

大成沪深 300 指数证券投资基金 2021 年中期报告

2021 年 6 月 30 日

基金管理人：大成基金管理有限公司

基金托管人：中国农业银行股份有限公司

送出日期：2021 年 8 月 31 日

§ 1 重要提示及目录

1.1 重要提示

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

基金托管人中国农业银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2021 年 8 月 30 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告财务资料未经审计。

本报告期自 2021 年 01 月 01 日起至 06 月 30 日止。

1.2 目录

§ 1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
§ 2 基金简介	5
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人和基金托管人	5
2.4 信息披露方式	6
2.5 其他相关资料	6
§ 3 主要财务指标和基金净值表现	6
3.1 主要会计数据和财务指标	6
3.2 基金净值表现	7
§ 4 管理人报告	8
4.1 基金管理人及基金经理情况	8
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	10
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	10
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明	11
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	12
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	12
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	13
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明	13
§ 5 托管人报告	13
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	13
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	13
5.3 托管人对本中期报告中财务信息内容的真实、准确和完整发表意见	13
§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）	14
6.1 资产负债表	14
6.2 利润表	15
6.3 所有者权益（基金净值）变动表	16
6.4 报表附注	17
§ 7 投资组合报告	37
7.1 期末基金资产组合情况	37
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	37
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细	38
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	47
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	49
7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细	49

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细	49
7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细	49
7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细	49
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明	49
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	49
7.12 投资组合报告附注	50
§ 8 基金份额持有人信息	51
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	51
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	51
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况	52
§ 9 开放式基金份额变动	52
§ 10 重大事件揭示	52
10.1 基金份额持有人大会决议	52
10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动	52
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	52
10.4 基金投资策略的改变	53
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	53
10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况	53
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	53
10.8 其他重大事件	55
§ 11 影响投资者决策的其他重要信息	57
11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况	57
11.2 影响投资者决策的其他重要信息	57
§ 12 备查文件目录	57
12.1 备查文件目录	57
12.2 存放地点	57
12.3 查阅方式	57

§ 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	1,313,261,449.40 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	1,309,570,873.80 份	3,690,575.60 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	秦一楠
	联系电话	0755-83183388	010-66060069
	电子邮箱	office@dcfund.com.cn	tgxxpl@abchina.com
客户服务电话		4008885558	95599
传真		0755-83199588	010-68121816
注册地址		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	谷澍

2.4 信息披露方式

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

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	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 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2021年1月1日-2021年6月30日)	
	大成沪深 300 指数 A	大成沪深 300 指数 C
本期已实现收益	178,137,573.54	325,773.80
本期利润	37,215,682.27	185,382.49
加权平均基金份额本期利润	0.0279	0.0686
本期加权平均净值利润率	2.28%	5.65%
本期基金份额净值增长率	1.74%	1.68%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2021年6月30日)	
期末可供分配利润	279,258,338.55	774,005.53
期末可供分配基金份额利润	0.2132	0.2097
期末基金资产净值	1,588,829,212.35	4,464,581.13
期末基金份额净值	1.2132	1.2097
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2021年6月30日)	
基金份额累计净值增长率	323.70%	44.91%

注：1、本期已实现收益指本期利息收入、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。

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

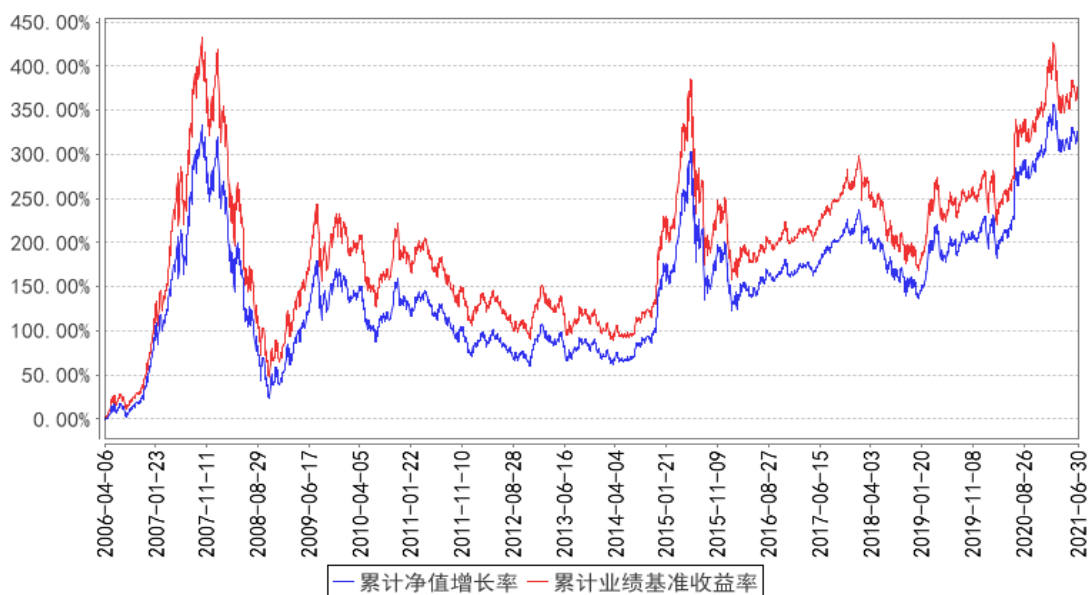
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	-1.46%	0.71%	-2.02%	0.80%	0.56%	-0.09%
过去三个月	3.16%	0.83%	3.48%	0.98%	-0.32%	-0.15%
过去六个月	1.74%	1.10%	0.24%	1.31%	1.50%	-0.21%
过去一年	27.94%	1.18%	25.46%	1.33%	2.48%	-0.15%
过去三年	52.89%	1.25%	48.79%	1.37%	4.10%	-0.12%
自基金合同生效起至今	323.70%	1.62%	373.52%	1.72%	-49.82%	-0.10%

大成沪深 300 指数 C

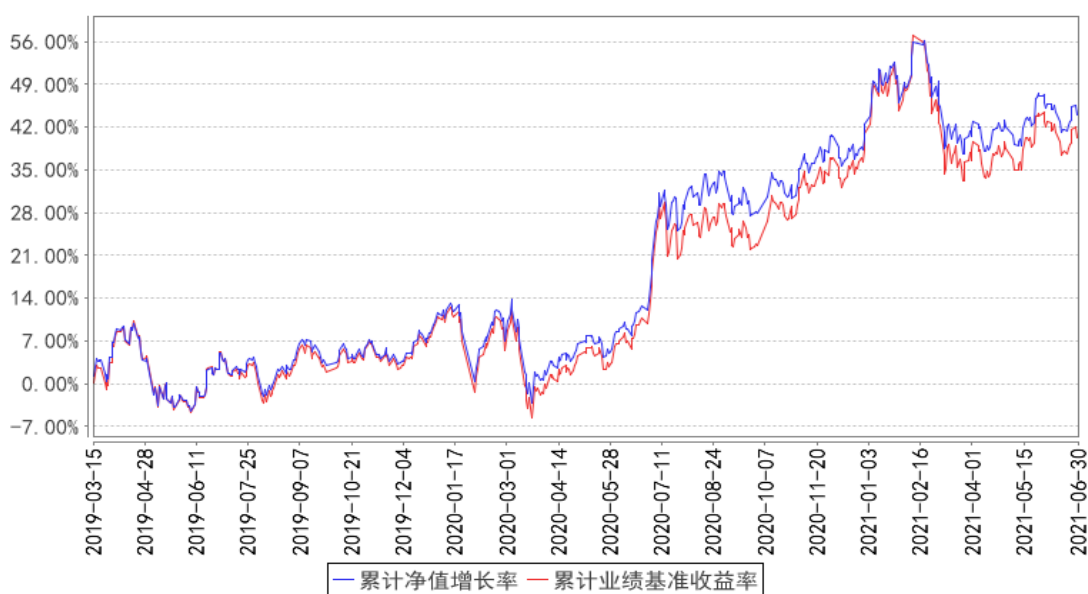
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	-1.47%	0.71%	-2.02%	0.80%	0.55%	-0.09%
过去三个月	3.15%	0.83%	3.48%	0.98%	-0.33%	-0.15%
过去六个月	1.68%	1.10%	0.24%	1.31%	1.44%	-0.21%
过去一年	27.61%	1.18%	25.46%	1.33%	2.15%	-0.15%
自基金合同生效起至今	44.91%	1.20%	41.25%	1.31%	3.66%	-0.11%

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：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、本基金于 2019 年 3 月 11 日起增设 C 类份额。

§ 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 2 亿元人民币，注册地广东省深圳市。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%)。主要业务是公募基金的募集、销售和管理，还具有全国社保基金投资管理、基本养老保险投资管理、受托管理保险资金、保险保障基金投资管理、特定客户资产管理和 QDII 业务资格。

经过二十二年的稳健发展，公司形成了强大稳固的综合实力。公司旗下基金产品齐全、风格多样，构建了涵盖股票型基金、混合型基金、指数型基金、债券型基金和货币市场基金的完备产品线。截至 2021 年 6 月 30 日，本基金管理人共管理 9 只 ETF 及 3 只 ETF 联接基金，8 只 QDII 基金及 107 只开放式证券投资基金。

