

大成动态量化配置策略混合型证券投资基金

2026 年中期报告

2026 年 6 月 30 日

基金管理人：大成基金管理有限公司

基金托管人：中国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	9
4.1 基金管理人及基金经理情况	9
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	10
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	10
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明	11
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	11
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	12
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	13
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	13
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	13
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	13
§6 半年度财务会计报告（未经审计）	13
6.1 资产负债表	13
6.2 利润表	14
6.3 净资产变动表	16
6.4 报表附注	17
§7 投资组合报告	41
7.1 期末基金资产组合情况	41
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	41
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	42
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	50
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	53
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	53
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	53
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	53

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	53
7.10 本基金投资股指期货的投资政策	53
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	53
7.12 投资组合报告附注	53
§ 8 基金份额持有人信息.....	54
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	54
8.2 盈利投资者数量占比	55
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	55
8.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况	55
§ 9 开放式基金份额变动.....	55
§ 10 重大事件揭示	56
10.1 基金份额持有人大会决议	56
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	56
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	56
10.4 基金投资策略的改变	56
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	56
10.6 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况	56
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	57
10.8 其他重大事件	59
§ 11 影响投资者决策的其他重要信息	60
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	60
11.2 影响投资者决策的其他重要信息	60
§ 12 备查文件目录	60
12.1 备查文件目录	60
12.2 存放地点	60
12.3 查阅方式	60

§ 1 基金简介

1.1 基金基本情况

基金名称	大成动态量化配置策略混合型证券投资基金	
基金简称	大成动态量化配置策略混合	
基金主代码	003147	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2016 年 9 月 20 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	65,056,966.18 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	大成动态量化配置策略混合 A	大成动态量化配置策略混合 C
下属分级基金的交易代码	003147	015526
报告期末下属分级基金的份额总额	29,539,822.89 份	35,517,143.29 份

1.2 基金产品说明

投资目标	本基金运用量化投资策略进行资产配置和股票投资，并通过数学建模的方式根据宏观经济变量以及风险预警指标动态调整资产配置的比例，在有效控制风险的前提下追求基金资产长期稳定增长。
投资策略	本基金将通过量化建模的方式综合分析和持续跟踪基本面、政策面、市场面等多方面因素，对宏观经济、国家政策、资金面和市场情绪等影响证券市场的重要因素进行深入分析，确定当前市场环境下的主要投资方向和资产配置比例。同时，量化模型通过持续跟踪宏观经济变量、风险预警指标等，判断不同资产类别在当前市场环境下的风险收益状态，根据市场环境变化时，动态调整投资组合结构、各类资产配置比例。
业绩比较基准	沪深 300 指数收益率×50%+中债综合指数收益率×50%
风险收益特征	本基金是混合型基金，其预期收益及风险水平低于股票型基金，高于货币市场基金与债券型基金，属于风险水平中高的基金。

1.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		大成基金管理有限公司	中国农业银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	段皓静	任航
	联系电话	0755-83183388	010-66060069
	电子邮箱	office@dcfund.com.cn	tgxxpl@abchina.com
客户服务电话		4008885558	95599
传真		0755-83199588	010-68121816

注册地址	广东省深圳市南山区海德三道 1236 号大成基金总部大厦 5 层、27-33 层	北京市东城区建国门内大街 69 号
办公地址	广东省深圳市南山区海德三道 1236 号大成基金总部大厦 5 层、27-33 层	北京市西城区复兴门内大街 28 号凯晨世贸中心东座 F9
邮政编码	518054	100031
法定代表人	吴庆斌	谷澍

1.4 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

1.5 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

§ 2 主要财务指标和基金净值表现

2.1 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)	
	大成动态量化配置策略混合 A	大成动态量化配置策略混合 C
本期已实现收益	6,748,756.39	7,967,816.39
本期利润	5,758,234.08	5,745,293.45
加权平均基金份额本期利润	0.1656	0.1351
本期加权平均净值利润率	10.27%	8.55%
本期基金份额净值增长率	13.46%	13.23%
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	12,437,172.77	14,118,779.05
期末可供分配基金份额利润	0.4210	0.3975
期末基金资产净值	49,724,213.25	58,690,111.31
期末基金份额净值	1.6833	1.6524
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	68.33%	9.90%

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。

2.2 基金净值表现

2.2.1 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

大成动态量化配置策略混合 A

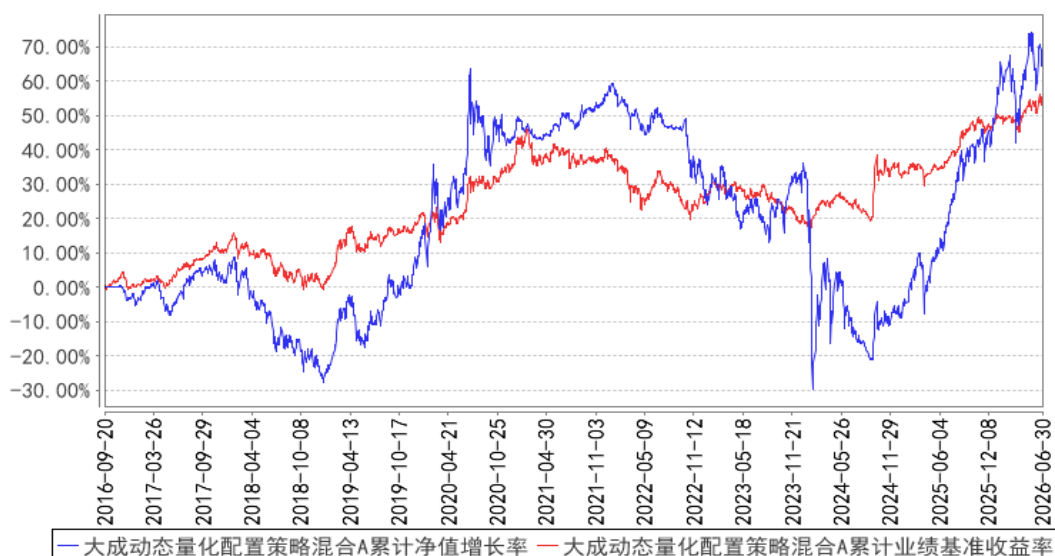
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①－③	②－④
过去三个月	13.00%	1.52%	6.53%	0.63%	6.47%	0.89%
过去六个月	13.46%	1.58%	4.94%	0.57%	8.52%	1.01%
过去一年	42.77%	1.32%	13.75%	0.51%	29.02%	0.81%
过去三年	34.52%	1.94%	22.33%	0.55%	12.19%	1.39%
过去五年	11.82%	1.58%	10.44%	0.55%	1.38%	1.03%
过去七年	87.74%	1.52%	35.55%	0.58%	52.19%	0.94%
自基金合同生效起至今	68.33%	1.41%	54.98%	0.57%	13.35%	0.84%

