

# 大成深证成份交易型开放式指数证券投资 基金 2026 年中期报告

2026 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：2026 年 8 月 28 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。

基金托管人中国农业银行股份有限公司根据本基金合同约定，于 2026 年 08 月 27 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 2026 年 01 月 01 日起至 06 月 30 日止。

## 1.2 目录

|                                         |           |
|-----------------------------------------|-----------|
| <b>§ 1 重要提示及目录</b>                      | <b>2</b>  |
| 1.1 重要提示                                | 2         |
| 1.2 目录                                  | 3         |
| <b>§ 2 基金简介</b>                         | <b>5</b>  |
| 2.1 基金基本情况                              | 5         |
| 2.2 基金产品说明                              | 5         |
| 2.3 基金管理人和基金托管人                         | 5         |
| 2.4 信息披露方式                              | 6         |
| 2.5 其他相关资料                              | 6         |
| <b>§ 3 主要财务指标和基金净值表现</b>                | <b>6</b>  |
| 3.1 主要会计数据和财务指标                         | 6         |
| 3.2 基金净值表现                              | 7         |
| <b>§ 4 管理人报告</b>                        | <b>7</b>  |
| 4.1 基金管理人及基金经理情况                        | 7         |
| 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明              | 9         |
| 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明                 | 9         |
| 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             | 9         |
| 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望             | 10        |
| 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明                | 11        |
| 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明                 | 11        |
| 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       | 11        |
| <b>§ 5 托管人报告</b>                        | <b>12</b> |
| 5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明                  | 12        |
| 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 | 12        |
| 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       | 12        |
| <b>§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）</b>              | <b>12</b> |
| 6.1 资产负债表                               | 12        |
| 6.2 利润表                                 | 13        |
| 6.3 净资产变动表                              | 15        |
| 6.4 报表附注                                | 16        |
| <b>§ 7 投资组合报告</b>                       | <b>37</b> |
| 7.1 期末基金资产组合情况                          | 37        |
| 7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合                    | 38        |
| 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       | 39        |
| 7.4 报告期内股票投资组合的重大变动                     | 51        |
| 7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合                    | 53        |
| 7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细      | 53        |
| 7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细   | 53        |
| 7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细   | 53        |

|                                          |           |
|------------------------------------------|-----------|
| 7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细 ..... | 53        |
| 7.10 本基金投资股指期货的投资政策 .....                | 53        |
| 7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 .....          | 53        |
| 7.12 投资组合报告附注 .....                      | 54        |
| <b>§ 8 基金份额持有人信息 .....</b>               | <b>55</b> |
| 8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....              | 55        |
| 8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....           | 55        |
| 8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况 .....   | 55        |
| <b>§ 9 开放式基金份额变动 .....</b>               | <b>55</b> |
| <b>§ 10 重大事件揭示 .....</b>                 | <b>55</b> |
| 10.1 基金份额持有人大会决议 .....                   | 55        |
| 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 .....   | 55        |
| 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....        | 56        |
| 10.4 基金投资策略的改变 .....                     | 56        |
| 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....              | 56        |
| 10.6 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况 .....       | 56        |
| 10.7 基金租用或者通过证券公司交易单元进行证券投资的相关情况 .....   | 56        |
| 10.8 其他重大事件 .....                        | 58        |
| <b>§ 11 影响投资者决策的其他重要信息 .....</b>         | <b>60</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 ..... | 60        |
| 11.2 影响投资者决策的其他重要信息 .....                | 60        |
| <b>§ 12 备查文件目录 .....</b>                 | <b>60</b> |
| 12.1 备查文件目录 .....                        | 60        |
| 12.2 存放地点 .....                          | 60        |
| 12.3 查阅方式 .....                          | 60        |

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

|              |                      |
|--------------|----------------------|
| 基金名称         | 大成深证成份交易型开放式指数证券投资基金 |
| 基金简称         | 深证 ETF               |
| 场内简称         | 深证成指 ETF 大成          |
| 基金主代码        | 159943               |
| 交易代码         | 159943               |
| 基金运作方式       | 交易型开放式               |
| 基金合同生效日      | 2015 年 6 月 5 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   | 122,229,922.00 份     |
| 基金合同存续期      | 不定期                  |
| 基金份额上市的证券交易所 | 深圳证券交易所              |
| 上市日期         | 2015 年 7 月 8 日       |

### 2.2 基金产品说明

|        |                                                                                                                                                                                                                            |
|--------|----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
| 投资目标   | 紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化。                                                                                                                                                                                                 |
| 投资策略   | <p>本基金采取完全复制法，即按照标的指数的成份股组成及其权重构建股票投资组合，并根据标的指数成份股及其权重的变动进行相应调整。</p> <p>当预期成份股发生调整和成份股发生配股、增发、分红等行为时，或因基金的申购和赎回等对本基金跟踪标的指数的效果可能带来影响时，或因某些特殊情况导致流动性不足时，或其他原因导致无法有效复制和跟踪标的指数时，基金管理人可以对投资组合管理进行适当变通和调整，从而使得投资组合紧密地跟踪标的指数。</p> |
| 业绩比较基准 | 深证成份指数收益率                                                                                                                                                                                                                  |
| 风险收益特征 | <p>本基金为股票型指数基金，属于较高风险、较高预期收益的基金品种，其风险与预期收益高于混合基金、债券基金与货币市场基金。</p> <p>本基金采用完全复制法跟踪标的指数的表现，具有与标的指数、以及标的指数所代表的股票市场相似的风险收益特征。</p>                                                                                              |

### 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<br>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<br>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<br>号 |

|       |                                                 |                                 |
|-------|-------------------------------------------------|---------------------------------|
|       | 27-33 层                                         |                                 |
| 办公地址  | 广东省深圳市南山区海德三道<br>1236 号大成基金总部大厦 5 层、<br>27-33 层 | 北京市西城区复兴门内大街 28<br>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》           |
| 登载基金中期报告的管理人互联网网址 | www.dcfund.com.cn |
| 基金中期报告置备地点        | 基金管理人及基金托管人住所     |

## 2.5 其他相关资料

| 项目     | 名称             | 办公地址             |
|--------|----------------|------------------|
| 注册登记机构 | 中国证券登记结算有限责任公司 | 北京市西城区太平桥大街 17 号 |

# § 3 主要财务指标和基金净值表现

## 3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

| 3.1.1 期间数据和指标 | 报告期(2026 年 1 月 1 日-2026 年 6 月 30 日) |
|---------------|-------------------------------------|
| 本期已实现收益       | 25,670,118.18                       |
| 本期利润          | 40,405,009.66                       |
| 加权平均基金份额本期利润  | 0.3151                              |
| 本期加权平均净值利润率   | 19.72%                              |
| 本期基金份额净值增长率   | 20.85%                              |
| 3.1.2 期末数据和指标 | 报告期末(2026 年 6 月 30 日)               |
| 期末可供分配利润      | 60,267,282.42                       |
| 期末可供分配基金份额利润  | 0.4931                              |
| 期末基金资产净值      | 217,832,813.72                      |
| 期末基金份额净值      | 1.7822                              |
| 3.1.3 累计期末指标  | 报告期末(2026 年 6 月 30 日)               |
| 基金份额累计净值增长率   | 38.27%                              |

注：1、本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用和信用减值损失后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

2、期末可供分配利润，采用期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数（为期末余额，不是当期发生数）。

3、所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

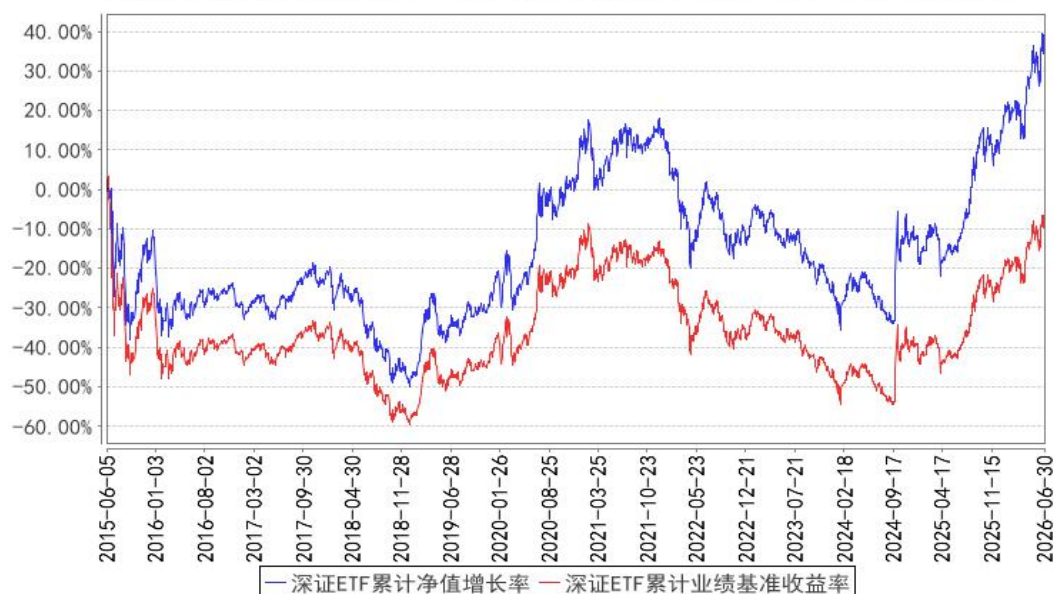
## 3.2 基金净值表现

### 3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

| 阶段         | 份额净值增长率① | 份额净值增长率标准差② | 业绩比较基准收益率③ | 业绩比较基准收益率标准差④ | ①－③    | ②－④    |
|------------|----------|-------------|------------|---------------|--------|--------|
| 过去三个月      | 21.30%   | 1.70%       | 20.24%     | 1.72%         | 1.06%  | -0.02% |
| 过去六个月      | 20.85%   | 1.53%       | 19.82%     | 1.54%         | 1.03%  | -0.01% |
| 过去一年       | 57.26%   | 1.39%       | 54.85%     | 1.40%         | 2.41%  | -0.01% |
| 过去三年       | 57.02%   | 1.47%       | 46.97%     | 1.50%         | 10.05% | -0.03% |
| 过去五年       | 20.00%   | 1.37%       | 6.88%      | 1.40%         | 13.12% | -0.03% |
| 过去七年       | 111.26%  | 1.40%       | 76.56%     | 1.42%         | 34.70% | -0.02% |
| 过去十年       | 90.77%   | 1.36%       | 54.49%     | 1.39%         | 36.28% | -0.03% |
| 自基金合同生效起至今 | 38.27%   | 1.53%       | -7.40%     | 1.58%         | 45.67% | -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

深证ETF累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



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

## § 4 管理人报告

### 4.1 基金管理人及基金经理情况

#### 4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

大成基金管理有限公司成立于 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 |        |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                             |
| 李湔玮 | 本基金基金经理 | 2025 年 12 月 16 日 | —    | 10 年   | 美国纽约大学理学硕士。2016 年 5 月加入大成基金管理有限公司，曾担任数量与指数投资部研究员、指数与期货投资部投资经理、基金经理助理，现任指数与期货投资部基金经理。2025 年 12 月 16 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基金经理。2026 年 4 月 17 日起任大成中证工业互联网主题交易型开放式指数证券投资基金基金经理。2026 年 5 月 6 日起任大成中证畜牧养殖产业交易型开放式指数证券投资基金基金经理。2026 年 6 月 15 日起任大成中证稀有金属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

无。

## 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

报告期内，本基金管理人严格遵守《中华人民共和国证券法》、《中华人民共和国证券投资基金法》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

回顾 2026 年上半年，A 股市场整体呈现“科技单边牛+传统板块承压”的极致 K 型分化行情，上证指数在 3 月份跌破 3800 点之后，一路拉升至年内高点 4258.86，而后步入宽幅震荡。收益方面，沪深 300 涨 7.55%；中证 500 涨 20.97%；中证 1000 涨 15.99%；创业板指涨 35.58%；科创 50 涨 64.25%。行业上，电子、通信和建材涨幅靠前；综合、综合金融、消费者服务则居跌幅前；资金主要流向科技、高端制造等高景气方向。

2026 年上半年国内 GDP 同比增长 4.7%，经济呈“外需强、内需弱，生产强、消费弱”的 K 型分化。1-6 月规上工业企业利润同比增 18.7%，电子行业贡献了大部分的增量，AI 与高端制造景气高涨，而消费复苏乏力、地产投资继续疲软。盈利结构同步重构：上游原材料端利润高增，汽车、

传统消费制造利润收缩，K 型结构分化加剧。海外地缘扰动不断、海峡通航预期反复，全球“类滞胀”担忧先升后降。上半年全球流动性维持紧平衡，市场此前预期的美联储 6 月降息未至，受美国通胀粘性较强、就业韧性超预期影响，降息节奏延后。海外扰动从“地缘+流动性双紧”转向“流动性紧平衡+地缘缓和”，对 A 股风险偏好的压制边际缓解。

A 股层面，行情跟随产业验证与交易结构变化阶梯式演进，一季度“春季躁动”中市场在科技与资源间轮动；而从 4 月一季报验证期，市场对地缘风险逐步“脱敏”开始，上半年资金更偏好业绩弹性强、产业趋势明确、国产替代逻辑较强的板块，电子、通信等科技成长方向明显跑赢传统宽基。整体而言，赚钱效应极致集中于科技内部分支，有确定性数据方向（半导体设备/存储/MLC/光通信上游等）穿越波动，海外算力中部分细分方向呈现出进一步“缩圈”的现象。

本基金标的指数为深证成份指数（399001）。深证成份指数由深圳证券交易所市值大、流动性好的 500 只 A 股组成，定位于深交所标尺指数，反映深交所多层次市场的整体表现。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

截至本报告期末本基金份额净值为 1.7822 元；本报告期基金份额净值增长率为 20.85%，业绩比较基准收益率为 19.82%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望后市，宏观环境预计延续“国内产业验证落地、海外流动性边际改善”的格局。国内方面，核心变量为中报与三季报业绩兑现节奏，供需优化的出口链制造业、电子等科技产业景气占优，广义内需板块和地产链需等待更明确的企稳信号。海外方面，随着美伊之间逐步缓和，油价进一步上涨的可能性降低，美国非农、CPI 数据显示通胀压力缓解，叠加特朗普面临的中期选举压力，美联储下半年加息的预期正逐步走低。美元趋势性走弱下全球资本回流新兴市场，为 A 股提供外部流动性支持。

