

大成中证 800 指数增强型发起式证券投资
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	7
2.4 信息披露方式	7
2.5 其他相关资料	7
§ 3 主要财务指标和基金净值表现	8
3.1 主要会计数据和财务指标	8
3.2 基金净值表现	8
§ 4 管理人报告	10
4.1 基金管理人及基金经理情况	10
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	12
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	12
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明	13
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	13
4.6 管理人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	17
6.4 报表附注	18
§ 7 投资组合报告	43
7.1 期末基金资产组合情况	43
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	45
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	55
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	56
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	56
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	56
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	56

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	56
7.10 本基金投资股指期货的投资政策	56
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	56
7.12 投资组合报告附注	57
§ 8 基金份额持有人信息	57
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	57
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	58
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况	58
8.4 发起式基金发起资金持有份额情况	59
§ 9 开放式基金份额变动	59
§ 10 重大事件揭示	59
10.1 基金份额持有人大会决议	59
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	60
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	60
10.4 基金投资策略的改变	60
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	60
10.6 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况	60
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	60
10.8 其他重大事件	61
§ 11 影响投资者决策的其他重要信息	62
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	62
11.2 影响投资者决策的其他重要信息	62
§ 12 备查文件目录	62
12.1 备查文件目录	62
12.2 存放地点	63
12.3 查阅方式	63

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	大成中证 800 指数增强型发起式证券投资基金	
基金简称	大成中证 800 指数增强发起式	
基金主代码	024715	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2025 年 12 月 2 日	
基金管理人	大成基金管理有限公司	
基金托管人	中国银行股份有限公司	
报告期末基金份 额总额	14,841,970.45 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基 金简称	大成中证 800 指数增强发起式 A	大成中证 800 指数增强发起式 C
下属分级基金的交 易代码	024715	024716
报告期末下属分级 基金的份额总额	12,136,733.95 份	2,705,236.50 份

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金为增强型股票指数基金，力争在对标的指数进行有效跟踪的基础上，实现超越目标指数的投资收益，谋求基金资产的长期增值。本基金力争使日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.5%，年化跟踪误差不超过 7.75%。
投资策略	本基金在指数化投资的基础上通过数量化模型进行投资组合优化，在控制与业绩比较基准偏离风险的前提下，力争获得超越标的指数的投资收益。 （一）股票投资策略 1、指数化投资策略 本基金将运用指数化的投资方法，通过研究标的指数成份股的构成及其权重确定本基金投资组合的基本构成和大致占比，并通过控制投资组合中成份股对标的指数中权重的偏离，以控制跟踪误差，进而达成对标的指数的跟踪目标。 2、指数增强型策略 本基金在参考标的指数成份股在指数中的权重比例构建基本投资组合，再基于数量化投资分析及基本面研究等方法对投资组合进行优化，以争取实现指数增强型的目标。 （二）港股投资策略 本基金可通过内地与香港股票市场交易互联互通机制投资于香港股票市场，不使用合格境内机构投资者(QDII)境外投资额度进行境外投资。 （三）债券投资策略 1、本基金基于基金流动性管理和有效利用基金资产的需要进行

	债券投资。本基金将主要投资于流动性较好的国债、金融债、央行票据等债券以及参与债券回购投资，保证基金资产流动性，提高基金资产的投资收益。本基金将根据宏观经济形势、货币政策、证券市场变化等分析判断未来利率变化，结合债券定价技术，进行个券选择。 2、可转换债券/可交换债券兼具权益类证券与固定收益类证券的特性，具有抵御下行风险、分享股票价格上涨收益的特点。本基金主要从公司基本面分析、理论定价分析、债券发行条款、投资导向的变化等方面综合评估可转换债券/可交换债券投资价值，选取具有较高价值的可转换债券/可交换债券进行投资。本基金将着重对可转换债券/可交换债券对应的基础股票进行分析与研究，对那些有着较好盈利能力或成长前景的上市公司的可转换债券/可交换债券进行重点选择。可转换债券/可交换债券的投资的目的是保证基金资产流动性，有效利用基金资产，更好地降低跟踪误差。 （四）资产支持证券投资策略 本基金将重点对市场利率、发行条款、支持资产的构成及质量、提前偿还率、风险补偿收益和市场流动性等影响资产支持证券价值的因素进行分析，并辅助采用数量化定价模型，评估资产支持证券的相对投资价值并做出相应的投资决策。本基金将严格控制资产支持证券的总体投资规模并进行分散，以降低流动性风险。 （五）股指期货的投资策略 本基金在注重风险管理的前提下，根据风险管理的原则，以套期保值为目的，将适度运用股指期货。本基金利用股指期货流动性好、交易成本低和杠杆操作等特点，通过股指期货对本基金投资组合的跟踪效果进行及时、有效地调整和优化，并提高投资组合的运作效率等。 （六）国债期货投资策略 本基金投资国债期货将根据风险管理原则，以套期保值为目的，以回避市场风险，故国债期货空头的合约价值主要与债券组合的多头价值相对应。基金管理人通过对宏观经济和利率市场走势的分析与判断，并充分考虑国债期货的收益性、流动性及风险特征，通过资产配置，谨慎进行投资，以调整债券组合的久期，降低投资组合的整体风险。 （七）股票期权投资策略 在法律法规允许的范围内，本基金应当按照风险管理的原则，以套期保值为主要目的，基于谨慎原则运用股票期权对基金投资组合进行管理，以控制投资组合风险、提高投资效率，从而更好地实现本基金的投资目标。本基金将在有效控制风险的前提下，选择流动性好、交易活跃的期权合约进行投资。 （八）融资及转融通证券出借业务投资策略 本基金在参与融资、转融通证券出借业务时将根据风险管理的原则，在法律法规允许的范围和比例内、风险可控的前提下，本着谨慎原则，参与融资和转融通证券出借业务。参与融资业务时，本基金将力争利用融资的杠杆作用，降低因申购造成基金仓位较
--	---

	低带来的跟踪误差，达到有效跟踪标的指数的目的。参与转融通证券出借业务时，本基金将从基金持有的融券标的股票中选择流动性好、交易活跃的股票作为转融通出借交易对象，力争为本基金份额持有人增厚投资收益。 若相关融资及转融通证券出借业务法律法规发生变化，本基金将从其最新规定，以符合上述法律法规和监管要求的变化。 （九）存托凭证投资策略 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。 随着证券市场投资工具的发展和丰富，基金管理人可在不改变投资目标的前提下，根据法律法规的有关规定，在履行适当程序后相应调整或更新投资策略，并公告。
业绩比较基准	中证 800 指数收益率 $\times$ 95%+银行活期存款利率(税后) $\times$ 5%
风险收益特征	本基金是股票型基金，其预期风险与预期收益高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。本基金主要投资于标的指数成份股及备选成份股，具有与标的指数相似的风险收益特征。本基金还可投资港股通标的股票，需承担港股通机制下因投资环境、投资标的、市场制度以及交易规则等差异带来的特有风险。同时本基金为指数基金，通过跟踪标的指数表现，具有与标的指数以及标的指数所代表的公司相似的风险收益特征。

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	中国银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	段皓静	许俊
	联系电话	0755-83183388	010-66596688
	电子邮箱	office@dcfund.com.cn	fxjd_hq@bank-of-china.com
客户服务电话		4008885558	95566
传真		0755-83199588	010-66594942
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	北京市西城区复兴门内大街1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1号
邮政编码		518054	100818
法定代表人		吴庆斌	葛海蛟

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)	
	大成中证 800 指数增强发起式 A	大成中证 800 指数增强发起式 C
本期已实现收益	985,314.02	254,710.34
本期利润	1,164,347.11	305,213.73
加权平均基金份额本期利润	0.0864	0.0835
本期加权平均净值利润率	8.33%	8.07%
本期基金份额净值增长率	8.50%	8.29%
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	961,328.09	207,483.56
期末可供分配基金份额利润	0.0792	0.0767
期末基金资产净值	13,320,279.33	2,962,148.43
期末基金份额净值	1.0975	1.0950
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	9.75%	9.50%

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

大成中证 800 指数增强发起式 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	13.09%	1.26%	13.02%	1.27%	0.07%	-0.01%
过去六个月	8.50%	1.20%	10.59%	1.18%	-2.09%	0.02%
自基金合同生效	9.75%	1.10%	12.92%	1.12%	-3.17%	-0.02%

