成沪深 300 指数 Y

| 项目            | 本期                              |            |
|---------------|---------------------------------|------------|
|               | 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日 |            |
|               | 基金份额（份）                         | 账面金额       |
| 上年度末          | 132,745.88                      | 132,745.88 |
| 本期申购          | 658,859.31                      | 658,859.31 |
| 本期赎回（以“-”号填列） | -90,078.42                      | -90,078.42 |
| 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           | 701,526.77                      | 701,526.77 |

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           | 722,653,337.39 | -714,815,851.85 | 7,837,485.54  |
| 本期期初           | 722,653,337.39 | -714,815,851.85 | 7,837,485.54  |
| 本期利润           | 970,894.67     | 12,231,571.46   | 13,202,466.13 |
| 本期基金份额交易产生的变动数 | -23,595,826.89 | 23,340,803.58   | -255,023.31   |
| 其中：基金申购款       | 26,479,693.24  | -27,324,332.57  | -844,639.33   |
| 基金赎回款          | -50,075,520.13 | 50,665,136.15   | 589,616.02    |
| 本期已分配利润        | -3,929,576.49  | -               | -3,929,576.49 |
| 本期末            | 696,098,828.68 | -679,243,476.81 | 16,855,351.87 |

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           | 35,318,172.89  | -35,270,191.46 | 47,981.43   |
| 本期期初           | 35,318,172.89  | -35,270,191.46 | 47,981.43   |
| 本期利润           | 79,044.65      | -228,566.18    | -149,521.53 |
| 本期基金份额交易产生的变动数 | -24,299,850.97 | 24,633,506.59  | 333,655.62  |
| 其中：基金申购款       | 5,879,110.93   | -6,124,804.01  | -245,693.08 |
| 基金赎回款          | -30,178,961.90 | 30,758,310.60  | 579,348.70  |
| 本期已分配利润        | -25,173.18     | -              | -25,173.18  |
| 本期末            | 11,072,193.39  | -10,865,251.05 | 206,942.34  |

大成沪深 300 指数 Y

| 项目             | 已实现部分      | 未实现部分       | 未分配利润合计    |
|----------------|------------|-------------|------------|
| 上年度末           | 82,924.90  | -81,993.19  | 931.71     |
| 本期期初           | 82,924.90  | -81,993.19  | 931.71     |
| 本期利润           | 1,120.31   | 23,800.82   | 24,921.13  |
| 本期基金份额交易产生的变动数 | 356,349.99 | -367,381.80 | -11,031.81 |
| 其中：基金申购款       | 412,787.16 | -424,462.99 | -11,675.83 |
| 基金赎回款          | -56,437.17 | 57,081.19   | 644.02     |
| 本期已分配利润        | -          | -           | -          |
| 本期末            | 440,395.20 | -425,574.17 | 14,821.03  |

6.4.7.13 存款利息收入

单位：人民币元

| 项目        | 本期<br>2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日 |
|-----------|---------------------------------------|
| 活期存款利息收入  | 144,513.67                            |
| 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 | 235.54                                |

|    |            |
|----|------------|
| 其他 | 32,738.95  |
| 合计 | 177,488.16 |

6.4.7.14 股票投资收益

6.4.7.14.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

| 项目               | 本期<br>2025年1月1日至2025年6月30日 |
|------------------|----------------------------|
| 股票投资收益——买卖股票差价收入 | -8,536,353.39              |
| 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               | -8,536,353.39              |

6.4.7.14.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

| 项目         | 本期<br>2025年1月1日至2025年6月30日 |
|------------|----------------------------|
| 卖出股票成交总额   | 155,511,709.61             |
| 减：卖出股票成本总额 | 163,913,492.51             |
| 减：交易费用     | 134,570.49                 |
| 买卖股票差价收入   | -8,536,353.39              |

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<br>2025年1月1日至2025年6月30日 |
|------------------------------|----------------------------|
| 债券投资收益——利息收入                 | 15,980.71                  |
| 债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入 | -27,652.00                 |
| 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                           | -11,671.29                 |

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<br>2025年1月1日至2025年6月30日 |
|---------------------|----------------------------|
| 卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总 | 12,643,040.00              |

|                        |               |
|------------------------|---------------|
| 额                      |               |
| 减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额 | 12,427,652.00 |
| 减：应计利息总额               | 243,040.00    |
| 减：交易费用                 | -             |
| 买卖债券差价收入               | -27,652.00    |

#### 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<br>2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日 |
|---------------|---------------------------------------|
| 股票投资产生的股利收益   | 14,745,190.57                         |
| 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            | 14,745,190.57                         |

6.4.7.20 公允价值变动收益

单位：人民币元

| 项目名称                   | 本期<br>2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日 |
|------------------------|---------------------------------------|
| 1. 交易性金融资产             | 12,026,806.10                         |
| 股票投资                   | 12,009,074.10                         |
| 债券投资                   | 17,732.00                             |
| 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                     | 12,026,806.10                         |

6.4.7.21 其他收入

单位：人民币元

| 项目      | 本期<br>2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日 |
|---------|---------------------------------------|
| 基金赎回费收入 | 36,275.06                             |
| 合计      | 36,275.06                             |

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<br>2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日 |
|------|---------------------------------------|
| 审计费用 | 34,712.18                             |

|         |            |
|---------|------------|
| 信息披露费   | 59,507.37  |
| 证券出借违约金 | —          |
| 银行划款手续费 | 2,792.99   |
| 账户维护费   | 9,000.00   |
| 合计      | 106,012.54 |

6.4.7.24 分部报告

无。

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 或有事项

无。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

无。

6.4.9 关联方关系

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

本基金本报告期存在控制关系或者其他重大利害关系的关联方未发生变化。

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

| 关联方名称                  | 与本基金的关系             |
|------------------------|---------------------|
| 大成基金管理有限公司（“大成基金”）     | 基金管理人、注册登记机构、基金销售机构 |
| 中国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<br>2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日 |                         | 上年度可比期间<br>2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日 |                         |
|-------|---------------------------------------|-------------------------|--------------------------------------------|-------------------------|
|       | 成交金额                                  | 占当期股票<br>成交总额的比<br>例（%） | 成交金额                                       | 占当期股票<br>成交总额的比<br>例（%） |
| 光大证券  | —                                     | —                       | 95,387,496.15                              | 75.68                   |

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<br>2025年1月1日至2025年6月30日      |                   |              |                     |
|-------|---------------------------------|-------------------|--------------|---------------------|
|       | 当期<br>佣金                        | 占当期佣金总量<br>的比例（%） | 期末应付佣金余<br>额 | 占期末应付佣金<br>总额的比例（%） |
| -     | -                               | -                 | -            | -                   |
| 关联方名称 | 上年度可比期间<br>2024年1月1日至2024年6月30日 |                   |              |                     |
|       | 当期<br>佣金                        | 占当期佣金总量<br>的比例（%） | 期末应付佣金余<br>额 | 占期末应付佣金<br>总额的比例（%） |
| 光大证券  | 70,195.05                       | 71.00             | 59,643.86    | 95.14               |

注：1、上述佣金按协议约定的佣金率计算，佣金费率参考市场价格经本基金的基金管理人与对方协商确定；

2、根据《公开募集证券投资基金证券交易费用管理规定》，自 2024 年 7 月 1 日起，基金管理人管理的被动股票型基金的股票交易佣金费率原则上不得超过市场平均股票交易佣金费率，且不得通过交易佣金支付研究服务、流动性服务等其他费用；其他类型基金可以通过交易佣金支付研究服务费用，但股票交易佣金费率原则上不得超过市场平均股票交易佣金费率的两倍，且不得通过交易佣金支付研究服务之外的其他费用。

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

| 项目               | 本期<br>2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6<br>月 30 日 | 上年度可比期间<br>2024 年 1 月 1 日至 2024 年<br>6 月 30 日 |
|------------------|------------------------------------------|-----------------------------------------------|
| 当期发生的基金应支付的管理费   | 4,360,769.98                             | 4,354,231.85                                  |
| 其中：应支付销售机构的客户维护费 | 1,258,306.90                             | 1,224,864.82                                  |
| 应支付基金管理人的净管理费    | 3,102,463.08                             | 3,129,367.03                                  |

注：基金管理费每日计提，按月支付。本基金 A 类基金份额和 C 类基金份额的基金管理费按前一日基金资产净值的 0.75% 的年费率计提；Y 类基金份额的基金管理费按前一日基金资产净值的 0.375% 的年费率计提。计算方法如下：

$H=E\times R/\text{当年天数}$

H 为每日应支付的基金管理费

E 为前一日对应类别基金资产净值

R 为该类基金份额的基金管理费率

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

| 项目             | 本期                              | 上年度可比期间                         |
|----------------|---------------------------------|---------------------------------|
|                | 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日 | 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日 |
| 当期发生的基金应支付的托管费 | 872, 153. 98                    | 870, 846. 30                    |

注：基金托管费每日计提，按月支付。本基金 A 类基金份额和 C 类基金份额的基金托管费按前一日基金资产净值的 0. 15% 的年费率计提；Y 类基金份额的基金托管费按前一日基金资产净值的 0. 075% 的年费率计提。计算方法如下：

$H=E\times R/\text{当年天数}$

H 为每日应支付的基金托管费

E 为前一日对应类别基金资产净值

R 为该类基金份额的基金托管费率

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                              |               |               |             |
|----------------|---------------------------------|---------------|---------------|-------------|
|                | 2025 年 1 月 1 日至 2025 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 | 大成沪深 300 指数 Y | 合计          |
| 大成基金           | -                               | 9, 666. 77    | -             | 9, 666. 77  |
| 合计             | -                               | 9, 666. 77    | -             | 9, 666. 77  |
| 获得销售服务费的各关联方名称 | 上年度可比期间                         |               |               |             |
|                | 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 | 大成沪深 300 指数 Y | 合计          |
| 大成基金           | -                               | 13, 880. 96   | -             | 13, 880. 96 |
| 合计             | -                               | 13, 880. 96   | -             | 13, 880. 96 |

