

大成中华沪深港 300 指数证券投资基金
(LOF)
2025 年中期报告

2025 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：2025 年 8 月 29 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 2025 年 08 月 28 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 2025 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 and 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	11
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	11
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明	11
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	12
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	12
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	13
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明	13
§ 5 托管人报告	13
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	13
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	14
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	14
§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）	14
6.1 资产负债表	14
6.2 利润表	15
6.3 净资产变动表	17
6.4 报表附注	18
§ 7 投资组合报告	39
7.1 期末基金资产组合情况	39
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	40
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	42
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	49
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	51
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	51

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	51
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	51
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	51
7.10 本基金投资股指期货的投资政策	51
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	51
7.12 投资组合报告附注	51
§ 8 基金份额持有人信息	52
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	52
8.2 期末上市基金前十名持有人	52
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	53
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	53
§ 9 开放式基金份额变动	53
§ 10 重大事件揭示	54
10.1 基金份额持有人大会决议	54
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	54
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	54
10.4 基金投资策略的改变	54
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	54
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	55
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	55
10.8 其他重大事件	56
§ 11 影响投资者决策的其他重要信息	58
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	58
11.2 影响投资者决策的其他重要信息	58
§ 12 备查文件目录	58
12.1 备查文件目录	58
12.2 存放地点	58
12.3 查阅方式	58

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	大成中华沪深深港 300 指数证券投资基金 (LOF)	
基金简称	大成中华沪深深港 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	27,871,896.85 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	大成中华沪深深港 300 指数 (LOF) A	大成中华沪深深港 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	23,838,544.47 份	4,033,352.38 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	任航
	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(2025 年 1 月 1 日 - 2025 年 6 月 30 日)	
	大成中华沪深港 300 指数 (LOF) A	大成中华沪深港 300 指数 (LOF) C
本期已实现收益	230,110.19	24,005.30
本期利润	2,917,515.13	362,025.96
加权平均基金份 额本期利润	0.1154	0.0977

本期加权平均净 值利润率	10.02%	8.53%
本期基金份额净 值增长率	10.01%	9.97%
3.1.2 期 末 数 据和指标	报告期末(2025 年 6 月 30 日)	
期末可供分配利 润	2,564,100.77	413,494.03
期末可供分配基 金份额利润	0.1076	0.1025
期末基金资产净 值	28,689,282.57	4,829,167.68
期末基金份额净 值	1.2035	1.1973
3.1.3 累计期 末指标	报告期末(2025 年 6 月 30 日)	
基金份额累计净 值增长率	20.35%	1.65%

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

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

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

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

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	2.66%	0.71%	2.12%	0.71%	0.54%	0.00%
过去三个月	2.35%	1.47%	1.05%	1.48%	1.30%	-0.01%
过去六个月	10.01%	1.32%	7.78%	1.31%	2.23%	0.01%
过去一年	23.60%	1.26%	20.88%	1.29%	2.72%	-0.03%

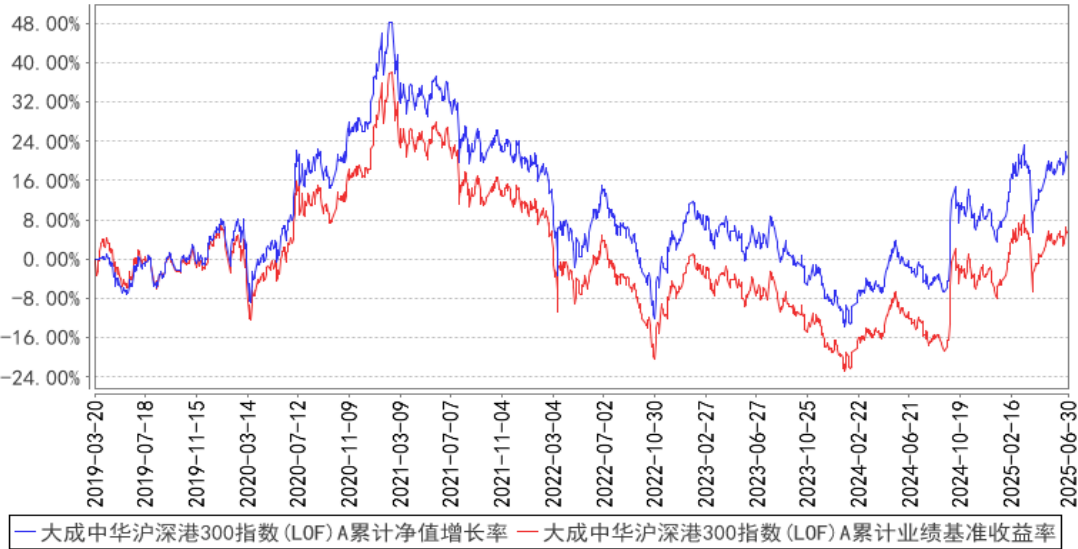
过去三年	5.30%	1.10%	1.13%	1.10%	4.17%	0.00%
自基金合同生效起 至今	20.35%	1.14%	5.09%	1.13%	15.26%	0.01%

大成中华沪深港 300 指数 (LOF) C

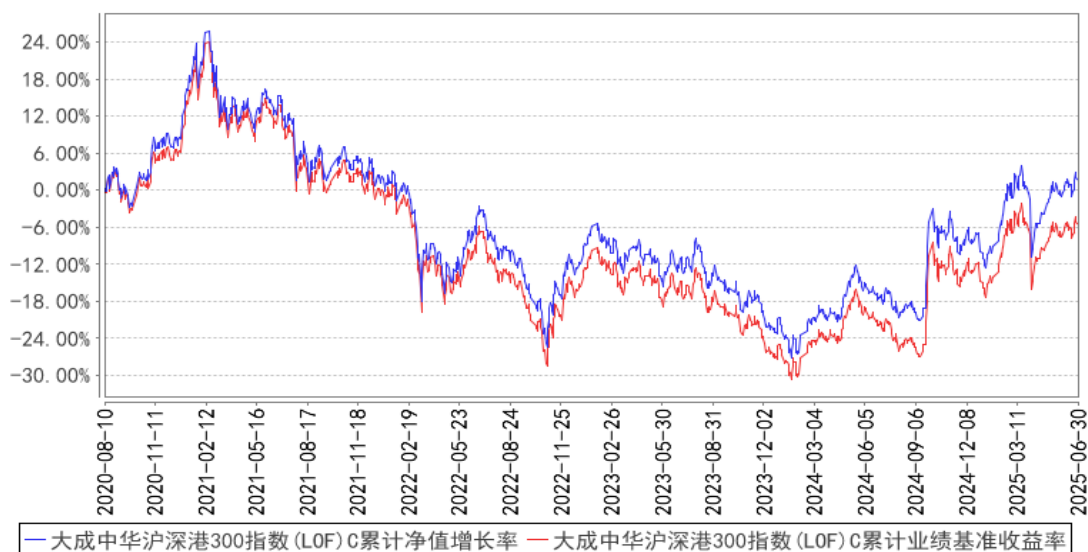
阶段	份额净值 增长率①	份额净值 增长率标 准差②	业绩比较基 准收益率③	业绩比较基准 收益率标准差 ④	①—③	②—④
过去一个月	2.65%	0.71%	2.12%	0.71%	0.53%	0.00%
过去三个月	2.32%	1.47%	1.05%	1.48%	1.27%	-0.01%
过去六个月	9.97%	1.32%	7.78%	1.31%	2.19%	0.01%
过去一年	23.43%	1.26%	20.88%	1.29%	2.55%	-0.03%
过去三年	4.94%	1.10%	1.13%	1.10%	3.81%	0.00%
自基金合同生效起 至今	1.65%	1.13%	-5.61%	1.12%	7.26%	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

