

# 大成沪深 300 指数证券投资基金 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。安永华明会计师事务所(特殊普通合伙)为本基金出具了无保留意见的审计报告，请投资者注意阅读。

本报告期自 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 .....	5
2.4 信息披露方式 .....	6
2.5 其他相关资料 .....	6
<b>§ 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况</b> .....	<b>6</b>
3.1 主要会计数据和财务指标 .....	6
3.2 基金净值表现 .....	7
3.3 过去三年基金的利润分配情况 .....	10
<b>§ 4 管理人报告</b> .....	<b>10</b>
4.1 基金管理人及基金经理情况 .....	10
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明 .....	12
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明 .....	12
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明 .....	13
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望 .....	14
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况 .....	14
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明 .....	15
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明 .....	16
4.9 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明 .....	16
<b>§ 5 托管人报告</b> .....	<b>16</b>
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明 .....	16
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明 .....	16
5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见 .....	17
<b>§ 6 审计报告</b> .....	<b>17</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 .....	20
7.3 所有者权益（基金净值）变动表 .....	21
7.4 报表附注 .....	22
<b>§ 8 投资组合报告</b> .....	<b>49</b>
8.1 期末基金资产组合情况 .....	49
8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合 .....	50

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 .....	51
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动 .....	59
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合 .....	61
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 .....	61
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 .....	61
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 .....	61
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 .....	61
8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明 .....	61
8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 .....	61
8.12 投资组合报告附注 .....	61
<b>§ 9 基金份额持有人信息 .....</b>	<b>63</b>
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....	63
9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....	63
9.3 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 .....	63
9.4 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 .....	64
<b>§ 10 开放式基金份额变动 .....</b>	<b>64</b>
<b>§ 11 重大事件揭示 .....</b>	<b>64</b>
11.1 基金份额持有人大会决议 .....	64
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 .....	64
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....	65
11.4 基金投资策略的改变 .....	65
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....	65
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 .....	65
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	65
11.8 其他重大事件 .....	68
<b>§ 12 影响投资者决策的其他重要信息 .....</b>	<b>70</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 .....	70
12.2 影响投资者决策的其他重要信息 .....	71
<b>§ 13 备查文件目录 .....</b>	<b>71</b>
13.1 备查文件目录 .....	71
13.2 存放地点 .....	71
13.3 查阅方式 .....	71

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	大成沪深 300 指数证券投资基金	
基金简称	大成沪深 300 指数	
基金主代码	519300	
前端交易代码	519300	
后端交易代码	519301	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2006 年 4 月 6 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	1,350,512,298.77 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	大成沪深 300 指数 A	大成沪深 300 指数 C
下属分级基金的交易代码	519300	007096
报告期末下属分级基金的份额总额	1,348,387,265.57 份	2,125,033.20 份

### 2.2 基金产品说明

投资目标	通过严格的投资程序约束和数量化风险管理手段，实现指数投资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%，年跟踪误差不超过 4%。
投资策略	本基金采用被动式指数投资策略。原则上，股票投资组合的构建主要按照标的指数的成份股组成及其权重来拟合、复制标的指数，并原则上根据标的指数成份股及其权重的变动而进行相应调整。
业绩比较基准	沪深 300 指数
风险收益特征	本基金为指数基金，是风险中等、获得证券市场平均收益率的产品。

### 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	安永华明会计师事务所(特殊普通合伙)	北京市东城区东长安街1号东方广场安永大楼17层01-12室
注册登记机构	中国证券登记结算有限责任公司	北京市西城区太平桥大街17号

## §3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

## 3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	2020 年		2019 年		2018 年	
	大成沪深 300 指数 A	大成沪深 300 指数 C	大成沪深 300 指数 A	大成沪深 300 指数 C	大成沪深 300 指数 A	大成沪深 300 指数 C
本期已实现收益	370,132,406.92	1,212,463.81	72,050,654.79	1,179.74	-9,967,494.64	-
本期利润	481,864,757.22	-1,013,453.85	530,333,179.95	4,751.57	-439,540,141.96	-
加权平均基金份额本期利润	0.3035	-0.6439	0.2779	0.0780	-0.2463	-
本期加权平均净值利润率	26.47%	-52.22%	27.30%	7.41%	-25.06%	-
本期基金份额净值增长率	29.70%	29.37%	33.89%	10.16%	-23.44%	-
3.1.2 期末数据和指标	2020 年末		2019 年末		2018 年末	
	大成沪深 300 指数 A	大成沪深 300 指数 C	大成沪深 300 指数 A	大成沪深 300 指数 C	大成沪深 300 指数 A	大成沪深 300 指数 C
期末可供分配利润	498,474,395.29	774,058.70	207,009,286.64	14,691.56	-325,880,783.24	-
期末可供分配基金份额利润	0.3697	0.3643	0.1122	0.1107	-0.1693	-
期末基金资产净值	1,846,861,660.86	2,899,091.90	2,052,189,960.70	147,446.40	1,598,586,681.03	-
期末基金份额净值	1.3697	1.3643	1.1122	1.1107	0.8307	-
3.1.3 累计期末指标	2020 年末		2019 年末		2018 年末	
	大成沪深 300 指数 A	大成沪深 300 指数 C	大成沪深 300 指数 A	大成沪深 300 指数 C	大成沪深 300 指数 A	大成沪深 300 指数 C

基金份额累计净值增长率	316.47%	42.51%	221.11%	10.16%	139.84%	-
-------------	---------	--------	---------	--------	---------	---

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。

4、根据我公司 2019 年 3 月 8 日《关于大成沪深 300 指数证券投资基金增设 C 类基金份额并相应修订基金合同和托管协议的公告》，自 2019 年 3 月 11 日起，大成沪深 300 指数证券投资基金增设 C 类份额。本报告关于 C 类份额的指标计算起始日为 C 类份额的初始申购确认日。

### 3.2 基金净值表现

#### 3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

大成沪深 300 指数 A

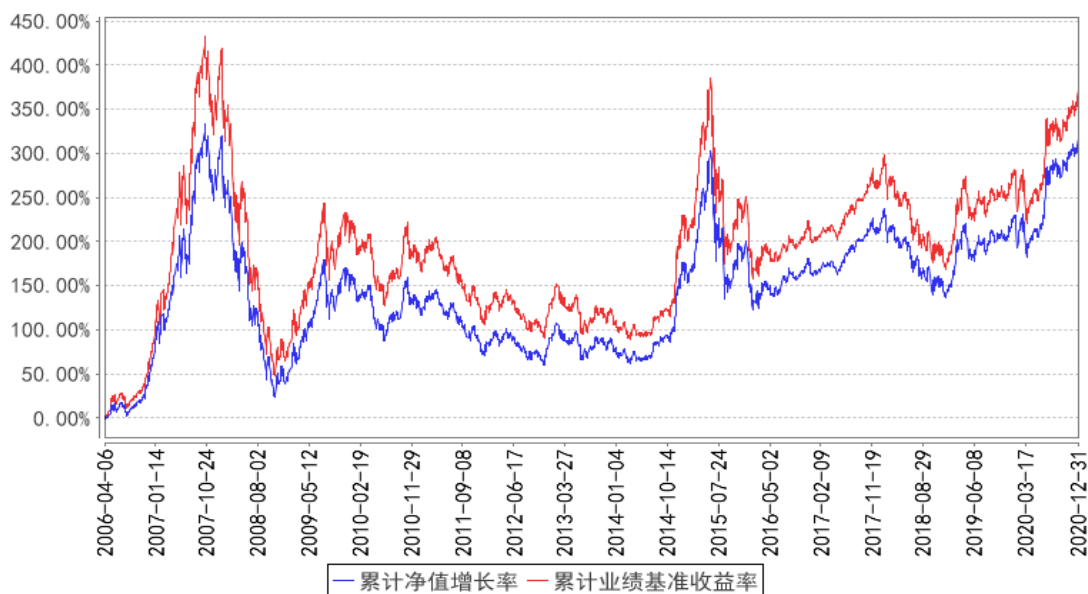
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	11.35%	0.92%	13.60%	0.99%	-2.25%	-0.07%
过去六个月	25.75%	1.24%	25.15%	1.35%	0.60%	-0.11%
过去一年	29.70%	1.33%	27.21%	1.43%	2.49%	-0.10%
过去三年	32.95%	1.25%	29.28%	1.34%	3.67%	-0.09%
过去五年	43.57%	1.17%	39.68%	1.25%	3.89%	-0.08%
自基金合同生效起至今	316.47%	1.64%	372.36%	1.73%	-55.89%	-0.09%

大成沪深 300 指数 C

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	11.32%	0.92%	13.60%	0.99%	-2.28%	-0.07%
过去六个月	25.50%	1.24%	25.15%	1.35%	0.35%	-0.11%
过去一年	29.37%	1.33%	27.21%	1.43%	2.16%	-0.10%
自基金合同生效起至今	42.51%	1.22%	40.90%	1.31%	1.61%	-0.09%

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

大成沪深300指数A累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图





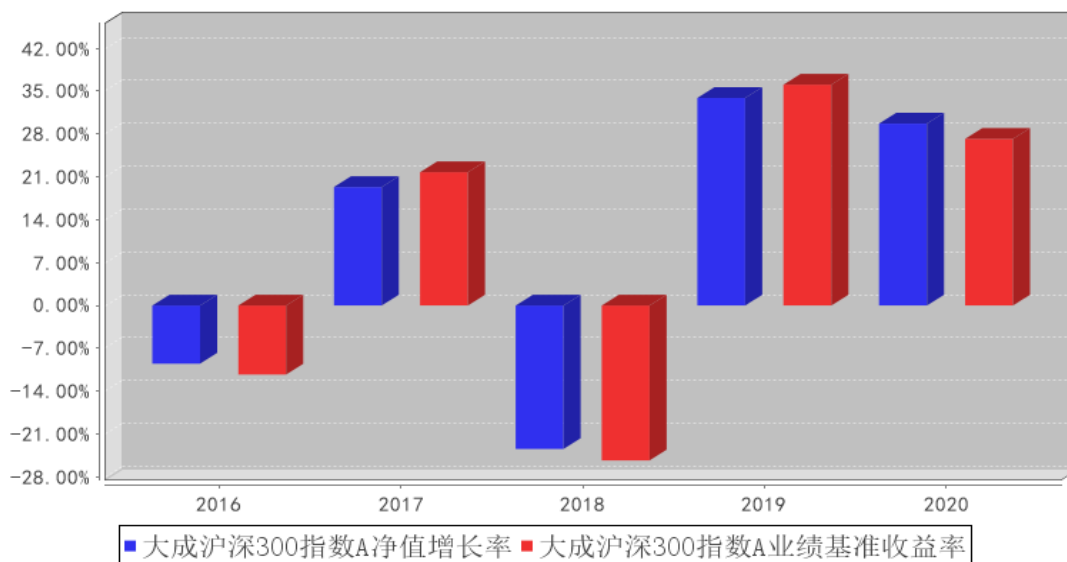
大成沪深300指数C累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