注：C 类基金份额的销售服务费年费率为 0. 1%。

销售服务费的计算方法如下：

$$H=E\times \text{该类基金份额销售服务费年费率}\div \text{当年天数}$$

H 为该类基金份额每日应计提的销售服务费

E 为该类基金份额前一日基金资产净值

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<br>2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日 |            | 上年度可比期间<br>2024 年 1 月 1 日至 2024 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 | 66,507,988.45                         | 144,513.67 | 67,641,518.06                              | 184,087.57 |

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

单位：人民币元

|               |
|---------------|
| 大成沪深 300 指数 A |
|---------------|

| 序号            | 权益<br>登记日       | 除息日 |                 | 每 10 份基<br>金份额分<br>红数 | 现金形<br>式<br>发放总<br>额 | 再投资形<br>式<br>发放总额 | 本期利<br>润分配<br>合计 | 备注 |
|---------------|-----------------|-----|-----------------|-----------------------|----------------------|-------------------|------------------|----|
|               |                 | 场内  | 场外              |                       |                      |                   |                  |    |
| 1             | 2025 年 1 月 20 日 | -   | 2025 年 1 月 20 日 | 0.0339                | 1,931,713.46         | 1,997,863.03      | 3,929,576.49     | -  |
| 合计            | -               | -   | -               | 0.0339                | 1,931,713.46         | 1,997,863.03      | 3,929,576.49     | -  |
| 大成沪深 300 指数 C |                 |     |                 |                       |                      |                   |                  |    |
| 序号            | 权益<br>登记日       | 除息日 |                 | 每 10 份基<br>金份额分<br>红数 | 现金形<br>式<br>发放总<br>额 | 再投资形<br>式<br>发放总额 | 本期利<br>润分配<br>合计 | 备注 |
|               |                 | 场内  | 场外              |                       |                      |                   |                  |    |
| 1             | 2025 年 1 月 20 日 | -   | 2025 年 1 月 20 日 | 0.0042                | 20,500.38            | 4,672.80          | 25,173.18        | -  |
| 合计            | -               | -   | -               | 0.0042                | 20,500.38            | 4,672.80          | 25,173.18        | -  |

6.4.12 期末（2025 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<br>代码             | 证<br>券<br>名<br>称 | 成<br>功<br>认<br>购<br>日 | 受<br>限<br>期 | 流<br>通<br>受<br>限<br>类<br>型 | 认<br>购<br>价<br>格 | 期<br>末<br>估<br>值<br>单<br>价 | 数<br>量<br>（<br>单<br>位：<br>股） | 期<br>末<br>成<br>本<br>总<br>额 | 期<br>末<br>估<br>值<br>总<br>额 | 备<br>注 |
| 001335               | 信凯科技             | 2025 年 4 月 2 日        | 6 个月        | 新股锁定                       | 12.80            | 28.05                      | 80                           | 1,024.00                   | 2,244.00                   | -      |
| 001356               | 富岭股份             | 2025 年 1 月 16 日       | 6 个月        | 新股锁定                       | 5.30             | 14.44                      | 709                          | 3,757.70                   | 10,237.96                  | -      |
| 001382               | 新亚电缆             | 2025 年 3 月 13 日       | 6 个月        | 新股锁定                       | 7.40             | 20.21                      | 366                          | 2,708.40                   | 7,396.86                   | -      |
| 001388               | 信通电子             | 2025 年 6 月 24 日       | 6 个月        | 新股未上市                      | 16.42            | 16.42                      | 94                           | 1,543.48                   | 1,543.48                   | -      |
| 001388               | 信通               | 2025 年 6 月            | 1 个月内（含）    | 新股未上                       | 16.42            | 16.42                      | 843                          | 13,842.06                  | 13,842.06                  | -      |

|        |      |                 |      |      |       |        |     |          |           |     |
|--------|------|-----------------|------|------|-------|--------|-----|----------|-----------|-----|
|        | 电子   | 24 日            |      | 市    |       |        |     |          |           |     |
| 001390 | 古麒绒材 | 2025 年 5 月 21 日 | 6 个月 | 新股锁定 | 12.08 | 18.12  | 178 | 2,150.24 | 3,225.36  | -   |
| 001395 | 亚联机械 | 2025 年 1 月 20 日 | 6 个月 | 新股锁定 | 19.08 | 47.25  | 80  | 1,526.40 | 3,780.00  | -   |
| 301173 | 毓恬冠佳 | 2025 年 2 月 24 日 | 6 个月 | 新股锁定 | 28.33 | 44.98  | 173 | 4,901.09 | 7,781.54  | -   |
| 301458 | 钧崴电子 | 2025 年 1 月 2 日  | 6 个月 | 新股锁定 | 10.40 | 34.11  | 701 | 7,290.40 | 23,911.11 | -   |
| 301479 | 弘景光电 | 2025 年 3 月 6 日  | 6 个月 | 新股锁定 | -     | 77.87  | 52  | -        | 4,049.24  | 转增股 |
| 301479 | 弘景光电 | 2025 年 3 月 6 日  | 6 个月 | 新股锁定 | 41.90 | 77.87  | 130 | 5,447.00 | 10,123.10 | -   |
| 301501 | 恒鑫生活 | 2025 年 3 月 11 日 | 6 个月 | 新股锁定 | -     | 45.22  | 109 | -        | 4,928.98  | 转增股 |
| 301501 | 恒鑫生活 | 2025 年 3 月 11 日 | 6 个月 | 新股锁定 | 39.92 | 45.22  | 241 | 9,620.72 | 10,898.02 | -   |
| 301535 | 浙江华远 | 2025 年 3 月 18 日 | 6 个月 | 新股锁定 | 4.92  | 18.99  | 734 | 3,611.28 | 13,938.66 | -   |
| 301560 | 众捷汽车 | 2025 年 4 月 17 日 | 6 个月 | 新股锁定 | 16.50 | 27.45  | 190 | 3,135.00 | 5,215.50  | -   |
| 301590 | 优优   | 2025 年 5 月      | 6 个月 | 新股锁定 | 89.60 | 139.48 | 73  | 6,540.80 | 10,182.04 | -   |

|        |      |                  |      |      |       |       |     |           |           |   |
|--------|------|------------------|------|------|-------|-------|-----|-----------|-----------|---|
|        | 绿能   | 28 日             |      |      |       |       |     |           |           |   |
| 301595 | 太力科技 | 2025 年 5 月 12 日  | 6 个月 | 新股锁定 | 17.05 | 29.10 | 196 | 3,341.80  | 5,703.60  | - |
| 301601 | 惠通科技 | 2025 年 1 月 8 日   | 6 个月 | 新股锁定 | 11.80 | 33.85 | 342 | 4,035.60  | 11,576.70 | - |
| 301602 | 超研股份 | 2025 年 1 月 15 日  | 6 个月 | 新股锁定 | 6.70  | 24.80 | 658 | 4,408.60  | 16,318.40 | - |
| 301636 | 泽润新能 | 2025 年 4 月 30 日  | 6 个月 | 新股锁定 | 33.06 | 47.46 | 128 | 4,231.68  | 6,074.88  | - |
| 301658 | 首航新能 | 2025 年 3 月 26 日  | 6 个月 | 新股锁定 | 11.80 | 22.98 | 437 | 5,156.60  | 10,042.26 | - |
| 301662 | 宏工科技 | 2025 年 4 月 10 日  | 6 个月 | 新股锁定 | 26.60 | 82.50 | 143 | 3,803.80  | 11,797.50 | - |
| 301678 | 新恒汇  | 2025 年 6 月 13 日  | 6 个月 | 新股锁定 | 12.80 | 44.54 | 382 | 4,889.60  | 17,014.28 | - |
| 603014 | 威高血净 | 2025 年 5 月 12 日  | 6 个月 | 新股锁定 | 26.50 | 32.68 | 205 | 5,432.50  | 6,699.40  | - |
| 603049 | 中策橡胶 | 2025 年 5 月 27 日  | 6 个月 | 新股锁定 | 46.50 | 42.85 | 553 | 25,714.50 | 23,696.05 | - |
| 603072 | 天和磁材 | 2024 年 12 月 24 日 | 6 个月 | 新股锁定 | 12.30 | 54.45 | 226 | 2,779.80  | 12,305.70 | - |
| 603120 | 肯特催  | 2025 年 4 月 9 日   | 6 个月 | 新股锁定 | 15.00 | 33.43 | 65  | 975.00    | 2,172.95  | - |