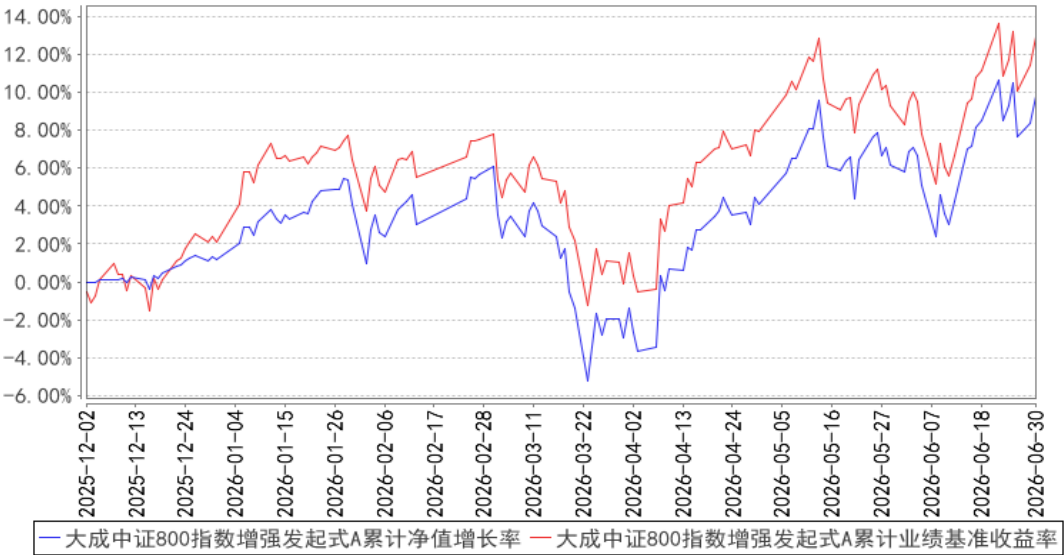
起至今						
-----	--	--	--	--	--	--

大成中证 800 指数增强发起式 C

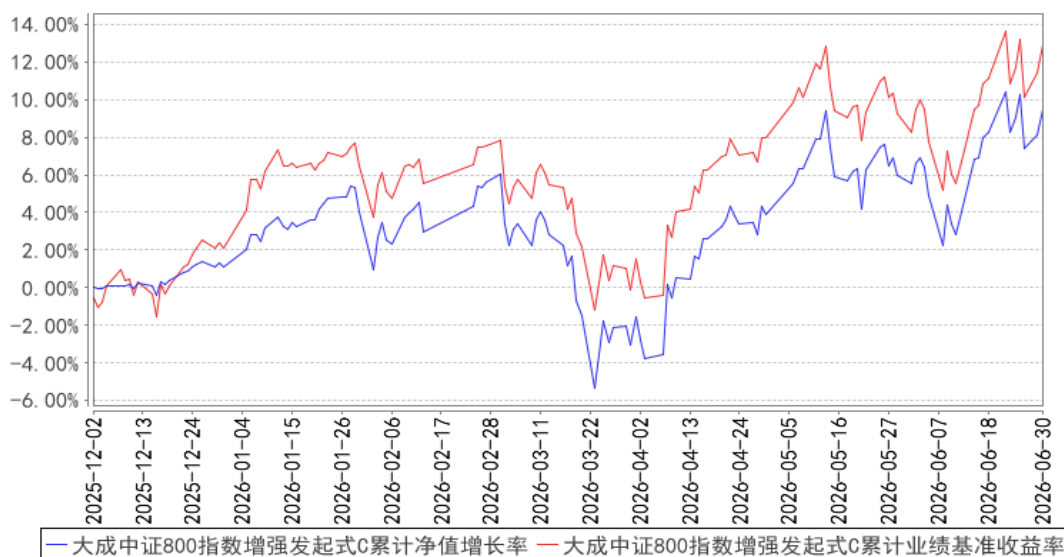
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①－③	②－④
过去三个月	12.98%	1.26%	13.02%	1.27%	-0.04%	-0.01%
过去六个月	8.29%	1.20%	10.59%	1.18%	-2.30%	0.02%
自基金合同生效起至今	9.50%	1.10%	12.92%	1.12%	-3.42%	-0.02%

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

大成中证800指数增强发起式A累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



大成中证800指数增强发起式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、本基金合同生效日为 2025 年 12 月 2 日，截止报告期末本基金合同生效未满一年。

2、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。

§ 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		
李子钰	本基金基金经理助理	2025 年 12 月 2 日	—	10 年	上海交通大学工程硕士。曾任博时基金管理有限公司信息技术部程序员、华泰证券股份有限公司研究所金融工程研究员。2023 年 10 月加入大成基金管理有限公司，曾任指数与期货投资部高级研究员，现任指数与期货投资部基金经理助理。2025 年 11 月 28 日起任大成沪深 300 指数增强型发起式证券投资基金、大成中证 500 指数增强型证券投资基金、大成中证 1000 指数增强型发起式证券投资基金、大成上证科创板综合指数增强型证券投资基金、大成智惠量化多策略灵活配置混合型证券投资基金基金经理助理，2025 年 12 月 2 日起任大成中证 800 指数增强型发起式证券投资基金基金经理助理。具有基金从业资格。国籍：中国
夏高	本基金基金经理，指数与期货投资部副总监	2025 年 12 月 2 日	—	15 年	清华大学工学博士。2011 年 1 月至 2012 年 5 月就职于博时基金管理有限公司，任股票投资部投资分析员。2012 年 7 月加入大成基金管理有限公司，曾担任数量与指数投资部高级数量分析师、基金经理助理、总监助理，现任指数与期货投资部副总监。2014 年 12 月 6 日至 2023 年 3 月 20 日任大成中证红利指数证券投资基金基金经理。2015 年 6 月 29 日至 2020 年 11 月 13 日担任大成中证互联网金融指数分级证券投资基金基金经理。2016 年 2 月 3 日起任大成中证 360 互联网+大数据 100 指数型证券投资基金基金经理。2017 年 3 月 21 日至 2021 年 4 月 27 日任大成智惠量化多策略灵活配置混合型证券投资基金基金经理。2020 年 9 月 18 日至 2022 年 10 月 17 日任大成动态量化配置策略混合型证券投资基金基金经理。2020 年 9 月 18 日至 2022 年 10 月 25 日任大成绝对收益策略混合型发起式证券投资基金基金经理。2021 年 2 月 23 日起任大成沪深 300 指数增强型发起式证券投资基金基金经理。2021 年 4 月 29 日至 2022 年 5 月 26 日任大成中证全指医疗保健设备与服务交易型开放式指数证券投资基金

					基金经理。2023 年 4 月 14 日起任大成动态量化配置策略混合型证券投资基金基金经理。2024 年 7 月 19 日起任大成中证 500 指数增强型证券投资基金基金经理。2025 年 4 月 29 日起任大成上证科创板综合指数增强型证券投资基金基金经理。2025 年 12 月 2 日起任大成中证 800 指数增强型发起式证券投资基金基金经理。2026 年 3 月 17 日起任大成招享汇智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。公司运用统计分析和工具，对旗下所有投资组合连续 4 个季度的日内、3 日内、5 日内及 10 日内股票及债券交易同向交易价差进行分析，针对同一基金经理管理的多个投资组合及公私募兼任基金经理管理的多个投资组合的投资交易行为加强了公平交易监测与分析，包括对不同时间窗下（同日、3 日、5 日、10 日）反向交易和同向交易价差监控的分析。分析结果表明：债券交易同向交易频率较低；部分股票同向交易溢价率较大主要来源于投资策略差异、市场因素（如个股当日价格振幅较高）及组合经理交易时机选择，同时结合交易价差专项统计分析，未发现违反公平交易原则的异常情况。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

报告期内，公司旗下所有投资组合未发现存在异常交易行为。公司旗下投资组合间存在证券同日反向交易，但不存在参与交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当

日成交量 5% 的情形。投资组合间相邻交易日反向交易的市场成交比例、成交均价等交易结果数据表明该类交易不对市场产生重大影响，无异常。

4.4 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 年上半年，A 股市场呈现明显的结构性分化特征。一月份，市场延续去年底的涨势，继续上行，有色金属、石油石化、建材、基础化工和传媒等行业领涨，银行、非银行金融和交通运输等行业出现一定回撤。二月份，市场的分化加大，钢铁、建材、机械和煤炭等行业涨幅明显，非银行金融、银行、传媒、消费者服务和商贸零售等行业有所下行。三月份，市场调整压力增大，多数行业出现调整，仅少数行业略有上涨。四月份，在经过一季度的调整之后，科技板块开始再度活跃，电子、通信、计算机、机械和基础化工等行业涨幅突出，消费者服务、食品饮料和交通运输等行业小幅回撤。五月份，科技板块震荡上行，分化有所扩大，通信、电子和电力等少数行业表现亮眼，其他多数行业以调整为主。六月份，市场分化持续扩大，电子、通信和建材等少数行业领涨，多数行业继续调整。整体来看，在上半年，上证综指上涨 3.16%，沪深 300 指数上涨 7.55%，中证 500 指数上涨 20.97%，中证 800 指数上涨 11.12%。在本报告期内，本基金未能战胜业绩比较基准。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末大成中证 800 指数增强发起式 A 的基金份额净值为 1.0975 元，本报告期基金份额净值增长率为 8.50%，同期业绩比较基准收益率为 10.59%；截至本报告期末大成中证 800 指数增强发起式 C 的基金份额净值为 1.0950 元，本报告期基金份额净值增长率为 8.29%，同期业绩比较基准收益率为 10.59%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

2026 年 7 月，市场在上半年上涨之后出现一轮调整。本次调整释放了一定的压力，有利于市场继续健康发展。接下来，随着政策支持的加强和经济动能的发展，我们对 A 股市场保持谨慎乐观，投资者可以综合考虑自身对收益和风险的判断，合理作出投资决策。本基金将继续坚持量化指数增强模型，保持稳定投资风格，持续挖掘有效的选股因子，并采用风险模型和组合优化等方法严格控制风险暴露，努力实现对业绩比较基准进行增强的投资目标。