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		
苏秉毅	本基金基金经理，数量与指数投资部副总监（主持工作）	2016 年 3 月 4 日	-	17 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、数量与指数投资部总监助理，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。2021年4月23日起任大成智慧量化多策略灵活配置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
张钟玉	本基金基金经理	2015年8月26日	-	11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

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

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

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

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

报告期内，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 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不存在同日反向交易。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 2 笔同日反向交易，原因为流动性需要。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

上半年，全球宏观经济继续在复苏的轨道上运行，带动大宗商品价格上涨。尽管受疫情影响，商品供需错配的格局短期内难以得到缓解，但通胀还未成为全球投资者关心的焦点。美国十年国债收益率在一季度显著上行后，二季度则震荡下行。全球流动性也较为宽裕，外资持续流入境内市场。而我国控制疫情较为出色，在本轮周期中也先于其它主要经济体复苏。相较于海外的“大放水”，国内的流动性释放较为克制，也在逐步有序退出非常规的宽松政策。

股票市场上半年则经历了较大的转折。从年初到春节前，市场延续了去年的风格，对消费、新能源等“赛道股”的追捧趋于狂热，少数股票快速上涨带领指数冲高。然而春节后，风格剧烈切换。部分白马股快速下跌，而之前受其“虹吸”影响丧失流动性的大量股票反而迎来转机，形成鲜明对比，价值风格重得青睐。进入二季度，市场止跌回稳，指数保持窄幅震荡。而白马股也出现分化，新能源股票高歌猛进，而传统行业龙头则相对表现不佳，成长风格又再占优。上半年市场基准沪深 300 指数上涨 0.24%。

本基金标的指数沪深 300 指数上涨 0.24%。上半年，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 1.2132 元，本报告期基金份额净值增长率为 1.74%，同期业绩比较基准收益率为 0.24%；截至本报告期末大成沪深 300 指数 C 的基金份额净值为 1.2097 元，本报告期基金份额净值增长率为 1.68%，同期业绩比较基准收益率为 0.24%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望下半年，宏观经济环境面临高度不确定性。新冠疫情反反复复，目前看来很难彻底根除，人类社会需要在抗疫和发展之间取得平衡。无论国内国外，除非放任通胀高企，否则因为疫情而投放的天量流动性终究要回收，如何平稳、有序地退出非常规的货币政策，又将成为各国政府面前的一道难题。而我们还要完成保民生、处置金融风险、科技强国等多重目标，任务更为艰巨。

对于股票市场，我们持总体中性观点。目前市场的估值体系极度分裂，相当多的股票估值处于历史低位，向下空间有限，以上证指数为代表的宽基指数也不会有太大风险。然而，在硬币的另一面，却是部分充满梦想的股票估值远远高于合理水平。这些股票聚集了大量杠杆资金，若出现超预期的利空事件，有可能引发局部剧烈波动，造成阶段性的市场冲击。

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。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金管理人严格按照本基金基金合同的规定进行收益分配。本报告期内大成沪深 300A 已分配利润 237,994,546.44 元、大成沪深 300C 已分配利润 358,957.01 元（A 类每十份基金份额分红 1.850 元，C 类每十份基金份额分红 1.823 元），符合基金合同规定的分红比例。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

无。

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

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《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一大成基金管理有限公司 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日基金的投资运作，进行了认真、独立的会计核算和必要的投资监督，认真履行了托管人的义务，没有从事任何损害基金份额持有人利益的行为。

5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、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《证券投资基金法》等有关法律法规，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、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《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半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，未发现有害基金持有人利益的行为。

§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：大成沪深 300 指数证券投资基金

报告截止日：2021 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2021 年 6 月 30 日	上年度末 2020 年 12 月 31 日
资产：			
银行存款	6.4.3.1	63,858,585.92	129,405,463.54
结算备付金		718,109.21	818,678.59
存出保证金		178,071.23	196,685.14
交易性金融资产	6.4.3.2	1,546,580,669.92	1,726,079,936.76
其中：股票投资		1,496,520,669.92	1,726,079,936.76
基金投资		-	-
债券投资		50,060,000.00	-
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	6.4.3.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.3.4	-	-
应收证券清算款		14,938,976.08	1,919,386.89
应收利息	6.4.3.5	416,658.87	26,216.70
应收股利		-	-
应收申购款		815,016.95	1,044,094.26
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.3.6	-	-
资产总计		1,627,506,088.18	1,859,490,461.88
负债和所有者权益	附注号	本期末 2021 年 6 月 30 日	上年度末 2020 年 12 月 31 日
负债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.3.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		30,920,331.00	-
应付赎回款		1,148,169.46	7,310,930.49
应付管理人报酬		981,705.98	1,156,639.89
应付托管费		196,341.20	231,327.96
应付销售服务费		298.76	151.83
应付交易费用	6.4.3.7	832,161.60	773,005.94
应交税费		-	-
应付利息		-	-

应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.3.8	133,286.70	257,653.01
负债合计		34,212,294.70	9,729,709.12
所有者权益：			
实收基金	6.4.3.9	1,313,261,449.40	1,350,512,298.77
未分配利润	6.4.3.10	280,032,344.08	499,248,453.99
所有者权益合计		1,593,293,793.48	1,849,760,752.76
负债和所有者权益总计		1,627,506,088.18	1,859,490,461.88

注：报告截止日 2021 年 06 月 30 日，基金份额总额 1,313,261,449.40 份，其中大成沪深 300 指数 A 基金份额总额为 1,309,570,873.80 份，基金份额净值 1.2132 元。大成沪深 300 指数 C 基金份额总额为 3,690,575.60 份，基金份额净值 1.2097 元。

6.2 利润表

会计主体：大成沪深 300 指数证券投资基金

本报告期：2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期	上年度可比期间
		2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日	2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日
一、收入		47,511,919.17	65,521,894.40
1. 利息收入		676,001.60	538,451.29
其中：存款利息收入	6.4.3.11	427,015.30	499,481.43
债券利息收入		248,986.30	38,969.86
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）		187,737,047.69	132,315,619.61
其中：股票投资收益	6.4.3.12	176,119,157.67	115,913,046.94
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.3.13	-	49,040.00
资产支持证券投资收益		-	-
贵金属投资收益	6.4.3.14	-	-
衍生工具收益	6.4.3.15	-	-
股利收益	6.4.3.16	11,617,890.02	16,353,532.67
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.3.17	-141,062,282.58	-67,667,025.45

4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.3.18	161,152.46	334,848.95
减：二、费用		10,110,854.41	10,955,180.94
1. 管理人报酬	6.4.6.2.1	6,116,267.56	6,709,864.69
2. 托管费	6.4.6.2.2	1,223,253.60	1,341,972.93
3. 销售服务费	6.4.6.2.3	1,634.50	69.45
4. 交易费用	6.4.3.19	2,624,565.02	2,765,351.94
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	6.4.3.20	145,133.73	137,921.93
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		37,401,064.76	54,566,713.46
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		37,401,064.76	54,566,713.46

6.3 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：2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 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）	1,350,512,298.77	499,248,453.99	1,849,760,752.76
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	37,401,064.76	37,401,064.76
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）	-37,250,849.37	-18,263,671.22	-55,514,520.59
其中：1. 基金申购款	209,630,805.81	50,989,817.04	260,620,622.85
2. 基金赎回款	-246,881,655.18	-69,253,488.26	-316,135,143.44
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）	-	-238,353,503.45	-238,353,503.45
五、期末所有者权益（基金净值）	1,313,261,449.40	280,032,344.08	1,593,293,793.48
项目	上年度可比期间 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 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）	-	54,566,713.46	54,566,713.46
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）	-209,600,347.81	-12,064,042.88	-221,664,390.69
其中：1. 基金申购款	203,667,506.18	5,759,346.97	209,426,853.15
2. 基金赎回款	-413,267,853.99	-17,823,389.85	-431,091,243.84
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）	1,635,713,081.09	145,871,234.00	1,781,584,315.09

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署：

谭晓冈

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

6.4 报表附注

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

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

6.4.2 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。

6.4.3 重要财务报表项目的说明

6.4.3.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 6 月 30 日
活期存款	63,858,585.92

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	63,858,585.92

6.4.3.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 6 月 30 日			
	成本	公允价值	公允价值变动	
股票	1,236,290,756.12	1,496,520,669.92	260,229,913.80	
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	
债券	交易所市场	-	-	
	银行间市场	49,983,650.00	50,060,000.00	76,350.00
	合计	49,983,650.00	50,060,000.00	76,350.00
资产支持证券	-	-	-	
基金	-	-	-	
其他	-	-	-	
合计	1,286,274,406.12	1,546,580,669.92	260,306,263.80	

6.4.3.3 衍生金融资产/负债

无。

6.4.3.4 买入返售金融资产

无。

6.4.3.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 6 月 30 日
应收活期存款利息	13,008.23
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	290.88
应收债券利息	403,287.67
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	72.09
合计	416,658.87

