大成沪深300指数证券投资基金
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。安永华明会计师事务所（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 8
3.3 过去三年基金的利润分配情况 11
§4 管理人报告 12
4.1 基金管理人及基金经理情况 12
4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明 16
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明 16
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 17
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望 18
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况 19
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明 19
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明 20
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 20
§5 托管人报告 21
5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明 21
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 21
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 21
§6 审计报告 21
§7 年度财务报表 23
7.1 资产负债表 23
7.2 利润表 24
7.3 净资产变动表 26
7.4 报表附注 27
§8 投资组合报告 60
8.1 期末基金资产组合情况 60
8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合 60

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 62
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动 70
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合 71
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 71
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 71
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 71
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 71
8.10 本基金投资股指期货的投资政策 71
8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 72
8.12 投资组合报告附注 72

§9 基金份额持有人信息 73

9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 73
9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 73
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 74
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 74

§10 开放式基金份额变动 74

§11 重大事件揭示 75

11.1 基金份额持有人大会决议 75
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 75
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 75
11.4 基金投资策略的改变 75
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 75
11.6 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况 75
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 76
11.8 其他重大事件 77

§12 影响投资者决策的其他重要信息 80

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 80
12.2 影响投资者决策的其他重要信息 80

§13 备查文件目录 80

13.1 备查文件目录 80
13.2 存放地点 80
13.3 查阅方式 80

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	大成沪深 300 指数证券投资基金		
基金简称	大成沪深 300 指数		
基金主代码	519300		
基金运作方式	契约型开放式		
基金合同生效日	2006 年 4 月 6 日		
基金管理人	大成基金管理有限公司		
基金托管人	中国农业银行股份有限公司		
报告期末基金份额总额	994,800,847.71 份		
基金合同存续期	不定期		
下属分级基金的基金简称	大成沪深 300 指数 A	大成沪深 300 指数 C	大成沪深 300 指数 Y
下属分级基金的交易代码	519300	007096	022973
下属分级基金的前端交易代码	519300	-	-
下属分级基金的后端交易代码	519301	-	-
报告期末下属分级基金的份额总额	978,027,010.85 份	14,828,620.68 份	1,945,216.18 份

2.2 基金产品说明

投资目标	通过严格的投资程序约束和数量化风险管理手段，实现指数投资偏离度和跟踪误差的最小化。在正常市场情况下，本基金日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.35%，年跟踪误差不超过 4%。
投资策略	本基金采用被动式指数投资策略。原则上，股票投资组合的构建主要按照标的指数的成份股组成及其权重来拟合、复制标的指数，并原则上根据标的指数成份股及其权重的变动而进行相应调整。
业绩比较基准	沪深 300 指数
风险收益特征	本基金为指数基金，是风险中等、获得证券市场平均收益率的产品。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		大成基金管理有限公司	中国农业银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	段皓静	任航
	联系电话	0755-83183388	010-66060069
	电子邮箱	office@dcfund.com.cn	tgxxpl@abchina.com
客户服务电话		4008885558	95599
传真		0755-83199588	010-68121816
注册地址		广东省深圳市南山区海德三道 1236 号大成基金总部大厦 5 层、	北京市东城区建国门内大街 69 号

	27-33 层	
办公地址	广东省深圳市南山区海德三道 1236 号大成基金总部大厦 5 层、27-33 层	北京市西城区复兴门内大街 28 号凯晨世贸中心东座 F9
邮政编码	518054	100031
法定代表人	吴庆斌	谷澍

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《中国证券报》
登载基金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	安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）	北京市东城区东长安街 1 号东方广场安永大楼 17 层 01-12 室
注册登记机构	中国证券登记结算有限责任公司	北京市西城区太平桥大街 17 号
注册登记机构	大成基金管理有限公司	广东省深圳市南山区海德三道 1236 号大成基金总部大厦 5 层、27-33 层

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

§3 主要财务指标、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		2024 年 12 月 13 日(基金合同生效日）- 2024 年 12 月 31 日	2023 年	
	大成沪深300指数A	大成沪深300指数C	大成沪深300指数Y	大成沪深300指数A	大成沪深300指数C	大成沪深300指数Y	大成沪深300指数A	大成沪深300指数C
本期已实现收益	28,139,376.32	472,797.30	29,483.28	-5,799,821.66	-187,491.97	84.85	-45,136,276.77	-10,234,601.05
本期利	206,857	2,706,4	192,275	157,808	18,710,	-1,279.	-101,84	-12,675

润	,211.68	39.71	.33	,023.91	316.95	17	4,526.30	,727.42
加权平均基金份额本期利润	0.1904	0.0951	0.2439	0.1325	0.1733	-0.0395	-0.0851	-0.1605
本期加权平均净值利润率	17.92%	9.26%	21.99%	14.47%	18.96%	-3.89%	-8.85%	-17.16%
本期基金份额净值增长率	19.32%	19.19%	19.86%	15.02%	14.90%	0.68%	-8.99%	-9.06%
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	192,749,841.87	2,852,074.55	402,667.47	7,837,485.54	47,981.43	931.71	-149,230,931.55	-17,983,381.88
期末可供分配基金份额利润	0.1971	0.1923	0.2070	0.0068	0.0008	0.0070	-0.1247	-0.1290
期末基金资产净值	1,170,776,852.72	17,680,695.23	2,347,883.65	1,165,272,198.24	57,249,143.99	133,677.59	1,047,863,869.66	121,427,734.78
期末基金份额净值	1.1971	1.1923	1.2070	1.0068	1.0008	1.0070	0.8753	0.8710
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	319.53%	42.89%	20.68%	251.62%	19.88%	0.68%	205.69%	4.34%

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

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

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

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

大成沪深 300 指数 A

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①－③	②－④
过去三个月	0.27%	0.90%	-0.23%	0.95%	0.50%	-0.05%
过去六个月	17.93%	0.86%	17.63%	0.91%	0.30%	-0.05%
过去一年	19.32%	0.91%	17.66%	0.96%	1.66%	-0.05%
过去三年	24.90%	0.99%	19.59%	1.07%	5.31%	-0.08%
过去五年	0.73%	1.04%	-11.16%	1.14%	11.89%	-0.10%
自基金合同生效起至今	319.53%	1.51%	319.67%	1.60%	-0.14%	-0.09%

大成沪深 300 指数 C

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①－③	②－④
过去三个月	0.24%	0.90%	-0.23%	0.95%	0.47%	-0.05%
过去六个月	17.87%	0.86%	17.63%	0.91%	0.24%	-0.05%
过去一年	19.19%	0.91%	17.66%	0.96%	1.53%	-0.05%
过去三年	24.54%	0.99%	19.59%	1.07%	4.95%	-0.08%
过去五年	0.26%	1.04%	-11.16%	1.14%	11.42%	-0.10%
自基金合同生效起至今	42.89%	1.09%	25.18%	1.19%	17.71%	-0.10%

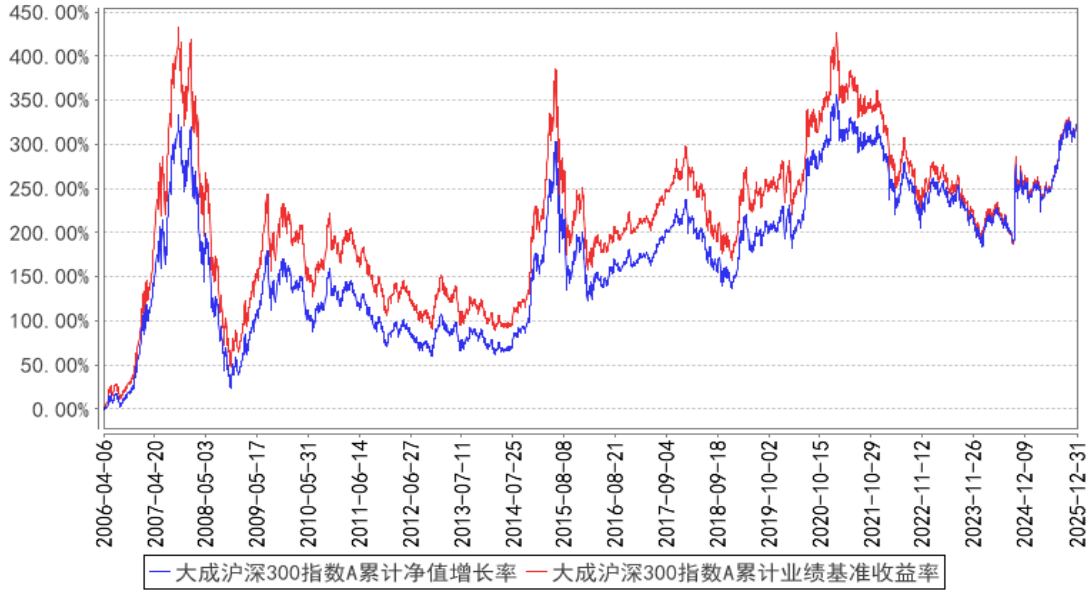
大成沪深 300 指数 Y

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①－③	②－④

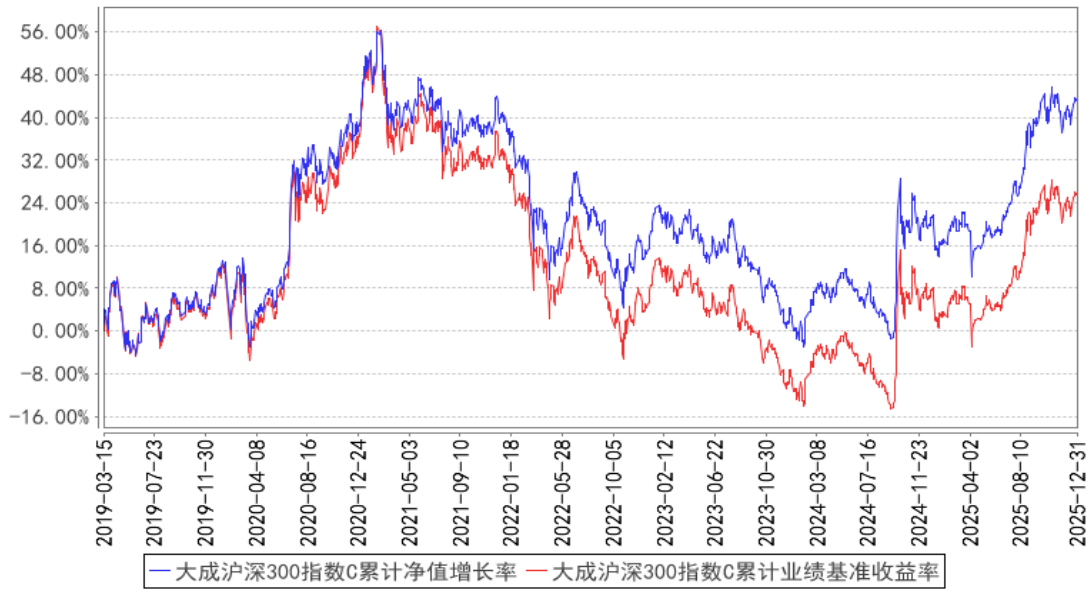
过去三个月	0.37%	0.90%	-0.23%	0.95%	0.60%	-0.05%
过去六个月	18.21%	0.86%	17.63%	0.91%	0.58%	-0.05%
过去一年	19.86%	0.91%	17.66%	0.96%	2.20%	-0.05%
自基金合同生效起至今	20.68%	0.90%	18.36%	0.95%	2.32%	-0.05%

