

# 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 2026 年第 2 季度报告

2026 年 6 月 30 日

基金管理人：大成基金管理有限公司

基金托管人：招商银行股份有限公司

报告送出日期：2026 年 7 月 21 日

§1 重要提示

基金管理人的董事会及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责任。

基金托管人招商银行股份有限公司根据本基金合同约定，于 2026 年 07 月 20 日复核了本报告中的财务指标、净值表现和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。

本报告中财务资料未经审计。  
本报告期自 2026 年 04 月 01 日起至 06 月 30 日止。

§2 基金产品概况

2.1 基金基本情况

|            |                                                                                                                                                                                                                                                                                 |
|------------|---------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
| 基金简称       | 大成中证 A500ETF 发起式联接                                                                                                                                                                                                                                                              |
| 基金主代码      | 022421                                                                                                                                                                                                                                                                          |
| 基金运作方式     | 契约型开放式                                                                                                                                                                                                                                                                          |
| 基金合同生效日    | 2024 年 11 月 29 日                                                                                                                                                                                                                                                                |
| 报告期末基金份额总额 | 434,168,661.10 份                                                                                                                                                                                                                                                                |
| 投资目标       | 本基金主要投资于目标 ETF，紧密跟踪业绩比较基准，追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化。                                                                                                                                                                                                                                     |
| 投资策略       | 在正常市场情况下，本基金与业绩比较基准的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%。如因指数编制规则调整或其他因素导致跟踪偏离度和跟踪误差超过上述范围，基金管理人应采取合理措施避免跟踪偏离度、跟踪误差进一步扩大。<br>(一) 目标 ETF 投资策略<br>(二) 股票投资策略<br>(三) 债券投资策略<br>(四) 资产支持证券投资策略<br>(五) 股指期货的投资策略<br>(六) 国债期货投资策略<br>(七) 股票期权投资策略<br>(八) 融资及转融通证券出借业务投资策略<br>(九) 存托凭证投资策略 |
| 业绩比较基准     | 中证 A500 指数收益率×95%+银行活期存款利率(税后)×5%                                                                                                                                                                                                                                               |
| 风险收益特征     | 本基金为大成中证 A500ETF 的联接基金，主要投资于目标                                                                                                                                                                                                                                                  |

|                 |                                                                                               |                      |                      |                      |
|-----------------|-----------------------------------------------------------------------------------------------|----------------------|----------------------|----------------------|
|                 | ETF，实现对业绩比较基准的紧密跟踪。因此，本基金的业绩表现与中证 A500 指数及目标 ETF 的表现密切相关。本基金的预期风险与预期收益水平高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。 |                      |                      |                      |
| 基金管理人           | 大成基金管理有限公司                                                                                    |                      |                      |                      |
| 基金托管人           | 招商银行股份有限公司                                                                                    |                      |                      |                      |
| 下属分级基金的基金简称     | 大成中证 A500ETF 发起式联接 A                                                                          | 大成中证 A500ETF 发起式联接 C | 大成中证 A500ETF 发起式联接 E | 大成中证 A500ETF 发起式联接 Y |
| 下属分级基金的交易代码     | 022421                                                                                        | 022422               | 022423               | 022904               |
| 报告期末下属分级基金的份额总额 | 228,676,036.00 份                                                                              | 196,039,902.72 份     | 6,100,266.10 份       | 3,352,456.28 份       |

2.1.1 目标基金基本情况

|              |                          |
|--------------|--------------------------|
| 基金名称         | 大成中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金 |
| 基金主代码        | 159358                   |
| 基金运作方式       | 交易型开放式                   |
| 基金合同生效日      | 2024 年 11 月 22 日         |
| 基金份额上市的证券交易所 | 深圳证券交易所                  |
| 上市日期         | 2024 年 11 月 29 日         |
| 基金管理人名称      | 大成基金管理有限公司               |
| 基金托管人名称      | 招商银行股份有限公司               |

2.1.2 目标基金产品说明

|        |                                                                                                                          |
|--------|--------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
| 投资目标   | 紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化。在正常市场情况下，本基金的日均跟踪偏离度的绝对值争取不超过 0.2%，年跟踪误差争取不超过 2%。                                              |
| 投资策略   | （一）股票投资策略<br>（二）衍生金融产品投资策略<br>（三）债券投资策略<br>（四）资产支持证券投资策略<br>（五）融资及转融通证券出借策略<br>（六）存托凭证投资策略                               |
| 业绩比较基准 | 中证 A500 指数收益率                                                                                                            |
| 风险收益特征 | 本基金属于股票型基金，其预期收益及预期风险水平高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。<br>本基金为被动式投资的股票型指数基金，主要采用完全复制策略，跟踪中证 A500 指数，其风险收益特征与标的指数所表征的市场组合的风险收益特征相似。 |