大成动态量化配置策略混合 C

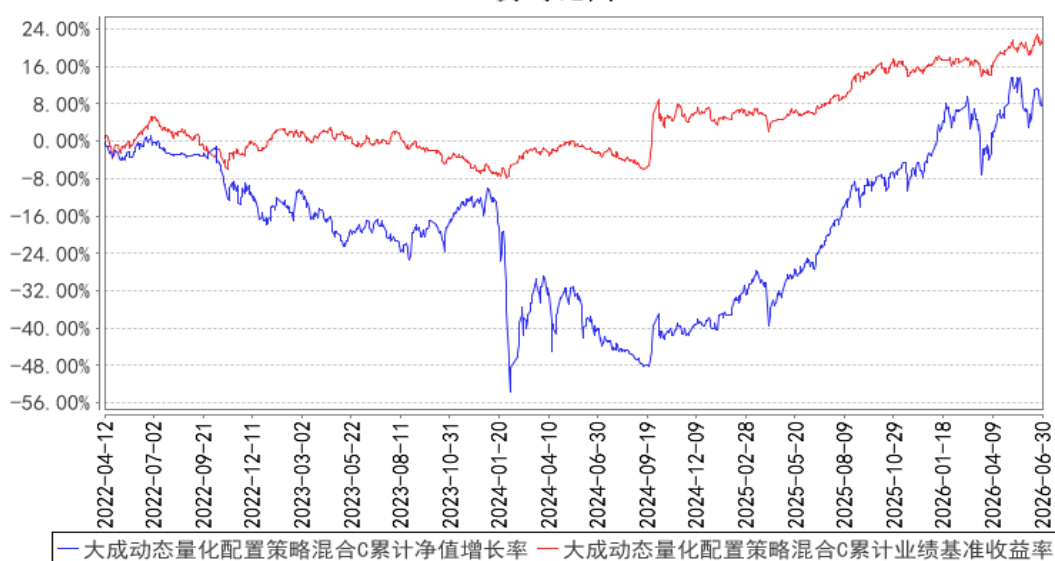
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①－③	②－④
过去三个月	12.89%	1.52%	6.53%	0.63%	6.36%	0.89%
过去六个月	13.23%	1.58%	4.94%	0.57%	8.29%	1.01%
过去一年	42.20%	1.32%	13.75%	0.51%	28.45%	0.81%
过去三年	32.94%	1.94%	22.33%	0.55%	10.61%	1.39%
自基金合同生效起至今	9.90%	1.70%	21.83%	0.54%	-11.93%	1.16%

2.2.2 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

大成动态量化配置策略混合A累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



大成动态量化配置策略混合C累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：1、本基金合同规定，基金管理人应当自基金合同生效之日起六个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的约定。建仓期结束时，本基金的投资组合比例符合基金合同的约定。

2、本基金自 2022 年 4 月 8 日起增设 C 类基金份额类别，C 类的净值增长率和业绩比较基准收益率自 2022 年 4 月 12 日 C 类有份额起开始计算。

§ 3 管理人报告

3.1 基金管理人及基金经理情况

3.1.1 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。

3.1.2 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		
夏高	本基金基金经理，指数与期货投资部副总监	2023 年 4 月 14 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。

3.1.3 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。

3.2 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。

3.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

3.3.1 公平交易制度的执行情况

报告期内，公司严格执行了公平交易的原则和制度。公司运用统计分析和工具，对旗下所有投资组合连续 4 个季度的日内、3 日内、5 日内及 10 日内股票及债券交易同向交易价差进行分析，针对同一基金经理管理的多个投资组合及公私募兼任基金经理管理的多个投资组合的投资交易行为加强了公平交易监测与分析，包括对不同时间窗下（同日、3 日、5 日、10 日）反向交

易和同向交易价差监控的分析。分析结果表明：债券交易同向交易频率较低；部分股票同向交易溢价率较大主要来源于投资策略差异、市场因素（如个股当日价格振幅较高）及组合经理交易时机选择，同时结合交易价差专项统计分析，未发现违反公平交易原则的异常情况。

3.3.2 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。

3.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

3.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2026 年上半年，A 股市场呈现明显的结构性分化特征。一月份，市场延续去年底的涨势，继续上行，有色金属、石油石化、建材、基础化工和传媒等行业领涨，银行、非银行金融和交通运输等行业出现一定回撤。二月份，市场的分化加大，钢铁、建材、机械和煤炭等行业涨幅明显，非银行金融、银行、传媒、消费者服务和商贸零售等行业有所下行。三月份，市场调整压力增大，多数行业出现调整，仅少数行业略有上涨。四月份，在经过一季度的调整之后，科技板块开始再度活跃，电子、通信、计算机、机械和基础化工等行业涨幅突出，消费者服务、食品饮料和交通运输等行业小幅回撤。五月份，科技板块震荡上行，分化有所扩大，通信、电子和电力等少数行业表现亮眼，其他多数行业以调整为主。六月份，市场分化持续扩大，电子、通信和建材等少数行业领涨，多数行业继续调整。整体来看，在上半年，上证综指上涨 3.16%，沪深 300 指数上涨 7.55%，中证 500 指数上涨 20.97%，中证 1000 指数上涨 15.99%，中证 2000 指数上涨 9.10%。在本报告期内，本基金战胜了业绩比较基准。

3.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末大成动态量化配置策略混合 A 的基金份额净值为 1.6833 元，本报告期基金份额净值增长率为 13.46%，同期业绩比较基准收益率为 4.94%；截至本报告期末大成动态量化配置策略混合 C 的基金份额净值为 1.6524 元，本报告期基金份额净值增长率为 13.23%，同期业绩比较基准收益率为 4.94%。

3.5 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。本基金将继续研究优化

A 股市场的量化投资策略，力争在风险可控的前提下为持有人创造长期投资价值。

3.6 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。

3.7 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。

3.8 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。

§ 4 托管人报告

4.1 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。

4.2 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。

4.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

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

§ 5 半年度财务会计报告（未经审计）

5.1 资产负债表

会计主体：大成动态量化配置策略混合型证券投资基金

报告截止日：2026 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2026 年 6 月 30 日	上年度末 2025 年 12 月 31 日
资 产：			
货币资金	6.4.7.1	7,926,932.71	6,648,140.53
结算备付金		1,233,851.55	405,802.92
存出保证金		495,293.50	217,930.06
交易性金融资产	6.4.7.2	98,358,561.23	89,183,659.42
其中：股票投资		98,358,561.23	89,183,659.42
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		1,384,308.80	-
应收股利		-	-
应收申购款		231,385.50	2,472,981.00
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.8	-	2,790.01
资产总计		109,630,333.29	98,931,303.94
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		217,751.69	2,032,424.69
应付赎回款		654,097.86	387,750.37
应付管理人报酬		53,169.09	40,426.90
应付托管费		13,292.29	10,106.72
应付销售服务费		17,828.49	15,847.15
应付投资顾问费		-	-
应交税费		7,985.71	634.15
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.9	251,883.60	99,227.06
负债合计		1,216,008.73	2,586,417.04
净资产:			
实收基金	6.4.7.10	65,056,966.18	65,545,922.02
未分配利润	6.4.7.12	43,357,358.38	30,798,964.88
净资产合计		108,414,324.56	96,344,886.90
负债和净资产总计		109,630,333.29	98,931,303.94

注：报告截止日 2026 年 6 月 30 日，基金份额总额 65,056,966.18 份。其中大成动态量化配置策略混合 A 类基金份额总额为 29,539,822.89 份，基金份额净值 1.6833 元；大成动态量化配置策略混合 C 类基金份额总额为 35,517,143.29 份，基金份额净值 1.6524 元。

5.2 利润表

会计主体：大成动态量化配置策略混合型证券投资基金

本报告期：2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日

单位：人民币元

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

		2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日	2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
一、营业总收入		12,156,837.64	5,390,618.34
1. 利息收入		19,646.46	5,171.59
其中：存款利息收入	6.4.7.13	19,646.46	5,171.59
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）		15,018,338.16	5,298,989.54
其中：股票投资收益	6.4.7.14	14,134,472.38	5,169,534.72
基金投资收益	6.4.7.15	-	-
债券投资收益	6.4.7.16	44,299.91	-1,898.61
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	406,802.35	-7,880.93
股利收益	6.4.7.20	432,763.52	139,234.36
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	-3,213,045.25	31,796.39
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	331,898.27	54,660.82
减：二、营业总支出		653,310.11	118,493.89
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	368,295.36	73,147.65
2. 托管费	6.4.10.2.2	92,073.91	18,286.94
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	134,386.25	25,056.02
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		1,465.30	-
8. 其他费用	6.4.7.24	57,089.29	2,003.28

三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		11,503,527.53	5,272,124.45
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		11,503,527.53	5,272,124.45
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		11,503,527.53	5,272,124.45

