

大成中华沪深港 300 指数证券投资基金 (LOF) 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	6
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	8
§ 4 管理人报告	10
4.1 基金管理人及基金经理情况	10
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	11
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	11
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明	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	14
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	14
§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）	14
6.1 资产负债表	14
6.2 利润表	15
6.3 所有者权益（基金净值）变动表	16
6.4 报表附注	18
§ 7 投资组合报告	35
7.1 期末基金资产组合情况	35
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	35
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	36
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	44
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	45
7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细	45

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细	46
7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细	46
7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细	46
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明	46
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	46
7.12 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	48
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	49
§ 9 开放式基金份额变动	49
§ 10 重大事件揭示	49
10.1 基金份额持有人大会决议	49
10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动	49
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	50
10.4 基金投资策略的改变	50
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	50
10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况	50
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	50
10.8 其他重大事件	53
§ 11 影响投资者决策的其他重要信息	54
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	54
11.2 影响投资者决策的其他重要信息	54
§ 12 备查文件目录	55
12.1 备查文件目录	55
12.2 存放地点	55
12.3 查阅方式	55

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	大成中华沪深港 300 指数证券投资基金 (LOF)	
基金简称	大成中华沪深港 300 指数 (LOF)	
场内简称	沪深港 300LOF	
基金主代码	160925	
交易代码	160925	
基金运作方式	上市契约型开放式 (LOF)	
基金合同生效日	2019 年 3 月 20 日	
基金管理人	大成基金管理有限公司	
基金托管人	中国农业银行股份有限公司	
报告期末基金份 额总额	85,887,375.17 份	
基金合同存续期	不定期	
基金份额上市的 证券交易所	深圳证券交易所	
上市日期	2019 年 3 月 29 日	
下属分级基金的基 金简称	大成中华沪深港 300 指数 (LOF) A	大成中华沪深港 300 指数 (LOF) C
下属分级基金的场 内简称	沪深港 300LOF	-
下属分级基金的交 易代码	160925	008973
报告期末下属分级 基金的份额总额	84,641,826.95 份	1,245,548.22 份

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金进行被动式指数化投资, 紧密跟踪标的指数, 追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化。在正常市场情况下, 本基金日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.35%, 年化跟踪误差不超过 4%。
投资策略	本基金主要按照标的指数的成份股及其权重构建基金股票投资组合, 并根据标的指数成份股及其权重的变动进行相应调整。但因特

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

2.3 基金管理人和基金托管人

项目	基金管理人	基金托管人
名称	大成基金管理有限公司	中国农业银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	赵冰
	联系电话	0755-83183388
	电子邮箱	office@dcfund.com.cn
客户服务电话	4008885558	95599
传真	0755-83199588	010-68121816
注册地址	深圳市福田区深南大道 7088 号招商银行大厦 32 层	北京市东城区建国门内大街 69 号
办公地址	深圳市福田区深南大道 7088 号招商银行大厦 32 层	北京市西城区复兴门内大街 28 号凯晨世贸中心东座 F9
邮政编码	518040	100031
法定代表人	吴庆斌	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)	
	大成中华沪深港 300 指数(LOF)A	大成中华沪深港 300 指数(LOF)C
本期已实现收益	3,047,624.17	31,233.98
本期利润	2,646,560.50	-42,841.61
加权平均基金份额本期利润	0.0293	-0.0445
本期加权平均净值利润率	2.15%	-3.29%
本期基金份额净值增长率	2.01%	1.96%
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	16,676,570.26	244,138.26
期末可供分配基金份额利润	0.1970	0.1960
期末基金资产净值	114,043,143.60	1,676,931.25
期末基金份额净值	1.3474	1.3463
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	34.74%	14.30%

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)扣除相关费用后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

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

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

4. 本基金于 2020 年 3 月 3 日起增设 C 类份额。

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

大成中华沪深港 300 指数 (LOF) 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	-1.37%	0.65%	-1.23%	0.70%	-0.14%	-0.05%
过去三个月	1.64%	0.85%	1.73%	0.86%	-0.09%	-0.01%
过去六个月	2.01%	1.17%	2.68%	1.17%	-0.67%	0.00%
过去一年	23.73%	1.12%	20.80%	1.12%	2.93%	0.00%
自基金合同生效起至今	34.74%	1.13%	25.66%	1.13%	9.08%	0.00%

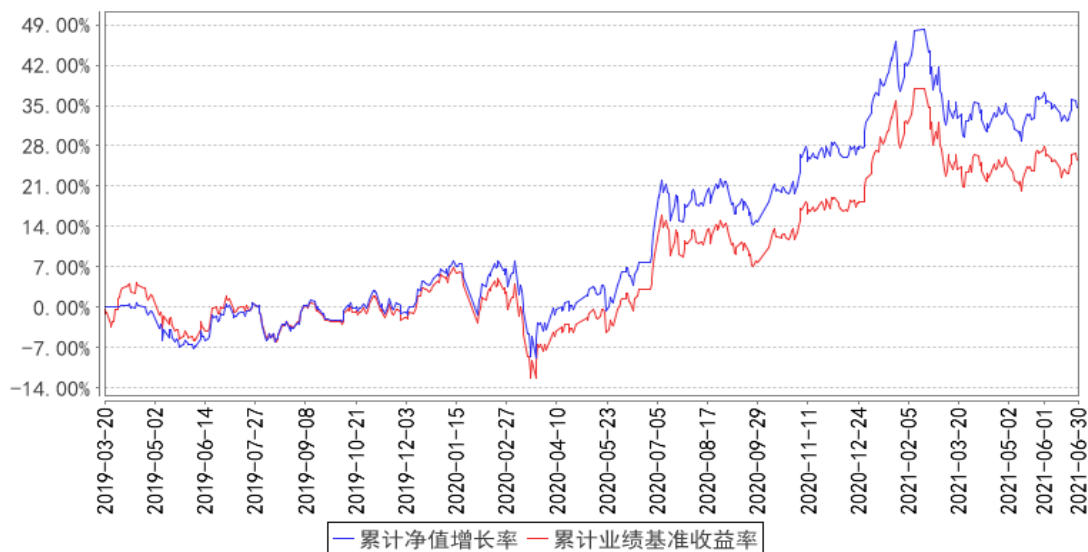
大成中华沪深港 300 指数 (LOF) C

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	-1.38%	0.65%	-1.23%	0.70%	-0.15%	-0.05%
过去三个月	1.62%	0.85%	1.73%	0.86%	-0.11%	-0.01%
过去六个月	1.96%	1.17%	2.68%	1.17%	-0.72%	0.00%
自基金合同生效起至今	14.30%	1.03%	12.86%	1.03%	1.44%	0.00%

