

大成上证科创板综合指数增强型证券投资基金

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 04 月 29 日（基金合同生效日）起至 06 月 30 日止。

1.2 目录

§ 1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
§ 2 基金简介	5
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人和基金托管人	6
2.4 信息披露方式	6
2.5 其他相关资料	6
§ 3 主要财务指标和基金净值表现	6
3.1 主要会计数据和财务指标	6
3.2 基金净值表现	7
§ 4 管理人报告	9
4.1 基金管理人及基金经理情况	9
4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明	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遵规守信情况声明	13
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	13
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见	13
§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）	14
6.1 资产负债表	14
6.2 利润表	15
6.3 净资产变动表	16
6.4 报表附注	17
§ 7 投资组合报告	42
7.1 期末基金资产组合情况	42
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	42
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	44
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	53
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	54
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	55

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	55
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	55
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	55
7.10 本基金投资股指期货的投资政策	55
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	55
7.12 投资组合报告附注	55
§ 8 基金份额持有人信息	56
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	56
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	57
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	57
§ 9 开放式基金份额变动	57
§ 10 重大事件揭示	58
10.1 基金份额持有人大会决议	58
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	58
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	58
10.4 基金投资策略的改变	58
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	58
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	58
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	59
10.8 其他重大事件	59
§ 11 影响投资者决策的其他重要信息	61
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	61
11.2 影响投资者决策的其他重要信息	61
§ 12 备查文件目录	61
12.1 备查文件目录	61
12.2 存放地点	61
12.3 查阅方式	61

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	大成上证科创板综合指数增强型证券投资基金	
基金简称	大成上证科创板综合指数增强	
基金主代码	023893	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2025 年 4 月 29 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	119,375,166.19 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	大成上证科创板综合指数增强 A	大成上证科创板综合指数增强 C
下属分级基金的交易代码	023893	023894
报告期末下属分级基金的份额总额	79,794,276.92 份	39,580,889.27 份

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金为增强型股票指数基金，力争在对标的指数进行有效跟踪的基础上，实现超越目标指数的投资收益，谋求基金资产的长期增值。本基金力争使日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.5%，年化跟踪误差不超过 7.75%。
投资策略	<p>标的指数：上证科创板综合指数</p> <p>本基金在指数化投资的基础上通过数量化模型进行投资组合优化，在控制与业绩比较基准偏离风险的前提下，力争获得超越标的指数的投资收益。</p> <p>一) 股票投资策略</p> <p>1、指数化投资策略</p> <p>本基金将运用指数化的投资方法，通过研究标的指数成份股的构成及其权重确定本基金投资组合的基本构成和大致占比，并通过控制投资组合中成份股对标的指数中权重的偏离，以控制跟踪误差，进而达成对标的指数的跟踪目标。</p> <p>2、指数增强型策略</p> <p>3、股票组合调整</p> <p>二) 港股投资策略</p> <p>三) 债券投资策略</p> <p>四) 资产支持证券投资策略</p> <p>五) 股指期货的投资策略</p> <p>六) 国债期货投资策略</p> <p>七) 股票期权投资策略</p> <p>八) 融资及转融通证券出借业务投资策略</p>

	九) 存托凭证投资策略
业绩比较基准	上证科创板综合指数收益率 \times 95% + 银行活期存款利率(税后) \times 5%
风险收益特征	本基金是股票型基金，其预期风险与预期收益高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。本基金主要投资于标的指数成份股及备选成份股，具有与标的指数相似的风险收益特征。本基金还可投资港股通标的股票，需承担港股通机制下因投资环境、投资标的、市场制度以及交易规则等差异带来的特有风险。同时本基金为指数基金，通过跟踪标的指数表现，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。

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	《上海证券报》
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	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

§ 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	2025 年 4 月 29 日(基金合同生效日) - 2025 年 6 月 30 日	
	大成上证科创板综合指数增强 A	大成上证科创板综合指数增强 C

本期已实现收益	3,496,371.99	1,555,663.09
本期利润	5,625,239.79	2,780,194.31
加权平均基金份额本期利润	0.0335	0.0260
本期加权平均净值利润率	3.35%	2.60%
本期基金份额净值增长率	4.51%	4.43%
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	2,409,212.68	1,165,505.56
期末可供分配基金份额利润	0.0302	0.0294
期末基金资产净值	83,390,020.27	41,334,491.25
期末基金份额净值	1.0451	1.0443
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	4.51%	4.43%

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

大成上证科创板综合指数增强 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

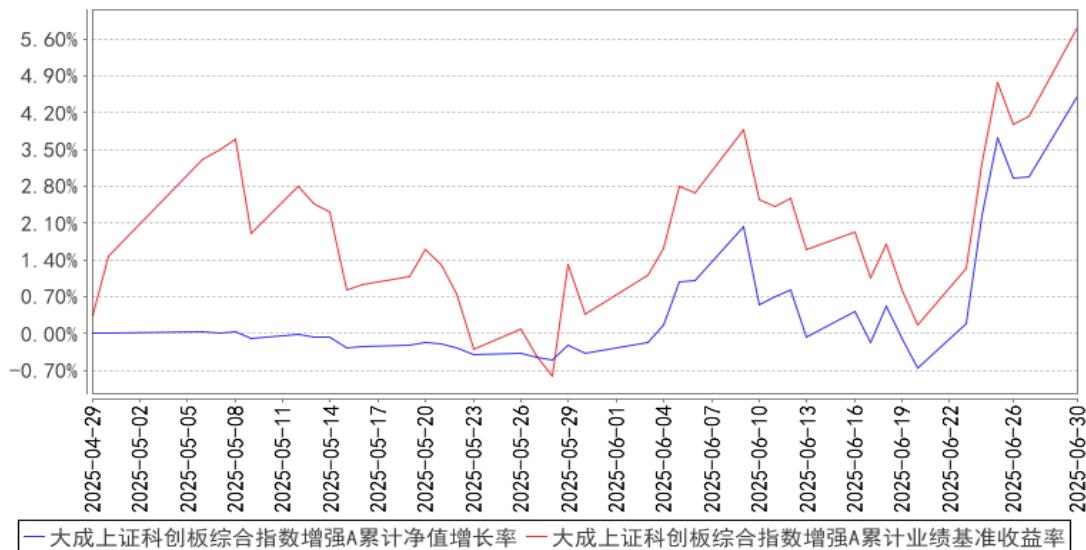
过去一个月	4.90%	0.90%	5.43%	0.96%	-0.53%	-0.06%
自基金合同生效起至今	4.51%	0.64%	5.82%	0.96%	-1.31%	-0.32%

大成上证科创板综合指数增强 C

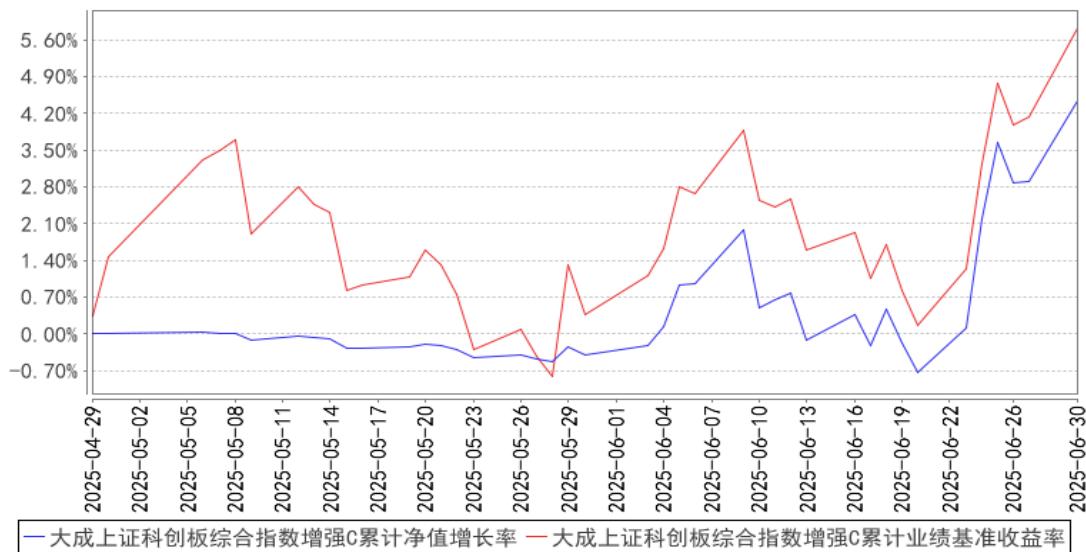
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	4.85%	0.89%	5.43%	0.96%	-0.58%	-0.07%
自基金合同生效起至今	4.43%	0.63%	5.82%	0.96%	-1.39%	-0.33%

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

大成上证科创板综合指数增强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



大成上证科创板综合指数增强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、本基金合同生效日为 2025 年 4 月 29 日，截止报告期末本基金合同生效未满一年。

