# 大成国家安全主题灵活配置混合型证券投资基金
# 2025 年年度报告

2025 年 12 月 31 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 3 月 31 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。本年度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 2026 年 3 月 30 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。

本报告财务资料已经审计。容诚会计师事务所（特殊普通合伙）为本基金出具了无保留意见的审计报告，请投资者注意阅读。

本报告期自 2025 年 01 月 01 日起至 12 月 31 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、基金净值表现及利润分配情况 ..... 6**

3.1 主要会计数据和财务指标 ..... 6
3.2 基金净值表现 ..... 7
3.3 过去三年基金的利润分配情况 ..... 10

**§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遵规守信情况的说明 ..... 12
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明 ..... 12
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 ..... 13
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望 ..... 13
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况 ..... 14
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明 ..... 15
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明 ..... 15
4.9 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 ..... 15

**§5 托管人报告 ..... 16**

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明 ..... 16
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明 ..... 16
5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见 ..... 16

**§6 审计报告 ..... 16**

**§7 年度财务报表 ..... 18**

7.1 资产负债表 ..... 18
7.2 利润表 ..... 19
7.3 净资产变动表 ..... 21
7.4 报表附注 ..... 22

**§8 投资组合报告 ..... 51**

8.1 期末基金资产组合情况 ..... 51
8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合 ..... 52

8.3 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 ..... 52
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动 ..... 53
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合 ..... 55
8.6 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
8.7 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
8.8 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
8.9 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
8.10 本基金投资股指期货的投资政策 ..... 55
8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 ..... 55
8.12 投资组合报告附注 ..... 55

**§9 基金份额持有人信息 ..... 56**

9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 ..... 56
9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 ..... 57
9.3 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
9.4 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理本人及其直系亲属持有本人管理的产品情况 ..... 57

**§10 开放式基金份额变动 ..... 57**

**§11 重大事件揭示 ..... 58**

11.1 基金份额持有人大会决议 ..... 58
11.2 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
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 ..... 58
11.4 基金投资策略的改变 ..... 58
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 ..... 58
11.6 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况 ..... 59
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 ..... 59
11.8 其他重大事件 ..... 61

**§12 影响投资者决策的其他重要信息 ..... 62**

12.1 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 ..... 62
12.2 影响投资者决策的其他重要信息 ..... 63

**§13 备查文件目录 ..... 63**

13.1 备查文件目录 ..... 63
13.2 存放地点 ..... 63
13.3 查阅方式 ..... 63

# §2 基金简介

## 2.1 基金基本情况

| | | |
|---|---|---|
| 基金名称 | 大成国家安全主题灵活配置混合型证券投资基金 | |
| 基金简称 | 大成国家安全主题灵活配置混合 | |
| 基金主代码 | 002567 | |
| 基金运作方式 | 契约型开放式 | |
| 基金合同生效日 | 2016 年 5 月 4 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 | 40,101,472.67 份 | |
| 基金合同存续期 | 不定期 | |
| 下属分级基金的基金简称 | 大成国家安全主题灵活配置混合 A | 大成国家安全主题灵活配置混合 C |
| 下属分级基金的交易代码 | 002567 | 019224 |
| 报告期末下属分级基金的份额总额 | 13,543,653.51 份 | 26,557,819.16 份 |

## 2.2 基金产品说明

| | |
|---|---|
| 投资目标 | 本基金的投资目标是通过投资于与国家安全主题相关的优质上市公司，在控制风险的前提下追求基金资产长期稳定增长。 |
| 投资策略 | 本基金通过对宏观经济环境、国家经济政策、股票市场风险、债券市场整体收益率曲线变化和资金供求关系等因素的分析，研判经济周期在美林投资时钟理论所处的阶段，综合评价各类资产的市场趋势、预期风险收益水平和配置时机。在此基础上，本基金将积极、主动地确定权益类资产、固定收益类资产和现金等各类资产的配置比例并进行实时动态调整。 |
| 业绩比较基准 | 中证 800 指数收益率*80%+中债综合指数收益率*20% |
| 风险收益特征 | 本基金是混合型基金，其预期收益及风险水平低于股票型基金，高于货币市场基金与债券型基金，属于风险水平中高的基金。 |

## 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》 |
| 登载基金年度报告正文的管理人互联网网址 | www.dcfund.com.cn |
| 基金年度报告备置地点 | 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 |
|---|---|---|
| 会计师事务所 | 容诚会计师事务所（特殊普通合伙） | 北京市西城区阜成门外大街 22 号 1 幢 10 层 1001-1 至 1001-26 |
| 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、基金净值表现及利润分配情况

## 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 | | 2024 年 | | 2023 年 | 2023 年 10 月 16 日(基金合同生效日) - 2023 年 12 月 31 日 |
|---|---|---|---|---|---|---|
| | 大成国家安全主题灵活配置混合 A | 大成国家安全主题灵活配置混合 C | 大成国家安全主题灵活配置混合 A | 大成国家安全主题灵活配置混合 C | 大成国家安全主题灵活配置混合 A | 大成国家安全主题灵活配置混合 C |
| 本期已实现收益 | 2,390,326.18 | 3,771,093.20 | -1,632,974.71 | -7,038,483.05 | -4,286,051.76 | 337.41 |
| 本期利润 | 4,508,597.05 | 6,786,822.09 | -2,570,015.87 | -6,916,435.06 | -3,586,377.76 | 424.75 |
| 加权平均基金份额本期利润 | 0.2653 | 0.2545 | -0.0974 | -0.3176 | -0.1175 | 0.0626 |
| 本期加权平均净值利润率 | 18.02% | 17.31% | -6.45% | -21.36% | -7.64% | 4.18% |
| 本期基金份额净值增长 | 19.09% | 18.62% | -8.14% | -8.61% | -6.73% | 4.28% |

| 率 | | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|---|
| 3.1.2 期末数据和指标 | 2025 年末 | | 2024 年末 | | 2023 年末 | |
| 期末可供分配利润 | 8,364,031.96 | 15,998,276.05 | 7,763,712.07 | 10,368,822.78 | 15,322,667.81 | 3,522.30 |
| 期末可供分配基金份额利润 | 0.6176 | 0.6024 | 0.3876 | 0.3798 | 0.5109 | 0.5096 |
| 期末基金资产净值 | 22,392,211.44 | 43,488,208.44 | 27,794,005.45 | 37,669,479.42 | 45,313,353.00 | 10,434.75 |
| 期末基金份额净值 | 1.653 | 1.637 | 1.388 | 1.380 | 1.511 | 1.510 |
| 3.1.3 累计期末指标 | 2025 年末 | | 2024 年末 | | 2023 年末 | |
| 基金份额累计净值增长率 | 65.30% | 13.05% | 38.80% | -4.70% | 51.10% | 4.28% |

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

大成国家安全主题灵活配置混合 A

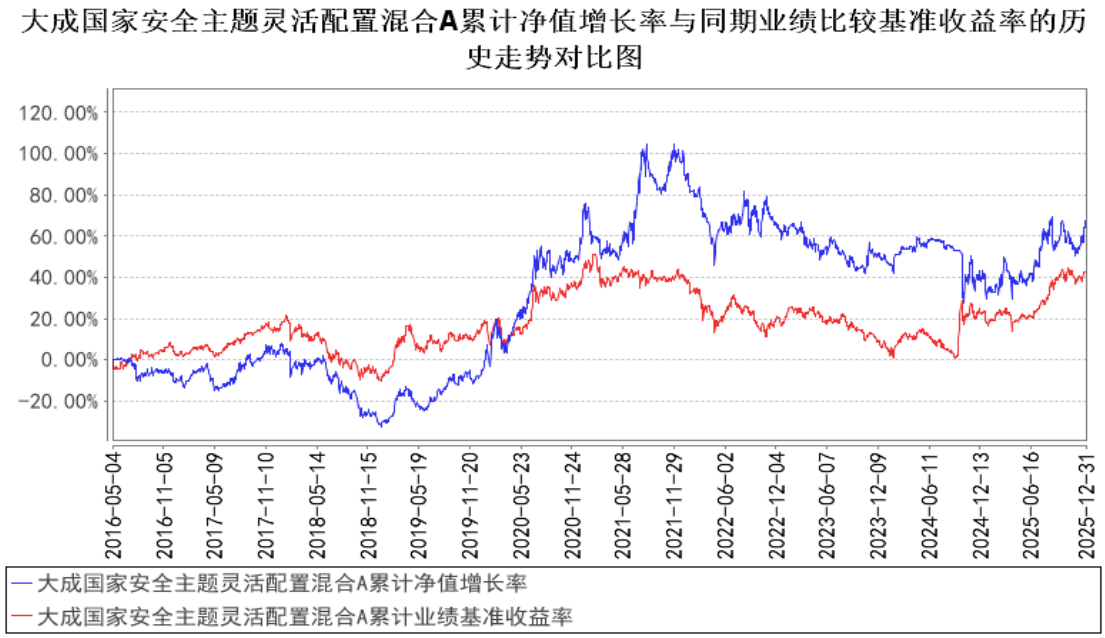
| 阶段 | 份额净值增长率① | 份额净值增长率标准差② | 业绩比较基准收益率③ | 业绩比较基准收益率标准差④ | ①－③ | ②－④ |
|---|---|---|---|---|---|---|
| 过去三个月 | -0.36% | 1.21% | 0.17% | 0.81% | -0.53% | 0.40% |
| 过去六个月 | 11.24% | 1.36% | 15.61% | 0.76% | -4.37% | 0.60% |
| 过去一年 | 19.09% | 1.40% | 16.80% | 0.81% | 2.29% | 0.59% |
| 过去三年 | 2.04% | 1.20% | 20.82% | 0.89% | -18.78% | 0.31% |
| 过去五年 | 3.12% | 1.29% | 1.33% | 0.91% | 1.79% | 0.38% |
| 自基金合同生效 | 65.30% | 1.30% | 42.37% | 0.92% | 22.93% | 0.38% |

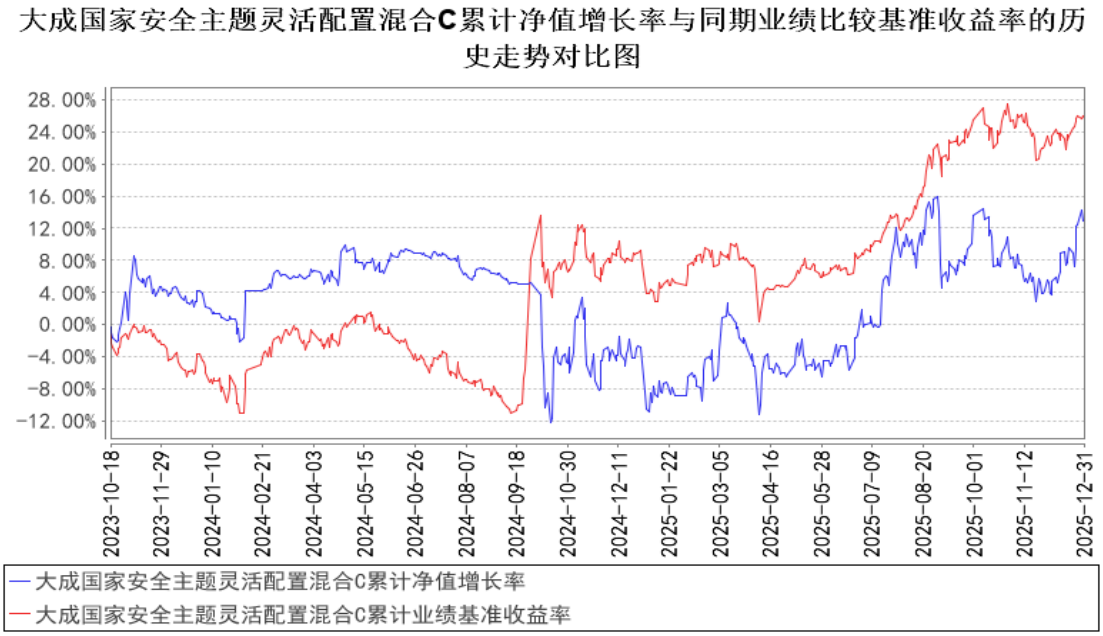
| | | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|---|
| 起至今 | | | | | | |