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，中国银行股份有限公司（以下称“本托管人”）在大成中证 800 指数增强型发起式证券投资基金（以下称“本基金”）的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责的履行了应尽的义务。

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，本托管人根据《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，对本基金管理人的投资运作进行了必要的监督，对基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算以及基金费用开支等方面进行了认真的复核，未发现本基金管理人存在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

本报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告（注：财务会计报告中的“金融工具风险及管理”、“关联方承销证券”、“关联方证券出借”部分未在托管人复核范围内）、投资组合报告等财务数据真实、准确和完整。

§ 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：大成中证 800 指数增强型发起式证券投资基金

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	1,057,199.09	11,707,235.63
结算备付金		2,233.85	400,342.27
存出保证金		-	-
交易性金融资产	6.4.7.2	15,239,312.50	10,769,434.94
其中：股票投资		15,239,312.50	10,769,434.94
基金投资		-	-
债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
其他投资		-	-
衍生金融资产	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		29.96	60,028.18
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.8	-	-
资产总计		16,298,775.40	22,937,041.02
负债和净资产	附注号	本期末	上年度末

		2026 年 6 月 30 日	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		661.83	111.82
应付管理人报酬		10,459.35	15,723.69
应付托管费		1,307.42	1,965.48
应付销售服务费		968.84	2,123.65
应付投资顾问费		-	-
应交税费		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.9	2,950.20	-
负债合计		16,347.64	19,924.64
净资产：			
实收基金	6.4.7.10	14,841,970.45	22,657,945.36
未分配利润	6.4.7.12	1,440,457.31	259,171.02
净资产合计		16,282,427.76	22,917,116.38
负债和净资产总计		16,298,775.40	22,937,041.02

注：报告截止日 2026 年 06 月 30 日，基金份额总额 14,841,970.45 份。其中大成中证 800 指数增强发起式 A 类基金份额总额为 12,136,733.95 份，基金份额净值 1.0975 元；大成中证 800 指数增强发起式 C 类基金份额总额为 2,705,236.50 份，基金份额净值 1.0950 元。

6.2 利润表

会计主体：大成中证 800 指数增强型发起式证券投资基金

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
一、营业总收入		1,560,732.37
1. 利息收入		5,084.89
其中：存款利息收入	6.4.7.13	5,084.89
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）		1,325,631.09
其中：股票投资收益	6.4.7.14	1,017,365.93

基金投资收益	6.4.7.15	-
债券投资收益	6.4.7.16	3,366.20
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	156,117.45
股利收益	6.4.7.20	148,781.51
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	229,536.48
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	479.91
减：二、营业总支出		91,171.53
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	70,832.28
2. 托管费	6.4.10.2.2	8,854.06
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	7,564.87
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		562.57
8. 其他费用	6.4.7.24	3,357.75
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		1,469,560.84
减：所得税费用		-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		1,469,560.84
五、其他综合收益的税后净额		-
六、综合收益总额		1,469,560.84

6.3 净资产变动表

会计主体：大成中证 800 指数增强型发起式证券投资基金

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	22,657,945.36	-	259,171.02	22,917,116.38
二、本期期初净	22,657,945.36	-	259,171.02	22,917,116.38

资产				
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	-7,815,974.91	-	1,181,286.29	-6,634,688.62
(一)、综合收益总额	-	-	1,469,560.84	1,469,560.84
(二)、本期基金份额交易产生的净资产变动数(净资产减少以“-”号填列)	-7,815,974.91	-	-288,274.55	-8,104,249.46
其中：1. 基金申购款	2,465,461.50	-	81,946.28	2,547,407.78
2. 基金赎回款	-10,281,436.41	-	-370,220.83	-10,651,657.24
(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	14,841,970.45	-	1,440,457.31	16,282,427.76

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

基金管理人负责人

范瑛

主管会计工作负责人

梁靖

会计机构负责人

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

大成中证 800 指数增强型发起式证券投资基金（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【2025】1190 号文《关于准予大成中证 800 指数增强型发起式证券投资基金注册的批复》注册，由大成基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《大成中证 800 指数增强型发起式证券投资基金基金合同》作为发起人向社会公开募集，募集期为 2025 年 11 月 24 日至 2025 年 11 月 28 日，首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币 27,157,757.14 元，募集期结束经安永华明会计师事务所验证并出具安永华明(2025) 验字第 70039092_H23 号验资报告后，向中国证监会报送基金备案材料。基金合同于 2025 年 12 月

2 日生效，基金合同生效日的基金份额总额为 27,160,104.03 份基金份额，其中认购资金利息折合 2,346.89 份基金份额。本基金为契约型开放式，存续期限不定。本基金的基金管理人为大成基金管理有限公司，注册登记机构为本基金管理人，基金托管人为中国银行股份有限公司。

本基金为发起式基金，发起资金认购部分为 10,001,666.83 份基金份额（含利息转份额），发起资金认购方承诺使用发起资金认购的基金份额持有期限不少于 3 年。

本基金根据认购/申购费用、销售服务费收取方式等的不同，将基金份额分为不同的类别。其中 A 类基金份额为在投资人认购/申购时收取认购/申购费用，且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，且不收取认购/申购费用的基金份额。本基金 A 类和 C 类基金份额分别设置代码。由于基金费用的不同，本基金 A 类基金份额和 C 类基金份额将分别计算基金份额净值。

本基金投资范围主要为标的指数成份股及备选成份股（含存托凭证，下同），此外，为更好地实现投资目标，本基金可少量投资于部分非成份股（包含主板、创业板、科创板及其他经中国证监会核准或注册上市的股票及存托凭证、港股通标的股票）、债券（包括国债、央行票据、金融债券、企业债券、公司债券、中期票据、短期融资券、超短期融资券、公开发行的次级债券、政府支持机构债券、政府支持债券、地方政府债券、可转换债券、可交换公司债券及其他经中国证监会允许投资的债券）、资产支持证券、债券回购、同业存单、银行存款（包括协议存款、定期存款及其他银行存款）、货币市场工具、股指期货、国债期货、股票期权、现金以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具。本基金可参与融资业务。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。本基金的投资组合比例为：股票资产投资比例不低于基金资产的 80%，其中投资于标的指数成份股和备选成份股的资产不低于非现金基金资产的 80%，投资于港股通标的股票的比例占股票资产的 0-50%；每个交易日日终在扣除股指期货、国债期货、股票期权合约需缴纳的交易保证金后，保持不低于基金资产净值 5% 的现金或到期日在一年以内的政府债券，其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。股指期货、国债期货、股票期权及其他金融工具的投资比例符合法律法规和监管机构的规定。如法律法规或监管机构变更投资品种的投资比例限制，基金管理人在履行适当程序后，可以调整上述投资品种的投资比例。

本基金的业绩比较基准：中证 800 指数收益率*95%+银行活期存款利率（税后）*5%。

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 重要会计政策和会计估计

6.4.4.1 会计年度

本基金会计年度为公历 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。本财务报表的实际编制期间为 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日止。

6.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

6.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

金融工具是指形成本基金的金融资产（或负债），并形成其他单位的金融负债（或资产）或权益工具的合同。

（1）金融资产分类

本基金的金融资产于初始确认时根据管理金融资产的业务模式和金融资产的合同现金流量特征分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、以摊余成本计量的金融资产。

（2）金融负债分类

本基金的金融负债于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债、以摊余成本计量的金融负债。

6.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

本基金于成为金融工具合同的一方时确认一项金融资产或金融负债。

划分为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和金融负债，以及不作为有效套期工具的衍生工具，按照取得时的公允价值作为初始确认金额，相关的交易费用在发生时计入当期损益。

划分为以摊余成本计量的金融资产和金融负债，按照取得时的公允价值作为初始确认金额，相关交易费用计入其初始确认金额。

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，采用公允价值进行后续计量，所有公允价值变动计入当期损益。

对于以摊余成本计量的金融资产，采用实际利率法确认利息收入，其终止确认、修改或减值产生的利得或损失，均计入当期损益。

本基金以预期信用损失为基础，对以摊余成本计量的金融资产进行减值处理并确认损失准备。对于不含重大融资成分的应收款项，本基金运用简化计量方法，按照相当于整个存续期内的预期信用损失金额计量损失准备。除上述采用简化计量方法以外的金融资产，本基金在每个估值日评估其信用风险自初始确认后是否已经显著增加，如果信用风险自初始确认后未显著增加，处于第一阶段，本基金按照相当于未来 12 个月内预期信用损失的金额计量损失准备，并按照账面余额和实际利率计算利息收入；如果信用风险自初始确认后已显著增加但尚未发生信用减值的，处于第二阶段，本基金按照相当于整个存续期内预期信用损失的金额计量损失准备，并按照账面余额和实际利率计算利息收入；如果初始确认后发生信用减值的，处于第三阶段，本基金按照相当于整个存续期内预期信用损失的金额计量损失准备，并按照摊余成本和实际利率计算利息收入。

本基金在每个估值日评估相关金融工具的信用风险自初始确认后是否已显著增加。本基金以单项金融工具或者具有相似信用风险特征的金融工具组合为基础，通过比较金融工具在估值日发生违约的风险与在初始确认日发生违约的风险，以确定金融工具预计存续期内发生违约风险的变化情况。

