

大成恒生指数证券投资基金（LOF）

2023 年中期报告

2023 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：中国工商银行股份有限公司

送出日期：2023 年 8 月 30 日

§ 1 重要提示及目录

1.1 重要提示

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

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2023 年 8 月 29 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告财务资料未经审计。

本报告期自 2023 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 境外投资顾问和境外资产托管人..... | 6 |
| 2.5 信息披露方式..... | 6 |
| 2.6 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..... | 9 |
| 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明..... | 9 |
| 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..... | 10 |
| 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望..... | 10 |
| 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明..... | 10 |
| 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明..... | 11 |
| 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..... | 11 |
| §5 托管人报告 | 11 |
| 5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明..... | 11 |
| 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..... | 12 |
| 5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见..... | 12 |
| §6 半年度财务会计报告（未经审计） | 12 |
| 6.1 资产负债表..... | 12 |
| 6.2 利润表..... | 13 |
| 6.3 净资产（基金净值）变动表..... | 15 |
| 6.4 报表附注..... | 17 |
| §7 投资组合报告 | 36 |
| 7.1 期末基金资产组合情况..... | 36 |
| 7.2 期末在各个国家（地区）证券市场的权益投资分布..... | 36 |
| 7.3 期末按行业分类的权益投资组合..... | 36 |
| 7.4 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有权益投资明细..... | 37 |
| 7.5 报告期内权益投资组合的重大变动..... | 44 |
| 7.6 期末按债券信用等级分类的债券投资组合..... | 46 |
| 7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名债券投资明细..... | 46 |

| | |
|---|-----------|
| 7.8 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的所有资产支持证券投资明细 | 46 |
| 7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名金融衍生品投资明细 | 46 |
| 7.10 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名基金投资明细 | 46 |
| 7.11 投资组合报告附注..... | 46 |
| §8 基金份额持有人信息..... | 47 |
| 8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构..... | 47 |
| 8.2 期末上市基金前十名持有人..... | 47 |
| 8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况..... | 48 |
| 8.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况 | 48 |
| §9 开放式基金份额变动..... | 48 |
| §10 重大事件揭示..... | 48 |
| 10.1 基金份额持有人大会决议..... | 48 |
| 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 | 48 |
| 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼..... | 48 |
| 10.4 基金投资策略的改变..... | 48 |
| 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况..... | 49 |
| 10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况..... | 49 |
| 10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况..... | 49 |
| 10.8 其他重大事件..... | 50 |
| §11 影响投资者决策的其他重要信息 | 51 |
| 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 | 51 |
| 11.2 影响投资者决策的其他重要信息..... | 51 |
| §12 备查文件目录..... | 51 |
| 12.1 备查文件目录..... | 51 |
| 12.2 存放地点..... | 51 |
| 12.3 查阅方式..... | 51 |

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

| | |
|--------------|-------------------|
| 基金名称 | 大成恒生指数证券投资基金（LOF） |
| 基金简称 | 大成恒生指数（QDII-LOF） |
| 场内简称 | 恒生指数 LOF |
| 基金主代码 | 160924 |
| 交易代码 | 160924 |
| 基金运作方式 | 上市契约型开放式（LOF） |
| 基金合同生效日 | 2017 年 8 月 10 日 |
| 基金管理人 | 大成基金管理有限公司 |
| 基金托管人 | 中国工商银行股份有限公司 |
| 报告期末基金份额总额 | 131,518,095.84 份 |
| 基金合同存续期 | 不定期 |
| 基金份额上市的证券交易所 | 深圳证券交易所 |
| 上市日期 | 2017 年 8 月 28 日 |

2.2 基金产品说明

| | |
|--------|---|
| 投资目标 | 本基金进行被动式指数化投资，紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化。 |
| 投资策略 | 本基金主要按照标的指数的成份股及其权重构建基金股票投资组合，并根据标的指数成份股及其权重的变动进行相应调整。但因特殊情况（如股票停牌、流动性不足）导致无法获得足够数量的股票时，或者因为法律法规的限制无法投资某只股票时，基金管理人将采用其他指数投资技术适当调整基金投资组合，以达到跟踪标的指数的目的。 |
| 业绩比较基准 | 恒生指数收益率×95%+人民币活期存款利率（税后）×5% |
| 风险收益特征 | 本基金为股票型基金，其长期平均风险和预期收益率高于混合型基金、债券型基金及货币市场基金。本基金为指数型基金，被动跟踪标的指数的表现，具有与标的指数以及标的指数所代表的股票市场相似的风险收益特征。 |

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 | 中国工商银行股份有限公司 |
| 信息披露 负责人 | 姓名 | 段皓静 | 郭明 |
| | 联系电话 | 0755-83183388 | 010-66105799 |
| | 电子邮箱 | office@dcfund.com.cn | custody@icbc.com.cn |
| 客户服务电话 | | 4008885558 | 95588 |
| 传真 | | 0755-83199588 | 010-66105798 |
| 注册地址 | | 广东省深圳市南山区海德三道 1236 号大成基金总部大厦 5 | 北京市西城区复兴门内大街 55 号 |

| | | |
|-------|--|----------------------|
| | 层、27-33 层 | |
| 办公地址 | 广东省深圳市南山区海德三道 1236 号大成基金总部大厦 5 层、27-33 层 | 北京市西城区复兴门内大街 55 号 |
| 邮政编码 | 518054 | 100140 |
| 法定代表人 | 吴庆斌 | 陈四清 |

2.4 境外投资顾问和境外资产托管人

| 项目 | | 境外资产托管人 |
|------|----|------------------------------------|
| 名称 | 英文 | BNP Paribas Securities Services |
| | 中文 | 法国巴黎银行 |
| 注册地址 | | 3 RUE D' ANTIN 75002 PARIS, FRANCE |
| 办公地址 | | 3 RUE D' ANTIN 75002 PARIS, FRANCE |
| 邮政编码 | | 75002 PARIS |

2.5 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 |

2.6 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(2023 年 1 月 1 日-2023 年 6 月 30 日) |
|---------------|-------------------------------------|
| 本期已实现收益 | 793,376.79 |
| 本期利润 | -480,741.49 |
| 加权平均基金份额本期利润 | -0.0037 |
| 本期加权平均净值利润率 | -0.47% |
| 本期基金份额净值增长率 | -0.90% |
| 3.1.2 期末数据和指标 | 报告期末(2023 年 6 月 30 日) |
| 期末可供分配利润 | -30,656,539.45 |
| 期末可供分配基金份额利润 | -0.2331 |
| 期末基金资产净值 | 100,861,556.39 |
| 期末基金份额净值 | 0.767 |
| 3.1.3 累计期末指标 | 报告期末(2023 年 6 月 30 日) |
| 基金份额累计净值增长率 | -23.30% |

注：1、本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用和信用减值损失后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

2、期末可供分配利润，采用期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数（为期末余额，不是当期发生数）。

3、所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

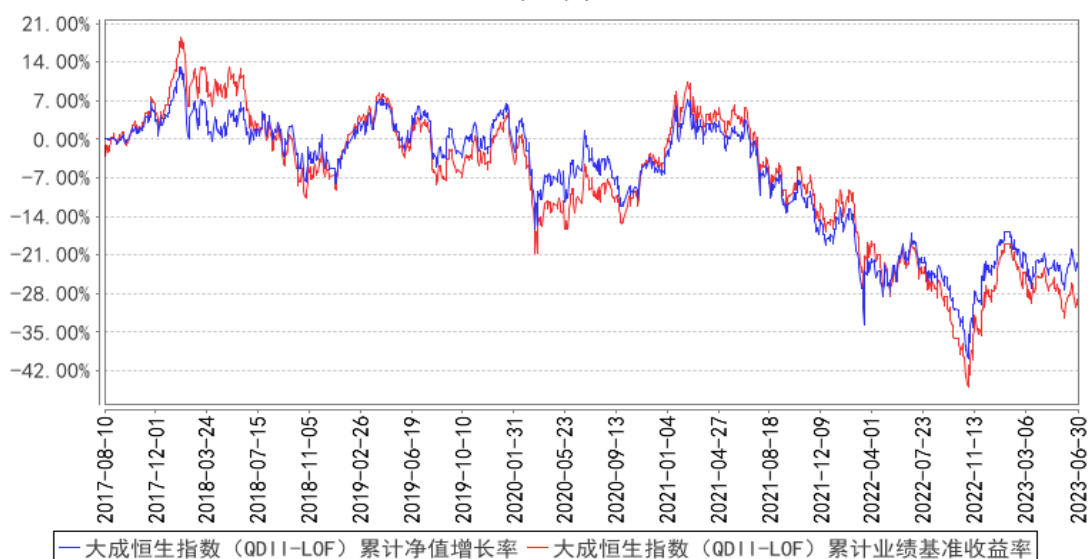
3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

| 阶段 | 份额净值增长率① | 份额净值增长率标准差② | 业绩比较基准收益率③ | 业绩比较基准收益率标准差④ | ①-③ | ②-④ |
|------------|----------|-------------|------------|---------------|-------|--------|
| 过去一个月 | 5.65% | 1.28% | 3.56% | 1.38% | 2.09% | -0.10% |
| 过去三个月 | -1.67% | 1.10% | -6.90% | 1.15% | 5.23% | -0.05% |
| 过去六个月 | -0.90% | 1.24% | -4.10% | 1.29% | 3.20% | -0.05% |
| 过去一年 | -5.77% | 1.50% | -12.68% | 1.60% | 6.91% | -0.10% |
| 过去三年 | -18.92% | 1.40% | -21.20% | 1.47% | 2.28% | -0.07% |
| 自基金合同生效起至今 | -23.30% | 1.29% | -29.99% | 1.34% | 6.69% | -0.05% |

