

大成绝对收益策略混合型发起式证券投资
基金
2024 年中期报告

2024 年 6 月 30 日

基金管理人：大成基金管理有限公司

基金托管人：中国农业银行股份有限公司

送出日期：2024 年 8 月 30 日

§ 1 重要提示及目录

1.1 重要提示

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

基金托管人中国农业银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2024 年 08 月 29 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告财务资料未经审计。

本报告期自 2024 年 01 月 01 日起至 06 月 30 日止。

1.2 目录

| | |
|-----------------------------------------------|-----------|
| § 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合规守信情况的说明 | 11 |
| 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明 | 11 |
| 4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明 | 12 |
| 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望 | 12 |
| 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明 | 13 |
| 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明 | 13 |
| 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合规守信情况声明 | 13 |
| 5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明 | 14 |
| 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 | 14 |
| § 6 半年度财务会计报告（未经审计） | 14 |
| 6.1 资产负债表 | 14 |
| 6.2 利润表 | 15 |
| 6.3 净资产变动表 | 17 |
| 6.4 报表附注 | 18 |
| § 7 投资组合报告 | 39 |
| 7.1 期末基金资产组合情况 | 39 |
| 7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合 | 40 |
| 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 | 41 |
| 7.4 报告期内股票投资组合的重大变动 | 44 |
| 7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合 | 45 |
| 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 | 45 |
| 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 | 46 |
| 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 | 46 |

| | |
|------------------------------------------|-----------|
| 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 | 46 |
| 7.10 本基金投资股指期货的投资政策 | 46 |
| 7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 | 46 |
| 7.12 市场中性策略执行情况 | 46 |
| 7.13 投资组合报告附注 | 46 |
| § 8 基金份额持有人信息 | 47 |
| 8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 | 47 |
| 8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 | 48 |
| 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 | 48 |
| 8.4 发起式基金发起资金持有份额情况 | 48 |
| § 9 开放式基金份额变动 | 49 |
| § 10 重大事件揭示 | 49 |
| 10.1 基金份额持有人大会决议 | 49 |
| 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 | 49 |
| 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 | 49 |
| 10.4 基金投资策略的改变 | 49 |
| 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 | 49 |
| 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 | 50 |
| 10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 | 50 |
| 10.8 其他重大事件 | 52 |
| § 11 影响投资者决策的其他重要信息 | 53 |
| 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 | 53 |
| 11.2 影响投资者决策的其他重要信息 | 53 |
| § 12 备查文件目录 | 53 |
| 12.1 备查文件目录 | 53 |
| 12.2 存放地点 | 54 |
| 12.3 查阅方式 | 54 |

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

| | | |
|-----------------|----------------------|-----------------|
| 基金名称 | 大成绝对收益策略混合型发起式证券投资基金 | |
| 基金简称 | 大成绝对收益策略混合型发起式 | |
| 基金主代码 | 001791 | |
| 基金运作方式 | 契约型开放式 | |
| 基金合同生效日 | 2015 年 9 月 23 日 | |
| 基金管理人 | 大成基金管理有限公司 | |
| 基金托管人 | 中国农业银行股份有限公司 | |
| 报告期末基金份额总额 | 37,041,957.66 份 | |
| 基金合同存续期 | 不定期 | |
| 下属分级基金的基金简称 | 大成绝对收益混合发起 A | 大成绝对收益混合发起 C |
| 下属分级基金的交易代码 | 001791 | 001792 |
| 报告期末下属分级基金的份额总额 | 15,006,996.07 份 | 22,034,961.59 份 |

2.2 基金产品说明

| | |
|--------|-------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
| 投资目标 | 灵活配置股票和债券等各类资产的比例，优选量化投资策略进行投资，在有效控制风险的基础上，运用股指期货等工具对冲市场风险，寻求基金资产的长期稳健增值。 |
| 投资策略 | <p>本基金采用多种绝对收益策略，剥离系统性风险，力争实现稳定的绝对回报。</p> <p>1、Alpha 对冲策略 本基金通过持续、科学、系统、深入的研究构建多头股票组合，并匹配合适的空头工具，剥离系统性风险。</p> <p>2、其他绝对收益策略 本基金主要采用事件驱动、股指期货套利的对冲策略来捕捉绝对收益机会。同时，本基金根据市场情况的变化，灵活运用其他绝对收益策略（如统计套利策略、定向增发套利策略、大宗交易套利、并购套利策略等）策略提高资本的利用率，从而提高绝对收益，达到投资策略的多元化以进一步降低本基金收益的波动。</p> |
| 业绩比较基准 | 中国人民银行公布的一年期定期存款基准利率（税后） |
| 风险收益特征 | 本基金具有低波动率、低下方风险的特点，并且运用股指期货对冲投资组合的系统性风险，其预期收益及风险水平低于股票型基金，但高于债券型基金，属于中低风险水平的基金。 |

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 | 中国农业银行股份有限公司 |
| 信息披露 姓名 | 段皓静 | 任航 |

| | | | |
|--------|------|-------------------------------------------------|---------------------------------|
| 负责人 | 联系电话 | 0755-83183388 | 010-66060069 |
| | 电子邮箱 | office@dcfund.com.cn | tgxxpl@abchina.com |
| 客户服务电话 | | 4008885558 | 95599 |
| 传真 | | 0755-83199588 | 010-68121816 |
| 注册地址 | | 广东省深圳市南山区海德三道 1236 号大成基金总部大厦 5 层、 27-33 层 | 北京市东城区建国门内大街 69 号 |
| 办公地址 | | 广东省深圳市南山区海德三道 1236 号大成基金总部大厦 5 层、 27-33 层 | 北京市西城区复兴门内大街 28 号凯晨世贸中心东座 F9 |
| 邮政编码 | | 518054 | 100031 |
| 法定代表人 | | 吴庆斌 | 谷澍 |

2.4 信息披露方式

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

2.5 其他相关资料

| 项目 | 名称 | 办公地址 |
|--------|------------|------------------------------------------------|
| 注册登记机构 | 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(2024 年 1 月 1 日-2024 年 6 月 30 日) | |
|-------------------|-------------------------------------|--------------|
| | 大成绝对收益混合发起 A | 大成绝对收益混合发起 C |
| 本期已实现收益 | -62,281.31 | -439,639.45 |
| 本期利润 | 68,028.75 | 111,942.81 |
| 加权平均基金份 额本期利润 | 0.0045 | 0.0039 |
| 本期加权平均净 值利润率 | 0.56% | 0.52% |
| 本期基金份额净 值增长率 | 0.79% | 0.36% |
| 3.1.2 期末数 | 报告期末(2024 年 6 月 30 日) | |

| 据和指标 | | |
|--------------|------------------|---------------|
| 期末可供分配利润 | -2,740,138.96 | -5,251,480.65 |
| 期末可供分配基金份额利润 | -0.1826 | -0.2383 |
| 期末基金资产净值 | 12,266,857.11 | 16,783,480.94 |
| 期末基金份额净值 | 0.8174 | 0.7617 |
| 3.1.3 累计期末指标 | 报告期末(2024年6月30日) | |
| 基金份额累计净值增长率 | -18.26% | -23.83% |

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

大成绝对收益混合发起 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 | 0.89% | 0.25% | 0.12% | 0.00% | 0.77% | 0.25% |
| 过去三个月 | 0.54% | 0.30% | 0.37% | 0.00% | 0.17% | 0.30% |
| 过去六个月 | 0.79% | 0.38% | 0.75% | 0.01% | 0.04% | 0.37% |
| 过去一年 | -1.52% | 0.29% | 1.50% | 0.00% | -3.02% | 0.29% |
| 过去三年 | -8.87% | 0.29% | 4.50% | 0.00% | -13.37% | 0.29% |
| 自基金合同生效起至今 | -18.26% | 0.27% | 13.18% | 0.00% | -31.44% | 0.27% |

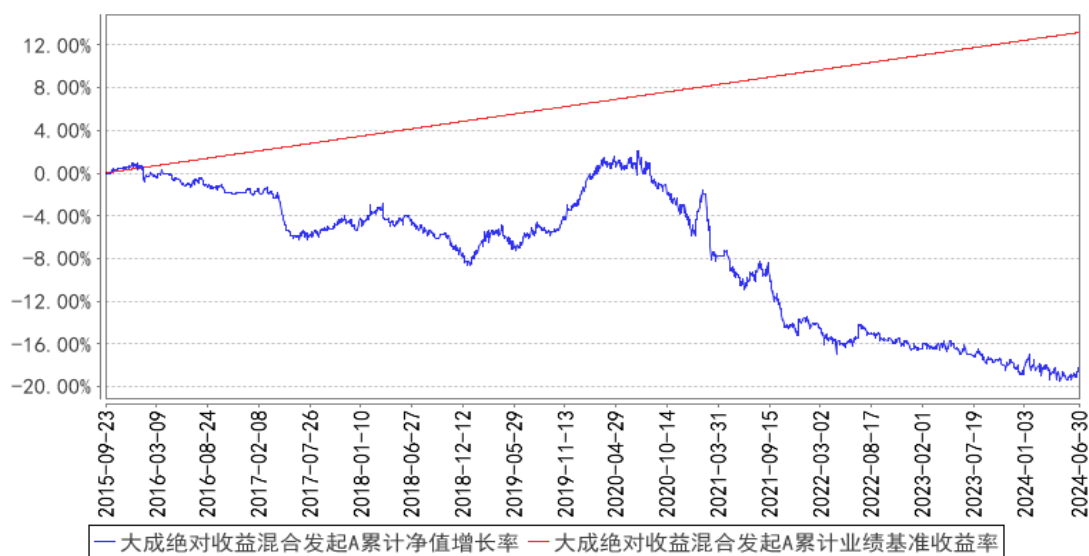
大成绝对收益混合发起 C

| 阶段 | 份额净 | 份额净值 | 业绩比较基 | 业绩比较基准 | ①-③ | ②-④ |
|----|-----|------|-------|--------|-----|-----|
|----|-----|------|-------|--------|-----|-----|

