

# 大成中华沪深港 300 指数证券投资基金 (LOF) 2020 年年度报告

2020 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：2021 年 3 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 2021 年 03 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。

本报告财务资料已经审计。普华永道中天会计师事务所(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 2020 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 .....	6
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>7</b>
3.1 主要会计数据和财务指标 .....	7
3.2 基金净值表现 .....	8
3.3 过去三年基金的利润分配情况 .....	10
<b>§ 4 管理人报告</b> .....	<b>11</b>
4.1 基金管理人及基金经理情况 .....	11
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 .....	13
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 .....	15
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>16</b>
<b>§ 7 年度财务报表</b> .....	<b>18</b>
7.1 资产负债表 .....	18
7.2 利润表 .....	19
7.3 所有者权益（基金净值）变动表 .....	20
7.4 报表附注 .....	22
<b>§ 8 投资组合报告</b> .....	<b>46</b>
8.1 期末基金资产组合情况 .....	46
8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合 .....	47

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 .....	49
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动 .....	56
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合 .....	58
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 .....	58
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 .....	58
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 .....	58
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 .....	58
8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明 .....	58
8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 .....	58
8.12 投资组合报告附注 .....	58
<b>§ 9 基金份额持有人信息 .....</b>	<b>60</b>
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....	60
9.2 期末上市基金前十名持有人 .....	60
9.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....	60
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 .....	61
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 .....	61
<b>§ 10 开放式基金份额变动 .....</b>	<b>61</b>
<b>§ 11 重大事件揭示 .....</b>	<b>62</b>
11.1 基金份额持有人大会决议 .....	62
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 .....	62
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....	62
11.4 基金投资策略的改变 .....	62
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....	62
11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况 .....	62
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	62
11.8 其他重大事件 .....	65
<b>§ 12 影响投资者决策的其他重要信息 .....</b>	<b>68</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 .....	68
12.2 影响投资者决策的其他重要信息 .....	69
<b>§ 13 备查文件目录 .....</b>	<b>69</b>
13.1 备查文件目录 .....	69
13.2 存放地点 .....	69
13.3 查阅方式 .....	69

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	大成中华沪深港 300 指数证券投资基金 (LOF)	
基金简称	大成中华沪深港 300 指数 (LOF)	
场内简称	中华 300	
基金主代码	160925	
交易代码	160925	
基金运作方式	上市契约型开放式 (LOF)	
基金合同生效日	2019 年 3 月 20 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	97,993,090.30 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	2019 年 3 月 29 日	
下属分级基金的基金简称	中华 300A	中华 300C
下属分级基金的场内简称	中华 300	-
下属分级基金的交易代码	160925	008973
报告期末下属分级基金的份额总额	97,777,316.38 份	215,773.92 份

### 2.2 基金产品说明

投资目标	本基金进行被动式指数化投资，紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化。在正常市场情况下，本基金日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.35%，年化跟踪误差不超过 4%。
投资策略	本基金主要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进行相应调整。但因特

	殊情况或者因为法律法规的限制无法投资某只股票时，基金管理人将采用其他指数投资技术适当调整基金投资组合，以达到跟踪标的指数的目的。本基金通过港股通投资港股的策略是按照指数成份股组成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进行相应调整。
业绩比较基准	中华交易服务沪深港 300 指数（人民币）收益率×95%+人民币活期存款利率（税后）×5%
风险收益特征	本基金为股票型基金，其长期平均风险和预期收益率高于混合型基金、债券型基金及货币市场基金。本基金为指数型基金，被动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。本基金部分基金资产将投资于香港市场，除了需要承担与境内证券投资基金类似的市场波动风险等一般投资风险之外，本基金还面临汇率风险、香港市场风险等境外证券市场投资所面临的特别投资风险。

### 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	赵冰
	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	深圳市福田区深南大道 7088 号招商银行大厦 32 层	北京市东城区建国门内大街 69 号
办公地址	深圳市福田区深南大道 7088 号招商银行大厦 32 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	518040	100031
法定代表人	吴庆斌	周慕冰

注：中国农业银行股份有限公司法定代表人已于 2021 年 2 月 9 日变更为谷澍。

### 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	普华永道中天会计师事务所 (特殊普通合伙)	上海市黄浦区湖滨路 202 号领展企业广场 2 座 11 楼
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	2020 年		2019 年 3 月 20 日 (基金合同生效 日)-2019 年 12 月 31 日	
	中华 300A	中华 300C	中华 300A	中华 300C
本期已 实现收 益	18,475,050.57	3,849.51	18,069,745.12	-
本期利 润	26,563,015.60	13,121.98	27,218,260.85	-
加权平 均基金 份额本 期利润	0.2071	0.1228	0.0315	-
本期加 权平均 净值利 润率	18.95%	9.92%	3.12%	-
本期基 金份额 净值增 长率	25.23%	12.10%	5.47%	-
3.1.2 期末数 据和指 标	2020 年末		2019 年末	
期末可 供分配 利润	15,950,927.40	35,116.41	7,516,238.21	-
期末可 供分配 基金份 额利润	0.1631	0.1627	0.0214	-
期末基 金资产 净值	129,142,472.83	284,900.09	370,274,883.10	-
期末基 金份额 净值	1.3208	1.3204	1.0547	-

3.1.3 累计期 末指标	2020 年末		2019 年末	
基金份 额累计 净值增 长率	32.08%	12.10%	5.47%	-

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。

4. 本基金于 2020 年 3 月 3 日起增设 C 类份额。

## 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

中华 300A

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	14.46%	0.82%	13.20%	0.82%	1.26%	0.00%
过去六个月	21.29%	1.08%	17.64%	1.06%	3.65%	0.02%
过去一年	25.23%	1.33%	17.29%	1.30%	7.94%	0.03%
自基金合同生效起 至今	32.08%	1.12%	22.38%	1.12%	9.70%	0.00%

中华 300C

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
----	--------------	---------------------	----------------	-----------------------	-----	-----

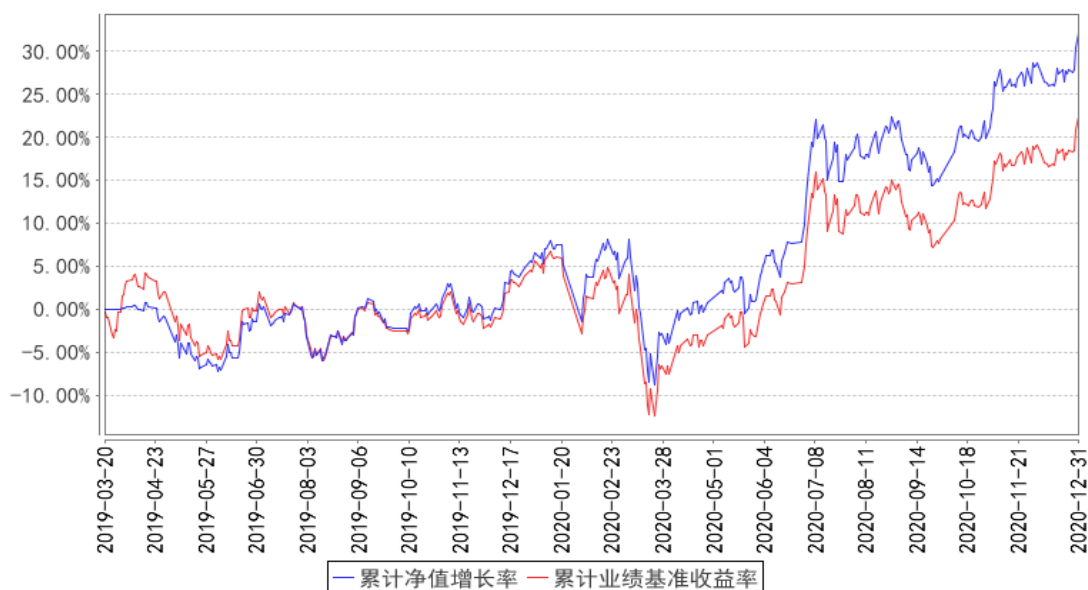


过去三个月	14.44%	0.82%	13.20%	0.82%	1.24%	0.00%
自基金合同生效起 至今	12.10%	0.85%	9.92%	0.85%	2.18%	0.00%

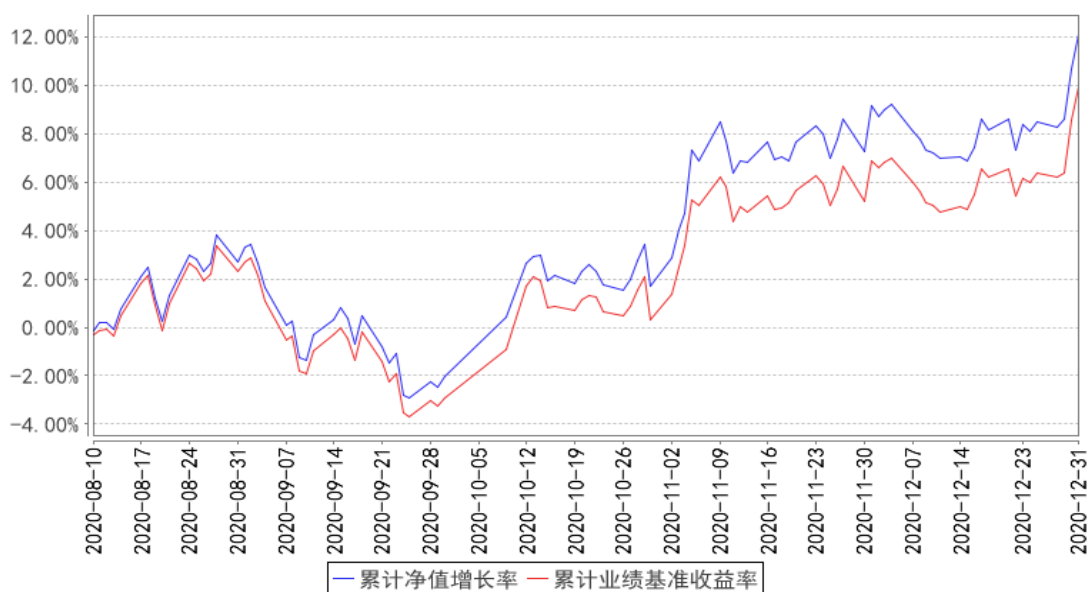
注：C 类的净值增长率和业绩比较基准收益率从 2020 年 8 月 10 日 C 类开始有份额之日开始计算。