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、本基金自 2020 年 3 月 3 日起增设 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自 2020 年 8 月 10 日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成立于 1999 年 4 月 12 日，注册资本人民币 2 亿元，是中国首批获准成立的“老十家”基金管理公司之一。公司总部位于深圳，同时设置了北方、华东和南方营销总部，在北京、上海等地开设有 5 家分公司。2009 年，公司在香港设立大成国际资产管理有限公司；2013 年，设立大成创新资本管理有限公司。

公司业务资质齐全，全面覆盖公募基金、机构投资、海外投资、财富管理、养老金管理等业务，还受全国社会保障基金理事会委托管理部分社保基金和基本养老保险基金。旗下大成国际资产管理公司具备 QFII、RQFII 等资格，是首批首家完成备案的能够提供港股通投资顾问服务的香港机构。

历经二十余年的磨砺和沉淀，大成基金形成了以长期投资能力为核心的竞争优势，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。公司目前已形成权益投资、固收投资、指数与期货投资、跨境投资、混合资产投资、大类资产配置六大投资团队，全面覆盖各类投资领域，综合实力不断提升，各项业务迅猛发展，管理资产种类位居同业前列。

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	—	22 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 交易型开放式指数证券投资基金联接基金（QDII）（转型前为大成纳斯达克 100 指数证券投资基金）基金经理。2016 年 12 月 2 日至 2023 年 3 月 14 日任大成恒生综合中小型股指数基金（QDII-LOF）基金经理。2016 年 12 月 29 日至 2020 年 7 月 7 日任大成海外中国机会混合型证券投资基金（LOF）基金经理。2017 年 8 月 10 日起任大成恒生指数证券投资基金（LOF）基金经理。2019 年 3 月 20 日起任大成中华沪深港 300 指数证券投资基金（LOF）基金经理。2021 年 5 月 18 日起任大成恒生科技交易型开放式指数证券投资基金（QDII）基金经理。2021 年 9 月 9 日起任大成恒生科技交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金基金经理。2023 年 7 月 12 日起任大成纳斯达克 100 交易型开放式指数证券投资基金（QDII）基金经理。2024 年 5 月 29 日起任大成全球美元债债券型证券投资基金（QDII）基金经理。2024 年 6 月 18 日起任大成恒生医疗保健交易型开放式指数证券投资基金（QDII）基金经理。2025 年 6 月 24 日起担任大成恒生医疗保健交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金（QDII）基金经理。具有基金从业资格。国籍：中国

注：1、任职日期、离任日期为本基金管理人作出决定之日。

2、证券从业年限的计算标准遵从中国证监会《证券基金经营机构董事、监事、高级管理人员及从业人员监督管理办法》的相关规定。

4.1.3 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理同时管理的产品情况

无。

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

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

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

报告期内，公司严格执行了公平交易的原则和制度。公司运用统计分析和工具，对旗下所有投资组合连续 4 个季度的日内、3 日内、5 日内及 10 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，同时结合交易价差专项统计分析，未发现违反公平交易原则的异常情况。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

报告期内，公司旗下所有投资组合未发现存在异常交易行为。公司旗下投资组合间存在证券同日反向交易，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证券当日成交量 5% 的情形。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

2025 年上半年，中国宏观经济运行总体平稳，主要经济指标呈现结构性分化特征。在外部环境复杂严峻的背景下，GDP 仍保持 5.3% 的同比增速，展现出较强的经济韧性。

4 月 2 日，特朗普政府施行新的关税政策，进一步加剧了宏观经济前景的不确定性。受此影响，港股市场出现剧烈波动，主要反映投资者对中国外需走弱可能拖累经济增长和企业盈利的担忧。5 月后，随着特朗普政府关税政策的实施细则逐渐明朗，市场预期趋于稳定，推动港股展开持续反弹行情。

美国新关税政策对科技股的直接影响较小，这是因为主要科技股公司的主营业务收入中直接

对美国出口的占比极低。关税的影响主要体现在如果经济增速下行会对恒生科技的需求产生一定的次生拖累，但中国有望加大内需刺激力度来有效对冲外部冲击，因此这种次生拖累的幅度可能非常有限。此外，中国科技产业的自主创新进程反而有望进一步加速。

2024 年财报数据表明，2024 年中华沪深港 300 指数主要成份股的总体利润取得了正增长，因此也推动了指数在 2025 年上半年的强劲上涨。

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 1.2035 元，本报告期基金份额净值增长率为 10.01%，同期业绩比较基准收益率为 7.78%；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 1.1973 元，本报告期基金份额净值增长率为 9.97%，同期业绩比较基准收益率为 7.78%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

7 月份的宏观经济指标小幅走弱，其中 7 月制造业 PMI 指数更是超预期回落至 49.3%，这主要是受高温多雨等极端天气影响以及“抢出口”步入尾声后出口动能也开始放缓等因素影响，但这也说明经济维持较弱的修复态势，经济增长动能高点或已过去。整体来看，下半年经济增速可能稍微弱于上半年，但是如果增长动能过低，中央政府有望采取进一步的经济刺激措施来托底。

同时，7 月份以来美国宏观经济也有边际走弱的趋势，因此市场对于美联储降息的预期有所提升。

来自彭博的一致预期数据显示 2025 年中华沪深港 300 指数成份股公司盈利仍然会有一定程度的增长，这使得指数的动态估值水平下降。当前，中华沪深港 300 指数 2025 年预期市盈率仍然低于历史平均水平，这带来了长期投资价值。

本基金的投资目标是要复制基准指数的收益率，因此本基金将坚持被动化的投资理念，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。估值委员会由公司分管领导、各投研部门、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。

各投研部门、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，并负责与托管人沟通估值调整事项；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，并与托管人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人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 60 个工作日资产净值低于五千万元的情形。我公司已根据法律法规及基金合同要求拟定相关应对方案上报中国证券监督管理委员会。自 2024 年 6 月 28 日起，由本基金管理人承担本基金的固定费用。

§ 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报告期内基金的投资运作，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合规守信、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：2025 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2025 年 6 月 30 日	上年度末 2024 年 12 月 31 日
资 产：			
货币资金	6.4.7.1	3,110,814.26	2,239,567.78
结算备付金		11.25	22.34
存出保证金		631.01	1,129.67
交易性金融资产	6.4.7.2	31,567,133.34	31,481,929.89
其中：股票投资		31,567,133.34	31,481,929.89
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		82,514.25	3,854.64
应收申购款		135,325.04	9,497.23
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.8	-	-
资产总计		34,896,429.15	33,736,001.55
负债和净资产	附注号	本期末 2025 年 6 月 30 日	上年度末 2024 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		11.01	15.72
应付赎回款		1,356,678.01	151,234.58
应付管理人报酬		13,890.53	14,317.65
应付托管费		2,778.10	2,863.53
应付销售服务费		368.68	384.17
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	4,252.57	34,329.02
负债合计		1,377,978.90	203,144.67
净资产:			
实收基金	6.4.7.10	27,871,896.85	30,669,820.41
未分配利润	6.4.7.12	5,646,553.40	2,863,036.47
净资产合计		33,518,450.25	33,532,856.88
负债和净资产总计		34,896,429.15	33,736,001.55

注： 报告截止日 2025 年 06 月 30 日,基金份额总额 27,871,896.85 份。其中大成中华沪深港 300 指数 (LOF) A 类基金份额总额为 23,838,544.47 份,基金份额净值 1.2035 元;大成中华沪深港 300 指数 (LOF) C 类基金份额总额为 4,033,352.38 份,基金份额净值 1.1973 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：2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日
一、营业总收入		3,383,786.38	1,109,810.36
1. 利息收入		6,055.70	7,197.41
其中：存款利息收入	6.4.7.13	6,055.70	7,197.41

