

大成价值增长证券投资基金 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：中国农业银行股份有限公司

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。

基金托管人中国农业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	6
2.4 信息披露方式	6
2.5 其他相关资料	6
§ 3 主要财务指标和基金净值表现	6
3.1 主要会计数据和财务指标	6
3.2 基金净值表现	7
§ 4 管理人报告	9
4.1 基金管理人及基金经理情况	9
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	11
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	12
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明	12
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	13
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	13
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	14
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	14
§ 5 托管人报告	14
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	14
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	15
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	15
§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）	15
6.1 资产负债表	15
6.2 利润表	16
6.3 净资产变动表	18
6.4 报表附注	19
§ 7 投资组合报告	45
7.1 期末基金资产组合情况	45
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	46
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	46
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	48
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	50
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	50
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	51

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	51
7.10 本基金投资股指期货的投资政策	51
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	51
7.12 投资组合报告附注	51
§ 8 基金份额持有人信息	52
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	52
8.2 盈利投资者数量占比	52
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	53
§ 9 开放式基金份额变动	53
§ 10 重大事件揭示	54
10.1 基金份额持有人大会决议	54
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	54
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	54
10.4 基金投资策略的改变	54
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	54
10.6 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况	54
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	55
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	大成价值增长证券投资基金	
基金简称	大成价值增长混合	
基金主代码	090001	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2002 年 11 月 11 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	1,161,347,748.08 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	大成价值增长混合 A	大成价值增长混合 C
下属分级基金的交易代码	090001	018457
下属分级基金的前端交易代码	090001	—
下属分级基金的后端交易代码	091001	—
报告期末下属分级基金的份额总额	1,158,737,433.46 份	2,610,314.62 份

2.2 基金产品说明

投资目标	以价值增长类股票为主构造投资组合，在有效分散投资风险的基础上，通过资产配置和投资组合的动态调整，达到超过市场的风险收益比之目标，实现基金资产的长期稳定增值。
投资策略	本基金投资策略分三个层次：资产配置和行业配置遵循自上而下的积极策略，个股选择遵循自下而上的积极策略。本基金的国债投资比例将不低于 20%，股票投资部分重点关注：低 P/B 值、具有可持续增长潜力、盈利水平超过行业平均水平、具有核心竞争力的优势企业。在控制风险的前提下，本基金将根据本基金的投资目标和股票投资策略，基于对基础证券投资价值的深入研究判断，进行存托凭证的投资。
业绩比较基准	沪深 300 指数×80%+中债综合指数×20%
风险收益特征	本基金的收益与风险介于价值型基金与成长型基金之间，具有风险中等、收益较高的特点。

注：本基金原业绩比较基准为中信价值指数×80%+中信国债指数×20%，自 2008 年 3 月 1 日起变更为：沪深 300 指数×80%+中信标普国债指数×20%，自 2015 年 9 月 14 日起变更为：沪深 300 指数×80%+中债综合指数×20%。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		大成基金管理有限公司	中国农业银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	段皓静	任航
	联系电话	0755-83183388	010-66060069
	电子邮箱	office@dcfund.com.cn	tgxxpl@abchina.com
客户服务电话		4008885558	95599
传真		0755-83199588	010-68121816
注册地址		广东省深圳市南山区海德三道 1236 号大成基金总部大厦 5 层、27-33 层	北京市东城区建国门内大街 69 号
办公地址		广东省深圳市南山区海德三道 1236 号大成基金总部大厦 5 层、27-33 层	北京市西城区复兴门内大街 28 号凯晨世贸中心东座 F9
邮政编码		518054	100031
法定代表人		吴庆斌	谷澍

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《证券时报》
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)	
	大成价值增长混合 A	大成价值增长混合 C
本期已实现收益	222,435,858.81	135,856.87
本期利润	387,336,361.22	378,321.04
加权平均基金份额本期利润	0.3177	0.7778
本期加权平均净值利润率	35.72%	79.50%
本期基金份额净值增长率	40.78%	40.51%
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	126,945,350.93	250,722.66
期末可供分配基金份额利润	0.1096	0.0961
期末基金资产净值	1,285,682,784.39	2,861,037.28
期末基金份额净值	1.1096	1.0961
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	1,412.57%	26.88%
-------------	-----------	--------

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

大成价值增长混合 A

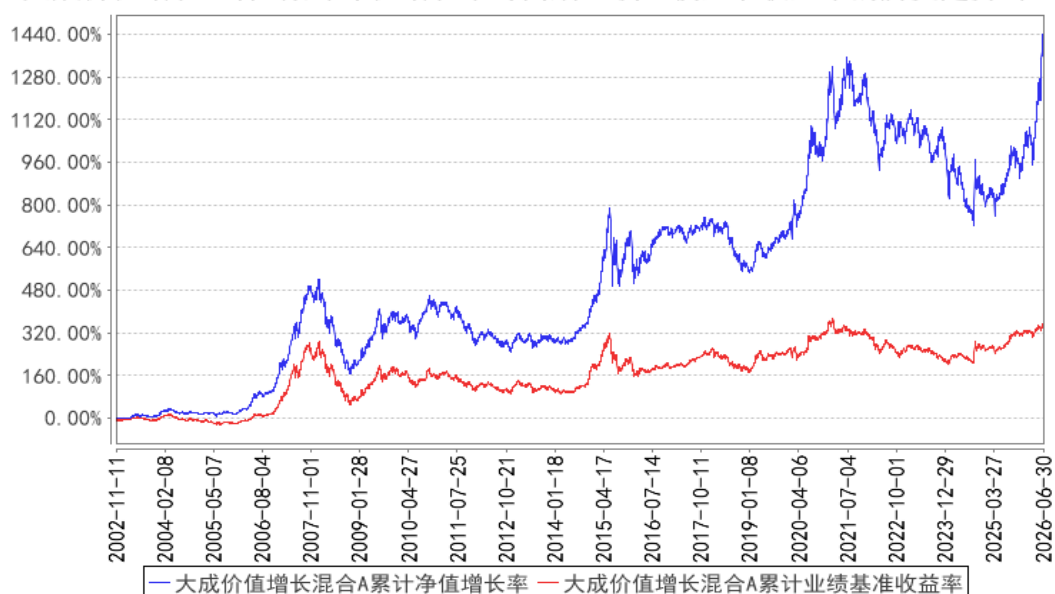
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去三个月	41.19%	2.21%	9.75%	1.01%	31.44%	1.20%
过去六个月	40.78%	1.90%	6.55%	0.91%	34.23%	0.99%
过去一年	57.35%	1.60%	21.33%	0.81%	36.02%	0.79%
过去三年	26.18%	1.42%	26.99%	0.89%	-0.81%	0.53%
过去五年	3.88%	1.28%	1.58%	0.89%	2.30%	0.39%
过去七年	107.09%	1.26%	33.24%	0.93%	73.85%	0.33%
过去十年	106.94%	1.14%	59.88%	0.92%	47.06%	0.22%
自基金合同生效起至今	1,412.57%	1.30%	347.04%	1.25%	1,065.53%	0.05%