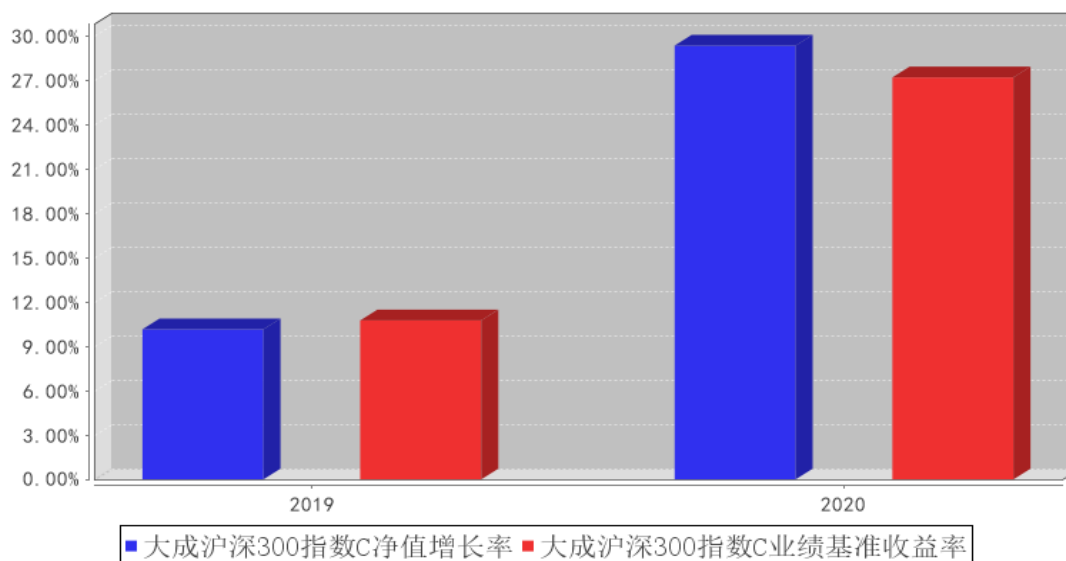
注：本基金合同规定，基金管理人应当自基金合同生效之日起六个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的约定。建仓期结束时，本基金的投资组合比例符合基金合同的约定。

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

大成沪深300指数A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



大成沪深300指数C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

单位：人民币元

大成沪深 300 指数 A

年度	每 10 份基金份额分红数	现金形式发放总额	再投资形式发放总额	年度利润分配合计	备注
2020 年	0.5700	56,937,952.61	46,709,885.56	103,647,838.17	-
2019 年	-	-	-	-	-
2018 年	0.8130	70,836,598.34	68,847,119.25	139,683,717.59	-
合计	1.3830	127,774,550.95	115,557,004.81	243,331,555.76	-

大成沪深 300 指数 C

年度	每 10 份基金份额分红数	现金形式发放总额	再投资形式发放总额	年度利润分配合计	备注
2020 年	0.5700	1,768.44	5,808.17	7,576.61	-
2019 年	-	-	-	-	-
合计	0.5700	1,768.44	5,808.17	7,576.61	-

## § 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		
张钟玉	本基金基金经理	2015 年 8 月 26 日	-	10 年	会计学硕士。2010 年 7 月加入大成基金管理有限公司，曾担任研究部研究员、数量与指数投资部数量分析师、基金经理助理。2015 年 2 月 28 日起任大成核心双动力混合型证券投资基金基金经理（更名前为大成核心双动力股票型证券投资基金）。2015 年 5 月 23 日起任深证成长 40 交易型开放式指数证券投资基金、大成深证成长 40 交易型开放式指数证券投资基金联接基金、大成中证 500 深市交易型开放式指数证券投资基金基金经理。2015 年 8 月 26 日起任大成沪深 300 指数证券投资基金基金经理。2019 年 9 月 26 日起任大成 MSCI 中国 A 股质优价值 100 交易型开放式指数证券投资基金、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。具有基金从业资格。国籍：中国
苏秉毅	本基金基金经理，数量与指数投资部副总监	2016 年 3 月 4 日	-	16 年	经济学硕士。2004 年 9 月至 2008 年 5 月就职于华夏基金管理有限公司基金运作部。2008 年加入大成基金管理有限公司，曾担任规划发展部高级产品设计师、数量与指数投资部基金经理助理，现任数量与指数投资部副总监。2012 年 8 月 28 日至 2014 年 1 月 23 日任大成中证 500 沪市交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理。2014 年 1 月 24 日至 2014 年 2 月 17 日任大成健康产业股票型证券投资基金基金经理。2012 年 2 月 9 日至 2014 年 9 月 11 日任深证成长 40 交易型开放式指数

					证券投资基金及大成深证成长 40 交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理。2012 年 8 月 24 日起任中证 500 沪市交易型开放式指数证券投资基金基金经理。2013 年 1 月 1 日至 2015 年 8 月 25 日任大成沪深 300 指数证券投资基金基金经理。2013 年 2 月 7 日起任大成中证 100 交易型开放式指数证券投资基金基金经理。2015 年 6 月 5 日起任大成深证成份交易型开放式指数证券投资基金基金经理。2015 年 6 月 29 日至 2020 年 11 月 13 日任大成中证互联网金融指数分级证券投资基金基金经理。2016 年 3 月 4 日起任大成核心双动力混合型证券投资基金、大成沪深 300 指数证券投资基金基金经理。2018 年 6 月 26 日起任大成景恒混合型证券投资基金基金经理。具有基金从业资格。国籍：中国
--	--	--	--	--	--

注：1、任职日期、离任日期为本基金管理人作出决定之日。

2、证券从业年限的计算标准遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

3、本基金经理张钟玉自 2020 年 6 月 29 日起休产假。在产假期间，由共同管理该基金的基金经理苏秉毅先生继续管理。上述事项已按有关法规进行披露并向中国证监会深圳证监局备案。

#### 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遵规守信情况的说明

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

#### 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

##### 4.3.1 公平交易制度和控制方法

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、业绩评估等与投资管理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 年是充满动荡的一年。由于史无前例的疫情，宏观经济运行偏离了既有轨道，外部环境也面临巨大变局。尽管疫情虽然已经得到一定控制，但时至今日仍无法根治，持续影响社会运作和世界格局。由于疫情的影响，各国都释放了天量流动性来对冲受损的经济，对资产价格产生了重大的冲击。相对而言，我国控制疫情较为出色，经济也更快复苏。

受疫情和流动性的影响，A 股市场经历了较大的波动。以春节前后新冠肺炎的爆发为转折点，节后市场一度暴跌，相关部门及时出手，股市从流动性危机的边缘被挽救回来，并在流动性和情绪驱动下走出一波反弹行情。三月份海外疫情进一步蔓延并引发了各类资产的史诗级波动，也导致了 A 股产生系统性调整，随后市场利空出尽站稳，并走出了一波可观的行情。尤其是三季度，各类股票均有较大的涨幅，风格也趋于均衡，而四季度则分化较大，机构重仓股的上涨和大量股

票的下跌形成鲜明对比。

经过反复剧烈波动，全年市场基准沪深 300 指数大幅上涨 27.21%。行业和风格分化较大，机构持仓较为集中的板块优势明显。成长风格大幅领先价值风格，创业板指成为全年表现最为优异的主流宽基指数，涨幅高达 65%。在行业板块方面，消费、新能源、军工、医药等板块表现较好，“赛道”优势淋漓尽致；而房地产、通讯、建筑等行业则表现较弱。

本基金标的指数沪深 300 指数上涨 27.21%。全年本基金申购赎回和份额交易情况均较为平稳。本基金基本保持满仓运作，严格根据标的指数成分股调整以及权重的变化及时调整投资组合。各项操作与指标均符合基金合同的要求。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末大成沪深 300 指数 A 的基金份额净值为 1.3697 元，本报告期基金份额净值增长率为 29.70%，同期业绩比较基准收益率为 27.21%；截至本报告期末大成沪深 300 指数 C 的基金份额净值为 1.3643 元，本报告期基金份额净值增长率为 29.37%，同期业绩比较基准收益率为 27.21%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望明年，疫情冲击还未完全散去，但曙光已在不远处，宏观经济复苏确定性非常高。但另一方面，各国为了对冲疫情所推出的刺激政策有可能逐步退出，政策退出的节奏和力度，将是影响全球资产价格的主要因素。

对于股票市场，我们持中性偏谨慎的观点。一方面，国家对股市依然非常重视，发生系统性风险的可能性很小。另一方面，由于全球供需阶段性错配，大宗商品已有不小的涨幅，存在一定的输入性通胀压力，这将对货币政策空间构成制约。而部分股票估值已经明显泡沫化，若流动性边际收紧，有可能出现大幅调整。

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

#### 4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

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

本基金管理人将严格按照本基金基金合同的规定进行收益分配。本报告期内大成沪深 300 已分配利润 103,655,414.78（每十份基金份额分红 0.5700 元），符合基金合同规定的分红比例。

#### 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	大成沪深 300 指数证券投资基金全体基金份额持有人
审计意见	<p>我们审计了大成沪深 300 指数证券投资基金的财务报表（以下简称“大成沪深 300 指数基金”），包括 2020 年 12 月 31 日的资产负债表，2020 年度的利润表、所有者权益（基金净值）变动表以及相关财务报表附注。</p> <p>我们认为，后附的大成沪深 300 指数基金的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则的规定编制，公允反映了大成沪深 300 指数证券投资基金 2020 年 12 月 31 日的财务状况以及 2020 年度的经营成果和净值变动情况。</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。按照中国注册会计师职业道德守则，我们独立于大成沪深 300 指数基金，并履行了职业道德方面的其他责任。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>
其他信息	<p>大成沪深 300 指数证券投资基金管理层对其他信息负责。其他信息包括年度报告中涵盖的信息，但不包括财务报表和我们的审计报告。</p> <p>我们对财务报表发表的审计意见不涵盖其他信息，我们也不对其他信息发表任何形式的鉴证结论。</p> <p>结合我们对财务报表的审计，我们的责任是阅读其他信息，在此过程中，考虑其他信息是否与财务报表或我们在审计过程中了解到的情况存在重大不一致或者似乎存在重大错报。基于我们已执行的工作，如果我们确定其他信息存在重大错报，我们应当报告该事实。在这方面，我们无任何事项需要报告。</p>
管理层和治理层对财务报表的责任	<p>管理层负责按照企业会计准则的规定编制财务报表，使其实现公允反映，并设计、执行和维护必要的内部控制，以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。</p> <p>在编制财务报表时，管理层负责评估大成沪深 300 指数基金的持续经营能力，披露与持续经营相关的事项（如适用），并</p>

	运用持续经营假设，除非计划进行清算、终止运营或别无其他现实的选择。 治理层负责监督大成沪深 300 指数基金的财务报告过程。
注册会计师对财务报表审计的责任	<p>我们的目标是对财务报表整体是否不存在由于舞弊或错误导致的重大错报获取合理保证，并出具包含审计意见的审计报告。合理保证是高水平的保证，但并不能保证按照审计准则执行的审计在某一重大错报存在时总能发现。错报可能由于舞弊或错误导致，如果合理预期错报单独或汇总起来可能影响财务报表使用者依据财务报表作出的经济决策，则通常认为错报是重大的。</p> <p>在按照审计准则执行审计工作的过程中，我们运用职业判断，并保持职业怀疑。同时，我们也执行以下工作：</p> <p>(1) 识别和评估由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险，设计和实施审计程序以应对这些风险，并获取充分、适当的审计证据，作为发表审计意见的基础。由于舞弊可能涉及串通、伪造、故意遗漏、虚假陈述或凌驾于内部控制之上，未能发现由于舞弊导致的重大错报的风险高于未能发现由于错误导致的重大错报的风险。</p> <p>(2) 了解与审计相关的内部控制，以设计恰当的审计程序，但目的并非对内部控制的有效性发表意见。</p> <p>(3) 评价管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计及相关披露的合理性。</p> <p>(4) 对管理层使用持续经营假设的恰当性得出结论。同时，根据获取的审计证据，就可能对大成沪深 300 指数基金持续经营能力产生重大疑虑的事项或情况是否存在重大不确定性得出结论。如果我们得出结论认为存在重大不确定性，审计准则要求我们在审计报告中提请报表使用者注意财务报表中的相关披露；如果披露不充分，我们应当发表非无保留意见。我们的结论基于截至审计报告日可获得的信息。然而，未来的事项或情况可能导致大成沪深 300 指数基金不能持续经营。</p> <p>(5) 评价财务报表的总体列报（包括披露）、结构和内容，并评价财务报表是否公允反映相关交易和事项。</p> <p>我们与治理层就计划的审计范围、时间安排和重大审计发现等事项进行沟通，包括沟通我们在审计中识别出的值得关注的内部控制缺陷。</p>
会计师事务所的名称	安永华明会计师事务所(特殊普通合伙)
注册会计师的姓名	昌华   高鹤
会计师事务所的地址	北京市东城区东长安街1号东方广场安永大楼17层01-12室
审计报告日期	2021年3月29日