本基金计量金融工具预期信用损失的方法反映的因素包括：通过评价一系列可能的结果而确定的无偏概率加权平均金额、货币时间价值，以及在估值日无须付出不必要的额外成本或努力即可获得的有关过去事项、当前状况以及未来经济状况预测的合理且有依据的信息。

当对金融资产预期未来现金流量具有不利影响的一项或多项事件发生时，该金融资产成为已发生信用减值的金融资产。

当本基金不再合理预期能够全部或部分收回金融资产合同现金流量时，本基金直接减记该金融资产的账面余额。

当收取该金融资产现金流量的合同权利终止，或该收取金融资产现金流量的权利已转移，且符合金融资产转移的终止确认条件的，金融资产将终止确认。

本基金已将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方的，终止确认该金融资产；保留了金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬的，不终止确认该金融资产；本基金既没有转移

也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬的，分别下列情况处理：放弃了对该金融资产控制的，终止确认该金融资产并确认产生的资产和负债；未放弃对该金融资产控制的，按照其继续涉入所转移金融资产的程度确认有关金融资产，并相应确认有关负债。

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债（含交易性金融负债和衍生金融负债），按照公允价值进行后续计量，所有公允价值变动均计入当期损益。对于以摊余成本计量的金融负债，采用实际利率法，按照摊余成本进行后续计量。如果金融负债的责任已履行、撤销或届满，则对金融负债进行终止确认。

6.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

公允价值，是指市场参与者在计量日发生的有序交易中，出售一项资产所能收到或者转移一项负债所需支付的价格。本基金以公允价值计量相关资产或负债，假定出售资产或者转移负债的有序交易在相关资产或负债的主要市场进行；不存在主要市场的，本基金假定该交易在相关资产或负债的最有利市场进行。主要市场（或最有利市场）是本基金在计量日能够进入的交易市场。本基金采用市场参与者在对该资产或负债定价时为实现其经济利益最大化所使用的假设。

在财务报表中以公允价值计量或披露的资产和负债，根据对公允价值计量整体而言具有重要意义的最低层次输入值，确定所属的公允价值层次：第一层次输入值，在计量日能够取得的相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价；第二层次输入值，除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值；第三层次输入值，相关资产或负债的不可观察输入值。

每个资产负债表日，本基金对在财务报表中确认的持续以公允价值计量的资产和负债进行重新评估，以确定是否在公允价值计量层次之间发生转换。

本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和金融负债按如下原则确定公允价值并进行估值：

（1）存在活跃市场的金融工具，按照估值日能够取得的相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价作为公允价值；估值日无报价且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，应采用最近交易日的报价确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的报价不能真实反映公允价值的，应对报价进行调整，确定公允价值。

与上述投资品种相同，但具有不同特征的，应以相同资产或负债的公允价值为基础，并在估值技术中考虑不同特征因素的影响。特征是指对资产出售或使用的限制等，如果该限制是针对资产持有者的，那么在估值技术中不应将该限制作为特征考虑。此外，基金管理人不应考虑因大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价。

（2）不存在活跃市场的金融工具，应采用在当前情况下适用并且有足够可利用数据和其他信

息支持的估值技术确定公允价值。采用估值技术确定公允价值时，应优先使用可观察输入值，只有在无法取得相关资产或负债可观察输入值或取得不切实可行的情况下，才使用不可观察输入值。

(3) 如有确凿证据表明按上述方法进行估值不能客观反映其公允价值的，基金管理人可根据具体情况与基金托管人商定后，按最能反映公允价值的方法估值。

(4) 如有新增事项，按国家最新规定估值。

6.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

当本基金具有抵销已确认金融资产和金融负债的法定权利，且该种法定权利现在是可执行的，同时本基金计划以净额结算或同时变现该金融资产和清偿该金融负债时，金融资产和金融负债以相互抵销后的金额在资产负债表内列示。除此以外，金融资产和金融负债在资产负债表内分别列示，不予相互抵销。

6.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行的基金份额总额所对应的金额。由于申购和赎回引起的实收基金变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日确认。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

6.4.4.8 损益平准金

损益平准金包括已实现平准金和未实现平准金。已实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现损益占净资产比例计算的金额。未实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未实现损益占净资产比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日确认，并于期末全额转入未分配利润/(累计亏损)。

6.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

(1) 对于以摊余成本计量的金融资产，采用实际利率法计算的利息扣除在适用情况下的相关税费后的净额确认利息收入，计入当期损益。处置时，其处置价格扣除相关交易费用后的净额与账面价值之间的差额确认为投资收益。

(2) 对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和金融负债，相关交易费用直接计入投资收益。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产为债务工具投资的，在持有期间将按票面或合同利率计算的利息收入扣除在适用情况下的相关税费后的净额计入投资收益，扣除该部分利息后的公允价值变动额计入公允价值变动损益；除上述之外的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和金融负债的公允价值变动形成的应计入当期损益的利得或损失计入公允价值变动损益。处置时，其处置价格与初始确认金额之间的差额扣除相关交易费用及在适用情况下的相关税费后的净额确认为投资收益。

本基金在同时符合下列条件时确认股利收入并计入当期损益：1）本基金收取股利的权利已经确立；2）与股利相关的经济利益很可能流入本基金；3）股利的金额能够可靠计量。

（3）其他收入在经济利益很可能流入从而导致资产增加或者负债减少、且经济利益的流入额能够可靠计量时确认。

6.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬和托管费等费用按照权责发生制原则，在本基金接受相关服务的期间计入当期损益。

以摊余成本计量的金融负债在持有期间确认的利息支出按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

6.4.4.11 基金的收益分配政策

本基金同一类别的每一基金份额享有同等分配权。本基金收益以现金形式分配，但基金份额持有人可选择现金红利或将现金红利按分红除权日的基金份额净值自动转为基金份额进行再投资。若期末未分配利润中的未实现部分为正数，包括基金经营活动产生的未实现损益以及基金份额交易产生的未实现平准金等，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润中的已实现部分；若期末未分配利润的未实现部分为负数，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润，即已实现部分相抵未实现部分后的余额。在基金收益评价日，基金管理人会对基金相对业绩比较基准的超额收益率以及基金的可供分配利润进行评价。在符合收益分配相关规定的前提下，基金管理人可进行收益分配。

经宣告的拟分配基金收益于分红除权日从净资产转出。

6.4.4.12 外币交易

无。

6.4.4.13 分部报告

本基金以内部组织结构、管理要求、内部报告制度为依据确定经营分部，以经营分部为基础确定报告分部并披露分部信息。经营分部是指本基金内同时满足下列条件的组成部分：

- （1）该组成部分能够在日常活动中产生收入、发生费用。
- （2）本基金的基金管理人能够定期评价该组成部分的经营成果，以决定向其配置资源、评价其业绩。
- （3）本基金能够取得该组成部分的财务状况、经营成果和现金流量等有关会计信息。

如果两个或多个经营分部具有相似的经济特征，并且满足一定条件的，则合并为一个经营分部。本基金目前以一个单一的经营分部运作，不需要披露分部信息。

6.4.4.14 其他重要的会计政策和会计估计

无。

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	124,431.66
等于：本金	124,417.36
加：应计利息	14.30
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	932,767.43
等于：本金	932,727.91
加：应计利息	39.52
减：坏账准备	-
合计	1,057,199.09

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	14,830,934.90	-	15,239,312.50	408,377.60
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	-
债券	交易所市场	-	-	-
	银行间市场	-	-	-
	合计	-	-	-
资产支持证券	-	-	-	-
基金	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	14,830,934.90	-	15,239,312.50	408,377.60

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	-

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	2,479.70
其他	470.50
合计	2,950.20

6.4.7.10 实收基金

金额单位：人民币元

大成中证 800 指数增强发起式 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	17,213,358.10	17,213,358.10
本期申购	763,416.89	763,416.89
本期赎回（以“-”号填列）	-5,840,041.04	-5,840,041.04
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	12,136,733.95	12,136,733.95

大成中证 800 指数增强发起式 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	5,444,587.26	5,444,587.26
本期申购	1,702,044.61	1,702,044.61
本期赎回（以“-”号填列）	-4,441,395.37	-4,441,395.37
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	2,705,236.50	2,705,236.50

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

大成中证 800 指数增强发起式 A

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
----	-------	-------	---------

上年度末	72,800.47	125,474.54	198,275.01
本期期初	72,800.47	125,474.54	198,275.01
本期利润	985,314.02	179,033.09	1,164,347.11
本期基金份额交易产生的变动数	-96,786.40	-82,290.34	-179,076.74
其中：基金申购款	18,842.33	2,840.77	21,683.10
基金赎回款	-115,628.73	-85,131.11	-200,759.84
本期已分配利润	-	-	-
本期末	961,328.09	222,217.29	1,183,545.38

大成中证 800 指数增强发起式 C

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	21,213.99	39,682.02	60,896.01
本期期初	21,213.99	39,682.02	60,896.01
本期利润	254,710.34	50,503.39	305,213.73
本期基金份额交易产生的变动数	-68,440.77	-40,757.04	-109,197.81
其中：基金申购款	31,083.89	29,179.29	60,263.18
基金赎回款	-99,524.66	-69,936.33	-169,460.99
本期已分配利润	-	-	-
本期末	207,483.56	49,428.37	256,911.93

