

大成策略回报混合型证券投资基金

2026 年中期报告

2026 年 6 月 30 日

基金管理人：大成基金管理有限公司

基金托管人：中国光大银行股份有限公司

送出日期：2026 年 8 月 28 日

§ 1 重要提示及目录

1.1 重要提示

基金管理人的董事会、董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带的法律责任。本中期报告已经三分之二以上独立董事签字同意。

基金托管人中国光大银行股份有限公司根据本基金合同约定，于 2026 年 08 月 27 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书及其更新。

本报告财务资料未经审计。

本报告期自 2026 年 01 月 01 日起至 06 月 30 日止。

1.2 目录

§ 1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
§ 2 基金简介	5
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人和基金托管人	5
2.4 信息披露方式	6
2.5 其他相关资料	6
§ 3 主要财务指标和基金净值表现	6
3.1 主要会计数据和财务指标	6
3.2 基金净值表现	7
§ 4 管理人报告	9
4.1 基金管理人及基金经理情况	9
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	10
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	10
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明	11
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	11
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	11
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	12
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明	12
§ 5 托管人报告	12
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	12
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	13
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	13
§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）	13
6.1 资产负债表	13
6.2 利润表	14
6.3 净资产变动表	16
6.4 报表附注	18
§ 7 投资组合报告	42
7.1 期末基金资产组合情况	42
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	43
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细	43
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	50
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	51
7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细	51
7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细	51
7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细	52

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细	52
7.10 本基金投资股指期货的投资政策	52
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	52
7.12 投资组合报告附注	52
§ 8 基金份额持有人信息	53
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	53
8.2 盈利投资者数量占比	53
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	53
8.4 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	54
§ 9 开放式基金份额变动	54
§ 10 重大事件揭示	55
10.1 基金份额持有人大会决议	55
10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动	55
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	55
10.4 基金投资策略的改变	55
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	55
10.6 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况	55
10.7 基金租用或者通过证券公司交易单元进行证券投资的相关情况	56
10.8 其他重大事件	57
§ 11 影响投资者决策的其他重要信息	58
11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况	58
11.2 影响投资者决策的其他重要信息	58
§ 12 备查文件目录	58
12.1 备查文件目录	58
12.2 存放地点	58
12.3 查阅方式	58

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	大成策略回报混合型证券投资基金	
基金简称	大成策略回报混合	
基金主代码	090007	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2008 年 11 月 26 日	
基金管理人	大成基金管理有限公司	
基金托管人	中国光大银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	2,338,580,254.84 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	大成策略回报混合 A	大成策略回报混合 C
下属分级基金的交易代码	090007	018225
报告期末下属分级基金的份额总额	2,039,960,042.04 份	298,620,212.80 份

2.2 基金产品说明

投资目标	追求基金资产的长期稳健增值，兼顾当期收益；同时，实施积极的分红政策，回报投资者。
投资策略	本基金在控制风险的前提下，采取趋势投资策略进行总体资产配置；在行业配置、个股投资上分别实施行业轮动投资策略、核心-卫星策略、价值投资策略、买入并持有策略，以期在承担中高风险的前提下获取尽可能高的投资收益；同时，强调收益管理，实施收益管理策略，以期在增长期及时锁定收益，制度性的减少未来可能的下跌风险，增加投资总收益。
业绩比较基准	80%×沪深 300 指数收益率+20%×中债综合指数收益率
风险收益特征	本基金属于风险收益水平适中的混合型基金品种，其长期平均的预期收益和风险低于股票基金，高于债券基金和货币市场基金。

注：本基金业绩比较基准自 2015 年 9 月 14 日起由原“80%×沪深 300 指数收益率+20%×中信标普全债指数收益率”变更为“80%×沪深 300 指数收益率+20%×中债综合指数收益率”。

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	中国光大银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	段皓静	王茵
	联系电话	0755-83183388	010-63639180
	电子邮箱	office@dcfund.com.cn	wangyin@cebbank.com
客户服务电话		4008885558	95595
传真		0755-83199588	010-63639132

注册地址	广东省深圳市南山区海德三道 1236 号大成基金总部大厦 5 层、27-33 层	北京市西城区太平桥大街 25 号、甲 25 号中国光大中心
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	北京市西城区太平桥大街 25 号中国光大中心
邮政编码	518054	100033
法定代表人	吴庆斌	吴利军

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《中国证券报》
登载基金中期报告的管理人互联网网址	www.dcfund.com.cn
基金中期报告置备地点	基金管理人及基金托管人住所

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	大成基金管理有限公司	广东省深圳市南山区海德三道 1236 号大成基金总部大厦 5 层、27-33 层

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2026 年 1 月 1 日 - 2026 年 6 月 30 日)	
	大成策略回报混合 A	大成策略回报混合 C
本期已实现收益	237,736,720.11	31,558,012.54
本期利润	-41,619,625.70	-6,771,283.69
加权平均基金份额本期利润	-0.0169	-0.0200
本期加权平均净值利润率	-1.48%	-1.77%
本期基金份额净值增长率	-2.85%	-3.15%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2026 年 6 月 30 日)	
期末可供分配利润	144,997,952.74	18,661,574.79
期末可供分配基金份额利润	0.0711	0.0625
期末基金资产净值	2,184,957,994.78	317,281,787.59
期末基金份额净值	1.0711	1.0625
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2026 年 6 月 30 日)	
基金份额累计净值增长率	828.88%	20.34%

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

大成策略回报混合 A

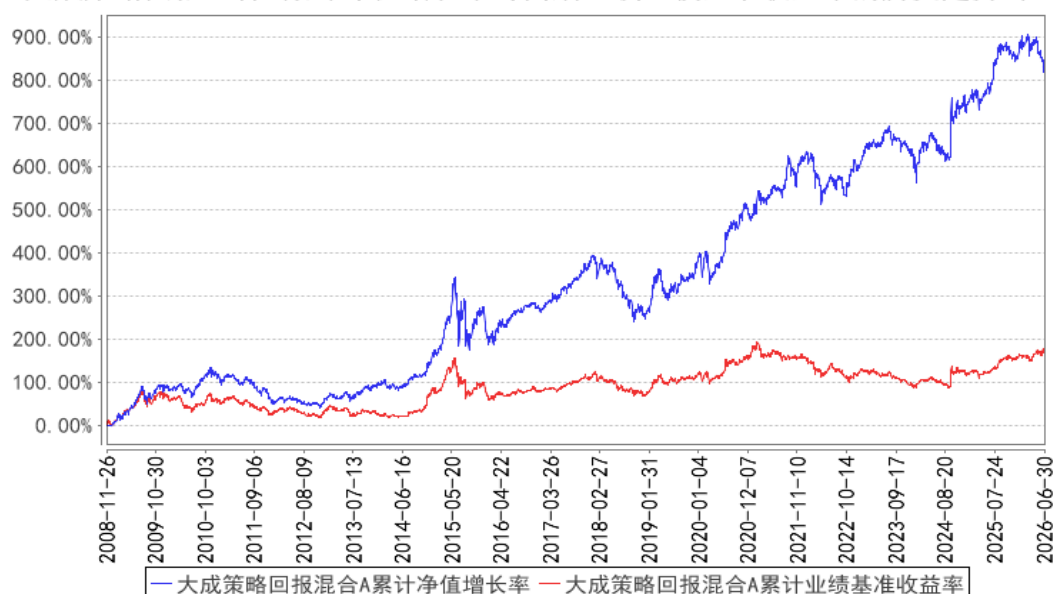
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①－③	②－④
过去三个月	-4.81%	0.53%	9.75%	1.01%	-14.56%	-0.48%
过去六个月	-2.85%	0.61%	6.55%	0.91%	-9.40%	-0.30%
过去一年	4.57%	0.57%	21.33%	0.81%	-16.76%	-0.24%
过去三年	19.56%	0.75%	26.99%	0.89%	-7.43%	-0.14%
过去五年	42.41%	0.76%	1.58%	0.89%	40.83%	-0.13%
过去七年	123.79%	0.84%	33.24%	0.93%	90.55%	-0.09%
过去十年	163.16%	0.90%	59.88%	0.92%	103.28%	-0.02%
自基金合同生效起至今	828.88%	1.26%	173.59%	1.13%	655.29%	0.13%

大成策略回报混合 C

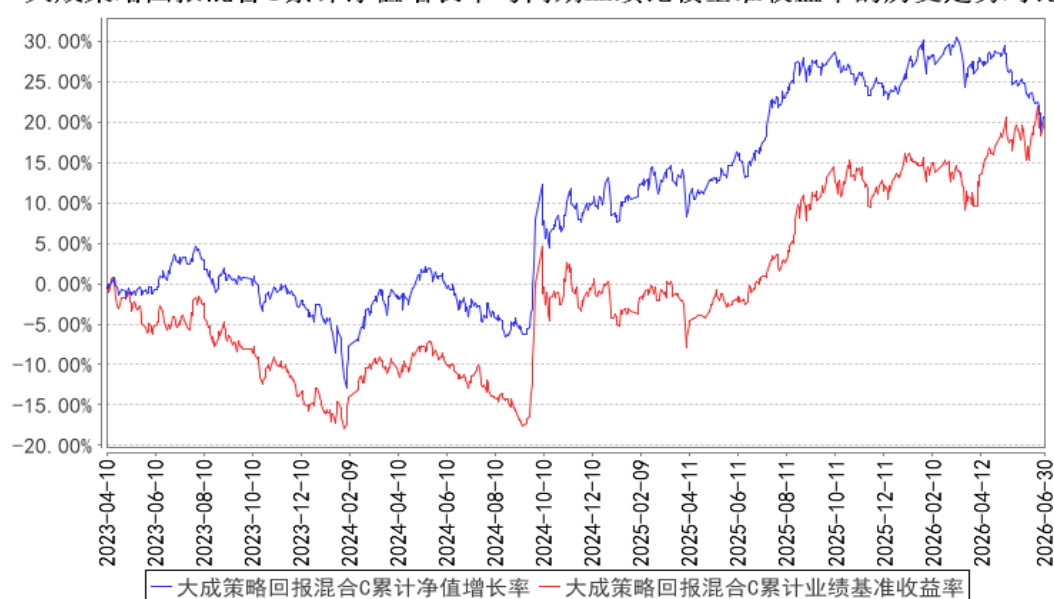
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①－③	②－④
过去三个月	-4.96%	0.53%	9.75%	1.01%	-14.71%	-0.48%
过去六个月	-3.15%	0.61%	6.55%	0.91%	-9.70%	-0.30%
过去一年	3.94%	0.57%	21.33%	0.81%	-17.39%	-0.24%
过去三年	17.47%	0.76%	26.99%	0.89%	-9.52%	-0.13%
自基金合同生效起至今	20.34%	0.74%	20.45%	0.87%	-0.11%	-0.13%