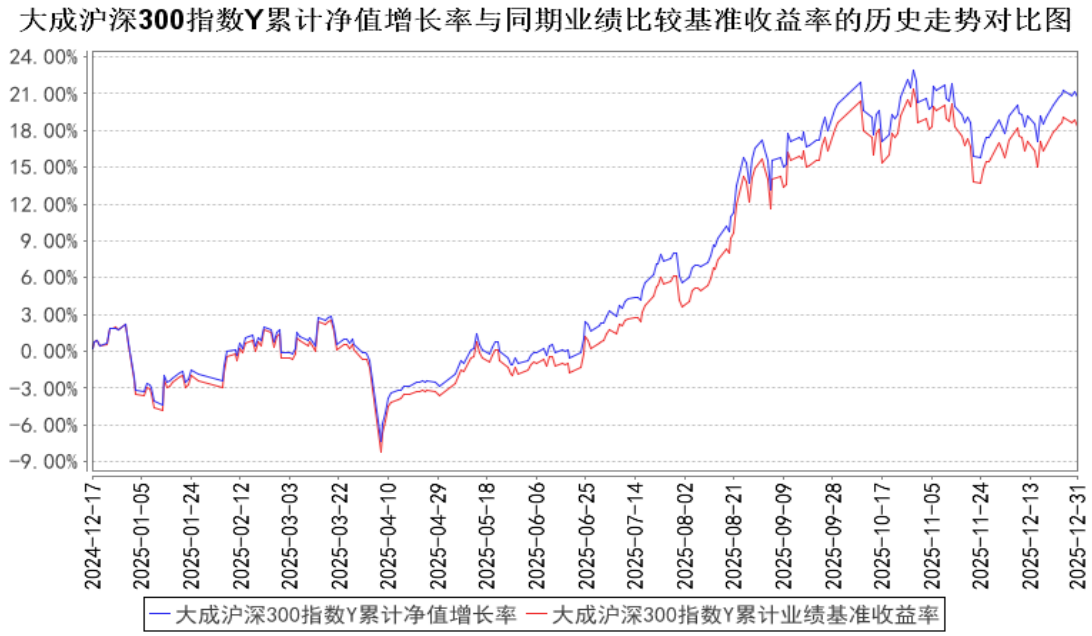
3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

大成沪深300指数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



大成沪深300指数C累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



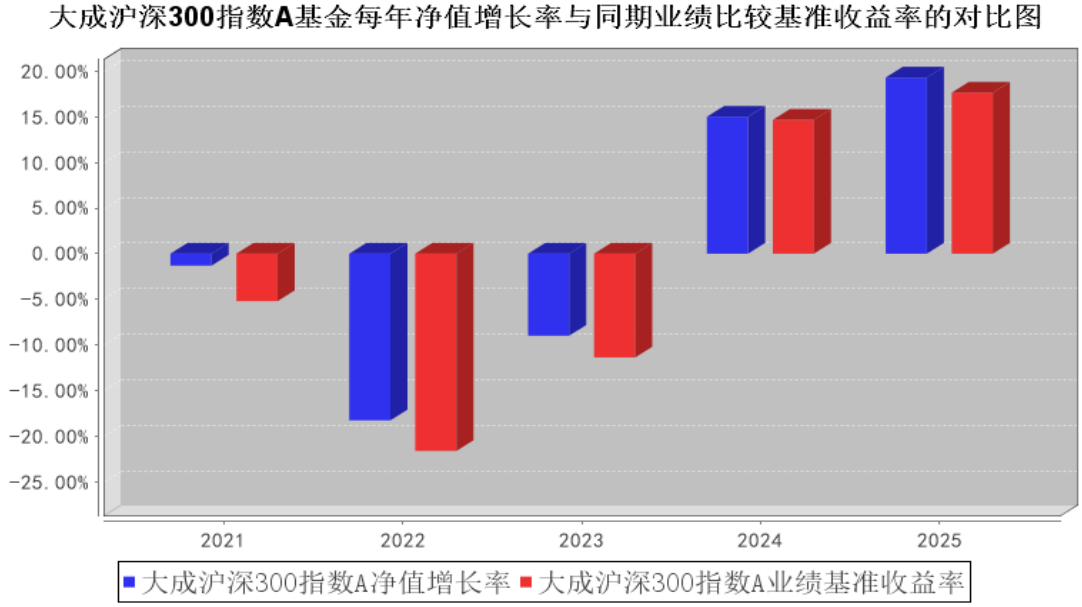


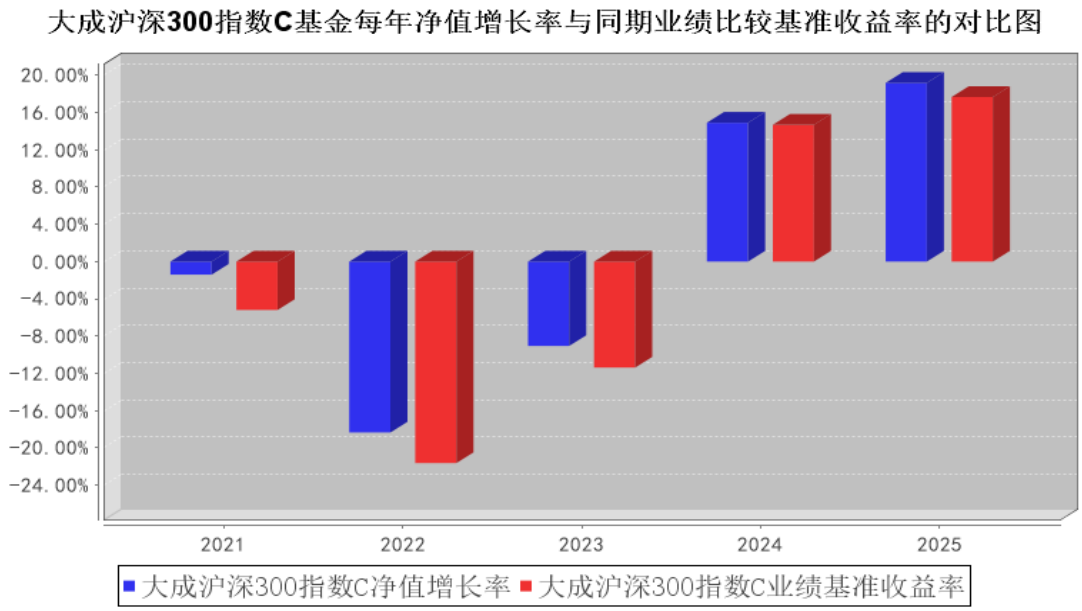
注：1、本基金合同规定，基金管理人应当自基金合同生效之日起六个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的约定。建仓期结束时，本基金的投资组合比例符合基金合同的约定。

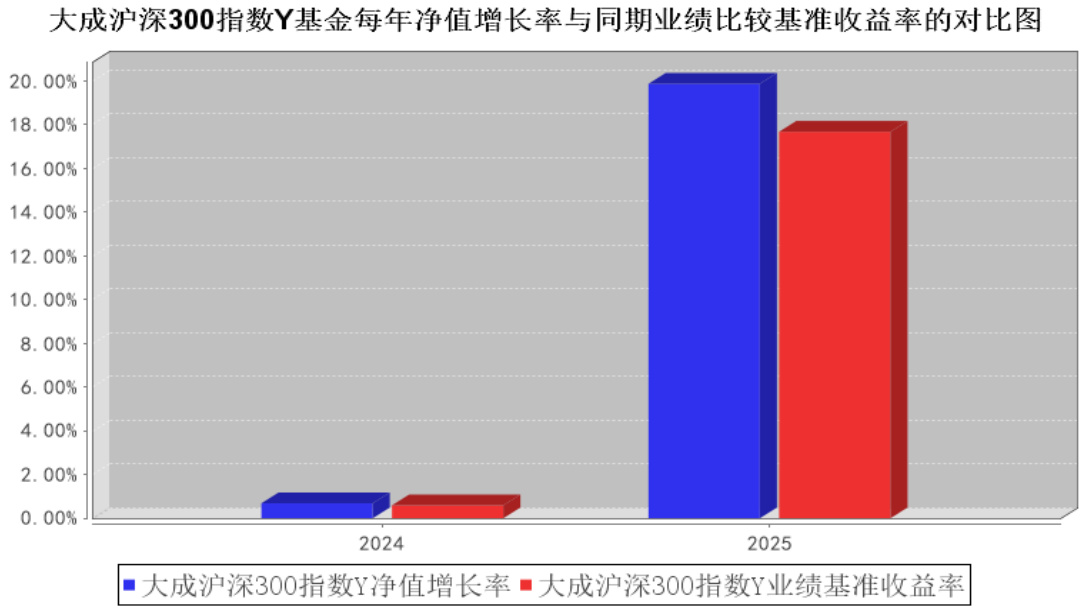
2、本基金自 2019 年 3 月 8 日起增设 C 类基金份额类别，C 类的净值增长率和业绩比较基准收益率自 2019 年 3 月 15 日有份额之日开始计算。

3、本基金自 2024 年 12 月 13 日起增设 Y 类基金份额类别，Y 类的净值增长率和业绩比较基准收益率自 2024 年 12 月 17 日有份额之日开始计算。

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

单位：人民币元

大成沪深 300 指数 A

年度	每 10 份基金份额分红数	现金形式发放总额	再投资形式发放总额	年度利润分配合计	备注
2025 年	0.0339	1,931,713.46	1,997,863.03	3,929,576.49	-
2024 年	-	-	-	-	-
2023 年	-	-	-	-	-
合计	0.0339	1,931,713.46	1,997,863.03	3,929,576.49	-

大成沪深 300 指数 C

年度	每 10 份基金	现金形式发放	再投资形式发	年度利润分配	备注

	份额分红数	总额	放总额	合计	
2025 年	0.0042	20,500.38	4,672.80	25,173.18	-
2024 年	-	-	-	-	-
2023 年	-	-	-	-	-
合计	0.0042	20,500.38	4,672.80	25,173.18	-

大成沪深 300 指数 Y

年度	每 10 份基金份额分红数	现金形式发放总额	再投资形式发放总额	年度利润分配合计	备注
2025 年	-	-	-	-	-
2024 年	-	-	-	-	-
合计	-	-	-	-	-

§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		
刘淼	本基金基金经理	2023 年 4 月 14 日	-	17 年	北京大学工商管理硕士。2008 年 4 月至 2011 年 5 月就职于招商基金管理有限公司，任基金核算部基金会计。2011 年 5 月加入大成基金管理有限公司，先后担任基金运营部基金会计、股票投资部投委会秘

					书兼风控员、数量与指数投资部数量分析师、指数与期货投资部基金经理、指数与期货投资部总监助理。2020 年 6 月 29 日至 2023 年 5 月 30 日任大成 MSCI 中国 A 股质优价值 100 交易型开放式指数证券投资基金基金经理。2020 年 6 月 29 日至 2023 年 6 月 14 日任大成 MSCI 中国 A 股质优价值 100 交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理。2020 年 6 月 29 日至 2025 年 12 月 19 日任深证成长 40 交易型开放式指数证券投资基金、大成深证成长 40 交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理。2020 年 6 月 29 日至 2022 年 11 月 30 日任大成中证 500 深市交易型开放式指数证券投资基金基金经理。2021 年 4 月 30 日至 2025 年 7 月 29 日任大成中证全指医疗保健设备与服务交易型开放式指数证券投资基金基金经理。2021 年 6 月 17 日起任大成中证红利指数证券投资基金基金经理。2021 年 9 月 2 日至 2022 年 12 月 8 日任中证 500 沪市交易型开放式指数证券投资基金基金经理。2021 年 9 月 2 日至 2025 年 3 月 17 日任大成中证 A100 交易型开放式指数证券投资基金（更名前为大成中证 100 交易型开放式指数证券投资基金）基金经理。2021 年 9 月 2 日至 2025 年 12 月 19 日任大成深证成份交易型开放式指数证券投资基金基金经理。2022 年 6 月 28 日至 2025 年 2 月 18 日任大成中证电池主题指数型发起式证券投资基金基金经理。2022 年 7 月 13 日至 2025 年 3 月 17 日任大成中证上海环交所碳中和交易型开放式指数证券投资基金基金经理。2022 年 10 月 13 日至 2023 年 10 月 20 日任大成动态量化配置策略混合型证券投资基金基金经理。2023 年 3 月 20 日起任大成有色金属期货交易型开放式指数证券投资基金、大成有色金属期货交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理。2023 年 4 月 14 日起任大成沪深 300 指数证券投资基金基金经理。2024 年 3 月 6 日起任大成中证 A50 交易型开放式指数证券投资基金基金经理。2024 年 4 月 8 日至 2025 年 7 月 29 日任大成中证红利低波动 100 交易型开放式指数证券投资基金基金经理。2024 年 4 月