具体到 A 股市场，一是 AI 硬件产业链，全球 AI Capex 无收缩、上游产能硬约束下，中报验证后的海外算力（CPO/PCB/MLCC）与国产算力（半导体设备/材料/存储）仍值得关注，同时相关的算力小金属亦可关注；二是在通胀预期走缓、美伊缓和的大背景下，黄金、工业有色等资源品（供给约束+AI/新能源需求+降息逻辑共振）仍具备右侧的配置价值，化工等则受益于上游成本端的下降；三是出口制造与优势出海，电池、工程机械、电网设备等受益于海外制造业补库与 AI 数据中心建设，出口增速有望维持。整体而言，在风险筹码经过释放调整之后，科技+制造仍是会

相对跑出 alpha 的方向，但更多的是体现在里面的结构性机会。

#### 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。本报告期内本基金无收益分配事项。

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

无。

## § 5 托管人报告

### 5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内，中国农业银行股份有限公司（以下简称“本基金托管人”）在本基金的托管过程中，严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》及其他相关法律、法规的规定和基金合同、托管协议的约定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

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

本报告期内，本基金托管人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》及其他相关法律、法规的规定和基金合同、托管协议的约定，对本基金的投资运作情况进行了必要的监督，对本基金的基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格计算、基金费用开支、利润分配等方面进行了复核，未发现基金管理人有关损害基金份额持有人利益的行为。

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

本基金托管人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》及其他相关法律、法规的规定和基金合同、托管协议的约定，以自身能够获取的数据和信息为限，对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、投资组合报告等内容进行核查，以上内容真实、准确、完整。

## § 6 半年度财务会计报告（未经审计）

### 6.1 资产负债表

会计主体：大成深证成份交易型开放式指数证券投资基金

报告截止日：2026 年 6 月 30 日

单位：人民币元

| 资 产         | 附注号     | 本期末<br>2026 年 6 月 30 日 | 上年度末<br>2025 年 12 月 31 日 |
|-------------|---------|------------------------|--------------------------|
| <b>资 产：</b> |         |                        |                          |
| 货币资金        | 6.4.7.1 | 2,512,277.15           | 2,673,057.15             |
| 结算备付金       |         | 5,693.83               | —                        |
| 存出保证金       |         | 87,424.99              | 109,249.00               |
| 交易性金融资产     | 6.4.7.2 | 215,706,985.13         | 191,046,218.24           |
| 其中：股票投资     |         | 215,692,038.84         | 191,046,218.24           |
| 基金投资        |         | —                      | —                        |
| 债券投资        |         | 14,946.29              | —                        |
| 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    | -                              | -                                |
| 应收清算款         |            | -                              | 15,200.49                        |
| 应收股利          |            | -                              | -                                |
| 应收申购款         |            | -                              | -                                |
| 递延所得税资产       |            | -                              | -                                |
| 其他资产          | 6.4.7.8    | -                              | -                                |
| 资产总计          |            | 218,312,381.10                 | 193,843,724.88                   |
| <b>负债和净资产</b> | <b>附注号</b> | <b>本期末<br/>2026 年 6 月 30 日</b> | <b>上年度末<br/>2025 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         |            | 275,502.07                     | 48,654.73                        |
| 应付赎回款         |            | -                              | -                                |
| 应付管理人报酬       |            | 85,754.32                      | 89,350.25                        |
| 应付托管费         |            | 17,150.86                      | 17,870.06                        |
| 应付销售服务费       |            | -                              | -                                |
| 应付投资顾问费       |            | -                              | -                                |
| 应交税费          |            | -                              | -                                |
| 应付利润          |            | -                              | -                                |
| 递延所得税负债       |            | -                              | -                                |
| 其他负债          | 6.4.7.9    | 101,160.13                     | 166,681.99                       |
| 负债合计          |            | 479,567.38                     | 322,557.03                       |
| <b>净资产：</b>   |            |                                |                                  |
| 实收基金          | 6.4.7.10   | 157,565,531.30                 | 169,167,353.16                   |
| 未分配利润         | 6.4.7.12   | 60,267,282.42                  | 24,353,814.69                    |
| 净资产合计         |            | 217,832,813.72                 | 193,521,167.85                   |
| 负债和净资产总计      |            | 218,312,381.10                 | 193,843,724.88                   |

注：报告截止日 2026 年 6 月 30 日，基金份额净值 1.7822 元，基金份额总额 122,229,922.00 份。

## 6.2 利润表

会计主体：大成深证成份交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日

单位：人民币元

| 项 目            | 附注号 | 本期<br>2026 年 1 月 1 日至 2026<br>年 6 月 30 日 | 上年度可比期间<br>2025 年 1 月 1 日至 2025<br>年 6 月 30 日 |
|----------------|-----|------------------------------------------|-----------------------------------------------|
| <b>一、营业总收入</b> |     | 41,096,542.19                            | 8,020,160.48                                  |
| 1. 利息收入        |     | 4,424.27                                 | 8,847.11                                      |

|                            |            |               |               |
|----------------------------|------------|---------------|---------------|
| 其中：存款利息收入                  | 6.4.7.13   | 4,424.27      | 8,847.11      |
| 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                     |            | -             | -             |
| 2. 投资收益（损失以“-”填列）          |            | 26,336,500.93 | 11,105,874.50 |
| 其中：股票投资收益                  | 6.4.7.14   | 24,946,320.07 | 8,989,230.92  |
| 基金投资收益                     | 6.4.7.15   | -             | -             |
| 债券投资收益                     | 6.4.7.16   | 0.57          | 21,076.64     |
| 资产支持证券投资                   | 6.4.7.17   | -             | -             |
| 收益                         |            |               |               |
| 贵金属投资收益                    | 6.4.7.18   | -             | -             |
| 衍生工具收益                     | 6.4.7.19   | -             | -             |
| 股利收益                       | 6.4.7.20   | 1,390,180.29  | 2,095,566.94  |
| 以摊余成本计量的金融资产终止确认产生的收益      |            | -             | -             |
| 其他投资收益                     |            | -             | -             |
| 3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）     | 6.4.7.21   | 14,734,891.48 | -2,992,078.88 |
| 4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）         |            | -             | -             |
| 5. 其他收入（损失以“-”号填列）         | 6.4.7.22   | 20,725.51     | -102,482.25   |
| <b>减：二、营业总支出</b>           |            | 691,532.53    | 710,888.06    |
| 1. 管理人报酬                   | 6.4.10.2.1 | 507,845.59    | 512,304.63    |
| 2. 托管费                     | 6.4.10.2.2 | 101,569.08    | 102,461.01    |
| 3. 销售服务费                   | 6.4.10.2.3 | -             | -             |
| 4. 投资顾问费                   |            | -             | -             |
| 5. 利息支出                    |            | -             | -             |
| 其中：卖出回购金融资产支出              |            | -             | -             |
| 6. 信用减值损失                  | 6.4.7.23   | -             | -             |
| 7. 税金及附加                   |            | -             | 0.02          |
| 8. 其他费用                    | 6.4.7.24   | 82,117.86     | 96,122.40     |
| <b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b> |            | 40,405,009.66 | 7,309,272.42  |
| 减：所得税费用                    |            | -             | -             |
| <b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>   |            | 40,405,009.66 | 7,309,272.42  |
| <b>五、其他综合收益的税后</b>         |            | -             | -             |

|          |  |               |              |
|----------|--|---------------|--------------|
| 净额       |  |               |              |
| 六、综合收益总额 |  | 40,405,009.66 | 7,309,272.42 |

### 6.3 净资产变动表

会计主体：大成深证成份交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日

单位：人民币元

| 项目                                       | 本期<br>2026 年 1 月 1 日至 2026 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                                | 169,167,353.16                             | -      | 24,353,814.69  | 193,521,167.85  |
| 二、本期期初净资产                                | 169,167,353.16                             | -      | 24,353,814.69  | 193,521,167.85  |
| 三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）                     | -11,601,821.86                             | -      | 35,913,467.73  | 24,311,645.87   |
| （一）、综合收益总额                               | -                                          | -      | 40,405,009.66  | 40,405,009.66   |
| （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）      | -11,601,821.86                             | -      | -4,491,541.93  | -16,093,363.79  |
| 其中：1. 基金申购款                              | 100,549,122.83                             | -      | 22,381,022.13  | 122,930,144.96  |
| 2. 基金赎回款                                 | -112,150,944.69                            | -      | -26,872,564.06 | -139,023,508.75 |
| （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                                | 157,565,531.30                             | -      | 60,267,282.42  | 217,832,813.72  |
| 项目                                       | 上年度可比期间<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                                | 261,981,928.04                             | -      | -36,242,489.58 | 225,739,438.46  |

|                                          |                 |   |                |                 |
|------------------------------------------|-----------------|---|----------------|-----------------|
| 二、本期期初净资产                                | 261,981,928.04  | - | -36,242,489.58 | 225,739,438.46  |
| 三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）                     | -50,274,561.42  | - | 10,656,844.54  | -39,617,716.88  |
| （一）、综合收益总额                               | -               | - | 7,309,272.42   | 7,309,272.42    |
| （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）      | -50,274,561.42  | - | 3,347,572.12   | -46,926,989.30  |
| 其中：1. 基金申购款                              | 139,221,862.32  | - | -24,307,507.45 | 114,914,354.87  |
| 2. 基金赎回款                                 | -189,496,423.74 | - | 27,655,079.57  | -161,841,344.17 |
| （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                                | 211,707,366.62  | - | -25,585,645.04 | 186,121,721.58  |

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

大成深证成份交易型开放式指数证券投资基金(以下简称“本基金”)经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2015]450号《关于准予大成深证成份交易型开放式指数证券投资基金注册的批复》注册，由大成基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《大成深证成份交易型开放式指数证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型的交易型开放式基金，存续期限不定，首次设立募集不包括认购资金利息共募集2,384,454,750.00元(含募集股票市值)，业经普华永道中天会计师事务所有限公司普华永道中天

验字(2015)第 634 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《大成深证成份交易型开放式指数证券投资基金基金合同》于 2015 年 6 月 5 日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为 2,384,588,069.00 份基金份额,其中认购资金利息折合 133,319.00 份基金份额。本基金的基金管理人为大成基金管理有限公司,基金托管人为中国农业银行股份有限公司。

经深圳证券交易所(以下简称“深交所”)深证上[2015]330 号文审核同意,本基金于 2015 年 7 月 8 日在深交所挂牌交易。根据《大成深证成份交易型开放式指数证券投资基金招募说明书》和《关于大成深证成份交易型开放式指数证券投资基金基金折算结果的公告》的有关规定,本基金于 2015 年 6 月 29 日进行了基金份额折算,折算比例为 1: 0.06565125,并于 2015 年 6 月 30 日进行了变更登记。根据大成基金管理有限公司于 2021 年 10 月 22 日发布的《大成深证成份交易型开放式指数证券投资基金基金份额拆分结果的公告》,本基金于 2021 年 10 月 21 日进行了基金份额拆分并进行了变更登记,拆分比例为 11.817461846。根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《大成深证成份交易型开放式指数证券投资基金基金合同》的有关规定,本基金的投资目标是紧密跟踪标的指数,追求与标的指数相似的投资回报;主要投资范围为标的指数的成份股(含存托凭证)和备选成份股(含存托凭证),该部分资产比例不低于基金资产净值的 95%;本基金还可投资于国内依法发行上市的非标的指数成份股(包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票)、存托凭证、债券(含中期票据)、货币市场工具、银行存款、权证、股指期货、资产支持证券以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具(但须符合中国证监会的相关规定)。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 0.2%,年跟踪误差不超过 2%。

本基金的业绩比较基准为:深证成份指数收益率。

#### 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》、《公开募集证券投资基金信息披露内容与格式准则第 2 号——定期报告的内容与格式》、《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>》,中国证券投资基金业协会发布的《公开募集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 2026 年 6 月 30 日的财务状况以及 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日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

根据中华人民共和国主席令第四十一号《中华人民共和国增值税法》、中华人民共和国国务院令 826 号《中华人民共和国增值税法实施条例》及财政部、税务总局公告 2026 年第 10 号《关于增值税法施行后增值税优惠政策衔接事项的公告》的规定，资管产品运营过程中发生的应税交易，资管产品管理人为纳税人；自 2026 年 1 月 1 日至 2027 年 12 月 31 日，资管产品管理人运营契约制资管产品过程中发生的增值税应税行为，可以选择适用简易计税方法，按照 3% 的规定征收率计算缴纳增值税，公募证券投资基金（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、债券取得的收入及金融同业往来利息收入免征增值税，金融同业往来利息收入包括金融机构与人民银行所发生的资金往来业务、银行联行往来业务、金融机构间的资金往来业务，以及金融机构开展同业存款、同业借款、同业代付、买断式买入返售金融商品、质押式买入返售金融商品、同业存单，取得的利息收入；取得存款利息收入不属于应税交易，不征收增值税。

根据财政部、税务总局公告 2025 年第 4 号《关于国债等债券利息收入增值税政策的公告》的规定，自 2025 年 8 月 8 日起，对在该日期之后（含当日）新发行的国债、地方政府债券、金融债券的利息收入，恢复征收增值税。对在该日期之前已发行的国债、地方政府债券、金融债券（包含在 2025 年 8 月 8 日之后续发行的部分）的利息收入，继续免征增值税直至债券到期。

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《财政部 国家税务总局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《财政部 国家税务总局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《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《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》的规定，自2013年1月1日起，证券投资基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，持股期限在1个月以内（含1个月）的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在1个月以上至1年（含1年）的，暂减按50%计入应纳税所得额；持股期限超过1年的，暂减按25%计入应纳税所得额。上述所得统一适用20%的税率计征个人所得税。

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

## （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《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《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>2026 年 6 月 30 日 |
|----------------|------------------------|
| 活期存款           | 2,512,277.15           |
| 等于：本金          | 2,512,061.93           |
| 加：应计利息         | 215.22                 |
| 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             | 2,512,277.15           |

### 6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

| 项目            |       | 本期末<br>2026 年 6 月 30 日 |      |                |               |
|---------------|-------|------------------------|------|----------------|---------------|
|               |       | 成本                     | 应计利息 | 公允价值           | 公允价值变动        |
| 股票            |       | 172,815,848.30         | -    | 215,692,038.84 | 42,876,190.54 |
| 贵金属投资-金交所黄金合约 |       | -                      | -    | -              | -             |
| 债券            | 交易所市场 | 3,400.00               | 0.57 | 14,946.29      | 11,545.72     |
|               | 银行间市场 | -                      | -    | -              | -             |
|               | 合计    | 3,400.00               | 0.57 | 14,946.29      | 11,545.72     |
| 资产支持证券        |       | -                      | -    | -              | -             |
| 基金            |       | -                      | -    | -              | -             |
| 其他            |       | -                      | -    | -              | -             |
| 合计            |       | 172,819,248.30         | 0.57 | 215,706,985.13 | 42,887,736.26 |

