

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

2025 年 12 月 31 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 3 月 31 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。本年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人中国农业银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2026 年 3 月 30 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。

本报告财务资料已经审计。安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）为本基金出具了无保留意见的审计报告，请投资者注意阅读。

本报告期自 2025 年 01 月 01 日起至 12 月 31 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、基金净值表现及利润分配情况</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
3.3 过去三年基金的利润分配情况	8
<b>§ 4 管理人报告</b>	<b>9</b>
4.1 基金管理人及基金经理情况	9
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	12
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	12
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明	13
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	14
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况	14
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	15
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	16
4.9 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	16
<b>§ 5 托管人报告</b>	<b>16</b>
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	16
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	16
5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见	16
<b>§ 6 审计报告</b>	<b>17</b>
<b>§ 7 年度财务报表</b>	<b>19</b>
7.1 资产负债表	19
7.2 利润表	20
7.3 净资产变动表	21
7.4 报表附注	23
<b>§ 8 投资组合报告</b>	<b>51</b>
8.1 期末基金资产组合情况	51
8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	52

8.3 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 .....	53
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动 .....	65
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合 .....	67
8.6 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 .....	67
8.7 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 .....	67
8.8 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 .....	67
8.9 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 .....	67
8.10 本基金投资股指期货的投资政策 .....	67
8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 .....	67
8.12 投资组合报告附注 .....	67
<b>§ 9 基金份额持有人信息 .....</b>	<b>68</b>
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....	68
9.2 期末上市基金前十名持有人 .....	69
9.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....	69
9.4 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 .....	69
9.5 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理本人及其直系亲属持有本人管理的产 品情况 .....	69
<b>§ 10 开放式基金份额变动 .....</b>	<b>69</b>
<b>§ 11 重大事件揭示 .....</b>	<b>70</b>
11.1 基金份额持有人大会决议 .....	70
11.2 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 .....	70
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....	70
11.4 基金投资策略的改变 .....	70
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....	70
11.6 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况 .....	70
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	71
11.8 其他重大事件 .....	73
<b>§ 12 影响投资者决策的其他重要信息 .....</b>	<b>76</b>
12.1 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 .....	76
12.2 影响投资者决策的其他重要信息 .....	76
<b>§ 13 备查文件目录 .....</b>	<b>76</b>
13.1 备查文件目录 .....	76
13.2 存放地点 .....	76
13.3 查阅方式 .....	76

## § 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
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	131, 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 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	95599
传真	0755-83199588	010-68121816
注册地址	广东省深圳市南山区海德三道 1236 号大成基金总部大厦 5 层、	北京市东城区建国门内大街 69 号

	27-33 层	
办公地址	广东省深圳市南山区海德三道 1236 号大成基金总部大厦 5 层、 27-33 层	北京市西城区复兴门内大街 28 号凯晨世贸中心东座 F9
邮政编码	518054	100031
法定代表人	吴庆斌	谷澍

## 2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《中国证券报》
登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	www.dcfund.com.cn
基金年度报告备置地点	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
会计师事务所	安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）	北京市东城区东长安街 1 号东方广场安永大楼 17 层 01-12 室
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、基金净值表现及利润分配情况

### 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	2025 年	2024 年	2023 年
本期已实现收益	48,471,330.04	6,469,628.05	-160,833.58
本期利润	62,721,640.71	34,771,970.53	-17,804,370.31
加权平均基金份额本期利润	0.3652	0.1750	-0.1539
本期加权平均净值利润率	29.95%	17.72%	-14.07%
本期基金份额净值增长率	32.76%	12.32%	-12.17%
3.1.2 期末数据和指标	2025 年末	2024 年末	2023 年末
期末可供分配利润	24,353,814.69	-36,242,489.58	-48,347,315.60
期末可供	0.1856	-0.1783	-0.2999

分配基金份额利润			
期末基金资产净值	193,521,167.85	225,739,438.46	159,492,777.09
期末基金份额净值	1.4747	1.1108	0.9890
3.1.3 累计期末指标	2025 年末	2024 年末	2023 年末
基金份额累计净值增长率	14.41%	-13.82%	-23.27%

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。

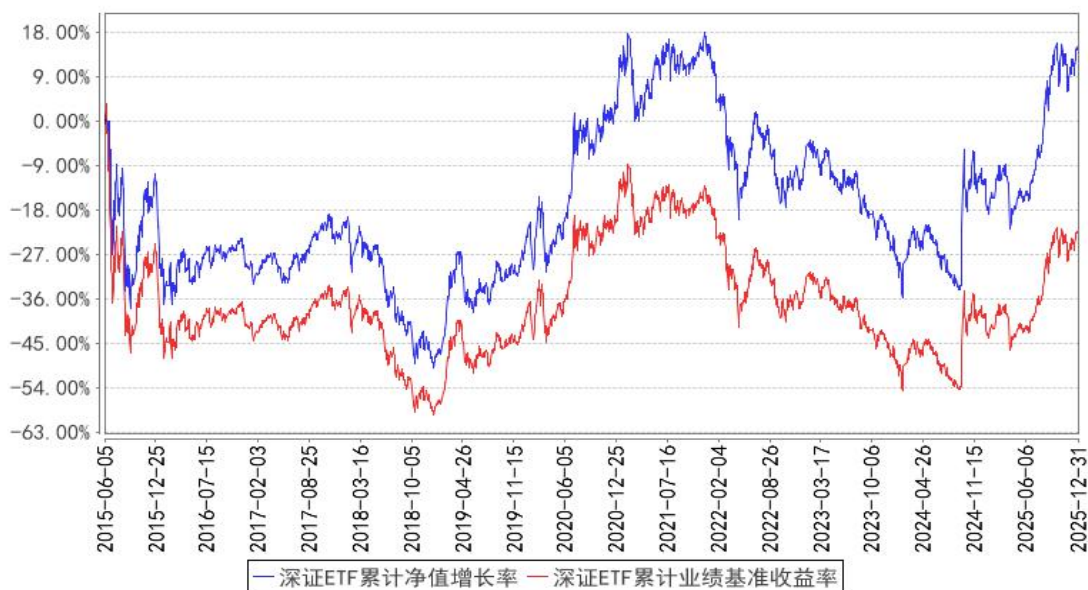
## 3.2 基金净值表现

### 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	0.29%	1.31%	-0.01%	1.32%	0.30%	-0.01%
过去六个月	30.12%	1.25%	29.24%	1.27%	0.88%	-0.02%
过去一年	32.76%	1.31%	29.87%	1.33%	2.89%	-0.02%
过去三年	30.97%	1.38%	22.78%	1.41%	8.19%	-0.03%
过去五年	7.55%	1.36%	-6.54%	1.39%	14.09%	-0.03%
自基金合同生效起至今	14.41%	1.53%	-22.72%	1.58%	37.13%	-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

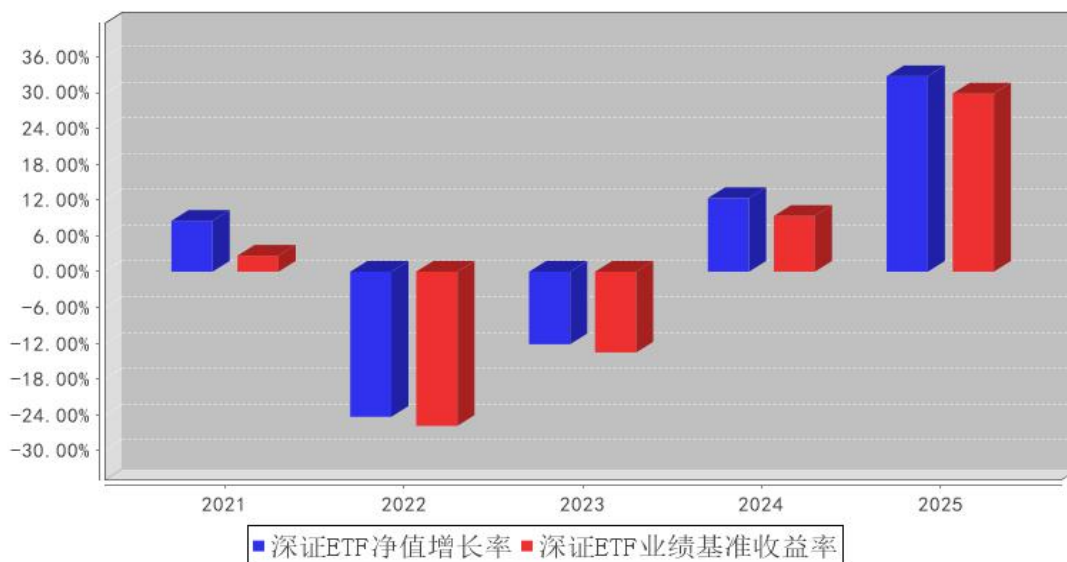
深证ETF累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



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。

### 3.2.3 过去五年基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

深证ETF基金每年净值增长率与同期业绩比较基准收益率的对比图



注：合同生效当年按实际存续期计算，不按整个自然年度进行折算。

### 3.3 过去三年基金的利润分配情况

无。

## § 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		
李溟玮	本基金的基金经理	2025 年 12 月 16 日	-	9 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。具有基金从业资格。国籍：中国
刘淼	本基金基金经理	2021 年 9 月 2 日	2025 年 12 月 19 日	17 年	北京大学工商管理硕士。2008 年 4 月至 2011 年 5 月就职于招商基金管理有限公司，任基金核算部基金会计。2011 年 5 月加入大成基金管理有限公司，先后担任基金运营部基金会计、股票投资部投委会秘书兼风控员、数量与指数投资部数量分析师、指数与期货投资部基金经理、指数与

				<p>期货投资部总监助理。2020年6月29日至2023年5月30日任大成MSCI中国A股质优价值100交易型开放式指数证券投资基金基金经理。2020年6月29日至2023年6月14日任大成MSCI中国A股质优价值100交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理。2020年6月29日至2025年12月19日任深证成长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基金经理。2020年6月29日至2022年11月30日任大成中证500深市交易型开放式指数证券投资基金基金经理。2021年4月30日至2025年7月29日任大成中证全指医疗保健设备与服务交易型开放式指数证券投资基金基金经理。2021年6月17日起任大成中证红利指数证券投资基金基金经理。2021年9月2日至2022年12月8日任中证500沪市交易型开放式指数证券投资基金基金经理。2021年9月2日至2025年3月17日任大成中证A100交易型开放式指数证券投资基金（更名前为大成中证100交易型开放式指数证券投资基金）基金经理。2021年9月2日至2025年12月19日任大成深证成份交易型开放式指数证券投资基金基金经理。2022年6月28日至2025年2月18日任大成中证电池主题指数型发起式证券投资基金基金经理。2022年7月13日至2025年3月17日任大成中证上海环交所碳中和交易型开放式指数证券投资基金基金经理。2022年10月13日至2023年10月20日任大成动态量化配置策略混合型证券投资基金基金经理。2023年3月20日起任大成有色金属期货交易型开放式指数证券投资基金、大成有色金属期货交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理。2023年4月14日起任大成沪深300指数证券投资基金基金经理。2024年3月6日起任大成中证A50交易型开放式指数证券投资基金基金经理。2024年4月8日至2025年7月29日任大成中证红利低波动100交易型开放式指数证券投资基金基金经理。2024年4月23日起任大成中证A50交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理。2024年</p>
--	--	--	--	---

					5月24日至2025年2月18日任大成中证芯片产业指数型发起式证券投资基金基金经理。2024年5月28日至2025年7月29日任大成中证工程机械主题交易型开放式指数证券投资基金基金经理。2024年11月12日起任大成中证A500交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金（转型前为大成中证A500指数型发起式证券投资基金）基金经理。2024年11月22日起任大成中证A500交易型开放式指数证券投资基金基金经理。2025年4月2日起任大成深证100交易型开放式指数证券投资基金基金经理。2025年4月23日起任大成中证全指自由现金流交易型开放式指数证券投资基金基金经理。2025年7月2日起任大成中证全指自由现金流交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金基金经理。2025年7月16日起担任大成创业板人工智能交易型开放式指数证券投资基金基金经理。2025年8月29日起任大成创业板50交易型开放式指数证券投资基金基金经理。2025年9月23日起任大成创业板50交易型开放式指数证券投资基金联接基金（转型前为大成创业板50指数型证券投资基金）基金经理。2025年10月21日起任大成创业板人工智能交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金基金经理。具备基金从业资格。国籍：中国
李溟玮	本基金基金经理助理	2024年4月15日	2025年12月15日	9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。具有基金从业资格。国籍：中国

注：1、任职日期、离任日期为本基金管理人作出决定之日。

2、证券从业年限的计算标准遵从中国证监会《证券投资基金经营机构董事、监事、高级管理人员及从业人员监督管理办法》的相关规定。

#### 4.1.3 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理同时管理的产品情况

无。

#### 4.1.4 基金经理薪酬机制

无。

### 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

报告期内，本基金管理人严格遵守《证券法》、《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 公平交易制度和控制方法

