

大成中华沪深港 300 指数证券投资基金 (LOF) 2022 年中期报告

2022 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：2022 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。

基金托管人中国农业银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2022 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 2022 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	7
3.1 主要会计数据和财务指标	7
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	12
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	13
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	14
§ 5 托管人报告	14
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	14
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	16
6.3 净资产（基金净值）变动表	17
6.4 报表附注	20
§ 7 投资组合报告	45
7.1 期末基金资产组合情况	45
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	46
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	47
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	54
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	56
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	56

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	56
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	56
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	56
7.10 本基金投资股指期货的投资政策	56
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	56
7.12 投资组合报告附注	57
§ 8 基金份额持有人信息	58
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	58
8.2 期末上市基金前十名持有人	58
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	59
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	59
§ 9 开放式基金份额变动	59
§ 10 重大事件揭示	60
10.1 基金份额持有人大会决议	60
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	60
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	60
10.4 基金投资策略的改变	60
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	60
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	60
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	61
10.8 其他重大事件	62
§ 11 影响投资者决策的其他重要信息	64
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	64
11.2 影响投资者决策的其他重要信息	64
§ 12 备查文件目录	64
12.1 备查文件目录	64
12.2 存放地点	64
12.3 查阅方式	64

§ 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	29,604,815.17 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	27,487,319.01 份	2,117,496.16 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	段皓静	秦一楠
	联系电话	0755-83183388	010-66060069
	电子邮箱	office@dcfund.com.cn	tgxxpl@abchina.com
客户服务电话		4008885558	95599
传真		0755-83199588	010-68121816
注册地址		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	北京市东城区建国门内大街 69 号
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 28 号凯晨世贸中心东座 F9
邮政编码		518054	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(2022年01月01日-2022年06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	-3,099,624.28	-190,517.11
本期利润	-7,099,393.72	-56,241.60
加权平均基金份额本期利润	-0.1446	-0.0302
本期加权平均净值利润率	-13.12%	-2.76%
本期基金份额净值增长率	-5.22%	-5.26%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2022年6月30日)	
期末可供分配利润	3,888,708.80	295,213.22
期末可供分配基金份额利润	0.1415	0.1394
期末基金资产净值	31,415,498.76	2,415,890.04
期末基金份额净值	1.1429	1.1409
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2022年6月30日)	
基金份额累计净值增长率	14.29%	-3.14%

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	6.95%	1.10%	6.27%	1.10%	0.68%	0.00%
过去三个月	7.13%	1.38%	5.65%	1.29%	1.48%	0.09%
过去六个月	-5.22%	1.53%	-6.79%	1.48%	1.57%	0.05%
过去一年	-15.18%	1.30%	-17.30%	1.27%	2.12%	0.03%
过去三年	15.83%	1.21%	4.01%	1.18%	11.82%	0.03%
自基金合同生效起至今	14.29%	1.18%	3.92%	1.16%	10.37%	0.02%

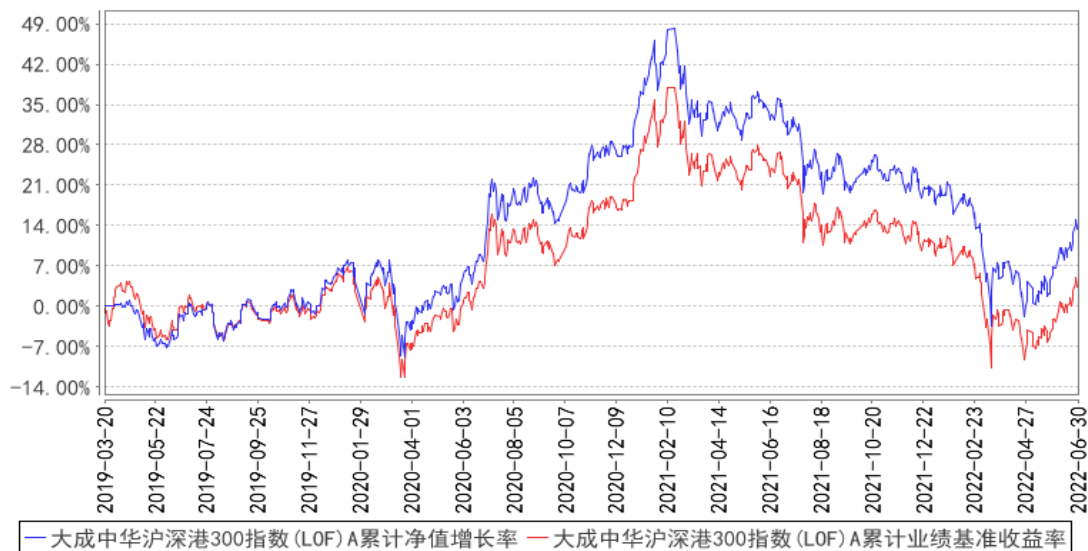
大成中华沪深港 300 指数 (LOF) C

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	6.94%	1.10%	6.27%	1.10%	0.67%	0.00%
过去三个月	7.11%	1.39%	5.65%	1.29%	1.46%	0.10%
过去六个月	-5.26%	1.53%	-6.79%	1.48%	1.53%	0.05%
过去一年	-15.26%	1.30%	-17.30%	1.27%	2.04%	0.03%
自基金合同生效起至今	-3.14%	1.19%	-6.67%	1.17%	3.53%	0.02%

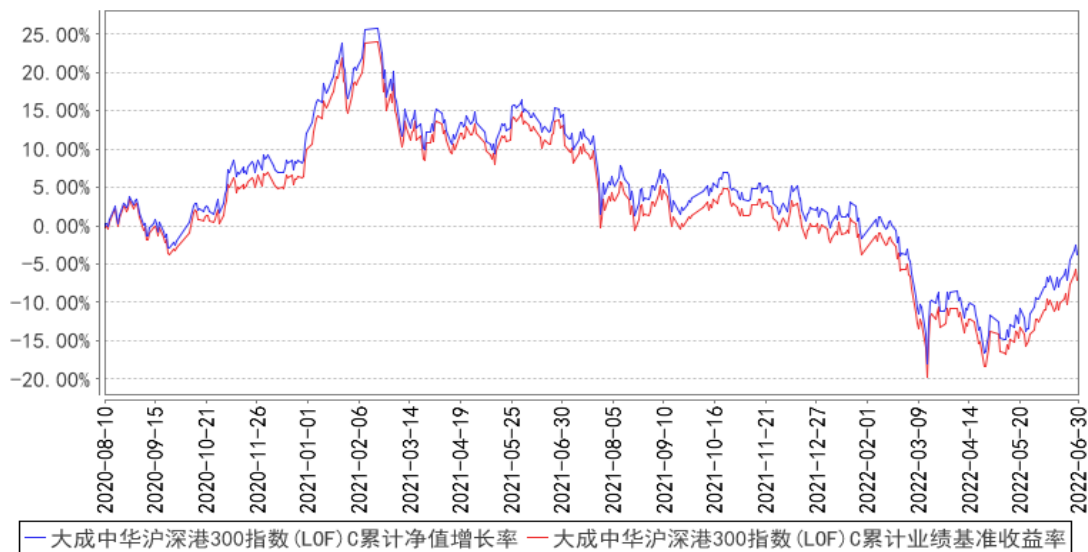
注：C 类的净值增长率和业绩比较基准收益率从 2020 年 8 月 10 日 C 类开始有份额之日开始计算。

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 23 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	2019 年 3 月 20 日	-	19 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。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。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, 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, 基金管理人旗下所有投资组合未发现存在异常交易行为。主动投资组合间股票交易存在 1 笔同日反向交易, 原因为投资策略需要。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, 原因为流动性需要或合规比例调整。投资组合间相邻交易日反向交易的市场成交比例、成交均价等交易结果数据表明该类交易不对市场产生重大影响, 无异常。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2022 年上半年，全球资本市场都出现了较大幅度的波动，中华沪深港 300 指数也不例外，也出现了较大幅度的震荡。

