

# 大成多元配置三个月持有期混合型基金中 基金（ETF-FOF） 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：恒丰银行股份有限公司

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。

基金托管人恒丰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

|                                         |           |
|-----------------------------------------|-----------|
| <b>§ 1 重要提示及目录</b>                      | <b>2</b>  |
| 1.1 重要提示                                | 2         |
| 1.2 目录                                  | 3         |
| <b>§ 2 基金简介</b>                         | <b>5</b>  |
| 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         |
| <b>§ 3 主要财务指标和基金净值表现</b>                | <b>7</b>  |
| 3.1 主要会计数据和财务指标                         | 7         |
| 3.2 基金净值表现                              | 8         |
| <b>§ 4 管理人报告</b>                        | <b>9</b>  |
| 4.1 基金管理人及基金经理情况                        | 9         |
| 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明              | 11        |
| 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明                 | 11        |
| 4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明             | 12        |
| 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望             | 13        |
| 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明                | 14        |
| 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明                 | 15        |
| 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       | 15        |
| <b>§ 5 托管人报告</b>                        | <b>15</b> |
| 5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明                  | 15        |
| 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        |
| <b>§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）</b>              | <b>15</b> |
| 6.1 资产负债表                               | 15        |
| 6.2 利润表                                 | 16        |
| 6.3 净资产变动表                              | 18        |
| 6.4 报表附注                                | 19        |
| <b>§ 7 投资组合报告</b>                       | <b>40</b> |
| 7.1 期末基金资产组合情况                          | 40        |
| 7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合                    | 40        |
| 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                     | 40        |
| 7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合                    | 40        |
| 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      | 41        |
| 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   | 41        |
| 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   | 41        |

|                                          |           |
|------------------------------------------|-----------|
| 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 ..... | 41        |
| 7.10 本基金投资股指期货的投资政策 .....                | 41        |
| 7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 .....          | 41        |
| 7.12 本报告期投资基金情况 .....                    | 41        |
| 7.13 投资组合报告附注 .....                      | 45        |
| <b>§ 8 基金份额持有人信息 .....</b>               | <b>46</b> |
| 8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....              | 46        |
| 8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....           | 46        |
| 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 .....   | 47        |
| <b>§ 9 开放式基金份额变动 .....</b>               | <b>47</b> |
| <b>§ 10 重大事件揭示 .....</b>                 | <b>48</b> |
| 10.1 基金份额持有人大会决议 .....                   | 48        |
| 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 .....   | 48        |
| 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....        | 48        |
| 10.4 基金投资策略的改变 .....                     | 48        |
| 10.5 本报告期持有的基金发生的重大影响事件 .....            | 48        |
| 10.6 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....              | 48        |
| 10.7 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况 .....       | 48        |
| 10.8 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 .....   | 49        |
| 10.9 其他重大事件 .....                        | 50        |
| <b>§ 11 影响投资者决策的其他重要信息 .....</b>         | <b>50</b> |
| 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 ..... | 50        |
| 11.2 影响投资者决策的其他重要信息 .....                | 51        |
| <b>§ 12 备查文件目录 .....</b>                 | <b>51</b> |
| 12.1 备查文件目录 .....                        | 51        |
| 12.2 存放地点 .....                          | 51        |
| 12.3 查阅方式 .....                          | 51        |

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

|                     |                               |                             |
|---------------------|-------------------------------|-----------------------------|
| 基金名称                | 大成多元配置三个月持有期混合型基金中基金（ETF-FOF） |                             |
| 基金简称                | 大成多元配置三个月持有混合（ETF-FOF）        |                             |
| 基金主代码               | 025521                        |                             |
| 基金运作方式              | 契约型开放式                        |                             |
| 基金合同生效日             | 2025 年 10 月 28 日              |                             |
| 基金管理人               | 大成基金管理有限公司                    |                             |
| 基金托管人               | 恒丰银行股份有限公司                    |                             |
| 报告期末基金份<br>额总额      | 58,180,029.96 份               |                             |
| 基金合同存续期             | 不定期                           |                             |
| 下属分级基金的基<br>金简称     | 大成多元配置三个月持有混合（ETF-<br>FOF）A   | 大成多元配置三个月持有混合（ETF-<br>FOF）C |
| 下属分级基金的交<br>易代码     | 025521                        | 025522                      |
| 报告期末下属分级<br>基金的份额总额 | 16,988,421.26 份               | 41,191,608.70 份             |

2.2 基金产品说明

|      |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                     |
|------|-------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
| 投资目标 | 本基金以积极的投资风格进行长期资产配置，通过构建与收益风险水平相匹配的基金组合，在严格控制投资风险并保持良好流动性的前提下，追求基金资产的长期增值。                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                          |
| 投资策略 | <p>（一）资产配置策略</p> <p>1、大类资产配置策略</p> <p>本基金属于混合型基金中基金，将根据基金合同约定的各类资产的目标配置比重进行资产配置。同时，基金经理将根据市场实际表现及预期判断，在基金合同约定的范围内对各大类资产配置比例进行动态调整。</p> <p>2、区域资产配置策略</p> <p>本基金将投资的资产分为境内资产和境外资产两类。基金管理人根据全球经济以及区域化经济发展进程，及不同国家或地区经济体的宏观经济状况、利率与汇率走势、各证券市场的发展变化、全球范围的资本流动情况等，并结合基金管理人对国家或地区的相对估值水平判断与金融市场风险预期，确定两类市场具体的资产配置比例。</p> <p>3、权益类基金资产配置策略</p> <p>本基金原则上以境外市场、境内市场上的权益类资产为主要投资方向。通过大类资产配置策略最终决定权益类基金在本基金组合中的占比。</p> <p>（二）基金投资策略</p> <p>1、ETF 投资策略</p> <p>本基金通过定量分析和定性分析相结合的方式，一方面通过严格</p> |

|        |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                     |
|--------|-------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
|        | <p>的量化指标（包括日最大跟踪偏离度、累计跟踪偏离度、日均跟踪偏离度、跟踪误差、基金规模、日均成交额、开放申赎情况等）筛选出跟踪误差低、流动性较好的标的纳入投资范围，另一方面结合所选基金的基金管理人的 ETF 管理经验和风险监控能力进行二次研判，双重维度筛选出优质的 ETF 标的。</p> <p>2、其他基金投资策略</p> <p>基金管理人对于不同类型的基金和基金经理通过合理的多维度指标进行评估和验证。</p> <p>在主动管理的权益基金选择上，基金管理人重点考察基金经理的投资风格和投资能力，包括但不限于历史收益率、历史波动率、最大回撤、换手率、持股集中度等，以及在不同市场环境下的适应性和稳定性。基金管理人将选择业绩相对优异、稳定，风险控制合理，与当前市场环境和投资目标相匹配的权益基金进行投资。</p> <p>在被动权益基金选择上，基金管理人除需重点分析跟踪标的指数外，还需重点考察基金规模、基金流动性、费率结构、跟踪误差等。指数基金具有高透明度、风格明确、费率较低、交易灵活等多重优势，适合进行战术资产配置。</p> <p>（三）股票投资策略</p> <p>本基金通过定量和定性相结合的方法精选个股，主要考察上市公司治理结构、核心竞争优势、市占率、成长性、盈利能力、现金流情况以及公司基本面变化等，综合评估上市公司的投资价值，优选具有较高投资价值的上市公司构建股票组合。</p> <p>（四）债券投资策略</p> <p>首先，根据宏观经济分析、资金面动向分析和投资人行为分析判断未来利率期限结构变化，并充分考虑组合的流动性管理的实际情况，配置债券组合的久期和债券组合结构；其次，结合信用分析、流动性分析、税收分析等综合影响确定债券组合的类属配置；再次，在上述基础上利用债券定价技术，进行个券选择，选择被低估的债券进行投资。在具体投资操作中，我们采用骑乘操作、放大操作、换券操作等灵活多样的操作方式，力求获取超额的投资收益。</p> <p>（五）资产支持证券投资策略</p> <p>本基金将通过对宏观经济、提前偿还率、资产池结构以及资产池资产所在行业景气变化等因素的研究，预测资产池未来现金流变化，并通过研究标的证券发行条款，预测提前偿还率变化对标的证券的久期与收益率的影响。在严格控制风险的情况下，结合信用研究和流动性管理，选择风险调整后收益高的品种进行投资，以期获得长期稳定收益。</p> <p>（六）存托凭证投资策略</p> <p>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。</p> |
| 业绩比较基准 | <p>中证 A500 指数收益率*55%+恒生指数收益率（使用估值汇率调整）*20%+上海黄金交易所 Au99.99 现货实盘合约收盘价收益率</p>                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                         |

|        |                                                                                                                                   |
|--------|-----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
|        | *10%+中债新综合全价(总值)指数收益率*15%                                                                                                         |
| 风险收益特征 | 本基金是混合型基金中基金，预期风险和预期收益高于债券型基金、货币市场基金、债券型基金中基金、货币型基金中基金，但低于股票型基金、股票型基金中基金。本基金若投资港股通标的股票，则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。 |