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位：人民币元

| 主要财务指标          | 报告期（2026 年 4 月 1 日 - 2026 年 6 月 30 日） |                      |                      |                      |
|-----------------|---------------------------------------|----------------------|----------------------|----------------------|
|                 | 大成中证 A500ETF 发起式联接 A                  | 大成中证 A500ETF 发起式联接 C | 大成中证 A500ETF 发起式联接 E | 大成中证 A500ETF 发起式联接 Y |
| 1. 本期已实现收益      | 31,168,129.44                         | 20,825,170.80        | 849,957.21           | 310,550.53           |
| 2. 本期利润         | 61,795,666.76                         | 36,673,657.86        | 1,502,803.69         | 523,245.65           |
| 3. 加权平均基金份额本期利润 | 0.1806                                | 0.1727               | 0.1780               | 0.1732               |
| 4. 期末基金资产净值     | 308,168,072.85                        | 263,121,603.11       | 8,208,031.58         | 4,518,796.41         |
| 5. 期末基金份额净值     | 1.3476                                | 1.3422               | 1.3455               | 1.3479               |

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

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

大成中证 A500ETF 发起式联接 A

| 阶段         | 净值增长率① | 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      | 14.46% | 1.32%     | 13.54%     | 1.34%         | 0.92%  | -0.02% |
| 过去六个月      | 11.02% | 1.19%     | 11.34%     | 1.22%         | -0.32% | -0.03% |
| 过去一年       | 34.79% | 1.07%     | 34.41%     | 1.09%         | 0.38%  | -0.02% |
| 自基金合同生效起至今 | 36.45% | 1.04%     | 36.30%     | 1.06%         | 0.15%  | -0.02% |

大成中证 A500ETF 发起式联接 C

| 阶段    | 净值增长率① | 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 | 14.39% | 1.32%     | 13.54%     | 1.34%         | 0.85% | -0.02% |

|                |        |       |        |       |        |        |
|----------------|--------|-------|--------|-------|--------|--------|
| 过去六个月          | 10.89% | 1.19% | 11.34% | 1.22% | -0.45% | -0.03% |
| 过去一年           | 34.45% | 1.07% | 34.41% | 1.09% | 0.04%  | -0.02% |
| 自基金合同<br>生效起至今 | 35.92% | 1.04% | 36.30% | 1.06% | -0.38% | -0.02% |

大成中证 A500ETF 发起式联接 E

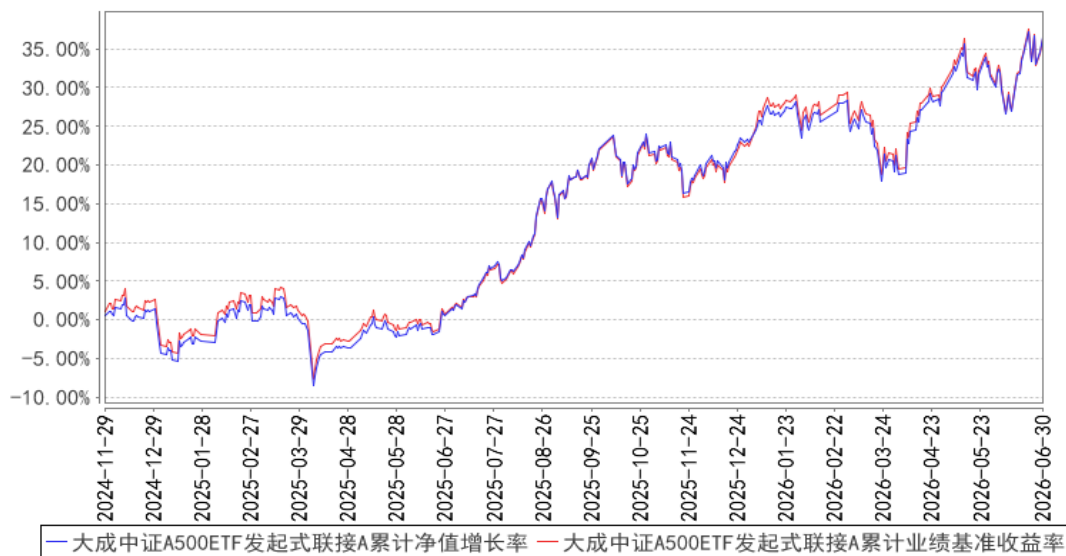
| 阶段             | 净值增长率① | 净值增长率标准差② | 业绩比较基准收益率③ | 业绩比较基准收益率标准差④ | ①—③    | ②—④    |
|----------------|--------|-----------|------------|---------------|--------|--------|
| 过去三个月          | 14.43% | 1.32%     | 13.54%     | 1.34%         | 0.89%  | -0.02% |
| 过去六个月          | 10.97% | 1.19%     | 11.34%     | 1.22%         | -0.37% | -0.03% |
| 过去一年           | 34.66% | 1.07%     | 34.41%     | 1.09%         | 0.25%  | -0.02% |
| 自基金合同<br>生效起至今 | 36.24% | 1.04%     | 36.30%     | 1.06%         | -0.06% | -0.02% |