### 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

中华300A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



中华300C累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图

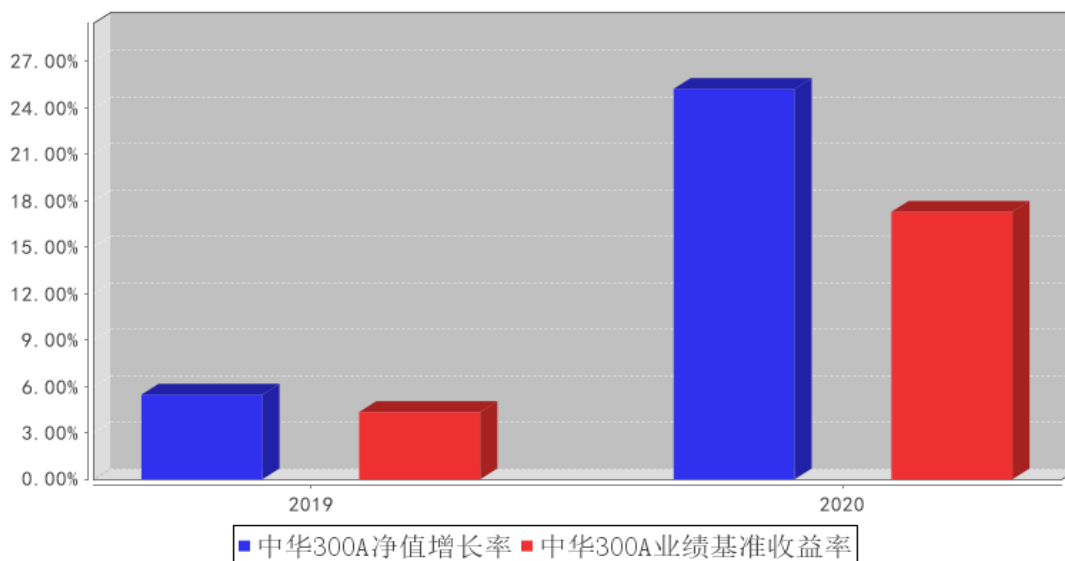


注：1、本基金合同规定，基金管理人应当自基金合同生效之日起六个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的约定。建仓期结束时，本基金的投资组合比例符合基金合同的约定。

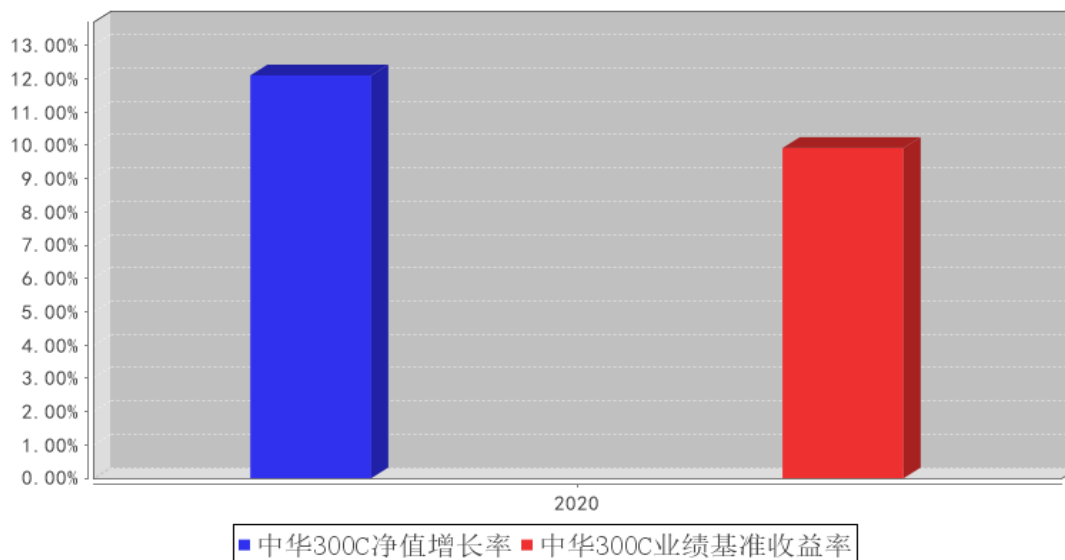
2、自 2020 年 3 月 3 日起，大成中华沪深港 300 指数证券投资基金增设收取销售服务费的 C 类基金份额类别。C 类的净值增长率和业绩比较基准收益率从 2020 年 8 月 10 日 C 类开始有份额之日开始计算。

### 3.2.3 自基金合同生效以来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

中华300A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



中华300C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经中国证监会证监基金字[1999]10 号文批准, 于 1999 年 4 月 12 日正式成立, 是中国证监会批准成立的首批十家基金管理公司之一, 注册资本为 2 亿元人民币, 注册地为深圳。目前公司由三家股东组成, 分别为中泰信托有限责任公司 (50%)、光大证券股份有限公司 (25%)、中国银河投资管理有限公司 (25%)。公司业务资质齐全, 是全国同时具有境内、境外社保基金管理人资格和基本养老保险基金管理人资格的四家基金公司之一, 全面涵盖公募基金、机构投资、海外投资、财富管理、养老金管理、私募股权投资等业务, 旗下大成国际资产管理公司具备 QFII、RQFII 以及 QFLP 等资格。

历经 21 年的发展, 大成基金形成了以长期投资能力为核心竞争优势, 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。目前已形成权益、固定收益、量化投资、商品期货、境外投资、大类资产配置等六大投资团队, 全面覆盖各类投资领域。截至 2020 年 12 月 31 日, 公司管理公募基金产品数量共 115 只。

#### 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		
冉凌浩	本基金基金经理	2019 年 3 月 20 日	-	17 年	金融学硕士。2003 年 4 月至 2004 年 6 月就职于国信证券研究部, 任研究员。2004 年 6 月至 2005 年 9 月就职于华西证券研究部, 任高级研究员。2005 年 9 月加入大成基金管理有限公司, 曾担任金融工程师、境外市场研究员及基金经理助理。2011 年 8 月 26 日起任大成标普 500 等权重指数型证券投资基金基金经理。2014 年 11 月 13 日起任大成纳斯达克 100 指数证券投资基金基金经理。2016 年 12 月 2 日起任大成恒生综合中小型股指数基金 (QDII-LOF) 基金经理。2016 年 12 月 29 日至 2020 年 7 月 7 日任大成海外中国机会混合型证券投资基金 (LOF) 基金经理。2017 年 8 月 10 日起任大成恒生指数证券投资基金 (LOF) 基金经理。2019 年 3 月 20 日起任大成中华沪深港 300 指数证券投资基金 (LOF) 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行业协会《证券业从业人员资格管理办法》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》、《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，基金管理人严格执行了公平交易的原则和制度。基金管理人运用统计分析方法和工具，对旗下所有投资组合间连续 4 个季度的日内、3 日内及 5 日内股票及债券交易同向交易价差进行分析。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，即投资组合成交时间不一致以及成交价格的日内较大变动导致个别些组合间的成交价格差异较大，但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，基金管理人旗下所有投资组合未发现存在异常交易行为。主动投资组合间股票交

易存在 7 笔同日反向交易，原因为流动性需要或合规比例调整。主动型投资组合与指数型投资组合之间或指数型投资组合之间存在股票同日反向交易，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股当日成交量 5% 的情形；主动投资组合间债券交易存在 5 笔同日反向交易，原因为流动性需要或合规比例调整。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

2020 年，全球主要国家都经历了较大的一次黑天鹅事件，即新型冠状病毒肺炎在全球蔓延。为了减缓疫情的扩散，各国政府采取了较为严格的管控手段，这些管控手段阻止了疫情的快速传播，但同时也极大减少了社会经济活动，对短期的宏观经济造成了较大影响。疫情引发了对投资者全球经济衰退的担忧，全球主要股票市场都出现了较大的波动，港股市场也不例外。

面对疫情，中国政府采取了较为严格的人流管控手段，这些手段较为有效的阻止了疫情的快速传播，但同时也极大减少了短期的社会经济活动，对短期的宏观经济造成了较大影响，致使 1 季度的 GDP 同比下行 6.8%。

中国是最早控制疫情的国家，也是最早进入经济复苏状态的国家。在 1 季度末期，中国的疫情已经得到了有效控制，并且各行业开始逐步推进复工复产活动，因此，中国 2 季度的宏观经济已经开始恢复，至 4 季度，中国的宏观经济基本恢复到了正常的增长状态中。

A 股及港股市场走势也反映了中国宏观经济的变化。A 股及港股在 1、2 季度出现了下滑，而在 3、4 季度出现了明显的反弹。

##### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末中华 300A 的基金份额净值为 1.3208 元，本报告期基金份额净值增长率为 25.23%，同期业绩比较基准收益率为 17.29%；截至本报告期末中华 300C 的基金份额净值为 1.3204 元，本报告期基金份额净值增长率为 12.10%，同期业绩比较基准收益率为 9.92%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

2020 年，A 股的表现明显优于港股，但港股前期的滞胀正是为将来的补涨提供了充足的空间，未来也将会有多重动能驱动港股上涨，原因主要有以下三个方面。

一方面，从传统行业股票来看，在中报之后，市场所担心的企业盈利下行将尘埃落定。随着中国经济的逐步恢复，上市公司利润也会同时修复，这将支持传统经济股票的上涨。

另一方面，近年来，中国科技巨头公司纷纷登陆港股市场，改变了港股的市场结构，使得港股市场的金融行业权重大幅下降且科技行业权重大幅上升，这将有力提升港股的长期增长前景。

本基金的目标指数即包括 A 股也包括港股，因此无论是 A 股还是港股有较好表现，都对本基金的业绩有推动作用。

本基金为被动型指数基金，其投资目标就是要复制指数的收益率。本基金将坚持被动型的指数化投资理念，持续实施高效的组合管理策略、交易策略及风险控制方法，以期更好地跟踪指数，力争将跟踪误差控制在较低的水平。

#### 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，维护本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。估值委员会由股票投资部、研究部、固定收益总部、数量与指数投资部、大类资产配置部、交易管理部、风险管理部、基金运营部、监察稽核部指定人员组成。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五名投资组合经理。

股票投资部、研究部、固定收益总部、数量与指数投资部、大类资产配置部、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同业市场的估值数据，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 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 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遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

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

#### 5.3 托管人对本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，未发现有关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	大成中华沪深港 300 指数证券投资基金 (LOF) 全体基金份额持有人
审计意见	<p>(一) 我们审计的内容</p> <p>我们审计了大成中华沪深港 300 指数证券投资基金 (LOF) (以下简称“大成中华沪深港 300 指数基金 (LOF)”) 的财务报表，包括 2020 年 12 月 31 日的资产负债表，2020 年度的利润表和所有者权益 (基金净值) 变动表以及财务报表附注。</p> <p>(二) 我们的意见</p> <p>我们认为，后附的财务报表在所有重大方面按照企业会计准</p>



	<p>则在财务报表附注中所列示的中国证券监督管理委员会 (以下简称“中国证监会”)、中国证券投资基金业协会 (以下简称“中国基金业协会”) 发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制, 公允反映了大成中华沪深港 300 指数基金 (LOF) 2020 年 12 月 31 日的财务状况以及 2020 年度的经营成果和基金净值变动情况。</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。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> <p>按照中国注册会计师职业道德守则, 我们独立于大成中华沪深港 300 指数基金 (LOF), 并履行了职业道德方面的其他责任。</p>
管理层和治理层对财务报表的责任	<p>大成中华沪深港 300 指数基金 (LOF) 的基金管理人大成基金管理有限公司 (以下简称“基金管理人”) 管理层负责按照企业会计准则和中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制财务报表, 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, 基金管理人管理层负责评估大成中华沪深港 300 指数基金 (LOF) 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, 除非基金管理人管理层计划清算大成中华沪深港 300 指数基金 (LOF)、终止运营或别无其他现实的选择。</p> <p>基金管理人治理层负责监督大成中华沪深港 300 指数基金 (LOF) 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>(一) 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>(二) 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>(三) 评价基金管理人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>(四) 对基金管理人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, 就可能导致对大成中华沪深港 300 指数基金 (LOF) 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中华沪深港 300 指数基金 (LOF) 不能持续经营。</p> <p>(五) 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。我们与基金管理人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	普华永道中天会计师事务所 (特殊普通合伙)	
注册会计师的姓名	张振波	陈薇瑶
会计师事务所的地址	上海市黄浦区湖滨路 202 号领展企业广场 2 座 11 楼	
审计报告日期	2021 年 3 月 29 日	