大成价值增长混合 C

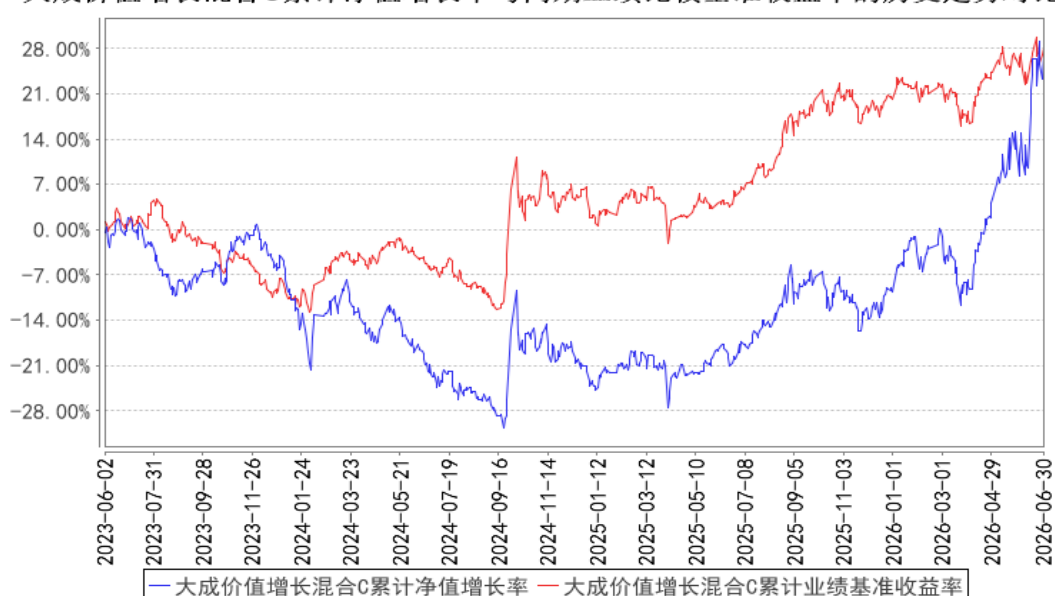
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去三个月	41.05%	2.21%	9.75%	1.01%	31.30%	1.20%
过去六个月	40.51%	1.90%	6.55%	0.91%	33.96%	0.99%
过去一年	56.72%	1.60%	21.33%	0.81%	35.39%	0.79%
过去三年	24.67%	1.42%	26.99%	0.89%	-2.32%	0.53%
自基金合同生效起至今	26.88%	1.41%	28.05%	0.88%	-1.17%	0.53%

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

大成价值增长混合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



大成价值增长混合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、本基金自2023年5月31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6月2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		
杨挺	本基金基金经理	2017 年 9 月 12 日	—	18 年	天津大学工学硕士。曾任广发证券股份有限公司发展研究中心研究员。2012 年 8 月加入大成基金管理有限公司，曾担任研究部研究员、基金经理助理，现任股票投资部基金经理。2019 年 2 月 20 日至 2020 年 6 月 29 日任大成国家安全主题灵活配置混合型证券投资基金基金经理。2014 年 6 月 26 日起任大成健康产业混合型证券投资基金基金经理（更名前为大成健康产业股票型证券投资基金）。2015 年 7 月 8 日至 2022 年 11 月 27 日大成正向回报灵活配置混合型证券投资基金基金经理。2017 年 9 月 12 日起任大成价值增长证券投资基金基金经理。2021 年 9 月 16 日起任大成医药健康股票型证券投资基金基金经理。2022 年 5 月 6 日至 2023 年 6 月 5 日任大成品质医疗股票型证券投资基

					金基金经理。具有基金从业资格。国籍：中国
孙丹	本基金基金经理助理，混合资产投资部总监	2020 年 7 月 6 日	-	18 年	美国德克萨斯 A&M 大学经济学硕士。2008 年至 2012 年任景顺长城产品开发部产品经理。2012 年至 2014 年任华夏基金机构债券投资部研究员。2014 年 5 月加入大成基金管理有限公司，曾担任固定收益总部信用策略及宏观利率研究员、基金经理助理、固定收益总部总监助理、固定收益总部副总监、混合资产投资部副总监，现任混合资产投资部总监。2017 年 5 月 8 日起任大成景尚灵活配置混合型证券投资基金、大成景兴信用债债券型证券投资基金基金经理。2017 年 5 月 8 日至 2019 年 10 月 31 日任大成景荣债券型证券投资基金（原大成景荣保本混合型证券投资基金转型）基金经理。2017 年 5 月 31 日至 2020 年 10 月 20 日任大成惠裕定期开放纯债债券型证券投资基金基金经理。2017 年 6 月 2 日至 2018 年 11 月 19 日任大成景禄灵活配置混合型证券投资基金基金经理。2017 年 6 月 2 日至 2018 年 12 月 8 日任大成景源灵活配置混合型证券投资基金基金经理。2017 年 6 月 2 日至 2019 年 6 月 15 日任大成景秀灵活配置混合型证券投资基金基金经理。2017 年 6 月 6 日至 2019 年 9 月 29 日任大成惠明定期开放纯债债券型证券投资基金基金经理。2018 年 3 月 14 日至 2018 年 11 月 30 日任大成景辉灵活配置混合型证券投资基金基金经理。2018 年 3 月 14 日至 2018 年 11 月 30 日任大成景沛灵活配置混合型证券投资基金基金经理。2018 年 3 月 14 日至 2018 年 7 月 20 日任大成景裕灵活配置混合型证券投资基金基金经理。2018 年 3 月 14 日起任大成财富管理 2020 生命周期证券投资基金基金经理。2019 年 7 月 31 日至 2020 年 5 月 23 日任大成景丰债券型证券投资基金（LOF）基金经理。2020 年 2 月 27 日至 2021 年 4 月 13 日任大成景泰纯债债券型证券投资基金基金经理。2020 年 3 月 5 日至 2021 年 4 月 14 日任大成恒享混合型证券投资基金基金经理。2020 年 3 月 31 日至 2021 年 4 月 14 日任大成民稳增长混合型证券投资