大成国家安全主题灵活配置混合 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 | -0.49% | 1.21% | 0.17% | 0.81% | -0.66% | 0.40% |
| 过去六个月 | 10.98% | 1.36% | 15.61% | 0.76% | -4.63% | 0.60% |
| 过去一年 | 18.62% | 1.40% | 16.80% | 0.81% | 1.82% | 0.59% |
| 自基金合同生效起至今 | 13.05% | 1.31% | 25.62% | 0.96% | -12.57% | 0.35% |

### 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

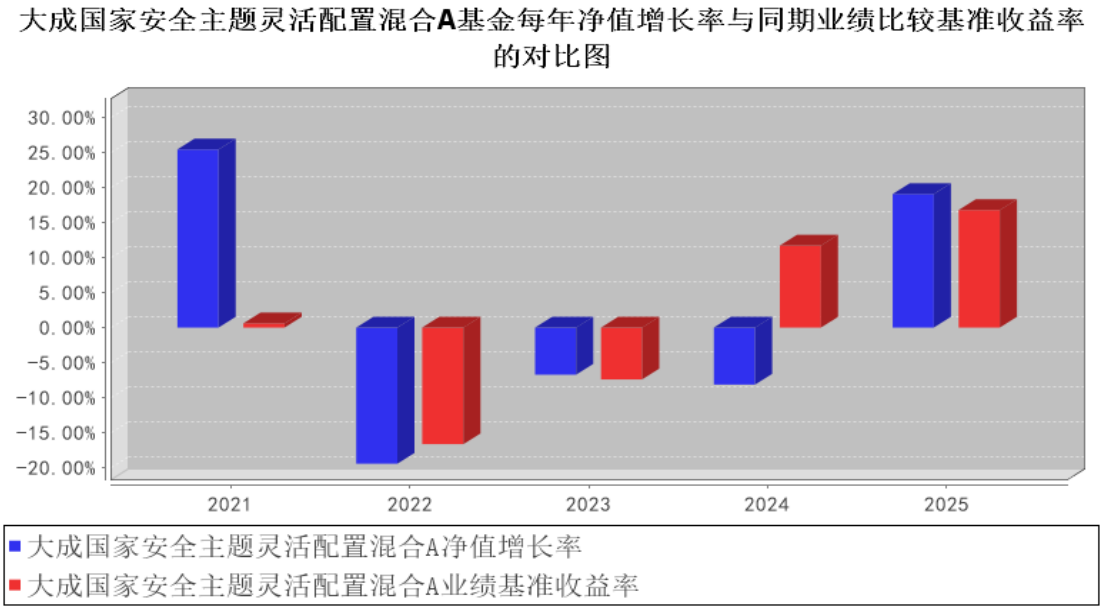


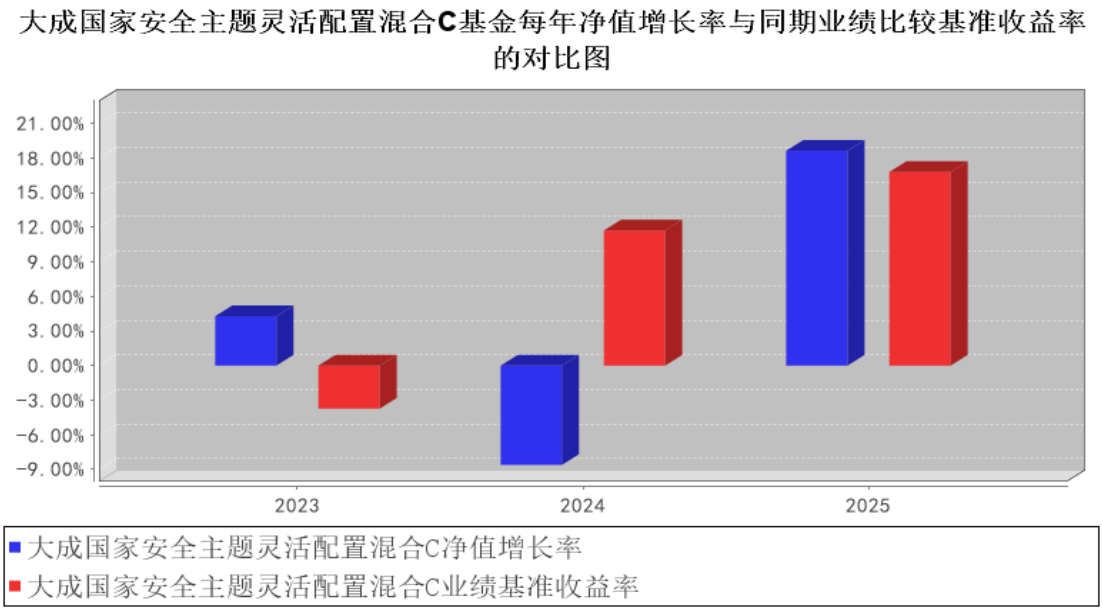



注：1、按基金合同规定，本基金自基金合同生效之日起 6 个月内为建仓期。建仓期结束时，本基金的各项投资组合比例符合基金合同的约定。

2、本基金自 2023 年 10 月 16 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 2023 年 10 月 18 日有份额之日开始计算。

### 3.2.3 过去五年基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较






注：合同生效当年按实际存续期计算，不按整个自然年度进行折算。

### 3.3 过去三年基金的利润分配情况

无。

## §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 | | |
| 王帅 | 本基金基金经理 | 2023 年 9 月 27 日 | - | 8 年 | 上海交通大学硕士。2017 年 3 月至 2019 年 9 月任广发证券股份有限公司发展研究中心研究员。2019 年 9 月加入大成基金管理有限公司，曾任大成中小盘混合型证券投资基金（LOF）、大成盛世精选灵活配置混合型证券投资基金、大成行业先锋混合型证券投资基金、大成科技消费股票型证券投资基金基金经理助理，现任股票投资部基金经理。2021 年 12 月 1 日至 2023 年 7 月 25 日任大成蓝筹稳健证券投资基金基金经理。2022 年 11 月 27 日起任大成互联网思维混合型证券投资基金基金经理。2023 年 6 月 1 日起任大成科创主题混合型证券投资基金（LOF）基金经理。2023 年 9 月 27 日起任大成国家安全主题灵活配置混合型证券投资基金基金经理。2024 年 8 月 28 日起任大成领先动力混合型证券投资基金基金经理。具有基金从业资格。国籍：中国 |
| 童若琰 | 本基金基金经理助理 | 2024 年 12 月 22 日 | - | 6 年 | 上海交通大学金融硕士。2019 年 7 月至 2022 年 5 月任广发证券股份有限公司发展研究中心研究员。2022 年 6 月至 2023 年 4 月任盈峰资本管理有限公司研究员。2023 年 4 月加入大成基金管理有限公司，曾任研究部研究员，现任研究部基金经理助理。2024 年 12 月 22 日起任大成互联网思维混合型证券投资基金、大成科创主题混合型证券投资基金（LOF）、大成国家安全主题灵活配置混合型证券投资基金、大成领先动力混合型证券投资基金基金经理助理。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。

3、李煜先生自 2026 年 1 月 13 日起担任本基金基金经理，王帅先生自 2026 年 1 月 16 日起不再担任本基金基金经理。上述事项已按法规要求及公司相关制度办理，变更流程合法合规。

4、因工作调整，童若琰女士自 2026 年 1 月 15 日起不再担任本基金基金经理助理。上述事项已按法规要求及公司相关制度办理，变更流程合法合规。

### 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。

### 4.1.4 基金经理薪酬机制

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》、《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 公平交易制度和控制方法

根据《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》的规定，公司制订了《大成基金管理有限公司公平交易制度》、《大成基金管理有限公司异常交易监控与报告制度》。公司旗下投资组合严格按照制度的规定，参与股票、债券的一级市场申购、二级市场交易等投资管理活动，内容包括授权、研究分析、投资决策、交易执行、业绩评估等与投资管理活动相关的各个环节。研究部负责提供投资研究支持，投资部门负责投资决策，交易管理部负责实施交易并实时监控，监察稽核部负责事前监督、事中检查和事后稽核，风险管理部负责对交易情况进行合理性分析，通过多部门的协作互控，保证了公平交易的可操作、可稽核和可持续。

### 4.3.2 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。

#### 4.3.2.1 增加执行的基金经理公平交易制度执行情况及公平交易管理情况

无。

### 4.3.3 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。公司旗下所有投资组合参与的

交易所公开竞价交易中，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的 5%的交易共 1 次，为完全按照指数的构成比例进行投资的组合和其他组合发生的反向交易。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，市场经历了一季度到 4 月初的震荡下行，又随后走出了趋势性行情。在这期间，很多细分行业都阶段性走出趋势性行情，包括创新药、新消费、海外 AI 算力链、国产半导体自主可控、商业航天、可控核聚变等。

回归到国防科技产业板块，年中在对外军贸和阅兵活动的刺激下，有一轮明显的超额收益行情，年底得益于商业航天的刺激，板块内呈现出明显的结构性机会。

2025 年，基金经理维持了总体仓位的同时，在具体布局方向上向先进战机方向更多倾斜。先进战机方向、体系化作战方向符合世界武器装备发展的需求，并在实战中得到验证。无论在我国自身列装还是对外军贸层面，先进飞机都是重要抓手。基金经理乐观看待先进战机产业链的成长前景。

### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末大成国家安全主题灵活配置混合 A 的基金份额净值为 1.653 元，本报告期基金份额净值增长率为 19.09%，同期业绩比较基准收益率为 16.80%；截至本报告期末大成国家安全主题灵活配置混合 C 的基金份额净值为 1.637 元，本报告期基金份额净值增长率为 18.62%，同期业绩比较基准收益率为 16.80%。

## 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，我们对宏观经济与证券市场持谨慎乐观态度。站在当前时点回望，过去两年市场完成了一轮从低估向均衡水平的回归过程。资产价格的修复显著领先于宏观基本面的改善，市场部分定价了经济企稳修复的预期，也意味着 2026 年的市场环境将与过去两年有本质不同——我们不再处于“估值修复”的起点，而是进入了“情绪与基本面赛跑”的阶段。宏观层面，积极财政政策的为总需求提供支撑；海外制造业景气周期的回升与我国出口结构升级赋予经济以韧性；随着供给端收缩与产能出清持续推进，A 股盈利能力有望延续企稳态势。

近年来不论是在商业航天、深海探索等研发竞赛，还是燃气、核能发电等高端先进制造，中国企业的竞争力都有不同程度的体现；创新技术对产业链重塑的过程正在展开，效率提升在不同领域正改写产业、商业的剧本。而 A 股市场给予新兴事物的关注从来不吝啬，高估值高波动已经

是常态，确实在追逐星辰大海的征途上，也唯有不断创新才能立足。管理这样一个组合并不容易，希望在追求收益的过程中能够平衡风险，既保持对产业趋势的敏感，也警惕情绪过热带来的估值风险，力求在控制风险的前提下，实现资产的长期稳定增值。

最后，非常感谢基金份额持有人的宽容、信任与支持。

## 4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

本报告期内，依据相关的法律法规、基金合同以及内部监察稽核制度，本基金管理人对本基金运作、内部管理、制度执行及遵规守法情况进行了监察稽核。内部监察稽核的重点是：国家法律法规及行业监管规则的执行情况；基金合同的遵守情况；内部规章制度的执行情况；资讯管制和保密工作落实情况；员工职业操守规范情况，目的是规范基金财产的运作，防范和控制投资风险，确保经营业务的稳健运行和受托资产的安全完整，维护本基金份额持有人的合法权益。

（一）根据最新的法律法规、规章、规范性文件，本基金管理人及时制定了相应的公司制度，并对现有制度进行不断修订和完善，确保本基金管理人内控制度的适时性、全面性和合法合规性。同时，为保障制度的适时性，避免部分内控制度、业务规则与业务发展不相适应，报告期内本基金管理人组织各部门对内部管理制度作了进一步梳理和完善。

