

大成中华沪深港 300 指数证券投资基金 (LOF) 2020 年中期报告

2020 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：2020 年 8 月 28 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 2020 年 8 月 27 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 2020 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	7
§ 4 管理人报告	9
4.1 基金管理人及基金经理情况	9
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	10
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	10
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明	10
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	11
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	11
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	12
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	12
§ 5 托管人报告	12
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	12
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	13
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	13
§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）	13
6.1 资产负债表	13
6.2 利润表	14
6.3 所有者权益（基金净值）变动表	15
6.4 报表附注	17
§ 7 投资组合报告	33
7.1 期末基金资产组合情况	33
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	34
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	35
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	43
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	44
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	44

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	44
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	45
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	45
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明	45
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	45
7.12 投资组合报告附注	45
§ 8 基金份额持有人信息	46
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	46
8.2 期末上市基金前十名持有人	47
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	47
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	47
§ 9 开放式基金份额变动	48
§ 10 重大事件揭示	48
10.1 基金份额持有人大会决议	48
10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动	48
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	48
10.4 基金投资策略的改变	49
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	49
10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况	49
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	49
10.8 其他重大事件	51
§ 11 影响投资者决策的其他重要信息	53
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	53
11.2 影响投资者决策的其他重要信息	53
§ 12 备查文件目录	53
12.1 备查文件目录	53
12.2 存放地点	53
12.3 查阅方式	54

§ 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	中华 300	
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	117,461,092.67 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	中华 300A	中华 300C
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	117,461,092.67 份	0.00 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	贺倩
	联系电话	0755-83183388	010-66060069
	电子邮箱	office@dcfund.com.cn	tgxxpl@abchina.com
客户服务电话		4008885558	95599
传真		0755-83199588	010-68121816
注册地址		深圳市福田区深南大道 7088 号招商银行大厦 32 层	北京市东城区建国门内大街 69 号
办公地址		深圳市福田区深南大道 7088 号招商银行大厦 32 层	北京市西城区复兴门内大街 28 号凯晨世贸中心东座 F9
邮政编码		518040	100031
法定代表人		吴庆斌	周慕冰

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(2020 年 1 月 1 日-2020 年 6 月 30 日)
---------------	-------------------------------------

	中华 300A
本期已实现收益	10,565,140.49
本期利润	4,274,942.41
加权平均基金份额本期利润	0.0238
本期加权平均净值利润率	2.30%
本期基金份额净值增长率	3.25%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2020年6月30日)
期末可供分配利润	8,678,953.00
期末可供分配基金份额利润	0.0739
期末基金资产净值	127,920,443.94
期末基金份额净值	1.0890
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2020年6月30日)
基金份额累计净值增长率	8.90%

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。截止本报告期末，C 类份额无份额持有人。

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

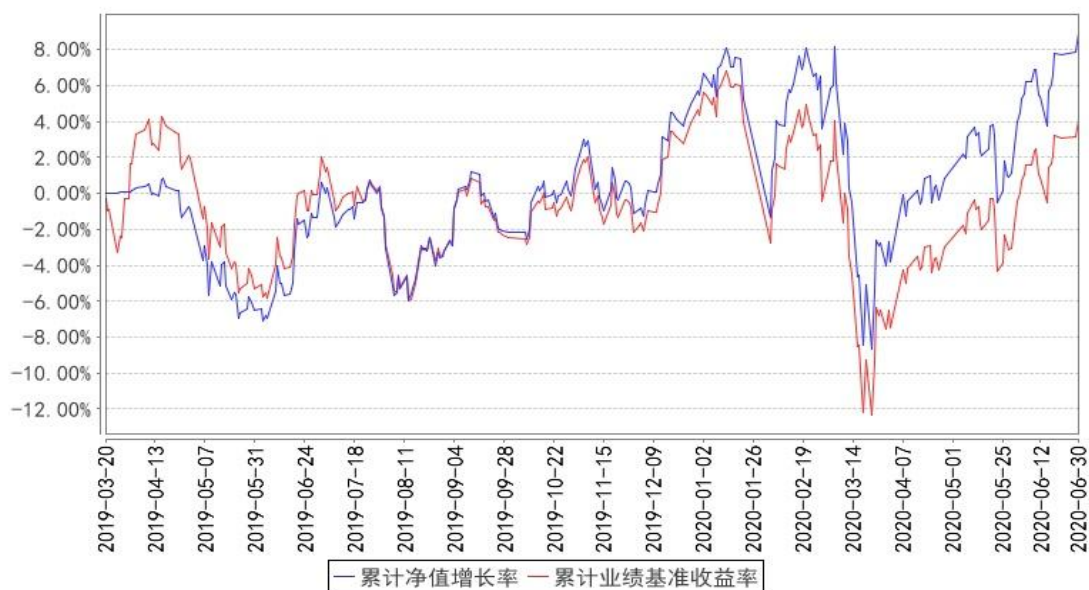
中华 300A

阶段	份额净值	份额净值增	业绩比较基	业绩比较基	①-③	②-④
----	------	-------	-------	-------	-----	-----

	增长率①	长率标准差 ②	准收益率③	准收益率标 准差④		
过去一个月	7.68%	0.99%	7.32%	0.97%	0.36%	0.02%
过去三个月	11.94%	1.06%	11.23%	1.04%	0.71%	0.02%
过去六个月	3.25%	1.49%	-0.30%	1.45%	3.55%	0.04%
过去一年	10.37%	1.17%	4.12%	1.13%	6.25%	0.04%
自基金合同生效起至今	8.90%	1.10%	4.03%	1.11%	4.87%	-0.01%

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

中华300A累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



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

§ 4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

大成基金管理有限公司经中国证监会证监基金字[1999]10 号文批准，于 1999 年 4 月 12 日正式成立，是中国证监会批准成立的首批十家基金管理公司之一，注册资本为 2 亿元人民币，注册地为深圳。目前公司由三家股东组成，分别为中泰信托有限责任公司 (50%)、光大证券股份有限公司 (25%)、中国银河投资管理有限公司 (25%)。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 2020 年 6 月 30 日，公司管理公募基金产品数量共 103 只。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
冉凌浩	本基金基金经理	2019 年 3 月 20 日	-	17 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。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存在 1 笔同日反向交易，原因为组合流动性需要。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 1 笔同日反向交易，原因为组合流动性需要。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

2020 年上半年，全球主要国家都经历了较大的一次黑天鹅事件，即新型冠状病毒肺炎在全球蔓延。为了减缓疫情的扩散，各国政府采取了较为严格的管控手段，这些管控手段阻止了疫情的快速传播，但同时也极大减少了社会经济活动，对短期的宏观经济造成了较大影响。

疫情引发了对投资者全球经济衰退的担忧，全球主要股票市场都出现了较大的跌幅，港股市场也不例外，同时全球市场的暴跌也间接引发了 A 股的下跌。

面对疫情，中国政府采取了较为严格的人流管控手段，这些手段较为有效的阻止了疫情的快速传播，但同时也极大减少了短期的社会经济活动，对短期的宏观经济造成了较大影响，致使 1 季度的 GDP 同比下跌 6.8%。