					资基金基金经理。2020 年 4 月 26 日至 2023 年 8 月 31 日任大成景瑞稳健配置混合型证券投资基金基金经理。2020 年 8 月 21 日至 2021 年 5 月 18 日任大成景和债券型证券投资基金基金经理。2020 年 9 月 3 日至 2021 年 11 月 26 日任大成汇享一年持有期混合型证券投资基金基金经理。2020 年 9 月 23 日至 2023 年 3 月 24 日任大成尊享 18 个月持有期混合型发起式证券投资基金（原大成尊享 18 个月定期开放混合型证券投资基金转型）基金经理。2020 年 11 月 16 日至 2024 年 12 月 9 日任大成卓享一年持有期混合型证券投资基金基金经理。2020 年 11 月 18 日至 2024 年 8 月 14 日任大成丰享回报混合型证券投资基金基金经理。2021 年 4 月 22 日至 2024 年 6 月 6 日任大成安享得利六个月持有期混合型证券投资基金基金经理。2022 年 3 月 11 日起任大成民享安盈一年持有期混合型证券投资基金基金经理。2023 年 2 月 24 日至 2025 年 4 月 14 日任大成盛享一年持有期混合型证券投资基金基金经理。2023 年 11 月 2 日起任大成元丰多利债券型证券投资基金基金经理。2024 年 4 月 2 日起任大成元辰招利债券型证券投资基金基金经理。2025 年 3 月 10 日起任大成安享得利六个月持有期混合型证券投资基金基金经理。2025 年 11 月 4 日起任大成元享臻利债券型证券投资基金基金经理。2025 年 12 月 18 日起任大成优享 6 个月持有期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

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

2026 年二季度，全球资本市场的配置加速向 AI 聚焦，核心原因在于 AI 的能力跳跃式增长：AI 大模型能力实现从代码生成（Coding）向自主智能体（Agent）的关键跃升，Agent 能够独立完成多步骤、高复杂度的真实任务，单次任务调用的 Token 消耗较传统对话场景呈指数级增长。AI 能实现长程的 Agent 任务，在大幅提升主要应用场景渗透率同时，也给供给端带来极大刺激——全球主要云厂商的积压订单（backlog/PRO）在公布一季度财报时大幅增长，未来收入和在手订单大幅跃升，为资本开支提供强劲支撑，季内密集上修全年算力投资指引。一端是 Token 的指数级增长的需求，而另一端的硬件供应链必须服从物理约束只能线性扩产。供需矛盾，导致 AI 硬件供应链全面吃紧，并通过“挤出效应”，将供需错配扩散到非 AI 的传统行业，也使得对 AI 的关注度“破圈”吸引更多资金配置。

二级市场上，AI 算力与硬件成为全球权益资产最核心的结构性主线，季末市场从预期驱动转向订单与盈利验证。操作层面，本基金在二季度增加 AI 硬件配置，布局方向兼顾全球算力产业链

与国内自主可控两条主线，在产业趋势与估值间动态平衡，力争把握算力基础设施长周期增长机遇。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末大成价值增长混合 A 的基金份额净值为 1.1096 元，本报告期基金份额净值增长率为 40.78%，同期业绩比较基准收益率为 6.55%；截至本报告期末大成价值增长混合 C 的基金份额净值为 1.0961 元，本报告期基金份额净值增长率为 40.51%，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

展望下半年，全球宏观经济整体维持平稳运行态势，但包括美联储在内的主要央行货币政策路径的不确定性有所上升。市场对美联储未来利率路径的预期存在分歧，加息与否与加息节奏的预期变化将对全球大类资产估值产生扰动，需密切跟踪美国通胀数据及劳动力市场演变。与此同时，AI 相关资本开支与硬件产业链已在中美两国 GDP 及进出口中的占比显著提升，短期正成为主导经济波动的重要产业变量。AI 不仅通过投资、贸易影响宏观经济，也通过估值、融资影响金融市场。

美联储加息预期抬头，也是全球资本市场 7 月 AI 交易大幅调整的触发因素之一，但 7 月调整的核心原因在于前期交易结构过度拥挤，而非产业基本面发生根本性逆转。中长期看，如果 AI 模型能力实现进一步提升，仍有望向更多应用场景拓展，企业级推理需求渗透率仍可以持续提升。短期，从订单可见度、资本开支指引及产业链供需格局来看，AI 算力硬件仍在扩张趋势中。随着市场情绪修复，后续投资将更趋于理性，市场将从泛泛的景气投资阶段切换至业绩验证、技术路线驱动的投资阶段。具备真实订单支撑、盈利持续兑现能力以及技术路线正确的优势企业有望跑赢。

操作思路方面，本基金将坚持上一季度选择的聚焦 AI 算力基础设施配置策略，同时兼顾估值安全边际与组合流动性管理。配置方向上，本基金将持续把握两条主线：一是全球算力产业链中供需格局最为紧张的环节，二是国内自主可控方向中具备突破能力的优质资产，在产业趋势与估值合理区间之间保持动态平衡。本基金亦将密切跟踪美联储货币政策变化及全球流动性拐点信号，合理控制利率预期波动带来的估值风险，在市场波动中保持定力，力争为持有人获取长期可持续的回报。

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。本报告期内本基金无收益分配事项。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

无。

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内，中国农业银行股份有限公司（以下简称“本基金托管人”）在本基金的托管过程中，严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》及其他相关法律、法规的规定和基金合同、托管协议的约定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

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，本基金托管人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》及其他相关法律、法规的规定和基金合同、托管协议的约定，对本基金的投资运作情况进行了必要的监督，对本基金的基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格计算、基金费用开支、利润分配等方面进行了复核，未发现基金管理人有关损害基金份额持有人利益的行为。

5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本基金托管人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》及其他相关法律、法规的规定和基金合同、托管协议的约定，以自身能够获取的数据和信息为限，对本基金中期报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容进行核查，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：大成价值增长证券投资基金

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	90,759,325.96	21,102,240.51
结算备付金		5,735,584.01	1,185,643.84
存出保证金		547,710.64	476,822.08
交易性金融资产	6.4.7.2	1,158,731,464.24	980,823,384.31
其中：股票投资		896,414,584.06	764,617,436.37
基金投资		-	-
债券投资		262,316,880.18	216,205,947.94
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		35,890,496.18	10,253,523.19
应收股利		-	-
应收申购款		1,025,202.93	174,152.44
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.8	-	-
资产总计		1,292,689,783.96	1,014,015,766.37

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		-	3,053,942.82
应付赎回款		1,442,461.92	365,088.29
应付管理人报酬		1,195,250.27	1,012,127.23
应付托管费		199,208.40	168,687.89
应付销售服务费		645.28	40.36
应付投资顾问费		-	-
应交税费		2,990.27	1.05
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.9	1,305,406.15	592,094.17
负债合计		4,145,962.29	5,191,981.81
净资产：			
实收基金	6.4.7.10	1,161,347,748.08	1,279,945,684.68
未分配利润	6.4.7.12	127,196,073.59	-271,121,900.12
净资产合计		1,288,543,821.67	1,008,823,784.56
负债和净资产总计		1,292,689,783.96	1,014,015,766.37