根据《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》的规定，公司制订了《大成基金管理有限公司公平交易制度》、《大成基金管理有限公司异常交易监控与报告制度》。公司旗下投资组合严格按照制度的规定，参与股票、债券的一级市场申购、二级市场交易等投资管理活动，内容包括授权、研究分析、投资决策、交易执行、业绩评估等与投资活动相关的各个环节。研究部负责提供投资研究支持，投资部门负责投资决策，交易管理部负责实施交易并实时监控，监察稽核部负责事前监督、事中检查和事后稽核，风险管理部负责对交易情况进行合理性分析，通过多部门的协作互控，保证了公平交易的可操作、可稽核和可持续。

#### 4.3.2 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。

##### 4.3.2.1 增加执行的基金经理公平交易制度执行情况及公平交易管理情况

无。

#### 4.3.3 异常交易行为的专项说明

报告期内，公司旗下所有投资组合未发现存在异常交易行为。公司旗下所有投资组合参与的

交易所公开竞价交易中，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的 5% 的交易共 1 次，为完全按照指数的构成比例进行投资的组合和其他组合发生的反向交易。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，国内经济在高质量发展轨道上稳步前行，GDP 同比增长 5.0%，完成年度目标。节奏上，上半年受外部关税政策等因素扰动市场有所波折，下半年在产业政策深化与流动性改善驱动下重拾升势。结构上，以人工智能、高端制造为代表的科技创新成为经济增长核心引擎；传统消费板块相对承压。

本报告期内，国内股票市场整体大幅上涨，呈现显著的结构性牛市特征。上证指数年中突破 4000 点关口，创下近十年新高。收益方面，沪深 300 涨 17.66%；中证 500 涨 30.39%；中证 1000 涨 27.49%；创业板指涨 49.57%；科创 50 涨 35.92%。行业上，有色金属、通信和电子涨幅靠前；食品饮料、煤炭、房地产则居后三。风格方面，成长风格明显占优，科技成长与中小盘股表现突出。

阶段表现上，年初由 DeepSeek 等国产大模型突破点燃的 AI 行情引领市场，科技主线贯穿一季度。两会期间的《2025 年政府工作报告》明确提出“持续推进‘人工智能+’行动”，叠加海外产业巨头持续创新高，内外共振推动 TMT 板块表现。四月上旬，受外部关税政策冲击，市场出现急跌，沪指一度探至 3040 点年内低点。而后随着“平稳”资金入市稳定市场，叠加政策组合拳发力，市场企稳反弹。二季度至三季度，市场在“科技重估”与“资源保障”双主线驱动下上行。在此期间，光模块、人工智能、稀土有色等细分赛道轮番表现。十月下旬，主要受海外美联储开启降息周期、全球资金回流新兴市场，以及国内三季度经济数据超预期、上市公司三季报盈利拐点确认等多重利好推动，沪指时隔十年重返 4000 点。四季度，市场在 4000 点附近震荡整固，其中贵金属、工业有色金属、商业航空、卫星等主题行业在外围市场及市场情绪的推动下表现突出，而在政策预期与跨年行情催化下，沪指在年末也走出“十一连阳”，以强势姿态收官。

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 1.4747 元；本报告期基金份额净值增长率为 32.76%，业绩比较基准收益率为 29.87%。

#### 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 2026 年，作为“十五五”规划开局之年，宏观政策有望持续发力。国内将实施更加积极的财政政策与适度宽松的货币政策，财政赤字率将维持政策连续性和当前经济需求，新增专项债、超长期特别国债等工具将重点支持科技创新、新质生产力等“十五五”规划强调的领域。同时，“反内卷”政策将进入精细化实施阶段，通过遏制低价竞争修复企业利润表，推动 PPI 触底回升。海外方面，美联储降息通道已打开，但随着新任主席人选的公布，内部存在显著分歧，通胀粘性与政治压力交织可能使降息路径出现波折。若降息落地，美元趋势性走弱有望推动全球资本向新兴市场回流，为中国资本市场提供外部流动性支持。中美关系预计边际缓和，但高科技领域竞争依然存在，中国出口将通过市场多元化保持韧性。

具体到 A 股市场，企业盈利修复与增量资金流入可能共同驱动市场表现。2026 年全 A 盈利增速有望提升，市场驱动力将从估值修复转向企业业绩驱动。在“春季行情”下，可重点关注“十五五”规划强调的以 AI、高端制造为代表的科技成长主线。同时，在 PPI 改善预期及“反内卷”政策催化下，有色金属、化工等顺周期板块亦具备重估潜力。消费板块随居民财富效应释放以及进一步细则政策的出台，有望迎来结构性复苏。资金面预计维持充裕，保险资金、外资回流及居民“存款搬家”趋势将提供增量动力。综合来看，2026 年 A 股有望在政策支持、盈利改善与流动性宽松三重支撑下表现出结构性平稳上涨的格局，市场呈现“震荡上行、结构分化、基本面主导”的特征，风格或更趋均衡，结构性机会突出。

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

#### 4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

本报告期内，依据相关的法律法规、基金合同以及内部监察稽核制度，本基金管理人对本基金运作、内部管理、制度执行及遵纪守法情况进行了监察稽核。内部监察稽核的重点是：国家法律法规及行业监管规则的执行情况；基金合同的遵守情况；内部规章制度的执行情况；资讯管制和保密工作落实情况；员工职业操守规范情况，目的是规范基金财产的运作，防范和控制投资风险，确保经营业务的稳健运行和受托资产的安全完整，维护基金份额持有人的合法权益。

（一）根据最新的法律法规、规章、规范性文件，本基金管理人及时制定了相应的公司制度，并对现有制度进行不断修订和完善，确保本基金管理人内控制度的适时性、全面性和合法合规性。

同时，为保障制度的适时性，避免部分内控制度、业务规则与业务发展不相适应，报告期内本基金管理人组织各部门对内部管理制度作了进一步梳理和完善。

（二）全面加强风险监控，不断提高基金业务风险管理水平。为督促各部门完善并落实各项内控措施，公司严格执行风险控制管理员制度，健全内控工作协调机制及监督机制，并进一步加强投资风险数量化评价能力及事前风险防范能力，有效防范相关业务风险。同时，公司严格执行投资报备制度，建立了基金从业人员证券投资管理监控信息系统，将投资报备工作纳入常态。

（三）日常监察和专项监察相结合，确保监察稽核的有效性和深入性。本年度，公司继续对本基金销售、宣传等方面的材料、协议及其他法律资料等进行了严格审查，对本基金各项投资比例、投资权限、基金交易、股票投资限制、股票库维护等方面进行实时监控，同时，还专门针对基金投资交易（包括公平交易、转债投资、投资权限、投资比例、流动性风险、基金重仓股等）、基金运营（基金头寸、基金结算、登记清算等）、网上交易、基金销售等进行专项监察。通过日常监察，保证了公司监察的全面性、实时性，通过专项监察，及时发现并纠正了业务中的潜在风险，加强了业务部门和人员的风险意识，从而较好地预防了风险的发生。

（四）加强了对投资管理人员通讯工具在交易时间的集中管理，定期或不定期对投资管理人员的网络即时通讯记录、电话录音等进行抽查，有效的防范了各种形式的利益输送行为。

（五）以多种方式加强合规教育与培训，提高全公司的合规守法意识。及时向全公司传达与基金相关的法律法规，并要求公司各部门贯彻到日常工作中。公司监察稽核部通过解答各业务部门提出的法律问题，提供法律依据，对于较为重大疑难法律事项及时咨询公司外部律师或监管部门，避免了业务发展中的盲目性，及时防范风险，维护了基金份额持有人的利益。

#### 4.7 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。

#### 4.8 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。

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

无。

## § 5 托管人报告

### 5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

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

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

报告期内，大成基金管理有限公司在本基金的投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支及利润分配等问题上，本托管人未发现有损害基金份额持有人利益的行为；在报告期内，严格遵守了《中华人民共和国证券投资基金法》等有关法律法规，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

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

本托管人认为，大成基金管理有限公司的信息披露事务符合《公开募集证券投资基金信息披

露管理办法》及其他相关法律法规的规定，基金管理人所编制和披露的本基金年度报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告等信息真实、准确、完整，未发现有损害基金持有人利益的行为。

## § 6 审计报告

审计报告标题	审计报告
审计报告收件人	大成深证成份交易型开放式指数证券投资基金全体基金份额持有人
审计意见	<p>我们审计了大成深证成份交易型开放式指数证券投资基金的财务报表，包括 2025 年 12 月 31 日的资产负债表，2025 年度的利润表、净资产变动表以及相关财务报表附注。</p> <p>我们认为，后附的大成深证成份交易型开放式指数证券投资基金的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则的规定编制，公允反映了大成深证成份交易型开放式指数证券投资基金 2025 年 12 月 31 日的财务状况以及 2025 年度的经营成果和净资产变动情况。</p>
形成审计意见的基础	<p>我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。审计报告的“注册会计师对财务报表审计的责任”部分进一步阐述了我们在这些准则下的责任。按照《中国注册会计师独立性准则第 1 号——财务报表审计和审阅业务对独立性的要求》和中国注册会计师职业道德守则，我们独立于大成深证成份交易型开放式指数证券投资基金，并履行了职业道德方面的其他责任。我们在审计中遵循了对公众利益实体审计的独立性要求。我们相信，我们获取的审计证据是充分、适当的，为发表审计意见提供了基础。</p>
其他信息	<p>大成深证成份交易型开放式指数证券投资基金管理层对其他信息负责。其他信息包括年度报告中涵盖的信息，但不包括财务报表和我们的审计报告。</p> <p>我们对财务报表发表的审计意见不涵盖其他信息，我们也不对其他信息发表任何形式的鉴证结论。</p> <p>结合我们对财务报表的审计，我们的责任是阅读其他信息，在此过程中，考虑其他信息是否与财务报表或我们在审计过程中了解到的情况存在重大不一致或者似乎存在重大错报。</p> <p>基于我们已执行的工作，如果我们确定其他信息存在重大错报，我们应当报告该事实。在这方面，我们无任何事项需要报告。</p>
管理层和治理层对财务报表的责任	<p>管理层负责按照企业会计准则的规定编制财务报表，使其实现公允反映，并设计、执行和维护必要的内部控制，以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。</p> <p>在编制财务报表时，管理层负责评估大成深证成份交易</p>

	<p>型开放式指数证券投资基金的持续经营能力，披露与持续经营相关的事项（如适用），并运用持续经营假设，除非计划进行清算、终止运营或别无其他现实的选择。</p> <p>治理层负责监督大成深证成份交易型开放式指数证券投资基金的财务报告过程。</p>
注册会计师对财务报表审计的责任	<p>我们的目标是对财务报表整体是否不存在由于舞弊或错误导致的重大错报获取合理保证，并出具包含审计意见的审计报告。合理保证是高水平的保证，但并不能保证按照审计准则执行的审计在某一重大错报存在时总能发现。错报可能由于舞弊或错误导致，如果合理预期错报单独或汇总起来可能影响财务报表使用者依据财务报表作出的经济决策，则通常认为错报是重大的。</p> <p>在按照审计准则执行审计工作的过程中，我们运用职业判断，并保持职业怀疑。同时，我们也执行以下工作：</p> <p>（1）识别和评估由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险，设计和实施审计程序以应对这些风险，并获取充分、适当的审计证据，作为发表审计意见的基础。由于舞弊可能涉及串通、伪造、故意遗漏、虚假陈述或凌驾于内部控制之上，未能发现由于舞弊导致的重大错报的风险高于未能发现由于错误导致的重大错报的风险。</p> <p>（2）了解与审计相关的内部控制，以设计恰当的审计程序，但目的并非对内部控制的有效性发表意见。</p> <p>（3）评价管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计及相关披露的合理性。</p> <p>（4）对管理层使用持续经营假设的恰当性得出结论。同时，根据获取的审计证据，就可能导致对大成深证成份交易型开放式指数证券投资基金持续经营能力产生重大疑虑的事项或情况是否存在重大不确定性得出结论。如果我们得出结论认为存在重大不确定性，审计准则要求我们在审计报告中提请报表使用者注意财务报表中的相关披露；如果披露不充分，我们应当发表非无保留意见。我们的结论基于截至审计报告日可获得的信息。然而，未来的事项或情况可能导致大成深证成份交易型开放式指数证券投资基金不能持续经营。</p> <p>（5）评价财务报表的总体列报（包括披露）、结构和内容，并评价财务报表是否公允反映相关交易和事项。</p> <p>我们与治理层就计划的审计范围、时间安排和重大审计发现等事项进行沟通，包括沟通我们在审计中识别出的值得关注的内部控制缺陷。</p>
会计师事务所的名称	安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）
注册会计师的姓名	高鹤   林恩丽
会计师事务所的地址	北京市东城区东长安街1号东方广场安永大楼17层01-12室
审计报告日期	2026年3月30日