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		-	-
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		344,140.48	-176,954.58
其中：股票投资收益	6.4.7.14	-141,860.21	-525,396.62
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.15	-	-
资产支持证券投资	6.4.7.16	-	-
收益			
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	486,000.69	348,442.04
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	3,025,425.60	1,277,822.24
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	8,164.60	1,745.29
减：二、营业总支出		104,245.29	137,427.37
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	82,637.22	64,983.92
其中：暂估管理人报酬		-	-
2. 托管费	6.4.10.2.2	16,527.43	12,996.79
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	2,107.30	826.17
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	2,973.34	58,620.49
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		3,279,541.09	972,382.99
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		3,279,541.09	972,382.99
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		3,279,541.09	972,382.99

6.3 净资产变动表

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：2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 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	30,669,820.41	-	2,863,036.47	33,532,856.88
二、本期期初净资产	30,669,820.41	-	2,863,036.47	33,532,856.88
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	-2,797,923.56	-	2,783,516.93	-14,406.63
（一）、综合收益总额	-	-	3,279,541.09	3,279,541.09
（二）、本期基金份额交易产生的净资产变动数 （净资产减少以“-”号填列）	-2,797,923.56	-	-496,024.16	-3,293,947.72
其中：1. 基金申购款	7,218,066.51	-	1,154,964.89	8,373,031.40
2. 基金赎回款	-10,015,990.07	-	-1,650,989.05	-11,666,979.12
（三）、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动（净资产减少以“-”号填列）	-	-	-	-
四、本期期末净资产	27,871,896.85	-	5,646,553.40	33,518,450.25
项目	上年度可比期间 2024 年 1 月 1 日至 2024 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	27,828,638.93	-	-1,743,555.40	26,085,083.53
二、本期期初净资产	27,828,638.93	-	-1,743,555.40	26,085,083.53
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	-540,779.52	-	1,020,095.04	479,315.52

(一)、综合收益总额	-	-	972,382.99	972,382.99
(二)、本期基金份额交易产生的净资产变动数 (净资产减少以“-”号填列)	-540,779.52	-	47,712.05	-493,067.47
其中：1. 基金申购款	2,504,236.59	-	-89,529.10	2,414,707.49
2. 基金赎回款	-3,045,016.11	-	137,241.15	-2,907,774.96
(三)、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动(净资产减少以“-”号填列)	-	-	-	-
四、本期期末净资产	27,287,859.41	-	-723,460.36	26,564,399.05

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：

<u>谭晓冈</u>	<u>范瑛</u>	<u>梁靖</u>
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》注册，由大成基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《大成中华沪深港 300 指数证券投资基金 (LOF) 基金合同》负责公开募集。本基金为上市契约型开放式 (LOF) 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） $\times 5\%$ 。

本财务报表由本基金的基金管理人大成基金管理有限公司于 2025 年 8 月 28 日批准报出。

6.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于 2006 年 2 月 15 日及以后期间颁布的《企业会计准则—基本准则》、各项具体会计准则、《资产管理产品相关会计处理规定》及其他相关规定（以下合称“企业会计准则”）、中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和中期报告>》、中国证券投资基金业协会（以下简称“中国基金业协会”）颁布的《证券投资基金会计核

算业务指引》、本基金基金合同和在财务报表附注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 2025 年 6 月 30 日的财务状况以及自 2025 年 1 月 1 日起至 2025 年 6 月 30 日止期间的经营成果和净资产变动情况等有关信息。

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

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 会计政策变更的说明

无。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

无。

6.4.5.3 差错更正的说明

无。

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》及其他相关境内外财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1) 资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人。资管产

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

对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税, 对国债、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 日前取得的基金、非货物期货, 可以选择按照实际买入价计算销售额, 或者以 2017 年最后一个交易日的基金份额净值、非货物期货结算价格作为买入价计算销售额。

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

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

(5) 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。根据财政部、国家税务总局公告 2023 年第 39 号《关于减半征收证券交易印花税的公告》, 自 2023 年 8 月 28 日起, 证券交易印花税实施减半征收。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。

(6) 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 货币资金

单位：人民币元

项目	本期末 2025 年 6 月 30 日
活期存款	3,110,814.26
等于：本金	3,110,545.82
加：应计利息	268.44
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	3,110,814.26

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末 2025 年 6 月 30 日			
		成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票		29,450,268.80	-	31,567,133.34	2,116,864.54
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		29,450,268.80	-	31,567,133.34	2,116,864.54

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
----	-----

	2025 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	3,874.36
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	378.21
其中：交易所市场	378.21
银行间市场	-
应付利息	-
合计	4,252.57

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	
	2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	26,651,456.05	26,651,456.05
本期申购	3,912,535.99	3,912,535.99
本期赎回（以“-”号填列）	-6,725,447.57	-6,725,447.57
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	23,838,544.47	23,838,544.47

大成中华沪深港 300 指数 (LOF) C

项目	本期	
	2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	4,018,364.36	4,018,364.36
本期申购	3,305,530.52	3,305,530.52
本期赎回（以“-”号填列）	-3,290,542.50	-3,290,542.50
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	4,033,352.38	4,033,352.38

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
上年度末	2,631,408.73	-125,328.24	2,506,080.49
本期期初	2,631,408.73	-125,328.24	2,506,080.49
本期利润	230,110.19	2,687,404.94	2,917,515.13
本期基金份额交易产生的变动数	-297,418.15	-275,439.37	-572,857.52
其中：基金申购款	414,591.29	161,998.34	576,589.63
基金赎回款	-712,009.44	-437,437.71	-1,149,447.15
本期已分配利润	-	-	-
本期末	2,564,100.77	2,286,637.33	4,850,738.10

大成中华沪深港 300 指数 (LOF) C

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	378,951.84	-21,995.86	356,955.98
本期期初	378,951.84	-21,995.86	356,955.98
本期利润	24,005.30	338,020.66	362,025.96
本期基金份额交易产生的变动数	10,536.89	66,296.47	76,833.36
其中：基金申购款	337,887.22	240,488.04	578,375.26
基金赎回款	-327,350.33	-174,191.57	-501,541.90
本期已分配利润	-	-	-
本期末	413,494.03	382,321.27	795,815.30

6.4.7.13 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	6,007.47
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	45.27
其他	2.96
合计	6,055.70

6.4.7.14 股票投资收益

6.4.7.14.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2025年1月1日至2025年6月30日
股票投资收益——买卖股票差价收入	-141,860.21
股票投资收益——赎回差价收入	-
股票投资收益——申购差价收入	-
股票投资收益——证券出借差价收入	-

合计	-141,860.21
----	-------------

6.4.7.14.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期
	2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
卖出股票成交总额	3,985,059.91
减：卖出股票成本总额	4,121,911.61
减：交易费用	5,008.51
买卖股票差价收入	-141,860.21

6.4.7.14.3 股票投资收益——证券出借差价收入

无。

6.4.7.15 债券投资收益

6.4.7.15.1 债券投资收益项目构成

无。

6.4.7.15.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

无。

6.4.7.15.3 债券投资收益——赎回差价收入

无。

6.4.7.15.4 债券投资收益——申购差价收入

无。

6.4.7.16 资产支持证券投资基金收益

6.4.7.16.1 资产支持证券投资基金收益项目构成

无。

6.4.7.16.2 资产支持证券投资基金收益——买卖资产支持证券差价收入

无。

6.4.7.16.3 资产支持证券投资基金收益——赎回差价收入

无。

6.4.7.16.4 资产支持证券投资基金收益——申购差价收入

无。

6.4.7.17 贵金属投资收益

6.4.7.17.1 贵金属投资收益项目构成

无。

6.4.7.17.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

无。

6.4.7.17.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

无。

6.4.7.17.4 贵金属投资收益——申购差价收入

无。

6.4.7.18 衍生工具收益

6.4.7.18.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

无。

6.4.7.18.2 衍生工具收益——其他投资收益

无。

6.4.7.19 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
股票投资产生的股利收益	486,000.69
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	486,000.69