## § 7 年度财务报表

### 7.1 资产负债表

会计主体: 大成中华沪深港 300 指数证券投资基金 (LOF)

报告截止日: 2020 年 12 月 31 日

单位: 人民币元

资产	附注号	本期末 2020 年 12 月 31 日	上年度末 2019 年 12 月 31 日
<b>资产:</b>			
银行存款	7.4.7.1	7,639,931.99	52,935,155.96
结算备付金		-	3,510.86
存出保证金		14,018.23	106,566.29
交易性金融资产	7.4.7.2	121,805,271.00	344,656,864.56
其中: 股票投资		121,805,271.00	344,656,864.56
基金投资		-	-
债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	7.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	-	-
应收证券清算款		2,141,466.06	11,837,433.99
应收利息	7.4.7.5	1,923.19	17,705.32
应收股利		3,590.74	16,553.42
应收申购款		63,766.43	73,277.65

递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.6	-	-
资产总计		131,669,967.64	409,647,068.05
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2020年12月31日</b>	<b>上年度末 2019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		-	-
应付证券清算款		-	2,600,652.09
应付赎回款		1,923,602.98	35,817,601.65
应付管理人报酬		51,224.91	201,112.80
应付托管费		10,244.97	40,222.55
应付销售服务费		20.07	-
应付交易费用	7.4.7.7	51,415.68	428,096.60
应交税费		-	-
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.8	206,086.11	284,499.26
负债合计		2,242,594.72	39,372,184.95
<b>所有者权益:</b>			
实收基金	7.4.7.9	97,993,090.30	351,061,620.03
未分配利润	7.4.7.10	31,434,282.62	19,213,263.07
所有者权益合计		129,427,372.92	370,274,883.10
负债和所有者权益总计		131,669,967.64	409,647,068.05

注：报告截止日 2020 年 12 月 31 日，大成中华沪深港 300 指数证券投资基金 (LOF) A 类基金份额净值 1.3208 元，大成中华沪深港 300 指数证券投资基金 (LOF) C 类基金份额净值 1.3204 元。大成中华沪深港 300 指数证券投资基金 (LOF) 基金份额总额 97,993,090.30 份，其中 A 类基金份额 97,777,316.38 份，C 类基金份额 215,773.92 份。

## 7.2 利润表

会计主体：大成中华沪深港 300 指数证券投资基金 (LOF)

本报告期：2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期	上年度可比期间
		2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日	2019 年 3 月 20 日 (基金合 同生效日) 至 2019 年 12 月 31 日
一、收入		28,473,626.56	34,277,353.18

1. 利息收入		115,714.68	3,041,399.34
其中：存款利息收入	7.4.7.11	115,714.68	2,113,123.80
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		-	928,275.54
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		19,907,929.73	19,993,028.84
其中：股票投资收益	7.4.7.12	17,469,890.25	3,362,959.22
基金投资收益	-	-	-
债券投资收益	7.4.7.13	-	-
资产支持证券投资收益	7.4.7.13.	-	-
贵金属投资收益	7.4.7.14	-	-
衍生工具收益	7.4.7.15	814.64	-
股利收益	7.4.7.16	2,437,224.84	16,630,069.62
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.17	8,097,237.50	9,148,515.73
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.18	352,744.65	2,094,409.27
减：二、费用		1,897,488.98	7,059,092.33
1. 管理人报酬	7.4.10.2.1	710,783.03	3,300,195.28
2. 托管费	7.4.10.2.2	142,156.66	660,039.13
3. 销售服务费	7.4.10.2.3	51.18	-
4. 交易费用	7.4.7.19	692,409.43	2,721,221.79
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 税金及附加		2.93	-
7. 其他费用	7.4.7.20	352,085.75	377,636.13
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		26,576,137.58	27,218,260.85
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		26,576,137.58	27,218,260.85

### 7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：大成中华沪深港 300 指数证券投资基金 (LOF)

本报告期：2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益(基金净值)	351,061,620.03	19,213,263.07	370,274,883.10
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	26,576,137.58	26,576,137.58
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数(净值减少以“-”号填列)	-253,068,529.73	-14,355,118.03	-267,423,647.76
其中：1. 基金申购款	231,060,068.29	12,883,151.69	243,943,219.98
2. 基金赎回款	-484,128,598.02	-27,238,269.72	-511,366,867.74
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以“-”号填列)	-	-	-
五、期末所有者权益(基金净值)	97,993,090.30	31,434,282.62	129,427,372.92
项目	上年度可比期间 2019 年 3 月 20 日(基金合同生效日)至 2019 年 12 月 31 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益(基金净值)	1,968,326,601.16	-	1,968,326,601.16
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	27,218,260.85	27,218,260.85
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数(净值减少以“-”号填列)	-1,617,264,981.13	-8,004,997.78	-1,625,269,978.91
其中：1. 基金申购款	49,126,590.61	-868,975.47	48,257,615.14

2. 基金赎回款	-1,666,391,571.74	-7,136,022.31	-1,673,527,594.05
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-	-
五、期末所有者权益（基金净值）	351,061,620.03	19,213,263.07	370,274,883.10

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：

谭晓冈

周立新

刘亚林

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

大成中华沪深港 300 指数证券投资基金 (LOF) (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[2018]2130 号《关于准予大成中华沪深港 300 指数证券投资基金(LOF)注册的批复》核准,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《大成中华沪深港 300 指数证券投资基金(LOF)基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式基金,存续期限不定,首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币 1,967,654,798.00 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(2019)第 0120 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《大成中华沪深港 300 指数证券投资基金(LOF)基金合同》于 2019 年 3 月 20 日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为 1,968,326,601.16 份基金份额,其中认购资金利息折合 671,803.16 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[2019]143 号文审核同意,本基金 8,136,323.00 份基金份额于 2019 年 3 月 29 日在深交所挂牌交易。未上市交易的基金份额托管在场外,基金份额持有人将其转托管至深交所场内后即可上市流通。

根据基金管理人大成基金管理有限公司于 2020 年 2 月 29 日发布的《关于大成中华沪深港 300 指数证券投资基金(LOF)增设 C 类基金份额并相应修订基金合同和托管协议的公告》及更新的《大成中华沪深港 300 指数证券投资基金(LOF)基金合同》的有关规定,自 2020 年 3 月 3 日起,对大成中华沪深港 300 指数证券投资基金(LOF)增设 C 类基金份额,原有基金份额转为 A 类基金份额。

其中，在投资者申购时收取申购费用，不从本类别资产中计提销售服务费的基金份额，称为 A 类基金份额；投资者申购时不收取申购费用，而是从本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。本基金 A 类基金份额和 C 类基金份额分别设置基金代码并分别计算基金份额净值。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《大成中华沪深港 300 指数证券投资基金 (LOF) 基金合同》的有关规定，本基金主要投资于具有良好流动性的金融工具，包括标的指数成份股 (含存托凭证)、备选成份股 (含存托凭证)、国内依法发行上市的股票 (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、港股通机制允许买卖的香港联交所上市的股票、债券 (包括国债、金融债、企业债、公司债、次级债、可转换债券、分离交易可转债、央行票据、中期票据、短期融资券、超短期融资券、地方政府债)、资产支持证券、债券回购、货币市场工具、银行存款、衍生工具 (股指期货、权证) 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相关规定)。本基金股票资产、存托凭证占基金资产的比例不低于 80%；投资于标的指数成份股 (含存托凭证) 和备选成份股 (含存托凭证) 的资产不低于基金资产净值的 90%；每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，保持现金 (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不低于基金资产净值的 5%；权证、股指期货及其他金融工具的投资比例依照法律法规或监管机构的规定执行。本基金的业绩比较基准为：中华交易服务沪深港 300 指数 (人民币) 收益率  $\times 95\%$  + 人民币活期存款利率 (税后)  $\times 5\%$ 。

本财务报表由本基金的基金管理人大成基金管理有限公司于 2021 年 3 月 29 日批准报出。

#### 7.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于 2006 年 2 月 15 日及以后期间颁布的《企业会计准则—基本准则》、各项具体会计准则及相关规定 (以下合称“企业会计准则”)、中国证监会颁布的《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>》、中国证券投资基金业协会 (以下简称“中国基金业协会”) 颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《大成中华沪深港 300 指数证券投资基金 (LOF) 基金合同》和在财务报表附注 7.4.4 所列示的中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

本财务报表以持续经营为基础编制。

#### 7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2020 年度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 2020 年 12 月 31 日的财务状况以及 2020 年度的经营成果和基金净值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。比较财务报表的实际编制期间为 2019 年 3 月 20 日 (基金合同生效日) 起至 2019 年 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

#### (1) 金融资产的分类

金融资产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资产、应收款项、可供出售金融资产及持有至到期投资。金融资产的分类取决于本基金对金融资产的持有意图和持有能力。本基金现无金融资产分类为可供出售金融资产及持有至到期投资。

本基金目前以交易目的持有的股票投资、债券投资和衍生工具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。除衍生工具所产生的金融资产在资产负债表中以衍生金融资产列示外，以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在资产负债表中以交易性金融资产列示。

本基金持有的其他金融资产分类为应收款项，包括银行存款、买入返售金融资产和其他各类应收款项等。应收款项是指在活跃市场中没有报价、回收金额固定或可确定的非衍生金融资产。

#### (2) 金融负债的分类

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及其他金融负债。本基金目前暂无金融负债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。本基金持有的其他金融负债包括卖出回购金融资产款和其他各类应付款项等。

### 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

金融资产或金融负债于本基金成为金融工具合同的一方时，按公允价值在资产负债表内确认。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，取得时发生的相关交易费用计入当期损益；对于支付的价款中包含的债券起息日或上次除息日至购买日止的利息，单独确认为应收项目。应收款项和其他金融负债的相关交易费用计入初始确认金额。

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，按照公允价值进行后续计量；对于应收款项和其他金融负债采用实际利率法，以摊余成本进行后续计量。

金融资产满足下列条件之一的，予以终止确认：(1) 收取该金融资产现金流量的合同权利终止；(2) 该金融资产已转移，且本基金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；或者(3) 该金融资产已转移，虽然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，但是放弃了对该金融资产控制。



金融资产终止确认时，其账面价值与收到的对价的差额，计入当期损益。

当金融负债的现时义务全部或部分已经解除时，终止确认该金融负债或义务已解除的部分。终止确认部分的账面价值与支付的对价之间的差额，计入当期损益。

#### 7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

本基金持有的股票投资、债券投资和衍生工具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其估值日的市场交易价格确定公允价值；估值日无交易且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，按最近交易日的市场交易价格确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的市场交易价格不能真实反映公允价值的，应对市场交易价格进行调整，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) 当金融工具不存在活跃市场，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。采用估值技术时，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，才可以使用不可观察输入值。