（二）全面加强风险监控，不断提高基金业务风险管理水平。为督促各部门完善并落实各项内控措施，公司严格执行风险控制管理员制度，健全内控工作协调机制及监督机制，并进一步加强投资风险数量化评价能力及事前风险防范能力，有效防范相关业务风险。同时，公司严格执行投资报备制度，建立了基金从业人员证券投资管理监控信息系统，将投资报备工作纳入常态。

（三）日常监察和专项监察相结合，确保监察稽核的有效性和深入性。本年度，公司继续对本基金销售、宣传等方面的材料、协议及其他法律资料等进行了严格审查，对本基金各项投资比例、投资权限、基金交易、股票投资限制、股票库维护等方面进行实时监察，同时，还专门针对基金投资交易（包括公平交易、转债投资、投资权限、投资比例、流动性风险、基金重仓股等）、基金运营（基金头寸、基金结算、登记清算等）、网上交易、基金销售等进行专项监察。通过日常监察，保证了公司监察的全面性、实时性，通过专项监察，及时发现并纠正了业务中的潜在风险，加强了业务部门和人员的风险意识，从而较好地预防了风险的发生。

（四）加强了对投资管理人员通讯工具在交易时间的集中管理，定期或不定期的对投资管理人员的网络即时通讯记录、电话录音等进行抽查，有效的防范了各种形式的利益输送行为。

（五）以多种方式加强合规教育与培训，提高全公司的合规守法意识。及时向全公司传达与基金相关的法律法规，并要求公司各部门贯彻到日常工作中。公司监察稽核部通过解答各业务部门提出的法律问题，提供法律依据，对于较为重大疑难法律事项及时咨询公司外部律师或监管部

门，避免了业务发展中的盲目性，及时防范风险，维护了基金份额持有人的利益。

## 4.7 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。

## 4.8 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。

## 4.9 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—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

报告期内，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，本托管人未发现有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 托管人对本年度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年度报告中的财务指标、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 审计报告

| | |
|---|---|
| 审计报告标题 | 审计报告 |
| 审计报告收件人 | 大成国家安全主题灵活配置混合型证券投资基金全体基金份额持有人 |
| 审计意见 | 我们审计了大成国家安全主题灵活配置混合型证券投资基金财务报表，包括 2025 年 12 月 31 日的资产负债表，2025 年度的利润表、净资产变动表以及相关财务报表附注。<br>我们认为，后附的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则和在财务报表附注中所列示的中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）、中国证券投资基金业协会（以下简称“中国基金业协会”）发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制，公允反映了大成国家安全主题灵活配置混合型证券投资基金 2025 年 12 月 31 日的财务状况以及 2025 年度的经营成果和净资产变动情况。 |
| 形成审计意见的基础 | 我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。审计报告的“注册会计师对财务报表审计的责任”部分进一步阐述了我们在这些准则下的责任。按照中国注册会计师职 |

| | |
|---|---|
| | 业道德守则和中国注册会计师独立性准则，我们独立于大成国家安全主题灵活配置混合型证券投资基金，并遵守了独立性准则中适用于公众利益实体财务报表审计的规定，同时履行了职业道德方面的其他责任。我们相信，我们获取的审计证据是充分、适当的，为发表审计意见提供了基础。 |
| 其他信息 | 大成国家安全主题灵活配置混合型证券投资基金的基金管理人大成基金管理有限公司（以下简称“基金管理人”）管理层对其他信息负责。其他信息包括大成国家安全主题灵活配置混合型证券投资基金 2025 年年度报告中涵盖的信息，但不包括财务报表和我们的审计报告。<br>我们对财务报表发表的审计意见不涵盖其他信息，我们也不对其他信息发表任何形式的鉴证结论。<br>结合我们对财务报表的审计，我们的责任是阅读其他信息，在此过程中，考虑其他信息是否与财务报表或我们在审计过程中了解到的情况存在重大不一致或者似乎存在重大错报。<br>基于我们已执行的工作，如果我们确定其他信息存在重大错报，我们应当报告该事实。在这方面，我们无任何事项需要报告。 |
| 管理层和治理层对财务报表的责任 | 基金管理人管理层负责按照企业会计准则和中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制财务报表，使其实现公允反映，并设计、执行和维护必要的内部控制，以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。<br>在编制财务报表时，基金管理人管理层负责评估大成国家安全主题灵活配置混合型证券投资基金的持续经营能力，披露与持续经营相关的事项（如适用），并运用持续经营假设，除非基金管理人管理层计划清算大成国家安全主题灵活配置混合型证券投资基金、终止运营或别无其他现实的选择。<br>基金管理人治理层负责监督大成国家安全主题灵活配置混合型证券投资基金的财务报告过程。 |
| 注册会计师对财务报表审计的责任 | 我们的目标是对财务报表整体是否不存在由于舞弊或错误导致的重大错报获取合理保证，并出具包含审计意见的审计报告。合理保证是高水平的保证，但并不能保证按照审计准则执行的审计在某一重大错报存在时总能发现。错报可能由于舞弊或错误导致，如果合理预期错报单独或汇总起来可能影响财务报表使用者依据财务报表作出的经济决策，则通常认为错报是重大的。<br>在按照审计准则执行审计工作的过程中，我们运用职业判断，并保持职业怀疑。同时，我们也执行以下工作：<br>（1）识别和评估由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险，设计和实施审计程序以应对这些风险，并获取充分、适当的审计证据，作为发表审计意见的基础。由于舞弊可能涉及串通、伪造、故意遗漏、虚假陈述或凌驾于内部控制之上，未能发现由于舞弊导致的重大错报的风险高于未能发现 |

| | |
|---|---|
| | 由于错误导致的重大错报的风险。<br>（2）了解与审计相关的内部控制，以设计恰当的审计程序，但目的并非对内部控制的有效性发表意见。<br>（3）评价基金管理人管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计及相关披露的合理性。<br>（4）对基金管理人管理层使用持续经营假设的恰当性得出结论。同时，根据获取的审计证据，就可能导致对大成国家安全主题灵活配置混合型证券投资基金持续经营能力产生重大疑虑的事项或情况是否存在重大不确定性得出结论。如果我们得出结论认为存在重大不确定性，审计准则要求我们在审计报告中提请报表使用者注意财务报表中的相关披露；如果披露不充分，我们应当发表非无保留意见。我们的结论基于截至审计报告日可获得的信息。然而，未来的事项或情况可能导致大成国家安全主题灵活配置混合型证券投资基金不能持续经营。<br>（5）评价财务报表的总体列报、结构和内容，并评价财务报表是否公允反映相关交易和事项。<br>我们与基金管理人治理层就计划的审计范围、时间安排和重大审计发现等事项进行沟通，包括沟通我们在审计中识别出的值得关注的内部控制缺陷。 |
| 会计师事务所的名称 | 容诚会计师事务所（特殊普通合伙） |
| 注册会计师的姓名 | 陈熹　　陶文欣 |
| 会计师事务所的地址 | 北京市西城区阜成门外大街 22 号 1 幢 10 层 1001-1 至 1001-26 |
| 审计报告日期 | 2026 年 3 月 30 日 |

# §7 年度财务报表

## 7.1 资产负债表

会计主体：大成国家安全主题灵活配置混合型证券投资基金

报告截止日：2025 年 12 月 31 日

单位：人民币元

| 资 产 | 附注号 | 本期末<br>2025 年 12 月 31 日 | 上年度末<br>2024 年 12 月 31 日 |
|---|---|---|---|
| **资 产：** | | | |
| 货币资金 | 7.4.7.1 | 17,757,675.94 | 6,843,122.63 |
| 结算备付金 | | 14,427.69 | 350,543.73 |
| 存出保证金 | | 38,973.12 | 116,780.08 |
| 交易性金融资产 | 7.4.7.2 | 39,974,171.97 | 58,421,992.10 |
| 其中：股票投资 | | 39,974,171.97 | 58,421,992.10 |
| 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 | 7.4.7.3 | - | - |
| 买入返售金融资产 | 7.4.7.4 | - | - |
| 应收清算款 | | 8,012,659.88 | - |
| 应收股利 | | - | - |
| 应收申购款 | | 361,285.85 | 9,391.20 |
| 递延所得税资产 | | - | - |
| 其他资产 | 7.4.7.8 | - | - |
| 资产总计 | | 66,159,194.45 | 65,741,829.74 |
| **负债和净资产** | **附注号** | **本期末<br>2025 年 12 月 31 日** | **上年度末<br>2024 年 12 月 31 日** |
| **负 债：** | | | |
| 短期借款 | | - | - |
| 交易性金融负债 | | - | - |
| 衍生金融负债 | 7.4.7.3 | - | - |
| 卖出回购金融资产款 | | - | - |
| 应付清算款 | | - | - |
| 应付赎回款 | | 151,616.00 | 8,425.73 |
| 应付管理人报酬 | | 64,007.68 | 68,067.51 |
| 应付托管费 | | 10,667.95 | 11,344.59 |
| 应付销售服务费 | | 14,035.48 | 13,081.86 |
| 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 | 7.4.7.9 | 38,447.46 | 177,425.18 |
| 负债合计 | | 278,774.57 | 278,344.87 |
| **净资产：** | | | |
| 实收基金 | 7.4.7.10 | 40,101,472.67 | 47,330,950.02 |
| 未分配利润 | 7.4.7.12 | 25,778,947.21 | 18,132,534.85 |
| 净资产合计 | | 65,880,419.88 | 65,463,484.87 |
| 负债和净资产总计 | | 66,159,194.45 | 65,741,829.74 |

注：报告截止日 2025 年 12 月 31 日，基金份额总额 40,101,472.67 份。其中大成国家安全主题灵活配置混合 A 类基金份额总额为 13,543,653.51 份，基金份额净值 1.653 元；大成国家安全主题灵活配置混合 C 类基金份额总额为 26,557,819.16 份，基金份额净值 1.637 元。

## 7.2 利润表

会计主体：大成国家安全主题灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2025 年 1 月 1 日至 2025 年 12 月 31 日

单位：人民币元

| 项 目 | 附注号 | 本期<br>2025 年 1 月 1 日至 2025 | 上年度可比期间<br>2024 年 1 月 1 日至 2024 |
|---|---|---|---|

| | | 年 12 月 31 日 | 年 12 月 31 日 |
|---|---|---|---|
| **一、营业总收入** | | 12,463,006.01 | -8,191,554.81 |
| 1.利息收入 | | 48,606.53 | 333,842.30 |
| 其中：存款利息收入 | 7.4.7.13 | 48,606.53 | 322,747.02 |
| 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 | | - | 11,095.28 |
| 其他利息收入 | | - | - |
| 2.投资收益（损失以“-”填列） | | 7,236,763.37 | -7,837,777.57 |
| 其中：股票投资收益 | 7.4.7.14 | 6,995,024.21 | -8,351,611.42 |
| 基金投资收益 | | - | - |
| 债券投资收益 | 7.4.7.15 | - | - |
| 资产支持证券投资收益 | 7.4.7.16 | - | - |
| 贵金属投资收益 | 7.4.7.17 | - | - |
| 衍生工具收益 | 7.4.7.18 | - | - |
| 股利收益 | 7.4.7.19 | 241,739.16 | 513,833.85 |
| 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） | 7.4.7.20 | 5,133,999.76 | -814,993.17 |
| 4.汇兑收益（损失以“-”号填列） | | - | - |
| 5.其他收入（损失以“-”号填列） | 7.4.7.21 | 43,636.35 | 127,373.63 |
| **减：二、营业总支出** | | 1,167,586.87 | 1,294,896.12 |
| 1．管理人报酬 | 7.4.10.2.1 | 770,663.06 | 866,959.50 |
| 2．托管费 | 7.4.10.2.2 | 128,443.76 | 144,493.28 |
| 3．销售服务费 | 7.4.10.2.3 | 156,711.87 | 128,902.13 |
| 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 | 7.4.7.22 | - | - |
| 7．税金及附加 | | - | - |
| 8．其他费用 | 7.4.7.23 | 111,768.18 | 154,541.21 |
| **三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）** | | 11,295,419.14 | -9,486,450.93 |
| 减：所得税费用 | | - | - |

| | | | |
|---|---|---|---|
| **四、净利润（净亏损以“-”号填列）** | | 11,295,419.14 | -9,486,450.93 |
| **五、其他综合收益的税后净额** | | - | - |
| **六、综合收益总额** | | 11,295,419.14 | -9,486,450.93 |