|        |      |                 |      |      |       |       |     |           |           |     |
|--------|------|-----------------|------|------|-------|-------|-----|-----------|-----------|-----|
|        | 化    |                 |      |      |       |       |     |           |           |     |
| 603124 | 江南新材 | 2025 年 3 月 12 日 | 6 个月 | 新股锁定 | 10.54 | 46.31 | 88  | 927.52    | 4,075.28  | -   |
| 603202 | 天有为  | 2025 年 4 月 16 日 | 6 个月 | 新股锁定 | 93.50 | 90.66 | 166 | 15,521.00 | 15,049.56 | -   |
| 603257 | 中国瑞林 | 2025 年 3 月 28 日 | 6 个月 | 新股锁定 | 20.52 | 37.47 | 78  | 1,600.56  | 2,922.66  | -   |
| 603271 | 永杰新材 | 2025 年 3 月 4 日  | 6 个月 | 新股锁定 | 20.60 | 35.08 | 126 | 2,595.60  | 4,420.08  | -   |
| 603382 | 海阳科技 | 2025 年 6 月 5 日  | 6 个月 | 新股锁定 | 11.50 | 22.39 | 105 | 1,207.50  | 2,350.95  | -   |
| 603409 | 汇通控股 | 2025 年 2 月 25 日 | 6 个月 | 新股锁定 | 24.18 | 33.32 | 100 | 2,418.00  | 3,332.00  | -   |
| 688411 | 海博思创 | 2025 年 1 月 20 日 | 6 个月 | 新股锁定 | 19.38 | 83.49 | 560 | 10,852.80 | 46,754.40 | -   |
| 688545 | 兴福电子 | 2025 年 1 月 15 日 | 6 个月 | 新股锁定 | 11.68 | 26.95 | 994 | 11,609.92 | 26,788.30 | -   |
| 688583 | 思看科技 | 2025 年 1 月 8 日  | 6 个月 | 新股锁定 | -     | 79.68 | 52  | -         | 4,143.36  | 转增股 |
| 688583 | 思看科技 | 2025 年 1 月 8 日  | 6 个月 | 新股锁定 | 33.46 | 79.68 | 175 | 5,855.50  | 13,944.00 | -   |
| 688755 | 汉邦科技 | 2025 年 5 月 9 日  | 6 个月 | 新股锁定 | 22.77 | 39.33 | 203 | 4,622.31  | 7,983.99  | -   |

|        |      |                 |      |      |       |        |     |           |           |   |
|--------|------|-----------------|------|------|-------|--------|-----|-----------|-----------|---|
| 688757 | 胜科纳米 | 2025 年 3 月 18 日 | 6 个月 | 新股锁定 | 9.08  | 25.94  | 536 | 4,866.88  | 13,903.84 | - |
| 688758 | 赛分科技 | 2025 年 1 月 2 日  | 6 个月 | 新股锁定 | 4.32  | 16.97  | 777 | 3,356.64  | 13,185.69 | - |
| 688775 | 影石创新 | 2025 年 6 月 4 日  | 6 个月 | 新股锁定 | 47.27 | 124.16 | 573 | 27,085.71 | 71,143.68 | - |

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

无。

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

无。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

无。

6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

无。

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

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

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

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

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

#### 6.4.13.2 信用风险

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

本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的银行存款存放在本基金的托管人中国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），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。

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未来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<br>2025 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                   | 66,507,988.45 | -     | -     | -                | 66,507,988.45    |
| 结算备付金                  | 82,731.36     | -     | -     | -                | 82,731.36        |
| 存出保证金                  | 24,856.49     | -     | -     | -                | 24,856.49        |
| 交易性金融资产                | -             | -     | -     | 1,089,970,119.68 | 1,089,970,119.68 |
| 应收申购款                  | 5,731.00      | -     | -     | 198,837.25       | 204,568.25       |

|                          |               |       |       |                  |                  |
|--------------------------|---------------|-------|-------|------------------|------------------|
| 应收清算款                    | -             | -     | -     | 31,373.51        | 31,373.51        |
| 资产总计                     | 66,621,307.30 | -     | -     | 1,090,200,330.44 | 1,156,821,637.74 |
| 负债                       |               |       |       |                  |                  |
| 应付赎回款                    | -             | -     | -     | 642,697.85       | 642,697.85       |
| 应付管理人报酬                  | -             | -     | -     | 705,885.19       | 705,885.19       |
| 应付托管费                    | -             | -     | -     | 141,177.08       | 141,177.08       |
| 应付清算款                    | -             | -     | -     | 20.40            | 20.40            |
| 应付销售服务费                  | -             | -     | -     | 1,884.27         | 1,884.27         |
| 其他负债                     | -             | -     | -     | 126,646.67       | 126,646.67       |
| 负债总计                     | -             | -     | -     | 1,618,311.46     | 1,618,311.46     |
| 利率敏感度缺口                  | 66,621,307.30 | -     | -     | 1,088,582,018.98 | 1,155,203,326.28 |
| 上年度末<br>2024 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                     | 59,743,996.66 | -     | -     | -                | 59,743,996.66    |
| 结算备付金                    | 27,420.39     | -     | -     | -                | 27,420.39        |
| 存出保证金                    | 119,468.87    | -     | -     | -                | 119,468.87       |
| 交易性金融资产                  | 12,636,979.29 | -     | -     | 1,152,942,481.66 | 1,165,579,460.95 |
| 应收申购款                    | 6,456.89      | -     | -     | 576,610.25       | 583,067.14       |
| 资产总计                     | 72,534,322.10 | -     | -     | 1,153,519,091.91 | 1,226,053,414.01 |
| 负债                       |               |       |       |                  |                  |
| 应付赎回款                    | -             | -     | -     | 1,105,749.82     | 1,105,749.82     |
| 应付管理人报酬                  | -             | -     | -     | 781,797.08       | 781,797.08       |
| 应付托管费                    | -             | -     | -     | 156,359.39       | 156,359.39       |
| 应付清算款                    | -             | -     | -     | 1,065,217.34     | 1,065,217.34     |
| 应付销售服务费                  | -             | -     | -     | 4,821.37         | 4,821.37         |
| 其他负债                     | -             | -     | -     | 284,449.19       | 284,449.19       |
| 负债总计                     | -             | -     | -     | 3,398,394.19     | 3,398,394.19     |
| 利率敏感度缺口                  | 72,534,322.10 | -     | -     | 1,150,120,697.72 | 1,222,655,019.82 |

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和交易性资产支持证券投资（上年度末：1.03%），因此市场利率的变动对于本基金净资产无重大影响（上年度末：同）。

6.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基

金持有的金融工具以人民币计价，因此无重大外汇风险。

6.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市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<br>2025 年 6 月 30 日 |                  | 上年度末<br>2024 年 12 月 31 日 |                  |
|---------------|------------------------|------------------|--------------------------|------------------|
|               | 公允价值                   | 占基金资产净值<br>比例（%） | 公允价值                     | 占基金资产净值<br>比例（%） |
| 交易性金融资产—股票投资  | 1,089,970,119.68       | 94.35            | 1,152,942,481.66         | 94.30            |
| 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            | 1,089,970,119.68       | 94.35            | 1,152,942,481.66         | 94.30            |

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（2025 年 6 月 30 日）        | 上年度末（2024 年 12 月 31 日） |
|    | 业绩比较基准上升 5%          | 54,586,543.71               | 55,955,539.89          |

|  |                |                   |                   |
|--|----------------|-------------------|-------------------|
|  | 业绩比较基准下降<br>5% | -54, 586, 543. 71 | -55, 955, 539. 89 |
|--|----------------|-------------------|-------------------|

6. 4. 14 公允价值

6. 4. 14. 1 金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属的层次，由对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次决定：

- 第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。
- 第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。
- 第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

6. 4. 14. 2 持续的以公允价值计量的金融工具

6. 4. 14. 2. 1 各层次金融工具的公允价值

单位：人民币元

| 公允价值计量结果所属的层次 | 本期末<br>2025 年 6 月 30 日 | 上年度末<br>2024 年 12 月 31 日 |
|---------------|------------------------|--------------------------|
| 第一层次          | 1, 089, 483, 422. 26   | 1, 150, 468, 898. 53     |
| 第二层次          | 15, 385. 54            | 14, 537, 424. 95         |
| 第三层次          | 471, 311. 88           | 573, 137. 47             |
| 合计            | 1, 089, 970, 119. 68   | 1, 165, 579, 460. 95     |

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证券，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证券的公允价值列入第一层次；对于定期开放的基金投资，本基金不会于封闭期将相关基金列入第一层次；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，确定相关投资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工具(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货币资金、应收款项和其他金融负债等，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              | 1,089,970,119.68 | 94.22         |
|    | 其中：股票             | 1,089,970,119.68 | 94.22         |
| 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      | 66,590,719.81    | 5.76          |
| 8  | 其他各项资产            | 260,798.25       | 0.02          |
| 9  | 合计                | 1,156,821,637.74 | 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         | 10,752,004.95  | 0.93          |
| B  | 采矿业              | 54,481,203.43  | 4.72          |
| C  | 制造业              | 546,165,674.24 | 47.28         |
| D  | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | 39,359,641.78  | 3.41          |
| E  | 建筑业              | 20,442,157.94  | 1.77          |
| F  | 批发和零售业           | 2,636,878.80   | 0.23          |
| G  | 交通运输、仓储和邮政业      | 38,379,693.53  | 3.32          |
| H  | 住宿和餐饮业           | —              | —             |
| I  | 信息传输、软件和信息技术服务业  | 51,605,181.73  | 4.47          |
| J  | 金融业              | 292,968,528.96 | 25.36         |
| K  | 房地产业             | 8,037,665.93   | 0.70          |

|   |               |                  |       |
|---|---------------|------------------|-------|
| L | 租赁和商务服务业      | 9,938,893.70     | 0.86  |
| M | 科学研究和技术服务业    | 11,675,220.15    | 1.01  |
| 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       | 3,040,677.12     | 0.26  |
| R | 文化、体育和娱乐业     | —                | —     |
| S | 综合            | —                | —     |
|   | 合计            | 1,089,483,422.26 | 94.31 |