### 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 |
|----|-----|
|----|-----|

|             | 2026 年 6 月 30 日 |
|-------------|-----------------|
| 应付券商交易单元保证金 | -               |
| 应付赎回费       | -               |
| 应付证券出借违约金   | -               |
| 应付交易费用      | 2,745.08        |
| 其中：交易所市场    | 2,745.08        |
| 银行间市场       | -               |
| 应付利息        | -               |
| 应退退补款       | 16,592.19       |
| 预提费用        | 81,822.86       |
| 合计          | 101,160.13      |

#### 6.4.7.10 实收基金

金额单位：人民币元

| 项目            | 本期                              |                 |
|---------------|---------------------------------|-----------------|
|               | 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日 |                 |
|               | 基金份额（份）                         | 账面金额            |
| 上年度末          | 131,229,922.00                  | 169,167,353.16  |
| 本期申购          | 78,000,000.00                   | 100,549,122.83  |
| 本期赎回（以“-”号填列） | -87,000,000.00                  | -112,150,944.69 |
| 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           | 122,229,922.00                  | 157,565,531.30  |

#### 6.4.7.11 其他综合收益

无。

#### 6.4.7.12 未分配利润

单位：人民币元

| 项目             | 已实现部分          | 未实现部分          | 未分配利润合计        |
|----------------|----------------|----------------|----------------|
| 上年度末           | 57,631,632.06  | -33,277,817.37 | 24,353,814.69  |
| 本期期初           | 57,631,632.06  | -33,277,817.37 | 24,353,814.69  |
| 本期利润           | 25,670,118.18  | 14,734,891.48  | 40,405,009.66  |
| 本期基金份额交易产生的变动数 | -4,642,718.74  | 151,176.81     | -4,491,541.93  |
| 其中：基金申购款       | 40,651,898.46  | -18,270,876.33 | 22,381,022.13  |
| 基金赎回款          | -45,294,617.20 | 18,422,053.14  | -26,872,564.06 |
| 本期已分配利润        | -              | -              | -              |
| 本期末            | 78,659,031.50  | -18,391,749.08 | 60,267,282.42  |

#### 6.4.7.13 存款利息收入

单位：人民币元

| 项目        | 本期<br>2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日 |
|-----------|---------------------------------------|
| 活期存款利息收入  | 4,202.96                              |
| 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 | 24.27                                 |
| 其他        | 197.04                                |
| 合计        | 4,424.27                              |

#### 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>2026年1月1日至2026年6月30日 |
|------------------|----------------------------|
| 股票投资收益——买卖股票差价收入 | 2,767,053.17               |
| 股票投资收益——赎回差价收入   | 22,179,266.90              |
| 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               | 24,946,320.07              |

##### 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>2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日 |
|------------|---------------------------------------|
| 卖出股票成交总额   | 14,483,092.79                         |
| 减：卖出股票成本总额 | 11,703,788.68                         |
| 减：交易费用     | 12,250.94                             |
| 买卖股票差价收入   | 2,767,053.17                          |

##### 6.4.7.14.3 股票投资收益——赎回差价收入

单位：人民币元

| 项目          | 本期<br>2026年1月1日至2026年6月30日 |
|-------------|----------------------------|
| 赎回基金份额对价总额  | 139,023,508.75             |
| 减：现金支付赎回款总额 | 186,460.75                 |
| 减：赎回股票成本总额  | 116,657,781.10             |
| 减：交易费用      | —                          |
| 赎回差价收入      | 22,179,266.90              |

##### 6.4.7.14.4 股票投资收益——申购差价收入

无。

##### 6.4.7.14.5 股票投资收益——证券出借差价收入

无。

**6.4.7.15 基金投资收益**

无。

**6.4.7.16 债券投资收益****6.4.7.16.1 债券投资收益项目构成**

单位：人民币元

| 项目                           | 本期<br>2026年1月1日至2026年6月30日 |
|------------------------------|----------------------------|
| 债券投资收益——利息收入                 | 0.57                       |
| 债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入 | —                          |
| 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                           | 0.57                       |

**6.4.7.16.2 债券投资收益——买卖债券差价收入**

无。

**6.4.7.16.3 债券投资收益——赎回差价收入**

无。

**6.4.7.16.4 债券投资收益——申购差价收入**

无。

**6.4.7.17 资产支持证券投资收益****6.4.7.17.1 资产支持证券投资收益项目构成**

无。

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

无。

**6.4.7.17.3 资产支持证券投资收益——赎回差价收入**

无。

**6.4.7.17.4 资产支持证券投资收益——申购差价收入**

无。

**6.4.7.18 贵金属投资收益****6.4.7.18.1 贵金属投资收益项目构成**

无。

**6.4.7.18.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入**

无。

## 6.4.7.18.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

无。

## 6.4.7.18.4 贵金属投资收益——申购差价收入

无。

## 6.4.7.19 衍生工具收益

## 6.4.7.19.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

无。

## 6.4.7.19.2 衍生工具收益——其他投资收益

无。

## 6.4.7.20 股利收益

单位：人民币元

| 项目            | 本期<br>2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日 |
|---------------|---------------------------------------|
| 股票投资产生的股利收益   | 1,390,180.29                          |
| 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            | 1,390,180.29                          |

## 6.4.7.21 公允价值变动收益

单位：人民币元

| 项目名称                   | 本期<br>2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日 |
|------------------------|---------------------------------------|
| 1. 交易性金融资产             | 14,734,891.48                         |
| 股票投资                   | 14,723,345.76                         |
| 债券投资                   | 11,545.72                             |
| 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                     | 14,734,891.48                         |

## 6.4.7.22 其他收入

单位：人民币元

| 项目 | 本期<br>2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日 |
|----|---------------------------------------|
|----|---------------------------------------|

|         |           |
|---------|-----------|
| 基金赎回费收入 | -         |
| 替代损益    | 20,725.51 |
| 合计      | 20,725.51 |

注：替代损益（如有）是指投资者采用可以现金替代或退补现金替代方式申购（赎回）本基金时，补入（卖出）被替代成分证券的实际买入成本（实际卖出金额）与申购（赎回）确认日估值的差额或强制退款的被替代成分证券在强制退款计算日与申购（赎回）确认日估值的差额。

#### 6.4.7.23 信用减值损失

无。

#### 6.4.7.24 其他费用

单位：人民币元

| 项目      | 本期<br>2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日 |
|---------|---------------------------------------|
| 审计费用    | 22,315.49                             |
| 信息披露费   | 59,507.37                             |
| 证券出借违约金 | -                                     |
| 银行划款手续费 | 295.00                                |
| 合计      | 82,117.86                             |

#### 6.4.7.25 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、关联关系

#### 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           |
| 中国农业银行股份有限公司（“中国农业银行”） | 基金托管人           |
| 光大证券股份有限公司（“光大证券”）     | 基金管理人的股东、基金销售机构 |

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

## 6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

## 6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

## 6.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

| 关联方名称 | 本期<br>2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日 |                          | 上年度可比期间<br>2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日 |                          |
|-------|---------------------------------------|--------------------------|--------------------------------------------|--------------------------|
|       | 成交金额                                  | 占当期股票<br>成交总额的<br>比例 (%) | 成交金额                                       | 占当期股票<br>成交总额的<br>比例 (%) |
| 光大证券  | 30,519,366.39                         | 100.00                   | 29,082,997.95                              | 100.00                   |

## 6.4.10.1.2 债券交易

金额单位：人民币元

| 关联方名称 | 本期<br>2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日 |                          | 上年度可比期间<br>2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日 |                          |
|-------|---------------------------------------|--------------------------|--------------------------------------------|--------------------------|
|       | 成交金额                                  | 占当期债券<br>成交总额的<br>比例 (%) | 成交金额                                       | 占当期债券<br>成交总额的<br>比例 (%) |
| 光大证券  | -                                     | -                        | 131,885.11                                 | 100.00                   |

## 6.4.10.1.3 债券回购交易

无。

## 6.4.10.1.4 基金交易

无。

## 6.4.10.1.5 权证交易

无。

## 6.4.10.1.6 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>2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日      |                |          |                  |
|-------|--------------------------------------------|----------------|----------|------------------|
|       | 当期佣金                                       | 占当期佣金总量的比例 (%) | 期末应付佣金余额 | 占期末应付佣金总额的比例 (%) |
| 光大证券  | 3,051.71                                   | 100.00         | 2,745.08 | 100.00           |
| 关联方名称 | 上年度可比期间<br>2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日 |                |          |                  |
|       | 当期佣金                                       | 占当期佣金总量的比例 (%) | 期末应付佣金余额 | 占期末应付佣金总额的比例 (%) |
| 光大证券  | 2,908.42                                   | 100.00         | 2,255.44 | 100.00           |

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>2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6<br>月 30 日 | 上年度可比期间<br>2025 年 1 月 1 日至 2025 年<br>6 月 30 日 |
|------------------|------------------------------------------|-----------------------------------------------|
| 当期发生的基金应支付的管理费   | 507,845.59                               | 512,304.63                                    |
| 其中：应支付销售机构的客户维护费 | 171,830.34                               | 114,673.54                                    |
| 应支付基金管理人的净管理费    | 336,015.25                               | 397,631.09                                    |

注：本基金管理费年费率为 0.50%，每日计提，按月支付。其计算公式为：

日管理费 = 前一日基金资产净值 × 管理费年费率 / 当年天数。

##### 6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

| 项目             | 本期<br>2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6<br>月 30 日 | 上年度可比期间<br>2025 年 1 月 1 日至 2025 年<br>6 月 30 日 |
|----------------|------------------------------------------|-----------------------------------------------|
| 当期发生的基金应支付的托管费 | 101,569.08                               | 102,461.01                                    |

注：本基金托管费年费率为 0.10%，每日计提，按月支付。其计算公式为：

日托管费 = 前一日基金资产净值 × 托管费年费率 / 当年天数。

##### 6.4.10.2.3 销售服务费

无。

##### 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>2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日 |          | 上年度可比期间<br>2025 年 1 月 1 日至 2025 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 | 2,512,277.15                          | 4,202.96 | 2,157,760.21                               | 8,635.79 |

注：本基金由基金托管人保管的银行存款，按银行约定利率计息。

6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

无。

6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

无。

6.4.11 利润分配情况

无。

6.4.12 期末（2026 年 6 月 30 日）本基金持有的流通受限证券

6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

| 6.4.12.1.1 受限证券类别：股票 |      |                 |      |        |       |        |          |          |          |    |
|----------------------|------|-----------------|------|--------|-------|--------|----------|----------|----------|----|
| 证券代码                 | 证券名称 | 成功认购日           | 受限期  | 流通受限类型 | 认购价格  | 期末估值单价 | 数量（单位：股） | 期末成本总额   | 期末估值总额   | 备注 |
| 001220               | 世盟股份 | 2026 年 1 月 27 日 | 6 个月 | 新股锁定   | 28.00 | 27.78  | 52       | 1,456.00 | 1,444.56 | -  |
| 001237               | 惠康   | 2026 年 5        | 6 个月 | 新股锁定   | 53.26 | 58.74  | 91       | 4,846.66 | 5,345.34 | -  |

|        |       |                 |          |       |       |       |       |           |           |   |
|--------|-------|-----------------|----------|-------|-------|-------|-------|-----------|-----------|---|
|        | 科技    | 月 15 日          |          |       |       |       |       |           |           |   |
| 001248 | 华润新能源 | 2026 年 6 月 24 日 | 1 个月内(含) | 新股未上市 | 10.11 | 10.11 | 2,910 | 29,420.10 | 29,420.10 | - |
| 001248 | 华润新能源 | 2026 年 6 月 24 日 | 6 个月     | 新股未上市 | 10.11 | 10.11 | 6,790 | 68,646.90 | 68,646.90 | - |
| 001257 | 盛龙股份  | 2026 年 3 月 24 日 | 6 个月     | 新股锁定  | 7.82  | 20.74 | 875   | 6,842.50  | 18,147.50 | - |
| 001312 | 福恩股份  | 2026 年 4 月 14 日 | 6 个月     | 新股锁定  | 18.38 | 16.78 | 79    | 1,452.02  | 1,325.62  | - |
| 001365 | 天海电子  | 2026 年 5 月 11 日 | 6 个月     | 新股锁定  | 27.19 | 31.31 | 213   | 5,791.47  | 6,669.03  | - |
| 001393 | 维通利   | 2026 年 5 月 8 日  | 6 个月     | 新股锁定  | 30.38 | 38.99 | 155   | 4,708.90  | 6,043.45  | - |
| 001399 | 惠科股份  | 2026 年 6 月 16 日 | 6 个月     | 新股锁定  | 10.12 | 27.73 | 1,096 | 11,091.52 | 30,392.08 | - |
| 301513 | 尚水智能  | 2026 年 4 月 10 日 | 6 个月     | 新股锁定  | 26.66 | 50.96 | 138   | 3,679.08  | 7,032.48  | - |
| 301531 | 春光集团  | 2026 年 4 月 28 日 | 6 个月     | 新股锁定  | 13.30 | 51.56 | 242   | 3,218.60  | 12,477.52 | - |
| 301599 | 理奇智能  | 2026 年 4 月 22 日 | 6 个月     | 新股锁定  | 13.91 | 32.47 | 258   | 3,588.78  | 8,377.26  | - |

|        |      |             |     |      |       |        |     |           |            |   |
|--------|------|-------------|-----|------|-------|--------|-----|-----------|------------|---|
| 301666 | 大普微  | 2026年4月8日   | 6个月 | 新股锁定 | 46.08 | 463.33 | 349 | 16,081.92 | 161,702.17 | - |
| 301669 | 高特电子 | 2026年6月2日   | 6个月 | 新股锁定 | 7.08  | 28.40  | 405 | 2,867.40  | 11,502.00  | - |
| 301680 | 固德电材 | 2026年2月27日  | 6个月 | 新股锁定 | 58.00 | 112.16 | 64  | 3,712.00  | 7,178.24   | - |
| 301682 | 宏明电子 | 2026年3月18日  | 6个月 | 新股锁定 | 69.66 | 160.06 | 205 | 14,280.30 | 32,812.30  | - |
| 301683 | 慧谷新材 | 2026年3月24日  | 6个月 | 新股锁定 | 78.38 | 121.77 | 46  | 3,605.48  | 5,601.42   | - |
| 301687 | 新广益  | 2025年12月24日 | 6个月 | 新股锁定 | 21.93 | 77.78  | 173 | 3,793.89  | 13,455.94  | - |
| 301696 | 三瑞智能 | 2026年3月31日  | 6个月 | 新股锁定 | 24.68 | 86.80  | 144 | 3,553.92  | 12,499.20  | - |