					23 日起任大成中证 A50 交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理。2024 年 5 月 24 日至 2025 年 2 月 18 日任大成中证芯片产业指数型发起式证券投资基金基金经理。2024 年 5 月 28 日至 2025 年 7 月 29 日任大成中证工程机械主题交易型开放式指数证券投资基金基金经理。2024 年 11 月 12 日起任大成中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金（转型前为大成中证 A500 指数型发起式证券投资基金）基金经理。2024 年 11 月 22 日起任大成中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金基金经理。2025 年 4 月 2 日起任大成深证 100 交易型开放式指数证券投资基金基金经理。2025 年 4 月 23 日起任大成中证全指自由现金流交易型开放式指数证券投资基金基金经理。2025 年 7 月 2 日起任大成中证全指自由现金流交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金基金经理。2025 年 7 月 16 日起担任大成创业板人工智能交易型开放式指数证券投资基金基金经理。2025 年 8 月 29 日起任大成创业板 50 交易型开放式指数证券投资基金基金经理。2025 年 9 月 23 日起任大成创业板 50 交易型开放式指数证券投资基金联接基金（转型前为大成创业板 50 指数型证券投资基金）基金经理。2025 年 10 月 21 日起任大成创业板人工智能交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金基金经理。具备基金从业资格。国籍：中国
郑少芳	本基金基金经理	2024 年 12 月 9 日	-	15 年	北京大学医学部理学硕士。2010 年 7 月加入大成基金管理有限公司，曾任研究部研究员、社保及养老投资管理部投资经理、权益专户投资部投资经理、总监助理，现任指数与期货投资部总监助理。2023 年 7 月 5 日至 2025 年 12 月 8 日兼任大成智惠量化多策略灵活配置混合型证券投资基金基金经理。2024 年 12 月 9 日起兼任大成沪深 300 指数证券投资基金、大成中证电池主题指数型发起式证券投资基金、大成中证芯片产业指数型发起式证券投资基金基金经理。2025 年 3 月 10 日起兼任大成中证 A100 交易型开放式指数证券投资基金、大成中证上海环交所碳中和交易型开

					放式指数证券投资基金基金经理。2025 年 5 月 27 日起兼任大成北证 50 成份指数型发起式证券投资基金基金经理。2025 年 7 月 25 日起兼任大成中证全指医疗保健设备与服务交易型开放式指数证券投资基金、大成中证红利低波动 100 交易型开放式指数证券投资基金、大成中证工程机械主题交易型开放式指数证券投资基金基金经理。具有基金从业资格。国籍：中国
李淏玮	本基金基金经理助理	2024 年 4 月 15 日	2025 年 12 月 15 日	9 年	美国纽约大学理学硕士。2016 年 5 月加入大成基金管理有限公司，曾担任数量与指数投资部研究员、指数与期货投资部投资经理、基金经理助理，现任指数与期货投资部基金经理。2025 年 12 月 16 日起任深证成长 40 交易型开放式指数证券投资基金、大成深证成长 40 交易型开放式指数证券投资基金联接基金、大成深证成份交易型开放式指数证券投资基金基金经理。具有基金从业资格。国籍：中国

注：1、任职日期、离任日期为本基金管理人作出决定之日。

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

4.1.3 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理同时管理的产品情况

姓名	产品类型	产品数量（只）	资产净值（元）	任职时间
郑少芳	公募基金	9	2,308,583,558.22	2024 年 12 月 9 日
	私募资产管理计划	2	2,071,236,886.21	2017 年 6 月 14 日
	其他组合	-	-	-
	合计	11	4,379,820,444.43	-

注：本报告期内，郑少芳已于 2025 年 3 月 4 日离任其管理的 2 个私募资产管理计划，于 2025 年 4 月 26 日离任其管理的 1 个私募资产管理计划，于 2025 年 8 月 6 日离任其管理的 1 个私募资产管理计划，于 2025 年 12 月 8 日离任其管理的 1 只公募基金。

4.1.4 基金经理薪酬机制

本基金基金经理的薪酬激励不与私募资产管理计划浮动管理费直接挂钩，会以产品业绩表现作为考核依据。基金经理薪酬激励以中长期业绩为依据，同时参考业绩基准完成情况，按 3 年递延发放。

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

公司严格执行公平交易制度控制要求，确保不同投资组合在研究、交易、分配等各环节得到公平对待。报告期内，兼任基金经理管理的公私募组合间未发现违反公平交易原则的异常情况。

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，国内经济稳健运行，新旧动能转换持续深化，GDP 同比增长 5%，如期完成全年目标。经济增长以前高后稳、结构优化、民生稳定的特征，为资本市场上行夯实支撑力量。报告期内，A 股市场大幅上行，主要宽基指数均录得正收益，且收益中枢抬升明显。其中，沪深 300 涨 17.66%；中证 500 涨 30.39%；创业板指涨 49.57%；中证 1000 涨 27.49%。行业上，有色金属、通信和电子涨幅领先；食品饮料、煤炭和房地产表现萎靡。风格上，成长全年明显占优。

过去一年，A 股市场走势在科技突破、流动性充裕和风险偏好提升的共振下大幅上行。政策层面也始终多措并举稳定市场。科技、有色金属成为全年投资主线，传统板块如消费、房地产则表现偏弱。阶段表现上，开年至 3 月中，A 股整体上行，DeepSeek 大模型、大热电影、机器人等引发泛科技板块关注度飙升，叠加决策层推动中长期资金入市，市场风险偏好抬升，科技板块表现尤为强势。这段时间内，规模指数表现较为分化，小市值风格明显占优，而与经济相关性更高的大盘风格则表现较为平淡，总体上，做多情绪仍支撑了市场上行。3 月下旬至 4 月中，市场阶段性调整，此前领涨的成长和小盘风格跌幅相对更深，食品饮料及部分顺周期板块的轮动表现难以对冲整体调整压力。一方面，AI 和机器人主题前期交易集中度偏高加之海外科技板块调整形成外部扰动，板块存在获利回吐需求；另一方面，美国对等关税政策落地冲击市场，A 股出现单日较大跌幅，成交明显回落。4 月下半月至 11 月下旬，市场走出 V 型反转后进入大幅上行阶段。尤其是三季度，更成为全年的核心收益期。除了政策托底外，上行期的核心驱动因素是流动性与风险偏好。充足的流动性来自于中长期资金持续入市、不断创新高的杠杆资金以及循序渐进的居民存款搬家等。而赚钱效应也推动交易热情不断提高，全 A 股票日成交额中枢不断迈上新台阶。这样的环境相对更利好流动性敏感的风格或板块，同时趋势力量得到强化，投资主线始终围绕成长风格、科技板块展开，通信、有色金属、新能源、电子等表现突出。上行区间内的几轮行情波动均较为短暂，且快速反弹。11 月下旬，市场经历前期强势上涨后估值处于高位，对基本面支撑的诉求提升，而经济内生增长动能仍待提振，叠加岁末风格切换概率上升，向上突破难度增加。虽然科技板块依托海外行情修复取得超额收益，但市场整体赚钱效应一般，持续在高位震荡月余。12 月下旬起，受益于情绪修复和中长期资金入市，市场再度企稳上行至年末顺利收官，科技和周期双主线领涨，全年实现中枢上移。

本基金标的指数为沪深 300 指数。沪深 300 指数由沪深市场中规模大、流动性好的最具代表性的 300 只证券组成，反映沪深市场上市公司证券的整体表现。本基金采取完全复制法进行投资，

即原则上按照标的指数的成份股及其权重构建基金股票投资组合，并根据标的指数成份股及其权重的变动而进行相应调整。运作层面上，本基金在报告期内基本保持满仓，各项操作符合基金合同的要求。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末大成沪深 300 指数 A 的基金份额净值为 1.1971 元，本报告期基金份额净值增长率为 19.32%，同期业绩比较基准收益率为 17.66%；截至本报告期末大成沪深 300 指数 C 的基金份额净值为 1.1923 元，本报告期基金份额净值增长率为 19.19%，同期业绩比较基准收益率为 17.66%；截至本报告期末大成沪深 300 指数 Y 的基金份额净值为 1.2070 元，本报告期基金份额净值增长率为 19.86%，同期业绩比较基准收益率为 17.66%。

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，作为"十五五"规划的开局之年，宏观经济将在政策托举与结构转型中延续稳健态势。结构上，扩内需作为经济增长主要引擎处于战略首要位置，但消费潜力的增长和消费率的提高仍需政策系统性的支持和服务业的结构性支撑。投资领域呈现分化格局：制造业投资凭借设备更新和高技术产业的高景气度预计增速领跑；"两重"建设为基建投资提供托底，新型基建及传统基建更新使得增速保持平稳；地产投资历经三年调整周期后，下行斜率有望趋缓，对经济的负面拖累减轻。出口端，有望在新兴市场和 AI 相关优势产品带动下继续维持较强韧性，实现偏高增速为经济提供稳定支撑。货币政策延续“适度宽松"取向以稳定融资环境，同时强化逆周期调节与财政政策的协同配合。财政政策更加积极，将“保持必要的财政赤字、债务总规模和支出总量”，节奏或继续前倾。价格层面，在低基数背景下，随着"反内卷"政策落地与物价拖累因素减轻，通胀有望迎来温和修复，企业盈利环境最终随之改善。

对于 A 股市场而言，2026 年虽然外部扰动因素犹存，但内部环境积极向好的态势愈发清晰。政策上，宏观调控转向提质增效，叠加资本市场改革持续深化、长期资金入市引导等红利逐步释放，为权益资产营造了友好的环境。盈利维度，随着经济温和复苏态势巩固，上市公司基本面逐渐进入修复通道，部分行业的景气度在去年完成探底回升，预计今年 A 股盈利重回上行周期，为行情持续性提供业绩支撑。资金层面上，随着通胀回归与赚钱效应显现，居民资产配置向权益类资产倾斜的趋势强化，个人投资者、中长期资金、北向资金和杠杆资金等继续构建今年多元流入的良性格局。估值层面，尽管主要宽基指数纵向对比处于历史相对较高水平，但在全球视野下横向比较依然具备吸引力。综上，2026 年 A 股或将呈现震荡向上的行情特征，节奏可能遵循 N 型轨迹展开。

组合管理上，我们将严格按照基金合同的相关约定，紧密跟踪标的指数，按照标的指数成分

股组成及其权重的变化调整投资组合，努力实现跟踪误差的最小化。

4.6 管理人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，大成沪深 300 指数 A 已分配利润 3,929,576.49 元，每十份基金份额分红 0.0339 元；大成沪深 300 指数 C 已分配利润 25,173.18 元，每十份基金份额分红 0.0042 元，每十份基金份额分红符合基金合同规定的分红比例。

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	大成沪深 300 指数证券投资基金全体基金份额持有人
审计意见	我们审计了大成沪深 300 指数证券投资基金的财务报表，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。 我们认为，后附的大成沪深 300 指数证券投资基金的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则的规定编制，公允反映了大成沪深 300 指数证券投资基金 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《中国注册会计师独立性准则第 1 号——财务报表审计和审阅业务对独立性的要求》和中国注册会计师职业道德守则，我们独立于大成沪深 300 指数证券投资基金，并履行了职业道德方面的其他责任。我们在审计中遵循了对公众利益实体审计的独立性要求。

	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	大成沪深 300 指数证券投资基金管理层对其他信息负责。其他信息包括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。 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。 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。 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	管理层负责按照企业会计准则的规定编制财务报表，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。 在编制财务报表时，管理层负责评估大成沪深 300 指数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，除非计划进行清算、终止运营或别无其他现实的选择。 治理层负责监督大成沪深 300 指数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。 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： （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。 （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。 （3）评价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。 （4）对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，就可能导致对大成沪深 300 指数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沪深 300 指数证券投资基金不能持续经营。 （5）评价财务报表的总体列报（包括披露）、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。 我们与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	安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）	
注册会计师的姓名	高鹤	林恩丽
会计师事务所的地址	北京市东城区东长安街 1 号东方广场安永大楼 17 层 01-12 室	
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：大成沪深 300 指数证券投资基金

