

大成中证 500 指数增强型证券投资基金 2026 年中期报告

2026 年 6 月 30 日

基金管理人：大成基金管理有限公司

基金托管人：中国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	5
2.4 信息披露方式	6
2.5 其他相关资料	6
§ 3 主要财务指标和基金净值表现	6
3.1 主要会计数据和财务指标	6
3.2 基金净值表现	7
§ 4 管理人报告	8
4.1 基金管理人及基金经理情况	8
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	10
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	10
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明	10
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	11
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	11
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	12
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明	12
§ 5 托管人报告	12
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	12
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	12
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	12
§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）	13
6.1 资产负债表	13
6.2 利润表	14
6.3 净资产变动表	15
6.4 报表附注	17
§ 7 投资组合报告	37
7.1 期末基金资产组合情况	37
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	38
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	40
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	46
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	49
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	49
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	49
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	49

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	49
7.10 本基金投资股指期货的投资政策	49
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	49
7.12 投资组合报告附注	49
§ 8 基金份额持有人信息	50
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	50
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	51
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	51
§ 9 开放式基金份额变动	51
§ 10 重大事件揭示	52
10.1 基金份额持有人大会决议	52
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	52
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	52
10.4 基金投资策略的改变	52
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	52
10.6 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况	52
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	53
10.8 其他重大事件	55
§ 11 影响投资者决策的其他重要信息	56
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	56
11.2 影响投资者决策的其他重要信息	56
§ 12 备查文件目录	56
12.1 备查文件目录	56
12.2 存放地点	56
12.3 查阅方式	56

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	大成中证 500 指数增强型证券投资基金	
基金简称	大成中证 500 指数增强	
基金主代码	021170	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2024 年 7 月 19 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	18,206,727.72 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 500 指数增强 A	大成中证 500 指数增强 C
下属分级基金的交易代码	021170	021171
报告期末下属分级基金的份额总额	10,351,794.18 份	7,854,933.54 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。
业绩比较基准	中证 500 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。

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	北京市西城区复兴门内大街 28

	1236 号大成基金总部大厦 5 层、27-33 层	号凯晨世贸中心东座 F9
邮政编码	518054	100031
法定代表人	吴庆斌	谷澍

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《中国证券报》
登载基金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 500 指数增强 A	大成中证 500 指数增强 C
本期已实现收益	1,381,209.27	957,547.62
本期利润	1,813,371.54	647,718.59
加权平均基金份额本期利润	0.1613	0.0820
本期加权平均净值利润率	9.77%	5.00%
本期基金份额净值增长率	14.41%	14.18%
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	7,522,381.64	5,604,824.52
期末可供分配基金份额利润	0.7267	0.7135
期末基金资产净值	18,115,164.42	13,639,024.49
期末基金份额净值	1.7500	1.7364
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	75.00%	73.64%

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 500 指数增强 A

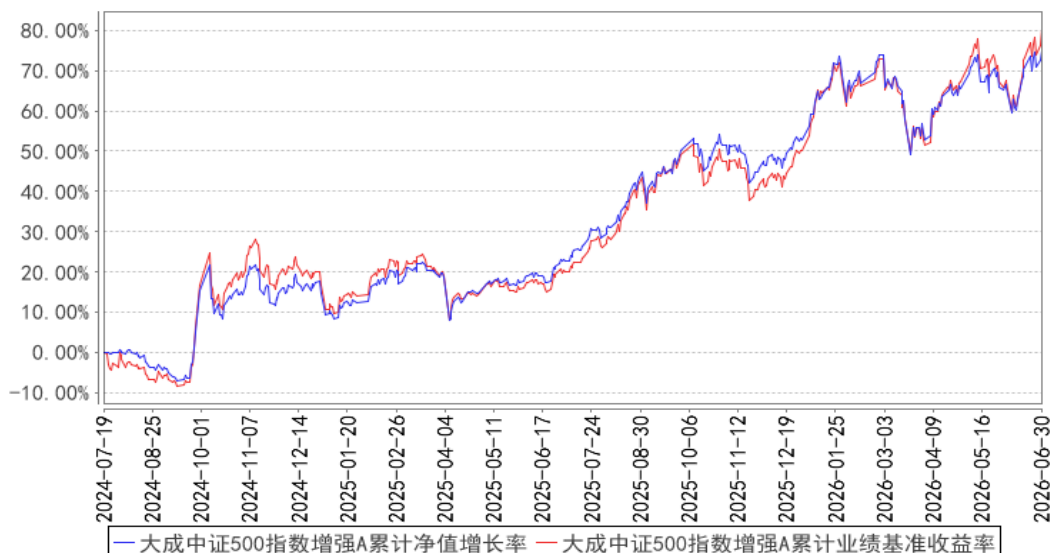
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去三个月	13.83%	1.41%	17.61%	1.56%	-3.78%	-0.15%
过去六个月	14.41%	1.47%	19.93%	1.58%	-5.52%	-0.11%
过去一年	43.14%	1.24%	49.68%	1.35%	-6.54%	-0.11%
自基金合同生效起至今	75.00%	1.37%	80.11%	1.51%	-5.11%	-0.14%

大成中证 500 指数增强 C

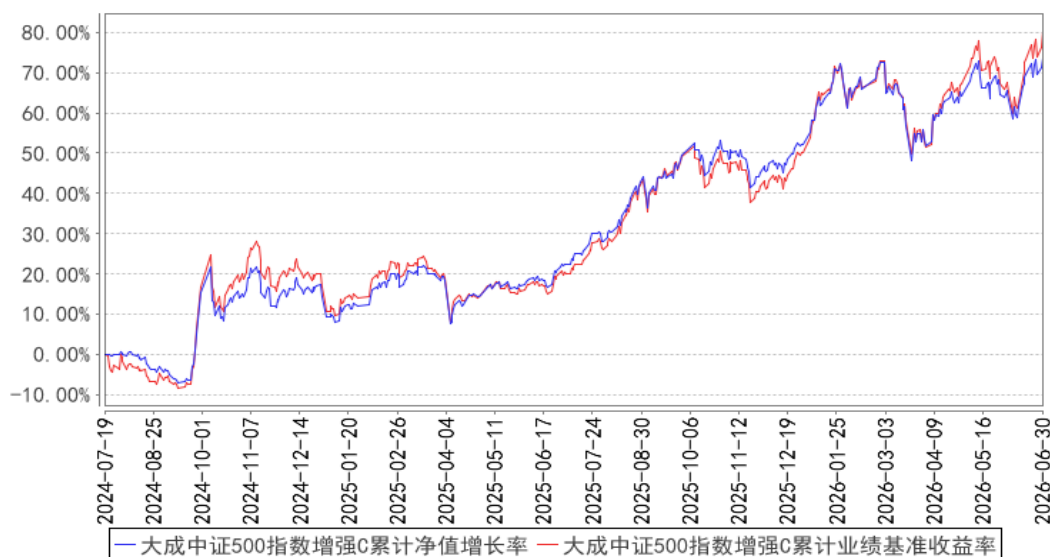
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去三个月	13.72%	1.41%	17.61%	1.56%	-3.89%	-0.15%
过去六个月	14.18%	1.47%	19.93%	1.58%	-5.75%	-0.11%
过去一年	42.57%	1.24%	49.68%	1.35%	-7.11%	-0.11%
自基金合同生效起至今	73.64%	1.37%	80.11%	1.51%	-6.47%	-0.14%