2、本基金合同规定，本基金自基金合同生效之日起六个月内为建仓期。截至报告期末，本基金处于建仓期。

§ 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		
刘旺	本基金基 金经理	2025 年 4 月 29 日	-	7 年	香港中文大学理学(金融工程)硕士。2018 年 5 月加入大成基金管理有限公司, 曾担任指数与期货投资部研究员兼基金经理助理, 现任指数与期货投资部基金经理。2024 年 1 月 2 日起任大成沪深 300 指数增强型发起式证券投资基金基金经理。2024 年 11 月 15 日起任大成中证 1000 指数增强型发起式证券投资基金基金经理。2025 年 4 月 29 日起任大成上证科创板综合指数增强型证券投资基金基金经理。具备基金从业资格。国籍: 中国
夏高	本基金基 金经理, 指数与期 货投资部 副总监	2025 年 4 月 29 日	-	14 年	清华大学工学博士。2011 年 1 月至 2012 年 5 月就职于博时基金管理有限公司, 任股票投资部投资分析员。2012 年 7 月加入大成基金管理有限公司, 曾担任数量与指数投资部高级数量分析师、基金经理助理、总监助理, 现任指数与期货投资部副总监。2014 年 12 月 6 日至 2023 年 3 月 20 日任大成中证红利指数证券投资基金基金经理。2015 年 6 月 29 日至 2020 年 11 月 13 日担任大成中证互联网金融指数分级证券投资基金基金经理。2016 年 2 月 3 日起任大成中证 360 互联网+大数据 100 指数型证券投资基金基金经理。2017 年 3 月 21 日至 2021 年 4 月 27 日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。2020 年 9 月 18 日至 2022 年 10 月 17 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。2020 年 9 月 18 日至 2022 年 10 月 25 日任大成绝对收益策略混合型发起式证券投资基金基金经理。2021 年 2 月 23 日起任大成沪深 300 指数增强型发起式证券投资基金基金经理。2021 年 4 月 29 日至 2022 年 5 月 26 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。2023 年 4 月 14 日起任大成动态量化配置策略混合型证券投资基金基金经理。2024 年 7 月 19 日起任大成中证 500 指数增强型证券投资基金基金经理。2025 年 4 月 29 日起任大成上证科创板综合指数增强型证券投资基金基金经理。

					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遵规守信情况的说明

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

2025年上半年，国内经济在“政策托底、结构性复苏”主线下稳步修复。根据国家统计局数据，上半年GDP同比增长5.3%，其中一季度增长5.4%，二季度增长5.2%。财政政策通过超长期特别国债、专项债等工具支持“两重”“两新”建设，叠加货币政策降准降息落地，市场流动性

保持充裕。央行通过逆回购和 MLF 操作释放资金，银行间市场利率维持低位。

板块方面，市场上半年主线聚焦政策支持的科技与高端制造领域，人工智能、机器人、新能源等热点主题轮动上涨，成长风格显著优于价值风格表现。

2 季度内本基金成立并择机建仓，建仓后保持高仓位运作。策略方面采用低相关性多策略分仓管理，从而降低基金整体超额收益波动。风控方面约束全体大类风格因子暴露，从而降低单一风格因子回撤带来的影响。本基金后续将继续采用数量化手段优选个股及构建组合，同时严格控制跟踪误差及风险暴露，以期获得超越基准的稳定超额收益。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末大成上证科创板综合指数增强 A 的基金份额净值为 1.0451 元，本报告期基金份额净值增长率为 4.51%，同期业绩比较基准收益率为 5.82%；截至本报告期末大成上证科创板综合指数增强 C 的基金份额净值为 1.0443 元，本报告期基金份额净值增长率为 4.43%，同期业绩比较基准收益率为 5.82%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望下半年，政策效果预期将持续释放。科技产业在 AI 大模型、机器人等技术突破催化下，有望成为经济增长的核心引擎。相关成果有望持续提高市场风险偏好，看好全年受益于情绪提振的科创板块表现。

本基金将继续按照基金合同约定，保持较高仓位运作，力争在控制跟踪误差的前提下尽量获得超额收益。

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有交易的债券品种的估值数据和流通受限股票的折扣率数据。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金管理人严格按照本基金基金合同的规定进行收益分配。本报告期内本基金无收益分配事项。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

无。

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

在托管本基金的过程中，本基金托管人中国农业银行股份有限公司严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》相关法律法规的规定以及基金合同、托管协议的约定，对本基金基金管理人一大成基金管理有限公司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遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

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

5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人认为，大成基金管理有限公司的信息披露事务符合《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》及其他相关法律法规的规定，基金管理人所编制和披露的本基金中期报告中的财务

指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告等信息真实、准确、完整，未发现有损害基金持有人利益的行为。

§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：大成上证科创板综合指数增强型证券投资基金

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
资产：		
货币资金	6.4.7.1	17,494,511.74
结算备付金		911,321.58
存出保证金		301,891.20
交易性金融资产	6.4.7.2	115,111,540.54
其中：股票投资		115,055,535.63
基金投资		—
债券投资		56,004.91
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		—
应收申购款		144,248.60
递延所得税资产		—
其他资产	6.4.7.8	—
资产总计		133,963,513.66
负债和净资产	附注号	本期末 2025 年 6 月 30 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		-
应付赎回款		9,033,053.71
应付管理人报酬		134,307.36
应付托管费		16,788.44
应付销售服务费		22,893.37
应付投资顾问费		-
应交税费		0.22
应付利润		-
递延所得税负债		-
其他负债	6.4.7.9	31,959.04
负债合计		9,239,002.14
净资产：		
实收基金	6.4.7.10	119,375,166.19
未分配利润	6.4.7.12	5,349,345.33
净资产合计		124,724,511.52
负债和净资产总计		133,963,513.66

注：报告截止日 2025 年 06 月 30 日，基金份额总额 119,375,166.19 份。其中大成上证科创板综合指数增强 A 类基金份额总额为 79,794,276.92 份，基金份额净值 1.0451 元；大成上证科创板综合指数增强 C 类基金份额总额为 39,580,889.27 份，基金份额净值 1.0443 元。

6.2 利润表

会计主体：大成上证科创板综合指数增强型证券投资基金

本报告期：2025 年 4 月 29 日（基金合同生效日）至 2025 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2025 年 4 月 29 日（基金合同 生效日）至 2025 年 6 月 30 日
一、营业收入		8,934,741.77
1. 利息收入		205,764.54
其中：存款利息收入	6.4.7.13	162,550.44
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		43,214.10
其他利息收入		-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		5,328,466.35
其中：股票投资收益	6.4.7.14	4,811,336.75
基金投资收益		-
债券投资收益	6.4.7.15	4.71
资产支持证券投资收益	6.4.7.16	-
贵金属投资收益	6.4.7.17	-
衍生工具收益	6.4.7.18	-57.79

股利收益	6. 4. 7. 19	517, 182. 68
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, 353, 399. 02
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	47, 111. 86
减：二、营业总支出		529, 307. 67
1. 管理人报酬	6. 4. 10. 2. 1	375, 845. 25
其中：暂估管理人报酬		—
2. 托管费	6. 4. 10. 2. 2	46, 980. 69
3. 销售服务费	6. 4. 10. 2. 3	73, 479. 29
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		0. 02
8. 其他费用	6. 4. 7. 23	33, 002. 42
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		8, 405, 434. 10
减：所得税费用		—
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		8, 405, 434. 10
五、其他综合收益的税后净额		—
六、综合收益总额		8, 405, 434. 10

6.3 净资产变动表

会计主体：大成上证科创板综合指数增强型证券投资基金

本报告期：2025 年 4 月 29 日（基金合同生效日）至 2025 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期			
	2025 年 4 月 29 日（基金合同生效日）至 2025 年 6 月 30 日	实收基金	其他综合收益	未分配利润
一、上期期末净资产	—	—	—	—
二、本期期初净资产	389, 373, 541. 46	—	—	389, 373, 541. 46
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	-269, 998, 375. 2 7	—	5, 349, 345. 33	-264, 649, 029. 94
(一)、综合收益总额	—	—	8, 405, 434. 10	8, 405, 434. 10
(二)、本期基金份额交易产生的净资产变动数	-269, 998, 375. 2 7	—	-3, 056, 088. 77	-273, 054, 464. 04

(净资产减少以“-”号填列)				
其中：1. 基金申购款	3,107,804.58	-	17,151.76	3,124,956.34
2. 基金赎回款	-273,106,179.85	-	-3,073,240.53	-276,179,420.38
(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	119,375,166.19	-	5,349,345.33	124,724,511.52

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

大成上证科创板综合指数增强型证券投资基金(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”)证监许可[2025]584号文《关于准予大成上证科创板综合指数增强型证券投资基金注册的批复》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《大成上证科创板综合指数增强型证券投资基金基金合同》作为发起人向社会公开募集,募集期为2025年4月7日至2025年4月25日,首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币389,253,058.23元。募集期结束经安永华明会计师事务所验证并出具安永华明(2025)验字第70039092_H08号验资报告后,向中国证监会报送基金备案材料。基金合同于2025年4月29日生效,基金合同生效日的基金份额总额为389,373,541.46份基金份额,其中认购资金利息折合120,483.23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,注册登记机构为本基金管理人,基金托管人为中国农业银行股份有限公司。