在上半年的前几个月，港股及 A 股基本上呈现单边剧烈下跌的情形，导致市场下跌的因素有很多，主要有以下几个方面。

首先，新冠变种病毒 Omicron 不仅在中国香港大流行，也逐步传播到中国内地。因为 Omicron 传播速度很快，所以在疫情快速升级过程中对经济的需求和供给都造成了较大的瞬时冲击，再加上境内疫情反复，各行各业遭遇冲击，导致中国宏观经济短期承压，相关股票下跌。

其次，互联网行业的政策风险增大，加剧了市场的担忧，对互联网平台公司估值形成了较大压力。此外，美国监管当局严格执行关于中概股上市地位的监管要求，引发了中概股的下跌，从而导致港股主要科技权重股下跌。

再次，由于美国的通胀水平居高不下，美联储在上半年采取了包括多次加息及缩表在内的紧缩性货币政策，且预计未来还会持续加息及缩表。高通胀及加息预期引发了全球股市的剧烈波动，港股及 A 股也未能独善其身。

此外，俄罗斯及乌克兰地缘政治事件导致能源价格进一步上涨，加剧了对通货膨胀的担忧，因此也导致全球股市出现大幅波动。

但是，5 月份以来，导致下跌的这些因素都发生了改变，中华沪深港 300 指数也出现了一定反弹，主要包括：（1）互联网公司的监管环境趋于正常化；（2）中美监管当局对于中概股监管问题正在积极进行协商，以期完美解决问题；（3）境内疫情逐步缓解，社会经济活动逐步恢复，国务院也采取了多项促进经济发展的措施，有助于经济增长。因此，港股及 A 股都出现了大幅反弹。

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 1.1429 元，本报告期基金份额净值增长率为-5.22%，同期业绩比较基准收益率为-6.79%；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 1.1409 元，本报告期基金份额净值增长率为-5.26%，同期业绩比较基准收益率为-6.79%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

从长期来看，中国股票具有长期成长性及长期投资价值。同时，中华沪深港 300 指数经过 1 年左右的下跌，从技术层面来看，调整已经很充分；从估值方面来看，也是历史最低水平区间；从基本面展望来看，未来互联网公司的监管环境可能会趋松，同时中国宏观经济增长速度也有望

逐步恢复，因此，从大概率来看，市场对中华沪深港 300 指数未来的走势较为乐观。

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、固定收益总部、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七名投资组合经理。

股票投资部、固定收益总部、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

本基金在本报告期内，曾出现了连续 20 个工作日资产净值低于五千万元的情形。

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

在托管本基金的过程中，本基金托管人中国农业银行股份有限公司严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》相关法律法规的规定以及基金合同、托管协议的约定，对本基金基金管理人——大成基金管理有限公司 2022 年 1 月 1 日至 2022 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，未发现有关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：2022 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2022 年 6 月 30 日	上年度末 2021 年 12 月 31 日
资产：			
银行存款	6.4.7.1	2,622,049.12	5,198,085.76
结算备付金		-	-
存出保证金		7,477.48	1,254.62

交易性金融资产	6.4.7.2	31,537,675.94	68,680,283.87
其中：股票投资		31,537,675.94	68,680,283.87
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		84,618.23	2,843.50
应收申购款		23,938.86	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.8	-	1,220.62
资产总计		34,275,759.63	73,883,688.37
负债和净资产	附注号	本期末 2022年6月30日	上年度末 2021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		2.91	6.14
应付赎回款		306,530.62	115,727.47
应付管理人报酬		13,458.26	34,658.94
应付托管费		2,691.64	6,931.78
应付销售服务费		193.48	168.69
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	121,493.92	232,134.91
负债合计		444,370.83	389,627.93
净资产：			
实收基金	6.4.7.10	29,604,815.17	60,952,922.90
其他综合收益	6.4.7.11	-	-
未分配利润	6.4.7.12	4,226,573.63	12,541,137.54
净资产合计		33,831,388.80	73,494,060.44

负债和净资产总计		34,275,759.63	73,883,688.37
----------	--	---------------	---------------

注：报告截止日 2022 年 06 月 30 日，基金份额总额 29,604,815.17 份，其中大成中华沪深港 300 指数 (LOF)A 基金份额总额为 27,487,319.01 份，基金份额净值 1.1429 元。大成中华沪深港 300 指数 (LOF)C 基金份额总额为 2,117,496.16 份，基金份额净值 1.1409 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：2022 年 1 月 1 日至 2022 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
		2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日	2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
一、营业总收入		-6,874,225.96	3,185,171.66
1. 利息收入		19,232.49	34,236.10
其中：存款利息收入	6.4.7.13	19,232.49	34,236.10
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）		-3,037,484.49	3,592,597.65
其中：股票投资收益	6.4.7.14	-3,481,989.14	2,597,995.44
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.15	-	-
资产支持证券投资收益	6.4.7.16	-	-
贵金属投资收益	6.4.7.17	-	-
衍生工具收益	6.4.7.18	-	-
股利收益	6.4.7.19	444,504.65	994,602.21
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）	6.4.7.20	-3,865,493.93	-475,139.26
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.21	9,519.97	33,477.17
减：二、营业总支出		281,409.36	581,452.77

1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	140,430.35	309,470.83
2. 托管费	6.4.10.2.2	28,086.04	61,894.21
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	1,010.05	646.58
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	6.4.7.22	-	-
7. 税金及附加		-	-
8. 其他费用	6.4.7.23	111,882.92	209,441.15
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-7,155,635.32	2,603,718.89
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-7,155,635.32	2,603,718.89
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		-7,155,635.32	2,603,718.89

6.3 净资产（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：2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 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)	60,952,922.90	-	12,541,137.54	73,494,060.44
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)	60,952,922.90	-	12,541,137.54	73,494,060.44
三、本期增减变	-31,348,107.73	-	-8,314,563.91	-39,662,671.64

动额(减少以“-”号填列)				
(一)、综合收益总额	-	-	-7,155,635.32	-7,155,635.32
(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)	-31,348,107.73	-	-1,158,928.59	-32,507,036.32
其中:1.基金申购款	3,784,521.37	-	302,538.41	4,087,059.78
2.基金赎回款	-35,132,629.10	-	-1,461,467.00	-36,594,096.10
(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、本期末净资产(基金净值)	29,604,815.17	-	4,226,573.63	33,831,388.80
项目	上年度可比期间			

	2021 年 1 月 1 日至 2021 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)	97,993,090.30	-	31,434,282.62	129,427,372.92
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)	97,993,090.30	-	31,434,282.62	129,427,372.92
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	-12,105,715.13	-	-1,601,582.94	-13,707,298.07
(一)、综合收益总额	-	-	2,603,718.89	2,603,718.89
(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)	-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
(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)	85,887,375.17	-	29,832,699.68	115,720,074.85

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

大成中华沪深港 300 指数证券投资基金 (LOF) (以下简称“本基金”)经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2018]2130 号《关于准予大成中华沪深港 300 指数证券投资基金 (LOF) 注册的批复》核准,由大成基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《大成中华沪深港 300 指数证券投资基金 (LOF) 基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式基金,存续期限不定,首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币 1,967,654,798.00 元,业经普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)普华永道中天验字(2019)第 0120 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《大成中华沪深港 300 指数证券投资基金 (LOF) 基金合同》于 2019 年 3 月 20 日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为 1,968,326,601.16 份基金份额,其中认购资金利息折合 671,803.16 份基金份额。本基金的基金管理人为大成基金管理有限公司,基金

托管人为中国农业银行股份有限公司。

经深圳证券交易所(以下简称“深交所”)深证上[2019]143 号文审核同意,本基金 8,136,323.00 份基金份额于 2019 年 3 月 29 日在深交所挂牌交易。未上市交易的基金份额托管在场外,基金份额持有人将其转托管至深交所场内后即可上市流通。