6.4.7.20 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
1. 交易性金融资产	3,025,425.60
股票投资	3,025,425.60
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	3,025,425.60

6.4.7.21 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
基金赎回费收入	8,164.60
合计	8,164.60

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 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
审计费用	-
信息披露费	-
证券出借违约金	-
深港通证券组合费	643.93
银行划款手续费	2,329.41
合计	2,973.34

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

本基金本报告期存在控制关系或者其他重大利害关系的关联方未发生变化。

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
大成基金管理有限公司（“大成基金”）	基金管理人、基金销售机构
中国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 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2024 年 1 月 1 日至 2024 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	-	-	1,675,990.73	63.92

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 2025 年 1 月 1 日至 2025 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（%）
-	-	-	-	-
关联方名称	上年度可比期间 2024 年 1 月 1 日至 2024 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	1,233.28	60.83	1,233.28	69.60

注：1、上述佣金按协议约定的佣金率计算，佣金费率参考市场价格经本基金的基金管理人与对方协商确定；

2、根据《公开募集证券投资基金证券交易费用管理规定》，自 2024 年 7 月 1 日起，基金管理人管理的被动股票型基金的股票交易佣金费率原则上不得超过市场平均股票交易佣金费率，且不得通过交易佣金支付研究服务、流动性服务等其他费用；其他类型基金可以通过交易佣金支付研究服务费用，但股票交易佣金费率原则上不得超过市场平均股票交易佣金费率的两倍，且不得通过交易佣金支付研究服务之外的其他费用。

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 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	82,637.22	64,983.92
其中：应支付销售机构的客户维护费	37,772.59	28,667.93
应支付基金管理人的净管理费	44,864.63	36,315.99

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：

$$\text{日管理人报酬} = \text{前一日基金资产净值} \times 0.50\% / \text{当年天数}。$$

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	16,527.43	12,996.79

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：

$$\text{日托管费} = \text{前一日基金资产净值} \times 0.10\% / \text{当年天数}。$$

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 2025 年 1 月 1 日至 2025 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	-	35.12
合计	-	35.12	35.12
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2024 年 1 月 1 日至 2024 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	-	26.83	26.83
合计	-	26.83	26.83

注：C 类基金份额的销售服务费年费率为 0.1%。

销售服务费的计算方法如下：

$$H=E\times \text{该类基金份额销售服务费年费率}\div \text{当年天数}$$

H 为该类基金份额每日应计提的销售服务费

E 为该类基金份额前一日基金资产净值

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固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 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2024 年 1 月 1 日至 2024 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	3,110,814.26	6,007.47	2,122,548.85	7,156.15

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（2025 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

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末 估值单 价	复牌 日期	复牌 开盘单 价	数量 (股)	期末 成本总额	期末 估值总 额	备注
01821	ESR	2025 年 6 月 17 日	重大事 项停牌	11.80	-	-	2,600	46,716.64	30,681.65	-

注：ESR，股票代码 01821 HK，已于 2025 年 7 月 4 日起退市。

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、拒绝支付到期本息等情况,导致基金资产损失和收益变化的风险。

本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的银行存款存放在本基金的托管人中国农业银行股份有限公司,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。

本基金的基金管理人建立了信用风险管理流程,通过对投资品种信用等级评估来控制证券发行人的信用风险。信用等级评估以内部信用评级为主,外部信用评级为辅。内部债券信用评级主要考察发行人的经营风险、财务风险和流动性风险,以及信用产品的条款和担保人的情况等。此外,本基金的基金管理人根据信用产品的内部评级,通过单只信用产品投资占基金资产净值的比例及占发行量的比例进行控制,通过分散化投资以分散信用风险。

本期末,本基金无债券投资(上年度末:同)。

6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金在履行与金融负债有关的义务时遇到资金短缺的风险。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额,另一方面来自于投资品种

所处的交易市场不活跃而带来的变现困难或因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理的价格变现。

6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

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

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

6.4.13.4 市场风险

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

6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指金融工具的公允价值或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、结算备付金和存出保证金等。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2025 年 6 月 30 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
货币资金	3,110,814.26	-	-	-	3,110,814.26
结算备付金	11.25	-	-	-	11.25
存出保证金	631.01	-	-	-	631.01
交易性金融资产	-	-	-	31,567,133.34	31,567,133.34
应收股利	-	-	-	82,514.25	82,514.25
应收申购款	500.00	-	-	134,825.04	135,325.04
资产总计	3,111,956.52	-	-	31,784,472.63	34,896,429.15
负债					
应付赎回款	-	-	-	1,356,678.01	1,356,678.01
应付管理人报酬	-	-	-	13,890.53	13,890.53
应付托管费	-	-	-	2,778.10	2,778.10
应付清算款	-	-	-	11.01	11.01
应付销售服务费	-	-	-	368.68	368.68
其他负债	-	-	-	4,252.57	4,252.57
负债总计	-	-	-	1,377,978.90	1,377,978.90
利率敏感度缺口	3,111,956.52	-	-	30,406,493.73	33,518,450.25
上年度末 2024 年 12 月 31 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
货币资金	2,239,567.78	-	-	-	2,239,567.78
结算备付金	22.34	-	-	-	22.34
存出保证金	1,129.67	-	-	-	1,129.67
交易性金融资产	-	-	-	31,481,929.89	31,481,929.89
应收股利	-	-	-	3,854.64	3,854.64
应收申购款	-	-	-	9,497.23	9,497.23
资产总计	2,240,719.79	-	-	31,495,281.76	33,736,001.55
负债					
应付赎回款	-	-	-	151,234.58	151,234.58
应付管理人报酬	-	-	-	14,317.65	14,317.65
应付托管费	-	-	-	2,863.53	2,863.53
应付清算款	-	-	-	15.72	15.72
应付销售服务费	-	-	-	384.17	384.17
其他负债	-	-	-	34,329.02	34,329.02
负债总计	-	-	-	203,144.67	203,144.67
利率敏感度缺口	2,240,719.79	-	-	31,292,137.09	33,532,856.88

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

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

于本期末，本基金未持有交易性债券投资和交易性资产支持证券投资(上年度末：同)，因此市场利率的变动对于本基金净资产无重大影响(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 2025 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	-	16,752,277.38	-	16,752,277.38
资产合计	-	16,752,277.38	-	16,752,277.38
以外币计价的负债				
负债合计	-	-	-	-
资产负债表外 外汇风险敞口净额	-	16,752,277.38	-	16,752,277.38
项目	上年度末 2024 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	-	15,147,536.12	-	15,147,536.12
资产合计	-	15,147,536.12	-	15,147,536.12

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	-	15,147,536.12	-	15,147,536.12

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		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2025 年 6 月 30 日）	上年度末（2024 年 12 月 31 日）
	所有外币相对人民币升值 5%	837,613.87	757,376.84
	所有外币相对人民币贬值 5%	-837,613.87	-757,376.84

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 2025 年 6 月 30 日		上年度末 2024 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	31,567,133.34	94.18	31,481,929.89	93.88
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	31,567,133.34	94.18	31,481,929.89	93.88

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除业绩比较基准以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2025 年 6 月 30 日）	上年度末（2024 年 12 月 31 日）
	业绩比较基准上升 5%	1,669,737.60	1,585,720.79
	业绩比较基准下降 5%	-1,669,737.60	-1,585,720.79