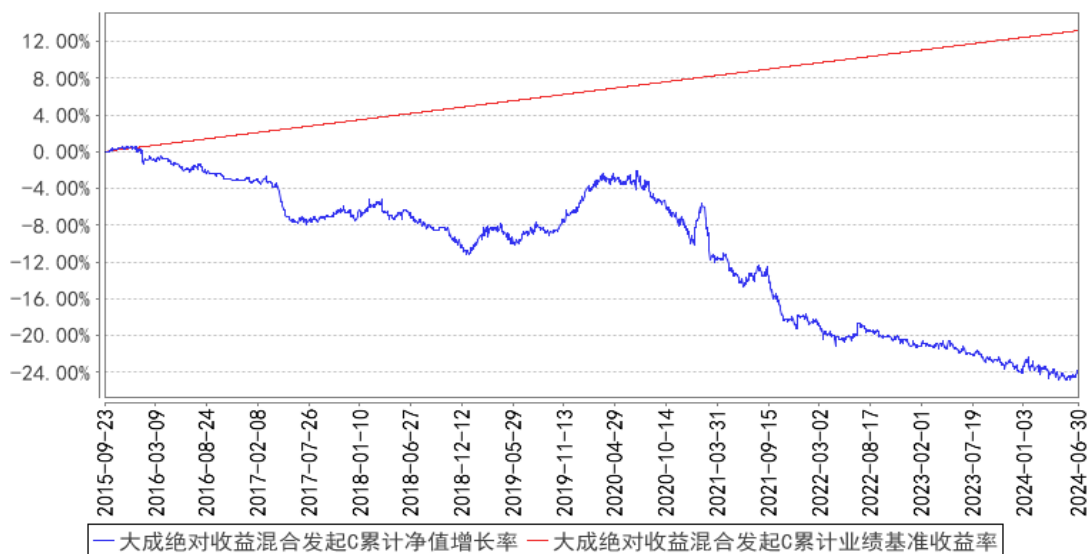
| | 值增长率① | 增长率标准差② | 准收益率③ | 收益率标准差④ | | |
|------------|---------|---------|--------|---------|---------|-------|
| 过去一个月 | 0.83% | 0.25% | 0.12% | 0.00% | 0.71% | 0.25% |
| 过去三个月 | 0.36% | 0.30% | 0.37% | 0.00% | -0.01% | 0.30% |
| 过去六个月 | 0.36% | 0.38% | 0.75% | 0.01% | -0.39% | 0.37% |
| 过去一年 | -2.35% | 0.30% | 1.50% | 0.00% | -3.85% | 0.30% |
| 过去三年 | -11.22% | 0.29% | 4.50% | 0.00% | -15.72% | 0.29% |
| 自基金合同生效起至今 | -23.83% | 0.27% | 13.18% | 0.00% | -37.01% | 0.27% |

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

大成绝对收益混合发起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



大成绝对收益混合发起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，大力拓展国际业务；2013年，设立大成创新资本管理有限公司，开拓专户及专项管理业务。公司业务资质齐全，全面覆盖公募基金、机构投资、海外投资、财富管理、养老金管理等业务，还受全国社会保障基金理事会委托管理部分社保基金和基本养老保险基金。旗下大成国际资产管理有限公司具备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 | 证券从 | 说明 |
|----|----|-----------|-----|----|
|----|----|-----------|-----|----|

| | | (助理) 期限 | | 业年限 | |
|-----|----------------------------|------------------------|-------------------|------|------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
| | | 任职日期 | 离任日期 | | |
| 李绍 | 本基金基金经理， 指数与期货投资部 总监 | 2021 年 10 月 21 日 | - | 24 年 | 东北财经大学经济学硕士。曾先后任职于大连商品交易所、中国金融期货交易所和中国期货市场监控中心，曾负责中国证监会期货市场运行监测监控系统建设，获证券期货科技进步评比一等奖；主持编制发布中国商品期货指数、农产品期货指数等系列指数。2015 年 5 月加入大成基金管理有限公司，现任指数与期货投资部总监。2019 年 10 月 24 日起任大成有色金属期货交易型开放式指数证券投资基金基金经理。2019 年 10 月 30 日起任大成有色金属期货交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理。2021 年 10 月 21 日起任大成绝对收益策略混合型发起式证券投资基金基金经理。2022 年 3 月 18 日至 2023 年 6 月 14 日任大成上海金交易型开放式证券投资基金基金经理。2023 年 3 月 20 日起任大成中证红利指数证券投资基金、大成中证全指医疗保健设备与服务交易型开放式指数证券投资基金、大成中证上海环交所碳中和交易型开放式指数证券投资基金基金经理。2023 年 4 月 14 日起任大成沪深 300 指数证券投资基金基金经理。2024 年 3 月 6 日起任大成中证 A50 交易型开放式指数证券投资基金基金经理。2024 年 4 月 8 日起任大成中证红利低波动 100 交易型开放式指数证券投资基金基金经理。具有基金从业资格。国籍：中国 |
| 王宁宁 | 本基金基金经理助理 | 2022 年 8 月 1 日 | 2024 年 1 月 8 日 | 6 年 | 法国雷恩高等商学院管理学硕士。2017 年 6 月至 2018 年 10 月任平安道远投资管理（上海）有限公司企划财务部企划财务。2018 年 11 月至 2022 年 7 月任平安基金管理有限公司 ETF 指数投资部指数研究员、基金经理助理。2022 年 7 月至 2024 年 1 月任大成基金管理有限公司指数与期货投资部基金经理助理。2022 年 8 月 1 日至 2023 年 6 月 14 日任大成上海金交易型开放式证券投资基金基金经理助理。2022 年 8 月 1 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助理。2022 年 8 月 1 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助理。2022 年 8 月 1 日至 2024 年 1 月 8 日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、大成绝对收益策略混合型发起式证券投资基金、大成中证上海环交所碳中和交易型开放式指数证券投资基金、大成中证全指医疗保健设备与服务交易型开放式指数证券投资基金、深证成长 40 交易型开放式指数证券投资基金、大成中证 100 交易型开放式指数证券投资基金、中证 500 沪市交易型开放式指数证券投资基金、大成中证 500 深市交易型开放式指数证券投资基金、大成深证成份交易型开放式指数证券投资基金、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助理。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《证券投资基金经营机构董事、监事、高级管理人员及从业人员监督管理办法》的相关规定。

4.1.3 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理同时管理的产品情况

无。

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

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

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

报告期内，公司严格执行了公平交易的原则和制度。公司运用统计分析方法和工具，对旗下所有投资组合连续 4 个季度的日内、3 日内、5 日内及 10 日内股票及债券交易同向交易价差进行分析，针对同一基金经理管理的多个投资组合及公私募兼任基金经理管理的多个投资组合的投资交易行为加强了公平交易监测与分析，包括对不同时间窗下（同日、3 日、5 日、10 日）反向交易和同向交易价差监控的分析。分析结果表明：债券交易同向交易频率较低；部分股票同向交

易溢价率较大主要来源于投资策略差异、市场因素（如个股当日价格振幅较高）及组合经理交易时机选择，同时结合交易价差专项统计分析，未发现违反公平交易原则的异常情况。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

报告期内，公司旗下所有投资组合未发现存在异常交易行为。公司旗下投资组合间存在证券同日反向交易，但不存在参与交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量 5% 的情形。投资组合间相邻交易日反向交易的市场成交比例、成交均价等交易结果数据表明该类交易不对市场产生重大影响，无异常。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2024 年上半年，国内股票权益市场整体继续缺乏表现，主要宽基指数中小票风格迥异，上证 50、沪深 300 整体抗跌性强，且略微上涨；中证 500、中证 1000 及国证 2000 等指数则跌幅较大。具体看，上证 50 指数上涨 2.95%，沪深 300 指数上涨 0.89%，中证 500 下跌 8.96%，中证 1000 下跌 16.84%，国证 2000 下跌 19.67%。

本基金在上半年将股票多头进行了较大调整，沪深 300、中证 500 和中证 1000 成份股配置上进行了再平衡，适时增配了大盘蓝筹股票权重，且增加了配置切换的频率，同时选择合适股指期货合约进行对冲配置，确保投资比例符合合同约定。此外，利用量化模型对股指期货对冲头寸中基于合约月间价差、品种价差进行了部分套利交易。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末大成绝对收益混合发起 A 的基金份额净值为 0.8174 元，本报告期基金份额净值增长率为 0.79%，同期业绩比较基准收益率为 0.75%；截至本报告期末大成绝对收益混合发起 C 的基金份额净值为 0.7617 元，本报告期基金份额净值增长率为 0.36%，同期业绩比较基准收益率为 0.75%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

2024 年下半年，我国将迎来二十届三中全会的召开，这一具有重大意义的会议将从高屋建瓴的角度剖析过去一段时间我国政治、经济、外交等诸多领域的政策方针所取得的成绩，并为未来谋篇布局，补足短板，可以肯定继续坚持改革开放、坚持发展将是未来长时间的主线。从证券市场看，今年以来上市公司质量治理工作有望逐渐为股市提供更好的出清环境。在目前证券市场指数点位居于较低分位数的前提下，大盘向上概率将大于继续向下概率，我们认为下半年 A 股市场将有若干重要的投资机会值得把握。本基金将坚持量化选股、风格均衡的投资思路，进一步优化选股策略、对冲策略和套利策略，努力做好基金投资运作。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本基金管理人指导基金估值业务的领导小组为公司估值委员会，公司估值委员会主要负责估值政策和估值程序的制定、修订以及执行情况的监督。估值委员会由公司各投研部门、交易管理部、风险管理部、监察稽核部、基金运营部指定人员组成。公司估值委员会的相关成员均具备相应的专业胜任能力和相关工作经历，估值委员会成员中包括八名投资组合经理。

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

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

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

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

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

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

本基金在本报告期内，曾出现了连续 20 个工作日资产净值低于五千万元的情形。

§ 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

《证券投资基金法》相关法律法规的规定以及基金合同、托管协议的约定，对本基金基金管理人—大成基金管理有限公司 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日基金的投资运作，进行了认真、独立的会计核算和必要的投资监督，认真履行了托管人的义务，没有从事任何损害基金份额持有人利益的行为。

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

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

5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人认为，大成基金管理有限公司的信息披露事务符合《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》及其他相关法律法规的规定，基金管理人所编制和披露的本基金中期报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告等信息真实、准确、完整，未发现有关损害基金持有人利益的行为。