## § 7 年度财务报表

## 7.1 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：2025 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2025 年 12 月 31 日	上年度末 2024 年 12 月 31 日
<b>资产：</b>			
货币资金	7.4.7.1	2,673,057.15	3,830,193.16
结算备付金		-	85.56
存出保证金		109,249.00	91,441.04
交易性金融资产	7.4.7.2	191,046,218.24	222,129,476.91
其中：股票投资		191,046,218.24	222,107,013.44
基金投资		-	-
债券投资		-	22,463.47
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
其他投资		-	-
衍生金融资产	7.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	-	-
应收清算款		15,200.49	14,926.61
应收股利		-	-
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.8	-	-
资产总计		193,843,724.88	226,066,123.28
<b>负债和净资产</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2025 年 12 月 31 日</b>	<b>上年度末 2024 年 12 月 31 日</b>
<b>负债：</b>			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	7.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付清算款		48,654.73	4,770.31
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		89,350.25	98,437.48
应付托管费		17,870.06	19,687.48
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	7.4.7.9	166,681.99	203,789.55
负债合计		322,557.03	326,684.82
<b>净资产：</b>			
实收基金	7.4.7.10	169,167,353.16	261,981,928.04
未分配利润	7.4.7.12	24,353,814.69	-36,242,489.58
净资产合计		193,521,167.85	225,739,438.46
负债和净资产总计		193,843,724.88	226,066,123.28

注：报告截止日 2025 年 12 月 31 日，基金份额净值 1.4747 元，基金份额总额 131,229,922.00 份。

## 7.2 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：2025 年 1 月 1 日至 2025 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日
<b>一、营业总收入</b>		64,159,520.10	36,255,610.22
1. 利息收入		13,795.05	29,432.74
其中：存款利息收入	7.4.7.13	13,795.05	29,432.74
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）		49,969,701.39	7,892,496.30
其中：股票投资收益	7.4.7.14	46,563,472.97	4,272,073.42
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.15	36,541.04	3.43
资产支持证券投资	7.4.7.16	-	-
贵金属投资收益	7.4.7.17	-	-
衍生工具收益	7.4.7.18	-	-
股利收益	7.4.7.19	3,369,687.38	3,620,419.45
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	7.4.7.20	14,250,310.67	28,302,342.48

失以“-”号填列)			
4. 汇兑收益(损失以“-”号填列)		-	-
5. 其他收入(损失以“-”号填列)	7.4.7.21	-74,287.01	31,338.70
<b>减: 二、营业总支出</b>		1,437,879.39	1,483,639.69
1. 管理人报酬	7.4.10.2.1	1,048,749.75	981,853.89
2. 托管费	7.4.10.2.2	209,750.08	196,370.80
3. 销售服务费	7.4.10.2.3	-	-
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	7.4.7.22	-	-
7. 税金及附加		0.02	-
8. 其他费用	7.4.7.23	179,379.54	305,415.00
<b>三、利润总额(亏损总额以“-”号填列)</b>		62,721,640.71	34,771,970.53
减: 所得税费用		-	-
<b>四、净利润(净亏损以“-”号填列)</b>		62,721,640.71	34,771,970.53
<b>五、其他综合收益的税后净额</b>		-	-
<b>六、综合收益总额</b>		62,721,640.71	34,771,970.53

### 7.3 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: 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 12 月 31 日

单位: 人民币元

项目	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 12 月 31 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)	-92,814,574.88	-	60,596,304.27	-32,218,270.61
(一)、综合收益总额	-	-	62,721,640.71	62,721,640.71
(二)、本期基金份额交易产	-92,814,574.88	-	-2,125,336.44	-94,939,911.32

生的净资产变动数（净资产减少以“-”号填列）				
其中：1. 基金申购款	305,514,642.37	-	-14,563,643.68	290,950,998.69
2. 基金赎回款	-398,329,217.25	-	12,438,307.24	-385,890,910.01
（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	169,167,353.16	-	24,353,814.69	193,521,167.85
项目	上年度可比期间 2024年1月1日至2024年12月31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	207,840,092.69	-	-48,347,315.60	159,492,777.09
二、本期期初净资产	207,840,092.69	-	-48,347,315.60	159,492,777.09
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	54,141,835.35	-	12,104,826.02	66,246,661.37
（一）、综合收益总额	-	-	34,771,970.53	34,771,970.53
（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）	54,141,835.35	-	-22,667,144.51	31,474,690.84
其中：1. 基金申购款	409,931,039.14	-	-97,134,399.70	312,796,639.44
2. 基金赎回款	-355,789,203.79	-	74,467,255.19	-281,321,948.60
（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	261,981,928.04	-	-36,242,489.58	225,739,438.46

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.4 财务报表由下列负责人签署：

<u>谭晓冈</u>	<u>范瑛</u>	<u>梁靖</u>
基金管理人负责人	主管会计工作负责人	会计机构负责人

## 7.4 报表附注

### 7.4.1 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。

#### 7.4.2 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 2 号《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。

#### 7.4.3 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 12 月 31 日的财务状况以及 2025 年度的经营成果和净资产变动情况等有关信息。

#### 7.4.4 重要会计政策和会计估计

##### 7.4.4.1 会计年度

本基金会计年度为公历 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

##### 7.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

##### 7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

金融工具是指形成本基金的金融资产(或负债),并形成其他单位的金融负债(或资产)或权益工具的合同。

###### (1) 金融资产分类

本基金的金融资产于初始确认时根据管理金融资产的业务模式和金融资产的合同现金流量特征分类为:以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、以摊余成本计量的金融资产。

###### (2) 金融负债分类

本基金的金融负债于初始确认时分类为:以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债、以摊余成本计量的金融负债。

#### 7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

本基金于成为金融工具合同的一方时确认一项金融资产或金融负债。

划分为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和金融负债，以及不作为有效套期工具的衍生工具，按照取得时的公允价值作为初始确认金额，相关的交易费用在发生时计入当期损益。

划分为以摊余成本计量的金融资产和金融负债，按照取得时的公允价值作为初始确认金额，相关交易费用计入其初始确认金额。

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，采用公允价值进行后续计量，所有公允价值变动计入当期损益。

对于以摊余成本计量的金融资产，采用实际利率法确认利息收入，其终止确认、修改或减值产生的利得或损失，均计入当期损益。

本基金以预期信用损失为基础，对以摊余成本计量的金融资产进行减值处理并确认损失准备。对于不含重大融资成分的应收款项，本基金运用简化计量方法，按照相当于整个存续期内的预期信用损失金额计量损失准备。除上述采用简化计量方法以外的金融资产，本基金在每个估值日评估其信用风险自初始确认后是否已经显著增加，如果信用风险自初始确认后未显著增加，处于第一阶段，本基金按照相当于未来 12 个月内预期信用损失的金额计量损失准备，并按照账面余额和实际利率计算利息收入；如果信用风险自初始确认后已显著增加但尚未发生信用减值的，处于第二阶段，本基金按照相当于整个存续期内预期信用损失的金额计量损失准备，并按照账面余额和实际利率计算利息收入；如果初始确认后发生信用减值的，处于第三阶段，本基金按照相当于整个存续期内预期信用损失的金额计量损失准备，并按照摊余成本和实际利率计算利息收入。

本基金在每个估值日评估相关金融工具的信用风险自初始确认后是否已显著增加。本基金以单项金融工具或者具有相似信用风险特征的金融工具组合为基础，通过比较金融工具在估值日发生违约的风险与在初始确认日发生违约的风险，以确定金融工具预计存续期内发生违约风险的变化情况。

本基金计量金融工具预期信用损失的方法反映的因素包括：通过评价一系列可能的结果而确定的无偏概率加权平均金额、货币时间价值，以及在估值日无须付出不必要的额外成本或努力即可获得的有关过去事项、当前状况以及未来经济状况预测的合理且有依据的信息。

当对金融资产预期未来现金流量具有不利影响的一项或多项事件发生时，该金融资产成为已发生信用减值的金融资产。

当本基金不再合理预期能够全部或部分收回金融资产合同现金流量时，本基金直接减记该金

融资产的账面余额。

当收取该金融资产现金流量的合同权利终止，或该收取金融资产现金流量的权利已转移，且符合金融资产转移的终止确认条件的，金融资产将终止确认。

本基金已将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方的，终止确认该金融资产；保留了金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬的，不终止确认该金融资产；本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬的，分别下列情况处理：放弃了对该金融资产控制的，终止确认该金融资产并确认产生的资产和负债；未放弃对该金融资产控制的，按照其继续涉入所转移金融资产的程度确认有关金融资产，并相应确认有关负债。

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债（含交易性金融负债和衍生金融负债），按照公允价值进行后续计量，所有公允价值变动均计入当期损益。对于以摊余成本计量的金融负债，采用实际利率法，按照摊余成本进行后续计量。如果金融负债的责任已履行、撤销或届满，则对金融负债进行终止确认。

#### 7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

公允价值，是指市场参与者在计量日发生的有序交易中，出售一项资产所能收到或者转移一项负债所需支付的价格。本基金以公允价值计量相关资产或负债，假定出售资产或者转移负债的有序交易在相关资产或负债的主要市场进行；不存在主要市场的，本基金假定该交易在相关资产或负债的最有利市场进行。主要市场（或最有利市场）是本基金在计量日能够进入的交易市场。本基金采用市场参与者在对该资产或负债定价时为实现其经济利益最大化所使用的假设。

在财务报表中以公允价值计量或披露的资产和负债，根据对公允价值计量整体而言具有重要意义的最低层次输入值，确定所属的公允价值层次：第一层次输入值，在计量日能够取得的相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价；第二层次输入值，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；第三层次输入值，相关资产或负债的不可观察输入值。

每个资产负债表日，本基金对在财务报表中确认的持续以公允价值计量的资产和负债进行重新评估，以确定是否在公允价值计量层次之间发生转换。

本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和金融负债按如下原则确定公允价值并进行估值：

(1) 存在活跃市场的金融工具，按照估值日能够取得的相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价作为公允价值；估值日无报价且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，应采用最近交易日的报价确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的报价不能真实反映公允价值的，应对报价进行调整，确定公允价值。

与上述投资品种相同，但具有不同特征的，应以相同资产或负债的公允价值为基础，并在估值技术中考虑不同特征因素的影响。特征是指对资产出售或使用的限制等，如果该限制是针对资产持有者的，那么在估值技术中不应将该限制作为特征考虑。此外，基金管理人不应考虑因大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价。

(2) 不存在活跃市场的金融工具，应采用在当前情况下适用并且有足够可利用数据和其他信息支持的估值技术确定公允价值。采用估值技术确定公允价值时，应优先使用可观察输入值，只有在无法取得相关资产或负债可观察输入值或取得不切实可行的情况下，才使用不可观察输入值。

(3) 如有确凿证据表明按上述方法进行估值不能客观反映其公允价值的，基金管理人可根据具体情况与基金托管人商定后，按最能反映公允价值的方法估值。

(4) 如有新增事项，按国家最新规定估值。

#### 7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

当本基金具有抵销已确认金融资产和金融负债的法定权利，且该种法定权利现在是可执行的，同时本基金计划以净额结算或同时变现该金融资产和清偿该金融负债时，金融资产和金融负债以相互抵销后的金额在资产负债表内列示。除此以外，金融资产和金融负债在资产负债表内分别列示，不予相互抵销。

#### 7.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行的基金份额总额所对应的金额。由于申购和赎回引起的实收基金变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日确认。由于基金份额拆分引起的实收基金份额变动于基金份额拆分日根据拆分前的基金份额数及确定的拆分比例计算确认。由于基金份额折算引起的实收基金份额变动于基金份额折算日根据折算前的基金份额数及确定的折算比例计算确认。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

#### 7.4.4.8 损益平准金

损益平准金包括已实现平准金和未实现平准金。已实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现损益占净资产比例计算的金额。未实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未实现损益占净资产比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日确认，并于期末全额转入未分配利润/(累计亏损)。

#### 7.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

(1) 对于以摊余成本计量的金融资产，采用实际利率法计算的利息扣除在适用情况下的相关税费后的净额确认利息收入，计入当期损益。处置时，其处置价格扣除相关交易费用后的净额与

账面价值之间的差额确认为投资收益。

(2) 对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和金融负债，相关交易费用直接计入投资收益。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产为债务工具投资的，在持有期间将按票面或合同利率计算的利息收入扣除在适用情况下的相关税费后的净额计入投资收益，扣除该部分利息后的公允价值变动额计入公允价值变动损益；除上述之外的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和金融负债的公允价值变动形成的应计入当期损益的利得或损失计入公允价值变动损益。处置时，其处置价格与初始确认金额之间的差额扣除相关交易费用及在适用情况下的相关税费后的净额确认为投资收益。