5.3 净资产变动表

会计主体：大成动态量化配置策略混合型证券投资基金

本报告期：2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	65,545,922.02	-	30,798,964.88	96,344,886.90
二、本期期初净资产	65,545,922.02	-	30,798,964.88	96,344,886.90
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-488,955.84	-	12,558,393.50	12,069,437.66
（一）、综合收益总额	-	-	11,503,527.53	11,503,527.53
（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）	-488,955.84	-	1,054,865.97	565,910.13
其中：1. 基金申购款	118,672,227.86	-	70,875,045.54	189,547,273.40
2. 基金赎回款	-119,161,183.70	-	-69,820,179.57	-188,981,363.27
（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	65,056,966.18	-	43,357,358.38	108,414,324.56

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	26,838,912.24	-	-1,805,831.57	25,033,080.67
二、本期期初净资产	26,838,912.24	-	-1,805,831.57	25,033,080.67
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-3,415,269.86	-	5,787,446.46	2,372,176.60
（一）、综合收益总额	-	-	5,272,124.45	5,272,124.45
（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）	-3,415,269.86	-	515,322.01	-2,899,947.85
其中：1. 基金申购款	22,286,423.61	-	1,075,686.07	23,362,109.68
2. 基金赎回款	-25,701,693.47	-	-560,364.06	-26,262,057.53
（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	23,423,642.38	-	3,981,614.89	27,405,257.27

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署：

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

5.4 报表附注

5.4.1 基金基本情况

大成动态量化配置策略混合型证券投资基金(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[2016]1630 号《关于准予大成动态量化配置策略混合型证

券投资基金注册的批复》注册，由大成基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《大成动态量化配置策略混合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 560,377,352.03 元，业经普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)普华永道中天验字(2016)第 1173 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《大成动态量化配置策略混合型证券投资基金基金合同》于 2016 年 9 月 20 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 560,560,675.30 份基金份额，其中认购资金利息折合 183,323.27 份基金份额。本基金的基金管理人为大成基金管理有限公司，基金托管人为中国农业银行股份有限公司。

根据本基金的基金管理人大成基金管理有限公司于 2022 年 4 月 8 日发布的《关于大成动态量化配置策略混合型证券投资基金增设 C 类基金份额并相应修订基金合同和托管协议的公告》以及修改后的《大成动态量化配置策略混合型证券投资基金基金合同》，自 2022 年 4 月 8 日起，本基金增设 C 类基金份额，原有基金份额转为 A 类基金份额。其中，在投资人申购时收取申购费用、但不从本类别基金资产中计提销售服务费的，称为 A 类基金份额；在投资人申购时不收取申购费用，但从本类别基金资产中计提销售服务费的，称为 C 类基金份额。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《大成动态量化配置策略混合型证券投资基金基金合同》的规定，本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的股票(包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票)、存托凭证等权益类金融工具、债券等固定收益类金融工具(包括国债、央行票据、金融债、企业债、公司债、次级债、中小企业私募债、地方政府债券、中期票据、可转换债券(含分离交易可转债)、短期融资券、超级短期融资券、资产支持证券、债券回购等)、货币市场工具、银行存款、国债期货、权证、股指期货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(但须符合中国证监会相关规定)。本基金的投资组合比例为：股票、存托凭证等权益类资产占基金资产的比例不低于 10%；每个交易日日终在扣除股指期货合约和国债期货合约需缴纳的交易保证金后，应当保持现金(不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等)或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%，权证及其他金融工具的投资比例依照法律法规或监管机构的规定执行。本基金的业绩比较基准为：沪深 300 指数收益率×50%+中债综合指数收益率×50%。

5.4.2 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。

5.4.3 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。

5.4.4 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。

5.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

5.4.5.1 会计政策变更的说明

无。

5.4.5.2 会计估计变更的说明

无。

5.4.5.3 差错更正的说明

无。

5.4.6 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。

5.4.7 重要财务报表项目的说明

5.4.7.1 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	7,926,932.71
等于：本金	7,926,089.85
加：应计利息	842.86
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	7,926,932.71

5.4.7.2 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	101,892,254.70	-	98,358,561.23	-3,533,693.47
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	101,892,254.70	-	98,358,561.23	-3,533,693.47

5.4.7.3 衍生金融资产/负债

5.4.7.3.1 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	3,221,680.00	-	-	-
其中：股指期货投资	3,221,680.00	-	-	-
其他衍生工具	-	-	-	-
合计	3,221,680.00	-	-	-

5.4.7.3.2 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
IM2607	IM2607	1.00	1,737,920.00	106,360.00
IM2609	IM2609	1.00	1,697,000.00	106,880.00
合计				213,240.00
减：可抵销期货暂收款				213,240.00
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。

5.4.7.3.3 期末基金持有的黄金衍生品情况

无。

5.4.7.4 买入返售金融资产

5.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

无。

5.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

无。

5.4.7.4.3 按预期信用损失一般模型计提减值准备的说明

无。

5.4.7.5 债权投资

5.4.7.5.1 债权投资情况

无。

5.4.7.5.2 债权投资减值准备计提情况

无。

5.4.7.6 其他债权投资

5.4.7.6.1 其他债权投资情况

无。

5.4.7.6.2 其他债权投资减值准备计提情况

无。

5.4.7.7 其他权益工具投资

5.4.7.7.1 其他权益工具投资情况

无。

5.4.7.7.2 报告期末其他权益工具投资情况

无。

5.4.7.8 其他资产

无。

5.4.7.9 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	666.34
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	197,661.17
其中：交易所市场	197,661.17
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用	53,556.09
合计	251,883.60

5.4.7.10 实收基金

金额单位：人民币元

大成动态量化配置策略混合 A

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	28,577,241.89	28,577,241.89
本期申购	32,957,163.63	32,957,163.63
本期赎回（以“-”号填列）	-31,994,582.63	-31,994,582.63
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	29,539,822.89	29,539,822.89

大成动态量化配置策略混合 C

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	36,968,680.13	36,968,680.13
本期申购	85,715,064.23	85,715,064.23
本期赎回（以“-”号填列）	-87,166,601.07	-87,166,601.07
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	35,517,143.29	35,517,143.29

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)。

5.4.7.11 其他综合收益

无。

5.4.7.12 未分配利润

单位：人民币元

大成动态量化配置策略混合 A

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	6,220,647.32	7,599,023.75	13,819,671.07
本期期初	6,220,647.32	7,599,023.75	13,819,671.07
本期利润	6,748,756.39	-990,522.31	5,758,234.08
本期基金份额交易产生的变动数	-532,230.94	1,138,716.15	606,485.21
其中：基金申购款	10,441,798.27	9,921,551.18	20,363,349.45
基金赎回款	-10,974,029.21	-8,782,835.03	-19,756,864.24
本期已分配利润	-	-	-
本期末	12,437,172.77	7,747,217.59	20,184,390.36

大成动态量化配置策略混合 C

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	7,423,405.13	9,555,888.68	16,979,293.81
本期期初	7,423,405.13	9,555,888.68	16,979,293.81
本期利润	7,967,816.39	-2,222,522.94	5,745,293.45
本期基金份额交易产生的变动数	-1,272,442.47	1,720,823.23	448,380.76
其中：基金申购款	26,136,924.40	24,374,771.69	50,511,696.09
基金赎回款	-27,409,366.87	-22,653,948.46	-50,063,315.33
本期已分配利润	-	-	-
本期末	14,118,779.05	9,054,188.97	23,172,968.02

5.4.7.13 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	16,010.40
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	-
结算备付金利息收入	3,499.60
其他	136.46
合计	19,646.46

5.4.7.14 股票投资收益

5.4.7.14.1 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	14,134,472.38
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	14,134,472.38

5.4.7.14.2 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	518,553,310.24
减：卖出股票成本总额	503,621,528.38
减：交易费用	797,309.48
买卖股票差价收入	14,134,472.38

5.4.7.14.3 股票投资收益——证券出借差价收入

无。

5.4.7.15 基金投资收益

无。

5.4.7.16 债券投资收益

5.4.7.16.1 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	3.39
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	44,296.52
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	44,299.91

5.4.7.16.2 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	83,003.26
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	38,700.00
减：应计利息总额	3.39
减：交易费用	3.35
买卖债券差价收入	44,296.52