6.4.3.6 其他资产

无。

6.4.3.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2021年6月30日
交易所市场应付交易费用	831,886.60
银行间市场应付交易费用	275.00
合计	832,161.60

6.4.3.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2021年6月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	2,334.67
应付证券出借违约金	-
预提费用	130,952.03
合计	133,286.70

6.4.3.9 实收基金

金额单位：人民币元

大成沪深 300 指数 A

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月30日	
	基金份额(份)	账面金额
上年度末	1,348,387,265.57	1,348,387,265.57
本期申购	199,420,128.07	199,420,128.07
本期赎回(以“-”号填列)	-238,236,519.84	-238,236,519.84
本期末	1,309,570,873.80	1,309,570,873.80

大成沪深 300 指数 C

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月30日	
	基金份额(份)	账面金额
上年度末	2,125,033.20	2,125,033.20
本期申购	10,210,677.74	10,210,677.74
本期赎回(以“-”号填列)	-8,645,135.34	-8,645,135.34
本期末	3,690,575.60	3,690,575.60

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

6.4.3.10 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	884,289,461.57	-385,815,066.28	498,474,395.29
本期利润	178,137,573.54	-140,921,891.27	37,215,682.27
本期基金份额交易产生的变动数	-32,146,459.25	13,709,266.68	-18,437,192.57
其中：基金申购款	110,229,073.49	-61,441,858.15	48,787,215.34
基金赎回款	-142,375,532.74	75,151,124.83	-67,224,407.91
本期已分配利润	-237,994,546.44	-	-237,994,546.44
本期末	792,286,029.42	-513,027,690.87	279,258,338.55

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	1,380,992.88	-606,934.18	774,058.70
本期利润	325,773.80	-140,391.31	185,382.49
本期基金份额交易产生的变动数	869,193.06	-695,671.71	173,521.35
其中：基金申购款	5,933,414.74	-3,730,813.04	2,202,601.70
基金赎回款	-5,064,221.68	3,035,141.33	-2,029,080.35
本期已分配利润	-358,957.01	-	-358,957.01
本期末	2,217,002.73	-1,442,997.20	774,005.53

6.4.3.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	419,077.70
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	6,298.69
其他	1,638.91
合计	427,015.30

6.4.3.12 股票投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
卖出股票成交总额	955,182,410.21
减：卖出股票成本总额	779,063,252.54
买卖股票差价收入	176,119,157.67

6.4.3.13 债券投资收益

无。

6.4.3.14 贵金属投资收益

无。

6.4.3.15 衍生工具收益

无。

6.4.3.16 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
股票投资产生的股利收益	11,617,890.02
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	11,617,890.02

6.4.3.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
1. 交易性金融资产	-141,062,282.58
股票投资	-141,138,632.58
债券投资	76,350.00
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	-141,062,282.58

6.4.3.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
基金赎回费收入	161,152.46
合计	161,152.46

注：本基金的赎回费率按持有期间递减，赎回费总额的 25% 归入基金资产。

6.4.3.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期
	2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
交易所市场交易费用	2,624,290.02
银行间市场交易费用	275.00
合计	2,624,565.02

6.4.3.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期
	2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
审计费用	66,944.66
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
银行划款手续费	5,181.70
账户维护费	13,500.00
合计	145,133.73

6.4.3.21 分部报告

无。

6.4.4 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.4.1 或有事项

无。

6.4.4.2 资产负债表日后事项

无。

6.4.5 关联方关系

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

无。

6.4.5.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
大成基金管理有限公司（“大成基金”）	基金管理人、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

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。

6.4.6 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.6.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.6.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2021年1月1日至2021年6月30日		上年度可比期间 2020年1月1日至2020年6月30日	
	成交金额	占当期股票 成交总额的比例 (%)	成交金额	占当期股票 成交总额的比例 (%)
光大证券	266,342,936.14	16.29	491,609,901.60	29.23

6.4.6.1.2 债券交易

无。

6.4.6.1.3 债券回购交易

无。

6.4.6.1.4 权证交易

无。

6.4.6.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2021年1月1日至2021年6月30日			
	当期 佣金	占当期佣金总量 的比例 (%)	期末应付佣金余 额	占期末应付佣金 总额的比例 (%)
光大证券	242,714.30	16.29	129,707.19	15.59
关联方名称	上年度可比期间 2020年1月1日至2020年6月30日			
	当期 佣金	占当期佣金总量 的比例 (%)	期末应付佣金余 额	占期末应付佣金 总额的比例 (%)
光大证券	447,999.12	29.23	289,224.06	41.98

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。

6.4.6.2 关联方报酬

6.4.6.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日	2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	6,116,267.56	6,709,864.69
其中：支付销售机构的客户维护费	1,556,715.11	1,584,053.79

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% 的年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 0.75\% / \text{当年天数}$$

H 为每日应支付的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

6.4.6.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日	2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	1,223,253.60	1,341,972.93

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% 的年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 0.15\% / \text{当年天数}$$

H 为每日应支付的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

6.4.6.2.3 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		
	2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	大成沪深 300 指数 A	大成沪深 300 指数 C	合计

大成基金	-	412.19	412.19
合计	-	412.19	412.19
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2020年1月1日至2020年6月30日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	大成沪深 300 指数 A	大成沪深 300 指数 C	合计
大成基金	-	69.45	69.45
合计	-	69.45	69.45

注：支付基金销售机构的销售服务费按前一日 C 类基金份额基金资产净值的约定年费率计提，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。C 类基金份额约定的销售服务费年费率分别为 0.10%。其计算公式为：

日销售服务费 = 前一日 C 类基金资产净值 × 0.10% / 当年天数。

6.4.6.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

无。

6.4.6.4 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。

6.4.6.5 各关联方投资本基金的情况

6.4.6.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

无。

6.4.6.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

无。

6.4.6.6 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 2021年1月1日至2021年6月30日		上年度可比期间 2020年1月1日至2020年6月30日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国农业银行	63,858,585.92	419,077.70	150,760,248.16	489,087.51

注：本基金由基金托管人保管的银行存款，按银行约定利率计息。

6.4.6.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

无。

6.4.6.8 其他关联交易事项的说明

无。

6.4.7 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
		场内	场外					
1	2021 年 1 月 18 日	-	2021 年 1 月 18 日	1.8500	126,800, 341.62	111,194,20 4.82	237,994, 546.44	-
合计	-	-	-	1.8500	126,800, 341.62	111,194,20 4.82	237,994, 546.44	-
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
		场内	场外					
1	2021 年 1 月 18 日	-	2021 年 1 月 18 日	1.8230	328,705. 30	30,251.71	358,957. 01	-
合计	-	-	-	1.8230	328,705. 30	30,251.71	358,957. 01	-

6.4.8 期末(2021 年 6 月 30 日)本基金持有的流通受限证券

6.4.8.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

6.4.8.1.1 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
300614	百川 畅银	2021 年 5 月 18 日	2021 年 11 月 25 日	新股锁 定	9.19	40.38	329	3,023.51	13,285.02	-
300926	博俊 科技	2020 年 12 月 29 日	2021 年 7 月 7 日	新股锁 定	10.76	22.20	359	3,862.84	7,969.80	-
300927	江天 化学	2020 年 12 月 29 日	2021 年 7 月 7 日	新股锁 定	13.39	30.10	217	2,905.63	6,531.70	-
300929	华骐 环保	2021 年 1 月 12 日	2021 年 7 月 20 日	新股锁 定	13.87	29.55	183	2,538.21	5,407.65	-

		日	日								
300932	三友联众	2021年 1月15 日	2021年 7月22 日	新股锁 定	24.69	31.71	492	12,147.48	15,601.32		-
300933	中辰股份	2021年 1月15 日	2021年 7月22 日	新股锁 定	3.37	10.44	1,112	3,747.44	11,609.28		-
300937	药易购	2021年 1月20 日	2021年 7月27 日	新股锁 定	12.25	53.71	244	2,989.00	13,105.24		-
300940	南极光	2021年 1月27 日	2021年 8月3 日	新股锁 定	12.76	43.38	307	3,917.32	13,317.66		-
300941	创识科技	2021年 2月2 日	2021年 8月9 日	新股锁 定	21.31	49.94	399	8,502.69	19,926.06		-
300942	易瑞生物	2021年 2月2 日	2021年 8月9 日	新股锁 定	5.31	28.52	443	2,352.33	12,634.36		-
300943	春晖智控	2021年 2月3 日	2021年 8月10 日	新股锁 定	9.79	23.01	255	2,496.45	5,867.55		-
300945	曼卡龙	2021年 2月3 日	2021年 8月10 日	新股锁 定	4.56	18.88	474	2,161.44	8,949.12		-
300950	德固特	2021年 2月24 日	2021年 9月3 日	新股锁 定	8.41	39.13	219	1,841.79	8,569.47		-
300952	恒辉安防	2021年 3月3 日	2021年 9月13 日	新股锁 定	11.72	27.08	340	3,984.80	9,207.20		-
300953	震裕科技	2021年 3月11 日	2021年 9月22 日	新股锁 定	28.77	99.85	240	6,904.80	23,964.00		-
300955	嘉亨家化	2021年 3月16 日	2021年 9月24 日	新股锁 定	16.53	46.07	232	3,834.96	10,688.24		-
300956	英力股份	2021年 3月16 日	2021年 9月27 日	新股锁 定	12.85	25.80	371	4,767.35	9,571.80		-
300957	贝泰妮	2021年 3月18 日	2021年 9月27 日	新股锁 定	47.33	251.96	853	40,372.49	214,921.88		-
300958	建工	2021年	2021年	新股锁	8.53	27.22	300	2,559.00	8,166.00		-