## 7.3 净资产变动表

会计主体：大成国家安全主题灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2025 年 1 月 1 日至 2025 年 12 月 31 日

单位：人民币元

| 项目 | 本期<br>2025 年 1 月 1 日至 2025 年 12 月 31 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 | 47,330,950.02 | - | 18,132,534.85 | 65,463,484.87 |
| 二、本期期初净资产 | 47,330,950.02 | - | 18,132,534.85 | 65,463,484.87 |
| 三、本期增减变动额（减少以“-”号填列） | -7,229,477.35 | - | 7,646,412.36 | 416,935.01 |
| （一）、综合收益总额 | - | - | 11,295,419.14 | 11,295,419.14 |
| （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） | -7,229,477.35 | - | -3,649,006.78 | -10,878,484.13 |
| 其中：1.基金申购款 | 9,674,183.79 | - | 4,876,850.83 | 14,551,034.62 |
| 2.基金赎回款 | -16,903,661.14 | - | -8,525,857.61 | -25,429,518.75 |
| （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 | 40,101,472.67 | - | 25,778,947.21 | 65,880,419.88 |
| 项目 | 上年度可比期间<br>2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日 | | | |
| | 实收基金 | 其他综合 | 未分配利润 | 净资产合计 |

| | | 收益 | | |
|---|---|---|---|---|
| 一、上期期末净资产 | 29,997,597.64 | - | 15,326,190.11 | 45,323,787.75 |
| 二、本期期初净资产 | 29,997,597.64 | - | 15,326,190.11 | 45,323,787.75 |
| 三、本期增减变动额（减少以“-”号填列） | 17,333,352.38 | - | 2,806,344.74 | 20,139,697.12 |
| （一）、综合收益总额 | - | - | -9,486,450.93 | -9,486,450.93 |
| （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） | 17,333,352.38 | - | 12,292,795.67 | 29,626,148.05 |
| 其中：1.基金申购款 | 76,765,703.01 | - | 42,091,444.45 | 118,857,147.46 |
| 2.基金赎回款 | -59,432,350.63 | - | -29,798,648.78 | -89,230,999.41 |
| （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 | 47,330,950.02 | - | 18,132,534.85 | 65,463,484.87 |

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.4 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 |

## 7.4 报表附注

### 7.4.1 基金基本情况

大成国家安全主题灵活配置混合型证券投资基金(以下简称“本基金”)经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可证监许可[2015]3082 号《关于准予大成国家安全主题灵活配置混合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《大成国家安全主题灵活配置混合型证券投资基金基金合同》负责公开募集。

本基金为契约型开放式，存续期限不定,首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币 366,943,393.10 元，业经普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)普华永道中天验字(2016)第 543 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《大成国家安全主题灵活配置混合型证券投资基金基金合同》于 2016 年 5 月 4 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 367,042,410.54 份基金份额，其中认购资金利息折合 99,017.44 份基金份额。本基金的基金管理人为大成基金管理有限公司，基金托管人为中国农业银行股份有限公司。

根据本基金的基金管理人于 2023 年 10 月 12 日发布的《关于大成国家安全主题灵活配置混合型证券投资基金增设 C 类基金份额并相应修订基金合同和托管协议的公告》，自 2023 年 10 月 16 日起对本基金进行份额分类，增加 C 类份额，原有基金份额转为 A 类份额。其中 A 类基金份额为在投资人申购时收取前端申购费用，但不从本类别基金资产中计提销售服务费的基金份额；C 类基金份额为从本类别基金资产中计提销售服务费，但不收取申购费用的基金份额。本基金 A 类基金份额和 C 类基金份额分别设置基金代码并分别计算基金份额净值。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《大成国家安全主题灵活配置混合型证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的股票(包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票)、存托凭证、债券(包括国债、央行票据、金融债、企业债、公司债、次级债、中小企业私募债、地方政府债券、中期票据、可转换债券(含分离交易可转债)、短期融资券、超短期融资券、资产支持证券、债券回购等)、货币市场工具、银行存款、权证、股指期货以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具(但须符合中国证监会相关规定)。本基金投资于股票资产、存托凭证占基金资产的比例为 0-95%，其中投资于国家安全主题相关股票、存托凭证的比例不低于非现金基金资产的 80%；固定收益类资产(债券、银行存款等)以及货币市场工具等其他资产不低于基金资产的 5%，本基金每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，应当保持不低于基资产净值 5%的现金(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，权证及其他金融工具的投资比例依照法律法规或监管机构的规定执行。本基金投资业绩比较基准为：中证 800 指数收益率*80%+中债综合指数收益率*20%。

## 7.4.2 会计报表的编制基础

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

算业务指引》、本基金基金合同和在财务报表附注所列示的中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

本财务报表以持续经营为基础编制。

### 7.4.3 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 12 月 31 日的财务状况以及 2025 年度的经营成果和净资产变动情况等有关信息。

### 7.4.4 重要会计政策和会计估计

#### 7.4.4.1 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。

#### 7.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

#### 7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

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

(1)金融资产

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

债务工具

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

以摊余成本计量：

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

以公允价值计量且其变动计入当期损益：

本基金将持有的未划分为以摊余成本计量的债务工具，以公允价值计量且其变动计入当期损益。本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产主要为债券投资、资产支持

证券投资和基金投资，在资产负债表中以交易性金融资产列示。

权益工具

权益工具是指从发行方角度分析符合权益定义的工具。本基金将对其没有控制、共同控制和重大影响的权益工具(主要为股票投资)按照公允价值计量且其变动计入当期损益，在资产负债表中列示为交易性金融资产。

(2)金融负债

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

(3)衍生金融工具

本基金将持有的衍生金融工具以公允价值计量且其变动计入当期损益，在资产负债表中列示为衍生金融资产/负债。

### 7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

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

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

本基金对于以摊余成本计量的金融资产，以预期信用损失为基础确认损失准备。

本基金考虑在资产负债表日无须付出不必要的额外成本和努力即可获得的有关过去事项、当前状况以及对未来经济状况的预测等合理且有依据的信息，以发生违约的风险为权重，计算合同应收的现金流量与预期能收到的现金流量之间差额的现值的概率加权金额，确认预期信用损失。

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

三阶段，本基金按照该工具整个存续期的预期信用损失计量损失准备。

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

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

本基金将计提或转回的损失准备计入当期损益。

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

金融资产终止确认时，其账面价值与收到的对价的差额，计入当期损益。

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

### 7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

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其估值日的市场交易价格确定公允价值；估值日无交易且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，按最近交易日的市场交易价格确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的市场交易价格不能真实反映公允价值的，应对市场交易价格进行调整，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)当金融工具不存在活跃市场，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。采用估值技术时，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，才可以使用不可观察输入值。

(3)如经济环境发生重大变化或证券发行人发生影响金融工具价格的重大事件，应对估值进行调整并确定公允价值。

### 7.4.4.6 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。

### 7.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行基金份额所募集的总金额在扣除损益平准金分摊部分后的余额。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。

本基金发行的份额作为可回售工具具备以下特征：(1)赋予基金份额持有人在基金清算时按比例份额获得该基金净资产的权利，这里所指基金净资产是扣除所有优先于该基金份额对基金资产要求权之后的剩余资产；这里所指按比例份额是清算时将基金的净资产分拆为金额相等的单位，并且将单位金额乘以基金份额持有人所持有的单位数量；(2)该工具所属的类别次于其他所有工具类别，即本基金份额在归属于该类别前无须转换为另一种工具，且在清算时对基金资产没有优先于其他工具的要求权；(3)该工具所属的类别中(该类别次于其他所有工具类别)，所有工具具有相同的特征(例如它们必须都具有可回售特征，并且用于计算回购或赎回价格的公式或其他方法都相同)；(4)除了发行方应当以现金或其他金融资产回购或赎回该基金份额的合同义务外，该工具不满足金融负债定义中的任何其他特征；(5)该工具在存续期内的预计现金流量总额，应当实质上基于该基金存续期内基金的损益、已确认净资产的变动、已确认和未确认净资产的公允价值变动(不包括本基金的任何影响)。

可回售工具，是指根据合同约定，持有方有权将该工具回售给发行方以获取现金或其他金融资产的权利，或者在未来某一不确定事项发生或者持有方死亡或退休时，自动回售给发行方的金融工具。

本基金没有同时具备下列特征的其他金融工具或合同：(1)现金流量总额实质上基于基金的损益、已确认净资产的变动、已确认和未确认净资产的公允价值变动(不包括该基金或合同的任何影响)；(2)实质上限制或固定了上述工具持有方所获得的剩余回报。

本基金将实收基金分类为权益工具，列报于净资产。

### 7.4.4.8 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)。

### 7.4.4.9 收入/（损失）的确认和计量

股票投资在持有期间应取得的现金股利扣除由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额确认为投资收益。债券投资和资产支持证券投资在持有期间应取得的按票面利率(对于贴现债为按发行价计算的利率)或合同利率计算的利息扣除在适用情况下由债券和资产支持证券发行企业代扣代缴的个人所得税及由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为投资收益。基金投资在持有期间应取得的红利于除权日确认为投资收益。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在持有期间的公允价值变动扣除按票面利率(对于贴现债为按发行价计算的利率)或合同利率计算的利息后的净额确认为公允价值变动损益；于处置时，其处置价格与初始确认金额之间的差额扣除相关交易费用及在适用情况下由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为投资收益，其中包括从公允价值变动损益结转的公允价值累计变动额。

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

### 7.4.4.10 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。

### 7.4.4.11 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。

### 7.4.4.12 外币交易

无。

### 7.4.4.13 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。

### 7.4.4.14 其他重要的会计政策和会计估计

根据本基金的估值原则和中国证监会允许的基金行业估值实务操作，本基金确定以下类别股票投资、基金投资、债券投资和资产支持证券的公允价值时采用的估值方法及其关键假设如下：

(1)对于证券交易所上市的股票和债券，若出现重大事项停牌或交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)等情况，本基金根据中国证监会公告[2017]13 号《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》，根据具体情况采用《关于发布中基协(AMAC)基金行业股票估值指数的通知》提供的指数收益法、市盈率法、现金流量折现法等估值技术进行估值。

(2)对于在锁定期内的非公开发行股票、首次公开发行股票时公司股东公开发售股份、通过大宗交易取得的带限售期的股票等流通受限股票，根据中国基金业协会中基协发[2017]6 号《关于发布<证券投资基金投资流通受限股票估值指引(试行)>的通知》之附件《证券投资基金投资流通受限股票估值指引(试行)》(以下简称“指引”)，按估值日在证券交易所上市交易的同一股票的公允价值扣除中证指数有限公司根据指引所独立提供的该流通受限股票剩余限售期对应的流动性折扣后的价值进行估值。

(3)对于在证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券和可交换债券除外)及在银行间同业市场交易的固定收益品种，根据中国证监会公告[2017]13 号《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》及中国基金业协会中基协字[2022]566 号《关于发布<关于固定收益品种的估值处理标准>的通知》之附件《关于固定收益品种的估值处理标准》采用估值技术确定公允价值。本基金持有的证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券和可交换债券除外)，按照中证指数有限公司所独立提供的估值结果确定公允价值。本基金持有的银行间同业市场

固定收益品种按照中债金融估值中心有限公司所独立提供的估值结果确定公允价值。

(4)对于基金投资，根据中基协发[2017]3 号《关于发布<基金中基金估值业务指引(试行)>的通知》之附件《基金中基金估值业务指引(试行)》所述方法估值。

## 7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

### 7.4.5.1 会计政策变更的说明

无。

### 7.4.5.2 会计估计变更的说明

无。

### 7.4.5.3 差错更正的说明

无。

## 7.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128 号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2008]1 号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85 号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2014]81 号《财政部国家税务总局证监会关于沪港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》、财税[2015]101 号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2016]36 号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46 号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70 号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、财税[2016]127 号《财政部国家税务总局证监会关于深港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》、财税[2016]140 号《关于明确金融 房地产开发 教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税[2017]2 号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017]56 号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90 号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》、财政部、国家税务总局公告 2025 年第 4 号《关于国债等债券利息收入增值税政策的公告》 及其他相关境内外财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

