

大成沪深 300 指数证券投资基金 2026 年中期报告

2026 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：2026 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。

基金托管人中国农业银行股份有限公司根据本基金合同约定，于 2026 年 08 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 2026 年 01 月 01 日起至 06 月 30 日止。

1.2 目录

§ 1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
§ 2 基金简介	5
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人和基金托管人	5
2.4 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	10
4.1 基金管理人及基金经理情况	10
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	13
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	14
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	14
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	15
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	15
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	16
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	16
§ 5 托管人报告	16
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	16
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	16
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	16
§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）	17
6.1 资产负债表	17
6.2 利润表	18
6.3 净资产变动表	19
6.4 报表附注	21
§ 7 投资组合报告	45
7.1 期末基金资产组合情况	45
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	46
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细	47
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	55
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	57
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	57
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	57
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	57

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	57
7.10 本基金投资股指期货的投资政策	57
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	57
7.12 投资组合报告附注	57
§ 8 基金份额持有人信息	58
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	58
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	59
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况	59
§ 9 开放式基金份额变动	59
§ 10 重大事件揭示	60
10.1 基金份额持有人大会决议	60
10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动	60
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	60
10.4 基金投资策略的改变	60
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	60
10.6 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况	60
10.7 基金租用或者通过证券公司交易单元进行证券投资的相关情况	61
10.8 其他重大事件	63
§ 11 影响投资者决策的其他重要信息	65
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	65
11.2 影响投资者决策的其他重要信息	65
§ 12 备查文件目录	65
12.1 备查文件目录	65
12.2 存放地点	65
12.3 查阅方式	65

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	大成沪深 300 指数证券投资基金		
基金简称	大成沪深 300 指数		
基金主代码	519300		
基金运作方式	契约型开放式		
基金合同生效日	2006 年 4 月 6 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	946,708,823.14 份		
基金合同存续期	不定期		
下属分级基金的基金简称	大成沪深 300 指数 A	大成沪深 300 指数 C	大成沪深 300 指数 Y
下属分级基金的交易代码	519300	007096	022973
下属分级基金的前端交易代码	519300	-	-
下属分级基金的后端交易代码	519301	-	-
报告期末下属分级基金的份额总额	927,480,244.18 份	15,968,540.41 份	3,260,038.55 份

2.2 基金产品说明

投资目标	通过严格的投资程序约束和数量化风险管理手段，实现指数投资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%，年跟踪误差不超过 4%。
投资策略	本基金采用被动式指数投资策略。原则上，股票投资组合的构建主要按照标的指数的成份股组成及其权重来拟合、复制标的指数，并原则上根据标的指数成份股及其权重的变动而进行相应调整。
业绩比较基准	沪深 300 指数
风险收益特征	本基金为指数基金，是风险中等、获得证券市场平均收益率的产品。

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、	北京市东城区建国门内大街 69 号

	27-33 层	
办公地址	广东省深圳市南山区海德三道 1236 号大成基金总部大厦 5 层、 27-33 层	北京市西城区复兴门内大街 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》
登载基金中期报告的管理人互联网网址	www.dcfund.com.cn
基金中期报告置备地点	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
注册登记机构	大成基金管理有限公司	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

注：本基金 A 类基金份额和 C 类基金份额的注册登记机构为中国证券登记结算有限责任公司，Y 类基金份额的注册登记机构为大成基金管理有限公司。

§ 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(2026 年 1 月 1 日 - 2026 年 6 月 30 日)		
	大成沪深 300 指数 A	大成沪深 300 指数 C	大成沪深 300 指数 Y
本期已实现收益	38,860,495.79	573,951.03	122,998.93
本期利润	92,498,606.45	1,405,952.26	301,238.97
加权平均基金份额本期利润	0.0954	0.0973	0.1030
本期加权平均净值利润率	8.38%	8.56%	9.00%
本期基金份额净值增长率	8.51%	8.46%	8.76%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2026 年 6 月 30 日)		
期末可供分配利润	180,488,805.60	3,056,608.22	661,068.10
期末可供分配基金份额利润	0.1946	0.1914	0.2028
期末基金资产净值	1,107,969,049.78	19,025,148.63	3,921,106.65
期末基金份额净值	1.1946	1.1914	1.2028
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2026 年 6 月 30 日)		
基金份额累计净值增长	355.25%	54.98%	31.25%

率			
---	--	--	--

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

大成沪深 300 指数 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
过去三个月	12.41%	1.18%	11.90%	1.26%	0.51%	-0.08%
过去六个月	8.51%	1.07%	7.55%	1.13%	0.96%	-0.06%
过去一年	27.97%	0.96%	26.51%	1.02%	1.46%	-0.06%
过去三年	35.16%	1.04%	29.59%	1.11%	5.57%	-0.07%
过去五年	7.44%	1.04%	-4.68%	1.12%	12.12%	-0.08%
过去七年	52.73%	1.07%	30.16%	1.17%	22.57%	-0.10%
过去十年	83.91%	1.06%	57.88%	1.15%	26.03%	-0.09%
自基金合同生效起至今	355.25%	1.50%	351.35%	1.59%	3.90%	-0.09%

大成沪深 300 指数 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
过去三个月	12.39%	1.18%	11.90%	1.26%	0.49%	-0.08%
过去六个月	8.46%	1.07%	7.55%	1.13%	0.91%	-0.06%
过去一年	27.85%	0.96%	26.51%	1.02%	1.34%	-0.06%
过去三年	34.75%	1.04%	29.59%	1.11%	5.16%	-0.07%
过去五年	6.95%	1.04%	-4.68%	1.12%	11.63%	-0.08%
过去七年	51.44%	1.07%	30.16%	1.17%	21.28%	-0.10%

自基金合同生效起 至今	54.98%	1.09%	34.63%	1.18%	20.35%	-0.09%
----------------	--------	-------	--------	-------	--------	--------

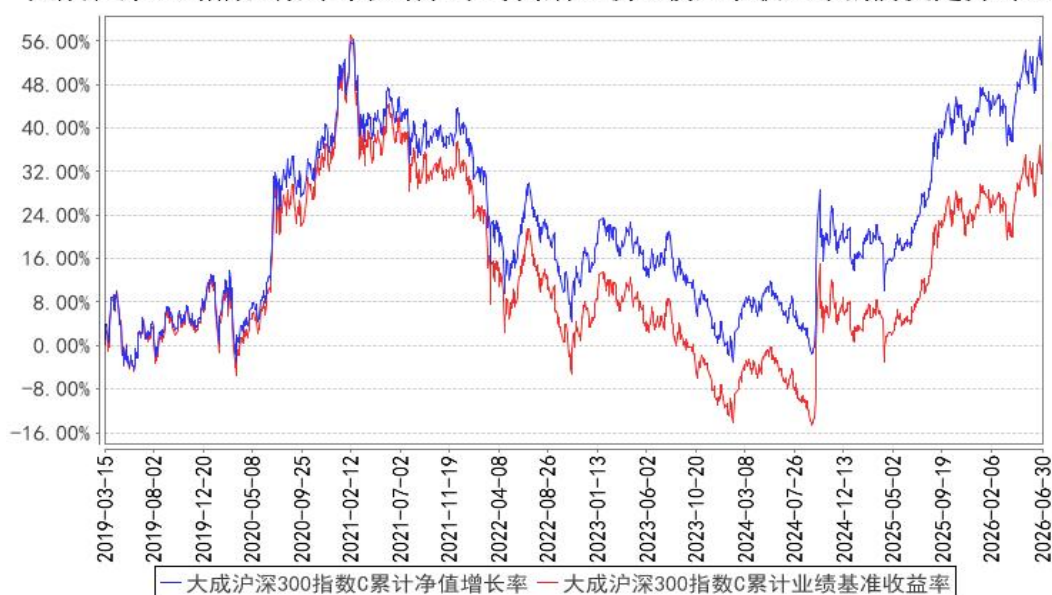
大成沪深 300 指数 Y

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
过去三个月	12.55%	1.18%	11.90%	1.26%	0.65%	-0.08%
过去六个月	8.76%	1.07%	7.55%	1.13%	1.21%	-0.06%
过去一年	28.56%	0.96%	26.51%	1.02%	2.05%	-0.06%
自基金合同生效起 至今	31.25%	0.95%	27.29%	1.01%	3.96%	-0.06%

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



大成沪深300指数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



大成沪深300指数Y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 2019 年 3 月 8 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 2019 年 3 月 15 日有份额之日开始计算。

3、本基金自 2024 年 12 月 13 日起增设 Y 类基金份额类别，Y 类的净值增长率和业绩比较基准收益率自 2024 年 12 月 17 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		
刘森	本 基 金 基 金 经 理	2023 年 4 月 14 日	-	18 年	北京大学工商管理硕士。2008 年 4 月至 2011 年 5 月就职于招商基金管理有限公司，任基金核算部基金会计。2011 年 5 月加入大成基金管理有限公司，先后担任基金运营部基金会计、股票投资部投委会秘书兼风控员、数量与指数投资部数量分析师、指数与期货投资部基金经理、指数与期货投资部总监助理。2020 年 6 月 29 日至 2023 年 5 月 30 日任大成 MSCI 中国 A 股质优价值 100 交易型开放式指数证券投资基金基金经理。2020 年 6 月 29 日至 2023 年 6 月 14 日任大成 MSCI 中国 A 股质优价值 100 交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理。2020 年 6 月 29 日至 2025 年 12 月 19 日任深证成长 40 交易型开放式指数

