

大成沪深 300 指数增强型发起式证券投资基金

2025 年中期报告

2025 年 6 月 30 日

基金管理人：大成基金管理有限公司

基金托管人：中国工商银行股份有限公司

送出日期：2025 年 8 月 29 日

§ 1 重要提示及目录

1.1 重要提示

基金管理人的董事会、董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带的法律责任。本中期报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2025 年 08 月 28 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书及其更新。

本报告财务资料未经审计。

本报告期自 2025 年 01 月 01 日起至 06 月 30 日止。

1.2 目录

§ 1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
§ 2 基金简介	5
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人和基金托管人	5
2.4 信息披露方式	6
2.5 其他相关资料	6
§ 3 主要财务指标和基金净值表现	6
3.1 主要会计数据和财务指标	6
3.2 基金净值表现	7
§ 4 管理人报告	9
4.1 基金管理人及基金经理情况	9
4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明	10
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	10
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明	11
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	12
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	12
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	12
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明	13
§ 5 托管人报告	13
5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明	13
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	13
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	13
§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）	13
6.1 资产负债表	13
6.2 利润表	14
6.3 净资产变动表	16
6.4 报表附注	18
§ 7 投资组合报告	43
7.1 期末基金资产组合情况	43
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	43
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	45
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	50
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	54
7.12 投资组合报告附注	54
§ 8 基金份额持有人信息	55
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	56
8.4 发起式基金发起资金持有份额情况	56
§ 9 开放式基金份额变动	56
§ 10 重大事件揭示	57
10.1 基金份额持有人大会决议	57
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	57
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	57
10.4 基金投资策略的改变	57
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	57
10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况	57
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	58
10.8 其他重大事件	59
§ 11 影响投资者决策的其他重要信息	60
11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20% 的情况	60
11.2 影响投资者决策的其他重要信息	60
§ 12 备查文件目录	60
12.1 备查文件目录	60
12.2 存放地点	61
12.3 查阅方式	61

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	大成沪深 300 指数增强型发起式证券投资基金	
基金简称	大成沪深 300 增强发起式	
基金主代码	010908	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2021 年 2 月 23 日	
基金管理人	大成基金管理有限公司	
基金托管人	中国工商银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	531,732,573.32 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	大成沪深 300 增强发起式 A	大成沪深 300 增强发起式 C
下属分级基金的交易代码	010908	010909
报告期末下属分级基金的份额总额	326,597,786.57 份	205,134,786.75 份

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金为增强型股票指数基金，在力求对标的指数进行有效跟踪的基础上，力争实现超越目标指数的投资收益，谋求基金资产的长期增值。本基金力争使日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.5%，年化跟踪误差不超过 8.0%。
投资策略	本基金在指数化投资的基础上通过数量化模型进行投资组合优化，在控制与业绩比较基准偏离风险的前提下，力争获得超越标的指数的投资收益。
业绩比较基准	沪深 300 指数收益率 \times 95% + 银行活期存款利率(税后) \times 5%
风险收益特征	本基金是股票型基金，其预期风险与预期收益高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目	基金管理人	基金托管人
名称	大成基金管理有限公司	中国工商银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	段皓静
	联系电话	0755-83183388
	电子邮箱	office@dcfund.com.cn
客户服务电话	4008885558	95588
传真	0755-83199588	010-66105798
注册地址	广东省深圳市南山区海德三道 1236 号大成基金总部大厦 5 层、27-33 层	北京市西城区复兴门内大街 55 号
办公地址	广东省深圳市南山区海德三道	北京市西城区复兴门内大街 55

	1236 号大成基金总部大厦 5 层、 27-33 层	号
邮政编码	518054	100140
法定代表人	吴庆斌	廖林

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《上海证券报》
登载基金中期报告正文的管理人互联网网址	www. dcfund. com. cn
基金中期报告备置地点	基金管理人及基金托管人住所

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	大成基金管理有限公司	广东省深圳市南山区海德三道 1236 号大成基金总部大厦 5 层、27-33 层

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2025 年 1 月 1 日 – 2025 年 6 月 30 日)	
	大成沪深 300 增强发起式 A	大成沪深 300 增强发起式 C
本期已实现收益	9,350,811.94	4,719,151.15
本期利润	5,503,546.70	4,909,044.75
加权平均基金份额本期利润	0.0155	0.0230
本期加权平均净值利润率	1.87%	2.83%
本期基金份额净值增长率	2.06%	1.86%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2025 年 6 月 30 日)	
期末可供分配利润	-49,656,981.75	-34,157,532.92
期末可供分配基金份额利润	-0.1520	-0.1665
期末基金资产净值	278,699,916.38	172,017,670.42

期末基金份额净值	0.8533	0.8386
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2025 年 6 月 30 日)	
基金份额累计净值增长率	-14.67%	-16.14%

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

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

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

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

大成沪深 300 增强发起式 A

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	2.56%	0.46%	2.37%	0.55%	0.19%	-0.09%
过去三个月	1.64%	1.04%	1.21%	1.04%	0.43%	0.00%
过去六个月	2.06%	0.94%	0.07%	0.97%	1.99%	-0.03%
过去一年	14.85%	1.15%	13.12%	1.32%	1.73%	-0.17%
过去三年	-4.68%	0.97%	-11.43%	1.05%	6.75%	-0.08%
自基金合同生效起至今	-14.67%	0.99%	-28.14%	1.09%	13.47%	-0.10%

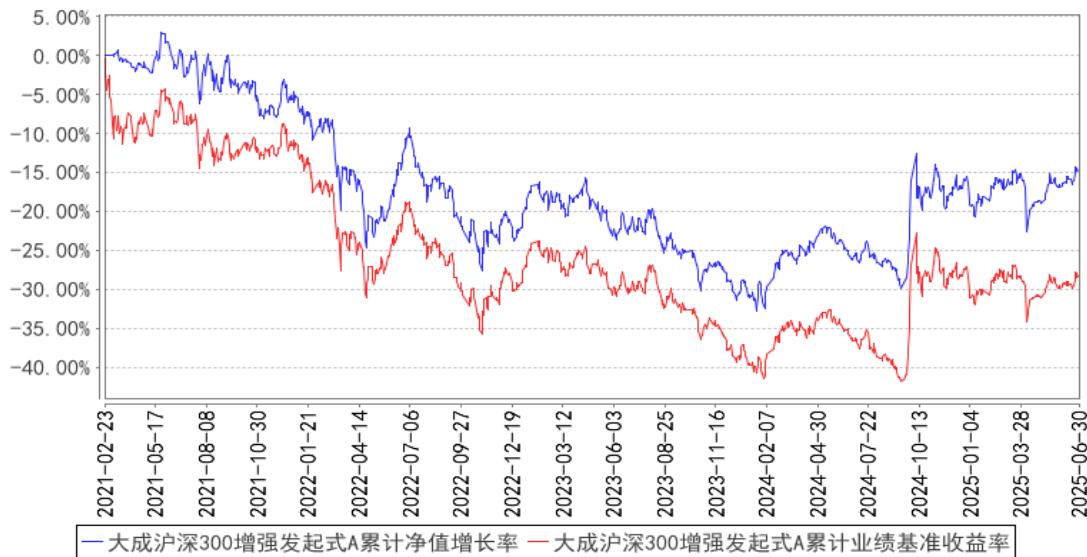
大成沪深 300 增强发起式 C

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	2.53%	0.46%	2.37%	0.55%	0.16%	-0.09%
过去三个月	1.55%	1.04%	1.21%	1.04%	0.34%	0.00%
过去六个月	1.86%	0.94%	0.07%	0.97%	1.79%	-0.03%
过去一年	14.39%	1.15%	13.12%	1.32%	1.27%	-0.17%

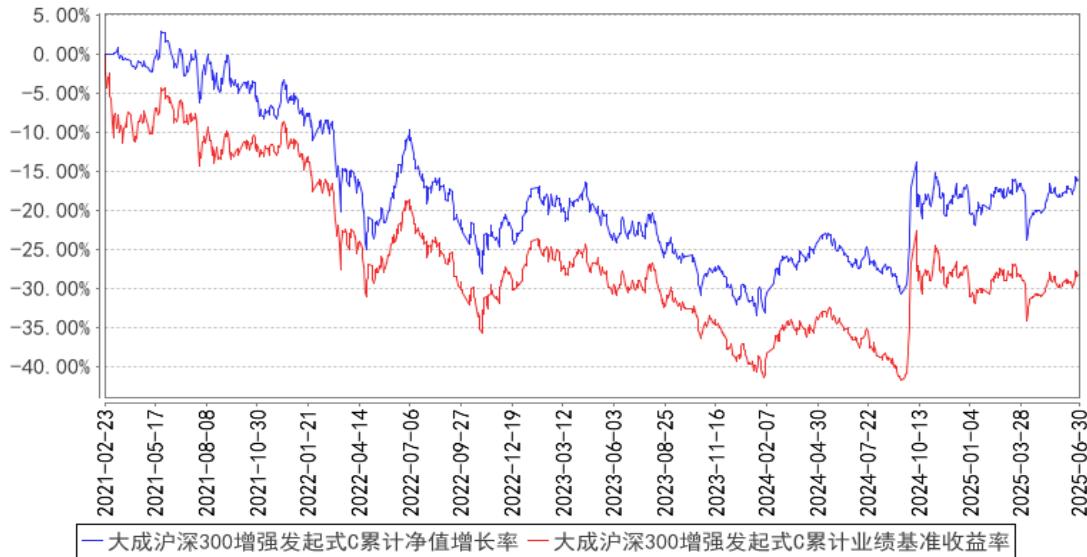
过去三年	-5.82%	0.97%	-11.43%	1.05%	5.61%	-0.08%
自基金合同生效起至今	-16.14%	0.99%	-28.14%	1.09%	12.00%	-0.10%