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

对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税，对除持有金融债券外的金融同业往来利息收入亦免征增值税。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，免征增值税直至债券到期。资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务，以 2018 年 1 月 1 日起产生的利息及利息性质的收入为销售额。资管产品管理人运营资管产品转让 2017 年 12 月 31 日前取得的基金、非货物期货，可以选择按照实际买入价计算销售额，或者以 2017 年最后一个交易日的基金份额净值、非货物期货结算价格作为买入价计算销售额。

(2)对基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股票的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

(3)对基金取得的企业债券利息收入，应由发行债券的企业在向基金支付利息时代扣代缴 20%的个人所得税。对基金从上市公司取得的股息红利所得，持股期限在 1 个月以内(含 1 个月)的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在 1 个月以上至 1 年(含 1 年)的，暂减按 50%计入应纳税所得额；持股期限超过 1 年的，暂免征收个人所得税。对基金持有的上市公司限售股，解禁后取得的股息、红利收入，按照上述规定计算纳税，持股时间自解禁日起计算；解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按 50%计入应纳税所得额。上述所得统一适用 20%的税率计征个人所得税。

对基金通过港股通投资香港联交所上市 H 股取得的股息红利，H 股公司应向中国证券登记结算有限责任公司(以下简称“中国结算”)提出申请，由中国结算向 H 股公司提供内地个人投资者名册，H 股公司按照 20%的税率代扣个人所得税。基金通过港股通投资香港联交所上市的非 H 股取得的股息红利，由中国结算按照 20%的税率代扣个人所得税。

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

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

(5)基金卖出股票按 0.1%的税率缴纳股票交易印花税，买入股票不征收股票交易印花税。根据财政部、国家税务总局公告 2023 年第 39 号《关于减半征收证券交易印花税的公告》，自 2023 年 8 月 28 日起，证券交易印花税实施减半征收。基金通过港股通买卖、继承、赠与联交所上市股票，按照香港特别行政区现行税法规定缴纳印花税。

(6)本基金的城市维护建设税、教育费附加和地方教育附加等税费按照实际缴纳增值税额的适用比例计算缴纳。

## 7.4.7 重要财务报表项目的说明

### 7.4.7.1 货币资金

单位：人民币元

| 项目 | 本期末<br>2025 年 12 月 31 日 | 上年度末<br>2024 年 12 月 31 日 |
|---|---|---|
| 活期存款 | 17,757,675.94 | 6,843,122.63 |
| 等于：本金 | 17,756,842.86 | 6,840,925.79 |
| 加：应计利息 | 833.08 | 2,196.84 |
| 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 | 17,757,675.94 | 6,843,122.63 |

### 7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

| 项目 | | 本期末<br>2025 年 12 月 31 日 | | | |
|---|---|---|---|---|---|
| | | 成本 | 应计利息 | 公允价值 | 公允价值变动 |
| 股票 | | 35,388,820.10 | - | 39,974,171.97 | 4,585,351.87 |
| 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 | | 35,388,820.10 | - | 39,974,171.97 | 4,585,351.87 |
| 项目 | | 上年度末<br>2024 年 12 月 31 日 | | | |
| | | 成本 | 应计利息 | 公允价值 | 公允价值变动 |
| 股票 | | 58,970,639.99 | - | 58,421,992.10 | -548,647.89 |
| 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 | | 58,970,639.99 | - | 58,421,992.10 | -548,647.89 |

### 7.4.7.3 衍生金融资产/负债

#### 7.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

无。

#### 7.4.7.3.2 期末基金持有的期货合约情况

无。

#### 7.4.7.3.3 期末基金持有的黄金衍生品情况

无。

### 7.4.7.4 买入返售金融资产

#### 7.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

无。

#### 7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

无。

#### 7.4.7.4.3 按预期信用损失一般模型计提减值准备的说明

| |
|---|
| 无。 |

### 7.4.7.5 债权投资

#### 7.4.7.5.1 债权投资情况

无。

#### 7.4.7.5.2 债权投资减值准备计提情况

无。

### 7.4.7.6 其他债权投资

#### 7.4.7.6.1 其他债权投资情况

无。

#### 7.4.7.6.2 其他债权投资减值准备计提情况

无。

### 7.4.7.7 其他权益工具投资

#### 7.4.7.7.1 其他权益工具投资情况

无。

#### 7.4.7.7.2 报告期末其他权益工具投资情况

无。

### 7.4.7.8 其他资产

无。

### 7.4.7.9 其他负债

单位：人民币元

| 项目 | 本期末<br>2025 年 12 月 31 日 | 上年度末<br>2024 年 12 月 31 日 |
|---|---|---|
| 应付券商交易单元保证金 | - | - |
| 应付赎回费 | 45.90 | 0.14 |
| 应付证券出借违约金 | - | - |
| 应付交易费用 | 10,401.56 | 149,425.04 |
| 其中：交易所市场 | 10,401.56 | 149,425.04 |
| 银行间市场 | - | - |
| 应付利息 | - | - |
| 预提费用 | 28,000.00 | 28,000.00 |
| 合计 | 38,447.46 | 177,425.18 |

### 7.4.7.10 实收基金

金额单位：人民币元

大成国家安全主题灵活配置混合 A

| 项目 | 本期<br>2025 年 1 月 1 日至 2025 年 12 月 31 日 | |
|---|---|---|
| | 基金份额（份） | 账面金额 |
| 上年度末 | 20,030,293.38 | 20,030,293.38 |
| 本期申购 | 4,931,631.40 | 4,931,631.40 |
| 本期赎回（以“-”号填列） | -11,418,271.27 | -11,418,271.27 |
| 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 | 13,543,653.51 | 13,543,653.51 |

大成国家安全主题灵活配置混合 C

| 项目 | 本期<br>2025 年 1 月 1 日至 2025 年 12 月 31 日 | |
|---|---|---|
| | 基金份额（份） | 账面金额 |
| 上年度末 | 27,300,656.64 | 27,300,656.64 |
| 本期申购 | 4,742,552.39 | 4,742,552.39 |

| | | |
|---|---|---|
| 本期赎回（以“-”号填列） | -5,485,389.87 | -5,485,389.87 |
| 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 | 26,557,819.16 | 26,557,819.16 |

注：申购含红利再投份额(如有)、转换入份额(如有)；赎回含转换出份额(如有)。

## 7.4.7.11 其他综合收益

无。

## 7.4.7.12 未分配利润

单位：人民币元

大成国家安全主题灵活配置混合 A

| 项目 | 已实现部分 | 未实现部分 | 未分配利润合计 |
|---|---|---|---|
| 上年度末 | 9,368,479.15 | -1,604,767.08 | 7,763,712.07 |
| 本期期初 | 9,368,479.15 | -1,604,767.08 | 7,763,712.07 |
| 本期利润 | 2,390,326.18 | 2,118,270.87 | 4,508,597.05 |
| 本期基金份额交易产生的变动数 | -3,394,773.37 | -28,977.82 | -3,423,751.19 |
| 其中：基金申购款 | 2,591,038.58 | -37,343.97 | 2,553,694.61 |
| 基金赎回款 | -5,985,811.95 | 8,366.15 | -5,977,445.80 |
| 本期已分配利润 | - | - | - |
| 本期末 | 8,364,031.96 | 484,525.97 | 8,848,557.93 |

大成国家安全主题灵活配置混合 C

| 项目 | 已实现部分 | 未实现部分 | 未分配利润合计 |
|---|---|---|---|
| 上年度末 | 12,548,319.75 | -2,179,496.97 | 10,368,822.78 |
| 本期期初 | 12,548,319.75 | -2,179,496.97 | 10,368,822.78 |
| 本期利润 | 3,771,093.20 | 3,015,728.89 | 6,786,822.09 |
| 本期基金份额交易产生的变动数 | -321,136.90 | 95,881.31 | -225,255.59 |
| 其中：基金申购款 | 2,466,513.10 | -143,356.88 | 2,323,156.22 |
| 基金赎回款 | -2,787,650.00 | 239,238.19 | -2,548,411.81 |
| 本期已分配利润 | - | - | - |
| 本期末 | 15,998,276.05 | 932,113.23 | 16,930,389.28 |

## 7.4.7.13 存款利息收入

单位：人民币元

| 项目 | 本期<br>2025 年 1 月 1 日至 2025 年 12 月 31 日 | 上年度可比期间<br>2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日 |
|---|---|---|
| 活期存款利息收入 | 48,117.72 | 315,454.94 |
| 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 | 281.24 | 5,204.26 |
| 其他 | 207.57 | 2,087.82 |
| 合计 | 48,606.53 | 322,747.02 |

### 7.4.7.14 股票投资收益

#### 7.4.7.14.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

| 项目 | 本期<br>2025年1月1日至2025年12月31日 | 上年度可比期间<br>2024年1月1日至2024年12月31日 |
|---|---|---|
| 股票投资收益——买卖股票差价收入 | 6,995,024.21 | -8,351,611.42 |
| 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 | 6,995,024.21 | -8,351,611.42 |

#### 7.4.7.14.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

| 项目 | 本期<br>2025 年 1 月 1 日至 2025 年 12 月 31 日 | 上年度可比期间<br>2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日 |
|---|---|---|
| 卖出股票成交总额 | 145,293,749.58 | 397,260,443.81 |
| 减：卖出股票成本总额 | 138,090,951.82 | 404,818,615.57 |
| 减：交易费用 | 207,773.55 | 793,439.66 |
| 买卖股票差价收入 | 6,995,024.21 | -8,351,611.42 |

#### 7.4.7.14.3 股票投资收益——证券出借差价收入

无。

### 7.4.7.15 债券投资收益

#### 7.4.7.15.1 债券投资收益项目构成

无。

#### 7.4.7.15.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

无。

#### 7.4.7.15.3 债券投资收益——赎回差价收入

无。

### 7.4.7.15.4 债券投资收益——申购差价收入

无。

### 7.4.7.16 资产支持证券投资收益

### 7.4.7.16.1 资产支持证券投资收益项目构成

无。

### 7.4.7.16.2 资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入

无。

### 7.4.7.16.3 资产支持证券投资收益——赎回差价收入

无。

### 7.4.7.16.4 资产支持证券投资收益——申购差价收入

无。

### 7.4.7.17 贵金属投资收益

### 7.4.7.17.1 贵金属投资收益项目构成

无。

### 7.4.7.17.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

无。

### 7.4.7.17.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

无。

### 7.4.7.17.4 贵金属投资收益——申购差价收入

无。

### 7.4.7.18 衍生工具收益

### 7.4.7.18.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

无。

### 7.4.7.18.2 衍生工具收益——其他投资收益

无。

### 7.4.7.19 股利收益

单位：人民币元

| 项目 | 本期<br>2025 年 1 月 1 日至 2025 年 12 月 31 日 | 上年度可比期间<br>2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日 |
|---|---|---|
| 股票投资产生的股利收益 | 241,739.16 | 513,833.85 |

| | | |
|---|---|---|
| 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 | 241,739.16 | 513,833.85 |

## 7.4.7.20 公允价值变动收益

单位：人民币元

| 项目名称 | 本期<br>2025 年 1 月 1 日至 2025 年 12 月 31 日 | 上年度可比期间<br>2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日 |
|---|---|---|
| 1.交易性金融资产 | 5,133,999.76 | -814,993.17 |
| 股票投资 | 5,133,999.76 | -814,993.17 |
| 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 | 5,133,999.76 | -814,993.17 |

## 7.4.7.21 其他收入

单位：人民币元

| 项目 | 本期<br>2025 年 1 月 1 日至 2025 年 12 月 31 日 | 上年度可比期间<br>2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日 |
|---|---|---|
| 基金赎回费收入 | 41,079.68 | 64,844.12 |
| 基金转换费收入 | 2,556.67 | 62,529.51 |
| 合计 | 43,636.35 | 127,373.63 |