§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：大成绝对收益策略混合型发起式证券投资基金

报告截止日：2024 年 6 月 30 日

单位：人民币元

| 资产 | 附注号 | 本期末 2024 年 6 月 30 日 | 上年度末 2023 年 12 月 31 日 |
|------------|---------|------------------------|--------------------------|
| 资产： | | | |
| 货币资金 | 6.4.7.1 | 3,042,102.68 | 5,326,504.68 |
| 结算备付金 | | 4,875,013.28 | 3,376,079.70 |
| 存出保证金 | | 1,967,937.83 | 2,007,396.36 |
| 交易性金融资产 | 6.4.7.2 | 19,286,277.80 | 17,406,102.14 |
| 其中：股票投资 | | 19,286,277.80 | 17,406,102.14 |
| 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 | | - | - |
| 应收股利 | | - | - |
| 应收申购款 | | 330.00 | 741.00 |
| 递延所得税资产 | | - | - |
| 其他资产 | 6.4.7.8 | - | - |
| 资产总计 | | 29,171,661.59 | 28,116,823.88 |
| 负债和净资产 | 附注号 | 本期末 2024年6月30日 | 上年度末 2023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 | | - | - |
| 应付赎回款 | | 84.62 | 91.42 |
| 应付管理人报酬 | | 28,361.53 | 28,606.25 |
| 应付托管费 | | 4,726.92 | 4,767.73 |
| 应付销售服务费 | | 10,924.76 | 11,431.23 |
| 应付投资顾问费 | | - | - |
| 应交税费 | | - | 32,358.12 |
| 应付利润 | | - | - |
| 递延所得税负债 | | - | - |
| 其他负债 | 6.4.7.9 | 77,225.71 | 136,168.67 |
| 负债合计 | | 121,323.54 | 213,423.42 |
| 净资产： | | | |
| 实收基金 | 6.4.7.10 | 37,041,957.66 | 35,801,550.63 |
| 未分配利润 | 6.4.7.12 | -7,991,619.61 | -7,898,150.17 |
| 净资产合计 | | 29,050,338.05 | 27,903,400.46 |
| 负债和净资产总计 | | 29,171,661.59 | 28,116,823.88 |

注：报告截止日 2024 年 06 月 30 日，基金份额总额 37,041,957.66 份，其中大成绝对收益混合发起 A 基金份额总额为 15,006,996.07 份，基金份额净值 0.8174 元。大成绝对收益混合发起 C 基金份额总额为 22,034,961.59 份，基金份额净值 0.7617 元。

6.2 利润表

会计主体：大成绝对收益策略混合型发起式证券投资基金

本报告期：2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日

单位：人民币元

| 项目 | 附注号 | 本期 2024年1月1日至2024 年6月30日 | 上年度可比期间 2023年1月1日至2023 年6月30日 |
|----------------------------|------------|--------------------------------|-------------------------------------|
| 一、营业总收入 | | 525,614.77 | 212,566.71 |
| 1. 利息收入 | | 63,431.03 | 82,531.64 |
| 其中：存款利息收入 | 6.4.7.13 | 63,431.03 | 82,531.64 |
| 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） | | -273,308.88 | -1,120,929.68 |
| 其中：股票投资收益 | 6.4.7.14 | -234,352.58 | -1,364,683.57 |
| 基金投资收益 | | - | - |
| 债券投资收益 | 6.4.7.15 | - | 311.21 |
| 资产支持证券投资 | 6.4.7.16 | - | - |
| 贵金属投资收益 | 6.4.7.17 | - | - |
| 衍生工具收益 | 6.4.7.18 | -346,837.13 | 28,006.26 |
| 股利收益 | 6.4.7.19 | 307,880.83 | 215,436.42 |
| 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 | 681,892.32 | 1,064,892.17 |
| 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 | 53,600.30 | 186,072.58 |
| 减：二、营业总支出 | | 345,643.21 | 373,749.68 |
| 1. 管理人报酬 | 6.4.10.2.1 | 203,665.58 | 228,633.04 |
| 其中：暂估管理人报酬 | | - | - |
| 2. 托管费 | 6.4.10.2.2 | 33,944.24 | 38,105.47 |
| 3. 销售服务费 | 6.4.10.2.3 | 87,097.25 | 75,844.50 |
| 4. 投资顾问费 | | - | - |
| 5. 利息支出 | | - | - |
| 其中：卖出回购金融资产支出 | | - | - |
| 6. 信用减值损失 | 6.4.7.22 | - | - |
| 7. 税金及附加 | | 1,850.64 | 123.21 |
| 8. 其他费用 | 6.4.7.23 | 19,085.50 | 31,043.46 |
| 三、利润总额（亏损总额以“-”号填列） | | 179,971.56 | -161,182.97 |

| | | | |
|-------------------|--|------------|-------------|
| 减：所得税费用 | | - | - |
| 四、净利润（净亏损以“-”号填列） | | 179,971.56 | -161,182.97 |
| 五、其他综合收益的税后净额 | | - | - |
| 六、综合收益总额 | | 179,971.56 | -161,182.97 |

6.3 净资产变动表

会计主体：大成绝对收益策略混合型发起式证券投资基金

本报告期：2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日 | | | |
|------------------------------------------|--------------------------------------------|--------|---------------|----------------|
| | 实收基金 | 其他综合收益 | 未分配利润 | 净资产合计 |
| 一、上期期末净资产 | 35,801,550.63 | - | -7,898,150.17 | 27,903,400.46 |
| 二、本期期初净资产 | 35,801,550.63 | - | -7,898,150.17 | 27,903,400.46 |
| 三、本期增减变动额（减少以“-”号填列） | 1,240,407.03 | - | -93,469.44 | 1,146,937.59 |
| （一）、综合收益总额 | - | - | 179,971.56 | 179,971.56 |
| （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） | 1,240,407.03 | - | -273,441.00 | 966,966.03 |
| 其中：1. 基金申购款 | 35,676,123.91 | - | -8,627,044.30 | 27,049,079.61 |
| 2. 基金赎回款 | -34,435,716.88 | - | 8,353,603.30 | -26,082,113.58 |
| （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 | 37,041,957.66 | - | -7,991,619.61 | 29,050,338.05 |
| 项目 | 上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日 | | | |
| | 实收基金 | 其他综合收益 | 未分配利润 | 净资产合计 |

| | | | | |
|------------------------------------------|----------------|---|----------------|----------------|
| 一、上期期末净资产 | 74,520,775.29 | - | -15,094,784.12 | 59,425,991.17 |
| 二、本期期初净资产 | 74,520,775.29 | - | -15,094,784.12 | 59,425,991.17 |
| 三、本期增减变动额(减少以“-”号填列) | -10,042,030.72 | - | 1,608,930.61 | -8,433,100.11 |
| (一)、综合收益总额 | - | - | -161,182.97 | -161,182.97 |
| (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) | -10,042,030.72 | - | 1,770,113.58 | -8,271,917.14 |
| 其中：1. 基金申购款 | 38,160,803.81 | - | -8,299,309.55 | 29,861,494.26 |
| 2. 基金赎回款 | -48,202,834.53 | - | 10,069,423.13 | -38,133,411.40 |
| (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 | 64,478,744.57 | - | -13,485,853.51 | 50,992,891.06 |

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署：

谭晓冈

范瑛

梁靖

基金管理人负责人

主管会计工作负责人

会计机构负责人

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

大成绝对收益策略混合型发起式证券投资基金(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]第 938 号《关于准予大成绝对收益策略混合型发起式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《大成绝对收益策略混合型发起式证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式，存续期限不定，首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币 306,733,002.85

元，业经普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)普华永道中天验字(2015)第 1141 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《大成绝对收益策略混合型发起式证券投资基金基金合同》于 2015 年 9 月 23 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 306,779,340.95 份基金份额，其中认购资金利息折合 46,338.10 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。

根据《大成绝对收益策略混合型发起式证券投资基金基金合同》和《大成绝对收益策略混合型发起式证券投资基金基金招募说明书》的规定，大成绝对收益基金根据认购费、申购费和销售服务费收取方式的不同，将基金份额分为不同的类别。在投资者认购、申购时收取前端认购、申购费的，称为 A 类基金份额；不收取认购、申购费，从该类别基金资产中计提销售服务费的基金份额，称为 C 类基金份额。由于基金费用的不同，本基金 A 类基金份额和 C 类基金份额将分别计算基金份额净值和基金份额累计净值。投资者可自行选择认购、申购的基金份额类别。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《大成绝对收益策略混合型发起式证券投资基金基金合同》的规定，本基金投资于依法发行或上市的股票、债券等金融工具及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具，包括：股票(包含中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票)、存托凭证、股指期货、权证，债券(国债、金融债、企业(公司)债、次级债、可转换债券(含分离交易可转债)、中小企业私募债、央行票据、短期融资券、超短期融资券、中期票据等)、资产支持证券、债券回购、银行存款等，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)。本基金的投资组合比例为：本基金权益类空头头寸的价值占本基金权益类多头头寸的价值的比例范围在 80%-120%之间(权益类空头头寸的价值是指融券卖出的股票和存托凭证市值、卖出股指期货的合约价值及卖出其他权益类衍生工具的合约价值的合计值；权益类多头头寸的价值是指买入持有的股票和存托凭证市值、买入股指期货的合约价值及买入其他权益类衍生工具的合约价值的合计)；每个交易日日终，持有的买入期货合约价值和有价证券市值之和，不得超过基金资产净值的 95%；在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，基金保留的现金(不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等)或到期日在一年以内的政府债券的比例合计不低于基金资产净值的 5%。本基金的业绩比较基准为：中国人民银行公布的一年期定期存款基准利率(税后)。

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 2024 年 8 月 29 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、应用指南、解释以及《资产管理产品相关会计处理规定》和其他相关规定(统称“企

业会计准则”）编制，同时，在信息披露和估值方面，也参考了中国证监会颁布的《中国证券监督管理委员会关于证券投资基金估值业务的指导意见》、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》、《证券投资基金信息披露内容与格式准则》第 3 号《半年度报告的内容与格式》、《证券投资基金信息披露编报规则》第 3 号《会计报表附注的编制及披露》、《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号〈年度报告和中期报告〉》以及中国证监会和中国证券投资基金业协会颁布的其他相关规定。

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金于 2024 年 06 月 30 日的财务状况以及自 2024 年 01 月 01 日起至 2024 年 06 月 30 日止期间的经营成果和净资产变动情况等有关信息。

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

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期未发生会计政策变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

6.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128 号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2008]1 号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85 号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2015]101 号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2016]36 号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46 号《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》、财税[2016]70 号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、财税[2016]140 号《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》、财税[2017]2 号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017]56 号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90 号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》及其他相关财税法规和实务

操作，主要税项列示如下：

(1) 资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人。资管产品管理人运营资管产品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。对资管产品在 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，已纳税额从资管产品管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。