本基金在同时符合下列条件时确认股利收入并计入当期损益：1) 本基金收取股利的权利已经确立；2) 与股利相关的经济利益很可能流入本基金；3) 股利的金额能够可靠计量。

(3) 其他收入在经济利益很可能流入从而导致资产增加或者负债减少、且经济利益的流入额能够可靠计量时确认。

#### 7.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬和托管费等费用按照权责发生制原则，在本基金接受相关服务的期间计入当期损益。

以摊余成本计量的金融负债在持有期间确认的利息支出按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

#### 7.4.4.11 基金的收益分配政策

每一基金份额享有同等分配权。本基金收益以现金形式分配。基金收益评价日核定的基金净值率超过标的指数同期增长率达到 1%以上时，本基金的基金管理人可进行收益分配；以使收益分配后基金份额净值增长率尽可能贴近标的指数同期增长率为原则确定收益分配。本基金收益分配后有可能使除息后的基金份额净值低于面值。

经宣告的拟分配基金收益于分红除权日从净资产转出。

#### 7.4.4.12 外币交易

无。

#### 7.4.4.13 分部报告

本基金以内部组织结构、管理要求、内部报告制度为依据确定经营分部，以经营分部为基础确定报告分部并披露分部信息。经营分部是指本基金内同时满足下列条件的组成部分：

- (1) 该组成部分能够在日常活动中产生收入、发生费用。
- (2) 本基金的基金管理人能够定期评价该组成部分的经营成果，以决定向其配置资源、评价其

业绩。

(3) 本基金能够取得该组成部分的财务状况、经营成果和现金流量等有关会计信息。

如果两个或多个经营分部具有相似的经济特征，并且满足一定条件的，则合并为一个经营分部。本基金目前以一个单一的经营分部运作，不需要披露分部信息。

#### 7.4.4.14 其他重要的会计政策和会计估计

无。

#### 7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

##### 7.4.5.1 会计政策变更的说明

无。

##### 7.4.5.2 会计估计变更的说明

无。

##### 7.4.5.3 差错更正的说明

无。

#### 7.4.6 税项

##### (1) 增值税及附加

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

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

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

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

根据财政部、国家税务总局财税[2017]56号文《关于资管产品增值税有关问题的通知》的规

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

根据财政部、国家税务总局公告 2025 年第 4 号《关于国债等债券利息收入增值税政策的公告》，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。

### 7.4.7 重要财务报表项目的说明

#### 7.4.7.1 货币资金

单位：人民币元

项目	本期末 2025 年 12 月 31 日	上年度末 2024 年 12 月 31 日
活期存款	2,673,057.15	3,830,193.16
等于：本金	2,672,786.55	3,828,933.66
加：应计利息	270.60	1,259.50
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	2,673,057.15	3,830,193.16

## 7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末 2025 年 12 月 31 日			
		成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票		162,893,373.46	-	191,046,218.24	28,152,844.78
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		162,893,373.46	-	191,046,218.24	28,152,844.78
项目		上年度末 2024 年 12 月 31 日			
		成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票		208,209,139.37	-	222,107,013.44	13,897,874.07
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-	-
债券	交易所市场	17,800.00	3.43	22,463.47	4,660.04
	银行间市场	-	-	-	-
	合计	17,800.00	3.43	22,463.47	4,660.04
资产支持证券		-	-	-	-
基金		-	-	-	-
其他		-	-	-	-
合计		208,226,939.37	3.43	222,129,476.91	13,902,534.11

## 7.4.7.3 衍生金融资产/负债

## 7.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

无。

## 7.4.7.3.2 期末基金持有的期货合约情况

无。

## 7.4.7.3.3 期末基金持有的黄金衍生品情况

无。

## 7.4.7.4 买入返售金融资产

## 7.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

无。

## 7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

无。

## 7.4.7.4.3 按预期信用损失一般模型计提减值准备的说明

无。

## 7.4.7.5 债权投资

## 7.4.7.5.1 债权投资情况

无。

## 7.4.7.5.2 债权投资减值准备计提情况

无。

## 7.4.7.6 其他债权投资

## 7.4.7.6.1 其他债权投资情况

无。

## 7.4.7.6.2 其他债权投资减值准备计提情况

无。

## 7.4.7.7 其他权益工具投资

## 7.4.7.7.1 其他权益工具投资情况

无。

## 7.4.7.7.2 报告期末其他权益工具投资情况

无。

## 7.4.7.8 其他资产

无。

## 7.4.7.9 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2025年12月31日	上年度末 2024年12月31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	1,681.99	1,818.75
其中：交易所市场	1,681.99	1,818.75
银行间市场	-	-
应付利息	-	-
预提费用	165,000.00	165,000.00
应付指数使用费	-	35,000.00

可退替代款	-	1,970.80
合计	166,681.99	203,789.55

#### 7.4.7.10 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2025年1月1日至2025年12月31日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	203,229,922.00	261,981,928.04
本期申购	237,000,000.00	305,514,642.37
本期赎回（以“-”号填列）	-309,000,000.00	-398,329,217.25
基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算调整	-	-
本期申购	-	-
本期赎回（以“-”号填列）	-	-
本期末	131,229,922.00	169,167,353.16

#### 7.4.7.11 其他综合收益

无。

#### 7.4.7.12 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	27,060,547.74	-63,303,037.32	-36,242,489.58
本期期初	27,060,547.74	-63,303,037.32	-36,242,489.58
本期利润	48,471,330.04	14,250,310.67	62,721,640.71
本期基金份额交易产生的变动数	-17,900,245.72	15,774,909.28	-2,125,336.44
其中：基金申购款	55,334,419.62	-69,898,063.30	-14,563,643.68
基金赎回款	-73,234,665.34	85,672,972.58	12,438,307.24
本期已分配利润	-	-	-
本期末	57,631,632.06	-33,277,817.37	24,353,814.69

#### 7.4.7.13 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12月31日	上年度可比期间 2024年1月1日至2024年12月31日
活期存款利息收入	13,405.75	28,176.42
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	68.87	265.38
其他	320.43	990.94
合计	13,795.05	29,432.74

## 7.4.7.14 股票投资收益

## 7.4.7.14.1 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12月31日	上年度可比期间 2024年1月1日至2024年12月31日
股票投资收益——买卖股票差价收入	3,680,406.37	1,639,806.44
股票投资收益——赎回差价收入	42,883,066.60	2,632,266.98
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	46,563,472.97	4,272,073.42

## 7.4.7.14.2 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12月31日	上年度可比期间 2024年1月1日至2024年12月31日
卖出股票成交总额	24,611,364.89	22,565,885.83
减：卖出股票成本总额	20,909,746.30	20,904,910.20
减：交易费用	21,212.22	21,169.19
买卖股票差价收入	3,680,406.37	1,639,806.44

## 7.4.7.14.3 股票投资收益——赎回差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2025年1月1日至2025年12月31日	上年度可比期间 2024年1月1日至2024年12月31日
赎回基金份额对价总额	385,890,910.01	281,321,948.60
减：现金支付赎回款总额	-1,206,022.99	-1,224,344.40
减：赎回股票成本总额	344,213,866.40	279,914,026.02
减：交易费用	-	-
赎回差价收入	42,883,066.60	2,632,266.98

## 7.4.7.14.4 股票投资收益——申购差价收入

无。

## 7.4.7.14.5 股票投资收益——证券出借差价收入

无。

## 7.4.7.15 债券投资收益

## 7.4.7.15.1 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12月31 日	上年度可比期间 2024年1月1日至2024年12月31 日
债券投资收益——利息收入	23.40	3.43
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	36,517.64	-
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	36,541.04	3.43

## 7.4.7.15.2 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12月31 日	上年度可比期间 2024年1月1日至2024年12月 31日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	184,952.11	-
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	148,400.00	-
减：应计利息总额	27.06	-
减：交易费用	7.41	-
买卖债券差价收入	36,517.64	-

## 7.4.7.15.3 债券投资收益——赎回差价收入

无。

## 7.4.7.15.4 债券投资收益——申购差价收入

无。

## 7.4.7.16 资产支持证券投资收益

## 7.4.7.16.1 资产支持证券投资收益项目构成

无。

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

无。

## 7.4.7.16.3 资产支持证券投资收益——赎回差价收入

无。

## 7.4.7.16.4 资产支持证券投资收益——申购差价收入

无。

## 7.4.7.17 贵金属投资收益

## 7.4.7.17.1 贵金属投资收益项目构成

无。

## 7.4.7.17.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

无。

## 7.4.7.17.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

无。

## 7.4.7.17.4 贵金属投资收益——申购差价收入

无。

## 7.4.7.18 衍生工具收益

## 7.4.7.18.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

无。

## 7.4.7.18.2 衍生工具收益——其他投资收益

无。

## 7.4.7.19 股利收益

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2025年1月1日至2025年12月31日	2024年1月1日至2024年12月31日
股票投资产生的股利收益	3,369,687.38	3,620,419.45
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	3,369,687.38	3,620,419.45

## 7.4.7.20 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 12 月 31 日	上年度可比期间 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日
1. 交易性金融资产	14,250,310.67	28,302,342.48
股票投资	14,254,970.71	28,297,682.44
债券投资	-4,660.04	4,660.04
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	14,250,310.67	28,302,342.48

#### 7.4.7.21 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日
基金赎回费收入	-	-
替代损益	-74,287.01	31,338.70
合计	-74,287.01	31,338.70

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。

#### 7.4.7.22 信用减值损失

无。

#### 7.4.7.23 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日
审计费用	45,000.00	45,000.00
信息披露费	120,000.00	120,000.00
证券出借违约金	-	-
银行划款手续费	395.00	415.00
指数使用费	13,984.54	140,000.00
合计	179,379.54	305,415.00

#### 7.4.7.24 分部报告

无。

#### 7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

##### 7.4.8.1 或有事项

无。

##### 7.4.8.2 资产负债表日后事项

无。

#### 7.4.9 关联方关系

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
中泰信托有限责任公司	基金管理人的股东
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
中国银河投资管理有限公司	基金管理人的股东
大成国际资产管理有限公司(“大成国际”)	基金管理人的子公司
大成创新资本管理有限公司(“大成创新资本”)	基金管理人的合营企业

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。

#### 7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

##### 7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

###### 7.4.10.1.1 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12月31日		上年度可比期间 2024年1月1日至2024年12月31日	
	成交金额	占当期股票成交总额的比例(%)	成交金额	占当期股票成交总额的比例(%)
光大证券	54,263,667.89	100.00	45,825,610.17	95.10

###### 7.4.10.1.2 债券交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2025年1月1日至2025年12月31日	上年度可比期间 2024年1月1日至2024年12月31日
-------	-----------------------------	----------------------------------

	成交金额	占当期债券成交总额的比例 (%)	成交金额	占当期债券成交总额的比例 (%)
光大证券	184,952.11	100.00	-	-

#### 7.4.10.1.3 债券回购交易

无。

#### 7.4.10.1.4 权证交易

无。

#### 7.4.10.1.5 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12月31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	5,426.72	100.00	1,681.99	100.00
关联方名称	上年度可比期间 2024年1月1日至2024年12月31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	4,583.41	67.45	1,818.75	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。

#### 7.4.10.2 关联方报酬

##### 7.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2025年1月1日至2025年12月31日	上年度可比期间 2024年1月1日至2024年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	1,048,749.75	981,853.89
其中：应支付销售机构的客户维护费	286,776.44	61,985.34
应支付基金管理人的净管理费	761,973.31	919,868.55

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。

#### 7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2025 年 1 月 1 日至 2025 年 12 月 31 日	2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的托管费	209,750.08	196,370.80

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。

#### 7.4.10.2.3 销售服务费

无。

#### 7.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易

无。

#### 7.4.10.4 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

##### 7.4.10.4.1 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。

##### 7.4.10.4.2 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。

#### 7.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

##### 7.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

无。

##### 7.4.10.5.2 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。

#### 7.4.10.6 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		上年度可比期间	
	2025 年 1 月 1 日至 2025 年 12 月 31 日		2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 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	2,673,057.15	13,405.75	3,830,193.16	28,176.42

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。

## 7.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

无。

## 7.4.10.8 其他关联交易事项的说明

无。

## 7.4.11 利润分配情况

无。

## 7.4.12 期末（2025 年 12 月 31 日）本基金持有的流通受限证券

## 7.4.12.1 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

7.4.12.1.1 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
001221	悍高集团	2025年7月23日	6个月	新股锁定	15.43	56.94	135	2,083.05	7,686.90	-
001233	海安集团	2025年11月18日	6个月	新股锁定	48.00	51.88	135	6,480.00	7,003.80	-
001280	中国铝业	2025年11月25日	6个月	新股锁定	17.89	45.36	828	14,812.92	37,558.08	-
001285	瑞立科密	2025年9月23日	6个月	新股锁定	42.28	56.08	53	2,240.84	2,972.24	-
001369	双欣环保	2025年12月23日	6个月	新股锁定	6.85	12.89	356	2,438.60	4,588.84	-
001386	马可波罗	2025年10月15日	6个月	新股锁定	13.75	18.53	571	7,851.25	10,580.63	-
001388	信通电	2025年6月24日	6个月	新股锁定	16.42	42.94	94	1,543.48	4,036.36	-