## 7.4.7.22 信用减值损失

无。

## 7.4.7.23 其他费用

单位：人民币元

| 项目 | 本期<br>2025 年 1 月 1 日至 2025 年 12 月 31 日 | 上年度可比期间<br>2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日 |
|---|---|---|
| 审计费用 | 28,000.00 | 28,000.00 |
| 信息披露费 | 80,000.00 | 120,000.00 |
| 证券出借违约金 | - | - |

| | | |
|---|---|---|
| 存托服务费 | - | 12.16 |
| 银行划款手续费 | 3,768.18 | 6,529.05 |
| 合计 | 111,768.18 | 154,541.21 |

### 7.4.7.24 分部报告

无。

## 7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

### 7.4.8.1 或有事项

无。

### 7.4.8.2 资产负债表日后事项

无。

## 7.4.9 关联方关系

| 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 |
| 中泰信托有限责任公司 | 基金管理人的股东 |
| 光大证券股份有限公司(“光大证券”) | 基金管理人的股东、基金销售机构 |
| 中国银河投资管理有限公司 | 基金管理人的股东 |
| 大成国际资产管理有限公司(“大成国际”) | 基金管理人的子公司 |
| 大成创新资本管理有限公司(“大成创新资本”) | 基金管理人的合营企业 |

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。

## 7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

### 7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

#### 7.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

| 关联方名称 | 本期<br>2025 年 1 月 1 日至 2025 年 12 月 31 日 | | 上年度可比期间<br>2024年1月1日至2024年12月31日 | |
|---|---|---|---|---|
| | 成交金额 | 占当期股票成交总额的比例（%） | 成交金额 | 占当期股票成交总额的比例（%） |
| 光大证券 | 119,922,702.02 | 46.16 | 40,326,259.64 | 4.78 |

#### 7.4.10.1.2 债券交易

无。

### 7.4.10.1.3 债券回购交易

无。

### 7.4.10.1.4 权证交易

无。

### 7.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

| 关联方名称 | 本期<br>2025年1月1日至2025年12月31日 | | | |
|---|---|---|---|---|
| | 当期佣金 | 占当期佣金总量的比例（%） | 期末应付佣金余额 | 占期末应付佣金总额的比例（%） |
| 光大证券 | 54,684.74 | 46.16 | 3,947.45 | 37.95 |
| 关联方名称 | 上年度可比期间<br>2024年1月1日至2024年12月31日 | | | |
| | 当期佣金 | 占当期佣金总量的比例（%） | 期末应付佣金余额 | 占期末应付佣金总额的比例（%） |
| 光大证券 | 18,388.77 | 3.40 | 18,388.77 | 12.31 |

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

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

### 7.4.10.2 关联方报酬

### 7.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

| 项目 | 本期<br>2025 年 1 月 1 日至 2025 年 12 月 31 日 | 上年度可比期间<br>2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日 |
|---|---|---|
| 当期发生的基金应支付的管理费 | 770,663.06 | 866,959.50 |
| 其中：应支付销售机构的客户维护费 | 175,307.80 | 226,442.13 |
| 应支付基金管理人的净管理费 | 595,355.26 | 640,517.37 |

注：本基金管理费年费率为 1.20%，每日计提，按月支付。其计算公式为：

日管理费＝前一日基金资产净值×管理费年费率/当年天数。

### 7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

| 项目 | 本期<br>2025 年 1 月 1 日至 2025 年 12 月 31 日 | 上年度可比期间<br>2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日 |
|---|---|---|
| 当期发生的基金应支付的托管费 | 128,443.76 | 144,493.28 |

注：本基金托管费年费率为 0.20%，每日计提，按月支付。其计算公式为：

日托管费＝前一日基金资产净值×托管费年费率/当年天数。

### 7.4.10.2.3 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<br>2025 年 1 月 1 日至 2025 年 12 月 31 日 | | |
|---|---|---|---|
| | 当期发生的基金应支付的销售服务费 | | |
| | 大成国家安全主题灵活配置混合 A | 大成国家安全主题灵活配置混合 C | 合计 |
| 大成基金 | - | 105,071.64 | 105,071.64 |
| 合计 | - | 105,071.64 | 105,071.64 |
| 获得销售服务费的各关联方名称 | 上年度可比期间<br>2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日 | | |
| | 当期发生的基金应支付的销售服务费 | | |
| | 大成国家安全主题灵活配置混合 A | 大成国家安全主题灵活配置混合 C | 合计 |
| 大成基金 | - | 74,421.72 | 74,421.72 |
| 合计 | - | 74,421.72 | 74,421.72 |

注：C 类基金份额的销售服务费年费率为 0.40%。

销售服务费的计算方法如下：

H＝E×该类基金份额销售服务费年费率÷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

### 7.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

无。

### 7.4.10.4 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

#### 7.4.10.4.1 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。

#### 7.4.10.4.2 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。

### 7.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

#### 7.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

份额单位：份

| 项目 | 本期<br>2025 年 1 月 1 日至 2025 年 12 月 31 日 | |
|---|---|---|
| | 大成国家安全主题灵活配置混合 A | 大成国家安全主题灵活配置混合 C |
| 基金合同生效日（2016 年 5 月 4 日）持有的基金份额 | - | - |
| 报告期初持有的基金份额 | - | 6,906.08 |
| 报告期间申购/买入总份额 | - | - |
| 报告期间因拆分变动份额 | - | - |
| 减：报告期间赎回/卖出总份额 | - | 6,906.08 |
| 报告期末持有的基金份额 | - | - |
| 报告期末持有的基金份额占基金总份额比例 | - | - |
| 项目 | 上年度可比期间<br>2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日 | |
| | 大成国家安全主题灵活配置混合 A | 大成国家安全主题灵活配置混合 C |
| 基金合同生效日（2016 年 5 月 4 日）持有的基金份额 | - | - |
| 报告期初持有的基金份额 | - | 6,906.08 |
| 报告期间申购/ | - | 0.00 |

| | | |
|---|---|---|
| 买入总份额 | | |
| 报告期间因拆分变动份额 | - | - |
| 减：报告期间赎回/卖出总份额 | - | 0.00 |
| 报告期末持有的基金份额 | - | 6,906.08 |
| 报告期末持有的基金份额占基金总份额比例 | - | 0.01% |

注：基金管理人大成基金投资本基金适用的交易费率与本基金法律文件规定一致。

### 7.4.10.5.2 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。

### 7.4.10.6 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<br>2025 年 1 月 1 日至 2025 年 12 月 31 日 | | 上年度可比期间<br>2024年1月1日至2024年12月31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 | 17,757,675.94 | 48,117.72 | 6,843,122.63 | 315,454.94 |

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。

### 7.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

无。

### 7.4.10.8 其他关联交易事项的说明

无。

### 7.4.11 利润分配情况

无。

### 7.4.12 期末（2025 年 12 月 31 日）本基金持有的流通受限证券

### 7.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

无。

### 7.4.12.2 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 | 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 |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|

| | | | | | | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| | 称 | | | | | | | | | |
| 688012 | 中微公司 | 2025 年 12 月 19 日 | 重大事项停牌 | 283.75 | 2026 年 1 月 5 日 | 278.00 | 279 | 47,124.63 | 79,166.25 | - |

### 7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

#### 7.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

无。

#### 7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

无。

### 7.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

无。

### 7.4.13 金融工具风险及管理

#### 7.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金属于混合型基金，其预期收益及风险水平低于股票基金，高于债券基金与货币市场基金，属于较高风险/收益特征的开放式基金。本基金投资的金融工具主要包括股票投资、债券投资及股指期货投资等。本基金在日常经营活动中面临的与这些金融工具相关的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金的基金管理人从事风险管理的主要目标是争取将以上风险控制在限定的范围之内，使本基金在风险和收益之间取得最佳的平衡以实现“风险和收益相匹配”的风险收益目标。

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。

### 7.4.13.2 信用风险

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

本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的银行存款存放在本基金的托管人中国农业银行股份有限公司，因而与银行存款相关的信用风险不重大。本基金在交易所进行的交易均以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，违约风险可能性很小；在银行间同业市场进行交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式进行限制以控制相应的信用风险。

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

本期末，本基金无债券投资(上年度末：同)。

### 7.4.13.3 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。

#### 7.4.13.3.1 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。

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。本报告期内，本基金未发生重大流动性风险事件。

### 7.4.13.4 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。

#### 7.4.13.4.1 利率风险

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

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

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

##### 7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

| 本期末<br>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 | 17,757,675.94 | - | - | - | 17,757,675.94 |
| 结算备付金 | 14,427.69 | - | - | - | 14,427.69 |
| 存出保证金 | 38,973.12 | - | - | - | 38,973.12 |
| 交易性金融资产 | - | - | - | 39,974,171.97 | 39,974,171.97 |
| 应收申购款 | - | - | - | 361,285.85 | 361,285.85 |
| 应收清算款 | - | - | - | 8,012,659.88 | 8,012,659.88 |
| 资产总计 | 17,811,076.75 | - | - | 48,348,117.70 | 66,159,194.45 |
| 负债 | | | | | |
| 应付赎回款 | - | - | - | 151,616.00 | 151,616.00 |
| 应付管理人报酬 | - | - | - | 64,007.68 | 64,007.68 |

| | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|
| 应付托管费 | - | - | - | 10,667.95 | 10,667.95 |
| 应付销售服务费 | - | - | - | 14,035.48 | 14,035.48 |
| 其他负债 | - | - | - | 38,447.46 | 38,447.46 |
| 负债总计 | - | - | - | 278,774.57 | 278,774.57 |
| 利率敏感度缺口 | 17,811,076.75 | - | - | 48,069,343.13 | 65,880,419.88 |
| 上年度末<br>2024 年 12 月 31 日 | 1 年以内 | 1-5 年 | 5 年以上 | 不计息 | 合计 |
| 资产 | | | | | |
| 货币资金 | 6,843,122.63 | - | - | - | 6,843,122.63 |
| 结算备付金 | 350,543.73 | - | - | - | 350,543.73 |
| 存出保证金 | 116,780.08 | - | - | - | 116,780.08 |
| 交易性金融资产 | - | - | - | 58,421,992.10 | 58,421,992.10 |
| 应收申购款 | - | - | - | 9,391.20 | 9,391.20 |
| 资产总计 | 7,310,446.44 | - | - | 58,431,383.30 | 65,741,829.74 |
| 负债 | | | | | |
| 应付赎回款 | - | - | - | 8,425.73 | 8,425.73 |
| 应付管理人报酬 | - | - | - | 68,067.51 | 68,067.51 |
| 应付托管费 | - | - | - | 11,344.59 | 11,344.59 |
| 应付销售服务费 | - | - | - | 13,081.86 | 13,081.86 |
| 其他负债 | - | - | - | 177,425.18 | 177,425.18 |
| 负债总计 | - | - | - | 278,344.87 | 278,344.87 |
| 利率敏感度缺口 | 7,310,446.44 | - | - | 58,153,038.43 | 65,463,484.87 |

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。

### 7.4.13.4.1.2 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)。

### 7.4.13.4.2 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。

### 7.4.13.4.3 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。

本基金采用自上而下与自下而上相结合的方法进行主动投资策略，以宏观经济和政策研究为基础，通过分析影响证券市场整体运行的内外部因素，进行自上而下的资产配置和组合管理，同

时自下而上的精选各个行业中具有良好治理结构、在细分行业具有竞争优势以及有较高成长性的产业升级股票进行投资。本基金的基金管理人定期结合宏观及微观环境的变化，对投资策略、资产配置、投资组合进行修正，来主动应对可能发生的市场价格风险。

本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险。本基金投资于股票资产、存托凭证占基金资产的比例为 0%-95%，其中投资于国家安全主题相关股票、存托凭证的比例不低于非现金基金资产的 80%；固定收益类资产(债券、银行存款等)以及货币市场工具等其他资产不低于基金资产的 5%，本基金每个交易日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，应当保持不低于基资产净值 5%的现金(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政府债券，权证及其他金融工具的投资比例依照法律法规或监管机构的规定执行。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。