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

大成策略回报混合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



大成策略回报混合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、本基金于 2015 年 7 月 22 日起由大成策略回报股票型证券投资基金更名为大成策略回报混合型证券投资基金；

3、本基金自 2023 年 3 月 30 日起增设 C 类基金份额类别，C 类的净值增长率和业绩比较基准收益率自 2023 年 4 月 10 日有份额之日开始计算。

§ 4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

大成基金管理有限公司成立于 1999 年 4 月 12 日，注册资本人民币 2 亿元，是中国首批获准成立的“老十家”基金管理公司之一。公司总部位于深圳，同时设置了北方、华东和南方营销总部，在北京、上海等地开设有 5 家分公司。2009 年，公司在香港设立大成国际资产管理有限公司；2013 年，设立大成创新资本管理有限公司。

公司业务资质齐全，全面覆盖公募基金、机构投资、海外投资、财富管理、养老金管理等业务，还受全国社会保障基金理事会委托管理部分社保基金和基本养老保险基金。旗下大成国际资产管理公司具备 QFII、RQFII 等资格，是首批首家完成备案的能够提供港股通投资顾问服务的香港机构。

历经二十余年的磨砺和沉淀，大成基金形成了以长期投资能力为核心的竞争优势，打造了一支具有良好职业素养和丰富经验的资产管理队伍。公司目前已形成权益投资、固收投资、指数与期货投资、跨境投资、混合资产投资、大类资产配置六大投资团队，全面覆盖各类投资领域，综合实力不断提升，各项业务迅猛发展，管理资产种类位居同业前列。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
徐彦	本基金基金经理，首席权益投资官	2020 年 3 月 20 日	—	20 年	复旦大学管理学硕士。2006 年 7 月至 2007 年 7 月任职于中国东方资产管理公司。2007 年 7 月至 2018 年 9 月任职于大成基金管理有限公司，先后担任研究员、研究主管、股票投资部价值组投资总监，2012 年 10 月起历任大成策略回报混合型证券投资基金、大成竞争优势混合型证券投资基金、大成高新技术产业股票型证券投资基金和大成景阳领先混合型证券投资基金基金经理。2018 年 10 月至 2019 年 7 月任正心谷创新资本研究团队负责人。2019 年 8 月至 2021 年 2 月任大成基金管理有限公司股票投资部总监。2021 年 2 月起任首席权益投资官。2019 年 12 月 30 日起任大成睿享混合型证券投资基金、大成竞争优势混合型证券投资基金基金经理。2019 年 12 月 30 日至 2021 年 5 月 19

					日任大成景阳领先混合型证券投资基金基金经理。2020 年 3 月 20 日起任大成策略回报混合型证券投资基金基金经理。2020 年 7 月 16 日至 2021 年 8 月 18 日任大成创业板两年定期开放混合型证券投资基金基金经理。2021 年 7 月 16 日起任大成投资严选六个月持有期混合型证券投资基金基金经理。2021 年 11 月 26 日起任大成致远优势一年持有期混合型证券投资基金基金经理。2022 年 9 月 27 日起任大成弘远回报一年持有期混合型证券投资基金基金经理。2024 年 6 月 12 日起任大成卓远视野混合型证券投资基金基金经理。2025 年 3 月 11 日起任大成兴远启航混合型证券投资基金基金经理。具有基金从业资格。国籍：中国
--	--	--	--	--	---

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
徐彦	公募基金	8	13,501,666,714.87	2019 年 12 月 30 日
	私募资产管理计划	1	490,696,366.05	2024 年 3 月 15 日
	其他组合	-	-	-
	合计	9	13,992,363,080.92	-

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法》、《中华人民共和国证券投资基金法》等有关法律法规及基金合同、基金招募说明书等有关基金法律文件的规定，以取信于市场、取信于社会投资公众为宗旨，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在规范基金运作和严格控制投资风险的前提下，为基金份额持有人谋求最大利益，无损害基金份额持有人利益的行为。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

报告期内，公司严格执行了公平交易的原则和制度。公司运用统计分析方法和工具，对旗下所有投资组合间连续 4 个季度的日内、3 日内、5 日内及 10 日内股票及债券交易同向交易价差进

行分析，针对同一基金经理管理的多个投资组合及公私募兼任基金经理管理的多个投资组合的投资交易行为加强了公平交易监测与分析，包括对不同时间窗下（同日、3 日、5 日、10 日）反向交易和同向交易价差监控的分析。分析结果表明：债券交易同向交易频率较低；部分股票同向交易溢价率较大主要来源于投资策略差异、市场因素（如个股当日价格振幅较高）及组合经理交易时机选择，同时结合交易价差专项统计分析，未发现违反公平交易原则的异常情况。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

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

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

上半年本基金小幅下跌，明显跑输业绩基准并大幅跑输同行，其中二季度更是过去很多年里我管理的组合跑输同行最多的一个季度。本组合的持仓里几乎没有 AI 产业链的股票，是当期跑输的原因。

确实，我曾经在三四年前买过几只后来成为国内和国外 AI 产业链龙头股的股票，回头来看，卖出时 AI 产业趋势甚至都还谈不上开始。连我自己都怀疑这样的操作不能说明我有前瞻性，很可能恰恰相反说明我没有前瞻性没能预测产业界短期内如此巨大的资本开支，并且肯定也能说明我缺乏面对某一类股票时的勇气。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末大成策略回报混合 A 的基金份额净值为 1.0711 元，本报告期基金份额净值增长率为-2.85%，同期业绩比较基准收益率为 6.55%；截至本报告期末大成策略回报混合 C 的基金份额净值为 1.0625 元，本报告期基金份额净值增长率为-3.15%，同期业绩比较基准收益率为 6.55%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

技术进步、商业闭环和社会发展，环环相扣但并不天然如此。就股票投资而言，如果仅仅是把时间拉长到七月底，股市的巨大波动似乎又让保守成了一种美德。

不管是红利牛还是 AI 牛，不管是牛市还是熊市，赚钱从来不容易。股市里没有老师，股市自己就是最好的老师。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本基金管理人指导基金估值业务的领导小组为公司估值委员会，公司估值委员会主要负责估

值政策和估值程序的制定、修订以及执行情况的监督。估值委员会由公司分管领导、各投研部门、交易管理部、风险管理部、监察稽核部、基金运营部指定人员组成。公司估值委员会的相关成员均具备相应的专业胜任能力和相关工作经历。

各投研部门、风险管理部负责关注相关投资品种的动态，评判基金持有的投资品种是否处于不活跃的交易状态或者最近交易日后经济环境发生了重大变化或证券发行机构发生了影响证券价格的重大事件，从而确定估值日需要进行估值测算或者调整的投资品种；提出合理的数量分析模型对需要进行估值测算或者调整的投资品种进行公允价值定价与计量；定期对估值政策和程序进行评价，以保证其持续适用；交易管理部负责关注相关投资品种的流动性状况，协助反馈其市场交易信息；基金运营部负责日常的基金资产的估值业务，执行基金估值政策，并负责与托管人沟通估值调整事项；监察稽核部负责审核估值政策和程序的一致性，监督估值委员会工作流程中的风险控制，并负责估值调整事项的信息披露工作。

本基金的日常估值程序由基金运营部基金估值核算人员执行，并与托管人的估值结果核对一致。基金估值政策的议定和修改采用集体讨论机制，投资组合经理作为估值小组成员，对持仓证券的交易情况、信息披露情况保持应有的职业敏感，向估值委员会提供估值参考信息，参与估值政策讨论。对需采用特别估值程序的证券，基金管理人及时启动特别估值程序，由估值委员会讨论议定特别估值方案并与托管人沟通后由基金运营部具体执行。

本基金管理人参与估值流程各方之间不存在任何重大利益冲突。截止报告期末本基金管理人已与中央国债登记结算有限责任公司及中证指数有限公司签署服务协议，由中央国债登记结算有限责任公司按约定提供银行间交易的债券品种的估值数据，由中证指数有限公司按约定提供交易所交易的债券品种的估值数据和流通受限股票的折扣率数据。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金管理人严格按照本基金基金合同的规定进行收益分配。本报告期内，大成策略回报混合 A 已分配利润 374,328,925.57 元，每十份基金份额分红 1.4800 元；大成策略回报混合 C 已分配利润 49,036,511.95 元，每十份基金份额分红 1.4000 元；符合基金合同规定的分红比例。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

无。

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内，中国光大银行股份有限公司在大成策略回报混合型证券投资基金（以下称“本

基金”) 托管过程中, 严格遵守了《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》及其他法律法规、基金合同、托管协议等的规定, 依法安全保管了基金的全部资产, 对本基金的投资运作进行了全面的会计核算和应有的监督, 对发现的问题及时提出了意见和建议。同时, 按规定如实、独立地向监管机构提交了本基金运作情况报告, 没有发生任何损害基金份额持有人利益的行为, 诚实信用、勤勉尽责地履行了作为基金托管人所应尽的义务。

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

本报告期内, 中国光大银行股份有限公司依据《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》及其他法律法规、基金合同、托管协议等的规定, 对基金管理人的投资运作等行为进行了复核、监督, 未发现基金管理人在投资运作、基金资产净值的计算、利润分配等方面存在损害基金份额持有人利益的行为。该基金在运作中遵守了有关法律法规的要求, 各重要方面的运作严格依据基金合同的约定进行。

5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

中国光大银行股份有限公司以自身能够获取的数据和信息为限, 根据法律法规规定、基金合同和托管协议约定对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进行了复核, 认为以上内容真实、准确、完整。

§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：大成策略回报混合型证券投资基金

报告截止日：2026 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2026 年 6 月 30 日	上年度末 2025 年 12 月 31 日
资 产：			
货币资金	6.4.7.1	970,879,908.17	1,366,924,318.29
结算备付金		-	-
存出保证金		-	-
交易性金融资产	6.4.7.2	1,540,755,268.81	2,362,206,288.07
其中：股票投资		1,505,061,466.34	2,266,920,903.68
基金投资		-	-
债券投资		35,693,802.47	95,285,384.39
资产支持证券投资		-	-