5.4.7.16.3 债券投资收益——赎回差价收入

无。

5.4.7.16.4 债券投资收益——申购差价收入

无。

5.4.7.17 资产支持证券投资收益

5.4.7.17.1 资产支持证券投资收益项目构成

无。

5.4.7.17.2 资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入

无。

5.4.7.17.3 资产支持证券投资收益——赎回差价收入

无。

5.4.7.17.4 资产支持证券投资收益——申购差价收入

无。

5.4.7.18 贵金属投资收益

5.4.7.18.1 贵金属投资收益项目构成

无。

5.4.7.18.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

无。

5.4.7.18.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

无。

5.4.7.18.4 贵金属投资收益——申购差价收入

无。

5.4.7.19 衍生工具收益

5.4.7.19.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

无。

5.4.7.19.2 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	406,802.35

5.4.7.20 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	432,763.52
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	432,763.52

5.4.7.21 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	-3,353,965.25
股票投资	-3,353,965.25

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	140,920.00
权证投资	-
期货投资	140,920.00
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	-3,213,045.25

5.4.7.22 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	318,857.89
基金转换费收入	13,040.38
合计	331,898.27

5.4.7.23 信用减值损失

无。

5.4.7.24 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	13,884.51
信息披露费	39,671.58
证券出借违约金	-
银行划款手续费	3,533.20
合计	57,089.29

5.4.7.25 分部报告

无。

5.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

5.4.8.1 或有事项

无。

5.4.8.2 资产负债表日后事项

无。

5.4.9 关联方、关联关系

5.4.9.1 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。

5.4.9.2 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。

5.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

5.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

5.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日	
	成交金 额	占当期股票 成交总额的 比例（%）	成交金额	占当期股票 成交总额的比例（%）
光大证券	-	-	33,804,564.64	16.58

5.4.10.1.2 债券交易

无。

5.4.10.1.3 债券回购交易

无。

5.4.10.1.4 基金交易

无。

5.4.10.1.5 权证交易

无。

5.4.10.1.6 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日			
	当期 佣金	占当期佣金总量 的比例（%）	期末应付佣金余 额	占期末应付佣金 总额的比例 （%）

-	-	-	-	-
关联方名称	上年度可比期间 2025年1月1日至2025年6月30日			
	当期 佣金	占当期佣金总量 的比例（%）	期末应付佣金余 额	占期末应付佣金 总额的比例 （%）
光大证券	15,414.80	16.58	1,580.46	5.27

注：1、上述佣金按协议约定的佣金率计算，佣金费率参考市场价格经本基金的基金管理人与对方协商确定；

2、根据《公开募集证券投资基金证券交易费用管理规定》，自 2024 年 7 月 1 日起，基金管理人管理的被动股票型基金的股票交易佣金费率原则上不得超过市场平均股票交易佣金费率，且不得通过交易佣金支付研究服务、流动性服务等其他费用；其他类型基金可以通过交易佣金支付研究服务费用，但股票交易佣金费率原则上不得超过市场平均股票交易佣金费率的两倍，且不得通过交易佣金支付研究服务之外的其他费用。

5.4.10.2 关联方报酬

5.4.10.2.1 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	368,295.36	73,147.65
其中：应支付销售机构的客户维护费	169,264.26	30,990.03
应支付基金管理人的净管理费	199,031.10	42,157.62

注：本基金管理费年费率为 0.60%，每日计提，按月支付。其计算公式为：

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

5.4.10.2.2 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	92,073.91	18,286.94

注：本基金托管费年费率为 0.15%，每日计提，按月支付。其计算公式为：

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

5.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

	本期
--	----

获得销售服务费的各关联方名称	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		
	大成动态量化配置策略混合 A	大成动态量化配置策略混合 C	合计
大成基金	-	1,247.08	1,247.08
合计	-	1,247.08	1,247.08
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		
	大成动态量化配置策略混合 A	大成动态量化配置策略混合 C	合计
大成基金	-	104.63	104.63
合计	-	104.63	104.63

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

5.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

无。

5.4.10.4 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

5.4.10.4.1 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。

5.4.10.4.2 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。

5.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

5.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

份额单位：份

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

	大成动态量化配置策略混合 A	大成动态量化配置策略混合 C
基金合同生效日 （ 2016 年 9 月 20 日）持有的基 金份额	—	—
报告期初持有的 基金份额	—	—
报告期间申购/ 买入总份额	—	—
报告期间因拆分 变动份额	—	—
减：报告期间赎 回/卖出总份额	—	—
报告期末持有的 基金份额	—	—
报告期末持有的 基金份额 占基金总份额比 例	—	—
项目	上年度可比期间 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日	
	大成动态量化配置策略混合 A	大成动态量化配置策略混合 C
基金合同生效日 （ 2016 年 9 月 20 日）持有的基 金份额	—	—
报告期初持有的 基金份额	—	6,849.32
报告期间申购/ 买入总份额	—	—
报告期间因拆分 变动份额	—	—
减：报告期间赎 回/卖出总份额	—	6,849.32
报告期末持有的 基金份额	—	—
报告期末持有的 基金份额 占基金总份额比 例	—	—

注：基金管理人大成基金投资本基金适用的交易费率与本基金法律文件规定一致。

5.4.10.5.2 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。

5.4.10.6 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	7,926,932.71	16,010.40	2,325,003.04	3,973.87

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。

5.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

无。

5.4.10.8 其他关联交易事项的说明

无。

5.4.11 利润分配情况

无。

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

5.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

6.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	受限期	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量（单位：股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
001248	华润新能源	2026 年 6 月 25 日	1 个月内（含）	新股未上市	10.11	10.11	1,500	15,165.00	15,165.00	-
001257	盛龙股份	2026 年 3 月 24 日	6 个月	新股锁定	7.82	20.74	621	4,856.22	12,879.54	-
001312	福恩股份	2026 年 4 月 14 日	6 个月	新股锁定	18.38	16.78	46	845.48	771.88	-
603284	林平发展	2026 年 2 月 3 日	6 个月	新股锁定	37.88	34.87	19	719.72	662.53	-

603293	埃泰克	2026 年 4 月 9 日	6 个月	新股 锁定	33.49	33.93	23	770.27	780.39	-
603459	红板科技	2026 年 3 月 31 日	6 个月	新股 锁定	17.70	84.32	85	1,504.50	7,167.20	-
688712	北芯生命	2026 年 1 月 28 日	6 个月	新股 锁定	17.52	35.92	64	1,121.28	2,298.88	-
688781	视涯科技	2026 年 3 月 18 日	6 个月	新股 锁定	22.68	47.61	49	1,111.32	2,332.89	-
688808	联讯仪器	2026 年 4 月 16 日	6 个月	新股 锁定	81.88	1,584.33	31	2,538.28	49,114.23	-
688811	有研复材	2026 年 4 月 1 日	6 个月	新股 锁定	6.41	24.13	397	2,544.77	9,579.61	-
688813	泰金新能	2026 年 3 月 24 日	6 个月	新股 锁定	26.28	172.09	113	2,969.64	19,446.17	-
688816	易思维	2026 年 2 月 4 日	6 个月	新股 锁定	55.95	57.10	41	2,293.95	2,341.10	-
688818	电科蓝天	2026 年 2 月 3 日	6 个月	新股 锁定	9.47	70.14	295	2,793.65	20,691.30	-
688820	盛合晶微	2026 年 4 月 13 日	6 个月	新股 锁定	19.68	141.49	181	3,562.08	25,609.69	-

5.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

无。

5.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

5.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

无。

5.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

无。

5.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

无。

5.4.13 金融工具风险及管理

5.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金是混合型基金，其预期收益及风险水平高于货币市场基金和债券型基金，低于股票型基金，属于中高收益风险特征的基金。本基金运用量化投资策略进行资产配置和股票投资，并通过数学建模的方式根据宏观经济变量以及风险预警指标动态调整资产配置的比例，在有效控制风险的前提下追求基金资产长期稳定增长。