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

大成恒生指数（QDII-LOF）累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



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

§ 4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

大成基金管理有限公司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 等资格。

历经 24 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。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

| 姓名 | 职务 | 任本基金的基金经理（助理）期限 | | 证券从业年限 | 说明 |
|-----|---------|-----------------|------|--------|--|
| | | 任职日期 | 离任日期 | | |
| 冉凌浩 | 本基金基金经理 | 2017 年 8 月 10 日 | - | 20 年 | 英国曼彻斯特大学商学院金融学硕士。2003 年 4 月至 2004 年 6 月就职于国信证券研究部，任研究员。2004 年 6 月至 2005 年 9 月就职于华西证券研究部，任高级研究员。2005 年 9 月加入大成基金管理有限公司，曾担任金融工程师、境外市场研究员及基金经理助理，现任国际业务部基金经理。2011 年 8 月 26 日起任大成标普 500 等权重指数型证券投资基金基金经理。2014 年 11 月 13 日起任大成纳斯达克 100 指数证券投资基金基金经理。2016 年 12 月 2 日至 2023 年 3 月 14 日任大成恒生综合中小型股指数基金（QDII-LOF）基金经理。2016 年 12 月 29 日至 2020 年 7 月 7 日任大成海外中国机会混合型证券投资基金（LOF）基金经理。2017 年 8 月 10 日起任大成恒生指数证券投资基金（LOF）基金经理。2019 年 3 月 20 日起任大成中华沪深港 300 指数证券投资基金（LOF）基金经理。2021 年 5 月 18 日 |

| | | | | | |
|--|--|--|--|--|--|
| | | | | | 起任大成恒生科技交易型开放式指数证券投资基金（QDII）基金经理。2021 年 9 月 9 日起任大成恒生科技交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金基金经理。2023 年 7 月 12 日起任大成纳斯达克 100 交易型开放式指数证券投资基金（QDII）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，公司严格执行了公平交易的原则和制度。公司运用统计分析方法和工具，对旗下所有投资组合间连续 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，针对同一基金经理管理的多个投资组合及公私募兼任基金经理管理的多个投资组合的投资交易行为加强了公平交易监测与分析，包括对不同时间窗下（同日、3 日、5 日、10 日）反向交易和同向交易价差监控的分析。分析结果表明：债券交易同向交易频率较低；部分股票同向交易溢价率较大主要来源于投资策略差异、市场因素（如个股当日价格振幅较高）及组合经理交易时机选择，即投资组合成交时间不一致以及成交价格的日内较大变动导致个别些组合间的成交价格差异较大，同时结合交易价差专项统计分析，未发现违反公平交易原则的异常情况。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

报告期内，公司旗下所有投资组合未发现存在异常交易行为。公司旗下所有投资组合参与的交易所公开竞价，未发生成交较少的单边交易量超过该股当日成交量 5% 的股票同日反向交易；主动投资组合间债券交易存在 1 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

2023 年上半年，恒生指数出现了先涨后跌的行情，呈现了一定的波动性。年初的上涨是延续去年底的反弹，反映的是对今年经济复苏的预期。但进入到 2 季度，中国宏观经济表现较为疲软，恒生指数也呈现震荡下跌的走势。

在 2 季度，各项宏观经济数据差强人意。首先，中国房地产市场在 2 季度再次走软，无论是房地产销售，还是房地产开发投资都不及 1 季度，而地产产业链景气度的再次下滑对宏观经济造成了较大影响。

其次，受宏观经济影响，中国制造业采购经理人指数在 2 季度跌入枯荣分界线之下，同时，1-6 月份中国工业企业利润同比降低 16.8%，这意味着在盈利增长低迷情况下，工业企业资产扩张速度进一步放缓，吸纳就业的能力意愿可能受到影响。

再次，通胀水平持续下行，6 月份 CPI 同比增长为零，通胀下行反映居民收入和消费恢复相对较为温和，经济复苏的力度较弱，表明经济已经陷入通缩的边缘。

从海外来看，美国 CPI 增速下降趋势已经确定，因此美联储对未来加息态度有所软化，暗示本轮加息周期接近尾声，因此港股资金面的边际压力变小。

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

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末本基金份额净值为 0.767 元；本报告期基金份额净值增长率为-0.90%，业绩比较基准收益率为-4.10%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

由于宏观经济疲弱，各级政府已经并将持续出台促进经济增长的宽松政策。6 月 16 日国务院常务会议上也明确指出“针对经济形势的变化，必须采取更加有力的措施，增强发展动能，优化经济结构，推动经济持续回升向好”，并研究出台推动经济持续回升向好的一批政策措施。随着这些经济刺激政策的出台，中国的宏观经济有望得到边际改善并逐步恢复。

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、固定收益总部、混合资产投资部、研究部、指数与期货投资部、大类资产配置部、权益专户投资部、国际业务部、

交易管理部、风险管理部、监察稽核部、基金运营部指定人员组成。公司估值委员会的相关成员均具备相应的专业胜任能力和相关工作经历，估值委员会成员中包括八名投资组合经理。

股票投资部、固定收益总部、混合资产投资部、研究部、指数与期货投资部、大类资产配置部、权益专户投资部、国际业务部、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交易的债券品种的估值数据，由中证指数有限公司按约定提供交易所交易的债券品种的估值数据和流通受限股票的折扣率数据。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

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

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

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

本报告期内，本基金托管人在对本基金的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他法律法规和基金合同的有关规定，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地

履行了基金托管人应尽的义务。

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

本报告期内，本基金的管理人——大成基金管理有限公司在本基金的投资运作、基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格计算、基金费用开支等问题上，托管人未发现损害基金份额持有人利益的行为。

5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人依法对大成基金管理有限公司编制和披露的本基金 2023 年中期报告中财务指标、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进行了核查，以上内容真实、准确和完整。

§ 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：大成恒生指数证券投资基金（LOF）

报告截止日：2023 年 6 月 30 日

单位：人民币元

| 资产 | 附注号 | 本期末 2023 年 6 月 30 日 | 上年度末 2022 年 12 月 31 日 |
|------------|---------|------------------------|--------------------------|
| 资产： | | | |
| 银行存款 | 6.4.7.1 | 7,867,333.60 | 7,683,581.65 |
| 结算备付金 | | - | - |
| 存出保证金 | | - | - |
| 交易性金融资产 | 6.4.7.2 | 92,970,007.13 | 100,869,960.68 |
| 其中：股票投资 | | 92,970,007.13 | 100,869,960.68 |
| 基金投资 | | - | - |
| 债券投资 | | - | - |
| 资产支持证券投资 | | - | - |
| 贵金属投资 | | - | - |
| 其他投资 | | - | - |
| 衍生金融资产 | 6.4.7.3 | - | - |
| 买入返售金融资产 | 6.4.7.4 | - | - |
| 债权投资 | 6.4.7.5 | - | - |
| 其中：债券投资 | | - | - |
| 资产支持证券投资 | | - | - |
| 其他投资 | | - | - |
| 其他债权投资 | 6.4.7.6 | - | - |
| 其他权益工具投资 | 6.4.7.7 | - | - |
| 应收清算款 | | - | - |

| | | | |
|---------------|------------|---------------------------|-----------------------------|
| 应收股利 | | 479,287.80 | 42,152.52 |
| 应收申购款 | | 115,606.58 | 112,973.05 |
| 递延所得税资产 | | - | - |
| 其他资产 | 6.4.7.8 | - | - |
| 资产总计 | | 101,432,235.11 | 108,708,667.90 |
| 负债和净资产 | 附注号 | 本期末 2023年6月30日 | 上年度末 2022年12月31日 |
| 负 债： | | | |
| 短期借款 | | - | - |
| 交易性金融负债 | | - | - |
| 衍生金融负债 | 6.4.7.3 | - | - |
| 卖出回购金融资产款 | | - | - |
| 应付清算款 | | 17.95 | 19.23 |
| 应付赎回款 | | 308,922.96 | 503,578.49 |
| 应付管理人报酬 | | 83,286.64 | 91,575.25 |
| 应付托管费 | | 16,657.33 | 18,315.06 |
| 应付销售服务费 | | - | - |
| 应付投资顾问费 | | - | - |
| 应交税费 | | - | - |
| 应付利润 | | - | - |
| 递延所得税负债 | | - | - |
| 其他负债 | 6.4.7.9 | 161,793.84 | 187,567.78 |
| 负债合计 | | 570,678.72 | 801,055.81 |
| 净资产： | | | |
| 实收基金 | 6.4.7.10 | 131,518,095.84 | 139,421,481.39 |
| 其他综合收益 | 6.4.7.11 | - | - |
| 未分配利润 | 6.4.7.12 | -30,656,539.45 | -31,513,869.30 |
| 净资产合计 | | 100,861,556.39 | 107,907,612.09 |
| 负债和净资产总计 | | 101,432,235.11 | 108,708,667.90 |