注：报告截止日 2026 年 6 月 30 日，基金份额总额 1,161,347,748.08 份。其中大成价值增长混合 A 类基金份额总额为 1,158,737,433.46 份，基金份额净值 1.1096 元；大成价值增长混合 C 类基金份额总额为 2,610,314.62 份，基金份额净值 1.0961 元。

6.2 利润表

会计主体：大成价值增长证券投资基金

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 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
一、营业总收入		395,359,651.21	42,426,610.96
1. 利息收入		72,743.62	75,412.82
其中：存款利息收入	6.4.7.13	72,743.62	75,412.82
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		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		230,052,264.14	-32,118,310.28
其中：股票投资收益	6.4.7.14	226,485,345.04	-40,521,894.57
基金投资收益	6.4.7.15	-	-
债券投资收益	6.4.7.16	2,024,528.77	2,508,407.48
资产支持证券投资	6.4.7.17	-	-
收益			
贵金属投资收	6.4.7.18	-	-
益			
衍生工具收益	6.4.7.19	-	-
股利收益	6.4.7.20	1,542,390.33	5,895,176.81
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	6.4.7.21	165,142,966.58	74,447,292.81
列）			
4. 汇兑收益（损失以		-	-
“-”号填列）			
5. 其他收入（损失以	6.4.7.22	91,676.87	22,215.61
“-”号填列）			
减：二、营业总支出		7,644,968.95	6,682,855.62
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	6,445,483.95	5,628,019.53
2. 托管费	6.4.10.2.2	1,074,247.30	938,003.26
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	904.77	157.48
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		1,376.77	0.05
8. 其他费用	6.4.7.24	122,956.16	116,675.30
三、利润总额（亏损		387,714,682.26	35,743,755.34
总额以“-”号填列）			
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损		387,714,682.26	35,743,755.34
以“-”号填列）			
五、其他综合收益的		-	-
税后净额			
六、综合收益总额		387,714,682.26	35,743,755.34

6.3 净资产变动表

会计主体：大成价值增长证券投资基金

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	1,279,945,684.68	-	-271,121,900.12	1,008,823,784.56
二、本期期初净资产	1,279,945,684.68	-	-271,121,900.12	1,008,823,784.56
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-118,597,936.60	-	398,317,973.71	279,720,037.11
（一）、综合收益总额	-	-	387,714,682.26	387,714,682.26
（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）	-118,597,936.60	-	10,603,291.45	-107,994,645.15
其中：1. 基金申购款	35,908,488.43	-	-2,466,943.27	33,441,545.16
2. 基金赎回款	-154,506,425.03	-	13,070,234.72	-141,436,190.31
（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	1,161,347,748.08	-	127,196,073.59	1,288,543,821.67
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	1,396,562,202.28	-	-448,059,652.34	948,502,549.94
二、本期期初净资产	1,396,562,202.28	-	-448,059,652.34	948,502,549.94

三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-37,034,120.97	-	47,296,178.15	10,262,057.18
（一）、综合收益总额	-	-	35,743,755.34	35,743,755.34
（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）	-37,034,120.97	-	11,552,422.81	-25,481,698.16
其中：1. 基金申购款	12,024,663.55	-	-3,812,190.89	8,212,472.66
2. 基金赎回款	-49,058,784.52	-	15,364,613.70	-33,694,170.82
（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	1,359,528,081.31	-	-400,763,474.19	958,764,607.12

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署：

谭晓冈

范瑛

梁靖

基金管理人负责人

主管会计工作负责人

会计机构负责人

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

大成价值增长证券投资基金(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”)证监基金字[2002]第 58 号《关于同意大成价值增长证券投资基金设立的批复》核准，由大成基金管理有限公司依照《证券投资基金管理暂行办法》及其实施细则、《开放式证券投资基金试点办法》等有关规定和《大成价值增长证券投资基金基金契约》(后更名为《大成价值增长证券投资基金基金合同》)发起，并于 2002 年 11 月 11 日募集成立。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 2,603,664,854.20 元，业经普华永道中天会计师事务所有限公司普华永道验字(2002)第 124 号验资报告予以验证，基金合同生效日的

基金份额总额为 2,604,752,899.89 份基金份额，认购资金利息折合 1,088,045.69 份基金份额。

本基金的基金管理人为大成基金管理有限公司，基金托管人为中国农业银行股份有限公司。

根据本基金的基金管理人于 2023 年 5 月 26 日发布的《关于大成价值增长证券投资基金增设 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 5 月 31 日起对本基金进行份额分类，增加 C 类份额，原有在投资者申购时缴纳前端申购费用模式的份额转为 A 类基金份额，在投资者赎回时缴纳后端申购费用模式的份额转为 B 类基金份额。其中，A 类基金份额和 B 类基金份额不从本类别基金资产中计提销售服务费；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。根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《大成价值增长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公开发行、上市的股票、存托凭证、债券及中国证监会允许基金投资的其他金融工具，主要投资对象为深、沪两市 A 股中 P/B 值低、具有良好增长潜力的上市公司。本基金投资于股票、存托凭证、债券的比例不低于基金资产总值的 80%；投资于国债的比例不低于基金资产净值的 20%。

根据本基金的基金管理人于 2015 年 9 月 14 日发布的《大成价值增长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“沪深 300 指数×80%+中信标普国债指数×20%”变更为“沪深 300 指数×80%+中债综合指数×20%”。

6.4.2 会计报表的编制基础

本财务报表系按照财政部颁布的《企业会计准则——基本准则》以及其后颁布及修订的具体会计准则、解释以及《资产管理产品相关会计处理规定》和其他相关规定（统称“企业会计准则”）编制，同时，在信息披露和估值方面，也参考了中国证监会颁布的《中国证券监督管理委员会关于证券投资基金估值业务的指导意见》、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》、《公开募集证券投资基金信息披露内容与格式准则第 2 号——定期报告的内容与格式》、《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〉》，中国证券投资基金业协会发布的《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》以及中国证监会和中国证券投资基金业协会颁布的其他相关规定。

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金 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

（1）增值税及附加

根据中华人民共和国主席令第四十一号《中华人民共和国增值税法》、中华人民共和国国务院令 第 826 号《中华人民共和国增值税法实施条例》及财政部、税务总局公告 2026 年第 10 号《关于增值税法施行后增值税优惠政策衔接事项的公告》的规定，资管产品运营过程中发生的应税交易，资管产品管理人为纳税人；自 2026 年 1 月 1 日至 2027 年 12 月 31 日，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% 的规定征收率计算缴纳增值税，公募证券投资基金（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、债券取得的收入及金融同业往来利息收入免征增值税，金融同业往来利息收入包括金融机构与人民银行所发生的资金往来业务、银行联行往来业务、金融机构间的资金往来业务，以及金融机构开展同业存款、同业借款、同业代付、买断式买入返售金融商品、质押式买入返售金融商品、同业存单，取得的利息收入；取得存款利息收入不属于应税交易，不征收增值税。