## 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                          | 恒丰银行股份有限公司            |
| 信息披露负责人 | 姓名                                  | 段皓静                   |
|         | 联系电话                                | 0755-83183388         |
|         | 电子邮箱                                | office@dcfund.com.cn  |
| 客户服务电话  | 4008885558                          | 95395                 |
| 传真      | 0755-83199588                       | 021-63890708          |
| 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 | 济南市历下区泺源大街8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 | 上海市黄浦区开平路88号瀛通绿地大厦16楼 |
| 邮政编码    | 518054                              | 200023                |
| 法定代表人   | 吴庆斌                                 | 辛树人                   |

## 2.4 信息披露方式

|                   |                   |
|-------------------|-------------------|
| 本基金选定的信息披露报纸名称    | 《证券日报》            |
| 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) |                         |
|---------------|-----------------------------|-------------------------|
|               | 大成多元配置三个月持有混合（ETF-FOF）A     | 大成多元配置三个月持有混合（ETF-FOF）C |
| 本期已实现收益       | 1,873,996.40                | 3,851,026.79            |
| 本期利润          | 2,609,411.10                | 5,611,385.79            |
| 加权平均基金份额本期利润  | 0.0783                      | 0.0699                  |

|               |                       |               |
|---------------|-----------------------|---------------|
| 本期加权平均净值利润率   | 7.75%                 | 6.94%         |
| 本期基金份额净值增长率   | 3.71%                 | 3.50%         |
| 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      | 195,368.97            | 361,687.27    |
| 期末可供分配基金份额利润  | 0.0115                | 0.0088        |
| 期末基金资产净值      | 17,486,444.86         | 42,284,333.82 |
| 期末基金份额净值      | 1.0293                | 1.0265        |
| 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   | 2.93%                 | 2.65%         |

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

大成多元配置三个月持有混合（ETF-FOF）A

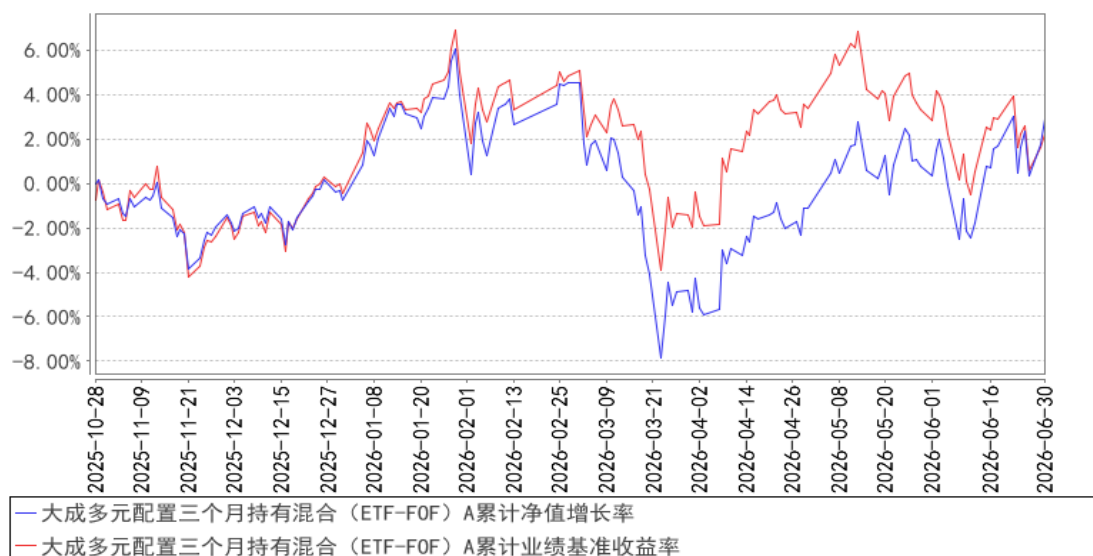
| 阶段         | 份额净值增长率① | 份额净值增长率标准差② | 业绩比较基准收益率③ | 业绩比较基准收益率标准差④ | ①—③   | ②—④   |
|------------|----------|-------------|------------|---------------|-------|-------|
| 过去三个月      | 9.29%    | 1.13%       | 4.28%      | 1.00%         | 5.01% | 0.13% |
| 过去六个月      | 3.71%    | 1.19%       | 2.70%      | 1.04%         | 1.01% | 0.15% |
| 自基金合同生效起至今 | 2.93%    | 1.05%       | 2.22%      | 0.96%         | 0.71% | 0.09% |

大成多元配置三个月持有混合（ETF-FOF）C

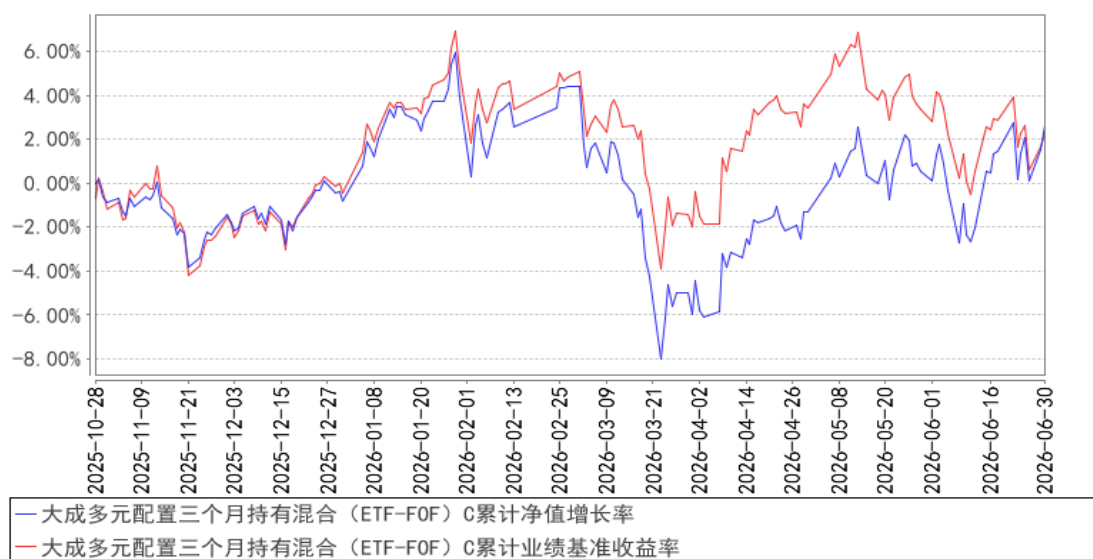
| 阶段         | 份额净值增长率① | 份额净值增长率标准差② | 业绩比较基准收益率③ | 业绩比较基准收益率标准差④ | ①—③   | ②—④   |
|------------|----------|-------------|------------|---------------|-------|-------|
| 过去三个月      | 9.18%    | 1.13%       | 4.28%      | 1.00%         | 4.90% | 0.13% |
| 过去六个月      | 3.50%    | 1.19%       | 2.70%      | 1.04%         | 0.80% | 0.15% |
| 自基金合同生效起至今 | 2.65%    | 1.05%       | 2.22%      | 0.96%         | 0.43% | 0.09% |