注：报告截止日 2023 年 06 月 30 日，基金份额净值 0.767 元，基金份额总额 131,518,095.84 份。

6.2 利润表

会计主体：大成恒生指数证券投资基金（LOF）

本报告期：2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日

单位：人民币元

| 项 目 | 附注号 | 本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日 | 上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日 |
|----------------|----------|--|---|
| 一、营业总收入 | | 244,081.23 | 617,388.41 |
| 1. 利息收入 | | 15,400.89 | 13,205.68 |
| 其中：存款利息收入 | 6.4.7.13 | 15,400.89 | 13,205.68 |

| | | | |
|----------------------------|------------|---------------|--------------|
| 债券利息收入 | | - | - |
| 资产支持证券利息收入 | | - | - |
| 买入返售金融资产收入 | | - | - |
| 证券出借利息收入 | | - | - |
| 其他利息收入 | | - | - |
| 2. 投资收益（损失以“-”填列） | | 1,446,863.01 | 657,573.30 |
| 其中：股票投资收益 | 6.4.7.14 | 169,313.15 | -561,430.23 |
| 基金投资收益 | 6.4.7.15 | - | - |
| 债券投资收益 | 6.4.7.16 | - | - |
| 资产支持证券投资 | 6.4.7.17 | - | - |
| 贵金属投资收益 | 6.4.7.18 | - | - |
| 衍生工具收益 | 6.4.7.19 | - | - |
| 股利收益 | 6.4.7.20 | 1,277,549.86 | 1,219,003.53 |
| 以摊余成本计量的金融资产终止确认产生的收益 | | - | - |
| 其他投资收益 | | - | - |
| 3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列） | 6.4.7.21 | -1,274,118.28 | -93,020.54 |
| 4. 汇兑收益（损失以“-”号填列） | | 29,336.64 | -1,607.12 |
| 5. 其他收入（损失以“-”号填列） | 6.4.7.22 | 26,598.97 | 41,237.09 |
| 减：二、营业总支出 | | 724,822.72 | 623,115.15 |
| 1. 管理人报酬 | 6.4.10.2.1 | 509,719.35 | 426,295.08 |
| 2. 托管费 | 6.4.10.2.2 | 101,943.87 | 85,259.00 |
| 3. 销售服务费 | 6.4.10.2.3 | - | - |
| 4. 投资顾问费 | | - | - |
| 5. 利息支出 | | - | - |
| 其中：卖出回购金融资产支出 | | - | - |
| 6. 信用减值损失 | 6.4.7.23 | - | - |
| 7. 税金及附加 | | - | - |
| 8. 其他费用 | 6.4.7.24 | 113,159.50 | 111,561.07 |
| 三、利润总额（亏损总额以“-”号填列） | | -480,741.49 | -5,726.74 |
| 减：所得税费用 | | - | - |
| 四、净利润（净亏损以“-”号填列） | | -480,741.49 | -5,726.74 |

| | | | |
|---------------|--|-------------|-----------|
| 五、其他综合收益的税后净额 | | - | - |
| 六、综合收益总额 | | -480,741.49 | -5,726.74 |

6.3 净资产（基金净值）变动表

会计主体：大成恒生指数证券投资基金（LOF）

本报告期：2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日 | | | |
|--|---------------------------------------|--------|----------------|----------------|
| | 实收基金 | 其他综合收益 | 未分配利润 | 净资产合计 |
| 一、上期期末净资产(基金净值) | 139,421,481.39 | - | -31,513,869.30 | 107,907,612.09 |
| 加：会计政策变更 | - | - | - | - |
| 前期差错更正 | - | - | - | - |
| 其他 | - | - | - | - |
| 二、本期期初净资产(基金净值) | 139,421,481.39 | - | -31,513,869.30 | 107,907,612.09 |
| 三、本期增减变动额(减少以“-”号填列) | -7,903,385.55 | - | 857,329.85 | -7,046,055.70 |
| (一)、综合收益总额 | - | - | -480,741.49 | -480,741.49 |
| (二)、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) | -7,903,385.55 | - | 1,338,071.34 | -6,565,314.21 |
| 其中：1. 基金申购款 | 23,428,322.07 | - | -5,213,158.28 | 18,215,163.79 |
| 2. 基金赎回款 | -31,331,707.62 | - | 6,551,229.62 | -24,780,478.00 |
| (三)、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) | - | - | - | - |
| (四)、其他综合收益结转留存收益 | - | - | - | - |

| | | | | |
|--|----------------------|--------|----------------|----------------|
| 四、本期期末净资产(基金净值) | 131,518,095.84 | - | -30,656,539.45 | 100,861,556.39 |
| 项目 | 上年度可比期间 | | | |
| | 2022年1月1日至2022年6月30日 | | | |
| | 实收基金 | 其他综合收益 | 未分配利润 | 净资产合计 |
| 一、上期期末净资产(基金净值) | 95,616,541.64 | - | -16,592,169.99 | 79,024,371.65 |
| 加：会计政策变更 | - | - | - | - |
| 前期差错更正 | - | - | - | - |
| 其他 | - | - | - | - |
| 二、本期期初净资产(基金净值) | 95,616,541.64 | - | -16,592,169.99 | 79,024,371.65 |
| 三、本期增减变动额(减少以“-”号填列) | 21,333,723.89 | - | -5,214,276.12 | 16,119,447.77 |
| (一)、综合收益总额 | - | - | -5,726.74 | -5,726.74 |
| (二)、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) | 21,333,723.89 | - | -5,208,549.38 | 16,125,174.51 |
| 其中：1. 基金申购款 | 55,141,782.80 | - | -12,532,388.33 | 42,609,394.47 |
| 2. 基金赎回款 | -33,808,058.91 | - | 7,323,838.95 | -26,484,219.96 |
| (三)、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) | - | - | - | - |
| (四)、其他综合收益结转留存收益 | - | - | - | - |
| 四、本期期末净资产(基金净值) | 116,950,265.53 | - | -21,806,446.11 | 95,143,819.42 |

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署：

谭晓冈

范瑛

孙蕊

基金管理人负责人

主管会计工作负责人

会计机构负责人

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

大成恒生指数证券投资基金(LOF)(以下简称“本基金”)经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2015]第 2748 号《关于准予大成恒生指数证券投资基金(LOF)注册的批复》及机构部函[2017]第 877 号《关于大成恒生指数证券投资基金(LOF)延期募集备案的回函》注册,由大成基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《大成恒生指数证券投资基金(LOF)基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式基金,存续期限不定,首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币 308,687,590.45 元,业经普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)普华永道中天验字(2017)第 711 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《大成恒生指数证券投资基金(LOF)基金合同》于 2017 年 8 月 10 日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为 308,898,062.99 份基金份额,其中认购资金利息折合 210,472.54 份基金份额。本基金的基金管理人为大成基金管理有限公司,基金托管人为中国工商银行股份有限公司,境外资产托管人为法国巴黎银行全球托管行。

经深圳证券交易所(以下简称“深交所”)深证上字[2017]533 号文审核同意,本基金 9,557,340.00 份基金份额(截至 2017 年 8 月 21 日止)于 2017 年 8 月 28 日在深交所挂牌交易。未上市交易的基金份额托管在场外,基金份额持有人将其转托管至深交所场内后即可上市流通。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》、《合格境内机构投资者境外证券投资管理试行办法》和《大成恒生指数证券投资基金(LOF)基金合同》的有关规定,本基金主要投资于标的指数成份股、备选成份股。此外,为了更好地实现本基金的投资目标,本基金可通过沪港股票市场交易互联互通机制(以下简称“沪港通”)投资于沪港通允许买卖的规定范围内的香港联合交易所上市的股票,以及银行存款、可转让存单、银行承兑汇票、银行票据、商业票据、回购协议、短期政府债券等货币市场工具;政府债券、公司债券、可转换债券、住房按揭支持证券、资产支持证券等及经中国证监会认可的国际金融组织发行的证券;已与中国证监会签署双边监管合作谅解备忘录的国家或地区证券市场挂牌交易的普通股、优先股、全球存托凭证和美国存托凭证、房地产信托凭证;在已与中国证监会签署双边监管合作谅解备忘录的国家或地区证券监管机构登记注册的公募基金;与固定收益、股权、信用、商品指数、基金等标的物挂钩的结构性投资产品;远期合约、互换及经中国证监会认可的境外交易所上市交易的权证、期权、期货等金融衍生产品以及法律法规或监管机构允许本基金投资的其他产品或金融工具。基金的投资组合比例为:股票占基金资产的比例

不低于 80%，其中投资于港股通标的股票占基金资产的比例为 0—95%；投资于标的指数成份股和备选成份股的资产不低于基金非现金资产的 80%；每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，保持现金（不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等）或到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%；权证、股指期货及其他金融工具的投资比例依照法律法规或监管机构的规定执行。本基金的业绩比较基准为：恒生指数收益率×95%+人民币活期存款利率（税后）×5%。

6.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于 2006 年 2 月 15 日及以后期间颁布的《企业会计准则—基本准则》、各项具体会计准则、《资产管理产品相关会计处理规定》及其他相关规定（以下合称“企业会计准则”）、中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号〈年度报告和中期报告〉》、中国证券投资基金业协会（以下简称“中国基金业协会”）颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《大成恒生指数证券投资基金（LOF）基金合同》和在财务报表附注 6.4.4 所列示的中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

本财务报表以持续经营为基础编制。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金于 2023 年 6 月 30 日的财务状况以及自 2023 年 1 月 1 日起至 2023 年 6 月 30 日止期间的经营成果和净值变动情况。

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

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期未发生会计政策变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

6.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无重大会计差错更正。

6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128 号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2008]1 号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2014]81 号《财政部国家税务总局证监会关于沪港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》、财税[2016]36 号

《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46 号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70 号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、财税[2016]127 号《财政部国家税务总局证监会关于深港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》、财税[2016]140 号《关于明确金融 房地产开发 教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税[2017]2 号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017]56 号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90 号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》及其他相关境内外财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1) 资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人。资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为，暂适用简易计税方法，按照 3% 的征收率缴纳增值税。对资管产品在 2018 年 1 月 1 日前运营过程中发生的增值税应税行为，未缴纳增值税的，不再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从资管产品管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。

对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税，对金融同业往来利息收入亦免征增值税。资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务，以 2018 年 1 月 1 日起产生的利息及利息性质的收入为销售额。资管产品管理人运营资管产品转让 2017 年 12 月 31 日前取得的非货物期货，可以选择按照实际买入价计算销售额，或者以 2017 年最后一个交易日的非货物期货结算价格作为买入价计算销售额。