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。

5.4.13.2 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)。

5.4.13.3 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。

5.4.13.3.1 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。

5.4.13.4 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。

5.4.13.4.1 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。

5.4.13.4.1.1 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	7,926,932.71	-	-	-	7,926,932.71
结算备付金	1,233,851.55	-	-	-	1,233,851.55
存出保证金	83,103.10	-	-	412,190.40	495,293.50
交易性金融资产	-	-	-	98,358,561.23	98,358,561.23
应收申购款	-	-	-	231,385.50	231,385.50
应收清算款	-	-	-	1,384,308.80	1,384,308.80
资产总计	9,243,887.36	-	-	100,386,445.93	109,630,333.29
负债					
应付赎回款	-	-	-	654,097.86	654,097.86
应付管理人报酬	-	-	-	53,169.09	53,169.09
应付托管费	-	-	-	13,292.29	13,292.29
应付清算款	-	-	-	217,751.69	217,751.69
应付销售服务费	-	-	-	17,828.49	17,828.49
应交税费	-	-	-	7,985.71	7,985.71
其他负债	-	-	-	251,883.60	251,883.60
负债总计	-	-	-	1,216,008.73	1,216,008.73
利率敏感度缺口	9,243,887.36	-	-	99,170,437.20	108,414,324.56
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	6,648,140.53	-	-	-	6,648,140.53
结算备付金	405,802.92	-	-	-	405,802.92
存出保证金	45,019.66	-	-	172,910.40	217,930.06
交易性金融资产	-	-	-	89,183,659.42	89,183,659.42
应收申购款	-	-	-	2,472,981.00	2,472,981.00
其他资产	-	-	-	2,790.01	2,790.01
资产总计	7,098,963.11	-	-	91,832,340.83	98,931,303.94
负债					
应付赎回款	-	-	-	387,750.37	387,750.37
应付管理人报酬	-	-	-	40,426.90	40,426.90
应付托管费	-	-	-	10,106.72	10,106.72
应付清算款	-	-	-	2,032,424.69	2,032,424.69
应付销售服务费	-	-	-	15,847.15	15,847.15
应交税费	-	-	-	634.15	634.15
其他负债	-	-	-	99,227.06	99,227.06
负债总计	-	-	-	2,586,417.04	2,586,417.04
利率敏感度缺口	7,098,963.11	-	-	89,245,923.79	96,344,886.90

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。

5.4.13.4.1.2 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）。

5.4.13.4.2 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。

5.4.13.4.3 其他价格风险

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

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

本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险。股票、存托凭证等权益类资产占基金资产

的比例不低于 10%；每个交易日日终在扣除股指期货合约和国债期货合约需缴纳的交易保证金后，应当保持现金(不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等)或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%。此外，本基金的基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控，定期运用多种定量方法对基金进行风险度量，包括 VaR(Value at Risk)指标等来测试本基金面临的潜在价格风险，及时可靠地对风险进行跟踪和控制。

5.4.13.4.3.1 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	98,358,561.23	90.72	89,183,659.42	92.57
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	98,358,561.23	90.72	89,183,659.42	92.57

5.4.13.4.3.2 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%	10,820,999.06	10,529,714.81
	业绩比较基准下降 5%	-10,820,999.06	-10,529,714.81

5.4.14 公允价值

5.4.14.1 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。

5. 4. 14. 2 持续的以公允价值计量的金融工具

5. 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	98, 189, 720. 82	89, 183, 659. 42
第二层次	15, 165. 00	-
第三层次	153, 675. 41	-
合计	98, 358, 561. 23	89, 183, 659. 42

5. 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。

5. 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)。

5. 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。

5. 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。

§ 6 投资组合报告

6.1 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	98,358,561.23	89.72
	其中：股票	98,358,561.23	89.72
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	9,160,784.26	8.36
8	其他各项资产	2,110,987.80	1.93
9	合计	109,630,333.29	100.00

6.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

6.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	162,309.00	0.15
B	采矿业	1,244,350.54	1.15
C	制造业	73,667,629.78	67.95
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	1,837,633.00	1.70
E	建筑业	1,513,595.00	1.40
F	批发和零售业	2,303,964.00	2.13
G	交通运输、仓储和邮政业	131,777.00	0.12
H	住宿和餐饮业	684,000.00	0.63
I	信息传输、软件和信息技术服务业	5,814,019.31	5.36
J	金融业	780,450.00	0.72
K	房地产业	2,073,301.00	1.91
L	租赁和商务服务业	2,413,079.00	2.23
M	科学研究和技术服务业	2,877,665.60	2.65
N	水利、环境和公共设施管理业	764,295.00	0.70

O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	343,170.00	0.32
R	文化、体育和娱乐业	1,172,780.00	1.08
S	综合	574,543.00	0.53
	合计	98,358,561.23	90.72

6.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

无。

6.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量 (股)	公允价值 (元)	占基金资产净值比例 (%)
1	300786	国林科技	40,000	1,002,800.00	0.92
2	603519	立霸股份	64,200	982,260.00	0.91
3	603186	华正新材	4,300	968,790.00	0.89
4	300909	汇创达	16,600	966,452.00	0.89
5	301280	珠城科技	18,680	944,647.60	0.87
6	603124	江南新材	4,900	916,202.00	0.85
7	002803	吉宏股份	35,400	914,736.00	0.84
8	300700	岱勒新材	42,800	910,784.00	0.84
9	688090	瑞松科技	8,340	887,793.00	0.82
10	301321	翰博高新	20,100	887,415.00	0.82
11	688609	九联科技	80,400	885,204.00	0.82
12	000922	佳电股份	61,320	856,027.20	0.79
13	605289	罗曼股份	5,900	855,500.00	0.79
14	002849	威星智能	49,800	842,616.00	0.78
15	002154	报喜鸟	234,500	834,820.00	0.77
16	603726	朗迪集团	24,000	822,000.00	0.76
17	688238	和元生物	147,400	798,908.00	0.74
18	601860	紫金银行	322,500	780,450.00	0.72
19	600325	华发股份	334,400	772,464.00	0.71
20	301169	零点有数	10,700	756,062.00	0.70
21	300681	英搏尔	26,000	744,120.00	0.69
22	002250	联化科技	54,400	743,648.00	0.69
23	301326	捷邦科技	5,200	724,724.00	0.67
24	603689	皖天然气	104,100	721,413.00	0.67
25	600558	大西洋	144,700	714,818.00	0.66
26	600123	兰花科创	133,400	712,356.00	0.66
27	003012	东鹏控股	161,200	702,832.00	0.65
28	688246	嘉和美康	34,190	702,604.50	0.65
29	300775	三角防务	31,700	698,668.00	0.64