## § 7 年度财务报表

### 7.1 资产负债表

会计主体：大成沪深 300 指数证券投资基金

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	129,405,463.54	28,756,908.71
结算备付金		818,678.59	788,709.41
存出保证金		196,685.14	131,592.88
交易性金融资产	7.4.7.2	1,726,079,936.76	2,023,496,924.50
其中：股票投资		1,726,079,936.76	1,943,472,924.50
基金投资		-	-
债券投资		-	80,024,000.00
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		1,919,386.89	2,447,528.54
应收利息	7.4.7.5	26,216.70	2,000,341.58
应收股利		-	-
应收申购款		1,044,094.26	604,145.11
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.6	-	-
资产总计		1,859,490,461.88	2,058,226,150.73
<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		-	-
应付赎回款		7,310,930.49	3,429,301.12
应付管理人报酬		1,156,639.89	1,278,450.92
应付托管费		231,327.96	255,690.20
应付销售服务费		151.83	11.33
应付交易费用	7.4.7.7	773,005.94	788,235.69
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	257,653.01	137,054.37
负债合计		9,729,709.12	5,888,743.63
<b>所有者权益：</b>			

实收基金	7.4.7.9	1,350,512,298.77	1,845,313,428.90
未分配利润	7.4.7.10	499,248,453.99	207,023,978.20
所有者权益合计		1,849,760,752.76	2,052,337,407.10
负债和所有者权益总计		1,859,490,461.88	2,058,226,150.73

注：报告截止日 2020 年 12 月 31 日，基金份额总额 1,350,512,298.77 份，其中大成沪深 300 指数 A 基金份额总额为 1,348,387,265.57 份，基金份额净值 1.3697 元；大成沪深 300 指数 C 基金份额总额为 2,125,033.20 份，基金份额净值 1.3643 元。

## 7.2 利润表

会计主体：大成沪深 300 指数证券投资基金

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 1 月 1 日至 2019 年 12 月 31 日
一、收入		503,307,908.38	552,925,058.16
1. 利息收入		971,448.14	2,556,331.21
其中：存款利息收入	7.4.7.11	932,478.28	385,591.48
债券利息收入		38,969.86	2,170,739.73
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	-
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		392,239,246.56	91,579,420.82
其中：股票投资收益	7.4.7.12	358,093,181.99	52,331,404.53
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.13	49,040.00	-232,480.00
资产支持证券投资收益		-	-
贵金属投资收益	7.4.7.14	-	-
衍生工具收益	7.4.7.15	-	-
股利收益	7.4.7.16	34,097,024.57	39,480,496.29
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.17	109,506,432.64	458,286,096.99
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	590,781.04	503,209.14
减：二、费用		22,456,605.01	22,587,126.64

1. 管理人报酬	7.4.10.2.1	13,664,967.36	14,546,508.32
2. 托管费	7.4.10.2.2	2,732,993.43	2,909,301.67
3. 销售服务费	7.4.10.2.3	1,897.67	51.68
4. 交易费用	7.4.7.19	5,778,373.29	4,853,582.89
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 税金及附加		-	-
7. 其他费用	7.4.7.20	278,373.26	277,682.08
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		480,851,303.37	530,337,931.52
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		480,851,303.37	530,337,931.52

### 7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：大成沪深 300 指数证券投资基金

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）	1,845,313,428.90	207,023,978.20	2,052,337,407.10
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	480,851,303.37	480,851,303.37
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）	-494,801,130.13	-84,971,412.80	-579,772,542.93
其中：1. 基金申购款	357,670,841.80	45,177,980.86	402,848,822.66
2. 基金赎回款	-852,471,971.93	-130,149,393.66	-982,621,365.59
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）	-	-103,655,414.78	-103,655,414.78

五、期末所有者权益(基金净值)	1,350,512,298.77	499,248,453.99	1,849,760,752.76
项目	上年度可比期间 2019年1月1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)	1,924,467,464.27	-325,880,783.24	1,598,586,681.03
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	530,337,931.52	530,337,931.52
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)	-79,154,035.37	2,566,829.92	-76,587,205.45
其中：1. 基金申购款	491,094,981.87	12,067,088.54	503,162,070.41
2. 基金赎回款	-570,249,017.24	-9,500,258.62	-579,749,275.86
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)	1,845,313,428.90	207,023,978.20	2,052,337,407.10

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

大成沪深 300 指数证券投资基金(以下简称“本基金”),系经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监基金字[2006]24 号文《关于同意大成沪深 300 指数证券投资基金募集的批复》的核准,由基金管理人大成基金管理有限公司向社会公开发行募集,基金合同于 2006 年 4 月 6 日正式生效,首次设立募集规模为 1,813,356,066.47 份基金份额。本基金为契约型开放

式，存续期限不定。本基金的基金管理人为大成基金管理有限公司，注册登记机构为中国证券登记结算有限责任公司，基金托管人为中国农业银行股份有限公司（简称“中国农业银行”）。

根据《关于大成沪深 300 指数证券投资基金增设 C 类基金份额并相应修订基金合同和托管协议的公告》自 2019 年 3 月 11 日起，对本基金增设 C 类基金份额类别，并对本基金的基金合同、托管协议作出相应修改。

本基金 A 类、B 类和 C 类基金份额分别设置代码。由于基金费用的不同，本基金 A 类基金份额、B 类基金份额和 C 类基金份额将分别计算基金份额净值。C 类基金份额的管理费率、托管费率与 A 类基金份额及 B 类基金份额相同。A 类份额与 B 类份额收取申购费、不收取销售服务费，C 类基金份额的销售服务费按前一日 C 类基金资产净值的 0.10% 年费计提、不收取申购费用，但对持有期限少于 30 日的本类别基金份额的赎回收取赎回费。

本基金主要投资于具有良好流动性的金融工具，包括沪深 300 指数成份股（含存托凭证）、备选成份股（含存托凭证）、新股（一级市场初次发行或增发）、存托凭证等，现金（不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等）或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金财产净值的 5%。本基金还可以投资于法律法规及中国证监会允许基金投资的其他金融工具。待金融衍生产品推出后，本基金可以依照法律法规或监管机构的规定运用金融衍生产品进行风险管理。本基金跟踪标的指数的投资组合资产原则上不低于基金财产净值的 90%。除非法律法规另有规定，本基金的股票投资比例可以提高到基金财产净值的 100%。本基金的业绩比较基准为：沪深 300 指数。

#### 7.4.2 会计报表的编制基础

本财务报表系按照财政部颁布的《企业会计准则—基本准则》以及其后颁布及修订的具体会计准则、应用指南、解释以及其他相关规定（以下合称“企业会计准则”）编制，同时，对于在具体会计核算和信息披露方面，也参考了中国证券投资基金业协会修订并发布的《证券投资基金会计核算业务指引》、中国证监会制定的《中国证券监督管理委员会关于证券投资基金估值业务的指导意见》、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》、《证券投资基金信息披露内容与格式准则》第 2 号《年度报告的内容与格式》、《证券投资基金信息披露编报规则》第 3 号《会计报表附注的编制及披露》、《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号〈年度报告和中期报告〉》及其他中国证监会及中国证券投资基金业协会颁布的相关规定。

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

#### 7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金于 2020 年 12 月 31 日的财务状况以及 2020 年度的经营成果和净值变动情况。

## 7.4.4 重要会计政策和会计估计

### 7.4.4.1 会计年度

本基金会计年度采用公历年度，即每年 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

### 7.4.4.2 记账本位币

本基金记账本位币和编制本财务报表所采用的货币均为人民币。除有特别说明外，均以人民币元为单位表示。

### 7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

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

#### （1）金融资产分类

本基金的金融资产于初始确认时分为以下两类：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、贷款和应收款项；

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主要包括股票投资、债券投资和衍生工具等；

本基金目前持有的其他金融资产分类为应收款项，包括银行存款、结算备付金、买入返售金融资产和各类应收款项等。

#### （2）金融负债分类

本基金的金融负债于初始确认时归类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债和其他金融负债。

本基金持有的金融负债划分为其他金融负债。

### 7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

#### 初始确认

本基金于成为金融工具合同的一方时确认一项金融资产或金融负债，按照取得时的公允价值作为初始确认金额。划分为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产取得时发生的相关交易费用计入当期损益；应收款项及其他金融负债的相关交易费用计入初始确认金额。

#### 后续计量

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产采用公允价值进行后续计量。在持有该类金融资产期间取得的利息或现金股利，应当确认为当期收益。每日，本基金将以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产或金融负债的公允价值变动计入当期损益；应收款项及其他金融负债采用实际利率法，按照摊余成本进行后续计量，其摊销或减值产生的利得或损失，均计入当期损益。



#### 终止确认

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

当金融负债的现时义务全部或部分已经解除的，该金融负债或其一部分将终止确认；

处置该金融资产或金融负债时，其公允价值与初始入账金额之间的差额应确认为投资收益，同时调整公允价值变动收益。

#### 金融资产转移

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

#### 7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

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

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

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

本基金持有的股票投资、债券投资和权证投资等投资按如下原则确定公允价值并进行估值：

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

与上述投资品种相同，但具有不同特征的，应以相同资产或负债的公允价值为基础，并在估

值技术中考虑不同特征因素的影响。特征是指对资产出售或使用的限制等，如果该限制是针对资产持有者的，那么在估值技术中不应将该限制作为特征考虑。此外，基金管理人不应考虑因大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价；

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

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

(4) 如有新增事项，按国家最新规定估值。

#### 7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

当本基金同时满足下列条件时，金融资产和金融负债以相互抵销后的净额在资产负债表内列示：具有抵销已确认金额的法定权利，且该种法定权利是当前可执行的；计划以净额结算，或同时变现该金融资产和清偿该金融负债。

#### 7.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行的基金份额总额所对应的金额。由于申购和赎回引起的实收基金份额变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日确认。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

#### 7.4.4.8 损益平准金

损益平准金包括已实现损益平准金和未实现损益平准金。已实现损益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收益/(损失)占基金净值比例计算的金额。未实现损益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利得/(损失)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确认。

未实现损益平准金与已实现损益平准金均在“损益平准金”科目中核算，并于期末全额转入“未分配利润/(累计亏损)”。

#### 7.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

(1) 存款利息收入按存款的本金与适用的利率逐日计提的金额入账。若提前支取定期存款，按协议规定的利率及持有期重新计算存款利息收入，并根据提前支取所实际收到的利息收入与账面已确认的利息收入的差额确认利息损失，列入利息收入减项，存款利息收入以净额列示；

(2) 债券利息收入按债券票面价值与票面利率或内含票面利率计算的金额扣除应由债券发行企业代扣代缴的个人所得税及应由管理人缴纳的增值税后的净额确认，在债券实际持有期内逐日

计提；

(3) 资产支持证券利息收入按证券票面价值与票面利率计算的金额，扣除应由资产支持证券发行企业代扣代缴的个人所得税及应由管理人缴纳的增值税后的净额确认，在证券实际持有期内逐日计提；

(4) 买入返售金融资产收入，按买入返售金融资产的成本及实际利率（当实际利率与合同利率差异较小时，也可以用合同利率），在回购期内逐日计提；

(5) 股票投资收益/(损失)于卖出股票成交日确认，并按卖出股票成交金额与其成本的差额入账；

(6) 债券投资收益/(损失)于成交日确认，并按成交总额与其成本、应收利息的差额入账；

(7) 衍生工具收益/(损失)于卖出权证成交日确认，并按卖出权证成交金额与其成本的差额扣除应由基金管理人缴纳的增值税后的净额入账；

(8) 股利收益于除息日确认，并按上市公司宣告的分红派息比例计算的金额扣除应由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额入账；

(9) 公允价值变动收益/(损失)系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、以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债等公允价值变动形成的应计入当期损益的利得或损失；