贵金属投资		-	-
其他投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
应收清算款		-	-
应收股利		-	-
应收申购款		2,233,421.97	2,293,215.47
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.8	-	-
资产总计		2,513,868,598.95	3,731,423,821.83
负债和净资产	附注号	本期末 2026 年 6 月 30 日	上年度末 2025 年 12 月 31 日
负 债:			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付清算款		-	-
应付赎回款		8,264,629.78	13,044,853.54
应付管理人报酬		2,633,785.13	4,064,321.56
应付托管费		438,964.19	677,386.93
应付销售服务费		163,972.65	268,485.35
应付投资顾问费		-	-
应交税费		733.49	2,410.57
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.9	126,731.34	230,442.54
负债合计		11,628,816.58	18,287,900.49
净资产:			
实收基金	6.4.7.10	2,338,580,254.84	2,982,696,104.92
未分配利润	6.4.7.12	163,659,527.53	730,439,816.42
净资产合计		2,502,239,782.37	3,713,135,921.34
负债和净资产总计		2,513,868,598.95	3,731,423,821.83

注：报告截止日 2026 年 6 月 30 日，基金份额总额 2,338,580,254.84 份。其中大成策略回报混合 A 类基金份额总额为 2,039,960,042.04 份，基金份额净值 1.0711 元；大成策略回报混合 C 类基金份额总额为 298,620,212.80 份，基金份额净值 1.0625 元。

6.2 利润表

会计主体：大成策略回报混合型证券投资基金

本报告期：2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期	上年度可比期间
-----	-----	----	---------

		2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日	2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
一、营业总收入		-24,905,349.78	171,086,731.85
1. 利息收入		2,328,206.78	5,172,011.49
其中：存款利息收入	6.4.7.13	892,807.07	2,000,166.06
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		1,435,399.71	3,171,845.43
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以 “-”填列）		289,338,903.83	207,801,369.94
其中：股票投资收益	6.4.7.14	257,076,315.77	172,074,843.03
基金投资收益	6.4.7.15	-	-
债券投资收益	6.4.7.16	561,596.08	247,036.88
资产支持证券 投资收益	6.4.7.17	-	-
贵金属投资收 益	6.4.7.18	-	-
衍生工具收益	6.4.7.19	-	-
股利收益	6.4.7.20	31,700,991.98	35,479,490.03
以摊余成本计 量的金融资产终止确 认产生的收益		-	-
其他投资收益		-	-
3. 公允价值变动收益 （损失以“-”号填 列）	6.4.7.21	-317,685,642.04	-43,135,804.99
4. 汇兑收益（损失以 “-”号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以 “-”号填列）	6.4.7.22	1,113,181.65	1,249,155.41
减：二、营业总支出		23,485,559.61	29,460,586.37
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	19,046,669.29	23,732,820.40
2. 托管费	6.4.10.2.2	3,174,444.87	3,955,470.04
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	1,145,023.69	1,645,639.28
4. 投资顾问费		-	-
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融 资产支出		-	-
6. 信用减值损失	6.4.7.23	-	-
7. 税金及附加		1,007.11	-
8. 其他费用	6.4.7.24	118,414.65	126,656.65

三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-48,390,909.39	141,626,145.48
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-48,390,909.39	141,626,145.48
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		-48,390,909.39	141,626,145.48

6.3 净资产变动表

会计主体：大成策略回报混合型证券投资基金

本报告期：2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	2,982,696,104.92	-	730,439,816.42	3,713,135,921.34
二、本期期初净资产	2,982,696,104.92	-	730,439,816.42	3,713,135,921.34
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-644,115,850.08	-	-566,780,288.89	-
（一）、综合收益总额	-	-	-48,390,909.39	-48,390,909.39
（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）	-644,115,850.08	-	-95,023,941.98	-739,139,792.06
其中：1. 基金申购款	657,758,253.30	-	90,994,152.89	748,752,406.19
2. 基金赎回款	- 1,301,874,103.38	-	-186,018,094.87	- 1,487,892,198.25
（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）	-	-	-423,365,437.52	-423,365,437.52

四、本期期末净资产	2,338,580,254.84	-	163,659,527.53	2,502,239,782.37
项目	上年度可比期间 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	3,359,775,620.94	-	975,133,785.97	4,334,909,406.91
二、本期期初净资产	3,359,775,620.94	-	975,133,785.97	4,334,909,406.91
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	143,868,095.54	-	-425,260,007.46	-281,391,911.92
（一）、综合收益总额	-	-	141,626,145.48	141,626,145.48
（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）	143,868,095.54	-	-92,653.74	143,775,441.80
其中：1. 基金申购款	1,513,670,833.92	-	203,831,814.39	1,717,502,648.31
2. 基金赎回款	- 1,369,802,738.38	-	-203,924,468.13	- 1,573,727,206.51
（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）	-	-	-566,793,499.20	-566,793,499.20
四、本期期末净资产	3,503,643,716.48	-	549,873,778.51	4,053,517,494.99

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署：

<u>谭晓冈</u>	<u>范瑛</u>	<u>梁靖</u>
基金管理人负责人	主管会计工作负责人	会计机构负责人

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

大成策略回报混合型证券投资基金(原名为大成策略回报股票型证券投资基金,以下简称“本基金”)经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2008]第 1103 号《关于核准大成策略回报股票型证券投资基金募集的批复》核准,由大成基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《大成策略回报股票型证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式,存续期限不定,首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币 1,057,807,851.96 元,业经普华永道中天会计师事务所有限公司普华永道中天验字(2008)第 180 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《大成策略回报股票型证券投资基金基金合同》于 2008 年 11 月 26 日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为 1,058,010,199.76 份基金份额,其中认购资金利息折合 202,347.80 份基金份额。本基金的基金管理人为大成基金管理有限公司,基金托管人为中国光大银行股份有限公司。

根据中国证监会 2014 年 7 月 7 日颁布的《公开募集证券投资基金运作管理办法》(以下简称“《运作办法》”)的有关规定,经与本基金托管人中国光大银行股份有限公司协商一致,自 2015 年 7 月 22 日起本基金名称变更为“大成策略回报混合型证券投资基金”;基金简称变更为“大成策略回报混合”;基金类别变更为“混合型”。

根据本基金的基金管理人于 2023 年 3 月 28 日发布的《关于大成策略回报混合型证券投资基金增设 C 类基金份额并相应修订基金合同和托管协议的公告》,自 2023 年 3 月 30 日起对本基金进行份额分类,增加 C 类份额,原有基金份额转为 A 类份额。其中 A 类基金份额为在投资人申购时收取前端申购费用,但不从本类别基金资产中计提销售服务费的基金份额;C 类基金份额为从本类别基金资产中计提销售服务费,但不收取申购费用的基金份额。本基金 A 类基金份额和 C 类基金份额分别设置基金代码并分别计算基金份额净值。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《大成策略回报混合型证券投资基金基金合同》的有关规定,本基金的投资范围为国内依法发行交易的股票、存托凭证、权证、债券、资产支持证券及法律法规或监管机构允许基金投资的其他金融工具。本基金的股票、存托凭证投资比例范围为基金资产的 60%-95%;权证投资比例范围为基金资产的 0%-3%;债券投资比例范围为基金资产的 0%-35%;资产支持证券投资比例范围为基金资产的 0%-20%;现金(不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等)或到期日在一年以内的政府债券比例不低于基金资产净值的 5%。根据本基金的基金管理人于 2015 年 9 月 14 日发布的《大成策略回报混合型证券投资基金变更业绩比较基准并修改基金合同的公告》,自 2015 年 9 月 14 日起,本基金的业绩比较基准由原“80%×沪深 300

指数收益率+20%×中信标普全债指数收益率”变更为“80%×沪深 300 指数收益率+20%×中债综合指数收益率”。

6.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于 2006 年 2 月 15 日及以后期间颁布的《企业会计准则—基本准则》、各项具体会计准则、《资产管理产品相关会计处理规定》及其他相关规定（以下合称“企业会计准则”）、中国证券投资基金业协会（以下简称“中国基金业协会”）发布的《公开募集证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和中期报告>》、《证券投资基金会计核算业务指引》、本基金基金合同和在财务报表附注所列示的中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

本财务报表以持续经营为基础编制。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金 2026 年 6 月 30 日的财务状况以及 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日期间的经营成果和净资产变动情况等有关信息。

6.4.4 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 会计政策变更的说明

无。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

无。

6.4.5.3 差错更正的说明

无。

6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128 号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2008]1 号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85 号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2014]81 号《财政部国家税务总局证监会关于沪港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》、财税[2015]101 号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2016]127 号《财政部国家税务总局证监会关于深港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》、财税[2017]56 号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90 号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值

税政策的通知》、财政部、国家税务总局公告 2025 年第 4 号《关于国债等债券利息收入增值税政策的公告》、国务院令第 826 号《中华人民共和国增值税法实施条例》、财政部、税务总局公告 2026 年第 10 号《财政部 税务总局关于增值税法施行后增值税优惠政策衔接事项的公告》及其他相关境内外财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1) 资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人。2027 年 12 月 31 日前，资管产品管理人运营契约制资管产品过程中发生的增值税应税行为，可以选择适用简易计税方法，按照 3% 的征收率缴纳增值税。对资管产品在 2018 年 1 月 1 日前运营过程中发生的增值税应税行为，未缴纳增值税的，不再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从资管产品管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。

2027 年 12 月 31 日前，对证券投资基金管理人运用基金资产买卖股票、债券的转让收入免征增值税，对除持有金融债券外的金融同业往来利息收入亦免征增值税。自 2025 年 8 月 8 日起，对在该日期之后(含当日)新发行的国债、地方政府债券、金融债券的利息收入，恢复征收增值税。对在该日期之前已发行的国债、地方政府债券、金融债券(包含在 2025 年 8 月 8 日之后续发行的部分)的利息收入，免征增值税直至债券到期。资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务，以 2018 年 1 月 1 日起产生的利息及利息性质的收入为销售额。资管产品管理人运营资管产品转让 2017 年 12 月 31 日前取得的基金、非货物期货，可以选择按照实际买入价计算销售额，或者以 2017 年最后一个交易日的基金份额净值、非货物期货结算价格作为买入价计算销售额。