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500指数增强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500指数增强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：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。

§ 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	证券从	说明
----	----	-----------	-----	----

		(助理) 期限		业年限	
		任职日期	离任日期		
夏高	本基金基金经理， 指数与期货投资部 副总监	2024 年 7 月 19 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。公司运用统计分析方法和工具，对旗下所有投资组合连续 4 个季度的日内、3 日内、5 日内及 10 日内股票及债券交易同向交易价差进行分析，针对同一基金经理管理的多个投资组合及公私募兼任基金经理管理的多个投资组合的投资交易行为加强了公平交易监测与分析，包括对不同时间窗下（同日、3 日、5 日、10 日）反向交易和同向交易价差监控的分析。分析结果表明：债券交易同向交易频率较低；部分股票同向交易溢价率较大主要来源于投资策略差异、市场因素（如个股当日价格振幅较高）及组合经理交易时机选择，同时结合交易价差专项统计分析，未发现违反公平交易原则的异常情况。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

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

4.4 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%。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 500 指数增强 A 的基金份额净值为 1.7500 元，本报告期基金份额净值增长率为 14.41%，同期业绩比较基准收益率为 19.93%；截至本报告期末大成中证 500 指数增强 C 的基金份额净值为 1.7364 元，本报告期基金份额净值增长率为 14.18%，同期业绩比较基准收益率为 19.93%。

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

本基金在本报告期内，曾出现了连续 60 个工作日资产净值低于五千万元的情形。我公司已根据法律法规及基金合同要求拟定相关应对方案上报中国证券监督管理委员会。自 2025 年 1 月 4 日起，由本基金管理人承担本基金的固定费用。

§ 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遵规守信、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：大成中证 500 指数增强型证券投资基金

报告截止日：2026 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2026 年 6 月 30 日	上年度末 2025 年 12 月 31 日
资 产：			
货币资金	6.4.7.1	2,990,971.92	2,101,755.12
结算备付金		462,359.06	326,871.61
存出保证金		233,666.16	191,240.54
交易性金融资产	6.4.7.2	28,176,454.07	16,240,973.77
其中：股票投资		28,176,454.07	16,240,973.77
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		—	277,128.41
应收股利		—	—
应收申购款		26,142.19	61,554.72
递延所得税资产		—	—
其他资产	6.4.7.8	—	—
资产总计		31,889,593.40	19,199,524.17
负债和净资产	附注号	本期末 2026 年 6 月 30 日	上年度末 2025 年 12 月 31 日
负 债：			
短期借款		—	—
交易性金融负债		—	—
衍生金融负债	6.4.7.3	—	—
卖出回购金融资产款		—	—
应付清算款		—	—
应付赎回款		90,593.09	339,056.09
应付管理人报酬		19,324.06	14,728.52
应付托管费		2,415.50	1,841.06
应付销售服务费		3,866.84	2,945.67
应付投资顾问费		—	—

应交税费		5,248.13	5,370.78
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.9	13,956.87	12,316.21
负债合计		135,404.49	376,258.33
净资产：			
实收基金	6.4.7.10	18,206,727.72	12,334,633.28
未分配利润	6.4.7.12	13,547,461.19	6,488,632.56
净资产合计		31,754,188.91	18,823,265.84
负债和净资产总计		31,889,593.40	19,199,524.17

注：报告截止日 2026 年 6 月 30 日，基金份额总额 18,206,727.72 份。其中大成中证 500 指数增强 A 类基金份额总额为 10,351,794.18 份，基金份额净值 1.7500 元；大成中证 500 指数增强 C 类基金份额总额为 7,854,933.54 份，基金份额净值 1.7364 元。

6.2 利润表

会计主体：大成中证 500 指数增强型证券投资基金

本报告期：2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 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		2,631,178.90	1,781,857.61
1. 利息收入		7,066.00	7,042.86
其中：存款利息收入	6.4.7.13	7,066.00	7,042.86
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）		2,488,517.10	1,650,718.93
其中：股票投资收益	6.4.7.14	1,890,094.64	1,498,302.99
基金投资收益	6.4.7.15	-	-
债券投资收益	6.4.7.16	5,852.40	3,479.64
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	360,265.61	-41,763.07
股利收益	6.4.7.20	232,304.45	190,699.37

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	122,333.24	111,737.49
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	13,262.56	12,358.33
减：二、营业总支出		170,088.77	130,660.45
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	125,577.43	98,441.11
2. 托管费	6.4.10.2.2	15,697.17	12,305.10
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	25,801.63	18,438.96
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		1,297.54	23.21
8. 其他费用	6.4.7.24	1,715.00	1,452.07
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		2,461,090.13	1,651,197.16
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		2,461,090.13	1,651,197.16
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		2,461,090.13	1,651,197.16

6.3 净资产变动表

会计主体：大成中证 500 指数增强型证券投资基金

本报告期：2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	12,334,633.28	-	6,488,632.56	18,823,265.84
二、本期期初净资产	12,334,633.28	-	6,488,632.56	18,823,265.84

三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	5,872,094.44	-	7,058,828.63	12,930,923.07
（一）、综合收益总额	-	-	2,461,090.13	2,461,090.13
（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）	5,872,094.44	-	4,597,738.50	10,469,832.94
其中：1. 基金申购款	32,311,514.28	-	21,648,978.75	53,960,493.03
2. 基金赎回款	-26,439,419.84	-	-17,051,240.25	-43,490,660.09
（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	18,206,727.72	-	13,547,461.19	31,754,188.91
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	30,667,675.68	-	4,483,845.48	35,151,521.16
二、本期期初净资产	30,667,675.68	-	4,483,845.48	35,151,521.16
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-15,840,883.62	-	-1,212,498.58	-17,053,382.20
（一）、综合收益总额	-	-	1,651,197.16	1,651,197.16
（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）	-15,840,883.62	-	-2,863,695.74	-18,704,579.36
其中：1. 基金申购款	17,933,162.64	-	2,906,753.87	20,839,916.51