受益于中国政府的高效疫情管控措施，在 1 季度末期，中国的疫情已经得到了有效控制，并且各行业开始逐步推进复工复产活动，因此，中国 2 季度的宏观经济得到较好的恢复。

正因为中国率先从疫情中走出，因此港股及 A 股市场也对此有了较好的回应，港股及 A 股在 2 季度出现了明显的反弹。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末中华 300A 的基金份额净值为 1.0890 元，本报告期基金份额净值增长率为 3.25%，同期业绩比较基准收益率为-0.30%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

根据历史经验，由于一次性疫情引发的宏观经济衰退一般都是短期现象，当疫情逐步得到控制时，宏观经济和股票市场都会得以恢复。我们预计本次疫情也不例外，一旦疫情能逐步得到控制，中国的宏观经济可能会快速反转。

中国是最早控制住疫情的国家，因此宏观经济也最早呈现明显的复苏迹象。各种宏观数据，包括工业产出、投资、消费及企业利润方面更是证明了经济正在复苏，而 2 季度的 GDP 增速已经恢复到 3.2%。我们预计，按照正常的经济逻辑，这种经济复苏的势头会保持下去。

虽然经过了小幅反弹，港股指数仍然处于较低估值区间。过往十年间，恒指的平均静态市盈率是 11.5 倍，而当前恒指的静态市盈率为 10.75 倍，依然位于较低估值区间。

与估值对应，在经济复苏的预期下，港股及 A 股的主要公司盈利也会出现较好的变化。在这种较好的预期盈利增速及较低的估值的情景下，本基金标的指数有较好的长期前景。

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《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 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日基金的投资运作，进行了认真、独立的会计核算和

必要的投资监督，认真履行了托管人的义务，没有从事任何损害基金份额持有人利益的行为。

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

本托管人认为，大成基金管理有限公司在本基金的投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支及利润分配等问题上，不存在损害基金份额持有人利益的行为；在报告期内，严格遵守了《证券投资基金法》等有关法律法规，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、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：2020 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2020 年 6 月 30 日	上年度末 2019 年 12 月 31 日
资产：			
银行存款	6.4.3.1	10,507,863.27	52,935,155.96
结算备付金		-	3,510.86
存出保证金		59,392.95	106,566.29
交易性金融资产	6.4.3.2	119,305,656.76	344,656,864.56
其中：股票投资		119,305,656.76	344,656,864.56
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		3,136,951.19	11,837,433.99
应收利息	6.4.3.5	2,203.49	17,705.32
应收股利		346,790.71	16,553.42
应收申购款		48,136.23	73,277.65
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.3.6	-	-

资产总计		133,406,994.60	409,647,068.05
负债和所有者权益	附注号	本期末 2020年6月30日	上年度末 2019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		573,848.09	2,600,652.09
应付赎回款		4,636,905.04	35,817,601.65
应付管理人报酬		56,288.97	201,112.80
应付托管费		11,257.82	40,222.55
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.3.7	49,403.96	428,096.60
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	158,846.78	284,499.26
负债合计		5,486,550.66	39,372,184.95
所有者权益:			
实收基金	6.4.3.9	117,461,092.67	351,061,620.03
未分配利润	6.4.3.10	10,459,351.27	19,213,263.07
所有者权益合计		127,920,443.94	370,274,883.10
负债和所有者权益总计		133,406,994.60	409,647,068.05

注：报告截止日 2020 年 06 月 30 日，基金份额总额 117,461,092.67 份，其中中华 300A 基金份额总额为 117,461,092.67 份，基金份额净值 1.0890 元。中华 300C 基金份额总额为 0.00 份，基金份额净值 1.0890 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：2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2020年1月1日至2020年 6月30日	上年度可比期间 2019年3月20日（基金合 同生效日）至2019年6月 30日
一、收入		5,512,739.87	-11,445,123.76
1. 利息收入		79,035.69	2,788,785.64
其中：存款利息收入	6.4.3.11	79,035.69	1,860,510.10
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			928,275.54
证券出借利息收入			-
其他利息收入			-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		11,435,461.72	6,565,643.25
其中：股票投资收益	6.4.3.12	9,938,804.40	-2,167,987.92
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	1,496,657.32	8,733,631.17
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.3.17	-6,290,198.08	-22,142,383.59
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	288,440.54	1,342,830.94
减：二、费用		1,237,797.46	3,334,275.27
1. 管理人报酬	6.4.6.2.1	463,398.53	1,518,616.29
2. 托管费	6.4.6.2.2	92,679.76	303,723.32
3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用	6.4.3.19	492,996.35	1,360,013.59
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	188,722.82	151,922.07
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		4,274,942.41	-14,779,399.03
减：所得税费用			-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		4,274,942.41	-14,779,399.03

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：2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期	
	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
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
项目	上年度可比期间		
	2019年3月20日(基金合同生效日)至2019年6月30日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益(基金净值)	1,968,326,601.16	-	1,968,326,601.16
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	-14,779,399.03	-14,779,399.03
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)	-1,056,493,074.16	2,636,119.98	-1,053,856,954.18
其中: 1. 基金申购款	19,435,063.54	-167,995.08	19,267,068.46
2. 基金赎回款	-1,075,928,137.70	2,804,115.06	-1,073,124,022.64
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）	911,833,527.00	-12,143,279.05	899,690,247.95

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[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]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。对资管产品在 2018 年 1 月 1 日前运营过程中发生的增值税应税行为，未缴纳增值税的，不再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从资管产品管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。

对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税，对国债、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 2018 年 1 月 1 日起产生的利息及利息性质的收入为销售额。资管产品管理人运营资管产品转让

2017 年 12 月 31 日前取得的非货物期货，可以选择按照实际买入价计算销售额，或者以 2017 年最后一个交易日的非货物期货结算价格作为买入价计算销售额。

(2)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。

(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。

(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 2020 年 6 月 30 日
活期存款	10,507,863.27
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	10,507,863.27

6.4.3.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2020 年 6 月 30 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	116,447,339.11	119,305,656.76	2,858,317.65
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	116,447,339.11	119,305,656.76	2,858,317.65

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 2020年6月30日
应收活期存款利息	2,179.09
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	24.40
合计	2,203.49

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
----	-----

	2020 年 6 月 30 日
交易所市场应付交易费用	49,403.96
银行间市场应付交易费用	-
合计	49,403.96

6.4.3.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2020 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	9,557.62
应付证券出借违约金	-
预提费用	129,289.16
应付指数使用费	20,000.00
合计	158,846.78

6.4.3.9 实收基金

金额单位：人民币元

中华 300A

项目	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	351,061,620.03	351,061,620.03
本期申购	6,508,294.68	6,508,294.68
本期赎回（以“-”号填列）	-240,108,822.04	-240,108,822.04
本期末	117,461,092.67	117,461,092.67