对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，对国债、地方政府债以及金融同业往来利息收入亦免征增值税。资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务，以 2018 年 1 月 1 日起产生的利息及利息性质的收入为销售额。资管产品管理人运营资管产品转让 2017 年 12 月 31 日前取得的非货物期货，可以选择按照实际买入价计算销售额，或者以 2017 年最后一个交易日的非货物期货结算价格作为买入价计算销售额。

(2) 对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，股票的股息、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) 对基金取得的企业债券利息收入，应由发行债券的企业在向基金支付利息时代扣代缴 20% 的个人所得税。对基金从上市公司取得的股息红利所得，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，暂免征收个人所得税。对基金持有的上市公司限售股，解禁后取得的股息、红利收入，按照上述规定计算纳税，持股时间自解禁日起计算；解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按 50% 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。

(4) 基金卖出股票按 0.1% 的税率缴纳股票交易印花税，买入股票不征收股票交易印花税。根据财政部、国家税务总局公告 2023 年第 39 号《关于减半征收证券交易印花税的公告》，自 2023 年 8 月 28 日起，证券交易印花税实施减半征收。

(5) 本基金的城市维护建设税、教育费附加和地方教育附加等税费按照实际缴纳增值税额的适用比例计算缴纳。

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 货币资金

单位：人民币元

| 项目 | 本期末 2024 年 6 月 30 日 |
|--------|------------------------|
| 活期存款 | 3,042,102.68 |
| 等于：本金 | 3,041,481.91 |
| 加：应计利息 | 620.77 |

| | |
|----------------|--------------|
| 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 | 3,042,102.68 |

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

| 项目 | 本期末 2024年6月30日 | | | |
|-------------------|-------------------|------|---------------|-------------|
| | 成本 | 应计利息 | 公允价值 | 公允价值变动 |
| 股票 | 19,641,454.48 | - | 19,286,277.80 | -355,176.68 |
| 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 | 19,641,454.48 | - | 19,286,277.80 | -355,176.68 |

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 2024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 | -17,111,800.15 | - | - | - |
| | -17,111,800.15 | - | - | - |

| | | | | |
|-----------|----------------|---|---|---|
| 其中：股指期货投资 | | | | |
| 其他衍生工具 | - | - | - | - |
| 合计 | -17,111,800.15 | - | - | - |

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 |
|------------|--------|----------|---------------|------------|
| IC2409 | IC2409 | -5.00 | -4,875,200.00 | 406,026.67 |
| IF2412 | IF2412 | -6.00 | -6,159,600.00 | 296,674.28 |
| IH2409 | IH2409 | -2.00 | -1,416,840.00 | 2,779.20 |
| IM2409 | IM2409 | -4.00 | -3,824,160.00 | 130,520.00 |
| 合计 | | | | 836,000.15 |
| 减：可抵销期货暂收款 | | | | 836,000.15 |
| 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 2024年6月30日 |
|-------------|-------------------|
| 应付券商交易单元保证金 | - |
| 应付赎回费 | - |
| 应付证券出借违约金 | - |
| 应付交易费用 | 67,281.23 |
| 其中：交易所市场 | 67,281.23 |
| 银行间市场 | - |
| 应付利息 | - |
| 预提费用 | 9,944.48 |
| 合计 | 77,225.71 |

6.4.7.10 实收基金

金额单位：人民币元

大成绝对收益混合发起 A

| 项目 | 本期 2024年1月1日至2024年6月30日 | |
|---------------|----------------------------|---------------|
| | 基金份额（份） | 账面金额 |
| 上年度末 | 13,763,430.39 | 13,763,430.39 |
| 本期申购 | 1,955,964.92 | 1,955,964.92 |
| 本期赎回（以“-”号填列） | -712,399.24 | -712,399.24 |
| 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 | 15,006,996.07 | 15,006,996.07 |
|-----|---------------|---------------|

大成绝对收益混合发起 C

| 项目 | 本期 | |
|----------------|---------------------------------|----------------|
| | 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日 | |
| | 基金份额 (份) | 账面金额 |
| 上年度末 | 22,038,120.24 | 22,038,120.24 |
| 本期申购 | 33,720,158.99 | 33,720,158.99 |
| 本期赎回 (以“-”号填列) | -33,723,317.64 | -33,723,317.64 |
| 基金拆分/份额折算前 | - | - |
| 基金拆分/份额折算调整 | - | - |
| 本期申购 | - | - |
| 本期赎回 (以“-”号填列) | - | - |
| 本期末 | 22,034,961.59 | 22,034,961.59 |

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

大成绝对收益混合发起 A

| 项目 | 已实现部分 | 未实现部分 | 未分配利润合计 |
|----------------|---------------|-------------|---------------|
| 上年度末 | -1,749,294.83 | -846,090.65 | -2,595,385.48 |
| 本期期初 | -1,749,294.83 | -846,090.65 | -2,595,385.48 |
| 本期利润 | -62,281.31 | 130,310.06 | 68,028.75 |
| 本期基金份额交易产生的变动数 | -150,044.67 | -62,737.56 | -212,782.23 |
| 其中：基金申购款 | -248,052.67 | -100,072.04 | -348,124.71 |
| 基金赎回款 | 98,008.00 | 37,334.48 | 135,342.48 |
| 本期已分配利润 | - | - | - |
| 本期末 | -1,961,620.81 | -778,518.15 | -2,740,138.96 |

大成绝对收益混合发起 C

| 项目 | 已实现部分 | 未实现部分 | 未分配利润合计 |
|----------------|---------------|---------------|---------------|
| 上年度末 | -4,031,887.97 | -1,270,876.72 | -5,302,764.69 |
| 本期期初 | -4,031,887.97 | -1,270,876.72 | -5,302,764.69 |
| 本期利润 | -439,639.45 | 551,582.26 | 111,942.81 |
| 本期基金份额交易产生的变动数 | 292,644.97 | -353,303.74 | -60,658.77 |
| 其中：基金申购款 | -6,302,389.61 | -1,976,529.98 | -8,278,919.59 |
| 基金赎回款 | 6,595,034.58 | 1,623,226.24 | 8,218,260.82 |
| 本期已分配利润 | - | - | - |
| 本期末 | -4,178,882.45 | -1,072,598.20 | -5,251,480.65 |

6.4.7.13 存款利息收入

单位：人民币元

| 项目 | 本期 | |
|-----------|----------------------|-----------|
| | 2024年1月1日至2024年6月30日 | |
| 活期存款利息收入 | | 19,464.58 |
| 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 | | 43,829.37 |
| 其他 | | 137.08 |
| 合计 | | 63,431.03 |

6.4.7.14 股票投资收益

6.4.7.14.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

| 项目 | 本期 | |
|------------------|----------------------|-------------|
| | 2024年1月1日至2024年6月30日 | |
| 股票投资收益——买卖股票差价收入 | | -234,352.58 |
| 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 | | -234,352.58 |

6.4.7.14.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

| 项目 | 本期 | |
|------------|----------------------|---------------|
| | 2024年1月1日至2024年6月30日 | |
| 卖出股票成交总额 | | 60,655,789.08 |
| 减：卖出股票成本总额 | | 60,740,177.20 |
| 减：交易费用 | | 149,964.46 |
| 买卖股票差价收入 | | -234,352.58 |

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

无。

6.4.7.15.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

无。

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 |
|----------|----------------------|
| | 2024年1月1日至2024年6月30日 |
| 股指期货投资收益 | -346,837.13 |

6.4.7.19 股利收益

单位：人民币元

| 项目 | 本期 |
|-------------|----------------------|
| | 2024年1月1日至2024年6月30日 |
| 股票投资产生的股利收益 | 307,880.83 |

| | |
|---------------|------------|
| 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 | 307,880.83 |

6.4.7.20 公允价值变动收益

单位：人民币元

| 项目名称 | 本期 2024年1月1日至2024年6月30日 |
|------------------------|----------------------------|
| 1. 交易性金融资产 | -464,638.17 |
| 股票投资 | -464,638.17 |
| 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 | 1,146,530.49 |
| 权证投资 | - |
| 期货投资 | 1,146,530.49 |
| 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 | 681,892.32 |

6.4.7.21 其他收入

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2024年1月1日至2024年6月30日 |
|---------|----------------------------|
| 基金赎回费收入 | 53,599.63 |
| 基金转换费收入 | 0.67 |
| 合计 | 53,600.30 |

6.4.7.22 信用减值损失

无。

6.4.7.23 其他费用

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2024年1月1日至2024年6月30日 |
|---------|----------------------------|
| 审计费用 | 9,944.48 |
| 信息披露费 | - |
| 证券出借违约金 | - |
| 银行划款手续费 | 1,641.02 |
| 账户维护费 | 7,500.00 |
| 合计 | 19,085.50 |

6.4.7.24 分部报告

无。

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 或有事项

无。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

无。

6.4.9 关联方关系

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

本基金本报告期存在控制关系或者其他重大利害关系的关联方未发生变化。

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

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

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

| 关联方名称 | 本期 2024年1月1日至2024年6月30日 | | 上年度可比期间 2023年1月1日至2023年6月30日 | |
|-------|----------------------------|-------------------------|---------------------------------|-------------------------|
| | 成交金额 | 占当期股票 成交总额的比 例（%） | 成交金额 | 占当期股票 成交总额的比 例（%） |
| 光大证券 | - | - | 54,416,052.64 | 20.82 |

6.4.10.1.2 债券交易

无。

6.4.10.1.3 债券回购交易

无。

6.4.10.1.4 权证交易

无。

6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

| 关联方名称 | 本期 2024年1月1日至2024年6月30日 | | | |
|-------|---------------------------------|--------------------|--------------|----------------------|
| | 当期 佣金 | 占当期佣金总量 的比例 (%) | 期末应付佣金余 额 | 占期末应付佣金 总额的比例 (%) |
| - | - | - | - | - |
| 关联方名称 | 上年度可比期间 2023年1月1日至2023年6月30日 | | | |
| | 当期 佣金 | 占当期佣金总量 的比例 (%) | 期末应付佣金余 额 | 占期末应付佣金 总额的比例 (%) |
| 光大证券 | 50,135.88 | 20.82 | 47,365.74 | 32.33 |