	子									
001396	誉帆科技	2025年12月23日	6个月	新股锁定	22.29	35.39	69	1,538.01	2,441.91	-
301449	天溯计量	2025年12月16日	6个月	新股锁定	36.80	65.23	112	4,121.60	7,305.76	-
301491	汉桑科技	2025年7月29日	6个月	新股锁定	28.91	55.11	163	4,712.33	8,982.93	-
301563	云汉芯城	2025年9月23日	6个月	新股锁定	27.00	133.69	110	2,970.00	14,705.90	-
301575	艾芬达	2025年9月3日	6个月	新股锁定	27.69	49.55	126	3,488.94	6,243.30	-
301584	建发致新	2025年9月18日	6个月	新股锁定	7.05	26.82	447	3,151.35	11,988.54	-
301609	山大电力	2025年7月16日	6个月	新股锁定	14.66	40.99	263	3,855.58	10,780.37	-
301632	广东建科	2025年8月5日	6个月	新股锁定	6.56	23.68	525	3,444.00	12,432.00	-
301638	南网数字	2025年11月11日	6个月	新股锁定	5.69	14.21	870	4,950.30	12,362.70	-
301656	联合动力	2025年9月17日	6个月	新股锁定	12.48	25.46	1,341	16,735.68	34,141.86	-
301667	纳百川	2025年12月10日	6个月	新股锁定	22.63	57.07	151	3,417.13	8,617.57	-

301668	昊创瑞通	2025年9月15日	6个月	新股锁定	21.00	44.80	165	3,465.00	7,392.00	-
301687	新广益	2025年12月24日	6个月	新股锁定	21.93	54.39	173	3,793.89	9,409.47	-

#### 7.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量(股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
002049	紫光国微	2025年12月30日	重大事项停牌	78.81	2026年1月15日	86.69	8,180	593,615.87	644,665.80	-

#### 7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

##### 7.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

无。

##### 7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

无。

#### 7.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

无。

#### 7.4.13 金融工具风险及管理

##### 7.4.13.1 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。

#### 7.4.13.2 信用风险

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

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

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

本期末,本基金无债券投资(上年度末:本基金持有的除国债、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%)。

#### 7.4.13.3 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。

#### 7.4.13.3.1 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。

#### 7.4.13.4 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。

##### 7.4.13.4.1 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。

## 7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 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
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	3,830,193.16	-	-	-	3,830,193.16
结算备付金	85.56	-	-	-	85.56
存出保证金	91,441.04	-	-	-	91,441.04
交易性金融资产	-	-	22,463.47	222,107,013.44	222,129,476.91
应收清算款	-	-	-	14,926.61	14,926.61
资产总计	3,921,719.76	-	22,463.47	222,121,940.05	226,066,123.28
负债					
应付管理人报酬	-	-	-	98,437.48	98,437.48
应付托管费	-	-	-	19,687.48	19,687.48
应付清算款	-	-	-	4,770.31	4,770.31
其他负债	-	-	-	203,789.55	203,789.55
负债总计	-	-	-	326,684.82	326,684.82
利率敏感度缺口	3,921,719.76	-	22,463.47	221,795,255.23	225,739,438.46

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。

## 7.4.13.4.1.2 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：0.01%），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）。

## 7.4.13.4.2 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。

#### 7.4.13.4.3 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。

##### 7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2025 年 12 月 31 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	191,046,218.24	98.72	222,107,013.44	98.39
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	191,046,218.24	98.72	222,107,013.44	98.39

##### 7.4.13.4.3.2 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 12 月 31 日）	上年度末（2024 年 12 月 31 日）

	业绩比较基准上升 5%	9,526,377.39	11,069,615.67
	业绩比较基准下降 5%	-9,526,377.39	-11,069,615.67

#### 7.4.14 公允价值

##### 7.4.14.1 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。

##### 7.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

###### 7.4.14.2.1 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12月31日	上年度末 2024年12月31日
第一层次	190,180,321.28	221,198,271.49
第二层次	644,665.80	639,114.40
第三层次	221,231.16	292,091.02
合计	191,046,218.24	222,129,476.91

###### 7.4.14.2.2 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。

###### 7.4.14.2.3 第三层次公允价值余额及变动情况

###### 7.4.14.2.3.1 第三层次公允价值余额及变动情况

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 12 月 31 日		
	交易性金融资产		合计
	债券投资	股票投资	
期初余额	-	292,091.02	292,091.02
当期购买	-	-	-
当期出售/结算	-	-	-
转入第三层次	-	418,973.41	418,973.41
转出第三层次	-	545,101.09	545,101.09
当期利得或损失总额	-	55,267.82	55,267.82
其中：计入损益的利得或损失	-	55,267.82	55,267.82
计入其他综合收益的利得或损失	-	-	-
期末余额	-	221,231.16	221,231.16
期末仍持有的第三层次金融资产计入本期损益的未实现利得或损失的变动——公允价值变动损益	-	124,137.21	124,137.21
项目	上年度可比期间 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日		
	交易性金融资产		合计
	债券投资	股票投资	
期初余额	-	150,199.99	150,199.99
当期购买	-	-	-
当期出售/结算	-	-	-
转入第三层次	-	490,039.69	490,039.69
转出第三层次	-	174,058.53	174,058.53
当期利得或损失总额	-	-174,090.13	-174,090.13
其中：计入损益的利得或损失	-	-174,090.13	-174,090.13
计入其他综合收益的利得或损失	-	-	-
期末余额	-	292,091.02	292,091.02
期末仍持有的第三层次金融资产计入本期损益的未实现利得或损失的变动——公允价值变动损益	-	188,380.07	188,380.07

## 7.4.14.2.3.2 使用重要不可观察输入值的第三层次公允价值计量的情况

单位：人民币元

项目	本期末公允价值	采用的估值技术	不可观察输入值		
			名称	范围/加权平均值	与公允价值之间的关系
证券交易所上市但尚在限售期内的股票	221,231.16	平均价格亚式期权模型	预期波动率	0.1920-2.4267	负相关
项目	上年度末公允价值	采用的估值技术	不可观察输入值		
			名称	范围/加权平均值	与公允价值之间的关系
证券交易所上市但尚在限售期内的股票	292,091.02	平均价格亚式期权模型	预期波动率	0.4607-5.7444	负相关

## 7.4.14.3 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)。

## 7.4.14.4 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。

## 7.4.15 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。

## § 8 投资组合报告

## 8.1 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	191,046,218.24	98.56
	其中：股票	191,046,218.24	98.56
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	2,673,057.15	1.38
8	其他各项资产	124,449.49	0.06
9	合计	193,843,724.88	100.00

注：上述股票投资金额包括可退替代款估值增值（如有）。

## 8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

### 8.2.1 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	3,231,821.88	1.67
B	采矿业	2,635,238.71	1.36
C	制造业	147,351,179.47	76.14
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	1,869,433.80	0.97
E	建筑业	280,209.00	0.14
F	批发和零售业	2,128,257.85	1.10
G	交通运输、仓储和邮政业	2,274,993.02	1.18
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	11,001,453.30	5.68
J	金融业	13,133,527.06	6.79
K	房地产业	1,113,968.64	0.58
L	租赁和商务服务业	2,327,623.04	1.20
M	科学研究和技术服务业	1,271,574.30	0.66
N	水利、环境和公共设施管理业	232,181.28	0.12
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	164,400.00	0.08
Q	卫生和社会工作	819,399.64	0.42
R	文化、体育和娱乐业	989,726.09	0.51
S	综合	-	-
	合计	190,824,987.08	98.61

### 8.2.2 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	37,558.08	0.02
C	制造业	122,436.27	0.06
D	电力、热力、燃气	-	-

	及水生产和供应业		
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	26,694.44	0.01
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	12,362.70	0.01
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	22,179.67	0.01
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	221,231.16	0.11

### 8.2.3 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

无。

### 8.3 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

#### 8.3.1 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	300750	宁德时代	31,580	11,598,070.80	5.99
2	300308	中际旭创	10,628	6,483,080.00	3.35
3	300502	新易盛	10,965	4,724,599.20	2.44
4	000333	美的集团	59,607	4,658,287.05	2.41
5	300059	东方财富	158,938	3,684,182.84	1.90
6	002475	立讯精密	57,746	3,274,775.66	1.69
7	300274	阳光电源	18,212	3,114,980.48	1.61
8	002594	比亚迪	31,200	3,048,864.00	1.58
9	000858	五粮液	22,200	2,351,868.00	1.22
10	002371	北方华创	4,750	2,180,630.00	1.13
11	300476	胜宏科技	7,500	2,156,850.00	1.11
12	000651	格力电器	52,900	2,127,638.00	1.10

13	300124	汇川技术	24,191	1,822,308.03	0.94
14	000725	京东方 A	407,700	1,716,417.00	0.89
15	002714	牧原股份	30,806	1,558,167.48	0.81
16	000063	中兴通讯	39,000	1,475,760.00	0.76
17	002050	三花智控	26,200	1,449,122.00	0.75
18	300760	迈瑞医疗	7,500	1,428,375.00	0.74
19	002415	海康威视	45,450	1,356,228.00	0.70
20	002384	东山精密	15,600	1,320,540.00	0.68
21	000425	徐工机械	108,200	1,252,956.00	0.65
22	002463	沪电股份	16,750	1,223,922.50	0.63
23	002230	科大讯飞	23,775	1,195,644.75	0.62
24	000001	平安银行	104,100	1,187,781.00	0.61
25	002142	宁波银行	41,817	1,174,639.53	0.61
26	300498	温氏股份	68,405	1,154,676.40	0.60
27	002352	顺丰控股	29,300	1,122,776.00	0.58
28	000792	盐湖股份	39,700	1,117,952.00	0.58
29	300394	天孚通信	5,480	1,112,604.40	0.57
30	002028	思源电气	7,000	1,082,130.00	0.56
31	000338	潍柴动力	62,600	1,076,720.00	0.56
32	300014	亿纬锂能	16,331	1,073,926.56	0.55
33	000568	泸州老窖	9,200	1,069,224.00	0.55
34	000100	TCL 科技	223,440	1,014,417.60	0.52
35	002625	光启技术	19,440	947,894.40	0.49
36	002027	分众传媒	124,188	915,265.56	0.47
37	002241	歌尔股份	30,400	873,392.00	0.45
38	002460	赣锋锂业	13,790	867,253.10	0.45
39	000807	云铝股份	25,500	837,420.00	0.43
40	000977	浪潮信息	12,553	836,029.80	0.43
41	000988	华工科技	10,400	825,032.00	0.43
42	300033	同花顺	2,500	805,450.00	0.42
43	002837	英维克	7,340	784,572.60	0.41
44	000776	广发证券	34,500	759,690.00	0.39
45	002709	天赐材料	16,192	750,175.36	0.39
46	000408	藏格矿业	8,800	742,720.00	0.38
47	300433	蓝思科技	23,859	722,211.93	0.37
48	002916	深南电路	3,039	705,929.31	0.36
49	300408	三环集团	15,400	704,550.00	0.36
50	002466	天齐锂业	12,600	697,788.00	0.36
51	300450	先导智能	13,500	674,730.00	0.35
52	002558	巨人网络	15,000	649,350.00	0.34
53	002049	紫光国微	8,180	644,665.80	0.33
54	002202	金风科技	31,336	639,254.40	0.33
55	000625	长安汽车	53,314	632,304.04	0.33