30	300475	香农芯创	2,300	690,000.00	0.64
31	000428	华天酒店	225,000	684,000.00	0.63
32	603020	爱普股份	47,700	672,570.00	0.62
33	301086	鸿富瀚	3,200	669,696.00	0.62
34	002818	富森美	63,400	658,726.00	0.61
35	002899	英派斯	29,000	632,200.00	0.58
36	002206	海利得	121,400	627,638.00	0.58
37	300938	信测标准	12,400	618,512.00	0.57
38	001389	广合科技	2,600	616,850.00	0.57
39	300806	斯迪克	5,500	616,000.00	0.57
40	300756	金马游乐	18,620	615,391.00	0.57
41	603150	万朗磁塑	8,600	608,880.00	0.56
42	688030	山石网科	38,341	605,404.39	0.56
43	603998	方盛制药	66,200	597,786.00	0.55
44	603867	新化股份	17,700	592,773.00	0.55
45	002079	苏州固锝	39,400	592,182.00	0.55
46	002972	科安达	30,000	586,800.00	0.54
47	688378	奥来德	9,400	582,800.00	0.54
48	300416	苏试试验	28,300	576,754.00	0.53
49	300767	震安科技	25,800	575,082.00	0.53
50	300745	欣锐科技	13,500	569,970.00	0.53
51	001359	平安电工	4,510	564,877.50	0.52
52	300572	安车检测	19,400	550,378.00	0.51
53	002643	万润股份	25,600	536,320.00	0.49
54	600502	安徽建工	120,600	524,610.00	0.48
55	688096	京源环保	37,900	506,344.00	0.47
56	603626	科森科技	26,700	493,950.00	0.46
57	300596	利安隆	9,400	493,312.00	0.46
58	300055	万邦达	75,700	486,751.00	0.45
59	002484	江海股份	4,600	483,000.00	0.45
60	002955	鸿合科技	13,400	479,050.00	0.44
61	603012	创力集团	57,600	472,320.00	0.44
62	301062	上海艾录	82,400	470,504.00	0.43
63	300843	胜蓝股份	3,000	468,750.00	0.43
64	688218	江苏北人	8,400	461,664.00	0.43
65	301227	森鹰窗业	18,220	459,326.20	0.42
66	603660	苏州科达	37,300	456,925.00	0.42
67	301002	崧盛股份	11,700	451,620.00	0.42
68	688680	海优新材	10,500	441,000.00	0.41
69	002763	汇洁股份	64,500	437,955.00	0.40
70	688299	长阳科技	25,975	434,042.25	0.40
71	603010	万盛股份	23,800	431,256.00	0.40
72	688388	嘉元科技	9,670	425,480.00	0.39

73	688275	万润新能	3,300	420,915.00	0.39
74	688667	菱电电控	3,100	414,315.00	0.38
75	000802	北京文化	118,600	412,728.00	0.38
76	603990	麦迪科技	19,200	408,768.00	0.38
77	600226	亨通股份	42,600	408,534.00	0.38
78	603878	武进不锈	78,700	404,518.00	0.37
79	603058	永吉股份	46,400	404,144.00	0.37
80	600094	大名城	116,800	404,128.00	0.37
81	300996	普联软件	37,040	403,365.60	0.37
82	688215	瑞晟智能	10,036	403,045.76	0.37
83	600189	泉阳泉	53,100	399,843.00	0.37
84	300132	青松股份	70,100	398,168.00	0.37
85	603701	德宏股份	18,100	397,838.00	0.37
86	605168	三人行	7,800	394,992.00	0.36
87	688373	盟科药业	87,100	394,563.00	0.36
88	301045	天禄科技	4,400	391,952.00	0.36
89	603863	松炘资源	31,300	384,990.00	0.36
90	600620	天宸股份	97,400	384,730.00	0.35
91	600487	亨通光电	3,500	382,690.00	0.35
92	603185	弘元绿能	22,900	382,201.00	0.35
93	688212	澳华内镜	13,000	382,200.00	0.35
94	600790	轻纺城	116,100	379,647.00	0.35
95	301196	唯科科技	3,000	376,260.00	0.35
96	301251	威尔高	7,040	375,091.20	0.35
97	300151	昌红科技	14,900	371,755.00	0.34
98	688173	希荻微	19,361	370,569.54	0.34
99	600533	栖霞建设	195,400	369,306.00	0.34
100	688046	药康生物	15,250	369,050.00	0.34
101	300426	华智数媒	72,700	367,862.00	0.34
102	300945	曼卡龙	33,800	366,054.00	0.34
103	688710	益诺思	5,400	362,880.00	0.33
104	603223	恒通股份	27,700	361,485.00	0.33
105	688369	致远互联	17,200	361,372.00	0.33
106	688386	泛亚微透	3,965	356,215.60	0.33
107	688575	亚辉龙	40,300	353,028.00	0.33
108	002970	锐明技术	6,600	352,638.00	0.33
109	688311	盟升电子	13,400	350,946.00	0.32
110	002488	金固股份	38,800	345,708.00	0.32
111	688678	福立旺	14,200	343,214.00	0.32
112	600327	大东方	110,700	343,170.00	0.32
113	000612	焦作万方	31,800	336,762.00	0.31
114	300903	科翔股份	3,300	334,323.00	0.31
115	605319	无锡振华	14,500	329,005.00	0.30

116	002328	新朋股份	44,600	327,364.00	0.30
117	600496	精工钢构	105,600	327,360.00	0.30
118	300696	爱乐达	12,500	325,375.00	0.30
119	300424	航新科技	20,600	324,244.00	0.30
120	600641	先导基电	8,100	322,866.00	0.30
121	300606	金太阳	7,500	319,200.00	0.29
122	688309	恒誉环保	5,237	318,828.56	0.29
123	300816	艾可蓝	4,300	314,760.00	0.29
124	603818	曲美家居	105,500	313,335.00	0.29
125	605111	新洁能	3,100	307,334.00	0.28
126	002245	蔚蓝锂芯	16,400	306,844.00	0.28
127	002169	智光电气	20,800	304,512.00	0.28
128	300835	龙磁科技	1,300	298,337.00	0.28
129	603567	珍宝岛	67,900	297,402.00	0.27
130	301360	荣旗科技	4,340	297,246.60	0.27
131	002947	恒铭达	3,900	296,595.00	0.27
132	688600	皖仪科技	8,899	296,158.72	0.27
133	300943	春晖智控	6,500	292,175.00	0.27
134	002919	名臣健康	15,200	288,648.00	0.27
135	603286	日盈电子	6,300	287,469.00	0.27
136	002266	浙富控股	56,400	285,384.00	0.26
137	300740	水羊股份	15,500	285,355.00	0.26
138	603110	东方材料	12,300	284,991.00	0.26
139	300984	金沃股份	5,300	284,769.00	0.26
140	603322	超讯科技	10,000	283,800.00	0.26
141	002785	万里石	6,400	283,584.00	0.26
142	300358	楚天科技	35,300	282,400.00	0.26
143	603291	联合水务	35,100	282,204.00	0.26
144	301181	标榜股份	12,100	279,994.00	0.26
145	001313	粤海饲料	38,700	274,383.00	0.25
146	301097	天益医疗	7,682	274,247.40	0.25
147	601567	三星电气	18,300	273,402.00	0.25
148	002986	宇新股份	23,000	272,090.00	0.25
149	300980	祥源新材	9,200	270,572.00	0.25
150	301052	果麦文化	12,000	266,640.00	0.25
151	002398	垒知集团	69,400	260,250.00	0.24
152	688013	天臣医疗	10,516	259,429.72	0.24
153	002937	兴瑞科技	5,900	259,187.00	0.24
154	600782	新钢股份	103,300	256,184.00	0.24
155	300548	长芯博创	900	250,200.00	0.23
156	688228	开普云	3,212	248,416.08	0.23
157	600288	大恒科技	18,600	247,380.00	0.23
158	600963	岳阳林纸	81,300	247,152.00	0.23