(3) 如经济环境发生重大变化或证券发行人发生影响金融工具价格的重大事件，应对估值进行调整并确定公允价值。

#### 7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

本基金持有的资产和承担的负债基本为金融资产和金融负债。当本基金 1) 具有抵销已确认金额的法定权利且该种法定权利现在是可执行的；且 2) 交易双方准备按净额结算时，金融资产与金融负债按抵销后的净额在资产负债表中列示。

#### 7.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行基金份额所募集的总金额在扣除损益平准金分摊部分后的余额。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认列。

#### 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基金净值比例计算的金额。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基金净值比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日认列，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

股票投资在持有期间应取得的现金股利扣除由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额确认为投资收益。债券投资在持有期间应取得的按票面利率或者发行价计算的利息扣除在适用情况下由债券发行企业代扣代缴的个人所得税及由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为利息收入。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在持有期间的公允价值变动确认为公允价值变动损益；于处置时，其处置价格与初始确认金额之间的差额扣除在适用情况下由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为投资收益，其中包括从公允价值变动损益结转的公允价值累计变动额。

应收款项在持有期间确认的利息收入按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

#### 7.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬、托管费和销售服务费在费用涵盖期间按基金合同约定的费率和计算方法逐日确认。

其他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

本基金同一类别的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，其中场外基金份额持有人可选择现金红利或将现金红利按分红除权日的基金份额净值自动转为基金份额进行再投资，场内基金份额持有人只能选择现金分红。若期末未分配利润中的未实现部分为正数，包括基金经营活动产生的未实现损益以及基金份额交易产生的未实现平准金等，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润中的已实现部分；若期末未分配利润的未实现部分为负数，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润，即已实现部分相抵未实现部分后的余额。

经宣告的拟分配基金收益于分红除权日从所有者权益转出。

#### 7.4.4.12 外币交易

外币交易按交易发生日的即期汇率将外币金额折算为人民币入账。

以公允价值计量的外币非货币性项目，于估值日采用估值日的即期汇率折算为人民币，所产生的折算差额直接计入公允价值变动损益科目。

#### 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

根据本基金的估值原则和中国证监会允许的基金行业估值实务操作,本基金确定以下类别股票投资和债券投资的公允价值时采用的估值方法及其关键假设如下:

(1) 对于证券交易所上市的股票和债券,若出现重大事项停牌或交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)等情况,本基金根据中国证监会公告[2017]13号《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》根据具体情况采用《关于发布中基协(AMAC)基金行业股票估值指数的通知》提供的指数收益法、市盈率法、现金流量折现法等估值技术进行估值。

(2) 对于在锁定期内的非公开发行股票、首次公开发行股票时公司股东公开发售股份、通过大宗交易取得的带限售期的股票等流通受限股票,根据中国基金业协会中基协发[2017]6号《关于发布〈证券投资基金投资流通受限股票估值指引(试行)〉的通知》之附件《证券投资基金投资流通受限股票估值指引(试行)》(以下简称“指引”),按估值日在证券交易所上市交易的同一股票的公允价值扣除中证指数有限公司根据指引所独立提供的该流通受限股票剩余限售期对应的流动性折扣后的价值进行估值。

(3) 对于在证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券、可交换债券和私募债券除外)及在银行间同业市场交易的固定收益品种,根据中国证监会公告[2017]13号《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》及《中国证券投资基金业协会估值核算工作小组关于2015年1季度固定收益品种的估值处理标准》采用估值技术确定公允价值。本基金持有的证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券、可交换债券和私募债券除外),按照中证指数有限公司所独立提供的估值结果确定公允价值。本基金持有的银行间同业市场固定收益品种按照中债金融估值中心有限公司所独立提供的估值结果确定公允价值。

#### 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

本基金本报告期未发生会计政策变更。

##### 7.4.5.2 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。

### 7.4.5.3 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。

### 7.4.6 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[2014]81号《财政部国家税务总局证监会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[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]127号《财政部国家税务总局证监会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》、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，以产生的利息及利息性质的收入为销售额。

(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。

对基金通过港股通投资香港联交所上市 H 股取得的股息红利，H 股公司应向中国证券登记结算有限责任公司（以下简称“中国结算”）提出申请，由中国结算向 H 股公司提供内地个人投资者名册，H 股公司按照 20% 的税率代扣个人所得税。基金通过港股通投资香港联交所上市的非 H 股取得的股息红利，由中国结算按照 20% 的税率代扣个人所得税。

(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。基金通过港股通买卖、继承、赠与联交所上市股票，按照香港特别行政区现行税法规定缴纳印花税。

(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。

#### 7.4.7 重要财务报表项目的说明

##### 7.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2020 年 12 月 31 日		上年度末 2019 年 12 月 31 日	
	活期存款	7,639,931.99		52,935,155.96
定期存款	-		-	
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	-		-	
合计	7,639,931.99		52,935,155.96	

##### 7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2020 年 12 月 31 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	104,559,517.77	121,805,271.00	17,245,753.23
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	104,559,517.77	121,805,271.00	17,245,753.23

项目	上年度末 2019 年 12 月 31 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	335,508,348.83	344,656,864.56	9,148,515.73
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	335,508,348.83	344,656,864.56	9,148,515.73

#### 7.4.7.3 衍生金融资产/负债

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。

#### 7.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2020 年 12 月 31 日	上年度末 2019 年 12 月 31 日
应收活期存款利息	1,916.15	12,327.14
应收定期存款利息	-	-
应收其他存款利息	-	-
应收结算备付金利息	-	5,347.93
应收债券利息	-	-
应收资产支持证券利息	-	-
应收买入返售证券利息	-	-
应收申购款利息	-	-
应收黄金合约拆借孳息	-	-
应收出借证券利息	-	-
其他	7.04	30.25
合计	1,923.19	17,705.32

## 7.4.7.6 其他资产

无。

## 7.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2020 年 12 月 31 日	上年度末 2019 年 12 月 31 日
交易所市场应付交易费用	51,415.68	428,096.60
银行间市场应付交易费用	-	-
合计	51,415.68	428,096.60

## 7.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2020 年 12 月 31 日	上年度末 2019 年 12 月 31 日
应付券商交易单元保证金	-	-
应付赎回费	6,086.11	134,972.07
应付证券出借违约金	-	-
预提费用	180,000.00	120,000.00
应付指数使用费	20,000.00	29,527.19
合计	206,086.11	284,499.26

## 7.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

## 中华 300A

项目	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日	
	基金份额 (份)	账面金额
上年度末	351,061,620.03	351,061,620.03
本期申购	230,584,234.37	230,584,234.37
本期赎回 (以“-”号填列)	-483,868,538.02	-483,868,538.02
本期末	97,777,316.38	97,777,316.38

## 中华 300C

项目	本期 2020 年 3 月 3 日 (基金合同生效日) 至 2020 年 12 月 31 日	
	基金份额 (份)	账面金额
上年度末	-	-
本期申购	475,833.92	475,833.92
本期赎回 (以“-”号填列)	-260,060.00	-260,060.00
本期末	215,773.92	215,773.92

注：1. 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)。

2. 截至本期末止，本基金于深交所上市的基金份额为 606,035.00 份(上年度末：2,391,525.00 份)，托管在场外未上市交易的基金份额为 97,387,055.30 份(上年度末：

348,670,095.03 份)。上市的基金份额登记在证券登记结算系统，可选择按市价流通或按基金份额净值申购或赎回；未上市的基金份额登记在注册登记系统，按基金份额净值申购或赎回。通过跨系统转登记可实现基金份额在两个系统之间的转换。

#### 7.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

##### 中华 300A

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	7,516,238.21	11,697,024.86	19,213,263.07
本期利润	18,475,050.57	8,087,965.03	26,563,015.60
本期基金份额交易产生的变动数	-10,040,361.38	-4,370,760.84	-14,411,122.22
其中：基金申购款	8,031,891.39	4,736,788.35	12,768,679.74
基金赎回款	-18,072,252.77	-9,107,549.19	-27,179,801.96
本期已分配利润	-	-	-
本期末	15,950,927.40	15,414,229.05	31,365,156.45

##### 中华 300C

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-	-	-
本期利润	3,849.51	9,272.47	13,121.98
本期基金份额交易产生的变动数	31,266.90	24,737.29	56,004.19
其中：基金申购款	70,816.02	43,655.93	114,471.95
基金赎回款	-39,549.12	-18,918.64	-58,467.76
本期已分配利润	-	-	-
本期末	35,116.41	34,009.76	69,126.17

#### 7.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2020年1月1日至2020年12月31日	2019年3月20日（基金合同生效日）至2019年12月31日
活期存款利息收入	100,748.89	961,582.92



定期存款利息收入	-	-
其他存款利息收入	-	1,047,569.44
结算备付金利息收入	12,308.47	90,858.06
其他	2,657.32	13,113.38
合计	115,714.68	2,113,123.80

#### 7.4.7.12 股票投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年12月31日	上年度可比期间 2019年3月20日(基金合同生效日)至2019年12月31日
卖出股票成交总额	304,680,224.03	630,140,861.04
减：卖出股票成本总额	287,210,333.78	626,777,901.82
买卖股票差价收入	17,469,890.25	3,362,959.22

#### 7.4.7.13 债券投资收益

无。

#### 7.4.7.14 贵金属投资收益

无。

#### 7.4.7.15 衍生工具收益

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年12月31日	上年度可比期间 2019年3月20日(基金合同生效日)至2019年12月31日
卖出权证成交总额	839.08	-
减：卖出权证成本总额	-	-
减：买卖权证差价收入应 缴纳增值税额	24.44	-
买卖权证差价收入	814.64	-

#### 7.4.7.16 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年12月31日	上年度可比期间 2019年3月20日(基金合同生效日)至2019年12月31日
股票投资产生的股利收益	2,437,224.84	16,630,069.62
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	2,437,224.84	16,630,069.62

## 7.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2020年1月1日至2020年 12月31日	上年度可比期间 2019年3月20日(基金合 同生效日)至2019年12月31 日
1. 交易性金融资产	8,097,237.50	9,148,515.73
股票投资	8,097,237.50	9,148,515.73
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	-	-
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	8,097,237.50	9,148,515.73

## 7.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年12月 31日	上年度可比期间 2019年3月20日(基金合 同生效日)至2019年12月31 日
基金赎回费收入	352,744.65	2,094,409.27
合计	352,744.65	2,094,409.27

注：本基金的赎回费率按持有期间递减，不低于赎回费总额的 25% 归入基金资产。

## 7.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年12月 31日	上年度可比期间 2019年3月20日(基金合同生效日) 至2019年12月31日
交易所市场交易费用	692,409.43	2,721,221.79
银行间市场交易费用	-	-
合计	692,409.43	2,721,221.79

## 7.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年12月	上年度可比期间 2019年3月20日(基金合同生效日)

	31 日	至 2019 年 12 月 31 日
审计费用	60,000.00	120,000.00
信息披露费	120,000.00	-
证券出借违约金	-	-
银行划款手续费	13,816.03	26,683.34
指数使用费	98,269.72	150,552.79
上市费	60,000.00	80,000.00
开户费	-	400.00
合计	352,085.75	377,636.13

注：指数使用费为支付标的指数供应商的标的指数许可使用费，按前一日基金资产净值的 0.04% 的年费率计提（基金成立之日起首 3 年，标的指数使用许可费年费率为 0.02%），逐日累计，按季支付，标的指数许可使用费的收取下限为每季人民币 20,000.00 元。