本基金投资范围主要为标的指数成份股及备选成份股(含存托凭证,下同),此外,为更好地实现投资目标,本基金可少量投资于部分非成份股(包含主板、创业板、科创板及其他经中国证监

会核准或注册上市的股票及存托凭证、港股通标的股票)、债券(包括国债、央行票据、金融债券、企业债券、公司债券、中期票据、短期融资券、超短期融资券、公开发行的次级债券、政府支持机构债券、政府支持债券、地方政府债券、可转换债券、可交换公司债券及其他经中国证监会允许投资的债券)、资产支持证券、债券回购、同业存单、银行存款(包括协议存款、定期存款及其他银行存款)、货币市场工具、股指期货、国债期货、股票期权、现金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。本基金可以根据有关法律法规的规定参与融资及转融通证券出借业务。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种(包括但不限于股指期权等金融衍生品),基金管理人在履行适当程序后,可以将其纳入投资范围。

基金的投资组合比例为:股票资产投资比例不低于基金资产的 80%,其中投资于标的指数成份股和备选成份股的资产不低于非现金基金资产的 80%,投资于港股通标的股票的比例占股票资产的 0-50%;每个交易日日终在扣除股指期货、国债期货、股票期权合约需缴纳的交易保证金后,保持不低于基金资产净值 5%的现金或到期日在一年以内的政府债券,其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。股指期货、国债期货、股票期权及其他金融工具的投资比例符合法律法规和监管机构的规定。如法律法规或中国证监会变更投资品种的投资比例限制,基金管理人在履行适当程序后,可以调整上述投资品种的投资比例。

本基金的业绩比较基准:上证科创板综合指数收益率×95%+银行活期存款利率(税后)×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》、《证券投资基金信息披露内容与格式准则》第 3 号《半年度报告的内容与格式》、《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》、《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 2025 年 6 月 30 日的财务状况以及 2025 年 4 月 29 日(基金合同生效日)起至 2025 年 6 月 30 日止的经营成果和净资产变动情况等有关信息。

6.4.4 重要会计政策和会计估计

6.4.4.1 会计年度

本基金会计年度为公历 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。本财务报表的实际编制期间为 2025 年 4 月 29 日（基金合同生效日）至 2025 年 6 月 30 日止期间。

6.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

6.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

金融工具是指形成本基金的金融资产（或负债），并形成其他单位的金融负债（或资产）或权益工具的合同。

（1）金融资产分类

本基金的金融资产于初始确认时根据管理金融资产的业务模式和金融资产的合同现金流量特征分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、以摊余成本计量的金融资产。

（2）金融负债分类

本基金的金融负债于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债、以摊余成本计量的金融负债。

6.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

本基金于成为金融工具合同的一方时确认一项金融资产或金融负债。

划分为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和金融负债，以及不作为有效套期工具的衍生工具，按照取得时的公允价值作为初始确认金额，相关的交易费用在发生时计入当期损益。

划分为以摊余成本计量的金融资产和金融负债，按照取得时的公允价值作为初始确认金额，相关交易费用计入其初始确认金额。

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，采用公允价值进行后续计量，所有公允价值变动计入当期损益。

对于以摊余成本计量的金融资产，采用实际利率法确认利息收入，其终止确认、修改或减值产生的利得或损失，均计入当期损益。

本基金以预期信用损失为基础，对以摊余成本计量的金融资产进行减值处理并确认损失准备。对于不含重大融资成分的应收款项，本基金运用简化计量方法，按照相当于整个存续期内的预期信用损失金额计量损失准备。除上述采用简化计量方法以外的金融资产，本基金在每个估值日评估其信用风险自初始确认后是否已经显著增加，如果信用风险自初始确认后未显著增加，处

于第一阶段，本基金按照相当于未来 12 个月内预期信用损失的金额计量损失准备，并按照账面余额和实际利率计算利息收入；如果信用风险自初始确认后已显著增加但尚未发生信用减值的，处于第二阶段，本基金按照相当于整个存续期内预期信用损失的金额计量损失准备，并按照账面余额和实际利率计算利息收入；如果初始确认后发生信用减值的，处于第三阶段，本基金按照相当于整个存续期内预期信用损失的金额计量损失准备，并按照摊余成本和实际利率计算利息收入。

本基金在每个估值日评估相关金融工具的信用风险自初始确认后是否已显著增加。本基金以单项金融工具或者具有相似信用风险特征的金融工具组合为基础，通过比较金融工具在估值日发生违约的风险与在初始确认日发生违约的风险，以确定金融工具预计存续期内发生违约风险的变化情况。

本基金计量金融工具预期信用损失的方法反映的因素包括：通过评价一系列可能的结果而确定的无偏概率加权平均金额、货币时间价值，以及在估值日无须付出不必要的额外成本或努力即可获得的有关过去事项、当前状况以及未来经济状况预测的合理且有依据的信息。

当对金融资产预期未来现金流量具有不利影响的一项或多项事件发生时，该金融资产成为已发生信用减值的金融资产。

当本基金不再合理预期能够全部或部分收回金融资产合同现金流量时，本基金直接减记该金融资产的账面余额。

当收取该金融资产现金流量的合同权利终止，或该收取金融资产现金流量的权利已转移，且符合金融资产转移的终止确认条件的，金融资产将终止确认。

本基金已将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方的，终止确认该金融资产；保留了金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬的，不终止确认该金融资产；本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬的，分别下列情况处理：放弃了对该金融资产控制的，终止确认该金融资产并确认产生的资产和负债；未放弃对该金融资产控制的，按照其继续涉入所转移金融资产的程度确认有关金融资产，并相应确认有关负债。

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债（含交易性金融负债和衍生金融负债），按照公允价值进行后续计量，所有公允价值变动均计入当期损益。对于以摊余成本计量的金融负债，采用实际利率法，按照摊余成本进行后续计量。如果金融负债的责任已履行、撤销或届满，则对金融负债进行终止确认。

6.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

公允价值，是指市场参与者在计量日发生的有序交易中，出售一项资产所能收到或者转移一项负债所需支付的价格。本基金以公允价值计量相关资产或负债，假定出售资产或者转移负债的

有序交易在相关资产或负债的主要市场进行；不存在主要市场的，本基金假定该交易在相关资产或负债的最有利市场进行。主要市场（或最有利市场）是本基金在计量日能够进入的交易市场。本基金采用市场参与者在对该资产或负债定价时为实现其经济利益最大化所使用的假设。

在财务报表中以公允价值计量或披露的资产和负债，根据对公允价值计量整体而言具有重要意义的最低层次输入值，确定所属的公允价值层次：第一层次输入值，在计量日能够取得的相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价；第二层次输入值，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；第三层次输入值，相关资产或负债的不可观察输入值。

每个资产负债表日，本基金对在财务报表中确认的持续以公允价值计量的资产和负债进行重新评估，以确定是否在公允价值计量层次之间发生转换。

本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和金融负债按如下原则确定公允价值并进行估值：

（1）存在活跃市场的金融工具，按照估值日能够取得的相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价作为公允价值；估值日无报价且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，应采用最近交易日的报价确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的报价不能真实反映公允价值的，应对报价进行调整，确定公允价值。

与上述投资品种相同，但具有不同特征的，应以相同资产或负债的公允价值为基础，并在估值技术中考虑不同特征因素的影响。特征是指对资产出售或使用的限制等，如果该限制是针对资产持有者的，那么在估值技术中不应将该限制作为特征考虑。此外，基金管理人不应考虑因大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价。

（2）不存在活跃市场的金融工具，应采用在当前情况下适用并且有足够可利用数据和其他信息支持的估值技术确定公允价值。采用估值技术确定公允价值时，应优先使用可观察输入值，只有在无法取得相关资产或负债可观察输入值或取得不切实可行的情况下，才使用不可观察输入值。

（3）如有确凿证据表明按上述方法进行估值不能客观反映其公允价值的，基金管理人可根据具体情况与基金托管人商定后，按最能反映公允价值的方法估值。

（4）如有新增事项，按国家最新规定估值。

6.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

当本基金具有抵销已确认金融资产和金融负债的法定权利，且该种法定权利现在是可执行的，同时本基金计划以净额结算或同时变现该金融资产和清偿该金融负债时，金融资产和金融负债以相互抵销后的金额在资产负债表内列示。除此以外，金融资产和金融负债在资产负债表内分别列示，不予相互抵销。

6.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行的基金份额总额所对应的金额。由于申购和赎回引起的实收基金变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日确认。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

6.4.4.8 损益平准金

损益平准金包括已实现平准金和未实现平准金。已实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现损益占净资产比例计算的金额。未实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未实现损益占净资产比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日确认，并于期末全额转入未分配利润/(累计亏损)。

6.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

(1) 对于以摊余成本计量的金融资产，采用实际利率法计算的利息扣除在适用情况下的相关税费后的净额确认利息收入，计入当期损益。处置时，其处置价格扣除相关交易费用后的净额与账面价值之间的差额确认为投资收益。