2. 基金赎回款	-33,774,046.26	-	-5,770,449.61	-39,544,495.87
(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	14,826,792.06	-	3,271,346.90	18,098,138.96

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

大成中证 500 指数增强型证券投资基金(以下简称“本基金”)经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2024]442 号《关于准予大成中证 500 指数增强型证券投资基金注册的批复》准予注册,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 500 指数增强型证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式,存续期限不定,首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币 438,593,700.22 元,业经安永华明会计师事务所(特殊普通合伙)安永华明(2024)验字第 70039092_H05 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《大成中证 500 指数增强型证券投资基金基金合同》于 2024 年 7 月 19 日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为 438,664,107.60 份基金份额,其中认购资金利息折合 70,407.38 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《中华人民共和国证券投资基金法》和《大成中证 500 指数增强型证券投资基金基金合同》的有关规定,本基金主要投资于标的指数成份股和备选成份股(含存托凭证,下同)。为更好地实现基金的投资目标,本基金可少量投资于部分非成份股(包含创业板、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。本基金可根据法律法规的规定参与融资业务和转融通证券出借业务。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种(包括但不限于股指期货等金融衍生品),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:投资于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。本基金的业绩比较基准为:中证 500 指数收益率 $\times$ 95%+银行活期存款利率(税后) $\times$ 5%。

6.4.2 会计报表的编制基础

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

本财务报表以持续经营为基础编制。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

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

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

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 会计政策变更的说明

无。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

无。

6.4.5.3 差错更正的说明

无。

6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128 号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2008]1 号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85 号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2014]81 号《财政部国家税务总局证监会关于沪港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》、财税[2015]101 号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2016]127 号《财政部国家税务总局证监会关于深港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》、财税[2017]56 号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90 号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》、财政部、国家税务总局公告 2025 年第 4 号《关于国债等债券利息收入增值税政策的公告》、国务院令 第 826 号《中华人民共和国增值税法实施条例》、财政部、税务总局公告 2026 年第 10 号《财政部 税务总局关于增值税法施行后增值税优惠政策衔接事项的公告》及其他相关境内外财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

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

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

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

(3) 对基金取得的企业债券利息收入，应由发行债券的企业在向基金支付利息时代扣代缴 20%

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

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

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

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

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

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

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 货币资金

单位：人民币元

项目	本期末 2026 年 6 月 30 日
活期存款	2,990,971.92
等于：本金	2,990,693.60
加：应计利息	278.32
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	2,990,971.92

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	27,715,870.13	-	28,176,454.07	460,583.94
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	27,715,870.13	-	28,176,454.07	460,583.94

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

单位：人民币元

项目	本期末 2026 年 6 月 30 日			
	合同/名义 金额	公允价值		备注
		资产	负债	
利率衍生工具	-	-	-	-
货币衍生工具	-	-	-	-
权益衍生工具	1,713,080.00	-	-	-
其中：股指期货 投资	1,713,080.00	-	-	-
其他衍生工具	-	-	-	-

合计	1,713,080.00	-	-	-
----	--------------	---	---	---

6.4.7.3.2 期末基金持有的期货合约情况

单位：人民币元

代码	名称	持仓量（买/卖）	合约市值	公允价值变动
IC2607	IC2607	1.00	1,785,640.00	72,560.00
合计				72,560.00
减：可抵销期货暂收款				72,560.00
净额				0.00

注：1、买入持仓量以正数表示，卖出持仓量以负数表示；

2、期货投资采用当日无负债结算制度，结算准备金已包括所持期货合约产生的持仓损益，因此衍生金融工具项下的期货投资与相关的期货暂收款（结算所得的持仓损益）之间按抵销后的净额为 0。

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	9.09
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	13,947.78
其中：交易所市场	13,947.78
银行间市场	-
应付利息	-
合计	13,956.87

6.4.7.10 实收基金

金额单位：人民币元

大成中证 500 指数增强 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	7,422,975.67	7,422,975.67
本期申购	17,926,590.83	17,926,590.83
本期赎回（以“-”号填列）	-14,997,772.32	-14,997,772.32
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	10,351,794.18	10,351,794.18

大成中证 500 指数增强 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	4,911,657.61	4,911,657.61
本期申购	14,384,923.45	14,384,923.45
本期赎回（以“-”号填列）	-11,441,647.52	-11,441,647.52

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	7,854,933.54	7,854,933.54

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 500 指数增强 A

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	4,421,398.84	-490,166.34	3,931,232.50
本期期初	4,421,398.84	-490,166.34	3,931,232.50
本期利润	1,381,209.27	432,162.27	1,813,371.54
本期基金份额交易产生的变动数	1,719,773.53	298,992.67	2,018,766.20
其中：基金申购款	11,964,828.57	-11,919.07	11,952,909.50
基金赎回款	-10,245,055.04	310,911.74	-9,934,143.30
本期已分配利润	-	-	-
本期末	7,522,381.64	240,988.60	7,763,370.24

大成中证 500 指数增强 C

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	2,880,931.47	-323,531.41	2,557,400.06
本期期初	2,880,931.47	-323,531.41	2,557,400.06
本期利润	957,547.62	-309,829.03	647,718.59
本期基金份额交易产生的变动数	1,766,345.43	812,626.87	2,578,972.30
其中：基金申购款	9,454,588.46	241,480.79	9,696,069.25
基金赎回款	-7,688,243.03	571,146.08	-7,117,096.95
本期已分配利润	-	-	-
本期末	5,604,824.52	179,266.43	5,784,090.95

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	5,263.43
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	1,768.37
其他	34.20

合计	7,066.00
----	----------

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	1,890,094.64
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	1,890,094.64

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	73,062,126.55
减：卖出股票成本总额	71,094,932.52
减：交易费用	77,099.39
买卖股票差价收入	1,890,094.64

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	0.59
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	5,851.81
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	5,852.40

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	12,052.88
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	6,200.00
减：应计利息总额	0.59
减：交易费用	0.48
买卖债券差价收入	5,851.81

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	360,265.61

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	232,304.45
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	232,304.45

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	131,053.24
股票投资	131,053.24
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	-8,720.00
权证投资	—
期货投资	-8,720.00
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	122,333.24