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

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



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



注：本基金合同规定，基金管理人应当自基金合同生效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		
夏高	本基金基金经理，指数与期货投资部副总监	2021 年 2 月 23 日	-	14 年	清华大学工学博士。2011 年 1 月至 2012 年 5 月就职于博时基金管理有限公司，任股票投资部投资分析员。2012 年 7 月加入大成基金管理有限公司，曾担任数量与指数投资部高级数量分析师、基金经理助理、总监助理，现任指数与期货投资部副总监。2014 年 12 月 6 日至 2023 年 3 月 20 日任大成中证红利指数证券投资基金基金经理。2015 年 6 月 29 日至 2020 年 11 月 13 日担任大成中证互联网金融指数分级证券投资基金基金经理。2016 年 2 月 3 日起任大成中证 360 互联网+大数据 100 指数型证券投资基金基金经理。2017 年 3 月 21 日至 2021 年 4 月 27 日任大成智惠量化多策略灵活配置混合型证券投资基金基金经理。2020 年 9 月 18 日至 2022 年 10 月 17 日任大成动态量化配置策略混合型证券投资基金基金经理。2023 年 3 月 20 日起任大成景恒混合型证券投资基金基金经理。

					资基金基金经理。2020 年 9 月 18 日至 2022 年 10 月 25 日任大成绝对收益策略混合型发起式证券投资基金基金经理。2021 年 2 月 23 日起任大成沪深 300 指数增强型发起式证券投资基金基金经理。2021 年 4 月 29 日至 2022 年 5 月 26 日任大成中证全指医疗保健设备与服务交易型开放式指数证券投资基金基金经理。2023 年 4 月 14 日起任大成动态量化配置策略混合型证券投资基金基金经理。2024 年 7 月 19 日起任大成中证 500 指数增强型证券投资基金基金经理。2025 年 4 月 29 日起任大成上证科创板综合指数增强型证券投资基金基金经理。具有基金从业资格。国籍：中国
刘旺	本基金基金经理	2024 年 1 月 2 日	-	7 年	香港中文大学理学(金融工程)硕士。2018 年 5 月加入大成基金管理有限公司，曾担任指数与期货投资部研究员兼基金经理助理，现任指数与期货投资部基金经理。2024 年 1 月 2 日起任大成沪深 300 指数增强型发起式证券投资基金基金经理。2024 年 11 月 15 日起任大成中证 1000 指数增强型发起式证券投资基金基金经理。2025 年 4 月 29 日起任大成上证科创板综合指数增强型证券投资基金基金经理。具备基金从业资格。国籍：中国

注：1、任职日期、离任日期为本基金管理人作出决定之日。

2、证券从业年限的计算标准遵从中国证监会《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遵规守信情况的说明

报告期内，本基金管理人严格遵守《证券法》、《证券投资基金法》等有关法律法规及基金合同、基金招募说明书等有关基金法律文件的规定，以取信于市场、取信于社会投资公众为宗旨，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在规范基金运作和严格控制投资风险的前提下，为基金份额持有人谋求最大利益，无损害基金份额持有人利益的行为。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

报告期内，公司严格执行了公平交易的原则和制度。公司运用统计分析方法和工具，对旗下

所有投资组合间连续 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

2025 年上半年，A 股市场整体以震荡逐步上行为主。一月份，市场窄幅调整，行业出现分化，有色金属、银行和汽车等行业上涨，商贸零售、煤炭、食品饮料和非银行金融等行业出现一定回撤。二月份，市场各行业多为上涨，受益于 AI 模型、机器人和智能驾驶等技术进步的推动，计算机、机械、电子和汽车等行业涨幅明显，煤炭、保险、石油石化和交通运输等行业有所下行。三月份，市场分化加大，有色金属、家电、煤炭和银行等传统行业继续上行，计算机、房地产、电子、通信和建筑等行业冲高回落。四月份，受外围因素扰动，A 股一度出现回调，在市场力量的带动下企稳回升，农林牧渔、商贸零售和电力及公用事业等行业上涨，新能源、通信、机械和计算机等行业出现一定回撤。五月份，市场以上涨为主，银行、保险、医药和通信等行业涨幅领先，电子、计算机和消费者服务等行业略微下行。六月份，市场继续上行，金融、通信、电子和有色金属等行业表现突出，食品饮料、家电和交通运输等行业有所回落。整体来看，在上半年，上证综指上涨 2.76%，沪深 300 指数上涨 0.03%。在本报告期内，本基金战胜了业绩比较基准，取得了超额收益。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末大成沪深 300 增强发起式 A 的基金份额净值为 0.8533 元，本报告期基金份额净值增长率为 2.06%，同期业绩比较基准收益率为 0.07%；截至本报告期末大成沪深 300 增强发起式 C 的基金份额净值为 0.8386 元，本报告期基金份额净值增长率为 1.86%，同期业绩比较基准收益率为 0.07%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

2025 年下半年，随着改革和经济拉动措施的持续落实，以及市场流动性的进一步改善，我们认为 A 股市场值得投资者加强关注，在自身风险承受能力范围内作出合理的投资决策。本基金将继续坚持量化指数增强模型，持续挖掘有效的选股因子，并采用风险模型、组合优化等方法严格控制风险暴露，努力实现对业绩比较基准进行增强的投资目标。

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，本基金托管人在对本基金的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他法律法规和基金合同的有关规定，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，完全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，本基金的管理人——大成基金管理有限公司在本基金的投资运作、基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格计算、基金费用开支等问题上，托管人未发现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

本托管人依法对大成基金管理有限公司编制和披露的本基金 2025 年中期报告中财务指标、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进行了核查，以上内容真实、准确和完整。

§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：大成沪深 300 指数增强型发起式证券投资基金

报告截止日：2025 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2025 年 6 月 30 日	上年度末 2024 年 12 月 31 日
资产：			
货币资金	6.4.7.1	47,607,392.89	28,974,021.71
结算备付金		6,953,201.88	3,343,262.70
存出保证金		3,970,561.59	722,344.98
交易性金融资产	6.4.7.2	392,166,826.56	460,308,467.50
其中：股票投资		392,166,826.56	460,308,467.50
基金投资		—	—
债券投资		—	—
资产支持证券投资		—	—
贵金属投资		—	—
其他投资		—	—

衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
债权投资	6.4.7.5	-	-
其中：债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
其他投资		-	-
其他债权投资	6.4.7.6	-	-
其他权益工具投资	6.4.7.7	-	-
应收清算款		16,137,099.39	6,132,259.59
应收股利		-	-
应收申购款		69,970.16	3,091,188.55
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.8	-	-
资产总计		466,905,052.47	502,571,545.03
负债和净资产	附注号	本期末 2025年6月30日	上年度末 2024年12月31日
负债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付清算款		15,295,473.06	-
应付赎回款		180,978.32	9,600,636.56
应付管理人报酬		294,206.36	340,817.25
应付托管费		55,163.69	63,903.25
应付销售服务费		56,287.51	63,272.66
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	305,356.73	370,987.58
负债合计		16,187,465.67	10,439,617.30
净资产：			
实收基金	6.4.7.10	531,732,573.32	591,929,618.30
未分配利润	6.4.7.12	-81,014,986.52	-99,797,690.57
净资产合计		450,717,586.80	492,131,927.73
负债和净资产总计		466,905,052.47	502,571,545.03

注： 报告截止日 2025 年 06 月 30 日，基金份额总额 531,732,573.32 份。其中大成沪深 300 增强发起式 A 类基金份额总额为 326,597,786.57 份，基金份额净值 0.8533 元；大成沪深 300 增强发起式 C 类基金份额总额为 205,134,786.75 份，基金份额净值 0.8386 元。

6.2 利润表

会计主体：大成沪深 300 指数增强型发起式证券投资基金

本报告期：2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日
一、营业收入		13,074,289.40	18,435,967.50
1. 利息收入		92,762.08	61,409.42
其中：存款利息收入	6.4.7.13	92,762.08	61,409.42
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“-” 号填列）		16,634,202.65	11,331,835.12
其中：股票投资收益	6.4.7.14	9,305,240.35	7,379,741.19
基金投资收益		—	—
债券投资收益	6.4.7.15	1,619.61	—
资产支持证券投资 收益	6.4.7.16	—	—
贵金属投资收益	6.4.7.17	—	—
衍生工具收益	6.4.7.18	1,999,823.20	457,988.15
股利收益	6.4.7.19	5,327,519.49	3,494,105.78
其他投资收益		—	—
3. 公允价值变动收益（损 失以“-”号填列）	6.4.7.20	-3,657,371.64	7,041,798.65
4. 汇兑收益（损失以“-” 号填列）		—	—
5. 其他收入（损失以“-” 号填列）	6.4.7.21	4,696.31	924.31
减：二、营业总支出		2,661,697.95	1,972,263.30
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	1,852,755.56	1,261,961.03
其中：暂估管理人报酬		—	—
2. 托管费	6.4.10.2.2	347,391.63	236,617.63
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	343,429.51	345,020.94
4. 投资顾问费		—	—
5. 利息支出		—	—
其中：卖出回购金融资产 支出		—	—
6. 信用减值损失	6.4.7.22	—	—
7. 税金及附加		7,772.28	1,654.48
8. 其他费用	6.4.7.23	110,348.97	127,009.22

三、利润总额(亏损总额以“-”号填列)		10,412,591.45	16,463,704.20
减: 所得税费用		-	-
四、净利润(净亏损以“-”号填列)		10,412,591.45	16,463,704.20
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		10,412,591.45	16,463,704.20