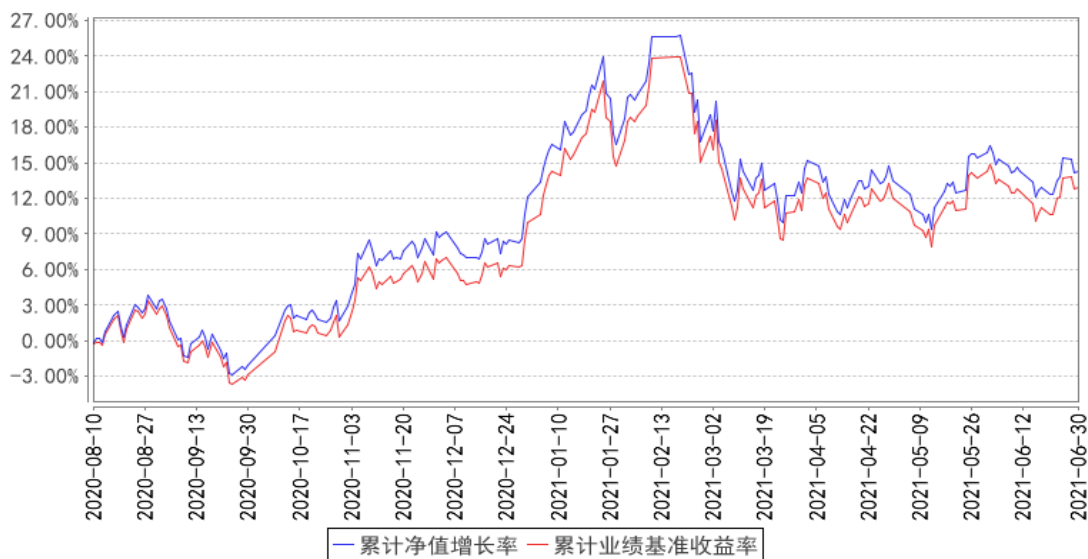
注：C 类的净值增长率和业绩比较基准收益率从 2020 年 8 月 10 日 C 类开始有份额之日开始计算。

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

大成中华沪深港300指数(LOF)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



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

§ 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		
冉凌浩	本基金基金经理	2019 年 3 月 20 日	-	18 年	金融学硕士。2003 年 4 月至 2004 年 6 月就职于国信证券研究部, 任研究员。2004 年 6 月至 2005 年 9 月就职于华西证券研究部, 任高级研究员。2005 年 9 月加入大成基金管理有限公司, 曾担任金融工程师、境外市场研究员及基金经理助理。2011 年 8 月 26 日起任大成标普 500 等权重指数型证券投资基金基金经理。2014 年 11 月 13 日起任大成纳斯达克 100 指数证券投资基金基金经理。2016 年 12 月 2 日起任大成恒生综合中小型股指数基金 (QDII-LOF) 基金经理。2016 年 12 月 29 日至 2020 年 7 月 7 日任大成海外中国机会混合型证券投资基金 (LOF) 基金经理。2017 年 8 月 10 日起任大成恒生指数证券投资基金 (LOF) 基金经理。2019 年 3 月 20 日起任大成中华沪深港 300 指数证券投资基金 (LOF) 基金经理。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。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些组合间的成交价格差异较大，但结合交易价差专项统计分析，未发现违反公平交易原则的异常情况。

4.3.2 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

2021 年上半年，多种新冠疫苗在发达国家推广接种，这使市场认为 2021 年发达国家的新冠疫情会逐步消除，未来疫情将不再是经济增长的显著拖累。

港股市场上，大部分上市公司的主营业务收入都来自中国，代表着中国经济的发展状况，因

此，中国经济增长将支撑港股的走势。

在 2021 年上半年，中国的疫情控制较佳，宏观经济也保持稳定增长。较好的宏观经济环境将会使得传统行业的企业盈利止跌回升，这将支持传统经济股票的上涨。

从新兴行业股票来看，中国科技巨头公司继续登陆港股市场，持续改变着港股的市场结构，使得港股市场的金融行业权重下降且科技行业权重大幅上升，有了更好的长期增长前景。

今年年初，港股的估值洼地被各类投资者发掘，各类资金也持续流入港股，这使得港股今年以来表现较佳，这也体现了宏观经济的稳健增长趋势，因此在 1 季度，港股取得了明显的正增长。但是在 2 季度，港股呈现区间震荡的格局，这也是市场在消化 1 季度涨幅的表现。

上半年 A 股也是呈现区间震荡的格局，而由于本基金的标的指数较为平均的分布于 A 股及港股中，所以上半年本基金的标的指数也同样是呈现区间震荡的走势。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末大成中华沪深港 300 指数 (LOF) A 的基金份额净值为 1.3474 元，本报告期基金份额净值增长率为 2.01%，同期业绩比较基准收益率为 2.68%；截至本报告期末大成中华沪深港 300 指数 (LOF) C 的基金份额净值为 1.3463 元，本报告期基金份额净值增长率为 1.96%，同期业绩比较基准收益率为 2.68%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

当前港股估值合理，因此未来港股市场的走势主要由上市公司盈利水平决定。港股中以传统行业为代表的指数权重板块有望受益于企业盈利上行和估值修复，亦有望在一定程度上能够支撑指数表现。A 股也有望随着宏观经济的变化而波动。

此外，由于全球主要国家的货币当局都实行较为宽松的货币政策，致使全球的通货膨胀水平有所提高。较高的通货膨胀水平促使市场预期未来的货币政策有缩紧的可能性，而这种预期也有可能加大新兴市场股票的波动性。

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

4.6 管理人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

在托管本基金的过程中，本基金托管人中国农业银行股份有限公司严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》相关法律法规的规定以及基金合同、托管协议的约定，对本基金基金管理人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《中华人民共和国证券投资基金法》等有关法律法规，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

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

§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：大成中华沪深港 300 指数证券投资基金 (LOF)

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	9,516,175.92	7,639,931.99
结算备付金		-	-
存出保证金		5,272.34	14,018.23
交易性金融资产	6.4.3.2	108,295,915.11	121,805,271.00
其中：股票投资		108,295,915.11	121,805,271.00
基金投资		-	-
债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	6.4.3.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.3.4	-	-
应收证券清算款		-	2,141,466.06
应收利息	6.4.3.5	1,960.61	1,923.19
应收股利		261,513.11	3,590.74
应收申购款		22,757.45	63,766.43

递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.3.6	-	-
资产总计		118,103,594.54	131,669,967.64
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		825,611.78	-
应付赎回款		1,329,261.96	1,923,602.98
应付管理人报酬		48,308.37	51,224.91
应付托管费		9,661.69	10,244.97
应付销售服务费		135.91	20.07
应付交易费用	6.4.3.7	13,739.72	51,415.68
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	156,800.26	206,086.11
负债合计		2,383,519.69	2,242,594.72
所有者权益:			
实收基金	6.4.3.9	85,887,375.17	97,993,090.30
未分配利润	6.4.3.10	29,832,699.68	31,434,282.62
所有者权益合计		115,720,074.85	129,427,372.92
负债和所有者权益总计		118,103,594.54	131,669,967.64

注：报告截止日 2021 年 06 月 30 日，基金份额总额 85,887,375.17 份，其中大成中华沪深港 300 指数 (LOF) A 基金份额总额为 84,641,826.95 份，基金份额净值 1.3474 元。大成中华沪深港 300 指数 (LOF) C 基金份额总额为 1,245,548.22 份，基金份额净值 1.3463 元。

6.2 利润表

会计主体：大成中华沪深港 300 指数证券投资基金 (LOF)