					证券投资基金、大成深证成长 40 交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理。2020 年 6 月 29 日至 2022 年 11 月 30 日任大成中证 500 深市交易型开放式指数证券投资基金基金经理。2021 年 4 月 30 日至 2025 年 7 月 29 日任大成中证全指医疗保健设备与服务交易型开放式指数证券投资基金基金经理。2021 年 6 月 17 日起任大成中证红利指数证券投资基金基金经理。2021 年 9 月 2 日至 2022 年 12 月 8 日任中证 500 沪市交易型开放式指数证券投资基金基金经理。2021 年 9 月 2 日至 2025 年 3 月 17 日任大成中证 A100 交易型开放式指数证券投资基金（更名前为大成中证 100 交易型开放式指数证券投资基金）基金经理。2021 年 9 月 2 日至 2025 年 12 月 19 日任大成深证成份交易型开放式指数证券投资基金基金经理。2022 年 6 月 28 日至 2025 年 2 月 18 日任大成中证电池主题指数型发起式证券投资基金基金经理。2022 年 7 月 13 日至 2025 年 3 月 17 日任大成中证上海环交所碳中和交易型开放式指数证券投资基金基金经理。2022 年 10 月 13 日至 2023 年 10 月 20 日任大成动态量化配置策略混合型证券投资基金基金经理。2023 年 3 月 20 日起任大成有色金属期货交易型开放式指数证券投资基金、大成有色金属期货交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理。2023 年 4 月 14 日起任大成沪深 300 指数证券投资基金基金经理。2024 年 3 月 6 日起任大成中证 A50 交易型开放式指数证券投资基金基金经理。2024 年 4 月 8 日至 2025 年 7 月 29 日任大成中证红利低波动 100 交易型开放式指数证券投资基金基金经理。2024 年 4 月 23 日起任大成中证 A50 交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理。2024 年 5 月 24 日至 2025 年 2 月 18 日任大成中证芯片产业指数型发起式证券投资基金基金经理。2024 年 5 月 28 日至 2025 年
--	--	--	--	--	--

					7 月 29 日任大成中证工程机械主题交易型开放式指数证券投资基金基金经理。2024 年 11 月 12 日起任大成中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金（转型前为大成中证 A500 指数型发起式证券投资基金）基金经理。2024 年 11 月 22 日起任大成中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金基金经理。2025 年 4 月 2 日起任大成深证 100 交易型开放式指数证券投资基金基金经理。2025 年 4 月 23 日起任大成中证全指自由现金流交易型开放式指数证券投资基金基金经理。2025 年 7 月 2 日起任大成中证全指自由现金流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。2025 年 7 月 16 日起担任大成创业板人工智能交易型开放式指数证券投资基金基金经理。2025 年 8 月 29 日起任大成创业板 50 交易型开放式指数证券投资基金基金经理。2025 年 9 月 23 日起任大成创业板 50 交易型开放式指数证券投资基金联接基金（转型前为大成创业板 50 指数型证券投资基金）基金经理。2025 年 10 月 21 日起任大成创业板人工智能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。2026 年 2 月 12 日起任大成国证石油天然气指数型发起式证券投资基金基金经理。2026 年 6 月 16 日起任大成上证科创板 50 成份指数型证券投资基金基金经理。具备基金从业资格。国籍：中国
郑少芳	本基金经理	2024 年 12 月 9 日	-	16 年	北京大学医学部理学硕士。2010 年 7 月加入大成基金管理有限公司，曾任研究部研究员、社保及养老投资管理部投资经理、权益专户投资部投资经理、总监助理，现任指数与期货投资部总监助理。2023 年 7 月 5 日至 2025 年 12 月 8 日兼任大成智惠量化多策略灵活配置混合型证券投资基金基金经理。2024 年 12 月 9 日起兼任大成沪深 300 指数证券投资基金、大成中证电池主题交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金（转型前为大成

					中证电池主题指数型发起式证券投资基金)、大成中证芯片产业指数型发起式证券投资基金基金经理。2025 年 3 月 10 日起兼任大成中证 A100 交易型开放式指数证券投资基金、大成中证上海环交所碳中和交易型开放式指数证券投资基金基金经理。2025 年 5 月 27 日起兼任大成北证 50 成份指数型发起式证券投资基金基金经理。2025 年 7 月 25 日起兼任大成中证全指医疗保健设备与服务交易型开放式指数证券投资基金、大成中证红利低波动 100 交易型开放式指数证券投资基金、大成中证工程机械主题交易型开放式指数证券投资基金基金经理。2026 年 1 月 13 日起兼任大成中证电池主题交易型开放式指数证券投资基金基金经理。2026 年 6 月 2 日起兼任大成国证机器人产业交易型开放式指数证券投资基金基金经理。2026 年 6 月 25 日起兼任大成中证红利低波动 100 交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金基金经理。具有基金从业资格。国籍：中国
--	--	--	--	--	--

注：1、任职日期、离任日期为本基金管理人作出决定之日。

2、证券从业年限的计算标准遵从中国证监会《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

姓名	产品类型	产品数量（只）	资产净值（元）	任职时间
郑少芳	公募基金	12	3,130,913,862.15	2024 年 12 月 9 日
	私募资产管理计划	1	2,040,328.54	2017 年 6 月 14 日
	其他组合	-	-	-
	合计	13	3,132,954,190.69	-

注：本报告期内，郑少芳已于 2026 年 6 月 10 日离任其管理的 1 个私募资产管理计划。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

报告期内，本基金管理人严格遵守《中华人民共和国证券法》、《中华人民共和国证券投资基金法》等有关法律法规及基金合同、基金招募说明书等有关基金法律文件的规定，以取信于市场、取信于社会投资公众为宗旨，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在规范基金

运作和严格控制投资风险的前提下，为基金份额持有人谋求最大利益，无损害基金份额持有人利益的行为。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

报告期内，公司严格执行了公平交易的原则和制度。公司运用统计分析方法和工具，对旗下所有投资组合间连续 4 个季度的日内、3 日内、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

2026 年上半年 A 股呈“先扬后抑再修复”三阶段走势，大部分宽基指数收红为主，市场成交持续活跃，6 月日均成交基本维持在 3 万亿以上。节奏上，1-2 月科技领涨，上证指数走出“17 连阳”；3-4 月初中东地缘冲突引发调整、资金转向高股息防御；4 月中旬起政策发力、叠加盈利修复驱动市场反弹。

行业表现层面，2026 年上半年，市场呈现典型“K 型”极致分化，超额收益高度集中于硬科技，通信、电子、建材等领涨，其中人工智能算力、光模块、PCB、存储、半导体国产替代为核心主线；商贸零售、食品饮料、传媒等承压，跌幅居前。底层支撑是盈利分层，以科创 50 为代表的科技成长盈利爆发式增长，与上证 50 为传统的传统板块剪刀差走阔。

本基金标的指数为沪深 300 指数。沪深 300 指数由沪深市场中规模大、流动性好的最具代表性的 300 只证券组成，反映沪深市场上市公司证券的整体表现。报告期内，沪深 300 指数涨跌幅 +7.55%。本基金采取完全复制法进行投资，即原则上按照标的指数的成份股及其权重构建基金股票投资组合。

运作层面上，本基金在报告期内基本保持满仓，并根据标的指数成份股及其权重的变动而进行相应调整。各项操作和指标均符合基金合同的要求。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末大成沪深 300 指数 A 的基金份额净值为 1.1946 元，本报告期基金份额净值增长率为 8.51%，同期业绩比较基准收益率为 7.55%；截至本报告期末大成沪深 300 指数 C 的基金份额净值为 1.1914 元，本报告期基金份额净值增长率为 8.46%，同期业绩比较基准收益率为 7.55%；截至本报告期末大成沪深 300 指数 Y 的基金份额净值为 1.2028 元，本报告期基金份额净值增长率为 8.76%，同期业绩比较基准收益率为 7.55%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望 2026 年下半年，我们判断市场震荡上行趋势未改但短期波动或加剧，市场后续或延续“K 型”分化，经济“新强旧弱”、CPI 偏弱、PPI 或回落；流动性上增量资金可期、外资流入节奏或有反复，海外美联储政策为主要扰动因素；国内政策端货币适度宽松。

组合管理上，我们将严格按照基金合同的相关约定，紧密跟踪标的指数，按照标的指数成份股组成及其权重的变化调整投资组合，努力实现跟踪误差的最小化。

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，大成沪深 300 指数 A 已分配利润 94,471,274.64 元，每十份基金份额分红 0.9860 元；大成沪深 300 指数 C 已分配利润 1,414,799.96 元，每十份基金份额分红 0.9620 元；大成沪深 300 指数 Y 已分配利润 228,576.71 元，每十份基金份额分红 1.0360 元；符合基金合同规定的分红比例。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

无。

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内，中国农业银行股份有限公司（以下简称“本基金托管人”）在本基金的托管过程中，严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》及其他相关法律、法规的规定和基金合同、托管协议的约定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

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

本报告期内，本基金托管人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》及其他相关法律、法规的规定和基金合同、托管协议的约定，对本基金的投资运作情况进行了必要的监督，对本基金的基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格计算、基金费用开支、利润分配等方面进行了复核，未发现基金管理人有关损害基金份额持有人利益的行为。

5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本基金托管人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》及其他相关法律、法规的规定和基金合同、托管协议的约定，以自身能够获取的数据和信息为限，对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、投资组合报告等内容进行核查，以上内容真实、准确、完整。

§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：大成沪深 300 指数证券投资基金

报告截止日：2026 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2026 年 6 月 30 日	上年度末 2025 年 12 月 31 日
资 产：			
货币资金	6.4.7.1	61,668,038.34	67,493,405.27
结算备付金		18,782.89	16,224.75
存出保证金		59,034.04	62,058.90
交易性金融资产	6.4.7.2	1,069,883,057.23	1,124,838,462.10
其中：股票投资		1,069,883,057.23	1,124,838,462.10
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	-	-
应收清算款		1,091,928.85	-
应收股利		-	-
应收申购款		551,451.07	1,320,676.15
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.8	-	-
资产总计		1,133,272,292.42	1,193,730,827.17
负债和净资产	附注号	本期末 2026 年 6 月 30 日	上年度末 2025 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		-	1,101,218.10
应付赎回款		1,392,746.98	694,740.34
应付管理人报酬		686,813.88	755,806.50
应付托管费		137,362.71	151,161.31
应付销售服务费		1,411.00	1,509.95
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	138,652.79	220,959.37
负债合计		2,356,987.36	2,925,395.57
净资产:			
实收基金	6.4.7.10	946,708,823.14	994,800,847.71
未分配利润	6.4.7.12	184,206,481.92	196,004,583.89
净资产合计		1,130,915,305.06	1,190,805,431.60
负债和净资产总计		1,133,272,292.42	1,193,730,827.17