(2) 目前基金取得的源自境外的差价收入，其涉及的境外所得税税收政策，按照相关国家或地区税收法律和法规执行，在境内暂不征收企业所得税。

(3) 目前基金取得的源自境外的股利收益，其涉及的境外所得税税收政策，按照相关国家或地区税收法律和法规执行，在境内暂不征收个人所得税和企业所得税。

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

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

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

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

| 项目 | 本期末 |
|----------------|-----------------|
| | 2023 年 6 月 30 日 |
| 活期存款 | 7,867,333.60 |
| 等于：本金 | 7,866,652.37 |
| 加：应计利息 | 681.23 |
| 减：坏账准备 | - |
| 定期存款 | - |
| 等于：本金 | - |
| 加：应计利息 | - |
| 减：坏账准备 | - |
| 其中：存款期限 1 个月以内 | - |
| 存款期限 1-3 个月 | - |
| 存款期限 3 个月以上 | - |
| 其他存款 | - |
| 等于：本金 | - |
| 加：应计利息 | - |
| 减：坏账准备 | - |
| 合计 | 7,867,333.60 |

注：于本期末，活期存款中包括的外币余额为港币活期存款 1,133,612.86 元，折合人民币 1,045,168.39 元。

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

| 项目 | 本期末 | | | |
|---------------|-----------------|------|---------------|----------------|
| | 2023 年 6 月 30 日 | | | |
| | 成本 | 应计利息 | 公允价值 | 公允价值变动 |
| 股票 | 106,329,816.86 | - | 92,970,007.13 | -13,359,809.73 |
| 贵金属投资-金交所黄金合约 | - | - | - | - |
| 债券 | 交易所市场 | - | - | - |
| | 银行间市场 | - | - | - |
| | 合计 | - | - | - |
| 资产支持证券 | - | - | - | - |
| 基金 | - | - | - | - |
| 其他 | - | - | - | - |
| 合计 | 106,329,816.86 | - | 92,970,007.13 | -13,359,809.73 |

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

6.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

无。

6.4.7.3.2 期末基金持有的期货合约情况

无。

6.4.7.3.3 期末基金持有的黄金衍生品情况

无。

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

无。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

无。

6.4.7.4.3 按预期信用损失一般模型计提减值准备的说明

无。

6.4.7.5 债权投资

6.4.7.5.1 债权投资情况

无。

6.4.7.5.2 债权投资减值准备计提情况

无。

6.4.7.6 其他债权投资

6.4.7.6.1 其他债权投资情况

无。

6.4.7.6.2 其他债权投资减值准备计提情况

无。

6.4.7.7 其他权益工具投资

6.4.7.7.1 其他权益工具投资情况

无。

6.4.7.7.2 报告期末其他权益工具投资情况

无。

6.4.7.8 其他资产

无。

6.4.7.9 其他负债

单位：人民币元

| 项目 | 本期末 2023 年 6 月 30 日 |
|-------------|------------------------|
| 应付券商交易单元保证金 | - |
| 应付赎回费 | 886.15 |
| 应付证券出借违约金 | - |
| 应付交易费用 | 4,300.10 |
| 其中：交易所市场 | 4,300.10 |
| 银行间市场 | - |
| 应付利息 | - |
| 预提费用 | 139,260.15 |
| 应付指数使用费 | 17,347.44 |
| 合计 | 161,793.84 |

6.4.7.10 实收基金

金额单位：人民币元

| 项目 | 本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日 | |
|---------------|---------------------------------------|----------------|
| | 基金份额（份） | 账面金额 |
| 上年度末 | 139,421,481.39 | 139,421,481.39 |
| 本期申购 | 23,428,322.07 | 23,428,322.07 |
| 本期赎回（以“-”号填列） | -31,331,707.62 | -31,331,707.62 |
| 基金拆分/份额折算前 | - | - |
| 基金拆分/份额折算调整 | - | - |
| 本期申购 | - | - |
| 本期赎回（以“-”号填列） | - | - |
| 本期末 | 131,518,095.84 | 131,518,095.84 |

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

6.4.7.11 其他综合收益

无。

6.4.7.12 未分配利润

单位：人民币元

| 项目 | 已实现部分 | 未实现部分 | 未分配利润合计 |
|----------------|---------------|----------------|----------------|
| 上年度末 | 34,074,799.38 | -65,588,668.68 | -31,513,869.30 |
| 本期利润 | 793,376.79 | -1,274,118.28 | -480,741.49 |
| 本期基金份额交易产生的变动数 | -1,921,492.98 | 3,259,564.32 | 1,338,071.34 |
| 其中：基金申购款 | 5,673,096.07 | -10,886,254.35 | -5,213,158.28 |

| | | | |
|---------|---------------|----------------|----------------|
| 基金赎回款 | -7,594,589.05 | 14,145,818.67 | 6,551,229.62 |
| 本期已分配利润 | - | - | - |
| 本期末 | 32,946,683.19 | -63,603,222.64 | -30,656,539.45 |

6.4.7.13 存款利息收入

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2023年1月1日至2023年6月30日 |
|-----------|----------------------------|
| 活期存款利息收入 | 15,015.02 |
| 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 | 383.24 |
| 其他 | 2.63 |
| 合计 | 15,400.89 |

6.4.7.14 股票投资收益

6.4.7.14.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2023年1月1日至2023年6月30日 |
|------------------|----------------------------|
| 股票投资收益——买卖股票差价收入 | 169,313.15 |
| 股票投资收益——赎回差价收入 | - |
| 股票投资收益——申购差价收入 | - |
| 股票投资收益——证券出借差价收入 | - |
| 合计 | 169,313.15 |

6.4.7.14.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2023年1月1日至2023年6月30日 |
|------------|----------------------------|
| 卖出股票成交总额 | 10,179,097.83 |
| 减：卖出股票成本总额 | 9,980,265.47 |
| 减：交易费用 | 29,519.21 |
| 买卖股票差价收入 | 169,313.15 |

6.4.7.14.3 股票投资收益——证券出借差价收入

无。

6.4.7.15 基金投资收益

无。

6.4.7.16 债券投资收益

6.4.7.16.1 债券投资收益项目构成

无。

6.4.7.16.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

无。

6.4.7.16.3 债券投资收益——赎回差价收入

无。

6.4.7.16.4 债券投资收益——申购差价收入

无。

6.4.7.17 资产支持证券投资收益

6.4.7.17.1 资产支持证券投资收益项目构成

无。

6.4.7.17.2 资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入

无。

6.4.7.17.3 资产支持证券投资收益——赎回差价收入

无。

6.4.7.17.4 资产支持证券投资收益——申购差价收入

无。

6.4.7.18 贵金属投资收益

6.4.7.18.1 贵金属投资收益项目构成

无。

6.4.7.18.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

无。

6.4.7.18.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

无。

6.4.7.18.4 贵金属投资收益——申购差价收入

无。

6.4.7.19 衍生工具收益

6.4.7.19.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

无。

6.4.7.19.2 衍生工具收益——其他投资收益

无。

6.4.7.20 股利收益

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日 |
|---------------|---------------------------------------|
| 股票投资产生的股利收益 | 1,277,549.86 |
| 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 | 1,277,549.86 |

6.4.7.21 公允价值变动收益

单位：人民币元

| 项目名称 | 本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日 |
|------------------------|---------------------------------------|
| 1. 交易性金融资产 | -1,274,118.28 |
| 股票投资 | -1,274,118.28 |
| 债券投资 | - |
| 资产支持证券投资 | - |
| 基金投资 | - |
| 贵金属投资 | - |
| 其他 | - |
| 2. 衍生工具 | - |
| 权证投资 | - |
| 3. 其他 | - |
| 减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税 | - |
| 合计 | -1,274,118.28 |

6.4.7.22 其他收入

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日 |
|---------|---------------------------------------|
| 基金赎回费收入 | 26,598.97 |
| 合计 | 26,598.97 |

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

6.4.7.23 信用减值损失

无。

6.4.7.24 其他费用

单位：人民币元

| 项目 | 本期 |
|----|----|
|----|----|

| | 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日 |
|----------|---------------------------------|
| 审计费用 | 29,752.78 |
| 信息披露费 | 59,507.37 |
| 证券出借违约金 | - |
| 深港通证券组合费 | 3,326.53 |
| 银行划款手续费 | 184.00 |
| 指数使用费 | 20,388.82 |
| 合计 | 113,159.50 |

6.4.7.25 分部报告

无。

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 或有事项

无。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

无。

6.4.9 关联方关系

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

本基金本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

| 关联方名称 | 与本基金的关系 |
|------------------------|--------------|
| 大成基金管理有限公司（“大成基金”） | 基金管理人、基金销售机构 |
| 中国工商银行股份有限公司（“中国工商银行”） | 基金托管人、基金销售机构 |
| 法国巴黎银行（“法国巴黎银行”） | 境外资产托管人 |

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 股票交易

无。

6.4.10.1.2 债券交易

无。

6.4.10.1.3 债券回购交易

无。

6.4.10.1.4 基金交易

无。

6.4.10.1.5 权证交易

无。

6.4.10.1.6 应支付关联方的佣金

无。

6.4.10.2 关联方报酬**6.4.10.2.1 基金管理费**

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日 | 上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日 |
|-----------------|--|---|
| 当期发生的基金应支付的管理费 | 509,719.35 | 426,295.08 |
| 其中：支付销售机构的客户维护费 | 207,286.82 | 170,707.74 |

注：支付基金管理人大成基金的管理人报酬按前一日基金资产净值 1.00% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日管理人报酬 = 前一日基金资产净值 × 1.00% / 当年天数。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日 | 上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日 |
|----------------|--|---|
| 当期发生的基金应支付的托管费 | 101,943.87 | 85,259.00 |

注：支付基金托管人中国工商银行的托管费按前一日基金资产净值 0.20% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日托管费 = 前一日基金资产净值 × 0.20% / 当年天数。

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

无。

6.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明**6.4.10.4.1 与关联方通过约定申报方式进行的适用固定期限费率的证券出借业务的情况**

无。

6.4.10.4.2 与关联方通过约定申报方式进行的适用市场化期限费率的证券出借业务的情况

无。

6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用自有资金投资本基金的情况

无。

6.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

无。

6.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

| 关联方名称 | 本期 2023年1月1日至2023年6月30日 | | 上年度可比期间 2022年1月1日至2022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 |
| 法国巴黎银行 | 1,045,168.13 | 2,129.50 | 23,556.88 | - |
| 中国工商银行 | 6,822,165.47 | 12,885.52 | 8,433,240.43 | 13,014.92 |