根据财政部、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》的规定，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《财政部 国家税务总局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《财政部 国家税务总局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《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《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，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《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，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《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《关于深港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》及其他境内外相关税务法规的规定和实务操作执行。

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 货币资金

单位：人民币元

项目	本期末 2026 年 6 月 30 日
活期存款	90,759,325.96

等于：本金	90,755,099.11
加：应计利息	4,226.85
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	90,759,325.96

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		623,114,795.95	-	896,414,584.06	273,299,788.11
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-	-
债券	交易所市场	27,645,425.00	313,978.58	27,924,998.58	-34,405.00
	银行间市场	232,876,516.00	1,528,881.60	234,391,881.60	-13,516.00
	合计	260,521,941.00	1,842,860.18	262,316,880.18	-47,921.00
资产支持证券		-	-	-	-
基金		-	-	-	-
其他		-	-	-	-
合计		883,636,736.95	1,842,860.18	1,158,731,464.24	273,251,867.11

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	2,712.24
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	1,199,174.36

其中：交易所市场	1,198,799.36
银行间市场	375.00
应付利息	—
预提费用	103,519.55
合计	1,305,406.15

6.4.7.10 实收基金

金额单位：人民币元

大成价值增长混合 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	1,279,787,033.57	1,279,787,033.57
本期申购	33,119,702.37	33,119,702.37
本期赎回（以“-”号填列）	-154,169,302.48	-154,169,302.48
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	1,158,737,433.46	1,158,737,433.46

大成价值增长混合 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	158,651.11	158,651.11
本期申购	2,788,786.06	2,788,786.06
本期赎回（以“-”号填列）	-337,122.55	-337,122.55
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	2,610,314.62	2,610,314.62

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

大成价值增长混合 A

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	168,983,607.71	-440,070,613.74	-271,087,006.03
本期期初	168,983,607.71	-440,070,613.74	-271,087,006.03
本期利润	222,435,858.81	164,900,502.41	387,336,361.22

本期基金份额交易产生的变动数	-24,603,941.12	35,299,936.86	10,695,995.74
其中：基金申购款	7,339,545.76	-9,689,149.05	-2,349,603.29
基金赎回款	-31,943,486.88	44,989,085.91	13,045,599.03
本期已分配利润	-	-	-
本期末	366,815,525.40	-239,870,174.47	126,945,350.93

大成价值增长混合 C

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	19,764.01	-54,658.10	-34,894.09
本期期初	19,764.01	-54,658.10	-34,894.09
本期利润	135,856.87	242,464.17	378,321.04
本期基金份额交易产生的变动数	641,332.19	-734,036.48	-92,704.29
其中：基金申购款	715,949.17	-833,289.15	-117,339.98
基金赎回款	-74,616.98	99,252.67	24,635.69
本期已分配利润	-	-	-
本期末	796,953.07	-546,230.41	250,722.66

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	68,272.56
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	3,591.03
其他	880.03
合计	72,743.62

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	226,485,345.04
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	226,485,345.04

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	2,185,501,755.05
减：卖出股票成本总额	1,955,788,420.31
减：交易费用	3,227,989.70
买卖股票差价收入	226,485,345.04

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	1,830,481.76
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	194,047.01
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	2,024,528.77

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	68,581,034.18
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	67,787,667.03
减：应计利息总额	598,477.22
减：交易费用	842.92
买卖债券差价收入	194,047.01

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	1,542,390.33
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	1,542,390.33

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	165,142,966.58

股票投资	164,636,832.05
债券投资	506,134.53
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	165,142,966.58

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	90,090.31
基金转换费收入	1,586.56
合计	91,676.87

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	34,712.18
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	—
存托服务费	42.31
银行划款手续费	10,094.30
账户维护费	18,600.00
合计	122,956.16

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
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

金额单位：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	
	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	160,149,322.39	3.90	-	-

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

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
-------	---------------------------------------

	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	73,028.09	3.90	73,028.09	6.09
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 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 （%）
—	—	—	—	—

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。

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	6,445,483.95	5,628,019.53
其中：应支付销售机构的客户维护费	1,508,674.25	1,298,684.85
应支付基金管理人的净管理费	4,936,809.70	4,329,334.68

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：

$$\text{日管理费} = \text{前一日基金资产净值} \times \text{管理费年费率} / \text{当年天数}。$$

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	1,074,247.30	938,003.26

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：

$$\text{日托管费} = \text{前一日基金资产净值} \times \text{托管费年费率} / \text{当年天数}。$$

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		
	大成价值增长混合 A	大成价值增长混合 C	合计
大成基金	-	62.87	62.87
合计	-	62.87	62.87
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		
	大成价值增长混合 A	大成价值增长混合 C	合计
大成基金	-	15.06	15.06
合计	-	15.06	15.06

注：C 类基金份额的销售服务费年费率为 0.40%。

销售服务费的计算方法如下：

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

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		

	大成价值增长混合 A	大成价值增长混合 C
基金合同生效日 （ 2002 年 11 月 11 日）持有的基 金份额	—	—
报告期初持有的 基金份额	—	11,575.41
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	—	11,575.41
报告期末持有的 基金份额 占基金总份额比 例	—	0.00%
项目	上年度可比期间 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日	
	大成价值增长混合 A	大成价值增长混合 C
基金合同生效日 （ 2002 年 11 月 11 日）持有的基 金份额	—	—
报告期初持有的 基金份额	—	11,575.41
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	—	11,575.41
报告期末持有的 基金份额 占基金总份额比 例	—	0.00%

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
中国农业银行	90,759,325.96	68,272.56	33,805,791.69	72,840.15

注：本基金由基金托管人保管的银行存款，按银行约定利率计息。

6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

无。

6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

无。

6.4.11 利润分配情况

无。

6.4.12 期末（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	16,231	164,095.41	164,095.41	-

001248	华润新能源	2026年6月24日	6个月	新股未上市	10.11	10.11	37,875	382,916.25	382,916.25	-
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	-
001365	天海电子	2026年5月11日	6个月	新股锁定	27.19	31.31	719	19,549.61	22,511.89	-
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	5,904	59,748.48	163,717.92	-
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	-

301666	大普微	2026年4月8日	6个月	新股锁定	46.08	463.33	1,220	56,217.60	565,262.60	-
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	2026	6个月	新	33.49	33.93	72	2,411.28	2,442.96	-