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	532.33
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	1,466.57
结算备付金利息收入	3,085.97
其他	0.02
合计	5,084.89

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	1,017,365.93
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	1,017,365.93

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	42,705,312.94
减：卖出股票成本总额	41,646,602.35
减：交易费用	41,344.66
买卖股票差价收入	1,017,365.93

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	0.29
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	3,365.91
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	3,366.20

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	6,566.46
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	3,200.00
减：应计利息总额	0.29
减：交易费用	0.26
买卖债券差价收入	3,365.91

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

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
股指期货投资收益	156,117.45

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	148,781.51
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	148,781.51
----	------------

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	229,536.48
股票投资	229,536.48
债券投资	-
资产支持证券投资	-
基金投资	-
贵金属投资	-
其他	-
2. 衍生工具	-
权证投资	-
3. 其他	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税	-
合计	229,536.48

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	478.86
基金转换费收入	1.05
合计	479.91

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	2,479.70
信息披露费	-
证券出借违约金	-
银行划款手续费	878.05
合计	3,357.75

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
中国银行股份有限公司（“中国银行”）	基金托管人

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
----	---------------------------------------

当期发生的基金应支付的管理费	70,832.28
其中：应支付销售机构的客户维护费	7,537.09
应支付基金管理人的净管理费	63,295.19

注：本基金管理费年费率为 0.80%，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
当期发生的基金应支付的托管费	8,854.06

注：本基金托管费年费率为 0.10%，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		
	大成中证 800 指数增强发起式 A	大成中证 800 指数增强发起式 C	合计
大成基金	—	864.18	864.18
合计	—	864.18	864.18

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	
	大成中证 800 指数增强发起式 A	大成中证 800 指数增强发起式 C
基金合同生效日(2025 年 12 月 2 日) 持有的基金份额	-	-
报告期初持有的基金份额	10,001,666.83	-
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	10,001,666.83	-
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	67.39%	-

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	
	期末余额	当期利息收入
中国银行	124,431.66	532.33

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
001248	华润新能源	2026 年 6 月 25 日	1 个月内（含）	新股未上市	10.11	10.11	1,000	10,110.00	10,110.00	-

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

本基金是股票型基金，其预期风险与预期收益高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。同时本基金为指数基金，主要投资于标的指数成份股及备选成份股，具有与标的指数相似的风险收益特征。本基金还可投资港股通标的股票，需承担港股通机制下因投资环境、投资标的、市场制度以及交易规则等差异带来的特有风险。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力争在对标的指数进行有效跟踪的基础上，实现超越目标指数的投资收益，谋求基金资产的长期增值。

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银行股份有限公司,因而与银行存款相关的信用风险不重大。本基金在交易所进行的交易均以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算,违约风险可能性很小;在银行间同业市场进行交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式进行限制以控制相应的信用风险。

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

本期末,本基金无债券投资(上年度末:同)。

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、结算备付金及存出保证金等。

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	1,057,199.09	-	-	-	1,057,199.09
结算备付金	2,233.85	-	-	-	2,233.85
交易性金融资产	-	-	-	15,239,312.50	15,239,312.50
应收申购款	-	-	-	29.96	29.96
资产总计	1,059,432.94	-	-	15,239,342.46	16,298,775.40
负债					
应付赎回款	-	-	-	661.83	661.83
应付管理人报酬	-	-	-	10,459.35	10,459.35
应付托管费	-	-	-	1,307.42	1,307.42
应付销售服务费	-	-	-	968.84	968.84
其他负债	-	-	-	2,950.20	2,950.20
负债总计	-	-	-	16,347.64	16,347.64
利率敏感度缺口	1,059,432.94	-	-	15,222,994.82	16,282,427.76
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	11,707,235.63	-	-	-	11,707,235.63
结算备付金	400,342.27	-	-	-	400,342.27
交易性金融资产	-	-	-	10,769,434.94	10,769,434.94
应收申购款	-	-	-	60,028.18	60,028.18
资产总计	12,107,577.90	-	-	10,829,463.12	22,937,041.02
负债					
应付赎回款	-	-	-	111.82	111.82
应付管理人报酬	-	-	-	15,723.69	15,723.69
应付托管费	-	-	-	1,965.48	1,965.48
应付销售服务费	-	-	-	2,123.65	2,123.65
负债总计	-	-	-	19,924.64	19,924.64
利率敏感度缺口	12,107,577.90	-	-	10,809,538.48	22,917,116.38

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，本基金未持有交易性债券投资和交易性资产支持证券投资（上年度末：同），因此市场利率的变动对于本基金净资产无重大影响（上年度末：同）。

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的股票，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。

本基金为增强型股票指数基金，力争在对标的指数进行有效跟踪的基础上，实现超越目标指数的投资收益，谋求基金资产的长期增值。

本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险。本基金股票资产投资比例不低于基金资产的 80%，其中投资于标的指数成份股和备选成份股的资产不低于非现金基金资产的 80%，投资于港股通标的股票的比例占股票资产的 0-50%；每个交易日日终在扣除股指期货、国债期货、股票期权合约需缴纳的交易保证金后，保持不低于基金资产净值 5%的现金或到期日在一年以内的政府债券，其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。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	15,239,312.50	93.59	10,769,434.94	46.99
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	15,239,312.50	93.59	10,769,434.94	46.99

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%	810,587.62	340,834.84
	业绩比较基准下降 5%	-810,587.62	-340,834.84

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	15,229,202.50	10,712,684.94
第二层次	10,110.00	56,750.00
第三层次	-	-
合计	15,239,312.50	10,769,434.94

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	15,239,312.50	93.50
	其中：股票	15,239,312.50	93.50
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	1,059,432.94	6.50
8	其他各项资产	29.96	0.00
9	合计	16,298,775.40	100.00

7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 报告期末指数投资按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	2,168.00	0.01
B	采矿业	515,806.00	3.17
C	制造业	8,453,153.60	51.92
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	401,864.00	2.47

E	建筑业	13,433.00	0.08
F	批发和零售业	213,320.00	1.31
G	交通运输、仓储和邮政业	356,852.00	2.19
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	511,207.00	3.14
J	金融业	1,987,455.20	12.21
K	房地产业	145,304.00	0.89
L	租赁和商务服务业	171,867.00	1.06
M	科学研究和技术服务业	193,695.00	1.19
N	水利、环境和公共设施管理业	124,982.00	0.77
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	2,952.00	0.02
S	综合	-	-
	合计	13,094,058.80	80.42

7.2.2 报告期末积极投资按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	20,979.00	0.13
B	采矿业	21,450.00	0.13
C	制造业	1,663,484.30	10.22
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	24,607.00	0.15
E	建筑业	20,048.00	0.12
F	批发和零售业	32,078.00	0.20
G	交通运输、仓储和邮政业	14,278.00	0.09
H	住宿和餐饮业	18,240.00	0.11
I	信息传输、软件和信息技术服务业	107,448.20	0.66
J	金融业	24,442.00	0.15
K	房地产业	56,399.00	0.35

L	租赁和商务服务业	60,327.00	0.37
M	科学研究和技术服务业	42,138.40	0.26
N	水利、环境和公共设施管理业	16,922.80	0.10
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	2,790.00	0.02
R	文化、体育和娱乐业	19,622.00	0.12
S	综合	-	-
	合计	2,145,253.70	13.18

7.2.3 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

7.3.1 期末指数投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量 (股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例 (%)
1	300308	中际旭创	400	508,000.00	3.12
2	688256	寒武纪	200	319,110.00	1.96
3	300502	新易盛	520	315,640.00	1.94
4	300750	宁德时代	800	314,408.00	1.93
5	603986	兆易创新	300	244,500.00	1.50
6	603259	药明康德	1,500	186,765.00	1.15
7	600030	中信证券	6,000	172,380.00	1.06
8	300857	协创数据	500	169,950.00	1.04
9	002384	东山精密	600	157,410.00	0.97
10	688008	澜起科技	500	154,950.00	0.95
11	002475	立讯精密	2,200	154,880.00	0.95
12	601328	交通银行	23,700	152,391.00	0.94
13	300475	香农芯创	500	150,000.00	0.92
14	000333	美的集团	1,900	143,507.00	0.88
15	002027	分众传媒	27,000	130,680.00	0.80
16	301536	星辰科技	1,000	128,710.00	0.79
17	002266	浙富控股	24,700	124,982.00	0.77
18	601899	紫金矿业	4,800	120,672.00	0.74
19	001389	广合科技	500	118,625.00	0.73
20	600519	贵州茅台	100	118,549.00	0.73