	修复	3月18日	9月29日	定							
300960	通业科技	2021年3月22日	2021年9月29日	新股锁定	12.08	23.06	234	2,826.72	5,396.04		-
300961	深水海纳	2021年3月23日	2021年9月30日	新股锁定	8.48	22.07	394	3,341.12	8,695.58		-
300962	中金辐照	2021年3月29日	2021年10月11日	新股锁定	3.40	16.37	576	1,958.40	9,429.12		-
300963	中洲特材	2021年3月30日	2021年10月11日	新股锁定	12.13	22.49	283	3,432.79	6,364.67		-
300966	共同药业	2021年3月31日	2021年10月11日	新股锁定	8.24	31.54	286	2,356.64	9,020.44		-
300967	晓鸣股份	2021年4月2日	2021年10月13日	新股锁定	4.54	11.54	507	2,301.78	5,850.78		-
300968	格林精密	2021年4月6日	2021年10月15日	新股锁定	6.87	12.07	1,162	7,982.94	14,025.34		-
300971	博亚精工	2021年4月7日	2021年10月15日	新股锁定	18.24	28.29	245	4,468.80	6,931.05		-
300973	立高食品	2021年4月8日	2021年10月15日	新股锁定	28.28	115.71	360	10,180.80	41,655.60		-
300975	商络电子	2021年4月14日	2021年10月21日	新股锁定	5.48	13.03	492	2,696.16	6,410.76		-
300978	东箭科技	2021年4月15日	2021年10月26日	新股锁定	8.42	13.60	593	4,993.06	8,064.80		-
300979	华利集团	2021年4月15日	2021年10月26日	新股锁定	33.22	87.50	925	30,728.50	80,937.50		-
300981	中红医疗	2021年4月19日	2021年10月27日	新股锁定	48.59	90.39	601	29,202.59	54,324.39		-
300982	苏文电能	2021年4月19日	2021年10月27日	新股锁定	15.83	45.29	317	5,018.11	14,356.93		-

300986	志特新材	2021年 4月21 日	2021年 11月1 日	新股锁 定	14.79	30.57	264	3,904.56	8,070.48	-
300991	创益通	2021年 5月12 日	2021年 11月 22日	新股锁 定	13.06	26.51	254	3,317.24	6,733.54	-
300992	泰福泵业	2021年 5月17 日	2021年 11月 25日	新股锁 定	9.36	20.32	200	1,872.00	4,064.00	-
300993	玉马遮阳	2021年 5月17 日	2021年 11月 24日	新股锁 定	12.10	19.29	410	4,961.00	7,908.90	-
300995	奇德新材	2021年 5月17 日	2021年 11月 26日	新股锁 定	14.72	23.32	191	2,811.52	4,454.12	-
300996	普联软件	2021年 5月26 日	2021年 12月3 日	新股锁 定	20.81	42.23	241	5,015.21	10,177.43	-
300997	欢乐家	2021年 5月26 日	2021年 12月2 日	新股锁 定	4.94	13.05	928	4,584.32	12,110.40	-
300998	宁波方正	2021年 5月25 日	2021年 12月2 日	新股锁 定	6.02	21.32	201	1,210.02	4,285.32	-
301002	崧盛股份	2021年 5月27 日	2021年 12月7 日	新股锁 定	18.71	57.62	201	3,760.71	11,581.62	-
301007	德迈仕	2021年 6月4 日	2021年 12月 16日	新股锁 定	5.29	14.44	303	1,602.87	4,375.32	-
301009	可靠股份	2021年 6月8 日	2021年 12月 17日	新股锁 定	12.54	27.89	801	10,044.54	22,339.89	-
301010	晶雪节能	2021年 6月9 日	2021年 12月 20日	新股锁 定	7.83	17.61	218	1,706.94	3,838.98	-
301011	华立科技	2021年 6月9 日	2021年 12月 17日	新股锁 定	14.20	33.84	175	2,485.00	5,922.00	-
301012	扬电科技	2021年 6月15 日	2021年 12月 22日	新股锁 定	8.05	24.26	170	1,368.50	4,124.20	-
301013	利和兴	2021年 6月21 日	2021年 12月	新股锁 定	8.72	27.11	471	4,107.12	12,768.81	-

		日	29 日								
301015	百洋医药	2021 年 6 月 22 日	2021 年 12 月 30 日	新股锁定	7.64	38.83	462	3,529.68	17,939.46		-
301016	雷尔伟	2021 年 6 月 23 日	2021 年 12 月 30 日	新股锁定	13.75	32.98	275	3,781.25	9,069.50		-
301020	密封科技	2021 年 6 月 28 日	2021 年 7 月 6 日	新股未上市	10.64	10.64	4,210	44,794.40	44,794.40		-
301021	英诺激光	2021 年 6 月 28 日	2021 年 7 月 6 日	新股未上市	9.46	9.46	2,899	27,424.54	27,424.54		-
605162	新中港	2021 年 6 月 29 日	2021 年 7 月 7 日	新股未上市	6.07	6.07	1,377	8,358.39	8,358.39		-
688087	英科再生	2021 年 6 月 30 日	2021 年 7 月 9 日	新股未上市	21.96	21.96	2,469	54,219.24	54,219.24		-
688113	联测科技	2021 年 4 月 26 日	2021 年 11 月 8 日	新股锁定	19.14	49.29	1,415	27,083.10	69,745.35		-
688183	生益电子	2021 年 2 月 10 日	2021 年 8 月 25 日	新股锁定	12.42	14.19	18,394	228,453.48	261,010.86		-
688226	威腾电气	2021 年 6 月 28 日	2021 年 7 月 7 日	新股未上市	6.42	6.42	2,693	17,289.06	17,289.06		-
688239	航宇科技	2021 年 6 月 25 日	2021 年 7 月 5 日	新股未上市	11.48	11.48	4,926	56,550.48	56,550.48		-
688499	利元亨	2021 年 6 月 23 日	2021 年 7 月 1 日	新股未上市	38.85	38.85	2,149	83,488.65	83,488.65		-
688625	呈和科技	2021 年 5 月 31 日	2021 年 12 月 7 日	新股锁定	16.48	42.63	2,672	44,034.56	113,907.36		-

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。

6.4.8.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量(股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
002024	苏宁易购	2021年6月16日	重大事项	5.59	2021年7月6日	6.15	250,425	2,657,193.82	1,399,875.75	-

注：本基金截至本期末止持有以上因公布的重大事项可能产生重大影响而被暂时停牌的股票，该类股票将在所公布事项的重大影响消除后，经交易所批准复牌。

6.4.8.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

无。

6.4.8.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

无。

6.4.9 金融工具风险及管理

6.4.9.1 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。

6.4.9.2 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，本基金未持有除国债、央行票据和政策性金融债以外的债券（上年度末：同）。

6.4.9.3 流动性风险

流动性风险是指基金在履行与金融负债有关的义务时遇到资金短缺的风险。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难或因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理的价格变现。

6.4.9.3.1 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%。

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。

6.4.9.4 市场风险

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

6.4.9.4.1 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、结算备付金及债券投资等。

6.4.9.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2021 年 6 月 30 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	63,858,585.92	-	-	-	63,858,585.92
结算备付金	718,109.21	-	-	-	718,109.21
存出保证金	178,071.23	-	-	-	178,071.23
交易性金融资产	50,060,000.00	-	-	1,496,520,669.92	1,546,580,669.92
应收利息	-	-	-	416,658.87	416,658.87
应收申购款	12,261.75	-	-	802,755.20	815,016.95
应收证券清算款	-	-	-	14,938,976.08	14,938,976.08
资产总计	114,827,028.11	-	-	1,512,679,060.07	1,627,506,088.18

负债					
应付赎回款	-	-	-	1,148,169.46	1,148,169.46
应付管理人报酬	-	-	-	981,705.98	981,705.98
应付托管费	-	-	-	196,341.20	196,341.20
应付证券清算款	-	-	-	30,920,331.00	30,920,331.00
应付销售服务费	-	-	-	298.76	298.76
应付交易费用	-	-	-	832,161.60	832,161.60
其他负债	-	-	-	133,286.70	133,286.70
负债总计	-	-	-	34,212,294.70	34,212,294.70
利率敏感度缺口	114,827,028.11	-	-	-1,478,466,765.37	1,593,293,793.48
上年度末 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

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。

6.4.9.4.1.2 利率风险的敏感性分析

于本期末，本基金持有的交易性债券投资公允价值占基金资产净值的比例为 3.14%(上年度末：无)，因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响(上年度末：同)。