#### 6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

无。

#### 6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

##### 6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

无。

##### 6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

无。

#### 6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

无。

### 6.4.13 金融工具风险及管理

#### 6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金是指数型基金，紧密跟踪深证成份指数，具有和标的指数所代表的股票市场相似的风险收益特征，属于证券投资基金中风险较高、收益较高的品种。本基金以标的指数成份股、备选成份股为主要投资对象。本基金采用完全复制法，跟踪深证成份指数，以完全按照标的指数成份股组成及其权重构建基金股票投资组合为原则，进行被动式指数化投资。股票在投资组合中的权重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。但在因特殊情况（如流动性不足等）导致无法获得足够数量的股票时，基金管理人将搭配使用其他合理方法进行适当的替代，力求与标的指数的跟踪偏离度与跟踪误差的最小化。

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同责任，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，本基金持有的除国债、央行票据和政策性金融债以外的债券占基金资产净值的比例为 0.01%(上年度末：本基金无债券投资)。

#### 6.4.13.3 流动性风险

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

##### 6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

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

本基金主要投资于交易所及银行间市场内交易的证券，除在附注“期末本基金持有的流通受限证券”中列示的部分基金资产流通暂时受限制外(如有)，其余均能及时变现。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券资产的公允价值。除附注“期末债券正回购交易中作为抵押的债券”中列示的卖出回购金融资产款余额(如有)将在 1 个月内到期且计息外，本基金于资产负债表日所持有的金融负债的合同约定剩余到期日均为一年以内且一般不计息，可赎回基金份额净值无固定到期日且不计息，因此账面余额一般即为未折现的合约到期现金流量。本报告期内，本基金未发生重大流动性风险事件。

#### 6.4.13.4 市场风险

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动

而发生波动的风险，包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

#### 6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指金融工具的公允价值或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。

本基金持有及承担的大部分金融资产和金融负债不计息，因此本基金的收入及经营活动的现金流量在很大程度上独立于市场利率变化。本基金持有的利率敏感性资产主要为银行存款和存出保证金等。

##### 6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

| 本期末<br>2026 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                     | 2,512,277.15 | -     | -         | -              | 2,512,277.15   |
| 结算备付金                    | 5,693.83     | -     | -         | -              | 5,693.83       |
| 存出保证金                    | 87,424.99    | -     | -         | -              | 87,424.99      |
| 交易性金融资产                  | -            | -     | 14,946.29 | 215,692,038.84 | 215,706,985.13 |
| 资产总计                     | 2,605,395.97 | -     | 14,946.29 | 215,692,038.84 | 218,312,381.10 |
| 负债                       |              |       |           |                |                |
| 应付管理人报酬                  | -            | -     | -         | 85,754.32      | 85,754.32      |
| 应付托管费                    | -            | -     | -         | 17,150.86      | 17,150.86      |
| 应付清算款                    | -            | -     | -         | 275,502.07     | 275,502.07     |
| 其他负债                     | -            | -     | -         | 101,160.13     | 101,160.13     |
| 负债总计                     | -            | -     | -         | 479,567.38     | 479,567.38     |
| 利率敏感度缺口                  | 2,605,395.97 | -     | 14,946.29 | 215,212,471.46 | 217,832,813.72 |
| 上年度末<br>2025 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                     | 2,673,057.15 | -     | -         | -              | 2,673,057.15   |
| 存出保证金                    | 109,249.00   | -     | -         | -              | 109,249.00     |
| 交易性金融资产                  | -            | -     | -         | 191,046,218.24 | 191,046,218.24 |
| 应收清算款                    | -            | -     | -         | 15,200.49      | 15,200.49      |
| 资产总计                     | 2,782,306.15 | -     | -         | 191,061,418.73 | 193,843,724.88 |
| 负债                       |              |       |           |                |                |
| 应付管理人报酬                  | -            | -     | -         | 89,350.25      | 89,350.25      |
| 应付托管费                    | -            | -     | -         | 17,870.06      | 17,870.06      |
| 应付清算款                    | -            | -     | -         | 48,654.73      | 48,654.73      |

|         |              |   |   |                |                |
|---------|--------------|---|---|----------------|----------------|
| 其他负债    | -            | - | - | 166,681.99     | 166,681.99     |
| 负债总计    | -            | - | - | 322,557.03     | 322,557.03     |
| 利率敏感度缺口 | 2,782,306.15 | - | - | 190,738,861.70 | 193,521,167.85 |

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，本基金持有的交易性债券投资和交易性资产支持证券投资公允价值占净资产的比例为 0.01%(上年度末：无)，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。本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无重大外汇风险。

#### 6.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市的股票和债券，所面临的其他价格风险来源于单个证券发行主体自身经营情况或特殊事项的影响，也可能来源于证券市场整体波动的影响。

本基金采用完全复制法跟踪深证成份指数，以完全按照标的指数成份股组成及其权重构建基金股票投资组合为原则，通过指数化分散投资降低其他价格风险。本基金投资组合中，深证成份指数成份股和备选成份股股票投资比例不低于基金资产净值的 95%。此外，本基金的基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控，定期运用多种定量方法对基金进行风险度量，包括 VaR(Value at Risk) 指标等来测试本基金面临的潜在价格风险，及时可靠地对风险进行跟踪和控制。

#### 6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

| 项目           | 本期末<br>2026 年 6 月 30 日 |                   | 上年度末<br>2025 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 | 215,692,038.84         | 99.02             | 191,046,218.24           | 98.72             |
| 交易性金融资产—基金投资 | -                      | -                 | -                        | -                 |
| 交易性金融资产—债券投资 | 14,946.29              | 0.01              | -                        | -                 |

|               |                |       |                |       |
|---------------|----------------|-------|----------------|-------|
| 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            | 215,706,985.13 | 99.02 | 191,046,218.24 | 98.72 |

#### 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（2026年6月30日）             | 上年度末（2025年12月31日） |
|    | 业绩比较基准上升5%           | 10,804,643.07               | 9,526,377.39      |
|    | 业绩比较基准下降5%           | -10,804,643.07              | -9,526,377.39     |

#### 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>2026年6月30日 | 上年度末<br>2025年12月31日 |
|---------------|-------------------|---------------------|
| 第一层次          | 215,266,912.02    | 190,180,321.28      |
| 第二层次          | 98,067.00         | 644,665.80          |
| 第三层次          | 342,006.11        | 221,231.16          |

|    |                |                |
|----|----------------|----------------|
| 合计 | 215,706,985.13 | 191,046,218.24 |
|----|----------------|----------------|

#### 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              | 215,692,038.84 | 98.80         |
|    | 其中：股票             | 215,692,038.84 | 98.80         |
| 2  | 基金投资              | -              | -             |
| 3  | 固定收益投资            | 14,946.29      | 0.01          |
|    | 其中：债券             | 14,946.29      | 0.01          |
|    | 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      | 2,517,970.98   | 1.15          |
| 8  | 其他各项资产            | 87,424.99      | 0.04          |
| 9  | 合计                | 218,312,381.10 | 100.00        |

注：上述股票投资金额包括可退替代款估值增值（如有）。

## 7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

### 7.2.1 报告期末指数投资按行业分类的境内股票投资组合

| 代码 | 行业类别             | 公允价值（元）        | 占基金资产净值比例（%） |
|----|------------------|----------------|--------------|
| A  | 农、林、牧、渔业         | 2,129,381.14   | 0.98         |
| B  | 采矿业              | 2,209,936.12   | 1.01         |
| C  | 制造业              | 179,489,652.47 | 82.40        |
| D  | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | 1,818,454.00   | 0.83         |
| E  | 建筑业              | 303,547.00     | 0.14         |
| F  | 批发和零售业           | 2,207,636.50   | 1.01         |
| G  | 交通运输、仓储和邮政业      | 1,819,311.80   | 0.84         |
| H  | 住宿和餐饮业           | —              | —            |
| I  | 信息传输、软件和信息技术服务业  | 9,445,810.94   | 4.34         |
| J  | 金融业              | 10,607,105.12  | 4.87         |
| K  | 房地产业             | 703,749.43     | 0.32         |
| L  | 租赁和商务服务业         | 1,720,270.78   | 0.79         |
| M  | 科学研究和技术服务业       | 1,112,607.50   | 0.51         |
| N  | 水利、环境和公共设施管理业    | 232,809.06     | 0.11         |
| O  | 居民服务、修理和其他服务业    | —              | —            |
| P  | 教育               | 111,060.00     | 0.05         |
| Q  | 卫生和社会工作          | 615,880.36     | 0.28         |
| R  | 文化、体育和娱乐业        | 724,753.51     | 0.33         |
| S  | 综合               | —              | —            |
|    | 合计               | 215,251,965.73 | 98.82        |

### 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              | 18,147.50  | 0.01         |
| C  | 制造业              | 322,414.05 | 0.15         |
| D  | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | 98,067.00  | 0.05         |
| E  | 建筑业              | —          | —            |
| F  | 批发和零售业           | —          | —            |
| G  | 交通运输、仓储和邮政业      | 1,444.56   | 0.00         |

|   |                 |            |      |
|---|-----------------|------------|------|
| 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      | -          | -    |
| 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              | 440,073.11 | 0.20 |

### 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  | 300308 | 中际旭创  | 9,728   | 12,354,560.00 | 5.67         |
| 2  | 300750 | 宁德时代  | 29,180  | 11,468,031.80 | 5.26         |
| 3  | 300502 | 新易盛   | 13,951  | 8,468,257.00  | 3.89         |
| 4  | 000333 | 美的集团  | 54,007  | 4,079,148.71  | 1.87         |
| 5  | 002371 | 北方华创  | 4,550   | 4,024,748.00  | 1.85         |
| 6  | 002384 | 东山精密  | 14,100  | 3,699,135.00  | 1.70         |
| 7  | 002475 | 立讯精密  | 52,346  | 3,685,158.40  | 1.69         |
| 8  | 000725 | 京东方 A | 363,900 | 3,158,652.00  | 1.45         |
| 9  | 300059 | 东方财富  | 143,338 | 2,921,228.44  | 1.34         |
| 10 | 300274 | 阳光电源  | 16,512  | 2,625,738.24  | 1.21         |
| 11 | 300476 | 胜宏科技  | 6,900   | 2,390,367.00  | 1.10         |
| 12 | 300408 | 三环集团  | 14,000  | 2,336,600.00  | 1.07         |
| 13 | 002463 | 沪电股份  | 15,250  | 2,330,200.00  | 1.07         |
| 14 | 002594 | 比亚迪   | 28,400  | 2,263,480.00  | 1.04         |
| 15 | 300394 | 天孚通信  | 6,992   | 2,116,338.56  | 0.97         |
| 16 | 301308 | 江波龙   | 2,700   | 1,900,260.00  | 0.87         |
| 17 | 000651 | 格力电器  | 47,800  | 1,792,500.00  | 0.82         |

|    |        |        |         |              |      |
|----|--------|--------|---------|--------------|------|
| 18 | 300604 | 长川科技   | 5,100   | 1,741,242.00 | 0.80 |
| 19 | 000988 | 华工科技   | 9,400   | 1,735,334.00 | 0.80 |
| 20 | 001309 | 德明利    | 1,700   | 1,602,930.00 | 0.74 |
| 21 | 000338 | 潍柴动力   | 56,300  | 1,534,175.00 | 0.70 |
| 22 | 000858 | 五粮液    | 20,200  | 1,494,800.00 | 0.69 |
| 23 | 300124 | 汇川技术   | 22,491  | 1,491,828.03 | 0.68 |
| 24 | 002281 | 光迅科技   | 5,500   | 1,413,170.00 | 0.65 |
| 25 | 002415 | 海康威视   | 41,150  | 1,407,330.00 | 0.65 |
| 26 | 002008 | 大族激光   | 8,900   | 1,335,979.00 | 0.61 |
| 27 | 002916 | 深南电路   | 2,839   | 1,299,978.10 | 0.60 |
| 28 | 000063 | 中兴通讯   | 35,400  | 1,281,126.00 | 0.59 |
| 29 | 000100 | TCL 科技 | 213,840 | 1,244,548.80 | 0.57 |
| 30 | 300857 | 协创数据   | 3,584   | 1,218,201.60 | 0.56 |
| 31 | 300433 | 蓝思科技   | 21,659  | 1,162,221.94 | 0.53 |
| 32 | 300475 | 香农芯创   | 3,800   | 1,140,000.00 | 0.52 |
| 33 | 002142 | 宁波银行   | 38,017  | 1,128,724.73 | 0.52 |
| 34 | 000792 | 盐湖股份   | 36,900  | 1,114,011.00 | 0.51 |
| 35 | 002028 | 思源电气   | 6,400   | 1,107,200.00 | 0.51 |
| 36 | 300136 | 信维通信   | 9,020   | 1,075,635.00 | 0.49 |
| 37 | 002050 | 三花智控   | 23,900  | 1,047,537.00 | 0.48 |
| 38 | 300014 | 亿纬锂能   | 16,031  | 1,042,495.93 | 0.48 |
| 39 | 002353 | 杰瑞股份   | 6,700   | 1,021,750.00 | 0.47 |
| 40 | 300223 | 北京君正   | 4,000   | 995,600.00   | 0.46 |
| 41 | 000657 | 中钨高新   | 10,400  | 995,488.00   | 0.46 |
| 42 | 002156 | 通富微电   | 13,100  | 993,897.00   | 0.46 |
| 43 | 300285 | 国瓷材料   | 9,500   | 980,210.00   | 0.45 |
| 44 | 002714 | 牧原股份   | 27,606  | 965,933.94   | 0.44 |
| 45 | 000001 | 平安银行   | 94,100  | 945,705.00   | 0.43 |
| 46 | 300760 | 迈瑞医疗   | 6,800   | 923,644.00   | 0.42 |
| 47 | 002602 | 世纪华通   | 63,900  | 900,990.00   | 0.41 |
| 48 | 300666 | 江丰电子   | 2,400   | 884,640.00   | 0.41 |
| 49 | 002230 | 科大讯飞   | 21,575  | 881,123.00   | 0.40 |
| 50 | 002436 | 兴森科技   | 16,800  | 855,960.00   | 0.39 |
| 51 | 002352 | 顺丰控股   | 26,700  | 834,642.00   | 0.38 |
| 52 | 300054 | 鼎龙股份   | 7,800   | 826,566.00   | 0.38 |
| 53 | 002460 | 赣锋锂业   | 12,490  | 816,846.00   | 0.37 |
| 54 | 000977 | 浪潮信息   | 11,453  | 801,710.00   | 0.37 |
| 55 | 002709 | 天赐材料   | 15,392  | 791,610.56   | 0.36 |
| 56 | 000776 | 广发证券   | 33,700  | 788,580.00   | 0.36 |
| 57 | 300033 | 同花顺    | 3,260   | 785,660.00   | 0.36 |
| 58 | 002938 | 鹏鼎控股   | 7,300   | 769,274.00   | 0.35 |
| 59 | 000021 | 深科技    | 11,966  | 769,054.82   | 0.35 |
| 60 | 002851 | 麦格米特   | 4,600   | 769,028.00   | 0.35 |