注：1. 上述佣金参考市场价格经本基金的基金管理人与对方协商确定。

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

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2024年1月1日至2024年6 月30日 | 上年度可比期间 2023年1月1日至2023年 6月30日 |
|------------------|--------------------------------|-------------------------------------|
| | 当期发生的基金应支付的管理费 | 203,665.58 |
| 其中：应支付销售机构的客户维护费 | 11,978.94 | 15,755.99 |
| 应支付基金管理人的净管理费 | 191,686.64 | 212,877.05 |

注：自 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 7 月 9 日止，支付基金管理人大成基金的管理人报酬按前一日基金资产净值 1.50% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

$$\text{日管理人报酬} = \text{前一日基金资产净值} \times 1.50\% / \text{当年天数}。$$

根据基金管理人大成基金于 2023 年 7 月 8 日发布的《大成基金管理有限公司关于调低旗下部分基金费率并修订基金合同的公告》，自 2023 年 7 月 10 日起，支付基金管理人大成基金的管理人报酬按前一日基金资产净值 1.20% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

$$\text{日管理人报酬} = \text{前一日基金资产净值} \times 1.20\% / \text{当年天数}。$$

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2024年1月1日至2024年6 | 上年度可比期间 2023年1月1日至2023年 |
|----|------------------------|----------------------------|
| | | |

| | 月 30 日 | 6 月 30 日 |
|----------------|-----------|-----------|
| 当期发生的基金应支付的托管费 | 33,944.24 | 38,105.47 |

注：自 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 7 月 9 日止，支付基金托管人中国农业银行的托管费按前一日基金资产净值 0.25% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

$$\text{日托管费} = \text{前一日基金资产净值} \times 0.25\% / \text{当年天数}。$$

根据基金管理人大成基金于 2023 年 7 月 8 日发布的《大成基金管理有限公司关于调低旗下部分基金费率并修订基金合同的公告》，自 2023 年 7 月 10 日起，支付基金托管人的托管费按前一日基金资产净值 0.20% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

$$\text{日托管费} = \text{前一日基金资产净值} \times 0.20\% / \text{当年天数}。$$

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 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 | | |
| | 大成绝对收益混合发 起 A | 大成绝对收益混合发 起 C | 合计 |
| 大成基金 | - | 77,429.23 | 77,429.23 |
| 中国农业银行 | - | 1,606.21 | 1,606.21 |
| 合计 | - | 79,035.44 | 79,035.44 |
| 获得销售服务费的各关联方名称 | 上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日 | | |
| | 当期发生的基金应支付的销售服务费 | | |
| | 大成绝对收益混合发 起 A | 大成绝对收益混合发 起 C | 合计 |
| 大成基金 | - | 63,855.83 | 63,855.83 |
| 中国农业银行 | - | 1,744.71 | 1,744.71 |
| 合计 | - | 65,600.54 | 65,600.54 |

注：支付基金销售机构的销售服务费按前一日 C 类基金份额的基金资产净值 0.80% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付给大成基金，再由大成基金计算并支付给各基金销售机构。其计算公式为：

$$\text{日销售服务费} = \text{前一日 C 类基金份额的基金资产净值} \times 0.80\% / \text{当年天数}。$$

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 2024年1月1日至2024年6月30日 | 本期 2024年1月1日至2024年6月30日 |
|----------------------------|---------------------------------|---------------------------------|
| | 大成绝对收益混合发起 A | 大成绝对收益混合发起 C |
| 基金合同生效日（2015年9月23日）持有的基金份额 | - | - |
| 报告期初持有的基金份额 | 10,001,777.95 | - |
| 报告期间申购/买入总份额 | - | - |
| 报告期间因拆分变动份额 | - | - |
| 减：报告期间赎回/卖出总份额 | - | - |
| 报告期末持有的基金份额 | 10,001,777.95 | - |
| 报告期末持有的基金份额占基金总份额比例 | 27.00% | - |
| 项目 | 上年度可比期间 2023年1月1日至2023年6月30日 | 上年度可比期间 2023年1月1日至2023年6月30日 |
| | 大成绝对收益混合发起 A | 大成绝对收益混合发起 C |
| 基金合同生效日（2015年9月23日）持有的基金份额 | - | - |
| 报告期初持有的基金份额 | 10,001,777.95 | - |
| 报告期间申购/买入总份额 | - | - |
| 报告期间因拆分变动份额 | - | - |
| 减：报告期间赎回/卖出总份额 | - | - |
| 报告期末持有的基金份额 | 10,001,777.95 | - |

| | | |
|-------------------------|--------|---|
| 报告期末持有的基金份额 占基金总份额比例 | 15.51% | - |
|-------------------------|--------|---|

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 2024年1月1日至2024年6月30日 | | 上年度可比期间 2023年1月1日至2023年6月30日 | |
|--------|----------------------------|-----------|---------------------------------|-----------|
| | 期末余额 | 当期利息收入 | 期末余额 | 当期利息收入 |
| 中国农业银行 | 3,042,102.68 | 19,464.58 | 5,820,846.21 | 29,255.07 |

注：本基金由基金托管人保管的银行存款，按银行约定利率计息。

6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

无。

6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

无。

6.4.11 利润分配情况

无。

6.4.12 期末（2024年6月30日）本基金持有的流通受限证券

6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

无。

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

无。

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

无。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

无。

6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

无。

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金是混合型基金，其预期收益及风险水平高于货币市场基金和债券型基金，低于股票型基金，属于中低收益风险特征的基金。本基金通过灵活配置股票和债券等各类资产的比例，优选量化投资策略进行投资，在有效控制风险的基础上，运用股指期货等工具对冲市场风险，寻求基金资产的长期稳健增值。本基金所采用的量化对冲投资策略，通过同时构建多头和空头的方式实现策略。因此本基金除面临一般混合型基金风险，如信用风险、流动性风险及市场风险等之外，还包括本基金所特有的风险。首先，本基金的量化对冲策略是否能实现对冲多头股票系统性风险具有不确定性；其次，本基金的主要投资工具股指期货还可能引发的基差风险、杠杆风险、对手方风险、盯市结算风险等。本基金的基金管理人从事风险管理的主要目标是争取将相对风险控制在限定的范围之内，使本基金在风险和收益之间取得最佳的平衡以实现“风险和收益相匹配”的风险收益目标。

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

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

6.4.13.2 信用风险

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

本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的银行存款存放在本基金的托管人中国农业银行股份有限公司，因而与银行存款相关的信用风险不重大。本基金在交易所进行的交易均以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清

算，违约风险可能性很小；在银行间同业市场进行交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式进行限制以控制相应的信用风险。

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

本期末，本基金无债券投资(上年度末：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，约定在非正常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。于本期末，本基金持有的流动性受限资产的估值占基金资产净值的比例未超过 15%。

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。

6.4.13.4 市场风险

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

6.4.13.4.1 利率风险

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

本基金的基金管理人定期对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控，并通过调整投资组合的久期等方法对上述利率风险进行管理。

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

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

| 本期末 2024年6月30日 | 1年以内 | 1-5年 | 5年以上 | 不计息 | 合计 |
|---------------------|--------------|------|------|---------------|---------------|
| 资产 | | | | | |
| 货币资金 | 3,042,102.68 | - | - | - | 3,042,102.68 |
| 结算备付金 | 4,875,013.28 | - | - | - | 4,875,013.28 |
| 存出保证金 | 14,841.83 | - | - | 1,953,096.00 | 1,967,937.83 |
| 交易性金融资产 | - | - | - | 19,286,277.80 | 19,286,277.80 |
| 应收申购款 | - | - | - | 330.00 | 330.00 |
| 资产总计 | 7,931,957.79 | - | - | 21,239,703.80 | 29,171,661.59 |
| 负债 | | | | | |
| 应付赎回款 | - | - | - | 84.62 | 84.62 |
| 应付管理人报酬 | - | - | - | 28,361.53 | 28,361.53 |
| 应付托管费 | - | - | - | 4,726.92 | 4,726.92 |
| 应付销售服务费 | - | - | - | 10,924.76 | 10,924.76 |
| 其他负债 | - | - | - | 77,225.71 | 77,225.71 |
| 负债总计 | - | - | - | 121,323.54 | 121,323.54 |
| 利率敏感度缺口 | 7,931,957.79 | - | - | 21,118,380.26 | 29,050,338.05 |
| 上年度末 2023年12月31日 | 1年以内 | 1-5年 | 5年以上 | 不计息 | 合计 |
| 资产 | | | | | |
| 货币资金 | 5,326,504.68 | - | - | - | 5,326,504.68 |

| | | | | | |
|---------|--------------|---|---|---------------|---------------|
| 结算备付金 | 3,376,079.70 | - | - | - | 3,376,079.70 |
| 存出保证金 | 23,640.36 | - | - | 1,983,756.00 | 2,007,396.36 |
| 交易性金融资产 | - | - | - | 17,406,102.14 | 17,406,102.14 |
| 应收申购款 | - | - | - | 741.00 | 741.00 |
| 资产总计 | 8,726,224.74 | - | - | 19,390,599.14 | 28,116,823.88 |
| 负债 | | | | | |
| 应付赎回款 | - | - | - | 91.42 | 91.42 |
| 应付管理人报酬 | - | - | - | 28,606.25 | 28,606.25 |
| 应付托管费 | - | - | - | 4,767.73 | 4,767.73 |
| 应付销售服务费 | - | - | - | 11,431.23 | 11,431.23 |
| 应交税费 | - | - | - | 32,358.12 | 32,358.12 |
| 其他负债 | - | - | - | 136,168.67 | 136,168.67 |
| 负债总计 | - | - | - | 213,423.42 | 213,423.42 |
| 利率敏感度缺口 | 8,726,224.74 | - | - | 19,177,175.72 | 27,903,400.46 |

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。

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(上年度末：同)，因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响(上年度末：同)。

6.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无重大外汇风险。

6.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场交易的股票和债券，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。

本基金的基金管理人在构建和管理投资组合的过程中，采用“自上而下”的策略，通过对宏观经济情况及政策的分析，结合证券市场运行情况，做出资产配置及组合构建的决定；通过对单个证券的定性分析及定量分析，选择符合基金合同约定范围的投资品种进行投资。本基金的基金管理人定期结合宏观及微观环境的变化，对投资策略、资产配置、投资组合进行修正，来主动应对可能发生的市场价格风险。

本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险。本基金权益类空头头寸的价值占本基金权益类多头头寸的价值的比例范围在 80%-120%之间。每个交易日日终，持有的买入期货合约价值和