注：1. 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)。

2. 截至本期末止，本基金于深交所上市的基金份额为 793,578.00 份（上年度末：2,391,525.00 份），托管在场外未上市交易的基金份额为 116,667,514.67 份（上年度末：348,670,095.03 份）。上市的基金份额登记在证券登记结算系统，可选择按市价流通或按基金份额净值申购或赎回；未上市的基金份额登记在注册登记系统，按基金份额净值申购或赎回。通过跨系统转登记可实现基金份额在两个系统之间的转换。

6.4.3.10 未分配利润

单位：人民币元

中华 300A			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	7,516,238.21	11,697,024.86	19,213,263.07
本期利润	10,565,140.49	-6,290,198.08	4,274,942.41
本期基金份额 交易产生的变 动数	-9,402,425.70	-3,626,428.51	-13,028,854.21
其中：基金申	333,758.09	-228,765.25	104,992.84

购款			
基金赎回款	-9,736,183.79	-3,397,663.26	-13,133,847.05
本期已分配利润			
本期末	8,678,953.00	1,780,398.27	10,459,351.27

6.4.3.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年6月30日
活期存款利息收入	67,998.84
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	8,616.01
其他	2,420.84
合计	79,035.69

6.4.3.12 股票投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年6月30日
卖出股票成交总额	238,193,482.55
减：卖出股票成本总额	228,254,678.15
买卖股票差价收入	9,938,804.40

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 2020年1月1日至2020年6月30日
股票投资产生的股利收益	1,496,657.32
其中：证券出借权益补偿收入	-

基金投资产生的股利收益	-
合计	1,496,657.32

6.4.3.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2020年1月1日至2020年6月30日
1. 交易性金融资产	-6,290,198.08
股票投资	-6,290,198.08
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	-6,290,198.08

6.4.3.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年6月30日
基金赎回费收入	288,440.54
合计	288,440.54

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 2020年1月1日至2020年6月30日
交易所市场交易费用	492,996.35
银行间市场交易费用	-
合计	492,996.35

6.4.3.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年6月30日
审计费用	39,781.56
信息披露费	59,672.34
证券出借违约金	-
银行划款手续费	8,680.47
指数使用费	50,753.19

上市费	29,835.26
合计	188,722.82

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年费率 0.04% 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，指数使用许可费的收取下限为每季度人民币 2 万元。

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 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2019 年 3 月 20 日（基金合同生效日） 至 2019 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	113,664,544.66	46.53	845,229,979.81	94.71

6.4.6.1.2 债券交易

无。

6.4.6.1.3 债券回购交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2020年1月1日至2020年6月30日		上年度可比期间 2019年3月20日（基金合同生效日） 至2019年6月30日	
	成交金额	占当期债券回购 成交总额的比例 （%）	成交金额	占当期债券回购 成交总额的比例 （%）
光大证券	-	-	3,104,900,000.00	79.94

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 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
关联方名称	上年度可比期间 2019年3月20日（基金合同生效日）至2019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	715,278.92	94.33	715,278.92	94.33

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，以扣除由中国证券登记结算有限责任公司收取的证管费和经手费的净额列示。

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

6.4.6.2 关联方报酬

6.4.6.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
----	----	---------

	2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日	2019 年 3 月 20 日 (基金合同生效日) 至 2019 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	463,398.53	1,518,616.29
其中:支付销售机构的客户维护费	307,854.87	1,235,315.55

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 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2019 年 3 月 20 日 (基金合同生效日) 至 2019 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	92,679.76	303,723.32

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。

6.4.6.3 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自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 2020年1月1日至2020年6月30日		上年度可比期间 2019年3月20日（基金合同生效日）至2019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	10,507,863.27	67,998.84	98,532,986.74	733,854.38

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(2020年6月30日)本基金持有的流通受限证券

6.4.8.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

6.4.8.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量 (单位：股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
300840	酷特智能	2020年6月30日	2020年7月8日	新股未上市	5.94	5.94	1,185	7,038.90	7,038.90	-
300843	胜蓝股份	2020年6月23日	2020年7月2日	新股未上市	10.01	10.01	751	7,517.51	7,517.51	-

300845	捷安 高科	2020 年 6 月 24 日	2020 年 7 月 3 日	新股未 上市	17.63	17.63	470	8,286.10	8,286.10	-
300846	首都 在线	2020 年 6 月 22 日	2020 年 7 月 1 日	新股未 上市	3.37	3.37	1,131	3,811.47	3,811.47	-
688169	石头 科技	2020 年 2 月 13 日	2020 年 8 月 21 日	新股锁 定	271.12	365.14	1,291	350,015.92	471,395.74	-
688396	华润 微	2020 年 2 月 14 日	2020 年 8 月 27 日	新股锁 定	12.80	41.45	15,767	201,817.60	653,542.15	-

注：1、基金可使用以基金名义开设的股票账户，选择网上或者网下一种方式进行新股申购。其中基金作为一般法人或战略投资者认购的新股，根据基金与上市公司所签订申购协议的规定，在新股上市后的约定期限内不能自由转让。

2、根据《上海证券交易所科创板股票公开发行自律委员会促进科创板初期企业平稳发行行业倡导建议》，本基金获配的科创板股票如经抽签方式确定需要锁定的，锁定期限为自发行人股票上市之日起 6 个月。

6.4.8.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

无。

6.4.8.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

无。

6.4.8.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

无。

6.4.9 金融工具风险及管理

6.4.9.1 风险管理政策和组织架构

本基金为股票型基金，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 2020 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	10,507,863.27	-	-	-	10,507,863.27
存出保证金	59,392.95	-	-	-	59,392.95
交易性金融资产	-	-	-	119,305,656.76	119,305,656.76
应收利息	-	-	-	2,203.49	2,203.49
应收股利	-	-	-	346,790.71	346,790.71
应收申购款	728.01	-	-	47,408.22	48,136.23
应收证券清算款	-	-	-	3,136,951.19	3,136,951.19
资产总计	10,567,984.23	-	-	122,839,010.37	133,406,994.60
负债					
应付赎回款	-	-	-	4,636,905.04	4,636,905.04
应付管理人报酬	-	-	-	56,288.97	56,288.97
应付托管费	-	-	-	11,257.82	11,257.82
应付证券清算款	-	-	-	573,848.09	573,848.09
应付交易费用	-	-	-	49,403.96	49,403.96
其他负债	-	-	-	158,846.78	158,846.78
负债总计	-	-	-	5,486,550.66	5,486,550.66
利率敏感度缺口	10,567,984.23	-	-	-117,352,459.71	127,920,443.94
上年度末 2019 年 12 月 31 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	52,935,155.96	-	-	-	52,935,155.96
结算备付金	3,510.86	-	-	-	3,510.86
存出保证金	106,566.29	-	-	-	106,566.29
交易性金融资产	-	-	-	344,656,864.56	344,656,864.56
应收利息	-	-	-	17,705.32	17,705.32
应收股利	-	-	-	16,553.42	16,553.42
应收申购款	-	-	-	73,277.65	73,277.65
应收证券清算款	-	-	-	11,837,433.99	11,837,433.99
资产总计	53,045,233.11	-	-	356,601,834.94	409,647,068.05
负债					
应付赎回款	-	-	-	35,817,601.65	35,817,601.65
应付管理人报酬	-	-	-	201,112.80	201,112.80
应付托管费	-	-	-	40,222.55	40,222.55
应付证券清算款	-	-	-	2,600,652.09	2,600,652.09
应付交易费用	-	-	-	428,096.60	428,096.60
其他负债	-	-	-	284,499.26	284,499.26
负债总计	-	-	-	39,372,184.95	39,372,184.95