6.4.9.4.2 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。

6.4.9.4.3 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%。

6.4.9.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2021年6月30日		上年度末 2020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	1,496,520,669.92	93.93	1,726,079,936.76	93.31
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	1,496,520,669.92	93.93	1,726,079,936.76	93.31

6.4.9.4.3.2 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（2021年6月30日）	上年度末（2020年12月31日）
分析	沪深300指数上升5%	66,516,893.60	85,175,496.87
	沪深300指数下降5%	-66,516,893.60	-85,175,496.87

6.4.10 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

无。

§ 7 投资组合报告

7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	1,496,520,669.92	91.95
	其中：股票	1,496,520,669.92	91.95
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	50,060,000.00	3.08
	其中：债券	50,060,000.00	3.08
	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	64,576,695.13	3.97
8	其他各项资产	16,348,723.13	1.00
9	合计	1,627,506,088.18	100.00

7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 报告期末指数投资按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	15,728,917.34	0.99
B	采矿业	31,630,014.03	1.99
C	制造业	822,930,632.02	51.65
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	26,454,033.51	1.66
E	建筑业	19,265,737.19	1.21
F	批发和零售业	10,735,444.24	0.67
G	交通运输、仓储和邮政业	43,874,172.52	2.75
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	49,182,599.34	3.09
J	金融业	354,341,102.56	22.24
K	房地产业	30,863,453.97	1.94
L	租赁和商务服务业	27,431,188.88	1.72
M	科学研究和技术服务业	21,420,948.33	1.34
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	2,709,433.00	0.17
Q	卫生和社会工作	31,913,980.54	2.00
R	文化、体育和娱乐业	6,265,344.80	0.39
S	综合	-	-

	合计	1,494,747,002.27	93.81
--	----	------------------	-------

7.2.2 报告期末积极投资按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	5,850.78	0.00
B	采矿业	-	-
C	制造业	1,573,653.27	0.10
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	13,020.39	0.00
E	建筑业	14,356.93	0.00
F	批发和零售业	46,404.58	0.00
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	42,333.89	0.00
J	金融业	34,721.10	0.00
K	房地产业	7,772.46	0.00
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	35,554.25	0.00
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	1,773,667.65	0.11

7.2.3 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

无。

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	600519	贵州茅台	44,258	91,025,428.60	5.71
2	601318	中国平安	781,357	50,225,627.96	3.15
3	600036	招商银行	868,142	47,044,614.98	2.95
4	000858	五粮液	137,689	41,016,176.21	2.57
5	601012	隆基股份	304,061	27,012,779.24	1.70
6	600276	恒瑞医药	314,477	21,375,001.69	1.34
7	002415	海康威视	327,842	21,145,809.00	1.33
8	601888	中国中免	68,800	20,646,880.00	1.30

9	601166	兴业银行	979,815	20,135,198.25	1.26
10	603259	药明康德	125,587	19,665,668.33	1.23
11	300059	东方财富	579,915	19,015,412.85	1.19
12	000651	格力电器	339,489	17,687,376.90	1.11
13	000333	美的集团	231,008	16,487,040.96	1.03
14	600900	长江电力	797,562	16,461,679.68	1.03
15	002594	比亚迪	63,700	15,988,700.00	1.00
16	002475	立讯精密	342,847	15,770,962.00	0.99
17	600887	伊利股份	426,808	15,719,338.64	0.99
18	000001	平安银行	680,718	15,397,841.16	0.97
19	600030	中信证券	597,832	14,909,930.08	0.94
20	000725	京东方 A	2,376,163	14,827,257.12	0.93
21	300015	爱尔眼科	189,479	13,449,219.42	0.84
22	601398	工商银行	2,458,018	12,707,953.06	0.80
23	000568	泸州老窖	51,400	12,127,316.00	0.76
24	600031	三一重工	416,806	12,116,550.42	0.76
25	600309	万华化学	110,314	12,004,369.48	0.75
26	603501	韦尔股份	36,800	11,849,600.00	0.74
27	603288	海天味业	88,544	11,417,748.80	0.72
28	000002	万科 A	477,419	11,367,346.39	0.71
29	002714	牧原股份	184,703	11,233,636.46	0.71
30	600809	山西汾酒	24,400	10,931,200.00	0.69
31	601988	中国银行	3,473,740	10,699,119.20	0.67
32	300122	智飞生物	56,489	10,548,190.97	0.66
33	601919	中远海控	339,322	10,362,893.88	0.65
34	002142	宁波银行	252,878	9,854,655.66	0.62
35	600436	片仔癀	21,111	9,464,061.30	0.59
36	601328	交通银行	1,925,808	9,436,459.20	0.59
37	601899	紫金矿业	968,799	9,387,662.31	0.59
38	002304	洋河股份	42,515	8,809,108.00	0.55
39	002812	恩捷股份	37,200	8,708,520.00	0.55
40	002352	顺丰控股	128,200	8,679,140.00	0.54
41	002230	科大讯飞	124,574	8,418,710.92	0.53
42	300014	亿纬锂能	79,761	8,289,560.73	0.52
43	600000	浦发银行	823,528	8,235,280.00	0.52
44	300274	阳光电源	71,513	8,228,285.78	0.52
45	600438	通威股份	189,700	8,208,319.00	0.52
46	601688	华泰证券	510,875	8,071,825.00	0.51
47	300124	汇川技术	108,600	8,064,636.00	0.51
48	601668	中国建筑	1,713,994	7,970,072.10	0.50
49	600837	海通证券	677,393	7,790,019.50	0.49
50	000661	长春高新	19,700	7,623,900.00	0.48

51	000100	TCL 科技	984,222	7,529,298.30	0.47
52	601816	京沪高铁	1,376,700	7,282,743.00	0.46
53	000063	中兴通讯	216,620	7,198,282.60	0.45
54	002241	歌尔股份	167,853	7,174,037.22	0.45
55	300347	泰格医药	37,040	7,159,832.00	0.45
56	603986	兆易创新	37,648	7,074,059.20	0.44
57	601601	中国太保	240,193	6,958,391.21	0.44
58	600585	海螺水泥	168,768	6,927,926.40	0.43
59	600690	海尔智家	265,434	6,877,394.94	0.43
60	002271	东方雨虹	124,100	6,865,212.00	0.43
61	603799	华友钴业	59,854	6,835,326.80	0.43
62	002460	赣锋锂业	56,400	6,829,476.00	0.43
63	300142	沃森生物	110,100	6,793,170.00	0.43
64	002027	分众传媒	720,968	6,784,308.88	0.43
65	600016	民生银行	1,493,772	6,587,534.52	0.41
66	600763	通策医疗	15,700	6,452,700.00	0.40
67	600196	复星医药	84,701	6,109,483.13	0.38
68	600048	保利地产	504,287	6,071,615.48	0.38
69	600703	三安光电	188,202	6,031,874.10	0.38
70	000338	潍柴动力	332,992	5,950,567.04	0.37
71	600919	江苏银行	828,010	5,878,871.00	0.37
72	002129	中环股份	148,900	5,747,540.00	0.36
73	601229	上海银行	698,611	5,728,610.20	0.36
74	600050	中国联通	1,306,136	5,642,507.52	0.35
75	600660	福耀玻璃	98,426	5,497,092.10	0.35
76	600570	恒生电子	58,513	5,456,337.25	0.34
77	601211	国泰君安	316,039	5,416,908.46	0.34
78	600104	上汽集团	246,300	5,411,211.00	0.34
79	601766	中国中车	852,704	5,184,440.32	0.33
80	688111	金山办公	12,900	5,092,920.00	0.32
81	601169	北京银行	1,039,780	5,063,728.60	0.32
82	600999	招商证券	259,839	4,942,137.78	0.31
83	002371	北方华创	17,600	4,881,888.00	0.31
84	600019	宝钢股份	624,652	4,772,341.28	0.30
85	002311	海大集团	58,400	4,765,440.00	0.30
86	002049	紫光国微	29,700	4,579,443.00	0.29
87	002410	广联达	66,800	4,555,760.00	0.29
88	601088	中国神华	231,746	4,523,681.92	0.28
89	600406	国电南瑞	194,570	4,521,806.80	0.28
90	300498	温氏股份	312,824	4,495,280.88	0.28
91	601818	光大银行	1,160,900	4,388,202.00	0.28
92	300601	康泰生物	29,000	4,321,000.00	0.27