(10) 其他收入在主要风险和报酬已经转移给对方，经济利益很可能流入且金额可以可靠计量的时候确认。

#### 7.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬和托管费等费用在费用涵盖期间按基金合同或相关公告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计算，当实际利率与合同利率差异较小时，也可以用合同利率计算。

#### 7.4.4.11 基金的收益分配政策

(1) 基金收益分配应当采用现金方式。基金份额持有人可以事先选择将所获分配的现金收益，按照基金合同有关基金份额申购的约定转为基金份额；基金份额持有人事先未做出选择，基金管理人应当支付现金；本基金默认的分红方式为现金分红；

(2) 由于本基金 A 类基金份额、B 类基金份额不收取销售服务费，C 类基金份额收取销售服务费，各基金份额类别对应的可供分配利润有所不同，本基金同一类别每一基金份额享有同等分配权；

- (3) 基金当期收益先弥补上期亏损后，方可进行当期收益分配；
- (4) 基金当期出现亏损，则可不进行收益分配；
- (5) 基金收益分配后每基金份额净值不能低于面值；
- (6) 在符合有关基金分红条件的前提下，基金收益分配每年不超过 6 次，成立不满 3 个月，收益可不分配；
- (7) 基金年度收益分配比例不低于基金年度已实现收益的 50%；
- (8) 法律法规或监管机构另有规定的从其规定。

#### 7.4.4.12 分部报告

截至本报告期末，本基金仅在中国大陆境内从事证券投资单一业务，因此，无需作披露的分部报告。

#### 7.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计

本基金本报告期间无需要说明的其他重要会计政策和会计估计事项。

#### 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

本基金本报告期末发生会计政策变更。

##### 7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期末发生会计估计变更。

##### 7.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无重大会计差错更正。

#### 7.4.6 税项

##### 1、印花税

证券（股票）交易印花税税率为 1%，由出让方缴纳。

##### 2、增值税、企业所得税

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

根据财政部、国家税务总局财税[2016]140 号文《关于明确金融、房地产开发、教育辅助服务等增值税政策的通知》的规定，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；

根据财政部、国家税务总局财税[2017]56 号文《关于资管产品增值税有关问题的通知》的规定，自 2018 年 1 月 1 日起，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（以下简称“资管产品运营业务”），暂适用简易计税方法，按照 3% 的征收率缴纳增值税，资管产品管理人未分别核算资管产品运营业务和其他业务的销售额和增值税应纳税额的除外。资管产品管理人可选择分别或汇总核算资管产品运营业务销售额和增值税应纳税额。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。

根据财政部、国家税务总局财税[2017]90 号文《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》的规定，提供贷款服务，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；转让 2017 年 12 月 31 日前取得的股票（不包括限售股）、债券、基金、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股票收盘价（2017 年最后一个交易日处于停牌期间的股票，为停牌前最后一个交易日收盘价）、债券估值（中债金融估值中心有限公司或中证指数有限公司提供的债券估值）、基金份额净值、非货物期货结算价格作为买入价计算销售额。

证券投资基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股权的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

### 3、个人所得税

个人所得税税率为 20%。

基金取得的股票的股息、红利收入、债券的利息收入及储蓄利息收入，由上市公司、债券发行企业及金融机构在向基金派发股息、红利收入、债券的利息收入及储蓄利息收入时代扣代缴个人所得税。

基金从上市公司分配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，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。

暂免征收储蓄存款利息所得个人所得税。

## 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	129,405,463.54	28,756,908.71
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	129,405,463.54	28,756,908.71

## 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	1,324,711,390.38	1,726,079,936.76	401,368,546.38	
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	1,324,711,390.38	1,726,079,936.76	401,368,546.38	
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	1,651,683,850.76	1,943,472,924.50	291,789,073.74	
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	
债券	交易所市场	-	-	
	银行间市场	79,950,960.00	80,024,000.00	73,040.00
	合计	79,950,960.00	80,024,000.00	73,040.00
资产支持证券	-	-	-	
基金	-	-	-	
其他	-	-	-	
合计	1,731,634,810.76	2,023,496,924.50	291,862,113.74	

## 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

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	25,759.80	6,897.34
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	368.40	354.90
应收债券利息	-	1,993,030.14
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	88.50	59.20
合计	26,216.70	2,000,341.58

## 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	773,005.94	788,235.69
银行间市场应付交易费用	-	-
合计	773,005.94	788,235.69

## 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	5,920.93	6,231.52
应付证券出借违约金	-	-
预提费用	250,000.00	130,000.00
应付后端申购费	1,732.08	822.85
合计	257,653.01	137,054.37

## 7.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

大成沪深 300 指数 A

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	1,845,180,674.06	1,845,180,674.06
本期申购	324,310,268.66	324,310,268.66
本期赎回 (以“-”号填列)	-821,103,677.15	-821,103,677.15
本期末	1,348,387,265.57	1,348,387,265.57

## 大成沪深 300 指数 C

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	132,754.84	132,754.84
本期申购	33,360,573.14	33,360,573.14
本期赎回 (以“-”号填列)	-31,368,294.78	-31,368,294.78
本期末	2,125,033.20	2,125,033.20

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)。

## 7.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

## 大成沪深 300 指数 A

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	874,019,321.73	-667,010,035.09	207,009,286.64
本期利润	370,132,406.92	111,732,350.30	481,864,757.22
本期基金份额交易产生的变动数	-256,214,428.91	169,462,618.51	-86,751,810.40
其中：基金申购款	160,325,519.70	-123,338,360.06	36,987,159.64
基金赎回款	-416,539,948.61	292,800,978.57	-123,738,970.04
本期已分配利润	-103,647,838.17	-	-103,647,838.17
本期末	884,289,461.57	-385,815,066.28	498,474,395.29

## 大成沪深 300 指数 C

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	62,638.24	-47,946.68	14,691.56
本期利润	1,212,463.81	-2,225,917.66	-1,013,453.85
本期基金份额交易产生的变动数	113,467.44	1,666,930.16	1,780,397.60
其中：基金申购款	17,013,351.28	-8,822,530.06	8,190,821.22
基金赎回款	-16,899,883.84	10,489,460.22	-6,410,423.62
本期已分配利润	-7,576.61	-	-7,576.61
本期末	1,380,992.88	-606,934.18	774,058.70

## 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 1 月 1 日至 2019 年 12 月 31 日



		月 31 日
活期存款利息收入	910,455.46	357,672.63
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	18,387.90	19,723.86
其他	3,634.92	8,194.99
合计	932,478.28	385,591.48

#### 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1月1日至2019年12 月31日
卖出股票成交总额	2,113,342,010.44	1,624,562,788.66
减：卖出股票成本总额	1,755,248,828.45	1,572,231,384.13
买卖股票差价收入	358,093,181.99	52,331,404.53

#### 7.4.7.13 债券投资收益

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1月1日至2019年12 月31日
卖出债券（、债转股及债券 到期兑付）成交总额	82,032,000.00	83,280,000.00
减：卖出债券（、债转股及 债券到期兑付）成本总额	79,950,960.00	80,232,480.00
减：应收利息总额	2,032,000.00	3,280,000.00
买卖债券差价收入	49,040.00	-232,480.00

#### 7.4.7.14 贵金属投资收益

无。

#### 7.4.7.15 衍生工具收益

无。

#### 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1月1日至2019年12 月31日
股票投资产生的股利收益	34,097,024.57	39,480,496.29
其中：证券出借权益补偿收入	-	-
基金投资产生的股利收益	-	-

合计	34,097,024.57	39,480,496.29
----	---------------	---------------

## 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1月1日至2019 年12月31日
1. 交易性金融资产	109,506,432.64	458,286,096.99
股票投资	109,579,472.64	458,180,576.99
债券投资	-73,040.00	105,520.00
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	109,506,432.64	458,286,096.99

## 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1月1日至2019年 12月31日
基金赎回费收入	590,781.04	503,209.14
合计	590,781.04	503,209.14

注：本基金的赎回费率按持有期间递减，将不低于 25% 的赎回费用归入基金资产。

## 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1月1日至2019年12月31日
交易所市场交易费用	5,778,373.29	4,853,232.89
银行间市场交易费用	-	350.00
合计	5,778,373.29	4,853,582.89

## 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 31日	上年度可比期间 2019年1月1日至2019年12月31日
审计费用	130,000.00	130,000.00
信息披露费	120,000.00	120,000.00

证券出借违约金	-	-
银行划款手续费	10,373.26	9,682.08
账户维护费	18,000.00	18,000.00
合计	278,373.26	277,682.08

#### 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

本基金的基金管理人于 2021 年 1 月 14 日宣告 2020 年度第 1 次分红，向截至 2021 年 1 月 18 日止登记在册的全体持有人分红，其中 A 类按每 10 份基金份额派发红利 1.8500 元，C 类按每 10 份基金份额派发红利 1.8230 元。

#### 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
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
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
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

注：以下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 1 月 1 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	943,045,025.31	27.01	1,484,191,253.30	47.00

## 7.4.10.1.2 债券交易

无。

## 7.4.10.1.3 债券回购交易

无。

## 7.4.10.1.4 权证交易

无。

## 7.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 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	859,391.20	27.01	90,343.75	11.69
关联方名称	上年度可比期间 2019年1月1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	1,352,539.28	47.00	246,062.34	31.22

注：1) 上述佣金按市场佣金率计算，以扣除由中国证券登记结算有限责任公司收取的证管费和经手费后的净额列示。

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1月1日至2019年 12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	13,664,967.36	14,546,508.32
其中：支付销售机构的客户维护费	3,267,284.26	3,378,108.19

注：基金管理费每日计提，按月支付。基金管理费按前一日的基金资产净值的0.75%年费率计提。

计算方法如下：

$$H = E \times 0.75\% / \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

#### 7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日	2019 年 1 月 1 日至 2019 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的托管费	2,732,993.43	2,909,301.67

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

计算方法如下：

$$H = E \times 0.15\% / \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

#### 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		
	大成沪深 300 指数 A	大成沪深 300 指数 C	合计
大成基金	-	1,776.82	1,776.82
合计	-	1,776.82	1,776.82
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间		
	2019 年 1 月 1 日至 2019 年 12 月 31 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	大成沪深 300 指数 A	大成沪深 300 指数 C	合计
大成基金	-	50.96	50.96
合计	-	50.96	50.96

注：1) 自 2019 年 3 月起，对本基金增设 C 类基金份额类别。

2) 本基金 A 类份额不收取销售服务费，C 类份额的销售服务费按前一日 C 类基金份额基金资产净值的 0.10% 年费率计提。计算方法为：

$$H=E \times 0.10\% / \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的销售服务费

E 为 C 类基金份额前一日基金资产净值

#### 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

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1月1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	129,405,463.54	910,455.46	28,756,908.71	357,672.63

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

单位：人民币元

大成沪深 300 指数 A
---------------

序号	权益 登记日	除息日	每 10 份 基金份 额分红 数	现金形式 发放总额	再投资形式 发放总额	本期利润分配合 计	备注
1	2020 年 1 月 17 日	2020 年 1 月 17 日	0.5700	56,937,952.61	46,709,885.56	103,647,838.17	-
合计	-	-	0.5700	56,937,952.61	46,709,885.56	103,647,838.17	-
大成沪深 300 指数 C							
序号	权益 登记日	除息日	每 10 份基金 份额分红数	现金形式 发放总额	再投资形式 发放总额	本期利润分配 合计	备注
1	2020 年 1 月 17 日	2020 年 1 月 17 日	0.5700	1,768.44	5,808.17	7,576.61	-
合计	-	-	0.5700	1,768.44	5,808.17	7,576.61	-