大成中证 A500ETF 发起式联接 Y

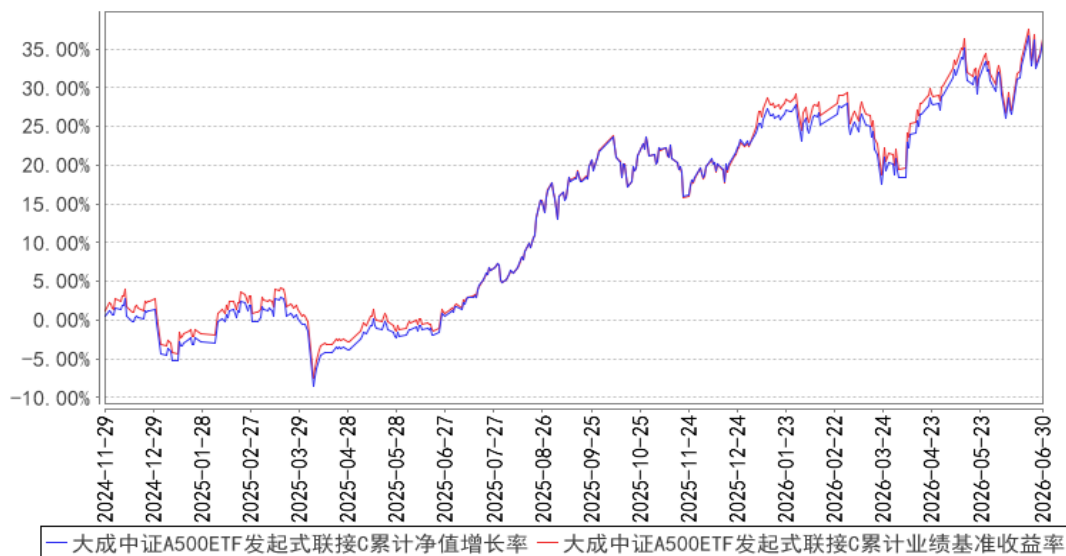
| 阶段             | 净值增长率① | 净值增长率标准差② | 业绩比较基准收益率③ | 业绩比较基准收益率标准差④ | ①—③    | ②—④    |
|----------------|--------|-----------|------------|---------------|--------|--------|
| 过去三个月          | 14.46% | 1.32%     | 13.54%     | 1.34%         | 0.92%  | -0.02% |
| 过去六个月          | 11.03% | 1.19%     | 11.34%     | 1.22%         | -0.31% | -0.03% |
| 过去一年           | 34.79% | 1.07%     | 34.41%     | 1.09%         | 0.38%  | -0.02% |
| 自基金合同<br>生效起至今 | 35.74% | 1.05%     | 33.93%     | 1.06%         | 1.81%  | -0.01% |

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

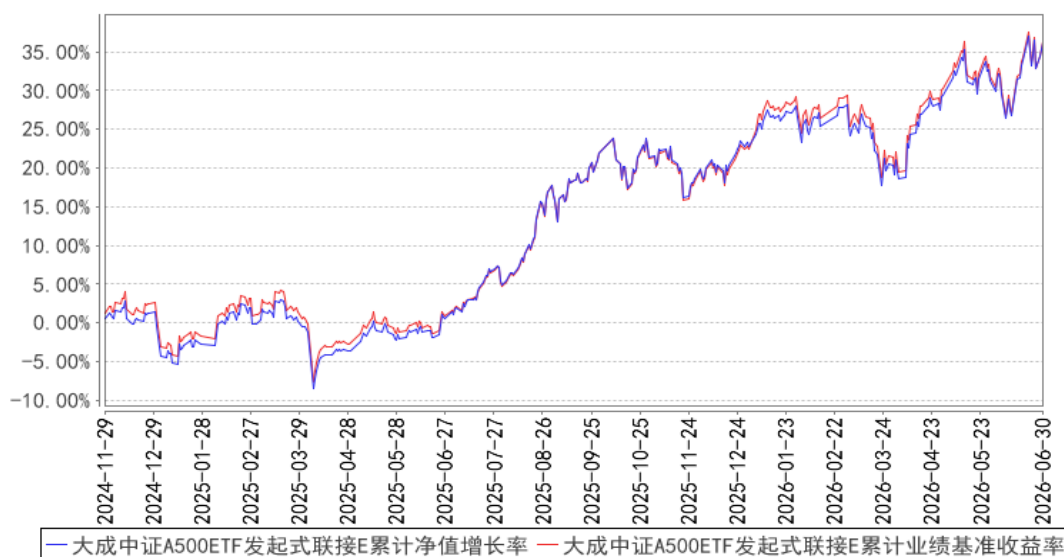
大成中证**A500ETF**发起式联接**A**累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