#### 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、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
中泰信托有限责任公司	基金管理人的股东
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 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2019 年 3 月 20 日（基金合同生效日）至 2019 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	202,895,495.28	57.02	1,132,126,312.17	72.20

#### 7.4.10.1.2 债券交易

无。

#### 7.4.10.1.3 债券回购交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2020年1月1日至2020年12月31日		上年度可比期间 2019年3月20日（基金合同生效日） 至2019年12月31日	
	成交金额	占当期债券回购 成交总额的比例 (%)	成交金额	占当期债券回购 成交总额的比例 (%)
光大证券	-	-	3,104,900,000.00	79.94

#### 7.4.10.1.4 权证交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2020年1月1日至2020年12月31日		上年度可比期间 2019年3月20日（基金合同生效日）至 2019年12月31日	
	成交金额	占当期权证 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	839.08	100.00	-	-

#### 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 2020年1月1日至2020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	176,522.87	57.93	40,755.52	79.27
关联方名称	上年度可比期间 2019年3月20日（基金合同生效日）至2019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	953,594.34	71.30	140,105.28	32.73

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。

#### 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 2020年1月1日至2020年12月31日	上年度可比期间 2019年3月20日（基金合同生效日）至2019年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	710,783.03	3,300,195.28
其中：支付销售机构的客户维护费	413,986.65	2,642,423.60

注：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 0.50% 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：

$$\text{日管理人报酬} = \text{前一日基金资产净值} \times 0.50\% / \text{当年天数}。$$

##### 7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年12月31日	上年度可比期间 2019年3月20日（基金合同生效日）至2019年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	142,156.66	660,039.13

注：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 0.10% 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：

$$\text{日托管费} = \text{前一日基金资产净值} \times 0.10\% / \text{当年天数}。$$

##### 7.4.10.2.3 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 2020年1月1日至2020年12月31日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	中华 300A	中华 300C	合计
大成基金	-	1.59	1.59

合计	-	1.59	1.59
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2019年3月20日（基金合同生效日）至2019年12月31日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	中华 300A	中华 300C	合计
大成基金	-	-	-
合计	-	-	-

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 0.10% 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：

$$\text{日销售服务费} = \text{前一日 C 类基金份额的基金资产净值} \times 0.10\% / \text{当年天数}。$$

#### 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 2020年1月1日至2020年12月31日	上年度可比期间 2019年3月20日（基金合同生效日）至2019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	7,639,931.99	100,748.89	52,935,155.96	961,582.92

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(2020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	可流通日	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
601995	中金公司	2020年10月22日	2021年5月6日	新股锁定	28.78	68.71	24,951	718,089.78	1,714,383.21	-

注：基金可使用以基金名义开设的股票账户，选择网上或者网下一种方式进行新股申购。本基金参与网下申购获得的新股，在新股上市之前及上市之后的约定期限(若有)内不得转让；本基金参与网上申购获得的新股，在新股上市之前不得转让。

##### 7.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

无。

##### 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

本基金为股票型基金，其长期平均风险和预期收益率高于混合型基金、债券型基金及货币市场基金。同时本基金为指数型基金，被动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公司相似的风险收益特征。本基金投资的金融工具主要包括股票投资、债券投资及权证投资等。本基金在日常经营活动中面临的与这些金融工具相关的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金部分基金资产投资于香港证券市场，基金净值除了会因香港证券市场波动等因素产生波动之外，还需面临汇率风险等投资海外市场的特殊风险。本基金的基金管理人从事风险管理的主要目标是争取将以上风险控制在限定的范围之内，紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化。

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，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，且通过分散化投资以分散信用风险。

于本期末，本基金无债券投资(上年度末：同)。

#### 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。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。

#### 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 2020 年 12 月 31 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
<b>资产</b>					
银行存款	7,639,931.99	-	-	-	7,639,931.99
存出保证金	14,018.23	-	-	-	14,018.23
交易性金融资产	-	-	-	121,805,271.00	121,805,271.00
应收利息	-	-	-	1,923.19	1,923.19
应收股利	-	-	-	3,590.74	3,590.74
应收申购款	-	-	-	63,766.43	63,766.43
应收证券清算款	-	-	-	2,141,466.06	2,141,466.06
<b>资产总计</b>	<b>7,653,950.22</b>	<b>-</b>	<b>-</b>	<b>124,016,017.42</b>	<b>131,669,967.64</b>
<b>负债</b>					
应付赎回款	-	-	-	1,923,602.98	1,923,602.98
应付管理人报酬	-	-	-	51,224.91	51,224.91
应付托管费	-	-	-	10,244.97	10,244.97
应付销售服务费	-	-	-	20.07	20.07
应付交易费用	-	-	-	51,415.68	51,415.68
其他负债	-	-	-	206,086.11	206,086.11
<b>负债总计</b>	<b>-</b>	<b>-</b>	<b>-</b>	<b>2,242,594.72</b>	<b>2,242,594.72</b>
<b>利率敏感度缺口</b>	<b>7,653,950.22</b>	<b>-</b>	<b>-</b>	<b>-121,773,422.70</b>	<b>129,427,372.92</b>
上年度末 2019 年 12 月 31 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
<b>资产</b>					
银行存款	52,935,155.96	-	-	-	52,935,155.96
结算备付金	3,510.86	-	-	-	3,510.86
存出保证金	106,566.29	-	-	-	106,566.29
交易性金融资产	-	-	-	344,656,864.56	344,656,864.56
应收利息	-	-	-	17,705.32	17,705.32

应收股利	-	-	-	16,553.42	16,553.42
应收申购款	-	-	-	73,277.65	73,277.65
应收证券清算款	-	-	-	11,837,433.99	11,837,433.99
资产总计	53,045,233.11	-	-	356,601,834.94	409,647,068.05
负债	-	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	35,817,601.65	35,817,601.65
应付管理人报酬	-	-	-	201,112.80	201,112.80
应付托管费	-	-	-	40,222.55	40,222.55
应付证券清算款	-	-	-	2,600,652.09	2,600,652.09
应付交易费用	-	-	-	428,096.60	428,096.60
其他负债	-	-	-	284,499.26	284,499.26
负债总计	-	-	-	39,372,184.95	39,372,184.95
利率敏感度缺口	53,045,233.11	-	-	-317,229,649.99	370,274,883.10

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（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）。

#### 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。本基金持有不以记账本位币计价的资产，因此存在相应的外汇风险。本基金管理人每日对本基金的外汇头寸进行监控。

##### 7.4.13.4.2.1 外汇风险敞口

单位：人民币元

项目	本期末 2020年12月31日			
	美元 折合人民币 元	港币 折合人民币元	其他币种 折合人民币元	合计
以外币计价的 资产				
交易性金融资产	-	54,031,449.27	-	54,031,449.27
资产合计	-	54,031,449.27	-	54,031,449.27
以外币计价的 负债				

负债合计	-	-	-	-
资产负债表外 汇风险敞口净 额	-	54,031,449.27	-	54,031,449.27
项目	上年度末 2019 年 12 月 31 日			
	美元 折合人民 币元	港币 折合人民币元	其他币种 折合人民币元	合计
以外币计价的 资产				
交易性金融资 产	-	177,944,149.41	-	177,944,149.41
资产合计	-	177,944,149.41	-	177,944,149.41
以外币计价的 负债				
负债合计	-	-	-	-
资产负债表外 汇风险敞口净 额	-	177,944,149.41	-	177,944,149.41

#### 7.4.13.4.2.2 外汇风险的敏感性分析

假设	除港币以外的其他市场变量保持不变		
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（2020 年 12 月 31 日）	上年度末（2019 年 12 月 31 日）	
分析	港币相对人民币升 值 5%	2,701,572.46	8,897,207.47
	港币相对人民币贬 值 5%	-2,701,572.46	-8,897,207.47

#### 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，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通过严格的投资纪律约束和数量化风险管理手段，实现基金投资组合对标的指数的有效跟踪，追求跟踪误差最小化。

本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险。本基金的投资组合比例为：股票资产、存托凭证占基金资产的比例不低于 80%；投资于标的指数成份股(含存托凭证)和备选成份股(含存托凭证)的资产不低于基金非现金资产的 90%；每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，保持现金(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不低于基金资产净值的 5%。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 2020 年 12 月 31 日		上年度末 2019 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	121,805,271.00	94.11	344,656,864.56	93.08
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	121,805,271.00	94.11	344,656,864.56	93.08

#### 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		
	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 (2020 年 12 月 31 日)	上年度末 (2019 年 12 月 31 日)
分析	业绩比较基准上升 5%	6,586,054.55	15,061,807.15
	业绩比较基准下降 5%	-6,586,054.55	-15,061,807.15

#### 7.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

##### (1) 公允价值

###### (a) 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。

###### (b) 持续的以公允价值计量的金融工具

###### (i) 各层次金融工具公允价值

于本期末，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中属于第一层次的余额为 120,090,887.79 元，属于第二层次的余额为 1,714,383.21 元，无属于第三层次的余额（上年度末：第一层次 334,787,788.32 元，第二层次 9,869,076.24 元，无第三层次）。

###### (ii) 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，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，确定相关股票公允价值应属第二层次还是第三层次。

###### (iii) 第三层次公允价值余额和本期变动金额

无。

###### (c) 非持续的以公允价值计量的金融工具

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）。

###### (d) 不以公允价值计量的金融工具

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。

(2) 除公允价值外，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	121,805,271.00	92.51
	其中：股票	121,805,271.00	92.51
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	7,639,931.99	5.80
8	其他各项资产	2,224,764.65	1.69
9	合计	131,669,967.64	100.00

## 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	849,902.60	0.66
B	采矿业	1,529,944.28	1.18
C	制造业	35,337,035.49	27.30
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	1,013,670.78	0.78
E	建筑业	940,041.00	0.73
F	批发和零售业	299,272.80	0.23
G	交通运输、仓储和邮政业	1,415,163.10	1.09
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	2,315,241.66	1.79
J	金融业	16,992,342.38	13.13
K	房地产业	1,912,937.40	1.48
L	租赁和商务服务业	1,425,060.00	1.10
M	科学研究和技术服务业	725,547.20	0.56
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	87,825.00	0.07
Q	卫生和社会工作	902,741.13	0.70

R	文化、体育和娱乐业	297,736.20	0.23
S	综合	-	-
	合计	66,044,461.02	51.03

### 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	-	-
C	制造业	14,977.50	0.01
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	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	-	-
J	金融业	1,714,383.21	1.32
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	1,729,360.71	1.34

### 8.2.3 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

行业类别	公允价值 (人民币)	占基金资产净值比例 (%)
原材料	277,194.13	0.21
非日常生活消费品	7,258,187.36	5.61
日常消费品	2,626,430.03	2.03
能源	1,028,596.45	0.79
金融	17,741,597.23	13.71
医疗保健	2,678,798.01	2.07
工业	997,088.78	0.77
信息技术	2,976,520.48	2.30



通讯服务	12,293,856.86	9.50
公用事业	2,127,081.87	1.64
房地产	4,026,098.07	3.11
合计	54,031,449.27	41.75