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	11,378.07
基金转换费收入	1,884.49

合计	13,262.56
----	-----------

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	—
信息披露费	—
证券出借违约金	—
银行划款手续费	1,715.00
合计	1,715.00

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

无。

6.4.10.1.2 债券交易

无。

6.4.10.1.3 债券回购交易

无。

6.4.10.1.4 基金交易

无。

6.4.10.1.5 权证交易

无。

6.4.10.1.6 应支付关联方的佣金

无。

6.4.10.2 关联方报酬**6.4.10.2.1 基金管理费**

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	125,577.43	98,441.11
其中：应支付销售机构的客户维护费	54,794.59	43,124.25
应支付基金管理人的净管理费	70,782.84	55,316.86

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：

$$\text{日管理费} = \text{前一日基金资产净值} \times \text{管理费年费率} / \text{当年天数}。$$
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	15,697.17	12,305.10

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：

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

	大成中证 500 指数增强 A	大成中证 500 指数增强 C	合计
大成基金	—	597.08	597.08
光大证券	—	2.89	2.89
中国农业银行	—	8,462.61	8,462.61
合计	—	9,062.58	9,062.58
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		
	大成中证 500 指数增强 A	大成中证 500 指数增强 C	合计
	—	135.57	135.57
大成基金	—	11,927.75	11,927.75
中国农业银行	—	12,063.32	12,063.32
合计	—		

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

无。

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	2,990,971.92	5,263.43	1,751,734.37	5,117.14

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	500	5,055.00	5,055.00	-

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农业银行股份有限公司，因而与银行存款相关的信用风险不重大。本

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

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

本期末，本基金无债券投资(上年度末：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	2,990,971.92	-	-	-	2,990,971.92
结算备付金	462,359.06	-	-	-	462,359.06
存出保证金	19,389.36	-	-	214,276.80	233,666.16
交易性金融资产	-	-	-	28,176,454.07	28,176,454.07
应收申购款	-	-	-	26,142.19	26,142.19
资产总计	3,472,720.34	-	-	28,416,873.06	31,889,593.40
负债					
应付赎回款	-	-	-	90,593.09	90,593.09
应付管理人报酬	-	-	-	19,324.06	19,324.06
应付托管费	-	-	-	2,415.50	2,415.50
应付销售服务费	-	-	-	3,866.84	3,866.84
应交税费	-	-	-	5,248.13	5,248.13
其他负债	-	-	-	13,956.87	13,956.87
负债总计	-	-	-	135,404.49	135,404.49
利率敏感度缺口	3,472,720.34	-	-	28,281,468.57	31,754,188.91
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	2,101,755.12	-	-	-	2,101,755.12

结算备付金	326,871.61	-	-	-	326,871.61
存出保证金	14,442.14	-	-	176,798.40	191,240.54
交易性金融资产	-	-	-	16,240,973.77	16,240,973.77
应收申购款	-	-	-	61,554.72	61,554.72
应收清算款	-	-	-	277,128.41	277,128.41
资产总计	2,443,068.87	-	-	16,756,455.30	19,199,524.17
负债	-	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	339,056.09	339,056.09
应付管理人报酬	-	-	-	14,728.52	14,728.52
应付托管费	-	-	-	1,841.06	1,841.06
应付销售服务费	-	-	-	2,945.67	2,945.67
应交税费	-	-	-	5,370.78	5,370.78
其他负债	-	-	-	12,316.21	12,316.21
负债总计	-	-	-	376,258.33	376,258.33
利率敏感度缺口	2,443,068.87	-	-	16,380,196.97	18,823,265.84

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	28,176,454.07	88.73	16,240,973.77	86.28
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	28,176,454.07	88.73	16,240,973.77	86.28

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%	1,440,191.05	846,499.70
	业绩比较基准下降 5%	-1,440,191.05	-846,499.70

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	28,171,399.07	16,240,973.77
第二层次	5,055.00	—
第三层次	—	—
合计	28,176,454.07	16,240,973.77

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	28,176,454.07	88.36
	其中：股票	28,176,454.07	88.36
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	3,453,330.98	10.83
8	其他各项资产	259,808.35	0.81
9	合计	31,889,593.40	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	—	—
B	采矿业	1,121,246.00	3.53
C	制造业	18,349,466.93	57.79
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	842,485.00	2.65
E	建筑业	290,510.00	0.91
F	批发和零售业	737,557.00	2.32
G	交通运输、仓储和邮政业	472,994.00	1.49
H	住宿和餐饮业	—	—
I	信息传输、软件和信息技术服务业	1,304,056.00	4.11
J	金融业	1,462,345.24	4.61
K	房地产业	—	—
L	租赁和商务服务业	39,479.00	0.12
M	科学研究和技术服务业	307,285.00	0.97
N	水利、环境和公共设施管理业	366,048.00	1.15
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	25,293,472.17	79.65

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	-	-
B	采矿业	130,488.00	0.41
C	制造业	2,472,679.90	7.79
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	5,055.00	0.02
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	20,800.00	0.07
G	交通运输、仓储和邮政业	39,875.00	0.13
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	83,747.00	0.26
J	金融业	21,303.00	0.07
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	49,462.00	0.16
M	科学研究和技术服务业	25,020.00	0.08
N	水利、环境和公共设施管理业	34,552.00	0.11
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	2,882,981.90	9.08