(2) 对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和金融负债，相关交易费用直接计入投资收益。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产为债务工具投资的，在持有期间将按票面或合同利率计算的利息收入扣除在适用情况下的相关税费后的净额计入投资收益，扣除该部分利息后的公允价值变动额计入公允价值变动损益；除上述之外的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和金融负债的公允价值变动形成的应计入当期损益的利得或损失计入公允价值变动损益。处置时，其处置价格与初始确认金额之间的差额扣除相关交易费用及在适用情况下的相关税费后的净额确认为投资收益。

本基金在同时符合下列条件时确认股利收入并计入当期损益：1) 本基金收取股利的权利已经确立；2) 与股利相关的经济利益很可能流入本基金；3) 股利的金额能够可靠计量。

(3) 其他收入在经济利益很可能流入从而导致资产增加或者负债减少、且经济利益的流入额能够可靠计量时确认。

6.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬和托管费等费用按照权责发生制原则，在本基金接受相关服务的期间计入当期损益。

以摊余成本计量的金融负债在持有期间确认的利息支出按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

6.4.4.11 基金的收益分配政策

本基金同一类别的每一基金份额享有同等分配权。本基金收益以现金形式分配，但基金份额持有人可选择现金红利或将现金红利按分红除权日的基金份额净值自动转为基金份额进行再投资。若期末未分配利润中的未实现部分为正数，包括基金经营活动产生的未实现损益以及基金份额交易产生的未实现平准金等，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润中的已实现部分；若期末未分配利润的未实现部分为负数，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润，即已实现部分相抵未实现部分后的余额。

经宣告的拟分配基金收益于分红除权日从净资产转出。

6.4.4.12 外币交易

无。

6.4.4.13 分部报告

本基金以内部组织结构、管理要求、内部报告制度为依据确定经营分部，以经营分部为基础确定报告分部并披露分部信息。经营分部是指本基金内同时满足下列条件的组成部分：

(1) 该组成部分能够在日常活动中产生收入、发生费用。

(2) 本基金的基金管理人能够定期评价该组成部分的经营成果，以决定向其配置资源、评价其业绩。

(3) 本基金能够取得该组成部分的财务状况、经营成果和现金流量等有关会计信息。

如果两个或多个经营分部具有相似的经济特征，并且满足一定条件的，则合并为一个经营分部。本基金目前以一个单一的经营分部运作，不需要披露分部信息。

6.4.4.14 其他重要的会计政策和会计估计

无。

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

根据财政部、国家税务总局财税[2016]36号文《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》的规定，经国务院批准，自2016年5月1日起在全国范围内全面推开营业税改征增值税试点，金融业纳入试点范围，由缴纳营业税改为缴纳增值税。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、债券的转让收入免征增值税；国债、地方政府债券利息收入以及金融同业往来利息收入免征增值税；存款利息收入不征收增值税。

根据财政部、国家税务总局财税[2016]46号文《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》的规定，金融机构开展的质押式买入返售金融商品业务及持有政策性金融债券取得的利息收入属于金融同业往来利息收入。

根据财政部、国家税务总局财税[2016]70号文《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》的规定，金融机构开展的买断式买入返售金融商品业务、同业存款、同业存单以及持有金融债券取得的利息收入属于金融同业往来利息收入。

根据财政部、国家税务总局财税[2016]140号文《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》的规定，本基金运营过程中发生的增值税应税行为，以本基金的基金管理人为增值税纳税人。

根据财政部、国家税务总局财税[2017]56号文《关于资管产品增值税有关问题的通知》的规定，证券投资基金的基金管理人运营证券投资基金过程中发生的增值税应税行为，暂适用简易计税方法，按照3%的征收率缴纳增值税。对证券投资基金在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，已纳税额从证券投资基金的基金管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。增值税应税行为的销售额根据财政部、国家税务总局财税[2017]90号文《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》的规定确定。

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号文《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号文《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 号文《财政部、国家税务总局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 号文《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，(如有) 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 号文《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，(如有) 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 号文《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 号文《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 2025 年 6 月 30 日
活期存款	6,962,205.61
等于：本金	6,961,749.33
加：应计利息	456.28

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	10,532,306.13
等于：本金	10,531,883.13
加：应计利息	423.00
减：坏账准备	—
合计	17,494,511.74

注：其他存款为存放在证券经纪商专用存款账户的证券交易结算资金。

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	111,798,496.61	—	115,055,535.63	3,257,039.02
贵金属投资-金交所 黄金合约	—	—	—	—
债券	56,000.00	4.91	56,004.91	0.00
交易所市场	—	—	—	—
银行间市场	—	—	—	—
合计	56,000.00	4.91	56,004.91	0.00
资产支持证券	—	—	—	—
基金	—	—	—	—
其他	—	—	—	—
合计	111,854,496.61	4.91	115,111,540.54	3,257,039.02

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

单位：人民币元

项目	本期末 2025 年 6 月 30 日			
	合同/名义 金额	公允价值		备注
		资产	负债	
利率衍 生工具	—	—	—	—
货币衍 生工具	—	—	—	—
权益衍	2,419,400.00	—	—	—

生工具				
其 中: 股指 期货投 资	2,419,400.00	-	-	-
其他衍 生工具	-	-	-	-
合计	2,419,400.00	-	-	-

6.4.7.3.2 期末基金持有的期货合约情况

单位: 人民币元

代码	名称	持仓量(买/卖)	合约市值	公允价值变动
IM2507	IM2507	2.00	2,515,760.00	96,360.00
合计				96,360.00
减: 可抵销期货 暂收款				96,360.00
净额				0.00

注: 1、买入持仓量以正数表示, 卖出持仓量以负数表示;

2、期货投资采用当日无负债结算制度, 结算准备金已包括所持期货合约产生的持仓损益, 因此衍生金融工具项下的期货投资与相关的期货暂收款(结算所得的持仓损益)之间按抵销后的净额为0。

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	—
应付证券出借违约金	—
应付交易费用	—
其中：交易所市场	—
银行间市场	—
应付利息	—
预提费用	31,883.04
其他	76.00
合计	31,959.04

6.4.7.10 实收基金

金额单位：人民币元

大成上证科创板综合指数增强 A

项目	本期 2025年4月29日（基金合同生效日）至2025年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
基金合同生效日	217,739,276.57	217,739,276.57
本期申购	929,233.89	929,233.89
本期赎回（以“-”号填列）	-138,874,233.54	-138,874,233.54
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	79,794,276.92	79,794,276.92

大成上证科创板综合指数增强 C

项目	本期	
	基金份额(份)	账面金额
基金合同生效日	171,634,264.89	171,634,264.89
本期申购	2,178,570.69	2,178,570.69
本期赎回(以“-”号填列)	-134,231,946.31	-134,231,946.31
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	39,580,889.27	39,580,889.27

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

大成上证科创板综合指数增强 A

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
基金合同生效日	-	-	-
本期期初	-	-	-
本期利润	3,496,371.99	2,128,867.80	5,625,239.79
本期基金份额交易产生的变动数	-1,087,159.31	-942,337.13	-2,029,496.44
其中：基金申购款	1,608.32	-559.83	1,048.49
基金赎回款	-1,088,767.63	-941,777.30	-2,030,544.93
本期已分配利润	-	-	-
本期末	2,409,212.68	1,186,530.67	3,595,743.35

大成上证科创板综合指数增强 C

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
基金合同生效日	-	-	-
本期期初	-	-	-
本期利润	1,555,663.09	1,224,531.22	2,780,194.31
本期基金份额交易产生的变动数	-390,157.53	-636,434.80	-1,026,592.33
其中：基金申购款	15,998.07	105.20	16,103.27
基金赎回款	-406,155.60	-636,540.00	-1,042,695.60
本期已分配利润	-	-	-
本期末	1,165,505.56	588,096.42	1,753,601.98

6.4.7.13 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期
	2025年4月29日（基金合同生效日）至2025年6月30日
活期存款利息收入	30,642.28
定期存款利息收入	—
其他存款利息收入	14,997.59
结算备付金利息收入	116,910.57
其他	—
合计	162,550.44

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4月29日（基金合同生效日）至2025年6月30日
股票投资收益——买卖股票差价收入	4,811,336.75
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	4,811,336.75

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4月29日（基金合同生效日）至2025年6月30日
卖出股票成交总额	127,532,191.88
减：卖出股票成本总额	122,562,966.36
减：交易费用	157,888.77
买卖股票差价收入	4,811,336.75

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

单位：人民币元

项目	本期
	2025年4月29日（基金合同生效日）至2025年6月30日
债券投资收益——利息收入	4.71
债券投资收益——买卖债券（债转股及债	—

券到期兑付) 差价收入	
债券投资收益——赎回差价收入	-
债券投资收益——申购差价收入	-
合计	4.71

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 资产支持证券投资收益

6.4.7.16.1 资产支持证券投资收益项目构成

无。

6.4.7.16.2 资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入

无。

6.4.7.16.3 资产支持证券投资收益——赎回差价收入

无。

6.4.7.16.4 资产支持证券投资收益——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

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 4 月 29 日（基金合同生效日）至 2025 年 6 月 30 日
股指期货投资收益	-57.79

6.4.7.19 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 4 月 29 日（基金合同生效日）至 2025 年 6 月 30 日
股票投资产生的股利收益	517,182.68
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	517,182.68