注：报告截止日 2026 年 6 月 30 日,基金份额总额 946,708,823.14 份。其中大成沪深 300 指数 A 类基金份额总额为 927,480,244.18 份，基金份额净值 1.1946 元；大成沪深 300 指数 C 类基金份额总额为 15,968,540.41 份,基金份额净值 1.1914 元;大成沪深 300 指数 Y 类基金份额总额为 3,260,038.55 份，基金份额净值 1.2028 元。

6.2 利润表

会计主体：大成沪深 300 指数证券投资基金

本报告期：2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
一、营业总收入		99,320,630.74	18,437,735.21
1.利息收入		110,977.39	177,488.16
其中：存款利息收入	6.4.7.13	110,977.39	177,488.16
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）		44,497,447.47	6,197,165.89
其中：股票投资收益	6.4.7.14	33,893,436.58	-8,536,353.39
基金投资收益	6.4.7.15	-	-
债券投资收益	6.4.7.16	-	-11,671.29
资产支持证券投资	6.4.7.17	-	-
收益			
贵金属投资收益	6.4.7.18	-	-
衍生工具收益	6.4.7.19	-	-
股利收益	6.4.7.20	10,604,010.89	14,745,190.57
以摊余成本计量的金融资产终止确认产生的收益		-	-

其他投资收益		-	-
3.公允价值变动收益(损失以“-”号填列)	6.4.7.21	54,648,351.93	12,026,806.10
4.汇兑收益(损失以“-”号填列)		-	-
5.其他收入(损失以“-”号填列)	6.4.7.22	63,853.95	36,275.06
减：二、营业总支出		5,114,833.06	5,359,869.48
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	4,167,406.85	4,360,769.98
2. 托管费	6.4.10.2.2	833,481.38	872,153.98
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	8,152.12	20,932.98
4. 投资顾问费		-	-
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 信用减值损失	6.4.7.23	-	-
7. 税金及附加		-	-
8. 其他费用	6.4.7.24	105,792.71	106,012.54
三、利润总额(亏损总额以“-”号填列)		94,205,797.68	13,077,865.73
减：所得税费用		-	-
四、净利润(净亏损以“-”号填列)		94,205,797.68	13,077,865.73
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		94,205,797.68	13,077,865.73

6.3 净资产变动表

会计主体：大成沪深 300 指数证券投资基金

本报告期：2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 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	994,800,847.71	-	196,004,583.89	1,190,805,431.60
二、本期期初净资产	994,800,847.71	-	196,004,583.89	1,190,805,431.60
三、本期增减变动额(减少以	-48,092,024.57	-	-11,798,101.97	-59,890,126.54

“-”号填列)				
(一)、综合收益总额	-	-	94,205,797.68	94,205,797.68
(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)	-48,092,024.57	-	-9,889,248.34	-57,981,272.91
其中：1.基金申购款	106,748,211.95	-	14,101,398.87	120,849,610.82
2.基金赎回款	-154,840,236.52	-	-23,990,647.21	-178,830,883.73
(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)	-	-	-96,114,651.31	-96,114,651.31
四、本期期末净资产	946,708,823.14	-	184,206,481.92	1,130,915,305.06
项目	上年度可比期间 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	1,214,768,621.14	-	7,886,398.68	1,222,655,019.82
二、本期期初净资产	1,214,768,621.14	-	7,886,398.68	1,222,655,019.82
三、本期增减变动额(减少以“-”号填	-76,642,410.10	-	9,190,716.56	-67,451,693.54

列)				
(一)、综合收益总额	-	-	13,077,865.73	13,077,865.73
(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)	-76,642,410.10	-	67,600.50	-76,574,809.60
其中：1.基金申购款	52,702,361.34	-	-1,102,008.24	51,600,353.10
2.基金赎回款	-129,344,771.44	-	1,169,608.74	-128,175,162.70
(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)	-	-	-3,954,749.67	-3,954,749.67
四、本期期末净资产	1,138,126,211.04	-	17,077,115.24	1,155,203,326.28

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署：

谭晓冈

范瑛

梁靖

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

大成沪深 300 指数证券投资基金(以下简称“本基金”)，系经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监基金字[2006]24 号文《关于同意大成沪深 300 指数证券投资基金募集的批复》的核准，由基金管理人大成基金管理有限公司向社会公开发行募集，基金合同于 2006 年 4

月 6 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 1,813,356,066.47 份基金份额，本基金为契约型开放式，存续期限不定。本基金的基金管理人为大成基金管理有限公司，A 类基金份额和 B 类基金份额的注册登记机构为中国证券登记结算有限责任公司，Y 类基金份额的注册登记机构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。

根据《关于大成沪深 300 指数证券投资基金增设 C 类基金份额并相应修订基金合同和托管协议的公告》自 2019 年 3 月 11 日起，对本基金增设 C 类基金份额类别，并对本基金的基金合同、托管协议作出相应修改。

根据《关于大成沪深 300 指数证券投资基金增设 Y 类基金份额并相应修订基金合同和托管协议的公告》自 2024 年 12 月 13 日起，对本基金增设 Y 类基金份额类别，并对本基金的基金合同、托管协议作出相应修改。

本基金 A 类、B 类、C 类和 Y 类基金份额分别设置代码。由于基金费用的不同，本基金 A 类基金份额、B 类基金份额、C 类基金份额和 Y 类基金份额将分别计算基金份额净值。A 类基金份额、B 类基金份额和 C 类基金份额的管理费率、托管费率相同，Y 类基金份额管理费率与托管费率按照 A 类基金份额、B 类基金份额、C 类基金份额的五折设置。

A 类份额与 B 类份额收取申购费、不收取销售服务费，C 类基金份额的销售服务费按前一日 C 类基金资产净值的 0.10% 年费计提、不收取申购费用，但对持有期限少于 30 日的本类别基金份额的赎回收取赎回费，Y 类基金份额不收取销售服务费，可以豁免申购限制和申购费等销售费用（法定应当收取并计入基金资产的费用除外），可以对管理费和托管费实施一定的费率优惠。

本基金主要投资于具有良好流动性的金融工具，包括沪深 300 指数成份股(含存托凭证)、备选成份股(含存托凭证)、新股(一级市场初次发行或增发)、存托凭证等，现金(不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等)或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金财产净值的 5%。本基金还可以投资于法律法规及中国证监会允许基金投资的其他金融工具。待金融衍生产品推出后，本基金可以依照法律法规或监管机构的规定运用金融衍生产品进行风险管理。本基金跟踪标的指数的投资组合资产原则上不低于基金财产净值的 90%。除非法律法规另有规定，本基金的股票投资比例可以提高到基金财产净值的 100%。

本基金的业绩比较基准为：沪深 300 指数收益率。

6.4.2 会计报表的编制基础

本财务报表系按照财政部颁布的《企业会计准则——基本准则》以及其后颁布及修订的具体会计准则、解释以及《资产管理产品相关会计处理规定》和其他相关规定（统称“企业会计准则”）编制，同时，在信息披露和估值方面，也参考了中国证监会颁布的《中国证券监督管理委员会关

于证券投资基金估值业务的指导意见》、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》、《公开募集证券投资基金信息披露内容与格式准则第 2 号——定期报告的内容与格式》、《证券投资基金信息披露编报规则第 3 号<会计报表附注的编制及披露>》、中国证券投资基金业协会发布的《公开募集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》以及中国证监会和中国证券投资基金业协会颁布的其他相关规定。

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

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 2026 年 6 月 30 日的财务状况以及 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日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

(1) 增值税及附加

根据中华人民共和国主席令第四十一号《中华人民共和国增值税法》、中华人民共和国国务院令 826 号《中华人民共和国增值税法实施条例》及财政部、税务总局公告 2026 年第 10 号《关于增值税法施行后增值税优惠政策衔接事项的公告》的规定，资管产品运营过程中发生的应税交易，资管产品管理人为纳税人；自 2026 年 1 月 1 日至 2027 年 12 月 31 日，资管产品管理人运营契约制资管产品过程中发生的增值税应税行为，可以选择适用简易计税方法，按照 3% 的规定征收率计算缴纳增值税，公募证券投资基金（封闭式证券投资基金、开放式证券投资基金）管理人运用基金买卖股票、债券取得的收入及金融同业往来利息收入免征增值税，金融同业往来利息收入包括金融机构与人民银行所发生的资金往来业务、银行联行往来业务、金融机构间的资金往来业务，以及金融机构开展同业存款、同业借款、同业代付、买断式买入返售金融商品、质押式买入返售金融商品、同业存单，取得的利息收入；取得存款利息收入不属于应税交易，不征收增值税。

根据财政部、税务总局公告 2025 年第 4 号《关于国债等债券利息收入增值税政策的公告》的规定，自 2025 年 8 月 8 日起，对在该日期之后（含当日）新发行的国债、地方政府债券、金融债券的利息收入，恢复征收增值税。对在该日期之前已发行的国债、地方政府债券、金融债券（包含在 2025 年 8 月 8 日之后续发行的部分）的利息收入，继续免征增值税直至债券到期。

增值税附加税包括城市维护建设税、教育费附加和地方教育附加，以实际缴纳的增值税税额为计税依据，分别按 7%、3%和 2%的比例缴纳城市维护建设税、教育费附加和地方教育附加。

（2）企业所得税

根据财政部、国家税务总局财税[2004]78 号《财政部 国家税务总局关于证券投资基金税收政策的通知》的规定，自 2004 年 1 月 1 日起，对证券投资基金（封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金）管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入，继续免征企业所得税。

根据财政部、国家税务总局财税[2008]1 号《财政部 国家税务总局关于企业所得税若干优惠政策的通知》的规定，对证券投资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，股权的股息、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）个人所得税

根据财政部、国家税务总局财税[2008]132 号《关于储蓄存款利息所得有关个人所得税政策的通知》的规定，自 2008 年 10 月 9 日起，对储蓄存款利息所得暂免征收个人所得税。

根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[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》的规定，自 2013 年 1 月 1 日起，证券投资基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，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，暂减按 25%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。

根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[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》的规定，自 2015 年 9 月 8 日起，证券投资基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，持股期限超过 1 年的，股息红利所得暂免征收个人所得税。