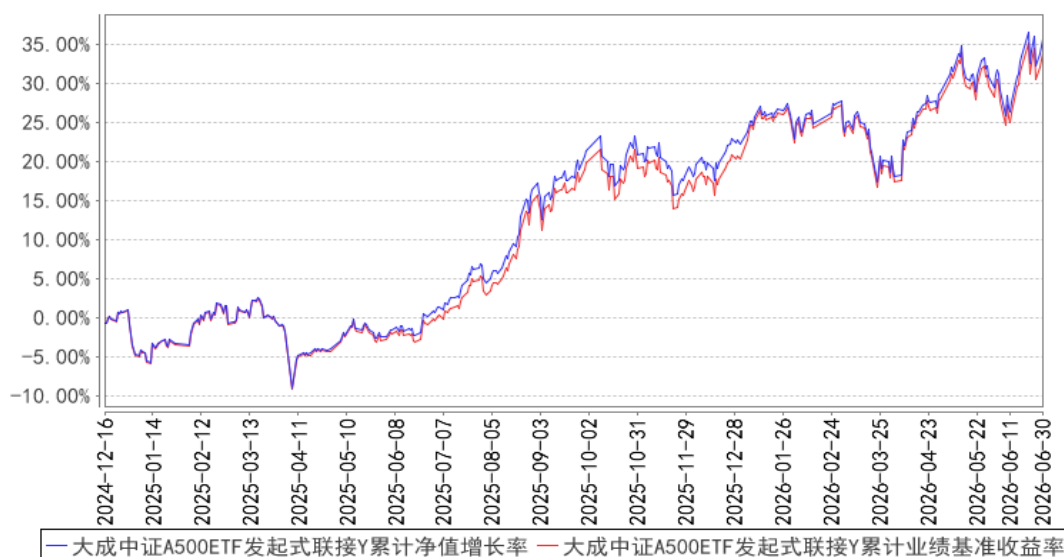
大成中证**A500ETF**发起式联接**C**累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



大成中证**A500ETF**发起式联接**E**累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



大成中证**A500ETF**发起式联接**Y**累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：1、本基金合同规定，基金管理人应当自基金合同生效之日（转型日）起六个月内使基金的投资组合比例符合基金合同约定。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、本基金于 2024 年 11 月 29 日由大成中证 A500 指数型发起式证券投资基金转型为大成中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金。

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 16 日有份额之日开始计算。

## §4 管理人报告

### 4.1 基金经理（或基金经理小组）简介

| 姓名 | 职务      | 任本基金的基金经理期限      |      | 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 | 2024 年 11 月 12 日 | -    | 18 年   | 北京大学工商管理硕士。2008 年 4 月至 2011 年 5 月就职于招商基金管理有限公司，任基金核算部基金会计。2011 年 5 月加入大成基金管理有限公司，先后担任基金运营部基金会计、股票投资部投委会秘书兼风控员、数量与指数投资部数量分析师、指数与期货投资部基金经理、指数与期货投资部总监助理。2020 年 6 月 29 日至 2023 年 5 月 30 日任大成 MSCI 中国 A 股质优价值 100 交易型开放式指数证券投资基金基金经理。2020 年 6 月 29 日至 2023 年 6 月 14 日任大成 MSCI 中国 A 股质优价值 100 交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理。2020 年 6 月 29 日至 2025 年 12 月 19 日任深证成长 40 交易型开放式指数证券投资基金、大成深证成长 40 交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理。2020 年 6 月 29 日至 2022 年 11 月 30 日任大成中证 500 深市交易型开放式指数证券投资基金基金经理。2021 年 4 月 30 日至 2025 年 7 月 29 日任大成中证全指医疗保健设备与服务交易型开放式指数证券投资基金基金经理。2021 年 6 月 17 日起任大成中证红利指数证券投资基金基金经理。2021 年 9 月 2 日至 2022 年 12 月 8 日任中证 500 沪市交易型开放式指数证券投资基金基金经理。2021 年 9 月 2 日至 2025 年 3 月 17 日任大成中证 A100 交易型开放式指数证券投资基金（更名前为大成中证 100 交易型开放式指数证券投资基金）基金经理。2021 年 9 月 2 日至 2025 年 12 月 19 日任大成深证成份交易型开放式指数证券投资基金基金经理。2022 年 6 月 28 日至 2025 年 2 月 18 日任大成中证电池主题指数型发起式证券投资基金基金经理。2022 年 7 月 13 日至 2025 年 3 月 17 日任大成中证上海环交所碳中和交易型开放式指数证券投资基金基金经理。2022 年 10 月 13 日至 2023 年 10 月 20 日任大成动态量化配置策略混合型证券投资基金基金经理。2023 年 3 月 20 日起任大成有色金属期货交易型开放式指数证券投资 |