### 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              | 456,050.22 | 0.04         |
| 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           | 2,244.00   | 0.00         |
| G  | 交通运输、仓储和邮政业      | —          | —            |
| H  | 住宿和餐饮业           | —          | —            |
| I  | 信息传输、软件和信息技术服务业  | —          | —            |
| J  | 金融业              | —          | —            |
| K  | 房地产业             | —          | —            |
| L  | 租赁和商务服务业         | —          | —            |
| M  | 科学研究和技术服务业       | 28,403.20  | 0.00         |
| N  | 水利、环境和公共设施管理业    | —          | —            |
| O  | 居民服务、修理和其他服务业    | —          | —            |
| P  | 教育               | —          | —            |
| Q  | 卫生和社会工作          | —          | —            |
| R  | 文化、体育和娱乐业        | —          | —            |
| S  | 综合               | —          | —            |
|    | 合计               | 486,697.42 | 0.04         |

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  | 32,858    | 46,314,008.16 | 4.01         |
| 2  | 300750 | 宁德时代  | 138,240   | 34,866,892.80 | 3.02         |
| 3  | 601318 | 中国平安  | 562,157   | 31,188,470.36 | 2.70         |
| 4  | 600036 | 招商银行  | 646,542   | 29,708,604.90 | 2.57         |
| 5  | 601166 | 兴业银行  | 868,115   | 20,261,804.10 | 1.75         |
| 6  | 600900 | 长江电力  | 639,162   | 19,264,342.68 | 1.67         |
| 7  | 000333 | 美的集团  | 257,008   | 18,555,977.60 | 1.61         |
| 8  | 601899 | 紫金矿业  | 860,149   | 16,772,905.50 | 1.45         |
| 9  | 601398 | 工商银行  | 2,093,418 | 15,889,042.62 | 1.38         |
| 10 | 002594 | 比亚迪   | 47,400    | 15,732,534.00 | 1.36         |
| 11 | 300059 | 东方财富  | 664,445   | 15,368,612.85 | 1.33         |
| 12 | 600030 | 中信证券  | 513,112   | 14,172,153.44 | 1.23         |
| 13 | 601328 | 交通银行  | 1,635,308 | 13,082,464.00 | 1.13         |
| 14 | 600276 | 恒瑞医药  | 233,288   | 12,107,647.20 | 1.05         |
| 15 | 000858 | 五粮液   | 101,589   | 12,078,932.10 | 1.05         |
| 16 | 601211 | 国泰海通  | 595,117   | 11,402,441.72 | 0.99         |
| 17 | 000651 | 格力电器  | 234,189   | 10,519,769.88 | 0.91         |
| 18 | 600887 | 伊利股份  | 330,608   | 9,217,351.04  | 0.80         |
| 19 | 002475 | 立讯精密  | 265,042   | 9,194,306.98  | 0.80         |
| 20 | 688981 | 中芯国际  | 103,940   | 9,164,389.80  | 0.79         |
| 21 | 600919 | 江苏银行  | 766,610   | 9,153,323.40  | 0.79         |
| 22 | 603259 | 药明康德  | 130,887   | 9,103,190.85  | 0.79         |
| 23 | 601816 | 京沪高铁  | 1,533,668 | 8,818,591.00  | 0.76         |
| 24 | 600000 | 浦发银行  | 613,811   | 8,519,696.68  | 0.74         |
| 25 | 000725 | 京东方 A | 1,917,463 | 7,650,677.37  | 0.66         |
| 26 | 002371 | 北方华创  | 16,800    | 7,429,128.00  | 0.64         |
| 27 | 300760 | 迈瑞医疗  | 31,700    | 7,124,575.00  | 0.62         |
| 28 | 601088 | 中国神华  | 172,446   | 6,990,960.84  | 0.61         |
| 29 | 688041 | 海光信息  | 48,629    | 6,870,791.41  | 0.59         |
| 30 | 300308 | 中际旭创  | 46,500    | 6,782,490.00  | 0.59         |
| 31 | 601601 | 中国太保  | 179,093   | 6,717,778.43  | 0.58         |
| 32 | 688256 | 寒武纪   | 10,960    | 6,592,440.00  | 0.57         |
| 33 | 300502 | 新易盛   | 51,860    | 6,587,257.20  | 0.57         |
| 34 | 300124 | 汇川技术  | 98,700    | 6,373,059.00  | 0.55         |
| 35 | 601728 | 中国电信  | 810,911   | 6,284,560.25  | 0.54         |
| 36 | 601668 | 中国建筑  | 1,079,094 | 6,226,372.38  | 0.54         |

|    |        |        |           |              |      |
|----|--------|--------|-----------|--------------|------|
| 37 | 601988 | 中国银行   | 1,095,240 | 6,155,248.80 | 0.53 |
| 38 | 600016 | 民生银行   | 1,295,772 | 6,154,917.00 | 0.53 |
| 39 | 002352 | 顺丰控股   | 125,900   | 6,138,884.00 | 0.53 |
| 40 | 000001 | 平安银行   | 507,218   | 6,122,121.26 | 0.53 |
| 41 | 002714 | 牧原股份   | 142,903   | 6,003,355.03 | 0.52 |
| 42 | 002230 | 科大讯飞   | 120,968   | 5,791,947.84 | 0.50 |
| 43 | 601127 | 赛力斯    | 42,700    | 5,735,464.00 | 0.50 |
| 44 | 603501 | 豪威集团   | 44,545    | 5,686,169.25 | 0.49 |
| 45 | 600031 | 三一重工   | 309,906   | 5,562,812.70 | 0.48 |
| 46 | 601229 | 上海银行   | 519,411   | 5,510,950.71 | 0.48 |
| 47 | 000063 | 中兴通讯   | 168,620   | 5,478,463.80 | 0.47 |
| 48 | 603019 | 中科曙光   | 76,568    | 5,390,387.20 | 0.47 |
| 49 | 002415 | 海康威视   | 192,842   | 5,347,508.66 | 0.46 |
| 50 | 600309 | 万华化学   | 98,514    | 5,345,369.64 | 0.46 |
| 51 | 600941 | 中国移动   | 47,200    | 5,312,360.00 | 0.46 |
| 52 | 601939 | 建设银行   | 560,962   | 5,295,481.28 | 0.46 |
| 53 | 601169 | 北京银行   | 772,880   | 5,278,770.40 | 0.46 |
| 54 | 300274 | 阳光电源   | 75,977    | 5,148,961.29 | 0.45 |
| 55 | 601658 | 邮储银行   | 933,700   | 5,107,339.00 | 0.44 |
| 56 | 601857 | 中国石油   | 591,756   | 5,059,513.80 | 0.44 |
| 57 | 601919 | 中远海控   | 329,119   | 4,949,949.76 | 0.43 |
| 58 | 688008 | 澜起科技   | 59,943    | 4,915,326.00 | 0.43 |
| 59 | 600690 | 海尔智家   | 196,249   | 4,863,050.22 | 0.42 |
| 60 | 601688 | 华泰证券   | 272,375   | 4,850,998.75 | 0.42 |
| 61 | 600660 | 福耀玻璃   | 83,826    | 4,778,920.26 | 0.41 |
| 62 | 601012 | 隆基绿能   | 316,833   | 4,758,831.66 | 0.41 |
| 63 | 300498 | 温氏股份   | 278,024   | 4,748,649.92 | 0.41 |
| 64 | 002142 | 宁波银行   | 172,586   | 4,721,952.96 | 0.41 |
| 65 | 600406 | 国电南瑞   | 209,984   | 4,705,741.44 | 0.41 |
| 66 | 600809 | 山西汾酒   | 25,580    | 4,512,056.20 | 0.39 |
| 67 | 601766 | 中国中车   | 635,104   | 4,471,132.16 | 0.39 |
| 68 | 601138 | 工业富联   | 207,600   | 4,438,488.00 | 0.38 |
| 69 | 603986 | 兆易创新   | 34,748    | 4,396,664.44 | 0.38 |
| 70 | 000568 | 泸州老窖   | 38,500    | 4,365,900.00 | 0.38 |
| 71 | 600050 | 中国联通   | 817,536   | 4,365,642.24 | 0.38 |
| 72 | 000338 | 潍柴动力   | 282,892   | 4,350,878.96 | 0.38 |
| 73 | 600028 | 中国石化   | 762,869   | 4,302,581.16 | 0.37 |
| 74 | 000100 | TCL 科技 | 980,414   | 4,245,192.62 | 0.37 |
| 75 | 601006 | 大秦铁路   | 632,257   | 4,172,896.20 | 0.36 |
| 76 | 688012 | 中微公司   | 22,869    | 4,169,018.70 | 0.36 |
| 77 | 600926 | 杭州银行   | 240,076   | 4,038,078.32 | 0.35 |
| 78 | 601818 | 光大银行   | 970,300   | 4,026,745.00 | 0.35 |
| 79 | 601985 | 中国核电   | 429,810   | 4,005,829.20 | 0.35 |