	泰克	年 4 月 9 日		股 锁 定						
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	-
688712	北芯生命	2026 年 1 月 28 日	6 个月	新 股 锁 定	17.52	35.92	234	4,099.68	8,405.28	-
688759	必贝特	2025 年 10 月 21 日	9 个月	新 股 锁 定	17.78	30.65	12,552	223,174.56	384,718.80	-
688765	禾元生物	2025 年 10 月 16 日	9 个月	新 股 锁 定	29.06	48.56	16,470	478,618.20	799,783.20	-
688781	视涯科技	2026 年 3 月 18 日	9 个月	新 股 锁 定	22.68	42.16	6,335	143,677.80	267,083.60	-

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	-
688790	昂瑞微	2025年12月9日	9个月	新股锁定	83.06	126.45	2,319	192,616.14	293,237.55	-
688795	摩尔线程	2025年11月26日	9个月	新股锁定	114.28	676.94	3,593	410,608.04	2,432,245.42	-
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	-
688802	沐曦股份	2025年12月9日	9个月	新股锁定	104.66	768.89	2,629	275,151.14	2,021,411.81	-
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	1,431	28,162.08	202,472.19	-

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

无。

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

本基金是一只偏股型的证券投资基金，属于高风险品种。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相对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“相对收益高、风险适中”的风险收益目标。

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

本基金的基金管理人对于金融工具的风险管理方法主要是通过定性分析和定量分析的方法去

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

6.4.13.2 信用风险

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

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

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

本期末，本基金未持有除国债、央行票据和政策性金融债以外的债券(上年度末：本基金持有的除国债、央行票据和政策性金融债以外的债券占基金资产净值的比例为 0.04%)。

6.4.13.3 流动性风险

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

6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》及《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》等有关法规的要求建立健全开放式基金流动性风险管理的内部控制体系，审慎评估各类资产的流动性，针对性制定流动性风险管理措施，对本基金组合资产的流动性风险进行管理。本基金的基金管理人采用监控基金组合资产持仓集中度指标、逆回购交易的到期日与交易对手的集中度、流动性受限资产比例、基金组合资产中 7 个工作日可变现资产

的可变现价值以及压力测试等方式防范流动性风险。并于开放日对本基金的申购赎回情况进行监控，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配，确保本基金资产的变现能力与投资者赎回需求的匹配与平衡。本基金的基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。

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	90,759,325.96	-	-	-	90,759,325.96
结算备付金	5,735,584.01	-	-	-	5,735,584.01
存出保证金	547,710.64	-	-	-	547,710.64
交易性金融资产	98,564,663.74	163,752,216.44	-	-896,414,584.06	1,158,731,464.24
应收申购款	-	-	-	1,025,202.93	1,025,202.93

应收清算款	-	-	-	35,890,496.18	35,890,496.18
资产总计	195,607,284.35	163,752,216.44	-	933,330,283.17	1,292,689,783.96
负债					
应付赎回款	-	-	-	1,442,461.92	1,442,461.92
应付管理人报酬	-	-	-	1,195,250.27	1,195,250.27
应付托管费	-	-	-	199,208.40	199,208.40
应付销售服务费	-	-	-	645.28	645.28
应交税费	-	-	-	2,990.27	2,990.27
其他负债	-	-	-	1,305,406.15	1,305,406.15
负债总计	-	-	-	4,145,962.29	4,145,962.29
利率敏感度缺口	195,607,284.35	163,752,216.44	-	929,184,320.88	1,288,543,821.67
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	21,102,240.51	-	-	-	21,102,240.51
结算备付金	1,185,643.84	-	-	-	1,185,643.84
存出保证金	476,822.08	-	-	-	476,822.08
交易性金融资产	112,505,854.92	51,567,550.68	52,132,542.34	764,617,436.37	980,823,384.31
应收申购款	-	-	-	174,152.44	174,152.44
应收清算款	-	-	-	10,253,523.19	10,253,523.19
资产总计	135,270,561.35	51,567,550.68	52,132,542.34	775,045,112.00	1,014,015,766.37
负债					
应付赎回款	-	-	-	365,088.29	365,088.29
应付管理人报酬	-	-	-	1,012,127.23	1,012,127.23
应付托管费	-	-	-	168,687.89	168,687.89
应付清算款	-	-	-	3,053,942.82	3,053,942.82
应付销售服务费	-	-	-	40.36	40.36
应交税费	-	-	-	1.05	1.05
其他负债	-	-	-	592,094.17	592,094.17
负债总计	-	-	-	5,191,981.81	5,191,981.81
利率敏感度缺口	135,270,561.35	51,567,550.68	52,132,542.34	769,853,130.19	1,008,823,784.56

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

假设	除市场利率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）
	市场利率上升 25	-1,310,942.55	-1,049,348.78

	个基点		
	市场利率下降 25 个基点	1, 326, 423. 83	1, 062, 852. 83

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。本基金投资于股票、存托凭证、债券的比例不低于基金资产总值的 80%；投资于国债的比例不低于基金资产净值的 20%。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	896, 414, 584. 06	69. 57	764, 617, 436. 37	75. 79
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	896,414,584.06	69.57	764,617,436.37	75.79

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%	103,331,591.23	66,717,091.73
	业绩比较基准下降 5%	-103,331,591.23	-66,717,091.73

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	887,717,762.47	716,757,546.55
第二层次	262,863,891.84	230,462,576.42
第三层次	8,149,809.93	33,603,261.34
合计	1,158,731,464.24	980,823,384.31

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	896,414,584.06	69.34
	其中：股票	896,414,584.06	69.34
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	262,316,880.18	20.29
	其中：债券	262,316,880.18	20.29
	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	96,494,909.97	7.46
8	其他各项资产	37,463,409.75	2.90
9	合计	1,292,689,783.96	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	-	-
B	采矿业	36,149.82	0.00
C	制造业	895,821,319.24	69.52
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	547,011.66	0.04
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	1,583.46	0.00
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	-	-
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	8,519.88	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	896,414,584.06	69.57

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	002463	沪电股份	789,400	120,620,320.00	9.36
2	002384	东山精密	417,538	109,541,094.30	8.50
3	301511	德福科技	756,200	108,779,370.00	8.44
4	688012	中微公司	223,156	104,548,586.00	8.11
5	300620	光库科技	242,700	91,789,140.00	7.12
6	300394	天孚通信	255,920	77,461,865.60	6.01
7	002436	兴森科技	1,475,400	75,171,630.00	5.83