利率敏感度缺口	53,045,233.11	-	-317,229,649.99	370,274,883.10
---------	---------------	---	-----------------	----------------

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，因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响。

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 2020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	-	57,727,506.28	-	57,727,506.28
资产合计	-	57,727,506.28	-	57,727,506.28
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	-	57,727,506.28	-	57,727,506.28
项目	上年度末 2019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	-	177,944,149.41	-	177,944,149.41
资产合计	-	177,944,149.41	-	177,944,149.41

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	-	177,944,149.41	-	177,944,149.41

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 (2020 年 6 月 30 日)	上年度末 (2019 年 12 月 31 日)
分析	港币相对人民币升值 5%	2,636,530.00	8,900,000.00
	港币相对人民币贬值 5%	-2,636,530.00	-8,900,000.00

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 2020 年 6 月 30 日		上年度末 2019 年 12 月 31 日	
	公允价值	占基金资产净值比例 (%)	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
交易性金融资产—股票投资	119,305,656.76	93.27	344,656,864.56	93.08
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	119,305,656.76	93.27	344,656,864.56	93.08

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（2020年6月30日）	上年度末（2019年12月31日）
分析	业绩比较基准上升5%	6,400,000.00	14,690,000.00
	业绩比较基准下降5%	-6,400,000.00	-14,690,000.00

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	119,305,656.76	89.43
	其中：股票	119,305,656.76	89.43
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	10,507,863.27	7.88
8	其他各项资产	3,593,474.57	2.69
9	合计	133,406,994.60	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	1,025,416.00	0.80
B	采矿业	1,398,169.20	1.09
C	制造业	29,037,094.45	22.70
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	1,299,335.84	1.02
E	建筑业	1,167,082.00	0.91
F	批发和零售业	423,724.00	0.33
G	交通运输、仓储和邮政业	1,412,829.35	1.10
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	2,443,737.80	1.91
J	金融业	17,036,813.80	13.32
K	房地产业	2,340,676.00	1.83
L	租赁和商务服务业	975,341.00	0.76
M	科学研究和技术服务业	469,476.00	0.37
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	88,800.00	0.07
Q	卫生和社会工作	846,866.85	0.66
R	文化、体育和娱乐业	405,301.00	0.32
S	综合	-	-
	合计	60,370,663.29	47.19

7.2.2 报告期末积极投资按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	1,182,623.30	0.92
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	12,766.32	0.01
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-

H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	12,097.57	0.01
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	1,207,487.19	0.94

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	25,137.87	0.02
非日常生活消费品	6,431,568.32	5.03
日常消费品	2,073,355.99	1.62
能源	1,415,019.47	1.11
金融	20,069,360.10	15.69
医疗保健	1,993,618.27	1.56
工业	1,286,998.89	1.01
信息技术	1,482,491.78	1.16
通信服务	15,335,134.07	11.99
公用事业	2,674,543.91	2.09
房地产	4,940,277.61	3.86
合计	57,727,506.28	45.13

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	29,570.00	13,467,395.81	10.53
2	601318	中国平安	50,601.00	3,612,911.40	2.82
2	02318	中国平安	28,000.00	1,982,164.80	1.55

3	01299	友邦保险	56,400.00	3,724,752.56	2.91
4	03690	美团点评-W	22,400.00	3,517,255.53	2.75
5	601939	建设银行	31,300.00	197,503.00	0.15
5	00939	建设银行	561,000.00	3,212,997.80	2.51
6	600519	贵州茅台	2,300.00	3,364,624.00	2.63
7	00005	汇丰控股	96,743.00	3,198,955.12	2.50
8	600036	招商银行	48,200.00	1,625,304.00	1.27
8	03968	招商银行	21,500.00	700,128.92	0.55
9	601398	工商银行	116,200.00	578,676.00	0.45
9	01398	工商银行	405,000.00	1,738,733.04	1.36
10	00388	香港交易所	5,889.00	1,775,151.89	1.39
11	600276	恒瑞医药	17,359.00	1,602,235.70	1.25
12	000858	五粮液	9,100.00	1,557,192.00	1.22
13	000333	美的集团	22,900.00	1,369,191.00	1.07
14	601988	中国银行	98,600.00	343,128.00	0.27
14	03988	中国银行	390,000.00	1,022,413.39	0.80
15	00941	中国移动	28,487.00	1,360,906.94	1.06
16	000651	格力电器	22,500.00	1,272,825.00	1.00
17	002475	立讯精密	19,547.00	1,003,738.45	0.78
18	600030	中信证券	39,800.00	959,578.00	0.75
19	601166	兴业银行	58,200.00	918,396.00	0.72
20	300750	宁德时代	5,200.00	906,672.00	0.71
21	600887	伊利股份	28,300.00	880,979.00	0.69
22	601328	交通银行	128,400.00	658,692.00	0.51
22	03328	交通银行	49,000.00	213,945.92	0.17
23	000002	万科A	31,800.00	831,252.00	0.65
24	01810	小米集团-W	67,400.00	790,505.59	0.62
25	600900	长江电力	41,100.00	778,434.00	0.61
26	600016	民生银行	99,300.00	563,031.00	0.44
26	01988	民生银行	30,952.00	150,411.27	0.12
27	601628	中国人寿	7,800.00	212,238.00	0.17
27	02628	中国人寿	34,968.00	498,282.25	0.39
28	601888	中国中免	4,600.00	708,538.00	0.55
29	00883	中国海洋石油	83,098.00	654,301.42	0.51
30	300059	东方财富	30,112.00	608,262.40	0.48
31	600585	海螺水泥	11,200.00	592,592.00	0.46
32	601601	中国太保	12,700.00	346,075.00	0.27
32	02601	中国太保	13,000.00	245,806.70	0.19
33	000725	京东方A	126,600.00	591,222.00	0.46
34	00002	中电控股	8,492.00	589,526.87	0.46
35	00669	创科实业	8,500.00	588,529.39	0.46
36	600000	浦发银行	54,800.00	579,784.00	0.45