159	603703	盛洋科技	22,200	246,420.00	0.23
160	301536	星辰科技	1,900	244,549.00	0.23
161	688110	东芯股份	1,200	244,440.00	0.23
162	600391	航发科技	7,300	244,185.00	0.23
163	002702	海欣食品	54,200	241,190.00	0.22
164	002008	大族激光	1,600	240,176.00	0.22
165	301526	国际复材	5,000	233,350.00	0.22
166	300922	天秦装备	15,400	233,310.00	0.22
167	688677	海泰新光	2,300	232,599.00	0.21
168	301172	君逸数码	8,900	230,955.00	0.21
169	688210	统联精密	5,700	230,907.00	0.21
170	603113	金能科技	54,800	225,776.00	0.21
171	600984	建设机械	59,800	223,652.00	0.21
172	603050	科林电气	11,400	222,984.00	0.21
173	688719	爱科赛博	2,839	218,603.00	0.20
174	300489	光智科技	700	218,365.00	0.20
175	300542	新晨科技	19,700	218,276.00	0.20
176	600425	青松建化	66,300	216,801.00	0.20
177	002523	天桥起重	72,600	216,348.00	0.20
178	001339	智微智能	2,110	215,810.80	0.20
179	300698	万马科技	7,900	214,880.00	0.20
180	300508	维宏股份	3,700	212,491.00	0.20
181	688663	新风光	2,400	212,304.00	0.20
182	002290	禾盛新材	2,300	211,301.00	0.19
183	600566	济川药业	9,500	210,805.00	0.19
184	002768	国恩股份	4,044	210,530.64	0.19
185	603121	华培动力	17,900	210,325.00	0.19
186	301285	鸿日达	1,900	209,627.00	0.19
187	002787	华源控股	6,400	206,080.00	0.19
188	002975	博杰股份	1,450	205,900.00	0.19
189	300857	协创数据	600	203,940.00	0.19
190	300382	斯莱克	8,800	203,368.00	0.19
191	603790	雅运股份	9,500	202,730.00	0.19
192	002284	亚太股份	20,800	197,392.00	0.18
193	603833	欧派家居	6,500	195,715.00	0.18
194	301021	英诺激光	1,600	195,040.00	0.18
195	000923	河钢资源	15,700	194,837.00	0.18
196	603958	哈森股份	11,500	194,810.00	0.18
197	300656	民德电子	5,000	190,450.00	0.18
198	600805	悦达投资	47,100	189,813.00	0.18
199	002796	世嘉科技	4,600	187,588.00	0.17
200	301003	江苏博云	3,500	187,250.00	0.17
201	002376	新北洋	32,500	186,875.00	0.17

202	300988	津荣天宇	11,780	184,121.40	0.17
203	000426	兴业银锡	5,500	181,280.00	0.17
204	688089	ST 嘉必优	17,000	180,370.00	0.17
205	002943	宇晶股份	4,060	179,573.80	0.17
206	688279	峰岹科技	800	179,552.00	0.17
207	603083	剑桥科技	700	178,409.00	0.16
208	603918	金桥信息	18,800	178,224.00	0.16
209	603108	润达医疗	20,000	178,000.00	0.16
210	301631	壹连科技	2,460	176,775.60	0.16
211	000811	冰轮环境	3,100	174,282.00	0.16
212	605068	明新旭腾	10,300	172,834.00	0.16
213	688028	沃尔德	1,100	171,457.00	0.16
214	002391	长青股份	35,200	171,424.00	0.16
215	600626	申达股份	53,000	169,070.00	0.16
216	603285	键邦股份	3,700	165,797.00	0.15
217	300201	海伦哲	7,800	164,346.00	0.15
218	688679	通源环境	3,900	164,151.00	0.15
219	603707	健友股份	23,000	162,610.00	0.15
220	300129	泰胜风能	18,800	160,740.00	0.15
221	600201	生物股份	13,600	158,440.00	0.15
222	000576	甘化科工	24,000	157,680.00	0.15
223	002912	中新赛克	8,300	153,052.00	0.14
224	688257	新锐股份	1,500	152,850.00	0.14
225	300025	华星创业	34,500	144,900.00	0.13
226	601615	明阳智能	12,200	141,154.00	0.13
227	300051	璎升科技	16,000	140,160.00	0.13
228	601515	衢州东峰	43,500	139,200.00	0.13
229	300731	科创新源	2,380	138,896.80	0.13
230	002772	众兴菌业	12,200	138,592.00	0.13
231	688435	英方软件	4,300	137,600.00	0.13
232	300779	惠城环保	2,740	137,548.00	0.13
233	603079	圣达生物	12,100	136,972.00	0.13
234	301011	华立科技	9,600	135,744.00	0.13
235	002487	大金重工	2,300	133,331.00	0.12
236	600960	渤海汽车	33,000	132,990.00	0.12
237	603222	济民健康	15,600	131,820.00	0.12
238	002730	电光科技	4,400	131,604.00	0.12
239	301168	通灵股份	2,900	130,239.00	0.12
240	688335	复洁科技	5,361	128,878.44	0.12
241	002534	西子洁能	6,900	127,995.00	0.12
242	605086	龙高股份	5,100	126,582.00	0.12
243	002905	金逸影视	18,600	125,550.00	0.12
244	688328	深科达	1,300	124,410.00	0.11

245	688062	迈威生物	4,400	124,300.00	0.11
246	688059	华锐精密	600	119,826.00	0.11
247	603391	力聚热能	2,200	119,636.00	0.11
248	603926	铁流股份	6,700	118,523.00	0.11
249	688689	银河微电	1,771	114,619.12	0.11
250	002285	世联行	55,200	113,160.00	0.10
251	600738	丽尚国潮	31,100	111,960.00	0.10
252	603738	泰晶科技	1,800	108,090.00	0.10
253	603988	中电电机	6,600	107,052.00	0.10
254	600230	沧州大化	8,100	105,462.00	0.10
255	603678	火炬电子	1,200	99,600.00	0.09
256	300481	濮阳惠成	5,200	98,904.00	0.09
257	688291	金橙子	1,665	97,369.20	0.09
258	300275	梅安森	12,100	97,163.00	0.09
259	600512	腾达建设	51,200	95,744.00	0.09
260	688443	智翔金泰	4,100	95,325.00	0.09
261	301128	强瑞技术	600	93,540.00	0.09
262	002443	金洲管道	9,800	93,394.00	0.09
263	688199	久日新材	2,700	93,231.00	0.09
264	300302	同有科技	1,800	92,106.00	0.08
265	600773	西藏城投	7,100	91,377.00	0.08
266	300006	莱美药业	17,600	90,288.00	0.08
267	603089	正裕工业	10,300	86,005.00	0.08
268	300553	集智股份	1,400	85,946.00	0.08
269	603063	禾望电气	1,600	84,624.00	0.08
270	603901	永创智能	7,700	83,699.00	0.08
271	300887	谱尼测试	11,800	82,128.00	0.08
272	605228	神通科技	6,000	80,580.00	0.07
273	002840	华统股份	10,600	77,274.00	0.07
274	002593	日上集团	18,900	75,411.00	0.07
275	000932	华菱钢铁	21,600	74,952.00	0.07
276	603216	梦天家居	3,600	74,052.00	0.07
277	603569	长久物流	13,900	73,670.00	0.07
278	688323	瑞华泰	1,300	73,450.00	0.07
279	688586	江航装备	6,200	72,478.00	0.07
280	603507	振江股份	2,200	72,358.00	0.07
281	601208	东材科技	1,000	70,790.00	0.07
282	300870	欧陆通	200	69,138.00	0.06
283	301391	卡莱特	1,200	68,520.00	0.06
284	002615	哈尔斯	9,800	67,620.00	0.06
285	002851	麦格米特	400	66,872.00	0.06
286	600714	金瑞矿业	3,200	65,696.00	0.06
287	300322	硕贝德	2,600	65,520.00	0.06