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

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

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

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

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

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

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

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 货币资金

单位：人民币元

项目	本期末 2026 年 6 月 30 日
活期存款	16,111,543.41
等于：本金	16,107,512.63
加：应计利息	4,030.78
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	954,768,364.76
等于：本金	954,732,649.62
加：应计利息	35,715.14
减：坏账准备	-
合计	970,879,908.17

注：其他存款为存放在证券经纪商专用存款账户的证券交易结算资金。

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2026 年 6 月 30 日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动

股票		1,636,414,970.36	-	1,505,061,466.34	- 131,353,504.02
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-	-
债券	交易所市场	-	-	-	-
	银行间市场	35,000,406.58	264,302.47	35,693,802.47	429,093.42
	合计	35,000,406.58	264,302.47	35,693,802.47	429,093.42
资产支持证券		-	-	-	-
基金		-	-	-	-
其他		-	-	-	-
合计		1,671,415,376.94	264,302.47	1,540,755,268.81	- 130,924,410.60

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

6.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

无。

6.4.7.3.2 期末基金持有的期货合约情况

无。

6.4.7.3.3 期末基金持有的黄金衍生品情况

无。

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

无。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

无。

6.4.7.4.3 按预期信用损失一般模型计提减值准备的说明

无。

6.4.7.5 债权投资

6.4.7.5.1 债权投资情况

无。

6.4.7.5.2 债权投资减值准备计提情况

无。

6.4.7.6 其他债权投资

6.4.7.6.1 其他债权投资情况

无。

6.4.7.6.2 其他债权投资减值准备计提情况

无。

6.4.7.7 其他权益工具投资

6.4.7.7.1 其他权益工具投资情况

无。

6.4.7.7.2 报告期末其他权益工具投资情况

无。

6.4.7.8 其他资产

无。

6.4.7.9 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2026 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	16,507.98
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	-
其中：交易所市场	-
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用	108,478.95
其他	1,744.41
合计	126,731.34

6.4.7.10 实收基金

金额单位：人民币元

大成策略回报混合 A

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	2,590,479,288.11	2,590,479,288.11
本期申购	557,549,304.53	557,549,304.53
本期赎回（以“-”号填列）	-1,108,068,550.60	-1,108,068,550.60
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	2,039,960,042.04	2,039,960,042.04

大成策略回报混合 C

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	392,216,816.81	392,216,816.81
本期申购	100,208,948.77	100,208,948.77
本期赎回（以“-”号填列）	-193,805,552.78	-193,805,552.78
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	298,620,212.80	298,620,212.80

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

6.4.7.11 其他综合收益

无。

6.4.7.12 未分配利润

单位：人民币元

大成策略回报混合 A

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	1,213,308,267.83	-574,369,858.06	638,938,409.77
本期期初	1,213,308,267.83	-574,369,858.06	638,938,409.77
本期利润	237,736,720.11	-279,356,345.81	-41,619,625.70
本期基金份额交易产生的变动数	-227,699,001.48	149,707,095.72	-77,991,905.76
其中：基金申购款	210,790,982.16	-133,296,707.58	77,494,274.58
基金赎回款	-438,489,983.64	283,003,803.30	-155,486,180.34
本期已分配利润	-374,328,925.57	-	-374,328,925.57
本期末	849,017,060.89	-704,019,108.15	144,997,952.74

大成策略回报混合 C

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	178,650,847.32	-87,149,440.67	91,501,406.65
本期期初	178,650,847.32	-87,149,440.67	91,501,406.65
本期利润	31,558,012.54	-38,329,296.23	-6,771,283.69
本期基金份额交易产生的变动数	-39,580,016.21	22,547,979.99	-17,032,036.22
其中：基金申购款	36,936,732.51	-23,436,854.20	13,499,878.31
基金赎回款	-76,516,748.72	45,984,834.19	-30,531,914.53
本期已分配利润	-49,036,511.95	-	-49,036,511.95
本期末	121,592,331.70	-102,930,756.91	18,661,574.79

6.4.7.13 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	115,983.82
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	776,784.51
结算备付金利息收入	-
其他	38.74
合计	892,807.07

6.4.7.14 股票投资收益

6.4.7.14.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2026年1月1日至2026年6月30日
股票投资收益——买卖股票差价收入	257,076,315.77
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	257,076,315.77

6.4.7.14.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
卖出股票成交总额	1,153,991,839.94
减：卖出股票成本总额	895,505,040.21
减：交易费用	1,410,483.96
买卖股票差价收入	257,076,315.77

6.4.7.14.3 股票投资收益——证券出借差价收入

无。

6.4.7.15 基金投资收益

无。

6.4.7.16 债券投资收益

6.4.7.16.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2026年1月1日至2026年6月30日
债券投资收益——利息收入	518,461.08

债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	43,135.00
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	561,596.08

6.4.7.16.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2026年1月1日至2026年6月30日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	140,359,411.51
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	139,975,160.00
减：应计利息总额	340,131.51
减：交易费用	985.00
买卖债券差价收入	43,135.00

6.4.7.16.3 债券投资收益——赎回差价收入

无。

6.4.7.16.4 债券投资收益——申购差价收入

无。

6.4.7.17 资产支持证券投资收益

6.4.7.17.1 资产支持证券投资收益项目构成

无。

6.4.7.17.2 资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入

无。

6.4.7.17.3 资产支持证券投资收益——赎回差价收入

无。

6.4.7.17.4 资产支持证券投资收益——申购差价收入

无。

6.4.7.18 贵金属投资收益

6.4.7.18.1 贵金属投资收益项目构成

无。

6.4.7.18.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

无。

6.4.7.18.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

无。

6.4.7.18.4 贵金属投资收益——申购差价收入

无。

6.4.7.19 衍生工具收益

6.4.7.19.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

无。

6.4.7.19.2 衍生工具收益——其他投资收益

无。

6.4.7.20 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
股票投资产生的股利收益	31,700,991.98
其中：证券出借权益补偿收入	-
基金投资产生的股利收益	-
合计	31,700,991.98

6.4.7.21 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
1. 交易性金融资产	-317,685,642.04
股票投资	-318,294,122.04
债券投资	608,480.00
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	-317,685,642.04

6.4.7.22 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
----	---------------------------------------

基金赎回费收入	1,071,447.30
基金转换费收入	41,734.35
合计	1,113,181.65

6.4.7.23 信用减值损失

无。

6.4.7.24 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
审计费用	39,671.58
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	—
存托服务费	5.00
银行划款手续费	630.70
账户维护费	18,600.00
合计	118,414.65

6.4.7.25 分部报告

无。

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 或有事项

无。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

无。

6.4.9 关联方、关联关系

6.4.9.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

本基金本报告期存在控制关系或者其他重大利害关系的关联方未发生变化。

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
大成基金管理有限公司（“大成基金”）	基金管理人、注册登记机构、基金销售机构
中国光大银行股份有限公司（“光大银行”）	基金托管人、基金销售机构
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

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 股票交易

无。

6.4.10.1.2 债券交易

无。

6.4.10.1.3 债券回购交易

无。

6.4.10.1.4 基金交易

无。

6.4.10.1.5 权证交易

无。

6.4.10.1.6 应支付关联方的佣金

无。

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	19,046,669.29	23,732,820.40
其中：应支付销售机构的客户维护费	5,795,608.10	6,671,348.70
应支付基金管理人的净管理费	13,251,061.19	17,061,471.70

注：本基金管理费年费率为 1.20%，每日计提，按月支付。其计算公式为：

日管理费 = 前一日基金资产净值 × 管理费年费率 / 当年天数。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	3,174,444.87	3,955,470.04

注：本基金托管费年费率为 0.20%，每日计提，按月支付。其计算公式为：

日托管费 = 前一日基金资产净值 × 托管费年费率 / 当年天数。

6.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期		
	2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	大成策略回报混合 A	大成策略回报混合 C	合计
大成基金	—	439,234.79	439,234.79
光大银行	—	4,665.88	4,665.88
光大证券	—	1,112.30	1,112.30
合计	—	445,012.97	445,012.97
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间		
	2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	大成策略回报混合 A	大成策略回报混合 C	合计
大成基金	—	540,368.67	540,368.67
光大证券	—	440.94	440.94
合计	—	540,809.61	540,809.61

注：C 类基金份额的销售服务费年费率为 0.60%。

销售服务费的计算方法如下：

$$H = E \times \text{该类基金份额销售服务费年费率} \div \text{当年天数}$$

H 为该类基金份额每日应计提的销售服务费

E 为该类基金份额前一日基金资产净值

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

无。

6.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

6.4.10.4.1 与关联方通过约定申报方式进行的适用固定期限费率的证券出借业务的情况

无。

6.4.10.4.2 与关联方通过约定申报方式进行的适用市场化期限费率的证券出借业务的情况

无。

6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

份额单位：份

项目	本期	
	2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日	
	大成策略回报混合 A	大成策略回报混合 C
基金合同生效日 （ 2008 年 11 月 26 日）持有的基 金份额	-	-
报告期初持有的 基金份额	-	-
报告期间申购/ 买入总份额	-	-
报告期间因拆分 变动份额	-	-
减：报告期间赎 回/卖出总份额	-	-
报告期末持有的 基金份额	-	-
报告期末持有的 基金份额 占基金总份额比 例	-	-
项目	上年度可比期间	
	2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日	
	大成策略回报混合 A	大成策略回报混合 C
基金合同生效日 （ 2008 年 11 月 26 日）持有的基 金份额	-	-
报告期初持有的 基金份额	-	8,771.93
报告期间申购/ 买入总份额	-	-
报告期间因拆分 变动份额	-	-
减：报告期间赎 回/卖出总份额	-	8,771.93
报告期末持有的 基金份额	-	-
报告期末持有的 基金份额 占基金总份额比	-	-

例		
---	--	--

注：基金管理人大成基金投资本基金适用的交易费率与本基金法律文件规定一致。

6. 4. 10. 5. 2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

无。

6. 4. 10. 6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
光大银行	16, 111, 543. 41	115, 983. 82	382, 912, 680. 20	1, 506, 916. 21