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 4 月 29 日（基金合同生效日）至 2025 年 6 月 30 日
1. 交易性金融资产	3,257,039.02
股票投资	3,257,039.02
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	96,360.00
权证投资	-
期货投资	96,360.00
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	3,353,399.02

6.4.7.21 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 4 月 29 日（基金合同生效日）至 2025 年 6 月 30 日
基金赎回费收入	45,045.68
基金转换费收入	2,066.18
合计	47,111.86

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4月29日(基金合同生效日)至2025年 6月30日
审计费用	11,477.97
信息披露费	20,405.07
证券出借违约金	-
存托服务费	4.38
银行划款手续费	715.00
其他	400.00
合计	33,002.42

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、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 权证交易

无。

6.4.10.1.5 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 2025 年 4 月 29 日（基金合同生效日）至 2025 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	375,845.25
其中：应支付销售机构的客户维护费	184,714.43
应支付基金管理人的净管理费	191,130.82

注：基金管理费每日计提，按月支付。基金管理费按前一日的基金资产净值的 0.80% 年费率计提。

计算方法如下：

$$H = E \times 0.80\% / \text{当年天数}$$

H 为每日应支付的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 4 月 29 日（基金合同生效日）至 2025 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	46,980.69

注：基金托管费每日计提，按月支付。基金托管费按前一日的基金资产净值的 0.10% 年费率计提。

计算方法如下：

$$H = E \times 0.10\% / \text{当年天数}$$

H 为每日应支付的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

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 4 月 29 日（基金合同生效日）至 2025 年 6 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	大成上证科创板综合指数增强 A	大成上证科创板综合指数增强 C	合计
大成基金	-	0.02	0.02
中国农业银行	-	53,060.87	53,060.87
合计	-	53,060.89	53,060.89

注：C 类基金份额的销售服务费年费率为 0.4%。

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 4 月 29 日（基金合同生效日）至 2025 年 6 月 30 日

	期末余额	当期利息收入
中国农业银行	6,962,205.61	30,642.28

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

金额单位：人民币元

6.4.12.1.2 受限证券类别：债券										
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：张)	期末成本总额	期末估值总额	备注
118056	路维转债	2025 年 6 月 11 日	1 个月内(含)	新债未上市	100.00	100.01	560	56,000.00	56,004.91	-

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
688313	仕佳光子	2025 年 6 月 30 日	重大事项停牌	38.05	2025 年 7 月 11 日	39.98	1,827	55,631.47	69,517.35	-

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

本基金是股票型基金，其预期风险与预期收益高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。同时本基金为指数基金，主要投资于标的指数成份股及备选成份股，具有与标的指数相似的风险收益特征。本基金还可投资港股通标的股票，需承担港股通机制下因投资环境、投资标的、市场制度以及交易规则等差异带来的特有风险。本基金在日常经营活动中面临的与这些金融工具相关的主要风险包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金的基金管理人从事风险管理的主要目标是力争在对标的指数进行有效跟踪的基础上，实现超越目标指数的投资收益，谋求基金资产的长期增值。

本基金的基金管理人奉行全面风险管理体系建设，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，本基金持有的除国债、央行票据和政策性金融债以外的债券占基金资产净值的比例为 0.04%。

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约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、结算备付金及存出保证金等。

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	17,494,511.74	-	-	-	17,494,511.74
结算备付金	911,321.58	-	-	-	911,321.58
存出保证金	-	-	-	301,891.20	301,891.20
交易性金融资产	-	-	56,004.91	115,055,535.63	115,111,540.54
应收申购款	-	-	-	144,248.60	144,248.60
资产总计	18,405,833.32	-	56,004.91	115,501,675.43	133,963,513.66
负债					
应付赎回款	-	-	-	9,033,053.71	9,033,053.71
应付管理人报酬	-	-	-	134,307.36	134,307.36
应付托管费	-	-	-	16,788.44	16,788.44
应付销售服务费	-	-	-	22,893.37	22,893.37
应交税费	-	-	-	0.22	0.22
其他负债	-	-	-	31,959.04	31,959.04
负债总计	-	-	56,004.91	106,262,673.29	9,239,002.14
利率敏感度缺口	18,405,833.32	-	56,004.91	106,262,673.29	124,724,511.52

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，本基金持有的交易性债券投资和交易性资产支持证券投资公允价值占净资产的比例为 0.04%，因此市场利率的变动对于本基金净资产无重大影响。

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。本基金的所有资产及负债以人民币计价，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的股票，所面临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。

本基金为增强型股票指数基金，力争在对标的指数进行有效跟踪的基础上，实现超越目标指数的投资收益，谋求基金资产的长期增值。

本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险。本基金股票资产投资比例不低于基金资产的 80%，其中投资于标的指数成份股和备选成份股的资产不低于非现金基金资产的 80%，投资于港股通标的股票的比例占股票资产的 0-50%；每个交易日日终在扣除股指期货、国债期货、股票期权合约需缴纳的交易保证金后，保持不低于基金资产净值 5%的现金或到期日在一年以内的政府债券，其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。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	
	公允价值	占基金资产净值比例（%）
交易性金融资产—股票投资	115,055,535.63	92.25
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	115,055,535.63	92.25

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)
	业绩比较基准上升 5%	3,466,700.29
	业绩比较基准下降 5%	-3,466,700.29

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
第一层次	114,986,018.28
第二层次	125,522.26
第三层次	-
合计	115,111,540.54

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。

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	115,055,535.63	85.89
	其中：股票	115,055,535.63	85.89
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	56,004.91	0.04
	其中：债券	56,004.91	0.04
	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	18,405,833.32	13.74
8	其他各项资产	446,139.80	0.33
9	合计	133,963,513.66	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	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	81,111,354.76	65.03

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	18,372,608.51	14.73
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	2,337,578.16	1.87
N	水利、环境和公共设施管理业	164,639.00	0.13
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	101,986,180.43	81.77

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	158,844.00	0.13
B	采矿业	—	—
C	制造业	10,846,222.20	8.70
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	254,148.00	0.20
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	1,211,507.00	0.97
J	金融业	214,402.00	0.17
K	房地产业	72,360.00	0.06

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	311,872.00	0.25
R	文化、体育和娱乐业	—	—
S	综合	—	—
	合计	13,069,355.20	10.48

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	688041	海光信息	37,151	5,249,064.79	4.21
2	688256	寒武纪	7,709	4,636,963.50	3.72
3	688036	传音控股	21,724	1,731,402.80	1.39
4	688981	中芯国际	19,294	1,701,151.98	1.36
5	688271	联影医疗	12,344	1,576,822.56	1.26
6	688111	金山办公	4,846	1,357,122.30	1.09
7	688082	盛美上海	11,530	1,313,728.20	1.05
8	688396	华润微	25,024	1,180,131.84	0.95
9	688506	百利天恒	3,759	1,113,115.08	0.89
10	688012	中微公司	5,971	1,088,513.30	0.87
11	688608	恒玄科技	3,108	1,081,521.84	0.87
12	688122	西部超导	20,106	1,043,099.28	0.84
13	688188	柏楚电子	7,763	1,022,076.58	0.82
14	688009	中国通号	198,334	1,019,436.76	0.82
15	688728	格科微	65,257	1,004,957.80	0.81
16	688008	澜起科技	12,243	1,003,926.00	0.80
17	688072	拓荆科技	6,484	996,655.64	0.80
18	688578	艾力斯	10,583	984,642.32	0.79
19	688469	芯联集成	202,943	968,038.11	0.78
20	688120	华海清科	5,571	939,827.70	0.75
21	688220	翱捷科技	11,992	938,973.60	0.75

22	688065	凯赛生物	18,623	877,143.30	0.70
23	688819	天能股份	29,668	823,583.68	0.66
24	688099	晶晨股份	11,163	792,684.63	0.64
25	688002	睿创微纳	11,342	790,764.24	0.63
26	688568	中科星图	21,955	790,599.55	0.63
27	688187	时代电气	18,297	780,367.05	0.63
28	688475	萤石网络	24,607	775,612.64	0.62
29	688375	国博电子	12,521	751,385.21	0.60
30	688235	百济神州	3,164	739,236.96	0.59
31	688349	三一重能	29,439	734,208.66	0.59
32	688429	时创能源	50,465	733,761.10	0.59
33	688208	道通科技	23,883	730,819.80	0.59
34	688266	泽璟制药	6,763	727,090.13	0.58
35	688387	信科移动	125,571	709,476.15	0.57
36	688778	厦钨新能	12,679	709,009.68	0.57
37	688347	华虹公司	12,730	699,004.30	0.56
38	688322	奥比中光	11,797	696,140.97	0.56
39	688629	华丰科技	12,100	692,120.00	0.55
40	688651	盛邦安全	20,253	691,234.89	0.55
41	688472	阿特斯	74,515	681,812.25	0.55
42	688334	西高院	39,097	671,686.46	0.54
43	688582	芯动联科	9,738	654,393.60	0.52
44	688425	铁建重工	151,501	618,124.08	0.50
45	688192	迪哲医药	10,158	607,448.40	0.49
46	688088	虹软科技	12,035	580,688.75	0.47
47	688223	晶科能源	111,772	580,096.68	0.47
48	688100	威胜信息	15,086	558,936.30	0.45
49	688676	金盘科技	16,709	558,916.05	0.45
50	688019	安集科技	3,593	545,417.40	0.44
51	688327	云从科技	39,472	544,318.88	0.44
52	688029	南微医学	7,998	540,264.90	0.43
53	688172	燕东微	27,235	535,440.10	0.43
54	688150	莱特光电	21,531	532,246.32	0.43
55	688126	沪硅产业	27,746	519,405.12	0.42
56	688648	中邮科技	10,700	504,719.00	0.40
57	688301	奕瑞科技	5,633	493,507.13	0.40
58	688538	和辉光电	210,349	492,216.66	0.39
59	688289	圣湘生物	23,525	481,792.00	0.39
60	688198	佰仁医疗	4,682	480,794.58	0.39
61	688400	凌云光	17,401	479,745.57	0.38
62	688128	中国电研	19,230	471,135.00	0.38
63	688047	龙芯中科	3,519	469,399.41	0.38
64	688183	生益电子	9,152	468,582.40	0.38