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 2025 年 12 月 31 日	上年度末 2024 年 12 月 31 日
资 产：			
货币资金	7.4.7.1	67,493,405.27	59,743,996.66
结算备付金		16,224.75	27,420.39
存出保证金		62,058.90	119,468.87
交易性金融资产	7.4.7.2	1,124,838,462.10	1,165,579,460.95
其中：股票投资		1,124,838,462.10	1,152,942,481.66
基金投资		-	-
债券投资		-	12,636,979.29
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		-	-
应收股利		-	-
应收申购款		1,320,676.15	583,067.14
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.8	-	-
资产总计		1,193,730,827.17	1,226,053,414.01

负债和净资产	附注号	本期末 2025 年 12 月 31 日	上年度末 2024 年 12 月 31 日
负 债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	7.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付清算款		1,101,218.10	1,065,217.34
应付赎回款		694,740.34	1,105,749.82
应付管理人报酬		755,806.50	781,797.08
应付托管费		151,161.31	156,359.39
应付销售服务费		1,509.95	4,821.37
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	220,959.37	284,449.19
负债合计		2,925,395.57	3,398,394.19
净资产：			
实收基金	7.4.7.10	994,800,847.71	1,214,768,621.14
未分配利润	7.4.7.12	196,004,583.89	7,886,398.68
净资产合计		1,190,805,431.60	1,222,655,019.82
负债和净资产总计		1,193,730,827.17	1,226,053,414.01

注：报告截止日 2025 年 12 月 31 日,基金份额总额 994,800,847.71 份。其中大成沪深 300 指数 A 类基金份额总额为 978,027,010.85 份，基金份额净值 1.1971 元；大成沪深 300 指数 C 类基金份额总额为 14,828,620.68 份，基金份额净值 1.1923 元；大成沪深 300 指数 Y 类基金份额总额为 1,945,216.18 份，基金份额净值 1.2070 元。

7.2 利润表

会计主体：大成沪深 300 指数证券投资基金

本报告期：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 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日
一、营业总收入		220,660,025.48	187,572,889.35
1.利息收入		298,572.49	1,065,191.26
其中：存款利息收入	7.4.7.13	298,572.49	429,861.12
债券利息收入		-	-
资产支持证券利息收入		-	-

买入返售金融资产收入		-	-
其他利息收入		-	635,330.14
2.投资收益（损失以“-”填列）		39,142,163.61	3,882,632.20
其中：股票投资收益	7.4.7.14	8,347,792.65	-29,772,560.09
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.15	-11,671.29	109,864.17
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	30,806,042.25	33,545,328.12
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	181,114,269.82	182,504,290.47
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	105,019.56	120,775.42
减：二、营业总支出		10,904,098.76	11,055,827.66
1．管理人报酬	7.4.10.2.1	8,884,174.39	8,944,107.91
2．托管费	7.4.10.2.2	1,776,834.95	1,788,821.45
3．销售服务费	7.4.10.2.3	29,765.62	101,601.02
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		-	2,287.55
8．其他费用	7.4.7.23	213,323.80	219,009.73
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		209,755,926.72	176,517,061.69
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		209,755,926.72	176,517,061.69
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		209,755,926.72	176,517,061.69

7.3 净资产变动表

会计主体：大成沪深 300 指数证券投资基金

本报告期：2025 年 1 月 1 日至 2025 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 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	1,214,768,621.14	-	7,886,398.68	1,222,655,019.82
二、本期期初净资产	1,214,768,621.14	-	7,886,398.68	1,222,655,019.82
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-219,967,773.43	-	188,118,185.21	-31,849,588.22
（一）、综合收益总额	-	-	209,755,926.72	209,755,926.72
（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）	-219,967,773.43	-	-17,682,991.84	-237,650,765.27
其中：1.基金申购款	117,416,132.55	-	8,309,138.18	125,725,270.73
2. 基金赎回款	-337,383,905.98	-	-25,992,130.02	-363,376,036.00
（三）、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动（净资产减少以“-”号填列）	-	-	-3,954,749.67	-3,954,749.67
四、本期期末净资产	994,800,847.71	-	196,004,583.89	1,190,805,431.60
项目	上年度可比期间 2024 年 1 月 1 日至 2024 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	1,336,505,917.87	-	-167,214,313.43	1,169,291,604.44
二、本期期初净资产	1,336,505,917.87	-	-167,214,313.43	1,169,291,604.44

三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-121,737,296.73	-	175,100,712.11	53,363,415.38
（一）、综合收益总额	-	-	176,517,061.69	176,517,061.69
（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）	-121,737,296.73	-	-1,416,349.58	-123,153,646.31
其中：1.基金申购款	383,066,039.29	-	-19,976,483.62	363,089,555.67
2.基金赎回款	-504,803,336.02	-	18,560,134.04	-486,243,201.98
（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	1,214,768,621.14	-	7,886,398.68	1,222,655,019.82

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

大成沪深300指数证券投资基金(以下简称“本基金”)，系经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监基金字[2006]24号文《关于同意大成沪深300指数证券投资基金募集的批复》的核准，由基金管理人大成基金管理有限公司向社会公开发行募集，基金合同于2006年4月6日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为1,813,356,066.47份基金份额，本基金为契约型开放式，存续期限不定。本基金的基金管理人为大成基金管理有限公司，A类基金份额和B类基金份额的注册登记机构为中国证券登记结算有限责任公司，Y类基金份额的注册登记机构为大成基金管理有限公司，基金托管人为中国农业银行股份有限公司。

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

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

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

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

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

本基金的业绩比较基准为:沪深 300 指数收益率。

7.4.2 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 2 号《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。

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。

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

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。

7.4.4.5 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。

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。

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

（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。

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 Y 类基金份额的收益分配方式是红利再投资；其他份额类别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。基金收益分配后任一类基金份额净值不能低于面值，即基金收益分配基准日的任一类基金份额净值减去该类每单位基金份额收益分配金额后不能低于面值。

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

无。

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

（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。

根据财政部、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》，自 2025 年 8 月 8 日起，对在该日期之后（含当日）新发行的国债、地方政府债券、金融债券的利息收入，恢复征收增值税。对在该日期之前已发行的国债、地方政府债券、金融债券（包含在 2025 年 8 月 8 日之后续发行的部分）的利息收入，继续免征增值税直至债券到期。

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

（2）企业所得税

根据财政部、国家税务总局财税[2004]78号文《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。

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 2025 年 12 月 31 日	上年度末 2024 年 12 月 31 日
活期存款	67,493,405.27	59,743,996.66
等于：本金	67,486,242.96	59,731,185.42
加：应计利息	7,162.31	12,811.24
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	67,493,405.27	59,743,996.66

7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末 2025 年 12 月 31 日			
		成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票		951,254,637.92	-	1,124,838,462.10	173,583,824.18
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		951,254,637.92	-	1,124,838,462.10	173,583,824.18
项目		上年度末 2024 年 12 月 31 日			
		成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票		1,160,455,195.30	-	1,152,942,481.66	-7,512,713.64
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-	-
债券	交易所市场	12,427,652.00	227,059.29	12,636,979.29	-17,732.00
	银行间市场	-	-	-	-
	合计	12,427,652.00	227,059.29	12,636,979.29	-17,732.00
资产支持证券		-	-	-	-
基金		-	-	-	-
其他		-	-	-	-
合计		1,172,882,847.30	227,059.29	1,165,579,460.95	-7,530,445.64

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 2025 年 12 月 31 日	上年度末 2024 年 12 月 31 日
应付券商交易单元保证金	-	-
应付赎回费	621.20	2,820.32
应付证券出借违约金	-	-
应付交易费用	25,838.17	87,128.87
其中：交易所市场	25,838.17	87,128.87
银行间市场	-	-
应付利息	-	-
预提费用	194,500.00	194,500.00
合计	220,959.37	284,449.19

7.4.7.10 实收基金

金额单位：人民币元

大成沪深 300 指数 A

项目	本期 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	1,157,434,712.70	1,157,434,712.70
本期申购	94,067,473.20	94,067,473.20
本期赎回（以“-”号填列）	-273,475,175.05	-273,475,175.05
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	978,027,010.85	978,027,010.85

大成沪深 300 指数 C

项目	本期 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	57,201,162.56	57,201,162.56
本期申购	21,057,158.23	21,057,158.23
本期赎回（以“-”号填列）	-63,429,700.11	-63,429,700.11
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	14,828,620.68	14,828,620.68

大成沪深 300 指数 Y

项目	本期 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	132,745.88	132,745.88
本期申购	2,291,501.12	2,291,501.12
本期赎回（以“-”号填列）	-479,030.82	-479,030.82
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	1,945,216.18	1,945,216.18

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

大成沪深 300 指数 A

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	722,653,337.39	-714,815,851.85	7,837,485.54
本期期初	722,653,337.39	-714,815,851.85	7,837,485.54
本期利润	28,139,376.32	178,717,835.36	206,857,211.68
本期基金份额交易产生的变动数	-113,291,997.18	95,276,718.32	-18,015,278.86
其中：基金申购款	59,303,271.33	-52,713,720.45	6,589,550.88

基金赎回款	-172,595,268.51	147,990,438.77	-24,604,829.74
本期已分配利润	-3,929,576.49	-	-3,929,576.49
本期末	633,571,140.04	-440,821,298.17	192,749,841.87

大成沪深 300 指数 C

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	35,318,172.89	-35,270,191.46	47,981.43
本期期初	35,318,172.89	-35,270,191.46	47,981.43
本期利润	472,797.30	2,233,642.41	2,706,439.71
本期基金份额交易产生的变动数	-26,237,206.04	26,360,032.63	122,826.59
其中：基金申购款	13,180,485.80	-11,730,600.27	1,449,885.53
基金赎回款	-39,417,691.84	38,090,632.90	-1,327,058.94
本期已分配利润	-25,173.18	-	-25,173.18
本期末	9,528,590.97	-6,676,516.42	2,852,074.55

大成沪深 300 指数 Y

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	82,924.90	-81,993.19	931.71
本期期初	82,924.90	-81,993.19	931.71
本期利润	29,483.28	162,792.05	192,275.33
本期基金份额交易产生的变动数	1,164,806.59	-955,346.16	209,460.43
其中：基金申购款	1,472,048.25	-1,202,346.48	269,701.77
基金赎回款	-307,241.66	247,000.32	-60,241.34
本期已分配利润	-	-	-
本期末	1,277,214.77	-874,547.30	402,667.47

7.4.7.13 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日
活期存款利息收入	265,419.42	425,230.91
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	310.85	3,026.45
其他	32,842.22	1,603.76
合计	298,572.49	429,861.12

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 2025年1月1日至2025年12月31日	上年度可比期间 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	8,347,792.65	-29,772,560.09
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	8,347,792.65	-29,772,560.09

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 2025年1月1日至2025年12月31日	上年度可比期间 2024年1月1日至2024年12月31日
卖出股票成交总额	361,177,360.48	381,098,849.33
减：卖出股票成本总额	352,528,172.24	410,435,334.80
减：交易费用	301,395.59	436,074.62
买卖股票差价收入	8,347,792.65	-29,772,560.09

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

单位：人民币元

项目	本期 2025年1月1日至2025年12月31日	上年度可比期间 2024年1月1日至2024年12月31日
债券投资收益——利息收入	15,980.71	303,180.17
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	-27,652.00	-193,316.00
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	-11,671.29	109,864.17

7.4.7.15.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2025年1月1日至2025年12月31日	上年度可比期间 2024年1月1日至2024年12月31日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	12,643,040.00	51,969,013.37
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	12,427,652.00	51,794,058.00
减：应计利息总额	243,040.00	368,271.37
减：交易费用	-	-
买卖债券差价收入	-27,652.00	-193,316.00