|     |        |      |         |              |      |
|-----|--------|------|---------|--------------|------|
| 80  | 601225 | 陕西煤业 | 202,464 | 3,895,407.36 | 0.34 |
| 81  | 600104 | 上汽集团 | 241,800 | 3,880,890.00 | 0.34 |
| 82  | 002027 | 分众传媒 | 528,268 | 3,856,356.40 | 0.33 |
| 83  | 600150 | 中国船舶 | 116,800 | 3,800,672.00 | 0.33 |
| 84  | 601628 | 中国人寿 | 86,962  | 3,581,964.78 | 0.31 |
| 85  | 601009 | 南京银行 | 307,679 | 3,575,229.98 | 0.31 |
| 86  | 600999 | 招商证券 | 199,039 | 3,501,096.01 | 0.30 |
| 87  | 605499 | 东鹏饮料 | 10,930  | 3,432,566.50 | 0.30 |
| 88  | 688111 | 金山办公 | 12,171  | 3,408,488.55 | 0.30 |
| 89  | 603288 | 海天味业 | 87,165  | 3,391,590.15 | 0.29 |
| 90  | 600760 | 中航沈飞 | 57,618  | 3,377,567.16 | 0.29 |
| 91  | 000425 | 徐工机械 | 429,846 | 3,339,903.42 | 0.29 |
| 92  | 000792 | 盐湖股份 | 193,800 | 3,310,104.00 | 0.29 |
| 93  | 000625 | 长安汽车 | 259,002 | 3,304,865.52 | 0.29 |
| 94  | 688271 | 联影医疗 | 25,865  | 3,303,995.10 | 0.29 |
| 95  | 600111 | 北方稀土 | 132,454 | 3,298,104.60 | 0.29 |
| 96  | 600938 | 中国海油 | 125,269 | 3,270,773.59 | 0.28 |
| 97  | 600905 | 三峡能源 | 746,500 | 3,180,090.00 | 0.28 |
| 98  | 600436 | 片仔癀  | 15,811  | 3,162,358.11 | 0.27 |
| 99  | 600089 | 特变电工 | 264,280 | 3,152,860.40 | 0.27 |
| 100 | 601888 | 中国中免 | 51,090  | 3,114,957.30 | 0.27 |
| 101 | 603993 | 洛阳钼业 | 367,044 | 3,090,510.48 | 0.27 |
| 102 | 002050 | 三花智控 | 117,077 | 3,088,491.26 | 0.27 |
| 103 | 300033 | 同花顺  | 11,300  | 3,085,013.00 | 0.27 |
| 104 | 300015 | 爱尔眼科 | 243,644 | 3,040,677.12 | 0.26 |
| 105 | 600048 | 保利发展 | 375,187 | 3,039,014.70 | 0.26 |
| 106 | 600019 | 宝钢股份 | 458,252 | 3,019,880.68 | 0.26 |
| 107 | 600547 | 山东黄金 | 94,510  | 3,017,704.30 | 0.26 |
| 108 | 601390 | 中国中铁 | 536,445 | 3,009,456.45 | 0.26 |
| 109 | 002463 | 沪电股份 | 70,400  | 2,997,632.00 | 0.26 |
| 110 | 002241 | 歌尔股份 | 127,953 | 2,983,863.96 | 0.26 |
| 111 | 600415 | 小商品城 | 143,500 | 2,967,580.00 | 0.26 |
| 112 | 300014 | 亿纬锂能 | 64,161  | 2,939,215.41 | 0.25 |
| 113 | 601825 | 沪农商行 | 302,800 | 2,937,160.00 | 0.25 |
| 114 | 601600 | 中国铝业 | 414,243 | 2,916,270.72 | 0.25 |
| 115 | 601989 | 中国重工 | 596,595 | 2,768,200.80 | 0.24 |
| 116 | 000977 | 浪潮信息 | 53,988  | 2,746,909.44 | 0.24 |
| 117 | 600958 | 东方证券 | 282,419 | 2,733,815.92 | 0.24 |
| 118 | 600585 | 海螺水泥 | 125,468 | 2,693,797.96 | 0.23 |
| 119 | 000776 | 广发证券 | 160,002 | 2,689,633.62 | 0.23 |
| 120 | 600893 | 航发动力 | 69,669  | 2,685,043.26 | 0.23 |
| 121 | 002179 | 中航光电 | 66,508  | 2,684,262.88 | 0.23 |
| 122 | 601838 | 成都银行 | 132,963 | 2,672,556.30 | 0.23 |

|     |        |      |           |              |      |
|-----|--------|------|-----------|--------------|------|
| 123 | 601916 | 浙商银行 | 786,700   | 2,666,913.00 | 0.23 |
| 124 | 600570 | 恒生电子 | 79,053    | 2,651,437.62 | 0.23 |
| 125 | 603799 | 华友钴业 | 71,330    | 2,640,636.60 | 0.23 |
| 126 | 600015 | 华夏银行 | 332,313   | 2,628,595.83 | 0.23 |
| 127 | 000538 | 云南白药 | 46,656    | 2,602,938.24 | 0.23 |
| 128 | 002311 | 海大集团 | 43,500    | 2,548,665.00 | 0.22 |
| 129 | 601336 | 新华保险 | 43,525    | 2,546,212.50 | 0.22 |
| 130 | 600584 | 长电科技 | 74,900    | 2,523,381.00 | 0.22 |
| 131 | 000938 | 紫光股份 | 104,895   | 2,516,431.05 | 0.22 |
| 132 | 000166 | 申万宏源 | 489,110   | 2,455,332.20 | 0.21 |
| 133 | 002028 | 思源电气 | 32,600    | 2,376,866.00 | 0.21 |
| 134 | 600438 | 通威股份 | 141,200   | 2,365,100.00 | 0.20 |
| 135 | 601998 | 中信银行 | 276,684   | 2,351,814.00 | 0.20 |
| 136 | 002049 | 紫光国微 | 35,580    | 2,343,298.80 | 0.20 |
| 137 | 300408 | 三环集团 | 70,132    | 2,342,408.80 | 0.20 |
| 138 | 601377 | 兴业证券 | 375,991   | 2,327,384.29 | 0.20 |
| 139 | 300433 | 蓝思科技 | 104,300   | 2,325,890.00 | 0.20 |
| 140 | 601077 | 渝农商行 | 323,100   | 2,306,934.00 | 0.20 |
| 141 | 000002 | 万科 A | 355,720   | 2,283,722.40 | 0.20 |
| 142 | 601995 | 中金公司 | 63,700    | 2,252,432.00 | 0.19 |
| 143 | 600795 | 国电电力 | 465,005   | 2,250,624.20 | 0.19 |
| 144 | 600489 | 中金黄金 | 152,000   | 2,223,760.00 | 0.19 |
| 145 | 601669 | 中国电建 | 451,146   | 2,197,081.02 | 0.19 |
| 146 | 601689 | 拓普集团 | 45,580    | 2,153,655.00 | 0.19 |
| 147 | 600010 | 宝钢股份 | 1,185,756 | 2,122,503.24 | 0.18 |
| 148 | 002422 | 科伦药业 | 58,500    | 2,101,320.00 | 0.18 |
| 149 | 600009 | 上海机场 | 65,079    | 2,067,559.83 | 0.18 |
| 150 | 601881 | 中国银河 | 118,845   | 2,038,191.75 | 0.18 |
| 151 | 002304 | 洋河股份 | 31,515    | 2,034,293.25 | 0.18 |
| 152 | 601100 | 恒立液压 | 28,112    | 2,024,064.00 | 0.18 |
| 153 | 600160 | 巨化股份 | 70,500    | 2,021,940.00 | 0.18 |
| 154 | 002460 | 赣锋锂业 | 59,100    | 1,995,807.00 | 0.17 |
| 155 | 000768 | 中航西飞 | 72,888    | 1,992,757.92 | 0.17 |
| 156 | 300394 | 天孚通信 | 24,420    | 1,949,692.80 | 0.17 |
| 157 | 601186 | 中国铁建 | 239,753   | 1,920,421.53 | 0.17 |
| 158 | 600183 | 生益科技 | 63,400    | 1,911,510.00 | 0.17 |
| 159 | 002252 | 上海莱士 | 277,978   | 1,909,708.86 | 0.17 |
| 160 | 688036 | 传音控股 | 23,879    | 1,903,156.30 | 0.16 |
| 161 | 000157 | 中联重科 | 259,600   | 1,876,908.00 | 0.16 |
| 162 | 601360 | 三六零  | 182,355   | 1,860,021.00 | 0.16 |
| 163 | 600989 | 宝丰能源 | 115,200   | 1,859,328.00 | 0.16 |
| 164 | 000963 | 华东医药 | 45,930    | 1,853,734.80 | 0.16 |
| 165 | 600886 | 国投电力 | 125,290   | 1,846,774.60 | 0.16 |