6.3 净资产变动表

会计主体: 大成沪深 300 指数增强型发起式证券投资基金

本报告期: 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日

单位: 人民币元

项目	本期 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	591,929,618.30	-	-99,797,690.57	492,131,927.73
二、本期期初净资产	591,929,618.30	-	-99,797,690.57	492,131,927.73
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	-60,197,044.98	-	18,782,704.05	-41,414,340.93
(一)、综合收益总额	-	-	10,412,591.45	10,412,591.45
(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)	-60,197,044.98	-	8,370,112.60	-51,826,932.38
其中: 1. 基金申购款	110,167,128.80	-	-23,460,538.45	86,706,590.35
2. 基金赎回款	-170,364,173.78	-	31,830,651.05	-138,533,522.73
(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	531,732,573.32	-	-81,014,986.52	450,717,586.80
项目	上年度可比期间			

	2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	439,484,743.73	-	-127,687,744.50	311,796,999.23
二、本期期初净资产	439,484,743.73	-	-127,687,744.50	311,796,999.23
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	-2,686,223.25	-	12,530,948.28	9,844,725.03
(一)、综合收益总额	-	-	16,463,704.20	16,463,704.20
(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)	-2,686,223.25	-	-3,932,755.92	-6,618,979.17
其中：1. 基金申购款	482,203,290.10	-	-130,446,411.54	351,756,878.56
2. 基金赎回款	-484,889,513.35	-	126,513,655.62	-358,375,857.73
(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	436,798,520.48	-	-115,156,796.22	321,641,724.26

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署：

谭晓冈

范瑛

梁靖

基金管理人负责人

主管会计工作负责人

会计机构负责人

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

大成沪深 300 指数增强型发起式证券投资基金（以下简称“本基金”），系经中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）证监许可[2020]3164 号文《关于准予大成沪深 300 指数增强型发起式证券投资基金注册的批复》注册，由基金管理人大成基金管理有限公司向社会公开发行募集，基金合同于 2021 年 2 月 23 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 430,353,939.83 份基金份额，本基金为契约型开放式，存续期限不定。本基金的基金管理人为大成基金管理有限公司，注册登记机构为大成基金管理有限公司，基金托管人为中国工商银行股份有限公司。

本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的股票（包括中小板、创业板及其他依法发行上市的股票）、债券（包括国债、央行票据、金融债券、企业债券、公司债券、中期票据、短期融资券、超短期融资券、公开发行的次级债券、政府支持机构债券、政府支持债券、地方政府债券、可转换债券及其他经中国证监会允许投资的债券）、资产支持证券、衍生工具（包括股指期货、国债期货、股票期权等）、货币市场工具、同业存单、债券回购、银行存款以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具。本基金可以根据有关法律法规的规定参与融资及转融通证券出借业务。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。本基金的投资组合比例为：本基金股票资产投资比例不低于基金资产的 80%，其中投资于标的指数成份股和备选成份股的资产不低于非现金基金资产的 80%；每个交易日日终在扣除股指期货、国债期货、股票期权合约需缴纳的交易保证金后，保持不低于基金资产净值 5%的现金或到期日在一年以内的政府债券，其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。如法律法规或中国证监会变更投资品种的投资比例限制，基金管理人在履行适当程序后，可以调整上述投资品种的投资比例。

本基金的业绩比较基准为：沪深 300 指数收益率 \times 95% + 银行活期存款利率（税后） \times 5%。

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

6.4.2 会计报表的编制基础

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

报规则》第 3 号《会计报表附注的编制及披露》、《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和中期报告>》以及中国证监会和中国证券投资基金业协会颁布的其他相关规定。

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金 2025 年 6 月 30 日的财务状况以及自 2025 年 1 月 1 日起至 2025 年 6 月 30 日止期间的经营成果和净资产变动情况等有关信息。

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

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 会计政策变更的说明

无。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

无。

6.4.5.3 差错更正的说明

无。

6.4.6 税项

(1) 增值税及附加

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

根据财政部、国家税务总局财税[2016]46 号文《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》的规定，金融机构开展的质押式买入返售金融商品业务及持有政策性金融债券取得的利息收入属于金融同业往来利息收入。

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

根据财政部、国家税务总局财税[2016]140 号文《关于明确金融 房地产开发 教育辅助服务

等增值税政策的通知》的规定，本基金运营过程中发生的增值税应税行为，以本基金的基金管理人为增值税纳税人。

根据财政部、国家税务总局财税[2017]56号文《关于资管产品增值税有关问题的通知》的规定，证券投资基金的基金管理人运营证券投资基金过程中发生的增值税应税行为，暂适用简易计税方法，按照3%的征收率缴纳增值税。对证券投资基金在2018年1月1日前运营过程中发生的增值税应税行为，未缴纳增值税的，不再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从证券投资基金的基金管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。增值税应税行为的销售额根据财政部、国家税务总局财税[2017]90号文《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》的规定确定。

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

（2）企业所得税

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

根据财政部、国家税务总局财税[2008]1号文《关于企业所得税若干优惠政策的通知》的规定，对证券投资基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股权的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

（3）个人所得税

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

根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2012]85号文《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》的规定，自2013年1月1日起，（如有）证券投资基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，持股期限在1个月以内（含1个月）的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在1个月以上至1年（含1年）的，暂减按50%计入应纳税所得额；持股期限超过1年的，暂减按25%计入应纳税所得额。上述所得统一适用20%的税率计征个人所得税。

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

税。

(4) 印花税

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

(5) 境外投资

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

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 货币资金

单位: 人民币元

项目	本期末 2025 年 6 月 30 日
活期存款	47,607,392.89
等于: 本金	47,602,747.43
加: 应计利息	4,645.46
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	47,607,392.89

6.4.7.2 交易性金融资产

单位: 人民币元

项目	本期末 2025 年 6 月 30 日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	391,369,504.62	-	392,166,826.56	797,321.94
贵金属投资-金交所 黄金合约	-	-	-	-
债券	交易所市场	-	-	-
	银行间市场	-	-	-
	合计	-	-	-
资产支持证券	-	-	-	-
基金	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	391,369,504.62	-	392,166,826.56	797,321.94

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

6.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

单位：人民币元

项目	本期末 2025 年 6 月 30 日			
	合同/名义 金额	公允价值		备注
		资产	负债	
利率衍 生工具	-	-	-	-
货币衍 生工具	-	-	-	-
权益衍 生工具	30,799,860.00	-	-	-
其 中：股指 期货投 资	30,799,860.00	-	-	-
其他衍 生工具	-	-	-	-
合计	30,799,860.00	-	-	-

6.4.7.3.2 期末基金持有的期货合约情况

单位：人民币元

代码	名称	持仓量(买/卖)	合约市值	公允价值变动
IF2507	IF2507	26.00	30,480,840.00	839,280.00
IF2509	IF2509	1.00	1,166,100.00	7,800.00
合计				847,080.00
减：可抵销期货 暂收款				847,080.00
净额				0.00

注：1、买入持仓量以正数表示，卖出持仓量以负数表示；
2、期货投资采用当日无负债结算制度，结算准备金已包括所持期货合约产生的持仓损益，因此衍生金融工具项下的期货投资与相关的期货暂收款（结算所得的持仓损益）之间按抵销后的净额为 0。

6.4.7.3.3 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 2025 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	—
应付赎回费	0.28
应付证券出借违约金	—
应付交易费用	202,571.41
其中：交易所市场	202,571.41
银行间市场	—
应付利息	—
预提费用	86,322.86
应付指数使用费	16,462.18
合计	305,356.73

6.4.7.10 实收基金

金额单位：人民币元

大成沪深 300 增强发起式 A

项目	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	375,019,577.05	375,019,577.05
本期申购	4,638,427.69	4,638,427.69
本期赎回（以“-”号填列）	-53,060,218.17	-53,060,218.17
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	326,597,786.57	326,597,786.57

大成沪深 300 增强发起式 C

项目	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	216,910,041.25	216,910,041.25
本期申购	105,528,701.11	105,528,701.11
本期赎回（以“-”号填列）	-117,303,955.61	-117,303,955.61
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	205,134,786.75	205,134,786.75

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

6.4.7.11 其他综合收益

无。

6.4.7.12 未分配利润

单位：人民币元

大成沪深 300 增强发起式 A

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-67,044,066.94	5,580,240.37	-61,463,826.57
本期期初	-67,044,066.94	5,580,240.37	-61,463,826.57
本期利润	9,350,811.94	-3,847,265.24	5,503,546.70
本期基金份额交易产生的变动数	8,036,273.25	26,136.43	8,062,409.68
其中：基金申购款	-810,361.45	-10,489.53	-820,850.98
基金赎回款	8,846,634.70	36,625.96	8,883,260.66
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-49,656,981.75	1,759,111.56	-47,897,870.19

大成沪深 300 增强发起式 C

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-41,463,972.99	3,130,108.99	-38,333,864.00
本期期初	-41,463,972.99	3,130,108.99	-38,333,864.00
本期利润	4,719,151.15	189,893.60	4,909,044.75
本期基金份额交易产生的变动数	2,587,288.92	-2,279,586.00	307,702.92
其中：基金申购款	-19,524,393.62	-3,115,293.85	-22,639,687.47
基金赎回款	22,111,682.54	835,707.85	22,947,390.39
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-34,157,532.92	1,040,416.59	-33,117,116.33

6.4.7.13 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期
	2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	66,025.31
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	20,165.94
其他	6,570.83
合计	92,762.08

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
	2025年1月1日至2025年6月30日

股票投资收益——买卖股票差价收入	9,305,240.35
股票投资收益——赎回差价收入	-
股票投资收益——申购差价收入	-
股票投资收益——证券出借差价收入	-
合计	9,305,240.35

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
	2025年1月1日至2025年6月30日
卖出股票成交总额	1,505,957,554.07
减：卖出股票成本总额	1,495,135,633.15
减：交易费用	1,516,680.57
买卖股票差价收入	9,305,240.35