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 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日
股票投资产生的股利收益	30,806,042.25	33,545,328.12
其中：证券出借权益补偿收入	-	602,261.76
基金投资产生的股利收益	-	-
合计	30,806,042.25	33,545,328.12

7.4.7.20 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日
1.交易性金融资产	181,114,269.82	182,504,290.47
股票投资	181,096,537.82	182,384,402.47
债券投资	17,732.00	119,888.00
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	181,114,269.82	182,504,290.47

7.4.7.21 其他收入

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间

	2025 年 1 月 1 日至 2025 年 12 月 31 日	2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日
基金赎回费收入	105,019.56	120,775.42
合计	105,019.56	120,775.42

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 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日
审计费用	70,000.00	70,000.00
信息披露费	120,000.00	120,000.00
证券出借违约金	-	-
银行划款手续费	5,323.80	11,009.73
账户维护费	18,000.00	18,000.00
合计	213,323.80	219,009.73

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

本基金的基金管理人于 2026 年 01 月 14 日宣告 2025 年度第 1 次分红，向截至 2026 年 01 月 16 日止在本基金注册登记人登记在册的全体持有人，大成沪深 300 指数 A 按每 10 份基金份额派发红利 0.9860 元，大成沪深 300 指数 C 按每 10 份基金份额派发红利 0.9620 元，大成沪深 300 指数 Y 按每 10 份基金份额派发红利 1.0360 元。

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 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 12 月 31 日		上年度可比期间 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	-	-	95,387,496.15	14.48

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 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（%）
-	-	-	-	-
关联方名称	上年度可比期间 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	70,195.05	34.53	-	-

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 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 12 月 31 日	上年度可比期间 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	8,884,174.39	8,944,107.91
其中：应支付销售机构的客户维护费	2,580,378.50	2,483,989.22
应支付基金管理人的净管理费	6,303,795.89	6,460,118.69

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

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

7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 12 月 31 日	上年度可比期间 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	1,776,834.95	1,788,821.45

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

日托管费＝前一日 A/C/Y 类基金份额的基金资产净值×A/C/Y 类基金份额的托管费年费率/当年天数。

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 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			
	大成沪深 300 指数 A	大成沪深 300 指数 C	大成沪深 300 指数 Y	合计
大成基金	-	10,090.29	-	10,090.29

合计	-	10,090.29	-	10,090.29

获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2024年1月1日至2024年12月31日			
	当期发生的基金应支付的销售服务费			
	大成沪深300指数A	大成沪深300指数C	大成沪深300指数Y	合计
大成基金	-	47,599.12	-	47,599.12
合计	-	47,599.12	-	47,599.12

注：C类基金份额的销售服务费年费率为0.10%。

销售服务费的计算方法如下：

H＝E×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

无。

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 2025年1月1日至2025年12月31日		上年度可比期间 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	67,493,405.27	265,419.42	59,743,996.66	425,230.91

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

单位：人民币元

大成沪深 300 指数 A								
序号	权益登记日	除息日		每 10 份基金份额分红数	现金形式发放总额	再投资形式发放总额	本期利润分配合计	备注
		场内	场外					
1	2025 年 1 月 20 日	-	2025 年 1 月 20 日	0.0339	1,931,713.46	1,997,863.03	3,929,576.49	-
合计	-	-	-	0.0339	1,931,713.46	1,997,863.03	3,929,576.49	-

大成沪深 300 指数 C								
序号	权益登记日	除息日		每 10 份基金份额分红数	现金形式发放总额	再投资形式发放总额	本期利润分配合计	备注
		场内	场外					
1	2025 年 1 月 20 日	-	2025 年 1 月 20 日	0.0042	20,500.38	4,672.80	25,173.18	-
合计	-	-	-	0.0042	20,500.38	4,672.80	25,173.18	-

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

金额单位：人民币元

7.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	受限期	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量（单位：股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
001221	悍高集团	2025 年 7 月 23 日	6 个月	新股锁定	15.43	56.94	160	2,468.80	9,110.40	-
001233	海安	2025 年 11	6 个月	新股锁定	48.00	51.88	370	17,760.00	19,195.60	-

	集团	月 18 日								
001280	中国铀业	2025 年 11 月 25 日	6 个月	新股锁定	17.89	45.36	2,277	40,735.53	103,284.72	-
001285	瑞立科密	2025 年 9 月 23 日	6 个月	新股锁定	42.28	56.08	137	5,792.36	7,682.96	-
001369	双欣环保	2025 年 12 月 23 日	6 个月	新股锁定	6.85	12.89	897	6,144.45	11,562.33	-
001386	马可波罗	2025 年 10 月 15 日	6 个月	新股锁定	13.75	18.53	1,626	22,357.50	30,129.78	-
001388	信通电子	2025 年 6 月 24 日	6 个月	新股锁定	16.42	42.94	94	1,543.48	4,036.36	-
001396	誉帆科技	2025 年 12 月 23 日	6 个月	新股锁定	22.29	35.39	69	1,538.01	2,441.91	-
301449	天溯计量	2025 年 12 月 16 日	6 个月	新股锁定	36.80	65.23	112	4,121.60	7,305.76	-
301491	汉桑科技	2025 年 7 月 29 日	6 个月	新股锁定	28.91	55.11	245	7,082.95	13,501.95	-
301563	云汉芯城	2025 年 9 月 23 日	6 个月	新股锁定	27.00	133.69	110	2,970.00	14,705.90	-
301575	艾芬达	2025 年 9 月 3 日	6 个月	新股锁定	27.69	49.55	126	3,488.94	6,243.30	-
301584	建发	2025 年 9	6 个月	新股锁定	7.05	26.82	447	3,151.35	11,988.54	-

	致新	月 18 日								
301609	山大电力	2025 年 7 月 16 日	6 个月	新股锁定	14.66	40.99	277	4,060.82	11,354.23	-
301632	广东建科	2025 年 8 月 5 日	6 个月	新股锁定	6.56	23.68	656	4,303.36	15,534.08	-
301638	南网数字	2025 年 11 月 11 日	6 个月	新股锁定	5.69	14.21	2,322	13,212.18	32,995.62	-
301656	联合动力	2025 年 9 月 17 日	6 个月	新股锁定	12.48	25.46	7,395	92,289.60	188,276.70	-
301667	纳百川	2025 年 12 月 10 日	6 个月	新股锁定	22.63	57.07	151	3,417.13	8,617.57	-
301668	昊创瑞通	2025 年 9 月 15 日	6 个月	新股锁定	21.00	44.80	165	3,465.00	7,392.00	-
301687	新广益	2025 年 12 月 24 日	6 个月	新股锁定	21.93	54.39	195	4,276.35	10,606.05	-
601026	道生天合	2025 年 10 月 9 日	6 个月	新股锁定	5.98	14.28	451	2,696.98	6,440.28	-
603092	德力佳	2025 年 10 月 30 日	6 个月	新股锁定	46.68	55.66	146	6,815.28	8,126.36	-
603175	超颖电子	2025 年 10 月 17 日	6 个月	新股锁定	17.08	48.56	169	2,886.52	8,206.64	-
603248	锡华	2025 年 12	6 个月	新股锁定	10.10	16.30	260	2,626.00	4,238.00	-

	科技	月 16 日								
603262	技源集团	2025 年 7 月 16 日	6 个月	新股锁定	10.88	28.10	155	1,686.40	4,355.50	-
603334	丰倍生物	2025 年 10 月 29 日	6 个月	新股锁定	24.49	32.82	88	2,155.12	2,888.16	-
603370	华新精科	2025 年 8 月 27 日	6 个月	新股锁定	18.60	46.35	82	1,525.20	3,800.70	-
603376	大明电子	2025 年 10 月 28 日	6 个月	新股锁定	12.55	26.21	111	1,393.05	2,909.31	-
603406	天富龙	2025 年 7 月 30 日	6 个月	新股锁定	23.60	40.16	153	3,610.80	6,144.48	-
603418	友升股份	2025 年 9 月 16 日	6 个月	新股锁定	46.36	59.06	139	6,444.04	8,209.34	-
688727	恒坤新材	2025 年 11 月 11 日	6 个月	新股锁定	14.99	34.87	563	8,439.37	19,631.81	-
688759	必贝特	2025 年 10 月 21 日	6 个月	新股锁定	17.78	25.11	465	8,267.70	11,676.15	-
688765	禾元生物	2025 年 10 月 16 日	6 个月	新股锁定	29.06	52.62	262	7,613.72	13,786.44	-
688783	西安奕材	2025 年 10 月 20 日	6 个月	新股锁定	8.62	18.36	2,054	17,705.48	37,711.44	-
688790	昂瑞	2025 年 12	6 个月	新股锁定	83.06	117.19	86	7,143.16	10,078.34	-

	微	月 9 日								
688795	摩尔线程	2025 年 11 月 26 日	6 个月	新股锁定	114.28	416.18	146	16,684.88	60,762.28	-
688796	百奥赛图	2025 年 12 月 2 日	6 个月	新股锁定	26.68	42.25	423	11,285.64	17,871.75	-
688802	沐曦股份	2025 年 12 月 9 日	6 个月	新股锁定	104.66	399.31	85	8,896.10	33,941.35	-
688805	健信超导	2025 年 12 月 17 日	6 个月	新股锁定	18.58	32.37	265	4,923.70	8,578.05	-
688807	优迅股份	2025 年 12 月 10 日	6 个月	新股锁定	51.66	135.56	131	6,767.46	17,758.36	-
688809	强一股份	2025 年 12 月 23 日	6 个月	新股锁定	85.09	203.31	259	22,038.31	52,657.29	-

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
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	19,605	2,913,836.44	5,562,918.75	-
002049	紫光国微	2025 年 12 月 30 日	重大事项停牌	78.81	2026 年 1 月 15 日	86.69	30,280	2,690,287.41	2,386,366.80	-

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

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

本基金的基金管理人奉行全面风险管理体系的建设，建立了以由高层监控(合规与风险管理委员会、公司投资风险控制委员会)、专业监控(监察稽核部、风险管理部)、部门互控、岗位自控构成的风险管理架构体系。本基金的基金管理人在董事会下设立合规与风险管理委员会，对公司整体运营风险进行监督，监督风险控制措施的执行。在管理层层面设立投资风险控制委员会，通过定期会议讨论涉及投资风险的重大议题，形成正式决议提交投委会。在业务操作层面,监察稽核部履行合规控制职责，通过定期、不定期检查内控制度的执行情况、对重大风险点以专项稽核的方式确保公司内控制度、流程得到贯彻执行。风险管理部履行风险量化评估分析职责。

本基金的基金管理人对于金融工具的风险管理方法主要是通过定性分析和定量分析的方法去估测各种风险产生的可能损失。从定性分析的角度出发，判断风险损失的严重程度和出现同类风险损失的频度。而从定量分析的角度出发，根据本基金的投资目标，结合基金资产所运用金融工具特征通过特定的风险量化指标、模型，日常的量化报告，确定风险损失的限度和相应置信程度，及时可靠地对各种风险进行监督、检查和评估，并通过相应决策，将风险控制在可承受的范围内。

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：本基金未持有除国债、央行票据和政策性金融债以外的债券)。

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》、《货币市场基金监督管理办法》及《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》等有关法规的要求对本基金组合资产的流动性风险进行管理。本基金的基金管理人采用监控流动性受限资产比例、份额持有人集中度、调整平均剩余期限和平均剩余存续期、压力测试等方式防范流动性风险，并于开放日对本基金的申购赎回情况进行监控，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配，确保本基金资产的变现能力与投资者赎回需求的匹配与平衡。本基金的基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。

本基金主要投资于交易所及银行间市场内交易的证券，除在附注“期末本基金持有的流通受限证券”中列示的部分基金资产流通暂时受限制外（如有），均能够及时变现。本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券资产的公允价值。除附注“期末债券正回购交易中作为抵押的债券”中列示的卖出回购金融资产款余额（如有）将在 1 个月内到期且计息外，本基金于资产负债表日所持有的金融负债的合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。 本基金持有的大部分金融资产和金融负债不计息，因此本基金的收入及经营活动的现金流量在很大程度上独立于市场利率变化。本基金持有的利率敏感性资产主要为银行存款、结算备付金及应收申购款等。