注：本基金由基金托管人保管的银行存款，按银行约定利率计息。

6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

无。

6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

无。

6.4.11 利润分配情况

无。

6.4.12 期末（2023年6月30日）本基金持有的流通受限证券

6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

无。

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

无。

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

无。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

无。

6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

无。

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金为指数型基金，跟踪标的指数的表现，目标为获取市场平均收益，属于中高风险品种。本基金投资的金融工具主要包括股票投资、债券投资及权证投资等。本基金在日常经营活动中面临的与这些金融工具相关的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金投资于香港证券市场，基金净值除了会因香港证券市场波动等因素产生波动之外，还需面临汇率风险等投资海外市场的特殊风险。本基金的基金管理人从事风险管理的主要目标是进行被动式指数化投资，紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化。

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

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

6.4.13.2 信用风险

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

本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的银行存款存放在本基金的托管人中国工商银行股份有限公司及境外资产托管人法国巴黎银行，因而与银行存款相关的信用风险不重大。本基金在境外交易所进行的交易均通过有资格的经纪商进行证券交

收和款项清算，在境内交易所进行的交易均以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，违约风险发生的可能性很小；在场外交易市场进行交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式进行限制以控制相应的信用风险。

本基金的基金管理人建立了信用风险管理流程，通过对投资品种信用等级评估来控制证券发行人的信用风险，且通过分散化投资以分散信用风险。

本期末，本基金无债券投资（上年度末：同）。

6.4.13.3 流动性风险

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

6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》及《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》等有关法规的要求建立健全开放式基金流动性风险管理的内部控制体系，审慎评估各类资产的流动性，针对性制定流动性风险管理措施，对本基金组合资产的流动性风险进行管理。本基金的基金管理人采用监控基金组合资产持仓集中度指标、逆回购交易的到期日与交易对手的集中度、流动性受限资产比例、基金组合资产中 7 个工作日可变现资产的可变现价值以及压力测试等方式防范流动性风险。并于开放日对本基金的申购赎回情况进行监控，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配，确保本基金资产的变现能力与投资者赎回需求的匹配与平衡。本基金的基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。于本期末，本基金持有的流动性受限资产的估值占基金资产净值的比例未超过 15%。

本基金主要投资于交易所及银行间市场内交易的证券，除在附注“期末本基金持有的流通受限证券”中列示的部分基金资产流通暂时受限制外(如有)，其余均能及时变现。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券资产的公允价值。除附注“期末债券正回购交易中作为抵押的债券”中列示的卖出回购金融资产款余额(如有)将在 1 个月内到期且计息外，本基金于资产负债表日所持有的金融负债的合同约定剩余到期日均为一年以内且一般不计息，可赎回基金份额净值无固定到期日且不计息，因此账面余额一般即为未折现的合约到期现金流量。

6.4.13.4 市场风险

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

6.4.13.4.1 利率风险

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

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

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

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

| 本期末 2023 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 | 7,867,333.60 | - | - | - | 7,867,333.60 |
| 交易性金融资产 | - | - | - | 92,970,007.13 | 92,970,007.13 |
| 应收股利 | - | - | - | 479,287.80 | 479,287.80 |
| 应收申购款 | 1,010.00 | - | - | 114,596.58 | 115,606.58 |
| 资产总计 | 7,868,343.60 | - | - | 93,563,891.51 | 101,432,235.11 |
| 负债 | | | | | |
| 应付赎回款 | - | - | - | 308,922.96 | 308,922.96 |
| 应付管理人报酬 | - | - | - | 83,286.64 | 83,286.64 |
| 应付托管费 | - | - | - | 16,657.33 | 16,657.33 |
| 应付清算款 | - | - | - | 17.95 | 17.95 |
| 其他负债 | - | - | - | 161,793.84 | 161,793.84 |
| 负债总计 | - | - | - | 570,678.72 | 570,678.72 |
| 利率敏感度缺口 | 7,868,343.60 | - | - | 92,993,212.79 | 100,861,556.39 |
| 上年度末 2022 年 12 月 31 日 | | | | | |
| 资产 | | | | | |
| 银行存款 | 7,683,581.65 | - | - | - | 7,683,581.65 |
| 交易性金融资产 | - | - | - | 100,869,960.68 | 100,869,960.68 |
| 应收股利 | - | - | - | 42,152.52 | 42,152.52 |
| 应收申购款 | 5.00 | - | - | 112,968.05 | 112,973.05 |
| 资产总计 | 7,683,586.65 | - | - | 101,025,081.25 | 108,708,667.90 |

| | | | | | |
|---------|--------------|---|---|-----------------|----------------|
| 负债 | | | | | |
| 应付赎回款 | - | - | - | 503,578.49 | 503,578.49 |
| 应付管理人报酬 | - | - | - | 91,575.25 | 91,575.25 |
| 应付托管费 | - | - | - | 18,315.06 | 18,315.06 |
| 应付清算款 | - | - | - | 19.23 | 19.23 |
| 其他负债 | - | - | - | 187,567.78 | 187,567.78 |
| 负债总计 | - | - | - | 801,055.81 | 801,055.81 |
| 利率敏感度缺口 | 7,683,586.65 | - | - | -100,224,025.44 | 107,907,612.09 |

注：表中所示为本基金资产及负债的账面价值，并按照合约规定的利率重新定价日或到期日孰早者予以分类。

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

于本期末，本基金未持有交易性债券投资（上年度末：同），因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响（上年度末：同）。

6.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基金持有不以记账本位币计价的资产，因此存在相应的外汇风险。本基金管理人每日对本基金的外汇头寸进行监控。

6.4.13.4.2.1 外汇风险敞口

单位：人民币元

| 项目 | 本期末 2023年6月30日 | | | |
|-------------------|-------------------|---------------|----------------|---------------|
| | 美元 折合人民币 元 | 港币 折合人民币元 | 其他币种 折合人民币元 | 合计 |
| 以外币计价的 资产 | | | | |
| 银行存款 | - | 1,045,168.39 | - | 1,045,168.39 |
| 交易性金融资产 | - | 92,970,007.13 | - | 92,970,007.13 |
| 应收股利 | 3,897.60 | 20,153.75 | - | 24,051.35 |
| 资产合计 | 3,897.60 | 94,035,329.27 | - | 94,039,226.87 |
| 以外币计价的 负债 | | | | |
| 负债合计 | - | - | - | - |
| 资产负债表外 汇风险敞口净额 | 3,897.60 | 94,035,329.27 | - | 94,039,226.87 |

| 项目 | 上年度末 2022 年 12 月 31 日 | | | |
|-----------------------|--------------------------|----------------|----------------|----------------|
| | 美元 折合人民 币元 | 港币 折合人民币元 | 其他币种 折合人民币元 | 合计 |
| 以外币计价的资产 | | | | |
| 银行存款 | - | 284,749.55 | - | 284,749.55 |
| 交易性金融资产 | - | 100,869,960.68 | - | 100,869,960.68 |
| 应收股利 | 37,928.52 | - | - | 37,928.52 |
| 资产合计 | 37,928.52 | 101,154,710.23 | - | 101,192,638.75 |
| 以外币计价的负债 | | | | |
| 负债合计 | - | - | - | - |
| 资产负债表外 汇风险敞口净 额 | 37,928.52 | 101,154,710.23 | - | 101,192,638.75 |

6.4.13.4.2.2 外汇风险的敏感性分析

| 假设 | 除市场汇率以外的其他市场变量保持不变 | | |
|--------------------|--------------------|---------------------------------|---------------------------|
| 分析 | 相关风险变量的变 动 | 对资产负债表日基金资产净值的 影响金额（单位：人民币元） | |
| | | 本期末（2023 年 6 月 30 日） | 上年度末（2022 年 12 月 31 日） |
| | 市场汇率相对人民 币升值 5% | 4,701,961.25 | 5,059,631.94 |
| 市场汇率相对人民 币贬值 5% | -4,701,961.43 | -5,059,631.94 | |

6.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市的股票，所面临的其他价格风险来源于单个证券发行主体自身经营情况或特殊事项的影响，也可能来源于证券市场整体波动的影响。

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

本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险。本基金的投资组合比例为：股票占基金资产的比例不低于 80%，其中投资于港股通标的股票占基金资产的比例为 0-95%；投资于标的指数成份股和备选成份股的资产不低于基金非现金资产的 80%；每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，保持现金（不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等）或到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%；权证、股指期货及其他金融工具的投资比例依照法律法规或监管机构的规定执行。此外，本基金的基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控，定期运用多种定量方法对基金进行风险度量，包括 VaR(Value at Risk) 指标等来测试本基金面临的潜在价格风险，及时可靠地对风险进行跟踪和控制。

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

| 项目 | 本期末 2023 年 6 月 30 日 | | 上年度末 2022 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 | 92,970,007.13 | 92.18 | 100,869,960.68 | 93.48 |
| 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 | 92,970,007.13 | 92.18 | 100,869,960.68 | 93.48 |

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

| 假设 | 除业绩比较基准以外的其他市场变量保持不变 | | |
|----|----------------------|-----------------------------|------------------------|
| 分析 | 相关风险变量的变动 | 对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元） | |
| | | 本期末（2023 年 6 月 30 日） | 上年度末（2022 年 12 月 31 日） |
| | 业绩比较基准上升 5% | 4,696,923.79 | 5,014,826.04 |
| | 业绩比较基准下降 5% | -4,696,923.79 | -5,014,826.04 |