21	601000	唐山港	28,500	118,275.00	0.73
22	601318	中国平安	2,400	114,576.00	0.70
23	600497	驰宏锌锗	9,400	113,834.00	0.70
24	600008	首创环保	40,100	109,072.00	0.67
25	688002	睿创微纳	700	108,283.00	0.67
26	600150	中国船舶	3,200	108,128.00	0.66
27	601916	浙商银行	40,400	106,252.00	0.65
28	601665	齐鲁银行	18,300	105,591.00	0.65
29	000977	浪潮信息	1,500	105,000.00	0.64
30	600909	华安证券	9,300	103,323.00	0.63
31	600887	伊利股份	4,300	103,028.00	0.63
32	000938	紫光股份	3,400	98,124.00	0.60
33	600900	长江电力	3,700	97,939.00	0.60
34	601816	京沪高铁	21,500	97,395.00	0.60
35	601238	广汽集团	19,000	96,520.00	0.59
36	601211	国泰海通	5,300	96,460.00	0.59
37	002273	水晶光电	2,700	95,796.00	0.59
38	001309	德明利	100	94,290.00	0.58
39	688012	中微公司	200	93,700.00	0.58
40	601997	贵阳银行	17,800	91,314.00	0.56
41	000166	申万宏源	20,700	91,080.00	0.56
42	002409	雅克科技	400	89,800.00	0.55
43	300661	圣邦股份	600	86,088.00	0.53
44	300408	三环集团	500	83,450.00	0.51
45	000408	藏格矿业	1,200	83,184.00	0.51
46	600566	济川药业	3,600	79,884.00	0.49
47	002532	天山铝业	7,300	78,329.00	0.48
48	002463	沪电股份	500	76,400.00	0.47
49	688469	芯联集成	7,200	76,392.00	0.47
50	002353	杰瑞股份	500	76,250.00	0.47
51	300223	北京君正	300	74,670.00	0.46
52	600517	国网英大	15,800	73,944.00	0.45
53	300394	天孚通信	240	72,643.20	0.45
54	601009	南京银行	7,200	71,208.00	0.44
55	301308	江波龙	100	70,380.00	0.43
56	600066	宇通客车	2,600	69,706.00	0.43
57	000975	山金国际	4,100	69,700.00	0.43
58	600999	招商证券	3,300	69,630.00	0.43
59	600183	生益科技	400	69,360.00	0.43
60	300476	胜宏科技	200	69,286.00	0.43
61	002028	思源电气	400	69,200.00	0.42
62	002064	华峰化学	7,200	68,328.00	0.42
63	300604	长川科技	200	68,284.00	0.42

64	601398	工商银行	9,600	67,872.00	0.42
65	600369	西南证券	16,700	67,134.00	0.41
66	600460	士兰微	1,200	65,592.00	0.40
67	000338	潍柴动力	2,400	65,400.00	0.40
68	002299	圣农发展	4,300	65,188.00	0.40
69	603019	中科曙光	600	64,338.00	0.40
70	000983	山西焦煤	11,000	63,800.00	0.39
71	300274	阳光电源	400	63,608.00	0.39
72	300054	鼎龙股份	600	63,582.00	0.39
73	688981	中芯国际	400	63,528.00	0.39
74	300373	扬杰科技	400	62,892.00	0.39
75	000630	铜陵有色	9,700	61,692.00	0.38
76	600893	航发动力	1,600	61,344.00	0.38
77	000895	双汇发展	2,700	60,480.00	0.37
78	600498	烽火通信	800	58,880.00	0.36
79	601138	工业富联	800	57,720.00	0.35
80	000792	盐湖股份	1,900	57,361.00	0.35
81	600570	恒生电子	2,700	57,213.00	0.35
82	000651	格力电器	1,500	56,250.00	0.35
83	301526	国际复材	1,200	56,004.00	0.34
84	000807	云铝股份	2,500	55,350.00	0.34
85	600522	中天科技	900	54,612.00	0.34
86	605358	立昂微	700	54,320.00	0.33
87	600015	华夏银行	8,500	54,315.00	0.33
88	603833	欧派家居	1,800	54,198.00	0.33
89	600282	南钢股份	11,800	54,162.00	0.33
90	600489	中金黄金	3,000	54,150.00	0.33
91	600674	川投能源	3,800	53,846.00	0.33
92	002281	光迅科技	200	51,388.00	0.32
93	002851	麦格米特	300	50,154.00	0.31
94	601901	方正证券	6,900	49,680.00	0.31
95	003816	中国广核	12,700	49,657.00	0.30
96	000596	古井贡酒	600	47,880.00	0.29
96	002415	海康威视	1,400	47,880.00	0.29
98	000657	中钨高新	500	47,860.00	0.29
99	600546	山煤国际	4,200	45,906.00	0.28
100	002025	航天电器	600	45,732.00	0.28
101	002001	新 和 成	1,600	45,472.00	0.28
102	000893	亚钾国际	1,100	44,979.00	0.28
103	600704	物产中大	9,500	44,840.00	0.28
104	601399	国机重装	12,800	44,800.00	0.28
105	600515	海南机场	16,200	44,388.00	0.27
106	603156	养元饮品	900	44,163.00	0.27

107	002138	顺络电子	600	43,860.00	0.27
108	605117	德业股份	400	42,472.00	0.26
109	001979	招商蛇口	6,500	41,795.00	0.26
110	600584	长电科技	400	41,420.00	0.25
111	600027	华电国际	9,300	41,385.00	0.25
112	600426	华鲁恒升	1,700	40,664.00	0.25
113	600048	保利发展	8,700	40,281.00	0.25
114	603345	安井食品	500	40,095.00	0.25
115	002850	科达利	200	37,860.00	0.23
116	605499	东鹏饮料	300	37,029.00	0.23
117	000988	华工科技	200	36,922.00	0.23
118	300666	江丰电子	100	36,860.00	0.23
119	002466	天齐锂业	600	36,792.00	0.23
120	600919	江苏银行	3,400	36,652.00	0.23
121	600176	中国巨石	500	36,440.00	0.22
122	600316	洪都航空	1,300	36,322.00	0.22
123	000415	渤海租赁	8,800	35,816.00	0.22
124	603816	顾家家居	1,600	35,776.00	0.22
125	300136	信维通信	300	35,775.00	0.22
126	002049	紫光国微	400	35,500.00	0.22
127	002738	中矿资源	600	35,394.00	0.22
128	601128	常熟银行	5,960	34,687.20	0.21
129	601865	福莱特	3,300	34,683.00	0.21
130	600968	海油发展	10,400	34,632.00	0.21
131	000683	博源化工	5,900	33,984.00	0.21
132	002966	苏州银行	4,800	33,408.00	0.21
133	601598	中国外运	6,700	33,232.00	0.20
134	300124	汇川技术	500	33,165.00	0.20
135	600809	山西汾酒	300	32,811.00	0.20
136	002460	赣锋锂业	500	32,700.00	0.20
137	300059	东方财富	1,600	32,608.00	0.20
138	600372	中航机载	3,000	32,550.00	0.20
139	600363	联创光电	900	32,202.00	0.20
140	000729	燕京啤酒	3,100	31,403.00	0.19
141	600104	上汽集团	3,200	31,232.00	0.19
142	601108	财通证券	3,600	31,140.00	0.19
143	601688	华泰证券	1,500	30,930.00	0.19
144	600601	方正科技	2,200	30,448.00	0.19
145	600938	中国海油	1,100	29,865.00	0.18
146	601456	国联民生	3,300	29,172.00	0.18
147	600535	天士力	2,200	29,106.00	0.18
148	603786	科博达	700	28,637.00	0.18
149	000776	广发证券	1,200	28,080.00	0.17

149	603993	洛阳钼业	1,600	28,080.00	0.17
151	300122	智飞生物	2,400	28,056.00	0.17
152	601939	建设银行	2,900	27,927.00	0.17
153	601156	东航物流	1,700	27,404.00	0.17
154	002152	广电运通	2,900	27,202.00	0.17
155	601818	光大银行	9,400	27,166.00	0.17
156	601228	广州港	9,600	27,072.00	0.17
157	600105	永鼎股份	400	26,992.00	0.17
158	002185	华天科技	1,200	26,772.00	0.16
159	002414	高德红外	2,000	26,520.00	0.16
160	000001	平安银行	2,500	25,125.00	0.15
161	688220	翱捷科技	200	24,864.00	0.15
162	688301	奕瑞科技	200	24,800.00	0.15
163	600871	石化油服	12,100	24,563.00	0.15
164	300450	先导智能	600	24,432.00	0.15
165	601608	中信重工	5,100	24,327.00	0.15
166	300432	富临精工	1,200	24,108.00	0.15
167	300033	同花顺	100	24,100.00	0.15
168	603000	人民网	1,600	23,664.00	0.15
169	001286	陕西能源	2,300	23,322.00	0.14
170	601377	兴业证券	3,800	22,952.00	0.14
171	600585	海螺水泥	1,300	22,035.00	0.14
172	688213	思特威	200	21,414.00	0.13
173	600299	安迪苏	2,700	21,195.00	0.13
174	002841	视源股份	600	20,718.00	0.13
175	688099	晶晨股份	200	20,580.00	0.13
176	000598	兴蓉环境	3,200	20,544.00	0.13
177	601106	中国一重	6,200	20,460.00	0.13
178	600685	中船防务	800	20,352.00	0.12
179	601825	沪农商行	2,700	20,223.00	0.12
180	600741	华域汽车	1,300	20,176.00	0.12
181	300458	全志科技	500	19,730.00	0.12
182	000951	中国重汽	1,000	19,510.00	0.12
183	002558	巨人网络	700	19,292.00	0.12
184	600764	中国海防	1,100	19,173.00	0.12
185	002600	领益智造	1,100	19,074.00	0.12
186	603858	步长制药	1,300	18,980.00	0.12
187	600663	陆家嘴	3,000	18,840.00	0.12
188	601607	上海医药	1,200	18,480.00	0.11
189	601018	宁波港	5,700	17,955.00	0.11
190	600499	科达制造	1,300	17,940.00	0.11
191	600061	国投资本	2,700	17,685.00	0.11
192	688676	金盘科技	200	16,928.00	0.10