6.4.7.14.3 股票投资收益——证券出借差价收入

无。

6.4.7.15 债券投资收益

6.4.7.15.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期
	2025年1月1日至2025年6月30日
债券投资收益——利息收入	1.09
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	1,618.52
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	1,619.61

6.4.7.15.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期
	2025年1月1日至2025年6月30日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	12,420.11
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	10,800.00
减：应计利息总额	1.09
减：交易费用	0.50
买卖债券差价收入	1,618.52

6.4.7.15.3 债券投资收益——赎回差价收入

无。

6.4.7.15.4 债券投资收益——申购差价收入

无。

6.4.7.16 资产支持证券投资收益**6.4.7.16.1 资产支持证券投资收益项目构成**

无。

6.4.7.16.2 资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入

无。

6.4.7.16.3 资产支持证券投资收益——赎回差价收入

无。

6.4.7.16.4 资产支持证券投资收益——申购差价收入

无。

6.4.7.17 贵金属投资收益**6.4.7.17.1 贵金属投资收益项目构成**

无。

6.4.7.17.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

无。

6.4.7.17.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

无。

6.4.7.17.4 贵金属投资收益——申购差价收入

无。

6.4.7.18 衍生工具收益**6.4.7.18.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入**

无。

6.4.7.18.2 衍生工具收益——其他投资收益

单位：人民币元

项目	本期
	2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
股指期货投资收益	1,999,823.20

6.4.7.19 股利收益

单位：人民币元

项目	本期
	2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
股票投资产生的股利收益	5,327,519.49
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	5,327,519.49

6.4.7.20 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期
	2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
1. 交易性金融资产	-4,716,251.64
股票投资	-4,716,251.64
债券投资	—
资产支持证券投资	—
基金投资	—
贵金属投资	—
其他	—
2. 衍生工具	1,058,880.00
权证投资	—
期货投资	1,058,880.00
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	-3,657,371.64

6.4.7.21 其他收入

单位：人民币元

项目	本期
	2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
基金赎回费收入	4,625.21
基金转换费收入	71.10
合计	4,696.31

6.4.7.22 信用减值损失

无。

6.4.7.23 其他费用

单位：人民币元

项目	本期
	2025 年 1 月 1 日至 2025 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	3,063.93
账户维护费	9,000.00
指数使用费	16,462.18
合计	110,348.97

6.4.7.24 分部报告

无。

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 或有事项

无。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

无。

6.4.9 关联方关系

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

本基金本报告期存在控制关系或者其他重大利害关系的关联方未发生变化。

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

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

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2025年1月1日至2025年6月30日		上年度可比期间 2024年1月1日至2024年6月30日	
	成交金额	占当期股票 成交总额的比例 (%)	成交金额	占当期股票 成交总额的比例 (%)
光大证券	-	-	519,389,442.19	22.44

6.4.10.1.2 债券交易

无。

6.4.10.1.3 债券回购交易

无。

6.4.10.1.4 权证交易

无。

6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期			
	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 (%)	
-	-	-	-	-
关联方名称	上年度可比期间			
	2024年1月1日至2024年6月30日			
当期佣金	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	382,221.08	21.90	41,937.45	6.13

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 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	1,852,755.56	1,261,961.03
其中：应支付销售机构的客户维护费	366,462.31	335,767.98
应支付基金管理人的净管理费	1,486,293.25	926,193.05

注：基金管理费每日计提，按月支付。基金管理费按前一日的基金资产净值的 0.80% 年费率计提。

计算方法如下：

$$H = E \times 0.80\% / \text{当年天数}$$

H 为每日应支付的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	347,391.63	236,617.63

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

计算方法如下：

$$H = E \times 0.15\% / \text{当年天数}$$

H 为每日应支付的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

6.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联 方名称	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	大成沪深 300 增强发 起式 A	大成沪深 300 增强发 起式 C	合计
大成基金	-	102,496.17	102,496.17
光大证券	-	23.62	23.62
中国工商银行	-	69,238.52	69,238.52
合计	-	171,758.31	171,758.31
获得销售服务费的各关联 方名称	上年度可比期间 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	大成沪深 300 增强发 起式 A	大成沪深 300 增强发 起式 C	合计
大成基金	-	81,527.52	81,527.52
光大证券	-	2.83	2.83
中国工商银行	-	45,726.66	45,726.66
合计	-	127,257.01	127,257.01

注：C 类基金份额的销售服务费年费率为 0.4%。

销售服务费的计算方法如下：

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

H 为该类基金份额每日应计提的销售服务费

E 为该类基金份额前一日基金资产净值

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

无。

6.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

6.4.10.4.1 与关联方通过约定申报方式进行的适用固定期限费率的证券出借业务的情况

无。

6.4.10.4.2 与关联方通过约定申报方式进行的适用市场化期限费率的证券出借业务的情况

无。

6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

份额单位：份

项目	本期 2025年1月1日至2025年6月30 日	本期 2025年1月1日至2025年6 月30日
	大成沪深 300 增强发起式 A	大成沪深 300 增强发起式 C
基金合同生效日（2021年2月23日）持有的基金份额	-	-
报告期初持有的基金份额	10,000,000.00	-
报告期内申购/买入总份额	-	-
报告期内因拆分变动份额	-	-
减：报告期内赎回/卖出总份额	-	-
报告期内持有的基金份额	10,000,000.00	-
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	1.88%	-
项目	上年度可比期间 2024年1月1日至2024年6月30 日	上年度可比期间 2024年1月1日至2024年6 月30日
	大成沪深 300 增强发起式 A	大成沪深 300 增强发起式 C
基金合同生效日（2021年2	-	-

月 23 日) 持有的基金份额		
报告期初持有的基金份额	10,000,000.00	-
报告期内申购/买入总份额	-	-
报告期内因拆分变动份额	-	-
减: 报告期间赎回/卖出总份额	-	-
报告期末持有的基金份额	10,000,000.00	-
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	2.29%	-

注: 基金管理人大成基金投资本基金适用的交易费率与本基金法律文件规定一致。

6.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

无。

6.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位: 人民币元

关联方名称	本期 2025年1月1日至2025年6月30日		上年度可比期间 2024年1月1日至2024年6月30日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国工商银行	47,607,392.89	66,025.31	24,775,674.76	38,784.08

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(2025年6月30日)本基金持有的流通受限证券

6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位: 人民币元

6.4.12.1.1 受限证券类别: 股票										
证券代码	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
001335	信凯	2025年4月	6个月	新股锁定	12.80	28.05	80	1,024.00	2,244.00	-

	科 技	2 日								
001356	富 岭 股 份	2025 年1月 16日	6 个 月	新股 锁定	5. 30	14. 44	709	3, 757. 70	10, 237. 96	-
001382	新 亚 电 缆	2025 年3月 13日	6 个 月	新股 锁定	7. 40	20. 21	366	2, 708. 40	7, 396. 86	-
001388	信 通 电 子	2025 年6月 24日	6 个 月	新股 未上 市	16. 42	16. 42	94	1, 543. 48	1, 543. 48	-
001388	信 通 电 子	2025 年6月 24日	1 个 月 内(含)	新股 未上 市	16. 42	16. 42	843	13, 842. 06	13, 842. 06	-
001390	古 麒 绒 材	2025 年5月 21日	6 个 月	新股 锁定	12. 08	18. 12	178	2, 150. 24	3, 225. 36	-
001395	亚 联 机 械	2025 年1月 20日	6 个 月	新股 锁定	19. 08	47. 25	80	1, 526. 40	3, 780. 00	-
301173	毓 恬 冠 佳	2025 年2月 24日	6 个 月	新股 锁定	28. 33	44. 98	173	4, 901. 09	7, 781. 54	-
301458	钧 崴 电 子	2025 年1月 2日	6 个 月	新股 锁定	10. 40	34. 11	701	7, 290. 40	23, 911. 11	-
301479	弘 景 光 电	2025 年3月 6日	6 个 月	新股 锁定	-	77. 87	52	-	4, 049. 24	转增 股
301479	弘 景 光 电	2025 年3月 6日	6 个 月	新股 锁定	41. 90	77. 87	130	5, 447. 00	10, 123. 10	-
301501	恒 鑫	2025 年3月	6 个 月	新股 锁定	-	45. 22	108	-	4, 883. 76	转增 股

	生活	11 日								
301501	恒鑫生活	2025 年 3 月 11 日	6 个月	新股锁定	39.92	45.22	241	9,620.72	10,898.02	-
301535	浙江华远	2025 年 3 月 18 日	6 个月	新股锁定	4.92	18.99	734	3,611.28	13,938.66	-
301560	众捷汽车	2025 年 4 月 17 日	6 个月	新股锁定	16.50	27.45	190	3,135.00	5,215.50	-
301590	优优绿能	2025 年 5 月 28 日	6 个月	新股锁定	89.60	139.48	73	6,540.80	10,182.04	-
301595	太力科技	2025 年 5 月 12 日	6 个月	新股锁定	17.05	29.10	196	3,341.80	5,703.60	-
301601	惠通科技	2025 年 1 月 8 日	6 个月	新股锁定	11.80	33.85	342	4,035.60	11,576.70	-
301602	超研股份	2025 年 1 月 15 日	6 个月	新股锁定	6.70	24.80	658	4,408.60	16,318.40	-
301636	泽润新能	2025 年 4 月 30 日	6 个月	新股锁定	33.06	47.46	128	4,231.68	6,074.88	-
301658	首航新能	2025 年 3 月 26 日	6 个月	新股锁定	11.80	22.98	437	5,156.60	10,042.26	-
301662	宏工科技	2025 年 4 月 10 日	6 个月	新股锁定	26.60	82.50	143	3,803.80	11,797.50	-
301678	新恒	2025 年 6 月	6 个月	新股锁定	12.80	44.54	382	4,889.60	17,014.28	-