93	600745	闻泰科技	43,600	4,224,840.00	0.27
94	000625	长安汽车	159,000	4,178,520.00	0.26
95	000538	云南白药	35,726	4,134,212.72	0.26
96	600028	中国石化	939,169	4,094,776.84	0.26
97	600893	航发动力	74,769	3,976,963.11	0.25
98	300450	先导智能	66,040	3,971,645.60	0.25
99	601628	中国人寿	116,362	3,943,508.18	0.25
100	600346	恒力石化	147,979	3,882,968.96	0.24
101	601658	邮储银行	762,300	3,826,746.00	0.24
102	600588	用友网络	114,711	3,815,287.86	0.24
103	002821	凯莱英	10,100	3,763,260.00	0.24
104	601390	中国中铁	713,245	3,737,403.80	0.23
105	601633	长城汽车	85,400	3,722,586.00	0.23
106	300595	欧普康视	35,784	3,705,433.20	0.23
107	601009	南京银行	351,079	3,693,351.08	0.23
108	002493	荣盛石化	212,463	3,669,236.01	0.23
109	601377	兴业证券	375,401	3,626,373.66	0.23
110	601857	中国石油	670,556	3,547,241.24	0.22
111	688036	传音控股	16,642	3,486,499.00	0.22
112	300413	芒果超媒	50,000	3,430,000.00	0.22
113	601225	陕西煤业	280,864	3,328,238.40	0.21
114	600132	重庆啤酒	16,800	3,325,560.00	0.21
115	600584	长电科技	87,200	3,285,696.00	0.21
116	002601	龙佰集团	94,718	3,275,348.44	0.21
117	300408	三环集团	76,632	3,250,729.44	0.20
118	600009	上海机场	67,479	3,247,764.27	0.20
119	600426	华鲁恒升	103,780	3,211,991.00	0.20
120	600111	北方稀土	152,654	3,159,937.80	0.20
121	601939	建设银行	472,262	3,140,542.30	0.20
122	688012	中微公司	18,905	3,136,717.60	0.20
123	000776	广发证券	207,102	3,135,524.28	0.20
124	601100	恒立液压	36,412	3,128,519.04	0.20
125	002001	新和成	108,432	3,109,829.76	0.20
126	603882	金城医学	19,400	3,099,538.00	0.19
127	300433	蓝思科技	104,900	3,085,109.00	0.19
128	000895	双汇发展	96,797	3,078,144.60	0.19
129	600926	杭州银行	208,076	3,069,121.00	0.19
130	002179	中航光电	38,410	3,035,158.20	0.19
131	002050	三花智控	125,777	3,016,132.46	0.19
132	000166	申万宏源	633,510	2,964,826.80	0.19
133	600958	东方证券	293,274	2,929,807.26	0.18
134	002841	视源股份	23,553	2,927,402.37	0.18

135	600741	华域汽车	110,655	2,906,906.85	0.18
136	600600	青岛啤酒	25,000	2,891,250.00	0.18
137	300003	乐普医疗	88,717	2,849,590.04	0.18
138	000963	华东医药	61,530	2,830,995.30	0.18
139	002007	华兰生物	77,095	2,827,844.60	0.18
140	000786	北新建材	71,200	2,794,600.00	0.18
141	688169	石头科技	2,200	2,774,200.00	0.17
142	000157	中联重科	298,200	2,755,368.00	0.17
143	601006	大秦铁路	416,557	2,740,945.06	0.17
144	603806	福斯特	25,800	2,712,354.00	0.17
145	002607	中公教育	129,700	2,709,433.00	0.17
146	601901	方正证券	289,000	2,705,040.00	0.17
147	601336	新华保险	58,825	2,700,655.75	0.17
148	600029	南方航空	445,540	2,682,150.80	0.17
149	600015	华夏银行	432,713	2,678,493.47	0.17
150	002236	大华股份	125,849	2,655,413.90	0.17
151	601989	中国重工	641,195	2,641,723.40	0.17
152	600143	金发科技	126,600	2,640,876.00	0.17
153	601155	新城控股	63,250	2,631,200.00	0.17
154	600176	中国巨石	168,427	2,612,302.77	0.16
155	601138	工业富联	209,500	2,599,895.00	0.16
156	000768	中航西飞	97,588	2,564,612.64	0.16
157	603993	洛阳钼业	495,044	2,554,427.04	0.16
158	601877	正泰电器	75,679	2,526,165.02	0.16
159	600352	浙江龙盛	182,200	2,503,428.00	0.16
160	600010	包钢股份	1,601,956	2,483,031.80	0.16
161	600760	中航沈飞	40,956	2,469,646.80	0.16
162	300529	健帆生物	28,300	2,443,988.00	0.15
163	001979	招商蛇口	222,279	2,433,955.05	0.15
164	601600	中国铝业	458,643	2,430,807.90	0.15
165	600547	山东黄金	126,410	2,429,600.20	0.15
166	002008	大族激光	60,146	2,429,296.94	0.15
167	601186	中国铁建	322,453	2,395,825.79	0.15
168	603369	今世缘	44,100	2,388,456.00	0.15
169	002202	金风科技	194,468	2,364,730.88	0.15
170	601916	浙商银行	586,900	2,329,993.00	0.15
171	000876	新希望	157,633	2,312,476.11	0.15
172	601799	星宇股份	10,000	2,257,200.00	0.14
173	002555	三七互娱	93,729	2,251,370.58	0.14
174	003816	中国广核	826,400	2,206,488.00	0.14
175	000938	紫光股份	100,495	2,198,830.60	0.14
176	603899	晨光文具	25,800	2,181,648.00	0.14

177	002736	国信证券	202,000	2,171,500.00	0.14
178	601066	中信建投	68,500	2,152,955.00	0.14
179	600109	国金证券	169,337	2,148,886.53	0.13
180	000069	华侨城 A	287,329	2,137,727.76	0.13
181	300136	信维通信	68,353	2,110,740.64	0.13
182	600989	宝丰能源	154,000	2,106,720.00	0.13
183	000425	徐工机械	329,946	2,101,756.02	0.13
184	603160	汇顶科技	16,100	2,087,043.00	0.13
185	600150	中国船舶	126,100	2,081,911.00	0.13
186	601669	中国电建	535,446	2,072,176.02	0.13
187	603659	璞泰来	15,000	2,049,000.00	0.13
188	688008	澜起科技	32,513	2,028,160.94	0.13
189	000977	浪潮信息	71,688	2,016,583.44	0.13
190	600795	国电电力	826,905	2,009,379.15	0.13
191	002384	东山精密	96,100	2,002,724.00	0.13
192	000783	长江证券	271,624	1,988,287.68	0.12
193	601238	广汽集团	152,800	1,978,760.00	0.12
194	603019	中科曙光	71,468	1,973,231.48	0.12
195	600085	同仁堂	48,187	1,968,438.95	0.12
196	600079	人福医药	68,900	1,947,803.00	0.12
197	002624	完美世界	81,444	1,947,326.04	0.12
198	000596	古井贡酒	8,100	1,939,950.00	0.12
199	601838	成都银行	152,463	1,927,132.32	0.12
200	300558	贝达药业	17,600	1,905,024.00	0.12
201	600183	生益科技	80,700	1,889,187.00	0.12
202	600886	国投电力	195,690	1,880,580.90	0.12
203	300677	英科医疗	15,050	1,878,240.00	0.12
204	601985	中国核电	368,410	1,864,154.60	0.12
205	000703	恒逸石化	155,270	1,855,476.50	0.12
206	601108	财通证券	176,463	1,851,096.87	0.12
207	300144	宋城演艺	109,746	1,843,732.80	0.12
208	601360	三六零	150,855	1,841,939.55	0.12
209	002600	领益智造	198,600	1,825,134.00	0.11
210	002414	高德红外	65,920	1,818,073.60	0.11
211	601555	东吴证券	217,333	1,812,557.22	0.11
212	000066	中国长城	123,900	1,808,940.00	0.11
213	002252	上海莱士	236,778	1,773,467.22	0.11
214	603833	欧派家居	12,485	1,772,370.60	0.11
215	300676	华大基因	14,800	1,755,280.00	0.11
216	002044	美年健康	192,392	1,752,691.12	0.11
217	002938	鹏鼎控股	48,700	1,747,356.00	0.11
218	300033	同花顺	15,300	1,725,534.00	0.11

219	600522	中天科技	172,050	1,720,500.00	0.11
220	688396	华润微	18,800	1,711,176.00	0.11
221	601607	上海医药	80,737	1,705,972.81	0.11
222	000728	国元证券	214,029	1,705,811.13	0.11
223	002602	世纪华通	261,545	1,679,118.90	0.11
224	600332	白云山	48,869	1,654,215.65	0.10
225	601077	渝农商行	412,200	1,644,678.00	0.10
226	600161	天坛生物	48,000	1,644,000.00	0.10
227	600872	中炬高新	38,900	1,634,578.00	0.10
228	601111	中国国航	210,099	1,634,570.22	0.10
229	600362	江西铜业	72,915	1,631,837.70	0.10
230	600383	金地集团	158,100	1,618,944.00	0.10
231	601800	中国交建	247,488	1,603,722.24	0.10
232	600845	宝信软件	31,480	1,602,332.00	0.10
233	600115	中国东航	313,920	1,594,713.60	0.10
234	300628	亿联网络	18,700	1,567,060.00	0.10
235	002508	老板电器	33,300	1,548,450.00	0.10
236	000860	顺鑫农业	36,400	1,535,352.00	0.10
237	603517	绝味食品	18,200	1,534,078.00	0.10
238	600061	国投资本	179,765	1,526,204.85	0.10
239	601727	上海电气	359,700	1,525,128.00	0.10
240	002916	深南电路	13,540	1,504,700.20	0.09
241	601618	中国中冶	498,838	1,486,537.24	0.09
242	601162	天风证券	304,030	1,477,585.80	0.09
243	000708	中信特钢	70,700	1,473,388.00	0.09
244	601021	春秋航空	25,662	1,460,167.80	0.09
245	600705	中航产融	375,858	1,454,570.46	0.09
246	601878	浙商证券	109,400	1,430,952.00	0.09
247	603939	益丰药房	25,340	1,421,320.60	0.09
248	688363	华熙生物	5,100	1,417,086.00	0.09
249	002024	苏宁易购	250,425	1,399,875.75	0.09
250	600606	绿地控股	255,794	1,394,077.30	0.09
251	601990	南京证券	129,500	1,362,340.00	0.09
252	002456	欧菲光	150,780	1,338,926.40	0.08
253	002157	正邦科技	110,600	1,321,670.00	0.08
254	002463	沪电股份	84,900	1,313,403.00	0.08
255	600011	华能国际	307,700	1,298,494.00	0.08
256	000656	金科股份	223,485	1,293,978.15	0.08
257	600521	华海药业	61,400	1,282,032.00	0.08
258	601933	永辉超市	267,874	1,267,044.02	0.08
259	600655	豫园股份	108,800	1,260,992.00	0.08
260	603392	万泰生物	4,820	1,249,247.60	0.08