6.4.14 公允价值

6.4.14.1 金融工具公允价值计量的方法

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

第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

6.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

6.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

单位：人民币元

| 公允价值计量结果所属的层次 | 本期末 2023 年 6 月 30 日 | 上年度末 2022 年 12 月 31 日 |
|---------------|------------------------|--------------------------|
| 第一层次 | 92,970,007.13 | 100,869,960.68 |
| 第二层次 | - | - |
| 第三层次 | - | - |
| 合计 | 92,970,007.13 | 100,869,960.68 |

6.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

本基金以导致各层次之间转换的事项发生日为确认各层次之间转换的时点。

对于证券交易所上市的股票和债券，若出现重大事项停牌、交易不活跃（包括涨跌停时的交易不活跃）、或属于非公开发行等情况，本基金不会于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间将相关股票和债券的公允价值列入第一层次；并根据估值调整中采用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度，确定相关股票、债券和基金的公允价值应属第二层次还是第三层次。

6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

于本期末，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产（上年度末：同）。

6.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括应收款项和其他金融负债，其账面价值与公允价值相差很小。

6.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

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 | 92,970,007.13 | 91.66 |
| | 其中：普通股 | 92,970,007.13 | 91.66 |
| | 存托凭证 | - | - |
| | 优先股 | - | - |
| | 房地产信托凭证 | - | - |
| 2 | 基金投资 | - | - |
| 3 | 固定收益投资 | - | - |
| | 其中：债券 | - | - |
| | 资产支持证券 | - | - |
| 4 | 金融衍生品投资 | - | - |
| | 其中：远期 | - | - |
| | 期货 | - | - |
| | 期权 | - | - |
| | 权证 | - | - |
| 5 | 买入返售金融资产 | - | - |
| | 其中：买断式回购的买入返售金融资产 | - | - |
| 6 | 货币市场工具 | - | - |
| 7 | 银行存款和结算备付金合计 | 7,867,333.60 | 7.76 |
| 8 | 其他各项资产 | 594,894.38 | 0.59 |
| 9 | 合计 | 101,432,235.11 | 100.00 |

注：本基金通过深港通交易机制投资的港股公允价值为 81,492,517.82 元，占期末基金资产净值的比例为 80.80%。

7.2 期末在各个国家（地区）证券市场的权益投资分布

金额单位：人民币元

| 国家（地区） | 公允价值 | 占基金资产净值比例 (%) |
|--------|---------------|---------------|
| 中国香港 | 92,970,007.13 | 92.18 |
| 合计 | 92,970,007.13 | 92.18 |

注：1. 股票的国家（地区）类别根据其所在证券交易所确定。

2. 本基金本报告期末未持有存托凭证。

7.3 期末按行业分类的权益投资组合

7.3.1 期末指数投资按行业分类的权益投资组合

金额单位：人民币元

| 行业类别 | 公允价值 | 占基金资产净值比例 (%) |
|------|------|---------------|
|------|------|---------------|

| | | |
|--------|---------------|-------|
| 通讯 | 18,562,102.57 | 18.40 |
| 非必需消费品 | 15,852,709.45 | 15.72 |
| 必需消费品 | 4,663,098.25 | 4.62 |
| 能源 | 3,578,370.34 | 3.55 |
| 金融 | 33,169,876.24 | 32.89 |
| 房地产 | 5,810,755.91 | 5.76 |
| 医疗保健 | 1,982,659.17 | 1.97 |
| 工业 | 1,897,988.03 | 1.88 |
| 材料 | 1,469,036.84 | 1.46 |
| 科技 | 3,074,094.30 | 3.05 |
| 公用事业 | 2,909,316.03 | 2.88 |
| 政府 | - | - |
| 合计 | 92,970,007.13 | 92.18 |

注：以上分类采用彭博行业分类标准。

7.3.2 期末积极投资按行业分类的权益投资组合

无。

7.4 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有权益投资明细

7.4.1 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权益投资明细

金额单位：人民币元

| 序号 | 公司名称（英文） | 公司名称（中文） | 证券代码 | 所在证券市场 | 所属国家（地区） | 数量（股） | 公允价值 | 占基金资产净值比例（%） |
|----|---------------------------|----------|---------|---------|----------|---------|--------------|--------------|
| 1 | TENCENT HOLDING S LTD | 腾讯控股 | 700 HK | 香港联合交易所 | 中国香港 | 25,500 | 7,796,078.48 | 7.73 |
| 2 | HSBC HOLDING S PLC | 汇丰控股 | 5 HK | 香港联合交易所 | 中国香港 | 137,200 | 7,716,235.02 | 7.65 |
| 3 | AIA GROUP LTD | 友邦保险 | 1299 HK | 香港联合交易所 | 中国香港 | 102,000 | 7,438,719.04 | 7.38 |
| 4 | ALIBABA GROUP HOLDING LTD | 阿里巴巴 | 9988 HK | 香港联合交易所 | 中国香港 | 93,600 | 7,007,343.03 | 6.95 |
| 5 | MEITUAN-CLASS B | 美团-W | 3690 HK | 香港联合交易所 | 中国香港 | 48,930 | 5,517,256.48 | 5.47 |
| 6 | CHINA CONSTRUCTION BANK-H | 建设银行 | 939 HK | 香港联合交易所 | 中国香港 | 931,000 | 4,351,902.34 | 4.31 |

| | | | | | | | | |
|----|------------------------------|--------|---------|---------|------|-----------|--------------|------|
| 7 | BANK OF CHINA LTD-H | 中国银行 | 3988 HK | 香港联合交易所 | 中国香港 | 1,128,000 | 3,265,579.40 | 3.24 |
| 8 | CHINA MOBILE LTD | 中国移动 | 941 HK | 香港联合交易所 | 中国香港 | 53,000 | 3,129,799.41 | 3.10 |
| 9 | HONG KONG EXCHANGES & CLEAR | 香港交易所 | 388 HK | 香港联合交易所 | 中国香港 | 10,400 | 2,830,552.36 | 2.81 |
| 10 | PING AN INSURANCE GROUP CO-H | 中国平安 | 2318 HK | 香港联合交易所 | 中国香港 | 54,500 | 2,504,858.31 | 2.48 |
| 11 | CHINA MERCHANTS BANK-H | 招商银行 | 3968 HK | 香港联合交易所 | 中国香港 | 72,000 | 2,363,219.14 | 2.34 |
| 12 | JD.COM INC-CLASS A | 京东集团 | 9618 HK | 香港联合交易所 | 中国香港 | 15,250 | 1,861,569.82 | 1.85 |
| 13 | BYD CO LTD-H | 比亚迪 | 1211 HK | 香港联合交易所 | 中国香港 | 8,000 | 1,843,960.00 | 1.83 |
| 14 | XIAOMI CORP-CLASS B | 小米集团 | 1810 HK | 香港联合交易所 | 中国香港 | 150,800 | 1,490,450.74 | 1.48 |
| 15 | CNOOC LTD-H | 中国海洋石油 | 883 HK | 香港联合交易所 | 中国香港 | 136,000 | 1,404,359.94 | 1.39 |
| 16 | SUN HUNG KAI PROPERTIES | 新鸿基地产 | 16 HK | 香港联合交易所 | 中国香港 | 12,500 | 1,137,492.83 | 1.13 |
| 17 | WUXI BIOLOGICALS CAYMAN INC | 药明生物 | 2269 HK | 香港联合交易所 | 中国香港 | 31,000 | 1,073,230.82 | 1.06 |
| 18 | TECHTRONIC INDUSTRIES CO LTD | 创科实业 | 669 HK | 香港联合交易所 | 中国香港 | 13,500 | 1,059,839.06 | 1.05 |

| | | | | | | | | |
|----|--|------------|---------|-------------|------|---------|--------------|------|
| 19 | CK HUTCHIS ON HOLDING S LTD | 长和 | 1 HK | 香港联合 交易所 | 中国香港 | 23,000 | 1,014,685.09 | 1.01 |
| 20 | CLP HOLDING S LTD | 中电控股 | 2 HK | 香港联合 交易所 | 中国香港 | 17,500 | 982,600.19 | 0.97 |
| 21 | CHINA PETROLE UM & CHEMICA L-H | 中国石化 | 386 HK | 香港联合 交易所 | 中国香港 | 216,000 | 914,087.85 | 0.91 |
| 22 | PETROCH INA CO LTD-H | 中国石油 | 857 HK | 香港联合 交易所 | 中国香港 | 182,000 | 909,477.95 | 0.90 |
| 23 | GALAXY ENTERTA INMENT GROUP L | 银河娱乐 | 27 HK | 香港联合 交易所 | 中国香港 | 19,000 | 870,625.71 | 0.86 |
| 24 | CHINA RESOURC ES LAND LTD | 华润置地 | 1109 HK | 香港联合 交易所 | 中国香港 | 28,000 | 857,072.61 | 0.85 |
| 25 | ANTA SPORTS PRODUCT S LTD | 安踏体育 | 2020 HK | 香港联合 交易所 | 中国香港 | 11,600 | 856,132.19 | 0.85 |
| 26 | NETEASE INC | 网易 | 9999 HK | 香港联合 交易所 | 中国香港 | 5,800 | 816,026.06 | 0.81 |
| 27 | LI NING CO LTD | 李宁 | 2331 HK | 香港联合 交易所 | 中国香港 | 20,500 | 796,659.87 | 0.79 |
| 28 | CHINA LIFE INSURAN CE CO-H | 中国人寿 | 2628 HK | 香港联合 交易所 | 中国香港 | 64,000 | 770,627.76 | 0.76 |
| 29 | BAIDU INC- CLASS A | 百度 | 9888 HK | 香港联合 交易所 | 中国香港 | 6,150 | 752,999.51 | 0.75 |
| 30 | Link REIT | 领展房产 基金 | 823 HK | 香港联合 交易所 | 中国香港 | 18,400 | 737,952.79 | 0.73 |
| 31 | CHINA MENGNIU DAIRY | 蒙牛乳业 | 2319 HK | 香港联合 交易所 | 中国香港 | 27,000 | 734,357.07 | 0.73 |