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	688347	华虹宏力	1,500	504,450.00	1.59
2	300604	长川科技	1,400	477,988.00	1.51
3	300857	协创数据	1,300	441,870.00	1.39
4	300136	信维通信	3,700	441,225.00	1.39
5	002436	兴森科技	7,200	366,840.00	1.16
6	600885	宏发股份	10,380	358,006.20	1.13
7	001389	广合科技	1,500	355,875.00	1.12
8	002409	雅克科技	1,500	336,750.00	1.06
9	300373	扬杰科技	2,100	330,183.00	1.04
10	688002	睿创微纳	2,100	324,849.00	1.02
11	601958	金钼股份	11,400	320,454.00	1.01
12	002138	顺络电子	4,300	314,330.00	0.99
13	688099	晶晨股份	3,000	308,700.00	0.97
14	002850	科达利	1,500	283,950.00	0.89
15	001309	德明利	300	282,870.00	0.89
16	301526	国际复材	6,000	280,020.00	0.88
17	002273	水晶光电	7,700	273,196.00	0.86
18	002064	华峰化学	28,400	269,516.00	0.85
19	002821	凯莱英	1,600	259,200.00	0.82
20	002152	广电运通	27,000	253,260.00	0.80
21	688387	信科移动	12,700	251,968.00	0.79
22	600497	驰宏锌锗	20,500	248,255.00	0.78
23	688385	复旦微电	3,400	242,386.00	0.76
24	601108	财通证券	27,900	241,335.00	0.76
25	688301	奕瑞科技	1,940	240,560.00	0.76
26	600157	永泰能源	147,700	237,797.00	0.75
27	002444	巨星科技	7,500	233,250.00	0.73
28	002203	海亮股份	10,100	230,785.00	0.73
29	002402	和而泰	8,800	227,304.00	0.72
30	002008	大族激光	1,500	225,165.00	0.71
31	600298	安琪酵母	6,200	224,440.00	0.71
32	301536	星辰科技	1,700	218,807.00	0.69
33	002078	太阳纸业	17,500	218,575.00	0.69
34	300012	华测检测	15,700	217,602.00	0.69
35	000060	中金岭南	27,900	211,203.00	0.67
36	002624	完美世界	17,000	211,140.00	0.66
37	002266	浙富控股	41,500	209,990.00	0.66
38	300699	光威复材	7,300	209,145.00	0.66

39	300054	鼎龙股份	1,900	201,343.00	0.63
40	300919	中伟新材	4,600	201,250.00	0.63
41	600637	东方明珠	24,100	200,271.00	0.63
42	300677	英科医疗	5,100	199,767.00	0.63
43	688475	萤石网络	7,300	199,655.00	0.63
44	000729	燕京啤酒	19,300	195,509.00	0.62
45	688568	中科星图	4,700	194,909.00	0.61
46	605358	立昂微	2,500	194,000.00	0.61
47	002603	以岭药业	12,900	193,500.00	0.61
48	002025	航天电器	2,500	190,550.00	0.60
49	688281	华秦科技	3,780	189,869.40	0.60
50	600363	联创光电	5,300	189,634.00	0.60
51	000683	博源化工	32,800	188,928.00	0.59
52	600282	南钢股份	41,100	188,649.00	0.59
53	601699	潞安环能	13,200	188,496.00	0.59
54	000987	越秀资本	24,100	188,462.00	0.59
55	601717	中创智领	13,300	185,003.00	0.58
56	003022	联泓新科	7,100	183,890.00	0.58
57	688322	奥比中光	1,400	182,770.00	0.58
58	600704	物产中大	38,700	182,664.00	0.58
59	601880	辽港股份	131,600	181,608.00	0.57
60	000783	长江证券	18,600	181,350.00	0.57
61	601608	中信重工	38,000	181,260.00	0.57
62	000709	河钢股份	93,200	180,808.00	0.57
63	600517	国网英大	38,600	180,648.00	0.57
64	000932	华菱钢铁	51,200	177,664.00	0.56
65	601000	唐山港	42,700	177,205.00	0.56
66	601997	贵阳银行	34,200	175,446.00	0.55
67	600884	杉杉股份	12,800	173,440.00	0.55
68	000893	亚钾国际	4,200	171,738.00	0.54
69	600583	海油工程	33,800	170,014.00	0.54
70	688772	珠海冠宇	8,600	168,818.00	0.53
71	001286	陕西能源	16,400	166,296.00	0.52
72	301377	鼎泰高科	300	165,270.00	0.52
73	600998	九州通	34,600	162,274.00	0.51
74	000951	中国重汽	8,300	161,933.00	0.51
75	601001	晋控煤业	9,300	161,727.00	0.51
76	600008	首创环保	59,000	160,480.00	0.51
77	600098	广州发展	26,500	156,615.00	0.49
78	300140	节能环保	31,400	156,058.00	0.49
79	600909	华安证券	13,800	153,318.00	0.48
80	300620	光库科技	400	151,280.00	0.48
81	300475	香农芯创	500	150,000.00	0.47

82	300454	深信服	1,500	144,300.00	0.45
83	603345	安井食品	1,700	136,323.00	0.43
84	601216	君正集团	30,400	135,584.00	0.43
85	000878	云南铜业	8,500	134,980.00	0.43
86	601128	常熟银行	22,982	133,755.24	0.42
87	002851	麦格米特	800	133,744.00	0.42
88	002281	光迅科技	500	128,470.00	0.40
89	600970	中材国际	17,300	123,349.00	0.39
90	600312	平高电气	6,800	120,088.00	0.38
91	300496	中科创达	1,900	117,401.00	0.37
92	600166	福田汽车	39,900	116,109.00	0.37
93	000039	中集集团	14,100	114,351.00	0.36
94	603233	大参林	7,500	112,725.00	0.35
95	002738	中矿资源	1,900	112,081.00	0.35
96	300548	长芯博创	400	111,200.00	0.35
97	601869	长飞光纤	200	109,180.00	0.34
98	301200	大族数控	300	108,195.00	0.34
99	603298	杭叉集团	4,500	107,370.00	0.34
100	603256	宏和科技	400	106,132.00	0.33
101	688728	格科微	5,000	105,200.00	0.33
102	600562	国睿科技	4,900	103,978.00	0.33
103	300223	北京君正	400	99,560.00	0.31
104	601233	桐昆股份	4,500	97,425.00	0.31
105	600988	赤峰黄金	3,700	97,384.00	0.31
106	603816	顾家家居	4,300	96,148.00	0.30
107	300115	长盈精密	3,400	94,996.00	0.30
108	688629	华丰科技	500	93,755.00	0.30
109	603606	东方电缆	2,200	91,322.00	0.29
110	003031	中瓷电子	500	90,150.00	0.28
111	300759	康龙化成	3,100	89,683.00	0.28
112	600595	中孚实业	15,900	89,358.00	0.28
113	002487	大金重工	1,500	86,955.00	0.27
114	000703	恒逸石化	6,300	85,491.00	0.27
115	301606	绿联科技	1,400	85,428.00	0.27
116	688017	绿的谐波	200	83,572.00	0.26
117	600021	上海电力	5,500	82,885.00	0.26
118	600927	永安期货	6,500	80,925.00	0.25
119	000062	深圳华强	2,500	79,550.00	0.25
120	603565	中谷物流	8,100	79,461.00	0.25
121	300002	神州泰岳	10,100	78,881.00	0.25
122	600801	华新建材	5,000	78,000.00	0.25
123	600606	绿地控股	64,000	77,440.00	0.24
124	600563	法拉电子	400	76,320.00	0.24