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 2025 年 6 月 30 日	上年度末 2024 年 12 月 31 日
第一层次	31,536,451.69	31,445,107.89
第二层次	30,681.65	36,822.00
第三层次	—	—
合计	31,567,133.34	31,481,929.89

6.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

本基金以导致各层次之间转换的事项发生日为确认各层次之间转换的时点。

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

6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

于本期末，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融工具（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货币资金、应收款项和其他金融负债等，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

截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

§ 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	31,567,133.34	90.46
	其中：股票	31,567,133.34	90.46
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	3,110,825.51	8.91
8	其他各项资产	218,470.30	0.63
9	合计	34,896,429.15	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 16,752,277.38 元，占期末基金资产净值的比例为 49.98%。

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	174,580.78	0.52
B	采矿业	773,911.25	2.31
C	制造业	7,447,926.81	22.22
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	559,352.56	1.67
E	建筑业	242,194.00	0.72
F	批发和零售业	31,480.80	0.09
G	交通运输、仓储和邮政业	485,827.00	1.45
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	674,275.81	2.01
J	金融业	3,964,830.27	11.83
K	房地产业	113,191.00	0.34
L	租赁和商务服务业	110,826.00	0.33
M	科学研究和技术服务业	168,217.60	0.50
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	48,310.08	0.14
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	14,794,923.96	44.14

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	19,932.00	0.06
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
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	-	-
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	19,932.00	0.06

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（%）
通讯	3,858,229.54	11.51
非必需消费品	3,117,265.30	9.30
必需消费品	493,158.13	1.47
能源	453,029.11	1.35
金融	5,538,486.75	16.52
房地产	635,124.30	1.89
医疗保健	498,205.13	1.49
工业	306,981.52	0.92
材料	234,006.37	0.70
科技	1,248,289.41	3.72
公用事业	369,501.82	1.10
政府	-	-

合计	16,752,277.38	49.98
----	---------------	-------

注：以上分类采用彭博行业分类标准。

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	5,570	2,555,019.43	7.62
2	09988	阿里巴巴-W	16,500	1,652,179.82	4.93
3	00005	汇丰控股	15,143	1,311,227.11	3.91
4	01810	小米集团-W	15,800	863,808.16	2.58
5	002594	比亚迪	800	265,528.00	0.79
5	01211	比亚迪股份	5,000	558,569.38	1.67
6	601318	中国平安	9,101	504,923.48	1.51
6	02318	中国平安	6,500	295,494.60	0.88
7	00939	建设银行	108,000	780,045.55	2.33
8	600519	贵州茅台	500	704,760.00	2.10
9	600036	招商银行	10,400	477,880.00	1.43
9	03968	招商银行	4,000	200,081.83	0.60
10	601398	工商银行	29,500	223,905.00	0.67
10	01398	工商银行	78,000	442,441.66	1.32
11	03690	美团-W	5,247	599,560.71	1.79
12	01299	友邦保险	9,200	590,651.78	1.76
13	300750	宁德时代	2,240	564,972.80	1.69
14	600941	中国移动	800	90,040.00	0.27
14	00941	中国移动	5,487	435,837.05	1.30
15	00388	香港交易所	1,089	415,915.95	1.24
16	601899	紫金矿业	13,900	271,050.00	0.81
16	02899	紫金矿业	6,000	109,707.59	0.33
17	601988	中国银行	10,900	61,258.00	0.18
17	03988	中国银行	75,000	311,886.90	0.93
18	601166	兴业银行	14,400	336,096.00	1.00
19	000333	美的集团	4,300	310,460.00	0.93
20	600900	长江电力	10,300	310,442.00	0.93
21	688981	中芯国际	1,600	141,072.00	0.42
21	00981	中芯国际	4,000	163,056.66	0.49
22	601328	交通银行	19,800	158,400.00	0.47
22	03328	交通银行	16,000	106,515.76	0.32
23	00883	中国海洋石油	16,098	260,139.72	0.78
24	300059	东方财富	10,923	252,648.99	0.75
25	02888	渣打集团	2,050	244,717.22	0.73
26	600030	中信证券	8,200	226,484.00	0.68
27	02378	保诚	2,400	213,724.60	0.64

28	000858	五 粮 液	1,700	202,130.00	0.60
29	601088	中国神华	2,800	113,512.00	0.34
29	01088	中国神华	3,000	83,306.63	0.25
30	600276	恒瑞医药	3,768	195,559.20	0.58
31	601857	中国石油	9,500	81,225.00	0.24
31	00857	中国石油股份	18,000	110,801.93	0.33
32	601211	国泰海通	9,800	187,768.00	0.56
33	000651	格力电器	3,800	170,696.00	0.51
34	601601	中国太保	2,900	108,779.00	0.32
34	02601	中国太保	2,400	58,766.06	0.18
35	601728	中国电信	13,100	101,525.00	0.30
35	00728	中国电信	12,000	61,064.17	0.18
36	06160	百济神州	1,200	161,743.45	0.48
37	601628	中国人寿	1,400	57,666.00	0.17
37	02628	中国人寿	5,968	102,537.03	0.31
38	01024	快手-W	2,700	155,861.37	0.47
39	600028	中国石化	12,300	69,372.00	0.21
39	00386	中国石油化工股份	21,901	82,087.46	0.24
40	600887	伊利股份	5,400	150,552.00	0.45
41	600919	江苏银行	12,400	148,056.00	0.44
42	002475	立讯精密	4,247	147,328.43	0.44
43	603259	药明康德	2,112	146,889.60	0.44
44	09992	泡泡玛特	600	145,875.52	0.44
45	600000	浦发银行	9,900	137,412.00	0.41
46	601816	京沪高铁	23,400	134,550.00	0.40
47	002371	北方华创	300	132,663.00	0.40
48	600690	海尔智家	3,200	79,296.00	0.24
48	06690	海尔智家	2,600	53,230.52	0.16
49	02015	理想汽车-W	1,300	126,852.25	0.38
50	000725	京东方 A	31,100	124,089.00	0.37
51	02388	中银香港	3,936	122,399.74	0.37
52	00016	新鸿基地产	1,484	121,867.71	0.36
53	688256	寒武纪	200	120,300.00	0.36
54	00002	中电控股	1,992	120,077.55	0.36
55	00669	创科实业	1,500	118,051.93	0.35
56	300760	迈瑞医疗	500	112,375.00	0.34
57	09987	百胜中国	350	112,160.73	0.33
58	00001	长和	2,485	109,457.25	0.33
59	09868	小鹏汽车-W	1,700	109,452.24	0.33
60	300308	中际旭创	740	107,936.40	0.32
61	01801	信达生物	1,500	107,245.32	0.32
62	300502	新易盛	840	106,696.80	0.32
63	02020	安踏体育	1,200	103,415.13	0.31