261	600118	中国卫星	41,425	1,212,095.50	0.08
262	601696	中银证券	58,800	1,210,692.00	0.08
263	601216	君正集团	237,800	1,210,402.00	0.08
264	600848	上海临港	66,720	1,194,288.00	0.07
265	600489	中金黄金	135,384	1,167,010.08	0.07
266	600018	上港集团	243,347	1,160,765.19	0.07
267	603195	公牛集团	5,700	1,151,400.00	0.07
268	002558	巨人网络	84,704	1,126,563.20	0.07
269	601995	中金公司	18,200	1,119,300.00	0.07
270	601998	中信银行	214,784	1,095,398.40	0.07
271	002120	韵达股份	80,870	1,094,171.10	0.07
272	601872	招商轮船	226,680	1,047,261.60	0.07
273	002673	西部证券	125,763	1,037,544.75	0.07
274	601319	中国人保	174,900	1,037,157.00	0.07
275	688009	中国通号	180,345	1,026,163.05	0.06
276	688126	沪硅产业	34,700	1,012,546.00	0.06
277	603338	浙江鼎力	16,900	991,861.00	0.06
278	002739	万达电影	62,800	991,612.00	0.06
279	601881	中国银河	90,145	971,763.10	0.06
280	603658	安图生物	12,030	911,513.10	0.06
281	600233	圆通速递	88,600	886,886.00	0.06
282	603233	大参林	16,616	849,243.76	0.05
283	600482	中国动力	45,455	791,826.10	0.05
284	601231	环旭电子	46,200	776,622.00	0.05
285	002153	石基信息	31,272	735,204.72	0.05
286	600025	华能水电	126,642	733,257.18	0.05
287	002939	长城证券	65,000	723,450.00	0.05
288	600340	华夏幸福	137,466	720,321.84	0.05
289	002032	苏泊尔	11,200	714,448.00	0.04
290	000800	一汽解放	65,300	706,546.00	0.04
291	601236	红塔证券	51,100	692,916.00	0.04
292	002773	康弘药业	26,190	605,774.70	0.04
293	601808	中海油服	41,600	597,376.00	0.04
294	600918	中泰证券	52,900	572,378.00	0.04
295	601698	中国卫通	30,600	495,414.00	0.03
296	603087	甘李药业	4,220	449,767.60	0.03
297	600299	安迪苏	27,920	333,923.20	0.02
298	002945	华林证券	19,400	268,108.00	0.02

7.3.2 期末积极投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比
----	------	------	-------	---------	----------

					例 (%)
1	688183	生益电子	18,394	261,010.86	0.02
2	300957	贝泰妮	853	214,921.88	0.01
3	688625	呈和科技	2,672	113,907.36	0.01
4	300919	中伟股份	610	99,430.00	0.01
5	688499	利元亨	2,149	83,488.65	0.01
6	300979	华利集团	925	80,937.50	0.01
7	688113	联测科技	1,415	69,745.35	0.00
8	688239	航宇科技	4,926	56,550.48	0.00
9	300981	中红医疗	601	54,324.39	0.00
10	688087	英科再生	2,469	54,219.24	0.00
11	301020	密封科技	4,210	44,794.40	0.00
12	300973	立高食品	360	41,655.60	0.00
13	601528	瑞丰银行	2,230	34,721.10	0.00
14	301021	英诺激光	2,899	27,424.54	0.00
15	300953	震裕科技	240	23,964.00	0.00
16	301009	可靠股份	801	22,339.89	0.00
17	300941	创识科技	399	19,926.06	0.00
18	301015	百洋医药	462	17,939.46	0.00
19	688226	威腾电气	2,693	17,289.06	0.00
20	300932	三友联众	492	15,601.32	0.00
21	300982	苏文电能	317	14,356.93	0.00
22	300968	格林精密	1,162	14,025.34	0.00
23	001208	华菱线缆	1,754	13,558.42	0.00
24	300940	南极光	307	13,317.66	0.00
25	300614	百川畅银	329	13,285.02	0.00
26	300937	药易购	244	13,105.24	0.00
27	301013	利和兴	471	12,768.81	0.00
28	300942	易瑞生物	443	12,634.36	0.00
29	603171	税友股份	637	12,230.40	0.00
30	300997	欢乐家	928	12,110.40	0.00
31	300933	中辰股份	1,112	11,609.28	0.00
32	301002	崧盛股份	201	11,581.62	0.00
33	300918	南山智尚	1,063	11,065.83	0.00
34	300955	嘉亨家化	232	10,688.24	0.00
35	300996	普联软件	241	10,177.43	0.00
36	300922	天秦装备	287	9,996.21	0.00
37	300956	英力股份	371	9,571.80	0.00
38	300962	中金辐照	576	9,429.12	0.00
39	300952	恒辉安防	340	9,207.20	0.00
40	301016	雷尔伟	275	9,069.50	0.00
41	300966	共同药业	286	9,020.44	0.00
42	300945	曼卡龙	474	8,949.12	0.00

43	300961	深水海纳	394	8,695.58	0.00
44	300950	德固特	219	8,569.47	0.00
45	605162	新中港	1,377	8,358.39	0.00
46	300958	建工修复	300	8,166.00	0.00
47	300986	志特新材	264	8,070.48	0.00
48	300978	东箭科技	593	8,064.80	0.00
49	300926	博俊科技	359	7,969.80	0.00
50	300993	玉马遮阳	410	7,908.90	0.00
51	300917	特发服务	281	7,772.46	0.00
52	300971	博亚精工	245	6,931.05	0.00
53	300991	创益通	254	6,733.54	0.00
54	300927	江天化学	217	6,531.70	0.00
55	300975	商络电子	492	6,410.76	0.00
56	300963	中洲特材	283	6,364.67	0.00
57	301011	华立科技	175	5,922.00	0.00
58	300943	春晖智控	255	5,867.55	0.00
59	300967	晓鸣股份	507	5,850.78	0.00
60	300929	华骐环保	183	5,407.65	0.00
61	300960	通业科技	234	5,396.04	0.00
62	605011	杭州热电	525	4,662.00	0.00
63	300995	奇德新材	191	4,454.12	0.00
64	301007	德迈仕	303	4,375.32	0.00
65	300998	宁波方正	201	4,285.32	0.00
66	301012	扬电科技	170	4,124.20	0.00
67	300992	泰福泵业	200	4,064.00	0.00
68	301010	晶雪节能	218	3,838.98	0.00
69	603260	合盛硅业	38	2,922.58	0.00

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	600519	贵州茅台	53,712,670.44	2.90
2	601888	中国中免	27,525,556.00	1.49
3	601012	隆基股份	25,116,868.77	1.36
4	601318	中国平安	20,717,826.00	1.12
5	600809	山西汾酒	15,646,067.00	0.85
6	000568	泸州老窖	15,534,532.00	0.84
7	000333	美的集团	14,099,400.00	0.76
8	002594	比亚迪	11,815,338.73	0.64
9	002271	东方雨虹	11,429,671.00	0.62
10	600030	中信证券	10,221,398.00	0.55
11	600436	片仔癀	9,136,855.00	0.49

12	002714	牧原股份	8,893,812.00	0.48
13	002460	赣锋锂业	8,328,579.00	0.45
14	600036	招商银行	7,959,930.00	0.43
15	600600	青岛啤酒	7,668,750.00	0.41
16	300274	阳光电源	7,516,958.82	0.41
17	002415	海康威视	7,330,889.00	0.40
18	000625	长安汽车	7,149,926.00	0.39
19	601668	中国建筑	7,110,334.80	0.38
20	601816	京沪高铁	6,018,616.00	0.33