65	688617	惠泰医疗	1,575	467,775.00	0.38
66	688114	华大智造	7,078	458,866.74	0.37
67	688001	华兴源创	17,881	451,852.87	0.36
68	688677	海泰新光	11,463	447,171.63	0.36
69	688599	天合光能	30,317	440,506.01	0.35
70	688017	绿的谐波	3,500	437,115.00	0.35
71	688685	迈信林	7,765	433,675.25	0.35
72	688772	珠海冠宇	29,046	415,067.34	0.33
73	688209	英集芯	22,258	411,105.26	0.33
74	688181	八亿时空	13,195	410,628.40	0.33
75	688270	臻镭科技	8,679	404,094.24	0.32
76	688768	容知日新	9,064	402,350.96	0.32
77	688035	德邦科技	9,766	396,694.92	0.32
78	688315	诺禾致源	28,065	396,277.80	0.32
79	688696	极米科技	3,398	388,595.28	0.31
80	688015	交控科技	18,551	386,602.84	0.31
81	688169	石头科技	2,458	384,799.90	0.31
82	688052	纳芯微	2,173	379,166.77	0.30
83	688351	微电生理	19,063	375,541.10	0.30
84	688777	中控技术	8,309	373,157.19	0.30
85	688371	菲沃泰	22,417	371,225.52	0.30
86	688368	晶丰明源	4,212	369,939.96	0.30
87	688139	海尔生物	11,966	369,629.74	0.30
88	688588	凌志软件	25,325	368,985.25	0.30
89	688508	芯朋微	6,574	366,960.68	0.29
90	688698	伟创电气	7,755	366,036.00	0.29
91	688521	芯原股份	3,776	364,384.00	0.29
92	688702	盛科通信	5,894	360,005.52	0.29
93	688103	国力股份	5,789	352,202.76	0.28
94	688401	路维光电	10,027	347,936.90	0.28
95	688097	博众精工	12,319	343,823.29	0.28
96	688185	康希诺	5,760	343,468.80	0.28
97	688141	杰华特	10,526	342,937.08	0.27
98	688590	新致软件	16,661	342,216.94	0.27
99	688372	伟测科技	5,621	339,508.40	0.27
100	688055	龙腾光电	91,097	337,058.90	0.27
101	688127	蓝特光学	13,021	334,769.91	0.27
102	688388	嘉元科技	16,591	333,147.28	0.27
103	688390	固德威	7,599	330,176.55	0.26
104	688376	美埃科技	8,846	329,690.42	0.26
105	688800	瑞可达	6,552	322,358.40	0.26
106	688023	安恒信息	5,679	322,226.46	0.26
107	688225	亚信安全	15,679	319,694.81	0.26

108	688366	昊海生科	6,128	313,998.72	0.25
109	688636	智明达	9,212	311,273.48	0.25
110	688278	特宝生物	4,299	310,000.89	0.25
111	688606	奥泰生物	4,579	307,708.80	0.25
112	688191	智洋创新	12,921	307,261.38	0.25
113	688518	联赢激光	14,886	303,525.54	0.24
114	688213	思特威	2,967	303,286.74	0.24
115	688232	新点软件	9,728	292,229.12	0.23
116	688095	福昕软件	4,229	287,191.39	0.23
117	688428	诺诚健华	11,744	286,905.92	0.23
118	688336	三生国健	5,240	284,217.60	0.23
119	688410	山外山	19,784	280,932.80	0.23
120	688027	国盾量子	1,014	278,860.14	0.22
121	688286	敏芯股份	3,934	278,094.46	0.22
122	688690	纳微科技	12,176	277,978.08	0.22
123	688678	福立旺	14,580	277,603.20	0.22
124	688231	隆达股份	15,108	272,699.40	0.22
125	688625	呈和科技	8,874	271,366.92	0.22
126	688227	品高股份	8,594	270,195.36	0.22
127	688357	建龙微纳	9,367	269,675.93	0.22
128	688711	宏微科技	15,154	266,558.86	0.21
129	688257	新锐股份	18,184	266,395.60	0.21
130	688219	会通股份	21,181	265,821.55	0.21
131	688109	品茗科技	8,490	264,293.70	0.21
132	688328	深科达	11,610	262,966.50	0.21
133	688655	迅捷兴	12,346	261,611.74	0.21
134	688234	天岳先进	4,444	260,196.20	0.21
135	688007	光峰科技	17,907	258,935.22	0.21
136	688033	天宜新材	40,345	258,611.45	0.21
137	688456	有研粉材	7,153	257,150.35	0.21
138	688022	瀚川智能	17,101	253,436.82	0.20
139	688501	青达环保	9,092	253,212.20	0.20
140	688526	科前生物	16,103	250,884.74	0.20
141	688030	山石网科	15,621	249,779.79	0.20
142	688010	福光股份	7,976	247,575.04	0.20
143	688026	洁特生物	15,020	246,328.00	0.20
144	688739	成大生物	9,304	245,625.60	0.20
145	688667	菱电电控	4,595	244,499.95	0.20
146	688202	美迪西	6,695	240,551.35	0.19
147	688385	复旦微电	4,859	239,402.93	0.19
148	688681	科汇股份	16,513	231,182.00	0.19
149	688297	中无人机	4,320	230,688.00	0.18
150	688096	京源环保	14,886	226,564.92	0.18

151	688586	江航装备	19,887	223,728.75	0.18
152	688686	奥普特	2,338	223,559.56	0.18
153	688669	聚石化学	11,831	223,250.97	0.18
154	688101	三达膜	15,953	222,384.82	0.18
155	688013	天臣医疗	7,599	222,118.77	0.18
156	688147	微导纳米	7,345	221,672.10	0.18
157	688018	乐鑫科技	1,469	214,620.90	0.17
158	688133	泰坦科技	9,322	214,592.44	0.17
159	688432	有研硅	19,367	213,811.68	0.17
160	688110	东芯股份	6,796	208,365.36	0.17
161	688403	汇成股份	19,902	206,781.78	0.17
162	688352	颀中科技	17,687	198,625.01	0.16
163	688612	威迈斯	7,319	195,710.06	0.16
164	688248	南网科技	6,152	193,541.92	0.16
165	688146	中船特气	6,575	190,083.25	0.15
166	688523	航天环宇	8,430	181,329.30	0.15
167	688522	纳睿雷达	3,536	181,113.92	0.15
168	688123	聚辰股份	2,217	179,554.83	0.14
169	688525	佰维存储	2,600	175,240.00	0.14
170	688665	四方光电	3,866	172,887.52	0.14
171	688443	智翔金泰	6,200	171,988.00	0.14
172	688519	南亚新材	3,811	170,732.80	0.14
173	688091	上海谊众	3,630	169,811.40	0.14
174	688668	鼎通科技	2,661	166,206.06	0.13
175	688343	云天励飞	3,335	164,815.70	0.13
176	688057	金达莱	13,495	164,639.00	0.13
177	688484	南芯科技	4,156	164,369.80	0.13
178	688075	安旭生物	4,156	159,465.72	0.13
179	688161	威高骨科	5,780	154,846.20	0.12
180	688363	华熙生物	3,007	154,409.45	0.12
181	688468	科美诊断	20,608	151,674.88	0.12
182	688281	华秦科技	2,491	150,730.41	0.12
183	688153	唯捷创芯	4,690	145,436.90	0.12
184	688779	五矿新能	25,946	141,146.24	0.11
185	688536	思瑞浦	1,014	140,662.08	0.11
186	688279	峰岹科技	751	139,310.50	0.11
187	688716	中研股份	3,899	138,804.40	0.11
188	688138	清溢光电	5,094	138,505.86	0.11
189	688505	复旦张江	15,825	137,044.50	0.11
190	688562	航天软件	7,282	136,464.68	0.11
191	688200	华峰测控	935	134,827.00	0.11
192	688361	中科飞测	1,596	134,367.24	0.11
193	688663	新风光	4,922	132,647.90	0.11