125	603766	隆鑫通用	6,300	75,159.00	0.24
126	300003	乐普医疗	6,300	74,655.00	0.24
127	300666	江丰电子	200	73,720.00	0.23
128	601615	明阳智能	6,100	70,577.00	0.22
129	002414	高德红外	5,200	68,952.00	0.22
130	600170	上海建工	30,300	67,266.00	0.21
131	002056	横店东磁	2,200	67,056.00	0.21
132	688778	厦钨新能	1,200	65,280.00	0.21
133	600339	中油工程	21,000	64,470.00	0.20
134	688120	华海清科	200	64,436.00	0.20
135	300757	罗博特科	100	61,900.00	0.19
136	000739	普洛药业	3,600	59,976.00	0.19
137	300487	蓝晓科技	1,000	58,850.00	0.19
138	000528	柳 工	7,700	58,135.00	0.18
139	603699	纽威股份	1,100	55,330.00	0.17
140	603939	益丰药房	2,800	50,344.00	0.16
141	603308	应流股份	800	48,320.00	0.15
142	600808	马钢股份	18,700	46,750.00	0.15
143	601555	东吴证券	5,700	45,144.00	0.14
144	002126	银轮股份	900	44,820.00	0.14
145	603659	璞泰来	1,500	43,395.00	0.14
146	000960	锡业股份	1,000	42,690.00	0.13
147	002683	广东宏大	1,400	41,006.00	0.13
148	688563	航材股份	800	40,984.00	0.13
149	002340	格林美	6,200	40,982.00	0.13
150	000629	钒钛股份	12,000	40,080.00	0.13
151	000415	渤海租赁	9,700	39,479.00	0.12
152	002500	山西证券	7,600	39,216.00	0.12
153	600642	申能股份	4,400	38,412.00	0.12
154	688313	仕佳光子	200	36,930.00	0.12
155	600968	海油发展	11,000	36,630.00	0.12
156	000959	首钢股份	10,100	35,451.00	0.11
157	601598	中国外运	7,000	34,720.00	0.11
158	600141	兴发集团	700	32,879.00	0.10
159	688582	芯动联科	500	32,500.00	0.10
160	688469	芯联集成	3,053	32,392.33	0.10
161	600390	五矿资本	6,600	30,096.00	0.09
162	002756	永兴材料	500	28,320.00	0.09
163	300724	捷佳伟创	400	28,240.00	0.09
164	300953	震裕科技	200	26,740.00	0.08
165	002265	建设工业	1,500	26,100.00	0.08
166	002065	东华软件	3,600	25,704.00	0.08
167	000967	盈峰环境	2,400	25,272.00	0.08

168	002517	恺英网络	1,400	22,750.00	0.07
169	688425	铁建重工	5,600	22,512.00	0.07
170	000032	深桑达 A	900	22,455.00	0.07
171	600711	盛屯矿业	2,000	21,940.00	0.07
172	300735	光弘科技	900	20,466.00	0.06
173	000830	鲁西化工	1,700	20,400.00	0.06
174	600348	华阳股份	2,500	19,125.00	0.06
175	603338	浙江鼎力	400	17,000.00	0.05
176	002429	兆驰股份	1,500	15,585.00	0.05
177	301358	湖南裕能	200	15,174.00	0.05
178	603920	世运电路	300	14,412.00	0.05
179	600901	江苏金租	2,200	12,650.00	0.04
180	300627	华测导航	440	12,496.00	0.04
181	600685	中船防务	400	10,176.00	0.03
182	688708	佳驰科技	200	10,160.00	0.03

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	600487	亨通光电	1,200	131,208.00	0.41
2	300005	探路者	3,500	79,100.00	0.25
3	600522	中天科技	1,200	72,816.00	0.23
4	301308	江波龙	100	70,380.00	0.22
5	605020	永和股份	1,600	65,152.00	0.21
6	300502	新易盛	100	60,700.00	0.19
7	688678	福立旺	2,500	60,425.00	0.19
8	688011	新光光电	800	55,896.00	0.18
9	300745	欣锐科技	1,300	54,886.00	0.17
10	688609	九联科技	4,900	53,949.00	0.17
11	688531	日联科技	300	53,352.00	0.17
12	001339	智微智能	520	53,185.60	0.17
13	002595	豪迈科技	1,140	53,124.00	0.17
14	000933	神火股份	2,500	53,000.00	0.17
15	601918	新集能源	6,000	51,540.00	0.16
16	688218	江苏北人	900	49,464.00	0.16
17	301169	零点有数	700	49,462.00	0.16
18	002532	天山铝业	4,600	49,358.00	0.16
19	301039	中集车辆	7,000	49,350.00	0.16
20	001359	平安电工	390	48,847.50	0.15
21	301321	翰博高新	1,100	48,565.00	0.15
22	688388	嘉元科技	1,100	48,400.00	0.15
23	002653	海思科	700	46,438.00	0.15
24	002876	三利谱	1,300	45,773.00	0.14

25	002353	杰瑞股份	300	45,750.00	0.14
26	688653	康希通信	2,600	45,188.00	0.14
27	603186	华正新材	200	45,060.00	0.14
28	300590	移为通信	3,100	44,485.00	0.14
29	688398	赛特新材	1,700	44,047.00	0.14
30	000426	兴业银锡	1,300	42,848.00	0.13
31	002484	江海股份	400	42,000.00	0.13
32	301086	鸿富瀚	200	41,856.00	0.13
33	301371	敷尔佳	1,600	41,600.00	0.13
34	688215	瑞晟智能	1,015	40,762.40	0.13
35	688117	圣诺生物	1,500	40,545.00	0.13
36	300740	水羊股份	2,200	40,502.00	0.13
37	300943	春晖智控	900	40,455.00	0.13
38	688221	前沿生物	1,800	40,320.00	0.13
39	601333	广深铁路	14,500	39,875.00	0.13
40	688127	蓝特光学	400	39,040.00	0.12
41	300129	泰胜风能	4,500	38,475.00	0.12
42	688231	隆达股份	1,040	38,199.20	0.12
43	300871	回盛生物	1,700	37,502.00	0.12
44	300450	先导智能	900	36,648.00	0.12
45	600489	中金黄金	2,000	36,100.00	0.11
46	603992	松霖科技	1,100	35,640.00	0.11
47	301002	崧盛股份	900	34,740.00	0.11
48	300388	节能国祯	5,600	34,552.00	0.11
49	301292	海科新源	400	31,892.00	0.10
50	001314	亿道信息	500	30,900.00	0.10
51	000938	紫光股份	1,000	28,860.00	0.09
52	300848	美瑞新材	2,000	27,900.00	0.09
53	688107	安路科技	600	27,360.00	0.09
54	688315	诺禾致源	2,000	25,020.00	0.08
55	000338	潍柴动力	900	24,525.00	0.08
56	002206	海利得	4,600	23,782.00	0.07
57	603507	振江股份	700	23,023.00	0.07
58	300681	英搏尔	800	22,896.00	0.07
59	688365	光云科技	1,400	22,078.00	0.07
60	688448	磁谷科技	345	21,928.20	0.07
61	002953	日丰股份	2,500	21,800.00	0.07
62	002202	金风科技	900	21,510.00	0.07
63	601916	浙商银行	8,100	21,303.00	0.07
64	605056	咸亨国际	1,300	20,800.00	0.07
65	300691	联合光电	1,200	18,972.00	0.06
66	301382	蜂助手	400	18,400.00	0.06
67	301085	亚康股份	300	18,183.00	0.06