37	000001	平安银行	45,260.00	579,328.00	0.45
38	002714	牧原股份	6,970.00	571,540.00	0.45
39	00001	长和	12,485.00	567,934.06	0.44
40	000661	长春高新	1,300.00	565,890.00	0.44
41	01177	中国生物制药	41,000.00	546,785.18	0.43
42	00003	香港中华煤气	49,755.00	545,378.49	0.43
43	002415	海康威视	17,500.00	531,125.00	0.42
44	300760	迈瑞医疗	1,700.00	519,690.00	0.41
45	600031	三一重工	27,600.00	517,776.00	0.40
46	601688	华泰证券	27,500.00	517,000.00	0.40
47	01113	长实集团	11,987.00	505,862.52	0.40
48	000063	中兴通讯	12,600.00	505,638.00	0.40
49	601012	隆基股份	12,290.00	500,571.70	0.39
50	00016	新鸿基地产	5,484.00	495,670.73	0.39
51	600048	保利地产	33,400.00	493,652.00	0.39
52	00027	银河娱乐	10,000.00	481,839.60	0.38
53	600837	海通证券	37,800.00	475,524.00	0.37
54	603288	海天味业	3,800.00	472,720.00	0.37
55	603259	药明康德	4,860.00	469,476.00	0.37
56	601668	中国建筑	98,100.00	467,937.00	0.37
57	300498	温氏股份	20,820.00	453,876.00	0.35
58	02269	药明生物	3,500.00	453,340.27	0.35
59	02388	中银香港	19,936.00	448,884.88	0.35
60	00688	中国海外发展	20,454.00	438,128.12	0.34
61	01109	华润置地	15,957.00	427,798.62	0.33
62	00011	恒生银行	3,597.00	427,462.24	0.33
63	01928	金沙中国有限公司	15,200.00	422,082.36	0.33
64	02382	舜宇光学科技	3,600.00	407,759.62	0.32
65	300015	爱尔眼科	9,377.00	407,430.65	0.32
66	601088	中国神华	15,400.00	221,144.00	0.17
66	01088	中国神华	15,979.00	176,901.80	0.14
67	000100	TCL 科技	63,100.00	391,220.00	0.31
68	601229	上海银行	46,500.00	385,950.00	0.30
69	01918	融创中国	13,000.00	385,334.66	0.30
70	01093	石药集团	28,766.00	384,680.86	0.30
71	300142	沃森生物	7,200.00	376,992.00	0.29
72	00241	阿里健康	18,021.00	372,020.91	0.29
73	002142	宁波银行	14,000.00	367,780.00	0.29
74	600309	万华化学	7,300.00	364,927.00	0.29
75	601211	国泰君安	21,100.00	364,186.00	0.28
76	02313	申洲国际	4,200.00	358,324.24	0.28

77	00386	中国石油化工股份	119,901.00	353,757.25	0.28
78	02007	碧桂园	40,573.00	352,820.73	0.28
79	02319	蒙牛乳业	12,925.00	349,463.88	0.27
80	002352	顺丰控股	6,200.00	339,140.00	0.27
81	601169	北京银行	69,100.00	338,590.00	0.26
82	600588	用友网络	7,580.00	334,278.00	0.26
83	03333	中国恒大	17,947.00	327,870.15	0.26
84	600009	上海机场	4,500.00	324,315.00	0.25
85	601766	中国中车	56,800.00	316,376.00	0.25
86	00291	华润啤酒	7,988.00	315,211.34	0.25
87	600690	海尔智家	17,700.00	313,290.00	0.24
88	02020	安踏体育	5,000.00	312,396.48	0.24
89	00066	港铁公司	8,505.00	311,917.61	0.24
90	00175	吉利汽车	27,964.00	311,629.92	0.24
91	002241	歌尔股份	10,600.00	311,216.00	0.24
92	000568	泸州老窖	3,400.00	309,808.00	0.24
93	000338	潍柴动力	22,400.00	307,328.00	0.24
94	002594	比亚迪	4,200.00	301,560.00	0.24
95	300122	智飞生物	3,000.00	300,450.00	0.23
96	02688	新奥能源	3,700.00	294,712.28	0.23
97	002304	洋河股份	2,800.00	294,392.00	0.23
98	600999	招商证券	13,400.00	294,130.00	0.23
99	002410	广联达	4,200.00	292,740.00	0.23
100	000876	新希望	9,800.00	292,040.00	0.23
101	600703	三安光电	11,400.00	285,000.00	0.22
102	00960	龙湖集团	8,433.00	283,857.01	0.22
103	06186	中国飞鹤	20,000.00	283,531.78	0.22
104	601899	紫金矿业	64,300.00	282,920.00	0.22
105	600104	上汽集团	16,400.00	278,636.00	0.22
106	002555	三七互娱	5,900.00	276,120.00	0.22
107	00788	中国铁塔	218,000.00	272,807.99	0.21
108	002230	科大讯飞	7,200.00	269,496.00	0.21
109	00006	电能实业	6,996.00	269,356.47	0.21
110	002027	分众传媒	47,900.00	266,803.00	0.21
111	601818	光大银行	74,400.00	266,352.00	0.21
112	600745	闻泰科技	2,100.00	264,495.00	0.21
113	300601	康泰生物	1,600.00	259,456.00	0.20
114	002007	华兰生物	5,100.00	255,561.00	0.20
115	01876	百威亚太	12,400.00	255,416.09	0.20
116	300347	泰格医药	2,500.00	254,700.00	0.20
117	600919	江苏银行	43,200.00	244,944.00	0.19

118	600028	中国石化	62,500.00	244,375.00	0.19
119	601658	邮储银行	12,500.00	57,125.00	0.04
119	01658	邮储银行	46,000.00	186,981.17	0.15
120	001979	招商蛇口	14,800.00	243,312.00	0.19
121	02909	新世界发展	7,238.00	243,302.42	0.19
122	600436	片仔癀	1,400.00	238,350.00	0.19
123	00857	中国石油股份	98,000.00	230,059.00	0.18
124	000538	云南白药	2,400.00	225,144.00	0.18
125	601998	中信银行	14,300.00	73,645.00	0.06
125	00998	中信银行	48,948.00	151,123.39	0.12
126	00020	会德丰	3,967.00	222,127.69	0.17
127	600547	山东黄金	6,060.00	221,917.20	0.17
128	600406	国电南瑞	10,800.00	218,700.00	0.17
129	300413	芒果超媒	3,350.00	218,420.00	0.17
130	000895	双汇发展	4,700.00	216,623.00	0.17
131	000166	申万宏源	42,100.00	212,605.00	0.17
132	300003	乐普医疗	5,800.00	211,816.00	0.17
133	600050	中国联通	43,600.00	211,024.00	0.17
134	00288	万洲国际	34,221.00	207,558.63	0.16
135	300014	亿纬锂能	4,300.00	205,755.00	0.16
136	601009	南京银行	28,000.00	205,240.00	0.16
137	002371	北方华创	1,200.00	205,092.00	0.16
138	00384	中国燃气	9,371.00	204,580.33	0.16
139	000938	紫光股份	4,740.00	203,725.20	0.16
140	01997	九龙仓置业	5,956.00	201,296.60	0.16
141	603160	汇顶科技	900.00	200,610.00	0.16
142	03692	翰森制药	6,000.00	200,043.36	0.16
143	000776	广发证券	13,900.00	196,268.00	0.15
144	601006	大秦铁路	27,800.00	195,712.00	0.15
145	00813	世茂集团	6,500.00	194,745.41	0.15
146	00270	粤海投资	16,000.00	194,380.03	0.15
147	01044	恒安国际	3,500.00	194,060.33	0.15
148	601390	中国中铁	38,100.00	191,262.00	0.15
149	601857	中国石油	45,400.00	190,226.00	0.15
150	600196	复星医药	5,600.00	189,560.00	0.15
151	600019	宝钢股份	41,500.00	189,240.00	0.15
152	00012	恒基地产	6,980.00	187,448.85	0.15
153	02328	中国财险	31,873.00	186,038.93	0.15
154	002044	美年健康	12,820.00	184,736.20	0.14
155	000977	浪潮信息	4,700.00	184,146.00	0.14
156	00101	恒隆地产	10,949.00	183,623.03	0.14
157	002050	三花智控	8,377.00	183,456.30	0.14