### 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

大成多元配置三个月持有混合（ETF-FOF）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



大成多元配置三个月持有混合（ETF-FOF）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 10 月 28 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 |        |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                            |
| 陈丞  | 本基金基金经理助理 | 2025 年 10 月 28 日 | -    | 9 年    | 香港中文大学理学硕士。2017 年 11 月加入大成基金管理有限公司，曾担任大类资产配置部投资经理，现任大类资产配置部基金经理助理。2024 年 7 月 8 日起任大成养老目标日期 2040 三年持有期混合型基金中基金（FOF）、大成颐禧积极养老目标五年持有期混合型发起式基金中基金（FOF）基金经理助理。2024 年 7 月 8 日至 2025 年 8 月 22 日任大成丰华稳健六个月持有期混合型发起式基金中基金（FOF）基金经理助理。2024 年 7 月 8 日至 2025 年 9 月 26 日任大成颐享稳健养老目标一年持有期混合型发起式基金中基金（FOF）基金经理助理。2025 年 6 月 27 日起任大成睿浦智选三个月持有期混合型发起式基金中基金（FOF）基金经理助理。2025 年 10 月 28 日起任大成多元配置三个月持有期混合型基金中基金（ETF-FOF）基金经理助理。具有基金从业资格。国籍：中国 |
| 陈志伟 | 本基金基金经理   | 2025 年 10 月 28 日 | -    | 10 年   | 北京大学经济学硕士、香港大学金融学硕士。证券、保险资管从业年限 10 年。2011 年 7 月至 2014 年 2 月任华润深国投信托有限公司证券投资部经理。2014 年 2 月                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                  |

|  |  |  |  |  |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                            |
|--|--|--|--|--|------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
|  |  |  |  |  | 至 2016 年 6 月任方正东亚信托有限公司对冲基金部总监。2016 年 6 月至 2020 年 4 月任鹏华资产管理有限公司投资管理部高级研究员。2020 年 5 月至 2023 年 6 月任生命保险资产管理有限公司组合管理部投资经理。2023 年 6 月加入大成基金管理有限公司，现任大类资产配置部基金经理。2023 年 8 月 4 日至 2025 年 9 月 26 日任大成颐享稳健养老目标一年持有期混合型发起式基金中基金（FOF）基金经理。2024 年 3 月 14 日至 2025 年 8 月 22 日任大成丰华稳健六个月持有期混合型发起式基金中基金（FOF）。2024 年 3 月 14 日起任大成养老目标日期 2040 三年持有期混合型基金中基金（FOF）、大成颐禧积极养老目标五年持有期混合型发起式基金中基金（FOF）基金经理。2025 年 6 月 24 日起担任大成睿浦智选三个月持有期混合型发起式基金中基金（FOF）基金经理。2025 年 10 月 28 日起任大成多元配置三个月持有期混合型基金中基金（ETF-FOF）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《证券投资基金经营机构董事、监事、高级管理人员及从业人员监督管理办法》的相关规定。

4.1.3 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理同时管理的产品情况

无。

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

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

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

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

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

#### 4.3.2 异常交易行为的专项说明

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

### 4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

#### 4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

上半年国内宏观环境总体保持稳定，结构分化特征明显。上半年国内 GDP 同比增长 4.7%，增速符合全年经济增长预期目标。生产端，规上工业增加值同比增长 5.4%，以高端制造、数字经济、现代服务为代表的新动能对经济增长贡献率超过 40%。消费端，社会消费品和服务零售总额增长 2.7%，服务零售额增长 5.3%，但传统商品消费修复偏慢。出口保持较强韧性，上半年货物进出口总额 25.5 万亿元，同比增长 16.9%，其中高技术产品出口增长 39%。物价方面，CPI 同比上涨 1.0%，核心 CPI 上涨 1.2%，PPI 同比上涨 1.5%，价格水平温和回升；二季度 GDP 平减指数近三个季度以来首次转正，此前物价持续偏低的局面得到扭转。海外宏观环境不确定性在上半年显著升温。中东地缘冲突（美伊局势及霍尔木兹海峡事件）导致能源价格短期飙升，叠加美国通胀超预期反弹（CPI 从 1 月的 2.4%升至 5 月的 4.2%），美联储政策预期从年初的降息转向年中的加息，美联储新任主席沃什上任后 10 年期美债收益率从 4.0%附近显著上行至 4.5%以上，全球流动性环境边际收紧。

从大类资产表现来看，上半年全球股市围绕 AI 和半导体产业高度共振，但结构分化极为剧烈。A 股主要宽基指数涨跌互现：上证指数上涨 3.16%，沪深 300 上涨 7.55%，科创 50 大涨 64.25%，创业板指上涨 35.58%，中证 500 上涨 20.97%，但上证 50 下跌 1.38%，北证 50 下跌 13.14%。市场呈现极致的 K 型分化：全 A 中位数大幅下跌，超过 68%的个股录得负收益，仅约三成个股上涨。行业层面，电子、通信、建筑材料涨幅居前，而商贸零售、农林牧渔、美容护理、食品饮料等传统消费板块跌幅居前，行业间涨跌幅极差超过 115 个百分点。港股表现疲弱，恒生指数累计下跌 10.73%，恒生科技指数下跌 18.92%，恒生国企指数下跌 15.21%，主要受指数结构中缺乏大型半导

体标的、内地监管加强跨境资金管控及美联储加息预期升温三重因素压制。全球其他市场方面，韩国 KOSPI 指数、日经 225 指数大涨，美股主要指数表现较好，欧洲主要股市小幅上涨。债市方面，国内利率债走出“慢牛”行情，10 年期国债收益率在 1.70%至 1.90%区间震荡下行，半年末收于 1.73%附近，较年初下行约 11BP；央行上半年未实施降准降息，但资金面持续宽松与“资产荒”格局贯穿始终，信用利差被压缩至历史低位。海外债市方面，美债收益率在加息预期推动下显著上行，10 年美债实际收益率大幅上行。大宗商品方面，黄金上半年整体下跌约 7.5%，从年初高点约 5595 美元/盎司回落至 4000-4170 美元区间，主要受实际利率上升和美元走强压制；原油受中东地缘冲突冲击大幅波动，布伦特一度突破 100 美元/桶后随局势缓和回落；铜、铝等工业金属受益于 AI 基础设施建设需求表现相对坚挺。

上半年本基金坚持大类资产配置策略，在结构性分化加剧的市场环境中积极寻找阿尔法机会。在权益资产方面，重点把握了 AI 算力、半导体等科技成长主线的上涨行情，同时适度配置低估值高股息品种以控制组合波动。在商品及另类资产方面，适度参与了铜等供给端有约束品种的阶段性行情，并对黄金的剧烈波动保持审慎。在投资策略上，我们进一步完善了战术资产配置框架，继续深化量化模型与主观判断相结合的投资方法论，加强对产业趋势和中观行业景气度的跟踪研究，持续优化 ETF 投资的卫星策略。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末大成多元配置三个月持有混合（ETF-FOF）A 的基金份额净值为 1.0293 元，本报告期基金份额净值增长率为 3.71%，同期业绩比较基准收益率为 2.70%；截至本报告期末大成多元配置三个月持有混合（ETF-FOF）C 的基金份额净值为 1.0265 元，本报告期基金份额净值增长率为 3.50%，同期业绩比较基准收益率为 2.70%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望下半年，国内宏观环境有望保持“稳中向新”的态势。财政政策靠前发力、货币政策维持适度宽松的总基调不变，央行已增加隔夜逆回购操作品种并收窄利率走廊宽度，总量工具进一步宽松的空间有限，预计 10 年期国债收益率核心波动区间维持 1.70%至 1.90%。海外方面，随着美国 7 月下旬新一轮 301 关税落地但中美贸易谈判持续推进、中东局势逐步缓和（霍尔木兹海峡通航已改善），外部不确定性有望边际下降，但美联储加息预期与 AI 科技股高估值仍是需要持续关注的风险点。我们对国内权益资产持谨慎积极态度：一方面 AI 产业周期仍处早期阶段，科技成长主线具备中期逻辑支撑，但交易集中度和基金持仓集中度已达历史高位，需警惕阶段性回调风险；另一方面，随着经济内生动能逐步修复，估值处于低位的消费、医药等传统板块存在均值回归机会。商品价格在供给约束和结构性需求分化下预计维持震荡格局，铜等 AI 产业链上游品种具备较

好的基本面支撑。港股方面，随着央行明确外储增配港股、南向资金持续流入，估值处于历史低位的港股科技龙头有望迎来修复窗口。接下来我们将继续深化对大类资产及细分资产的研究，在结构性行情中寻找性价比较高的资产进行配置，同时加强风险管理，力争在复杂多变的市场环境中实现净值的稳健增长。