	汇	13 日								
603014	威高血净	2025 年 5 月 12 日	6 个月	新股锁定	26.50	32.68	205	5,432.50	6,699.40	-
603049	中策橡胶	2025 年 5 月 27 日	6 个月	新股锁定	46.50	42.85	222	10,323.00	9,512.70	-
603072	天和磁材	2024 年 12 月 24 日	6 个月	新股锁定	12.30	54.45	226	2,779.80	12,305.70	-
603120	肯特催化	2025 年 4 月 9 日	6 个月	新股锁定	15.00	33.43	65	975.00	2,172.95	-
603124	江南新材	2025 年 3 月 12 日	6 个月	新股锁定	10.54	46.31	88	927.52	4,075.28	-
603257	中国瑞林	2025 年 3 月 28 日	6 个月	新股锁定	20.52	37.47	78	1,600.56	2,922.66	-
603271	永杰新材	2025 年 3 月 4 日	6 个月	新股锁定	20.60	35.08	126	2,595.60	4,420.08	-
603382	海阳科技	2025 年 6 月 5 日	6 个月	新股锁定	11.50	22.39	105	1,207.50	2,350.95	-
603409	汇通控股	2025 年 2 月 25 日	6 个月	新股锁定	24.18	33.32	100	2,418.00	3,332.00	-
688411	海博思创	2025 年 1 月 20 日	6 个月	新股锁定	19.38	83.49	560	10,852.80	46,754.40	-
688545	兴福电	2025 年 1 月 15 日	6 个月	新股锁定	11.68	26.95	994	11,609.92	26,788.30	-

	子									
688583	思看科技	2025 年 1 月 8 日	6 个月	新股锁定	-	79.68	52	-	4,143.36	转增股
688583	思看科技	2025 年 1 月 8 日	6 个月	新股锁定	33.46	79.68	175	5,855.50	13,944.00	-
688755	汉邦科技	2025 年 5 月 9 日	6 个月	新股锁定	22.77	39.33	203	4,622.31	7,983.99	-
688757	胜科纳米	2025 年 3 月 18 日	6 个月	新股锁定	9.08	25.94	536	4,866.88	13,903.84	-
688758	赛分科技	2025 年 1 月 2 日	6 个月	新股锁定	4.32	16.97	777	3,356.64	13,185.69	-
688775	影石创新	2025 年 6 月 4 日	6 个月	新股锁定	47.27	124.16	401	18,955.27	49,788.16	-

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

无。

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

无。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

无。

6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

无。

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金在日常经营活动中由金融工具产生的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金管理人制定了政策和程序来识别及分析这些风险，并设定适当的风险限额及内部控制流程，

通过可靠的管理及信息系统持续监控上述各类风险。

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

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

6.4.13.2 信用风险

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

本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的银行存款存放在本基金的托管人中国工商银行股份有限公司，因而与银行存款相关的信用风险不重大。本基金在交易所进行的交易均以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，违约风险可能性很小；在银行间同业市场进行交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式进行限制以控制相应的信用风险。

本基金的基金管理人建立了信用风险管理流程，通过对投资品种信用等级评估来控制证券发行人的信用风险。信用等级评估以内部信用评级为主，外部信用评级为辅。内部债券信用评级主要考察发行人的经营风险、财务风险和流动性风险，以及信用产品的条款和担保人的情况等。此外，本基金的基金管理人根据信用产品的内部评级，通过单只信用产品投资占基金资产净值的比例及占发行量的比例进行控制，通过分散化投资以分散信用风险。

本期末，本基金无债券投资（上年度末：同）。

6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金在履行与金融负债有关的义务时遇到资金短缺的风险。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种

所处的交易市场不活跃而带来的变现困难或因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理的价格变现。

6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》及《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》等有关法规的要求建立健全开放式基金流动性风险管理的内部控制体系，审慎评估各类资产的流动性，针对性制定流动性风险管理措施，对本基金组合资产的流动性风险进行管理。本基金的基金管理人采用监控基金组合资产持仓集中度指标、逆回购交易的到期日与交易对手的集中度、流动性受限资产比例、基金组合资产中 7 个工作日可变现资产的可变现价值以及压力测试等方式防范流动性风险。并于开放日对本基金的申购赎回情况进行监控，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配，确保本基金资产的变现能力与投资者赎回需求的匹配与平衡。本基金的基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。于本期末，本基金持有的流动性受限资产的估值占基金资产净值的比例未超过 15%。

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

6.4.13.4 市场风险

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

6.4.13.4.1 利率风险

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

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

资产主要为货币资金及结算备付金等。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位: 人民币元

本期末 2025 年 6 月 30 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
货币资金	47,607,392.89	-	-	-	47,607,392.89
结算备付金	6,953,201.88	-	-	-	6,953,201.88
存出保证金	172,928.79	-	-	3,797,632.80	3,970,561.59
交易性金融资产	-	-	-	392,166,826.56	392,166,826.56
应收申购款	-	-	-	69,970.16	69,970.16
应收清算款	-	-	-	16,137,099.39	16,137,099.39
资产总计	54,733,523.56	-	-	412,171,528.91	466,905,052.47
负债					
应付赎回款	-	-	-	180,978.32	180,978.32
应付管理人报酬	-	-	-	294,206.36	294,206.36
应付托管费	-	-	-	55,163.69	55,163.69
应付清算款	-	-	-	15,295,473.06	15,295,473.06
应付销售服务费	-	-	-	56,287.51	56,287.51
其他负债	-	-	-	305,356.73	305,356.73
负债总计	-	-	-	16,187,465.67	16,187,465.67
利率敏感度缺口	54,733,523.56	-	-	395,984,063.24	450,717,586.80
上年度末 2024 年 12 月 31 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
货币资金	28,974,021.71	-	-	-	28,974,021.71
结算备付金	3,343,262.70	-	-	-	3,343,262.70
存出保证金	159,103.38	-	-	563,241.60	722,344.98
交易性金融资产	-	-	-	460,308,467.50	460,308,467.50
应收申购款	-	-	-	3,091,188.55	3,091,188.55
应收清算款	-	-	-	6,132,259.59	6,132,259.59
资产总计	32,476,387.79	-	-	470,095,157.24	502,571,545.03
负债					
应付赎回款	-	-	-	9,600,636.56	9,600,636.56
应付管理人报酬	-	-	-	340,817.25	340,817.25
应付托管费	-	-	-	63,903.25	63,903.25
应付销售服务费	-	-	-	63,272.66	63,272.66
其他负债	-	-	-	370,987.58	370,987.58
负债总计	-	-	-	10,439,617.30	10,439,617.30
利率敏感度缺口	32,476,387.79	-	-	459,655,539.94	492,131,927.73

注: 表中所示为本基金资产及负债的账面价值, 并按照合约规定的利率重新定价日或到期日孰早者予以分类。

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

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

6.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基金持有的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，所面临的最大市场价格风险由所持有的金融工具的公允价值决定。本基金通过投资组合的分散化降低市场价格风险，并且本基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控。

本基金的投资组合比例为：股票资产投资比例不低于基金资产的 80%，其中投资于标的指数成份股和备选成份股的资产不低于非现金基金资产的 80%；每个交易日日终在扣除股指期货、国债期货、股票期权合约需缴纳的交易保证金后，保持不低于基金资产净值 5%的现金或到期日在一年以内的政府债券，其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。如法律法规或中国证监会变更投资品种的投资比例限制，基金管理人在履行适当程序后，可以调整上述投资品种的投资比例。

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 2025年6月30日		上年度末 2024年12月31日	
	公允价值	占基金资产净值 比例 (%)	公允价值	占基金资产净值 比例 (%)
交易性金融资产—股票投资	392,166,826.56	87.01	460,308,467.50	93.53
交易性金融资产—基金投资	—	—	—	—
交易性金融资产—贵金属投资	—	—	—	—
衍生金融资产—权证投资	—	—	—	—
其他	—	—	—	—
合计	392,166,826.56	87.01	460,308,467.50	93.53

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除业绩比较基准以外的其他市场变量保持不变	
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额 (单位: 人民币元)
		本期末 (2025 年 6 月 30 日)
	业绩比较基准上升 5%	21,089,695.63
	业绩比较基准下降 5%	-21,089,695.63
		20,143,552.53
		-20,143,552.53

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 2025 年 6 月 30 日	上年度末 2024 年 12 月 31 日
第一层次	391,730,762.79	444,167,574.98
第二层次	15,385.54	15,685,750.50
第三层次	420,678.23	455,142.02
合计	392,166,826.56	460,308,467.50

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	392,166,826.56	83.99
	其中：股票	392,166,826.56	83.99
2	基金投资	—	—
3	固定收益投资	—	—
	其中：债券	—	—
	资产支持证券	—	—
4	贵金属投资	—	—
5	金融衍生品投资	—	—
6	买入返售金融资产	—	—
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	—	—
7	银行存款和结算备付金合计	54,560,594.77	11.69
8	其他各项资产	20,177,631.14	4.32
9	合计	466,905,052.47	100.00

7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 报告期末指数投资按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	640,043.00	0.14
B	采矿业	5,965,830.00	1.32
C	制造业	208,274,264.15	46.21
D	电力、热力、燃气及水生产和供应	19,705,161.00	4.37

	业		
E	建筑业	12,125,412.00	2.69
F	批发和零售业	—	—
G	交通运输、仓储和邮电业	16,014,328.32	3.55
H	住宿和餐饮业	—	—
I	信息传输、软件和信息技术服务业	14,185,406.00	3.15
J	金融业	96,662,348.32	21.45
K	房地产业	4,259,200.00	0.94
L	租赁和商务服务业	9,921,315.00	2.20
M	科学研究和技术服务业	1,152,794.00	0.26
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	433,056.00	0.10
R	文化、体育和娱乐业	—	—
S	综合	—	—
	合计	389,339,157.79	86.38