64	300124	汇川技术	1,600	103,312.00	0.31
65	601668	中国建筑	17,500	100,975.00	0.30
66	601998	中信银行	4,600	39,100.00	0.12
66	00998	中信银行	9,000	61,392.47	0.18
67	688041	海光信息	700	98,903.00	0.30
68	000001	平安银行	8,160	98,491.20	0.29
69	002352	顺丰控股	2,000	97,520.00	0.29
70	002714	牧原股份	2,318	97,379.18	0.29
71	600016	民生银行	20,500	97,375.00	0.29
72	601658	邮储银行	9,400	51,418.00	0.15
72	01658	邮储银行	9,000	44,977.37	0.13
73	002230	科大讯飞	2,000	95,760.00	0.29
74	02423	贝壳-W	2,200	95,098.15	0.28
75	601127	赛力斯	700	94,024.00	0.28
76	600031	三一重工	5,000	89,750.00	0.27
77	601229	上海银行	8,400	89,124.00	0.27
78	300274	阳光电源	1,300	88,101.00	0.26
79	000063	中兴通讯	2,700	87,723.00	0.26
80	600309	万华化学	1,600	86,816.00	0.26
81	603501	豪威集团	675	86,163.75	0.26
82	002415	海康威视	3,100	85,963.00	0.26
83	601169	北京银行	12,500	85,375.00	0.25
84	02328	中国财险	6,000	83,169.84	0.25
85	02269	药明生物	3,500	81,870.31	0.24
86	601919	中远海控	5,400	81,216.00	0.24
87	00267	中信股份	7,913	77,791.29	0.23
88	300498	温氏股份	4,520	77,201.60	0.23
89	601688	华泰证券	4,300	76,583.00	0.23
90	601012	隆基绿能	5,092	76,481.84	0.23
91	002142	宁波银行	2,750	75,240.00	0.22
92	600406	国电南瑞	3,341	74,871.81	0.22
93	00011	恒生银行	697	74,749.99	0.22
94	600660	福耀玻璃	1,300	74,113.00	0.22
95	00175	吉利汽车	4,964	72,249.64	0.22
96	601766	中国中车	10,200	71,808.00	0.21
97	01109	华润置地	2,957	71,730.52	0.21
98	600050	中国联通	13,400	71,556.00	0.21
99	000338	潍柴动力	4,600	70,748.00	0.21
100	601138	工业富联	3,300	70,554.00	0.21
101	00006	电能实业	1,496	68,827.78	0.21
102	000100	TCL 科技	15,860	68,673.80	0.20
103	000568	泸州老窖	600	68,040.00	0.20
104	00992	联想集团	7,882	67,710.86	0.20

105	600809	山西汾酒	380	67,028.20	0.20
106	09633	农夫山泉	1,800	65,824.55	0.20
107	601818	光大银行	15,600	64,740.00	0.19
108	601985	中国核电	6,900	64,308.00	0.19
109	00027	银河娱乐	2,000	63,562.92	0.19
110	601225	陕西煤业	3,300	63,492.00	0.19
111	605499	东鹏饮料	200	62,810.00	0.19
112	01113	长实集团	1,987	62,696.74	0.19
113	600104	上汽集团	3,900	62,595.00	0.19
114	00003	香港中华煤气	10,393	62,459.34	0.19
115	002027	分众传媒	8,500	62,050.00	0.19
116	600150	中国船舶	1,900	61,826.00	0.18
117	600436	片仔癀	300	60,003.00	0.18
118	02057	中通快递-W	450	56,837.28	0.17
119	00288	万洲国际	8,221	56,603.41	0.17
120	601006	大秦铁路	8,400	55,440.00	0.17
121	600999	招商证券	3,140	55,232.60	0.16
122	688012	中微公司	300	54,690.00	0.16
123	000792	盐湖股份	3,200	54,656.00	0.16
124	300033	同花顺	200	54,602.00	0.16
125	03692	翰森制药	2,000	54,261.03	0.16
126	600760	中航沈飞	920	53,930.40	0.16
127	000625	长安汽车	4,196	53,540.96	0.16
128	603288	海天味业	1,371	53,345.61	0.16
129	09660	地平线机器人 -W	9,000	53,267.00	0.16
130	000425	徐工机械	6,800	52,836.00	0.16
131	601009	南京银行	4,500	52,290.00	0.16
132	002625	光启技术	1,300	51,974.00	0.16
133	600905	三峡能源	12,100	51,546.00	0.15
134	688271	联影医疗	400	51,096.00	0.15
135	00762	中国联通	6,000	50,886.81	0.15
136	603993	洛阳钼业	6,000	50,520.00	0.15
137	002050	三花智控	1,877	49,515.26	0.15
138	600048	保利发展	6,100	49,410.00	0.15
139	00688	中国海外发展	3,954	49,111.68	0.15
140	002241	歌尔股份	2,100	48,972.00	0.15
141	601888	中国中免	800	48,776.00	0.15
142	600019	宝钢股份	7,400	48,766.00	0.15
143	300015	爱尔眼科	3,871	48,310.08	0.14
144	601390	中国中铁	8,600	48,246.00	0.14
145	01177	中国生物制药	10,000	47,968.57	0.14
146	600547	山东黄金	1,500	47,895.00	0.14
147	601600	中国铝业	6,700	47,168.00	0.14

148	002463	沪电股份	1,100	46,838.00	0.14
149	300014	亿纬锂能	1,000	45,810.00	0.14
150	000977	浪潮信息	900	45,792.00	0.14
151	002601	龙佰集团	2,800	45,388.00	0.14
152	01093	石药集团	6,425	45,116.45	0.13
153	601989	中国重工	9,600	44,544.00	0.13
154	02382	舜宇光学科技	700	44,270.61	0.13
155	06618	京东健康	1,100	43,135.24	0.13
156	02319	蒙牛乳业	2,925	42,946.01	0.13
157	600585	海螺水泥	2,000	42,940.00	0.13
158	002179	中航光电	1,062	42,862.32	0.13
159	600015	华夏银行	5,400	42,714.00	0.13
160	000538	云南白药	760	42,400.40	0.13
161	600893	航发动力	1,100	42,394.00	0.13
162	000776	广发证券	2,500	42,025.00	0.13
163	002311	海大集团	700	41,013.00	0.12
164	01378	中国宏桥	2,500	40,992.15	0.12
165	02313	申洲国际	800	40,709.45	0.12
166	000938	紫光股份	1,696	40,687.04	0.12
167	02688	新奥能源	700	40,025.49	0.12
168	01519	极兔速递-W	6,400	39,571.33	0.12
169	01997	九龙仓置业	1,923	38,931.69	0.12
170	00066	港铁公司	1,505	38,704.07	0.12
171	600438	通威股份	2,300	38,525.00	0.11
172	000166	申万宏源	7,600	38,152.00	0.11
173	300433	蓝思科技	1,700	37,910.00	0.11
174	600795	国电电力	7,700	37,268.00	0.11
175	002049	紫光国微	560	36,881.60	0.11
176	300408	三环集团	1,100	36,740.00	0.11
177	000002	万 科 A	5,700	36,594.00	0.11
178	002028	思源电气	500	36,455.00	0.11
179	601100	恒立液压	500	36,000.00	0.11
180	002422	科伦药业	1,000	35,920.00	0.11
181	601669	中国电建	7,200	35,064.00	0.10
182	00836	华润电力	2,000	34,544.67	0.10
183	600010	包钢股份	19,000	34,010.00	0.10
184	00291	华润啤酒	1,488	33,924.54	0.10
185	300394	天孚通信	420	33,532.80	0.10
186	06969	思摩尔国际	2,000	33,267.94	0.10
187	000768	中航西飞	1,200	32,808.00	0.10
188	002304	洋河股份	500	32,275.00	0.10
189	688036	传音控股	400	31,880.00	0.10
190	600009	上海机场	1,000	31,770.00	0.09