158	300124	汇川技术	4,800.00	182,352.00	0.14
159	601186	中国铁建	21,500.00	180,170.00	0.14
160	00267	中信股份	26,913.00	178,967.23	0.14
161	002602	世纪华通	11,580.00	177,289.80	0.14
162	600015	华夏银行	28,800.00	176,256.00	0.14
163	002311	海大集团	3,700.00	176,083.00	0.14
164	002001	新和成	6,000.00	174,600.00	0.14
165	600809	山西汾酒	1,200.00	174,000.00	0.14
166	002624	完美世界	3,000.00	172,920.00	0.14
167	601336	新华保险	3,900.00	172,692.00	0.14
168	300433	蓝思科技	6,100.00	171,044.00	0.13
169	601989	中国重工	42,500.00	170,000.00	0.13
170	601933	永辉超市	17,900.00	167,902.00	0.13
171	300454	深信服	800.00	164,768.00	0.13
172	06808	高鑫零售	13,500.00	163,268.27	0.13
173	603501	韦尔股份	800.00	161,560.00	0.13
174	002236	大华股份	8,400.00	161,364.00	0.13
175	600958	东方证券	16,700.00	158,483.00	0.12
176	000157	中联重科	24,200.00	155,606.00	0.12
177	00151	中国旺旺	28,869.00	154,265.08	0.12
178	600741	华域汽车	7,400.00	153,846.00	0.12
179	002024	苏宁易购	17,400.00	152,598.00	0.12
180	02018	瑞声科技	3,487.00	151,454.61	0.12
181	01169	海尔电器	7,000.00	149,941.18	0.12
182	600383	金地集团	10,600.00	145,220.00	0.11
183	002008	大族激光	4,000.00	143,800.00	0.11
184	00083	信和置业	15,929.00	141,864.31	0.11
185	601138	工业富联	9,300.00	140,895.00	0.11
186	01193	华润燃气	4,000.00	137,929.44	0.11
187	600346	恒力石化	9,840.00	137,760.00	0.11
188	300408	三环集团	4,900.00	135,730.00	0.11
189	601225	陕西煤业	18,700.00	134,827.00	0.11
190	300033	同花顺	1,000.00	133,080.00	0.10
191	00992	联想集团	33,882.00	132,771.96	0.10
192	002120	韵达股份	5,403.00	132,103.35	0.10
193	601155	新城控股	4,200.00	131,208.00	0.10
194	000425	徐工机械	21,900.00	129,429.00	0.10
195	002202	金风科技	12,900.00	128,613.00	0.10
196	600340	华夏幸福	5,600.00	128,016.00	0.10
197	01038	长江基建集团	3,500.00	127,561.90	0.10
198	300144	宋城演艺	7,360.00	127,328.00	0.10
199	00728	中国电信	64,000.00	126,858.55	0.10

200	601669	中国电建	35,700.00	123,522.00	0.10
201	000783	长江证券	18,100.00	121,994.00	0.10
202	601800	中国交建	16,500.00	121,110.00	0.09
203	06862	海底捞	4,000.00	119,477.95	0.09
204	002841	视源股份	1,200.00	119,424.00	0.09
205	601985	中国核电	28,900.00	118,201.00	0.09
206	000069	华侨城 A	19,100.00	115,746.00	0.09
207	000768	中航飞机	6,500.00	115,310.00	0.09
208	600010	包钢股份	106,000.00	114,480.00	0.09
209	00023	东亚银行	6,793.00	109,828.46	0.09
210	00322	康师傅控股	10,000.00	109,795.49	0.09
211	002493	荣盛石化	8,900.00	109,470.00	0.09
212	00656	复星国际	11,977.00	107,871.07	0.08
213	002916	深南电路	640.00	107,212.80	0.08
214	00762	中国联通	28,000.00	107,164.78	0.08
215	600029	南方航空	20,700.00	107,019.00	0.08
216	002179	中航光电	2,600.00	106,626.00	0.08
217	600606	绿地控股	17,000.00	105,060.00	0.08
218	000963	华东医药	4,080.00	103,224.00	0.08
219	002157	正邦科技	5,900.00	103,132.00	0.08
220	603993	洛阳钼业	28,000.00	102,760.00	0.08
221	600795	国电电力	54,800.00	101,380.00	0.08
222	000625	长安汽车	9,200.00	101,200.00	0.08
223	600061	国投资本	7,900.00	100,567.00	0.08
224	002466	天齐锂业	4,380.00	100,521.00	0.08
225	03380	龙光集团	8,000.00	100,259.17	0.08
226	600886	国投电力	12,700.00	99,822.00	0.08
227	002422	科伦药业	4,700.00	98,700.00	0.08
228	600893	航发动力	4,200.00	98,616.00	0.08
229	01972	太古地产	5,400.00	97,073.10	0.08
230	00966	中国太平	8,400.00	95,297.37	0.07
231	601066	中信建投	2,400.00	94,512.00	0.07
232	00019	太古股份公司 A	2,500.00	93,855.96	0.07
233	601111	中国国航	14,000.00	92,540.00	0.07
234	00135	昆仑能源	20,000.00	91,709.38	0.07
235	002607	中公教育	3,200.00	88,800.00	0.07
236	300628	亿联网络	1,300.00	88,738.00	0.07
237	600115	东方航空	21,000.00	88,620.00	0.07
238	000617	中油资本	8,500.00	88,315.00	0.07
239	01128	永利澳门	7,200.00	87,734.09	0.07
240	600011	华能国际	20,700.00	87,354.00	0.07