根据基金管理人大成基金管理有限公司于 2020 年 2 月 29 日发布的《关于大成中华沪深港 300 指数证券投资基金 (LOF) 增设 C 类基金份额并相应修订基金合同和托管协议的公告》及更新的《大成中华沪深港 300 指数证券投资基金 (LOF) 基金合同》的有关规定,自 2020 年 3 月 3 日起,对大成中华沪深港 300 指数证券投资基金 (LOF) 增设 C 类基金份额,原有基金份额转为 A 类基金份额。其中,在投资者申购时收取申购费用,不从本类别资产中计提销售服务费的基金份额,称为 A 类基金份额;投资者申购时不收取申购费用,而是从本类别基金资产中计提销售服务费的基金份额,称为 C 类基金份额。本基金 A 类基金份额和 C 类基金份额分别设置基金代码并分别计算基金份额净值。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《大成中华沪深港 300 指数证券投资基金 (LOF) 基金合同》的有关规定,本基金主要投资于具有良好流动性的金融工具,包括标的指数成份股(含存托凭证)、备选成份股(含存托凭证)、国内依法发行上市的股票(包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票)、存托凭证、港股通机制允许买卖的香港联交所上市的股票、债券(包括国债、金融债、企业债、公司债、次级债、可转换债券、分离交易可转债、央行票据、中期票据、短期融资券、超短期融资券、地方政府债)、资产支持证券、债券回购、货币市场工具、银行存款、衍生工具(股指期货、权证)以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具(但须符合中国证监会相关规定)。本基金股票资产、存托凭证占基金资产的比例不低于 80%;投资于标的指数成份股(含存托凭证)和备选成份股(含存托凭证)的资产不低于基金资产净值的 90%;每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后,保持现金(不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等)或到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%;权证、股指期货及其他金融工具的投资比例依照法律法规或监管机构的规定执行。本基金的业绩比较基准为:中华交易服务沪深港 300 指数(人民币)收益率 \times 95%+人民币活期存款利率(税后) \times 5%。

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》、各项具体会计准则及相关规定(以下合称“企业会计准则”)、中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和中期报告>》、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《大成中华沪深港 300 指数证券投资

基金 (LOF) 基金合同》和在财务报表附注 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 2022 年 6 月 30 日的财务状况以及自 2022 年 1 月 1 日起至 2022 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

除下文中涉及的变更外，本基金本报告期所采用的其他会计政策、会计估计与最近一期年度会计报表所采用的会计政策、会计估计一致。

一、金融资产和金融负债的分类

新金融工具准则

金融工具，是指形成一方的金融资产并形成其他方的金融负债或权益工具的合同。当本基金成为金融工具合同的一方时，确认相关的金融资产或金融负债。

(1) 金融资产

金融资产于初始确认时分类为：以摊余成本计量的金融资产、以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产及以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。金融资产的分类取决于本基金管理金融资产的业务模式和金融资产的合同现金流量特征。本基金现无金融资产分类为以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产。

债务工具

本基金持有的债务工具是指从发行方角度分析符合金融负债定义的工具，分别采用以下两种方式进行计量：

以摊余成本计量：

本基金管理以摊余成本计量的金融资产的业务模式为以收取合同现金流量为目标，且以摊余成本计量的金融资产的合同现金流量特征与基本借贷安排相一致，即在特定日期产生的现金流量，仅为对本金和以未偿付本金金额为基础的利息的支付。本基金持有的以摊余成本计量的金融资产主要为银行存款、买入返售金融资产和其他各类应收款项等。

以公允价值计量且其变动计入当期损益：

本基金将持有的未划分为以摊余成本计量的债务工具，以公允价值计量且其变动计入当期损益。本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产主要为债券投资，在资产负债表中以交易性金融资产列示。

(2) 金融负债

金融负债于初始确认时分类为以摊余成本计量的金融负债和以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。本基金目前暂无金融负债分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。本基金持有的以摊余成本计量的金融负债包括卖出回购金融资产款和其他各类应付款项等。原金融工具准则(截至 2021 年 12 月 31 日前适用的原金融工具准则)

本基金于 2022 年 1 月 1 日起执行新金融工具准则, 但选择不重述比较信息。因此, 比较信息继续适用本基金以前年度的如下会计政策。

(1) 金融资产的分类

金融资产于初始确认时分类为: 以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、应收款项、可供出售金融资产及持有至到期投资。金融资产的分类取决于本基金对金融资产的持有意图和持有能力。本基金现无金融资产分类为可供出售金融资产及持有至到期投资。

本基金目前以交易目的持有的债券投资分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在资产负债表中以交易性金融资产列示。

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

(2) 金融负债的分类

金融负债于初始确认时分类为: 以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债及其他金融负债。本基金目前暂无金融负债分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。本基金持有的其他金融负债包括卖出回购金融资产款和其他各类应付款项等。

二、金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

新金融工具准则

金融资产或金融负债在初始确认时以公允价值计量。对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和金融负债, 相关交易费用计入当期损益; 对于支付的价款中包含的债券起息日或上次除息日至购买日止的利息, 确认为应计利息, 包含在交易性金融资产的账面价值中。对于其他类别的金融资产和金融负债, 相关交易费用计入初始确认金额。

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

本基金对于以摊余成本计量的金融资产, 以预期信用损失为基础确认损失准备。

本基金考虑有关过去事项、当前状况以及对未来经济状况的预测等合理且有依据的信息, 以发生违约的风险为权重, 计算合同应收的现金流量与预期能收到的现金流量之间差额的现值的概

率加权金额，确认预期信用损失。

于每个资产负债表日，本基金对于处于不同阶段的金融工具的预期信用损失分别进行计量。金融工具自初始确认后信用风险未显著增加的，处于第一阶段，本基金按照未来 12 个月内的预期信用损失计量损失准备；金融工具自初始确认后信用风险已显著增加但尚未发生信用减值的，处于第二阶段，本基金按照该工具整个存续期的预期信用损失计量损失准备；金融工具自初始确认后已经发生信用减值的，处于第三阶段，本基金按照该工具整个存续期的预期信用损失计量损失准备。

对于在资产负债表日具有较低信用风险的金融工具，本基金假设其信用风险自初始确认后并未显著增加，认定为处于第一阶段的金融工具，按照未来 12 个月内的预期信用损失计量损失准备。

本基金对于处于第一阶段和第二阶段的金融工具，按照其未扣除减值准备的账面余额和实际利率计算利息收入。对于处于第三阶段的金融工具，按照其账面余额减已计提减值准备后的摊余成本和实际利率计算利息收入。

对于其他各类应收款项，无论是否存在重大融资成分，本基金均按照整个存续期的预期信用损失计量损失准备。

本基金将计提或转回的损失准备计入当期损益。

金融资产满足下列条件之一的，予以终止确认：(1) 收取该金融资产现金流量的合同权利终止；(2) 该金融资产已转移，且本基金将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方；或者(3) 该金融资产已转移，虽然本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬，但是放弃了对该金融资产控制。

金融资产终止确认时，其账面价值与收到的对价的差额，计入当期损益。

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

原金融工具准则(截至 2021 年 12 月 31 日前适用的原金融工具准则)

本基金于 2022 年 1 月 1 日起执行新金融工具准则，但选择不重述比较信息。因此，比较信息继续适用本基金以前年度的如下会计政策。

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

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，按照公允价值进行后续计量；对于

应收款项和其他金融负债采用实际利率法，以摊余成本进行后续计量。

金融资产满足下列条件之一的，予以终止确认：(1) 收取该金融资产现金流量的合同权利终止；(2) 该金融资产已转移，且本基金将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方；或者(3) 该金融资产已转移，虽然本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬，但是放弃了对该金融资产控制。