本报告期：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		3,185,171.66	5,512,739.87
1. 利息收入		34,236.10	79,035.69
其中：存款利息收入	6.4.3.11	34,236.10	79,035.69
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）			3,592,597.65	11,435,461.72
其中：股票投资收益	6.4.3.12		2,597,995.44	9,938,804.40
基金投资收益			-	-
债券投资收益	6.4.3.13		-	-
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		994,602.21	1,496,657.32
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.3.17		-475,139.26	-6,290,198.08
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		33,477.17	288,440.54
减：二、费用			581,452.77	1,237,797.46
1. 管理人报酬	6.4.6.2.1		309,470.83	463,398.53
2. 托管费	6.4.6.2.2		61,894.21	92,679.76
3. 销售服务费	6.4.6.2.3		646.58	-
4. 交易费用	6.4.3.19		48,147.75	492,996.35
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		161,293.40	188,722.82
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）			2,603,718.89	4,274,942.41
减：所得税费用			-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）			2,603,718.89	4,274,942.41

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：大成中华沪深港 300 指数证券投资基金 (LOF)

本报告期：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)	97,993,090.30	31,434,282.62	129,427,372.92
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	2,603,718.89	2,603,718.89
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)	-12,105,715.13	-4,205,301.83	-16,311,016.96
其中：1. 基金申购款	13,240,717.49	5,173,625.38	18,414,342.87
2. 基金赎回款	-25,346,432.62	-9,378,927.21	-34,725,359.83
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以“-”号填列)	-	-	-
五、期末所有者权益(基金净值)	85,887,375.17	29,832,699.68	115,720,074.85
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)	351,061,620.03	19,213,263.07	370,274,883.10
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	4,274,942.41	4,274,942.41
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)	-233,600,527.36	-13,028,854.21	-246,629,381.57
其中：1. 基金申购款	6,508,294.68	104,992.84	6,613,287.52
2. 基金赎回款	-240,108,822.04	-13,133,847.05	-253,242,669.09

回款			
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-	-
五、期末所有者权益（基金净值）	117,461,092.67	10,459,351.27	127,920,443.94

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

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128 号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2008]1 号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85 号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2014]81 号《财政部国家税务总局证监会关于沪港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》、财税[2015]101 号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2016]36 号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46 号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70 号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、财税[2016]127 号《财政部国家税务总局证监会关于深港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》、财税[2016]140 号《关于明确金融 房地产开发 教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税[2017]2 号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017]56 号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90 号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1) 资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人。资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为，暂适用简易计税方法，按照 3% 的征收率缴纳增值税。

对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税，对国债、地方政府

债以及金融同业往来利息收入亦免征增值税。资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务，以产生的利息及利息性质的收入为销售额。

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

(3) 对基金取得的企业债券利息收入，应由发行债券的企业在向基金支付利息时代扣代缴 20% 的个人所得税。对基金从上市公司取得的股息红利所得，持股期限在 1 个月以内(含 1 个月)的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在 1 个月以上至 1 年(含 1 年)的，暂减按 50% 计入应纳税所得额；持股期限超过 1 年的，暂免征收个人所得税。对基金持有的上市公司限售股，解禁后取得的股息、红利收入，按照上述规定计算纳税，持股时间自解禁日起计算；解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按 50% 计入应纳税所得额。上述所得统一适用 20% 的税率计征个人所得税。

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

(4) 基金卖出股票按 0.1% 的税率缴纳股票交易印花税，买入股票不征收股票交易印花税。基金通过港股通买卖、继承、赠与联交所上市股票，按照香港特别行政区现行税法规定缴纳印花税。

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

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	9,516,175.92
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	9,516,175.92

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	91,525,301.14	108,295,915.11	16,770,613.97
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	91,525,301.14	108,295,915.11	16,770,613.97

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

6.4.3.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

无。

6.4.3.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

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	1,958.21
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	-
应收债券利息	-
应收资产支持证券利息	-
应收买入返售证券利息	-
应收申购款利息	-
应收黄金合约拆借孳息	-
应收出借证券利息	-

其他	2.40
合计	1,960.61

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	13,739.72
银行间市场应付交易费用	-
合计	13,739.72

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	2,744.92
应付证券出借违约金	-
预提费用	114,055.34
应付指数使用费	40,000.00
合计	156,800.26

6.4.3.9 实收基金

金额单位：人民币元

大成中华沪深港 300 指数 (LOF) 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	97,777,316.38	97,777,316.38
本期申购	10,679,419.36	10,679,419.36
本期赎回 (以“-”号填列)	-23,814,908.79	-23,814,908.79
本期末	84,641,826.95	84,641,826.95

大成中华沪深港 300 指数 (LOF) 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	215,773.92	215,773.92
本期申购	2,561,298.13	2,561,298.13
本期赎回 (以“-”号填列)	-1,531,523.83	-1,531,523.83
本期末	1,245,548.22	1,245,548.22

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

大成中华沪深港 300 指数 (LOF) A

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	15,950,927.40	15,414,229.05	31,365,156.45
本期利润	3,047,624.17	-401,063.67	2,646,560.50
本期基金份额 交易产生的 变动数	-2,321,981.31	-2,288,418.99	-4,610,400.30
其中：基金申 购款	1,850,247.14	2,343,746.17	4,193,993.31
基金赎 回款	-4,172,228.45	-4,632,165.16	-8,804,393.61
本期已分配 利润	-	-	-
本期末	16,676,570.26	12,724,746.39	29,401,316.65

大成中华沪深港 300 指数 (LOF) C

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	35,116.41	34,009.76	69,126.17
本期利润	31,233.98	-74,075.59	-42,841.61
本期基金份额 交易产生的变 动数	177,787.87	227,310.60	405,098.47
其中：基金申 购款	451,015.06	528,617.01	979,632.07
基金赎 回款	-273,227.19	-301,306.41	-574,533.60
本期已分配利 润	-	-	-
本期末	244,138.26	187,244.77	431,383.03

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	33,621.25
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	522.92
其他	91.93
合计	34,236.10

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	20,122,632.06
减：卖出股票成本总额	17,524,636.62
买卖股票差价收入	2,597,995.44

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	994,602.21
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	994,602.21

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	-475,139.26
股票投资	-475,139.26
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	-475,139.26

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	33,477.17
合计	33,477.17

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。

6.4.3.19 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	48,147.75
银行间市场交易费用	-
合计	48,147.75

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	24,795.19
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
银行划款手续费	3,521.12
指数使用费	43,716.94
上市费	29,752.78
合计	161,293.40

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

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、基金销售机构

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.6 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	18,166,651.83	73.81	113,664,544.66	46.53

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	15,960.40	75.22	9,777.67	71.16
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	101,312.67	48.44	42,218.42	85.46

注：1. 上述佣金参考市场价格经本基金的基金管理人与对方协商确定。

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

6.4.6.2 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 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
当期发生的基金应支付的管理费	309,470.83	463,398.53
其中：支付销售机构的客户维护费	96,281.08	307,854.87

注：支付基金管理人大成基金的管理人报酬按前一日基金资产净值 0.50% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日管理人报酬 = 前一日基金资产净值 × 0.50% / 当年天数。

6.4.6.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	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
当期发生的基金应支付的托管费	61,894.21	92,679.76