（4）印花税

经国务院批准，财政部、国家税务总局研究决定，自 2008 年 4 月 24 日起，调整证券（股票）交易印花税税率，由原先的 3‰调整为 1‰，自 2008 年 9 月 19 日起，调整由出让方按证券（股票）交易印花税税率缴纳印花税，受让方不再征收，税率不变；根据财政部、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》的规定，自 2023 年 8 月 28 日起，证券交易印

花税实施减半征收。

(5) 境外投资

本基金运作过程中如有涉及的境外投资的税项问题，根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2014]81 号《关于沪港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》、财税[2016]127 号《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》及其他境内外相关税务法规的规定和实务操作执行。

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 2026 年 6 月 30 日
活期存款	61,668,038.34
等于：本金	61,661,872.05
加：应计利息	6,166.29
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	61,668,038.34

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2026 年 6 月 30 日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	841,650,881.12	-	1,069,883,057.23	228,232,176.11
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	841,650,881.12	-	1,069,883,057.23	228,232,176.11

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 2026 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	3,526.93
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	36,406.31
其中：交易所市场	36,406.31
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用	98,719.55
合计	138,652.79

6.4.7.10 实收基金

金额单位：人民币元

大成沪深 300 指数 A

项目	本期	
	2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	978,027,010.85	978,027,010.85
本期申购	91,063,487.55	91,063,487.55
本期赎回（以“-”号填列）	-141,610,254.22	-141,610,254.22
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	927,480,244.18	927,480,244.18

大成沪深 300 指数 C

项目	本期	
	2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	14,828,620.68	14,828,620.68
本期申购	13,405,291.36	13,405,291.36
本期赎回（以“-”号填列）	-12,265,371.63	-12,265,371.63
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	15,968,540.41	15,968,540.41

大成沪深 300 指数 Y

项目	本期	
	2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日	
	基金份额 (份)	账面金额
上年度末	1,945,216.18	1,945,216.18
本期申购	2,279,433.04	2,279,433.04
本期赎回 (以“-”号填列)	-964,610.67	-964,610.67
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	3,260,038.55	3,260,038.55

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

大成沪深 300 指数 A

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	633,571,140.04	-440,821,298.17	192,749,841.87
本期期初	633,571,140.04	-440,821,298.17	192,749,841.87
本期利润	38,860,495.79	53,638,110.66	92,498,606.45
本期基金份额交易产生的变动数	-31,300,562.65	21,012,194.57	-10,288,368.08
其中：基金申购款	51,565,208.85	-39,799,369.76	11,765,839.09
基金赎回款	-82,865,771.50	60,811,564.33	-22,054,207.17
本期已分配利润	-94,471,274.64	-	-94,471,274.64
本期末	546,659,798.54	-366,170,992.94	180,488,805.60

大成沪深 300 指数 C

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	9,528,590.97	-6,676,516.42	2,852,074.55
本期期初	9,528,590.97	-6,676,516.42	2,852,074.55
本期利润	573,951.03	832,001.23	1,405,952.26
本期基金份额交易产生的变动数	668,505.51	-455,124.14	213,381.37
其中：基金申购款	7,741,378.09	-5,749,465.41	1,991,912.68
基金赎回款	-7,072,872.58	5,294,341.27	-1,778,531.31
本期已分配利润	-1,414,799.96	-	-1,414,799.96
本期末	9,356,247.55	-6,299,639.33	3,056,608.22

大成沪深 300 指数 Y

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	1,277,214.77	-874,547.30	402,667.47
本期期初	1,277,214.77	-874,547.30	402,667.47
本期利润	122,998.93	178,240.04	301,238.97
本期基金份额交易产生的变动数	771,380.13	-585,641.76	185,738.37
其中：基金申购款	1,336,792.21	-993,145.11	343,647.10
基金赎回款	-565,412.08	407,503.35	-157,908.73
本期已分配利润	-228,576.71	-	-228,576.71
本期末	1,943,017.12	-1,281,949.02	661,068.10

6.4.7.13 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	110,735.23
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	95.28
其他	146.88
合计	110,977.39

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 2026年1月1日至2026年6月30日
股票投资收益——买卖股票差价收入	33,893,436.58
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	33,893,436.58

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 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
卖出股票成交总额	219,802,409.51
减：卖出股票成本总额	185,722,873.50
减：交易费用	186,099.43
买卖股票差价收入	33,893,436.58

6.4.7.14.3 股票投资收益——证券出借差价收入

无。

6.4.7.15 基金投资收益

无。

6.4.7.16 债券投资收益

6.4.7.16.1 债券投资收益项目构成

无。

6.4.7.16.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

无。

6.4.7.16.3 债券投资收益——赎回差价收入

无。

6.4.7.16.4 债券投资收益——申购差价收入

无。

6.4.7.17 资产支持证券投资收益

6.4.7.17.1 资产支持证券投资收益项目构成

无。

6.4.7.17.2 资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入

无。

6.4.7.17.3 资产支持证券投资收益——赎回差价收入

无。

6.4.7.17.4 资产支持证券投资收益——申购差价收入

无。

6.4.7.18 贵金属投资收益

6.4.7.18.1 贵金属投资收益项目构成

无。

6.4.7.18.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

无。

6.4.7.18.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

无。

6.4.7.18.4 贵金属投资收益——申购差价收入

无。

6.4.7.19 衍生工具收益

6.4.7.19.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

无。

6.4.7.19.2 衍生工具收益——其他投资收益

无。

6.4.7.20 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
股票投资产生的股利收益	10,604,010.89
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	10,604,010.89

6.4.7.21 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
1.交易性金融资产	54,648,351.93
股票投资	54,648,351.93
债券投资	-
资产支持证券投资	-
基金投资	-
贵金属投资	-
其他	-
2.衍生工具	-
权证投资	-
3.其他	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税	-
合计	54,648,351.93

6.4.7.22 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
基金赎回费收入	63,853.95
合计	63,853.95

6.4.7.23 信用减值损失

无。

6.4.7.24 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
审计费用	34,712.18
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
银行划款手续费	2,573.16
账户维护费	9,000.00
合计	105,792.71

6.4.7.25 分部报告

无。

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 或有事项

无。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

无。

6.4.9 关联方、关联关系

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、注册登记机构、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

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 股票交易

无。

6.4.10.1.2 债券交易

无。

6.4.10.1.3 债券回购交易

无。

6.4.10.1.4 基金交易

无。

6.4.10.1.5 权证交易

无。

6.4.10.1.6 应支付关联方的佣金

无。

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	4,167,406.85	4,360,769.98
其中：应支付销售机构的客户维护费	1,241,850.30	1,258,306.90
应支付基金管理人的净管理费	2,925,556.55	3,102,463.08

注：本基金 A 类基金份额、C 类基金份额和 Y 类基金份额的管理费年费率分别为 0.75%、0.75%和 0.375%，每日计提，按月支付。其计算公式为：

日管理费 = 前一日 A/C/Y 类基金份额的基金资产净值 × A/C/Y 类基金份额的管理费年费率/当年天数。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	833,481.38	872,153.98

注：本基金 A 类基金份额、C 类基金份额和 Y 类基金份额的托管费年费率分别为 0.15%、0.15%和 0.075%，每日计提，按月支付。其计算公式为：

日托管费 = 前一日 A/C/Y 类基金份额的基金资产净值 × A/C/Y 类基金份额的托管费年费率/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 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
	当期发生的基金应支付的销售服务费

	大成沪深 300 指数 A	大成沪深 300 指数 C	大成沪深 300 指数 Y	合计
大成基金	-	822.68	-	822.68
合计	-	822.68	-	822.68
获得销售服务费 的各关联方名称	上年度可比期间 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			
	大成沪深 300 指数 A	大成沪深 300 指数 C	大成沪深 300 指数 Y	合计
	-	9,666.77	-	9,666.77
大成基金	-	9,666.77	-	9,666.77
合计	-	9,666.77	-	9,666.77

注：C 类基金份额的销售服务费年费率为 0.10%。

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 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2025 年 1 月 1 日至 2025 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	61,668,038.34	110,735.23	66,507,988.45	144,513.67

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

单位：人民币元

大成沪深 300 指数 A								
序号	权益 登 记 日	除息日		每 10 份 基 金 份 额 分 红 数	现 金 形 式 发 放 总 额	再 投 资 形 式 发 放 总 额	本 期 利 润 分 配 合 计	备 注
		场 内	场 外					
1	2026 年 1 月 16 日	-	2026 年 1 月 16 日	0.986 0	46,1 12,6 75.0 4	48,35 8,599 .60	94,4 71,2 74.6 4	-
合计	-	-	-	0.986 0	46,1 12,6 75.0 4	48,35 8,599 .60	94,4 71,2 74.6 4	-
大成沪深 300 指数 C								
序号	权益 登 记 日	除息日		每 10 份 基 金 份 额 分 红	现 金 形 式 发 放 总 额	再 投 资 形 式 发 放 总 额	本 期 利 润 分 配 合 计	备 注
		场 内	场 外					

				数				
1	2026 年 1 月 16 日	-	2026 年 1 月 16 日	0.962 0	1,06 3,60 5.91	351,1 94.05	1,41 4,79 9.96	-
合计	-	-	-	0.962 0	1,06 3,60 5.91	351,1 94.05	1,41 4,79 9.96	-
大成沪深 300 指数 Y								
序号	权 益 登 记 日	除息日		每 10 份 基 金 份 额 分 红 数	现 金 形 式 发 放 总 额	再 投 资 形 式 发 放 总 额	本 期 利 润 分 配 合 计	备 注
		场 内	场 外					
1	2026 年 1 月 16 日	-	2026 年 1 月 16 日	1.036 0	-	228,5 76.71	228, 576. 71	-
合计	-	-	-	1.036 0	-	228,5 76.71	228, 576. 71	-

6.4.12 期末（2026 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

金额单位：人民币元

6.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券 代码	证 券 名 称	成 功 认 购 日	受 限 期	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
001220	世盟股份	2026 年 1 月 27 日	6 个月	新股 锁定	28.00	27.78	57	1,596.00	1,583.46	-
001237	惠康科技	2026 年 5 月 15 日	6 个月	新股 锁定	53.26	58.74	285	15,179.10	16,740.90	-
001248	华	2026	1 个月	新股	10.11	10.11	16,518	166,996.98	166,996.98	-