## 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
003030	祖名 股份	2020 年 12 月 25 日	2021 年 1 月 6 日	新股未 上市	15.18	15.18	480	7,286.40	7,286.40	-
003031	中瓷 电子	2020 年 12 月 24 日	2021 年 1 月 4 日	新股未 上市	15.27	15.27	387	5,909.49	5,909.49	-
300862	蓝盾 光电	2020 年 8 月 7 日	2021 年 3 月 4 日	新股锁 定	33.95	38.54	5,843	198,369.85	225,189.22	-
300864	南大 环境	2020 年 8 月 13 日	2021 年 2 月 25 日	新股锁 定	71.71	90.85	166	11,903.86	15,081.10	-
300866	安克 创新	2020 年 8 月 11 日	2021 年 2 月 24 日	新股锁 定	66.32	156.18	9,451	626,790.32	1,476,057.18	-
300867	圣元 环保	2020 年 8 月 12 日	2021 年 3 月 3 日	新股锁 定	19.34	31.97	1,498	28,971.32	47,891.06	-
300868	杰美 特	2020 年 8 月	2021 年 2 月	新股锁 定	41.26	43.28	593	24,467.18	25,665.04	-

		12 日	24 日							
300871	回盛生物	2020 年 8 月 13 日	2021 年 2 月 24 日	新股锁定	33.61	38.70	618	20,770.98	23,916.60	-
300873	海晨股份	2020 年 8 月 14 日	2021 年 3 月 2 日	新股锁定	30.72	41.32	484	14,868.48	19,998.88	-
300877	金春股份	2020 年 8 月 17 日	2021 年 3 月 3 日	新股锁定	30.54	50.85	569	17,377.26	28,933.65	-
300878	维康药业	2020 年 8 月 17 日	2021 年 3 月 3 日	新股锁定	41.34	48.72	401	16,577.34	19,536.72	-
300879	大叶股份	2020 年 8 月 25 日	2021 年 3 月 1 日	新股锁定	10.58	27.12	466	4,930.28	12,637.92	-
300882	万胜智能	2020 年 8 月 27 日	2021 年 3 月 10 日	新股锁定	10.33	25.79	440	4,545.20	11,347.60	-
300884	狄耐克	2020 年 11 月 5 日	2021 年 5 月 12 日	新股锁定	24.87	33.51	499	12,410.13	16,721.49	-
300886	华业香料	2020 年 9 月 8 日	2021 年 3 月 16 日	新股锁定	18.59	45.67	147	2,732.73	6,713.49	-
300887	谱尼测试	2020 年 9 月 9 日	2021 年 3 月 16 日	新股锁定	44.47	74.52	210	9,338.70	15,649.20	-
300889	爱克股份	2020 年 9 月 9 日	2021 年 3 月 16 日	新股锁定	27.97	30.12	479	13,397.63	14,427.48	-
300890	翔丰华	2020 年 9 月 10 日	2021 年 3 月 18 日	新股锁定	14.69	48.85	286	4,201.34	13,971.10	-
300891	惠云钛业	2020 年 9 月 10 日	2021 年 3 月 17 日	新股锁定	3.64	16.40	1,143	4,160.52	18,745.20	-
300892	品渥食品	2020 年 9 月 11 日	2021 年 3 月 30 日	新股锁定	26.66	60.01	272	7,251.52	16,322.72	-
300893	松原股份	2020 年 9 月 17 日	2021 年 3 月 24 日	新股锁定	13.47	35.08	276	3,717.72	9,682.08	-
300895	铜牛	2020	2021	新股锁	12.65	45.30	283	3,579.95	12,819.90	-



	信息	年 9 月 17 日	年 3 月 24 日	定						
300896	爱美客	2020 年 9 月 21 日	2021 年 3 月 29 日	新股锁 定	118.27	603.36	473	55,941.71	285,389.28	-
300898	熊猫乳品	2020 年 10 月 9 日	2021 年 4 月 16 日	新股锁 定	10.78	33.03	496	5,346.88	16,382.88	-
300900	广联航空	2020 年 10 月 19 日	2021 年 4 月 29 日	新股锁 定	17.87	33.16	879	15,707.73	29,147.64	-
300908	仲景食品	2020 年 11 月 13 日	2021 年 5 月 24 日	新股锁 定	39.74	60.44	285	11,325.90	17,225.40	-
300909	汇创达	2020 年 11 月 11 日	2021 年 5 月 18 日	新股锁 定	29.57	40.67	386	11,414.02	15,698.62	-
300910	瑞丰新材	2020 年 11 月 20 日	2021 年 5 月 27 日	新股锁 定	30.26	47.87	474	14,343.24	22,690.38	-
300911	亿田智能	2020 年 11 月 24 日	2021 年 6 月 3 日	新股锁 定	24.35	33.06	309	7,524.15	10,215.54	-
300912	凯龙高科	2020 年 11 月 26 日	2021 年 6 月 7 日	新股锁 定	17.62	28.49	5,117	90,161.54	145,783.33	-
300917	特发服务	2020 年 12 月 14 日	2021 年 6 月 21 日	新股锁 定	18.78	31.94	281	5,277.18	8,975.14	-
300918	南山智尚	2020 年 12 月 15 日	2021 年 6 月 22 日	新股锁 定	4.97	8.94	1,063	5,283.11	9,503.22	-
300919	中伟股份	2020 年 12 月 15 日	2021 年 6 月 23 日	新股锁 定	24.60	61.51	610	15,006.00	37,521.10	-

300922	天秦装备	2020年12月18日	2021年6月25日	新股锁定	16.05	31.58	287	4,606.35	9,063.46	-
300926	博俊科技	2020年12月29日	2021年1月7日	新股未上市	10.76	10.76	3,225	34,701.00	34,701.00	-
300926	博俊科技	2020年12月29日	2021年7月7日	新股锁定	10.76	10.76	359	3,862.84	3,862.84	-
300927	江天化学	2020年12月29日	2021年1月7日	新股未上市	13.39	13.39	1,946	26,056.94	26,056.94	-
300927	江天化学	2020年12月29日	2021年7月7日	新股锁定	13.39	13.39	217	2,905.63	2,905.63	-
300999	金龙鱼	2020年9月29日	2021年4月15日	新股锁定	25.70	88.29	8,253	212,102.10	728,657.37	-
600919	江苏银行	2020年12月17日	2021年1月14日	老股东配股	4.59	5.46	323,910	1,486,746.90	1,768,548.60	-
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	-
605277	新亚电子	2020年12月25日	2021年1月6日	新股未上市	16.95	16.95	507	8,593.65	8,593.65	-
688127	蓝特光学	2020年9月14日	2021年3月22日	新股锁定	15.41	33.60	5,322	82,012.02	178,819.20	-
688221	前沿生物	2020年10月20日	2021年4月28日	新股锁定	20.50	17.15	16,148	331,034.00	276,938.20	-
688311	盟升电子	2020年7月	2021年2月	新股锁定	41.58	115.36	4,182	173,887.56	482,435.52	-

		24 日	1 日							
688338	赛科希德	2020 年 7 月 27 日	2021 年 2 月 8 日	新股锁定	50.35	54.59	3,041	153,114.35	166,008.19	-
688561	奇安信	2020 年 7 月 16 日	2021 年 1 月 22 日	新股锁定	56.10	122.83	22,653	1,270,833.30	2,782,467.99	-
688569	铁科轨道	2020 年 8 月 21 日	2021 年 3 月 1 日	新股锁定	22.46	20.10	6,841	153,648.86	137,504.10	-
688617	惠泰医疗	2020 年 12 月 30 日	2021 年 1 月 7 日	新股未上市	74.46	74.46	1,673	124,571.58	124,571.58	-

注：1. 根据《上海证券交易所科创板股票公开发行自律委员会促进科创板初期企业平稳发行行业倡导建议》，本基金获配的科创板股票如经抽签方式确定需要锁定的，锁定期限为自发行人股票上市之日起 6 个月。根据《上海证券交易所科创板上市公司股东以向特定机构投资者询价转让和配售方式减持股份实施细则》，基金通过询价转让受让的股份，在受让后 6 个月内不得转让。

2. 根据《深圳证券交易所创业板首次公开发行证券发行与承销业务实施细则》，发行人和主承销商可以采用摇号限售方式或比例限售方式，安排基金通过网下发行获配的部分创业板股票设置不低于 6 个月的限售期。

3. 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。其中基金参与网下申购获得的新股或作为战略投资者参与配售获得的新股，在新股上市后的约定期限内不能自由转让；基金参与网上申购获配的新股，从新股获配日至新股上市日之间不能自由转让。

#### 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

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

本基金在日常经营活动中由金融工具产生的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金管理人制定了政策和程序来识别及分析这些风险，并设定适当的风险限额及内部控制流程，通过可靠的管理及信息系统持续监控上述各类风险。

本基金的基金管理人奉行全面风险管理体系的建设，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，导致基金资产损失和收益变化的风险。本基金均投资于具有良好信用等级的证券，且通过分散化投资以分散信用风险。

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。本基金在交易所进行的交易均与中国证券登记结算有限责任公司完成证券交收和款项清算，因此违约风险发生的可能性很小；基金在进行银行间同业市场交易前均对交易对手进行信用评估，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，本基金于本期末无债券投资（上年度末：本基金持有的除国债、央行票据和政策性金融债以外的债券占基金资产净值的比例为 0.00%）。

### 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》、《货币市场基金监督管理办法》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流动性受限资产比例、份额持有人集中度、调整平均剩余期限和平均剩余存续期、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%，且本基金组合资产中 7 个工作日可变现资产未超过最近工作日确认的净赎回金额。

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），均能够及时变现。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，因此账面余额一般为未折现的合约到期现金流量。本报告期内，本基金未发生重大流动性风险事件。

#### 7.4.13.4 市场风险

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

##### 7.4.13.4.1 利率风险

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

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

本基金持有的大部分金融资产和金融负债不计息，因此本基金的收入及经营活动的现金流量在很大程度上独立于市场利率变化。本基金持有的利率敏感性资产主要为银行存款、结算备付金及应收申购款等。

#### 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
资产					
银行存款	129,405,463.54	-	-	-	129,405,463.54
结算备付金	818,678.59	-	-	-	818,678.59
存出保证金	196,685.14	-	-	-	196,685.14
交易性金融资产	-	-	-	1,726,079,936.76	1,726,079,936.76
应收利息	-	-	-	26,216.70	26,216.70
应收申购款	4,920.23	-	-	1,039,174.03	1,044,094.26
应收证券清算款	-	-	-	1,919,386.89	1,919,386.89
资产总计	130,425,747.50	-	-	1,729,064,714.38	1,859,490,461.88
负债					
应付赎回款	-	-	-	7,310,930.49	7,310,930.49
应付管理人报酬	-	-	-	1,156,639.89	1,156,639.89
应付托管费	-	-	-	231,327.96	231,327.96
应付销售服务费	-	-	-	151.83	151.83
应付交易费用	-	-	-	773,005.94	773,005.94
其他负债	-	-	-	257,653.01	257,653.01
负债总计	-	-	-	9,729,709.12	9,729,709.12
利率敏感度缺口	130,425,747.50	-	-	1,719,335,005.26	1,849,760,752.76
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
资产					
银行存款	28,756,908.71	-	-	-	28,756,908.71
结算备付金	788,709.41	-	-	-	788,709.41
存出保证金	131,592.88	-	-	-	131,592.88
交易性金融资产	80,024,000.00	-	-	1,943,472,924.50	2,023,496,924.50
应收利息	-	-	-	2,000,341.58	2,000,341.58
应收申购款	21,422.18	-	-	582,722.93	604,145.11
应收证券清算款	-	-	-	2,447,528.54	2,447,528.54
资产总计	109,722,633.18	-	-	1,948,503,517.55	2,058,226,150.73
负债					
应付赎回款	-	-	-	3,429,301.12	3,429,301.12
应付管理人报酬	-	-	-	1,278,450.92	1,278,450.92

应付托管费	-	-	-	255,690.20	255,690.20
应付销售服务费	-	-	-	11.33	11.33
应付交易费用	-	-	-	788,235.69	788,235.69
其他负债	-	-	-	137,054.37	137,054.37
负债总计	-	-	-	5,888,743.63	5,888,743.63
利率敏感度缺口	109,722,633.18	-	-	-1,942,614,773.92	2,052,337,407.10

注：表中所示为本基金资产及负债的账面价值，并按照合同约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

假设	除市场利率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	利率上升 25 个基点	-	-4,001.81
	利率下降 25 个基点	-	4,002.31