| | | | | | | | | |
|----|---|--------------|---------|-------------|------|--------|------------|------|
| | CO | | | | | | | |
| 32 | BOC HONG KONG HOLDING S LTD | 中银香港 | 2388 HK | 香港联合 交易所 | 中国香港 | 32,000 | 706,605.47 | 0.70 |
| 33 | NONGFU SPRING CO LTD- H | 农夫山泉 | 9633 HK | 香港联合 交易所 | 中国香港 | 17,400 | 693,836.05 | 0.69 |
| 34 | CK ASSET HOLDING S LTD | 长实集团 | 1113 HK | 香港联合 交易所 | 中国香港 | 17,000 | 680,236.84 | 0.67 |
| 35 | HANG SENG BANK LTD | 恒生银行 | 11 HK | 香港联合 交易所 | 中国香港 | 6,600 | 678,485.08 | 0.67 |
| 36 | SEMICON DUCTOR MANUFAC TURIN-H | 中芯国际 | 981 HK | 香港联合 交易所 | 中国香港 | 36,000 | 677,102.11 | 0.67 |
| 37 | CHINA RESOURC ES BEER HOLDING | 华润啤酒 | 291 HK | 香港联合 交易所 | 中国香港 | 14,000 | 666,038.35 | 0.66 |
| 38 | CHINA SHENHUA ENERGY CO-H | 中国神华 | 1088 HK | 香港联合 交易所 | 中国香港 | 29,000 | 640,361.21 | 0.63 |
| 39 | ENN ENERGY HOLDING S LTD | 新奥能源 | 2688 HK | 香港联合 交易所 | 中国香港 | 6,800 | 611,899.69 | 0.61 |
| 40 | SANDS CHINA LTD | 金沙中国 有限公司 | 1928 HK | 香港联合 交易所 | 中国香港 | 24,400 | 600,651.53 | 0.60 |
| 41 | HONG KONG & CHINA GAS | 香港中华 煤气 | 3 HK | 香港联合 交易所 | 中国香港 | 96,053 | 599,544.06 | 0.59 |
| 42 | CITIC LTD | 中信股份 | 267 HK | 香港联合 交易所 | 中国香港 | 63,000 | 543,092.32 | 0.54 |
| 43 | MTR | 港铁公司 | 66 HK | 香港联合 交易所 | 中国香港 | 16,000 | 531,060.48 | 0.53 |

| | | | | | | | | |
|----|-------------------------------|--------|---------|---------|------|--------|------------|------|
| | CORP | | | 交易所 | | | | |
| 44 | CHINA OVERSEAS LAND & INVEST | 中国海外发展 | 688 HK | 香港联合交易所 | 中国香港 | 33,000 | 519,664.81 | 0.52 |
| 45 | ZIJIN MINING GROUP CO LTD-H | 紫金矿业 | 2899 HK | 香港联合交易所 | 中国香港 | 48,000 | 508,932.96 | 0.50 |
| 46 | WHARF REAL ESTATE INVESTMENT | 九龙仓置业 | 1997 HK | 香港联合交易所 | 中国香港 | 14,000 | 505,337.24 | 0.50 |
| 47 | SHENZHOU INTERNATIONAL GROUP | 申洲国际 | 2313 HK | 香港联合交易所 | 中国香港 | 7,100 | 489,317.84 | 0.49 |
| 48 | CSPC PHARMACEUTICAL GROUP LTD | 石药集团 | 1093 HK | 香港联合交易所 | 中国香港 | 77,520 | 486,723.57 | 0.48 |
| 49 | LENOVO GROUP LTD | 联想集团 | 992 HK | 香港联合交易所 | 中国香港 | 62,000 | 467,019.75 | 0.46 |
| 50 | GEELY AUTOMOBILE HOLDINGS LTD | 吉利汽车 | 175 HK | 香港联合交易所 | 中国香港 | 52,000 | 458,334.70 | 0.45 |
| 51 | HAIER SMART HOME CO LTD-H | 海尔智家 | 6690 HK | 香港联合交易所 | 中国香港 | 20,000 | 454,536.14 | 0.45 |
| 52 | POWER ASSETS HOLDINGS LTD | 电能实业 | 6 HK | 香港联合交易所 | 中国香港 | 12,000 | 454,167.35 | 0.45 |
| 53 | JD HEALTH INTERNATIONAL | 京东健康 | 6618 HK | 香港联合交易所 | 中国香港 | 9,700 | 442,241.54 | 0.44 |

| | | | | | | | | |
|----|--|------------|---------|-------------|------|--------|------------|------|
| | TIONAL INC | | | | | | | |
| 54 | SUNNY OPTICAL TECH | 舜宇光学 科技 | 2382 HK | 香港联合 交易所 | 中国香港 | 6,100 | 439,521.70 | 0.44 |
| 55 | XINYI SOLAR HOLDING S LTD | 信义光能 | 968 HK | 香港联合 交易所 | 中国香港 | 42,000 | 350,444.60 | 0.35 |
| 56 | BUDWEIS ER BREWING CO APAC LT | 百威亚太 | 1876 HK | 香港联合 交易所 | 中国香港 | 17,100 | 318,470.33 | 0.32 |
| 57 | SINO BIOPHAR MACEUTI CAL | 中国生物 制药 | 1177 HK | 香港联合 交易所 | 中国香港 | 97,500 | 306,535.30 | 0.30 |
| 58 | TRIP.CO M GROUP LTD | 携程集团 | 9961 HK | 香港联合 交易所 | 中国香港 | 1,200 | 301,598.10 | 0.30 |
| 59 | LONGFOR GROUP HOLDING S LTD | 龙湖集团 | 960 HK | 香港联合 交易所 | 中国香港 | 16,000 | 280,871.99 | 0.28 |
| 60 | HENDERS ON LAND DEVELOP MENT | 恒基地产 | 12 HK | 香港联合 交易所 | 中国香港 | 12,750 | 273,897.21 | 0.27 |
| 61 | CHINA RESOURC ES POWER HOLDIN | 华润电力 | 836 HK | 香港联合 交易所 | 中国香港 | 16,000 | 261,104.74 | 0.26 |
| 62 | CHINA UNICOM HONG KONG LTD | 中国联通 | 762 HK | 香港联合 交易所 | 中国香港 | 52,000 | 248,344.53 | 0.25 |
| 63 | HAIDILA O INTERNA TIONAL HOLDI | 海底捞 | 6862 HK | 香港联合 交易所 | 中国香港 | 15,000 | 238,424.03 | 0.24 |
| 64 | WH | 万洲国际 | 288 HK | 香港联合 交易所 | 中国香港 | 60,500 | 231,486.13 | 0.23 |

| | | | | | | | | |
|----|--|--------|---------|---------|------|--------|------------|------|
| | GROUP LTD | | | 交易所 | | | | |
| 65 | CHOW TAI FOOK JEWELLERY GROUP | 周大福 | 1929 HK | 香港联合交易所 | 中国香港 | 17,200 | 223,281.43 | 0.22 |
| 66 | CK INFRASTRUCTURE HOLDINGS LTD | 长江基建集团 | 1038 HK | 香港联合交易所 | 中国香港 | 5,500 | 210,188.39 | 0.21 |
| 67 | NEW WORLD DEVELOPMENT | 新世界发展 | 17 HK | 香港联合交易所 | 中国香港 | 11,750 | 208,865.35 | 0.21 |
| 68 | XINYI GLASS HOLDINGS LTD | 信义玻璃 | 868 HK | 香港联合交易所 | 中国香港 | 18,000 | 202,466.81 | 0.20 |
| 69 | ALIBABA HEALTH INFORMATION TECHNOLOGY LTD | 阿里健康 | 241 HK | 香港联合交易所 | 中国香港 | 46,000 | 199,756.19 | 0.20 |
| 70 | HENGAN INTERNATIONAL GROUP COMPANY LIMITED | 恒安国际 | 1044 HK | 香港联合交易所 | 中国香港 | 6,000 | 182,552.04 | 0.18 |
| 71 | TINGYI (CAYMAN ISLANDS) HOLDING COMPANY | 康师傅控股 | 322 HK | 香港联合交易所 | 中国香港 | 16,000 | 179,675.46 | 0.18 |
| 72 | CHINA RESOURCES MIXED LIFESTYLES | 华润万象生活 | 1209 HK | 香港联合交易所 | 中国香港 | 5,000 | 179,325.11 | 0.18 |
| 73 | HANG LUNG PROPERTIES LIMITED | 恒隆地产 | 101 HK | 香港联合交易所 | 中国香港 | 15,000 | 167,339.37 | 0.17 |
| 74 | COUNTRY GARDEN SERVICES HOLDINGS LIMITED | 碧桂园服务 | 6098 HK | 香港联合交易所 | 中国香港 | 17,000 | 158,617.44 | 0.16 |
| 75 | ZHONGSHAN | 中升控股 | 881 HK | 香港联合交易所 | 中国香港 | 5,500 | 151,873.16 | 0.15 |

| | | | | | | | | |
|----|-----------------------------|--------|---------|---------|------|--------|------------|------|
| | ENG GROUP HOLDINGS | | | 交易所 | | | | |
| 76 | CHINA HONGQIAO GROUP LTD | 中国宏桥 | 1378 HK | 香港联合交易所 | 中国香港 | 20,000 | 117,275.86 | 0.12 |
| 77 | HANSOH PHARMACEUTICAL GROUP | 翰森制药 | 3692 HK | 香港联合交易所 | 中国香港 | 10,000 | 116,169.48 | 0.12 |
| 78 | COUNTRY GARDEN HOLDINGS CO | 碧桂园 | 2007 HK | 香港联合交易所 | 中国香港 | 71,000 | 104,082.32 | 0.10 |
| 79 | ORIENT OVERSEAS INTL LTD | 东方海外国际 | 316 HK | 香港联合交易所 | 中国香港 | 1,000 | 96,900.10 | 0.10 |