有价证券市值之和，不得超过基金资产净值的 95%。此外，本基金的基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控，定期运用多种定量方法对基金进行风险度量，包括 VaR(Value at Risk) 指标等来测试本基金面临的潜在价格风险，及时可靠地对风险进行跟踪和控制。

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

| 项目 | 本期末 2024 年 6 月 30 日 | | 上年度末 2023 年 12 月 31 日 | |
|---------------|------------------------|-------------------|--------------------------|-------------------|
| | 公允价值 | 占基金资产净值 比例 (%) | 公允价值 | 占基金资产净值 比例 (%) |
| 交易性金融资产—股票投资 | 19,286,277.80 | 66.39 | 17,406,102.14 | 62.38 |
| 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 | 19,286,277.80 | 66.39 | 17,406,102.14 | 62.38 |

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

| 假设 | 除业绩比较基准以外的其他市场变量保持不变 | | |
|----|----------------------|-----------------------------|------------------------|
| 分析 | 相关风险变量的变动 | 对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元） | |
| | | 本期末（2024 年 6 月 30 日） | 上年度末（2023 年 12 月 31 日） |
| | 业绩比较基准上升 5% | 35,620.72 | 103,408.99 |
| | 业绩比较基准下降 5% | -35,620.72 | -103,408.99 |

6.4.14 公允价值

6.4.14.1 金融工具公允价值计量的方法

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

第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

6.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

6.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

单位：人民币元

| 公允价值计量结果所属的层次 | 本期末 2024 年 6 月 30 日 | 上年度末 2023 年 12 月 31 日 |
|---------------|------------------------|--------------------------|
| 第一层次 | 19,286,277.80 | 17,406,102.14 |
| 第二层次 | - | - |
| 第三层次 | - | - |
| 合计 | 19,286,277.80 | 17,406,102.14 |

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股票和债券，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股票和债券的公允价值列入第一层次；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，确定相关股票和债券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资产（上年度末：同）。

6.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括应收款项和其他金融负债，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 | 19,286,277.80 | 66.11 |
| | 其中：股票 | 19,286,277.80 | 66.11 |
| 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 | 7,917,115.96 | 27.14 |
| 8 | 其他各项资产 | 1,968,267.83 | 6.75 |
| 9 | 合计 | 29,171,661.59 | 100.00 |

7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

金额单位：人民币元

| 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 | 1,329,895.00 | 4.58 |
| C | 制造业 | 10,393,849.80 | 35.78 |
| D | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | 1,370,056.00 | 4.72 |
| E | 建筑业 | 711,081.00 | 2.45 |
| F | 批发和零售业 | 348,167.00 | 1.20 |
| G | 交通运输、仓储和邮政业 | 1,156,265.00 | 3.98 |
| H | 住宿和餐饮业 | - | - |
| I | 信息传输、软件和信息技术服务业 | 982,357.00 | 3.38 |
| J | 金融业 | 2,617,606.00 | 9.01 |
| K | 房地产业 | 171,990.00 | 0.59 |
| L | 租赁和商务服务业 | 51,624.00 | 0.18 |
| M | 科学研究和技术服务业 | 153,387.00 | 0.53 |
| 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 | 19,286,277.80 | 66.39 |

7.2.2 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

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 | 601398 | 工商银行 | 47,300 | 269,610.00 | 0.93 |
| 2 | 002180 | 纳思达 | 10,100 | 266,842.00 | 0.92 |
| 3 | 300760 | 迈瑞医疗 | 900 | 261,819.00 | 0.90 |
| 4 | 601088 | 中国神华 | 5,500 | 244,035.00 | 0.84 |
| 5 | 000725 | 京东方 A | 59,400 | 242,946.00 | 0.84 |
| 6 | 601166 | 兴业银行 | 13,200 | 232,584.00 | 0.80 |
| 7 | 600941 | 中国移动 | 2,100 | 225,750.00 | 0.78 |
| 8 | 601728 | 中国电信 | 36,700 | 225,705.00 | 0.78 |
| 9 | 002371 | 北方华创 | 700 | 223,923.00 | 0.77 |
| 10 | 600028 | 中国石化 | 34,800 | 219,936.00 | 0.76 |
| 11 | 601169 | 北京银行 | 37,400 | 218,416.00 | 0.75 |
| 12 | 688012 | 中微公司 | 1,500 | 211,890.00 | 0.73 |
| 13 | 000630 | 铜陵有色 | 58,600 | 211,546.00 | 0.73 |
| 14 | 600809 | 山西汾酒 | 1,000 | 210,880.00 | 0.73 |
| 15 | 600406 | 国电南瑞 | 8,200 | 204,672.00 | 0.70 |
| 16 | 600019 | 宝钢股份 | 30,400 | 202,160.00 | 0.70 |
| 17 | 601000 | 唐山港 | 43,000 | 202,100.00 | 0.70 |
| 18 | 600989 | 宝丰能源 | 11,600 | 201,028.00 | 0.69 |
| 19 | 003816 | 中国广核 | 43,400 | 200,942.00 | 0.69 |
| 20 | 002078 | 太阳纸业 | 14,400 | 200,880.00 | 0.69 |
| 21 | 002128 | 电投能源 | 9,400 | 198,340.00 | 0.68 |
| 22 | 600863 | 内蒙华电 | 42,500 | 197,200.00 | 0.68 |
| 23 | 603606 | 东方电缆 | 4,000 | 195,240.00 | 0.67 |
| 24 | 002444 | 巨星科技 | 7,900 | 195,130.00 | 0.67 |
| 25 | 002252 | 上海莱士 | 24,800 | 193,936.00 | 0.67 |
| 26 | 601231 | 环旭电子 | 12,000 | 192,600.00 | 0.66 |
| 27 | 002429 | 兆驰股份 | 39,700 | 190,957.00 | 0.66 |
| 28 | 600968 | 海油发展 | 46,300 | 190,756.00 | 0.66 |
| 29 | 600820 | 隧道股份 | 29,100 | 190,023.00 | 0.65 |
| 30 | 688120 | 华海清科 | 1,000 | 189,580.00 | 0.65 |
| 31 | 601916 | 浙商银行 | 68,400 | 188,784.00 | 0.65 |
| 32 | 600348 | 华阳股份 | 18,900 | 188,244.00 | 0.65 |
| 33 | 002001 | 新和成 | 9,800 | 188,160.00 | 0.65 |
| 34 | 601717 | 郑煤机 | 12,700 | 187,960.00 | 0.65 |
| 35 | 601117 | 中国化学 | 22,800 | 187,872.00 | 0.65 |
| 36 | 601615 | 明阳智能 | 19,700 | 185,968.00 | 0.64 |
| 37 | 600901 | 江苏金租 | 36,700 | 185,335.00 | 0.64 |

| | | | | | |
|----|--------|------|--------|------------|------|
| 38 | 600377 | 宁沪高速 | 14,700 | 185,220.00 | 0.64 |
| 39 | 600219 | 南山铝业 | 48,600 | 185,166.00 | 0.64 |
| 40 | 000166 | 申万宏源 | 42,800 | 184,468.00 | 0.63 |
| 41 | 600025 | 华能水电 | 17,100 | 184,338.00 | 0.63 |
| 42 | 600018 | 上港集团 | 31,700 | 183,226.00 | 0.63 |
| 43 | 601229 | 上海银行 | 25,000 | 181,500.00 | 0.62 |
| 44 | 000895 | 双汇发展 | 7,600 | 180,652.00 | 0.62 |
| 45 | 002019 | 亿帆医药 | 14,600 | 180,456.00 | 0.62 |
| 46 | 603583 | 捷昌驱动 | 8,800 | 179,344.00 | 0.62 |
| 47 | 600909 | 华安证券 | 42,400 | 178,504.00 | 0.61 |
| 48 | 002487 | 大金重工 | 7,800 | 178,464.00 | 0.61 |
| 49 | 601139 | 深圳燃气 | 26,700 | 178,356.00 | 0.61 |
| 50 | 000408 | 藏格矿业 | 7,400 | 178,118.00 | 0.61 |
| 51 | 000902 | 新洋丰 | 15,000 | 178,050.00 | 0.61 |
| 52 | 003006 | 百亚股份 | 7,500 | 177,750.00 | 0.61 |
| 53 | 600350 | 山东高速 | 20,000 | 177,000.00 | 0.61 |
| 54 | 600039 | 四川路桥 | 22,400 | 176,736.00 | 0.61 |
| 55 | 601216 | 君正集团 | 47,800 | 176,382.00 | 0.61 |
| 56 | 603505 | 金石资源 | 6,300 | 175,959.00 | 0.61 |
| 57 | 002003 | 伟星股份 | 14,000 | 175,700.00 | 0.60 |
| 58 | 002498 | 汉缆股份 | 53,300 | 175,357.00 | 0.60 |
| 59 | 600329 | 达仁堂 | 5,400 | 174,906.00 | 0.60 |
| 60 | 002563 | 森马服饰 | 30,100 | 174,881.00 | 0.60 |
| 61 | 002048 | 宁波华翔 | 13,500 | 174,690.00 | 0.60 |
| 62 | 600674 | 川投能源 | 9,300 | 174,375.00 | 0.60 |
| 63 | 002831 | 裕同科技 | 6,800 | 174,012.00 | 0.60 |
| 64 | 688239 | 航宇科技 | 5,000 | 174,000.00 | 0.60 |
| 65 | 603195 | 公牛集团 | 2,250 | 173,520.00 | 0.60 |
| 66 | 600663 | 陆家嘴 | 19,500 | 171,990.00 | 0.59 |
| 67 | 002697 | 红旗连锁 | 37,100 | 171,773.00 | 0.59 |
| 68 | 600997 | 开滦股份 | 25,000 | 171,500.00 | 0.59 |
| 69 | 601077 | 渝农商行 | 34,000 | 170,680.00 | 0.59 |
| 70 | 688800 | 瑞可达 | 6,000 | 168,480.00 | 0.58 |
| 71 | 002223 | 鱼跃医疗 | 4,400 | 165,440.00 | 0.57 |
| 72 | 600183 | 生益科技 | 7,800 | 164,268.00 | 0.57 |
| 73 | 300973 | 立高食品 | 5,800 | 162,922.00 | 0.56 |
| 74 | 002550 | 千红制药 | 29,300 | 157,927.00 | 0.54 |
| 75 | 600582 | 天地科技 | 22,800 | 157,092.00 | 0.54 |
| 76 | 603883 | 老百姓 | 8,450 | 155,142.00 | 0.53 |
| 77 | 000333 | 美的集团 | 2,400 | 154,800.00 | 0.53 |
| 78 | 688372 | 伟测科技 | 3,900 | 153,387.00 | 0.53 |
| 79 | 601006 | 大秦铁路 | 21,400 | 153,224.00 | 0.53 |
| 80 | 600587 | 新华医疗 | 9,700 | 152,678.00 | 0.53 |