本基金将坚持大类资产配置策略，在抓住大类资产贝塔基础上通过风格配置、行业配置、券种配置等策略获取一定超额收益。我们坚持多元资产配置的投资策略，相信在不确定的环境下多元配置的稳健性会重新受到重视。

#### 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，本托管人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，诚信、尽责地履行了基金托管人义务，不存在损害本基金份额持有人利益的行为。

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，本托管人根据国家有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，对基金管理人在本基金的投资运作、基金资产净值的计算、基金收益的计算、基金费用开支、利润分配情况等方面进行了必要的监督、复核和审查，未发现其存在任何损害本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

本托管人认真复核了报告中的财务指标、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，认为其真实、准确和完整，不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

§ 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：大成多元配置三个月持有期混合型基金中基金（ETF-FOF）

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<br>2026 年 6 月 30 日 | 上年度末<br>2025 年 12 月 31 日 |
|---------|---------|------------------------|--------------------------|
| 资 产：    |         |                        |                          |
| 货币资金    | 6.4.7.1 | 2,498,200.72           | 10,202,867.05            |
| 结算备付金   |         | -                      | -                        |
| 存出保证金   |         | -                      | -                        |
| 交易性金融资产 | 6.4.7.2 | 58,356,826.44          | 207,879,605.21           |
| 其中：股票投资 |         | -                      | -                        |
| 基金投资    |         | 55,318,950.00          | 197,416,660.00           |

|               |            |                                |                                  |
|---------------|------------|--------------------------------|----------------------------------|
| 债券投资          |            | 3,037,876.44                   | 10,462,945.21                    |
| 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          |            | -                              | 27,353.00                        |
| 应收申购款         |            | 209.76                         | 1,080.48                         |
| 递延所得税资产       |            | -                              | -                                |
| 其他资产          | 6.4.7.8    | -                              | -                                |
| 资产总计          |            | 60,855,236.92                  | 218,110,905.74                   |
| <b>负债和净资产</b> | <b>附注号</b> | <b>本期末<br/>2026 年 6 月 30 日</b> | <b>上年度末<br/>2025 年 12 月 31 日</b> |
| <b>负 债:</b>   |            |                                |                                  |
| 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         |            | 933,911.31                     | -                                |
| 应付管理人报酬       |            | 48,350.55                      | 173,317.45                       |
| 应付托管费         |            | 5,310.09                       | 18,407.86                        |
| 应付销售服务费       |            | 14,929.64                      | 50,858.50                        |
| 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    | 81,956.65                      | 55,000.00                        |
| 负债合计          |            | 1,084,458.24                   | 297,583.81                       |
| <b>净资产:</b>   |            |                                |                                  |
| 实收基金          | 6.4.7.10   | 58,180,029.96                  | 219,571,910.50                   |
| 未分配利润         | 6.4.7.12   | 1,590,748.72                   | -1,758,588.57                    |
| 净资产合计         |            | 59,770,778.68                  | 217,813,321.93                   |
| 负债和净资产总计      |            | 60,855,236.92                  | 218,110,905.74                   |

注：报告截止日 2026 年 6 月 30 日，基金份额总额 58,180,029.96 份。其中大成多元配置三个月持有混合（ETF-FOF）A 类基金份额总额为 16,988,421.26 份，基金份额净值 1.0293 元；大成多元配置三个月持有混合（ETF-FOF）C 类基金份额总额为 41,191,608.70 份，基金份额净值 1.0265 元。

## 6.2 利润表

会计主体：大成多元配置三个月持有期混合型基金中基金（ETF-FOF）

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<br>2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6<br>月 30 日 |
|----------------------------|------------|------------------------------------------|
| <b>一、营业总收入</b>             |            | 9,084,717.10                             |
| 1. 利息收入                    |            | 17,303.96                                |
| 其中：存款利息收入                  | 6.4.7.13   | 17,303.96                                |
| 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）          |            | 6,224,154.59                             |
| 其中：股票投资收益                  | 6.4.7.14   | -                                        |
| 基金投资收益                     | 6.4.7.15   | 5,878,772.10                             |
| 债券投资收益                     | 6.4.7.16   | 119,002.49                               |
| 资产支持证券投资收益                 | 6.4.7.17   | -                                        |
| 贵金属投资收益                    | 6.4.7.18   | -                                        |
| 衍生工具收益                     | 6.4.7.19   | -                                        |
| 股利收益                       | 6.4.7.20   | 226,380.00                               |
| 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   | 2,495,773.70                             |
| 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   | 347,484.85                               |
| <b>减：二、营业总支出</b>           |            | 863,920.21                               |
| 1. 管理人报酬                   | 6.4.10.2.1 | 534,583.19                               |
| 2. 托管费                     | 6.4.10.2.2 | 57,206.01                                |
| 3. 销售服务费                   | 6.4.10.2.3 | 161,509.83                               |
| 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                  | 6.4.7.24   | -                                        |
| 7. 税金及附加                   |            | 25,759.47                                |
| 8. 其他费用                    | 6.4.7.25   | 84,861.71                                |
| <b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b> |            | 8,220,796.89                             |
| 减：所得税费用                    |            | -                                        |

|                   |  |              |
|-------------------|--|--------------|
| 四、净利润（净亏损以“-”号填列） |  | 8,220,796.89 |
| 五、其他综合收益的税后净额     |  | -            |
| 六、综合收益总额          |  | 8,220,796.89 |

6.3 净资产变动表

会计主体：大成多元配置三个月持有期混合型基金中基金（ETF-FOF）

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<br>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                                | 219,571,910.50                        | -      | -1,758,588.57 | 217,813,321.93  |
| 二、本期期初净资产                                | 219,571,910.50                        | -      | -1,758,588.57 | 217,813,321.93  |
| 三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)                     | -<br>161,391,880.54                   | -      | 3,349,337.29  | -158,042,543.25 |
| （一）、综合收益总额                               | -                                     | -      | 8,220,796.89  | 8,220,796.89    |
| （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）      | -<br>161,391,880.54                   | -      | -4,871,459.60 | -166,263,340.14 |
| 其中：1. 基金申购款                              | 3,729,693.06                          | -      | 67,141.02     | 3,796,834.08    |
| 2. 基金赎回款                                 | -<br>165,121,573.60                   | -      | -4,938,600.62 | -170,060,174.22 |
| （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                                | 58,180,029.96                         | -      | 1,590,748.72  | 59,770,778.68   |

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

大成多元配置三个月持有期混合型基金中基金(ETF-FOF)(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]1878号《关于准予大成多元配置三个月持有期混合型基金中基金(ETF-FOF)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《大成多元配置三个月持有期混合型基金中基金(ETF-FOF)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 218,883,504.54 元,业经容诚会计师事务所(特殊普通合伙)容诚验字[2025]200Z0179号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《大成多元配置三个月持有期混合型基金中基金(ETF-FOF)基金合同》于2025年10月28日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为218,970,436.25份基金份额,其中认购资金利息折合86,931.71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,基金托管人为恒丰银行股份有限公司。

根据《大成多元配置三个月持有期混合型基金中基金(ETF-FOF)基金合同》和《大成多元配置三个月持有期混合型基金中基金(ETF-FOF)招募说明书》的有关规定,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/申购时收取前端认购/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类基金份额和C类基金份额分别设置基金代码并分别计算基金份额净值。

本基金设置投资者最短持有期限(即锁定期)为三个月。对于每份基金份额,自基金合同生效日(含)(对认购份额而言,下同)或基金份额申购申请确认日(含)(对申购份额而言,下同)起至三个月后对应日(如该对应日为非工作日或无该对应日,则顺延至下一个工作日,下同)的前一日(含该日)为最短持有期限,在最短持有期限内基金份额持有人不能就该份额提出赎回申请。每份基金份额的最短持有期限结束日的下一个工作日(含)起,基金份额持有人可就该份额提出赎回申请。因红利再投资所得的份额与原份额适用相同的最短持有期限。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《大成多元配置三个月持有期混合型基金中基金(ETF-FOF)基金合同》的有关规定,本基金主要投资于经中国证监会依法核准或注册的公开募集证券投资基金(以下简称“证券投资基金”,包含公开募集基础设施证券投资基金(以下简称“公募REITs”)、QDII基金、香港互认基金、商品基金(含商品期货基金和黄金ETF,下同)及其他经中