|     |        |       |         |              |      |
|-----|--------|-------|---------|--------------|------|
| 166 | 002074 | 国轩高科  | 56,700  | 1,840,482.00 | 0.16 |
| 167 | 002736 | 国信证券  | 158,600 | 1,827,072.00 | 0.16 |
| 168 | 601058 | 赛轮轮胎  | 137,700 | 1,806,624.00 | 0.16 |
| 169 | 600115 | 中国东航  | 446,320 | 1,798,669.60 | 0.16 |
| 170 | 601901 | 方正证券  | 227,200 | 1,797,152.00 | 0.16 |
| 171 | 300442 | 润泽科技  | 36,000  | 1,783,080.00 | 0.15 |
| 172 | 000408 | 藏格矿业  | 41,000  | 1,749,470.00 | 0.15 |
| 173 | 000807 | 云铝股份  | 109,200 | 1,745,016.00 | 0.15 |
| 174 | 002466 | 天齐锂业  | 54,261  | 1,738,522.44 | 0.15 |
| 175 | 600066 | 宇通客车  | 69,400  | 1,725,284.00 | 0.15 |
| 176 | 601066 | 中信建投  | 71,700  | 1,724,385.00 | 0.15 |
| 177 | 002001 | 新 和 成 | 80,598  | 1,714,319.46 | 0.15 |
| 178 | 688169 | 石头科技  | 10,860  | 1,700,133.00 | 0.15 |
| 179 | 000661 | 长春高新  | 17,100  | 1,695,978.00 | 0.15 |
| 180 | 600426 | 华鲁恒升  | 77,980  | 1,689,826.60 | 0.15 |
| 181 | 600029 | 南方航空  | 282,440 | 1,666,396.00 | 0.14 |
| 182 | 600196 | 复星医药  | 66,401  | 1,666,001.09 | 0.14 |
| 183 | 001979 | 招商蛇口  | 188,879 | 1,656,468.83 | 0.14 |
| 184 | 601800 | 中国交建  | 186,188 | 1,655,211.32 | 0.14 |
| 185 | 300661 | 圣邦股份  | 22,715  | 1,652,970.55 | 0.14 |
| 186 | 601878 | 浙商证券  | 151,500 | 1,652,865.00 | 0.14 |
| 187 | 000975 | 山金国际  | 86,900  | 1,645,886.00 | 0.14 |
| 188 | 600011 | 华能国际  | 230,000 | 1,642,200.00 | 0.14 |
| 189 | 002236 | 大华股份  | 103,349 | 1,641,182.12 | 0.14 |
| 190 | 600674 | 川投能源  | 102,300 | 1,640,892.00 | 0.14 |
| 191 | 301236 | 软通动力  | 30,000  | 1,639,200.00 | 0.14 |
| 192 | 688126 | 沪硅产业  | 86,241  | 1,614,431.52 | 0.14 |
| 193 | 600346 | 恒力石化  | 110,179 | 1,571,152.54 | 0.14 |
| 194 | 601111 | 中国国航  | 196,199 | 1,548,010.11 | 0.13 |
| 195 | 300418 | 昆仑万维  | 45,900  | 1,543,617.00 | 0.13 |
| 196 | 002648 | 卫星化学  | 88,160  | 1,527,812.80 | 0.13 |
| 197 | 600372 | 中航机载  | 126,600 | 1,526,796.00 | 0.13 |
| 198 | 603369 | 今世缘   | 39,100  | 1,522,163.00 | 0.13 |
| 199 | 600460 | 士兰微   | 60,900  | 1,511,538.00 | 0.13 |
| 200 | 601868 | 中国能建  | 677,100 | 1,509,933.00 | 0.13 |
| 201 | 002916 | 深南电路  | 13,952  | 1,504,165.12 | 0.13 |
| 202 | 003816 | 中国广核  | 411,000 | 1,496,040.00 | 0.13 |
| 203 | 002920 | 德赛西威  | 14,500  | 1,480,885.00 | 0.13 |
| 204 | 601117 | 中国化学  | 191,100 | 1,465,737.00 | 0.13 |
| 205 | 600741 | 华域汽车  | 82,355  | 1,453,565.75 | 0.13 |
| 206 | 601319 | 中国人保  | 166,800 | 1,452,828.00 | 0.13 |
| 207 | 600588 | 用友网络  | 107,511 | 1,437,422.07 | 0.12 |
| 208 | 600176 | 中国巨石  | 126,028 | 1,436,719.20 | 0.12 |

|     |        |        |         |              |      |
|-----|--------|--------|---------|--------------|------|
| 209 | 300347 | 泰格医药   | 26,940  | 1,436,440.80 | 0.12 |
| 210 | 601021 | 春秋航空   | 25,562  | 1,422,525.30 | 0.12 |
| 211 | 002601 | 龙佰集团   | 87,418  | 1,417,045.78 | 0.12 |
| 212 | 000786 | 北新建材   | 53,200  | 1,408,736.00 | 0.12 |
| 213 | 601633 | 长城汽车   | 65,400  | 1,404,792.00 | 0.12 |
| 214 | 300782 | 卓胜微    | 19,620  | 1,400,279.40 | 0.12 |
| 215 | 301269 | 华大九天   | 11,300  | 1,399,844.00 | 0.12 |
| 216 | 600219 | 南山铝业   | 363,800 | 1,393,354.00 | 0.12 |
| 217 | 300896 | 爱美客    | 7,940   | 1,387,991.40 | 0.12 |
| 218 | 302132 | 中航成飞   | 15,500  | 1,363,070.00 | 0.12 |
| 219 | 600482 | 中国动力   | 59,000  | 1,361,130.00 | 0.12 |
| 220 | 600039 | 四川路桥   | 136,260 | 1,348,974.00 | 0.12 |
| 221 | 000630 | 铜陵有色   | 400,000 | 1,336,000.00 | 0.12 |
| 222 | 000895 | 双汇发展   | 54,497  | 1,330,271.77 | 0.12 |
| 223 | 688396 | 华润微    | 27,846  | 1,313,217.36 | 0.11 |
| 224 | 002493 | 荣盛石化   | 158,363 | 1,311,245.64 | 0.11 |
| 225 | 002129 | TCL 中环 | 169,525 | 1,301,952.00 | 0.11 |
| 226 | 600085 | 同仁堂    | 35,887  | 1,294,085.22 | 0.11 |
| 227 | 600600 | 青岛啤酒   | 18,600  | 1,291,956.00 | 0.11 |
| 228 | 001965 | 招商公路   | 107,000 | 1,284,000.00 | 0.11 |
| 229 | 603296 | 华勤技术   | 15,900  | 1,282,812.00 | 0.11 |
| 230 | 601877 | 正泰电器   | 56,279  | 1,275,844.93 | 0.11 |
| 231 | 600362 | 江西铜业   | 54,415  | 1,274,943.45 | 0.11 |
| 232 | 002709 | 天赐材料   | 69,900  | 1,266,588.00 | 0.11 |
| 233 | 002600 | 领益智造   | 146,400 | 1,257,576.00 | 0.11 |
| 234 | 300122 | 智飞生物   | 62,633  | 1,226,980.47 | 0.11 |
| 235 | 688506 | 百利天恒   | 4,100   | 1,214,092.00 | 0.11 |
| 236 | 603392 | 万泰生物   | 19,823  | 1,209,203.00 | 0.10 |
| 237 | 002180 | 纳思达    | 51,900  | 1,190,586.00 | 0.10 |
| 238 | 600161 | 天坛生物   | 62,000  | 1,189,780.00 | 0.10 |
| 239 | 002938 | 鹏鼎控股   | 36,500  | 1,169,095.00 | 0.10 |
| 240 | 300832 | 新产业    | 20,600  | 1,168,432.00 | 0.10 |
| 241 | 600233 | 圆通速递   | 90,500  | 1,166,545.00 | 0.10 |
| 242 | 000301 | 东方盛虹   | 138,600 | 1,154,538.00 | 0.10 |
| 243 | 300759 | 康龙化成   | 46,275  | 1,135,588.50 | 0.10 |
| 244 | 600188 | 兖矿能源   | 93,220  | 1,134,487.40 | 0.10 |
| 245 | 000596 | 古井贡酒   | 8,500   | 1,131,775.00 | 0.10 |
| 246 | 600023 | 浙能电力   | 209,400 | 1,109,820.00 | 0.10 |
| 247 | 601618 | 中国中冶   | 372,138 | 1,108,971.24 | 0.10 |
| 248 | 000876 | 新希望    | 118,133 | 1,108,087.54 | 0.10 |
| 249 | 688047 | 龙芯中科   | 8,300   | 1,107,137.00 | 0.10 |
| 250 | 600061 | 国投资本   | 145,565 | 1,094,648.80 | 0.09 |
| 251 | 000999 | 华润三九   | 34,885  | 1,091,202.80 | 0.09 |

|     |        |      |         |              |      |
|-----|--------|------|---------|--------------|------|
| 252 | 688223 | 晶科能源 | 209,616 | 1,087,907.04 | 0.09 |
| 253 | 600845 | 宝信软件 | 45,356  | 1,071,308.72 | 0.09 |
| 254 | 600875 | 东方电气 | 63,500  | 1,062,990.00 | 0.09 |
| 255 | 601872 | 招商轮船 | 169,636 | 1,061,921.36 | 0.09 |
| 256 | 600515 | 海南机场 | 299,000 | 1,058,460.00 | 0.09 |
| 257 | 601898 | 中煤能源 | 95,300  | 1,042,582.00 | 0.09 |
| 258 | 002459 | 晶澳科技 | 103,876 | 1,036,682.48 | 0.09 |
| 259 | 600918 | 中泰证券 | 160,500 | 1,032,015.00 | 0.09 |
| 260 | 688599 | 天合光能 | 68,726  | 998,588.78   | 0.09 |
| 261 | 605117 | 德业股份 | 18,821  | 991,113.86   | 0.09 |
| 262 | 600027 | 华电国际 | 179,000 | 979,130.00   | 0.08 |
| 263 | 600332 | 白云山  | 36,669  | 966,594.84   | 0.08 |
| 264 | 601059 | 信达证券 | 56,400  | 964,440.00   | 0.08 |
| 265 | 000617 | 中油资本 | 132,000 | 963,600.00   | 0.08 |
| 266 | 000983 | 山西焦煤 | 148,600 | 951,040.00   | 0.08 |
| 267 | 300316 | 晶盛机电 | 34,200  | 928,530.00   | 0.08 |
| 268 | 601799 | 星宇股份 | 7,400   | 925,000.00   | 0.08 |
| 269 | 300628 | 亿联网络 | 26,480  | 920,444.80   | 0.08 |
| 270 | 300999 | 金龙鱼  | 31,100  | 918,383.00   | 0.08 |
| 271 | 600803 | 新奥股份 | 48,500  | 916,650.00   | 0.08 |
| 272 | 601698 | 中国卫通 | 44,100  | 902,727.00   | 0.08 |
| 273 | 600025 | 华能水电 | 93,842  | 896,191.10   | 0.08 |
| 274 | 603260 | 合盛硅业 | 18,700  | 886,380.00   | 0.08 |
| 275 | 601238 | 广汽集团 | 115,900 | 868,091.00   | 0.08 |
| 276 | 300413 | 芒果超媒 | 39,200  | 855,344.00   | 0.07 |
| 277 | 600018 | 上港集团 | 145,847 | 832,786.37   | 0.07 |
| 278 | 601607 | 上海医药 | 43,800  | 783,144.00   | 0.07 |
| 279 | 600026 | 中远海能 | 72,700  | 750,991.00   | 0.07 |
| 280 | 601236 | 红塔证券 | 84,800  | 718,256.00   | 0.06 |
| 281 | 688303 | 大全能源 | 33,505  | 714,326.60   | 0.06 |
| 282 | 603806 | 福斯特  | 54,778  | 709,922.88   | 0.06 |
| 283 | 688472 | 阿特斯  | 77,340  | 707,661.00   | 0.06 |
| 284 | 688009 | 中国通号 | 135,893 | 698,490.02   | 0.06 |
| 285 | 603195 | 公牛集团 | 14,105  | 680,566.25   | 0.06 |
| 286 | 601136 | 首创证券 | 33,400  | 663,992.00   | 0.06 |
| 287 | 601699 | 潞安环能 | 62,100  | 655,155.00   | 0.06 |
| 288 | 000708 | 中信特钢 | 53,200  | 625,632.00   | 0.05 |
| 289 | 601865 | 福莱特  | 40,000  | 608,400.00   | 0.05 |
| 290 | 688187 | 时代电气 | 13,640  | 581,746.00   | 0.05 |
| 291 | 603833 | 欧派家居 | 9,585   | 541,073.25   | 0.05 |
| 292 | 688082 | 盛美上海 | 4,700   | 535,518.00   | 0.05 |
| 293 | 601808 | 中海油服 | 31,100  | 427,936.00   | 0.04 |
| 294 | 300979 | 华利集团 | 8,000   | 420,560.00   | 0.04 |