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

7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	600519	贵州茅台	33,977,694.65	1.84
2	000333	美的集团	30,983,254.53	1.67
3	601318	中国平安	19,018,971.46	1.03
4	002714	牧原股份	18,166,452.65	0.98
5	002241	歌尔股份	15,970,350.42	0.86
6	000568	泸州老窖	14,431,465.00	0.78
7	600887	伊利股份	13,217,374.06	0.71
8	002271	东方雨虹	12,272,473.50	0.66
9	601155	新城控股	11,714,491.00	0.63
10	601211	国泰君安	11,674,788.00	0.63
11	601939	建设银行	11,527,793.97	0.62
12	600030	中信证券	11,436,821.94	0.62
13	000858	五粮液	11,038,632.00	0.60
14	601398	工商银行	10,588,138.89	0.57
15	600998	九州通	10,585,589.07	0.57
16	600600	青岛啤酒	10,194,550.74	0.55
17	300059	东方财富	10,154,844.04	0.55
18	300676	华大基因	9,702,912.09	0.52
19	600299	安迪苏	9,159,761.98	0.50
20	601377	兴业证券	8,645,351.00	0.47

注：本期累计卖出金额指卖出成交金额（成交单价乘以成交数量），不考虑相关交易费用。

7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	690,642,618.28
卖出股票收入（成交）总额	955,182,410.21

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。

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	50,060,000.00	3.14
	其中：政策性金融债	50,060,000.00	3.14
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	50,060,000.00	3.14

7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
1	210301	21 进出 01	500,000	50,060,000.00	3.14

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

无。

7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

无。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

无。

7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

无。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

无。

7.12 投资组合报告附注

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

1. 本基金投资的前十名证券之一招商银行（600036.SH）的发行主体招商银行股份有限公司于 2021 年 5 月 17 日因为同业投资提供第三方信用担保、为非保本理财产品出具保本承诺，部分未按规定计提风险加权资产等，受到中国银行保险监督管理委员会处罚（银保监罚决字〔2021〕16 号）。招商银行为本基金跟踪标的指数的成份股。

2. 本基金投资的前十名证券之一 21 进出 01（210301.IB）的发行主体中国进出口银行于 2021 年 7 月 13 日因违规投资企业股权等，受到中国银行保险监督管理委员会处罚（银保监罚决字〔2021〕31 号）。本基金认为，对中国进出口银行的处罚不会对其投资价值构成实质性负面影响。

3. 本基金投资的前十名证券之一兴业银行（601166.SH）的发行主体兴业银行股份有限公司于 2021 年 8 月 13 日因违反信用信息采集、提供、查询及相关管理规定，受到中国人民银行处罚（银罚字〔2021〕26 号）。兴业银行为本基金跟踪标的指数的成份股。

7.12.2 基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库

本基金投资的前十名股票未超出基金合同规定的备选股票库。

7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	178,071.23
2	应收证券清算款	14,938,976.08
3	应收股利	-
4	应收利息	416,658.87
5	应收申购款	815,016.95
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	16,348,723.13

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

无。

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

7.12.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

无。

7.12.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

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	688183	生益电子	261,010.86	0.02	新股锁定
2	300957	贝泰妮	214,921.88	0.01	新股锁定
3	688625	呈和科技	113,907.36	0.01	新股锁定
4	300919	中伟股份	99,430.00	0.01	新股锁定
5	688499	利元亨	83,488.65	0.01	新股未上市

7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入原因，分项之和与合计可能有尾差。

§ 8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额级别	持有人户数 (户)	户均持有的基金份额	持有人结构			
			机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总份额比例 (%)	持有份额	占总份额比例 (%)
大成沪深 300 指数 A	95,744	13,677.84	100,628,402.04	7.68	1,208,942,471.76	92.32
大成沪深 300 指数 C	1,687	2,187.66	-	-	3,690,575.60	100.00
合计	97,431	13,478.89	100,628,402.04	7.66	1,212,633,047.36	92.34

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

2、持有人户数为有效户数，即存量份额大于零的账户。

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数 (份)	占基金总份额比例 (%)
基金管理人所有从业人员持有本基金	大成沪深 300 指数 A	49,862.04	0.0038
	大成沪深 300 指数 C	400.16	0.0108
	合计	50,262.20	0.0038

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

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

项目	份额级别	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	大成沪深 300 指数 A	0~10
	大成沪深 300 指数 C	0
	合计	0~10
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 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	1,348,387,265.57	2,125,033.20
本报告期基金总申购份额	199,420,128.07	10,210,677.74
减：本报告期基金总赎回份额	238,236,519.84	8,645,135.34
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	1,309,570,873.80	3,690,575.60

§ 10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

无。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

一、基金管理人的重大人事变动

基金管理人报告期内无重大人事变动。

二、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

2021 年 5 月，中国农业银行总行决定谭敦宇任托管业务部总裁。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

无。

10.4 基金投资策略的改变

本基金投资策略在本报告期内没有重大改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金聘任的为本基金审计的会计师事务所为安永华明会计师事务所(特殊普通合伙)。该事务所自基金合同生效日起为本基金提供审计服务至今。

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

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。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
中信建投证券	2	292,129,280.71	17.87%	266,220.18	17.87%	-
华西证券	1	275,170,421.88	16.83%	250,765.56	16.83%	-
光大证券	2	266,342,936.14	16.29%	242,714.30	16.29%	-
中泰证券	2	167,815,339.44	10.26%	152,932.12	10.26%	-
兴业证券	2	153,464,474.31	9.39%	139,851.71	9.39%	-
中信证券	2	145,535,908.21	8.90%	132,626.36	8.90%	-
华泰证券	1	94,667,086.16	5.79%	86,271.65	5.79%	-
国泰君安	3	80,160,705.68	4.90%	73,050.65	4.90%	-
国盛证券	1	62,883,084.62	3.85%	57,306.20	3.85%	-
东财证券	1	49,871,013.58	3.05%	45,447.27	3.05%	-
招商证券	2	44,570,789.01	2.73%	40,619.63	2.73%	-
广发证券	2	2,429,321.88	0.15%	2,213.93	0.15%	-
爱建证券	1	-	-	-	-	-
安信证券	1	-	-	-	-	-
长城证券	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	-	-	-	-	-
国信证券	1	-	-	-	-	-
海通证券	1	-	-	-	-	-
红塔证券	1	-	-	-	-	-
华创证券	1	-	-	-	-	-
民生证券	1	-	-	-	-	-
南京证券	1	-	-	-	-	-
平安证券	1	-	-	-	-	-
瑞银证券	2	-	-	-	-	-
山西证券	1	-	-	-	-	-
上海证券	1	-	-	-	-	-
申万宏源	1	-	-	-	-	-
申万宏源西 部	1	-	-	-	-	-
世纪证券	1	-	-	-	-	-
天风证券	2	-	-	-	-	-
万和证券	1	-	-	-	-	-
西部证券	1	-	-	-	-	-
湘财证券	1	-	-	-	-	-
信达证券	1	-	-	-	-	-
粤开证券	1	-	-	-	-	-

浙商证券	1	-	-	-	-	-
中国银河证 券	4	-	-	-	-	-
中金公司	3	-	-	-	-	-
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。本报告期内本基金退租的交易单元：无，新增交易单元：无。

10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

无。

10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	关于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	2021年6月30日
2	大成基金管理有限公司关于旗下部分基金增加平安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	2021年6月28日
3	大成基金管理有限公司关于旗下部分基金增加招商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	2021年5月12日

4	大成基金管理有限公司关于旗下部分基金增加上海中正达广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	2021 年 5 月 12 日
5	大成沪深 300 指数证券投资基金更新招募说明书	中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站	2021 年 5 月 6 日
6	大成沪深 300 指数证券投资基金第一季度报告	中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站	2021 年 4 月 22 日
7	大成沪深 300 指数证券投资基金更新招募说明书	中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站	2021 年 3 月 30 日
8	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	2021 年 3 月 30 日
9	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	2021 年 3 月 30 日
10	大成沪深 300 指数证券投资基金 2020 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	2021 年 3 月 30 日
11	大成沪深 300 指数证券投资基金基金合同	中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站	2021 年 3 月 30 日
12	大成基金管理有限公司提醒投资者谨防金融诈骗的公告	中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站	2021 年 3 月 23 日
13	大成基金管理有限公司关于旗下部分基金增加上海联泰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	2021 年 3 月 17 日
14	大成基金管理有限公司关于基金经理张钟玉女士恢复履行职务的公告	中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站	2021 年 1 月 25 日
15	大成沪深 300 指数证券投资基金第四季度报告	中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站	2021 年 1 月 22 日
16	关于大成沪深 300 指数证券投资基金恢复大额申购（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	2021 年 1 月 20 日
17	大成基金管理有限公司关于大成沪深 300 指数证券投资基金 2020 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	2021 年 1 月 14 日

§ 11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

无。

11.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§ 12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

- 1、中国证监会批准设立大成沪深 300 指数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、本报告期内在规定报刊上披露的各种公告原稿。

12.2 存放地点

备查文件存放在本基金管理人和托管人的住所。

12.3 查阅方式

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

大成基金管理有限公司

2021 年 8 月 31 日