国证监会依法核准或注册的基金)、国内依法发行上市的股票(包含主板、创业板、科创板及其他中国证监会允许上市的股票及存托凭证)、内地与香港股票市场交易互联互通机制允许买卖的香港证券市场证券(包括股票和 ETF, 简称“港股通标的证券”)、债券(包含国债、金融债、企业债、公司债、地方政府债、政府支持债券、政府支持机构债、次级债、可转换债券(含分离交易可转债)、可交换债券、央行票据、中期票据、短期融资券(含超短期融资券)等)、资产支持证券、债券回购、银行存款、同业存单、货币市场工具及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具(但须符合中国证监会的相关规定)。本基金的投资组合比例为: 本基金投资于证券投资基金的资产比例不低于基金资产的 80%, 其中投资于交易型开放式指数证券投资基金(包括 QDII、黄金、商品期货等交易型开放式指数证券投资基金, 以下简称“ETF”)的比例不低于非现金基金资产的 80%。本基金投资于权益类资产的比例不低于基金资产的 60%, 投资于港股通股票的资产不超过股票资产的 50%; 保持不低于基金资产净值 5% 的现金或者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、存出保证金和应收申购款等。权益类资产包括股票、股票型基金以及权益类混合型基金。权益类混合型基金指至少满足以下一条标准的混合型基金: (1) 基金合同约定投资股票资产占基金资产的比例不低于 60%; (2) 基金最近 4 期季度报告中披露的股票资产占基金资产的比例均不低于 60%。本基金的业绩比较基准为: 中证 A500 指数收益率\*55%+恒生指数收益率(使用估值汇率调整)\*20%+上海黄金交易所 Au99.99 现货实盘合约收盘价收益率\*10%+中债新综合全价(总值)指数收益率\*15%。

#### 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<br>2026 年 6 月 30 日 |
|------|------------------------|
| 活期存款 | 821,665.78             |

|                |              |
|----------------|--------------|
| 等于：本金          | 821,225.49   |
| 加：应计利息         | 440.29       |
| 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           | 1,676,534.94 |
| 等于：本金          | 1,676,479.65 |
| 加：应计利息         | 55.29        |
| 减：坏账准备         | -            |
| 合计             | 2,498,200.72 |

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<br>2026 年 6 月 30 日 |           |               |              |
|---------------|-------|------------------------|-----------|---------------|--------------|
|               |       | 成本                     | 应计利息      | 公允价值          | 公允价值变动       |
| 股票            |       | -                      | -         | -             | -            |
| 贵金属投资-金交所黄金合约 |       | -                      | -         | -             | -            |
| 债券            | 交易所市场 | 2,999,989.11           | 37,276.44 | 3,037,876.44  | 610.89       |
|               | 银行间市场 | -                      | -         | -             | -            |
|               | 合计    | 2,999,989.11           | 37,276.44 | 3,037,876.44  | 610.89       |
| 资产支持证券        |       | -                      | -         | -             | -            |
| 基金            |       | 50,529,435.92          | -         | 55,318,950.00 | 4,789,514.08 |
| 其他            |       | -                      | -         | -             | -            |
| 合计            |       | 53,529,425.03          | 37,276.44 | 58,356,826.44 | 4,790,124.97 |

#### 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<br>2026 年 6 月 30 日 |
|-------------|------------------------|
| 应付券商交易单元保证金 | -                      |
| 应付赎回费       | 133.79                 |

|           |           |
|-----------|-----------|
| 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      | 81,822.86 |
| 合计        | 81,956.65 |

#### 6.4.7.10 实收基金

金额单位：人民币元

大成多元配置三个月持有混合（ETF-FOF）A

| 项目            | 本期<br>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          | 67,863,250.85                         | 67,863,250.85  |
| 本期申购          | 1,191,594.49                          | 1,191,594.49   |
| 本期赎回（以“-”号填列） | -52,066,424.08                        | -52,066,424.08 |
| 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           | 16,988,421.26                         | 16,988,421.26  |

大成多元配置三个月持有混合（ETF-FOF）C

| 项目            | 本期<br>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          | 151,708,659.65                        | 151,708,659.65  |
| 本期申购          | 2,538,098.57                          | 2,538,098.57    |
| 本期赎回（以“-”号填列） | -113,055,149.52                       | -113,055,149.52 |
| 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           | 41,191,608.70                         | 41,191,608.70   |

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

大成多元配置三个月持有混合（ETF-FOF）A

| 项目   | 已实现部分         | 未实现部分      | 未分配利润合计     |
|------|---------------|------------|-------------|
| 上年度末 | -1,219,028.41 | 708,128.62 | -510,899.79 |

|                |               |               |               |
|----------------|---------------|---------------|---------------|
| 本期期初           | -1,219,028.41 | 708,128.62    | -510,899.79   |
| 本期利润           | 1,873,996.40  | 735,414.70    | 2,609,411.10  |
| 本期基金份额交易产生的变动数 | -459,599.02   | -1,140,888.69 | -1,600,487.71 |
| 其中：基金申购款       | 12,691.05     | 9,362.61      | 22,053.66     |
| 基金赎回款          | -472,290.07   | -1,150,251.30 | -1,622,541.37 |
| 本期已分配利润        | -             | -             | -             |
| 本期末            | 195,368.97    | 302,654.63    | 498,023.60    |

大成多元配置三个月持有混合（ETF-FOF）C

| 项目             | 已实现部分         | 未实现部分         | 未分配利润合计       |
|----------------|---------------|---------------|---------------|
| 上年度末           | -2,828,976.04 | 1,581,287.26  | -1,247,688.78 |
| 本期期初           | -2,828,976.04 | 1,581,287.26  | -1,247,688.78 |
| 本期利润           | 3,851,026.79  | 1,760,359.00  | 5,611,385.79  |
| 本期基金份额交易产生的变动数 | -660,363.48   | -2,610,608.41 | -3,270,971.89 |
| 其中：基金申购款       | 23,928.40     | 21,158.96     | 45,087.36     |
| 基金赎回款          | -684,291.88   | -2,631,767.37 | -3,316,059.25 |
| 本期已分配利润        | -             | -             | -             |
| 本期末            | 361,687.27    | 731,037.85    | 1,092,725.12  |

6.4.7.13 存款利息收入

单位：人民币元

| 项目        | 本期<br>2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日 |
|-----------|---------------------------------------|
| 活期存款利息收入  | 16,737.17                             |
| 定期存款利息收入  | -                                     |
| 其他存款利息收入  | 566.79                                |
| 结算备付金利息收入 | -                                     |
| 其他        | -                                     |
| 合计        | 17,303.96                             |

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

无。

6.4.7.14.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

无。

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

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/赎回基金成交总额       | 429,501,155.70                  |
| 减：卖出/赎回基金成本总额     | 423,246,632.51                  |
| 减：买卖基金差价收入应缴纳增值税额 | 214,662.28                      |
| 减：交易费用            | 161,088.81                      |
| 基金投资收益            | 5,878,772.10                    |

#### 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<br>2026年1月1日至2026年6月30日 |
|------------------------------|----------------------------|
| 债券投资收益——利息收入                 | 45,973.98                  |
| 债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入 | 73,028.51                  |
| 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                           | 119,002.49                 |

##### 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<br>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   | 18,935,334.72              |
| 减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额 | 18,747,417.65              |
| 减：应计利息总额               | 113,874.96                 |
| 减：交易费用                 | 1,013.60                   |
| 买卖债券差价收入               | 73,028.51                  |

##### 6.4.7.16.3 债券投资收益——赎回差价收入

无。

##### 6.4.7.16.4 债券投资收益——申购差价收入

无。

#### 6.4.7.17 资产支持证券投资收益

##### 6.4.7.17.1 资产支持证券投资收益项目构成

无。

##### 6.4.7.17.2 资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入

无。

## 6.4.7.17.3 资产支持证券投资收益——赎回差价收入

无。

## 6.4.7.17.4 资产支持证券投资收益——申购差价收入

无。

## 6.4.7.18 贵金属投资收益

## 6.4.7.18.1 贵金属投资收益项目构成

无。

## 6.4.7.18.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

无。

## 6.4.7.18.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

无。

## 6.4.7.18.4 贵金属投资收益——申购差价收入

无。

## 6.4.7.19 衍生工具收益

## 6.4.7.19.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

无。

## 6.4.7.19.2 衍生工具收益——其他投资收益

无。

## 6.4.7.20 股利收益

单位：人民币元

| 项目            | 本期<br>2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日 |
|---------------|---------------------------------------|
| 股票投资产生的股利收益   | —                                     |
| 其中：证券出借权益补偿收入 | —                                     |
| 基金投资产生的股利收益   | 226,380.00                            |
| 合计            | 226,380.00                            |