193	000157	中联重科	2,400	16,728.00	0.10
194	601360	三六零	1,900	16,511.00	0.10
195	601225	陕西煤业	800	16,280.00	0.10
196	603392	万泰生物	600	16,182.00	0.10
197	603565	中谷物流	1,600	15,696.00	0.10
198	000725	京东方 A	1,800	15,624.00	0.10
199	600000	浦发银行	1,800	15,498.00	0.10
200	002837	英维克	190	15,116.40	0.09
201	603806	福斯特	900	15,111.00	0.09
202	002008	大族激光	100	15,011.00	0.09
203	000703	恒逸石化	1,100	14,927.00	0.09
204	603296	华勤技术	200	14,854.00	0.09
205	600595	中孚实业	2,600	14,612.00	0.09
206	603799	华友钴业	300	14,478.00	0.09
207	600801	华新建材	900	14,040.00	0.09
208	600018	上港集团	2,900	13,688.00	0.08
209	600482	中国动力	400	13,120.00	0.08
210	601229	上海银行	1,400	12,152.00	0.07
211	600398	海澜之家	2,300	12,029.00	0.07
212	600438	通威股份	900	10,899.00	0.07
213	600298	安琪酵母	300	10,860.00	0.07
214	601100	恒立液压	100	10,756.00	0.07
215	601658	邮储银行	2,100	10,353.00	0.06
216	600039	四川路桥	1,300	10,166.00	0.06
217	002126	银轮股份	200	9,960.00	0.06
217	600927	永安期货	800	9,960.00	0.06
219	002517	恺英网络	600	9,750.00	0.06
220	002444	巨星科技	300	9,330.00	0.06
221	600348	华阳股份	1,200	9,180.00	0.06
222	300803	指南针	100	9,167.00	0.06
223	601808	中海油服	800	8,648.00	0.05
224	600549	厦门钨业	100	8,520.00	0.05
225	000060	中金岭南	1,100	8,327.00	0.05
226	688568	中科星图	200	8,294.00	0.05
227	601577	长沙银行	900	7,839.00	0.05
228	600131	国网信通	500	7,300.00	0.04
229	300012	华测检测	500	6,930.00	0.04
230	300014	亿纬锂能	100	6,503.00	0.04
231	000088	盐田港	1,500	6,135.00	0.04
232	300316	晶盛机电	100	6,040.00	0.04
233	600177	雅戈尔	800	6,024.00	0.04
234	601699	潞安环能	400	5,712.00	0.04
235	601888	中国中免	100	5,371.00	0.03

236	600765	中航重机	400	5,168.00	0.03
237	600660	福耀玻璃	100	5,044.00	0.03
238	603699	纽威股份	100	5,030.00	0.03
239	603179	新泉股份	100	4,965.00	0.03
240	601169	北京银行	1,000	4,900.00	0.03
241	600547	山东黄金	200	4,618.00	0.03
242	300413	芒果超媒	300	4,389.00	0.03
243	002926	华西证券	500	4,085.00	0.03
244	000739	普洛药业	200	3,332.00	0.02
245	600795	国电电力	700	3,269.00	0.02
246	600606	绿地控股	2,700	3,267.00	0.02
247	002493	荣盛石化	300	3,225.00	0.02
248	000987	越秀资本	400	3,128.00	0.02
249	601098	中南传媒	300	2,952.00	0.02
250	601139	深圳燃气	500	2,830.00	0.02
251	002410	广联达	300	2,448.00	0.02
252	000039	中集集团	300	2,433.00	0.01
253	600598	北大荒	200	2,168.00	0.01
254	000425	徐工机械	200	1,618.00	0.01
255	601567	三星电气	100	1,494.00	0.01
256	600390	五矿资本	300	1,368.00	0.01
257	002624	完美世界	100	1,242.00	0.01
258	600295	鄂尔多斯	100	1,072.00	0.01

7.3.2 期末积极投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量 (股)	公允价值（元）	占基金资产净值比例 (%)
1	301045	天禄科技	400	35,632.00	0.22
2	300382	斯莱克	1,400	32,354.00	0.20
3	002643	万润股份	1,500	31,425.00	0.19
4	688378	奥来德	500	31,000.00	0.19
5	301307	美利信	400	30,116.00	0.18
6	301086	鸿富瀚	140	29,299.20	0.18
7	300909	汇创达	500	29,110.00	0.18
8	002955	鸿合科技	800	28,600.00	0.18
9	002079	苏州固锝	1,900	28,557.00	0.18
10	002803	吉宏股份	1,100	28,424.00	0.17
11	301326	捷邦科技	200	27,874.00	0.17
12	301328	维峰电子	380	27,056.00	0.17
13	301168	通灵股份	600	26,946.00	0.17
14	301548	崇德科技	300	26,631.00	0.16
15	688600	皖仪科技	800	26,624.00	0.16
16	301321	翰博高新	600	26,490.00	0.16

17	600477	杭萧钢构	11,000	25,410.00	0.16
18	002206	海利得	4,900	25,333.00	0.16
19	300745	欣锐科技	600	25,332.00	0.16
20	301097	天益医疗	700	24,990.00	0.15
21	002818	富森美	2,400	24,936.00	0.15
22	301162	国能日新	560	24,500.00	0.15
23	601860	紫金银行	10,100	24,442.00	0.15
24	300775	三角防务	1,100	24,244.00	0.15
25	600558	大西洋	4,800	23,712.00	0.15
26	301062	上海艾录	4,100	23,411.00	0.14
27	301280	珠城科技	460	23,262.20	0.14
28	002250	联化科技	1,700	23,239.00	0.14
29	603519	立霸股份	1,500	22,950.00	0.14
30	600325	华发股份	9,900	22,869.00	0.14
31	300656	民德电子	600	22,854.00	0.14
32	300572	安车检测	800	22,696.00	0.14
33	603285	键邦股份	500	22,405.00	0.14
34	300836	佰奥智能	300	22,197.00	0.14
35	002154	报喜鸟	6,200	22,072.00	0.14
36	603660	苏州科达	1,800	22,050.00	0.14
37	301019	宁波色母	1,200	21,396.00	0.13
38	300700	岱勒新材	1,000	21,280.00	0.13
39	601968	宝钢包装	5,400	21,168.00	0.13
40	688113	联测科技	600	21,060.00	0.13
41	002484	江海股份	200	21,000.00	0.13
42	002458	益生股份	2,700	20,979.00	0.13
43	300980	祥源新材	700	20,587.00	0.13
43	301122	采纳股份	700	20,587.00	0.13
45	688030	山石网科	1,300	20,527.00	0.13
46	002849	威星智能	1,200	20,304.00	0.12
47	002062	宏润建设	2,800	20,048.00	0.12
48	001359	平安电工	160	20,040.00	0.12
49	300681	英搏尔	700	20,034.00	0.12
50	600288	大恒科技	1,500	19,950.00	0.12
51	002383	合众思壮	2,900	19,691.00	0.12
52	002899	英派斯	900	19,620.00	0.12
53	000922	佳电股份	1,400	19,544.00	0.12
54	301133	金钟股份	500	19,100.00	0.12
55	688609	九联科技	1,700	18,717.00	0.11
56	002615	哈尔斯	2,700	18,630.00	0.11
57	688238	和元生物	3,400	18,428.00	0.11
58	000428	华天酒店	6,000	18,240.00	0.11
59	000726	鲁泰 A	3,300	17,919.00	0.11

60	600395	盘江股份	3,900	17,784.00	0.11
61	600533	栖霞建设	9,400	17,766.00	0.11
62	002785	万里石	400	17,724.00	0.11
63	688215	瑞晟智能	435	17,469.60	0.11
64	000802	北京文化	5,000	17,400.00	0.11
65	688218	江苏北人	300	16,488.00	0.10
66	688045	必易微	200	16,156.00	0.10
67	300055	万邦达	2,500	16,075.00	0.10
68	600790	轻纺城	4,900	16,023.00	0.10
69	688653	康希通信	900	15,642.00	0.10
70	301002	崧盛股份	400	15,440.00	0.09
71	688299	长阳科技	900	15,039.00	0.09
72	688013	天臣医疗	600	14,802.00	0.09
73	002996	顺博合金	2,500	14,750.00	0.09
74	600969	郴电国际	1,900	14,497.00	0.09
75	603998	方盛制药	1,600	14,448.00	0.09
76	600676	久事动娱	2,200	14,278.00	0.09
77	301169	零点有数	200	14,132.00	0.09
78	300938	信测标准	280	13,966.40	0.09
79	002543	万和电气	2,200	13,684.00	0.08
80	300767	震安科技	600	13,374.00	0.08
81	603089	正裕工业	1,600	13,360.00	0.08
82	002912	中新赛克	700	12,908.00	0.08
83	001311	多利科技	780	12,581.40	0.08
84	301221	光庭信息	420	12,394.20	0.08
85	002998	优彩资源	1,900	12,369.00	0.08
86	603012	创力集团	1,500	12,300.00	0.08
87	300539	横河精密	600	12,222.00	0.08
88	600641	先导基电	300	11,958.00	0.07
89	603050	科林电气	600	11,736.00	0.07
90	301487	盟固利	600	11,490.00	0.07
91	002228	合兴包装	3,800	11,172.00	0.07
92	300984	金沃股份	200	10,746.00	0.07
93	688267	中触媒	540	10,638.00	0.07
94	603726	朗迪集团	300	10,275.00	0.06
95	001248	华润新能源	1,000	10,110.00	0.06
96	300887	谱尼测试	1,400	9,744.00	0.06
97	300774	倍杰特	900	9,675.00	0.06
98	002169	智光电气	600	8,784.00	0.05
99	002296	辉煌科技	900	7,992.00	0.05
100	300756	金马游乐	240	7,932.00	0.05
101	300078	思创智联	2,600	7,722.00	0.05
102	002283	天润工业	800	7,720.00	0.05