56	300136	信维通信	9,920	615,040.00	0.32
57	002738	中矿资源	7,780	611,119.00	0.32
58	002600	领益智造	38,400	596,736.00	0.31
59	300803	指南针	4,555	596,112.85	0.31
60	002532	天山铝业	36,800	595,424.00	0.31
61	300475	香农芯创	4,100	591,794.00	0.31
62	300015	爱尔眼科	53,374	586,046.52	0.30
63	000426	兴业银锡	16,400	583,840.00	0.30
64	000630	铜陵有色	93,100	559,531.00	0.29
65	300604	长川科技	5,400	547,074.00	0.28
66	000938	紫光股份	22,147	544,816.20	0.28
67	000166	申万宏源	103,060	543,126.20	0.28
68	300115	长盈精密	11,636	541,074.00	0.28
69	002156	通富微电	14,200	535,340.00	0.28
70	002311	海大集团	9,580	530,540.40	0.27
71	000933	神火股份	19,300	530,171.00	0.27
72	002353	杰瑞股份	7,400	524,142.00	0.27
73	002074	国轩高科	13,390	523,682.90	0.27
74	300395	菲利华	5,200	521,560.00	0.27
75	000538	云南白药	9,160	519,921.60	0.27
76	000157	中联重科	60,100	518,663.00	0.27
77	000547	航天发展	15,600	514,956.00	0.27
78	300058	蓝色光标	44,186	509,022.72	0.26
79	000975	山金国际	20,877	507,937.41	0.26
80	300255	常山药业	8,100	503,010.00	0.26
81	002179	中航光电	14,124	500,554.56	0.26
82	002340	格林美	59,320	495,915.20	0.26
83	301308	江波龙	2,000	489,680.00	0.25
84	002001	新和成	19,117	481,557.23	0.25
85	002517	恺英网络	21,600	472,392.00	0.24
86	300857	协创数据	2,760	465,556.80	0.24
87	300339	润和软件	9,400	465,300.00	0.24
88	002851	麦格米特	5,100	459,357.00	0.24
89	002195	岩山科技	64,364	456,340.76	0.24
90	300223	北京君正	4,300	455,972.00	0.24
91	002304	洋河股份	7,462	453,241.88	0.23
92	300442	润泽科技	8,400	443,520.00	0.23
93	002236	大华股份	23,400	443,196.00	0.23
94	002736	国信证券	33,700	442,144.00	0.23
95	001309	德明利	1,900	440,591.00	0.23
96	002407	多氟多	12,920	438,117.20	0.23
97	300418	昆仑万维	10,500	437,850.00	0.23
98	300207	欣旺达	16,700	436,705.00	0.23

99	002261	拓维信息	13,000	430,300.00	0.22
100	002281	光迅科技	6,100	426,695.00	0.22
101	002595	豪迈科技	5,000	422,550.00	0.22
102	002555	三七互娱	17,900	422,440.00	0.22
103	002920	德赛西威	3,500	421,050.00	0.22
104	002422	科伦药业	14,200	416,770.00	0.22
105	002938	鹏鼎控股	8,100	409,698.00	0.21
106	002008	大族激光	9,900	407,781.00	0.21
107	002812	恩捷股份	7,170	406,108.80	0.21
108	000768	中航西飞	15,900	403,542.00	0.21
109	300751	迈为股份	1,944	400,444.56	0.21
110	002131	利欧股份	70,634	398,375.76	0.21
111	002436	兴森科技	18,600	393,762.00	0.20
112	002472	双环传动	8,300	393,503.00	0.20
113	002966	苏州银行	47,200	391,288.00	0.20
114	002402	和而泰	10,000	391,200.00	0.20
115	000831	中国稀土	8,400	390,096.00	0.20
116	300390	天华新能	7,080	386,638.80	0.20
117	002456	欧菲光	36,400	386,568.00	0.20
118	300548	长芯博创	2,700	383,400.00	0.20
119	000002	万科A	82,200	382,230.00	0.20
120	002493	荣盛石化	32,325	378,525.75	0.20
121	002252	上海莱士	59,320	376,088.80	0.19
122	002273	水晶光电	14,914	374,639.68	0.19
123	002648	卫星化学	21,162	374,144.16	0.19
124	300347	泰格医药	6,550	371,385.00	0.19
125	000963	华东医药	9,395	370,632.75	0.19
126	002601	龙佰集团	18,800	368,104.00	0.19
127	300456	赛微电子	6,500	363,740.00	0.19
128	002465	海格通信	22,900	360,675.00	0.19
129	001979	招商蛇口	41,601	359,432.64	0.19
130	002126	银轮股份	9,500	359,100.00	0.19
131	301236	软通动力	7,550	358,096.50	0.19
132	000066	中国长城	24,504	353,102.64	0.18
133	002185	华天科技	31,774	348,560.78	0.18
134	000661	长春高新	3,760	347,988.00	0.18
135	002850	科达利	2,200	347,292.00	0.18
136	000895	双汇发展	13,100	346,757.00	0.18
137	000878	云南铜业	16,900	346,619.00	0.18
138	300782	卓胜微	4,253	346,534.44	0.18
139	300661	圣邦股份	5,029	345,190.56	0.18
140	002128	电投能源	12,200	340,502.00	0.18
141	300454	深信服	2,900	333,964.00	0.17

142	002130	沃尔核材	12,600	331,632.00	0.17
143	000893	亚钾国际	6,900	330,993.00	0.17
144	000021	深科技	13,066	330,308.48	0.17
145	300759	康龙化成	11,550	328,366.50	0.17
146	002797	第一创业	47,620	327,149.40	0.17
147	000960	锡业股份	11,721	326,781.48	0.17
148	300724	捷佳伟创	3,400	325,040.00	0.17
149	301358	湖南裕能	5,000	323,300.00	0.17
150	003816	中国广核	85,900	322,984.00	0.17
151	300054	鼎龙股份	8,500	319,600.00	0.17
152	002271	东方雨虹	23,353	317,367.27	0.16
153	000657	中钨高新	11,300	313,123.00	0.16
154	300346	南大光电	7,296	312,998.40	0.16
155	300037	新宙邦	5,960	312,304.00	0.16
156	002497	雅化集团	12,600	311,850.00	0.16
157	000617	中油资本	32,120	308,352.00	0.16
158	300458	全志科技	7,333	308,205.99	0.16
159	002080	中材科技	8,480	308,163.20	0.16
160	002129	TCL 中环	35,950	308,091.50	0.16
161	000301	东方盛虹	28,200	307,098.00	0.16
162	300866	安克创新	2,680	306,565.20	0.16
163	002138	顺络电子	8,600	305,558.00	0.16
164	002078	太阳纸业	19,400	305,550.00	0.16
165	300474	景嘉微	4,250	305,447.50	0.16
166	000783	长江证券	37,300	303,995.00	0.16
167	300757	罗博特科	1,300	303,290.00	0.16
168	002240	盛新锂能	8,700	299,541.00	0.15
169	002157	正邦科技	92,100	298,404.00	0.15
170	002294	信立泰	6,000	297,300.00	0.15
171	000786	北新建材	11,900	297,143.00	0.15
172	300496	中科创达	4,300	290,250.00	0.15
173	002444	巨星科技	8,500	289,170.00	0.15
174	002414	高德红外	19,701	289,013.67	0.15
175	300073	当升科技	5,000	289,000.00	0.15
176	300748	金力永磁	8,396	286,387.56	0.15
177	300251	光线传媒	17,380	284,684.40	0.15
178	300285	国瓷材料	10,300	282,323.00	0.15
179	000034	神州数码	7,200	280,152.00	0.14
180	002223	鱼跃医疗	7,330	280,079.30	0.14
181	300316	晶盛机电	7,580	278,565.00	0.14
182	302132	中航成飞	3,500	276,500.00	0.14
183	002624	完美世界	16,650	272,893.50	0.14
184	000728	国元证券	32,650	272,627.50	0.14

185	002155	湖南黄金	12,910	272,271.90	0.14
186	000766	通化金马	9,900	272,151.00	0.14
187	002222	福晶科技	4,800	270,432.00	0.14
188	000423	东阿阿胶	5,500	269,940.00	0.14
189	300024	机器人	14,666	266,774.54	0.14
190	300002	神州泰岳	23,100	266,112.00	0.14
191	301269	华大九天	2,500	265,825.00	0.14
192	300017	网宿科技	25,852	264,983.00	0.14
193	000559	万向钱潮	15,328	263,641.60	0.14
194	002683	广东宏大	5,500	262,900.00	0.14
195	002085	万丰奥威	16,356	261,859.56	0.14
196	300122	智飞生物	13,850	261,349.50	0.14
197	300699	光威复材	6,584	259,804.64	0.13
198	000733	振华科技	4,900	256,809.00	0.13
199	002487	大金重工	4,900	254,457.00	0.13
200	000997	新大陆	8,950	253,464.00	0.13
201	002459	晶澳科技	22,032	252,266.40	0.13
202	002409	雅克科技	3,400	251,940.00	0.13
203	300896	爱美客	1,740	246,592.80	0.13
204	300373	扬杰科技	3,600	244,800.00	0.13
205	002335	科华数据	4,400	244,332.00	0.13
206	002405	四维图新	27,050	243,720.50	0.13
207	000703	恒逸石化	22,566	243,035.82	0.13
208	300919	中伟股份	5,220	241,842.60	0.12
209	002180	纳思达	11,900	240,618.00	0.12
210	300666	江丰电子	2,600	239,200.00	0.12
211	002065	东华软件	26,100	238,815.00	0.12
212	000876	新希望	25,900	238,798.00	0.12
213	000596	古井贡酒	1,800	238,680.00	0.12
214	002151	北斗星通	5,250	238,507.50	0.12
215	002673	西部证券	30,066	237,220.74	0.12
216	002756	永兴材料	4,370	237,072.50	0.12
217	000932	华菱钢铁	42,160	236,939.20	0.12
218	000683	博源化工	31,800	236,592.00	0.12
219	300832	新产业	4,200	236,250.00	0.12
220	002821	凯莱英	2,540	236,042.20	0.12
221	300438	鹏辉能源	4,400	234,168.00	0.12
222	300012	华测检测	17,200	233,060.00	0.12
223	000887	中鼎股份	10,000	232,100.00	0.12
224	300003	乐普医疗	14,626	231,237.06	0.12
225	300570	太辰光	2,000	231,100.00	0.12
226	000060	中金岭南	39,500	231,075.00	0.12
227	001965	招商公路	22,900	230,832.00	0.12

228	002064	华峰化学	20,900	229,900.00	0.12
229	300568	星源材质	15,042	229,390.50	0.12
230	300001	特锐德	8,900	228,552.00	0.12
231	000039	中集集团	22,640	228,437.60	0.12
232	300567	精测电子	2,450	223,440.00	0.12
233	000999	华润三九	7,816	222,443.36	0.11
234	300779	惠城环保	1,700	221,187.00	0.11
235	300972	万辰集团	1,100	221,177.00	0.11
236	002249	大洋电机	20,200	220,180.00	0.11
237	002318	久立特材	7,600	220,020.00	0.11
238	300383	光环新网	17,500	218,925.00	0.11
239	000528	柳工	18,380	218,170.60	0.11
240	002152	广电运通	15,750	217,507.50	0.11
241	000750	国海证券	51,165	216,939.60	0.11
242	300627	华测导航	6,180	215,743.80	0.11
243	000623	吉林敖东	11,020	215,220.60	0.11
244	300142	沃森生物	19,700	214,927.00	0.11
245	002203	海亮股份	16,900	213,954.00	0.11
246	002410	广联达	16,980	213,608.40	0.11
247	300432	富临精工	12,740	212,758.00	0.11
248	002245	蔚蓝锂芯	11,900	211,820.00	0.11
249	002739	万达电影	18,700	211,684.00	0.11
250	300628	亿联网络	5,890	209,978.50	0.11
251	300468	四方精创	5,400	209,682.00	0.11
252	000400	许继电气	8,000	205,680.00	0.11
253	000830	鲁西化工	12,400	205,468.00	0.11
254	300677	英科医疗	5,280	205,392.00	0.11
255	300953	震裕科技	1,200	201,624.00	0.10
256	002056	横店东磁	10,300	200,850.00	0.10
257	000009	中国宝安	20,272	199,679.20	0.10
258	300999	金龙鱼	6,900	198,306.00	0.10
259	000983	山西焦煤	30,810	197,800.20	0.10
260	002429	兆驰股份	26,500	196,630.00	0.10
261	300763	锦浪科技	2,740	195,663.40	0.10
262	001696	宗申动力	9,000	195,210.00	0.10
263	002044	美年健康	36,704	193,797.12	0.10
264	300672	国科微	1,800	193,716.00	0.10
265	300773	拉卡拉	6,800	193,664.00	0.10
266	002484	江海股份	6,500	193,050.00	0.10
267	300253	卫宁健康	21,847	192,690.54	0.10
268	000519	中兵红箭	10,400	189,384.00	0.10
269	002007	华兰生物	12,460	188,519.80	0.10
270	300487	蓝晓科技	3,050	188,337.50	0.10