241	601360	三六零	4,700.00	86,057.00	0.07
242	601727	上海电气	17,000.00	85,680.00	0.07
243	600332	白云山	2,600.00	84,058.00	0.07
244	000786	北新建材	3,900.00	83,187.00	0.07
245	601618	中国中冶	33,100.00	83,081.00	0.06
246	00836	华润电力	9,977.00	83,022.99	0.06
247	003816	中国广核	27,679.00	81,929.84	0.06
248	000656	金科股份	10,000.00	81,600.00	0.06
249	002252	上海莱士	9,500.00	80,370.00	0.06
250	000703	恒逸石化	8,510.00	77,696.30	0.06
251	00371	北控水务集团	28,000.00	77,240.49	0.06
252	000596	古井贡酒	500.00	75,120.00	0.06
253	601881	中国银河	6,000.00	68,820.00	0.05
254	600018	上港集团	16,100.00	67,620.00	0.05
255	002673	西部证券	8,200.00	66,912.00	0.05
256	002146	荣盛发展	8,100.00	65,610.00	0.05
257	601319	中国人保	10,000.00	64,400.00	0.05
258	002773	康弘药业	1,270.00	62,992.00	0.05
259	002938	鹏鼎控股	1,200.00	60,072.00	0.05
260	002739	万达电影	3,900.00	59,553.00	0.05
261	00392	北京控股	2,500.00	59,145.24	0.05
262	002153	石基信息	1,500.00	58,545.00	0.05
263	00004	九龙仓集团	3,983.00	57,338.53	0.04
264	002032	苏泊尔	800.00	56,800.00	0.04
265	002939	长城证券	4,300.00	52,976.00	0.04
266	00144	招商局港口	6,000.00	50,202.66	0.04
267	002558	巨人网络	2,800.00	48,720.00	0.04
268	000627	天茂集团	9,300.00	48,453.00	0.04
269	002468	申通快递	2,900.00	47,589.00	0.04
270	02282	美高梅中国	5,163.00	47,160.91	0.04
271	601633	长城汽车	5,700.00	44,004.00	0.03
272	00659	新创建集团	6,988.00	42,703.06	0.03
273	03799	达利食品	9,500.00	40,785.10	0.03
274	601916	浙商银行	10,200.00	40,188.00	0.03
275	601238	广汽集团	4,300.00	38,700.00	0.03
276	03320	华润医药	9,000.00	36,747.69	0.03
277	000723	美锦能源	5,800.00	36,308.00	0.03
278	01929	周大福	5,200.00	35,196.67	0.03
279	600025	华能水电	8,500.00	32,215.00	0.03
280	600989	宝丰能源	3,800.00	31,996.00	0.03
281	000708	中信特钢	1,700.00	29,053.00	0.02
282	00293	国泰航空	4,000.00	27,403.20	0.02

283	01378	中国宏桥	8,000.00	25,137.87	0.02
284	001965	招商公路	2,700.00	18,171.00	0.01

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	688396	华润微	15,767	653,542.15	0.51
2	688169	石头科技	1,291	471,395.74	0.37
3	603087	甘李药业	430	43,129.00	0.03
4	600956	新天绿能	2,533	12,766.32	0.01
5	300845	捷安高科	470	8,286.10	0.01
6	300843	胜蓝股份	751	7,517.51	0.01
7	300840	酷特智能	1,185	7,038.90	0.01
8	300846	首都在线	1,131	3,811.47	0.00

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例（%）
1	03690	美团点评-W	1,312,006.90	0.35
2	688266	泽璟制药	517,000.64	0.14
3	603288	海天味业	469,680.00	0.13
4	688158	优刻得	374,502.10	0.10
5	688169	石头科技	350,015.92	0.09
6	300760	迈瑞医疗	314,296.00	0.08
7	06186	中国飞鹤	273,756.03	0.07
8	002555	三七互娱	252,735.00	0.07
9	600745	闻泰科技	241,774.00	0.07
10	688396	华润微	201,817.60	0.05
11	000977	浪潮信息	193,755.00	0.05
12	300014	亿纬锂能	192,692.00	0.05
13	002371	北方华创	176,516.00	0.05
14	600809	山西汾酒	175,879.00	0.05
15	688200	华峰测控	171,426.36	0.05
16	688208	道通科技	165,258.24	0.04
17	603501	韦尔股份	161,173.00	0.04
18	000157	中联重科	160,882.00	0.04
19	688100	威胜信息	159,875.56	0.04
20	688186	广大特材	136,851.00	0.04

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

7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	00700	腾讯控股	24,185,338.89	6.53
2	00005	汇丰控股	9,370,271.07	2.53
3	601318	中国平安	8,072,605.54	2.18
4	01299	友邦保险	7,720,887.39	2.09
5	00939	建设银行	6,782,121.08	1.83
6	600519	贵州茅台	5,479,981.00	1.48
7	03690	美团点评-W	4,490,745.87	1.21
8	02318	中国平安	4,290,938.43	1.16
9	01398	工商银行	4,115,866.90	1.11
10	601658	邮储银行	3,779,987.16	1.02
11	688111	金山办公	3,734,541.40	1.01
12	600036	招商银行	3,600,864.00	0.97
13	00941	中国移动	3,378,623.27	0.91
14	00388	香港交易所	2,900,412.51	0.78
15	601166	兴业银行	2,700,543.19	0.73
16	600276	恒瑞医药	2,515,801.00	0.68
17	03988	中国银行	2,241,270.24	0.61
18	000651	格力电器	2,155,693.00	0.58
19	00883	中国海洋石油	2,101,250.93	0.57
20	600887	伊利股份	1,761,982.00	0.48

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

7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	9,193,668.43
卖出股票收入（成交）总额	238,193,482.55

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工商银行（1398.HK）的发行主体中国工商银行股份有限公司于 2020 年 4 月 20 日因监管标准化数据（EAST）系统数据质量及数据报送存在违法违规行为等，受到中国银行保险监督管理委员会处罚（银保监罚决字〔2020〕7 号）。工商银行为本基金跟踪标的指数的成份股。

2、本基金投资的前十名证券之一汇丰控股（0005.HK）的发行主体汇丰控股有限公司创始成员香港上海汇丰银行有限公司于 2019 年 9 月 10 日因没有遵守《操守准则》下的电话录音规定，受到香港证券及期货事务监察委员会谴责及罚款。汇丰控股为本基金跟踪标的指数的成份股。

3、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 2019 年 12 月 27 日因用于风险缓释的保证金管理存在漏洞等，受到中国银行保险监督管理委员会处罚（银保监罚决字〔2019〕22 号），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）。建设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	59,392.95
2	应收证券清算款	3,136,951.19
3	应收股利	346,790.71
4	应收利息	2,203.49
5	应收申购款	48,136.23
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	3,593,474.57

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	688396	华润微	653,542.15	0.51	新股锁定
2	688169	石头科技	471,395.74	0.37	新股锁定
3	300845	捷安高科	8,286.10	0.01	新股未上市

7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入原因，分项之和与合计可能有尾差。

§ 8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额级别	持有人户数 (户)	户均持有的基金份额	持有人结构			
			机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总份额比例 (%)	持有份额	占总份额比例 (%)

中华 300A	4,387	26,774.81	31,097,104.52	26.47	86,363,988.15	73.53
合计	4,387	26,774.81	31,097,104.52	26.47	86,363,988.15	73.53