|     |        |      |        |            |      |
|-----|--------|------|--------|------------|------|
| 295 | 600377 | 宁沪高速 | 25,800 | 395,772.00 | 0.03 |
| 296 | 000800 | 一汽解放 | 51,100 | 350,546.00 | 0.03 |
| 297 | 001391 | 国货航  | 45,200 | 304,196.00 | 0.03 |
| 298 | 001289 | 龙源电力 | 8,100  | 131,058.00 | 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  | 688775 | 影石创新 | 573   | 71,143.68 | 0.01         |
| 2  | 688411 | 海博思创 | 560   | 46,754.40 | 0.00         |
| 3  | 688545 | 兴福电子 | 994   | 26,788.30 | 0.00         |
| 4  | 301458 | 钧崴电子 | 701   | 23,911.11 | 0.00         |
| 5  | 603049 | 中策橡胶 | 553   | 23,696.05 | 0.00         |
| 6  | 688583 | 思看科技 | 227   | 18,087.36 | 0.00         |
| 7  | 301678 | 新恒汇  | 382   | 17,014.28 | 0.00         |
| 8  | 301602 | 超研股份 | 658   | 16,318.40 | 0.00         |
| 9  | 301501 | 恒鑫生活 | 350   | 15,827.00 | 0.00         |
| 10 | 001388 | 信通电子 | 937   | 15,385.54 | 0.00         |
| 11 | 603202 | 天有为  | 166   | 15,049.56 | 0.00         |
| 12 | 301479 | 弘景光电 | 182   | 14,172.34 | 0.00         |
| 13 | 301535 | 浙江华远 | 734   | 13,938.66 | 0.00         |
| 14 | 688757 | 胜科纳米 | 536   | 13,903.84 | 0.00         |
| 15 | 688758 | 赛分科技 | 777   | 13,185.69 | 0.00         |
| 16 | 603072 | 天和磁材 | 226   | 12,305.70 | 0.00         |
| 17 | 301662 | 宏工科技 | 143   | 11,797.50 | 0.00         |
| 18 | 301601 | 惠通科技 | 342   | 11,576.70 | 0.00         |
| 19 | 001356 | 富岭股份 | 709   | 10,237.96 | 0.00         |
| 20 | 301590 | 优优绿能 | 73    | 10,182.04 | 0.00         |
| 21 | 301658 | 首航新能 | 437   | 10,042.26 | 0.00         |
| 22 | 688755 | 汉邦科技 | 203   | 7,983.99  | 0.00         |
| 23 | 301173 | 毓恬冠佳 | 173   | 7,781.54  | 0.00         |
| 24 | 001382 | 新亚电缆 | 366   | 7,396.86  | 0.00         |
| 25 | 603014 | 威高血净 | 205   | 6,699.40  | 0.00         |
| 26 | 301636 | 泽润新能 | 128   | 6,074.88  | 0.00         |
| 27 | 301595 | 太力科技 | 196   | 5,703.60  | 0.00         |
| 28 | 301560 | 众捷汽车 | 190   | 5,215.50  | 0.00         |
| 29 | 603271 | 永杰新材 | 126   | 4,420.08  | 0.00         |
| 30 | 603124 | 江南新材 | 88    | 4,075.28  | 0.00         |
| 31 | 001395 | 亚联机械 | 80    | 3,780.00  | 0.00         |
| 32 | 603409 | 汇通控股 | 100   | 3,332.00  | 0.00         |
| 33 | 001390 | 古麒绒材 | 178   | 3,225.36  | 0.00         |
| 34 | 603257 | 中国瑞林 | 78    | 2,922.66  | 0.00         |
| 35 | 603382 | 海阳科技 | 105   | 2,350.95  | 0.00         |
| 36 | 001335 | 信凯科技 | 80    | 2,244.00  | 0.00         |

|    |        |      |    |            |       |
|----|--------|------|----|------------|-------|
| 37 | 603120 | 肯特催化 | 65 | 2, 172. 95 | 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  | 601211 | 国泰海通 | 6, 720, 568. 76 | 0. 55          |
| 2  | 601825 | 沪农商行 | 3, 002, 947. 00 | 0. 25          |
| 3  | 601166 | 兴业银行 | 2, 852, 648. 00 | 0. 23          |
| 4  | 300750 | 宁德时代 | 2, 510, 193. 20 | 0. 21          |
| 5  | 601077 | 渝农商行 | 2, 358, 400. 00 | 0. 19          |
| 6  | 601058 | 赛轮轮胎 | 2, 328, 263. 00 | 0. 19          |
| 7  | 601328 | 交通银行 | 1, 693, 383. 00 | 0. 14          |
| 8  | 301236 | 软通动力 | 1, 604, 059. 00 | 0. 13          |
| 9  | 601899 | 紫金矿业 | 1, 524, 097. 00 | 0. 12          |
| 10 | 002594 | 比亚迪  | 1, 477, 671. 00 | 0. 12          |
| 11 | 302132 | 中航成飞 | 1, 375, 711. 00 | 0. 11          |
| 12 | 300059 | 东方财富 | 1, 331, 691. 00 | 0. 11          |
| 13 | 002230 | 科大讯飞 | 1, 312, 817. 00 | 0. 11          |
| 14 | 002475 | 立讯精密 | 1, 283, 252. 00 | 0. 10          |
| 15 | 002600 | 领益智造 | 1, 206, 574. 00 | 0. 10          |
| 16 | 603259 | 药明康德 | 1, 161, 462. 00 | 0. 09          |
| 17 | 601006 | 大秦铁路 | 1, 073, 648. 00 | 0. 09          |
| 18 | 688047 | 龙芯中科 | 1, 038, 118. 89 | 0. 08          |
| 19 | 600926 | 杭州银行 | 915, 754. 00    | 0. 07          |
| 20 | 600519 | 贵州茅台 | 888, 812. 00    | 0. 07          |

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  | 600837 | 海通证券 | 6, 136, 679. 76 | 0. 50          |
| 2  | 300750 | 宁德时代 | 4, 816, 259. 00 | 0. 39          |
| 3  | 600519 | 贵州茅台 | 4, 351, 807. 00 | 0. 36          |
| 4  | 601988 | 中国银行 | 3, 113, 949. 00 | 0. 25          |
| 5  | 600036 | 招商银行 | 2, 780, 210. 00 | 0. 23          |
| 6  | 002594 | 比亚迪  | 2, 663, 972. 00 | 0. 22          |
| 7  | 601318 | 中国平安 | 2, 629, 828. 00 | 0. 22          |
| 8  | 601899 | 紫金矿业 | 2, 575, 876. 00 | 0. 21          |
| 9  | 300059 | 东方财富 | 2, 292, 864. 45 | 0. 19          |
| 10 | 002475 | 立讯精密 | 2, 044, 681. 00 | 0. 17          |
| 11 | 000333 | 美的集团 | 1, 998, 977. 00 | 0. 16          |

|    |        |      |              |      |
|----|--------|------|--------------|------|
| 12 | 300124 | 汇川技术 | 1,976,719.00 | 0.16 |
| 13 | 603259 | 药明康德 | 1,770,165.00 | 0.14 |
| 14 | 600745 | 闻泰科技 | 1,741,959.00 | 0.14 |
| 15 | 601398 | 工商银行 | 1,671,531.00 | 0.14 |
| 16 | 600900 | 长江电力 | 1,614,421.00 | 0.13 |
| 17 | 601166 | 兴业银行 | 1,461,702.00 | 0.12 |
| 18 | 600030 | 中信证券 | 1,458,053.00 | 0.12 |
| 19 | 300450 | 先导智能 | 1,445,140.20 | 0.12 |
| 20 | 002555 | 三七互娱 | 1,402,507.50 | 0.11 |

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 | 88,932,056.43  |
| 卖出股票收入（成交）总额 | 155,511,709.61 |

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

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

无。

7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

无。

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

无。

7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

无。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

无。

7.10 本基金投资股指期货的投资政策

无。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.11.1 本期国债期货投资政策

无。

7.11.2 本期国债期货投资评价

无。

7.12 投资组合报告附注

7.12.1 基金投资的前十名证券的发行主体本期是否出现被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形