#### 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。本基金持有的金融工具以人民币计价，因此无重大外汇风险。

#### 7.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场交易的股票和债券，所面临的最大市场价格风险由所持有的金融工具的公允价值决定。本基金通过投资组合的分散化降低市场价格风险，并且本基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控。

本基金跟踪标的指数的投资组合的资产原则上不低于基金资产净值的 90%。除非法律法规另有规定，本基金的股票投资比例可以提高到基金资产净值的 100%。现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%。

##### 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	1,726,079,936.76	93.31	1,943,472,924.50	94.70
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产—债券投资	-	-	-	-
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	1,726,079,936.76	93.31	1,943,472,924.50	94.70

#### 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	沪深 300 指数上升 5%	85,175,496.87	96,007,302.22
	沪深 300 指数下降 5%	-85,175,496.87	-96,007,302.22

#### 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、承诺事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的承诺事项。

##### 2、其他事项

###### (1) 公允价值

管理层已经评估了银行存款、结算备付金、买入返售金融资产、其他应收款项类投资以及其他金融负债因剩余期限不长，公允价值与账面价值相若。

###### 各层次金融工具公允价值

于 2020 年 12 月 31 日，本基金持有的持续以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产中划分为第一层次的余额为人民币 1,716,759,931.83 元，划分为第二层次的余额为人民币 9,320,004.93 元，无划分为第三层次的余额。（于 2019 年 12 月 31 日，本基金持有的持续以公允



价值计量且其变动计入当期损益的金融资产中划分为第一层次的余额为人民币 1,934,706,387.03 元,划分为第二层次的余额为人民币 88,790,537.47 元,无划分为第三层次的余额)。

#### 公允价值所属层次间重大变动

本基金调整公允价值计量层次转换时点的相关会计政策在前后各会计期间保持一致。

对于证券交易所上市的股票和可转换债券,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,本基金不会于停牌日至交易恢复活跃日期间及交易不活跃期间将相关股票和可转换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,确定相关股票和可转换债券公允价值应属第二层次还是第三层次。

#### 第三层次公允价值期初金额和本期变动金额

于 2020 年 12 月 31 日,本基金未持有划分为第三层次的金融工具,本基金本报告期未发生第三层次公允价值转入转出情况(2019 年 12 月 31 日:无)。

(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。

### 3、财务报表的批准

本财务报表已于 2021 年 3 月 29 日经本基金的基金管理人批准。

## § 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	1,726,079,936.76	92.83
	其中:股票	1,726,079,936.76	92.83
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	130,224,142.13	7.00
8	其他各项资产	3,186,382.99	0.17
9	合计	1,859,490,461.88	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	22,979,809.42	1.24
B	采矿业	38,285,513.64	2.07
C	制造业	862,860,220.78	46.65
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	29,701,021.29	1.61
E	建筑业	31,612,884.39	1.71
F	批发和零售业	23,596,920.51	1.28
G	交通运输、仓储和邮政业	47,399,491.94	2.56
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	52,238,372.45	2.82
J	金融业	480,064,653.26	25.95
K	房地产业	56,858,583.68	3.07
L	租赁和商务服务业	8,202,809.16	0.44
M	科学研究和技术服务业	21,917,139.84	1.18
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	5,164,110.00	0.28
Q	卫生和社会工作	23,609,792.81	1.28
R	文化、体育和娱乐业	12,179,357.12	0.66
S	综合	-	-
	合计	1,716,670,680.29	92.81

## 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	4,611,167.70	0.25
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	16,322.72	0.00
G	交通运输、仓储和邮政业	19,998.88	0.00
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	2,814,004.13	0.15
J	金融业	1,714,383.21	0.09
K	房地产业	8,975.14	0.00
L	租赁和商务服务业	-	-

M	科学研究和技术服务业	15,649.20	0.00
N	水利、环境和公共设施管理业	208,755.49	0.01
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	9,409,256.47	0.51

### 8.2.3 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

无。

### 8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

#### 8.3.1 期末指数投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	600519	贵州茅台	34,593	69,116,814.00	3.74
2	601318	中国平安	747,657	65,031,205.86	3.52
3	000858	五粮液	172,589	50,370,099.65	2.72
4	000333	美的集团	418,908	41,237,303.52	2.23
5	600036	招商银行	803,842	35,328,855.90	1.91
6	600276	恒瑞医药	258,264	28,786,105.44	1.56
7	600887	伊利股份	572,808	25,415,490.96	1.37
8	300059	东方财富	741,163	22,976,053.00	1.24
9	601398	工商银行	4,404,918	21,980,540.82	1.19
10	000651	格力电器	346,989	21,492,498.66	1.16
11	601166	兴业银行	989,915	20,659,526.05	1.12
12	600031	三一重工	554,106	19,382,627.88	1.05
13	600030	中信证券	599,132	17,614,480.80	0.95
14	601211	国泰君安	992,939	17,406,220.67	0.94
15	002475	立讯精密	306,747	17,214,641.64	0.93
16	002714	牧原股份	219,759	16,943,418.90	0.92
17	002241	歌尔股份	435,754	16,262,339.28	0.88
18	002352	顺丰控股	172,900	15,254,967.00	0.82
19	603288	海天味业	69,180	13,873,357.20	0.75
20	000725	京东方A	2,309,563	13,857,378.00	0.75
21	601988	中国银行	4,349,340	13,830,901.20	0.75
22	000002	万科A	481,119	13,808,115.30	0.75
23	000001	平安银行	708,318	13,698,870.12	0.74

24	300124	汇川技术	138,900	12,959,370.00	0.70
25	002415	海康威视	262,642	12,740,763.42	0.69
26	601939	建设银行	2,003,162	12,579,857.36	0.68
27	600900	长江电力	631,862	12,106,475.92	0.65
28	601688	华泰证券	671,875	12,100,468.75	0.65
29	600690	海尔智家	396,034	11,568,153.14	0.63
30	603259	药明康德	85,772	11,555,203.84	0.62
31	002304	洋河股份	48,815	11,519,851.85	0.62
32	600309	万华化学	118,014	10,743,994.56	0.58
33	000338	潍柴动力	679,792	10,733,915.68	0.58
34	601336	新华保险	184,725	10,708,508.25	0.58
35	601328	交通银行	2,371,308	10,623,459.84	0.57
36	300676	华大基因	80,600	10,361,936.00	0.56
37	000895	双汇发展	213,697	10,030,937.18	0.54
38	000568	泸州老窖	44,000	9,951,040.00	0.54
39	601899	紫金矿业	1,070,199	9,942,148.71	0.54
40	000661	长春高新	22,100	9,920,911.00	0.54
41	600585	海螺水泥	188,468	9,728,718.16	0.53
42	300015	爱尔眼科	129,245	9,679,158.05	0.52
43	601155	新城控股	271,150	9,444,154.50	0.51
44	601668	中国建筑	1,882,094	9,354,007.18	0.51
45	600998	九州通	507,769	9,221,085.04	0.50
46	601601	中国太保	239,793	9,208,051.20	0.50
47	000100	TCL 科技	1,251,422	8,860,067.76	0.48
48	600000	浦发银行	879,728	8,515,767.04	0.46
49	601377	兴业证券	977,301	8,482,972.68	0.46
50	600016	民生银行	1,605,672	8,349,494.40	0.45
51	000776	广发证券	507,702	8,265,388.56	0.45
52	002142	宁波银行	233,878	8,265,248.52	0.45
53	600837	海通证券	639,393	8,222,593.98	0.44
54	002493	荣盛石化	293,142	8,093,650.62	0.44
55	600048	保利地产	510,787	8,080,650.34	0.44
56	002027	分众传媒	802,468	7,920,359.16	0.43
57	601169	北京银行	1,632,980	7,903,623.20	0.43
58	000157	中联重科	792,000	7,840,800.00	0.42
59	600438	通威股份	203,000	7,803,320.00	0.42
60	300413	芒果超媒	100,300	7,271,750.00	0.39
61	300122	智飞生物	48,189	7,127,634.99	0.39
62	300347	泰格医药	41,540	6,713,279.40	0.36
63	000063	中兴通讯	197,220	6,636,453.00	0.36
64	600999	招商证券	280,339	6,543,112.26	0.35
65	300142	沃森生物	168,800	6,508,928.00	0.35

66	300014	亿纬锂能	79,861	6,508,671.50	0.35
67	600570	恒生电子	62,013	6,505,163.70	0.35
68	600958	东方证券	554,574	6,449,695.62	0.35
69	002236	大华股份	316,949	6,304,115.61	0.34
70	000786	北新建材	157,400	6,303,870.00	0.34
71	601919	中远海控	513,322	6,267,661.62	0.34
72	601009	南京银行	775,079	6,262,638.32	0.34
73	300408	三环集团	167,632	6,244,292.00	0.34
74	002460	赣锋锂业	60,400	6,112,480.00	0.33
75	600436	片仔癀	22,611	6,048,668.61	0.33
76	002508	老板电器	148,300	6,047,674.00	0.33
77	300498	温氏股份	331,124	6,036,390.52	0.33
78	603501	韦尔股份	26,100	6,031,710.00	0.33
79	601229	上海银行	763,911	5,989,062.24	0.32
80	600893	航发动力	99,569	5,909,420.15	0.32
81	600299	安迪苏	499,520	5,749,475.20	0.31
82	002271	东方雨虹	144,500	5,606,600.00	0.30
83	002410	广联达	71,200	5,606,288.00	0.30
84	600919	江苏银行	1,023,010	5,585,634.60	0.30
85	601117	中国化学	945,400	5,549,498.00	0.30
86	000538	云南白药	47,726	5,421,673.60	0.29
87	002001	新和成	158,860	5,350,404.80	0.29
88	600660	福耀玻璃	111,026	5,334,799.30	0.29
89	600009	上海机场	70,179	5,309,743.14	0.29
90	600050	中国联通	1,178,336	5,255,378.56	0.28
91	600584	长电科技	122,900	5,231,853.00	0.28
92	600588	用友网络	119,211	5,229,786.57	0.28
93	601600	中国铝业	1,438,443	5,221,548.09	0.28
94	603986	兆易创新	26,220	5,178,450.00	0.28
95	002607	中公教育	147,000	5,164,110.00	0.28
96	601628	中国人寿	134,462	5,161,996.18	0.28
97	600104	上汽集团	211,200	5,161,728.00	0.28
98	601225	陕西煤业	551,964	5,155,343.76	0.28
99	002230	科大讯飞	126,074	5,152,644.38	0.28
100	601555	东吴证券	519,433	5,121,609.38	0.28
101	601901	方正证券	492,311	5,105,265.07	0.28
102	000783	长江证券	605,524	5,086,401.60	0.27
103	600019	宝钢股份	848,052	5,045,909.40	0.27
104	600196	复星医药	92,901	5,015,724.99	0.27
105	600406	国电南瑞	188,742	5,014,874.94	0.27
106	002202	金风科技	351,668	5,011,269.00	0.27
107	601818	光大银行	1,248,800	4,982,712.00	0.27