103	300491	通合科技	200	7,638.00	0.05
104	002947	恒铭达	100	7,605.00	0.05
105	300933	中辰股份	1,200	7,296.00	0.04
106	300955	嘉亨家化	200	7,218.00	0.04
107	301108	洁雅股份	300	7,077.00	0.04
108	301026	浩通科技	300	6,066.00	0.04
109	300025	华星创业	1,400	5,880.00	0.04
110	600201	生物股份	500	5,825.00	0.04
111	688173	希荻微	300	5,742.00	0.04
112	002338	奥普光电	100	5,720.00	0.04
113	002919	名臣健康	300	5,697.00	0.03
114	300490	华自科技	400	5,292.00	0.03
115	600984	建设机械	1,400	5,236.00	0.03
116	002328	新朋股份	700	5,138.00	0.03
117	002572	索菲亚	700	5,110.00	0.03
118	300861	美畅股份	200	5,038.00	0.03
119	301608	博实结	100	5,026.00	0.03
120	002132	恒星科技	900	4,869.00	0.03
121	300571	平治信息	100	4,566.00	0.03
122	300943	春晖智控	100	4,495.00	0.03
123	001230	劲旅环境	280	4,300.80	0.03
124	002440	闰土股份	400	4,100.00	0.03
125	002396	星网锐捷	210	4,025.70	0.02
126	600094	大名城	1,100	3,806.00	0.02
127	002284	亚太股份	400	3,796.00	0.02
128	001337	四川黄金	100	3,666.00	0.02
129	002390	信邦制药	1,400	3,654.00	0.02
130	002544	普天科技	200	3,644.00	0.02
131	600425	青松建化	1,100	3,597.00	0.02
132	300132	青松股份	600	3,408.00	0.02
133	300893	松原安全	200	3,240.00	0.02
134	301510	固高科技	100	3,193.00	0.02
135	300422	博世科	700	2,947.00	0.02
136	600327	大东方	900	2,790.00	0.02
137	600963	岳阳林纸	900	2,736.00	0.02
138	603889	新澳股份	520	2,657.20	0.02
139	300696	爱乐达	100	2,603.00	0.02
140	301371	敷尔佳	100	2,600.00	0.02
141	301052	果麦文化	100	2,222.00	0.01
142	000933	神火股份	100	2,120.00	0.01
143	002391	长青股份	300	1,461.00	0.01
144	000612	焦作万方	100	1,059.00	0.01
145	003012	东鹏控股	100	436.00	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	688256	寒武纪	498,368.00	2.17
2	300502	新易盛	399,412.00	1.74
3	300750	宁德时代	371,885.00	1.62
4	601899	紫金矿业	299,464.00	1.31
5	300308	中际旭创	260,418.00	1.14
6	002475	立讯精密	256,167.00	1.12
7	601665	齐鲁银行	245,670.00	1.07
8	601318	中国平安	240,726.00	1.05
9	600183	生益科技	230,904.00	1.01
10	603986	兆易创新	225,559.00	0.98
11	600887	伊利股份	223,296.00	0.97
12	688008	澜起科技	218,452.00	0.95
13	600150	中国船舶	218,352.00	0.95
14	000977	浪潮信息	210,317.00	0.92
15	001389	广合科技	209,920.00	0.92
16	002916	深南电路	195,227.00	0.85
17	000408	藏格矿业	194,950.00	0.85
18	300274	阳光电源	194,545.00	0.85
19	300394	天孚通信	186,449.00	0.81
20	002463	沪电股份	185,631.00	0.81

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	300750	宁德时代	472,899.00	2.06
2	601899	紫金矿业	386,475.00	1.69
3	300502	新易盛	312,525.00	1.36
4	002475	立讯精密	295,573.00	1.29
5	600519	贵州茅台	274,909.00	1.20
6	688256	寒武纪	254,706.00	1.11
7	600183	生益科技	249,337.00	1.09
8	688041	海光信息	237,906.34	1.04
9	002916	深南电路	229,017.00	1.00
10	300308	中际旭创	228,495.00	1.00
11	688008	澜起科技	228,342.00	1.00
12	002130	沃尔核材	224,054.00	0.98

13	601318	中国平安	222,157.00	0.97
14	600919	江苏银行	216,977.00	0.95
15	001389	广合科技	215,596.00	0.94
16	002736	国信证券	207,668.00	0.91
17	600276	恒瑞医药	205,471.00	0.90
18	002436	兴森科技	204,624.00	0.89
19	000725	京东方 A	202,697.00	0.88
20	600487	亨通光电	202,419.00	0.88

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	45,886,943.43
卖出股票收入（成交）总额	42,705,312.94

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

无。

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

无。

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

本基金在注重风险管理的前提下，根据风险管理的原则，以套期保值为目的，将适度运用股指期货。本基金利用股指期货流动性好、交易成本低和杠杆操作等特点，通过股指期货对本基金投资组合的跟踪效果进行及时、有效地调整和优化，并提高投资组合的运作效率等。

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	-
2	应收清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	29.96
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	29.96

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

7.12.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

无。

7.12.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

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（%）
大成中证 800 指数增强发起式 A	108	112,377.17	10,001,666.83	82.41	2,135,067.12	17.59
大成中证 800 指数增强发起式 C	101	26,784.52	900,120.00	33.27	1,805,116.50	66.73
合计	209	71,014.21	10,901,786.83	73.45	3,940,183.62	26.55

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 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	大成中证 800 指数增强发起式 A	—	—
	大成中证 800 指数增强发起式 C	18,559.95	0.6861
	合计	18,559.95	0.1251

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）。

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

项目	份额级别	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	大成中证 800 指数增强发起式 A	0
	大成中证 800 指数增强发起式 C	0
	合计	0
本基金基金经理持有本开放式基金	大成中证 800 指数增强发起式 A	0

	大成中证 800 指数增强发起式 C	0
	合计	0

8.4 发起式基金发起资金持有份额情况

项目	持有份额总数	持有份额占基金总份额比例 (%)	发起份额总数	发起份额占基金总份额比例 (%)	发起份额承诺持有期限
基金管理人固有资金	10,001,666.83	67.39	10,001,666.83	67.39	3 年
基金管理人高级管理人员	-	-	-	-	-
基金经理等人员	18,559.95	0.13	-	-	-
基金管理人股东	-	-	-	-	-
其他	-	-	-	-	-
合计	10,020,226.78	67.51	10,001,666.83	67.39	3 年

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	大成中证 800 指数增强发起式 A	大成中证 800 指数增强发起式 C
基金合同生效日（2025 年 12 月 2 日）基金份额总额	18,058,198.23	9,101,905.80
本报告期期初基金份额总额	17,213,358.10	5,444,587.26
本报告期基金总申购份额	763,416.89	1,702,044.61
减：本报告期基金总赎回份额	5,840,041.04	4,441,395.37
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	12,136,733.95	2,705,236.50

§ 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

本报告期内，本基金托管人的基金托管业务履职不涉及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的基金托管业务履职不涉及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 (%)	

中信证券 (山东)	3	88,582,146.37	100.00	14,310.19	100.00	新增 3 个
--------------	---	---------------	--------	-----------	--------	-----------

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 (%)
中信证券 (山东)	6,566.46	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	大成中证 800 指数增强型发起式证券投资基金(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	大成中证 800 指数增强型发起式证券投资基金(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	中国证监会基金电子披	2026 年 04 月 30 日

	份（通过公募基金持股）参与股东大会投票信息披露	露网站、规定报刊及本公司网站	
4	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
5	大成中证 800 指数增强型发起式证券投资基金 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
6	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
7	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 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

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过 20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比（%）
机构	1	20260101-20260630	10,001,666.83	-	-	10,001,666.83	67.39
产品特有风险							
当基金份额持有人占比过于集中时，可能会因某单一基金份额持有人大额赎回而引发基金净值剧烈波动的风险，甚至有可能引起基金的流动性风险，基金管理人可能无法及时变现基金资产以应对基金份额持有人的赎回申请，基金份额持有人可能无法及时赎回持有的全部基金份额。							

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中证 800 指数增强型发起式证券投资基金的文件；
- 2、《大成中证 800 指数增强型发起式证券投资基金基金合同》；
- 3、《大成中证 800 指数增强型发起式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