注：支付基金托管人中国农业银行的托管费按前一日基金资产净值 0.10% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日托管费 = 前一日基金资产净值 × 0.10% / 当年天数。

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		
	大成中华沪深港 300 指数 (LOF) A	大成中华沪深港 300 指数 (LOF) C	合计
大成基金	-	8.23	8.23
合计	-	8.23	8.23
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		
	大成中华沪深港 300 指数 (LOF) A	大成中华沪深港 300 指数 (LOF) C	合计
-	-	-	-
合计	-	-	-

注：支付基金销售机构的销售服务费按前一日 C 类基金份额的基金资产净值 0.10% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付给大成基金，再由大成基金计算并支付给各基金销售机构。其计算公式为：

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

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

6.4.6.4.1 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。

6.4.6.4.2 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。

6.4.6.5 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	9,516,175.92	33,621.25	10,507,863.27	67,998.84

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

无。

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

无。

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07	6.15	12,200	156,661.27	68,198.00	-

		日			月 06					
					日					

6.4.8.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.8.3.1 银行间市场债券正回购

无。

6.4.8.3.2 交易所市场债券正回购

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

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

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

本基金的基金管理人对于金融工具的风险管理方法主要是通过定性分析和定量分析的方法去估测各种风险产生的可能损失。从定性分析的角度出发，判断风险损失的严重程度和出现同类风

险损失的频度。而从定量分析的角度出发，根据本基金的投资目标，结合基金资产所运用金融工具特征通过特定的风险量化指标、模型，日常的量化报告，确定风险损失的限度和相应置信程度，及时可靠地对各种风险进行监督、检查和评估，并通过相应决策，将风险控制在可承受的范围内。

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行中国农业银行，因而与银行存款相关的信用风险不重大。本基金在交易所进行的交易均以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，违约风险可能性很小；在银行间同业市场进行交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式进行限制以控制相应的信用风险。于本期末，本基金无债券投资。

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》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。

6.4.9.4 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。

6.4.9.4.1.1 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	9,516,175.92	-	-	-	9,516,175.92
存出保证金	5,272.34	-	-	-	5,272.34
交易性金融资产	-	-	-	108,295,915.11	108,295,915.11
应收利息	-	-	-	1,960.61	1,960.61
应收股利	-	-	-	261,513.11	261,513.11
应收申购款	200.00	-	-	22,557.45	22,757.45
资产总计	9,521,648.26	-	-	108,581,946.28	118,103,594.54
负债					
应付赎回款	-	-	-	1,329,261.96	1,329,261.96
应付管理人报酬	-	-	-	48,308.37	48,308.37
应付托管费	-	-	-	9,661.69	9,661.69
应付证券清算款	-	-	-	825,611.78	825,611.78

应付销售服务费	-	-	-	135.91	135.91
应付交易费用	-	-	-	13,739.72	13,739.72
其他负债	-	-	-	156,800.26	156,800.26
负债总计	-	-	-	2,383,519.69	2,383,519.69
利率敏感度缺口	9,521,648.26	-	-	-106,198,426.59	115,720,074.85
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	7,639,931.99	-	-	-	7,639,931.99
存出保证金	14,018.23	-	-	-	14,018.23
交易性金融资产	-	-	-	-121,805,271.00	121,805,271.00
应收利息	-	-	-	1,923.19	1,923.19
应收股利	-	-	-	3,590.74	3,590.74
应收申购款	-	-	-	63,766.43	63,766.43
应收证券清算款	-	-	-	2,141,466.06	2,141,466.06
资产总计	7,653,950.22	-	-	-124,016,017.42	131,669,967.64
负债					
应付赎回款	-	-	-	1,923,602.98	1,923,602.98
应付管理人报酬	-	-	-	51,224.91	51,224.91
应付托管费	-	-	-	10,244.97	10,244.97
应付销售服务费	-	-	-	20.07	20.07
应付交易费用	-	-	-	51,415.68	51,415.68
其他负债	-	-	-	206,086.11	206,086.11
负债总计	-	-	-	2,242,594.72	2,242,594.72
利率敏感度缺口	7,653,950.22	-	-	-121,773,422.70	129,427,372.92

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。

6.4.9.4.1.2 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）。

6.4.9.4.2 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。本基金持有不以记账本位币计价的资产，因此存在相应的外汇风险。

6.4.9.4.2.1 外汇风险敞口

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 6 月 30 日			
	美元	港币	其他币种	合计

	折合人民币元	折合人民币元	折合人民币元	
以外币计价的资产				
交易性金融资产	-	48,508,403.24	-	48,508,403.24
资产合计	-	48,508,403.24	-	48,508,403.24
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	-	48,508,403.24	-	48,508,403.24
项目	上年度末 2020 年 12 月 31 日			
	美元折合人民币元	港币折合人民币元	其他币种折合人民币元	合计
以外币计价的资产				
交易性金融资产	-	54,031,449.27	-	54,031,449.27
资产合计	-	54,031,449.27	-	54,031,449.27
以外币计价的负债				
负债合计	-	-	-	-
资产负债表外汇风险敞口净额	-	54,031,449.27	-	54,031,449.27

6.4.9.4.2.2 外汇风险的敏感性分析

假设	除港币以外的其他市场变量保持不变		
	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2021 年 6 月 30 日）	上年度末（2020 年 12 月 31 日）
分析	港币相对人民币升值 5%	2,425,420.16	2,701,572.46
	港币相对人民币贬值	-2,425,420.17	-2,701,572.46

	值 5%		
--	------	--	--

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。

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	108,295,915.11	93.58	121,805,271.00	94.11
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	108,295,915.11	93.58	121,805,271.00	94.11

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	业绩比较基准上升 5%	5,720,165.08	6,586,054.55
	业绩比较基准下降	-5,720,165.08	-6,586,054.55

	5%		
--	----	--	--

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	108,295,915.11	91.70
	其中：股票	108,295,915.11	91.70
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	9,516,175.92	8.06
8	其他各项资产	291,503.51	0.25
9	合计	118,103,594.54	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	735,673.16	0.64
B	采矿业	1,412,590.68	1.22
C	制造业	33,821,896.34	29.23
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	843,932.93	0.73
E	建筑业	688,416.00	0.59
F	批发和零售业	259,831.80	0.22
G	交通运输、仓储和邮政业	908,247.59	0.78
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	2,124,687.97	1.84
J	金融业	14,275,339.34	12.34

K	房地产业	1,286,967.00	1.11
L	租赁和商务服务业	1,279,319.00	1.11
M	科学研究和技术服务业	939,853.88	0.81
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	48,047.00	0.04
Q	卫生和社会工作	914,811.18	0.79
R	文化、体育和娱乐业	247,898.00	0.21
S	综合	-	-
	合计	59,787,511.87	51.67

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

无。

7.2.3 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

行业类别	公允价值（人民币）	占基金资产净值比例（%）
原材料	215,675.13	0.19
非日常生活消费品	7,472,093.22	6.46
日常消费品	2,141,336.10	1.85
能源	942,627.05	0.81
金融	15,228,937.76	13.16
医疗保健	2,819,776.51	2.44
工业	948,640.62	0.82
信息技术	2,223,343.52	1.92
通讯服务	11,065,452.36	9.56
公用事业	1,823,155.74	1.58
房地产	3,627,365.23	3.13
合计	48,508,403.24	41.92