108	300003	乐普医疗	180,917	4,917,324.06	0.27
109	002736	国信证券	360,500	4,917,220.00	0.27
110	601998	中信银行	940,484	4,805,873.24	0.26
111	002050	三花智控	194,577	4,796,323.05	0.26
112	002414	高德红外	114,600	4,784,550.00	0.26
113	600703	三安光电	177,102	4,783,525.02	0.26
114	300601	康泰生物	27,400	4,781,300.00	0.26
115	600346	恒力石化	168,479	4,712,357.63	0.25
116	601766	中国中车	883,004	4,688,751.24	0.25
117	002812	恩捷股份	33,000	4,678,740.00	0.25
118	600763	通策医疗	16,800	4,645,536.00	0.25
119	600028	中国石化	1,149,369	4,631,957.07	0.25
120	600745	闻泰科技	46,200	4,573,800.00	0.25
121	601390	中国中铁	860,145	4,532,964.15	0.25
122	002594	比亚迪	23,100	4,488,330.00	0.24
123	600926	杭州银行	300,476	4,483,101.92	0.24
124	601088	中国神华	248,446	4,474,512.46	0.24
125	002049	紫光国微	32,600	4,362,206.00	0.24
126	002311	海大集团	66,500	4,355,750.00	0.24
127	001979	招商蛇口	324,979	4,318,970.91	0.23
128	600795	国电电力	1,910,005	4,297,511.25	0.23
129	603369	今世缘	74,700	4,286,286.00	0.23
130	603799	华友钴业	52,854	4,191,322.20	0.23
131	603993	洛阳钼业	661,244	4,132,775.00	0.22
132	601607	上海医药	214,237	4,113,350.40	0.22
133	002624	完美世界	139,144	4,104,748.00	0.22
134	601100	恒立液压	36,312	4,103,256.00	0.22
135	601985	中国核电	826,510	4,066,429.20	0.22
136	601838	成都银行	377,563	4,028,597.21	0.22
137	000768	中航西飞	109,188	4,005,015.84	0.22
138	002008	大族激光	92,846	3,969,166.50	0.21
139	000166	申万宏源	747,010	3,944,212.80	0.21
140	601727	上海电气	722,500	3,901,500.00	0.21
141	002157	正邦科技	225,900	3,849,336.00	0.21
142	300433	蓝思科技	124,900	3,823,189.00	0.21
143	000860	顺鑫农业	52,400	3,801,096.00	0.21
144	000876	新希望	162,333	3,636,259.20	0.20
145	002007	华兰生物	85,895	3,628,204.80	0.20
146	601877	正泰电器	92,279	3,613,645.64	0.20
147	600741	华域汽车	124,255	3,581,029.10	0.19
148	002371	北方华创	19,800	3,578,652.00	0.19
149	002129	中环股份	139,300	3,552,150.00	0.19

150	300033	同花顺	28,500	3,533,430.00	0.19
151	002179	中航光电	45,110	3,531,661.90	0.19
152	002821	凯莱英	11,700	3,499,938.00	0.19
153	300144	宋城演艺	196,246	3,477,479.12	0.19
154	600176	中国巨石	173,600	3,465,056.00	0.19
155	600109	国金证券	211,337	3,438,452.99	0.19
156	600015	华夏银行	547,113	3,419,456.25	0.18
157	601916	浙商银行	825,600	3,368,448.00	0.18
158	600547	山东黄金	141,610	3,344,828.20	0.18
159	002252	上海莱士	448,978	3,322,437.20	0.18
160	002555	三七互娱	105,829	3,305,039.67	0.18
161	603899	晨光文具	37,200	3,294,432.00	0.18
162	600177	雅戈尔	458,015	3,293,127.85	0.18
163	600522	中天科技	302,850	3,282,894.00	0.18
164	601186	中国铁建	401,553	3,172,268.70	0.17
165	000596	古井贡酒	11,600	3,155,200.00	0.17
166	002841	视源股份	27,253	3,134,912.59	0.17
167	688008	澜起科技	37,700	3,124,576.00	0.17
168	600352	浙江龙盛	229,200	3,121,704.00	0.17
169	601857	中国石油	739,856	3,070,402.40	0.17
170	601989	中国重工	726,995	3,046,109.05	0.16
171	600989	宝丰能源	260,200	3,044,340.00	0.16
172	600183	生益科技	108,100	3,044,096.00	0.16
173	601006	大秦铁路	470,857	3,041,736.22	0.16
174	600600	青岛啤酒	30,500	3,031,700.00	0.16
175	000938	紫光股份	146,895	3,004,002.75	0.16
176	600606	绿地控股	510,494	2,976,180.02	0.16
177	601066	中信建投	70,300	2,952,600.00	0.16
178	688012	中微公司	18,500	2,915,415.00	0.16
179	002601	龙蟠佰利	94,718	2,914,472.86	0.16
180	600845	宝信软件	42,000	2,897,160.00	0.16
181	603019	中科曙光	83,068	2,843,417.64	0.15
182	000066	中国长城	148,400	2,818,116.00	0.15
183	601108	财通证券	222,663	2,816,686.95	0.15
184	603160	汇顶科技	18,100	2,815,455.00	0.15
185	600760	中航沈飞	35,454	2,771,793.72	0.15
186	600872	中炬高新	41,300	2,752,645.00	0.15
187	601878	浙商证券	177,900	2,721,870.00	0.15
188	600011	华能国际	598,600	2,681,728.00	0.14
189	000977	浪潮信息	99,488	2,674,237.44	0.14
190	002600	领益智造	221,100	2,650,989.00	0.14
191	603833	欧派家居	19,485	2,620,732.50	0.14

192	000728	国元证券	291,229	2,609,411.84	0.14
193	600383	金地集团	190,800	2,575,800.00	0.14
194	600068	葛洲坝	390,997	2,572,760.26	0.14
195	002044	美年健康	226,992	2,571,819.36	0.14
196	600061	国投资本	185,061	2,559,393.63	0.14
197	300136	信维通信	70,753	2,538,617.64	0.14
198	600489	中金黄金	286,284	2,522,162.04	0.14
199	601881	中国银河	199,745	2,498,809.95	0.14
200	000069	华侨城 A	350,929	2,488,086.61	0.13
201	002456	欧菲光	187,080	2,465,714.40	0.13
202	601138	工业富联	176,600	2,417,654.00	0.13
203	600111	北方稀土	184,354	2,413,193.86	0.13
204	002384	东山精密	92,100	2,394,600.00	0.13
205	002024	苏宁易购	310,025	2,390,292.75	0.13
206	002938	鹏鼎控股	48,100	2,389,127.00	0.13
207	003816	中国广核	832,900	2,348,778.00	0.13
208	000671	阳光城	359,226	2,342,153.52	0.13
209	000425	徐工机械	433,646	2,328,679.02	0.13
210	000963	华东医药	87,330	2,319,484.80	0.13
211	000961	中南建设	260,900	2,303,747.00	0.12
212	688036	传音控股	15,000	2,282,100.00	0.12
213	600161	天坛生物	54,300	2,264,310.00	0.12
214	601669	中国电建	583,346	2,263,382.48	0.12
215	002673	西部证券	221,663	2,247,662.82	0.12
216	601800	中国交建	304,588	2,211,308.88	0.12
217	600655	豫园股份	247,700	2,202,053.00	0.12
218	600029	南方航空	369,440	2,201,862.40	0.12
219	300529	健帆生物	32,400	2,197,368.00	0.12
220	601216	君正集团	442,600	2,190,870.00	0.12
221	601360	三六零	137,755	2,164,131.05	0.12
222	603156	养元饮品	83,347	2,153,686.48	0.12
223	601577	长沙银行	226,100	2,152,472.00	0.12
224	600705	中航资本	485,358	2,125,868.04	0.11
225	601933	永辉超市	295,774	2,123,657.32	0.11
226	002146	荣盛发展	317,515	2,073,372.95	0.11
227	600886	国投电力	239,690	2,070,921.60	0.11
228	600010	宝钢股份	1,769,556	2,070,380.52	0.11
229	601162	天风证券	339,230	2,069,303.00	0.11
230	002602	世纪华通	286,845	2,039,467.95	0.11
231	000656	金科股份	287,185	2,036,141.65	0.11
232	601198	东兴证券	151,800	2,021,976.00	0.11
233	002463	沪电股份	106,800	2,006,772.00	0.11



234	002032	苏泊尔	25,700	2,004,343.00	0.11
235	601111	中国国航	265,699	1,990,085.51	0.11
236	000703	恒逸石化	154,370	1,975,936.00	0.11
237	601618	中国中冶	716,738	1,956,694.74	0.11
238	603658	安图生物	13,300	1,930,894.00	0.10
239	000708	中信特钢	87,700	1,910,983.00	0.10
240	601021	春秋航空	33,962	1,882,513.66	0.10
241	600498	烽火通信	77,678	1,870,486.24	0.10
242	002916	深南电路	17,240	1,862,954.40	0.10
243	600115	东方航空	397,920	1,862,265.60	0.10
244	600340	华夏幸福	143,666	1,857,601.38	0.10
245	600362	江西铜业	92,915	1,853,654.25	0.10
246	600066	宇通客车	108,000	1,827,360.00	0.10
247	601658	邮储银行	380,900	1,820,702.00	0.10
248	002422	科伦药业	92,300	1,794,312.00	0.10
249	600369	西南证券	331,892	1,785,578.96	0.10
250	002958	青农商行	347,900	1,770,811.00	0.10
251	600233	圆通速递	152,000	1,748,000.00	0.09
252	600390	五矿资本	250,098	1,745,684.04	0.09
253	300628	亿联网络	23,800	1,740,256.00	0.09
254	600332	白云山	58,869	1,721,918.25	0.09
255	601816	京沪高铁	299,100	1,692,906.00	0.09
256	601872	招商轮船	299,500	1,692,175.00	0.09
257	600637	东方明珠	187,936	1,680,147.84	0.09
258	601990	南京证券	135,400	1,661,358.00	0.09
259	601319	中国人保	247,500	1,626,075.00	0.09
260	601231	环旭电子	84,000	1,624,560.00	0.09
261	600487	亨通光电	115,840	1,620,601.60	0.09
262	002773	康弘药业	33,490	1,612,543.50	0.09
263	600118	中国卫星	48,625	1,564,752.50	0.08
264	600018	上港集团	335,247	1,532,078.79	0.08
265	002120	韵达股份	97,470	1,530,279.00	0.08
266	688009	中国通号	256,300	1,501,918.00	0.08
267	002939	长城证券	116,100	1,494,207.00	0.08
268	600918	中泰证券	79,100	1,463,350.00	0.08
269	002739	万达电影	79,100	1,430,128.00	0.08
270	601236	红塔证券	75,900	1,410,981.00	0.08
271	600004	白云机场	98,600	1,393,218.00	0.08
272	600482	中国动力	74,755	1,339,609.60	0.07
273	600208	新湖中宝	423,345	1,312,369.50	0.07
274	600085	同仁堂	54,787	1,309,409.30	0.07
275	601077	渝农商行	284,100	1,278,450.00	0.07

276	601238	广汽集团	94,600	1,257,234.00	0.07
277	002558	巨人网络	72,004	1,255,029.72	0.07
278	600848	上海临港	62,000	1,241,240.00	0.07
279	600297	广汇汽车	429,020	1,226,997.20	0.07
280	600271	航天信息	96,750	1,219,050.00	0.07
281	000627	天茂集团	248,345	1,209,440.15	0.07
282	000723	美锦能源	179,400	1,198,392.00	0.06
283	002153	石基信息	35,723	1,110,628.07	0.06
284	603195	公牛集团	5,400	1,108,566.00	0.06
285	600027	华电国际	322,500	1,096,500.00	0.06
286	600150	中国船舶	61,000	1,079,090.00	0.06
287	603392	万泰生物	5,300	1,068,109.00	0.06
288	601696	中银证券	38,200	1,057,376.00	0.06
289	600025	华能水电	231,542	1,032,677.32	0.06
290	601808	中海油服	79,200	1,011,384.00	0.05
291	603087	甘李药业	7,480	989,005.60	0.05
292	002945	华林证券	65,400	985,578.00	0.05
293	601698	中国卫通	50,600	917,884.00	0.05
294	600809	山西汾酒	1,000	375,290.00	0.02
295	601888	中国中免	1,000	282,450.00	0.02
296	601012	隆基股份	1,000	92,200.00	0.00
297	601633	长城汽车	1,000	37,810.00	0.00
298	000625	长安汽车	1,000	21,880.00	0.00