注：本基金由基金托管人保管的银行存款，按银行约定利率计息。

6. 4. 10. 7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

无。

6. 4. 10. 8 其他关联交易事项的说明

无。

6. 4. 11 利润分配情况

单位：人民币元

大成策略回报混合 A								
序号	权益 登记日	除息日		每 10 份 基金份额 分红数	现金形 式 发放总 额	再投资形 式 发放总额	本期利 润分配 合计	备注
		场内	场外					
1	2026 年 1 月 16 日	-	2026 年 1 月 16 日	1. 4800	229, 563, 829. 40	144, 765, 096. 17	374, 328, 925. 57	-
合计	-	-	-	1. 4800	229, 563, 829. 40	144, 765, 096. 17	374, 328, 925. 57	-
大成策略回报混合 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	2026 年 1 月 16 日	-	2026 年 1 月 16 日	1. 4000	25, 915, 477. 30	23, 121, 034. 65	49, 036, 511. 95	-
合计	-	-	-	1. 4000	25, 915, 477. 30	23, 121, 034. 65	49, 036, 511. 95	-

6.4.12 期末（2026 年 6 月 30 日）本基金持有的流通受限证券

6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

6.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	受限期	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量（单位：股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
001220	世盟股份	2026 年 1 月 27 日	6 个月	新股锁定	28.00	27.78	57	1,596.00	1,583.46	-
001237	惠康科技	2026 年 5 月 15 日	6 个月	新股锁定	53.26	58.74	285	15,179.10	16,740.90	-
001248	华润新能源	2026 年 6 月 24 日	1 个月内（含）	新股未上市	10.11	10.11	25,231	255,085.41	255,085.41	-
001248	华润新能源	2026 年 6 月 24 日	6 个月	新股未上市	10.11	10.11	58,873	595,206.03	595,206.03	-
001257	盛龙股份	2026 年 3 月 24 日	6 个月	新股锁定	7.82	20.74	1,743	13,630.26	36,149.82	-
001312	福恩股份	2026 年 4 月 14 日	6 个月	新股锁定	18.38	16.78	134	2,462.92	2,248.52	-
001393	维通利	2026 年 5 月 8 日	6 个月	新股锁定	30.38	38.99	387	11,757.06	15,089.13	-
001399	惠科股份	2026 年 6 月 16 日	6 个月	新股锁定	10.12	27.73	6,488	65,658.56	179,912.24	-

301513	尚水智能	2026年4月10日	6个月	新股锁定	26.66	50.96	138	3,679.08	7,032.48	-
301531	春光集团	2026年4月28日	6个月	新股锁定	13.30	51.56	290	3,857.00	14,952.40	-
301599	理奇智能	2026年4月22日	6个月	新股锁定	13.91	32.47	433	6,023.03	14,059.51	-
301669	高特电子	2026年6月2日	6个月	新股锁定	7.08	28.40	546	3,865.68	15,506.40	-
301680	固德电材	2026年2月27日	6个月	新股锁定	58.00	112.16	117	6,786.00	13,122.72	-
301682	宏明电子	2026年3月18日	6个月	新股锁定	69.66	160.06	714	49,737.24	114,282.84	-
301683	慧谷新材	2026年3月24日	6个月	新股锁定	78.38	121.77	96	7,524.48	11,689.92	-
301687	新广益	2025年12月24日	6个月	新股锁定	21.93	77.78	195	4,276.35	15,167.10	-
301696	三瑞智能	2026年3月31日	6个月	新股锁定	24.68	86.80	216	5,330.88	18,748.80	-
601112	振石股份	2026年1月21日	6个月	新股锁定	11.18	17.59	775	8,664.50	13,632.25	-
603284	林平发展	2026年2月3日	6个月	新股锁定	37.88	34.87	46	1,742.48	1,604.02	-

603293	埃泰克	2026 年 4 月 9 日	6 个月	新股 锁定	33.49	33.93	72	2,411.28	2,442.96	-
603352	至信 股份	2026 年 1 月 8 日	6 个月	新股 锁定	21.88	25.52	112	2,450.56	2,858.24	-
603435	嘉德 利	2026 年 5 月 15 日	6 个月	新股 锁定	15.76	46.71	104	1,639.04	4,857.84	-
603459	红板 科技	2026 年 3 月 31 日	6 个月	新股 锁定	17.70	84.32	330	5,841.00	27,825.60	-
688635	长进 光子	2026 年 5 月 20 日	6 个月	新股 锁定	40.98	308.19	128	5,245.44	39,448.32	-
688785	恒运 昌	2026 年 1 月 20 日	6 个月	新股 锁定	92.18	463.15	116	10,692.88	53,725.40	-
688797	臻宝 科技	2026 年 6 月 16 日	6 个月	新股 锁定	44.56	468.67	207	9,223.92	97,014.69	-
688808	联讯 仪器	2026 年 4 月 16 日	6 个月	新股 锁定	81.88	1,584.33	163	13,346.44	258,245.79	-
688811	有研 复材	2026 年 4 月 1 日	6 个月	新股 锁定	6.41	24.13	834	5,345.94	20,124.42	-
688813	泰金 新能	2026 年 3 月 24 日	6 个月	新股 锁定	26.28	172.09	234	6,149.52	40,269.06	-
688816	易思 维	2026 年 2 月 4 日	6 个月	新股 锁定	55.95	57.10	177	9,903.15	10,106.70	-

688818	电科蓝天	2026 年 2 月 3 日	6 个月	新股锁定	9.47	70.14	1,717	16,259.99	120,430.38	-
688820	盛合晶微	2026 年 4 月 13 日	6 个月	新股锁定	19.68	141.49	2,391	47,054.88	338,302.59	-

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量（股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
601369	陕鼓动力	2026 年 6 月 29 日	重大事项停牌	9.05	2026 年 7 月 13 日	9.96	130	1,030.80	1,176.50	-

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

无。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

无。

6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

无。

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金是混合型基金，其预期收益及风险水平高于货币市场基金和债券型基金，低于股票型基金，属于中高收益风险特征的基金。本基金投资的金融工具主要包括股票投资和债券投资等。本基金在日常经营活动中面临的与这些金融工具相关的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金的基金管理人从事风险管理的主要目标是争取将以上风险控制在限定的范围之内，使本基金在风险和收益之间取得最佳的平衡以实现“风险和收益相匹配”的风险收益目标。

本基金的基金管理人奉行全面风险管理体系的建设，建立了以由高层监控（合规与风险管理委员会、公司投资风险控制委员会）、专业监控（监察稽核部、风险管理部）、部门互控、岗位自控构成的风险管理架构体系。本基金的基金管理人在董事会下设立合规与风险管理委员会，对公司整体运营风险进行监督，监督风险控制措施的执行；在管理层层面设立投资风险控制委员会，通过

定期会议讨论涉及投资风险的重大议题，形成正式决议提交投委会；在业务操作层面，监察稽核部履行合规控制职责，通过定期、不定期检查内控制度的执行情况、对重大风险点以专项稽核的方式确保公司内控制度、流程得到贯彻执行。风险管理部履行风险量化评估分析职责。

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

6.4.13.2 信用风险

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

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

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

本期末，本基金持有的除国债、央行票据和政策性金融债以外的债券占基金资产净值的比例为 1.43%(上年度末：0.95%)。

6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金在履行与金融负债有关的义务时遇到资金短缺的风险。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难或因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理的价格变现。

6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》及《公开募集开放式

证券投资基金流动性风险管理规定》等有关法规的要求建立健全开放式基金流动性风险管理的内部控制体系，审慎评估各类资产的流动性，针对性制定流动性风险管理措施，对本基金组合资产的流动性风险进行管理。本基金的基金管理人采用监控基金组合资产持仓集中度指标、逆回购交易的到期日与交易对手的集中度、流动性受限资产比例、基金组合资产中 7 个工作日可变现资产的可变现价值以及压力测试等方式防范流动性风险。并于开放日对本基金的申购赎回情况进行监控，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配，确保本基金资产的变现能力与投资者赎回需求的匹配与平衡。本基金的基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。

本基金主要投资于交易所及银行间市场内交易的证券，除在附注“期末本基金持有的流通受限证券”中列示的部分基金资产流通暂时受限制外(如有)，其余均能及时变现。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券资产的公允价值。除附注“期末债券正回购交易中作为抵押的债券”中列示的卖出回购金融资产款余额(如有)将在 1 个月内到期且计息外，本基金于资产负债表日所持有的金融负债的合同约定剩余到期日均为一年以内且一般不计息，可赎回基金份额净值无固定到期日且不计息，因此账面余额一般即为未折现的合约到期现金流量。本报告期内，本基金未发生重大流动性风险事件。

6.4.13.4 市场风险

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动而发生波动的风险，包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

6.4.13.4.1 利率风险

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

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

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

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2026 年 6 月 30 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
------------------------	-------	-------	-------	-----	----

资产					
货币资金	970,879,908.17	-	-	-	970,879,908.17
交易性金融资产	-	35,693,802.47	-	1,505,061,466.34	1,540,755,268.81
应收申购款	-	-	-	2,233,421.97	2,233,421.97
资产总计	970,879,908.17	35,693,802.47	-	1,507,294,888.31	2,513,868,598.95
负债					
应付赎回款	-	-	-	8,264,629.78	8,264,629.78
应付管理人报酬	-	-	-	2,633,785.13	2,633,785.13
应付托管费	-	-	-	438,964.19	438,964.19
应付销售服务费	-	-	-	163,972.65	163,972.65
应交税费	-	-	-	733.49	733.49
其他负债	-	-	-	126,731.34	126,731.34
负债总计	-	-	-	11,628,816.58	11,628,816.58
利率敏感度缺口	970,879,908.17	35,693,802.47	-	1,495,666,071.73	2,502,239,782.37
上年度末 2025 年 12 月 31 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
货币资金	1,366,924,318.29	-	-	-	1,366,924,318.29
交易性金融资产	60,194,942.47	35,090,441.92	-	2,266,920,903.68	2,362,206,288.07
应收申购款	-	-	-	2,293,215.47	2,293,215.47
资产总计	1,427,119,260.76	35,090,441.92	-	2,269,214,119.15	3,731,423,821.83
负债					
应付赎回款	-	-	-	13,044,853.54	13,044,853.54
应付管理人报酬	-	-	-	4,064,321.56	4,064,321.56
应付托管费	-	-	-	677,386.93	677,386.93
应付销售服务费	-	-	-	268,485.35	268,485.35
应交税费	-	-	-	2,410.57	2,410.57
其他负债	-	-	-	230,442.54	230,442.54
负债总计	-	-	-	18,287,900.49	18,287,900.49
利率敏感度缺口	1,427,119,260.76	35,090,441.92	-	2,250,926,218.66	3,713,135,921.34