7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2025 年 12 月 31 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
货币资金	67,493,405.27	-	-	-	67,493,405.27
结算备付金	16,224.75	-	-	-	16,224.75
存出保证金	62,058.90	-	-	-	62,058.90
交易性金融资产	-	-	-	1,124,838,462.10	1,124,838,462.10
应收申购款	2,240.57	-	-	1,318,435.58	1,320,676.15
资产总计	67,573,929.49	-	-	1,126,156,897.68	1,193,730,827.17
负债					
应付赎回款	-	-	-	694,740.34	694,740.34
应付管理人报酬	-	-	-	755,806.50	755,806.50
应付托管费	-	-	-	151,161.31	151,161.31
应付清算款	-	-	-	1,101,218.10	1,101,218.10
应付销售服务费	-	-	-	1,509.95	1,509.95
其他负债	-	-	-	220,959.37	220,959.37
负债总计	-	-	-	2,925,395.57	2,925,395.57
利率敏感度缺口	67,573,929.49	-	-	1,123,231,502.11	1,190,805,431.60
上年度末 2024 年 12 月 31 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
货币资金	59,743,996.66	-	-	-	59,743,996.66
结算备付金	27,420.39	-	-	-	27,420.39

存出保证金	119,468.87	-	-	-	119,468.87
交易性金融资产	12,636,979.29	-	-	1,152,942,481.66	1,165,579,460.95
应收申购款	6,456.89	-	-	576,610.25	583,067.14
资产总计	72,534,322.10	-	-	1,153,519,091.91	1,226,053,414.01
负债					
应付赎回款	-	-	-	1,105,749.82	1,105,749.82
应付管理人报酬	-	-	-	781,797.08	781,797.08
应付托管费	-	-	-	156,359.39	156,359.39
应付清算款	-	-	-	1,065,217.34	1,065,217.34
应付销售服务费	-	-	-	4,821.37	4,821.37
其他负债	-	-	-	284,449.19	284,449.19
负债总计	-	-	-	3,398,394.19	3,398,394.19
利率敏感度缺口	72,534,322.10	-	-	1,150,120,697.72	1,222,655,019.82

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：1.03%），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。本基金持有的金融工具均以人民币计价，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，所面临的最大市场价格风险由所持有的金融工具的公允价值决定。本基金通过投资组合的分散化降低市场价格风险，并且本基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控。

本基金跟踪标的指数的投资组合的资产原则上不低于基金资产净值的 90%。除非法律法规另有规定，本基金的股票投资比例可以提高到基金资产净值的 100%。现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%。

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 2025年12月31日		上年度末 2024年12月31日	
	公允价值	占基金资产净值比例（%）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
交易性金融资产－股票投资	1,124,838,462.10	94.46	1,152,942,481.66	94.30
交易性金融资产－基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产－贵金属投资	-	-	-	-
衍生金融资产－权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	1,124,838,462.10	94.46	1,152,942,481.66	94.30

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%	56,421,123.22	55,955,539.89
	业绩比较基准下降5%	-56,421,123.22	-55,955,539.89

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 2025 年 12 月 31 日	上年度末 2024 年 12 月 31 日
第一层次	1,116,033,438.76	1,150,468,898.53
第二层次	7,949,285.55	14,537,424.95
第三层次	855,737.79	573,137.47
合计	1,124,838,462.10	1,165,579,460.95

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 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	-	573,137.47	573,137.47
当期购买	-	-	-
当期出售/结算	-	-	-
转入第三层次	-	1,399,337.07	1,399,337.07
转出第三层次	-	1,281,407.54	1,281,407.54
当期利得或损失总额	-	164,670.79	164,670.79
其中：计入损益的利得或损失	-	164,670.79	164,670.79
计入其他综合收益的利得或损失	-	-	-
期末余额	-	855,737.79	855,737.79
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—	-	459,953.47	459,953.47

—公允价值变动损益			
项目	上年度可比期间 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	-	722,762.34	722,762.34
当期购买	-	-	-
当期出售/结算	-	-	-
转入第三层次	-	1,811,877.27	1,811,877.27
转出第三层次	-	1,428,923.68	1,428,923.68
当期利得或损失总额	-	-532,578.46	-532,578.46
其中：计入损益的利得或损失	-	-532,578.46	-532,578.46
计入其他综合收益的利得或损失	-	-	-
期末余额	-	573,137.47	573,137.47
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	-	335,498.04	335,498.04

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
证券交易所上市但尚在限售期内的股票	855,737.79	平均价格亚式期权模型	预期波动率	0.1800-3.0791	负相关
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	573,137.47	平均价格亚式期权模型	预期波动率	0.2665-5.7444	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	1,124,838,462.10	94.23
	其中：股票	1,124,838,462.10	94.23
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	67,509,630.02	5.66
8	其他各项资产	1,382,735.05	0.12
9	合计	1,193,730,827.17	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	10,139,834.86	0.85
B	采矿业	66,251,431.41	5.56
C	制造业	623,873,514.29	52.39
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	32,115,312.64	2.70
E	建筑业	16,716,953.36	1.40
F	批发和零售业	2,427,375.50	0.20
G	交通运输、仓储和邮政业	33,103,033.83	2.78
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	50,932,863.19	4.28

J	金融业	257,031,100.36	21.58
K	房地产业	6,094,328.26	0.51
L	租赁和商务服务业	9,370,893.56	0.79
M	科学研究和技术服务业	12,579,831.93	1.06
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	2,276,637.12	0.19
R	文化、体育和娱乐业	1,069,614.00	0.09
S	综合	-	-
	合计	1,123,982,724.31	94.39

8.2.2 报告期末积极投资按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	103,284.72	0.01
C	制造业	649,609.51	0.05
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	26,694.44	0.00
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	32,995.62	0.00
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	43,153.50	0.00
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	855,737.79	0.07

8.2.3 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

8.3.1 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	300750	宁德时代	117,540	43,167,740.40	3.63
2	600519	贵州茅台	27,858	38,365,480.44	3.22
3	601318	中国平安	473,957	32,418,658.80	2.72
4	300308	中际旭创	49,500	30,195,000.00	2.54
5	601899	紫金矿业	732,149	25,237,176.03	2.12
6	600036	招商银行	550,242	23,165,188.20	1.95
7	300502	新易盛	44,260	19,070,748.80	1.60
8	000333	美的集团	218,908	17,107,660.20	1.44
9	601166	兴业银行	752,615	15,850,071.90	1.33
10	600900	长江电力	543,862	14,787,607.78	1.24
11	601398	工商银行	1,684,818	13,360,606.74	1.12
12	300059	东方财富	565,145	13,100,061.10	1.10
13	002475	立讯精密	226,642	12,852,867.82	1.08
14	688256	寒武纪	9,360	12,687,948.00	1.07
15	600030	中信证券	436,412	12,529,388.52	1.05
16	600276	恒瑞医药	198,448	11,821,547.36	0.99
17	002594	比亚迪	120,900	11,814,348.00	0.99
18	300274	阳光电源	64,577	11,045,250.08	0.93
19	601138	工业富联	176,600	10,958,030.00	0.92
20	688981	中芯国际	88,963	10,927,325.29	0.92
21	601328	交通银行	1,450,008	10,512,558.00	0.88
22	601211	国泰海通	505,817	10,394,539.35	0.87
23	603259	药明康德	109,987	9,969,221.68	0.84
24	688041	海光信息	41,405	9,291,696.05	0.78
25	000858	五 粮 液	86,289	9,141,456.66	0.77
26	002371	北方华创	19,280	8,851,062.40	0.74
27	600887	伊利股份	281,308	8,045,408.80	0.68
28	000651	格力电器	199,189	8,011,381.58	0.67
29	300476	胜宏科技	27,100	7,793,418.00	0.65
30	603993	洛阳钼业	388,144	7,762,880.00	0.65
31	600000	浦发银行	592,211	7,367,104.84	0.62
32	000725	京东方 A	1,632,263	6,871,827.23	0.58
33	600919	江苏银行	652,610	6,787,144.00	0.57

34	601816	京沪高铁	1,304,868	6,720,070.20	0.56
35	600150	中国船舶	200,804	6,678,741.04	0.56
36	600309	万华化学	83,514	6,403,853.52	0.54
37	601601	中国太保	152,193	6,378,408.63	0.54
38	603986	兆易创新	29,748	6,373,509.00	0.54
39	300124	汇川技术	84,000	6,327,720.00	0.53
40	601688	华泰证券	262,975	6,203,580.25	0.52
41	002714	牧原股份	121,503	6,145,621.74	0.52
42	688008	澜起科技	50,943	6,001,085.40	0.50
43	601088	中国神华	146,646	5,939,163.00	0.50
44	601988	中国银行	978,640	5,607,607.20	0.47
45	603019	中科曙光	65,068	5,572,423.52	0.47
46	600031	三一重工	263,706	5,572,107.78	0.47
47	688012	中微公司	19,605	5,562,918.75	0.47
48	002050	三花智控	99,577	5,507,603.87	0.46
49	601939	建设银行	586,262	5,440,511.36	0.46
50	000063	中兴通讯	143,320	5,423,228.80	0.46
51	601857	中国石油	503,856	5,245,140.96	0.44
52	600111	北方稀土	112,454	5,186,378.48	0.44
53	002230	科大讯飞	102,768	5,168,202.72	0.43
54	300760	迈瑞医疗	27,000	5,142,150.00	0.43
55	600089	特变电工	224,680	4,992,389.60	0.42
56	000001	平安银行	431,318	4,921,338.38	0.41
57	601012	隆基绿能	269,533	4,905,500.60	0.41
58	002415	海康威视	163,042	4,865,173.28	0.41
59	000425	徐工机械	417,946	4,839,814.68	0.41
60	002384	东山精密	57,100	4,833,515.00	0.41
61	603501	豪威集团	37,645	4,739,505.50	0.40
62	601668	中国建筑	918,394	4,711,361.22	0.40
63	600660	福耀玻璃	71,326	4,619,785.02	0.39
64	603799	华友钴业	67,530	4,609,597.80	0.39
65	601658	邮储银行	845,700	4,609,065.00	0.39
66	601229	上海银行	442,211	4,466,331.10	0.38
67	601127	赛力斯	36,300	4,390,848.00	0.37
68	002463	沪电股份	59,900	4,376,893.00	0.37
69	600690	海尔智家	166,849	4,353,090.41	0.37
70	601728	中国电信	690,211	4,348,329.30	0.37
71	601600	中国铝业	352,343	4,305,631.46	0.36
72	002028	思源电气	27,700	4,282,143.00	0.36
73	601919	中远海控	280,219	4,253,724.42	0.36
74	600016	民生银行	1,103,472	4,226,297.76	0.35
75	300394	天孚通信	20,720	4,206,781.60	0.35
76	000100	TCL科技	924,714	4,198,201.56	0.35