注：以上分类采用全球行业分类标准（GICS）。

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	00700	腾讯控股	20,670	10,044,270.66	8.68
2	601318	中国平安	35,701	2,294,860.28	1.98
2	02318	中国平安	24,500	1,550,352.26	1.34

3	03690	美团-W	13,600	3,625,738.68	3.13
4	600519	贵州茅台	1,700	3,496,390.00	3.02
5	01299	友邦保险	40,000	3,211,828.80	2.78
6	600036	招商银行	40,800	2,210,952.00	1.91
6	03968	招商银行	15,000	826,879.50	0.71
7	00005	汇丰控股	68,343	2,550,477.93	2.20
8	00939	建设银行	414,000	2,104,779.64	1.82
9	300750	宁德时代	3,900	2,085,720.00	1.80
10	000858	五粮液	6,400	1,906,496.00	1.65
11	01398	工商银行	287,000	1,088,959.74	0.94
11	601398	工商银行	115,600	597,652.00	0.52
12	00388	香港交易所	4,189	1,613,127.87	1.39
13	02269	药明生物	11,000	1,302,454.82	1.13
14	000333	美的集团	16,200	1,156,194.00	1.00
15	01810	小米集团-W	49,800	1,118,814.77	0.97
16	601012	隆基股份	12,166	1,080,827.44	0.93
17	600276	恒瑞医药	14,868	1,010,577.96	0.87
18	601166	兴业银行	48,000	986,400.00	0.85
19	601888	中国中免	3,200	960,320.00	0.83
20	300059	东方财富	27,274	894,314.46	0.77
21	03988	中国银行	276,000	640,734.88	0.55
21	601988	中国银行	71,200	219,296.00	0.19
22	002594	比亚迪	3,000	753,000.00	0.65
22	01211	比亚迪股份	500	96,604.49	0.08
23	000651	格力电器	15,900	828,390.00	0.72
24	00941	中国移动	20,487	827,623.25	0.72
25	002415	海康威视	12,300	793,350.00	0.69
26	603259	药明康德	5,032	787,960.88	0.68
27	300760	迈瑞医疗	1,600	768,080.00	0.66
28	600887	伊利股份	20,100	740,283.00	0.64
29	000001	平安银行	32,060	725,197.20	0.63
30	600030	中信证券	28,100	700,814.00	0.61
31	601328	交通银行	90,700	444,430.00	0.38
31	03328	交通银行	59,000	256,264.00	0.22
32	002475	立讯精密	13,847	636,962.00	0.55
33	600900	长江电力	30,000	619,200.00	0.54
34	02020	安踏体育	4,000	608,416.90	0.53
35	02331	李宁	7,500	591,608.88	0.51
36	600031	三一重工	19,600	569,772.00	0.49
37	000568	泸州老窖	2,400	566,256.00	0.49
38	600309	万华化学	5,200	565,864.00	0.49
39	00669	创科实业	5,000	564,150.24	0.49

40	000725	京东方 A	89,400	557,856.00	0.48
41	603288	海天味业	4,190	540,300.50	0.47
42	600809	山西汾酒	1,200	537,600.00	0.46
43	000002	万科 A	22,500	535,725.00	0.46
44	002714	牧原股份	8,618	524,146.76	0.45
45	601601	中国太保	11,300	327,361.00	0.28
45	02601	中国太保	9,200	187,168.08	0.16
46	02382	舜宇光学科 技	2,500	510,481.08	0.44
47	02628	中国人寿	24,968	319,940.75	0.28
47	601628	中国人寿	5,600	189,784.00	0.16
48	300015	爱尔眼科	7,101	504,028.98	0.44
49	00016	新鸿基地产	4,984	479,817.93	0.41
50	600585	海螺水泥	7,900	324,295.00	0.28
50	00914	海螺水泥	4,500	154,267.63	0.13
51	06160	百济神州	2,700	474,485.30	0.41
52	00386	中国石化 工股份	85,901	280,902.66	0.24
52	600028	中国石化	44,200	192,712.00	0.17
53	02313	申洲国际	2,900	473,195.58	0.41
54	00175	吉利汽车	22,964	467,187.79	0.40
55	00001	长和	8,985	452,312.45	0.39
56	603501	韦尔股份	1,400	450,800.00	0.39
57	600436	片仔癀	1,000	448,300.00	0.39
58	00883	中国海洋石 油	60,098	441,556.02	0.38
59	601899	紫金矿业	45,400	439,926.00	0.38
60	00002	中电控股	6,492	414,863.11	0.36
61	002304	洋河股份	2,000	414,400.00	0.36
62	002352	顺丰控股	6,000	406,200.00	0.35
63	300014	亿纬锂能	3,800	394,934.00	0.34
64	300122	智飞生物	2,100	392,133.00	0.34
65	002230	科大讯飞	5,800	391,964.00	0.34
66	00857	中国石油股 份	70,000	220,168.37	0.19
66	601857	中国石油	32,100	169,809.00	0.15
67	600000	浦发银行	38,800	388,000.00	0.34
68	002142	宁波银行	9,900	385,803.00	0.33
69	300124	汇川技术	5,100	378,726.00	0.33
70	01113	长实集团	8,487	378,515.85	0.33
71	09633	农夫山泉	11,600	375,950.39	0.32
72	00027	银河娱乐	7,000	361,996.40	0.31

73	000100	TCL 科技	46,300	354,195.00	0.31
74	06098	碧桂园服务	5,000	349,057.56	0.30
75	02319	蒙牛乳业	8,925	348,665.44	0.30
76	000661	长春高新	900	348,300.00	0.30
77	00291	华润啤酒	5,988	347,529.03	0.30
78	600438	通威股份	8,000	346,160.00	0.30
79	300274	阳光电源	3,000	345,180.00	0.30
80	00003	香港中华煤 气	34,393	345,129.79	0.30
81	002241	歌尔股份	7,900	337,646.00	0.29
82	00012	恒基地产	10,980	336,213.57	0.29
83	300347	泰格医药	1,700	328,610.00	0.28
84	002812	恩捷股份	1,400	327,740.00	0.28
85	002460	赣锋锂业	2,700	326,943.00	0.28
86	600690	海尔智家	12,500	323,875.00	0.28
87	00011	恒生银行	2,497	322,251.85	0.28
88	601668	中国建筑	69,200	321,780.00	0.28
89	002271	东方雨虹	5,800	320,856.00	0.28
90	02688	新奥能源	2,600	319,751.70	0.28
91	002027	分众传媒	33,900	318,999.00	0.28
92	300142	沃森生物	5,100	314,670.00	0.27
93	01109	华润置地	11,957	312,901.73	0.27
94	600016	民生银行	70,200	309,582.00	0.27
95	601688	华泰证券	19,400	306,520.00	0.26
96	02388	中银香港	13,936	305,551.09	0.26
97	01093	石药集团	32,425	303,257.38	0.26
98	000063	中兴通讯	8,900	295,747.00	0.26
99	01928	金沙中国有 限公司	10,800	293,857.37	0.25
100	600837	海通证券	25,500	293,250.00	0.25
101	300782	卓胜微	540	290,250.00	0.25
102	603986	兆易创新	1,540	289,366.00	0.25
103	600196	复星医药	4,000	288,520.00	0.25
104	600048	保利地产	23,700	285,348.00	0.25
105	600919	江苏银行	39,600	281,160.00	0.24
106	000338	潍柴动力	15,700	280,559.00	0.24
107	01177	中国生物制 药	43,000	272,639.33	0.24
108	601229	上海银行	32,800	268,960.00	0.23
109	00981	中芯国际	13,500	268,470.61	0.23
110	600570	恒生电子	2,779	259,141.75	0.22
111	601211	国泰君安	14,900	255,386.00	0.22