注：表中所示为本基金资产及负债的账面价值，并按照合约规定的利率重新定价日或到期日孰早者予以分类。

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

于本期末，本基金持有的交易性债券投资和交易性资产支持证券投资公允价值占净资产的比例为 1.43%(上年度末：2.57%)，因此市场利率的变动对于本基金净资产无重大影响(上年度末：

同)。

6.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无重大外汇风险。

6.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场交易的股票和债券，所面临的其他价格风险来源于单个证券发行主体自身经营情况或特殊事项的影响，也可能来源于证券市场整体波动的影响。

本基金的基金管理人在构建和管理投资组合的过程中，采用“自上而下”的策略，通过对宏观经济情况及政策的分析，结合证券市场运行情况，做出资产配置及组合构建的决定；通过对单个证券的定性分析及定量分析，选择符合基金合同约定范围的投资品种进行投资。本基金的基金管理人定期结合宏观及微观环境的变化，对投资策略、资产配置、投资组合进行修正，来主动应对可能发生的市场价格风险。

本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险。本基金的股票、存托凭证投资比例范围为基金资产的 60%-95%；权证投资比例范围为基金资产的 0%-3%；债券投资比例范围为基金资产的 0%-35%；资产支持证券投资比例范围为基金资产的 0%-20%；现金(不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等)或到期日在一年以内的政府债券比例不低于基金资产净值的 5%。此外，本基金的基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控，定期运用多种定量方法对基金进行风险度量，包括 VaR(Value at Risk) 指标等来测试本基金面临的潜在价格风险，及时可靠地对风险进行跟踪和控制。

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2026 年 6 月 30 日		上年度末 2025年12月31日	
	公允价值	占基金资产净值 比例（%）	公允价值	占基金资产净 值比例（%）
交易性金融资产—股票投资	1,505,061,466.34	60.15	2,266,920,903.68	61.05
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	1,505,061,466.34	60.15	2,266,920,903.68	61.05

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除业绩比较基准以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2026 年 6 月 30 日）	上年度末（2025 年 12 月 31 日）
	业绩比较基准上升 5%	53,956,852.87	121,632,032.10
	业绩比较基准下降 5%	-53,956,852.87	-121,632,032.10

6.4.14 公允价值

6.4.14.1 金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属的层次，由对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次决定： 第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。 第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。 第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

6.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

6.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2026 年 6 月 30 日	上年度末 2025 年 12 月 31 日
第一层次	1,502,702,823.90	2,266,561,750.66
第二层次	36,545,270.41	95,285,384.39
第三层次	1,507,174.50	359,153.02

合计	1,540,755,268.81	2,362,206,288.07
----	------------------	------------------

6.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

本基金以导致各层次之间转换的事项发生日为确认各层次之间转换的时点。

对于证券交易所上市的证券，若出现重大事项停牌、交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)、或属于非公开发行等情况，本基金不会于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间将相关证券的公允价值列入第一层次；对于定期开放的基金投资，本基金不会于封闭期将相关基金列入第一层次；并根据估值调整中采用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度，确定相关投资的公允价值应属第二层次还是第三层次。

6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

于本期末，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融工具(上年度末：同)。

6.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括货币资金、应收款项和其他金融负债等，其账面价值与公允价值相差很小。

6.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

§ 7 投资组合报告

7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	1,505,061,466.34	59.87
	其中：股票	1,505,061,466.34	59.87
2	基金投资	—	—
3	固定收益投资	35,693,802.47	1.42
	其中：债券	35,693,802.47	1.42
	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	970,879,908.17	38.62
8	其他各项资产	2,233,421.97	0.09
9	合计	2,513,868,598.95	100.00

7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	1,002,700.00	0.04
B	采矿业	140,361,738.66	5.61
C	制造业	951,993,956.64	38.05
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	2,928,534.53	0.12
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	35,164,336.99	1.41
G	交通运输、仓储和邮政业	135,377,788.49	5.41
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	232,473,878.75	9.29
J	金融业	9,135.00	0.00
K	房地产业	21,363.50	0.00
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	115,032.38	0.00
N	水利、环境和公共设施管理业	6,178.16	0.00
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	24,695.46	0.00
R	文化、体育和娱乐业	5,582,127.78	0.22
S	综合	-	-
	合计	1,505,061,466.34	60.15

7.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

无。

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

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	600941	中国移动	2,691,479	231,817,086.27	9.26
2	000739	普洛药业	10,949,112	182,412,205.92	7.29
3	603899	晨光股份	5,935,618	122,451,799.34	4.89
4	601333	广深铁路	44,343,947	121,945,854.25	4.87
5	000063	中兴通讯	2,912,100	105,388,899.00	4.21
6	600938	中国海油	3,599,820	97,735,113.00	3.91
7	002773	康弘药业	3,571,860	73,044,537.00	2.92

8	603658	安图生物	2,417,888	70,167,109.76	2.80
9	000100	TCL 科技	11,610,300	67,571,946.00	2.70
10	000661	长春高新	922,534	61,440,764.40	2.46
11	603296	华勤技术	667,641	49,585,697.07	1.98
12	002318	久立特材	1,914,227	45,750,025.30	1.83
13	600256	广汇能源	8,103,100	40,029,314.00	1.60
14	600998	九州通	7,458,316	34,979,502.04	1.40
15	688153	唯捷创芯	774,116	24,864,605.92	0.99
16	002557	洽洽食品	1,259,300	22,617,028.00	0.90
17	002007	华兰生物	1,722,000	20,991,180.00	0.84
18	002129	TCL 中环	1,366,523	16,425,606.46	0.66
19	603237	五芳斋	1,253,215	15,514,801.70	0.62
20	002075	沙钢股份	4,221,040	14,351,536.00	0.57
21	300193	佳士科技	1,284,465	10,455,545.10	0.42
22	002352	顺丰控股	324,200	10,134,492.00	0.41
23	600132	重庆啤酒	241,112	9,957,925.60	0.40
24	600597	光明乳业	1,485,700	9,018,199.00	0.36
25	688575	亚辉龙	717,965	6,289,373.40	0.25
26	601949	中国出版	1,200,100	5,580,465.00	0.22
27	600690	海尔智家	257,800	5,261,698.00	0.21
28	688808	联讯仪器	1,624	3,651,169.92	0.15
29	601006	大秦铁路	632,300	2,914,903.00	0.12
30	600987	航民股份	416,300	2,518,615.00	0.10
31	600547	山东黄金	102,300	2,362,107.00	0.09
32	600116	三峡水利	370,272	2,073,523.20	0.08
33	689009	九号公司	36,444	1,390,338.60	0.06
34	688797	臻宝科技	2,070	1,382,689.62	0.06
35	000768	中航西飞	66,700	1,366,016.00	0.05
36	600598	北大荒	92,500	1,002,700.00	0.04
37	001248	华润新能源	84,104	850,291.44	0.03
38	688162	巨一科技	33,278	786,691.92	0.03
39	688635	长进光子	1,271	558,941.82	0.02
40	688256	寒武纪	247	394,100.85	0.02
41	688820	盛合晶微	2,391	338,302.59	0.01
42	000725	京东方 A	37,400	324,632.00	0.01
43	301322	绿通科技	5,470	291,824.50	0.01
44	300445	康斯特	13,800	287,316.00	0.01
45	301303	真兰仪表	14,804	253,888.60	0.01
46	603713	密尔克卫	2,900	206,393.00	0.01
47	001399	惠科股份	6,488	179,912.24	0.01
48	688623	双元科技	1,776	178,416.96	0.01
49	301528	多浦乐	2,143	175,511.70	0.01
50	688809	强一股份	259	161,357.00	0.01

51	603175	超颖电子	1,683	149,938.47	0.01
52	301439	泓淋电力	9,486	149,119.92	0.01
53	688576	西山科技	3,569	142,224.65	0.01
54	600583	海油工程	27,982	140,749.46	0.01
55	601112	振石股份	7,741	140,622.43	0.01
56	002841	视源股份	3,930	135,702.90	0.01
57	600377	宁沪高速	11,600	134,212.00	0.01
58	301683	慧谷新材	952	131,384.40	0.01
59	688570	天玛智控	8,837	125,750.51	0.01
60	688818	电科蓝天	1,717	120,430.38	0.00
61	688512	慧智微	7,209	115,127.73	0.00
62	301682	宏明电子	714	114,282.84	0.00
63	301509	金凯生科	3,720	113,125.20	0.00
64	688450	光格科技	1,662	111,337.38	0.00
65	301418	协昌科技	1,886	105,389.68	0.00
66	688489	三未信安	4,370	99,199.00	0.00
67	301609	山大电力	2,762	91,726.02	0.00
68	301584	建发致新	4,465	89,032.10	0.00
69	688392	骄成超声	385	87,464.30	0.00
70	301332	德尔玛	11,211	85,764.15	0.00
71	603092	德力佳	1,454	78,472.38	0.00
72	301429	森泰股份	4,989	78,177.63	0.00
73	300804	广康生化	2,257	70,553.82	0.00
74	603435	嘉德利	1,031	68,134.86	0.00
75	601026	道生天合	4,503	65,653.74	0.00
76	001237	惠康科技	947	64,219.54	0.00
77	688173	希荻微	3,343	63,985.02	0.00
78	603418	友升股份	1,383	61,087.11	0.00
79	301319	唯特偶	351	58,732.83	0.00
80	601065	江盐集团	8,748	58,699.08	0.00
81	301638	南网数字	2,322	55,844.10	0.00
82	301668	昊创瑞通	1,645	54,120.50	0.00
83	688785	恒运昌	116	53,725.40	0.00
84	301170	锡南科技	2,496	53,688.96	0.00
85	301369	联动科技	217	53,165.00	0.00
86	688807	优迅股份	131	52,718.33	0.00
87	688420	美腾科技	2,408	50,736.56	0.00
88	603281	江瀚新材	1,208	49,081.04	0.00
89	301575	艾芬达	1,753	46,997.93	0.00
90	603301	振德医疗	500	43,580.00	0.00
91	688727	恒坤新材	563	42,112.40	0.00
92	688813	泰金新能	234	40,269.06	0.00
93	603406	天富龙	1,526	39,599.70	0.00