注：以上分类采用全球行业分类标准（GICS）。

### 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	00700	腾讯控股	23,470	11,140,856.01	8.61
2	601318	中国平安	41,201	3,583,662.98	2.77
2	02318	中国平安	29,000	2,318,718.20	1.79
3	03690	美团点评—W	15,400	3,818,386.02	2.95
4	600519	贵州茅台	1,900	3,796,200.00	2.93
5	01299	友邦保险	45,400	3,629,993.32	2.80
6	600036	招商银行	46,500	2,043,675.00	1.58
6	03968	招商银行	18,000	742,326.48	0.57
7	00005	汇丰控股	77,543	2,659,479.09	2.05
8	00939	建设银行	462,000	2,290,253.94	1.77
8	601939	建设银行	25,200	158,256.00	0.12
9	000858	五粮液	7,300	2,130,505.00	1.65
10	01398	工商银行	330,000	1,397,038.24	1.08
10	601398	工商银行	131,500	656,185.00	0.51
11	000333	美的集团	18,800	1,850,672.00	1.43
12	00388	香港交易所	4,889	1,748,780.63	1.35
13	01810	小米集团—W	58,200	1,626,250.47	1.26
14	600276	恒瑞医药	14,040	1,564,898.40	1.21
15	300750	宁德时代	4,400	1,544,884.00	1.19
16	601166	兴业银行	54,500	1,137,415.00	0.88
17	000651	格力电器	18,100	1,121,114.00	0.87
18	02269	药明生物	12,500	1,081,507.40	0.84
19	601888	中国中免	3,700	1,045,065.00	0.81
20	600887	伊利股份	22,800	1,011,636.00	0.78
21	03988	中国银行	329,000	733,783.83	0.57
21	601988	中国银行	79,000	251,220.00	0.19
22	600030	中信证券	31,900	937,860.00	0.72
23	601012	隆基股份	9,890	911,858.00	0.70
24	00941	中国移动	23,987	892,328.11	0.69

25	002475	立讯精密	15,747	883,721.64	0.68
26	300059	东方财富	25,912	803,272.00	0.62
27	600031	三一重工	22,300	780,054.00	0.60
28	300760	迈瑞医疗	1,800	766,800.00	0.59
29	601601	中国太保	12,800	491,520.00	0.38
29	02601	中国太保	10,600	270,764.00	0.21
30	000002	万科A	25,600	734,720.00	0.57
31	603288	海天味业	3,600	721,944.00	0.56
32	000001	平安银行	36,360	703,202.40	0.54
33	601328	交通银行	103,200	462,336.00	0.36
33	03328	交通银行	67,000	231,198.51	0.18
34	002415	海康威视	14,000	679,140.00	0.52
35	002594	比亚迪	3,400	660,620.00	0.51
36	02628	中国人寿	28,968	416,908.73	0.32
36	601628	中国人寿	6,200	238,018.00	0.18
37	600900	长江电力	34,100	653,356.00	0.50
38	603259	药明康德	4,760	641,267.20	0.50
39	000568	泸州老窖	2,800	633,248.00	0.49
40	09633	农夫山泉	13,600	628,402.09	0.49
41	000725	京东方A	101,600	609,600.00	0.47
42	00175	吉利汽车	26,964	601,390.50	0.46
43	002352	顺丰控股	6,800	599,964.00	0.46
44	002714	牧原股份	7,070	545,097.00	0.42
45	002304	洋河股份	2,300	542,777.00	0.42
46	600309	万华化学	5,900	537,136.00	0.42
47	600016	民生银行	80,000	416,000.00	0.32
47	01988	民生银行	26,452	98,402.73	0.08
48	00669	创科实业	5,500	511,969.61	0.40
49	000661	长春高新	1,100	493,801.00	0.38
50	600809	山西汾酒	1,300	487,877.00	0.38
51	00002	中电控股	7,992	482,281.94	0.37
52	601899	紫金矿业	51,600	479,364.00	0.37
53	00001	长和	10,485	477,410.61	0.37
54	600585	海螺水泥	9,100	469,742.00	0.36
55	300015	爱尔眼科	6,177	462,595.53	0.36
56	00016	新鸿基地产	5,484	461,555.38	0.36
57	02313	申洲国际	3,500	447,752.48	0.35
58	600048	保利地产	27,300	431,886.00	0.33
59	02319	蒙牛乳业	10,925	430,322.12	0.33
60	02382	舜宇光学科技	3,000	428,478.92	0.33
61	600000	浦发银行	44,000	425,920.00	0.33

62	06160	百济神州— B	3,200	422,839.94	0.33
63	00883	中国海洋石油	69,098	417,557.50	0.32
64	600690	海尔智家	14,200	414,782.00	0.32
65	02020	安踏体育	4,000	413,750.22	0.32
66	00027	银河娱乐	8,000	405,670.48	0.31
67	601688	华泰证券	22,500	405,225.00	0.31
68	002142	宁波银行	11,400	402,876.00	0.31
69	00003	香港中华煤 气	40,755	397,206.02	0.31
70	601668	中国建筑	78,700	391,139.00	0.30
71	601088	中国神华	12,600	226,926.00	0.18
71	01088	中国神华	12,979	159,485.23	0.12
72	002027	分众传媒	38,500	379,995.00	0.29
73	01109	华润置地	13,957	375,896.62	0.29
74	600837	海通证券	29,000	372,940.00	0.29
75	000100	TCL 科技	52,600	372,408.00	0.29
76	603501	韦尔股份	1,600	369,760.00	0.29
77	300124	汇川技术	3,900	363,870.00	0.28
78	00291	华润啤酒	5,988	359,837.46	0.28
79	01928	金沙中国有 限公司	12,400	355,357.24	0.27
80	300122	智飞生物	2,400	354,984.00	0.27
81	06969	思摩尔国际	7,000	352,605.08	0.27
82	300014	亿纬锂能	4,300	350,450.00	0.27
83	000063	中兴通讯	10,200	343,230.00	0.27
84	00011	恒生银行	2,997	337,244.22	0.26
85	01113	长实集团	9,987	334,537.26	0.26
86	600570	恒生电子	3,179	333,477.10	0.26
87	00012	恒基地产	12,980	330,465.74	0.26
88	600999	招商证券	14,140	330,027.60	0.25
89	02388	中银香港	16,436	325,080.08	0.25
90	300347	泰格医药	2,000	323,220.00	0.25
91	01177	中国生物制 药	51,000	321,927.30	0.25
92	600104	上汽集团	13,100	320,164.00	0.25
93	002241	歌尔股份	8,500	317,220.00	0.25
94	02007	碧桂园	34,573	311,930.77	0.24
95	00241	阿里健康	16,021	308,781.64	0.24
96	300498	温氏股份	16,720	304,805.60	0.24
97	601211	国泰君安	17,100	299,763.00	0.23

98	600436	片仔癀	1,100	294,261.00	0.23
99	002460	赣锋锂业	2,900	293,480.00	0.23
100	601229	上海银行	37,300	292,432.00	0.23
101	00981	中芯国际	15,500	288,303.78	0.22
102	000338	潍柴动力	18,200	287,378.00	0.22
103	02688	新奥能源	3,000	287,335.90	0.22
104	00386	中国石油化工股份	97,901	285,918.97	0.22
105	002410	广联达	3,500	275,590.00	0.21
106	600009	上海机场	3,600	272,376.00	0.21
107	002230	科大讯飞	6,600	269,742.00	0.21
108	601169	北京银行	55,600	269,104.00	0.21
109	600588	用友网络	6,080	266,729.60	0.21
110	01918	融创中国	11,000	265,242.85	0.20
111	00960	龙湖地产	6,933	264,913.09	0.20
112	06186	中国飞鹤	17,000	259,831.10	0.20
113	00066	港铁公司	7,005	255,578.08	0.20
114	01093	石药集团	36,425	243,107.92	0.19
115	600196	复星医药	4,500	242,955.00	0.19
116	601766	中国中车	45,700	242,667.00	0.19
117	00688	中国海外发展	16,954	240,578.11	0.19
118	002271	东方雨虹	6,200	240,560.00	0.19
119	601818	光大银行	59,700	238,203.00	0.18
120	600893	航发动力	4,000	237,400.00	0.18
121	603986	兆易创新	1,200	237,000.00	0.18
122	600406	国电南瑞	8,700	231,159.00	0.18
123	06690	海尔智家	9,600	227,040.81	0.18
124	600703	三安光电	8,400	226,884.00	0.18
125	300601	康泰生物	1,300	226,850.00	0.18
126	002812	恩捷股份	1,600	226,848.00	0.18
127	600346	恒力石化	8,040	224,878.80	0.17
128	300142	沃森生物	5,800	223,648.00	0.17
129	06098	碧桂园服务	5,000	220,720.09	0.17
130	00384	中国燃气	8,371	216,997.35	0.17
131	000538	云南白药	1,900	215,840.00	0.17
132	002049	紫光国微	1,600	214,096.00	0.17
133	00006	电能实业	5,996	211,951.88	0.16
134	002493	荣盛石化	7,600	209,836.00	0.16
135	00914	安徽海螺水泥股份	5,000	204,308.11	0.16
136	600028	中国石化	50,200	202,306.00	0.16

137	600019	宝钢股份	33,900	201,705.00	0.16
138	601390	中国中铁	38,200	201,314.00	0.16
139	06862	海底捞	4,000	200,983.63	0.16
140	01658	邮储银行	38,000	140,082.56	0.11
140	601658	邮储银行	12,500	59,750.00	0.05
141	300454	深信服	800	198,408.00	0.15
142	002311	海大集团	3,000	196,500.00	0.15
143	01579	颐海国际	2,000	193,577.20	0.15
144	300413	芒果超媒	2,650	192,125.00	0.15
145	000768	中航西飞	5,200	190,736.00	0.15
146	000876	新希望	8,500	190,400.00	0.15
147	600745	闻泰科技	1,900	188,100.00	0.15
148	03333	中国恒大	14,947	187,441.90	0.14
149	000625	长安汽车	8,400	183,792.00	0.14
150	000895	双汇发展	3,900	183,066.00	0.14
151	601009	南京银行	22,600	182,608.00	0.14
152	600958	东方证券	15,700	182,591.00	0.14
153	00017	新世界发展	5,988	181,934.63	0.14
154	000776	广发证券	11,100	180,708.00	0.14
155	000166	申万宏源	34,100	180,048.00	0.14
156	601336	新华保险	3,100	179,707.00	0.14
157	01833	平安好医生	2,200	174,051.15	0.13
158	601633	长城汽车	4,600	173,926.00	0.13
159	002129	中环股份	6,800	173,400.00	0.13
160	002007	华兰生物	4,100	173,184.00	0.13
161	00992	联想集团	27,882	171,775.56	0.13
162	600919	江苏银行	31,400	171,444.00	0.13
163	300782	卓胜微	300	171,162.00	0.13
164	00788	中国铁塔	178,000	170,785.59	0.13
165	600741	华域汽车	5,900	170,038.00	0.13
166	000157	中联重科	17,100	169,290.00	0.13
167	00998	中信银行	39,948	110,615.84	0.09
167	601998	中信银行	11,400	58,254.00	0.05
168	01997	九龙仓置业	4,923	167,185.94	0.13
169	002050	三花智控	6,777	167,053.05	0.13
170	603993	洛阳钼业	26,600	166,250.00	0.13
171	00857	中国石油股份	82,000	165,634.75	0.13
172	002001	新和成	4,900	165,032.00	0.13
173	002179	中航光电	2,100	164,409.00	0.13
174	002371	北方华创	900	162,666.00	0.13
175	600547	山东黄金	6,844	161,655.28	0.12