77	000338	潍柴动力	240,792	4,141,622.40	0.35
78	002142	宁波银行	146,786	4,123,218.74	0.35
79	601888	中国中免	43,490	4,112,414.40	0.35
80	002352	顺丰控股	106,700	4,088,744.00	0.34
81	600941	中国移动	40,200	4,062,210.00	0.34
82	600406	国电南瑞	178,584	4,014,568.32	0.34
83	600028	中国石化	647,769	4,003,212.42	0.34
84	300498	温氏股份	236,624	3,994,213.12	0.34
85	000792	盐湖股份	141,200	3,976,192.00	0.33
86	600183	生益科技	54,100	3,863,281.00	0.32
87	000568	泸州老窖	32,700	3,800,394.00	0.32
88	600809	山西汾酒	21,680	3,722,456.00	0.31
89	601766	中国中车	540,804	3,688,283.28	0.31
90	601225	陕西煤业	172,464	3,676,932.48	0.31
91	300014	亿纬锂能	55,361	3,640,539.36	0.31
92	601169	北京银行	657,880	3,605,182.40	0.30
93	600050	中国联通	694,936	3,551,122.96	0.30
94	600926	杭州银行	225,676	3,448,329.28	0.29
95	601628	中国人寿	74,062	3,369,821.00	0.28
96	002027	分众传媒	449,468	3,312,579.16	0.28
97	002625	光启技术	67,100	3,271,796.00	0.27
98	600938	中国海油	106,369	3,210,216.42	0.27
99	688111	金山办公	10,371	3,184,622.97	0.27
100	002241	歌尔股份	110,353	3,170,441.69	0.27
101	601985	中国核电	365,810	3,164,256.50	0.27
102	002460	赣锋锂业	50,300	3,163,367.00	0.27
103	601009	南京银行	274,779	3,140,723.97	0.26
104	600547	山东黄金	80,410	3,112,671.10	0.26
105	600104	上汽集团	204,500	3,112,490.00	0.26
106	300033	同花顺	9,600	3,092,928.00	0.26
107	000977	浪潮信息	45,788	3,049,480.80	0.26
108	000807	云铝股份	92,500	3,037,700.00	0.26
109	600489	中金黄金	129,400	3,022,784.00	0.25
110	601689	拓普集团	38,580	2,977,604.40	0.25
111	000776	广发证券	134,602	2,963,936.04	0.25
112	000408	藏格矿业	34,900	2,945,560.00	0.25
113	002709	天赐材料	63,400	2,937,322.00	0.25
114	600019	宝钢股份	387,352	2,885,772.40	0.24
115	601818	光大银行	825,200	2,879,948.00	0.24
116	600999	招商证券	169,339	2,817,800.96	0.24
117	601006	大秦铁路	537,457	2,773,278.12	0.23
118	002916	深南电路	11,877	2,758,908.33	0.23
119	688271	联影医疗	21,965	2,756,607.50	0.23

120	603288	海天味业	74,165	2,745,588.30	0.23
121	300408	三环集团	59,732	2,732,739.00	0.23
122	300433	蓝思科技	88,600	2,681,922.00	0.23
123	000625	长安汽车	220,702	2,617,525.72	0.22
124	601100	恒立液压	23,812	2,617,176.92	0.22
125	600958	东方证券	239,219	2,607,487.10	0.22
126	600905	三峡能源	635,400	2,598,786.00	0.22
127	601336	新华保险	37,125	2,587,612.50	0.22
128	002466	天齐锂业	46,061	2,550,858.18	0.21
129	600362	江西铜业	46,215	2,538,127.80	0.21
130	002600	领益智造	162,400	2,523,696.00	0.21
131	605499	东鹏饮料	9,330	2,494,748.70	0.21
132	600438	通威股份	120,100	2,464,452.00	0.21
133	601390	中国中铁	455,245	2,462,875.45	0.21
134	600010	包钢股份	1,006,556	2,395,603.28	0.20
135	601825	沪农商行	257,300	2,390,317.00	0.20
136	002049	紫光国微	30,280	2,386,366.80	0.20
137	600893	航发动力	59,369	2,376,541.07	0.20
138	601377	兴业证券	316,991	2,352,073.22	0.20
139	600584	长电科技	63,700	2,342,886.00	0.20
140	600585	海螺水泥	106,668	2,331,762.48	0.20
141	600160	巨化股份	60,100	2,309,042.00	0.19
142	300015	爱尔眼科	207,344	2,276,637.12	0.19
143	600115	中国东航	378,420	2,270,520.00	0.19
144	600436	片仔癀	13,411	2,263,508.58	0.19
145	000538	云南白药	39,656	2,250,874.56	0.19
146	600522	中天科技	121,500	2,201,580.00	0.18
147	000938	紫光股份	88,995	2,189,277.00	0.18
148	000166	申万宏源	414,610	2,184,994.70	0.18
149	000630	铜陵有色	357,600	2,149,176.00	0.18
150	600760	中航沈飞	37,818	2,123,480.70	0.18
151	600346	恒力石化	93,879	2,115,093.87	0.18
152	300803	指南针	16,000	2,093,920.00	0.18
153	600426	华鲁恒升	66,180	2,080,037.40	0.17
154	002311	海大集团	37,000	2,049,060.00	0.17
155	601916	浙商银行	670,400	2,038,016.00	0.17
156	600570	恒生电子	67,453	2,033,707.95	0.17
157	002179	中航光电	56,608	2,006,187.52	0.17
158	600795	国电电力	396,505	1,998,385.20	0.17
159	601669	中国电建	382,946	1,991,319.20	0.17
160	600048	保利发展	319,287	1,947,650.70	0.16
161	600415	小商品城	122,000	1,945,900.00	0.16
162	600015	华夏银行	283,113	1,944,986.31	0.16

163	600066	宇通客车	59,100	1,932,570.00	0.16
164	600989	宝丰能源	97,800	1,919,814.00	0.16
165	600029	南方航空	239,640	1,919,516.40	0.16
166	300442	润泽科技	36,300	1,916,640.00	0.16
167	000157	中联重科	220,900	1,906,367.00	0.16
168	601995	中金公司	54,100	1,893,500.00	0.16
169	601058	赛轮轮胎	116,900	1,891,442.00	0.16
170	002074	国轩高科	48,200	1,885,102.00	0.16
171	002736	国信证券	142,200	1,865,664.00	0.16
172	688126	沪硅产业	85,441	1,848,943.24	0.16
173	600176	中国巨石	106,828	1,826,758.80	0.15
174	601838	成都银行	113,063	1,822,575.56	0.15
175	600009	上海机场	55,379	1,814,216.04	0.15
176	601998	中信银行	235,584	1,813,996.80	0.15
177	000975	山金国际	74,100	1,802,853.00	0.15
178	601360	三六零	155,655	1,738,666.35	0.15
179	002001	新 和 成	68,398	1,722,945.62	0.14
180	688036	传音控股	25,579	1,692,306.64	0.14
181	603893	瑞芯微	9,400	1,675,832.00	0.14
182	600219	南山铝业	309,800	1,666,724.00	0.14
183	002236	大华股份	87,749	1,661,966.06	0.14
184	603296	华勤技术	18,100	1,642,394.00	0.14
185	300418	昆仑万维	39,100	1,630,470.00	0.14
186	002304	洋河股份	26,815	1,628,743.10	0.14
187	601066	中信建投	60,600	1,622,262.00	0.14
188	002920	德赛西威	13,300	1,599,990.00	0.13
189	601881	中国银河	101,245	1,591,571.40	0.13
190	000768	中航西飞	61,888	1,570,717.44	0.13
191	601186	中国铁建	204,653	1,569,688.51	0.13
192	002938	鹏鼎控股	30,900	1,562,922.00	0.13
193	601111	中国国航	166,599	1,561,032.63	0.13
194	002493	荣盛石化	133,263	1,560,509.73	0.13
195	000963	华东医药	39,030	1,539,733.50	0.13
196	601077	渝农商行	235,900	1,523,914.00	0.13
197	601901	方正证券	192,400	1,500,720.00	0.13
198	600196	复星医药	56,601	1,499,360.49	0.13
199	002252	上海莱士	236,078	1,496,734.52	0.13
200	600460	士兰微	51,900	1,474,479.00	0.12
201	002422	科伦药业	49,800	1,461,630.00	0.12
202	600011	华能国际	195,500	1,458,430.00	0.12
203	002601	龙佰集团	74,218	1,453,188.44	0.12
204	600372	中航机载	107,600	1,443,992.00	0.12
205	301236	软通动力	29,700	1,408,671.00	0.12

206	688169	石头科技	9,260	1,408,075.60	0.12
207	000002	万　科A	302,620	1,407,183.00	0.12
208	600741	华域汽车	70,155	1,403,100.00	0.12
209	600886	国投电力	106,790	1,401,084.80	0.12
210	601878	浙商证券	128,800	1,392,328.00	0.12
211	605117	德业股份	16,121	1,389,630.20	0.12
212	001979	招商蛇口	160,379	1,385,674.56	0.12
213	300782	卓胜微	16,720	1,362,345.60	0.11
214	601868	中国能建	576,600	1,355,010.00	0.11
215	600515	海南机场	254,000	1,353,820.00	0.11
216	601698	中国卫通	37,600	1,343,448.00	0.11
217	000661	长春高新	14,500	1,341,975.00	0.11
218	601877	正泰电器	47,879	1,335,345.31	0.11
219	002648	卫星化学	74,960	1,325,292.80	0.11
220	300661	圣邦股份	19,215	1,318,917.60	0.11
221	600875	东方电气	54,300	1,318,404.00	0.11
222	003816	中国广核	349,700	1,314,872.00	0.11
223	300759	康龙化成	46,075	1,309,912.25	0.11
224	601800	中国交建	158,188	1,303,469.12	0.11
225	300347	泰格医药	22,940	1,300,698.00	0.11
226	601021	春秋航空	21,762	1,294,839.00	0.11
227	601872	招商轮船	143,636	1,289,851.28	0.11
228	000301	东方盛虹	117,600	1,280,664.00	0.11
229	601319	中国人保	142,100	1,271,795.00	0.11
230	601633	长城汽车	55,500	1,255,965.00	0.11
231	688396	华润微	23,646	1,249,927.56	0.10
232	600233	圆通速递	76,100	1,249,562.00	0.10
233	601117	中国化学	162,900	1,226,637.00	0.10
234	000895	双汇发展	46,297	1,225,481.59	0.10
235	600588	用友网络	91,211	1,209,457.86	0.10
236	600674	川投能源	86,700	1,205,130.00	0.10
237	688506	百利天恒	3,700	1,195,470.00	0.10
238	688047	龙芯中科	9,000	1,188,990.00	0.10
239	603369	今世缘	33,300	1,158,174.00	0.10
240	600039	四川路桥	115,960	1,153,802.00	0.10
241	000786	北新建材	45,500	1,136,135.00	0.10
242	300866	安克创新	9,600	1,098,144.00	0.09
243	000617	中油资本	112,400	1,079,040.00	0.09
244	300251	光线传媒	65,300	1,069,614.00	0.09
245	300316	晶盛机电	29,100	1,069,425.00	0.09
246	600188	兖矿能源	79,520	1,045,688.00	0.09
247	600482	中国动力	50,200	1,039,140.00	0.09
248	302132	中航成飞	13,100	1,034,900.00	0.09

249	301269	华大九天	9,700	1,031,401.00	0.09
250	601898	中煤能源	81,400	1,012,616.00	0.09
251	002459	晶澳科技	88,276	1,010,760.20	0.08
252	300122	智飞生物	53,333	1,006,393.71	0.08
253	688223	晶科能源	177,857	1,003,113.48	0.08
254	600918	中泰证券	152,000	988,000.00	0.08
255	300832	新产业	17,500	984,375.00	0.08
256	600085	同仁堂	30,487	983,510.62	0.08
257	688472	阿特斯	65,640	978,692.40	0.08
258	000596	古井贡酒	7,300	967,980.00	0.08
259	600600	青岛啤酒	15,800	966,960.00	0.08
260	300896	爱美客	6,740	955,192.80	0.08
261	600061	国投资本	123,365	943,742.25	0.08
262	601618	中国中冶	317,438	942,790.86	0.08
263	000876	新 希 望	100,133	923,226.26	0.08
264	001965	招商公路	90,700	914,256.00	0.08
265	601607	上海医药	49,700	887,642.00	0.07
266	600023	浙能电力	178,800	885,060.00	0.07
267	600027	华电国际	176,000	872,960.00	0.07
268	600026	中远海能	74,200	866,656.00	0.07
269	600803	新奥股份	41,400	859,464.00	0.07
270	000999	华润三九	29,585	841,989.10	0.07
271	601059	信达证券	47,500	841,225.00	0.07
272	603260	合盛硅业	15,800	832,660.00	0.07
273	600930	华电新能	129,900	817,071.00	0.07
274	300413	芒果超媒	33,300	813,186.00	0.07
275	000983	山西焦煤	126,300	810,846.00	0.07
276	300628	亿联网络	22,580	804,977.00	0.07
277	601238	广汽集团	98,500	803,760.00	0.07
278	600845	宝信软件	38,156	790,210.76	0.07
279	601456	国联民生	77,000	783,090.00	0.07
280	688303	大全能源	28,605	767,186.10	0.06
281	300999	金龙鱼	26,500	761,610.00	0.06
282	603392	万泰生物	16,923	760,519.62	0.06
283	688082	盛美上海	4,300	757,015.00	0.06
284	600025	华能水电	82,842	752,205.36	0.06
285	000708	中信特钢	45,000	736,650.00	0.06
286	600161	天坛生物	44,000	718,960.00	0.06
287	600018	上港集团	124,247	673,418.74	0.06
288	688009	中国通号	115,047	629,307.09	0.05
289	601018	宁波港	173,000	627,990.00	0.05
290	688187	时代电气	11,540	591,886.60	0.05
291	601236	红塔证券	71,800	588,042.00	0.05