271	300459	汤姆猫	40,780	187,180.20	0.10
272	300413	芒果超媒	7,630	186,324.60	0.10
273	002389	航天彩虹	7,700	184,646.00	0.10
274	300364	中文在线	7,300	183,376.00	0.09
275	000737	北方铜业	11,900	183,141.00	0.09
276	002841	视源股份	4,620	183,090.60	0.09
277	000415	渤海租赁	44,900	181,845.00	0.09
278	002544	普天科技	5,200	179,348.00	0.09
279	002048	宁波华翔	5,700	179,322.00	0.09
280	002139	拓邦股份	13,000	179,140.00	0.09
281	000738	航发控制	8,400	179,004.00	0.09
282	300777	中简科技	4,300	175,440.00	0.09
283	002176	江特电机	18,000	175,320.00	0.09
284	002025	航天电器	3,470	173,951.10	0.09
285	002617	露笑科技	21,200	171,720.00	0.09
286	300296	利亚德	27,150	171,588.00	0.09
287	000708	中信特钢	10,390	170,084.30	0.09
288	002653	海思科	3,300	169,356.00	0.09
289	300229	拓尔思	8,500	169,150.00	0.09
290	000875	电投绿能	29,900	168,636.00	0.09
291	002385	大北农	41,950	167,800.00	0.09
292	300638	广和通	5,660	167,762.40	0.09
293	300623	捷捷微电	6,150	167,095.50	0.09
294	000155	川能动力	14,300	166,595.00	0.09
295	300765	新诺威	4,600	165,922.00	0.09
296	300679	电连技术	3,400	165,512.00	0.09
297	002926	华西证券	17,800	165,184.00	0.09
298	000729	燕京啤酒	14,700	165,081.00	0.09
299	300674	宇信科技	6,780	164,482.80	0.08
300	002607	中公教育	60,000	164,400.00	0.08
301	002603	以岭药业	9,624	164,281.68	0.08
302	002939	长城证券	16,100	164,220.00	0.08
303	002432	九安医疗	4,100	164,164.00	0.08
304	000723	美锦能源	34,900	164,030.00	0.08
305	002958	青农商行	52,700	163,370.00	0.08
306	001389	广合科技	2,000	163,260.00	0.08
307	000629	钒钛股份	52,600	163,060.00	0.08
308	002270	华明装备	6,500	162,760.00	0.08
309	002262	恩华药业	6,700	161,671.00	0.08
310	300144	宋城演艺	19,651	160,941.69	0.08
311	000050	深天马 A	17,700	159,831.00	0.08
312	000686	东北证券	17,120	159,558.40	0.08
313	001203	大中矿业	5,200	159,380.00	0.08

314	000799	酒鬼酒	2,900	158,282.00	0.08
315	000970	中科三环	11,645	157,906.20	0.08
316	300088	长信科技	26,000	157,560.00	0.08
317	002583	海能达	13,900	157,348.00	0.08
318	300573	兴齐眼药	2,220	156,043.80	0.08
319	000636	风华高科	9,500	154,660.00	0.08
320	301611	珂玛科技	1,800	154,314.00	0.08
321	000513	丽珠集团	4,467	153,932.82	0.08
322	002430	杭氧股份	5,100	152,337.00	0.08
323	002145	钛能化学	30,965	151,728.50	0.08
324	002747	埃斯顿	6,400	151,680.00	0.08
325	300100	双林股份	3,800	150,556.00	0.08
326	300676	华大基因	3,300	149,688.00	0.08
327	002373	千方科技	12,700	149,479.00	0.08
328	002984	森麒麟	7,060	149,460.20	0.08
329	300558	贝达药业	3,200	149,408.00	0.08
330	300182	捷成股份	27,000	149,040.00	0.08
331	002506	协鑫集成	52,800	147,840.00	0.08
332	300775	三角防务	4,800	145,920.00	0.08
333	000591	太阳能	32,500	144,300.00	0.07
334	002312	川发龙蟒	13,200	144,276.00	0.07
335	300146	汤臣倍健	12,000	144,120.00	0.07
336	003031	中瓷电子	1,960	143,393.60	0.07
337	002500	山西证券	23,880	143,041.20	0.07
338	002568	百润股份	6,548	142,811.88	0.07
339	002268	电科网安	6,860	140,904.40	0.07
340	002518	科士达	2,900	140,708.00	0.07
341	002237	恒邦股份	10,300	138,226.00	0.07
342	003021	兆威机电	1,100	136,598.00	0.07
343	300718	长盛轴承	1,600	136,576.00	0.07
344	000032	深桑达 A	7,000	135,450.00	0.07
345	002244	滨江集团	13,400	134,670.00	0.07
346	000422	湖北宜化	9,300	132,153.00	0.07
347	000987	越秀资本	16,235	132,152.90	0.07
348	300009	安科生物	13,786	131,932.02	0.07
349	301536	星辰科技	2,200	131,802.00	0.07
350	002831	裕同科技	4,620	131,716.20	0.07
351	000998	隆平高科	13,900	130,104.00	0.07
352	000825	太钢不锈	26,600	130,074.00	0.07
353	002701	奥瑞金	21,600	128,520.00	0.07
354	002698	博实股份	7,600	127,756.00	0.07
355	002423	中粮资本	10,900	127,530.00	0.07
356	002266	浙富控股	30,640	127,462.40	0.07

357	000563	陕国投 A	36,800	126,960.00	0.07
358	300457	赢合科技	4,550	126,717.50	0.07
359	000099	中信海直	6,100	126,575.00	0.07
360	000958	电投产融	19,300	124,871.00	0.06
361	000581	威孚高科	6,000	123,720.00	0.06
362	000778	新兴铸管	29,500	123,310.00	0.06
363	000951	中国重汽	7,260	122,694.00	0.06
364	000555	神州信息	7,400	122,470.00	0.06
365	002299	圣农发展	7,400	122,396.00	0.06
366	000688	国城矿业	4,400	122,320.00	0.06
367	002507	涪陵榨菜	9,470	122,257.70	0.06
368	300735	光弘科技	4,900	121,814.00	0.06
369	002368	太极股份	4,911	120,270.39	0.06
370	300682	朗新科技	7,900	120,159.00	0.06
371	000818	航锦科技	6,200	119,660.00	0.06
372	000921	海信家电	4,800	119,088.00	0.06
373	002773	康弘药业	3,960	118,681.20	0.06
374	002439	启明星辰	8,400	118,608.00	0.06
375	000682	东方电子	10,000	118,600.00	0.06
376	300601	康泰生物	7,960	117,569.20	0.06
377	000739	普洛药业	7,200	117,144.00	0.06
378	000598	兴蓉环境	16,200	116,154.00	0.06
379	002670	国盛证券	6,893	116,078.12	0.06
380	300979	华利集团	2,300	115,483.00	0.06
381	300660	江苏雷利	2,100	115,122.00	0.06
382	002936	郑州银行	59,446	114,730.78	0.06
383	300034	钢研高纳	5,800	113,564.00	0.06
384	301050	雷电微力	2,160	112,752.00	0.06
385	301078	孩子王	10,800	111,996.00	0.06
386	000801	四川九洲	6,600	111,936.00	0.06
387	301029	怡合达	4,212	111,702.24	0.06
388	301377	鼎泰高科	800	111,280.00	0.06
389	000902	新洋丰	7,102	110,933.24	0.06
390	001227	兰州银行	47,800	110,896.00	0.06
391	002508	老板电器	5,690	110,101.50	0.06
392	000069	华侨城 A	44,100	109,368.00	0.06
393	002745	木林森	11,400	109,098.00	0.06
394	300747	锐科激光	4,012	108,444.36	0.06
395	301165	锐捷网络	1,220	108,336.00	0.06
396	300776	帝尔激光	1,740	108,123.60	0.06
397	002015	协鑫能科	10,800	107,460.00	0.06
398	300910	瑞丰新材	1,900	107,445.00	0.06
399	002153	石基信息	9,912	107,346.96	0.06

400	000709	河钢股份	46,300	106,953.00	0.06
401	002120	韵达股份	15,829	106,687.46	0.06
402	002948	青岛银行	23,610	105,772.80	0.05
403	002019	亿帆医药	8,800	105,248.00	0.05
404	002183	怡亚通	22,000	104,720.00	0.05
405	300070	碧水源	26,714	104,718.88	0.05
406	002675	东诚药业	7,600	104,424.00	0.05
407	300529	健帆生物	5,280	103,857.60	0.05
408	002091	江苏国泰	11,500	103,845.00	0.05
409	000403	派林生物	7,500	102,675.00	0.05
410	300212	易华录	5,800	101,210.00	0.05
411	000062	深圳华强	4,105	101,065.10	0.05
412	002416	爱施德	8,000	100,640.00	0.05
413	301219	腾远钴业	1,450	99,006.00	0.05
414	000027	深圳能源	15,140	98,712.80	0.05
415	002468	申通快递	7,300	97,966.00	0.05
416	300357	我武生物	3,440	97,524.00	0.05
417	301155	海力风电	1,200	97,116.00	0.05
418	000543	皖能电力	12,200	96,990.00	0.05
419	000883	湖北能源	21,100	95,794.00	0.05
420	000582	北部湾港	10,200	95,676.00	0.05
421	000967	盈峰环境	13,000	95,420.00	0.05
422	002572	索菲亚	7,008	95,378.88	0.05
423	300957	贝泰妮	2,400	95,064.00	0.05
424	301200	大族数控	800	95,016.00	0.05
425	000628	高新发展	2,100	93,639.00	0.05
426	002320	海峡股份	7,668	93,319.56	0.05
427	301095	广立微	1,300	93,223.00	0.05
428	002221	东华能源	11,500	93,150.00	0.05
429	300595	欧普康视	6,340	93,134.60	0.05
430	000088	盐田港	20,900	93,005.00	0.05
431	001287	中电港	4,100	92,906.00	0.05
432	000800	一汽解放	13,700	92,886.00	0.05
433	002003	伟星股份	8,700	92,220.00	0.05
434	301526	国际复材	13,100	91,700.00	0.05
435	000877	天山股份	17,100	90,972.00	0.05
436	300761	立华股份	4,360	90,470.00	0.05
437	002847	盐津铺子	1,300	88,803.00	0.05
438	003022	联泓新科	4,390	86,965.90	0.04
439	300726	宏达电子	1,700	86,547.00	0.04
440	300888	稳健医疗	2,280	86,275.20	0.04
441	002906	华阳集团	2,800	85,624.00	0.04
442	000156	华数传媒	11,300	85,541.00	0.04

443	300294	博雅生物	3,750	84,750.00	0.04
444	000935	四川双马	3,400	84,456.00	0.04
445	002010	传化智联	14,500	84,245.00	0.04
446	301039	中集车辆	9,200	84,180.00	0.04
447	002597	金禾实业	4,000	83,040.00	0.04
448	000959	首钢股份	16,600	81,340.00	0.04
449	001286	陕西能源	8,700	80,997.00	0.04
450	002690	美亚光电	3,900	80,223.00	0.04
451	301301	川宁生物	7,900	80,106.00	0.04
452	002372	伟星新材	7,640	79,685.20	0.04
453	002096	易普力	5,900	78,588.00	0.04
454	000089	深圳机场	11,200	78,288.00	0.04
455	301498	乖宝宠物	1,200	78,180.00	0.04
456	002265	建设工业	2,900	77,778.00	0.04
457	300428	立中集团	3,300	77,055.00	0.04
458	002408	齐翔腾达	15,780	77,006.40	0.04
459	002531	天顺风能	11,200	76,832.00	0.04
460	000810	创维数字	6,500	76,570.00	0.04
461	000429	粤高速 A	6,400	75,392.00	0.04
462	002032	苏泊尔	1,700	74,936.00	0.04
463	000029	深深房 A	3,400	74,868.00	0.04
464	000966	长源电力	17,400	74,298.00	0.04
465	300633	开立医疗	2,800	73,976.00	0.04
466	002541	鸿路钢构	4,430	72,829.20	0.04
467	000785	居然智家	24,400	71,248.00	0.04
468	000537	绿发电力	8,300	68,143.00	0.04
469	301091	深城交	2,520	67,384.80	0.03
470	002608	江苏国信	9,100	67,249.00	0.03
471	000937	冀中能源	12,390	66,658.20	0.03
472	000898	鞍钢股份	26,152	66,164.56	0.03
473	301589	诺瓦星云	400	65,820.00	0.03
474	001391	国货航	10,900	64,528.00	0.03
475	301297	富乐德	1,800	64,440.00	0.03
476	000791	甘肃能源	9,800	63,210.00	0.03
477	000927	中国铁物	24,100	62,901.00	0.03
478	000552	甘肃能化	26,900	62,139.00	0.03
479	002867	周大生	5,000	60,900.00	0.03
480	002978	安宁股份	1,800	59,490.00	0.03
481	003035	南网能源	12,500	57,250.00	0.03
482	002755	奥赛康	3,400	55,522.00	0.03
483	301238	瑞泰新材	2,700	55,080.00	0.03
484	002925	盈趣科技	3,180	53,869.20	0.03
485	002945	华林证券	3,500	53,655.00	0.03

486	001914	招商积余	5,000	53,400.00	0.03
487	000401	金隅冀东	12,100	53,361.00	0.03
488	002060	广东建工	14,200	51,120.00	0.03
489	001872	招商港口	2,600	50,258.00	0.03
490	002563	森马服饰	9,000	48,780.00	0.03
491	301551	无线传媒	1,500	47,325.00	0.02
492	301606	绿联科技	800	46,992.00	0.02
493	000539	粤电力A	10,400	45,968.00	0.02
494	002901	大博医疗	900	42,633.00	0.02
495	002461	珠江啤酒	4,500	41,805.00	0.02
496	001213	中铁特货	9,800	39,690.00	0.02
497	301267	华夏眼科	2,200	39,556.00	0.02
498	001289	龙源电力	1,800	27,072.00	0.01
499	301275	汉朔科技	500	26,710.00	0.01
500	001308	康冠科技	1,180	24,614.80	0.01