| | | | | | |
|-----|--------|-------|--------|------------|------|
| 81 | 601328 | 交通银行 | 20,400 | 152,388.00 | 0.52 |
| 82 | 601668 | 中国建筑 | 28,200 | 149,742.00 | 0.52 |
| 83 | 002215 | 诺普信 | 19,900 | 148,255.00 | 0.51 |
| 84 | 002332 | 仙琚制药 | 12,200 | 139,202.00 | 0.48 |
| 85 | 600252 | 中恒集团 | 59,600 | 129,332.00 | 0.45 |
| 86 | 000563 | 陕国投 A | 46,500 | 127,875.00 | 0.44 |
| 87 | 600282 | 南钢股份 | 25,500 | 126,990.00 | 0.44 |
| 88 | 600618 | 氯碱化工 | 14,300 | 125,554.00 | 0.43 |
| 89 | 002267 | 陕天然气 | 16,400 | 123,984.00 | 0.43 |
| 90 | 300910 | 瑞丰新材 | 2,800 | 122,416.00 | 0.42 |
| 91 | 002434 | 万里扬 | 24,800 | 121,520.00 | 0.42 |
| 92 | 600000 | 浦发银行 | 14,600 | 120,158.00 | 0.41 |
| 93 | 002152 | 广电运通 | 11,300 | 118,198.00 | 0.41 |
| 94 | 601228 | 广州港 | 38,400 | 117,120.00 | 0.40 |
| 95 | 002195 | 岩山科技 | 43,400 | 108,934.00 | 0.37 |
| 96 | 600795 | 国电电力 | 17,900 | 107,221.00 | 0.37 |
| 97 | 300379 | 东方通 | 13,000 | 105,040.00 | 0.36 |
| 98 | 600015 | 华夏银行 | 15,700 | 100,480.00 | 0.35 |
| 99 | 000598 | 兴蓉环境 | 13,200 | 99,264.00 | 0.34 |
| 100 | 600999 | 招商证券 | 6,400 | 89,024.00 | 0.31 |
| 101 | 002396 | 星网锐捷 | 6,200 | 81,902.00 | 0.28 |
| 102 | 600900 | 长江电力 | 2,600 | 75,192.00 | 0.26 |
| 103 | 603566 | 普莱柯 | 5,500 | 74,690.00 | 0.26 |
| 104 | 300170 | 汉得信息 | 11,900 | 73,066.00 | 0.25 |
| 105 | 600919 | 江苏银行 | 9,600 | 71,328.00 | 0.25 |
| 106 | 000582 | 北部湾港 | 9,400 | 69,936.00 | 0.24 |
| 107 | 600993 | 马应龙 | 2,600 | 69,342.00 | 0.24 |
| 108 | 002100 | 天康生物 | 8,700 | 60,291.00 | 0.21 |
| 109 | 002488 | 金固股份 | 13,700 | 60,143.00 | 0.21 |
| 110 | 601899 | 紫金矿业 | 3,300 | 57,981.00 | 0.20 |
| 111 | 002648 | 卫星化学 | 3,200 | 57,536.00 | 0.20 |
| 112 | 600755 | 厦门国贸 | 7,200 | 51,624.00 | 0.18 |
| 113 | 000651 | 格力电器 | 1,300 | 50,986.00 | 0.18 |
| 114 | 300122 | 智飞生物 | 1,800 | 50,454.00 | 0.17 |
| 115 | 000513 | 丽珠集团 | 1,300 | 48,373.00 | 0.17 |
| 116 | 002545 | 东方铁塔 | 7,100 | 48,351.00 | 0.17 |
| 117 | 000728 | 国元证券 | 7,900 | 47,874.00 | 0.16 |
| 118 | 601318 | 中国平安 | 1,100 | 45,496.00 | 0.16 |
| 119 | 000811 | 冰轮环境 | 4,500 | 43,425.00 | 0.15 |
| 120 | 688567 | 孚能科技 | 3,828 | 36,748.80 | 0.13 |
| 121 | 300303 | 聚飞光电 | 7,300 | 35,478.00 | 0.12 |
| 122 | 002410 | 广联达 | 3,400 | 32,572.00 | 0.11 |
| 123 | 002064 | 华峰化学 | 4,400 | 31,548.00 | 0.11 |

| | | | | | |
|-----|--------|------|-------|-----------|------|
| 124 | 600908 | 无锡银行 | 5,900 | 31,388.00 | 0.11 |
| 125 | 600887 | 伊利股份 | 1,200 | 31,008.00 | 0.11 |
| 126 | 600886 | 国投电力 | 1,600 | 29,184.00 | 0.10 |
| 127 | 002978 | 安宁股份 | 1,000 | 27,860.00 | 0.10 |
| 128 | 001872 | 招商港口 | 1,400 | 26,950.00 | 0.09 |
| 129 | 600985 | 淮北矿业 | 1,600 | 26,784.00 | 0.09 |
| 130 | 600372 | 中航机载 | 2,200 | 26,334.00 | 0.09 |
| 131 | 002585 | 双星新材 | 5,200 | 25,792.00 | 0.09 |
| 132 | 600529 | 山东药玻 | 1,000 | 25,340.00 | 0.09 |
| 133 | 600125 | 铁龙物流 | 4,200 | 25,074.00 | 0.09 |
| 134 | 688630 | 芯碁微装 | 400 | 25,028.00 | 0.09 |
| 135 | 600690 | 海尔智家 | 800 | 22,704.00 | 0.08 |
| 136 | 601988 | 中国银行 | 4,700 | 21,714.00 | 0.07 |
| 137 | 301078 | 孩子王 | 4,200 | 21,252.00 | 0.07 |
| 138 | 600033 | 福建高速 | 4,900 | 16,415.00 | 0.06 |
| 139 | 600595 | 中孚实业 | 6,100 | 15,189.00 | 0.05 |
| 140 | 600151 | 航天机电 | 3,300 | 14,916.00 | 0.05 |
| 141 | 300054 | 鼎龙股份 | 300 | 6,804.00 | 0.02 |
| 142 | 601669 | 中国电建 | 1,200 | 6,708.00 | 0.02 |
| 143 | 688173 | 希荻微 | 600 | 6,618.00 | 0.02 |

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 | 688031 | 星环科技 | 628,599.68 | 2.25 |
| 2 | 000333 | 美的集团 | 602,744.00 | 2.16 |
| 3 | 600941 | 中国移动 | 600,677.00 | 2.15 |
| 4 | 688435 | 英方软件 | 513,482.40 | 1.84 |
| 5 | 601166 | 兴业银行 | 511,475.00 | 1.83 |
| 6 | 300760 | 迈瑞医疗 | 496,339.00 | 1.78 |
| 7 | 688023 | 安恒信息 | 489,619.41 | 1.75 |
| 8 | 600997 | 开滦股份 | 476,943.00 | 1.71 |
| 9 | 688598 | 金博股份 | 472,805.91 | 1.69 |
| 10 | 688045 | 必易微 | 471,866.05 | 1.69 |
| 11 | 688239 | 航宇科技 | 460,192.42 | 1.65 |
| 12 | 688261 | 东微半导 | 459,659.94 | 1.65 |
| 13 | 601000 | 唐山港 | 451,747.00 | 1.62 |
| 14 | 000630 | 铜陵有色 | 442,772.00 | 1.59 |
| 15 | 000725 | 京东方 A | 440,419.00 | 1.58 |
| 16 | 600028 | 中国石化 | 431,305.00 | 1.55 |
| 17 | 688133 | 泰坦科技 | 430,392.81 | 1.54 |
| 18 | 300973 | 立高食品 | 422,076.00 | 1.51 |

| | | | | |
|----|--------|------|------------|------|
| 19 | 000895 | 双汇发展 | 418,012.00 | 1.50 |
| 20 | 601728 | 中国电信 | 415,529.00 | 1.49 |

注：本期累计买入金额指买入成交金额（成交单价乘以成交数量），不考虑相关交易费用。

7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

| 序号 | 股票代码 | 股票名称 | 本期累计卖出金额 | 占期初基金资产净值比例(%) |
|----|--------|--------|--------------|----------------|
| 1 | 600519 | 贵州茅台 | 1,312,071.00 | 4.70 |
| 2 | 688031 | 星环科技 | 652,324.17 | 2.34 |
| 3 | 688617 | 惠泰医疗 | 586,413.19 | 2.10 |
| 4 | 688598 | 金博股份 | 536,995.45 | 1.92 |
| 5 | 000333 | 美的集团 | 497,666.00 | 1.78 |
| 6 | 688261 | 东微半导 | 474,178.59 | 1.70 |
| 7 | 002129 | TCL 中环 | 468,512.75 | 1.68 |
| 8 | 688045 | 必易微 | 446,980.80 | 1.60 |
| 9 | 688435 | 英方软件 | 444,357.45 | 1.59 |
| 10 | 600919 | 江苏银行 | 431,665.00 | 1.55 |
| 11 | 000975 | 山金国际 | 431,558.00 | 1.55 |
| 12 | 688690 | 纳微科技 | 427,267.25 | 1.53 |
| 13 | 601233 | 桐昆股份 | 427,055.00 | 1.53 |
| 14 | 000039 | 中集集团 | 423,500.00 | 1.52 |
| 15 | 603267 | 鸿远电子 | 423,457.00 | 1.52 |
| 16 | 601328 | 交通银行 | 422,606.00 | 1.51 |
| 17 | 688385 | 复旦微电 | 421,017.62 | 1.51 |
| 18 | 603486 | 科沃斯 | 416,033.00 | 1.49 |
| 19 | 600566 | 济川药业 | 412,040.00 | 1.48 |
| 20 | 600997 | 开滦股份 | 411,602.00 | 1.48 |

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 | 63,084,991.03 |
| 卖出股票收入（成交）总额 | 60,655,789.08 |