金融资产终止确认时，其账面价值与收到的对价的差额，计入当期损益。

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

三、收入/(损失)的确认和计量

新金融工具准则

股票投资在持有期间应取得的现金股利扣除由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额确认为投资收益。债券投资在持有期间应取得的按票面利率(对于贴现债为按发行价计算的利率)或合同利率计算的利息扣除在适用情况下由债券发行企业代扣代缴的个人所得税及由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为投资收益。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在持有期间的公允价值变动确认为公允价值变动损益；于处置时，其处置价格与初始确认金额之间的差额扣除相关交易费用后的净额确认为投资收益，其中包括从公允价值变动损益结转的公允价值累计变动额。

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

原金融工具准则(截至 2021 年 12 月 31 日前适用的原金融工具准则)

本基金于 2022 年 1 月 1 日起执行新金融工具准则，但选择不重述比较信息。因此，比较信息继续适用本基金以前年度的如下会计政策。

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

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在持有期间的公允价值变动确认为公允价值变动损益；于处置时，其处置价格与初始确认金额之间的差额确认为投资收益，其中包括从公允价值变动损益结转的公允价值累计变动额。

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

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

财政部于 2017 年颁布了修订后的《企业会计准则第 22 号——金融工具确认和计量》、《企业会计准则第 23 号——金融资产转移》、《企业会计准则第 24 号——套期会计》及《企业会计准则第 37 号——金融工具列报》(以下合称“新金融工具准则”), 财政部、中国银行保险监督管理委员会于 2020 年 12 月 30 日发布了《关于进一步贯彻落实新金融工具相关会计准则的通知》, 公募证券投资基金自 2022 年 1 月 1 日起执行新金融工具准则。此外, 中国证监会于 2022 年颁布了修订后的《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>》, 本基金的基金管理人已采用上述准则及通知编制本基金财务报表, 对本基金财务报表的影响列示如下:

(a) 金融工具

根据新金融工具准则的相关规定, 本基金对于首次执行该准则的累积影响数调整 2022 年年初留存收益以及财务报表其他相关项目金额, 2021 年度的比较财务报表未重列。于 2021 年 12 月 31 日及 2022 年 1 月 1 日, 本基金均没有指定为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。

(i) 于 2022 年 1 月 1 日, 本财务报表中金融资产和金融负债按照原金融工具准则和新金融工具准则的规定进行分类和计量的结果对比表:

原金融工具准则下以摊余成本计量的金融资产为银行存款、存出保证金、应收利息和应收股利, 金额分别为 5,198,085.76 元、1,254.62 元、1,220.62 元和 2,843.50 元。新金融工具准则下以摊余成本计量的金融资产为银行存款、存出保证金、其他资产-应收利息和应收股利, 金额分别为 5,199,305.83 元、1,255.17 元、0.00 元和 2,843.50 元。

原金融工具准则下以公允价值计量且其变动计入当期损益计量的金融资产为交易性金融资产, 金额为 68,680,283.87 元。新金融工具准则下以公允价值计量且其变动计入当期损益计量的金融资产为交易性金融资产, 金额为 68,680,283.87 元。

原金融工具准则下以摊余成本计量的金融负债为应付证券清算款、应付赎回款、应付管理人报酬、应付托管费、应付销售服务费、应付交易费用和其他负债-其他应付款, 金额分别为 6.14 元、115,727.47 元、34,658.94 元、6,931.78 元、168.69 元、41,974.25 元和 20,160.66 元。新金融工具准则下以摊余成本计量的金融负债为应付清算款、应付赎回款、应付管理人报酬、应付托管费、应付销售服务费、其他负债-应付交易费用和其他负债-其他应付款, 金额分别为 6.14 元、115,727.47 元、34,658.94 元、6,931.78 元、168.69 元、41,974.25 元和 20,160.66 元。

i) 于 2021 年 12 月 31 日, 本基金持有的“银行存款”、“结算备付金”、“存出保证金”、“交易性金融资产”、“买入返售金融资产”、“卖出回购金融资产款”等对应的应计利息余额均列示在

“应收利息”或“应付利息”科目中。于 2022 年 1 月 1 日，本基金根据新金融工具准则下的计量类别，将上述应计利息分别转入“银行存款”、“结算备付金”、“存出保证金”、“交易性金融资产”、“买入返售金融资产”、“卖出回购金融资产款”等科目项下列示，无期初留存收益影响。

(b) 修订后的《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>》

根据中国证监会于 2022 年颁布的修订后的《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>》，本基金的基金管理人在编制本财务报表时调整了部分财务报表科目的列报和披露，这些调整未对本基金财务报表产生重大影响。

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[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。

6.4.7 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 2022 年 6 月 30 日
活期存款	2,622,049.12
等于：本金	2,621,529.66
加：应计利息	519.46
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	2,622,049.12

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2022 年 6 月 30 日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	32,404,186.55	-	31,537,675.94	-866,510.61
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	32,404,186.55	-	31,537,675.94	-866,510.61

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 2022年6月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	364.02
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	16,663.13
其中：交易所市场	16,663.13
银行间市场	-

应付利息	-
预提费用	64,466.77
应付指数使用费	40,000.00
合计	121,493.92

6.4.7.10 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 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日	
	基金份额 (份)	账面金额
上年度末	59,263,622.91	59,263,622.91
本期申购	2,715,999.31	2,715,999.31
本期赎回 (以“-”号填列)	-34,492,303.21	-34,492,303.21
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	27,487,319.01	27,487,319.01

大成中华沪深港 300 指数 (LOF) C

项目	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日	
	基金份额 (份)	账面金额
上年度末	1,689,299.99	1,689,299.99
本期申购	1,068,522.06	1,068,522.06
本期赎回 (以“-”号填列)	-640,325.89	-640,325.89
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	2,117,496.16	2,117,496.16

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

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
本期期初	13,824,128.00	-1,628,074.16	12,196,053.84
本期利润	-3,099,624.28	-3,999,769.44	-7,099,393.72

本期基金份额交易产生的变动数	-6,835,794.92	5,667,314.55	-1,168,480.37
其中：基金申购款	586,444.97	-364,846.64	221,598.33
基金赎回款	-7,422,239.89	6,032,161.19	-1,390,078.70
本期已分配利润	-	-	-
本期末	3,888,708.80	39,470.95	3,928,179.75

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
本期期初	391,226.60	-46,142.90	345,083.70
本期利润	-190,517.11	134,275.51	-56,241.60
本期基金份额交易产生的变动数	94,503.73	-84,951.95	9,551.78
其中：基金申购款	228,591.80	-147,651.72	80,940.08
基金赎回款	-134,088.07	62,699.77	-71,388.30
本期已分配利润	-	-	-
本期末	295,213.22	3,180.66	298,393.88

6.4.7.13 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	17,850.97
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	1,293.81
其他	87.71
合计	19,232.49

6.4.7.14 股票投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
卖出股票成交总额	31,239,042.79
减：卖出股票成本总额	34,656,907.84
减：交易费用	64,124.09
买卖股票差价收入	-3,481,989.14

6.4.7.15 债券投资收益

无。

6.4.7.16 资产支持证券投资收益

无。

6.4.7.17 贵金属投资收益

无。

6.4.7.18 衍生工具收益

无。

6.4.7.19 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
股票投资产生的股利收益	444,504.65
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	444,504.65

6.4.7.20 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
1. 交易性金融资产	-3,865,493.93
股票投资	-3,865,493.93
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	-3,865,493.93

6.4.7.21 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
基金赎回费收入	9,519.97
合计	9,519.97

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。

6.4.7.22 信用减值损失

无。

6.4.7.23 其他费用

单位：人民币元

项目	本期
	2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
审计费用	24,795.19
信息披露费	39,671.58
证券出借违约金	-
深港通证券组合费	912.68
银行划款手续费	2,848.53
指数使用费	43,654.94
合计	111,882.92

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率年费率为 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。

6.4.7.24 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

无。

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。

6.4.10 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

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2022年1月1日至2022年6月30日		上年度可比期间 2021年1月1日至2021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	19,568,910.31	59.99	18,166,651.83	73.81

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 权证交易

无。

6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2022年1月1日至2022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	13,906.64	57.12	9,821.12	58.94
关联方名称	上年度可比期间 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