	润 新 能 源	年6月 24日	内(含)	未上 市						
001248	华 润 新 能 源	2026 年6月 24日	6个月	新股 未上 市	10.11	10.11	38,542	389,659.62	389,659.62	-
001257	盛 龙 股 份	2026 年3月 24日	6个月	新股 锁定	7.82	20.74	1,743	13,630.26	36,149.82	-
001312	福 恩 股 份	2026 年4月 14日	6个月	新股 锁定	18.38	16.78	134	2,462.92	2,248.52	-
001365	天 海 电 子	2026 年5月 11日	6个月	新股 锁定	27.19	31.31	719	19,549.61	22,511.89	-
001393	维 通 利	2026 年5月 8日	6个月	新股 锁定	30.38	38.99	387	11,757.06	15,089.13	-
001399	惠 科 股 份	2026 年6月 16日	6个月	新股 锁定	10.12	27.73	6,027	60,993.24	167,128.71	-
301513	尚 水 智 能	2026 年4月 10日	6个月	新股 锁定	26.66	50.96	138	3,679.08	7,032.48	-
301531	春 光 集 团	2026 年4月 28日	6个月	新股 锁定	13.30	51.56	290	3,857.00	14,952.40	-
301599	理 奇 智 能	2026 年4月 22日	6个月	新股 锁定	13.91	32.47	433	6,023.03	14,059.51	-
301666	大 普 微	2026 年4月 8日	6个月	新股 锁定	46.08	463.33	1,220	56,217.60	565,262.60	-
301669	高	2026	6个月	新股	7.08	28.40	546	3,865.68	15,506.40	-

	特电子	年6月2日		锁定						
301680	固德电材	2026年2月27日	6个月	新股锁定	58.00	112.16	117	6,786.00	13,122.72	-
301682	宏明电子	2026年3月18日	6个月	新股锁定	69.66	160.06	714	49,737.24	114,282.84	-
301683	慧谷新材	2026年3月24日	6个月	新股锁定	78.38	121.77	96	7,524.48	11,689.92	-
301687	新广益	2025年12月24日	6个月	新股锁定	21.93	77.78	195	4,276.35	15,167.10	-
301696	三瑞智能	2026年3月31日	6个月	新股锁定	24.68	86.80	216	5,330.88	18,748.80	-
601112	振石股份	2026年1月21日	6个月	新股锁定	11.18	17.59	775	8,664.50	13,632.25	-
603284	林平发展	2026年2月3日	6个月	新股锁定	37.88	34.87	46	1,742.48	1,604.02	-
603293	埃泰克	2026年4月9日	6个月	新股锁定	33.49	33.93	72	2,411.28	2,442.96	-
603352	至信股份	2026年1月8日	6个月	新股锁定	21.88	25.52	112	2,450.56	2,858.24	-
603435	嘉德利	2026年5月15日	6个月	新股锁定	15.76	46.71	104	1,639.04	4,857.84	-
603459	红板科	2026年3月31日	6个月	新股锁定	17.70	84.32	330	5,841.00	27,825.60	-

	技									
688635	长 进 光 子	2026 年 5 月 20 日	6 个月	新股 锁定	40.98	308.19	128	5,245.44	39,448.32	-
688712	北 芯 生 命	2026 年 1 月 28 日	6 个月	新股 锁定	17.52	35.92	234	4,099.68	8,405.28	-
688781	视 涯 科 技	2026 年 3 月 18 日	6 个月	新股 锁定	22.68	47.61	217	4,921.56	10,331.37	-
688785	恒 运 昌	2026 年 1 月 20 日	6 个月	新股 锁定	92.18	463.15	116	10,692.88	53,725.40	-
688797	臻 宝 科 技	2026 年 6 月 16 日	6 个月	新股 锁定	44.56	468.67	207	9,223.92	97,014.69	-
688808	联 讯 仪 器	2026 年 4 月 16 日	6 个月	新股 锁定	81.88	1,584.33	163	13,346.44	258,245.79	-
688811	有 研 复 材	2026 年 4 月 1 日	6 个月	新股 锁定	6.41	24.13	834	5,345.94	20,124.42	-
688813	泰 金 新 能	2026 年 3 月 24 日	6 个月	新股 锁定	26.28	172.09	234	6,149.52	40,269.06	-
688816	易 思 维	2026 年 2 月 4 日	6 个月	新股 锁定	55.95	57.10	177	9,903.15	10,106.70	-
688818	电 科 蓝 天	2026 年 2 月 3 日	6 个月	新股 锁定	9.47	70.14	1,717	16,259.99	120,430.38	-
688820	盛 合 晶 微	2026 年 4 月 13 日	6 个月	新股 锁定	19.68	141.49	1,650	32,472.00	233,458.50	-

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
688072	拓荆科技	2026 年 6 月 29 日	重大事项停牌	879.53	2026 年 7 月 13 日	890.99	7,400	4,836,692.08	6,508,522.00	-

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

本基金在日常经营活动中由金融工具产生的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金管理人制定了政策和程序来识别及分析这些风险，并设定适当的风险限额及内部控制流程，通过可靠的管理及信息系统持续监控上述各类风险。

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同责任，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》、《货币市场基金监督管理办法》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流动性受限资产比例、份额持有人集中度、调整平均剩余期限和平均剩余存续期、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。

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），均能够及时变现。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。本报告期内，本基金未发生重大流动性风险事件。

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、结算备付金及应收申购款等。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2026 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	61,668,038.34	-	-	-	61,668,038.34
结算备付金	18,782.89	-	-	-	18,782.89
存出保证金	59,034.04	-	-	-	59,034.04
交易性金融资产	-	-	-	1,069,883,057.23	1,069,883,057.23
应收申购款	246,934.45	-	-	304,516.62	551,451.07
应收清算款	-	-	-	1,091,928.85	1,091,928.85
资产总计	61,992,789.72	-	-	1,071,279,502.70	1,133,272,292.42
负债					
应付赎回款	-	-	-	1,392,746.98	1,392,746.98
应付管理人报酬	-	-	-	686,813.88	686,813.88
应付托管费	-	-	-	137,362.71	137,362.71
应付销售服务费	-	-	-	1,411.00	1,411.00
其他负债	-	-	-	138,652.79	138,652.79

负债总计	-	-	-	2,356,987.36	2,356,987.36
利率敏感度缺口	61,992,789.72	-	-	-1,068,922,515.34	1,130,915,305.06
上年度末 2025 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	67,493,405.27	-	-	-	67,493,405.27
结算备付金	16,224.75	-	-	-	16,224.75
存出保证金	62,058.90	-	-	-	62,058.90
交易性金融资产	-	-	-	-1,124,838,462.10	1,124,838,462.10
应收申购款	2,240.57	-	-	1,318,435.58	1,320,676.15
资产总计	67,573,929.49	-	-	-1,126,156,897.68	1,193,730,827.17
负债					
应付赎回款	-	-	-	694,740.34	694,740.34
应付管理人报酬	-	-	-	755,806.50	755,806.50
应付托管费	-	-	-	151,161.31	151,161.31
应付清算款	-	-	-	1,101,218.10	1,101,218.10
应付销售服务费	-	-	-	1,509.95	1,509.95
其他负债	-	-	-	220,959.37	220,959.37
负债总计	-	-	-	2,925,395.57	2,925,395.57
利率敏感度缺口	67,573,929.49	-	-	-1,123,231,502.11	1,190,805,431.60

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。本基金持有的金融工具以人民币计价，因此无重大外汇风险。

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或银行间同业市场交易的股票和债券，所面临的最大市场价格风险由所持有的金融工具的公允价值决定。本基金通过投资组合的分散化降低市场价格风险，并且本基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控。

本基金跟踪标的指数的投资组合的资产原则上不低于基金资产净值的 90%。除非法律法规另有规定，本基金的股票投资比例可以提高到基金资产净值的 100%。现金或者到期日在一年以内的

政府债券不低于基金资产净值的 5%。

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 2026 年 6 月 30 日		上年度末 2025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	1,069,883,057.23	94.60	1,124,838,462.10	94.46
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	1,069,883,057.23	94.60	1,124,838,462.10	94.46

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（2026 年 6 月 30 日）	上年度末（2025 年 12 月 31 日）
	业绩比较基准上升 5%	53,284,275.48	56,421,123.22
	业绩比较基准下降 5%	-53,284,275.48	-56,421,123.22

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 2026 年 6 月 30 日	上年度末 2025 年 12 月 31 日
第一层次	1,060,821,820.61	1,116,033,438.76
第二层次	7,065,178.60	7,949,285.55
第三层次	1,996,058.02	855,737.79
合计	1,069,883,057.23	1,124,838,462.10

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	1,069,883,057.23	94.41
	其中：股票	1,069,883,057.23	94.41
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	61,686,821.23	5.44
8	其他各项资产	1,702,413.96	0.15
9	合计	1,133,272,292.42	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	6,091,187.65	0.54
B	采矿业	44,695,516.77	3.95
C	制造业	683,865,947.76	60.47
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	26,517,709.07	2.34
E	建筑业	12,179,980.56	1.08
F	批发和零售业	1,575,603.60	0.14
G	交通运输、仓储和邮政业	25,867,914.32	2.29
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	57,353,050.64	5.07
J	金融业	187,119,641.43	16.55
K	房地产业	3,480,777.98	0.31
L	租赁和商务服务业	4,876,372.02	0.43
M	科学研究和技术服务业	11,640,066.37	1.03
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	1,453,297.44	0.13
R	文化、体育和娱乐业	613,277.00	0.05
S	综合	-	-
	合计	1,067,330,342.61	94.38

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	36,149.82	0.00
C	制造业	1,958,324.74	0.17
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	556,656.60	0.05
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	1,583.46	0.00
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	2,552,714.62	0.23