|     |        |      |         |            |      |
|-----|--------|------|---------|------------|------|
| 61  | 300498 | 温氏股份 | 62,005  | 763,901.60 | 0.35 |
| 62  | 000425 | 徐工机械 | 94,000  | 760,460.00 | 0.35 |
| 63  | 300757 | 罗博特科 | 1,200   | 742,800.00 | 0.34 |
| 64  | 002428 | 云南锗业 | 6,100   | 733,098.00 | 0.34 |
| 65  | 300548 | 长芯博创 | 2,600   | 722,800.00 | 0.33 |
| 66  | 300567 | 精测电子 | 2,250   | 714,600.00 | 0.33 |
| 67  | 002466 | 天齐锂业 | 11,500  | 705,180.00 | 0.32 |
| 68  | 002080 | 中材科技 | 7,780   | 700,200.00 | 0.32 |
| 69  | 002409 | 雅克科技 | 3,100   | 695,950.00 | 0.32 |
| 70  | 002202 | 金风科技 | 28,736  | 686,790.40 | 0.32 |
| 71  | 000636 | 风华高科 | 9,500   | 686,280.00 | 0.32 |
| 72  | 000938 | 紫光股份 | 23,747  | 685,338.42 | 0.31 |
| 73  | 300661 | 圣邦股份 | 4,629   | 664,168.92 | 0.30 |
| 74  | 002837 | 英维克  | 8,302   | 660,507.12 | 0.30 |
| 75  | 002185 | 华天科技 | 29,274  | 653,102.94 | 0.30 |
| 76  | 000568 | 泸州老窖 | 8,400   | 651,168.00 | 0.30 |
| 77  | 300442 | 润泽科技 | 7,800   | 647,946.00 | 0.30 |
| 78  | 002049 | 紫光国微 | 7,280   | 646,100.00 | 0.30 |
| 79  | 300395 | 菲利华  | 4,800   | 641,904.00 | 0.29 |
| 80  | 002484 | 江海股份 | 6,100   | 640,500.00 | 0.29 |
| 81  | 002241 | 歌尔股份 | 28,100  | 633,093.00 | 0.29 |
| 82  | 002600 | 领益智造 | 35,300  | 612,102.00 | 0.28 |
| 83  | 300346 | 南大光电 | 6,596   | 611,119.40 | 0.28 |
| 84  | 300390 | 天华新能 | 6,380   | 596,593.80 | 0.27 |
| 85  | 002407 | 多氟多  | 11,720  | 588,695.60 | 0.27 |
| 86  | 002179 | 中航光电 | 12,724  | 587,848.80 | 0.27 |
| 87  | 301526 | 国际复材 | 12,400  | 578,708.00 | 0.27 |
| 88  | 002138 | 顺络电子 | 7,800   | 570,180.00 | 0.26 |
| 89  | 300620 | 光库科技 | 1,500   | 567,300.00 | 0.26 |
| 90  | 000408 | 藏格矿业 | 8,100   | 561,492.00 | 0.26 |
| 91  | 300058 | 蓝色光标 | 40,186  | 552,959.36 | 0.25 |
| 92  | 002625 | 光启技术 | 17,940  | 543,940.80 | 0.25 |
| 93  | 002027 | 分众传媒 | 112,288 | 543,473.92 | 0.25 |
| 94  | 000630 | 铜陵有色 | 84,200  | 535,512.00 | 0.25 |
| 95  | 300672 | 国科微  | 1,800   | 531,000.00 | 0.24 |
| 96  | 300373 | 扬杰科技 | 3,300   | 518,859.00 | 0.24 |
| 97  | 000807 | 云铝股份 | 23,200  | 513,648.00 | 0.24 |
| 98  | 300037 | 新宙邦  | 5,460   | 506,961.00 | 0.23 |
| 99  | 002273 | 水晶光电 | 14,214  | 504,312.72 | 0.23 |
| 100 | 300450 | 先导智能 | 12,300  | 500,856.00 | 0.23 |
| 101 | 002422 | 科伦药业 | 12,800  | 493,056.00 | 0.23 |
| 102 | 300751 | 迈为股份 | 1,744   | 492,610.24 | 0.23 |
| 103 | 000426 | 兴业银锡 | 14,900  | 491,104.00 | 0.23 |

|     |        |        |        |            |      |
|-----|--------|--------|--------|------------|------|
| 104 | 002001 | 新 和 成  | 17,217 | 489,307.14 | 0.22 |
| 105 | 301511 | 德福科技   | 3,400  | 489,090.00 | 0.22 |
| 106 | 000960 | 锡业股份   | 10,621 | 453,410.49 | 0.21 |
| 107 | 002648 | 卫星化学   | 19,262 | 452,464.38 | 0.21 |
| 108 | 301217 | 铜冠铜箔   | 2,700  | 445,689.00 | 0.20 |
| 109 | 300570 | 太辰光    | 1,800  | 444,078.00 | 0.20 |
| 110 | 301377 | 鼎泰高科   | 800    | 440,720.00 | 0.20 |
| 111 | 002812 | 恩捷股份   | 6,570  | 439,598.70 | 0.20 |
| 112 | 002126 | 银轮股份   | 8,700  | 433,260.00 | 0.20 |
| 113 | 300782 | 卓胜微    | 3,953  | 433,169.74 | 0.20 |
| 114 | 001389 | 广合科技   | 1,800  | 427,050.00 | 0.20 |
| 115 | 000066 | 中国长城   | 22,304 | 424,891.20 | 0.20 |
| 116 | 000831 | 中国稀土   | 7,600  | 421,724.00 | 0.19 |
| 117 | 002738 | 中矿资源   | 7,080  | 417,649.20 | 0.19 |
| 118 | 002850 | 科达利    | 2,200  | 416,460.00 | 0.19 |
| 119 | 300316 | 晶盛机电   | 6,880  | 415,552.00 | 0.19 |
| 120 | 300015 | 爱尔眼科   | 49,774 | 411,133.24 | 0.19 |
| 121 | 000166 | 申万宏源   | 93,060 | 409,464.00 | 0.19 |
| 122 | 002222 | 福晶科技   | 4,400  | 406,032.00 | 0.19 |
| 123 | 300418 | 昆仑万维   | 9,900  | 399,564.00 | 0.18 |
| 124 | 000538 | 云南白药   | 8,360  | 396,013.20 | 0.18 |
| 125 | 002129 | TCL 中环 | 32,650 | 392,453.00 | 0.18 |
| 126 | 300803 | 指南针    | 4,255  | 390,055.85 | 0.18 |
| 127 | 000625 | 长安汽车   | 53,314 | 382,261.38 | 0.18 |
| 128 | 002195 | 岩山科技   | 58,364 | 381,700.56 | 0.18 |
| 129 | 301358 | 湖南裕能   | 5,000  | 379,350.00 | 0.17 |
| 130 | 002821 | 凯莱英    | 2,340  | 379,080.00 | 0.17 |
| 131 | 000157 | 中联重科   | 54,300 | 378,471.00 | 0.17 |
| 132 | 002311 | 海大集团   | 8,480  | 378,292.80 | 0.17 |
| 133 | 000933 | 神火股份   | 17,500 | 371,000.00 | 0.17 |
| 134 | 002558 | 巨人网络   | 13,200 | 363,792.00 | 0.17 |
| 135 | 002532 | 天山铝业   | 33,800 | 362,674.00 | 0.17 |
| 136 | 002340 | 格林美    | 53,620 | 354,428.20 | 0.16 |
| 137 | 002203 | 海亮股份   | 15,500 | 354,175.00 | 0.16 |
| 138 | 002240 | 盛新锂能   | 7,900  | 354,157.00 | 0.16 |
| 139 | 300776 | 帝尔激光   | 1,640  | 352,534.40 | 0.16 |
| 140 | 002236 | 大华股份   | 21,100 | 347,939.00 | 0.16 |
| 141 | 003031 | 中瓷电子   | 1,860  | 335,358.00 | 0.15 |
| 142 | 002074 | 国轩高科   | 12,190 | 335,346.90 | 0.15 |
| 143 | 002261 | 拓维信息   | 11,900 | 333,319.00 | 0.15 |
| 144 | 300438 | 鹏辉能源   | 4,000  | 331,400.00 | 0.15 |
| 145 | 000783 | 长江证券   | 33,900 | 330,525.00 | 0.15 |
| 146 | 002456 | 欧菲光    | 34,900 | 330,154.00 | 0.15 |

|     |        |      |        |            |      |
|-----|--------|------|--------|------------|------|
| 147 | 300236 | 上海新阳 | 2,500  | 328,750.00 | 0.15 |
| 148 | 300339 | 润和软件 | 8,500  | 327,335.00 | 0.15 |
| 149 | 000975 | 山金国际 | 18,977 | 322,609.00 | 0.15 |
| 150 | 002517 | 恺英网络 | 19,600 | 318,500.00 | 0.15 |
| 151 | 300458 | 全志科技 | 8,040  | 317,258.40 | 0.15 |
| 152 | 300017 | 网宿科技 | 24,352 | 316,819.52 | 0.15 |
| 153 | 300759 | 康龙化成 | 10,950 | 316,783.50 | 0.15 |
| 154 | 002493 | 荣盛石化 | 29,125 | 313,093.75 | 0.14 |
| 155 | 300870 | 欧陆通  | 900    | 311,121.00 | 0.14 |
| 156 | 002595 | 豪迈科技 | 6,625  | 308,725.00 | 0.14 |
| 157 | 002736 | 国信证券 | 30,800 | 307,692.00 | 0.14 |
| 158 | 002472 | 双环传动 | 7,400  | 307,174.00 | 0.14 |
| 159 | 300001 | 特锐德  | 8,100  | 306,423.00 | 0.14 |
| 160 | 301611 | 珂玛科技 | 1,700  | 306,119.00 | 0.14 |
| 161 | 002131 | 利欧股份 | 64,234 | 305,111.50 | 0.14 |
| 162 | 002555 | 三七互娱 | 16,100 | 303,807.00 | 0.14 |
| 163 | 003816 | 中国广核 | 77,600 | 303,416.00 | 0.14 |
| 164 | 002245 | 蔚蓝锂芯 | 16,032 | 299,958.72 | 0.14 |
| 165 | 301236 | 软通动力 | 7,050  | 299,272.50 | 0.14 |
| 166 | 002966 | 苏州银行 | 42,700 | 297,192.00 | 0.14 |
| 167 | 000768 | 中航西飞 | 14,500 | 296,960.00 | 0.14 |
| 168 | 300115 | 长盈精密 | 10,536 | 294,375.84 | 0.14 |
| 169 | 300207 | 欣旺达  | 15,200 | 288,648.00 | 0.13 |
| 170 | 301200 | 大族数控 | 800    | 288,520.00 | 0.13 |
| 171 | 002601 | 龙佰集团 | 17,500 | 288,400.00 | 0.13 |
| 172 | 002056 | 横店东磁 | 9,400  | 286,512.00 | 0.13 |
| 173 | 300347 | 泰格医药 | 5,950  | 285,600.00 | 0.13 |
| 174 | 002797 | 第一创业 | 43,120 | 283,298.40 | 0.13 |
| 175 | 000547 | 航天发展 | 14,600 | 279,590.00 | 0.13 |
| 176 | 300088 | 长信科技 | 24,100 | 279,560.00 | 0.13 |
| 177 | 002155 | 湖南黄金 | 11,710 | 279,517.70 | 0.13 |
| 178 | 000301 | 东方盛虹 | 24,400 | 279,380.00 | 0.13 |
| 179 | 301269 | 华大九天 | 2,300  | 274,666.00 | 0.13 |
| 180 | 300456 | 赛微电子 | 6,400  | 271,808.00 | 0.12 |
| 181 | 000060 | 中金岭南 | 35,900 | 271,763.00 | 0.12 |
| 182 | 300454 | 深信服  | 2,800  | 269,360.00 | 0.12 |
| 183 | 002920 | 德赛西威 | 3,300  | 268,950.00 | 0.12 |
| 184 | 301626 | 苏州天脉 | 700    | 268,772.00 | 0.12 |
| 185 | 000703 | 恒逸石化 | 19,766 | 268,224.62 | 0.12 |
| 186 | 301205 | 联特科技 | 800    | 267,280.00 | 0.12 |
| 187 | 002465 | 海格通信 | 20,900 | 266,893.00 | 0.12 |
| 188 | 000895 | 双汇发展 | 11,900 | 266,560.00 | 0.12 |
| 189 | 300024 | 机器人  | 13,566 | 262,230.78 | 0.12 |