### 8.3.2 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	001280	中国铀业	828	37,558.08	0.02
2	301656	联合动力	1,341	34,141.86	0.02
3	301563	云汉芯城	110	14,705.90	0.01
4	301632	广东建科	525	12,432.00	0.01
5	301638	南网数字	870	12,362.70	0.01
6	301584	建发致新	447	11,988.54	0.01
7	301609	山大电力	263	10,780.37	0.01
8	001386	马可波罗	571	10,580.63	0.01
9	301687	新广益	173	9,409.47	0.00
10	301491	汉桑科技	163	8,982.93	0.00
11	301667	纳百川	151	8,617.57	0.00
12	001221	悍高集团	135	7,686.90	0.00
13	301668	昊创瑞通	165	7,392.00	0.00
14	301449	天溯计量	112	7,305.76	0.00
15	001233	海安集团	135	7,003.80	0.00
16	301575	艾芬达	126	6,243.30	0.00
17	001369	双欣环保	356	4,588.84	0.00
18	001388	信通电子	94	4,036.36	0.00
19	001285	瑞立科密	53	2,972.24	0.00
20	001396	誉帆科技	69	2,441.91	0.00

### 8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

#### 8.4.1 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（%）
----	------	------	----------	----------------

	码			
1	300760	迈瑞医疗	604,211.00	0.27
2	300255	常山药业	590,995.00	0.26
3	300750	宁德时代	525,104.00	0.23
4	300033	同花顺	498,615.00	0.22
5	300548	长芯博创	472,913.00	0.21
6	002475	立讯精密	451,927.00	0.20
7	001309	德明利	449,905.00	0.20
8	002261	拓维信息	443,370.00	0.20
9	300779	惠城环保	393,067.00	0.17
10	002130	沃尔核材	389,517.00	0.17
11	300502	新易盛	360,459.00	0.16
12	300308	中际旭创	325,834.00	0.14
13	301308	江波龙	314,104.00	0.14
14	002594	比亚迪	286,362.00	0.13
15	002850	科达利	282,584.00	0.13
16	300570	太辰光	269,068.00	0.12
17	002371	北方华创	263,741.00	0.12
18	301269	华大九天	260,923.00	0.12
19	002335	科华数据	258,082.00	0.11
20	002916	深南电路	243,791.00	0.11

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。

#### 8.4.2 累计卖出金额超期初基金资产净值 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	300750	宁德时代	576,445.00	0.26
2	002594	比亚迪	514,476.00	0.23
3	300308	中际旭创	381,100.00	0.17
4	000333	美的集团	292,737.00	0.13
5	000596	古井贡酒	285,339.00	0.13
6	002371	北方华创	276,370.00	0.12
7	301458	钧崴电子	261,037.00	0.12
8	000792	盐湖股份	259,327.00	0.11
9	300896	爱美客	255,333.00	0.11
10	300757	罗博特科	223,968.00	0.10
11	000858	五粮液	223,073.00	0.10
12	300182	捷成股份	218,204.78	0.10
13	301602	超研股份	211,903.22	0.09
14	300033	同花顺	185,349.00	0.08
15	301535	浙江华远	184,096.98	0.08
16	301632	广东建科	180,541.00	0.08
17	002317	众生药业	177,010.00	0.08

18	300751	迈为股份	174,559.00	0.08
19	300760	迈瑞医疗	172,952.00	0.08
20	301479	弘景光电	171,742.11	0.08

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。

#### 8.4.3 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	31,045,373.79
卖出股票收入（成交）总额	24,611,364.89

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。

#### 8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

无。

#### 8.6 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。

#### 8.7 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。

#### 8.8 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。

#### 8.9 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。

#### 8.10 本基金投资股指期货的投资政策

无。

#### 8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

##### 8.11.1 本期国债期货投资政策

无。

##### 8.11.2 本期国债期货投资评价

无。

#### 8.12 投资组合报告附注

##### 8.12.1 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。

### 8.12.2 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。

### 8.12.3 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	109,249.00
2	应收清算款	15,200.49
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	124,449.49

### 8.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

无。

### 8.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

#### 8.12.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

无。

#### 8.12.5.2 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	001280	中国铀业	37,558.08	0.02	新股锁定
2	301656	联合动力	34,141.86	0.02	新股锁定
3	301563	云汉芯城	14,705.90	0.01	新股锁定
4	301632	广东建科	12,432.00	0.01	新股锁定
5	301638	南网数字	12,362.70	0.01	新股锁定

### 8.12.6 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。

## § 9 基金份额持有人信息

### 9.1 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 (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 (%)
6,834	19,202.51	11,666,859.00	8.89	119,563,063.00	91.11

注：持有人户数为有效户数，即存量份额大于零的账户。

## 9.2 期末上市基金前十名持有人

序号	持有人名称	持有份额 (份)	占上市总份额比例 (%)
1	中信建投证券股份有限公司	3,917,251.00	2.99
2	罗媛香	2,332,800.00	1.78
3	陈月笑	2,300,000.00	1.75
4	广发证券股份有限公司	1,859,769.00	1.42
5	黄志华	1,615,700.00	1.23
6	杨铭	1,502,700.00	1.15
7	许明	1,000,000.00	0.76
8	川财证券有限责任公司	1,000,000.00	0.76
9	陈志伟	996,600.00	0.76
10	杜暄妍	945,300.00	0.72

注：以上数据由中国证券登记结算有限责任公司提供，持有人为场内持有人。

## 9.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

无。

## 9.4 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、基金投资和研发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

## 9.5 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理本人及其直系亲属持有本人管理的产品情况

无。

## § 10 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	203,229,922.00
本报告期基金总申购份额	237,000,000.00
减：本报告期基金总赎回份额	309,000,000.00

本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	131,229,922.00

## § 11 重大事件揭示

### 11.1 基金份额持有人大会决议

无。

### 11.2 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

2025 年 9 月 26 日，公司召开大成基金管理有限公司 2025 年第一次临时股东会，审议通过《关于公司董事会换届的议案》，选举吴庆斌先生、杨红女士、林昌先生、宋立志先生担任公司第九届董事会董事；选举杨飞先生、王亚坤先生、谢丹夏先生、江涛女士担任公司第九届董事会独立董事，杨晓帆、胡维翊不再担任公司独立董事；推举谭晓冈先生担任公司第九届董事会专职董事。第九届董事会董事任期为三年，自本次股东会决议生效之日起计算。

#### 二、基金托管人的基金托管部门的重大人事变动

2025 年 2 月，中国农业银行总行决定陈振华任托管业务部副总裁。

2025 年 3 月，中国农业银行总行决定常佳任托管业务部副总裁。

2025 年 4 月，中国农业银行总行决定李亚红任托管业务部高级专家。

2025 年 9 月，中国农业银行总行决定蔡崎峰任托管业务部总裁。

### 11.3 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。

### 11.4 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。

### 11.5 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，本年度应支付的审计费用为 45,000.00 元。

### 11.6 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况

#### 11.6.1 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。

### 11.6.2 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。

### 11.6.3 托管人受调查或处罚等情况

无。

### 11.6.4 托管人相关从业人员受调查或处罚等情况

无。

## 11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

### 11.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例 (%)	佣金	占当期佣金总量的比例 (%)	
光大证券	2	54,263,667.89	100.00	5,426.72	100.00	-
爱建证券	1	-	-	-	-	-
财通证券	1	-	-	-	-	-
第一创业	1	-	-	-	-	-
东北证券	1	-	-	-	-	退租 1个
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 证券	1	-	-	-	-	-
广发证券	2	-	-	-	-	-
国金证券	2	-	-	-	-	-
国盛证券	1	-	-	-	-	-
国泰海通	3	-	-	-	-	退租 1个
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	1	-	-	-	-	-
西部证券	1	-	-	-	-	-
信达证券	1	-	-	-	-	-
兴业证券	2	-	-	-	-	-
野村东方 国际证券	1	-	-	-	-	新增 1 个
粤开证券	1	-	-	-	-	-
招商证券	2	-	-	-	-	-
浙商证券	1	-	-	-	-	-
中国银河 证券	3	-	-	-	-	-
中金公司	2	-	-	-	-	-
中泰证券	2	-	-	-	-	-
中信建投 证券	2	-	-	-	-	-
中信证券	4	-	-	-	-	-
中银国际 证券	1	-	-	-	-	-

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。

### 11.7.2 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(%)
光大证券	184,952.11	100.00	-	-	-	-

### 11.8 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提请投资者持续完善身份信息信息的公告	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12月31日
2	关于大成深证成份交易型开放式指数证券投资基金场内简称变更的公告	中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站	2025年12月31日
3	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	2025年12月24日
4	大成深证成份交易型开放式指数证券投资基金更新招募说明书	中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站	2025年12月24日
5	大成深证成份交易型开放式指数证券投资基金变更基金经理公告	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12月20日
6	大成基金管理有限公司关于调整旗下部分基金风险等级的公告	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12月19日
7	大成深证成份交易型开放式指数证券投资基金更新招募说明书	中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站	2025年12月19日
8	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	2025年12月19日
9	大成深证成份交易型开放式指数证券投资基金增聘基金经理公告	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12月18日
10	关于大成深证成份交易型开放式指数证券投资基金新增流动性服务商的公告	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12月9日
11	大成基金管理有限公司旗下200只公募基金2025年第3季度报告提示性公告	规定报刊	2025年10月28日
12	大成深证成份交易型开放式指数证券投资基金2025年第3季度报告	中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本	2025年10月28日

		公司网站	
13	大成基金管理有限公司旗下 193 只公募基金 2025 年中期报告提示性公告	规定报刊	2025 年 8 月 29 日
14	大成深证成份交易型开放式指数证券投资基金 2025 年中期报告	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 8 月 29 日
15	大成基金管理有限公司旗下部分 ETF 基金新增东方财富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	2025 年 8 月 27 日
16	大成基金管理有限公司旗下部分 ETF 基金新增财通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	2025 年 8 月 21 日
17	大成基金管理有限公司旗下 194 只公募基金 2025 年第 2 季度报告提示性公告	规定报刊	2025 年 7 月 22 日
18	大成深证成份交易型开放式指数证券投资基金 2025 年第 2 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 7 月 21 日
19	大成基金管理有限公司旗下部分 ETF 基金新增方正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	2025 年 7 月 9 日
20	大成深证成份交易型开放式指数证券投资基金更新招募说明书	中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站	2025 年 7 月 5 日
21	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
22	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	2025 年 6 月 30 日
23	大成基金管理有限公司旗下部分 ETF 基金新增东莞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	2025 年 6 月 9 日
24	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
25	大成基金管理有限公司旗下部分 ETF 基金新增山西证券股份有限公司、湘财证券股份有限公司、爱建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	2025 年 5 月 9 日
26	大成基金管理有限公司旗下部分 ETF 基金新增东吴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	2025 年 5 月 9 日

27	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
28	大成基金管理有限公司旗下 188 只公募基金 2025 年第 1 季度报告提示性公告	规定报刊	2025 年 4 月 22 日
29	大成深证成份交易型开放式指数证券投资基金 2025 年第 1 季度报告	中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站	2025 年 4 月 22 日
30	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
31	大成基金管理有限公司旗下 184 只公募基金 2024 年年度报告提示性公告	规定报刊	2025 年 3 月 31 日
32	大成深证成份交易型开放式指数证券投资基金 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
33	大成基金管理有限公司旗下部分 ETF 基金新增东北证券股份有限公司、恒泰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	2025 年 3 月 26 日
34	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	2025 年 3 月 21 日
35	大成深证成份交易型开放式指数证券投资基金更新招募说明书	中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站	2025 年 3 月 21 日
36	大成深证成份交易型开放式指数证券投资基金基金合同	中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站	2025 年 3 月 20 日
37	大成深证成份交易型开放式指数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
38	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
39	大成深证成份交易型开放式指数证券投资基金更新招募说明书	中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站	2025 年 3 月 7 日
40	大成深证成份交易型开放式指数证券投资基金基金合同	中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站	2025 年 3 月 5 日
41	大成深证成份交易型开放式指数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	2025 年 3 月 5 日

		公司网站	
42	大成基金管理有限公司关于旗下部分完全按照指数构成比例投资的基金修订基金合同关联交易限制条款的公告	中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站	2025 年 3 月 5 日
43	大成深证成份交易型开放式指数证券投资基金 2024 年第 4 季度报告	中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站	2025 年 1 月 22 日
44	大成基金管理有限公司旗下 184 只公募基金 2024 年 4 季度报告提示性公告	规定报刊	2025 年 1 月 22 日

## § 12 影响投资者决策的其他重要信息

### 12.1 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。

### 12.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

## § 13 备查文件目录

### 13.1 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。

### 13.2 存放地点

备查文件存放在本基金管理人和托管人的住所。

### 13.3 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 3 月 31 日