|  |  |  |  |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                       |
|--|--|--|--|---------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
|  |  |  |  | <p>基金、大成有色金属期货交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理。2023 年 4 月 14 日起任大成沪深 300 指数证券投资基金基金经理。2024 年 3 月 6 日起任大成中证 A50 交易型开放式指数证券投资基金基金经理。2024 年 4 月 8 日至 2025 年 7 月 29 日任大成中证红利低波动 100 交易型开放式指数证券投资基金基金经理。2024 年 4 月 23 日起任大成中证 A50 交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理。2024 年 5 月 24 日至 2025 年 2 月 18 日任大成中证芯片产业指数型发起式证券投资基金基金经理。2024 年 5 月 28 日至 2025 年 7 月 29 日任大成中证工程机械主题交易型开放式指数证券投资基金基金经理。2024 年 11 月 12 日起任大成中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金(转型前为大成中证 A500 指数型发起式证券投资基金)基金经理。2024 年 11 月 22 日起任大成中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金基金经理。2025 年 4 月 2 日起任大成深证 100 交易型开放式指数证券投资基金基金经理。2025 年 4 月 23 日起任大成中证全指自由现金流交易型开放式指数证券投资基金基金经理。2025 年 7 月 2 日起任大成中证全指自由现金流交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金基金经理。2025 年 7 月 16 日起担任大成创业板人工智能交易型开放式指数证券投资基金基金经理。2025 年 8 月 29 日起任大成创业板 50 交易型开放式指数证券投资基金基金经理。2025 年 9 月 23 日起任大成创业板 50 交易型开放式指数证券投资基金联接基金(转型前为大成创业板 50 指数型证券投资基金)基金经理。2025 年 10 月 21 日起任大成创业板人工智能交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金基金经理。2026 年 2 月 12 日起任大成国证石油天然气指数型发起式证券投资基金基金经理。2026 年 6 月 16 日起任大成上证科创板 50 成份指数型证券投资基金基金经理。具备基金从业资格。国籍：中国</p> |
|--|--|--|--|---------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|

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《证券投资基金经营机构董事、监事、高级管理人员及从业人员监督管理办法》的相关规定。

#### 4.1.1 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理同时管理的产品情况

无。

#### 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

报告期内，本基金管理人严格遵守《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 公平交易专项说明

##### 4.3.1 公平交易制度的执行情况

报告期内，公司严格执行了公平交易的原则和制度。公司运用统计分析方法和工具，对旗下所有投资组合连续 4 个季度的日内、3 日内、5 日内及 10 日内股票及债券交易同向交易价差进行分析，针对同一基金经理管理的多个投资组合及公私募兼任基金经理管理的多个投资组合的投资交易行为加强了公平交易监测与分析，包括对不同时间窗下（同日、3 日、5 日、10 日）反向交易和同向交易价差监控的分析。分析结果表明：债券交易同向交易频率较低；部分股票同向交易溢价率较大主要来源于投资策略差异、市场因素（如个股当日价格振幅较高）及组合经理交易时机选择，同时结合交易价差专项统计分析，未发现违反公平交易原则的异常情况。

##### 4.3.2 异常交易行为的专项说明

报告期内，公司旗下所有投资组合未发现存在异常交易行为。公司旗下投资组合间存在证券同日反向交易，但不存在参与交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量 5% 的情形。投资组合间相邻交易日反向交易的市场成交比例、成交均价等交易结果数据表明该类交易不对市场产生重大影响，无异常。

#### 4.4 报告期内基金的投资策略和运作分析

二季度，A 股市场波动显著，风格极致分化。收益方面，沪深 300 涨 11.90%；中证 500 涨 18.56%；中证 1000 涨 15.62%；创业板指涨 36.35%；科创 50 涨 75.74%。行业上，电子、通信、建材涨幅较高；消费者服务、农林牧渔和综合表现不佳。风格上，成长大幅占优。