292	601136	首创证券	28,200	529,878.00	0.04
293	603195	公牛集团	12,105	494,247.15	0.04
294	300979	华利集团	7,800	391,638.00	0.03
295	601808	中海油服	26,300	369,252.00	0.03
296	600377	宁沪高速	22,100	267,631.00	0.02
297	601298	青岛港	31,200	260,208.00	0.02
298	001391	国货航	43,500	257,520.00	0.02

8.3.2 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	301656	联合动力	7,395	188,276.70	0.02
2	001280	中国铀业	2,277	103,284.72	0.01
3	688795	摩尔线程	146	60,762.28	0.01
4	688809	强一股份	259	52,657.29	0.00
5	688783	西安奕材	2,054	37,711.44	0.00
6	688802	沐曦股份	85	33,941.35	0.00
7	301638	南网数字	2,322	32,995.62	0.00
8	001386	马可波罗	1,626	30,129.78	0.00
9	688727	恒坤新材	563	19,631.81	0.00
10	001233	海安集团	370	19,195.60	0.00
11	688796	百奥赛图	423	17,871.75	0.00
12	688807	优迅股份	131	17,758.36	0.00
13	301632	广东建科	656	15,534.08	0.00
14	301563	云汉芯城	110	14,705.90	0.00
15	688765	禾元生物	262	13,786.44	0.00
16	301491	汉桑科技	245	13,501.95	0.00
17	301584	建发致新	447	11,988.54	0.00
18	688759	必贝特	465	11,676.15	0.00
19	001369	双欣环保	897	11,562.33	0.00
20	301609	山大电力	277	11,354.23	0.00
21	301687	新广益	195	10,606.05	0.00
22	688790	昂瑞微	86	10,078.34	0.00
23	001221	悍高集团	160	9,110.40	0.00
24	301667	纳百川	151	8,617.57	0.00
25	688805	健信超导	265	8,578.05	0.00
26	603418	友升股份	139	8,209.34	0.00
27	603175	超颖电子	169	8,206.64	0.00
28	603092	德力佳	146	8,126.36	0.00
29	001285	瑞立科密	137	7,682.96	0.00
30	301668	昊创瑞通	165	7,392.00	0.00
31	301449	天溯计量	112	7,305.76	0.00
32	601026	道生天合	451	6,440.28	0.00
33	301575	艾芬达	126	6,243.30	0.00

34	603406	天富龙	153	6,144.48	0.00
35	603262	技源集团	155	4,355.50	0.00
36	603248	锡华科技	260	4,238.00	0.00
37	001388	信通电子	94	4,036.36	0.00
38	603370	华新精科	82	3,800.70	0.00
39	603376	大明电子	111	2,909.31	0.00
40	603334	丰倍生物	88	2,888.16	0.00
41	001396	誉帆科技	69	2,441.91	0.00

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	300476	胜宏科技	7,967,848.70	0.65
2	601211	国泰海通	6,744,616.76	0.55
3	300308	中际旭创	5,664,160.00	0.46
4	002384	东山精密	4,547,982.00	0.37
5	600150	中国船舶	4,444,583.12	0.36
6	002625	光启技术	3,565,876.00	0.29
7	601825	沪农商行	3,007,524.00	0.25
8	601166	兴业银行	2,888,732.00	0.24
9	300750	宁德时代	2,585,871.20	0.21
10	601328	交通银行	2,368,160.00	0.19
11	601077	渝农商行	2,362,366.00	0.19
12	601058	赛轮轮胎	2,331,462.00	0.19
13	600522	中天科技	2,096,395.00	0.17
14	300803	指南针	2,019,850.00	0.17
15	601939	建设银行	1,933,403.00	0.16
16	301236	软通动力	1,769,588.00	0.14
17	002600	领益智造	1,745,038.00	0.14
18	603893	瑞芯微	1,710,404.08	0.14
19	601988	中国银行	1,624,837.00	0.13
20	601899	紫金矿业	1,581,021.00	0.13

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	600519	贵州茅台	11,720,299.00	0.96
2	300750	宁德时代	11,668,099.60	0.95
3	601318	中国平安	7,946,030.00	0.65
4	600036	招商银行	6,990,667.00	0.57

5	600837	海通证券	6,136,679.76	0.50
6	601899	紫金矿业	5,873,533.00	0.48
7	601398	工商银行	5,214,659.00	0.43
8	002594	比亚迪	4,938,328.00	0.40
9	000333	美的集团	4,898,207.00	0.40
10	300059	东方财富	4,818,200.45	0.39
11	601988	中国银行	4,564,839.00	0.37
12	600900	长江电力	4,346,794.00	0.36
13	601166	兴业银行	4,058,598.00	0.33
14	002475	立讯精密	3,945,319.00	0.32
15	603259	药明康德	3,767,303.00	0.31
16	600030	中信证券	3,747,039.00	0.31
17	600276	恒瑞医药	3,528,623.60	0.29
18	601989	中国重工	3,385,317.12	0.28
19	000858	五 粮 液	3,115,921.00	0.25
20	601328	交通银行	3,059,960.00	0.25

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	143,327,614.86
卖出股票收入（成交）总额	361,177,360.48

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

1、本基金投资的前十名证券兴业银行的发行主体兴业银行股份有限公司于 2025 年 12 月 5 日因外包机构管理不到位、企业划型不准确等受到国家金融监督管理总局处罚。兴业银行为本基金跟踪标的指数的成分券。

2、本基金投资的前十名证券招商银行的发行主体招商银行股份有限公司于 2025 年 9 月 12 日因数据安全管理不到位等受到国家金融监督管理总局处罚。招商银行为本基金跟踪标的指数的成分券。

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	62,058.90
2	应收清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	1,320,676.15
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	1,382,735.05

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

8.12.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

无。

8.12.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值	占基金资产净值比例（%）	流通受限情况说明
1	301656	联合动力	188,276.70	0.02	新股锁定
2	001280	中国铀业	103,284.72	0.01	新股锁定
3	688795	摩尔线程	60,762.28	0.01	新股锁定
4	688809	强一股份	52,657.29	0.00	新股锁定
5	688783	西安奕材	37,711.44	0.00	新股锁定

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（%）
大成沪深 300 指数 A	66,769	14,647.92	513,321.73	0.05	977,513,689.12	99.95
大成沪深 300 指数 C	2,133	6,952.00	2,093,714.29	14.12	12,734,906.39	85.88
大成沪深 300 指数 Y	421	4,620.47	0.00	0.00	1,945,216.18	100.00
合计	69,323	14,350.23	2,607,036.02	0.26	992,193,811.69	99.74

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	大成沪深 300 指数 A	64,917.80	0.0066
	大成沪深 300 指数 C	420.81	0.0028
	大成沪深 300 指数 Y	9.81	0.0005

	合计	65,348.42	0.0066

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

9.4 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

基金经理姓名	产品类型	持有本人管理的产品份额总量的数量区间（万份）
郑少芳	公募基金	0
	私募资产管理计划	0
	合计	0

§10 开放式基金份额变动

单位：份

项目	大成沪深 300 指数 A	大成沪深 300 指数 C	大成沪深 300 指数 Y
基金合同生效日（2006 年 4 月 6 日）基金份额总额	1,813,356,066.47	-	-
本报告期期初基金份额总额	1,157,434,712.70	57,201,162.56	132,745.88
本报告期基金总申购份额	94,067,473.20	21,057,158.23	2,291,501.12
减：本报告期基金总赎回份额	273,475,175.05	63,429,700.11	479,030.82
本报告期基金拆分变动份额	-	-	-

本报告期期末基金份额总额	978,027,010.85	14,828,620.68	1,945,216.18

§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，本年度应支付的审计费用为70,000.00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(%)	
国信证券	1	292,830,394.95	60.78	57,394.64	60.78	-
中信建投证券	2	100,798,589.91	20.92	19,756.26	20.92	-
国泰海通	3	76,671,981.20	15.91	15,027.70	15.91	退租1个
华泰证券	1	11,506,325.20	2.39	2,255.31	2.39	-
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	-	-	-	-	-
高盛中国证券	1	-	-	-	-	-
光大证券	2	-	-	-	-	-
广发证券	2	-	-	-	-	-
国金证券	2	-	-	-	-	-
国盛证券	1	-	-	-	-	-
国投证券	1	-	-	-	-	-
红塔证券	1	-	-	-	-	-
华创证券	1	-	-	-	-	-
民生证券	1	-	-	-	-	-
南京证券	1	-	-	-	-	-
平安证券	1	-	-	-	-	-

瑞银证券	2	-	-	-	-	-
山西证券	1	-	-	-	-	-
上海证券	1	-	-	-	-	-
申万宏源	1	-	-	-	-	-
天风证券	1	-	-	-	-	-
万和证券	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	关于大成沪深 300 指数证券投资基金暂停大额申购（含定期定额申购）业务的公告	中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站	2025 年 12 月 23 日
4	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
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	大成沪深 300 指数证券投资基金 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
7	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 9 月 5 日
8	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
9	大成沪深 300 指数证券投资基金 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
10	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
11	大成沪深 300 指数证券投资基金 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
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	大成沪深 300 指数证券投资基金(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
14	大成沪深 300 指数证券投资基金(Y 类份额)基金产品资料概要更新	中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站	2025 年 6 月 30 日
15	大成沪深 300 指数证券投资基金(C 类份额)基金产品资料概要更新	中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站	2025 年 6 月 30 日

16	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
17	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
18	大成沪深 300 指数证券投资基金更新招募说明书	中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站	2025 年 5 月 6 日
19	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
20	大成沪深 300 指数证券投资基金 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
21	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
22	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
23	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
24	大成沪深 300 指数证券投资基金 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
25	大成基金管理有限公司关于旗下部分基金估值调整情况的公告	中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站	2025 年 3 月 25 日
26	大成沪深 300 指数证券投资基金更新招募说明书	中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站	2025 年 3 月 7 日
27	大成沪深 300 指数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 5 日
28	大成基金管理有限公司关于旗下部分完全按照指数构成比例投资的基金修订基金合同关联交易限制条款的公告	中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站	2025 年 3 月 5 日
29	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
30	大成沪深 300 指数证券投资基金 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
31	关于大成沪深 300 指数证券投资基金	中国证监会基金电子披	2025 年 1 月 20 日

	恢复大额申购（含定期定额申购）业务的公告	露网站、规定报刊及本公司网站	
32	大成基金管理有限公司关于大成沪深 300 指数证券投资基金 2024 年度第 1 次分红的公告	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 1 月 16 日
33	关于大成沪深 300 指数证券投资基金暂停大额申购（含定期定额申购）业务的公告	中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站	2025 年 1 月 11 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

无。

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沪深 300 指数证券投资基金的文件；

2、《大成沪深 300 指数证券投资基金基金合同》；

3、《大成沪深 300 指数证券投资基金托管协议》；

4、大成基金管理有限公司批准文件、营业执照、公司章程；

5、本报告期内在规定报刊上披露的各种公告原稿。

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