94	688275	万润新能	302	38,520.10	0.00
95	603262	技源集团	1,543	37,988.66	0.00
96	001335	信凯科技	797	37,849.53	0.00
97	603699	纽威股份	723	36,366.90	0.00
98	001257	盛龙股份	1,743	36,149.82	0.00
99	600925	苏能股份	8,960	35,929.60	0.00
100	688757	胜科纳米	536	35,751.20	0.00
101	601138	工业富联	478	34,487.70	0.00
102	603120	肯特催化	644	34,357.40	0.00
103	600707	彩虹股份	2,000	33,780.00	0.00
104	001314	亿道信息	508	31,394.40	0.00
105	001360	南矿集团	1,762	31,169.78	0.00
106	000880	潍柴重机	1,348	31,017.48	0.00
107	301678	新恒汇	382	30,116.88	0.00
108	301356	天振股份	1,105	29,028.35	0.00
109	603352	至信股份	1,115	28,966.33	0.00
110	603916	苏博特	2,100	28,686.00	0.00
111	688061	灿瑞科技	563	27,964.21	0.00
112	603459	红板科技	330	27,825.60	0.00
113	301330	熵基科技	1,082	27,114.92	0.00
114	001388	信通电子	937	25,739.39	0.00
115	301563	云汉芯城	143	24,937.77	0.00
116	688631	莱斯信息	523	24,533.93	0.00
117	001395	亚联机械	1,040	24,232.00	0.00
118	001386	马可波罗	1,626	23,024.16	0.00
119	001311	多利科技	1,426	23,001.38	0.00
120	001367	海森药业	1,203	22,171.29	0.00
121	301150	中一科技	344	21,709.84	0.00
122	300725	药石科技	580	21,228.00	0.00
123	301327	华宝新能	441	21,198.87	0.00
124	600383	金地集团	9,900	20,889.00	0.00
125	603708	家家悦	2,400	20,592.00	0.00
126	688811	有研复材	834	20,124.42	0.00
127	600031	三一重工	1,148	19,837.44	0.00
128	920346	威贸电子	1,300	19,656.00	0.00
129	688758	赛分科技	883	19,434.83	0.00
130	688073	毕得医药	357	19,213.74	0.00
131	301696	三瑞智能	216	18,748.80	0.00
132	301282	金禄电子	608	17,929.92	0.00
133	603382	海阳科技	1,045	17,921.75	0.00
134	688507	索辰科技	65	17,529.20	0.00
135	002028	思源电气	100	17,300.00	0.00
136	301267	华夏眼科	1,172	17,099.48	0.00

137	000538	云南白药	360	17,053.20	0.00
138	603124	江南新材	88	16,454.24	0.00
139	301363	美好医疗	872	15,983.76	0.00
140	301669	高特电子	546	15,506.40	0.00
141	301479	弘景光电	255	15,351.00	0.00
142	688409	富创精密	50	15,312.50	0.00
143	603162	海通发展	1,696	15,213.12	0.00
144	301687	新广益	195	15,167.10	0.00
145	601022	宁波远洋	1,983	15,110.46	0.00
146	001393	维通利	387	15,089.13	0.00
147	301531	春光集团	290	14,952.40	0.00
148	920689	克莱特	700	14,917.00	0.00
149	688459	哈铁科技	1,726	14,377.58	0.00
150	601121	宝地矿业	2,532	14,280.48	0.00
151	301316	慧博云通	359	14,137.42	0.00
152	301599	理奇智能	433	14,059.51	0.00
153	600585	海螺水泥	795	13,475.25	0.00
154	920857	泓禧科技	1,000	13,450.00	0.00
155	301195	北路智控	495	13,414.50	0.00
156	301223	中荣股份	815	13,137.80	0.00
157	301680	固德电材	117	13,122.72	0.00
158	688805	健信超导	265	12,447.05	0.00
159	301313	凡拓数创	247	12,389.52	0.00
160	301273	瑞晨环保	388	12,225.88	0.00
161	001369	双欣材料	897	12,127.44	0.00
162	301658	首航新能	437	11,785.89	0.00
163	603065	宿迁联盛	581	11,771.06	0.00
164	301335	天元宠物	588	11,542.44	0.00
165	300782	卓胜微	100	10,958.00	0.00
166	301667	纳百川	151	10,920.32	0.00
167	603190	亚通精工	470	10,631.40	0.00
168	688391	钜泉科技	294	10,545.78	0.00
169	301632	广东建科	656	10,154.88	0.00
170	688816	易思维	177	10,106.70	0.00
171	301535	浙江华远	734	9,850.28	0.00
172	301491	汉桑科技	245	9,621.15	0.00
173	001298	好上好	454	9,420.50	0.00
174	603153	上海建科	740	9,383.20	0.00
175	300785	值得买	246	9,020.82	0.00
176	603202	天有为	166	8,157.24	0.00
177	001333	光华股份	426	7,783.02	0.00
178	688002	睿创微纳	49	7,579.81	0.00
179	001260	坤泰股份	484	7,574.60	0.00

180	301219	腾远钴业	133	7,288.40	0.00
181	001278	一彬科技	473	7,274.74	0.00
182	001368	通达创智	351	7,220.07	0.00
183	301513	尚水智能	138	7,032.48	0.00
184	301309	万得凯	228	6,988.20	0.00
185	603282	亚光股份	457	6,521.39	0.00
186	001221	悍高集团	160	6,435.20	0.00
187	688132	邦彦技术	485	6,377.75	0.00
188	301148	嘉戎技术	116	6,178.16	0.00
189	301296	新巨丰	1,042	6,126.96	0.00
190	603257	中国瑞林	78	6,083.22	0.00
191	301449	天溯计量	157	6,075.90	0.00
192	301366	一博科技	98	5,994.66	0.00
193	601919	中远海控	445	5,900.70	0.00
194	920419	路斯股份	600	5,736.00	0.00
195	001285	瑞立科密	137	5,634.81	0.00
196	603271	永杰新材	126	5,600.70	0.00
197	002588	史丹利	700	5,530.00	0.00
198	603248	锡华科技	260	5,483.40	0.00
199	600489	中金黄金	300	5,415.00	0.00
200	688031	星环科技	47	5,413.46	0.00
201	301270	汉仪股份	210	5,392.80	0.00
202	301293	三博脑科	111	5,347.98	0.00
203	603600	永艺股份	600	5,322.00	0.00
204	301173	毓恬冠佳	173	5,139.83	0.00
205	601318	中国平安	100	4,774.00	0.00
206	603889	新澳股份	884	4,517.24	0.00
207	603816	顾家家居	200	4,472.00	0.00
208	300171	东富龙	400	4,424.00	0.00
209	000009	中国宝安	700	4,361.00	0.00
210	603291	联合水务	536	4,309.44	0.00
211	001269	欧晶科技	204	4,239.12	0.00
212	301216	万凯新材	180	4,138.20	0.00
213	600233	圆通速递	262	4,126.50	0.00
214	001390	古麒绒材	178	3,579.58	0.00
215	603989	艾华集团	67	3,517.50	0.00
216	603057	紫燕食品	149	3,322.70	0.00
217	603334	丰倍生物	88	3,126.64	0.00
218	603370	华新精科	82	2,950.36	0.00
219	688222	成都先导	86	2,761.46	0.00
220	603376	大明电子	111	2,750.58	0.00
221	603409	汇通控股	149	2,734.15	0.00
222	603585	苏利股份	200	2,734.00	0.00

223	301622	英思特	56	2,637.60	0.00
224	688428	诺诚健华	88	2,505.36	0.00
225	002317	众生药业	100	2,457.00	0.00
226	001396	誉帆科技	69	2,443.98	0.00
227	603293	埃泰克	72	2,442.96	0.00
228	688129	东来技术	93	2,435.67	0.00
229	301398	星源卓镁	69	2,422.59	0.00
230	001312	福恩股份	134	2,248.52	0.00
231	603882	金域医学	100	2,248.00	0.00
232	300773	拉卡拉	140	2,142.00	0.00
233	001338	永顺泰	249	2,089.11	0.00
234	000034	神州数码	73	2,025.75	0.00
235	301268	铭利达	141	1,971.18	0.00
236	301047	义翘神州	30	1,936.80	0.00
237	001300	三柏硕	163	1,841.90	0.00
238	300788	中信出版	74	1,662.78	0.00
239	603284	林平发展	46	1,604.02	0.00
240	600188	兖矿能源	90	1,599.30	0.00
241	001220	世盟股份	57	1,583.46	0.00
242	603151	邦基科技	135	1,483.65	0.00
243	600166	福田汽车	500	1,455.00	0.00
244	002434	万里扬	200	1,210.00	0.00
245	600352	浙江龙盛	99	1,198.89	0.00
246	001322	箭牌家居	195	1,177.80	0.00
247	601369	陕鼓动力	130	1,176.50	0.00
248	001279	强邦新材	42	1,114.68	0.00
249	601808	中海油服	100	1,081.00	0.00
250	002283	天润工业	100	965.00	0.00
251	300228	富瑞特装	100	740.00	0.00
252	000629	钒钛股份	200	668.00	0.00
253	603160	汇顶科技	10	617.10	0.00
254	600737	中粮糖业	44	542.52	0.00
255	301585	蓝宇股份	20	504.20	0.00
256	600007	中国国贸	25	474.50	0.00
257	002556	辉隆股份	100	448.00	0.00
258	600104	上汽集团	41	400.16	0.00
259	600023	浙能电力	73	383.98	0.00
260	601728	中国电信	73	378.87	0.00
261	601933	永辉超市	100	284.00	0.00
262	002020	京新药业	20	249.80	0.00
263	002867	周大生	22	245.30	0.00
264	600900	长江电力	1	26.47	0.00
265	688009	中国通号	4	19.04	0.00

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	603899	晨光股份	78,957,732.00	2.13
2	600707	彩虹股份	72,745,325.00	1.96
3	000100	TCL 科技	65,898,354.00	1.77
4	600256	广汇能源	63,846,188.50	1.72
5	600941	中国移动	37,307,621.00	1.00
6	002557	洽洽食品	30,071,929.99	0.81
7	600690	海尔智家	20,303,605.30	0.55
8	688575	亚辉龙	18,444,544.72	0.50
9	000063	中兴通讯	8,072,633.00	0.22
10	601949	中国出版	7,660,648.00	0.21
11	603658	安图生物	5,440,639.00	0.15
12	600597	光明乳业	5,011,804.00	0.13
13	002262	恩华药业	4,874,447.62	0.13
14	000739	普洛药业	3,811,354.00	0.10
15	600377	宁沪高速	3,461,553.00	0.09
16	600998	九州通	3,257,866.00	0.09
17	002352	顺丰控股	3,252,474.00	0.09
18	600987	航民股份	2,701,077.00	0.07
19	600547	山东黄金	2,692,964.00	0.07
20	688508	芯朋微	2,592,401.35	0.07