8	300308	中际旭创	47,300	60,071,000.00	4.66
9	688313	仕佳光子	279,332	51,578,653.80	4.00
10	301196	唯科科技	351,170	44,043,741.40	3.42
11	688347	华虹宏力	108,999	36,656,363.70	2.84
12	002290	禾盛新材	71,100	6,531,957.00	0.51
13	688795	摩尔线程	3,593	2,432,245.42	0.19
14	688802	沐曦股份	2,629	2,021,411.81	0.16
15	688765	禾元生物	16,470	799,783.20	0.06
16	600482	中国动力	19,800	649,440.00	0.05
17	301666	大普微	1,220	565,262.60	0.04
18	001248	华润新能源	54,106	547,011.66	0.04
19	688759	必贝特	12,552	384,718.80	0.03
20	688790	昂瑞微	2,319	293,237.55	0.02
21	688781	视涯科技	6,335	267,083.60	0.02
22	688808	联讯仪器	163	258,245.79	0.02
23	688820	盛合晶微	1,431	202,472.19	0.02
24	001399	惠科股份	5,904	163,717.92	0.01
25	688809	强一股份	259	161,357.00	0.01
26	688818	电科蓝天	1,717	120,430.38	0.01
27	301682	宏明电子	714	114,282.84	0.01
28	688797	臻宝科技	207	97,014.69	0.01
29	688785	恒运昌	116	53,725.40	0.00
30	688807	优迅股份	131	52,718.33	0.00
31	688813	泰金新能	234	40,269.06	0.00
32	688635	长进光子	128	39,448.32	0.00
33	001257	盛龙股份	1,743	36,149.82	0.00
34	603459	红板科技	330	27,825.60	0.00
35	001365	天海电子	719	22,511.89	0.00
36	688811	有研复材	834	20,124.42	0.00
37	301696	三瑞智能	216	18,748.80	0.00
38	001237	惠康科技	285	16,740.90	0.00
39	301669	高特电子	546	15,506.40	0.00
40	301687	新广益	195	15,167.10	0.00
41	001393	维通利	387	15,089.13	0.00
42	301531	春光集团	290	14,952.40	0.00
43	301599	理奇智能	433	14,059.51	0.00
44	601112	振石股份	775	13,632.25	0.00
45	301680	固德电材	117	13,122.72	0.00
46	688805	健信超导	265	12,447.05	0.00
47	001369	双欣材料	897	12,127.44	0.00
48	301683	慧谷新材	96	11,689.92	0.00
49	301667	纳百川	151	10,920.32	0.00
50	688816	易思维	177	10,106.70	0.00

51	688712	北芯生命	234	8,405.28	0.00
52	301513	尚水智能	138	7,032.48	0.00
53	603014	威高血净	205	6,709.65	0.00
54	301449	天溯计量	157	6,075.90	0.00
55	603248	锡华科技	260	5,483.40	0.00
56	603435	嘉德利	104	4,857.84	0.00
57	603092	德力佳	80	4,317.60	0.00
58	603352	至信股份	112	2,858.24	0.00
59	001396	誉帆科技	69	2,443.98	0.00
60	603293	埃泰克	72	2,442.96	0.00
61	001312	福恩股份	134	2,248.52	0.00
62	603284	林平发展	46	1,604.02	0.00
63	001220	世盟股份	57	1,583.46	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	300394	天孚通信	88,974,689.61	8.82
2	688347	华虹宏力	77,634,833.50	7.70
3	301511	德福科技	75,936,754.75	7.53
4	002436	兴森科技	74,753,266.63	7.41
5	300620	光库科技	70,291,599.26	6.97
6	002384	东山精密	58,470,546.35	5.80
7	688072	拓荆科技	58,053,841.68	5.75
8	603087	甘李药业	57,322,261.59	5.68
9	301196	唯科科技	50,743,568.97	5.03
10	688313	仕佳光子	47,515,502.02	4.71
11	688981	中芯国际	47,006,554.03	4.66
12	688167	炬光科技	46,998,428.95	4.66
13	002463	沪电股份	46,636,741.00	4.62
14	688627	精智达	46,437,678.05	4.60
15	300919	中伟新材	45,840,143.51	4.54
16	688012	中微公司	44,610,822.32	4.42
17	000039	中集集团	38,420,380.50	3.81
18	301611	珂玛科技	37,967,396.00	3.76
19	688521	芯原股份	37,483,030.55	3.72
20	002353	杰瑞股份	35,880,534.00	3.56
21	301095	广立微	35,595,519.24	3.53
22	300679	电连技术	35,355,050.00	3.50
23	301396	宏景科技	35,238,979.40	3.49
24	688361	中科飞测	35,077,291.80	3.48
25	688766	普冉股份	34,985,465.36	3.47

26	688147	微导纳米	34,642,395.90	3.43
27	300236	上海新阳	34,381,118.00	3.41
28	002290	禾盛新材	34,117,801.00	3.38
29	600352	浙江龙盛	32,557,291.98	3.23
30	300820	英杰电气	29,561,975.00	2.93
31	605358	立昂微	28,837,898.40	2.86
32	300699	光威复材	25,487,202.88	2.53
33	300900	广联航空	23,938,766.61	2.37
34	300750	宁德时代	20,791,568.00	2.06

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	000792	盐湖股份	101,060,120.00	10.02
2	688521	芯原股份	85,335,446.45	8.46
3	300236	上海新阳	73,732,540.24	7.31
4	688072	拓荆科技	66,970,897.87	6.64
5	300308	中际旭创	64,871,144.65	6.43
6	002384	东山精密	59,616,253.52	5.91
7	300919	中伟新材	58,740,242.40	5.82
8	300750	宁德时代	57,114,229.20	5.66
9	603699	纽威股份	56,915,944.00	5.64
10	688347	华虹宏力	55,438,073.00	5.50
11	002475	立讯精密	54,313,160.10	5.38
12	688627	精智达	50,230,385.49	4.98
13	301611	珂玛科技	48,273,576.37	4.79
14	688167	炬光科技	48,069,793.46	4.76
15	603087	甘李药业	46,789,883.96	4.64
16	301033	迈普医学	45,063,627.92	4.47
17	300679	电连技术	44,926,011.00	4.45
18	002353	杰瑞股份	41,959,178.00	4.16
19	301263	泰恩康	41,477,363.00	4.11
20	300699	光威复材	41,211,022.42	4.09
21	000039	中集集团	39,311,786.60	3.90
22	688981	中芯国际	38,921,043.95	3.86
23	603092	德力佳	35,324,568.24	3.50
24	688361	中科飞测	34,463,037.74	3.42
25	688766	普冉股份	32,704,016.09	3.24
26	002156	通富微电	32,159,917.20	3.19
27	688147	微导纳米	31,660,763.81	3.14
28	605358	立昂微	30,275,935.97	3.00
29	300820	英杰电气	30,161,019.80	2.99