## 6.4.7.21 公允价值变动收益

单位：人民币元

| 项目名称       | 本期<br>2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日 |
|------------|---------------------------------------|
| 1. 交易性金融资产 | 2,495,773.70                          |
| 股票投资       | —                                     |
| 债券投资       | 24,137.26                             |
| 资产支持证券投资   | —                                     |

|                        |              |
|------------------------|--------------|
| 基金投资                   | 2,471,636.44 |
| 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                     | 2,495,773.70 |

#### 6.4.7.22 其他收入

单位：人民币元

| 项目      | 本期<br>2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日 |
|---------|---------------------------------------|
| 基金赎回费收入 | 347,484.85                            |
| 合计      | 347,484.85                            |

#### 6.4.7.23 持有基金产生的费用

| 项目                   | 本期<br>2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日 |
|----------------------|---------------------------------------|
| 当期持有基金产生的应支付销售服务费（元） | —                                     |
| 当期持有基金产生的应支付管理费（元）   | 232,872.69                            |
| 当期持有基金产生的应支付托管费（元）   | 50,983.40                             |

注：上述费用为根据所投资基金的招募说明书列明的计算方法对销售服务费、管理费和托管费进行的估算；上述费用已在本基金所持有基金的净值中体现，不构成本基金的费用项目。

#### 6.4.7.24 信用减值损失

无。

#### 6.4.7.25 其他费用

单位：人民币元

| 项目      | 本期<br>2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日 |
|---------|---------------------------------------|
| 审计费用    | 22,315.49                             |
| 信息披露费   | 59,507.37                             |
| 证券出借违约金 | —                                     |
| 银行划款手续费 | 3,038.85                              |
| 合计      | 84,861.71                             |

#### 6.4.7.26 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 |
| 恒丰银行股份有限公司（“恒丰银行”） | 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 |
|------------------|---------------------------------|
| 当期发生的基金应支付的管理费   | 534,583.19                      |
| 其中：应支付销售机构的客户维护费 | 258,666.79                      |
| 应支付基金管理人的净管理费    | 275,916.40                      |

注：本基金投资于基金管理人所管理的其他基金部分不收取管理费。本基金管理费年费率为 1.00%，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扣除本基金持有的基金管理人管理的其他基金部分后的余额  
×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<br>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 | 57,206.01                             |

注：本基金投资于基金托管人所托管的其他基金部分不收取托管费。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扣除本基金持有的基金托管人托管的其他基金部分后的余额  
×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<br>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                      |                                 |       |
|                | 大成多元配置三个月<br>持有混合（ETF-<br>FOF）A       | 大成多元配置三个月<br>持有混合（ETF-<br>FOF）C | 合计    |
| 大成基金           | -                                     | 14.47                           | 14.47 |
| 光大证券           | -                                     | 19.74                           | 19.74 |
| 合计             | -                                     | 34.21                           | 34.21 |

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 |           |
|       | 期末余额                            | 当期利息收入    |
| 恒丰银行  | 821,665.78                      | 16,737.17 |

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

6.4.10.8.1 其他关联交易事项的说明

于本期末，本基金持有基金管理人大成基金管理有限公司所管理的公开募集证券投资基金合计 6,317,950.00 元(上年度末：23,269,000.00 元)，占本基金资产净值的比例为 10.57%(上年度末：10.68%)。

6.4.10.8.2 当期交易及持有基金管理人以及管理人关联方所管理基金产生的费用

| 项目              | 本期                              |  |
|-----------------|---------------------------------|--|
|                 | 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日 |  |
| 当期交易基金产生的申购费（元） | —                               |  |
| 当期交易基金产生的赎回费（元） | —                               |  |
| 当期持有基金产生的应支付销售服 | —                               |  |

|                    |           |
|--------------------|-----------|
| 务费（元）              |           |
| 当期持有基金产生的应支付管理费（元） | 19,760.71 |
| 当期持有基金产生的应支付托管费（元） | 3,722.89  |
| 当期交易基金产生的交易费（元）    | 7,056.97  |

注：本基金申购、赎回本基金的基金管理人管理的其他基金（ETF 除外），应当通过基金管理人的直销渠道且不得收取申购费、赎回费（按规定应当收取并记入被投资基金其他收入部分的赎回费除外）、销售服务费等销售费用。相关申购费、赎回费由基金管理人直接减免，故当期交易基金产生的申购费为零，当期交易基金产生的赎回费仅为按规定应当收取并记入被投资基金其他收入部分的赎回费。相关销售服务费已作为费用计入被投资基金的基金份额净值，由基金管理人从被投资基金收取后向本基金返还，当期持有基金产生的应支付销售服务费为管理人当期应向本基金返还的销售服务费，相关披露金额根据本基金对被投资基金的实际持仓、被投资基金的基金合同约定的费率和方法估算。当期持有基金产生的应支付管理费、当期持有基金产生的应支付托管费已作为费用计入被投资基金的基金份额净值，相关披露金额根据本基金对被投资基金的实际持仓、被投资基金的基金合同约定的费率和方法估算。

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

无。

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

本基金是混合型基金中基金，其预期收益及预期风险水平低于股票型基金、股票型基金中基金，高于债券型基金、债券型基金中基金、货币市场基金及货币型基金中基金。本基金投资的金融工具主要包括基金投资、股票投资和债券投资等。本基金在日常经营活动中面临的与这些金融工具相关的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金的基金管理人从事风险管理的主要目标是在控制风险的基础上，通过定量分析和定性分析相结合的方式精选出基金管理人旗下优质基金构建投资组合，以适度动态的资产配置策略有效综合基金管理人主动投资管理能力，力争实现基金资产的长期稳定增值。

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

本基金的基金管理人建立了信用风险管理流程，通过对投资品种信用等级评估来控制证券发

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

本期末，本基金未持有除国债、央行票据和政策性金融债以外的债券（上年度末：本基金持有的除国债、央行票据和政策性金融债以外的债券占基金资产净值的比例为 1.11%）。

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

#### 6.4.13.4 市场风险

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

##### 6.4.13.4.1 利率风险

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

本基金的基金管理人定期对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控，并通过调整投资组合的久期等方法对上述利率风险进行管理。本基金持有及承担的大部分金融资产和金融负债不计息，因此本基金的收入及经营活动的现金流量在很大程度上独立于市场利率变化。本基金持有的利率敏感性资产主要为银行存款、结算备付金、存出保证金和债券投资等。

##### 6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

| 本期末<br>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                     | 2,498,200.72  | -            | -     | -              | 2,498,200.72   |
| 交易性金融资产                  | 3,037,876.44  | -            | -     | 55,318,950.00  | 58,356,826.44  |
| 应收申购款                    | -             | -            | -     | 209.76         | 209.76         |
| 资产总计                     | 5,536,077.16  | -            | -     | 55,319,159.76  | 60,855,236.92  |
| 负债                       |               |              |       |                |                |
| 应付赎回款                    | -             | -            | -     | 933,911.31     | 933,911.31     |
| 应付管理人报酬                  | -             | -            | -     | 48,350.55      | 48,350.55      |
| 应付托管费                    | -             | -            | -     | 5,310.09       | 5,310.09       |
| 应付销售服务费                  | -             | -            | -     | 14,929.64      | 14,929.64      |
| 其他负债                     | -             | -            | -     | 81,956.65      | 81,956.65      |
| 负债总计                     | -             | -            | -     | 1,084,458.24   | 1,084,458.24   |
| 利率敏感度缺口                  | 5,536,077.16  | -            | -     | 54,234,701.52  | 59,770,778.68  |
| 上年度末<br>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                     | 10,202,867.05 | -            | -     | -              | 10,202,867.05  |
| 交易性金融资产                  | 8,048,241.10  | 2,414,704.11 | -     | 197,416,660.00 | 207,879,605.21 |
| 应收股利                     | -             | -            | -     | 27,353.00      | 27,353.00      |
| 应收申购款                    | -             | -            | -     | 1,080.48       | 1,080.48       |
| 资产总计                     | 18,251,108.15 | 2,414,704.11 | -     | 197,445,093.48 | 218,110,905.74 |
| 负债                       |               |              |       |                |                |
| 应付管理人报酬                  | -             | -            | -     | 173,317.45     | 173,317.45     |
| 应付托管费                    | -             | -            | -     | 18,407.86      | 18,407.86      |

|         |               |              |   |                |                |
|---------|---------------|--------------|---|----------------|----------------|
| 应付销售服务费 | -             | -            | - | 50,858.50      | 50,858.50      |
| 其他负债    | -             | -            | - | 55,000.00      | 55,000.00      |
| 负债总计    | -             | -            | - | 297,583.81     | 297,583.81     |
| 利率敏感度缺口 | 18,251,108.15 | 2,414,704.11 | - | 197,147,509.67 | 217,813,321.93 |