### 7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

| 项目 | 本期末<br>2025 年 12 月 31 日 | | 上年度末<br>2024年12月31日 | |
|---|---|---|---|---|
| | 公允价值 | 占基金资产净值比例（%） | 公允价值 | 占基金资产净值比例（%） |
| 交易性金融资产－股票投资 | 39,974,171.97 | 60.68 | 58,421,992.10 | 89.24 |
| 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 | 39,974,171.97 | 60.68 | 58,421,992.10 | 89.24 |

### 7.4.13.4.3.2 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 12 月 31 日） | 上年度末 （2024 年 12 月 31 日 ） |

| | | | |
|---|---|---|---|
| | 业绩比较基准上升 5% | 3,717,286.78 | 1,984,049.88 |
| | 业绩比较基准下降 5% | -3,717,286.78 | -1,984,049.88 |

## 7.4.14 公允价值

### 7.4.14.1 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。

### 7.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

#### 7.4.14.2.1 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<br>2025 年 12 月 31 日 | 上年度末<br>2024 年 12 月 31 日 |
|---|---|---|
| 第一层次 | 39,895,005.72 | 58,417,449.31 |
| 第二层次 | 79,166.25 | - |
| 第三层次 | - | 4,542.79 |
| 合计 | 39,974,171.97 | 58,421,992.10 |

#### 7.4.14.2.2 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。

#### 7.4.14.2.3 第三层次公允价值余额及变动情况

##### 7.4.14.2.3.1 第三层次公允价值余额及变动情况

单位：人民币元

| 项目 | 本期<br>2025 年 1 月 1 日至 2025 年 12 月 31 日 | | |
|---|---|---|---|
| | 交易性金融资产 | | 合计 |
| | 债券投资 | 股票投资 | |
| 期初余额 | - | 4,542.79 | 4,542.79 |
| 当期购买 | - | - | - |
| 当期出售/结算 | - | - | - |
| 转入第三层次 | - | - | - |
| 转出第三层次 | - | 5,457.19 | 5,457.19 |
| 当期利得或损失总额 | - | 914.40 | 914.40 |
| 其中：计入损益的利得或损失 | - | 914.40 | 914.40 |
| 计入其他综合收益的利得或损失 | - | - | - |
| 期末余额 | - | - | - |
| 期末仍持有的第三层次金融资产计入本期损益的未实现利得或损失的变动——公允价值变动损益 | - | - | - |
| 项目 | 上年度可比期间<br>2024年1月1日至2024年12月31日 | | |
| | 交易性金融资产 | | 合计 |
| | 债券投资 | 股票投资 | |
| 期初余额 | - | - | - |
| 当期购买 | - | - | - |
| 当期出售/结算 | - | - | - |
| 转入第三层次 | - | 13,909.04 | 13,909.04 |
| 转出第三层次 | - | - | - |
| 当期利得或损失总额 | - | -9,366.25 | -9,366.25 |
| 其中：计入损益的利得或损失 | - | -9,366.25 | -9,366.25 |
| 计入其他综合收益的利得或损失 | - | - | - |
| 期末余额 | - | 4,542.79 | 4,542.79 |
| 期末仍持有的第三层次金融资产计入本期损益的未实现利得或损失的变动——公允价值变动损益 | - | 3,529.33 | 3,529.33 |

### 7.4.14.2.3.2 使用重要不可观察输入值的第三层次公允价值计量的情况

单位：人民币元

| 项目 | 本期末公允价值 | 采用的估值技术 | 不可观察输入值 | | |
|---|---|---|---|---|---|
| | | | 名称 | 范围/加权平均值 | 与公允价值之间的关系 |
| - | - | - | - | - | - |
| 项目 | 上年度末公允价值 | 采用的估值技术 | 不可观察输入值 | | |
| | | | 名称 | 范围/加权平均值 | 与公允价值之间的关系 |
| 证券交易所上市但尚在限售期内的股票 | 4,542.79 | 平均价格亚式期权模型 | 预期波动率 | 4.9648-4.9648 | 负相关 |

### 7.4.14.3 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)。

### 7.4.14.4 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。

### 7.4.15 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。

## §8 投资组合报告

### 8.1 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 | 39,974,171.97 | 60.42 |
| | 其中：股票 | 39,974,171.97 | 60.42 |
| 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 | 17,772,103.63 | 26.86 |

| | | | |
|---|---|---|---|
| 8 | 其他各项资产 | 8,412,918.85 | 12.72 |
| 9 | 合计 | 66,159,194.45 | 100.00 |

## 8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

### 8.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

金额单位：人民币元

| 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 | 39,974,171.97 | 60.68 |
| D | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | - | - |
| E | 建筑业 | - | - |
| F | 批发和零售业 | - | - |
| G | 交通运输、仓储和邮政业 | - | - |
| H | 住宿和餐饮业 | - | - |
| I | 信息传输、软件和信息技术服务业 | - | - |
| J | 金融业 | - | - |
| K | 房地产业 | - | - |
| L | 租赁和商务服务业 | - | - |
| M | 科学研究和技术服务业 | - | - |
| N | 水利、环境和公共设施管理业 | - | - |
| O | 居民服务、修理和其他服务业 | - | - |
| P | 教育 | - | - |
| Q | 卫生和社会工作 | - | - |
| R | 文化、体育和娱乐业 | - | - |
| S | 综合 | - | - |
| | 合计 | 39,974,171.97 | 60.68 |

### 8.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

无。

## 8.3 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

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 | 600893 | 航发动力 | 130,600 | 5,227,918.00 | 7.94 |
| 2 | 600760 | 中航沈飞 | 86,680 | 4,867,082.00 | 7.39 |
| 3 | 600418 | 江淮汽车 | 96,300 | 4,766,850.00 | 7.24 |
| 4 | 002625 | 光启技术 | 60,400 | 2,945,104.00 | 4.47 |
| 5 | 302132 | 中航成飞 | 32,500 | 2,567,500.00 | 3.90 |
| 6 | 600862 | 中航高科 | 107,700 | 2,544,951.00 | 3.86 |

| | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|
| 7 | 000768 | 中航西飞 | 94,400 | 2,395,872.00 | 3.64 |
| 8 | 688122 | 西部超导 | 29,631 | 2,209,879.98 | 3.35 |
| 9 | 600765 | 中航重机 | 82,300 | 1,576,868.00 | 2.39 |
| 10 | 688281 | 华秦科技 | 19,912 | 1,469,505.60 | 2.23 |
| 11 | 600372 | 中航机载 | 109,200 | 1,465,464.00 | 2.22 |
| 12 | 688239 | 航宇科技 | 20,934 | 1,416,603.78 | 2.15 |
| 13 | 605123 | 派克新材 | 12,800 | 1,329,920.00 | 2.02 |
| 14 | 002025 | 航天电器 | 26,400 | 1,323,432.00 | 2.01 |
| 15 | 688297 | 中无人机 | 26,368 | 1,266,191.36 | 1.92 |
| 16 | 600150 | 中国船舶 | 37,600 | 1,250,576.00 | 1.90 |
| 17 | 002179 | 中航光电 | 33,200 | 1,176,608.00 | 1.79 |
| 18 | 600456 | 宝钛股份 | 2,400 | 94,680.00 | 0.14 |
| 19 | 688012 | 中微公司 | 279 | 79,166.25 | 0.12 |

## 8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

### 8.4.1 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 | 600893 | 航发动力 | 7,737,825.00 | 11.82 |
| 2 | 688333 | 铂力特 | 7,369,571.15 | 11.26 |
| 3 | 600316 | 洪都航空 | 6,296,942.00 | 9.62 |
| 4 | 688981 | 中芯国际 | 6,191,356.56 | 9.46 |
| 5 | 002179 | 中航光电 | 6,101,776.00 | 9.32 |
| 6 | 300747 | 锐科激光 | 5,194,916.45 | 7.94 |
| 7 | 302132 | 中航成飞 | 4,866,837.00 | 7.43 |
| 8 | 002625 | 光启技术 | 4,792,361.00 | 7.32 |
| 9 | 600418 | 江淮汽车 | 4,574,136.00 | 6.99 |
| 10 | 600765 | 中航重机 | 4,529,902.00 | 6.92 |
| 11 | 600105 | 永鼎股份 | 4,426,914.00 | 6.76 |
| 12 | 000768 | 中航西飞 | 3,986,774.51 | 6.09 |
| 13 | 002049 | 紫光国微 | 3,424,657.00 | 5.23 |
| 14 | 688708 | 佳驰科技 | 3,269,512.25 | 4.99 |
| 15 | 002465 | 海格通信 | 2,759,122.00 | 4.21 |
| 16 | 688239 | 航宇科技 | 2,757,775.65 | 4.21 |
| 17 | 600372 | 中航机载 | 2,756,744.00 | 4.21 |
| 18 | 688563 | 航材股份 | 2,571,167.58 | 3.93 |
| 19 | 300395 | 菲利华 | 2,538,130.00 | 3.88 |
| 20 | 002149 | 西部材料 | 2,522,653.00 | 3.85 |
| 21 | 688122 | 西部超导 | 2,459,728.49 | 3.76 |
| 22 | 688297 | 中无人机 | 2,450,322.29 | 3.74 |
| 23 | 600760 | 中航沈飞 | 2,296,786.00 | 3.51 |
| 24 | 300699 | 光威复材 | 2,227,565.40 | 3.40 |
| 25 | 600862 | 中航高科 | 2,071,230.00 | 3.16 |

| | | | | |
|---|---|---|---|---|
| 26 | 688281 | 华秦科技 | 1,935,183.66 | 2.96 |
| 27 | 688002 | 睿创微纳 | 1,926,369.80 | 2.94 |
| 28 | 605123 | 派克新材 | 1,923,487.00 | 2.94 |
| 29 | 688070 | 纵横股份 | 1,910,624.08 | 2.92 |
| 30 | 688776 | 国光电气 | 1,908,676.65 | 2.92 |
| 31 | 002025 | 航天电器 | 1,545,412.00 | 2.36 |
| 32 | 600150 | 中国船舶 | 1,375,173.00 | 2.10 |

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。

### 8.4.2 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 | 002049 | 紫光国微 | 10,262,711.16 | 15.68 |
| 2 | 688333 | 铂力特 | 8,617,530.67 | 13.16 |
| 3 | 600893 | 航发动力 | 8,179,465.30 | 12.49 |
| 4 | 002179 | 中航光电 | 7,795,610.34 | 11.91 |
| 5 | 600316 | 洪都航空 | 7,014,928.00 | 10.72 |
| 6 | 688256 | 寒武纪 | 6,930,221.60 | 10.59 |
| 7 | 002465 | 海格通信 | 6,239,107.00 | 9.53 |
| 8 | 300395 | 菲利华 | 5,990,056.00 | 9.15 |
| 9 | 600765 | 中航重机 | 5,436,043.00 | 8.30 |
| 10 | 688981 | 中芯国际 | 5,393,058.74 | 8.24 |
| 11 | 688239 | 航宇科技 | 5,214,927.40 | 7.97 |
| 12 | 600105 | 永鼎股份 | 5,133,116.71 | 7.84 |
| 13 | 302132 | 中航成飞 | 4,872,900.50 | 7.44 |
| 14 | 300747 | 锐科激光 | 4,585,561.00 | 7.00 |
| 15 | 300593 | 新雷能 | 4,561,375.00 | 6.97 |
| 16 | 300699 | 光威复材 | 4,128,029.80 | 6.31 |
| 17 | 688708 | 佳驰科技 | 3,373,281.73 | 5.15 |
| 18 | 000768 | 中航西飞 | 3,014,451.00 | 4.60 |
| 19 | 002625 | 光启技术 | 3,001,385.00 | 4.58 |
| 20 | 002149 | 西部材料 | 2,654,504.00 | 4.05 |
| 21 | 688563 | 航材股份 | 2,581,021.57 | 3.94 |
| 22 | 600760 | 中航沈飞 | 2,575,199.00 | 3.93 |
| 23 | 002025 | 航天电器 | 2,573,364.00 | 3.93 |
| 24 | 600418 | 江淮汽车 | 2,518,557.00 | 3.85 |
| 25 | 300855 | 图南股份 | 2,456,027.00 | 3.75 |
| 26 | 688375 | 国博电子 | 2,295,907.48 | 3.51 |
| 27 | 688070 | 纵横股份 | 2,253,804.27 | 3.44 |
| 28 | 688002 | 睿创微纳 | 2,152,046.83 | 3.29 |
| 29 | 688281 | 华秦科技 | 2,120,322.86 | 3.24 |
| 30 | 688776 | 国光电气 | 1,988,073.07 | 3.04 |
| 31 | 600862 | 中航高科 | 1,961,998.00 | 3.00 |

| | | | | |
|---|---|---|---|---|
| 32 | 688636 | 智明达 | 1,493,622.63 | 2.28 |
| 33 | 600372 | 中航机载 | 1,439,896.00 | 2.20 |
| 34 | 688122 | 西部超导 | 1,333,278.31 | 2.04 |
| 35 | 605123 | 派克新材 | 1,312,079.00 | 2.00 |