报告期内，股票市场行情的内在逻辑可以概括为四个阶段：地缘压制下的缩量拉锯、风险缓释触发的成长修复、事件催化峰值与分母扰动的博弈，以及地缘溢价消退与政策共振下的风格极致加速。贯穿始终的矛盾是人工智能算力产业景气与传统资源、红利资产之间的对立。季度初，

中东地缘冲突的冲击余波仍在，市场延续调整态势，资金观望情绪主导。指数基本上围绕关键关口震荡，但并未形成有效反弹。特朗普政府在“极限施压”与“谈判缓和”间的频繁切换，进一步扰乱了市场对宏观风险的定价秩序，A 股整体缩量拉锯。4 月 8 日后，由于美伊进入停火谈判窗口期，霍尔木兹海峡通行回升，尾部风险骤降，跨资产联动性回落，市场由此进入一轮以成长风格为核心的估值修复行情。前期超跌的科技板块反弹幅度居前，红利价值风格相对承压。这一轮行情并非纯粹的情绪修复，AI 产业链恰好步入一季度业绩验证期，硬件龙头盈利高增兑现了市场此前的预期差，叠加 DeepSeek V4 模型发布及国产算力订单上修，产业趋势与基本面确定性形成共振，驱动行情由超跌修复演变为具有盈利支撑的趋势性上行，日均成交额随之显著回升，市场情绪改善。5 月的特朗普访华以及中美元首构建“建设性战略稳定关系”共识落地后，外交层面的超预期进展将市场风险偏好推升至阶段性峰值，上证指数一度创十年新高。然而，重大利好兑现后市场即进入长达近一个月的震荡回调期。五月中至六月上旬调整的原因由外而内层层叠加：分母端，美国通胀、非农数据全面超预期，鹰派新主席沃什履新后美联储全年降息预期基本被排除，10 年期美债收益率向上突破关口，市场进一步交易预防性加息可能，高利率环境对全球风险资产构成持续压制；流动性方面，内外部扰动在 6 月上旬集中释放；结构上，TMT 方向筹码拥挤，财报真空期缺乏新催化等等。部分资金从高拥挤的科技方向向煤炭、电力等低估值防御板块切换，市场进入存量博弈格局。转折出现在 6 月 11 日——特朗普宣布取消对伊空袭，美伊协议进入最终文本协调阶段，布油价格应声下跌，地缘风险溢价系统性消退。传统能源与红利板块估值的支撑之一是地缘溢价，溢价退潮后持仓资金从价值端被动向成长端腾挪，加速了风格的再平衡。此外，陆家嘴论坛与央行六项定向措施对科技资产给予背书，加之板块在前期震荡中完成了筹码净化，低摩擦启动条件与多重利好共振，推动科技在最后两周单边强势拉升，并与红利资产之间的形成巨大收益差，成为近年指数史上极端风格分化事件之一。

本基金以大成中证 A500ETF 作为其主要投资标的，业绩比较基准为中证 A500 指数收益率 $\times 95\%$ +银行活期存款利率(税后) $\times 5\%$ 。本基金在综合考虑合规、风险、效率、成本等因素的基础上，采用一级市场申购赎回或二级市场买卖的方式对目标 ETF 进行投资。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。

#### 4.5 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末大成中证 A500ETF 发起式联接 A 的基金份额净值为 1.3476 元，本报告期基金份额净值增长率为 14.46%，同期业绩比较基准收益率为 13.54%；截至本报告期末大成中证 A500ETF 发起式联接 C 的基金份额净值为 1.3422 元，本报告期基金份额净值增长率为 14.39%，同期业绩比较基准收益率为 13.54%；截至本报告期末大成中证 A500ETF 发起式联接 E 的基金份额净值为

1.3455 元，本报告期基金份额净值增长率为 14.43%，同期业绩比较基准收益率为 13.54%；截至本报告期末大成中证 A500ETF 发起式联接 Y 的基金份额净值为 1.3479 元，本报告期基金份额净值增长率为 14.46%，同期业绩比较基准收益率为 13.54%。

#### 4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

无。

## §5 投资组合报告

### 5.1 报告期末基金资产组合情况

| 序号 | 项目                | 金额（元）          | 占基金总资产的比例（%） |
|----|-------------------|----------------|--------------|
| 1  | 权益投资              | 2,114,599.95   | 0.36         |
|    | 其中：股票             | 2,114,599.95   | 0.36         |
| 2  | 基金投资              | 549,231,465.34 | 93.48        |
| 3  | 固定收益投资            | 4,049,435.34   | 0.69         |
|    | 其中：债券             | 4,049,435.34   | 0.69         |
|    | 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      | 31,251,348.98  | 5.32         |
| 8  | 其他资产              | 920,265.34     | 0.16         |
| 9  | 合计                | 587,567,114.95 | 100.00       |