7.2.2 报告期末积极投资按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	—	—
B	采矿业	—	—
C	制造业	2,191,556.57	0.49
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	251,064.00	0.06
E	建筑业	46,781.00	0.01
F	批发和零售业	2,244.00	0.00
G	交通运输、仓储和邮电业	—	—
H	住宿和餐饮业	—	—
I	信息传输、软件和信息技术服务业	—	—
J	金融业	307,620.00	0.07
K	房地产业	—	—
L	租赁和商务服务业	—	—
M	科学研究和技术服务业	28,403.20	0.01

N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
0	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	2,827,668.77	0.63

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	000100	TCL 科技	4,634,200	20,066,086.00	4.45
2	002001	新和成	915,016	19,462,390.32	4.32
3	688223	晶科能源	3,186,423	16,537,535.37	3.67
4	000725	京东方 A	3,873,100	15,453,669.00	3.43
5	000001	平安银行	1,129,800	13,636,686.00	3.03
6	601901	方正证券	1,703,400	13,473,894.00	2.99
7	600219	南山铝业	3,498,700	13,400,021.00	2.97
8	601288	农业银行	2,155,800	12,676,104.00	2.81
9	600519	贵州茅台	8,600	12,121,872.00	2.69
10	000166	申万宏源	2,334,400	11,718,688.00	2.60
11	600660	福耀玻璃	203,500	11,601,535.00	2.57
12	000651	格力电器	241,600	10,852,672.00	2.41
13	600176	中国巨石	873,000	9,952,200.00	2.21
14	600674	川投能源	577,300	9,259,892.00	2.05
15	002027	分众传媒	1,233,300	9,003,090.00	2.00
16	000333	美的集团	124,600	8,996,120.00	2.00
17	600900	长江电力	289,100	8,713,474.00	1.93
18	601766	中国中车	1,191,200	8,386,048.00	1.86
19	600115	中国东航	2,000,600	8,062,418.00	1.79
20	688009	中国通号	1,540,879	7,920,118.06	1.76
21	600015	华夏银行	921,800	7,291,438.00	1.62
22	601117	中国化学	857,100	6,573,957.00	1.46
23	300750	宁德时代	22,300	5,624,506.00	1.25
24	002230	科大讯飞	107,300	5,137,524.00	1.14
25	601688	华泰证券	264,500	4,710,745.00	1.05

26	601318	中国平安	82,459	4,574,825.32	1.02
27	600919	江苏银行	355,500	4,244,670.00	0.94
28	601919	中远海控	275,800	4,148,032.00	0.92
29	300124	汇川技术	62,800	4,054,996.00	0.90
30	600050	中国联通	751,300	4,011,942.00	0.89
31	601319	中国人保	438,700	3,821,077.00	0.85
32	601818	光大银行	916,500	3,803,475.00	0.84
33	601668	中国建筑	651,700	3,760,309.00	0.83
34	601360	三六零	335,600	3,423,120.00	0.76
35	601169	北京银行	479,700	3,276,351.00	0.73
36	000895	双汇发展	133,300	3,253,853.00	0.72
37	603288	海天味业	81,300	3,163,383.00	0.70
38	600018	上港集团	532,100	3,038,291.00	0.67
39	600887	伊利股份	103,900	2,896,732.00	0.64
40	300999	金龙鱼	84,900	2,507,097.00	0.56
41	600989	宝丰能源	148,900	2,403,246.00	0.53
42	601699	潞安环能	225,100	2,374,805.00	0.53
43	600515	海南机场	602,000	2,131,080.00	0.47
44	300628	亿联网络	60,300	2,096,028.00	0.47
45	600741	华域汽车	113,200	1,997,980.00	0.44
46	002493	荣盛石化	198,600	1,644,408.00	0.36
47	600048	保利发展	179,300	1,452,330.00	0.32
48	000425	徐工机械	177,700	1,380,729.00	0.31
49	000301	东方盛虹	165,400	1,377,782.00	0.31
50	600036	招商银行	29,500	1,355,525.00	0.30
51	600019	宝钢股份	198,500	1,308,115.00	0.29
52	600372	中航机载	93,600	1,128,816.00	0.25
53	601899	紫金矿业	57,600	1,123,200.00	0.25
54	601166	兴业银行	47,500	1,108,650.00	0.25
55	600030	中信证券	39,100	1,079,942.00	0.24
56	605499	东鹏饮料	3,400	1,067,770.00	0.24
57	601077	渝农商行	146,400	1,045,296.00	0.23
58	002179	中航光电	25,400	1,025,144.00	0.23
59	000408	藏格矿业	23,200	989,944.00	0.22
60	000858	五 粮 液	7,800	927,420.00	0.21
61	601211	国泰海通	45,800	877,528.00	0.19
62	601728	中国电信	107,900	836,225.00	0.19
63	601328	交通银行	103,700	829,600.00	0.18
64	603259	药明康德	11,600	806,780.00	0.18
65	600941	中国移动	6,900	776,595.00	0.17
66	600025	华能水电	73,900	705,745.00	0.16
67	601988	中国银行	113,800	639,556.00	0.14
68	600031	三一重工	33,400	599,530.00	0.13

69	603993	洛阳钼业	70,000	589,400.00	0.13
70	601857	中国石油	68,500	585,675.00	0.13
71	000063	中兴通讯	17,600	571,824.00	0.13
72	002415	海康威视	20,400	565,692.00	0.13
73	300498	温氏股份	32,800	560,224.00	0.12
74	002142	宁波银行	20,200	552,672.00	0.12
75	601628	中国人寿	13,300	547,827.00	0.12
76	600926	杭州银行	32,000	538,240.00	0.12
77	601012	隆基绿能	34,500	518,190.00	0.11
78	300408	三环集团	15,400	514,360.00	0.11
79	000630	铜陵有色	152,300	508,682.00	0.11
80	600028	中国石化	88,800	500,832.00	0.11
81	000338	潍柴动力	32,500	499,850.00	0.11
82	002594	比亚迪	1,500	497,865.00	0.11
83	002916	深南电路	4,440	478,676.40	0.11
84	601658	邮储银行	86,800	474,796.00	0.11
85	601888	中国中免	7,700	469,469.00	0.10
86	000792	盐湖股份	26,800	457,744.00	0.10
87	600415	小商品城	21,700	448,756.00	0.10
88	600016	民生银行	94,400	448,400.00	0.10
89	300014	亿纬锂能	9,700	444,357.00	0.10
90	000625	长安汽车	34,400	438,944.00	0.10
91	600958	东方证券	45,000	435,600.00	0.10
92	603799	华友钴业	11,700	433,134.00	0.10
93	300015	爱尔眼科	34,700	433,056.00	0.10
94	601009	南京银行	37,100	431,102.00	0.10
95	601600	中国铝业	60,700	427,328.00	0.09
96	601006	大秦铁路	63,900	421,740.00	0.09
97	000776	广发证券	24,900	418,569.00	0.09
98	600584	长电科技	12,100	407,649.00	0.09
99	000977	浪潮信息	8,000	407,040.00	0.09
100	600938	中国海油	15,500	404,705.00	0.09
101	601998	中信银行	47,100	400,350.00	0.09
102	002736	国信证券	34,400	396,288.00	0.09
103	000938	紫光股份	16,200	388,638.00	0.09
104	600585	海螺水泥	17,600	377,872.00	0.08
105	601390	中国中铁	66,800	374,748.00	0.08
106	601669	中国电建	76,900	374,503.00	0.08
107	600196	复星医药	14,700	368,823.00	0.08
108	601881	中国银河	21,400	367,010.00	0.08
109	601186	中国铁建	45,800	366,858.00	0.08
110	600010	包钢股份	198,300	354,957.00	0.08
111	002236	大华股份	22,200	352,536.00	0.08

112	600362	江西铜业	14,900	349,107.00	0.08
113	601066	中信建投	14,500	348,725.00	0.08
114	000002	万科 A	53,900	346,038.00	0.08
115	300759	康龙化成	14,100	346,014.00	0.08
116	601939	建设银行	36,200	341,728.00	0.08
117	003816	中国广核	93,300	339,612.00	0.08
118	002938	鹏鼎控股	10,500	336,315.00	0.07
119	600011	华能国际	47,100	336,294.00	0.07
120	688396	华润微	7,100	334,836.00	0.07
121	601989	中国重工	71,900	333,616.00	0.07
122	001979	招商蛇口	37,600	329,752.00	0.07
123	600875	东方电气	19,200	321,408.00	0.07
124	001965	招商公路	26,700	320,400.00	0.07
125	601618	中国中冶	105,300	313,794.00	0.07
126	688599	天合光能	21,200	308,036.00	0.07
127	601238	广汽集团	39,900	298,851.00	0.07
128	000708	中信特钢	25,200	296,352.00	0.07
129	000157	中联重科	40,700	294,261.00	0.07
130	300760	迈瑞医疗	1,300	292,175.00	0.06
131	601808	中海油服	21,000	288,960.00	0.06
132	600023	浙能电力	51,400	272,420.00	0.06
133	601800	中国交建	30,300	269,367.00	0.06
134	688187	时代电气	6,100	260,165.00	0.06
135	002600	领益智造	29,700	255,123.00	0.06
136	300433	蓝思科技	10,200	227,460.00	0.05
137	000568	泸州老窖	2,000	226,800.00	0.05
138	601138	工业富联	9,700	207,386.00	0.05
139	601878	浙商证券	18,900	206,199.00	0.05
140	600332	白云山	5,900	155,524.00	0.03
141	000617	中油资本	20,000	146,000.00	0.03
142	600482	中国动力	6,000	138,420.00	0.03
143	601601	中国太保	3,600	135,036.00	0.03
144	601336	新华保险	2,200	128,700.00	0.03
145	600089	特变电工	9,600	114,528.00	0.03
146	601995	中金公司	3,200	113,152.00	0.03
147	600690	海尔智家	3,900	96,642.00	0.02
148	601868	中国能建	41,200	91,876.00	0.02
149	002714	牧原股份	1,900	79,819.00	0.02
150	603833	欧派家居	1,400	79,030.00	0.02
151	601229	上海银行	6,400	67,904.00	0.02
152	601898	中煤能源	6,200	67,828.00	0.02
153	300979	华利集团	1,200	63,084.00	0.01
154	600795	国电电力	12,400	60,016.00	0.01