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。

### 8.4.3 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 | 114,509,131.93 |
| 卖出股票收入（成交）总额 | 145,293,749.58 |

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。

## 8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

无。

## 8.6 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。

## 8.7 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。

## 8.8 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。

## 8.9 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。

## 8.10 本基金投资股指期货的投资政策

无。

## 8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

### 8.11.1 本期国债期货投资政策

无。

### 8.11.2 本期国债期货投资评价

无。

## 8.12 投资组合报告附注

### 8.12.1 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。

### 8.12.2 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。

### 8.12.3 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 | 38,973.12 |
| 2 | 应收清算款 | 8,012,659.88 |
| 3 | 应收股利 | - |
| 4 | 应收利息 | - |
| 5 | 应收申购款 | 361,285.85 |
| 6 | 其他应收款 | - |
| 7 | 待摊费用 | - |
| 8 | 其他 | - |
| 9 | 合计 | 8,412,918.85 |

### 8.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

无。

### 8.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

无。

### 8.12.6 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。

## §9 基金份额持有人信息

### 9.1 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（%） |
| 大成国家安全主题灵活配置混合 A | 5,967 | 2,269.76 | 0.00 | 0.00 | 13,543,653.51 | 100.00 |
| 大成国家安全主题灵活配置 | 589 | 45,089.68 | 25,461,511.74 | 95.87 | 1,096,307.42 | 4.13 |

| | | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|---|
| 混合 C | | | | | | |
| 合计 | 6,556 | 6,116.76 | 25,461,511.74 | 63.49 | 14,639,960.93 | 36.51 |

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。

## 9.2 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 | 大成国家安全主题灵活配置混合 A | 12,465.69 | 0.0920 |
| | 大成国家安全主题灵活配置混合 C | 136,332.66 | 0.5133 |
| | 合计 | 148,798.35 | 0.3711 |

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）。

## 9.3 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 | 大成国家安全主题灵活配置混合 A | 0 |
| | 大成国家安全主题灵活配置混合 C | 0 |
| | 合计 | 0 |
| 本基金基金经理持有本开放式基金 | 大成国家安全主题灵活配置混合 A | 0 |
| | 大成国家安全主题灵活配置混合 C | 10~50 |
| | 合计 | 10~50 |

## 9.4 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理本人及其直系亲属持有本人管理的产品情况

无。

# §10 开放式基金份额变动

单位：份

| 项目 | 大成国家安全主题灵活配置混合 A | 大成国家安全主题灵活配置混合 C |
|---|---|---|
| 基金合同生效日（2016 年 5 月 4 日）基金份额总额 | 367,042,410.54 | - |

| | | |
|---|---|---|
| 本报告期期初基金份额总额 | 20,030,293.38 | 27,300,656.64 |
| 本报告期基金总申购份额 | 4,931,631.40 | 4,742,552.39 |
| 减：本报告期基金总赎回份额 | 11,418,271.27 | 5,485,389.87 |
| 本报告期基金拆分变动份额 | - | - |
| 本报告期期末基金份额总额 | 13,543,653.51 | 26,557,819.16 |

# §11 重大事件揭示

## 11.1 基金份额持有人大会决议

无。

## 11.2 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

2025 年 9 月 26 日，公司召开大成基金管理有限公司 2025 年第一次临时股东会，审议通过《关于公司董事会换届的议案》，选举吴庆斌先生、杨红女士、林昌先生、宋立志先生担任公司第九届董事会董事；选举杨飞先生、王亚坤先生、谢丹夏先生、江涛女士担任公司第九届董事会独立董事，杨晓帆、胡维翊不再担任公司独立董事；推举谭晓冈先生担任公司第九届董事会专职董事。第九届董事会董事任期为三年，自本次股东会决议生效之日起计算。

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。

2025 年 9 月，中国农业银行总行决定蔡崎峰任托管业务部总裁。

## 11.3 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。

## 11.4 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。

## 11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金自基金合同生效日起聘请普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）为本基金提

供审计服务，自 2024 年 12 月 11 日起，改聘容诚会计师事务所（特殊普通合伙）为本基金提供审计服务至今，本年度应支付的审计费用为 28,000.00 元。

## 11.6 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况

### 11.6.1 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。

### 11.6.2 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。

### 11.6.3 托管人受调查或处罚等情况

无。

### 11.6.4 托管人相关从业人员受调查或处罚等情况

无。

## 11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

### 11.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

| 券商名称 | 交易单元数量 | 股票交易 | | 应支付该券商的佣金 | | 备注 |
|---|---|---|---|---|---|---|
| | | 成交金额 | 占当期股票成交总额的比例(%) | 佣金 | 占当期佣金总量的比例(%) | |
| 光大证券 | 2 | 119,922,702.02 | 46.16 | 54,684.74 | 46.16 | - |
| 国泰海通 | 3 | 92,121,058.38 | 35.46 | 42,007.18 | 35.46 | 退租 1 个 |
| 天风证券 | 1 | 37,466,811.45 | 14.42 | 17,084.87 | 14.42 | - |
| 广发证券 | 2 | 10,292,309.66 | 3.96 | 4,693.29 | 3.96 | - |
| 爱建证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 财通证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 第一创业 | 1 | - | - | - | - | - |
| 东北证券 | 1 | - | - | - | - | 退租 1 个 |
| 东财证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 东方证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 东吴证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 东兴证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 方正证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 高盛中国 | 1 | - | - | - | - | - |

| | | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|---|
| 证券 | | | | | | |
| 国金证券 | 2 | - | - | - | - | - |
| 国盛证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 国投证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 国信证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 红塔证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 华创证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 华泰证券 | 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 | - | - | - | - | - |
| 万和证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 西部证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 信达证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 兴业证券 | 2 | - | - | - | - | - |
| 野村东方国际证券 | 1 | - | - | - | - | 新增 1 个 |
| 粤开证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 招商证券 | 2 | - | - | - | - | - |
| 浙商证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 中国银河证券 | 3 | - | - | - | - | - |
| 中金公司 | 2 | - | - | - | - | - |
| 中泰证券 | 2 | - | - | - | - | - |
| 中信建投证券 | 2 | - | - | - | - | - |
| 中信证券 | 4 | - | - | - | - | - |
| 中银国际证券 | 1 | - | - | - | - | - |

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

（一）筛选标准

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

（二）筛选流程

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

2、公司按照白名单与证券公司进行协议签署。

### 11.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

无。

## 11.8 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提请投资者持续完善身份信息的公告 | 中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站 | 2025 年 12 月 31 日 |
| 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 12 月 25 日 |
| 3 | 大成基金管理有限公司关于调整旗下部分基金风险等级的公告 | 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 12 月 19 日 |
| 4 | 大成国家安全主题灵活配置混合型证券投资基金 2025 年第 3 季度报告 | 中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站 | 2025 年 10 月 28 日 |
| 5 | 大成基金管理有限公司旗下 200 只公募基金 2025 年第 3 季度报告提示性公告 | 规定报刊 | 2025 年 10 月 28 日 |
| 6 | 大成基金管理有限公司旗下 193 只公募基金 2025 年中期报告提示性公告 | 规定报刊 | 2025 年 8 月 29 日 |
| 7 | 大成国家安全主题灵活配置混合型证券投资基金 2025 年中期报告 | 中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站 | 2025 年 8 月 29 日 |
| 8 | 大成基金管理有限公司旗下 194 只公募基金 2025 年第 2 季度报告提示性公告 | 规定报刊 | 2025 年 7 月 22 日 |
| 9 | 大成国家安全主题灵活配置混合型证券投资基金 2025 年第 2 季度报告 | 中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站 | 2025 年 7 月 21 日 |
| 10 | 大成国家安全主题灵活配置混合型证券投资基金(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 6 月 30 日 |
| 11 | 大成国家安全主题灵活配置混合型证券投资基金(C 类份额)基金产品资料 | 中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本 | 2025 年 6 月 30 日 |

| | | | |
|---|---|---|---|
| | 概要更新 | 公司网站 | |
| 12 | 大成基金管理有限公司关于再次提请投资者及时更新已过期身份证件及其他身份基本信息的公告 | 中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站 | 2025 年 6 月 30 日 |
| 13 | 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 |
| 14 | 大成国家安全主题灵活配置混合型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 | 2025 年 6 月 4 日 |
| 15 | 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 |
| 16 | 大成基金管理有限公司旗下 188 只公募基金 2025 年第 1 季度报告提示性公告 | 规定报刊 | 2025 年 4 月 22 日 |
| 17 | 大成国家安全主题灵活配置混合型证券投资基金 2025 年第 1 季度报告 | 中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站 | 2025 年 4 月 22 日 |
| 18 | 大成基金管理有限公司旗下 184 只公募基金 2024 年年度报告提示性公告 | 规定报刊 | 2025 年 3 月 31 日 |
| 19 | 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 |
| 20 | 大成国家安全主题灵活配置混合型证券投资基金 2024 年年度报告 | 中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站 | 2025 年 3 月 31 日 |
| 21 | 大成国家安全主题灵活配置混合型证券投资基金 2024 年第 4 季度报告 | 中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站 | 2025 年 1 月 22 日 |
| 22 | 大成基金管理有限公司旗下 184 只公募基金 2024 年 4 季度报告提示性公告 | 规定报刊 | 2025 年 1 月 22 日 |

# §12 影响投资者决策的其他重要信息

## 12.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

| 投资者类别 | 报告期内持有基金份额变化情况 | | | | | 报告期末持有基金情况 | |
|---|---|---|---|---|---|---|---|
| | 序号 | 持有基金份额比例达到或者超过 20%的时间区间 | 期初份额 | 申购份额 | 赎回份额 | 持有份额 | 份额占比（%） |
| 机构 | 1 | 20251118-20251124<br>20251224-202 | 7,975,394.55 | 0.00 | 0.00 | 7,975,394.55 | 19.89 |

| | | | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|---|---|
| | | 51226 | | | | | |
| | 2 | 20250101-20251231 | 15,869,040.86 | 0.00 | 0.00 | 15,869,040.86 | 39.57 |
| 产品特有风险 | | | | | | | |
| 当基金份额持有人占比过于集中时，可能会因某单一基金份额持有人大额赎回而引发基金净值剧烈波动的风险，甚至有可能引起基金的流动性风险，基金管理人可能无法及时变现基金资产以应对基金份额持有人的赎回申请，基金份额持有人可能无法及时赎回持有的全部基金份额。 | | | | | | | |

## 12.2 影响投资者决策的其他重要信息

| |
|---|
| 无。 |

# §13 备查文件目录

## 13.1 备查文件目录

1、中国证监会批准设立大成国家安全主题灵活配置混合型证券投资基金的文件；

2、《大成国家安全主题灵活配置混合型证券投资基金基金合同》；

3、《大成国家安全主题灵活配置混合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。

## 13.2 存放地点

备查文件存放在本基金管理人和托管人的住所。

## 13.3 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 3 月 31 日**