### 5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

#### 5.2.1 报告期末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         | 15,504.00    | 0.00         |
| B  | 采矿业              | 91,683.00    | 0.02         |
| C  | 制造业              | 1,484,017.95 | 0.25         |
| D  | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | 56,753.00    | 0.01         |
| E  | 建筑业              | 23,939.00    | 0.00         |
| F  | 批发和零售业           | 8,044.00     | 0.00         |
| G  | 交通运输、仓储和邮政业      | 47,821.00    | 0.01         |
| H  | 住宿和餐饮业           | —            | —            |
| I  | 信息传输、软件和信息技术服务业  | 74,048.00    | 0.01         |
| J  | 金融业              | 219,739.00   | 0.04         |
| K  | 房地产业             | 17,236.00    | 0.00         |

|   |               |              |      |
|---|---------------|--------------|------|
| L | 租赁和商务服务业      | 24,936.00    | 0.00 |
| M | 科学研究和技术服务业    | 30,567.00    | 0.01 |
| N | 水利、环境和公共设施管理业 | 5,166.00     | 0.00 |
| O | 居民服务、修理和其他服务业 | —            | —    |
| P | 教育            | 1,440.00     | 0.00 |
| Q | 卫生和社会工作       | 6,968.00     | 0.00 |
| R | 文化、体育和娱乐业     | 3,380.00     | 0.00 |
| S | 综合            | 3,358.00     | 0.00 |
|   | 合计            | 2,114,599.95 | 0.36 |

### 5.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

无。

### 5.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的股票投资明细

#### 5.3.1 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

| 序号 | 股票代码   | 股票名称  | 数量（股） | 公允价值（元）    | 占基金资产净值比例（%） |
|----|--------|-------|-------|------------|--------------|
| 1  | 300308 | 中际旭创  | 100   | 127,000.00 | 0.02         |
| 2  | 300502 | 新易盛   | 200   | 121,400.00 | 0.02         |
| 3  | 300750 | 宁德时代  | 300   | 117,903.00 | 0.02         |
| 4  | 002384 | 东山精密  | 200   | 52,470.00  | 0.01         |
| 5  | 000333 | 美的集团  | 600   | 45,318.00  | 0.01         |
| 6  | 002475 | 立讯精密  | 600   | 42,240.00  | 0.01         |
| 7  | 000725 | 京东方 A | 4,300 | 37,324.00  | 0.01         |
| 8  | 601318 | 中国平安  | 700   | 33,418.00  | 0.01         |
| 9  | 300408 | 三环集团  | 200   | 33,380.00  | 0.01         |
| 10 | 300059 | 东方财富  | 1,600 | 32,608.00  | 0.01         |

### 5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

| 序号 | 债券品种      | 公允价值（元）      | 占基金资产净值比例（%） |
|----|-----------|--------------|--------------|
| 1  | 国家债券      | 4,049,435.34 | 0.69         |
| 2  | 央行票据      | —            | —            |
| 3  | 金融债券      | —            | —            |
|    | 其中：政策性金融债 | —            | —            |
| 4  | 企业债券      | —            | —            |
| 5  | 企业短期融资券   | —            | —            |
| 6  | 中期票据      | —            | —            |
| 7  | 可转债（可交换债） | —            | —            |
| 8  | 同业存单      | —            | —            |
| 9  | 其他        | —            | —            |
| 10 | 合计        | 4,049,435.34 | 0.69         |

### 5.5 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债券投资明细

| 序号 | 债券代码   | 债券名称     | 数量（张）  | 公允价值（元）      | 占基金资产净值比例（%） |
|----|--------|----------|--------|--------------|--------------|
| 1  | 019785 | 25 国债 13 | 35,000 | 3,544,189.18 | 0.61         |

|   |        |          |       |            |      |
|---|--------|----------|-------|------------|------|
| 2 | 019792 | 25 国债 19 | 5,000 | 505,246.16 | 0.09 |
|---|--------|----------|-------|------------|------|

5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券投资  
明细

无。

5.7 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。

5.8 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权证投资明细

无。

5.9 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名基金投资明细

| 序号 | 基金名称            | 基金类型 | 运作方式       | 管理人                | 公允价值（元）        | 占基金资产<br>净值比例(%) |
|----|-----------------|------|------------|--------------------|----------------|------------------|
| 1  | 大成中证<br>A500ETF | 股票型  | 交易型开<br>放式 | 大成基金<br>管理有限<br>公司 | 549,231,465.34 | 94.04            |