176	001979	招商蛇口	12,100	160,809.00	0.12
177	00267	中信股份	33,913	156,698.53	0.12
178	600050	中国联通	34,800	155,208.00	0.12
179	00288	万洲国际	28,221	154,387.50	0.12
180	00101	恒隆地产	8,949	154,026.05	0.12
181	300408	三环集团	4,100	152,725.00	0.12
182	000786	北新建材	3,800	152,190.00	0.12
183	300999	金龙鱼	1,400	151,648.00	0.12
184	601857	中国石油	36,500	151,475.00	0.12
185	601066	中信建投	3,600	151,200.00	0.12
186	300433	蓝思科技	4,900	149,989.00	0.12
187	002841	视源股份	1,300	149,539.00	0.12
188	002555	三七互娱	4,700	146,781.00	0.11
189	002202	金风科技	10,200	145,350.00	0.11
190	600015	华夏银行	23,200	145,000.00	0.11
191	601006	大秦铁路	22,300	144,058.00	0.11
192	601989	中国重工	34,200	143,298.00	0.11
193	01876	百威亚太	6,600	142,203.49	0.11
194	601225	陕西煤业	15,200	141,968.00	0.11
195	00270	粤海投资	12,000	140,991.53	0.11
196	603160	汇顶科技	900	139,995.00	0.11
197	01193	华润燃气	4,000	138,870.60	0.11
198	01044	恒安国际	3,000	138,618.11	0.11
199	002008	大族激光	3,200	136,800.00	0.11
200	601186	中国铁建	17,300	136,670.00	0.11
201	002236	大华股份	6,700	133,263.00	0.10
202	002938	鹏鼎控股	2,600	129,142.00	0.10
203	002624	完美世界	4,350	128,325.00	0.10
204	02328	中国财险	25,873	127,823.66	0.10
205	300003	乐普医疗	4,700	127,746.00	0.10
206	03692	翰森制药	4,000	126,582.66	0.10
207	002600	领益智造	10,500	125,895.00	0.10
208	003816	中国广核	44,179	124,584.78	0.10
209	00151	中国旺旺	25,869	122,143.08	0.09
210	000783	长江证券	14,300	120,120.00	0.09
211	601360	三六零	7,600	119,396.00	0.09
212	601155	新城控股	3,400	118,422.00	0.09
213	00083	信和置业	13,929	118,404.36	0.09
214	002044	美年健康	10,320	116,925.60	0.09
215	00881	中升控股	2,500	116,251.53	0.09
216	600383	金地集团	8,600	116,100.00	0.09
217	601985	中国核电	23,400	115,128.00	0.09

218	00813	世茂房地产	5,500	114,336.79	0.09
219	601669	中国电建	29,100	112,908.00	0.09
220	000069	华侨城 A	15,700	111,313.00	0.09
221	000938	紫光股份	5,396	110,348.20	0.09
222	002024	苏宁易购	14,200	109,482.00	0.08
223	02018	瑞声科技	2,987	109,106.67	0.08
224	000596	古井贡酒	400	108,800.00	0.08
225	00656	复星国际	10,477	107,401.56	0.08
226	300144	宋城演艺	5,960	105,611.20	0.08
227	01038	长江基建集团	3,000	105,162.92	0.08
228	601138	工业富联	7,500	102,675.00	0.08
229	601933	永辉超市	14,300	102,674.00	0.08
230	000977	浪潮信息	3,800	102,144.00	0.08
231	300033	同花顺	800	99,184.00	0.08
232	002602	世纪华通	13,936	99,084.96	0.08
233	600029	南方航空	16,500	98,340.00	0.08
234	601800	中国交建	13,500	98,010.00	0.08
235	000425	徐工机械	17,800	95,586.00	0.07
236	01972	太古地产	4,800	91,099.11	0.07
237	600886	国投电力	10,500	90,720.00	0.07
238	00135	昆仑能源	16,000	90,223.81	0.07
239	00762	中国联通	24,000	89,887.15	0.07
240	00322	康师傅控股	8,000	89,146.51	0.07
241	000703	恒逸石化	6,910	88,448.00	0.07
242	002607	中公教育	2,500	87,825.00	0.07
243	600061	国投资本	6,300	87,129.00	0.07
244	000963	华东医药	3,280	87,116.80	0.07
245	601111	中国国航	11,300	84,637.00	0.07
246	000656	金科股份	11,900	84,371.00	0.07
247	300759	康龙化成	700	84,280.00	0.07
248	000708	中信特钢	3,800	82,802.00	0.06
249	00966	中国太平	7,000	82,362.89	0.06
250	00023	东亚银行	5,793	80,740.28	0.06
251	002157	正邦科技	4,700	80,088.00	0.06
252	002916	深南电路	740	79,964.40	0.06
253	600606	绿地控股	13,600	79,288.00	0.06
254	06808	高鑫零售	11,500	76,269.42	0.06
255	600340	华夏幸福	5,880	76,028.40	0.06
256	002252	上海莱士	10,200	75,480.00	0.06
257	601727	上海电气	13,800	74,520.00	0.06
258	300628	亿联网络	1,000	73,120.00	0.06

259	601816	京沪高铁	12,900	73,014.00	0.06
260	01313	华润水泥控股	10,000	72,886.02	0.06
261	00019	太古股份公司 A	2,000	72,381.04	0.06
262	01128	永利澳门	6,400	70,132.18	0.05
263	00004	九龙仓集团	3,950	69,315.37	0.05
264	002120	韵达股份	4,403	69,127.10	0.05
265	000617	中油资本	9,580	64,952.40	0.05
266	03380	龙光地产	6,000	64,132.97	0.05
267	601881	中国银河	4,800	60,048.00	0.05
268	600018	上港集团	13,100	59,867.00	0.05
269	00836	华润电力	7,977	56,059.92	0.04
270	002558	巨人网络	3,100	54,033.00	0.04
271	02282	美高梅中国	4,763	53,396.30	0.04
272	601319	中国人保	8,100	53,217.00	0.04
273	601916	浙商银行	12,800	52,224.00	0.04
274	002032	苏泊尔	600	46,794.00	0.04
275	601238	广汽集团	3,500	46,515.00	0.04
276	002939	长城证券	3,500	45,045.00	0.03
277	002153	石基信息	1,200	37,308.00	0.03
278	01929	周大福	4,400	36,106.36	0.03
279	03799	达利食品	8,500	31,691.95	0.02
280	600989	宝丰能源	2,700	31,590.00	0.02
281	600025	华能水电	6,700	29,882.00	0.02
282	603087	甘李药业	200	26,444.00	0.02
283	001965	招商公路	2,000	13,780.00	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	601995	中金公司	24,951	1,714,383.21	1.32
2	605377	华旺科技	750	14,977.50	0.01

### 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（%）
1	00700	腾讯控股	3,809,632.36	1.03
2	03690	美团点评-W	2,904,778.33	0.78
3	600519	贵州茅台	1,613,462.00	0.44



4	01299	友邦保险	1,325,522.22	0.36
5	601318	中国平安	1,266,766.00	0.34
6	02318	中国平安	1,133,584.80	0.31
7	00005	汇丰控股	1,089,837.70	0.29
8	601995	中金公司	1,025,805.54	0.28
9	600036	招商银行	952,138.00	0.26
10	00388	香港交易所	830,997.05	0.22
11	00939	建设银行	786,464.80	0.21
12	603288	海天味业	775,657.06	0.21
13	300760	迈瑞医疗	608,866.00	0.16
14	000858	五粮液	607,097.00	0.16
15	01810	小米集团-W	537,094.87	0.15
16	688266	泽璟制药	517,000.64	0.14
17	09633	农夫山泉	514,322.36	0.14
18	00941	中国移动	513,657.56	0.14
19	603501	韦尔股份	454,991.00	0.12
20	01398	工商银行	449,928.36	0.12

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	00700	腾讯控股	30,869,243.09	8.34
2	00005	汇丰控股	11,083,250.55	2.99
3	601318	中国平安	10,027,086.54	2.71
4	01299	友邦保险	9,752,459.25	2.63
5	00939	建设银行	8,212,055.67	2.22
6	600519	贵州茅台	7,707,807.00	2.08
7	03690	美团点评-W	7,282,717.18	1.97
8	02318	中国平安	5,331,446.09	1.44
9	01398	工商银行	4,940,318.59	1.33
10	600036	招商银行	4,500,724.00	1.22
11	00941	中国移动	4,220,802.40	1.14
12	00388	香港交易所	4,084,938.69	1.10
13	601658	邮储银行	3,805,009.16	1.03
14	688111	金山办公	3,734,541.40	1.01
15	600276	恒瑞医药	3,310,652.10	0.89
16	601166	兴业银行	3,160,331.19	0.85
17	03988	中国银行	2,693,904.19	0.73
18	000651	格力电器	2,648,670.00	0.72
19	000858	五粮液	2,596,710.00	0.70
20	00883	中国海洋石油	2,394,795.44	0.65

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	56,271,396.47
卖出股票收入（成交）总额	304,680,224.03

注：上述金额均指成交金额（成交单价乘以成交数量），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 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

无。

#### 8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

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之一建设银行（0939.HK，601939.SH）的发行主体中国建设银行股份有限公司于 2020 年 4 月 20 日因监管标准化数据（EAST）系统数据质量及数据报送存在违法违

规行为，受到中国银行保险监督管理委员会处罚（银保监罚决字〔2020〕8号），于2020年7月13日因内控管理不到位，支行原负责人擅自为同业投资违规提供担保并发生案件等，受到中国银行保险监督管理委员会处罚（银保监罚决字〔2020〕32号）。建设银行为本基金跟踪标的指数的成份股。

### 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	14,018.23
2	应收证券清算款	2,141,466.06
3	应收股利	3,590.74
4	应收利息	1,923.19
5	应收申购款	63,766.43
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	2,224,764.65

### 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	601995	中金公司	1,714,383.21	1.32	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

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 (%)
中华 300A	20,481	4,774.05	20,903,101.52	21.38	76,874,214.86	78.62
中华 300C	234	922.11	-	-	215,773.92	100.00
合计	20,715	4,730.54	20,903,101.52	21.33	77,089,988.78	78.67

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。

### 9.2 期末上市基金前十名持有人

中华 300A

序号	持有人名称	持有份额 (份)	占上市总份额比例 (%)
1	郑双双	114,928.00	18.96
2	陈钰林	100,000.00	16.50
3	杨凯	98,900.00	16.32
4	李宝良	50,908.00	8.40
5	于素芬	50,006.00	8.25
6	阮文军	41,585.00	6.86
7	曹立婷	25,000.00	4.13
8	吴晟铠	21,300.00	3.51
9	张森	20,000.00	3.30
10	李建中	10,200.00	1.68

以上数据由中国证券登记结算有限公司提供，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

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	中华 300A	126,632.27	0.1295
	中华 300C	8.26	0.0038

有本基金			
	合计	126,640.53	0.1292

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）。

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

无。

### § 10 开放式基金份额变动

单位：份

项目	中华 300A	中华 300C
基金合同生效日 (2019年3月20日) 基金份额总额	1,968,326,601.16	-
本报告期期初基金份额总额	351,061,620.03	-
本报告期基金总申购份额	230,584,234.37	475,833.92
减：本报告期基金总赎回份额	483,868,538.02	260,060.00
本报告期基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-	-
本报告期期末基金份额总额	97,777,316.38	215,773.92