112	600104	上汽集团	11,600	254,852.00	0.22
113	601766	中国中车	40,200	244,416.00	0.21
114	601169	北京银行	48,800	237,656.00	0.21
115	600703	三安光电	7,400	237,170.00	0.20
116	600999	招商证券	12,240	232,804.80	0.20
117	002129	中环股份	6,000	231,600.00	0.20
118	600019	宝钢股份	30,000	229,200.00	0.20
119	002371	北方华创	800	221,904.00	0.19
120	601088	中国神华	11,100	216,672.00	0.19
121	00066	港铁公司	6,005	216,104.70	0.19
122	002049	紫光国微	1,400	215,866.00	0.19
123	06969	思摩尔国际	6,000	214,926.26	0.19
124	00960	龙湖集团	5,933	214,747.78	0.19
125	02007	碧桂园	29,573	214,081.79	0.18
126	002311	海大集团	2,600	212,160.00	0.18
127	600406	国电南瑞	9,120	211,948.80	0.18
128	300498	温氏股份	14,720	211,526.40	0.18
129	002410	广联达	3,100	211,420.00	0.18
130	688036	传音控股	1,000	209,500.00	0.18
131	601009	南京银行	19,900	209,348.00	0.18
132	06186	中国飞鹤	15,000	209,184.91	0.18
133	01658	邮储银行	33,000	143,608.69	0.12
133	601658	邮储银行	11,900	59,738.00	0.05
134	00267	中信股份	28,913	201,364.87	0.17
135	00241	阿里健康	14,021	200,898.74	0.17
136	01918	融创中国	9,000	199,574.39	0.17
137	601818	光大银行	52,500	198,450.00	0.17
138	00688	中国海外发展	13,454	197,476.35	0.17
139	688111	金山办公	500	197,400.00	0.17
140	000538	云南白药	1,700	196,724.00	0.17
141	000625	长安汽车	7,300	191,844.00	0.17
142	600893	航发动力	3,500	186,165.00	0.16
143	600346	恒力石化	6,940	182,105.60	0.16
144	300454	深信服	700	181,636.00	0.16
145	600588	用友网络	5,380	178,938.80	0.15
146	00006	电能实业	4,496	178,260.16	0.15
147	00992	联想集团	23,882	177,454.59	0.15
148	601390	中国中铁	33,700	176,588.00	0.15
149	601633	长城汽车	4,000	174,360.00	0.15
150	002493	荣盛石化	10,000	172,700.00	0.15
151	00017	新世界发展	4,988	167,469.25	0.14

152	300601	康泰生物	1,100	163,900.00	0.14
153	300413	芒果超媒	2,350	161,210.00	0.14
154	600009	上海机场	3,300	158,829.00	0.14
155	00998	中信银行	34,948	107,012.68	0.09
155	601998	中信银行	10,100	51,510.00	0.04
156	300896	爱美客	200	157,776.00	0.14
157	601225	陕西煤业	13,200	156,420.00	0.14
158	01193	华润燃气	4,000	155,099.71	0.13
159	600745	闻泰科技	1,600	155,040.00	0.13
160	01833	平安好医生	1,900	152,878.06	0.13
161	300408	三环集团	3,600	152,712.00	0.13
162	300759	康龙化成	700	151,893.00	0.13
163	002821	凯莱英	400	149,040.00	0.13
164	002001	新和成	5,140	147,415.20	0.13
165	01997	九龙仓置业	3,923	147,380.88	0.13
166	000776	广发证券	9,700	146,858.00	0.13
167	300433	蓝思科技	4,900	144,109.00	0.12
168	002050	三花智控	5,977	143,328.46	0.12
169	002179	中航光电	1,800	142,236.00	0.12
170	000166	申万宏源	29,700	138,996.00	0.12
171	600958	东方证券	13,800	137,862.00	0.12
172	00384	中国燃气	6,971	137,470.18	0.12
173	00788	中国铁塔	154,000	137,110.14	0.12
174	002841	视源股份	1,100	136,719.00	0.12
175	600741	华域汽车	5,200	136,604.00	0.12
176	06862	海底捞	4,000	136,128.29	0.12
177	300003	乐普医疗	4,200	134,904.00	0.12
178	00881	中升控股	2,500	134,380.92	0.12
179	000786	北新建材	3,400	133,450.00	0.12
180	688012	中微公司	800	132,736.00	0.11
181	000963	华东医药	2,880	132,508.80	0.11
182	600050	中国联通	30,600	132,192.00	0.11
183	002007	华兰生物	3,600	132,048.00	0.11
184	000157	中联重科	14,000	129,360.00	0.11
185	00288	万洲国际	21,721	126,153.80	0.11
186	600015	华夏银行	20,300	125,657.00	0.11
187	601155	新城控股	3,000	124,800.00	0.11
188	002236	大华股份	5,900	124,490.00	0.11
189	601336	新华保险	2,700	123,957.00	0.11
190	601989	中国重工	30,000	123,600.00	0.11
191	603993	洛阳钼业	23,800	122,808.00	0.11
192	00083	信和置业	11,929	121,492.80	0.10

193	000768	中航西飞	4,600	120,888.00	0.10
194	02018	瑞声科技	2,487	120,231.15	0.10
195	600547	山东黄金	5,944	114,243.68	0.10
196	001979	招商蛇口	10,400	113,880.00	0.10
197	03692	翰森制药	4,000	113,162.88	0.10
198	601186	中国铁建	15,200	112,936.00	0.10
199	00101	恒隆地产	6,949	109,050.86	0.09
200	03333	中国恒大	12,947	109,022.15	0.09
201	000876	新希望	7,400	108,558.00	0.09
202	000895	双汇发展	3,400	108,120.00	0.09
203	01876	百威亚太	5,200	106,006.99	0.09
204	603160	汇顶科技	800	103,704.00	0.09
205	003816	中国广核	38,779	103,539.93	0.09
206	00322	康师傅控股	8,000	103,177.92	0.09
207	000938	紫光股份	4,696	102,748.48	0.09
208	300999	金龙鱼	1,200	101,952.00	0.09
209	002555	三七互娱	4,200	100,884.00	0.09
210	601066	中信建投	3,200	100,576.00	0.09
211	000069	华侨城 A	13,500	100,440.00	0.09
212	000425	徐工机械	15,500	98,735.00	0.09
213	01038	长江基建集团	2,500	96,313.26	0.08
214	000596	古井贡酒	400	95,800.00	0.08
215	000977	浪潮信息	3,400	95,642.00	0.08
216	000783	长江证券	12,700	92,964.00	0.08
217	00270	粤海投资	10,000	92,860.13	0.08
218	002624	完美世界	3,850	92,053.50	0.08
219	00151	中国旺旺	19,869	90,929.29	0.08
220	601360	三六零	7,200	87,912.00	0.08
221	600029	南方航空	14,600	87,892.00	0.08
222	601985	中国核电	17,200	87,032.00	0.08
223	01579	颐海国际	2,000	86,785.94	0.07
224	300144	宋城演艺	5,160	86,688.00	0.07
225	01044	恒安国际	2,000	86,536.32	0.07
226	002600	领益智造	9,200	84,548.00	0.07
227	00135	昆仑能源	14,000	83,407.70	0.07
228	002938	鹏鼎控股	2,300	82,524.00	0.07
229	002044	美年健康	9,020	82,172.20	0.07
230	601138	工业富联	6,600	81,906.00	0.07
231	688008	澜起科技	1,300	81,094.00	0.07
232	002602	世纪华通	12,336	79,197.12	0.07
233	300033	同花顺	700	78,946.00	0.07