注：本期累计买入金额指买入成交金额（成交单价乘以成交数量），不考虑相关交易费用。

7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	600938	中国海油	182,734,516.21	4.92
2	002773	康弘药业	143,499,862.95	3.86
3	002318	久立特材	96,302,431.55	2.59
4	600707	彩虹股份	94,679,674.00	2.55
5	601949	中国出版	91,743,465.55	2.47
6	600233	圆通速递	81,788,484.40	2.20
7	000739	普洛药业	46,520,667.13	1.25
8	000063	中兴通讯	46,446,870.35	1.25
9	603296	华勤技术	40,210,338.18	1.08
10	600256	广汇能源	27,065,735.00	0.73
11	600352	浙江龙盛	23,532,831.00	0.63
12	688002	睿创微纳	22,444,805.83	0.60

13	600598	北大荒	20,661,411.00	0.56
14	600941	中国移动	19,631,158.00	0.53
15	600132	重庆啤酒	19,563,854.00	0.53
16	002129	TCL 中环	18,701,887.25	0.50
17	600998	九州通	18,033,013.00	0.49
18	600690	海尔智家	15,240,632.00	0.41
19	688056	莱伯泰科	13,913,781.80	0.37
20	000100	TCL 科技	13,889,114.51	0.37

注：本期累计卖出金额指卖出成交金额（成交单价乘以成交数量），不考虑相关交易费用。

7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	451,939,724.91
卖出股票收入（成交）总额	1,153,991,839.94

注：本项中“买入股票的成本(成交)总额”及“卖出股票的收入(成交)总额”均按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	35,693,802.47	1.43
	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	35,693,802.47	1.43

7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量 (张)	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
1	242580017	25 农行永续 债 01BC	200,000	20,204,931.51	0.81
2	242580034	25 成都银行 永续债 01	150,000	15,488,870.96	0.62

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

无。

7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细
无。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细
无。

7.10 本基金投资股指期货的投资政策
无。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.11.1 本期国债期货投资政策
无。

7.11.2 本期国债期货投资评价
无。

7.12 投资组合报告附注

7.12.1 基金投资的前十名证券的发行主体本期是否出现被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形

1、本基金投资的前十名证券 25 成都银行永续债 01 的发行主体成都银行股份有限公司于 2025 年 12 月 5 日因对相关贷款、存款、贴现、票据业务管理不审慎等受到国家金融监督管理总局四川监管局处罚。本基金认为，对成都银行股份有限公司的处罚不会对其投资价值构成实质性负面影响。

2、本基金投资的前十名证券 25 农行永续债 01BC 的发行主体中国农业银行股份有限公司于 2025 年 10 月 31 日因相关产品销售、服务收费不合规，信贷资金流向管理不审慎等受到国家金融监督管理总局处罚。本基金认为，对中国农业银行股份有限公司的处罚不会对其投资价值构成实质性负面影响。

7.12.2 基金投资的前十名股票是否超出基金合同约定的备选股票库

本基金投资的前十名股票未超出基金合同规定的备选股票库。

7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	-
2	应收清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	2,233,421.97
6	其他应收款	-

7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	2,233,421.97

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

无。

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

无。

7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入原因，分项之和与合计可能有尾差。

§ 8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额级别	持有人户数 (户)	户均持有的基金 份额	持有人结构			
			机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总 份额 比例 (%)	持有份额	占总 份额 比例 (%)
大成策略 回报混合 A	178,126	11,452.34	587,053,796.57	28.78	1,452,906,245.47	71.22
大成策略 回报混合 C	12,629	23,645.59	181,519,521.89	60.79	117,100,690.91	39.21
合计	190,755	12,259.60	768,573,318.46	32.86	1,570,006,936.38	67.14

注：1、上述机构/个人投资者持有份额占总份额比例的计算中，对分级份额，比例的分母采用各自级别的份额，对合计数，比例的分母采用下属分级基金份额的合计数（即期末基金份额总额）。

2、持有人户数为有效户数，即存量份额大于零的账户。

8.2 盈利投资者数量占比

项目	过去一年（2025 年 7 月 1 日-2026 年 6 月 30 日）
盈利投资者数量占比（%）	81.67

8.3 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	大成策略回报混合 A	1,742,569.74	0.0854

理人所有从业人员持有本基金	大成策略回报混合 C	65,779.95	0.0220
	合计	1,808,349.69	0.0773

注：上述占基金总份额比例的计算中，对分级份额，比例的分母采用各自级别的份额，对合计数，比例的分母采用下属分级基金份额的合计数（即期末基金份额总额）。

8.4 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	大成策略回报混合 A	0~10
	大成策略回报混合 C	0
	合计	0~10
本基金基金经理持有本开放式基金	大成策略回报混合 A	10~50
	大成策略回报混合 C	0
	合计	10~50

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	大成策略回报混合 A	大成策略回报混合 C
基金合同生效日（2008 年 11 月 26 日）基金份额总额	1,058,010,199.76	—
本报告期期初基金份额总额	2,590,479,288.11	392,216,816.81
本报告期基金总申购份额	557,549,304.53	100,208,948.77
减：本报告期基金总赎回份额	1,108,068,550.60	193,805,552.78
本报告期基金拆分变动份额	—	—
本报告期期末基金份额总额	2,039,960,042.04	298,620,212.80

§ 10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

无。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

一、基金管理人的重大人事变动

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

二、基金托管人的基金托管部门的重大人事变动

本报告期内基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内无涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

10.4 基金投资策略的改变

本基金投资策略在本报告期内没有重大改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金自基金合同生效日起聘请普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）为本基金提供审计服务，自 2024 年 12 月 11 日起，改聘容诚会计师事务所（特殊普通合伙）为本基金提供审计服务至今。

10.6 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况

10.6.1 管理人受调查或处罚等情况

本报告期内，基金管理人无受调查或处罚等情况。

10.6.2 管理人相关从业人员受调查或处罚等情况

本报告期内，基金管理人相关从业人员无受调查或处罚等情况。

10.6.3 托管人受调查或处罚等情况

本报告期内，本基金托管人无受调查或处罚等情况。

10.6.4 托管人相关从业人员受调查或处罚等情况

本报告期内，本基金托管人相关从业人员无受调查或处罚等情况。

10.7 基金租用或者通过证券公司交易单元进行证券投资的相关情况

10.7.1 基金租用或者通过证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例(%)	佣金	占当期佣金总量的比例(%)	
华泰证券	4	1,353,788,191.96	84.47	617,248.17	84.47	新增1个
华福证券	2	248,961,026.09	15.53	113,509.63	15.53	-
东海证券	1	-	-	-	-	-
光大证券	1	-	-	-	-	-
广发证券	1	-	-	-	-	-
金元证券	1	-	-	-	-	-
中金公司	1	-	-	-	-	-
中信建投证券	1	-	-	-	-	-
中银国际证券	1	-	-	-	-	-

注：本基金采用证券公司交易结算模式，本基金管理人负责选择证券经纪商，使用其交易单元作为本基金的交易单元。证券经纪商的选择标准和流程如下：

（一）筛选标准

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

（二）筛选流程

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

2、公司按照白名单与证券公司进行协议签署。

10.7.2 基金租用或者通过证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易		基金交易	
	成交金	占当	成交金额	占当期	成交金额	占当	成交金	占当

	额	期债 券成 交总 额的 比例 (%)		债券回 购成交 总额的 比例 (%)		期权 证成 交总 额的 比例 (%)	额	期基 金成 交总 额的 比例 (%)
华泰 证券	-	-	4,890,846,000.00	100.00	-	-	-	-

10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	大成策略回报混合型证券投资基金 (A 类份额) 基金产品资料概要更新	中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站	2026 年 06 月 30 日
2	大成策略回报混合型证券投资基金 (C 类份额) 基金产品资料概要更新	中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站	2026 年 06 月 30 日
3	2025 年度公募基金管理人以股东身份（通过公募基金持股）参与股东大会投票信息披露	中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站	2026 年 04 月 30 日
4	大成策略回报混合型证券投资基金 2026 年第 1 季度报告	中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站	2026 年 04 月 22 日
5	大成基金管理有限公司旗下 212 只公募基金 2026 年第 1 季度报告提示性公告	规定报刊	2026 年 04 月 22 日
6	大成基金管理有限公司旗下 205 只公募基金 2025 年年度报告提示性公告	规定报刊	2026 年 03 月 31 日
7	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（2025 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	2026 年 03 月 31 日
8	大成策略回报混合型证券投资基金 2025 年年度报告	中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站	2026 年 03 月 31 日
9	大成基金管理有限公司提醒投资者谨防金融诈骗的公告	中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站	2026 年 02 月 14 日
10	大成基金管理有限公司提醒投资者谨防金融诈骗的公告	中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站	2026 年 01 月 30 日
11	大成策略回报混合型证券投资基金 2025 年第 4 季度报告	中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站	2026 年 01 月 22 日
12	大成基金管理有限公司旗下 205 只	规定报刊	2026 年 01 月 22 日

	公募基金 2025 年第 4 季度报告提示性公告		
13	关于大成策略回报混合型证券投资基金恢复大额申购（含定期定额申购）及转换转入业务的公告	中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站	2026 年 01 月 17 日
14	大成基金管理有限公司关于大成策略回报混合型证券投资基金 2025 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	2026 年 01 月 14 日

§ 11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

无。

11.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§ 12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

- 1、中国证监会批准设立大成策略回报股票型证券投资基金的文件；
- 2、《大成策略回报股票型证券投资基金变更基金名称、基金类别以及修订基金合同部分条款的公告》；
- 3、《大成策略回报混合型证券投资基金基金合同》；
- 4、《大成策略回报混合型证券投资基金托管协议》；
- 5、大成基金管理有限公司批准文件、营业执照、公司章程；
- 6、本报告期内在规定报刊上披露的各种公告原稿。

12.2 存放地点

备查文件存放在本基金管理人和托管人的住所。

12.3 查阅方式

投资者可在营业时间免费查阅，或登录本基金管理人网站 <http://www.dcfund.com.cn> 进行查阅。

大成基金管理有限公司

2026 年 8 月 28 日