本基金投资的前十名证券兴业银行的发行主体兴业银行股份有限公司于 2024 年 7 月 17 日因未严格按照公布的收费价目名录收费、向小微企业贷款客户转嫁抵押评估费、企业划型管理不到位等受到国家金融监督管理总局福建监管局处罚（闽金罚决字〔2024〕12 号）。兴业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 | 24,856.49  |
| 2  | 应收清算款 | 31,373.51  |
| 3  | 应收股利  | -          |
| 4  | 应收利息  | -          |
| 5  | 应收申购款 | 204,568.25 |
| 6  | 其他应收款 | -          |
| 7  | 待摊费用  | -          |
| 8  | 其他    | -          |
| 9  | 合计    | 260,798.25 |

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

无。

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

7.12.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

无。

7.12.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

金额单位：人民币元

| 序号 | 股票代码   | 股票名称 | 流通受限部分的公允价值 | 占基金资产净值比例（%） | 流通受限情况说明 |
|----|--------|------|-------------|--------------|----------|
| 1  | 688775 | 影石创新 | 71,143.68   | 0.01         | 新股锁定     |
| 2  | 688411 | 海博思创 | 46,754.40   | 0.00         | 新股锁定     |
| 3  | 688545 | 兴福电子 | 26,788.30   | 0.00         | 新股锁定     |
| 4  | 301458 | 钧崴电子 | 23,911.11   | 0.00         | 新股锁定     |
| 5  | 603049 | 中策橡胶 | 23,696.05   | 0.00         | 新股锁定     |

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<br>户数<br>(户) | 户均持有的基<br>金份额 | 持有人结构        |                   |                  |                   |
|------------------|------------------|---------------|--------------|-------------------|------------------|-------------------|
|                  |                  |               | 机构投资者        |                   | 个人投资者            |                   |
|                  |                  |               | 持有份额         | 占总份<br>额比例<br>(%) | 持有份额             | 占总份<br>额比例<br>(%) |
| 大成沪深<br>300 指数 A | 71,677           | 15,618.49     | 5,801,656.14 | 0.52              | 1,113,684,671.59 | 99.48             |
| 大成沪深<br>300 指数 C | 2,698            | 6,648.76      | 2,093,714.29 | 11.67             | 15,844,642.25    | 88.33             |
| 大成沪深<br>300 指数 Y | 128              | 5,480.68      | 0.00         | 0.00              | 701,526.77       | 100.00            |
| 合计               | 74,503           | 15,276.25     | 7,895,370.43 | 0.69              | 1,130,230,840.61 | 99.31             |

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<br>理人所有从业<br>人员持有本基<br>金 | 大成沪深 300 指数 A | 51,552.04 | 0.0046      |
|                              | 大成沪深 300 指数 C | 420.81    | 0.0023      |
|                              | 大成沪深 300 指数 Y | 9.81      | 0.0014      |
|                              | 合计            | 51,982.66 | 0.0046      |

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<br>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                 |
|                                    | 大成沪深 300 指数 Y | 0                 |

|                     |               |      |
|---------------------|---------------|------|
|                     | 合计            | 0~10 |
| 本基金基金经理持有<br>本开放式基金 | 大成沪深 300 指数 A | 0    |
|                     | 大成沪深 300 指数 C | 0    |
|                     | 大成沪深 300 指数 Y | 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    | 大成沪深 300 指数 Y |
|------------------------------------------|----------------------|------------------|---------------|
| 基金合同生效<br>日（2006 年 4<br>月 6 日）基金<br>份额总额 | 1, 813, 356, 066. 47 | —                | —             |
| 本报告期期初<br>基金份额总额                         | 1, 157, 434, 712. 70 | 57, 201, 162. 56 | 132, 745. 88  |
| 本报告期基金<br>总申购份额                          | 42, 527, 586. 00     | 9, 515, 916. 03  | 658, 859. 31  |
| 减：本报告期<br>基金总赎回份<br>额                    | 80, 475, 970. 97     | 48, 778, 722. 05 | 90, 078. 42   |
| 本报告期基金<br>拆分变动份额                         | —                    | —                | —             |
| 本报告期期末<br>基金份额总额                         | 1, 119, 486, 327. 73 | 17, 938, 356. 54 | 701, 526. 77  |

§ 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

2025 年 2 月，中国农业银行总行决定陈振华任托管业务部副总裁。

2025 年 3 月，中国农业银行总行决定常佳任托管业务部副总裁。

2025 年 4 月，中国农业银行总行决定李亚红任托管业务部高级专家。

**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**

本基金自基金合同生效日起聘请安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）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 (%) |    |
| 国信证券       | 1      | 141,972,450.56 | 61.69            | 27,826.55 | 61.69          | —  |
| 国泰海通       | 4      | 76,671,981.20  | 33.31            | 15,027.70 | 33.31          | —  |
| 华泰证券       | 1      | 11,506,325.20  | 5.00             | 2,255.31  | 5.00           | —  |
| 爱建证券       | 1      | —              | —                | —         | —              | —  |
| 财通证券       | 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      | —              | —                | —         | —              | —  |
| 方正证券       | 1      | —              | —                | —         | —              | —  |
| 高盛中国<br>证券 | 1      | —              | —                | —         | —              | —  |

|              |   |   |   |   |   |           |
|--------------|---|---|---|---|---|-----------|
| 光大证券         | 2 | - | - | - | - | -         |
| 广发证券         | 2 | - | - | - | - | -         |
| 国金证券         | 2 | - | - | - | - | -         |
| 国盛证券         | 1 | - | - | - | - | -         |
| 国投证券         | 1 | - | - | - | - | -         |
| 红塔证券         | 1 | - | - | - | - | -         |
| 华创证券         | 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 | - | - | - | - | -         |
| 天风证券         | 1 | - | - | - | - | -         |
| 万和证券         | 1 | - | - | - | - | -         |
| 西部证券         | 1 | - | - | - | - | -         |
| 信达证券         | 1 | - | - | - | - | -         |
| 兴业证券         | 2 | - | - | - | - | -         |
| 野村东方<br>国际证券 | 1 | - | - | - | - | 新增<br>1 个 |
| 粤开证券         | 1 | - | - | - | - | -         |
| 招商证券         | 2 | - | - | - | - | -         |
| 浙商证券         | 1 | - | - | - | - | -         |
| 中国银河<br>证券   | 3 | - | - | - | - | -         |
| 中金公司         | 2 | - | - | - | - | -         |
| 中泰证券         | 2 | - | - | - | - | -         |
| 中信建投<br>证券   | 2 | - | - | - | - | -         |
| 中信证券         | 4 | - | - | - | - | -         |
| 中银国际<br>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和流程如下：

#### （一）筛选标准

大成基金管理有限公司（以下简称“公司”）严格按照《公开募集证券投资基金证券交易费用管理规定》要求制定了证券公司筛选标准，建立了证券公司尽职调查、证券公司负面筛查、备选池筛选机制，选择财务状况良好，经营行为规范，合规风控能力和交易、研究等服务能力较强的证券公司参与证券交易。

(二) 筛选流程

- 1、经公司尽调符合条件的证券公司进入备选池，由股票投委会以公平、公正、公开为原则，结合定性及定量办法科学评估证券公司研究服务能力，形成证券公司白名单，并定期及不定期进行动态调整。
- 2、公司按照白名单与证券公司进行协议签署。

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  | 大成基金管理有限公司关于再次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 | 2025 年 6 月 30 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 | 2025 年 6 月 30 日 |
| 3  | 大成沪深 300 指数证券投资基金(Y 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 | 2025 年 6 月 30 日 |
| 4  | 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 | 2025 年 6 月 30 日 |
| 5  | 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 | 2025 年 6 月 6 日  |
| 6  | 大成基金管理有限公司关于旗下部分基金估值调整情况的公告                | 中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站 | 2025 年 6 月 6 日  |
| 7  | 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 | 2025 年 5 月 6 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 | 2025 年 4 月 26 日 |
| 9  | 大成沪深 300 指数证券投资基金 2025 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 | 2025 年 4 月 22 日 |
| 10 | 大成基金管理有限公司旗下公募基金通过证券公司证券交易及佣金支付情况（2024 年度） | 中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站 | 2025 年 3 月 31 日 |
| 11 | 大成沪深 300 指数证券投资基金 2024                     | 中国证监会基金电子披               | 2025 年 3 月 31 日 |

|    |                                                  |                          |                 |
|----|--------------------------------------------------|--------------------------|-----------------|
|    | 年年度报告                                            | 露网站、规定报刊及本公司网站           |                 |
| 12 | 大成基金管理有限公司关于旗下部分基金估值调整情况的公告                      | 中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站 | 2025 年 3 月 25 日 |
| 13 | 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 | 2025 年 3 月 7 日  |
| 14 | 大成沪深 300 指数证券投资基金基金合同                            | 中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站 | 2025 年 3 月 5 日  |
| 15 | 大成基金管理有限公司关于旗下部分完全按照指数构成比例投资的基金修订基金合同关联交易限制条款的公告 | 中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站 | 2025 年 3 月 5 日  |
| 16 | 大成沪深 300 指数证券投资基金 2024 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 | 2025 年 1 月 22 日 |
| 17 | 关于大成沪深 300 指数证券投资基金恢复大额申购（含定期定额申购）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 | 2025 年 1 月 20 日 |
| 18 | 大成基金管理有限公司关于大成沪深 300 指数证券投资基金 2024 年度第 1 次分红的公告  | 中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站 | 2025 年 1 月 16 日 |
| 19 | 关于大成沪深 300 指数证券投资基金暂停大额申购（含定期定额申购）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 | 2025 年 1 月 11 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

2025 年 8 月 29 日