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。

6.4.10.2 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	上年度可比期间
	2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日	2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	140,430.35	309,470.83
其中：支付销售机构的客户维护费	39,517.02	96,281.08

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。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日	2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	28,086.04	61,894.21

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。

6.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期		
	2022 年 1 月 1 日至 2022 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	-	22.92	22.92
合计	-	22.92	22.92
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间		
	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

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：

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

6.4.10.3 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 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2021 年 1 月 1 日至 2021 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	2,622,049.12	17,850.97	9,516,175.92	33,621.25

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(2022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。

6.4.13.2 信用风险

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

本基金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。本基金的活期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与中国证券登记结算有限责任公司完成证券交收和款项清算，因此违约风险发生的可能性很小；基金在进行银行间同业市场交易前均对交易对手进行信用评估，以控制相应的信用风险。

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

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

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

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2022 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	2,622,049.12	-	-	-	2,622,049.12
存出保证金	7,477.48	-	-	-	7,477.48
交易性金融资产	-	-	-	31,537,675.94	31,537,675.94
应收股利	-	-	-	84,618.23	84,618.23
应收申购款	223.66	-	-	23,715.20	23,938.86
资产总计	2,629,750.26	-	-	31,646,009.37	34,275,759.63
负债					
应付赎回款	-	-	-	306,530.62	306,530.62
应付管理人报酬	-	-	-	13,458.26	13,458.26
应付托管费	-	-	-	2,691.64	2,691.64
应付清算款	-	-	-	2.91	2.91
应付销售服务费	-	-	-	193.48	193.48
其他负债	-	-	-	121,493.92	121,493.92
负债总计	-	-	-	444,370.83	444,370.83
利率敏感度缺口	2,629,750.26	-	-	31,201,638.54	33,831,388.80
上年度末 2021 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	5,198,085.76	-	-	-	5,198,085.76
存出保证金	1,254.62	-	-	-	1,254.62
交易性金融资产	-	-	-	68,680,283.87	68,680,283.87
应收股利	-	-	-	2,843.50	2,843.50
其他资产	-	-	-	1,220.62	1,220.62
资产总计	5,199,340.38	-	-	68,684,347.99	73,883,688.37
负债					
应付赎回款	-	-	-	115,727.47	115,727.47
应付管理人报酬	-	-	-	34,658.94	34,658.94
应付托管费	-	-	-	6,931.78	6,931.78
应付证券清算款	-	-	-	6.14	6.14
应付销售服务费	-	-	-	168.69	168.69
其他负债	-	-	-	232,134.91	232,134.91
负债总计	-	-	-	389,627.93	389,627.93
利率敏感度缺口	5,199,340.38	-	-	68,294,720.06	73,494,060.44

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

假设	除市场利率以外的其他市场变量保持不变
----	--------------------

	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2022 年 6 月 30 日）	上年度末（2021 年 12 月 31 日）
分析	-	-	-
	-	-	-

注：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 2022 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				
交易性金融资产	-	13,225,926.57	-	13,225,926.57
资产合计	-	13,225,926.57	-	13,225,926.57
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	-	13,225,926.57	-	13,225,926.57
项目	上年度末 2021 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	-	28,322,928.28	-	28,322,928.28
资产合计	-	28,322,928.28	-	28,322,928.28
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	-	28,322,928.28	-	28,322,928.28

6.4.13.4.2.2 外汇风险的敏感性分析

假设	除汇率以外的其他市场变量保持不变		
	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2022年6月30日）	上年度末（2021年12月31日）
分析	港币相对人民币升值 5%	661,296.33	1,416,146.41
	港币相对人民币贬值 5%	-661,296.33	-1,416,146.41

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：股票资产、存托凭证占基金资产的比例不低于 80%；投资于标的指数成份股（含存托凭证）和备选成份股（含存托凭证）的资产不低于基金非现金资产的 90%；每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，保持现金（不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等）或到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%。此外，本基金的基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控，定期运用多种定量方法对基金进行风险度量，包括 VaR (Value at Risk) 指标等来测试本基金面临的潜在价格风险，及时可靠地对风险进行跟踪和控制。

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 2022年6月30日		上年度末 2021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	31,537,675.94	93.22	68,680,283.87	93.45
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	31,537,675.94	93.22	68,680,283.87	93.45

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		
	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（2022年6月30日）	上年度末（2021年12月31日）
分析	业绩比较基准上升5%	1,724,945.24	3,669,744.01
	业绩比较基准下降5%	-1,724,945.24	-3,669,744.01

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 2022 年 6 月 30 日	上年度末 2021 年 12 月 31 日
第一层次	31,537,675.94	68,680,283.87
第二层次	-	-
第三层次	-	-
合计	31,537,675.94	68,680,283.87

6.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

对于公开市场交易的证券等投资，若出现交易不活跃、非公开发行等情况，本基金不会于交易不活跃期间及限售期间将相关投资的公允价值列入第一层次，并根据估值调整中采用的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，确定相关投资的公允价值应属第二层次或第三层次。

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	31,537,675.94	92.01
	其中：股票	31,537,675.94	92.01
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	-	-

	产		
7	银行存款和结算备付金合计	2,622,049.12	7.65
8	其他各项资产	116,034.57	0.34
9	合计	34,275,759.63	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 13,225,926.57，占期末基金资产净值的比例为 39.09%。

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	259,228.66	0.77
B	采矿业	477,924.00	1.41
C	制造业	10,898,248.61	32.21
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	436,934.20	1.29
E	建筑业	247,710.00	0.73
F	批发和零售业	39,740.80	0.12
G	交通运输、仓储和邮政业	449,259.00	1.33
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	564,104.66	1.67
J	金融业	3,793,198.79	11.21
K	房地产业	362,029.00	1.07
L	租赁和商务服务业	302,249.00	0.89
M	科学研究和技术服务业	319,700.88	0.94
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	11,001.00	0.03
Q	卫生和社会工作	125,400.77	0.37
R	文化、体育和娱乐业	25,020.00	0.07
S	综合	-	-
	合计	18,311,749.37	54.13

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（%）
通信服务	2,508,623.75	7.42
非日常生活消费品	2,255,508.17	6.67
日常消费品	601,089.60	1.78
能源	308,899.59	0.91
金融	4,399,740.76	13.00
医疗保健	565,460.83	1.67
工业	476,555.36	1.41
信息技术	521,184.48	1.54
原材料	70,164.06	0.21
房地产	1,046,185.96	3.09
公用事业	472,514.01	1.40
合计	13,225,926.57	39.09

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	6,770	2,051,847.10	6.06
2	600519	贵州茅台	600	1,227,000.00	3.63
3	00005	汇丰控股	20,743	916,230.00	2.71
4	01299	友邦保险	12,200	887,353.70	2.62
5	601318	中国平安	11,001	513,636.69	1.52
5	02318	中国平安	7,500	342,182.90	1.01
6	03690	美团-W	5,000	830,389.49	2.45
7	300750	宁德时代	1,400	747,600.00	2.21
8	600036	招商银行	12,600	531,720.00	1.57
8	03968	招商银行	4,500	202,038.64	0.60
9	002594	比亚迪	900	300,141.00	0.89
9	01211	比亚迪股份	1,000	268,529.66	0.79
10	00939	建设银行	122,000	549,835.86	1.63
11	601398	工商银行	35,600	169,812.00	0.50
11	01398	工商银行	88,000	350,696.32	1.04
12	00388	香港交易所	1,289	425,503.21	1.26
13	601012	隆基绿能	6,192	412,572.96	1.22
14	000858	五粮液	2,000	403,860.00	1.19
15	000333	美的集团	5,000	301,950.00	0.89
16	601988	中国银行	21,400	69,764.00	0.21
16	03988	中国银行	85,000	227,523.30	0.67
17	601166	兴业银行	14,800	294,520.00	0.87