194	688252	天德钰	5,428	132,334.64	0.11
195	688593	新相微	8,096	132,207.68	0.11
196	688439	振华风光	2,217	129,140.25	0.10
197	688697	纽威数控	9,599	128,050.66	0.10
198	688317	之江生物	7,086	127,689.72	0.10
199	688798	艾为电子	1,841	125,556.20	0.10
200	688520	神州细胞	2,063	123,470.55	0.10
201	688786	悦安新材	5,299	123,466.70	0.10
202	688333	铂力特	2,061	122,753.16	0.10
203	688380	中微半导	4,493	121,760.30	0.10
204	688571	杭华股份	15,677	120,869.67	0.10
205	688106	金宏气体	6,609	118,235.01	0.09
206	688498	源杰科技	600	117,000.00	0.09
207	688059	华锐精密	2,491	116,479.16	0.09
208	688789	宏华数科	1,593	116,352.72	0.09
209	688660	电气风电	13,326	115,669.68	0.09
210	688180	君实生物	3,400	115,532.00	0.09
211	688037	芯源微	1,048	112,345.60	0.09
212	688206	概伦电子	3,776	109,806.08	0.09
213	688509	正元地信	25,492	109,360.68	0.09
214	688689	银河微电	4,733	109,190.31	0.09
215	688166	博瑞医药	1,983	106,506.93	0.09
216	688377	迪威尔	4,320	103,118.40	0.08
217	688381	帝奥微	4,710	102,018.60	0.08
218	688108	赛诺医疗	9,029	101,305.38	0.08
219	688766	普冉股份	1,469	92,840.80	0.07
220	688221	前沿生物	9,180	92,167.20	0.07
221	688581	安杰思	1,404	91,021.32	0.07
222	688006	杭可科技	4,660	90,870.00	0.07
223	688539	高华科技	3,400	90,440.00	0.07
224	688262	国芯科技	3,386	90,304.62	0.07
225	688358	祥生医疗	3,007	89,157.55	0.07
226	688362	甬矽电子	2,976	88,625.28	0.07
227	688318	财富趋势	770	88,488.40	0.07
228	688182	灿勤科技	3,200	88,192.00	0.07
229	688486	龙迅股份	1,297	86,743.36	0.07
230	688049	炬芯科技	1,404	84,942.00	0.07
231	688239	航宇科技	2,400	83,952.00	0.07
232	688433	华曙高科	2,229	81,915.75	0.07
233	688119	中钢洛耐	19,567	81,790.06	0.07
234	688066	航天宏图	4,168	81,609.44	0.07
235	688516	奥特维	2,432	80,839.68	0.06
236	688579	山大地纬	7,127	79,751.13	0.06

237	688575	亚辉龙	5,427	79,179.93	0.06
238	688076	ST 诺泰	2,073	77,157.06	0.06
239	688321	微芯生物	3,200	76,096.00	0.06
240	688107	安路科技	2,617	73,904.08	0.06
241	688050	爱博医疗	1,048	72,154.80	0.06
242	688515	裕太微	780	71,448.00	0.06
243	688093	世华科技	2,292	71,166.60	0.06
244	688621	阳光诺和	1,404	70,045.56	0.06
245	688313	仕佳光子	1,827	69,517.35	0.06
246	688409	富创精密	1,261	69,367.61	0.06
247	688212	澳华内镜	1,404	68,796.00	0.06
248	688589	力合微	3,189	68,212.71	0.05
249	688160	步科股份	780	66,846.00	0.05
250	688168	安博通	935	66,263.45	0.05
251	688233	神工股份	2,064	65,573.28	0.05
252	688633	星球石墨	2,400	65,352.00	0.05
253	688226	威腾电气	2,475	64,696.50	0.05
254	688551	科威尔	2,104	61,836.56	0.05
255	688622	禾信仪器	780	61,362.60	0.05
256	688566	吉贝尔	2,227	60,552.13	0.05
257	688083	中望软件	924	59,514.84	0.05
258	688312	燕麦科技	2,444	58,729.32	0.05
259	688105	诺唯赞	2,585	58,498.55	0.05
260	688288	鸿泉物联	1,900	55,119.00	0.04
261	688085	三友医疗	2,773	53,324.79	0.04
262	688658	悦康药业	2,800	53,312.00	0.04
263	688016	心脉医疗	600	53,052.00	0.04
264	688416	恒烁股份	1,317	53,022.42	0.04
265	688553	汇宇制药	3,200	52,128.00	0.04
266	688383	新益昌	1,014	51,572.04	0.04
267	688020	方邦股份	1,300	49,231.00	0.04
268	688408	中信博	1,048	48,920.64	0.04
269	688609	九联科技	4,666	48,853.02	0.04
270	688630	芯碁微装	600	47,622.00	0.04
271	688177	百奥泰	1,900	47,614.00	0.04
272	688190	云路股份	500	46,280.00	0.04
273	688559	海目星	1,404	46,191.60	0.04
274	688039	当虹科技	1,404	46,079.28	0.04
275	688418	震有科技	1,700	44,982.00	0.04
276	688131	皓元医药	900	43,515.00	0.03
277	688261	东微半导	1,048	43,230.00	0.03
278	688230	芯导科技	761	42,182.23	0.03
279	688135	利扬芯片	1,983	41,067.93	0.03

280	688067	爱威科技	1,905	40,976.55	0.03
281	688478	晶升股份	1,300	39,780.00	0.03
282	688799	华纳药厂	900	37,170.00	0.03
283	688236	春立医疗	1,961	36,454.99	0.03
284	688331	荣昌生物	600	36,300.00	0.03
285	688280	精进电动	4,900	35,623.00	0.03
286	688143	长盈通	900	35,100.00	0.03
287	688197	首药控股	900	32,580.00	0.03
288	688382	益方生物	973	31,933.86	0.03
289	688132	邦彦技术	857	17,397.10	0.01
290	688186	广大特材	571	16,336.31	0.01

7.3.2 期末积极投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	300140	节能环境	46,400	286,288.00	0.23
2	300232	洲明科技	37,600	272,224.00	0.22
3	300088	长信科技	45,300	269,988.00	0.22
4	301282	金禄电子	10,200	252,858.00	0.20
5	300019	硅宝科技	12,800	252,672.00	0.20
6	300990	同飞股份	5,000	249,500.00	0.20
7	300454	深信服	2,600	244,868.00	0.20
8	300207	欣旺达	12,000	240,720.00	0.19
9	300496	中科创达	4,200	240,324.00	0.19
10	301031	中熔电气	3,000	238,950.00	0.19
11	300623	捷捷微电	8,000	238,400.00	0.19
12	300408	三环集团	7,100	237,140.00	0.19
13	301328	维峰电子	5,600	236,040.00	0.19
14	300679	电连技术	5,200	235,976.00	0.19
15	300080	易成新能	56,100	234,498.00	0.19
16	300699	光威复材	7,400	234,358.00	0.19
17	300888	稳健医疗	5,700	234,270.00	0.19
18	300339	润和软件	4,600	233,818.00	0.19
19	301363	美好医疗	13,180	232,495.20	0.19
20	300124	汇川技术	3,600	232,452.00	0.19
21	300981	中红医疗	19,400	232,218.00	0.19
22	301507	民生健康	16,000	232,160.00	0.19
23	300206	理邦仪器	19,300	231,986.00	0.19
24	300134	大富科技	18,900	231,147.00	0.19
25	300346	南大光电	7,300	230,972.00	0.19
26	300433	蓝思科技	10,300	229,690.00	0.18
27	300869	康泰医学	15,800	226,572.00	0.18
28	300319	麦捷科技	20,800	223,392.00	0.18
29	301362	民爆光电	5,400	220,374.00	0.18

30	301239	普瑞眼科	5,600	219,520.00	0.18
31	300196	长海股份	17,800	217,160.00	0.17
32	301039	中集车辆	26,100	212,193.00	0.17
33	300790	宇瞳光学	9,400	196,554.00	0.16
34	300999	金龙鱼	6,500	191,945.00	0.15
35	001359	平安电工	5,300	184,864.00	0.15
36	301468	博盈特焊	7,500	176,175.00	0.14
37	301499	维科精密	6,400	174,400.00	0.14
38	603193	润本股份	5,300	166,473.00	0.13
39	002382	蓝帆医疗	29,100	162,960.00	0.13
40	301578	辰奕智能	4,500	161,055.00	0.13
41	300498	温氏股份	9,300	158,844.00	0.13
42	300421	力星股份	10,500	157,290.00	0.13
43	301321	翰博高新	8,600	131,494.00	0.11
44	300369	绿盟科技	16,100	125,097.00	0.10
45	301456	盘古智能	4,900	119,854.00	0.10
46	600704	物产中大	22,200	116,994.00	0.09
47	301559	中集环科	7,300	116,946.00	0.09
48	300239	东宝生物	19,000	112,670.00	0.09
49	603601	再升科技	27,000	109,620.00	0.09
50	301370	国科恒泰	9,600	102,240.00	0.08
51	002516	旷达科技	19,200	98,880.00	0.08
52	300015	爱尔眼科	7,400	92,352.00	0.07
53	301270	汉仪股份	1,900	90,554.00	0.07
54	000823	超声电子	7,500	88,875.00	0.07
55	600169	太原重工	36,400	88,088.00	0.07
56	600351	亚宝药业	14,500	88,015.00	0.07
57	002367	康力电梯	12,200	85,766.00	0.07
58	300105	龙源技术	10,700	82,497.00	0.07
59	002578	闽发铝业	24,200	81,070.00	0.06
60	600268	国电南自	10,100	78,982.00	0.06
61	000567	海德股份	13,100	77,552.00	0.06
62	600329	达仁堂	2,300	76,728.00	0.06
63	600237	铜峰电子	10,300	74,675.00	0.06
64	300014	亿纬锂能	1,600	73,296.00	0.06
65	600665	天地源	21,600	72,360.00	0.06
66	002544	普天科技	3,000	70,350.00	0.06
67	600016	民生银行	14,600	69,350.00	0.06
68	002839	张家港行	15,000	67,500.00	0.05
69	603987	康德莱	8,600	66,220.00	0.05
70	301090	华润材料	8,400	63,252.00	0.05
71	301195	北路智控	1,700	60,860.00	0.05
72	300017	网宿科技	5,400	57,888.00	0.05