234	00656	复星国际	8,477	78,858.60	0.07
235	601800	中国交建	11,900	77,112.00	0.07
236	601111	中国国航	9,800	76,244.00	0.07
237	300628	亿联网络	900	75,420.00	0.07
238	01972	太古地产	3,800	73,198.08	0.06
239	00004	九龙仓集团	2,950	72,657.23	0.06
240	000703	恒逸石化	6,010	71,819.50	0.06
241	00813	世茂集团	4,500	71,292.61	0.06
242	002916	深南电路	640	71,123.20	0.06
243	000708	中信特钢	3,300	68,772.00	0.06
244	002024	苏宁易购	12,200	68,198.00	0.06
245	002252	上海莱士	8,900	66,661.00	0.06
246	600606	绿地控股	12,000	65,400.00	0.06
247	01313	华润水泥控股	10,000	61,407.50	0.05
248	000656	金科股份	10,600	61,374.00	0.05
249	601816	京沪高铁	11,300	59,777.00	0.05
250	601933	永辉超市	12,500	59,125.00	0.05
251	00762	中国联通	16,000	56,448.31	0.05
252	002157	正邦科技	4,600	54,970.00	0.05
253	600018	上港集团	11,500	54,855.00	0.05
254	01929	周大福	3,600	53,139.96	0.05
255	01128	永利澳门	5,200	52,873.69	0.05
256	002120	韵达股份	3,803	51,454.59	0.04
257	601727	上海电气	12,100	51,304.00	0.04
258	000617	中油资本	8,280	49,845.60	0.04
259	601995	中金公司	800	49,200.00	0.04
260	03380	龙光集团	5,000	48,343.85	0.04
261	002607	中公教育	2,300	48,047.00	0.04
262	601881	中国银河	4,300	46,354.00	0.04
263	601916	浙商银行	11,100	44,067.00	0.04
264	601319	中国人保	7,200	42,696.00	0.04
265	603195	公牛集团	200	40,400.00	0.03
266	601238	广汽集团	3,100	40,145.00	0.03
267	600025	华能水电	5,900	34,161.00	0.03
268	600989	宝丰能源	2,400	32,832.00	0.03
269	002032	苏泊尔	500	31,895.00	0.03
270	600918	中泰证券	2,600	28,132.00	0.02
271	00968	信义光能	2,000	27,891.32	0.02
272	03799	达利食品	7,000	26,967.71	0.02
273	300888	稳健医疗	200	24,724.00	0.02
274	603087	甘李药业	200	21,316.00	0.02

275	06618	京东健康	200	18,522.10	0.02
276	300866	安克创新	100	16,747.00	0.01
277	06666	恒大物业	2,000	16,225.56	0.01
278	001965	招商公路	1,800	12,996.00	0.01
279	09992	泡泡玛特	200	12,814.03	0.01
280	01209	华润万象生活	200	8,845.01	0.01

注：对于同时在 A+H 股上市的股票，合并计算公允价值参与排序，并按照不同股票分别披露。

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

无。

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	02331	李宁	593,714.52	0.46
2	603501	韦尔股份	457,845.00	0.35
3	600438	通威股份	347,200.00	0.27
4	300274	阳光电源	343,398.00	0.27
5	01299	友邦保险	278,736.39	0.22
6	01810	小米集团-W	259,209.47	0.20
7	603986	兆易创新	214,664.00	0.17
8	688036	传音控股	209,427.64	0.16
9	600519	贵州茅台	201,429.00	0.16
10	688111	金山办公	195,826.80	0.15
11	02269	药明生物	174,439.82	0.13
12	300896	爱美客	156,710.00	0.12
13	002821	凯莱英	148,206.00	0.11
14	688012	中微公司	134,546.00	0.10
15	00941	中国移动	125,497.31	0.10
16	00388	香港交易所	117,161.45	0.09
17	01211	比亚迪股份	96,589.72	0.07
18	688008	澜起科技	81,824.00	0.06
19	600919	江苏银行	65,412.00	0.05
20	601995	中金公司	48,904.00	0.04

注：1、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。

2、对于同时在 A+H 股上市的股票，合并计算成交金额参与排序，并按照不同股票分别披露。

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	00700	腾讯控股	1,367,331.99	1.06
2	601995	中金公司	1,211,144.32	0.94
3	601318	中国平安	430,355.00	0.33
3	02318	中国平安	345,894.82	0.27
4	01299	友邦保险	719,650.73	0.56
5	600519	贵州茅台	625,686.00	0.48
6	01810	小米集团-W	542,298.98	0.42
7	603501	韦尔股份	452,780.00	0.35
8	600036	招商银行	294,301.00	0.23
8	03968	招商银行	153,521.07	0.12
9	03690	美团-W	445,488.24	0.34
10	00939	建设银行	237,215.55	0.18
10	601939	建设银行	166,731.00	0.13
11	00388	香港交易所	374,226.72	0.29
12	00005	汇丰控股	348,863.45	0.27
13	06690	海尔智家	241,565.95	0.19
13	600690	海尔智家	55,161.00	0.04
14	02269	药明生物	280,908.76	0.22
15	000858	五粮液	261,308.00	0.20
16	01398	工商银行	178,681.61	0.14
16	601398	工商银行	81,550.00	0.06
17	000333	美的集团	225,247.00	0.17
18	00941	中国移动	223,298.90	0.17
19	603986	兆易创新	204,480.00	0.16
20	300750	宁德时代	196,201.00	0.15

注：1、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。

2、对于同时在 A+H 股上市的股票，合并计算成交金额参与排序，并按照不同股票分别披露。

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	4,490,419.99
卖出股票收入（成交）总额	20,122,632.06