|     |        |      |        |            |      |
|-----|--------|------|--------|------------|------|
| 190 | 000893 | 亚钾国际 | 6,400  | 261,696.00 | 0.12 |
| 191 | 300866 | 安克创新 | 2,480  | 259,160.00 | 0.12 |
| 192 | 002304 | 洋河股份 | 6,762  | 257,970.30 | 0.12 |
| 193 | 301536 | 星宸科技 | 2,000  | 257,420.00 | 0.12 |
| 194 | 002128 | 电投能源 | 11,100 | 256,632.00 | 0.12 |
| 195 | 002487 | 大金重工 | 4,400  | 255,068.00 | 0.12 |
| 196 | 000733 | 振华科技 | 4,500  | 254,880.00 | 0.12 |
| 197 | 002432 | 九安医疗 | 3,600  | 254,448.00 | 0.12 |
| 198 | 000034 | 神州数码 | 9,160  | 254,190.00 | 0.12 |
| 199 | 300568 | 星源材质 | 13,542 | 253,506.24 | 0.12 |
| 200 | 002429 | 兆驰股份 | 24,100 | 250,399.00 | 0.11 |
| 201 | 300623 | 捷捷微电 | 5,550  | 249,694.50 | 0.11 |
| 202 | 002414 | 高德红外 | 18,701 | 247,975.26 | 0.11 |
| 203 | 300496 | 中科创达 | 4,000  | 247,160.00 | 0.11 |
| 204 | 300811 | 铂科新材 | 2,600  | 246,714.00 | 0.11 |
| 205 | 002335 | 科华数据 | 5,810  | 246,634.50 | 0.11 |
| 206 | 002271 | 东方雨虹 | 20,753 | 246,338.11 | 0.11 |
| 207 | 000878 | 云南铜业 | 15,300 | 242,964.00 | 0.11 |
| 208 | 002444 | 巨星科技 | 7,800  | 242,580.00 | 0.11 |
| 209 | 001979 | 招商蛇口 | 37,701 | 242,417.43 | 0.11 |
| 210 | 002025 | 航天电器 | 3,170  | 241,617.40 | 0.11 |
| 211 | 001267 | 汇绿生态 | 4,500  | 240,750.00 | 0.11 |
| 212 | 000963 | 华东医药 | 8,495  | 238,879.40 | 0.11 |
| 213 | 002402 | 和而泰  | 9,200  | 237,636.00 | 0.11 |
| 214 | 300432 | 富临精工 | 11,740 | 235,856.60 | 0.11 |
| 215 | 002157 | 正邦科技 | 83,500 | 234,635.00 | 0.11 |
| 216 | 300748 | 金力永磁 | 7,596  | 234,336.60 | 0.11 |
| 217 | 300142 | 沃森生物 | 18,000 | 233,820.00 | 0.11 |
| 218 | 300474 | 景嘉微  | 3,850  | 232,848.00 | 0.11 |
| 219 | 002497 | 雅化集团 | 11,400 | 232,218.00 | 0.11 |
| 220 | 002252 | 上海莱士 | 53,120 | 230,540.80 | 0.11 |
| 221 | 300763 | 锦浪科技 | 2,540  | 229,489.00 | 0.11 |
| 222 | 000423 | 东阿阿胶 | 5,000  | 226,800.00 | 0.10 |
| 223 | 002756 | 永兴材料 | 3,970  | 224,860.80 | 0.10 |
| 224 | 000661 | 长春高新 | 3,360  | 223,776.00 | 0.10 |
| 225 | 000728 | 国元证券 | 29,550 | 221,329.50 | 0.10 |
| 226 | 000002 | 万科 A | 74,700 | 221,112.00 | 0.10 |
| 227 | 002078 | 太阳纸业 | 17,700 | 221,073.00 | 0.10 |
| 228 | 300724 | 捷佳伟创 | 3,100  | 218,860.00 | 0.10 |
| 229 | 002130 | 沃尔核材 | 11,500 | 218,040.00 | 0.10 |
| 230 | 002747 | 埃斯顿  | 5,800  | 216,514.00 | 0.10 |
| 231 | 300012 | 华测检测 | 15,600 | 216,216.00 | 0.10 |
| 232 | 300073 | 当升科技 | 4,500  | 216,180.00 | 0.10 |

|     |        |       |        |            |      |
|-----|--------|-------|--------|------------|------|
| 233 | 002653 | 海思科   | 3,200  | 212,288.00 | 0.10 |
| 234 | 002831 | 裕同科技  | 5,816  | 206,816.96 | 0.09 |
| 235 | 300919 | 中伟新材  | 4,720  | 206,500.00 | 0.09 |
| 236 | 300953 | 震裕科技  | 1,540  | 205,898.00 | 0.09 |
| 237 | 002617 | 露笑科技  | 19,800 | 203,742.00 | 0.09 |
| 238 | 002378 | 章源钨业  | 6,000  | 200,880.00 | 0.09 |
| 239 | 300383 | 光环新网  | 16,000 | 199,040.00 | 0.09 |
| 240 | 000519 | 中兵红箭  | 9,400  | 198,058.00 | 0.09 |
| 241 | 000786 | 北新建材  | 10,900 | 197,181.00 | 0.09 |
| 242 | 002624 | 完美世界  | 15,550 | 193,131.00 | 0.09 |
| 243 | 000617 | 中油资本  | 29,120 | 191,900.80 | 0.09 |
| 244 | 300747 | 锐科激光  | 3,612  | 191,761.08 | 0.09 |
| 245 | 300972 | 万辰集团  | 1,100  | 190,751.00 | 0.09 |
| 246 | 001965 | 招商公路  | 20,800 | 190,528.00 | 0.09 |
| 247 | 000969 | 安泰科技  | 7,700  | 188,958.00 | 0.09 |
| 248 | 300558 | 贝达药业  | 2,900  | 188,703.00 | 0.09 |
| 249 | 002716 | 湖南白银  | 23,200 | 187,688.00 | 0.09 |
| 250 | 300677 | 英科医疗  | 4,780  | 187,232.60 | 0.09 |
| 251 | 300679 | 电连技术  | 3,100  | 185,969.00 | 0.09 |
| 252 | 302132 | 中航成飞  | 3,100  | 180,792.00 | 0.08 |
| 253 | 002064 | 华峰化学  | 19,000 | 180,310.00 | 0.08 |
| 254 | 000559 | 万向钱潮  | 13,928 | 180,089.04 | 0.08 |
| 255 | 300628 | 亿联网络  | 5,290  | 178,907.80 | 0.08 |
| 256 | 000623 | 吉林敖东  | 10,020 | 177,654.60 | 0.08 |
| 257 | 002673 | 西部证券  | 27,366 | 177,605.34 | 0.08 |
| 258 | 300102 | 乾照光电  | 6,800  | 177,072.00 | 0.08 |
| 259 | 002180 | 奔图科技  | 10,800 | 176,688.00 | 0.08 |
| 260 | 002044 | 美年健康  | 34,904 | 175,567.12 | 0.08 |
| 261 | 300699 | 光威复材  | 6,084  | 174,306.60 | 0.08 |
| 262 | 300251 | 光线传媒  | 15,680 | 173,891.20 | 0.08 |
| 263 | 300487 | 蓝晓科技  | 2,950  | 173,607.50 | 0.08 |
| 264 | 300255 | 常山药业  | 7,400  | 173,308.00 | 0.08 |
| 265 | 002294 | 信立泰   | 5,400  | 172,206.00 | 0.08 |
| 266 | 002065 | 东华软件  | 24,100 | 172,074.00 | 0.08 |
| 267 | 000958 | 电投产融  | 30,400 | 171,456.00 | 0.08 |
| 268 | 000766 | 通化金马  | 8,800  | 170,720.00 | 0.08 |
| 269 | 001203 | 大中矿业  | 5,700  | 170,715.00 | 0.08 |
| 270 | 000750 | 国海证券  | 46,365 | 170,623.20 | 0.08 |
| 271 | 002223 | 鱼跃医疗  | 6,630  | 170,125.80 | 0.08 |
| 272 | 301171 | 易点天下  | 5,000  | 169,800.00 | 0.08 |
| 273 | 000032 | 深桑达 A | 6,800  | 169,660.00 | 0.08 |
| 274 | 001696 | 宗申动力  | 8,100  | 168,561.00 | 0.08 |
| 275 | 300832 | 新产业   | 4,000  | 168,000.00 | 0.08 |

|     |        |       |        |            |      |
|-----|--------|-------|--------|------------|------|
| 276 | 000683 | 博源化工  | 29,100 | 167,616.00 | 0.08 |
| 277 | 000039 | 中集集团  | 20,540 | 166,579.40 | 0.08 |
| 278 | 000415 | 渤海租赁  | 40,800 | 166,056.00 | 0.08 |
| 279 | 002739 | 儒意电影  | 17,200 | 165,120.00 | 0.08 |
| 280 | 002318 | 久立特材  | 6,900  | 164,910.00 | 0.08 |
| 281 | 002085 | 万丰奥威  | 14,856 | 164,753.04 | 0.08 |
| 282 | 002176 | 江特电机  | 16,400 | 164,164.00 | 0.08 |
| 283 | 300002 | 神州泰岳  | 21,000 | 164,010.00 | 0.08 |
| 284 | 000887 | 中鼎股份  | 9,100  | 162,799.00 | 0.07 |
| 285 | 002506 | 协鑫集成  | 51,100 | 162,498.00 | 0.07 |
| 286 | 000983 | 山西焦煤  | 28,010 | 162,458.00 | 0.07 |
| 287 | 002459 | 晶澳科技  | 20,032 | 162,259.20 | 0.07 |
| 288 | 000970 | 中科三环  | 10,645 | 161,697.55 | 0.07 |
| 289 | 300627 | 华测导航  | 5,680  | 161,312.00 | 0.07 |
| 290 | 000688 | 国城矿业  | 4,700  | 160,881.00 | 0.07 |
| 291 | 000999 | 华润三九  | 7,116  | 160,038.84 | 0.07 |
| 292 | 002015 | 协鑫能科  | 9,800  | 159,936.00 | 0.07 |
| 293 | 000629 | 钒钛股份  | 47,800 | 159,652.00 | 0.07 |
| 294 | 002405 | 四维图新  | 24,550 | 158,838.50 | 0.07 |
| 295 | 000400 | 许继电气  | 7,300  | 158,410.00 | 0.07 |
| 296 | 300364 | 中文在线  | 6,700  | 158,053.00 | 0.07 |
| 297 | 300003 | 乐普医疗  | 13,226 | 156,728.10 | 0.07 |
| 298 | 000050 | 深天马 A | 15,800 | 156,578.00 | 0.07 |
| 299 | 301550 | 斯菱智驱  | 1,700  | 155,431.00 | 0.07 |
| 300 | 000155 | 川能动力  | 12,900 | 154,542.00 | 0.07 |
| 301 | 000967 | 盈峰环境  | 14,600 | 153,738.00 | 0.07 |
| 302 | 301095 | 广立微   | 1,300  | 153,465.00 | 0.07 |
| 303 | 002266 | 浙富控股  | 30,240 | 153,014.40 | 0.07 |
| 304 | 002151 | 北斗星通  | 4,750  | 150,812.50 | 0.07 |
| 305 | 000876 | 新希望   | 23,600 | 147,972.00 | 0.07 |
| 306 | 300122 | 智飞生物  | 12,550 | 146,709.50 | 0.07 |
| 307 | 300999 | 金龙鱼   | 6,300  | 146,538.00 | 0.07 |
| 308 | 002683 | 广东宏大  | 5,000  | 146,450.00 | 0.07 |
| 309 | 002841 | 视源股份  | 4,220  | 145,716.60 | 0.07 |
| 310 | 002518 | 科士达   | 2,700  | 144,693.00 | 0.07 |
| 311 | 000737 | 北方铜业  | 10,800 | 142,776.00 | 0.07 |
| 312 | 002430 | 杭氧股份  | 4,600  | 142,416.00 | 0.07 |
| 313 | 002249 | 大洋电机  | 18,800 | 141,000.00 | 0.06 |
| 314 | 000875 | 电投绿能  | 27,200 | 140,080.00 | 0.06 |
| 315 | 000738 | 航发控制  | 7,600  | 139,004.00 | 0.06 |
| 316 | 002007 | 华兰生物  | 11,360 | 138,478.40 | 0.06 |
| 317 | 300296 | 利亚德   | 24,650 | 138,040.00 | 0.06 |
| 318 | 002237 | 恒邦股份  | 9,300  | 136,617.00 | 0.06 |

|     |        |      |        |            |      |
|-----|--------|------|--------|------------|------|
| 319 | 002145 | 钛能化学 | 28,965 | 136,425.15 | 0.06 |
| 320 | 000830 | 鲁西化工 | 11,300 | 135,600.00 | 0.06 |
| 321 | 000591 | 太阳能  | 29,400 | 135,240.00 | 0.06 |
| 322 | 000729 | 燕京啤酒 | 13,300 | 134,729.00 | 0.06 |
| 323 | 002152 | 广电运通 | 14,350 | 134,603.00 | 0.06 |
| 324 | 300896 | 爱美客  | 1,540  | 134,288.00 | 0.06 |
| 325 | 002926 | 华西证券 | 16,300 | 133,171.00 | 0.06 |
| 326 | 300253 | 卫宁健康 | 19,747 | 132,897.31 | 0.06 |
| 327 | 000997 | 新大陆  | 8,150  | 132,845.00 | 0.06 |
| 328 | 300773 | 拉卡拉  | 8,660  | 132,498.00 | 0.06 |
| 329 | 000528 | 柳工   | 17,380 | 131,219.00 | 0.06 |
| 330 | 002603 | 以岭药业 | 8,724  | 130,860.00 | 0.06 |
| 331 | 002958 | 青农商行 | 47,700 | 130,698.00 | 0.06 |
| 332 | 000686 | 东北证券 | 15,520 | 130,368.00 | 0.06 |
| 333 | 000951 | 中国重汽 | 6,560  | 127,985.60 | 0.06 |
| 334 | 002389 | 航天彩虹 | 7,200  | 127,944.00 | 0.06 |
| 335 | 000596 | 古井贡酒 | 1,600  | 127,680.00 | 0.06 |
| 336 | 300726 | 宏达电子 | 1,500  | 126,855.00 | 0.06 |
| 337 | 001280 | 中国铀业 | 1,900  | 126,730.00 | 0.06 |
| 338 | 301165 | 锐捷网络 | 1,568  | 126,145.60 | 0.06 |
| 339 | 000932 | 华菱钢铁 | 36,260 | 125,822.20 | 0.06 |
| 340 | 300459 | 汤姆猫  | 37,080 | 125,701.20 | 0.06 |
| 341 | 001287 | 中电港  | 4,000  | 124,600.00 | 0.06 |
| 342 | 300182 | 捷成股份 | 26,100 | 123,975.00 | 0.06 |
| 343 | 002410 | 广联达  | 15,180 | 123,868.80 | 0.06 |
| 344 | 301297 | 富乐德  | 2,000  | 122,480.00 | 0.06 |
| 345 | 002939 | 长城证券 | 14,600 | 121,764.00 | 0.06 |
| 346 | 000921 | 海信家电 | 4,400  | 120,208.00 | 0.06 |
| 347 | 000987 | 越秀资本 | 15,335 | 119,919.70 | 0.06 |
| 348 | 000708 | 中信特钢 | 9,490  | 119,763.80 | 0.05 |
| 349 | 002048 | 宁波华翔 | 5,200  | 119,600.00 | 0.05 |
| 350 | 000582 | 北部湾港 | 11,000 | 118,030.00 | 0.05 |
| 351 | 000422 | 湖北宜化 | 8,400  | 118,020.00 | 0.05 |
| 352 | 000062 | 深圳华强 | 3,705  | 117,893.10 | 0.05 |
| 353 | 000973 | 佛塑科技 | 8,200  | 117,670.00 | 0.05 |
| 354 | 300573 | 兴齐眼药 | 2,874  | 117,144.24 | 0.05 |
| 355 | 000009 | 中国宝安 | 18,472 | 115,080.56 | 0.05 |
| 356 | 000682 | 东方电子 | 9,100  | 114,933.00 | 0.05 |
| 357 | 002262 | 恩华药业 | 6,100  | 114,375.00 | 0.05 |
| 358 | 300765 | 石药创新 | 4,200  | 114,366.00 | 0.05 |
| 359 | 301029 | 怡合达  | 4,212  | 113,766.12 | 0.05 |
| 360 | 000799 | 酒鬼酒  | 2,600  | 113,620.00 | 0.05 |
| 361 | 301219 | 腾远钴业 | 2,055  | 112,614.00 | 0.05 |