7.2.3 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

无。

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	300308	中际旭创	42,000	53,340,000.00	4.72
2	300750	宁德时代	100,040	39,316,720.40	3.48
3	300502	新易盛	52,564	31,906,348.00	2.82
4	600519	贵州茅台	23,558	27,927,773.42	2.47
5	603986	兆易创新	25,148	20,495,620.00	1.81
6	601318	中国平安	402,357	19,208,523.18	1.70

7	688256	寒武纪	11,866	18,932,796.30	1.67
8	600036	招商银行	467,142	16,583,541.00	1.47
9	601899	紫金矿业	622,149	15,640,825.86	1.38
10	002371	北方华创	16,380	14,489,092.80	1.28
11	000333	美的集团	183,508	13,860,359.24	1.23
12	002475	立讯精密	192,542	13,554,956.80	1.20
13	688008	澜起科技	43,173	13,379,312.70	1.18
14	688012	中微公司	28,223	13,222,475.50	1.17
15	688041	海光信息	34,866	12,910,879.80	1.14
16	002384	东山精密	48,300	12,671,505.00	1.12
17	600900	长江电力	461,762	12,222,840.14	1.08
18	688981	中芯国际	75,245	11,950,410.90	1.06
19	000725	京东方 A	1,372,063	11,909,506.84	1.05
20	603259	药明康德	93,487	11,640,066.37	1.03
21	601138	工业富联	149,800	10,808,070.00	0.96
22	600030	中信证券	370,312	10,639,063.76	0.94
23	601166	兴业银行	639,015	10,582,088.40	0.94
24	601398	工商银行	1,410,118	9,969,534.26	0.88
25	300059	东方财富	480,345	9,789,431.10	0.87
26	600183	生益科技	55,000	9,537,000.00	0.84
27	600276	恒瑞医药	168,548	8,771,237.92	0.78
28	300274	阳光电源	54,777	8,710,638.54	0.77
29	300408	三环集团	50,532	8,433,790.80	0.75
30	002594	比亚迪	102,800	8,193,160.00	0.72
31	300476	胜宏科技	23,000	7,967,890.00	0.70
32	601211	国泰海通	429,517	7,817,209.40	0.69
33	601328	交通银行	1,213,508	7,802,856.44	0.69
34	002463	沪电股份	50,700	7,746,960.00	0.69
35	300394	天孚通信	24,688	7,472,563.84	0.66
36	000988	华工科技	37,900	6,996,719.00	0.62
37	301308	江波龙	9,600	6,756,480.00	0.60
38	600176	中国巨石	90,828	6,619,544.64	0.59
39	688072	拓荆科技	7,400	6,508,522.00	0.58
40	000651	格力电器	169,089	6,340,837.50	0.56
41	600522	中天科技	103,300	6,268,244.00	0.55
42	600919	江苏银行	554,110	5,973,305.80	0.53
43	603019	中科曙光	55,168	5,915,664.64	0.52
44	688521	芯原股份	15,900	5,901,126.00	0.52
45	603993	洛阳钼业	329,544	5,783,497.20	0.51
46	600150	中国船舶	170,404	5,757,951.16	0.51
47	600887	伊利股份	238,808	5,721,839.68	0.51
48	600584	长电科技	54,000	5,591,700.00	0.49
49	000338	潍柴动力	202,992	5,531,532.00	0.49

50	000858	五 粮 液	73,389	5,430,786.00	0.48
51	601816	京沪高铁	1,108,068	5,019,548.04	0.44
52	600309	万华化学	71,014	4,858,067.74	0.43
53	300124	汇川技术	71,600	4,749,228.00	0.42
54	002415	海康威视	138,342	4,731,296.40	0.42
55	002916	深南电路	10,277	4,705,838.30	0.42
56	601688	华泰证券	223,175	4,601,868.50	0.41
57	600111	北方稀土	95,654	4,596,174.70	0.41
58	000100	TCL 科技	785,214	4,569,945.48	0.40
59	601988	中国银行	771,140	4,410,920.80	0.39
60	601939	建设银行	457,662	4,407,285.06	0.39
61	000063	中兴通讯	121,620	4,401,427.80	0.39
62	600000	浦发银行	502,811	4,329,202.71	0.38
63	600089	特变电工	190,680	4,290,300.00	0.38
64	601857	中国石油	489,056	4,245,006.08	0.38
65	002028	思源电气	23,500	4,065,500.00	0.36
66	601088	中国神华	103,846	4,054,147.84	0.36
67	300433	蓝思科技	75,300	4,040,598.00	0.36
68	600031	三一重工	223,806	3,867,367.68	0.34
69	300014	亿纬锂能	57,361	3,730,185.83	0.33
70	002050	三花智控	84,677	3,711,392.91	0.33
71	002142	宁波银行	124,686	3,701,927.34	0.33
72	601601	中国太保	129,093	3,681,732.36	0.33
73	000001	平安银行	366,218	3,680,490.90	0.33
74	000792	盐湖股份	119,900	3,619,781.00	0.32
75	002714	牧原股份	103,303	3,614,571.97	0.32
76	600549	厦门钨业	41,900	3,569,880.00	0.32
77	002353	杰瑞股份	23,200	3,538,000.00	0.31
78	600406	国电南瑞	151,584	3,463,694.40	0.31
79	601658	邮储银行	692,200	3,412,546.00	0.30
80	601668	中国建筑	779,794	3,384,305.96	0.30
81	000657	中钨高新	34,300	3,283,196.00	0.29
82	601229	上海银行	375,411	3,258,567.48	0.29
83	601919	中远海控	237,019	3,142,871.94	0.28
84	002602	世纪华通	222,500	3,137,250.00	0.28
85	300760	迈瑞医疗	22,900	3,110,507.00	0.28
86	600660	福耀玻璃	60,426	3,047,887.44	0.27
87	601728	中国电信	586,011	3,041,397.09	0.27
88	603501	豪威集团	31,945	3,029,983.25	0.27
89	600016	民生银行	936,972	3,017,049.84	0.27
90	600999	招商证券	142,739	3,011,792.90	0.27
91	601012	隆基绿能	228,833	3,002,288.96	0.27
92	601225	陕西煤业	146,364	2,978,507.40	0.26

93	002230	科大讯飞	72,668	2,967,761.12	0.26
94	600941	中国移动	34,000	2,928,420.00	0.26
95	600690	海尔智家	141,549	2,889,015.09	0.26
96	002352	顺丰控股	90,700	2,835,282.00	0.25
97	601985	中国核电	310,510	2,803,905.30	0.25
98	002460	赣锋锂业	42,500	2,779,500.00	0.25
99	600926	杭州银行	191,576	2,768,273.20	0.24
100	002709	天赐材料	53,800	2,766,934.00	0.24
101	603799	华友钴业	57,230	2,761,919.80	0.24
102	002938	鹏鼎控股	26,200	2,760,956.00	0.24
103	300033	同花顺	11,420	2,752,220.00	0.24
104	601169	北京银行	558,580	2,737,042.00	0.24
105	000977	浪潮信息	38,688	2,708,160.00	0.24
106	600160	巨化股份	50,800	2,692,908.00	0.24
107	000776	广发证券	113,902	2,665,306.80	0.24
108	300442	润泽科技	30,900	2,566,863.00	0.23
109	000425	徐工机械	309,446	2,503,418.14	0.22
110	000938	紫光股份	86,495	2,496,245.70	0.22
111	002202	金风科技	104,400	2,495,160.00	0.22
112	688126	沪硅产业	62,201	2,481,197.89	0.22
113	300498	温氏股份	201,024	2,476,615.68	0.22
114	601600	中国铝业	299,143	2,458,955.46	0.22
115	600938	中国海油	90,469	2,456,233.35	0.22
116	600028	中国石化	549,969	2,452,861.74	0.22
117	600460	士兰微	43,900	2,399,574.00	0.21
118	002600	领益智造	137,900	2,391,186.00	0.21
119	002466	天齐锂业	38,961	2,389,088.52	0.21
120	601766	中国中车	459,104	2,387,340.80	0.21
121	600050	中国联通	590,036	2,360,144.00	0.21
122	300661	圣邦股份	16,415	2,355,224.20	0.21
123	688082	盛美上海	5,400	2,332,800.00	0.21
124	601009	南京银行	233,379	2,308,118.31	0.20
125	002837	英维克	28,820	2,292,919.20	0.20
126	002049	紫光国微	25,580	2,270,225.00	0.20
127	601628	中国人寿	62,862	2,222,171.70	0.20
128	002179	中航光电	47,808	2,208,729.60	0.20
129	601100	恒立液压	20,212	2,174,002.72	0.19
130	000568	泸州老窖	27,700	2,147,304.00	0.19
131	601872	招商轮船	121,936	2,142,415.52	0.19
132	002241	歌尔股份	93,953	2,116,761.09	0.19
133	603288	海天味业	62,865	2,084,603.40	0.18
134	601006	大秦铁路	449,857	2,073,840.77	0.18
135	000408	藏格矿业	29,600	2,051,872.00	0.18