191	000963	华东医药	780	31,480.80	0.09
192	601186	中国铁建	3,900	31,239.00	0.09
193	002460	赣锋锂业	920	31,068.40	0.09
194	01821	ESR	2,600	30,681.65	0.09
195	00019	太古股份公司 A	500	30,664.32	0.09
196	000157	中联重科	4,200	30,366.00	0.09
197	00083	信和置业	3,929	29,918.48	0.09
198	01928	金沙中国有限 公司	2,000	29,802.53	0.09
199	000661	长春高新	300	29,754.00	0.09
200	300442	润泽科技	600	29,718.00	0.09
201	600886	国投电力	2,000	29,480.00	0.09
202	600989	宝丰能源	1,800	29,052.00	0.09
203	00285	比亚迪电子	1,000	29,000.01	0.09
204	002466	天齐锂业	900	28,836.00	0.09
205	000807	云铝股份	1,800	28,764.00	0.09
206	601995	中金公司	800	28,288.00	0.08
207	002916	深南电路	260	28,030.60	0.08
208	688111	金山办公	100	28,005.00	0.08
209	00135	昆仑能源	4,000	27,796.24	0.08
210	002736	国信证券	2,400	27,648.00	0.08
211	002001	新 和 成	1,288	27,395.76	0.08
212	001979	招商蛇口	3,100	27,187.00	0.08
213	00020	商汤-W	20,000	27,176.11	0.08
213	06862	海底捞	2,000	27,176.11	0.08
215	002236	大华股份	1,700	26,996.00	0.08
216	002252	上海莱士	3,900	26,793.00	0.08
217	601800	中国交建	3,000	26,670.00	0.08
218	600029	南方航空	4,500	26,550.00	0.08
219	000975	山金国际	1,400	26,516.00	0.08
220	601066	中信建投	1,100	26,455.00	0.08
221	600011	华能国际	3,700	26,418.00	0.08
222	302132	中航成飞	300	26,382.00	0.08
223	06186	中国飞鹤	5,000	26,036.17	0.08
224	00241	阿里健康	6,021	26,026.63	0.08
225	601111	中国国航	3,200	25,248.00	0.08
226	600346	恒力石化	1,740	24,812.40	0.07
227	301269	华大九天	200	24,776.00	0.07
228	00012	恒基地产	980	24,532.37	0.07
229	300896	爱美客	140	24,473.40	0.07
230	00151	中国旺旺	4,869	24,332.76	0.07
231	003816	中国广核	6,579	23,947.56	0.07
232	002648	卫星化学	1,380	23,915.40	0.07

233	01038	长江基建集团	500	23,687.90	0.07
234	601633	长城汽车	1,100	23,628.00	0.07
235	300418	昆仑万维	700	23,541.00	0.07
236	601319	中国人保	2,700	23,517.00	0.07
237	603392	万泰生物	366	22,326.00	0.07
238	01929	周大福	1,800	22,029.06	0.07
239	000895	双汇发展	900	21,969.00	0.07
240	300347	泰格医药	400	21,328.00	0.06
241	000786	北新建材	800	21,184.00	0.06
242	00322	康师傅控股	2,000	20,974.85	0.06
243	01209	华润万象生活	600	20,765.10	0.06
244	00004	九龙仓集团	950	20,705.82	0.06
245	002493	荣盛石化	2,500	20,700.00	0.06
246	002600	领益智造	2,400	20,616.00	0.06
247	00960	龙湖集团	2,433	20,545.85	0.06
248	002920	德赛西威	200	20,426.00	0.06
249	001965	招商公路	1,700	20,400.00	0.06
250	02618	京东物流	1,700	20,371.14	0.06
251	300782	卓胜微	284	20,269.08	0.06
252	300122	智飞生物	1,000	19,590.00	0.06
253	002938	鹏鼎控股	600	19,218.00	0.06
254	600188	兖矿能源	1,525	18,559.25	0.06
255	000301	东方盛虹	2,200	18,326.00	0.05
256	01972	太古地产	1,000	17,874.22	0.05
257	000876	新希望	1,900	17,822.00	0.05
258	300832	新产业	300	17,016.00	0.05
259	601898	中煤能源	1,500	16,410.00	0.05
260	002459	晶澳科技	1,632	16,287.36	0.05
261	000999	华润三九	520	16,265.60	0.05
262	000983	山西焦煤	2,400	15,360.00	0.05
263	000617	中油资本	2,080	15,184.00	0.05
264	300999	金龙鱼	500	14,765.00	0.04
265	01193	华润燃气	800	14,627.68	0.04
266	300628	亿联网络	420	14,599.20	0.04
267	600025	华能水电	1,500	14,325.00	0.04
268	300413	芒果超媒	650	14,183.00	0.04
269	300316	晶盛机电	500	13,575.00	0.04
270	603195	公牛集团	280	13,510.00	0.04
271	000596	古井贡酒	100	13,315.00	0.04
272	600018	上港集团	2,300	13,133.00	0.04
273	01876	百威亚太	1,500	10,628.78	0.03
274	00293	国泰航空	1,000	9,757.87	0.03
275	000708	中信特钢	800	9,408.00	0.03

276	000877	天山股份	1,200	5,568.00	0.02
277	300979	华利集团	100	5,257.00	0.02
278	001289	龙源电力	100	1,618.00	0.00

注：对于同时在 A+H 股上市的股票（如有），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	002709	天赐材料	1,100	19,932.00	0.06
2	00384	中国燃气	171	1,143.07	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	01211	比亚迪股份	228,586.18	0.68
2	09992	泡泡玛特	137,041.80	0.41
3	688256	寒武纪	116,705.86	0.35
4	601211	国泰海通	104,652.00	0.31
5	02423	贝壳-W	95,399.92	0.28
6	605499	东鹏饮料	64,117.00	0.19
7	09660	地平线机器人-W	52,594.42	0.16
8	601166	兴业银行	52,404.00	0.16
9	002625	光启技术	48,464.00	0.14
10	600795	国电电力	36,344.00	0.11
11	000807	云铝股份	27,360.00	0.08
12	300442	润泽科技	25,812.00	0.08
13	302132	中航成飞	25,488.00	0.08
14	688271	联影医疗	25,436.00	0.08
15	002601	龙佰集团	22,484.00	0.07
16	002600	领益智造	19,776.00	0.06
17	002230	科大讯飞	18,560.00	0.06
18	601998	中信银行	14,671.00	0.04
19	000333	美的集团	14,326.00	0.04
20	06160	百济神州	13,820.28	0.04

注：1. 本期累计买入金额指买入成交金额（成交单价乘以成交数量），不考虑相关交易费用。

2. 对于同时在 A+H 股上市的股票（如有），合并计算公允价值参与排序，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	601728	中国电信	13,603.00	0.04
1	00728	中国电信	621,638.07	1.85
2	00700	腾讯控股	230,058.87	0.69
3	09988	阿里巴巴-W	186,939.24	0.56
4	600519	贵州茅台	153,091.00	0.46
5	00005	汇丰控股	133,306.25	0.40
6	600837	海通证券	90,804.00	0.27
7	00939	建设银行	87,751.24	0.26
8	600036	招商银行	59,297.00	0.18
8	03968	招商银行	20,690.76	0.06
9	300750	宁德时代	79,834.00	0.24
10	601318	中国平安	56,450.00	0.17
10	02318	中国平安	21,765.00	0.06
11	601988	中国银行	50,676.00	0.15
11	03988	中国银行	16,178.96	0.05
12	600111	北方稀土	58,006.00	0.17
13	03690	美团-W	53,675.03	0.16
14	601328	交通银行	46,703.00	0.14
14	03328	交通银行	6,193.22	0.02
15	01299	友邦保险	48,044.27	0.14
16	601398	工商银行	26,765.00	0.08
16	01398	工商银行	20,774.82	0.06
17	000333	美的集团	42,966.00	0.13
18	600900	长江电力	38,633.00	0.12
19	01810	小米集团-W	38,373.65	0.11
20	00941	中国移动	37,764.37	0.11

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（如有），合并计算公允价值参与排序，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	1,181,689.46
卖出股票收入（成交）总额	3,985,059.91

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

本基金投资的前十名证券建设银行的发行主体中国建设银行股份有限公司于 2025 年 3 月 27 日因违反金融统计相关规定等受到中国人民银行处罚（银罚决字〔2025〕1 号）。建设银行为本基金跟踪标的指数的成分券。