155	002601	龙佰集团	2,700	43,767.00	0.01
156	600188	兖矿能源	2,500	30,425.00	0.01
157	601877	正泰电器	1,300	29,471.00	0.01
158	001391	国货航	3,484	23,447.32	0.01
159	601985	中国核电	1,900	17,708.00	0.00

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	300207	欣旺达	13,200	264,792.00	0.06
2	000050	深天马 A	30,900	263,268.00	0.06
3	300919	中伟股份	7,900	259,752.00	0.06
4	601456	国联民生	24,700	255,645.00	0.06
5	601991	大唐发电	79,200	251,064.00	0.06
6	000898	鞍钢股份	108,200	251,024.00	0.06
7	601992	金隅集团	153,800	233,776.00	0.05
8	000877	天山股份	49,300	228,752.00	0.05
9	300739	明阳电路	9,000	133,560.00	0.03
10	300140	节能环保	14,700	90,699.00	0.02
11	000783	长江证券	7,500	51,975.00	0.01
12	688775	影石创新	401	49,788.16	0.01
13	600606	绿地控股	28,700	46,781.00	0.01
14	688411	海博思创	560	46,754.40	0.01
15	300171	东富龙	3,300	43,857.00	0.01
16	688545	兴福电子	994	26,788.30	0.01
17	301458	钧崴电子	701	23,911.11	0.01
18	688583	思看科技	227	18,087.36	0.00
19	301678	新恒汇	382	17,014.28	0.00
20	000959	首钢股份	4,900	16,660.00	0.00
21	301602	超研股份	658	16,318.40	0.00
22	301501	恒鑫生活	349	15,781.78	0.00
23	001388	信通电子	937	15,385.54	0.00
24	301479	弘景光电	182	14,172.34	0.00
25	301535	浙江华远	734	13,938.66	0.00
26	688757	胜科纳米	536	13,903.84	0.00
27	688758	赛分科技	777	13,185.69	0.00
28	603072	天和磁材	226	12,305.70	0.00
29	301662	宏工科技	143	11,797.50	0.00
30	301601	惠通科技	342	11,576.70	0.00
31	001356	富岭股份	709	10,237.96	0.00
32	301590	优优绿能	73	10,182.04	0.00
33	301658	首航新能	437	10,042.26	0.00
34	603049	中策橡胶	222	9,512.70	0.00
35	688755	汉邦科技	203	7,983.99	0.00

36	301173	毓恬冠佳	173	7,781.54	0.00
37	001382	新亚电缆	366	7,396.86	0.00
38	603014	威高血净	205	6,699.40	0.00
39	301636	泽润新能	128	6,074.88	0.00
40	301595	太力科技	196	5,703.60	0.00
41	301560	众捷汽车	190	5,215.50	0.00
42	603271	永杰新材	126	4,420.08	0.00
43	603124	江南新材	88	4,075.28	0.00
44	001395	亚联机械	80	3,780.00	0.00
45	603409	汇通控股	100	3,332.00	0.00
46	001390	古麒绒材	178	3,225.36	0.00
47	603257	中国瑞林	78	2,922.66	0.00
48	603382	海阳科技	105	2,350.95	0.00
49	001335	信凯科技	80	2,244.00	0.00
50	603120	肯特催化	65	2,172.95	0.00

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	000725	京东方 A	36,529,896.70	7.42
2	601288	农业银行	32,242,372.00	6.55
3	603288	海天味业	25,392,998.74	5.16
4	603659	璞泰来	25,391,744.45	5.16
5	688599	天合光能	24,572,273.94	4.99
6	601688	华泰证券	23,833,540.01	4.84
7	002920	德赛西威	23,540,365.00	4.78
8	601877	正泰电器	22,277,595.00	4.53
9	600570	恒生电子	21,772,840.00	4.42
10	601766	中国中车	21,765,918.00	4.42
11	600219	南山铝业	21,727,486.80	4.41
12	601916	浙商银行	21,633,109.00	4.40
13	300408	三环集团	21,347,793.00	4.34
14	601166	兴业银行	21,124,149.00	4.29
15	000100	TCL 科技	20,759,154.00	4.22
16	300628	亿联网络	19,810,071.00	4.03
17	002648	卫星化学	19,605,950.40	3.98
18	688223	晶科能源	19,565,682.62	3.98
19	300661	圣邦股份	19,344,901.38	3.93
20	000333	美的集团	18,048,500.00	3.67
21	300750	宁德时代	17,606,421.00	3.58
22	601601	中国太保	17,124,453.00	3.48
23	000999	华润三九	16,921,352.30	3.44

24	601816	京沪高铁	16,566,063.00	3.37
25	601919	中远海控	16,545,240.70	3.36
26	600660	福耀玻璃	16,458,245.00	3.34
27	000425	徐工机械	16,425,862.00	3.34
28	688126	沪硅产业	16,195,760.44	3.29
29	002001	新和成	16,186,950.60	3.29
30	601319	中国人保	16,143,055.00	3.28
31	002028	思源电气	15,065,641.00	3.06
32	000166	申万宏源	15,028,317.60	3.05
33	600015	华夏银行	14,697,429.90	2.99
34	600600	青岛啤酒	14,546,341.00	2.96
35	000408	藏格矿业	14,302,719.00	2.91
36	603993	洛阳钼业	14,067,766.00	2.86
37	600926	杭州银行	13,922,453.00	2.83
38	600900	长江电力	13,695,474.00	2.78
39	000001	平安银行	13,528,320.00	2.75
40	601901	方正证券	13,512,728.00	2.75
41	601009	南京银行	13,506,804.30	2.74
42	601377	兴业证券	13,504,344.00	2.74
43	603195	公牛集团	13,362,416.31	2.72
44	000895	双汇发展	13,220,442.00	2.69
45	002812	恩捷股份	13,032,551.00	2.65
46	600519	贵州茅台	12,904,908.00	2.62
47	000651	格力电器	12,882,572.00	2.62
48	688009	中国通号	12,735,208.29	2.59
49	600016	民生银行	12,364,335.00	2.51
50	600795	国电电力	12,190,919.00	2.48
51	002027	分众传媒	11,774,024.00	2.39
52	600176	中国巨石	11,352,922.00	2.31
53	600919	江苏银行	11,077,299.00	2.25
54	002180	纳思达	10,881,396.00	2.21
55	002601	龙佰集团	10,742,132.42	2.18
56	600050	中国联通	10,629,995.00	2.16
57	601318	中国平安	10,448,232.40	2.12
58	688303	大全能源	10,274,339.65	2.09
59	600674	川投能源	10,224,323.00	2.08
60	300316	晶盛机电	10,181,636.00	2.07
61	600028	中国石化	9,909,334.16	2.01

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	300408	三环集团	41,639,830.00	8.46
2	601877	正泰电器	31,352,399.00	6.37
3	002648	卫星化学	30,302,380.14	6.16
4	600016	民生银行	27,650,174.00	5.62
5	600887	伊利股份	27,005,458.00	5.49
6	601166	兴业银行	26,720,905.00	5.43
7	600570	恒生电子	26,441,866.00	5.37
8	601009	南京银行	26,192,601.54	5.32
9	603659	璞泰来	25,461,342.18	5.17
10	002920	德赛西威	25,269,879.26	5.13
11	300661	圣邦股份	25,210,089.30	5.12
12	688599	天合光能	24,247,289.57	4.93
13	000725	京东方 A	24,045,675.00	4.89
14	601319	中国人保	22,473,665.70	4.57
15	600219	南山铝业	22,346,287.95	4.54
16	601916	浙商银行	22,147,929.00	4.50
17	603288	海天味业	21,564,988.73	4.38
18	000776	广发证券	20,636,007.00	4.19
19	601766	中国中车	20,620,971.00	4.19
20	300628	亿联网络	20,130,665.60	4.09
21	601688	华泰证券	20,013,464.00	4.07
22	601288	农业银行	19,977,835.00	4.06
23	600406	国电南瑞	19,817,910.56	4.03
24	000651	格力电器	19,094,905.00	3.88
25	000895	双汇发展	18,489,010.68	3.76
26	300433	蓝思科技	17,304,241.95	3.52
27	601601	中国太保	17,072,753.00	3.47
28	000999	华润三九	16,543,288.50	3.36
29	601816	京沪高铁	16,474,901.00	3.35
30	600926	杭州银行	15,955,373.97	3.24
31	000425	徐工机械	15,731,303.00	3.20
32	688126	沪硅产业	15,469,389.87	3.14
33	601318	中国平安	15,358,393.80	3.12
34	002028	思源电气	15,336,887.00	3.12
35	600660	福耀玻璃	15,289,903.00	3.11
36	600600	青岛啤酒	15,283,677.00	3.11
37	000408	藏格矿业	15,277,163.00	3.10
38	002252	上海莱士	14,690,319.00	2.99
39	688009	中国通号	14,562,776.33	2.96
40	601919	中远海控	14,192,651.40	2.88
41	600919	江苏银行	14,033,182.00	2.85
42	603195	公牛集团	13,869,784.45	2.82
43	601377	兴业证券	13,781,898.00	2.80