30	301396	宏景科技	29,966,236.40	2.97
31	301095	广立微	28,070,958.00	2.78
32	600352	浙江龙盛	27,152,484.00	2.69
33	002290	禾盛新材	26,132,122.00	2.59
34	688002	睿创微纳	25,515,947.30	2.53
35	300900	广联航空	25,513,534.43	2.53
36	301511	德福科技	23,967,832.72	2.38
37	002602	世纪华通	23,831,833.85	2.36
38	002463	沪电股份	23,053,645.00	2.29
39	002262	恩华药业	23,039,857.00	2.28
40	688029	南微医学	22,753,511.40	2.26
41	000960	锡业股份	22,435,389.00	2.22
42	002466	天齐锂业	22,418,715.57	2.22
43	600183	生益科技	21,363,077.98	2.12
44	600893	航发动力	21,112,696.00	2.09
45	002440	闰土股份	21,043,133.00	2.09
46	000338	潍柴动力	20,861,502.00	2.07

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	1,922,948,735.95
卖出股票收入（成交）总额	2,185,501,755.05

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	262,316,880.18	20.36
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	262,316,880.18	20.36

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	240013	24 付息国债 13	500,000	51,677,424.66	4.01
2	250024	25 付息国债 24	500,000	50,473,876.71	3.92
3	250013	25 付息国债 13	400,000	40,505,019.18	3.14
4	230021	23 付息国债 21	200,000	20,947,134.25	1.63
5	240008	24 付息国债 08	200,000	20,518,493.15	1.59

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

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

7.12.2 基金投资的前十名股票是否超出基金合同约定的备选股票库

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	547,710.64
2	应收清算款	35,890,496.18
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	1,025,202.93
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	37,463,409.75

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 (%)
大成价值 增长混合 A	67,009	17,292.27	11,152,341.02	0.96	1,147,585,092.44	99.04
大成价值 增长混合 C	102	25,591.32	2,104,965.91	80.64	505,348.71	19.36
合计	67,111	17,304.88	13,257,306.93	1.14	1,148,090,441.15	98.86

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（%）	99.77
--------------	-------

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（%）
基金管理人所有从业人员持有本基金	大成价值增长混合 A	77,808.37	0.0067
	大成价值增长混合 C	—	—
	合计	77,808.37	0.0067

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	大成价值增长混合 A	0
	大成价值增长混合 C	0
	合计	0
本基金基金经理持有本开放式基金	大成价值增长混合 A	0
	大成价值增长混合 C	0
	合计	0

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	大成价值增长混合 A	大成价值增长混合 C
基金合同生效日（2002 年 11 月 11 日）基金份额总额	2,604,752,899.89	—
本报告期期初基金份额总额	1,279,787,033.57	158,651.11
本报告期基金总申购份额	33,119,702.37	2,788,786.06
减：本报告期基金总赎回份额	154,169,302.48	337,122.55
本报告期基金拆分变动份额	—	—
本报告期期末基金	1,158,737,433.46	2,610,314.62

份额总额		
------	--	--

§ 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

无。

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，改聘安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）为本基金提供审计服务至今。

10.6 管理人、托管人及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

无。

10.6.4 托管人相关从业人员受调查或处罚等情况

无。

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(%)	
东吴证券	1	879,979,224.13	21.44	401,270.50	21.44	—
华泰证券	1	786,532,170.78	19.16	358,658.63	19.16	—
财通证券	1	748,344,709.69	18.23	341,245.20	18.23	—
广发证券	2	401,652,746.00	9.78	183,153.67	9.78	—
华创证券	1	302,574,827.04	7.37	137,974.13	7.37	—
光大证券	2	160,149,322.39	3.90	73,028.09	3.90	—
申万宏源	1	153,508,148.26	3.74	69,999.70	3.74	—
东财证券	1	140,930,990.39	3.43	64,264.54	3.43	—
浙商证券	1	127,126,532.81	3.10	57,969.70	3.10	—
国信证券	1	115,347,942.69	2.81	52,598.67	2.81	—
兴业证券	2	89,734,163.40	2.19	40,918.77	2.19	—
国盛证券	1	85,126,409.72	2.07	38,817.65	2.07	—
中泰证券	2	50,949,628.24	1.24	23,233.02	1.24	—
天风证券	1	47,515,502.02	1.16	21,667.07	1.16	—
野村东方国际证券	1	15,835,270.60	0.39	7,220.88	0.39	—
爱建证券	1	—	—	—	—	—
长江证券	1	—	—	—	—	新增1个
第一创业	1	—	—	—	—	—
东北证券	1	—	—	—	—	—
东方证券	1	—	—	—	—	—
东兴证券	1	—	—	—	—	—
方正证券	1	—	—	—	—	—
高盛中国证券	1	—	—	—	—	—

国金证券	2	-	-	-	-	-
国泰海通	3	-	-	-	-	-
国投证券	1	-	-	-	-	-
红塔证券	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	-	-	-	-	-
万和证券	0	-	-	-	-	退租 1 个
西部证券	1	-	-	-	-	-
信达证券	0	-	-	-	-	退租 1 个
粤开证券	1	-	-	-	-	-
招商证券	2	-	-	-	-	-
中国银河 证券	3	-	-	-	-	-
中金公司	2	-	-	-	-	-
中信建投 证券	2	-	-	-	-	-
中信证券	3	-	-	-	-	-
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。

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	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例 (%)	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例 (%)	成交金额	占当期权证成交总额的比例 (%)	成交金额	占当期基金成交总额的比例 (%)
财通证券	11,018,607.00	46.15	-	-	-	-	-	-
东财证券	6,000,579.00	25.13	-	-	-	-	-	-
国信证券	6,857,689.18	28.72	-	-	-	-	-	-

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	大成价值增长证券投资基金(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
2	大成价值增长证券投资基金(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
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	大成价值增长证券投资基金 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	大成价值增长证券投资基金 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
8	大成基金管理有限公司提醒投资者谨防金融诈骗的公告	中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站	2026年02月14日
9	大成基金管理有限公司提醒投资者	中国证监会基金电子披	2026年01月30日

	谨防金融诈骗的公告	露网站、规定报刊及本公司网站	
10	大成价值增长证券投资基金 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
11	大成基金管理有限公司旗下 205 只公募基金 2025 年第 4 季度报告提示性公告	规定报刊	2026 年 01 月 22 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价值增长证券投资基金的文件；
- 2、《大成价值增长证券投资基金基金合同》；
- 3、《大成价值增长证券投资基金托管协议》；
- 4、大成基金管理有限公司批准文件、营业执照、公司章程；
- 5、本报告期内在规定报刊上披露的各种公告原稿。

12.2 存放地点

备查文件存放在本基金管理人和托管人的住所。

12.3 查阅方式

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

大成基金管理有限公司
2026 年 8 月 28 日