|     |        |       |        |            |      |
|-----|--------|-------|--------|------------|------|
| 362 | 002139 | 拓邦股份  | 11,800 | 112,336.00 | 0.05 |
| 363 | 000513 | 丽珠集团  | 3,867  | 111,717.63 | 0.05 |
| 364 | 002270 | 华明装备  | 5,900  | 111,215.00 | 0.05 |
| 365 | 002607 | 中公教育  | 61,700 | 111,060.00 | 0.05 |
| 366 | 002312 | 川发龙蟒  | 12,000 | 110,040.00 | 0.05 |
| 367 | 002500 | 山西证券  | 21,280 | 109,804.80 | 0.05 |
| 368 | 002895 | 川恒股份  | 3,700  | 108,040.00 | 0.05 |
| 369 | 300229 | 拓尔思   | 7,800  | 107,796.00 | 0.05 |
| 370 | 300777 | 中简科技  | 4,100  | 107,748.00 | 0.05 |
| 371 | 300779 | 惠城环保  | 2,140  | 107,428.00 | 0.05 |
| 372 | 002385 | 大北农   | 38,750 | 106,950.00 | 0.05 |
| 373 | 002948 | 青岛银行  | 21,010 | 106,730.80 | 0.05 |
| 374 | 000739 | 普洛药业  | 6,400  | 106,624.00 | 0.05 |
| 375 | 000723 | 美锦能源  | 31,700 | 106,195.00 | 0.05 |
| 376 | 300676 | 华大基因  | 3,000  | 105,180.00 | 0.05 |
| 377 | 300468 | 四方精创  | 5,000  | 105,050.00 | 0.05 |
| 378 | 002244 | 滨江集团  | 13,800 | 104,880.00 | 0.05 |
| 379 | 300144 | 宋城演艺  | 17,851 | 103,714.31 | 0.05 |
| 380 | 003022 | 联泓新科  | 3,990  | 103,341.00 | 0.05 |
| 381 | 301316 | 慧博云通  | 2,600  | 102,388.00 | 0.05 |
| 382 | 300735 | 光弘科技  | 4,500  | 102,330.00 | 0.05 |
| 383 | 002299 | 圣农发展  | 6,700  | 101,572.00 | 0.05 |
| 384 | 300413 | 芒果超媒  | 6,930  | 101,385.90 | 0.05 |
| 385 | 000778 | 新兴铸管  | 26,900 | 99,799.00  | 0.05 |
| 386 | 300009 | 安科生物  | 12,586 | 98,800.10  | 0.05 |
| 387 | 300146 | 汤臣倍健  | 10,900 | 98,536.00  | 0.05 |
| 388 | 002468 | 申通快递  | 6,700  | 97,552.00  | 0.04 |
| 389 | 002439 | 启明星辰  | 7,700  | 97,405.00  | 0.04 |
| 390 | 002568 | 百润股份  | 5,748  | 97,256.16  | 0.04 |
| 391 | 300775 | 三角防务  | 4,400  | 96,976.00  | 0.04 |
| 392 | 002583 | 海能达   | 12,600 | 96,894.00  | 0.04 |
| 393 | 002545 | 东方铁塔  | 5,900  | 95,698.00  | 0.04 |
| 394 | 000598 | 兴蓉环境  | 14,800 | 95,016.00  | 0.04 |
| 395 | 000998 | 隆平高科  | 12,600 | 95,004.00  | 0.04 |
| 396 | 000628 | 高新发展  | 2,000  | 94,800.00  | 0.04 |
| 397 | 300100 | 双林股份  | 3,400  | 94,452.00  | 0.04 |
| 398 | 301275 | 汉朔科技  | 2,100  | 94,290.00  | 0.04 |
| 399 | 300638 | 广和通   | 5,060  | 93,660.60  | 0.04 |
| 400 | 300674 | 宇信科技  | 6,180  | 93,009.00  | 0.04 |
| 401 | 002544 | 普天科技  | 5,100  | 92,922.00  | 0.04 |
| 402 | 002507 | 涪陵榨菜  | 8,570  | 92,556.00  | 0.04 |
| 403 | 301345 | 涛涛车业  | 400    | 92,400.00  | 0.04 |
| 404 | 000563 | 陕国投 A | 33,300 | 91,908.00  | 0.04 |

|     |        |       |        |           |      |
|-----|--------|-------|--------|-----------|------|
| 404 | 000581 | 威孚高科  | 5,400  | 91,908.00 | 0.04 |
| 406 | 002120 | 韵达股份  | 14,429 | 91,768.44 | 0.04 |
| 407 | 300457 | 赢合科技  | 4,350  | 91,698.00 | 0.04 |
| 408 | 300718 | 长盛轴承  | 1,500  | 91,455.00 | 0.04 |
| 409 | 300034 | 钢研高纳  | 5,300  | 90,842.00 | 0.04 |
| 410 | 003021 | 兆威机电  | 1,000  | 87,350.00 | 0.04 |
| 411 | 000935 | 四川双马  | 3,300  | 86,097.00 | 0.04 |
| 412 | 002531 | 天顺风能  | 10,200 | 85,986.00 | 0.04 |
| 413 | 000027 | 深圳能源  | 13,740 | 85,188.00 | 0.04 |
| 414 | 002984 | 森麒麟   | 6,460  | 84,432.20 | 0.04 |
| 415 | 000543 | 皖能电力  | 11,100 | 84,027.00 | 0.04 |
| 416 | 002701 | 奥瑞金   | 19,600 | 83,496.00 | 0.04 |
| 417 | 002373 | 千方科技  | 11,600 | 83,288.00 | 0.04 |
| 418 | 002698 | 博实股份  | 6,900  | 83,283.00 | 0.04 |
| 419 | 000883 | 湖北能源  | 19,200 | 82,944.00 | 0.04 |
| 420 | 300601 | 康泰生物  | 7,260  | 82,328.40 | 0.04 |
| 421 | 000825 | 太钢不锈  | 24,100 | 82,181.00 | 0.04 |
| 422 | 000709 | 河钢股份  | 42,000 | 81,480.00 | 0.04 |
| 423 | 002423 | 中粮资本  | 9,900  | 81,477.00 | 0.04 |
| 424 | 002268 | 电科网安  | 6,260  | 80,754.00 | 0.04 |
| 425 | 001286 | 陕西能源  | 7,900  | 80,106.00 | 0.04 |
| 426 | 000099 | 中信海直  | 5,500  | 80,080.00 | 0.04 |
| 427 | 300070 | 碧水源   | 25,014 | 79,794.66 | 0.04 |
| 428 | 000429 | 粤高速 A | 5,800  | 79,170.00 | 0.04 |
| 429 | 000088 | 盐田港   | 19,000 | 77,710.00 | 0.04 |
| 430 | 000801 | 四川九洲  | 5,900  | 76,346.00 | 0.04 |
| 431 | 300682 | 朗新科技  | 7,700  | 76,230.00 | 0.03 |
| 432 | 002091 | 江苏国泰  | 10,500 | 75,915.00 | 0.03 |
| 433 | 002508 | 老板电器  | 5,190  | 75,877.80 | 0.03 |
| 434 | 002773 | 康弘药业  | 3,660  | 74,847.00 | 0.03 |
| 435 | 002019 | 亿帆医药  | 8,000  | 74,800.00 | 0.03 |
| 436 | 000800 | 一汽解放  | 12,500 | 74,375.00 | 0.03 |
| 437 | 000902 | 新洋丰   | 6,402  | 74,007.12 | 0.03 |
| 438 | 002670 | 国盛证券  | 6,693  | 73,623.00 | 0.03 |
| 439 | 300529 | 健帆生物  | 4,780  | 73,612.00 | 0.03 |
| 440 | 300357 | 我武生物  | 3,140  | 73,224.80 | 0.03 |
| 441 | 000555 | 神州信息  | 6,900  | 71,070.00 | 0.03 |
| 442 | 002925 | 盈趣科技  | 2,880  | 71,020.80 | 0.03 |
| 443 | 000029 | 深深房 A | 3,200  | 70,560.00 | 0.03 |
| 444 | 300660 | 江苏雷利  | 2,530  | 70,485.80 | 0.03 |
| 445 | 300761 | 立华股份  | 4,260  | 69,906.60 | 0.03 |
| 446 | 300957 | 贝泰妮   | 2,200  | 69,322.00 | 0.03 |
| 447 | 000791 | 甘肃能源  | 8,900  | 67,640.00 | 0.03 |

|     |        |       |        |           |      |
|-----|--------|-------|--------|-----------|------|
| 448 | 001391 | 国货航   | 16,600 | 67,562.00 | 0.03 |
| 449 | 002408 | 齐翔腾达  | 14,380 | 67,442.20 | 0.03 |
| 450 | 002906 | 华阳集团  | 2,700  | 67,392.00 | 0.03 |
| 451 | 301606 | 绿联科技  | 1,100  | 67,122.00 | 0.03 |
| 452 | 003035 | 南网能源  | 11,400 | 66,348.00 | 0.03 |
| 453 | 002368 | 太极股份  | 4,711  | 65,906.89 | 0.03 |
| 454 | 002416 | 爱施德   | 7,300  | 65,408.00 | 0.03 |
| 455 | 002153 | 石基信息  | 9,012  | 65,156.76 | 0.03 |
| 456 | 000156 | 华数传媒  | 10,300 | 64,993.00 | 0.03 |
| 457 | 000069 | 华侨城 A | 39,500 | 64,780.00 | 0.03 |
| 458 | 000539 | 粤电力 A | 9,500  | 64,695.00 | 0.03 |
| 459 | 002032 | 苏泊尔   | 1,600  | 63,360.00 | 0.03 |
| 460 | 300979 | 华利集团  | 2,100  | 62,475.00 | 0.03 |
| 461 | 300910 | 瑞丰新材  | 2,210  | 61,968.40 | 0.03 |
| 462 | 000966 | 长源电力  | 15,800 | 61,936.00 | 0.03 |
| 463 | 000089 | 深圳机场  | 10,200 | 61,506.00 | 0.03 |
| 464 | 301589 | 诺瓦星云  | 400    | 59,592.00 | 0.03 |
| 465 | 301039 | 中集车辆  | 8,400  | 59,220.00 | 0.03 |
| 466 | 301238 | 瑞泰新材  | 2,400  | 58,560.00 | 0.03 |
| 467 | 002010 | 传化智联  | 13,100 | 58,557.00 | 0.03 |
| 468 | 300888 | 稳健医疗  | 2,080  | 58,219.20 | 0.03 |
| 469 | 301301 | 川宁生物  | 7,200  | 57,168.00 | 0.03 |
| 470 | 002372 | 伟星新材  | 6,940  | 56,838.60 | 0.03 |
| 471 | 000877 | 天山股份  | 15,500 | 56,265.00 | 0.03 |
| 472 | 300428 | 立中集团  | 3,000  | 54,540.00 | 0.03 |
| 473 | 000537 | 绿发电力  | 7,400  | 54,094.00 | 0.02 |
| 474 | 002847 | 盐津铺子  | 1,200  | 53,520.00 | 0.02 |
| 475 | 002608 | 江苏国信  | 7,700  | 53,130.00 | 0.02 |
| 476 | 000959 | 首钢股份  | 14,600 | 51,246.00 | 0.02 |
| 477 | 002690 | 美亚光电  | 3,500  | 50,155.00 | 0.02 |
| 478 | 000927 | 中国铁物  | 21,900 | 49,713.00 | 0.02 |
| 479 | 000937 | 冀中能源  | 12,379 | 49,268.42 | 0.02 |
| 480 | 002096 | 易普力   | 5,400  | 47,412.00 | 0.02 |
| 481 | 301155 | 海力风电  | 1,100  | 47,190.00 | 0.02 |
| 482 | 002265 | 建设工业  | 2,700  | 46,980.00 | 0.02 |
| 483 | 001872 | 招商港口  | 2,400  | 46,632.00 | 0.02 |
| 484 | 002755 | 奥赛康   | 3,300  | 44,946.00 | 0.02 |
| 485 | 301498 | 乖宝宠物  | 1,100  | 44,649.00 | 0.02 |
| 486 | 000898 | 鞍钢股份  | 23,752 | 44,416.24 | 0.02 |
| 487 | 000785 | 居然智家  | 22,200 | 44,400.00 | 0.02 |
| 488 | 002320 | 海峡股份  | 7,068  | 44,316.36 | 0.02 |
| 489 | 002978 | 安宁股份  | 1,700  | 43,571.00 | 0.02 |
| 490 | 002945 | 华林证券  | 3,200  | 42,976.00 | 0.02 |

|     |        |      |        |           |      |
|-----|--------|------|--------|-----------|------|
| 491 | 301656 | 联合动力 | 2,400  | 41,352.00 | 0.02 |
| 492 | 002563 | 森马服饰 | 8,200  | 41,328.00 | 0.02 |
| 493 | 002060 | 广东建工 | 12,900 | 39,087.00 | 0.02 |
| 494 | 002901 | 大博医疗 | 900    | 37,602.00 | 0.02 |
| 495 | 002461 | 珠江啤酒 | 4,100  | 31,037.00 | 0.01 |
| 496 | 001213 | 中铁特货 | 8,900  | 29,815.00 | 0.01 |
| 497 | 301267 | 华夏眼科 | 2,000  | 29,180.00 | 0.01 |
| 498 | 001289 | 龙源电力 | 1,600  | 25,008.00 | 0.01 |
| 499 | 001221 | 悍高集团 | 500    | 20,110.00 | 0.01 |
| 500 | 001386 | 马可波罗 | 1,200  | 16,992.00 | 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  | 301666 | 大普微   | 349   | 161,702.17 | 0.07         |
| 2  | 001248 | 华润新能源 | 9,700 | 98,067.00  | 0.05         |
| 3  | 301682 | 宏明电子  | 205   | 32,812.30  | 0.02         |
| 4  | 001399 | 惠科股份  | 1,096 | 30,392.08  | 0.01         |
| 5  | 001257 | 盛龙股份  | 875   | 18,147.50  | 0.01         |
| 6  | 301687 | 新广益   | 173   | 13,455.94  | 0.01         |
| 7  | 301696 | 三瑞智能  | 144   | 12,499.20  | 0.01         |
| 8  | 301531 | 春光集团  | 242   | 12,477.52  | 0.01         |
| 9  | 301669 | 高特电子  | 405   | 11,502.00  | 0.01         |
| 10 | 301599 | 理奇智能  | 258   | 8,377.26   | 0.00         |
| 11 | 301680 | 固德电材  | 64    | 7,178.24   | 0.00         |
| 12 | 301513 | 尚水智能  | 138   | 7,032.48   | 0.00         |
| 13 | 001365 | 天海电子  | 213   | 6,669.03   | 0.00         |
| 14 | 001393 | 维通利   | 155   | 6,043.45   | 0.00         |
| 15 | 301683 | 慧谷新材  | 46    | 5,601.42   | 0.00         |
| 16 | 001237 | 惠康科技  | 91    | 5,345.34   | 0.00         |
| 17 | 001220 | 世盟股份  | 52    | 1,444.56   | 0.00         |
| 18 | 001312 | 福恩股份  | 79    | 1,325.62   | 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  | 002602 | 世纪华通 | 994,306.00 | 0.51           |
| 2  | 300394 | 天孚通信 | 642,379.60 | 0.33           |
| 3  | 301308 | 江波龙  | 590,174.00 | 0.30           |
| 4  | 002428 | 云南锗业 | 589,841.00 | 0.30           |
| 5  | 301511 | 德福科技 | 518,097.00 | 0.27           |
| 6  | 300620 | 光库科技 | 469,309.00 | 0.24           |