136	605117	德业股份	19,229	2,041,735.22	0.18
137	601818	光大银行	700,600	2,024,734.00	0.18
138	600809	山西汾酒	18,380	2,010,220.60	0.18
139	600905	三峡能源	539,500	2,001,545.00	0.18
140	600489	中金黄金	109,800	1,981,890.00	0.18
141	601888	中国中免	36,790	1,975,990.90	0.17
142	002625	光启技术	65,100	1,973,832.00	0.17
143	688396	华润微	20,131	1,963,779.05	0.17
144	000630	铜陵有色	303,700	1,931,532.00	0.17
145	600893	航发动力	50,169	1,923,479.46	0.17
146	600958	东方证券	203,119	1,917,443.36	0.17
147	600010	包钢股份	853,456	1,903,206.88	0.17
148	688271	联影医疗	18,706	1,893,608.38	0.17
149	601127	赛力斯	30,800	1,886,500.00	0.17
150	601336	新华保险	31,425	1,874,815.50	0.17
151	688111	金山办公	8,709	1,855,452.45	0.16
152	601689	拓普集团	32,780	1,849,447.60	0.16
153	002027	分众传媒	381,568	1,846,789.12	0.16
154	600118	中国卫星	22,300	1,829,715.00	0.16
155	600019	宝钢股份	328,952	1,786,209.36	0.16
156	600760	中航沈飞	42,718	1,755,709.80	0.16
157	000807	云铝股份	78,700	1,742,418.00	0.15
158	601838	成都银行	96,063	1,700,315.10	0.15
159	600362	江西铜业	39,115	1,693,679.50	0.15
160	600104	上汽集团	173,500	1,693,360.00	0.15
161	600989	宝丰能源	83,200	1,691,456.00	0.15
162	300450	先导智能	41,300	1,681,736.00	0.15
163	688183	生益电子	12,600	1,668,240.00	0.15
164	601727	上海电气	238,100	1,666,700.00	0.15
165	600875	东方电气	57,500	1,654,275.00	0.15
166	601995	中金公司	45,600	1,648,440.00	0.15
167	002001	新 和 成	57,998	1,648,303.16	0.15
168	601825	沪农商行	218,300	1,635,067.00	0.14
169	601377	兴业证券	269,691	1,628,933.64	0.14
170	002422	科伦药业	41,900	1,613,988.00	0.14
171	601390	中国中铁	386,445	1,611,475.65	0.14
172	000538	云南白药	33,656	1,594,284.72	0.14
173	603296	华勤技术	21,400	1,589,378.00	0.14
174	600547	山东黄金	68,210	1,574,968.90	0.14
175	600795	国电电力	336,605	1,571,945.35	0.14
176	000166	申万宏源	352,310	1,550,164.00	0.14
177	600585	海螺水泥	90,768	1,538,517.60	0.14
178	600015	华夏银行	240,313	1,535,600.07	0.14

179	601669	中国电建	325,146	1,528,186.20	0.14
180	603893	瑞芯微	8,000	1,506,880.00	0.13
181	601916	浙商银行	569,300	1,497,259.00	0.13
182	300316	晶盛机电	24,700	1,491,880.00	0.13
183	002648	卫星化学	63,460	1,490,675.40	0.13
184	601066	中信建投	50,800	1,476,756.00	0.13
185	300015	爱尔眼科	175,944	1,453,297.44	0.13
186	601698	中国卫通	47,700	1,442,925.00	0.13
187	600346	恒力石化	79,879	1,414,657.09	0.13
188	601868	中国能建	528,200	1,410,294.00	0.12
189	600482	中国动力	42,700	1,400,560.00	0.12
190	601998	中信银行	200,084	1,386,582.12	0.12
191	002311	海大集团	31,000	1,382,910.00	0.12
192	002558	巨人网络	50,100	1,380,756.00	0.12
193	300418	昆仑万维	33,900	1,368,204.00	0.12
194	000625	长安汽车	187,302	1,342,955.34	0.12
195	600066	宇通客车	50,000	1,340,500.00	0.12
196	600426	华鲁恒升	55,880	1,336,649.60	0.12
197	002532	天山铝业	122,300	1,312,279.00	0.12
198	600221	海航控股	970,300	1,309,905.00	0.12
199	000157	中联重科	187,500	1,306,875.00	0.12
200	688036	传音控股	21,799	1,285,051.05	0.11
201	300803	指南针	13,800	1,265,046.00	0.11
202	605499	东鹏饮料	10,229	1,262,565.47	0.11
203	600011	华能国际	166,100	1,260,699.00	0.11
204	600048	保利发展	271,087	1,255,132.81	0.11
205	600436	片仔癀	11,411	1,246,994.08	0.11
206	600438	通威股份	102,200	1,237,642.00	0.11
207	601077	渝农商行	200,400	1,224,444.00	0.11
208	600115	中国东航	321,220	1,223,848.20	0.11
209	002236	大华股份	74,149	1,222,717.01	0.11
210	002493	荣盛石化	113,163	1,216,502.25	0.11
211	002736	国信证券	121,300	1,211,787.00	0.11
212	600570	恒生电子	57,153	1,211,072.07	0.11
213	600886	国投电力	90,790	1,208,414.90	0.11
214	600188	兖矿能源	67,520	1,199,830.40	0.11
215	688047	龙芯中科	7,688	1,189,102.96	0.11
216	601901	方正证券	162,700	1,171,440.00	0.10
217	003816	中国广核	296,900	1,160,879.00	0.10
218	601360	三六零	132,055	1,147,557.95	0.10
219	601058	赛轮轮胎	99,500	1,147,235.00	0.10
220	000301	东方盛虹	100,000	1,145,000.00	0.10
221	600026	中远海能	62,900	1,128,426.00	0.10

222	002074	国轩高科	40,800	1,122,408.00	0.10
223	601456	国联民生	124,700	1,102,348.00	0.10
224	601881	中国银河	86,445	1,086,613.65	0.10
225	600009	上海机场	46,879	1,082,904.90	0.10
226	600196	复星医药	47,901	1,076,335.47	0.10
227	000768	中航西飞	52,388	1,072,906.24	0.09
228	000975	山金国际	62,700	1,065,900.00	0.09
229	601111	中国国航	175,899	1,064,188.95	0.09
230	600029	南方航空	203,540	1,054,337.20	0.09
231	600415	小商品城	103,700	1,053,592.00	0.09
232	600674	川投能源	73,700	1,044,329.00	0.09
233	600219	南山铝业	260,000	1,037,400.00	0.09
233	601878	浙商证券	109,200	1,037,400.00	0.09
235	601186	中国铁建	173,653	1,033,235.35	0.09
236	601117	中国化学	138,300	1,016,505.00	0.09
237	600233	圆通速递	64,500	1,015,875.00	0.09
238	601877	正泰电器	40,479	1,014,808.53	0.09
239	301236	软通动力	23,400	993,330.00	0.09
240	600372	中航机载	91,500	992,775.00	0.09
241	301269	华大九天	8,300	991,186.00	0.09
242	000963	华东医药	33,030	928,803.60	0.08
243	600741	华域汽车	59,455	922,741.60	0.08
244	002920	德赛西威	11,300	920,950.00	0.08
245	688506	百利天恒	3,100	911,493.00	0.08
246	000895	双汇发展	39,197	878,012.80	0.08
247	001979	招商蛇口	136,079	874,987.97	0.08
248	002304	洋河股份	22,715	866,577.25	0.08
249	300866	安克创新	8,100	846,450.00	0.07
250	601898	中煤能源	69,100	841,638.00	0.07
251	601021	春秋航空	18,462	841,497.96	0.07
252	601319	中国人保	120,600	815,256.00	0.07
253	600023	浙能电力	151,900	798,994.00	0.07
254	600039	四川路桥	98,660	771,521.20	0.07
255	601800	中国交建	134,288	766,784.48	0.07
256	000002	万 科 A	256,820	760,187.20	0.07
257	688223	晶科能源	155,547	738,848.25	0.07
258	600588	用友网络	77,611	712,468.98	0.06
259	601633	长城汽车	47,000	709,230.00	0.06
260	001965	招商公路	77,100	706,236.00	0.06
261	600600	青岛啤酒	13,400	699,882.00	0.06
262	600918	中泰证券	129,700	690,004.00	0.06
263	600061	国投资本	104,965	687,520.75	0.06
264	603369	今世缘	28,200	668,622.00	0.06

265	600027	华电国际	149,300	664,385.00	0.06
266	601618	中国中冶	269,538	657,672.72	0.06
267	601059	信达证券	40,100	649,219.00	0.06
268	302132	中航成飞	11,100	647,352.00	0.06
269	601607	上海医药	42,000	646,800.00	0.06
270	603260	合盛硅业	13,400	646,684.00	0.06
271	300628	亿联网络	19,080	645,285.60	0.06
272	000617	中油资本	95,600	630,004.00	0.06
273	600025	华能水电	70,442	626,229.38	0.06
274	300832	新产业	14,800	621,600.00	0.05
275	300251	光线传媒	55,300	613,277.00	0.05
276	600930	华电新能	125,900	600,543.00	0.05
277	600085	同仁堂	25,887	598,248.57	0.05
278	688472	阿特斯	54,781	592,730.42	0.05
279	600515	海南机场	215,500	590,470.00	0.05
280	000999	华润三九	25,085	564,161.65	0.05
281	600803	新奥股份	35,000	553,000.00	0.05
282	600018	上港集团	114,247	539,245.84	0.05
283	600845	宝信软件	32,356	538,080.28	0.05
284	300122	智飞生物	45,033	526,435.77	0.05
285	300999	金龙鱼	22,500	523,350.00	0.05
286	300896	爱美客	5,740	500,528.00	0.04
287	000596	古井贡酒	6,200	494,760.00	0.04
288	000708	中信特钢	38,000	479,560.00	0.04
289	688009	中国通号	97,344	463,357.44	0.04
290	601018	宁波港	146,800	462,420.00	0.04
291	601238	广汽集团	83,800	425,704.00	0.04
292	688303	大全能源	24,342	424,281.06	0.04
293	001280	中国铀业	6,300	420,210.00	0.04
294	300413	芒果超媒	28,200	412,566.00	0.04
295	301165	锐捷网络	5,100	410,295.00	0.04
296	603392	万泰生物	14,323	386,291.31	0.03
297	601136	首创证券	24,400	340,380.00	0.03
298	001391	国货航	55,300	225,071.00	0.02

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	301666	大普微	1,220	565,262.60	0.05
2	001248	华润新能源	55,060	556,656.60	0.05
3	688808	联讯仪器	163	258,245.79	0.02
4	688820	盛合晶微	1,650	233,458.50	0.02
5	001399	惠科股份	6,027	167,128.71	0.01
6	688818	电科蓝天	1,717	120,430.38	0.01