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

现阶段本基金将利用股指期货剥离多头股票部分的系统性风险。基金经理根据市场的变化、现货市场与期货市场的相关性等因素，计算需要用到的期货合约数量，对这个数量进行动态跟踪与测算，并进行适时灵活调整。同时，综合考虑各个月份期货合约之间的定价关系、套利机会、流动性以及保证金要求等因素，在各个月份期货合约之间进行动态配置，通过空头部分的优化创造额外收益。随着监管的放开及其他工具流动性增强，我们会优选空头工具，采用最优的多头系统性风险剥离方式。

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 市场中性策略执行情况

截至本报告期末，本基金持有股票资产 19,286,277.80 元，占基金资产净值的比例为 66.39%；运用股指期货进行对冲的空头合约市值 16,275,800.00 元，占基金资产净值的比例为 56.03%，空头合约市值占股票资产的比例为 84.39%。本报告期内，本基金执行市场中性策略的投资收益为 -581,189.71 元，公允价值变动损益为 681,892.32 元。

7.13 投资组合报告附注

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

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

7.13.2 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。

7.13.3 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 | 1,967,937.83 |
| 2 | 应收清算款 | - |
| 3 | 应收股利 | - |
| 4 | 应收利息 | - |
| 5 | 应收申购款 | 330.00 |
| 6 | 其他应收款 | - |
| 7 | 待摊费用 | - |
| 8 | 其他 | - |
| 9 | 合计 | 1,968,267.83 |

7.13.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

无。

7.13.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

无。

7.13.6 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 (%) |
| 大成绝对 收益混合 发起 A | 423 | 35,477.53 | 10,100,649.95 | 67.31 | 4,906,346.12 | 32.69 |
| 大成绝对 收益混合 发起 C | 573 | 38,455.43 | 18,773,466.83 | 85.20 | 3,261,494.76 | 14.80 |
| 合计 | 996 | 37,190.72 | 28,874,116.78 | 77.95 | 8,167,840.88 | 22.05 |

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 | 大成绝对收益混合发起 A | 9,694.42 | 0.0646 |
| | 大成绝对收益混合发起 C | 192,457.40 | 0.8734 |
| | 合计 | 202,151.82 | 0.5457 |

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、基金投资和部门负责人持有本开放式基金 | 大成绝对收益混合发起 A | 0 |
| | 大成绝对收益混合发起 C | 10~50 |
| | 合计 | 10~50 |
| 本基金基金经理持有本开放式基金 | 大成绝对收益混合发起 A | 0 |
| | 大成绝对收益混合发起 C | 10~50 |
| | 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 | 10,001,777.95 | 27.00 | 10,001,777.95 | 27.00 | 3年 |
| 基金管理人高级管理人员 | - | - | - | - | - |
| 基金经理等人员 | 202,151.82 | 0.55 | - | - | - |
| 基金管理人股东 | - | - | - | - | - |
| 其他 | - | - | - | - | - |
| 合计 | 10,203,929.77 | 27.55 | 10,001,777.95 | 27.00 | 3年 |

注：本报告期间基金管理人固有资金持有份额无变化，比例的分母采用各分级基金份额的合计数。

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

| 项目 | 大成绝对收益混合发起 A | 大成绝对收益混合发起 C |
|----------------------------------------|----------------|----------------|
| 基金合同生效日 (2015 年 9 月 23 日) 基金份额总额 | 117,403,940.78 | 189,375,400.17 |
| 本报告期期初基金份额总额 | 13,763,430.39 | 22,038,120.24 |
| 本报告期基金总申购份额 | 1,955,964.92 | 33,720,158.99 |
| 减：本报告期基金总赎回份额 | 712,399.24 | 33,723,317.64 |
| 本报告期基金拆分变动份额 | - | - |
| 本报告期期末基金份额总额 | 15,006,996.07 | 22,034,961.59 |

§ 10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

无。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

一、基金管理人的重大人事变动

无。

二、基金托管人的基金托管部门的重大人事变动

无。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内无涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

10.4 基金投资策略的改变

本基金投资策略在本报告期内没有重大改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金聘任的为本基金审计的会计师事务所为普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)。该事务所自基金合同生效日起为本基金提供审计服务至今。

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

10.6.1 管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，基金管理人及其相关高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

10.6.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

无。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

| 券商名称 | 交易单元数量 | 股票交易 | | 应支付该券商的佣金 | | 备注 |
|------------|--------|---------------|------------------|-----------|----------------|----------|
| | | 成交金额 | 占当期股票成交总额的比例 (%) | 佣金 | 占当期佣金总量的比例 (%) | |
| 国泰君安 | 3 | 38,827,609.83 | 31.38 | 36,339.05 | 32.53 | - |
| 财通证券 | 1 | 20,551,438.78 | 16.61 | 15,123.90 | 13.54 | - |
| 中信建投证券 | 2 | 16,295,434.80 | 13.17 | 15,253.18 | 13.66 | - |
| 华创证券 | 1 | 13,715,346.00 | 11.08 | 12,837.36 | 11.49 | - |
| 华泰证券 | 1 | 10,079,836.20 | 8.15 | 9,434.02 | 8.45 | - |
| 信达证券 | 2 | 9,761,704.23 | 7.89 | 9,135.81 | 8.18 | - |
| 天风证券 | 2 | 6,903,414.42 | 5.58 | 6,460.37 | 5.78 | - |
| 山西证券 | 1 | 5,517,356.85 | 4.46 | 5,163.90 | 4.62 | - |
| 国金证券 | 2 | 2,088,639.00 | 1.69 | 1,954.78 | 1.75 | - |
| 爱建证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 川财证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 第一创业 | 1 | - | - | - | - | - |
| 东北证券 | 2 | - | - | - | - | - |
| 东财证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 东方证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 东吴证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 东兴证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 东亚前海 | 1 | - | - | - | - | - |
| 方正证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 高盛中国 证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 光大证券 | 2 | - | - | - | - | - |
| 广发证券 | 2 | - | - | - | - | 本期 报告 |

| | | | | | | | |
|------------|---|---|---|---|---|---|-----------------------|
| | | | | | | | 新增 1 个 |
| 国盛证券 | 1 | - | - | - | - | - | - |
| 国投证券 | 1 | - | - | - | - | - | - |
| 国信证券 | 1 | - | - | - | - | - | - |
| 海通证券 | 1 | - | - | - | - | - | - |
| 红塔证券 | 1 | - | - | - | - | - | - |
| 华西证券 | 1 | - | - | - | - | - | - |
| 民生证券 | 1 | - | - | - | - | - | - |
| 南京证券 | 1 | - | - | - | - | - | - |
| 平安证券 | 1 | - | - | - | - | - | - |
| 瑞银证券 | 2 | - | - | - | - | - | - |
| 上海证券 | 1 | - | - | - | - | - | - |
| 申万宏源 | 1 | - | - | - | - | - | - |
| 世纪证券 | 0 | - | - | - | - | - | 本期 报告 退租 1 个 |
| 万和证券 | 1 | - | - | - | - | - | - |
| 西部证券 | 1 | - | - | - | - | - | - |
| 湘财证券 | 0 | - | - | - | - | - | 本期 报告 退租 1 个 |
| 兴业证券 | 2 | - | - | - | - | - | - |
| 粤开证券 | 1 | - | - | - | - | - | - |
| 招商证券 | 2 | - | - | - | - | - | - |
| 浙商证券 | 1 | - | - | - | - | - | - |
| 中国银河 证券 | 4 | - | - | - | - | - | - |
| 中金公司 | 2 | - | - | - | - | - | - |
| 中泰证券 | 2 | - | - | - | - | - | - |
| 中信证券 | 4 | - | - | - | - | - | - |
| 中银国际 证券 | 1 | - | - | - | - | - | - |
| 中原证券 | 1 | - | - | - | - | - | - |

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

- （一）财务状况良好，最近一年无重大违规行为；
- （二）经营行为规范，内控制度健全，能满足各投资组合运作的保密性要求；
- （三）研究实力较强，能提供包括研究报告、路演服务、协助进行上市公司调研等研究服务；

(四) 具备各投资组合运作所需的高效、安全的通讯条件，有足够的交易和清算能力，满足各投资组合证券交易需要；

(五) 相关基金合同、资产管理合同以及法律法规规定的其他条件。

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

10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

无。

10.8 其他重大事件

| 序号 | 公告事项 | 法定披露方式 | 法定披露日期 |
|----|-----------------------------------------------------|--------------------------|------------|
| 1 | 大成绝对收益策略混合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 | 2024年6月28日 |
| 2 | 大成绝对收益策略混合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 | 2024年6月28日 |
| 3 | 大成基金管理有限公司关于提请投资者及时更新已过期身份证件及其他身份基本信息的公告 | 中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站 | 2024年6月28日 |
| 4 | 大成基金管理有限公司关于暂停海银基金销售有限公司办理相关销售业务的公告 | 中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站 | 2024年6月12日 |
| 5 | 大成绝对收益策略混合型发起式证券投资基金2024年第1季度报告 | 中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站 | 2024年4月19日 |
| 6 | 大成绝对收益策略混合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 | 2024年4月17日 |
| 7 | 大成绝对收益策略混合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 | 2024年4月15日 |
| 8 | 大成绝对收益策略混合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 | 2024年4月15日 |
| 9 | 大成基金管理有限公司关于调整旗下部分基金基金份额净值的小数点保留位数并相应修订基金合同和托管协议的公告 | 中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站 | 2024年4月15日 |
| 10 | 大成基金管理有限公司提醒投资者谨防金融诈骗的公告 | 中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站 | 2024年4月2日 |

| | | | |
|----|-------------------------------------|--------------------------|-----------------|
| 11 | 大成绝对收益策略混合型发起式证券投资基金 2023 年年度报告 | 中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站 | 2024 年 3 月 29 日 |
| 12 | 大成基金管理有限公司提醒投资者谨防金融诈骗的公告 | 中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站 | 2024 年 1 月 23 日 |
| 13 | 大成绝对收益策略混合型发起式证券投资基金 2023 年第 4 季度报告 | 中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站 | 2024 年 1 月 19 日 |

§ 11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

| 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 | 20240101-20240327 20240520-20240630 | 10,001,777.95 | - | - | 10,001,777.95 | 27.00 |
| | 2 | 20240101-20240630 | 18,773,466.83 | - | - | 18,773,466.83 | 50.68 |
| | 3 | 20240328-20240517 | - | 19,920,318.73 | 19,920,318.73 | - | - |
| 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额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绝对收益策略混合型发起式证券投资基金的文件；
- 2、《大成绝对收益策略混合型发起式证券投资基金基金合同》；
- 3、《大成绝对收益策略混合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

2024 年 8 月 30 日