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	631.01
2	应收清算款	-
3	应收股利	82,514.25
4	应收利息	-
5	应收申购款	135,325.04

6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	218,470.30

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

无。

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

7.12.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

无。

7.12.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

无。

7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入原因，分项之和与合计可能有尾差。

§ 8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额级别	持有人 户数 (户)	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	3,229	7,382.64	28,234.84	0.12	23,810,309.63	99.88
大成中华 沪 深 港 300 指 数 (LOF) C	782	5,157.74	0.00	0.00	4,033,352.38	100.00
合计	4,011	6,948.86	28,234.84	0.10	27,843,662.01	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

序号	持有人名称	持有份额（份）	占上市总份额比例（%）
1	杨凯	810,058.00	47.78
2	徐青松	219,300.00	12.94
3	王哲	108,500.00	6.40
4	陈钰林	100,000.00	5.90
5	万鹏	83,200.00	4.91
6	郑双双	27,983.00	1.41
7	邵常红	24,715.00	1.46
8	吴朝霞	21,900.00	1.29
9	吴晟铠	21,200.00	1.25
10	王春华	19,591.00	1.16

注：以上数据由中国证券登记结算有限责任公司提供，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	60.89	0.0003
	大成中华沪深港 300 指数 (LOF) C	1,380.73	0.0342
	合计	1,441.62	0.0052

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
	合计	0
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	26,651,456.05	4,018,364.36
本报告期基金总申购份额	3,912,535.99	3,305,530.52
减:本报告期基金总赎回份额	6,725,447.57	3,290,542.50
本报告期基金拆分变动份额	—	—
本报告期期末基金份额总额	23,838,544.47	4,033,352.38

§ 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

2025 年 2 月, 中国农业银行总行决定陈振华任托管业务部副总裁。

2025 年 3 月, 中国农业银行总行决定常佳任托管业务部副总裁。

2025 年 4 月, 中国农业银行总行决定李亚红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

本报告期内无涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

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

本基金自基金合同生效日起聘请普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)为本基金提供审计服务, 自 2024 年 12 月 11 日起, 改聘容诚会计师事务所(特殊普通合伙)为本基金提供审计服务至今。

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

10.6.1 管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，基金管理人及其相关高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

10.6.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

无。

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 (%)	
华泰证券	1	3,420,870.51	66.21	670.51	66.21	—
国信证券	1	1,745,878.86	33.79	342.20	33.79	—
爱建证券	1	—	—	—	—	—
财通证券	1	—	—	—	—	—
第一创业	1	—	—	—	—	—
东北证券	2	—	—	—	—	—
东财证券	1	—	—	—	—	—
东方证券	1	—	—	—	—	—
东吴证券	1	—	—	—	—	—
东兴证券	1	—	—	—	—	—
方正证券	1	—	—	—	—	—
高盛中国 证券	1	—	—	—	—	—
光大证券	2	—	—	—	—	—
广发证券	2	—	—	—	—	—
国金证券	2	—	—	—	—	—
国盛证券	1	—	—	—	—	—
国泰海通	4	—	—	—	—	—
国投证券	1	—	—	—	—	—
红塔证券	1	—	—	—	—	—
华创证券	1	—	—	—	—	—
民生证券	1	—	—	—	—	—
南京证券	1	—	—	—	—	—
平安证券	1	—	—	—	—	—
瑞银证券	2	—	—	—	—	—
山西证券	1	—	—	—	—	—
上海证券	1	—	—	—	—	—
申万宏源	1	—	—	—	—	—

天风证券	1	-	-	-	-	-
万和证券	1	-	-	-	-	-
西部证券	1	-	-	-	-	-
信达证券	1	-	-	-	-	-
兴业证券	2	-	-	-	-	-
野村东方 国际证券	1	-	-	-	-	新增 1 个
粤开证券	1	-	-	-	-	-
招商证券	2	-	-	-	-	-
浙商证券	1	-	-	-	-	-
中国银河 证券	3	-	-	-	-	-
中金公司	2	-	-	-	-	-
中泰证券	2	-	-	-	-	-
中信建投 证券	2	-	-	-	-	-
中信证券	4	-	-	-	-	-
中银国际 证券	1	-	-	-	-	-

注：本基金采用托管人结算模式，本基金管理人负责选择证券经纪商，租用其交易单元作为本基金的交易单元。证券经纪商的选择标准和流程如下：

（一）筛选标准

大成基金管理有限公司（以下简称“公司”）严格按照《公开募集证券投资基金证券交易费用管理规定》要求制定了证券公司筛选标准，建立了证券公司尽职调查、证券公司负面筛查、备选池筛选机制，选择财务状况良好，经营行为规范，合规风控能力和交易、研究等服务能力较强的证券公司参与证券交易。

（二）筛选流程

1、经公司尽调符合条件的证券公司进入备选池，由股票投委会以公平、公正、公开为原则，结合定性及定量办法科学评估证券公司研究服务能力，形成证券公司白名单，并定期及不定期进行动态调整。

2、公司按照白名单与证券公司进行协议签署。

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) (C 类份额) 基金产品资料概要	中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本	2025 年 6 月 30 日

	更新	公司网站	
2	大成基金管理有限公司关于再次提请投资者及时更新已过期身份证件及其他身份基本信息的公告	中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站	2025 年 6 月 30 日
3	大成中华沪深港 300 指数证券投资基金 (LOF) (A 类份额) 基金产品资料概要更新	中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站	2025 年 6 月 30 日
4	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	2025 年 6 月 27 日
5	大成基金管理有限公司提醒投资者谨防金融诈骗的公告	中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站	2025 年 6 月 6 日
6	大成基金管理有限公司关于旗下部分基金估值调整情况的公告	中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站	2025 年 6 月 6 日
7	大成基金管理有限公司提醒投资者谨防金融诈骗的公告	中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站	2025 年 4 月 26 日
8	大成中华沪深港 300 指数证券投资基金 (LOF) 2025 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	2025 年 4 月 22 日
9	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	2025 年 4 月 19 日
10	大成中华沪深港 300 指数证券投资基金 (LOF) 暂停申购、赎回及定投业务的公告	中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站	2025 年 4 月 16 日
11	大成中华沪深港 300 指数证券投资基金 (LOF) 2024 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	2025 年 3 月 31 日
12	大成基金管理有限公司旗下公募基金通过证券公司证券交易及佣金支付情况 (2024 年度)	中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站	2025 年 3 月 31 日
13	大成基金管理有限公司关于旗下部分基金估值调整情况的公告	中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站	2025 年 3 月 25 日
14	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	2025 年 3 月 21 日
15	大成中华沪深港 300 指数证券投资基金 (LOF) (A 类份额) 基金产品资料概要更新	中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站	2025 年 3 月 21 日
16	大成中华沪深港 300 指数证券投资基	中国证监会基金电子披	2025 年 3 月 21 日

	金 (LOF) (C 类份额) 基金产品资料概要更新	露网站、规定报刊及本公司网站	
17	大成中华沪深港 300 指数证券投资基金 (LOF) 托管协议	中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站	2025 年 3 月 20 日
18	大成中华沪深港 300 指数证券投资基金 (LOF) 基金合同	中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站	2025 年 3 月 20 日
19	关于大成基金管理有限公司旗下部分指数基金指数使用费调整为基金管理人承担并修订基金合同的公告	中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站	2025 年 3 月 19 日
20	大成中华沪深港 300 指数证券投资基金 (LOF) 2024 年第 4 季度报告	中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站	2025 年 1 月 22 日

§ 11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

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

2025 年 8 月 29 日