5.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

无。

5.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

无。

5.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.11.1 本期国债期货投资政策

无。

5.11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

无。

5.11.3 本期国债期货投资评价

无。

5.12 投资组合报告附注

5.12.1 本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。

**5.12.2 基金投资的前十名股票是否超出基金合同约定的备选股票库**

本基金投资的前十名股票未超出基金合同规定的备选股票库。

**5.12.3 其他资产构成**

| 序号 | 名称      | 金额（元）      |
|----|---------|------------|
| 1  | 存出保证金   | 367,526.86 |
| 2  | 应收证券清算款 | —          |
| 3  | 应收股利    | —          |
| 4  | 应收利息    | —          |
| 5  | 应收申购款   | 552,738.48 |
| 6  | 其他应收款   | —          |
| 7  | 其他      | —          |
| 8  | 合计      | 920,265.34 |

**5.12.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细**

无。

**5.12.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明**

无。

**5.12.6 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。

**§6 开放式基金份额变动**

单位：份

| 项目                        | 大成中证 A500ETF 发起式联接 A | 大成中证 A500ETF 发起式联接 C | 大成中证 A500ETF 发起式联接 E | 大成中证 A500ETF 发起式联接 Y |
|---------------------------|----------------------|----------------------|----------------------|----------------------|
| 报告期期初基金份额总额               | 457,073,444.64       | 229,950,608.78       | 11,576,093.69        | 2,834,766.09         |
| 报告期期间基金总申购份额              | 18,566,146.71        | 16,795,402.15        | 9,505,507.99         | 1,107,876.47         |
| 减：报告期期间基金总赎回份额            | 246,963,555.35       | 50,706,108.21        | 14,981,335.58        | 590,186.28           |
| 报告期期间基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列） | —                    | —                    | —                    | —                    |
| 报告期期末基金份额总额               | 228,676,036.00       | 196,039,902.72       | 6,100,266.10         | 3,352,456.28         |

**§7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况****7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况**

单位：份

| 项目 | 大成中证 A500ETF 发起式联接 A | 大成中证 A500ETF 发起式联接 C | 大成中证 A500ETF 发起式联接 E | 大成中证 A500ETF |
|----|----------------------|----------------------|----------------------|--------------|
|----|----------------------|----------------------|----------------------|--------------|

|                          |               |   |   | 发起式联接 Y |
|--------------------------|---------------|---|---|---------|
| 报告期期初管理人持有的本基金份额         | 10,005,056.06 | - | - | -       |
| 报告期期间买入/申购总份额            | -             | - | - | -       |
| 报告期期间卖出/赎回总份额            | -             | - | - | -       |
| 报告期期末管理人持有的本基金份额         | 10,005,056.06 | - | - | -       |
| 报告期期末持有的本基金份额占基金总份额比例（%） | 2.30          | - | - | -       |

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

无。

§ 8 报告期末发起式基金发起资金持有份额情况

| 项目          | 持有份额总数        | 持有份额占基金总份额比例(%) | 发起份额总数        | 发起份额占基金总份额比例(%) | 发起份额承诺持有期限 |
|-------------|---------------|-----------------|---------------|-----------------|------------|
| 基金管理人固有资金   | 10,005,056.06 | 2.30            | 10,005,056.06 | 2.30            | 3 年        |
| 基金管理人高级管理人员 | 157,977.88    | 0.04            | -             | -               | -          |
| 基金经理等人员     | 148,943.94    | 0.03            | -             | -               | -          |
| 基金管理人股东     | -             | -               | -             | -               | -          |
| 其他          | -             | -               | -             | -               | -          |
| 合计          | 10,311,977.88 | 2.38            | 10,005,056.06 | 2.30            | 3 年        |

§9 影响投资者决策的其他重要信息

9.1 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。

9.2 影响投资者决策的其他重要信息

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

§10 备查文件目录

### 10.1 备查文件目录

- 1、中国证监会批准设立大成中证 A500 指数型发起式证券投资基金的文件；
- 2、《大成中证 A500 指数型发起式证券投资基金基金合同》；
- 3、《大成中证 A500 指数型发起式证券投资基金托管协议》；
- 4、《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基金合同》；
- 5、《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托管协议》；
- 6、《关于大成中证 A500 指数型发起式证券投资基金变更为大成中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金并相应修订法律文件的公告》；
- 7、大成基金管理有限公司批准文件、营业执照、公司章程；
- 8、本报告期内在规定报刊上披露的各种公告原稿。

### 10.2 存放地点

备查文件存放在本基金管理人和托管人的住所。

### 10.3 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 7 月 21 日