44	002027	分众传媒	13,604,720.00	2.76
45	002812	恩捷股份	13,504,700.00	2.74
46	300750	宁德时代	13,061,789.00	2.65
47	603993	洛阳钼业	12,596,726.00	2.56
48	600795	国电电力	12,395,147.00	2.52
49	601668	中国建筑	12,279,956.92	2.50
50	601998	中信银行	12,125,850.50	2.46
51	000166	申万宏源	11,988,806.95	2.44
52	300316	晶盛机电	11,966,828.84	2.43
53	002180	纳思达	11,811,349.00	2.40
54	688271	联影医疗	11,695,225.35	2.38
55	601618	中国中冶	11,678,920.00	2.37
56	600027	华电国际	11,260,953.00	2.29
57	002601	龙佰集团	11,229,589.00	2.28
58	688303	大全能源	10,681,410.29	2.17
59	300015	爱尔眼科	10,084,266.16	2.05
60	601006	大秦铁路	10,026,687.00	2.04

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	1,431,710,243.85
卖出股票收入（成交）总额	1,505,957,554.07

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

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

无。

7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

无。

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

无。

7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

无。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

无。

7.10 本基金投资股指期货的投资政策

本基金在股指期货投资中将根据风险管理的原则，以套期保值为目的，在风险可控的前提下，

参与股指期货的投资。此外，本基金还将运用股指期货来管理特殊情况下的流动性风险，如预期大额申购赎回、大量分红等。本报告期股指期货的投资符合既定的投资政策和投资目标。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.11.1 本期国债期货投资政策

无。

7.11.2 本期国债期货投资评价

无。

7.12 投资组合报告附注

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

1、本基金投资的前十名证券平安银行的发行主体平安银行股份有限公司于 2025 年 3 月 12 日因并购贷款管理严重违反审慎经营规则、理财业务投资管理严重违反审慎经营规则、固定资产贷款管理严重违反审慎经营规则等受到上海金融监管局处罚（沪金罚决字〔2025〕88 号）。平安银行为本基金跟踪标的指数的成分券。

2、本基金投资的前十名证券农业银行的发行主体中国农业银行股份有限公司于 2024 年 12 月 30 日因违反账户管理规定、违反清算管理规定、违反特约商户实名制管理规定、违反反假货币业务管理规定、违反人民币流通管理规定、违反国库科目设置和使用规定、占压财政存款或者资金等受到中国人民银行处罚（银罚决字〔2024〕67 号）。农业银行为本基金跟踪标的指数的成分券。

7.12.2 基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库

本基金投资的前十名股票未超出基金合同规定的备选股票库。

7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	3,970,561.59
2	应收清算款	16,137,099.39
3	应收股利	—
4	应收利息	—
5	应收申购款	69,970.16
6	其他应收款	—
7	待摊费用	—
8	其他	—
9	合计	20,177,631.14

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

无。

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

7.12.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

无。

7.12.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

无。

7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入原因，分项之和与合计可能有尾差。

§ 8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额级别	持有人户数(户)	户均持有的基金份额	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(%)
大成沪深 300 增强发起式 A	2,814	116,061.76	263,594,414.74	80.71	63,003,371.83	19.29
大成沪深 300 增强发起式 C	14,970	13,703.06	89,569,035.70	43.66	115,565,751.05	56.34
合计	17,784	29,899.49	353,163,450.44	66.42	178,569,122.88	33.58

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

2、持有人户数为有效户数，即存量份额大于零的账户。

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数(份)	占基金总份额比例(%)
基金管理人所有从业人员持有本基金	大成沪深 300 增强发起式 A	165,087.85	0.0505
	大成沪深 300 增强发起式 C	-	-

金			
	合计	165,087.85	0.0310

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

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

项目	份额级别	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	大成沪深 300 增强发起式 A	0
	大成沪深 300 增强发起式 C	0
	合计	0
本基金基金经理持有本开放式基金	大成沪深 300 增强发起式 A	10~50
	大成沪深 300 增强发起式 C	0
	合计	10~50

8.4 发起式基金发起资金持有份额情况

项目	持有份额总数	持有份额占基金总份额比例(%)	发起份额总数	发起份额占基金总份额比例(%)	发起份额承诺持有期限
基金管理人固有资金	10,000,000.00	1.88	10,000,000.00	1.88	3 年
基金管理人高级管理人员	-	-	-	-	-
基金经理等人员	165,087.85	0.03	-	-	-
基金管理人股东	-	-	-	-	-
其他	-	-	-	-	-
合计	10,165,087.85	1.91	10,000,000.00	1.88	3 年

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	大成沪深 300 增强发起式 A	大成沪深 300 增强发起式 C
基金合同生效日 (2021 年 2 月 23 日)	117,847,410.78	312,506,529.05
基金份额总额		
本报告期期初基金份	375,019,577.05	216,910,041.25

份额总额		
本报告期基金总申购份额	4,638,427.69	105,528,701.11
减：本报告期基金总赎回份额	53,060,218.17	117,303,955.61
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	326,597,786.57	205,134,786.75

§ 10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

无。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

一、基金管理人的重大人事变动

无。

二、基金托管人的基金托管部门的重大人事变动

本报告期基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内无涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

10.4 基金投资策略的改变

本基金投资策略在本报告期内没有重大改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金自基金合同生效日起聘请安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）为本基金提供审计服务至今。

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

10.6.1 管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，基金管理人及其相关高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

10.6.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内托管人及其高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元 数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成 交总额的比例 (%)	佣金	占当期佣金 总量的比例 (%)	
中信建投 证券	2	732,432,589. 97	24.95	143,556.76	24.95	-
国信证券	1	696,955,007. 42	23.74	136,603.17	23.74	-
国泰海通	3	597,116,758. 19	20.34	117,034.93	20.34	新增 2个
广发证券	1	469,930,518. 83	16.01	92,106.32	16.01	
华泰证券	1	439,548,152. 31	14.97	86,151.42	14.97	-
长江证券	1	-	-	-	-	-
东方证券	1	-	-	-	-	-
光大证券	1	-	-	-	-	-
汇丰前海 证券	1	-	-	-	-	-
申万宏源	1	-	-	-	-	-
招商证券	2	-	-	-	-	-
中金公司	1	-	-	-	-	-
中信证券	2	-	-	-	-	-

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

(一) 筛选标准

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

(二) 筛选流程

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

2、公司按照白名单与证券公司进行协议签署。

10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例(%)	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例(%)	成交金额	占当期权证成交总额的比例(%)
广发证券	12,420.11	100.00	-	-	-	-

10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	大成基金管理有限公司关于再次提请投资者及时更新已过期身份证件及其他身份基本信息的公告	中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站	2025 年 6 月 30 日
2	大成沪深 300 指数增强型发起式证券投资基金(C类份额)基金产品资料概要更新	中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站	2025 年 6 月 30 日
3	大成沪深 300 指数增强型发起式证券投资基金(A类份额)基金产品资料概要更新	中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站	2025 年 6 月 30 日
4	大成基金管理有限公司提醒投资者谨防金融诈骗的公告	中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站	2025 年 6 月 6 日
5	大成基金管理有限公司提醒投资者谨防金融诈骗的公告	中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站	2025 年 4 月 26 日
6	大成沪深 300 指数增强型发起式证券投资基金 2025 年第 1 季度报告	中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站	2025 年 4 月 22 日
7	大成基金管理有限公司旗下公募基金通过证券公司证券交易及佣金支付情况(2024 年度)	中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站	2025 年 3 月 31 日
8	大成沪深 300 指数增强型发起式证券投资基金 2024 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	2025 年 3 月 31 日
9	大成沪深 300 指数增强型发起式证券投资基金更新招募说明书	中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站	2025 年 3 月 22 日
10	大成沪深 300 指数增强型发起式证券投资基金(C类份额)基金产品资料概要更新	中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站	2025 年 3 月 21 日
11	大成沪深 300 指数增强型发起式证券投资基金(A类份额)基金产品资料概要更新	中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站	2025 年 3 月 21 日

	要更新	公司网站	
12	大成沪深 300 指数增强型发起式证券投资基金更新招募说明书	中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站	2025 年 3 月 21 日
13	大成沪深 300 指数增强型发起式证券投资基金基金合同	中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站	2025 年 3 月 20 日
14	大成沪深 300 指数增强型发起式证券投资基金托管协议	中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站	2025 年 3 月 20 日
15	关于大成基金管理有限公司旗下部分指数基金指数使用费调整为基金管理人承担并修订基金合同的公告	中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站	2025 年 3 月 19 日
16	大成沪深 300 指数增强型发起式证券投资基金 2024 年第 4 季度报告	中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站	2025 年 1 月 22 日

§ 11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过 20% 的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比(%)
机构	1	20250101-20250630	202,656,502.29	-	-	202,656,502.29	38.11
产品特有风险							
当基金份额持有人占比过于集中时，可能会因某单一基金份额持有人大幅赎回而引发基金净值剧烈波动的风险，甚至有可能引起基金的流动性风险，基金管理人可能无法及时变现基金资产以应对基金份额持有人的赎回申请，基金份额持有人可能无法及时赎回持有的全部基金份额。							

11.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§ 12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

- 1、中国证监会批准设立大成沪深 300 指数增强型发起式证券投资基金的文件；
- 2、《大成沪深 300 指数增强型发起式证券投资基金基金合同》；
- 3、《大成沪深 300 指数增强型发起式证券投资基金托管协议》；
- 4、大成基金管理有限公司批准文件、营业执照、公司章程；

5、本报告期内在规定报刊上披露的各种公告原稿。

12.2 存放地点

备查文件存放在本基金管理人和托管人的住所。

12.3 查阅方式

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

大成基金管理有限公司

2025 年 8 月 29 日