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

中华 300A

序号	持有人名称	持有份额（份）	占上市总份额比例（%）
1	陈钰林	100,000.00	12.60
2	杨凯	98,900.00	12.46
3	杜楚芬	90,004.00	11.34
4	李宝良	50,008.00	6.30
5	于素芬	50,006.00	6.30
6	张京湘	50,000.00	6.30
7	罗四倍	44,216.00	5.57
8	王凤艳	40,001.00	5.04
9	李成福	30,001.00	3.78
10	李万举	30,001.00	3.78

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	中华 300A	126,633.27	0.1078
	中华 300C	0.00	0.0000
	合计	126,633.27	0.1078

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	中华 300A	0~10
	中华 300C	0

基金		
	合计	0~10
本基金基金经理持有 本开放式基金	中华 300A	0
	中华 300C	0
	合计	0

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	中华 300A	中华 300C
基金合同生效日 (2019 年 3 月 20 日) 基金份额总额	1,968,326,601.16	0.00
本报告期期初基金份 额总额	351,061,620.03	0.00
本报告期基金总申购 份额	6,508,294.68	-
减：本报告期基金总 赎回份额	240,108,822.04	-
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	117,461,092.67	0.00

§ 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

无。

二、基金托管人的基金托管部门的重大人事变动

无。

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	
中金公司	3	126,503,236.13	51.79%	104,100.98	49.77%	-
光大证券	2	113,664,544.66	46.53%	101,312.67	48.44%	-
兴业证券	2	2,047,172.00	0.84%	1,865.72	0.89%	-
海通证券	1	1,478,753.17	0.61%	1,347.62	0.64%	-
中泰证券	2	573,000.00	0.23%	522.16	0.25%	-
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	-	-	-	-	-
宏源证券	1	-	-	-	-	-
红塔证券	1	-	-	-	-	-
华创证券	1	-	-	-	-	-
华泰证券	1	-	-	-	-	-
华西证券	1	-	-	-	-	-
联讯证券	1	-	-	-	-	-
民生证券	1	-	-	-	-	-
南京证券	1	-	-	-	-	-
平安证券	1	-	-	-	-	-
瑞银证券	2	-	-	-	-	-
山西证券	1	-	-	-	-	-
上海证券	1	-	-	-	-	-
申万宏源	1	-	-	-	-	-
世纪证券	1	-	-	-	-	-
天风证券	2	-	-	-	-	-
万和证券	1	-	-	-	-	-
西部证券	1	-	-	-	-	-
西藏东财	1	-	-	-	-	-
湘财证券	1	-	-	-	-	-
招商证券	2	-	-	-	-	-
浙商证券	1	-	-	-	-	-
中国银河证 券	4	-	-	-	-	-
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：长城证券，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	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	中国证券报、中国证监会基金电子披露网站及本公司网站	2020 年 6 月 29 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	中国证券报、中国证监会基金电子披露网站及本公司网站	2020 年 6 月 19 日
3	大成基金管理有限公司关于旗下部分基金增加安信证券股份有限公司为销售机构的公告	中国证券报、中国证监会基金电子披露网站及本公司网站	2020 年 6 月 18 日
4	大成基金管理有限公司关于旗下部分基金增加泛华普益基金销售有限公司	中国证券报、中国证监会基金电子披露网站及	2020 年 6 月 5 日

	为销售机构的公告	本公司网站	
5	大成基金管理有限公司关于旗下部分基金增加中信证券华南股份有限公司为销售机构的公告	中国证券报、中国证监会基金电子披露网站及本公司网站	2020 年 5 月 6 日
6	大成中华沪深港 300 指数证券投资基金 (LOF) 2019 年年度报告	中国证券报、中国证监会基金电子披露网站及本公司网站	2020 年 4 月 29 日
7	大成基金管理有限公司关于终止泰诚财富基金销售 (大连) 有限公司办理相关销售业务的公告	中国证券报、中国证监会基金电子披露网站及本公司网站	2020 年 4 月 25 日
8	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	中国证券报、中国证监会基金电子披露网站及本公司网站	2020 年 4 月 24 日
9	大成中华沪深港 300 指数证券投资基金 (LOF) 2020 年第 1 季度报告	中国证券报、中国证监会基金电子披露网站及本公司网站	2020 年 4 月 22 日
10	大成中华沪深港 300 指数证券投资基金 (LOF) 更新招募说明书及摘要	中国证券报、中国证监会基金电子披露网站及本公司网站	2020 年 4 月 21 日
11	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	中国证券报、中国证监会基金电子披露网站及本公司网站	2020 年 4 月 9 日
12	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	中国证券报、中国证监会基金电子披露网站及本公司网站	2020 年 4 月 1 日
13	大成基金管理有限公司关于延迟披露旗下公募基金 2019 年年度报告的公告	中国证券报、中国证监会基金电子披露网站及本公司网站	2020 年 3 月 25 日
14	大成基金管理有限公司关于注销南京分公司的公告	中国证券报、中国证监会基金电子披露网站及本公司网站	2020 年 3 月 21 日
15	大成中华沪深港 300 指数证券投资基金 (LOF) 托管协议	中国证券报、中国证监会基金电子披露网站及本公司网站	2020 年 2 月 29 日
16	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	中国证券报、中国证监会基金电子披露网站及本公司网站	2020 年 2 月 29 日
17	大成中华沪深港 300 指数证券投资基金 (LOF) 基金合同	中国证券报、中国证监会基金电子披露网站及本公司网站	2020 年 2 月 29 日
18	大成中华沪深港 300 指数证券投资基金 (LOF) 更新招募说明书及摘要	中国证券报、中国证监会基金电子披露网站及本公司网站	2020 年 2 月 29 日
19	大成基金管理有限公司关于注销青岛	中国证券报、中国证监	2020 年 2 月 29 日

	分公司的公告	会基金电子披露网站及 本公司网站	
20	大成基金管理有限公司关于 APP 交易 平台汇款交易费率优惠的公告	中国证券报、中国证监 会基金电子披露网站及 本公司网站	2020 年 2 月 26 日
21	大成基金管理有限公司关于 2020 年 春节假期延长期间调整公司公募基金 开放时间等相关事宜的公告	中国证券报、中国证监 会基金电子披露网站及 本公司网站	2020 年 1 月 30 日
22	大成中华沪深港 300 指数证券投资基 金 (LOF) 2019 年第 4 季度报告	中国证券报、中国证监 会基金电子披露网站及 本公司网站	2020 年 1 月 17 日
23	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	中国证券报、中国证监 会基金电子披露网站及 本公司网站	2020 年 1 月 17 日
24	大成中华沪深港 300 指数证券投资基 金 (LOF) 2020 年境外主要市场节假 日暂停申购赎回安排的公告	中国证券报、中国证监 会基金电子披露网站及 本公司网站	2020 年 1 月 4 日

§ 11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

无。

11.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§ 12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

- 1、中国证监会批准设立大成中华沪深港 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、本报告期内在指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

2020 年 8 月 28 日