73	603698	航天工程	3,200	56,384.00	0.05
74	301200	大族数控	1,300	55,211.00	0.04
75	300375	鹏翎股份	10,700	54,677.00	0.04
76	300119	瑞普生物	2,800	54,376.00	0.04
77	601311	骆驼股份	6,000	54,180.00	0.04
78	002223	鱼跃医疗	1,500	53,400.00	0.04
79	603040	新坐标	1,300	52,221.00	0.04
80	002543	万和电气	4,700	52,217.00	0.04
81	601096	宏盛华源	12,200	50,508.00	0.04
82	301356	天振股份	2,800	49,812.00	0.04
83	300980	祥源新材	2,100	49,182.00	0.04
84	603187	海容冷链	4,100	48,216.00	0.04
85	600076	康欣新材	19,900	47,362.00	0.04
86	600703	三安光电	3,800	47,196.00	0.04
87	300693	盛弘股份	1,500	44,940.00	0.04
88	300098	高新兴	8,600	44,720.00	0.04
89	000931	中 关 村	8,100	43,983.00	0.04
90	300025	华星创业	6,200	43,028.00	0.03
91	300638	广和通	1,500	42,945.00	0.03
92	301207	华兰疫苗	2,300	38,778.00	0.03
93	002523	天桥起重	9,600	35,040.00	0.03
94	600713	南京医药	6,900	34,914.00	0.03
95	301018	申菱环境	800	30,352.00	0.02
96	300406	九强生物	700	9,905.00	0.01

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末基金资产净值 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	占期末基金资产净值比例(%)
1	688041	海光信息	8,737,920.89	7.01
2	688256	寒武纪	7,684,680.47	6.16
3	688036	传音控股	2,884,648.31	2.31
4	688271	联影医疗	2,692,068.67	2.16
5	688008	澜起科技	2,476,951.65	1.99
6	688981	中芯国际	2,386,376.42	1.91
7	688188	柏楚电子	2,158,705.84	1.73
8	688111	金山办公	1,988,216.48	1.59
9	688608	恒玄科技	1,919,292.36	1.54
10	688082	盛美上海	1,915,499.16	1.54
11	688396	华润微	1,854,758.94	1.49
12	688578	艾力斯	1,817,124.20	1.46
13	688009	中国通号	1,729,356.76	1.39
14	688506	百利天恒	1,709,700.80	1.37

15	688728	格科微	1,659,818.17	1.33
16	688072	拓荆科技	1,599,534.69	1.28
17	688469	芯联集成	1,592,825.83	1.28
18	688122	西部超导	1,561,516.96	1.25
19	688012	中微公司	1,558,667.19	1.25
20	688266	泽璟制药	1,542,989.75	1.24

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末基金资产净值 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	占期末基金资产净值比例(%)
1	688041	海光信息	3,571,024.25	2.86
2	688256	寒武纪	2,771,601.17	2.22
3	688008	澜起科技	1,525,506.09	1.22
4	688036	传音控股	1,352,583.87	1.08
5	688183	生益电子	1,342,439.28	1.08
6	688188	柏楚电子	1,047,212.83	0.84
7	688361	中科飞测	1,008,488.39	0.81
8	688612	威迈斯	1,007,753.68	0.81
9	688271	联影医疗	970,344.29	0.78
10	688005	容百科技	871,067.29	0.70
11	688599	天合光能	865,206.18	0.69
12	688409	富创精密	839,708.61	0.67
13	688025	杰普特	820,782.53	0.66
14	688668	鼎通科技	817,746.96	0.66
15	688578	艾力斯	812,697.63	0.65
16	688266	泽璟制药	805,093.39	0.65
17	688186	广大特材	747,334.77	0.60
18	688981	中芯国际	738,997.10	0.59
19	688521	芯原股份	738,339.15	0.59
20	688082	盛美上海	733,227.68	0.59

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	234,361,462.97
卖出股票收入（成交）总额	127,532,191.88

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

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	56,004.91	0.04
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	56,004.91	0.04

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

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
1	118056	路维转债	560	56,004.91	0.04

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

本基金在注重风险管理的前提下，根据风险管理的原则，以套期保值为目的，将适度运用股指期货。本基金利用股指期货流动性好、交易成本低和杠杆操作等特点，通过股指期货对本基金投资组合的跟踪效果进行及时、有效地调整和优化，并提高投资组合的运作效率等。

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的发行主体本期没有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。

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	301,891.20
2	应收清算款	—
3	应收股利	—
4	应收利息	—
5	应收申购款	144,248.60
6	其他应收款	—
7	待摊费用	—
8	其他	—
9	合计	446,139.80

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(%)
大成上证科创板综合指数增	1,207	66,109.59	0.00	0.00	79,794,276.92	100.00

强 A						
大成上证科创板综合指数增强 C	1, 581	25, 035. 35	0. 00	0. 00	39, 580, 889. 27	100. 00
合计	2, 788	42, 817. 49	0. 00	0. 00	119, 375, 166. 19	100. 00

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	大成上证科创板综合指数增强 A	994, 870. 11	1. 2468
	大成上证科创板综合指数增强 C	320, 652. 46	0. 8101
	合计	1, 315, 522. 57	1. 1020

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	大成上证科创板综合指数增强 A	0
	大成上证科创板综合指数增强 C	0
	合计	0
本基金基金经理持有本开放式基金	大成上证科创板综合指数增强 A	0
	大成上证科创板综合指数增强 C	0
	合计	0

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	大成上证科创板综合指数增强 A	大成上证科创板综合指数增强 C
基金合同生效日 (2025 年 4 月 29 日) 基金份额总额	217, 739, 276. 57	171, 634, 264. 89

基金合同生效日起至报告期期末基金总申购份额	929,233.89	2,178,570.69
减：基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回份额	138,874,233.54	134,231,946.31
基金合同生效日起至报告期期末基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	79,794,276.92	39,580,889.27

§ 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 (%)	
华西证券	3	361,893,654. 85	100.00	70,931.01	100.00	新增 3 个

注：本基金采用证券公司交易结算模式，本基金管理人负责选择证券经纪商，使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

金额单位：人民币元

券商名 称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债 券 成交总额 的比例 (%)	成交金额	占当期债券 回购成交总 额的比例 (%)	成交金额	占当期权 证 成交总额 的比例 (%)
华西证券	-	-	622,000,000. 00	100.00	-	-

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	大成基金管理有限公司关于再次提请	中国证监会基金电子披	2025 年 6 月 30 日

	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	露网站、规定报刊及本公司网站	
2	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
3	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
4	大成上证科创板综合指数增强型证券投资基金开放日常申购、赎回、转换及定期定额投资业务的公告	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 5 月 8 日
5	大成上证科创板综合指数增强型证券投资基金(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	2025 年 5 月 1 日
6	大成上证科创板综合指数增强型证券投资基金(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 5 月 1 日
7	大成基金管理有限公司关于大成上证科创板综合指数增强型证券投资基金基金合同生效公告	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 30 日
8	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
9	关于大成上证科创板综合指数增强型证券投资基金延长募集期的公告	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 18 日
10	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
11	大成上证科创板综合指数增强型证券投资基金(A类份额)基金产品资料概要	中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站	2025 年 3 月 29 日
12	大成上证科创板综合指数增强型证券投资基金招募说明书	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 29 日
13	大成上证科创板综合指数增强型证券投资基金基金份额发售公告	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 29 日
14	大成上证科创板综合指数增强型证券投资基金基金合同	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 29 日
15	大成上证科创板综合指数增强型证券投资基金(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、规定报刊及本公司网站	2025 年 3 月 29 日

16	大成上证科创板综合指数增强型证券投资基金托管协议	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 29 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上证科创板综合指数增强型证券投资基金的文件；
- 2、《大成上证科创板综合指数增强型证券投资基金基金合同》；
- 3、《大成上证科创板综合指数增强型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

2025 年 8 月 29 日