68	002028	思源电气	100	17,300.00	0.05
69	300852	四会富仕	200	13,848.00	0.04
70	600406	国电南瑞	600	13,710.00	0.04
71	603918	金桥信息	1,200	11,376.00	0.04
72	001248	华润新能源	500	5,055.00	0.02

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	300450	先导智能	786,463.00	4.18
2	002558	巨人网络	785,015.00	4.17
3	300136	信维通信	784,195.00	4.17
4	688099	晶晨股份	776,414.55	4.12
5	601168	西部矿业	655,416.00	3.48
6	601958	金钼股份	636,952.00	3.38
7	001389	广合科技	615,437.00	3.27
8	002156	通富微电	612,616.00	3.25
9	000426	兴业银锡	602,377.00	3.20
10	002402	和而泰	586,634.00	3.12
11	002624	完美世界	581,925.00	3.09
12	002821	凯莱英	580,274.00	3.08
13	000932	华菱钢铁	567,285.00	3.01
14	002532	天山铝业	520,846.00	2.77
15	688347	华虹宏力	515,067.80	2.74
16	002340	格林美	509,509.00	2.71
17	603920	世运电路	508,818.00	2.70
18	301536	星宸科技	508,319.00	2.70
19	300012	华测检测	500,116.00	2.66
20	002603	以岭药业	498,013.00	2.65
21	600487	亨通光电	496,442.00	2.64
22	002281	光迅科技	495,654.00	2.63
23	300454	深信服	494,917.00	2.63
24	300223	北京君正	494,409.00	2.63
25	002130	沃尔核材	492,336.00	2.62
26	603659	璞泰来	489,506.00	2.60
27	600141	兴发集团	486,829.00	2.59
28	600885	宏发股份	476,734.00	2.53
29	002414	高德红外	476,286.00	2.53
30	000729	燕京啤酒	474,018.00	2.52
31	300373	扬杰科技	470,573.00	2.50
32	002436	兴森科技	468,100.00	2.49
33	300857	协创数据	465,276.00	2.47

34	000967	盈峰环境	461,179.00	2.45
35	002738	中矿资源	456,383.00	2.42
36	601717	中创智领	452,173.00	2.40
37	603298	杭叉集团	444,577.00	2.36
38	600884	杉杉股份	443,422.00	2.36
39	000951	中国重汽	441,327.00	2.34
40	601233	桐昆股份	437,277.00	2.32
41	300003	乐普医疗	435,223.00	2.31
42	600549	厦门钨业	434,927.00	2.31
43	603444	吉比特	431,127.00	2.29
44	300604	长川科技	428,140.00	2.27
45	002850	科达利	425,660.00	2.26
46	000960	锡业股份	419,327.00	2.23
47	300748	金力永磁	415,471.00	2.21
48	600909	华安证券	411,872.00	2.19
49	300735	光弘科技	410,305.00	2.18
50	002273	水晶光电	407,357.00	2.16
51	605358	立昂微	401,389.00	2.13
52	688213	思特威	400,243.00	2.13
53	000528	柳 工	399,559.00	2.12
54	600739	辽宁成大	397,658.00	2.11
55	002152	广电运通	396,125.00	2.10
56	600166	福田汽车	395,974.00	2.10
57	002409	雅克科技	394,217.00	2.09
58	688778	厦钨新能	389,863.93	2.07
59	003022	联泓新科	387,884.00	2.06
60	002138	顺络电子	383,795.00	2.04
61	600970	中材国际	381,414.00	2.03

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	600487	亨通光电	843,479.00	4.48
2	601168	西部矿业	751,070.00	3.99
3	002156	通富微电	733,549.00	3.90
4	600549	厦门钨业	686,365.00	3.65
5	300450	先导智能	676,731.00	3.60
6	603920	世运电路	647,320.00	3.44
7	000967	盈峰环境	637,107.00	3.38
8	002558	巨人网络	610,633.00	3.24
9	601991	大唐发电	606,285.00	3.22
10	601958	金钼股份	576,008.00	3.06

11	002821	凯莱英	558,294.00	2.97
12	688213	思特威	543,632.85	2.89
13	300373	扬杰科技	543,453.00	2.89
14	000426	兴业银锡	534,714.00	2.84
15	300735	光弘科技	529,356.00	2.81
16	688166	博瑞医药	521,521.17	2.77
17	002281	光迅科技	517,114.00	2.75
18	601233	桐昆股份	515,712.00	2.74
19	002340	格林美	515,111.00	2.74
20	605589	圣泉集团	503,866.00	2.68
21	002624	完美世界	502,505.00	2.67
22	001389	广合科技	501,441.90	2.66
23	301536	星宸科技	496,730.00	2.64
24	002414	高德红外	494,371.78	2.63
25	603659	璞泰来	493,592.00	2.62
26	600739	辽宁成大	490,528.00	2.61
27	300454	深信服	476,956.00	2.53
28	002056	横店东磁	476,359.00	2.53
29	600141	兴发集团	476,270.00	2.53
30	300003	乐普医疗	463,927.00	2.46
31	300073	当升科技	463,525.00	2.46
32	002410	广联达	456,438.00	2.42
33	002138	顺络电子	456,034.00	2.42
34	002130	沃尔核材	453,885.00	2.41
35	300748	金力永磁	451,757.00	2.40
36	002402	和而泰	444,048.00	2.36
37	600166	福田汽车	442,721.12	2.35
38	600909	华安证券	434,388.00	2.31
39	603129	春风动力	430,817.00	2.29
40	688099	晶晨股份	426,558.15	2.27
41	000960	锡业股份	426,380.00	2.27
42	601918	新集能源	418,166.00	2.22
43	600873	梅花生物	415,080.00	2.21
44	002273	水晶光电	413,760.00	2.20
45	002436	兴森科技	412,307.00	2.19
46	300223	北京君正	411,968.00	2.19
47	603979	金诚信	400,381.00	2.13
48	300136	信维通信	398,447.00	2.12
49	688248	南网科技	389,549.52	2.07
50	000415	渤海租赁	388,574.00	2.06
51	600208	衢州发展	387,595.00	2.06
52	002155	湖南黄金	384,130.00	2.04
53	603379	三美股份	380,961.00	2.02