18	02269	药明生物	4,500	276,311.89	0.82
19	300059	东方财富	10,769	273,532.60	0.81
20	600900	长江电力	11,500	265,880.00	0.79
21	00941	中国移动	5,987	250,881.10	0.74
22	601888	中国中免	1,000	232,930.00	0.69
23	601328	交通银行	27,900	138,942.00	0.41
23	03328	交通银行	18,000	83,432.34	0.25
24	603259	药明康德	2,112	219,626.88	0.65
25	600030	中信证券	9,900	214,434.00	0.63
26	01810	小米集团-W	17,800	207,633.29	0.61
27	600887	伊利股份	5,200	202,540.00	0.60
28	01024	快手-W	2,500	186,859.02	0.55
29	688981	中芯国际	2,000	90,340.00	0.27
29	00981	中芯国际	6,000	93,284.13	0.28
30	002415	海康威视	4,800	173,760.00	0.51
31	000568	泸州老窖	700	172,578.00	0.51
32	002475	立讯精密	5,047	170,538.13	0.50
33	02015	理想汽车-W	1,300	169,986.12	0.50
34	600276	恒瑞医药	4,568	169,427.12	0.50
35	000651	格力电器	4,800	161,856.00	0.48
36	600438	通威股份	2,700	161,622.00	0.48
37	00883	中国海洋石油	18,098	160,344.09	0.47
38	00016	新鸿基地产	1,984	157,283.81	0.46
39	300760	迈瑞医疗	500	156,600.00	0.46
40	600809	山西汾酒	480	155,904.00	0.46
41	02331	李宁	2,500	155,430.78	0.46
42	600309	万华化学	1,600	155,184.00	0.46
43	002714	牧原股份	2,718	150,223.86	0.44
44	000725	京东方 A	38,100	150,114.00	0.44
45	000001	平安银行	9,860	147,702.80	0.44
46	601628	中国人寿	1,700	52,836.00	0.16
46	02628	中国人寿	7,968	93,081.34	0.28
47	002142	宁波银行	4,050	145,030.50	0.43
48	000002	万科 A	6,900	141,450.00	0.42
49	00669	创科实业	2,000	139,994.60	0.41
50	09633	农夫山泉	3,600	138,694.71	0.41
51	002466	天齐锂业	1,100	137,280.00	0.41
52	601899	紫金矿业	14,600	136,218.00	0.40
53	002129	TCL 中环	2,300	135,447.00	0.40
54	600028	中国石化	13,600	55,488.00	0.16
54	00386	中国石油化工股份	25,901	78,190.47	0.23

55	000792	盐湖股份	4,400	131,824.00	0.39
56	09868	小鹏汽车-W	1,200	129,715.22	0.38
57	600585	海螺水泥	2,400	84,672.00	0.25
57	00914	海螺水泥	1,500	43,614.69	0.13
58	601601	中国太保	3,500	82,355.00	0.24
58	02601	中国太保	2,800	45,927.12	0.14
59	600048	保利发展	7,300	127,458.00	0.38
60	603288	海天味业	1,409	127,317.24	0.38
61	300015	爱尔眼科	2,801	125,400.77	0.37
62	002812	恩捷股份	500	125,225.00	0.37
63	300124	汇川技术	1,900	125,153.00	0.37
64	603799	华友钴业	1,300	124,306.00	0.37
65	01109	华润置地	3,957	123,853.92	0.37
66	601658	邮储银行	11,000	59,290.00	0.18
66	01658	邮储银行	12,000	63,934.00	0.19
67	601857	中国石油	9,900	52,470.00	0.16
67	00857	中国石油股份	22,000	70,365.03	0.21
68	00027	银河娱乐	3,000	120,068.68	0.35
69	002460	赣锋锂业	800	118,960.00	0.35
70	02388	中银香港	4,436	117,602.31	0.35
71	300014	亿纬锂能	1,200	117,000.00	0.35
72	02020	安踏体育	1,400	115,416.44	0.34
73	600031	三一重工	6,000	114,360.00	0.34
74	601668	中国建筑	21,300	113,316.00	0.33
75	00001	长和	2,485	112,739.06	0.33
76	002352	顺丰控股	2,000	111,620.00	0.33
77	00002	中电控股	1,992	110,900.36	0.33
78	002304	洋河股份	600	109,890.00	0.32
78	601088	中国神华	3,300	109,890.00	0.32
79	300498	温氏股份	5,120	109,004.80	0.32
80	300274	阳光电源	1,100	108,075.00	0.32
81	600436	片仔癀	300	107,019.00	0.32
82	600690	海尔智家	3,800	104,348.00	0.31
83	002271	东方雨虹	2,000	102,940.00	0.30
84	06160	百济神州	1,200	101,083.46	0.30
85	601816	京沪高铁	19,900	99,898.00	0.30
86	00291	华润啤酒	1,988	99,456.89	0.29
87	02319	蒙牛乳业	2,925	97,931.01	0.29
88	600837	海通证券	9,800	96,138.00	0.28
89	600000	浦发银行	11,900	95,319.00	0.28
90	00688	中国海外发展	4,454	94,463.60	0.28
91	00011	恒生银行	797	94,399.72	0.28

92	01113	长实集团	1,987	94,309.07	0.28
93	600016	民生银行	25,200	93,744.00	0.28
94	600406	国电南瑞	3,384	91,368.00	0.27
95	603986	兆易创新	640	91,014.40	0.27
96	00175	吉利汽车	5,964	90,990.30	0.27
97	601919	中远海控	6,400	88,960.00	0.26
98	300122	智飞生物	800	88,808.00	0.26
99	000625	长安汽车	5,096	88,262.72	0.26
100	02688	新奥能源	800	88,187.19	0.26
101	02382	舜宇光学科技	800	87,503.04	0.26
102	002709	天赐材料	1,400	86,884.00	0.26
103	603501	韦尔股份	500	86,515.00	0.26
104	600919	江苏银行	12,000	85,440.00	0.25
105	601688	华泰证券	6,000	85,200.00	0.25
106	600104	上汽集团	4,700	83,707.00	0.25
107	002371	北方华创	300	83,136.00	0.25
108	601225	陕西煤业	3,900	82,602.00	0.24
109	00003	香港中华煤气	11,393	82,329.87	0.24
110	000063	中兴通讯	3,200	81,696.00	0.24
111	002241	歌尔股份	2,400	80,640.00	0.24
112	002230	科大讯飞	1,900	78,318.00	0.23
113	300142	沃森生物	1,600	77,424.00	0.23
114	600111	北方稀土	2,200	77,352.00	0.23
115	002459	晶澳科技	980	77,322.00	0.23
116	00960	龙湖集团	2,433	77,089.09	0.23
117	002049	紫光国微	400	75,888.00	0.22
118	02313	申洲国际	900	73,157.23	0.22
119	688599	天合光能	1,100	71,775.00	0.21
120	00066	港铁公司	2,005	70,300.89	0.21
121	000661	长春高新	300	70,026.00	0.21
122	601211	国泰君安	4,600	69,920.00	0.21
123	300450	先导智能	1,100	69,498.00	0.21
124	01093	石药集团	10,425	69,450.62	0.21
125	002027	分众传媒	10,300	69,319.00	0.20
126	000338	潍柴动力	5,500	68,585.00	0.20
127	06618	京东健康	1,300	68,428.03	0.20
128	601169	北京银行	15,000	68,100.00	0.20
129	600745	闻泰科技	800	68,088.00	0.20
130	000100	TCL 科技	14,200	68,018.00	0.20
131	600660	福耀玻璃	1,600	66,896.00	0.20
132	601229	上海银行	10,100	66,155.00	0.20
133	601985	中国核电	9,600	65,856.00	0.19