### 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	688561	奇安信	22,653	2,782,467.99	0.15
2	601995	中金公司	24,951	1,714,383.21	0.09
3	300866	安克创新	9,451	1,476,057.18	0.08
4	300999	金龙鱼	8,253	728,657.37	0.04
5	688311	盟升电子	4,182	482,435.52	0.03
6	300896	爱美客	473	285,389.28	0.02
7	688221	前沿生物	16,148	276,938.20	0.01
8	300862	蓝盾光电	5,843	225,189.22	0.01
9	688127	蓝特光学	5,322	178,819.20	0.01
10	688338	赛科希德	3,041	166,008.19	0.01
11	300912	凯龙高科	5,117	145,783.33	0.01
12	688569	铁科轨道	6,841	137,504.10	0.01
13	688617	惠泰医疗	1,673	124,571.58	0.01
14	300867	圣元环保	1,498	47,891.06	0.00
15	300926	博俊科技	3,584	38,563.84	0.00

16	300919	中伟股份	610	37,521.10	0.00
17	300900	广联航空	879	29,147.64	0.00
18	300927	江天化学	2,163	28,962.57	0.00
19	300877	金春股份	569	28,933.65	0.00
20	300868	杰美特	593	25,665.04	0.00
21	300871	回盛生物	618	23,916.60	0.00
22	300910	瑞丰新材	474	22,690.38	0.00
23	003026	中晶科技	461	21,740.76	0.00
24	300873	海晨股份	484	19,998.88	0.00
25	300878	维康药业	401	19,536.72	0.00
26	300891	惠云钛业	1,143	18,745.20	0.00
27	003029	吉大正元	716	18,716.24	0.00
28	003028	振邦智能	432	18,010.08	0.00
29	300908	仲景食品	285	17,225.40	0.00
30	300884	狄耐克	499	16,721.49	0.00
31	605179	一鸣食品	939	16,582.74	0.00
32	300898	熊猫乳品	496	16,382.88	0.00
33	300892	品渥食品	272	16,322.72	0.00
34	300909	汇创达	386	15,698.62	0.00
35	300887	谱尼测试	210	15,649.20	0.00
36	300864	南大环境	166	15,081.10	0.00
37	300889	爱克股份	479	14,427.48	0.00
38	300890	翔丰华	286	13,971.10	0.00
39	688063	派能科技	50	12,931.00	0.00
40	300895	铜牛信息	283	12,819.90	0.00
41	300879	大叶股份	466	12,637.92	0.00
42	300882	万胜智能	440	11,347.60	0.00
43	300911	亿田智能	309	10,215.54	0.00
44	300893	松原股份	276	9,682.08	0.00
45	300918	南山智尚	1,063	9,503.22	0.00
46	300922	天秦装备	287	9,063.46	0.00
47	300917	特发服务	281	8,975.14	0.00
48	605277	新亚电子	507	8,593.65	0.00
49	003030	祖名股份	480	7,286.40	0.00
50	300886	华业香料	147	6,713.49	0.00
51	003031	中瓷电子	387	5,909.49	0.00
52	603260	合盛硅业	38	1,270.72	0.00

#### 8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

##### 8.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	000858	五粮液	26,222,899.09	1.28

2	601336	新华保险	21,644,889.64	1.05
3	601688	华泰证券	20,587,909.00	1.00
4	601398	工商银行	19,346,031.00	0.94
5	601211	国泰君安	17,500,116.25	0.85
6	000157	中联重科	16,204,708.24	0.79
7	002714	牧原股份	15,717,019.71	0.77
8	000333	美的集团	14,958,408.82	0.73
9	000776	广发证券	14,744,381.00	0.72
10	601939	建设银行	14,495,224.00	0.71
11	601328	交通银行	14,390,311.00	0.70
12	002241	歌尔股份	14,016,336.44	0.68
13	601601	中国太保	13,377,457.00	0.65
14	601668	中国建筑	12,737,856.00	0.62
15	601155	新城控股	12,423,642.00	0.61
16	600887	伊利股份	12,393,972.00	0.60
17	600998	九州通	12,296,351.16	0.60
18	000895	双汇发展	12,208,116.84	0.59
19	600031	三一重工	11,826,056.00	0.58
20	601838	成都银行	11,789,023.49	0.57

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	000858	五粮液	52,014,386.27	2.53
2	601318	中国平安	50,069,157.60	2.44
3	601012	隆基股份	47,815,382.64	2.33
4	688981	中芯国际	36,256,545.13	1.77
5	601668	中国建筑	27,528,558.56	1.34
6	600519	贵州茅台	26,226,296.15	1.28
7	601229	上海银行	25,073,040.90	1.22
8	601988	中国银行	24,604,241.00	1.20
9	601336	新华保险	22,922,170.48	1.12
10	002475	立讯精密	22,586,238.12	1.10
11	601688	华泰证券	21,993,204.48	1.07
12	000333	美的集团	21,890,364.00	1.07
13	000157	中联重科	21,167,174.53	1.03
14	002594	比亚迪	21,054,527.91	1.03
15	601628	中国人寿	20,120,030.44	0.98
16	600926	杭州银行	18,824,618.20	0.92
17	603160	汇顶科技	18,206,836.00	0.89
18	601888	中国中免	17,741,842.90	0.86

19	002146	荣盛发展	17,686,967.06	0.86
20	600036	招商银行	17,650,984.14	0.86

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	1,428,276,368.07
卖出股票收入（成交）总额	2,113,342,010.44

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工商银行（601398.SH）的发行主体中国工商银行股份有限公司

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）7 号）。工商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	196,685.14
2	应收证券清算款	1,919,386.89
3	应收股利	-
4	应收利息	26,216.70
5	应收申购款	1,044,094.26
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	3,186,382.99

### 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	688561	奇安信	2,782,467.99	0.15	新股锁定
2	601995	中金公司	1,714,383.21	0.09	新股锁定
3	300866	安克创新	1,476,057.18	0.08	新股锁定
4	300999	金龙鱼	728,657.37	0.04	新股锁定
5	688311	盟升电子	482,435.52	0.03	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（%）
大成沪深 300 指数 A	100,613	13,401.72	100,384,546.49	7.44	1,248,002,719.08	92.56
大成沪深 300 指数 C	994	2,137.86	-	-	2,125,033.20	100.00
合计	101,607	13,291.53	100,384,546.49	7.43	1,250,127,752.28	92.57

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 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数（份）	占基金总份额比例（%）
基金管理人所有从业人员持有本基金	大成沪深 300 指数 A	142,590.80	0.0106
	大成沪深 300 指数 C	12,349.49	0.5811
	合计	154,940.29	0.0115

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）。

### 9.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

项目	份额级别	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和研发部门负责人持有本开放式基金	大成沪深 300 指数 A	0
	大成沪深 300 指数 C	0
	合计	0

本基金基金经理持有 本开放式基金	大成沪深 300 指数 A	0
	大成沪深 300 指数 C	0
	合计	0

#### 9.4 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	大成沪深 300 指数 A	大成沪深 300 指数 C
基金合同生效日 (2006 年 4 月 6 日) 基金份额总额	1,813,356,066.47	-
本报告期期初基金份 额总额	1,845,180,674.06	132,754.84
本报告期基金总申购 份额	324,310,268.66	33,360,573.14
减：本报告期基金总 赎回份额	821,103,677.15	31,368,294.78
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	1,348,387,265.57	2,125,033.20

### § 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

本基金投资策略在本报告期内没有重大改变。

### 11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金聘任的为本基金审计的会计师事务所为安永华明会计师事务所(特殊普通合伙)，本报告期应支付的审计费用为 13 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	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
光大证券	2	943,045,025.31	27.01%	859,391.20	27.01%	-
广发证券	2	417,164,885.61	11.95%	380,167.09	11.95%	-
中泰证券	2	402,936,546.45	11.54%	367,192.47	11.54%	-
申万宏源	2	386,013,567.95	11.06%	351,778.27	11.06%	-
兴业证券	2	344,364,348.46	9.86%	313,825.81	9.86%	-
中国银河证券	4	322,004,738.76	9.22%	293,438.48	9.22%	-
招商证券	2	246,406,985.04	7.06%	224,552.27	7.06%	-

国泰君安	3	179,559,395.24	5.14%	163,633.64	5.14%	-
华西证券	1	117,366,721.02	3.36%	106,958.20	3.36%	-
中信建投证 券	2	84,425,708.91	2.42%	76,938.29	2.42%	-
安信证券	1	47,706,837.15	1.37%	43,475.55	1.37%	-
爱建证券	1	-	-	-	-	-
信达证券	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	-	-	-	-	-
国金证券	2	-	-	-	-	-
国盛证券	1	-	-	-	-	-
国信证券	1	-	-	-	-	-
海通证券	1	-	-	-	-	-
红塔证券	1	-	-	-	-	-
华创证券	1	-	-	-	-	-
华泰证券	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	-	-	-	-	-

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	-	-	-	-	-
浙商证券	1	-	-	-	-	-
中金公司	3	-	-	-	-	-
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：

- （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）能提供投资组合运作、管理所需的其他券商服务；
- （六）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交易单元。

本报告期内本基金租用证券公司交易单元的变更情况如下：

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

无。

## 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	大成基金管理有限公司关于基金经理张钟玉女士因延长产假暂停履行职务的公告	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 28 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	关于大成沪深 300 指数证券投资基金暂停大额申购（含定期定额申购）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 22 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	关于大成沪深 300 指数证券投资基金 C 类份额增加珠海盈米基金销售有限公司为代销机构的公告	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 3 日
8	大成沪深 300 指数证券投资基金招募说明书更新	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
9	大成沪深 300 指数证券投资基金托管协议更新	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
10	大成沪深 300 指数证券投资基金基金合同更新	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
11	大成沪深 300 指数证券投资基金基金产品资料概要更新	中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站	2020 年 12 月 2 日
12	大成沪深 300 指数证券投资基金基金产品资料概要更新	中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站	2020 年 12 月 2 日
13	关于大成沪深 300 指数证券投资基金 C 类份额增加上海天天基金销售有限公司为代销机构的公告	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 2 日
14	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

15	大成基金管理有限公司关于旗下部分基金增加腾安基金销售（深圳）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 25 日
16	大成沪深 300 指数证券投资基金第三季度报告	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
17	大成基金管理有限公司关于旗下部分基金增加宁波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 10 月 23 日
18	大成沪深 300 指数证券投资基金基金产品资料概要更新	中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站	2020 年 8 月 27 日
19	大成沪深 300 指数证券投资基金基金产品资料概要更新	中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站	2020 年 8 月 27 日
20	大成沪深 300 指数证券投资基金中期报告	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
21	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
22	大成沪深 300 指数证券投资基金第二季度报告	中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站	2020 年 7 月 21 日
23	大成基金管理有限公司关于旗下部分基金增加重庆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 7 月 13 日
24	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
25	大成基金管理有限公司关于旗下部分基金增加北京肯特瑞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 6 月 22 日
26	大成基金管理有限公司关于基金经理张钟玉女士因休产假暂停履行职务的公告	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 13 日
27	大成基金管理有限公司关于旗下部分基金增加泛华普益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 6 月 5 日
28	大成沪深 300 指数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 5 月 6 日
29	大成沪深 300 指数招募说明书更新	中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本	2020 年 5 月 6 日

		公司网站	
30	大成沪深 300 指数 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	大成沪深 300 指数 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
33	大成基金管理有限公司关于延迟披露旗下公募基金 2019 年年度报告的公告	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 25 日
34	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
35	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
36	大成沪深 300 指数基金恢复大额申购（含定期定额申购）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 2 月 27 日
37	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
38	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
39	大成沪深 300 指数 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
40	大成沪深 300 指数 2019 年度第 1 次分红的公告	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 15 日
41	大成沪深 300 指数基金暂停大额申购（含定期定额申购）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 9 日

## § 12 影响投资者决策的其他重要信息

### 12.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

无。

## 12.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

## § 13 备查文件目录

### 13.1 备查文件目录

- 1、中国证监会批准设立大成沪深 300 指数证券投资基金的文件；
- 2、《大成沪深 300 指数证券投资基金基金合同》；
- 3、《大成沪深 300 指数证券投资基金托管协议》；
- 4、大成基金管理有限公司批准文件、营业执照、公司章程；
- 5、本报告期内在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