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

无。

7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

无。

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

无。

7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

无。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

无。

7.10 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建设银行（0939.HK）的发行主体中国建设银行股份有限公司于 2020 年 4 月 20 日因监管标准化数据（EAST）系统数据质量及数据报送存在违法违规行为，受到中国银行保险监督管理委员会处罚（银保监罚决字〔2020〕8 号），于 2020 年 7 月 13 日因内控管理不到位，支行原负责人擅自为同业投资违规提供担保并发生案件等，受到中国银行保险监督管理委员会处罚（银保监罚决字〔2020〕32 号），于 2021 年 8 月 13 日因占压财政存款或者资金等，受到中国人民银行处罚（银罚字〔2021〕22 号）。建设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。

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	5,272.34
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	261,513.11
4	应收利息	1,960.61
5	应收申购款	22,757.45
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	291,503.51

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

无。

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	户均持有的基金份	持有人结构	
			机构投资者	个人投资者

	(户)	额	持有份额	占总份额比例 (%)	持有份额	占总份额比例 (%)
大成中华沪深港 300 指数 (LOF) A	17,658	4,793.40	20,607,894.52	24.35	64,033,932.43	75.65
大成中华沪深港 300 指数 (LOF) C	1,037	1,201.11	-	-	1,245,548.22	100.00
合计	18,695	4,594.14	20,607,894.52	23.99	65,279,480.65	76.01

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 期末上市基金前十名持有人

大成中华沪深港 300 指数 (LOF) A

序号	持有人名称	持有份额 (份)	占上市总份额比例 (%)
1	唐勇	368,220.00	29.05
2	杨凯	200,707.00	15.83
3	王哲	108,500.00	8.56
4	郑双双	107,928.00	8.51
5	陈钰林	100,000.00	7.89
6	于素芬	51,606.00	4.07
7	王宗巧	30,800.00	2.43
8	钱中明	26,388.00	2.08
9	吴晟铠	21,300.00	1.68
10	张森	20,000.00	1.58

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	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	大成中华沪深港 300 指数 (LOF) A	106,569.78	0.1259
	大成中华沪深港 300 指数 (LOF) C	502.06	0.0403
	合计	107,071.84	0.1247

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）。

8.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

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

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	大成中华沪深港 300 指数 (LOF) A	大成中华沪深港 300 指数 (LOF) C
基金合同生效日 (2019 年 3 月 20 日) 基金份额总额	1,968,326,601.16	-
本报告期期初基金份额总额	97,777,316.38	215,773.92
本报告期基金总申购份额	10,679,419.36	2,561,298.13
减：本报告期基金总赎回份额	23,814,908.79	1,531,523.83
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	84,641,826.95	1,245,548.22

§ 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

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	
光大证券	2	18,166,651.83	73.81%	15,960.40	75.22%	-
招商证券	2	5,533,090.22	22.48%	4,426.52	20.86%	-
海通证券	1	913,310.00	3.71%	832.24	3.92%	-
爱建证券	1	-	-	-	-	-
安信证券	1	-	-	-	-	-
川财证券	1	-	-	-	-	-
第一创业	1	-	-	-	-	-
东北证券	2	-	-	-	-	-
东财证券	1	-	-	-	-	-
东方证券	1	-	-	-	-	-

东吴证券	1	-	-	-	-	-
东兴证券	1	-	-	-	-	-
方正证券	1	-	-	-	-	-
高华证券	1	-	-	-	-	-
广发证券	2	-	-	-	-	-
国金证券	2	-	-	-	-	-
国盛证券	1	-	-	-	-	-
国泰君安	3	-	-	-	-	-
国信证券	1	-	-	-	-	-
红塔证券	1	-	-	-	-	-
华创证券	1	-	-	-	-	-
华泰证券	1	-	-	-	-	-
华西证券	1	-	-	-	-	-
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	-	-	-	-	-
兴业证券	2	-	-	-	-	-

粤开证券	1	-	-	-	-	-
浙商证券	1	-	-	-	-	-
中国银河证 券	4	-	-	-	-	-
中金公司	3	-	-	-	-	-
中泰证券	2	-	-	-	-	-
中信建投证 券	2	-	-	-	-	-
中信证券	2	-	-	-	-	-
中银国际证 券	1	-	-	-	-	-
中原证券	1	-	-	-	-	-

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

租用证券公司交易单元的选择标准主要包括：

- (1) 财务状况良好，最近一年无重大违规行为；
- (2) 经营行为规范，内控制度健全，能满足各投资组合运作的保密性要求；
- (3) 研究实力较强，能提供包括研究报告、路演服务、协助进行上市公司调研等研究服务；
- (4) 具备各投资组合运作所需的高效、安全的通讯条件，有足够的交易和清算能力，满足各投资组合证券交易需要；
- (5) 能提供投资组合运作、管理所需的其他券商服务；
- (6) 相关基金合同、资产管理合同以及法律法规规定的其他条件。

租用证券公司交易单元的程序：首先根据租用证券公司交易单元的选择标准形成《券商服务评价表》，然后根据评分高低进行选择基金专用席位。本报告期内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	大成中华沪深港 300 指数证券投资基金 (LOF) 暂停申购、赎回及定投业务的公告	中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站	2021 年 6 月 29 日
3	大成中华沪深港 300 指数证券投资基金 (LOF) 暂停申购、赎回及定投业务的公告	中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站	2021 年 5 月 14 日
4	大成基金管理有限公司关于旗下部分基金增加宁波银行股份有限公司为销售机构的公告	中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站	2021 年 5 月 13 日
5	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
6	大成中华沪深港 300 指数证券投资基金 (LOF) 暂停申购、赎回及定投业务的公告	中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站	2021 年 4 月 29 日
7	大成中华沪深港 300 指数证券投资基金 (LOF) 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
8	大成中华沪深港 300 指数证券投资基金 (LOF) 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 4 月 20 日
9	大成基金管理有限公司关于旗下部分基金增加北京度小满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 4 月 19 日
10	大成中华沪深港 300 指数证券投资基金 (LOF) 暂停申购、赎回及定投业务的公告	中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站	2021 年 3 月 31 日
11	大成中华沪深港 300 指数证券投资基金 (LOF) 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
12	大成中华沪深港 300 指数证券投资基金 (LOF) 基金产品资料概要更新	中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站	2021 年 3 月 30 日
13	大成中华沪深港 300 指数证券投资基金 (LOF) 基金产品资料概要更新	中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站	2021 年 3 月 30 日
14	大成中华沪深港 300 指数证券投资基金 (LOF) 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

15	大成中华沪深港 300 指数证券投资基金 (LOF) 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
16	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
17	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
18	大成中华沪深港 300 指数证券投资基金 (LOF) (C 类份额) 基金产品资料概要更新	中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站	2021 年 2 月 23 日
19	大成中华沪深港 300 指数证券投资基金 (LOF) 暂停申购、赎回及定投业务的公告	中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站	2021 年 2 月 6 日
20	大成中华沪深港 300 指数证券投资基金 (LOF) 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

§ 11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过 20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比 (%)
机构	1	20210101-20210630	20,606,903.66	-	-	20,606,903.66	23.99
产品特有风险							
当基金份额持有人占比过于集中时，可能会因某单一基金份额持有人大额赎回而引发基金净值剧烈波动的风险，甚至有可能引起基金的流动性风险，基金管理人可能无法及时变现基金资产以应对基金份额持有人的赎回申请，基金份额持有人可能无法及时赎回持有的全部基金份额。							

11.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§ 12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

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