134	600050	中国联通	18,900	65,394.00	0.19
135	601766	中国中车	12,400	64,480.00	0.19
136	601390	中国中铁	10,400	63,856.00	0.19
137	00006	电能实业	1,496	63,136.63	0.19
138	00968	信义光能	6,000	62,189.42	0.18
139	01997	九龙仓置业	1,923	61,505.44	0.18
140	00267	中信股份	8,913	60,597.35	0.18
141	300896	爱美客	100	60,001.00	0.18
142	06098	碧桂园服务	2,000	59,777.78	0.18
143	600893	航发动力	1,300	59,163.00	0.17
144	688111	金山办公	300	59,136.00	0.17
145	01821	ESR	3,200	58,016.09	0.17
146	300347	泰格医药	500	57,225.00	0.17
147	600009	上海机场	1,000	56,700.00	0.17
148	000776	广发证券	3,000	56,100.00	0.17
149	600019	宝钢股份	9,100	54,782.00	0.16
150	600905	三峡能源	8,700	54,723.00	0.16
151	300661	圣邦股份	300	54,606.00	0.16
152	002410	广联达	1,000	54,440.00	0.16
153	600010	包钢股份	23,100	54,285.00	0.16
154	601009	南京银行	5,200	54,184.00	0.16
155	600999	招商证券	3,740	53,893.40	0.16
156	002179	中航光电	840	53,188.80	0.16
157	600196	复星医药	1,200	52,908.00	0.16
158	000895	双汇发展	1,800	52,740.00	0.16
159	300782	卓胜微	384	51,840.00	0.15
160	01928	金沙中国有限公司	3,200	51,229.30	0.15
161	600570	恒生电子	1,171	50,985.34	0.15
162	601818	光大银行	16,800	50,568.00	0.15
163	000596	古井贡酒	200	49,932.00	0.15
164	00992	联想集团	7,882	49,408.65	0.15
165	002050	三花智控	1,777	48,831.96	0.14
166	600760	中航沈飞	800	48,360.00	0.14
167	00868	信义玻璃	3,000	48,284.03	0.14
168	601633	长城汽车	1,300	48,152.00	0.14
169	002311	海大集团	800	48,008.00	0.14
170	00017	新世界发展	1,988	47,858.31	0.14
171	00288	万洲国际	9,221	47,787.38	0.14
172	002493	荣盛石化	3,100	47,709.00	0.14
173	00004	九龙仓集团	1,950	47,693.95	0.14
174	600346	恒力石化	2,140	47,593.60	0.14

175	00881	中升控股	1,000	47,334.77	0.14
176	300316	晶盛机电	700	47,313.00	0.14
177	01177	中国生物制药	11,000	46,753.24	0.14
178	00322	康师傅控股	4,000	45,975.01	0.14
179	000538	云南白药	760	45,896.40	0.14
180	01801	信达生物	1,500	44,769.20	0.13
181	002001	新和成	1,888	43,065.28	0.13
182	001979	招商蛇口	3,200	42,976.00	0.13
183	300759	康龙化成	450	42,849.00	0.13
184	601989	中国重工	11,500	42,665.00	0.13
185	000768	中航西飞	1,400	42,406.00	0.13
186	06969	思摩尔国际	2,000	41,391.20	0.12
187	603993	洛阳钼业	7,200	41,256.00	0.12
188	01038	长江基建集团	1,000	41,134.64	0.12
189	02007	碧桂园	9,573	39,787.53	0.12
190	000963	华东医药	880	39,740.80	0.12
191	000166	申万宏源	9,200	39,468.00	0.12
192	601138	工业富联	4,000	39,360.00	0.12
193	00083	信和置业	3,929	38,909.28	0.12
194	600588	用友网络	1,780	38,643.80	0.11
195	06186	中国飞鹤	5,000	38,569.07	0.11
196	600029	南方航空	5,200	38,012.00	0.11
197	01929	周大福	3,000	37,867.81	0.11
198	601066	中信建投	1,300	37,583.00	0.11
199	000799	酒鬼酒	200	37,162.00	0.11
200	601186	中国铁建	4,700	37,130.00	0.11
201	600741	华域汽车	1,600	36,800.00	0.11
202	300408	三环集团	1,200	36,120.00	0.11
203	000876	新希望	2,300	35,190.00	0.10
204	688012	中微公司	300	35,025.00	0.10
205	601111	中国国航	3,000	34,830.00	0.10
206	000786	北新建材	1,000	34,620.00	0.10
207	00151	中国旺旺	5,869	34,230.33	0.10
208	01876	百威亚太	1,700	34,164.84	0.10
209	003816	中国广核	11,979	33,541.20	0.10
210	601238	广汽集团	2,200	33,528.00	0.10
211	601800	中国交建	3,600	33,408.00	0.10
212	603806	福斯特	500	32,760.00	0.10
213	300999	金龙鱼	600	32,412.00	0.10
214	600015	华夏银行	6,200	32,302.00	0.10
215	600989	宝丰能源	2,200	32,230.00	0.10
216	06862	海底捞	2,000	31,299.95	0.09

217	300454	深信服	300	31,134.00	0.09
218	002648	卫星化学	1,200	31,020.00	0.09
219	601100	恒立液压	500	30,860.00	0.09
220	000157	中联重科	5,000	30,800.00	0.09
221	300628	亿联网络	400	30,460.00	0.09
222	000301	东方盛虹	1,800	30,438.00	0.09
223	688008	澜起科技	500	30,290.00	0.09
224	002236	大华股份	1,800	29,556.00	0.09
225	603392	万泰生物	190	29,507.00	0.09
226	02618	京东物流	2,000	29,281.71	0.09
227	000938	紫光股份	1,496	29,022.40	0.09
228	300601	康泰生物	640	28,915.20	0.09
229	002821	凯莱英	100	28,900.00	0.09
230	300595	欧普康视	500	28,595.00	0.08
231	01193	华润燃气	900	28,131.48	0.08
232	002601	龙佰集团	1,400	28,070.00	0.08
233	00241	阿里健康	6,021	27,805.13	0.08
234	002555	三七互娱	1,300	27,599.00	0.08
235	000069	华侨城 A	4,200	27,258.00	0.08
236	03692	翰森制药	2,000	27,092.42	0.08
237	688036	传音控股	300	26,769.00	0.08
238	601995	中金公司	600	26,694.00	0.08
239	01378	中国宏桥	3,500	26,549.37	0.08
240	09992	泡泡玛特	800	25,929.36	0.08
241	601336	新华保险	800	25,752.00	0.08
242	002007	华兰生物	1,100	25,080.00	0.07
243	300413	芒果超媒	750	25,020.00	0.07
244	00101	恒隆地产	1,949	24,801.47	0.07
245	300919	中伟股份	200	24,780.00	0.07
246	601360	三六零	2,900	24,708.00	0.07
247	00012	恒基地产	980	24,639.73	0.07
248	603260	合盛硅业	200	23,592.00	0.07
249	01918	融创中国	6,000	23,500.62	0.07
250	601155	新城控股	900	22,887.00	0.07
251	002841	视源股份	300	22,596.00	0.07
252	00384	中国燃气	2,171	22,502.20	0.07
253	002916	深南电路	240	22,490.40	0.07
254	300433	蓝思科技	2,000	22,140.00	0.07
255	00135	昆仑能源	4,000	21,995.49	0.07
256	002602	世纪华通	4,536	21,863.52	0.06
257	300957	贝泰妮	100	21,753.00	0.06
258	00285	比亚迪电子	1,000	21,165.95	0.06

259	002938	鹏鼎控股	700	21,147.00	0.06
260	601728	中国电信	5,500	20,515.00	0.06
261	000708	中信特钢	1,000	20,150.00	0.06
262	01972	太古地产	1,200	19,990.92	0.06
263	01209	华润万象生活	600	19,960.13	0.06
264	600018	上港集团	3,300	19,239.00	0.06
265	300033	同花顺	200	19,230.00	0.06
266	00762	中国联通	6,000	19,036.53	0.06
267	06666	恒大物业	9,000	17,702.43	0.05
268	601319	中国人保	3,300	16,698.00	0.05
269	01044	恒安国际	500	15,756.88	0.05
270	00656	复星国际	2,477	15,357.72	0.05
271	601998	中信银行	3,100	14,725.00	0.04
272	002600	领益智造	2,900	14,558.00	0.04
273	00270	粤海投资	2,000	14,196.15	0.04
274	600025	华能水电	1,800	12,582.00	0.04
275	000617	中油资本	2,580	12,409.80	0.04
276	01833	平安好医生	600	11,929.90	0.04
277	002607	中公教育	1,900	11,001.00	0.03
278	000877	天山股份	600	7,380.00	0.02
279	300979	华利集团	100	7,308.00	0.02
280	03799	达利食品	2,000	7,132.28	0.02
281	001289	龙源电力	200	4,352.00	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