7	301682	宏明电子	714	114,282.84	0.01
8	688797	臻宝科技	207	97,014.69	0.01
9	688785	恒运昌	116	53,725.40	0.00
10	688813	泰金新能	234	40,269.06	0.00
11	688635	长进光子	128	39,448.32	0.00
12	001257	盛龙股份	1,743	36,149.82	0.00
13	603459	红板科技	330	27,825.60	0.00
14	001365	天海电子	719	22,511.89	0.00
15	688811	有研复材	834	20,124.42	0.00
16	301696	三瑞智能	216	18,748.80	0.00
17	001237	惠康科技	285	16,740.90	0.00
18	301669	高特电子	546	15,506.40	0.00
19	301687	新广益	195	15,167.10	0.00
20	001393	维通利	387	15,089.13	0.00
21	301531	春光集团	290	14,952.40	0.00
22	301599	理奇智能	433	14,059.51	0.00
23	601112	振石股份	775	13,632.25	0.00
24	301680	固德电材	117	13,122.72	0.00
25	301683	慧谷新材	96	11,689.92	0.00
26	688781	视涯科技	217	10,331.37	0.00
27	688816	易思维	177	10,106.70	0.00
28	688712	北芯生命	234	8,405.28	0.00
29	301513	尚水智能	138	7,032.48	0.00
30	603435	嘉德利	104	4,857.84	0.00
31	603352	至信股份	112	2,858.24	0.00
32	603293	埃泰克	72	2,442.96	0.00
33	001312	福恩股份	134	2,248.52	0.00
34	603284	林平发展	46	1,604.02	0.00
35	001220	世盟股份	57	1,583.46	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	000988	华工科技	5,852,824.63	0.49
2	301308	江波龙	5,115,705.04	0.43
3	688072	拓荆科技	4,967,413.49	0.42
4	688521	芯原股份	3,703,972.40	0.31
5	002353	杰瑞股份	3,535,609.00	0.30
6	002602	世纪华通	3,401,096.00	0.29
7	600549	厦门钨业	2,870,390.00	0.24
8	000657	中钨高新	2,757,154.00	0.23
9	002202	金风科技	2,309,918.00	0.19

10	002837	英维克	2,011,335.70	0.17
11	600118	中国卫星	1,794,586.00	0.15
12	300450	先导智能	1,790,152.00	0.15
13	601727	上海电气	1,749,996.00	0.15
14	002532	天山铝业	1,714,558.00	0.14
15	688183	生益电子	1,606,675.88	0.13
16	600221	海航控股	1,498,753.00	0.13
17	300502	新易盛	1,311,806.00	0.11
18	002558	巨人网络	1,227,105.00	0.10
19	600183	生益科技	1,192,525.00	0.10
20	300394	天孚通信	950,166.10	0.08

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	300750	宁德时代	7,335,743.00	0.62
2	300308	中际旭创	6,685,505.00	0.56
3	600519	贵州茅台	6,096,760.00	0.51
4	300502	新易盛	4,874,428.80	0.41
5	601318	中国平安	4,775,788.00	0.40
6	601899	紫金矿业	4,127,838.00	0.35
7	600036	招商银行	3,566,239.00	0.30
8	000333	美的集团	3,059,617.55	0.26
9	601088	中国神华	2,532,551.00	0.21
10	600900	长江电力	2,462,487.00	0.21
11	601166	兴业银行	2,391,151.00	0.20
12	002475	立讯精密	2,333,621.00	0.20
13	601398	工商银行	2,307,031.00	0.19
14	688256	寒武纪	2,290,872.90	0.19
15	300059	东方财富	1,983,682.00	0.17
16	600030	中信证券	1,971,127.00	0.17
17	601328	交通银行	1,914,901.00	0.16
18	601138	工业富联	1,903,569.00	0.16
19	300394	天孚通信	1,889,176.00	0.16
20	002594	比亚迪	1,877,668.00	0.16

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	76,119,116.70
卖出股票收入（成交）总额	219,802,409.51

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
第 56 页 共 65 页

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招商银行的发行主体招商银行股份有限公司于 2025 年 9 月 12 日因数据安全管理工作不到位等受到国家金融监督管理总局处罚; 于 2026 年 7 月 17 日因部分机构未纳入并表管理范围、未从银行集团层面对同一客户统一授信等受到国家金融监督管理总局处罚。招商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约定的备选股票库

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	59,034.04

2	应收清算款	1,091,928.85
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	551,451.07
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	1,702,413.96

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	301666	大普微	565,262.60	0.05	新股锁定
2	001248	华润新能源	556,656.60	0.05	新股未上市
3	688808	联讯仪器	258,245.79	0.02	新股锁定
4	688820	盛合晶微	233,458.50	0.02	新股锁定
5	001399	惠科股份	167,128.71	0.01	新股锁定

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 (%)
大成沪深 300 指数 A	63,295	14,653.29	506,808.41	0.05	926,973,435.77	99.95

大成沪深 300 指数 C	3,735	4,275.38	0.00	0.00	15,968,540.41	100.00
大成沪深 300 指数 Y	572	5,699.37	0.00	0.00	3,260,038.55	100.00
合计	67,602	14,004.15	506,808.41	0.05	946,202,014.73	99.95

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	大成沪深 300 指数 A	42,442.09	0.0046
	大成沪深 300 指数 C	402.09	0.0025
	大成沪深 300 指数 Y	9.09	0.0003
	合计	42,853.27	0.0045

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）。

8.3 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	大成沪深 300 指数 A	0~10
	大成沪深 300 指数 C	0
	大成沪深 300 指数 Y	0
	合计	0~10
本基金基金经理持有本开放式基金	大成沪深 300 指数 A	0
	大成沪深 300 指数 C	0
	大成沪深 300 指数 Y	0
	合计	0

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	大成沪深 300 指数 A	大成沪深 300 指数 C	大成沪深 300 指数 Y
基金合同生效日（2006 年 4 月 6 日）基金份额总额	1,813,356,066.47	-	-

本报告期期初 基金份额总额	978,027,010.85	14,828,620.68	1,945,216.18
本报告期基金 总申购份额	91,063,487.55	13,405,291.36	2,279,433.04
减：本报告期 基金总赎回份 额	141,610,254.22	12,265,371.63	964,610.67
本报告期基金 拆分变动份额	-	-	-
本报告期期末 基金份额总额	927,480,244.18	15,968,540.41	3,260,038.55

§ 10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

无。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

一、基金管理人的重大人事变动

经大成基金管理有限公司 2026 年第一次临时股东会及公司九届四次监事会审议通过，同意选举郭向东先生为公司第九届监事会股东代表监事，监事会主席，任期自 2026 年 4 月 30 日之日起计算，与公司第九届监事会剩余任期一致。自郭向东先生的监事任职生效之日起，陈勇先生将不再担任公司监事、监事会主席职务。

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

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安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）为本基金提供审计服务至今。

10.6 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况

10.6.1 管理人受调查或处罚等情况

本报告期内，基金管理人无受调查或处罚等情况。

10.6.2 管理人相关从业人员受调查或处罚等情况

本报告期内，基金管理人相关从业人员无受调查或处罚等情况。

10.6.3 托管人受调查或处罚等情况

无。

10.6.4 托管人相关从业人员受调查或处罚等情况

无。

10.7 基金租用或者通过证券公司交易单元进行证券投资的相关情况

10.7.1 基金租用或者通过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(%)	
国信证券	1	94,440,198.50	32.24	18,510.35	32.24	-
国泰海通	3	89,011,997.00	30.39	17,446.31	30.39	-
广发证券	2	67,935,026.75	23.19	13,315.31	23.19	-
中信建投证券	2	33,620,015.23	11.48	6,589.51	11.48	-
华泰证券	1	7,912,122.71	2.70	1,550.69	2.70	-
爱建证券	1	-	-	-	-	-
财通证券	1	-	-	-	-	-
长江证券	1	-	-	-	-	新增 1 个
第一创业	1	-	-	-	-	-
东北证券	1	-	-	-	-	-
东财证券	1	-	-	-	-	-
东方证券	1	-	-	-	-	-
东吴证	1	-	-	-	-	-

券						
东兴证 券	1	-	-	-	-	-
方正证 券	1	-	-	-	-	-
高盛中 国证券	1	-	-	-	-	-
光大证 券	2	-	-	-	-	-
国金证 券	2	-	-	-	-	-
国盛证 券	1	-	-	-	-	-
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	0	-	-	-	-	退 租 1 个
西部证 券	1	-	-	-	-	-
信达证 券	0	-	-	-	-	退 租 1 个
兴业证	2	-	-	-	-	-

券						
野村东方国际证券	1	-	-	-	-	-
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 基金租用或者通过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	大成沪深 300 指数证券投资基金(A 类)	中国证监会基金电子披	2026 年 06 月 30 日

	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	
2	大成沪深 300 指数证券投资基金(C 类份额)基金产品资料概要更新	中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站	2026 年 06 月 30 日
3	大成沪深 300 指数证券投资基金(Y 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	2026 年 06 月 30 日
4	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	2026 年 06 月 30 日
5	大成沪深 300 指数证券投资基金更新招募说明书	中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站	2026 年 05 月 06 日
6	2025 年度公募基金管理人以股东身份(通过公募基金持股)参与股东大会投票信息披露	中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站	2026 年 04 月 30 日
7	大成沪深 300 指数证券投资基金 2026 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	2026 年 04 月 22 日
8	大成基金管理有限公司旗下 212 只公募基金 2026 年第 1 季度报告提示性公告	规定报刊	2026 年 04 月 22 日
9	大成沪深 300 指数证券投资基金 2025 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	2026 年 03 月 31 日
10	大成基金管理有限公司旗下 205 只公募基金 2025 年年度报告提示性公告	规定报刊	2026 年 03 月 31 日
11	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	2026 年 02 月 14 日
12	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	2026 年 01 月 30 日
13	大成基金管理有限公司旗下 205 只公募基金 2025 年第 4 季度报告提示性公告	规定报刊	2026 年 01 月 22 日
14	大成沪深 300 指数证券投资基金 2025 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	2026 年 01 月 22 日
15	关于大成沪深 300 指数证券投资基金恢复大额申购(含定期定额申购)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	2026 年 01 月 17 日
16	大成基金管理有限公司关于大成沪深	中国证监会基金电子披	2026 年 01 月 14 日

	300 指数证券投资基金 2025 年度第 1 次分红的公告	露网站、规定报刊及本公司网站	
--	--------------------------------	----------------	--

§ 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沪深 300 指数证券投资基金的文件；
- 2、《大成沪深 300 指数证券投资基金基金合同》；
- 3、《大成沪深 300 指数证券投资基金托管协议》；
- 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

2026 年 8 月 28 日