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

#### 6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

于本期末，本基金持有的交易性债券投资和交易性资产支持证券投资公允价值占净资产的比例为 5.08% (上年度末：4.80%)，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。本基金主要投资于经中国证监会依法核准或注册的公开募集的基金份额、证券交易所上市或银行间同业市场交易的股票和债券，所面临的其他价格风险来源于单个证券发行主体自身经营情况或特殊事项的影响，也可能来源于证券市场整体波动的影响。

本基金的基金管理人在构建和管理投资组合的过程中，将结合内外部的投资研究经验，分析各大类资产历史投资回报并对未来表现进行预判，拟定基金在各类资产的配置中枢。在战术资产配置层面，基金管理人将结合当期宏观经济、政策导向和市场趋势变等因素，对各大类资产的短期风险收益水平进行估算，动态分配符合风险目标的权重，使得不同环境中表现良好的各类资产都能够为投资组合提供预期收益贡献。本基金的基金管理人定期结合宏观及微观环境的变化，对投资策略、资产配置、投资组合进行修正，来主动应对可能发生的市场价格风险。

本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险。本基金投资于证券投资基金的资产比例不低于基金资产的 80%，其中投资于交易型开放式指数证券投资基金（包括 QDII、黄金、商品期货等交易型开放式指数证券投资基金，以下简称“ETF”）的比例不低于非现金基金资产的 80%。本基金投资于权益类资产的比例不低于基金资产的 60%，投资于港股通股票的资产不超过股票资产的 50%；保持不低于基金资产净值 5% 的现金或者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、存出保证金和应收申购款等。权益类资产包括股票、股票型基金以及权益类混合型基金。权

益类混合型基金指至少满足以下一条标准的混合型基金：(1)基金合同约定投资股票资产占基金资产的比例不低于 60%；(2)基金最近 4 期季度报告中披露的股票资产占基金资产的比例均不低于 60%。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。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<br>2026 年 6 月 30 日 |                  | 上年度末<br>2025年12月31日 |                  |
|---------------|------------------------|------------------|---------------------|------------------|
|               | 公允价值                   | 占基金资产净值<br>比例（%） | 公允价值                | 占基金资产净值<br>比例（%） |
| 交易性金融资产—股票投资  | -                      | -                | -                   | -                |
| 交易性金融资产—基金投资  | 55,318,950.00          | 92.55            | 197,416,660.00      | 90.64            |
| 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            | 55,318,950.00          | 92.55            | 197,416,660.00      | 90.64            |

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%          | 3,321,242.97                | 6,494,864.76           |
|    | 业绩比较基准下降 5%          | -3,321,242.97               | -6,494,864.76          |

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<br>2026 年 6 月 30 日 | 上年度末<br>2025 年 12 月 31 日 |
|---------------|------------------------|--------------------------|
| 第一层次          | 55,318,950.00          | 199,831,364.11           |
| 第二层次          | 3,037,876.44           | 8,048,241.10             |
| 第三层次          | —                      | —                        |
| 合计            | 58,356,826.44          | 207,879,605.21           |

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<br>(%) |
|----|-------------------|---------------|------------------|
| 1  | 权益投资              | -             | -                |
|    | 其中：股票             | -             | -                |
| 2  | 基金投资              | 55,318,950.00 | 90.90            |
| 3  | 固定收益投资            | 3,037,876.44  | 4.99             |
|    | 其中：债券             | 3,037,876.44  | 4.99             |
|    | 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      | 2,498,200.72  | 4.11             |
| 8  | 其他各项资产            | 209.76        | 0.00             |
| 9  | 合计                | 60,855,236.92 | 100.00           |

### 7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

#### 7.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

无。

#### 7.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

无。

### 7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

无。

### 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

无。

#### 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

无。

#### 7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

无。

### 7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

| 序号 | 债券品种      | 公允价值         | 占基金资产净值比例（%） |
|----|-----------|--------------|--------------|
| 1  | 国家债券      | 3,037,876.44 | 5.08         |
| 2  | 央行票据      | —            | —            |
| 3  | 金融债券      | —            | —            |
|    | 其中：政策性金融债 | —            | —            |
| 4  | 企业债券      | —            | —            |
| 5  | 企业短期融资券   | —            | —            |
| 6  | 中期票据      | —            | —            |
| 7  | 可转债（可交换债） | —            | —            |
| 8  | 同业存单      | —            | —            |
| 9  | 其他        | —            | —            |
| 10 | 合计        | 3,037,876.44 | 5.08         |

## 7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

金额单位：人民币元

| 序号 | 债券代码   | 债券名称     | 数量<br>(张) | 公允价值         | 占基金资产净值比例<br>(%) |
|----|--------|----------|-----------|--------------|------------------|
| 1  | 019785 | 25 国债 13 | 30,000    | 3,037,876.44 | 5.08             |

## 7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

无。

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

无。

## 7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

无。

## 7.10 本基金投资股指期货的投资政策

无。

## 7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

### 7.11.1 本期国债期货投资政策

无。

### 7.11.2 本期国债期货投资评价

无。

## 7.12 本报告期投资基金情况

### 7.12.1 投资政策及风险说明

本基金以积极的投资风格进行长期资产配置，通过构建与收益风险水平相匹配的基金组合，在严格控制投资风险并保持良好流动性的前提下，追求基金资产的长期增值。

报告期内，本基金主要投资于开放式基金，所投资的子基金整体运作情况良好。本基金的投

资符合基金合同约定的投资政策、投资限制等要求。

7.12.2 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有基金投资明细

| 序号 | 基金代码   | 基金名称                    | 运作方式         | 持有份额（份）      | 公允价值（元）      | 占基金资产净值比例（%） | 是否属于基金管理人及管理人关联方所管理的基金 |
|----|--------|-------------------------|--------------|--------------|--------------|--------------|------------------------|
| 1  | 513850 | 易方达 MSCI 美国 50ETF(QDII) | 交易型开放式 (ETF) | 3,300,000.00 | 5,732,100.00 | 9.59         | 否                      |
| 2  | 159906 | 大成深证成长 40ETF            | 交易型开放式 (ETF) | 1,905,000.00 | 4,385,310.00 | 7.34         | 是                      |
| 3  | 159516 | 国泰中证半导体材料设备主题 ETF       | 交易型开放式 (ETF) | 2,000,000.00 | 3,950,000.00 | 6.61         | 否                      |
| 4  | 515880 | 国泰中证全指通信设备 ETF          | 交易型开放式 (ETF) | 2,100,000.00 | 3,771,600.00 | 6.31         | 否                      |
| 5  | 588200 | 嘉实上证科创板芯片 ETF           | 交易型开放式 (ETF) | 750,000.00   | 3,702,000.00 | 6.19         | 否                      |
| 6  | 518880 | 华安黄金 ETF                | 交易型开放式 (ETF) | 400,000.00   | 3,351,200.00 | 5.61         | 否                      |
| 7  | 159201 | 华夏国证自由现金流 ETF           | 交易型开放式 (ETF) | 3,000,000.00 | 3,183,000.00 | 5.33         | 否                      |