54	603444	吉比特	380,588.00	2.02
----	--------	-----	------------	------

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	82,899,359.58
卖出股票收入（成交）总额	73,062,126.55

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。本季度股指期货的投资符合既定的投资政策和投资目标。

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	233,666.16
2	应收清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	26,142.19
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	259,808.35

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 500 指数增强 A	549	18,855.73	0.00	0.00	10,351,794.18	100.00

大成中证 500 指数增强 C	450	17,455.41	0.00	0.00	7,854,933.54	100.00
合计	999	18,224.95	0.00	0.00	18,206,727.72	100.00

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 500 指数增强 A	32,861.31	0.3174
	大成中证 500 指数增强 C	—	—
	合计	32,861.31	0.1805

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 500 指数增强 A	0
	大成中证 500 指数增强 C	0
	合计	0
本基金基金经理持有本开放式基金	大成中证 500 指数增强 A	0~10
	大成中证 500 指数增强 C	0
	合计	0~10

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	大成中证 500 指数增强 A	大成中证 500 指数增强 C
基金合同生效日 （2024 年 7 月 19 日）基金份额总额	200,804,534.58	237,859,573.02
本报告期期初基金份额总额	7,422,975.67	4,911,657.61

本报告期基金总申购份额	17,926,590.83	14,384,923.45
减：本报告期基金总赎回份额	14,997,772.32	11,441,647.52
本报告期基金拆分变动份额	—	—
本报告期期末基金份额总额	10,351,794.18	7,854,933.54

§ 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，改聘容诚会计师事务所（特殊普通合伙）为本基金提供审计服务至今。

10.6 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况

10.6.1 管理人受调查或处罚等情况

本报告期内，基金管理人无受调查或处罚等情况。

10.6.2 管理人相关从业人员受调查或处罚等情况

本报告期内，基金管理人相关从业人员无受调查或处罚等情况。

10.6.3 托管人受调查或处罚等情况

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 (%)	
国信证券	1	60,557,078.17	38.83	11,869.40	38.83	-
国泰海通	3	45,654,954.58	29.28	8,948.69	29.28	-
广发证券	2	18,333,629.48	11.76	3,593.40	11.76	-
招商证券	2	17,205,156.00	11.03	3,372.23	11.03	-
中信建投证券	2	14,200,552.90	9.11	2,783.33	9.11	-
爱建证券	1	-	-	-	-	-
财通证券	1	-	-	-	-	-
长江证券	1	-	-	-	-	新增 1 个
第一创业	1	-	-	-	-	-
东北证券	1	-	-	-	-	-
东财证券	1	-	-	-	-	-
东方证券	1	-	-	-	-	-
东吴证券	1	-	-	-	-	-
东兴证券	1	-	-	-	-	-
方正证券	1	-	-	-	-	-
高盛中国	1	-	-	-	-	-
光大证券	2	-	-	-	-	-
国金证券	2	-	-	-	-	-
国盛证券	1	-	-	-	-	-
国投证券	1	-	-	-	-	-
红塔证券	1	-	-	-	-	-
华创证券	1	-	-	-	-	-
华泰证券	1	-	-	-	-	-
民生证券	1	-	-	-	-	-

南京证券	1	-	-	-	-	-
平安证券	1	-	-	-	-	-
瑞银证券	2	-	-	-	-	-
山西证券	1	-	-	-	-	-
上海证券	1	-	-	-	-	-
申万宏源	1	-	-	-	-	-
天风证券	1	-	-	-	-	-
万和证券	0	-	-	-	-	退租 1 个
西部证券	1	-	-	-	-	-
湘财证券	1	-	-	-	-	-
信达证券	0	-	-	-	-	退租 1 个
兴业证券	2	-	-	-	-	-
野村东方 国际证券	1	-	-	-	-	-
粤开证券	1	-	-	-	-	-
浙商证券	1	-	-	-	-	-
中国银河 证券	3	-	-	-	-	-
中金公司	2	-	-	-	-	-
中泰证券	2	-	-	-	-	-
中信证券	4	-	-	-	-	-
中银国际 证券	1	-	-	-	-	-

注：本基金采用托管人结算模式，本基金管理人负责选择证券经纪商，租用其交易单元作为本基金的交易单元。证券经纪商的选择标准和流程如下：

（一）筛选标准

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

（二）筛选流程

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

2、公司按照白名单与证券公司进行协议签署。

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 (%)
国泰海通	6,804.56	56.46	-	-	-	-	-	-
中信建投证券	5,248.32	43.54	-	-	-	-	-	-

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 500 指数增强型证券投资基金 (A 类份额) 基金产品资料概要更新	中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站	2026 年 06 月 30 日
2	大成中证 500 指数增强型证券投资基金 (C 类份额) 基金产品资料概要更新	中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站	2026 年 06 月 30 日
3	2025 年度公募基金管理人以股东身份 (通过公募基金持股) 参与股东大会投票信息披露	中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站	2026 年 04 月 30 日
4	大成中证 500 指数增强型证券投资基金 2026 年第 1 季度报告	中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站	2026 年 04 月 22 日
5	大成基金管理有限公司旗下 212 只公募基金 2026 年第 1 季度报告提示性公告	规定报刊	2026 年 04 月 22 日
6	大成基金管理有限公司旗下 205 只公募基金 2025 年年度报告提示性公告	规定报刊	2026 年 03 月 31 日
7	大成中证 500 指数增强型证券投资基金 2025 年年度报告	中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站	2026 年 03 月 31 日
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

		公司网站	
10	大成中证 500 指数增强型证券投资基金 2025 年第 4 季度报告	中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站	2026 年 01 月 22 日
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中证 500 指数增强型证券投资基金的文件；
- 2、《大成中证 500 指数增强型证券投资基金基金合同》；
- 3、《大成中证 500 指数增强型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