## § 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

1. 2020 年 12 月 28 日, 经大成基金管理有限公司 2020 年第一次临时股东会审议通过, 选举林昌先生担任公司股东董事, 翟斌先生不再担任公司股东董事。

2. 2020 年 12 月 28 日, 经大成基金管理有限公司第七届董事会第八次会议审议通过, 选举林昌先生担任公司第七届董事会副董事长, 同时, 选举其担任第七届董事会合规与风险管理委员会委员, 第七届董事会审计委员会委员。翟斌先生不再担任公司第七届董事会副董事长、第七届董事会合规与风险管理委员会委员、第七届董事会审计委员会委员。

上述变更详见公司相关公告。

#### 二、基金托管人的基金托管部门的重大人事变动

2020 年 8 月, 中国农业银行总行决定刘琳任托管业务部副总裁。

### 11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

无。

### 11.4 基金投资策略的改变

无。

### 11.5 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), 本年度应支付的审计费用为 6 万元整。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。

### 11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内, 基金管理人、托管人及其相关高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

### 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	股票交易	应支付该券商的佣金	备注
------	-----	------	-----------	----

	元数量	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	202,895,495.28	57.02%	176,522.87	57.93%	-
中金公司	3	126,503,236.13	35.55%	104,100.98	34.16%	-
海通证券	1	23,828,039.53	6.70%	21,714.99	7.13%	-
兴业证券	2	2,047,172.00	0.58%	1,865.72	0.61%	-
中泰证券	2	573,000.00	0.16%	522.16	0.17%	-
爱建证券	1	-	-	-	-	-
安信证券	1	-	-	-	-	-
川财证券	1	-	-	-	-	-
第一创业	1	-	-	-	-	-
东北证券	2	-	-	-	-	-
东方证券	1	-	-	-	-	-
东吴证券	1	-	-	-	-	-
东兴证券	1	-	-	-	-	-
方正证券	1	-	-	-	-	-
高华证券	1	-	-	-	-	-
广发证券	2	-	-	-	-	-
国金证券	2	-	-	-	-	-
国盛证券	1	-	-	-	-	-
国泰君安	3	-	-	-	-	-
国信证券	1	-	-	-	-	-
红塔证券	1	-	-	-	-	-
华创证券	1	-	-	-	-	-
华泰证券	1	-	-	-	-	-
华西证券	1	-	-	-	-	-
联讯证券	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	2	-	-	-	-	-
世纪证券	1	-	-	-	-	-
天风证券	2	-	-	-	-	-
万和证券	1	-	-	-	-	-
西部证券	1	-	-	-	-	-
西藏东财	1	-	-	-	-	-
湘财证券	1	-	-	-	-	-
信达证券	1	-	-	-	-	-
招商证券	2	-	-	-	-	-
浙商证券	1	-	-	-	-	-
中国银河证 券	4	-	-	-	-	-
中信建投证 券	2	-	-	-	-	-
中信证券	2	-	-	-	-	-
中银国际证 券	1	-	-	-	-	-
中原证券	1	-	-	-	-	-

注：根据中国证监会颁布的《关于完善证券投资基金交易席位制度有关问题的通知》（证监基金字[2007]48号）的有关规定，本公司制定了租用证券公司交易单元的选择标准和程序。

租用证券公司交易单元的选择标准主要包括：

- (1) 财务状况良好，最近一年无重大违规行为；
- (2) 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；
- (3) 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；
- (4) 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；

(5) 能提供投资组合运作、管理所需的其他券商服务；

(6) 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。

租用证券公司交易单元的程序：首先根据租用证券公司交易单元的选择标准形成《券商服务评价表》，然后根据评分高低进行选择基金专用席位。

本报告期内增加交易单元：信达证券。本报告期内退租交易单元：长城证券。

### 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	-	-	-	-	839.08	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	关于再次提请投资者及时更新已过期身份证件或者身份证明文件的公告	中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站	2020年12月31日
2	大成中华沪深港 300 指数证券投资基金 (LOF) 2021 年境外主要市场节假日暂停申购赎回安排的公告	中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站	2020年12月30日
3	大成基金管理有限公司关于旗下部分基金增加中国人寿保险股份有限公司为销售机构的公告	中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站	2020年12月25日
4	大成中华沪深港 300 指数证券投资基金 (LOF) 暂停申购、赎回及定投业务的公告	中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站	2020年12月24日
5	大成基金管理有限公司关于提示泰诚财富基金销售 (大连) 有限公司代销客户及时办理转托管业务的公告	中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站	2020年12月17日
6	大成基金管理有限公司关于旗下部分基金增加北京汇成基金销售有限公司为销售机构的公告	中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站	2020年12月17日
7	大成中华沪深港 300 指数证券投资基金 (LOF) 招募说明书更新	中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站	2020年12月2日
8	大成中华沪深港 300 指数证券投资基金 (LOF) 托管协议更新	中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站	2020年12月2日

9	大成中华沪深港 300 指数证券投资基金 (LOF) 基金合同更新	中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站	2020 年 12 月 2 日
10	大成中华沪深港 300 指数证券投资基金 (LOF) 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	2020 年 12 月 2 日
11	大成中华沪深港 300 指数证券投资基金 (LOF) 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	2020 年 12 月 2 日
12	关于调整旗下部分基金投资范围、增加侧袋机制并相应修改法律文件的公告	中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站	2020 年 12 月 1 日
13	大成基金管理有限公司关于旗下部分基金增加兴业银行股份有限公司为销售机构的公告	中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站	2020 年 11 月 5 日
14	大成基金管理有限公司关于旗下部分基金增加上海天天基金销售有限公司为销售机构的公告	中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站	2020 年 10 月 30 日
15	大成中华沪深港 300 指数证券投资基金 (LOF) 第三季度报告	中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站	2020 年 10 月 28 日
16	大成中华沪深港 300 指数证券投资基金 (LOF) 暂停申购、赎回及定投业务的公告	中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站	2020 年 10 月 23 日
17	大成中华沪深港 300 指数证券投资基金 (LOF) 暂停申购、赎回及定投业务的公告	中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站	2020 年 10 月 14 日
18	大成中华沪深港 300 指数证券投资基金 (LOF) 暂停申购、赎回及定投业务的公告	中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站	2020 年 9 月 26 日
19	大成中华沪深港 300 指数证券投资基金 (LOF) 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	2020 年 8 月 27 日
20	大成中华沪深港 300 指数证券投资基金 (LOF) 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	2020 年 8 月 27 日
21	大成中华沪深港 300 指数证券投资基金 (LOF) 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	2020 年 8 月 28 日
22	大成基金管理有限公司关于旗下部分基金增加蚂蚁(杭州)基金销售有限公司为销售机构的公告	中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站	2020 年 8 月 4 日
23	大成中华沪深港 300 指数证券投资基金 (LOF) 第二季度报告	中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本	2020 年 7 月 21 日

		公司网站	
24	大成基金管理有限公司关于旗下部分基金增加上海基煜基金销售有限公司为销售机构的公告	中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站	2020 年 7 月 9 日
25	关于再次提请投资者及时更新已过期身份证件或者身份证明文件的公告	中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站	2020 年 7 月 1 日
26	大成中华沪深港 300 指数证券投资基金 (LOF) 暂停申购、赎回及定投业务的公告	中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站	2020 年 6 月 29 日
27	大成中华沪深港 300 指数证券投资基金 (LOF) 暂停申购、赎回及定投业务的公告	中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站	2020 年 6 月 19 日
28	大成基金管理有限公司关于旗下部分基金增加安信证券股份有限公司为销售机构的公告	中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站	2020 年 6 月 18 日
29	大成基金关于旗下部分基金增加中信证券华南股份有限公司为销售机构的公告	中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站	2020 年 5 月 6 日
30	大成中华沪深港 300 指数 (LOF) 2019 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	2020 年 4 月 29 日
31	大成基金关于终止泰诚财富基金销售 (大连) 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	2020 年 4 月 25 日
32	大成中华沪深港 300 指数 (LOF) 基金暂停申购、赎回及定投业务的公告	中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站	2020 年 4 月 24 日
33	大成中华沪深港 300 指数 (LOF) 2020 年第一季度报告	中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站	2020 年 4 月 21 日
34	大成中华沪深港 300 指数 (LOF) 招募说明书摘要更新	中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站	2020 年 4 月 21 日
35	大成中华沪深港 300 指数 (LOF) 招募说明书更新	中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站	2020 年 4 月 21 日
36	大成中华沪深港 300 指数 (LOF) 基金暂停 (大额) 申购 (转换转入、赎回、转换转出、定期定额投资) 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	2020 年 4 月 9 日
37	大成中华沪深港 300 指数 (LOF) 基金暂停申购、赎回及定投业务的公告	中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站	2020 年 4 月 1 日
38	大成基金管理有限公司关于延迟披露	中国证监会基金电子披	2020 年 3 月 25 日

	旗下公募基金 2019 年年度报告的公告	露网站、规定报刊及本公司网站	
39	大成基金管理有限公司关于注销南京分公司的公告	中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站	2020 年 3 月 21 日
40	大成基金管理有限公司关于注销青岛分公司的公告	中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站	2020 年 2 月 29 日
41	大成中沪深港 300 指数 (LOF) 增设 C 类基金份额并相应修订基金合同和托管协议的公告	中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站	2020 年 2 月 29 日
42	大成中沪深港 300 指数 (LOF) 托管协议更新	中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站	2020 年 2 月 29 日
43	大成中沪深港 300 指数 (LOF) 基金合同更新	中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站	2020 年 2 月 29 日
44	大成中沪深港 300 指数 (LOF) 招募说明书摘要更新	中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站	2020 年 2 月 29 日
45	大成中沪深港 300 指数 (LOF) 招募说明书更新	中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站	2020 年 2 月 29 日
46	大成基金关于 APP 交易平台汇款交易费率优惠的公告	中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站	2020 年 2 月 26 日
47	大成基金管理有限公司关于 2020 年春节假期延长期间调整公司公募基金开放时间等相关事宜的公告	中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站	2020 年 1 月 30 日
48	大成中沪深港 300 指数 (LOF) 基金暂停申购、赎回及定投业务的公告	中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站	2020 年 1 月 17 日
49	大成中沪深港 300 指数 (LOF) 2019 年第四季度报告	中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站	2020 年 1 月 17 日
50	大成中沪深港 300 指数 (LOF) 2020 年境外主要市场节假日暂停申购赎回安排的公告	中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站	2020 年 1 月 4 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

投资者类	报告期内持有基金份额变化情况	报告期末持有基金情况
------	----------------	------------

别	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	20200302-20201231	20,606,903.66	-	-	20,606,903.66	21.03
个人	-	-	-	-	-	-	-
-	-	-	-	-	-	-	-
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。							

## 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中华沪深港 300 指数证券投资基金 (LOF) 的文件;
- 2、《大成中华沪深港 300 指数证券投资基金 (LOF) 基金合同》;
- 3、《大成中华沪深港 300 指数证券投资基金 (LOF) 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、本报告期内在指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

2021 年 3 月 30 日