7.4.2 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权益投资明细无。

7.5 报告期内权益投资组合的重大变动

7.5.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的权益投资明细

金额单位：人民币元

| 序号 | 公司名称（英文） | 证券代码 | 本期累计买入金额 | 占期初基金资产净值比例(%) |
|----|------------------------------|---------|--------------|----------------|
| 1 | MEITUAN-CLASS B | 3690 HK | 1,152,566.90 | 1.07 |
| 2 | ZIJIN MINING GROUP CO LTD-H | 2899 HK | 541,989.71 | 0.50 |
| 3 | JD HEALTH INTERNATIONAL INC | 6618 HK | 489,948.63 | 0.45 |
| 4 | TRIP.COM GROUP LTD | 9961 HK | 309,849.12 | 0.29 |
| 5 | BANK OF CHINA LTD-H | 3988 HK | 252,019.17 | 0.23 |
| 6 | CHINA RESOURCES POWER HOLDIN | 836 HK | 251,395.82 | 0.23 |
| 7 | CHINA MERCHANTS BANK-H | 3968 HK | 209,832.63 | 0.19 |
| 8 | BAIDU INC-CLASS A | 9888 HK | 146,828.22 | 0.14 |

注：本项中“本期累计买入金额”按买入成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关

交易费用。

7.5.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的权益投资明细

金额单位：人民币元

| 序号 | 公司名称（英文） | 证券代码 | 本期累计卖出金额 | 占期初基金资产净值比例(%) |
|----|------------------------------|---------|--------------|----------------|
| 1 | HSBC HOLDINGS PLC | 5 HK | 2,343,044.19 | 2.17 |
| 2 | TENCENT HOLDINGS LTD | 700 HK | 1,240,573.14 | 1.15 |
| 3 | MEITUAN-CLASS B | 3690 HK | 933,098.18 | 0.86 |
| 4 | ALIBABA GROUP HOLDING LTD | 9988 HK | 697,373.86 | 0.65 |
| 5 | AIA GROUP LTD | 1299 HK | 604,985.53 | 0.56 |
| 6 | CHINA MERCHANTS BANK-H | 3968 HK | 581,510.34 | 0.54 |
| 7 | CHINA CONSTRUCTION BANK-H | 939 HK | 315,951.05 | 0.29 |
| 8 | CNOOC LTD-H | 883 HK | 301,034.96 | 0.28 |
| 9 | JD.COM INC-CLASS A | 9618 HK | 248,432.39 | 0.23 |
| 10 | HONG KONG EXCHANGES & CLEAR | 388 HK | 243,759.19 | 0.23 |
| 11 | PING AN INSURANCE GROUP CO-H | 2318 HK | 230,360.20 | 0.21 |
| 12 | CHINA MOBILE LTD | 941 HK | 195,135.80 | 0.18 |
| 13 | WUXI BIOLOGICS CAYMAN INC | 2269 HK | 137,854.64 | 0.13 |
| 14 | XIAOMI CORP-CLASS B | 1810 HK | 129,011.82 | 0.12 |
| 15 | CHINA RESOURCES BEER HOLDING | 291 HK | 104,421.94 | 0.10 |
| 16 | BYD CO LTD-H | 1211 HK | 103,764.00 | 0.10 |
| 17 | ANTA SPORTS PRODUCTS LTD | 2020 HK | 95,212.61 | 0.09 |
| 18 | SUN HUNG KAI PROPERTIES | 16 HK | 94,958.51 | 0.09 |
| 19 | LI NING CO LTD | 2331 HK | 92,869.81 | 0.09 |
| 20 | TECHTRONIC INDUSTRIES CO LTD | 669 HK | 86,849.71 | 0.08 |

注：本项中“本期累计卖出金额”按卖出成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

7.5.3 权益投资的买入成本总额及卖出收入总额

单位：人民币元

| | |
|------------|---------------|
| 买入成本（成交）总额 | 3,354,430.20 |
| 卖出收入（成交）总额 | 10,179,097.83 |

注：本项中“买入股票的成本(成交)总额”及“卖出股票的收入(成交)总额”均按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

7.6 期末按债券信用等级分类的债券投资组合

无。

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名债券投资明细

无。

7.8 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的所有资产支持证券投资明细

无。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名金融衍生品投资明细

无。

7.10 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名基金投资明细

无。

7.11 投资组合报告附注

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

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

7.11.2 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。

7.11.3 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 | - |
| 2 | 应收清算款 | - |
| 3 | 应收股利 | 479,287.80 |
| 4 | 应收利息 | - |
| 5 | 应收申购款 | 115,606.58 |
| 6 | 其他应收款 | - |
| 7 | 待摊费用 | - |
| 8 | 其他 | - |
| 9 | 合计 | 594,894.38 |

7.11.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

无。

7.11.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

7.11.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

无。

7.11.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

无。

7.11.6 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

| 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 (%) |
| 10,136 | 12,975.34 | 690,172.00 | 0.52 | 130,827,923.84 | 99.48 |

注：持有人户数为有效户数，即存量份额大于零的账户。

8.2 期末上市基金前十名持有人

| 序号 | 持有人名称 | 持有份额（份） | 占上市总份额比例（%） |
|----|-----------------------------------|--------------|-------------|
| 1 | 邓秀娇 | 1,569,999.00 | 16.58 |
| 2 | 石家庄德厦贸易有限公司 | 470,172.00 | 4.96 |
| 3 | 邵常红 | 406,909.00 | 4.30 |
| 4 | 王晨 | 372,928.00 | 3.94 |
| 5 | 鲍刚 | 282,369.00 | 2.98 |
| 6 | 边田 | 266,774.00 | 2.82 |
| 7 | 王智伟 | 186,509.00 | 1.97 |
| 8 | 伊丽群 | 165,000.00 | 1.74 |
| 9 | 共青城树山投资管理有限公司一树山远星多策略精选5号私募证券投资基金 | 120,000.00 | 1.27 |
| 10 | 陈海峰 | 116,400.00 | 1.23 |

注：以上数据由中国证券登记结算有限公司提供，持有人为场内持有人。

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

| 项目 | 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 | 116,040.53 | 0.0882 |

8.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

| 项目 | 持有基金份额总量的数量区间（万份） |
|------------------------------------|-------------------|
| 本公司高级管理人员、基金投资和研 究部门负责人持有本开放式基金 | 0 |
| 本基金基金经理持有本开放式基金 | 0 |

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

| | |
|-------------------------------|----------------|
| 基金合同生效日（2017年8月10日） 基金份额总额 | 308,898,062.99 |
| 本报告期期初基金份额总额 | 139,421,481.39 |
| 本报告期基金总申购份额 | 23,428,322.07 |
| 减：本报告期基金总赎回份额 | 31,331,707.62 |
| 本报告期基金拆分变动份额 | - |
| 本报告期期末基金份额总额 | 131,518,095.84 |

§ 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

经大成基金管理有限公司第八届董事会第二次会议审议通过，自2023年3月25日起，温智敏先生不再担任公司副总经理职务；聘请石国武先生担任公司副总经理，任期自2023年3月25日起，至公司第八届董事会任期届满之日止。具体详见我司发布的《大成基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告》。

二、基金托管人的基金托管部门的重大人事变动

本报告期内，基金托管人的基金托管部门无重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内，无涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。

10.4 基金投资策略的改变

本基金投资策略在本报告期内没有重大改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

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

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

10.6.1 管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，基金管理人及其相关高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

10.6.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内托管人及其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 (%) | |
| 招商证券 | 2 | 10,288,241.83 | 86.74 | 9,569.13 | 94.56 | - |
| Daiwa Capital Markets Hong Kong Limited | 1 | 1,572,097.61 | 13.26 | 550.23 | 5.44 | - |
| 长江证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 东方证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 光大证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 海通证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 申万宏源 | 1 | - | - | - | - | - |
| 中信证券 | 1 | - | - | - | - | - |

注：1、租用券商专用交易单元的选择标准和程序：

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。

2、本基金本报告期内新增交易单元：无，退租交易单元：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 | 2023 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中国中金财富证券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 | 2023 年 5 月 30 日 |
| 3 | 大成基金管理有限公司关于旗下部分基金增加上海中欧财富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 | 2023 年 5 月 24 日 |
| 4 | 大成恒生指数证券投资基金（LOF）暂停申购、赎回及定投业务的公告 | 中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站 | 2023 年 5 月 24 日 |
| 5 | 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 | 2023 年 4 月 27 日 |
| 6 | 大成恒生指数证券投资基金（LOF）2023 年第 1 季度报告 | 中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站 | 2023 年 4 月 21 日 |
| 7 | 大成恒生指数证券投资基金（LOF）暂停申购、赎回及定投业务的公告 | 中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站 | 2023 年 4 月 4 日 |
| 8 | 大成恒生指数证券投资基金（LOF）2022 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 | 2023 年 3 月 30 日 |
| 9 | 大成基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告 | 中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站 | 2023 年 3 月 27 日 |

| | | | |
|----|--------------------------------------|--------------------------|-----------------|
| 10 | 大成基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告 | 中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站 | 2023 年 3 月 27 日 |
| 11 | 大成基金管理有限公司关于养老金客户通过直销柜台申购旗下基金费率优惠的公告 | 中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站 | 2023 年 3 月 24 日 |
| 12 | 大成恒生指数证券投资基金（LOF）2022 年第 4 季度报告 | 中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站 | 2023 年 1 月 18 日 |
| 13 | 大成恒生指数证券投资基金（LOF）暂停申购、赎回及定投业务的公告 | 中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站 | 2023 年 1 月 17 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恒生指数证券投资基金（LOF）的文件；
- 2、《大成恒生指数证券投资基金（LOF）基金合同》；
- 3、《大成恒生指数证券投资基金（LOF）托管协议》；
- 4、大成基金管理有限公司批准文件、营业执照、公司章程；
- 5、本报告期内在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

2023 年 8 月 30 日