|    |        |                     |              |              |              |      |   |
|----|--------|---------------------|--------------|--------------|--------------|------|---|
| 8  | 159207 | 广发中证智选高股息策略 ETF     | 交易型开放式 (ETF) | 2,800,000.00 | 2,970,800.00 | 4.97 | 否 |
| 9  | 159655 | 华夏标普 500ETF (QDII)  | 交易型开放式 (ETF) | 1,500,000.00 | 2,827,500.00 | 4.73 | 否 |
| 10 | 159569 | 景顺长城国证港股通红利低波动率 ETF | 交易型开放式 (ETF) | 2,000,000.00 | 2,460,000.00 | 4.12 | 否 |
| 11 | 159920 | 华夏恒生 ETF            | 交易型开放式 (ETF) | 1,500,000.00 | 2,020,500.00 | 3.38 | 否 |
| 12 | 159980 | 大成有色金属期货 ETF        | 交易型开放式 (ETF) | 940,000.00   | 1,932,640.00 | 3.23 | 是 |
| 13 | 159909 | 深证 TMT50ETF         | 交易型开放式 (ETF) | 1,100,000.00 | 1,865,600.00 | 3.12 | 否 |
| 14 | 512400 | 南方中证申万有色金属 ETF      | 交易型开放式 (ETF) | 800,000.00   | 1,483,200.00 | 2.48 | 否 |
| 15 | 159625 | 嘉实国证绿色电力 ETF        | 交易型开放式 (ETF) | 1,000,000.00 | 1,200,000.00 | 2.01 | 否 |
| 16 | 588020 | 易方达上证科创板成长 ETF      | 交易型开放式 (ETF) | 300,000.00   | 1,077,900.00 | 1.80 | 否 |

|    |        |                                 |                         |              |              |      |   |
|----|--------|---------------------------------|-------------------------|--------------|--------------|------|---|
| 17 | 159967 | 华夏创成长<br>ETF                    | 交易<br>型开<br>放式<br>(ETF) | 1,000,000.00 | 1,070,000.00 | 1.79 | 否 |
| 18 | 159993 | 龙头券商                            | 交易<br>型开<br>放式<br>(ETF) | 800,000.00   | 980,800.00   | 1.64 | 否 |
| 19 | 588780 | 国联安科创芯<br>片设计 ETF               | 交易<br>型开<br>放式<br>(ETF) | 600,000.00   | 857,400.00   | 1.43 | 否 |
| 20 | 159326 | 华夏中证电网<br>设备主题 ETF              | 交易<br>型开<br>放式<br>(ETF) | 400,000.00   | 835,200.00   | 1.40 | 否 |
| 21 | 516150 | 嘉实中证稀土<br>产业 ETF                | 交易<br>型开<br>放式<br>(ETF) | 400,000.00   | 820,000.00   | 1.37 | 否 |
| 22 | 159750 | 招商中证香港<br>科技<br>ETF(QDII)       | 交易<br>型开<br>放式<br>(ETF) | 1,000,000.00 | 816,000.00   | 1.37 | 否 |
| 23 | 513140 | 华泰柏瑞中证<br>港股通金融服<br>务 ETF(QDII) | 交易<br>型开<br>放式<br>(ETF) | 500,000.00   | 765,000.00   | 1.28 | 否 |
| 24 | 159796 | 汇添富中证电<br>池主题 ETF               | 交易<br>型开<br>放式<br>(ETF) | 600,000.00   | 628,800.00   | 1.05 | 否 |
| 25 | 561600 | 平安中证消费<br>电子主题 ETF              | 交易<br>型开<br>放式<br>(ETF) | 300,000.00   | 616,200.00   | 1.03 | 否 |

|    |        |                            |              |            |            |      |   |
|----|--------|----------------------------|--------------|------------|------------|------|---|
| 26 | 588010 | 博时上证科创板新材料 ETF             | 交易型开放式 (ETF) | 400,000.00 | 600,800.00 | 1.01 | 否 |
| 27 | 513050 | 易方达中证海外中国互联网 50 (QDII-ETF) | 交易型开放式 (ETF) | 500,000.00 | 489,500.00 | 0.82 | 否 |
| 28 | 517120 | 华泰柏瑞中证沪港深创新药产业 ETF         | 交易型开放式 (ETF) | 500,000.00 | 325,500.00 | 0.54 | 否 |
| 29 | 517520 | 黄金股 ETF 永赢                 | 交易型开放式 (ETF) | 200,000.00 | 316,800.00 | 0.53 | 否 |
| 30 | 159981 | 建信能源化工期货 ETF               | 交易型开放式 (ETF) | 200,000.00 | 283,600.00 | 0.47 | 否 |

7.12.3 报告期末基金持有的全部公开募集不动产投资信托基金情况

无。

7.13 投资组合报告附注

7.13.1 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。

7.13.2 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。

7.13.3 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 | 209.76 |
| 6 | 其他应收款 | -      |
| 7 | 待摊费用  | -      |
| 8 | 其他    | -      |
| 9 | 合计    | 209.76 |

7.13.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

无。

7.13.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

无。

7.13.6 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（%） |
| 大成多元配置三个月持有混合（ETF-FOF）A | 183      | 92,832.90 | 574,550.65   | 3.38      | 16,413,870.61 | 96.62     |
| 大成多元配置三个月持有混合（ETF-FOF）C | 467      | 88,204.73 | 1,260,733.44 | 3.06      | 39,930,875.26 | 96.94     |
| 合计                      | 650      | 89,507.74 | 1,835,284.09 | 3.15      | 56,344,745.87 | 96.85     |

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 | 大成多元配置三个月持有混合（ETF-FOF）A | 151,690.73 | 0.8929 |
|                  | 大成多元配置三个月持有混合（ETF-FOF）C | —          | —      |
|                  | 合计                      | 151,690.73 | 0.2607 |

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 | 大成多元配置三个月持有混合（ETF-FOF）A | 0                 |
|                                | 大成多元配置三个月持有混合（ETF-FOF）C | 0                 |
|                                | 合计                      | 0                 |
| 本基金基金经理持有本开放式基金                | 大成多元配置三个月持有混合（ETF-FOF）A | 10~50             |
|                                | 大成多元配置三个月持有混合（ETF-FOF）C | 0                 |
|                                | 合计                      | 10~50             |

## § 9 开放式基金份额变动

单位：份

| 项目                              | 大成多元配置三个月持有混合（ETF-FOF）A | 大成多元配置三个月持有混合（ETF-FOF）C |
|---------------------------------|-------------------------|-------------------------|
| 基金合同生效日（2025 年 10 月 28 日）基金份额总额 | 67,731,725.06           | 151,238,711.19          |
| 本报告期期初基金份额总额                    | 67,863,250.85           | 151,708,659.65          |
| 本报告期基金总申购份额                     | 1,191,594.49            | 2,538,098.57            |
| 减：本报告期基金总赎回份额                   | 52,066,424.08           | 113,055,149.52          |
| 本报告期基金拆分变动份额                    | —                       | —                       |
| 本报告期期末基金份额总额                    | 16,988,421.26           | 41,191,608.70           |

## § 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 本报告期持有的基金发生的重大影响事件

无。

### 10.6 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。

### 10.7 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况

#### 10.7.1 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。

#### 10.7.2 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。

#### 10.7.3 托管人受调查或处罚等情况

无。

10.7.4 托管人相关从业人员受调查或处罚等情况

无。

10.8 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

10.8.1 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      | -    | -                | 135,319.19 | 100.00         | -  |

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。

10.8.2 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 | 30,255,462.12 | 100.00           | -      | -                  | -    | -                | 708,178,441.77 | 100.00           |

|      |  |  |  |  |  |  |  |  |
|------|--|--|--|--|--|--|--|--|
| (山东) |  |  |  |  |  |  |  |  |
|------|--|--|--|--|--|--|--|--|

10.9 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  | 大成多元配置三个月持有期混合型基金中基金（ETF-FOF）（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  | 大成多元配置三个月持有期混合型基金中基金（ETF-FOF）（A 类份额）基金产品资料概要更新 | 中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站 | 2026 年 06 月 30 日 |
| 3  | 2025 年度公募基金管理人以股东身份（通过公募基金持股）参与股东大会投票信息披露      | 中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站 | 2026 年 04 月 30 日 |
| 4  | 大成多元配置三个月持有期混合型基金中基金（ETF-FOF）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  | 大成多元配置三个月持有期混合型基金中基金（ETF-FOF）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 |
| 10 | 大成多元配置三个月持有期混合型基金中基金（ETF-FOF）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多元配置三个月持有期混合型基金中基金（ETF-FOF）的文件；
- 2、《大成多元配置三个月持有期混合型基金中基金（ETF-FOF）基金合同》；
- 3、《大成多元配置三个月持有期混合型基金中基金（ETF-FOF）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