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	00813	世茂集团	2,500	9,449.85	0.03
2	03380	龙光集团	3,000	5,592.94	0.02

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	02015	理想汽车-W	137,355.87	0.19
2	000792	盐湖股份	134,332.00	0.18
3	002466	天齐锂业	126,148.00	0.17
4	09868	小鹏汽车-W	102,443.04	0.14
5	600111	北方稀土	90,269.00	0.12
6	688599	天合光能	61,798.62	0.08
7	01024	快手-W	59,388.77	0.08

8	01821	ESR	57,497.41	0.08
9	600010	包钢股份	49,203.00	0.07
10	300661	圣邦股份	48,502.00	0.07
11	300316	晶盛机电	41,356.00	0.06
12	00016	新鸿基地产	40,148.46	0.05
13	603806	福斯特	35,344.00	0.05
14	00027	银河娱乐	35,162.14	0.05
15	002648	卫星化学	33,664.00	0.05
16	000799	酒鬼酒	32,979.00	0.04
17	01193	华润燃气	27,506.42	0.04
18	01378	中国宏桥	27,441.95	0.04
19	603260	合盛硅业	24,138.00	0.03
20	000725	京东方 A	23,530.00	0.03

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	2,277,052.43	3.10
2	600519	贵州茅台	1,240,090.00	1.69
3	03690	美团-W	1,162,355.42	1.58
4	00005	汇丰控股	1,029,536.07	1.40
5	01299	友邦保险	908,278.53	1.24
6	601318	中国平安	506,970.00	0.69
6	02318	中国平安	360,450.30	0.49
7	600036	招商银行	537,844.00	0.73
7	03968	招商银行	217,784.85	0.30
8	300750	宁德时代	696,757.00	0.95
9	00939	建设银行	648,127.45	0.88
10	601398	工商银行	179,790.00	0.24
10	01398	工商银行	381,642.41	0.52
11	002594	比亚迪	275,870.00	0.38
11	01211	比亚迪股份	203,215.09	0.28
12	00388	香港交易所	409,788.39	0.56
13	601012	隆基绿能	354,232.00	0.48
14	000858	五粮液	325,081.00	0.44
15	601988	中国银行	74,240.00	0.10
15	03988	中国银行	241,237.39	0.33
16	601166	兴业银行	313,745.00	0.43
17	00941	中国移动	305,954.58	0.42

18	600900	长江电力	289,941.00	0.39
19	000333	美的集团	283,083.00	0.39
20	600887	伊利股份	282,664.00	0.38

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	1,379,793.84
卖出股票收入（成交）总额	31,239,042.79

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。

7.5 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 本基金投资股指期货的投资政策

无。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.11.1 本期国债期货投资政策

无。

7.11.2 本期国债期货投资评价

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 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），于 2022 年 3 月 21 日因贸易融资业务 EAST 数据存在偏差等，受到中国银行保险监督管理委员会处罚（银保监罚决字〔2022〕14 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 2022 年 3 月 21 日因不良贷款余额 EAST 数据存在偏差等，受到中国银行保险监督管理委员会处罚（银保监罚决字〔2022〕21 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	7,477.48
2	应收清算款	-
3	应收股利	84,618.23
4	应收利息	-
5	应收申购款	23,938.86
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	116,034.57

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

无。

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

7.12.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

无。

7.12.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公 允价值	占基金资产净 值比例 (%)	流通受限情况说明
1	00813	世茂集团	9,449.85	0.03	重大事项停牌
2	03380	龙光集团	5,592.94	0.02	重大事项停牌

7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入原因，分项之和与合计可能有尾差。

§ 8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额级别	持有人 户数 (户)	户均持有的基 金份额	持有人结构			
			机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总份 额比例 (%)	持有份额	占总份 额比例 (%)
大成中华 沪 深 港 300 指 数 (LOF)A	5,028	5,466.85	28,234.84	0.10	27,459,084.17	99.90
大成中华 沪 深 港 300 指 数 (LOF)C	935	2,264.70	-	-	2,117,496.16	100.00
合计	5,963	4,964.75	28,234.84	0.10	29,576,580.33	99.90

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	382,617.00	28.37
2	郑双双	225,462.00	16.72
3	杨凯	182,150.00	13.51
4	王哲	108,500.00	8.05
5	陈钰林	100,000.00	7.41
6	于素芬	53,006.00	3.93
7	吴晟铠	21,200.00	1.57
8	张森	20,000.00	1.48

9	郑宏	19,002.00	1.41
10	祝儒清	18,000.00	1.33

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	10,149.10	0.0369
	大成中华沪深港 300 指数 (LOF)C	1,718.50	0.0812
	合计	11,867.60	0.0401

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
	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	59,263,622.91	1,689,299.99
本报告期基金总申购份额	2,715,999.31	1,068,522.06
减：本报告期基金总赎回份额	34,492,303.21	640,325.89

本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	27,487,319.01	2,117,496.16

§ 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

1. 根据我司发布的《大成基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告》，经大成基金管理有限公司第七届董事会第十四次会议审议通过并履行必要程序，自 2022 年 4 月 15 日起，周立新先生因工作安排离任公司副总经理。具体事宜详见公司公告。

2. 根据我司发布的《大成基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告》，经大成基金管理有限公司第七届董事会第十五次会议审议通过并履行必要程序，自 2022 年 6 月 1 日起，赵冰女士担任公司副总经理，段皓静女士担任公司督察长。自同日起赵冰女士离任公司督察长。具体事宜详见公司公告。

二、基金托管人的基金托管部门的重大人事变动

2022 年 3 月，中国农业银行总行决定王霄勇任托管业务部总裁。

2022 年 3 月，中国农业银行总行决定王洪滨任托管业务部高级专家。

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、托管人的托管业务部门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	19,568,910.31	59.99	13,906.64	57.12	-
招商证券	2	13,049,926.32	40.01	10,439.90	42.88	-
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	-	-	-	-	-
东亚前海	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	-	-	-	-	-
海通证券	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	4	-	-	-	-	-
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。本报告期内本基金新增交易单元：中信证券、东亚前海，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	2022 年 06 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	2022 年 06 月 29 日
3	大成基金管理有限公司关于旗下部分基金增加泰信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	2022 年 06 月 28 日
4	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	2022 年 06 月 02 日
5	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	2022 年 04 月 29 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	2022 年 04 月 22 日
7	大成中华沪深港 300 指数证券投资基金 (LOF) 2022 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	2022 年 04 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	2022 年 04 月 20 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	2022 年 04 月 16 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	2022 年 04 月 15 日
11	大成中华沪深港 300 指数证券投资基金 (LOF) 2021 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	2022 年 03 月 29 日
12	大成基金管理有限公司关于旗下部分基金增加北京中植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	2022 年 03 月 25 日
13	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	2022 年 03 月 25 日
14	大成基金管理有限公司关于公司固有资金拟申购旗下偏股型公募基金的公告	中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站	2022 年 01 月 27 日
15	大成中华沪深港 300 指数证券投资基金 (LOF) 2021 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	2022 年 01 月 21 日

		公司网站	
16	大成中华沪深港 300 指数证券投资基金 (LOF) 暂停申购、赎回及定投业务的公告	中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站	2022 年 01 月 19 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	20220101-20220526	20,606,903.66	0.00	20,606,903.66	0.00	0.00
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

2022 年 8 月 30 日