|    |        |      |            |      |
|----|--------|------|------------|------|
| 7  | 301217 | 铜冠铜箔 | 423,964.00 | 0.22 |
| 8  | 300502 | 新易盛  | 282,023.00 | 0.15 |
| 9  | 300236 | 上海新阳 | 271,858.00 | 0.14 |
| 10 | 301205 | 联特科技 | 256,301.00 | 0.13 |
| 11 | 300811 | 铂科新材 | 250,550.00 | 0.13 |
| 12 | 300870 | 欧陆通  | 247,367.00 | 0.13 |
| 13 | 001267 | 汇绿生态 | 240,480.00 | 0.12 |
| 14 | 002716 | 湖南白银 | 224,980.00 | 0.12 |
| 15 | 002378 | 章源钨业 | 223,600.00 | 0.12 |
| 16 | 301626 | 苏州天脉 | 207,880.00 | 0.11 |
| 17 | 300750 | 宁德时代 | 207,067.00 | 0.11 |
| 18 | 000969 | 安泰科技 | 194,400.00 | 0.10 |
| 19 | 301171 | 易点天下 | 186,840.00 | 0.10 |
| 20 | 301550 | 斯菱智驱 | 180,234.00 | 0.09 |

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  | 300394 | 天孚通信 | 691,509.60 | 0.36           |
| 2  | 300502 | 新易盛  | 517,439.53 | 0.27           |
| 3  | 300308 | 中际旭创 | 494,643.00 | 0.26           |
| 4  | 300750 | 宁德时代 | 327,678.00 | 0.17           |
| 5  | 001309 | 德明利  | 298,249.00 | 0.15           |
| 6  | 301531 | 春光集团 | 195,611.72 | 0.10           |
| 7  | 301669 | 高特电子 | 194,622.14 | 0.10           |
| 8  | 000333 | 美的集团 | 180,823.00 | 0.09           |
| 9  | 300757 | 罗博特科 | 164,143.00 | 0.08           |
| 10 | 002475 | 立讯精密 | 137,495.00 | 0.07           |
| 11 | 301513 | 尚水智能 | 130,293.72 | 0.07           |
| 12 | 300476 | 胜宏科技 | 127,069.00 | 0.07           |
| 13 | 301696 | 三瑞智能 | 125,035.70 | 0.06           |
| 14 | 301599 | 理奇智能 | 121,455.16 | 0.06           |
| 15 | 301666 | 大普微  | 120,900.42 | 0.06           |
| 16 | 002183 | 怡亚通  | 118,198.00 | 0.06           |
| 17 | 300408 | 三环集团 | 112,617.00 | 0.06           |
| 18 | 002594 | 比亚迪  | 110,823.00 | 0.06           |
| 19 | 002745 | 木林森  | 108,823.00 | 0.06           |
| 20 | 300059 | 东方财富 | 106,066.00 | 0.05           |

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 | 16,593,679.62 |
| 卖出股票收入（成交）总额 | 14,483,092.79 |

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

金额单位：人民币元

| 序号 | 债券品种      | 公允价值      | 占基金资产净值比例（%） |
|----|-----------|-----------|--------------|
| 1  | 国家债券      | -         | -            |
| 2  | 央行票据      | -         | -            |
| 3  | 金融债券      | -         | -            |
|    | 其中：政策性金融债 | -         | -            |
| 4  | 企业债券      | -         | -            |
| 5  | 企业短期融资券   | -         | -            |
| 6  | 中期票据      | -         | -            |
| 7  | 可转债（可交换债） | 14,946.29 | 0.01         |
| 8  | 同业存单      | -         | -            |
| 9  | 其他        | -         | -            |
| 10 | 合计        | 14,946.29 | 0.01         |

## 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

金额单位：人民币元

| 序号 | 债券代码   | 债券名称 | 数量（张） | 公允价值      | 占基金资产净值比例（%） |
|----|--------|------|-------|-----------|--------------|
| 1  | 123267 | 珂玛转债 | 34    | 14,946.29 | 0.01         |

## 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的发行主体本期没有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。

7.12.2 基金投资的前十名股票是否超出基金合同约定的备选股票库

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 | 87,424.99 |
| 2  | 应收清算款 | -         |
| 3  | 应收股利  | -         |
| 4  | 应收利息  | -         |
| 5  | 应收申购款 | -         |
| 6  | 其他应收款 | -         |
| 7  | 待摊费用  | -         |
| 8  | 其他    | -         |
| 9  | 合计    | 87,424.99 |

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  | 301666 | 大普微   | 161,702.17  | 0.07         | 新股锁定     |
| 2  | 001248 | 华润新能源 | 98,067.00   | 0.05         | 新股未上市    |
| 3  | 301682 | 宏明电子  | 32,812.30   | 0.02         | 新股锁定     |
| 4  | 001399 | 惠科股份  | 30,392.08   | 0.01         | 新股锁定     |
| 5  | 001257 | 盛龙股份  | 18,147.50   | 0.01         | 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

| 持有人户数<br>(户) | 户均持有的<br>基金份额 | 持有人结构         |            |                |            |
|--------------|---------------|---------------|------------|----------------|------------|
|              |               | 机构投资者         |            | 个人投资者          |            |
|              |               | 持有份额          | 占总份额比例 (%) | 持有份额           | 占总份额比例 (%) |
| 7,305        | 16,732.36     | 13,055,926.00 | 10.68      | 109,173,996.00 | 89.32      |

注：持有人户数为有效户数，即存量份额大于零的账户。

### 8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

无。

### 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                             | 持有基金份额总量的数量区间（万份） |
|--------------------------------|-------------------|
| 本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金 | 0                 |
| 本基金基金经理持有本开放式基金                | 0                 |

## § 9 开放式基金份额变动

单位：份

|                               |                  |
|-------------------------------|------------------|
| 基金合同生效日（2015 年 6 月 5 日）基金份额总额 | 2,384,588,069.00 |
| 本报告期期初基金份额总额                  | 131,229,922.00   |
| 本报告期基金总申购份额                   | 78,000,000.00    |
| 减：本报告期基金总赎回份额                 | 87,000,000.00    |
| 本报告期基金拆分变动份额                  | —                |
| 本报告期期末基金份额总额                  | 122,229,922.00   |

## § 10 重大事件揭示

### 10.1 基金份额持有人大会决议

无。

### 10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

#### 一、基金管理人的重大人事变动

经大成基金管理有限公司 2026 年第一次临时股东会及公司九届四次监事会审议通过，同意选举郭向东先生为公司第九届监事会股东代表监事，监事会主席，任期自 2026 年 4 月 30 日

之日起计算，与公司第九届监事会剩余任期一致。自郭向东先生的监事任职生效之日起，陈勇先生将不再担任公司监事、监事会主席职务。

二、基金托管人的基金托管部门的重大人事变动

无。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内无涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

10.4 基金投资策略的改变

本基金投资策略在本报告期内没有重大改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金自基金合同生效日起聘请普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）为本基金提供审计服务，自 2024 年 12 月 11 日起，改聘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、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况

10.6.1 管理人受调查或处罚等情况

本报告期内，基金管理人无受调查或处罚等情况。

10.6.2 管理人相关从业人员受调查或处罚等情况

本报告期内，基金管理人相关从业人员无受调查或处罚等情况。

10.6.3 托管人受调查或处罚等情况

无。

10.6.4 托管人相关从业人员受调查或处罚等情况

无。

10.7 基金租用或者通过证券公司交易单元进行证券投资的相关情况

10.7.1 基金租用或者通过证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

| 券商名称 | 交易单元数量 | 股票交易          |                  | 应支付该券商的佣金 |                | 备注 |
|------|--------|---------------|------------------|-----------|----------------|----|
|      |        | 成交金额          | 占当期股票成交总额的比例 (%) | 佣金        | 占当期佣金总量的比例 (%) |    |
| 光大证券 | 2      | 30,519,366.39 | 100.00           | 3,051.71  | 100.00         | -  |
| 爱建证券 | 1      | -             | -                | -         | -              | -  |
| 财通证券 | 1      | -             | -                | -         | -              | -  |
| 长江证券 | 1      | -             | -                | -         | -              | 新增 |

|              |   |   |   |   |   |           |
|--------------|---|---|---|---|---|-----------|
|              |   |   |   |   |   | 1 个       |
| 第一创业         | 1 | - | - | - | - | -         |
| 东北证券         | 1 | - | - | - | - | -         |
| 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 | - | - | - | - | -         |
| 广发证券         | 2 | - | - | - | - | -         |
| 国金证券         | 2 | - | - | - | - | -         |
| 国盛证券         | 1 | - | - | - | - | -         |
| 国泰海通         | 3 | - | - | - | - | -         |
| 国投证券         | 1 | - | - | - | - | -         |
| 国信证券         | 1 | - | - | - | - | -         |
| 红塔证券         | 1 | - | - | - | - | -         |
| 华创证券         | 1 | - | - | - | - | -         |
| 华泰证券         | 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         | 0 | - | - | - | - | 退租<br>1 个 |
| 西部证券         | 1 | - | - | - | - | -         |
| 信达证券         | 0 | - | - | - | - | 退租<br>1 个 |
| 兴业证券         | 2 | - | - | - | - | -         |
| 野村东方<br>国际证券 | 1 | - | - | - | - | -         |
| 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 基金租用或者通过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  | 大成深证成份交易型开放式指数证券投资基金基金产品资料概要更新                     | 中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站 | 2026 年 06 月 30 日 |
| 2  | 关于大成基金旗下部分交易型开放式指数证券投资基金增加西部证券股份有限公司为申购赎回代办证券公司的公告 | 中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站 | 2026 年 06 月 01 日 |
| 3  | 2025 年度公募基金管理人以股东身份（通过公募基金持股）参与股东大会投票信息披露          | 中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站 | 2026 年 04 月 30 日 |
| 4  | 大成深证成份交易型开放式指数证券投资基金 2026 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 | 2026 年 04 月 22 日 |
| 5  | 大成基金管理有限公司旗下 212 只公募基金 2026 年第 1 季度报告提示性公告         | 规定报刊                     | 2026 年 04 月 22 日 |
| 6  | 关于大成基金旗下部分交易型开放式指数证券投资基金增加粤开证券股份                   | 中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本     | 2026 年 04 月 20 日 |

|    |                                                      |                          |                  |
|----|------------------------------------------------------|--------------------------|------------------|
|    | 有限公司为申购赎回代办证券公司的公告                                   | 公司网站                     |                  |
| 7  | 大成深证成份交易型开放式指数证券投资基金 2025 年年度报告                      | 中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站 | 2026 年 03 月 31 日 |
| 8  | 大成基金管理有限公司旗下 205 只公募基金 2025 年年度报告提示性公告               | 规定报刊                     | 2026 年 03 月 31 日 |
| 9  | 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（2025 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 | 2026 年 03 月 31 日 |
| 10 | 关于大成基金旗下部分交易型开放式指数证券投资基金增加德邦证券股份有限公司为申购赎回代办证券公司的公告   | 中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站 | 2026 年 03 月 27 日 |
| 11 | 关于大成基金旗下部分交易型开放式指数证券投资基金增加国联民生证券股份有限公司为申购赎回代办证券公司的公告 | 中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站 | 2026 年 03 月 27 日 |
| 12 | 关于大成基金旗下部分交易型开放式指数证券投资基金增加中国国际金融股份有限公司为申购赎回代办证券公司的公告 | 中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站 | 2026 年 03 月 20 日 |
| 13 | 大成基金管理有限公司旗下部分 ETF 基金新增华福证券股份有限公司为申购赎回代办证券公司的公告      | 中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站 | 2026 年 03 月 10 日 |
| 14 | 大成基金管理有限公司旗下部分 ETF 基金新增瑞银证券有限责任公司为申购赎回代办证券公司的公告      | 中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站 | 2026 年 03 月 10 日 |
| 15 | 大成基金管理有限公司旗下部分 ETF 基金新增浙商证券股份有限公司为申购赎回代办证券公司的公告      | 中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站 | 2026 年 03 月 10 日 |
| 16 | 大成基金管理有限公司旗下部分 ETF 基金新增华宝证券股份有限公司为申购赎回代办证券公司的公告      | 中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站 | 2026 年 03 月 03 日 |
| 17 | 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 | 2026 年 02 月 14 日 |
| 18 | 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 | 2026 年 01 月 30 日 |
| 19 | 大成深证成份交易型开放式指数证券投资基金 2025 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 | 2026 年 01 月 22 日 |
| 20 | 大成基金管理有限公司旗下 205 只公                                  | 规定报刊                     | 2026 年 01 月 22 日 |

|    |                                |                          |                  |
|----|--------------------------------|--------------------------|------------------|
|    | 募基金 2025 年第 4 季度报告提示性公告        |                          |                  |
| 21 | 大成深证成份交易型开放式指数证券投资基金基金产品资料概要更新 | 中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站 | 2026 年 01 月 05 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深证成份交易型开放式指数证券投资基金的文件；
- 2、《大成深证成份交易型开放式指数证券投资基金基金合同》；
- 3、《大成深证成份交易型开放式指数证券投资基金托管协议》；
- 4、大成基金管理有限公司批准文件、营业执照、公司章程；
- 5、本报告期内在规定报刊上披露的各种公告原稿。

### 12.2 存放地点

备查文件存放在本基金管理人和托管人的住所。

### 12.3 查阅方式

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

大成基金管理有限公司

2026 年 8 月 28 日