288	688007	光峰科技	4,900	65,170.00	0.06
289	600866	星湖科技	14,800	64,972.00	0.06
290	688510	航亚科技	2,700	64,476.00	0.06
291	301125	腾亚精工	4,400	63,184.00	0.06
292	300393	中来股份	8,500	61,965.00	0.06
293	605365	立达信	4,300	61,834.00	0.06
294	002174	游族网络	4,800	60,528.00	0.06
295	002057	中钢天源	4,800	59,664.00	0.06
296	301189	奥尼电子	1,000	58,930.00	0.05
297	000059	华锦股份	15,700	58,875.00	0.05
298	688191	智洋创新	1,640	58,548.00	0.05
299	600477	杭萧钢构	25,000	57,750.00	0.05
300	688148	芳源股份	6,700	57,486.00	0.05
301	601798	蓝科高新	7,900	57,196.00	0.05
302	603630	拉芳家化	4,400	56,232.00	0.05
303	003002	壶化股份	3,200	55,648.00	0.05
304	301093	华兰股份	400	54,252.00	0.05
305	688808	联讯仪器	31	49,114.23	0.05
306	600969	郴电国际	6,400	48,832.00	0.05
307	002757	南兴股份	2,600	46,930.00	0.04
308	605196	华通线缆	1,700	44,370.00	0.04
309	300622	博士眼镜	3,100	43,214.00	0.04
310	300049	福瑞医科	1,100	42,768.00	0.04
311	300331	苏大维格	600	42,666.00	0.04
312	688799	华纳药厂	900	40,383.00	0.04
313	300177	中海达	6,500	40,300.00	0.04
314	301371	敷尔佳	1,500	39,000.00	0.04
315	601886	江河集团	4,700	37,741.00	0.03
316	688035	德邦科技	400	36,720.00	0.03
317	603969	银龙股份	5,000	36,350.00	0.03
318	688239	航宇科技	600	35,898.00	0.03
319	601000	唐山港	8,400	34,860.00	0.03
320	002301	齐心集团	4,800	34,704.00	0.03
321	300901	中胤时尚	2,300	33,971.00	0.03
322	600419	天润乳业	4,100	31,037.00	0.03
323	688410	山外山	2,100	30,156.00	0.03
324	603915	国茂股份	2,100	29,799.00	0.03
325	002228	合兴包装	8,900	26,166.00	0.02
326	688820	盛合晶微	181	25,609.69	0.02
327	603018	华设集团	4,940	25,391.60	0.02
328	002531	天顺风能	3,000	25,290.00	0.02
329	603239	浙江仙通	1,700	25,177.00	0.02
330	688301	奕瑞科技	200	24,800.00	0.02

331	301252	同星科技	600	24,318.00	0.02
332	002234	民和股份	3,700	23,717.00	0.02
333	300118	东方日升	1,900	23,655.00	0.02
334	600020	中原高速	6,300	23,247.00	0.02
335	001368	通达创智	1,100	22,627.00	0.02
336	002483	润邦股份	4,400	21,736.00	0.02
337	002741	光华科技	600	21,444.00	0.02
338	688818	电科蓝天	295	20,691.30	0.02
339	301122	采纳股份	700	20,587.00	0.02
340	688813	泰金新能	113	19,446.17	0.02
341	301397	溯联股份	600	19,416.00	0.02
342	300969	恒帅股份	200	18,752.00	0.02
343	002903	宇环数控	400	18,168.00	0.02
344	300551	古鳌科技	1,800	17,712.00	0.02
345	301070	开勒股份	200	17,600.00	0.02
346	603299	苏盐井神	2,000	17,580.00	0.02
347	600395	盘江股份	3,600	16,416.00	0.02
348	600469	风神股份	3,000	16,320.00	0.02
349	603400	华之杰	300	16,206.00	0.01
350	300986	志特新材	900	15,435.00	0.01
351	001248	华润新能源	1,500	15,165.00	0.01
352	002655	共达电声	300	13,800.00	0.01
353	001257	盛龙股份	621	12,879.54	0.01
354	603931	格林达	200	11,880.00	0.01
355	002811	郑中设计	900	10,071.00	0.01
356	601388	怡球资源	3,500	9,905.00	0.01
357	002394	联发股份	1,100	9,812.00	0.01
358	300933	中辰股份	1,600	9,728.00	0.01
359	688811	有研新材	397	9,579.61	0.01
360	300916	朗特智能	400	9,348.00	0.01
361	603459	红板科技	85	7,167.20	0.01
362	688816	易思维	41	2,341.10	0.00
363	688781	视涯科技	49	2,332.89	0.00
364	688712	北芯生命	64	2,298.88	0.00
365	603293	埃泰克	23	780.39	0.00
366	001312	福恩股份	46	771.88	0.00
367	603284	林平发展	19	662.53	0.00

6.4 报告期内股票投资组合的重大变动

6.4.1 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	688046	药康生物	3,583,985.35	3.72

2	301387	光大同创	3,096,381.00	3.21
3	002062	宏润建设	2,866,151.00	2.97
4	002803	吉宏股份	2,719,963.00	2.82
5	688682	霍莱沃	2,513,806.59	2.61
6	600665	天地源	2,436,844.00	2.53
7	301216	万凯新材	2,434,771.87	2.53
8	603012	创力集团	2,420,718.00	2.51
9	688600	皖仪科技	2,392,736.90	2.48
10	300596	利安隆	2,352,143.00	2.44
11	605566	福莱茵特	2,327,090.00	2.42
12	603969	银龙股份	2,311,864.00	2.40
13	600963	岳阳林纸	2,223,142.00	2.31
14	688636	智明达	2,172,526.48	2.25
15	688015	交控科技	2,133,916.60	2.21
16	002943	宇晶股份	2,116,508.00	2.20
17	603079	圣达生物	2,101,807.00	2.18
18	601515	衢州东峰	2,089,832.80	2.17
19	002655	共达电声	2,083,722.00	2.16
20	000428	华天酒店	2,070,763.00	2.15
21	300055	万邦达	2,062,287.00	2.14
22	688677	海泰新光	2,059,970.83	2.14
23	300980	祥源新材	2,050,719.00	2.13
24	002912	中新赛克	2,050,475.00	2.13
25	000922	佳电股份	2,008,064.40	2.08
26	002250	联化科技	2,005,086.00	2.08
27	688013	天臣医疗	1,993,637.98	2.07
28	300756	金马游乐	1,967,031.00	2.04
29	301328	维峰电子	1,959,873.00	2.03
30	605376	博迁新材	1,957,056.00	2.03
31	688335	复洁科技	1,949,528.25	2.02
32	002849	威星智能	1,931,763.00	2.01
33	603191	望变电气	1,929,785.00	2.00

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。

6.4.2 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	002062	宏润建设	4,317,636.00	4.48
2	301387	光大同创	3,632,667.00	3.77
3	603012	创力集团	3,397,448.00	3.53
4	600665	天地源	3,186,125.00	3.31
5	300835	龙磁科技	3,069,788.00	3.19
6	688046	药康生物	3,020,218.57	3.13

7	688636	智明达	2,774,812.54	2.88
8	601999	出版传媒	2,731,942.00	2.84
9	301328	维峰电子	2,696,258.15	2.80
10	002913	奥士康	2,618,286.92	2.72
11	002655	共达电声	2,599,408.00	2.70
12	688682	霍莱沃	2,560,691.27	2.66
13	301216	万凯新材	2,538,437.00	2.63
14	600780	通宝能源	2,497,787.87	2.59
15	603191	望变电气	2,431,611.00	2.52
16	605376	博迁新材	2,430,793.00	2.52
17	603815	交建股份	2,410,193.00	2.50
18	600963	岳阳林纸	2,409,975.50	2.50
19	603267	鸿远电子	2,371,736.00	2.46
20	605566	福莱茵特	2,340,186.00	2.43
21	300025	华星创业	2,280,254.00	2.37
22	605277	新亚电子	2,266,465.00	2.35
23	688162	巨一科技	2,199,923.71	2.28
24	600965	*ST 福成	2,184,516.00	2.27
25	002531	天顺风能	2,169,005.00	2.25
26	002824	和胜股份	2,159,349.00	2.24
27	000726	鲁 泰 A	2,134,307.00	2.22
28	603969	银龙股份	2,117,334.00	2.20
29	002132	恒星科技	2,111,007.00	2.19
30	301162	国能日新	2,100,271.60	2.18
31	002440	闰土股份	2,083,456.00	2.16
32	688288	鸿泉技术	2,083,130.38	2.16
33	688070	纵横股份	2,078,114.92	2.16
34	300596	利安隆	2,076,875.00	2.16
35	688398	赛特新材	2,023,455.47	2.10
36	688015	交控科技	2,014,963.72	2.09
37	688267	中触媒	2,007,340.19	2.08
38	688600	皖仪科技	1,991,974.53	2.07
39	688551	科威尔	1,982,434.36	2.06
40	603255	鼎际得	1,973,930.00	2.05
41	300806	斯迪克	1,970,136.00	2.04
42	688335	复洁科技	1,969,470.27	2.04
43	002206	海 利 得	1,961,429.00	2.04
44	603379	三美股份	1,937,275.00	2.01

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。

6.4.3 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	516,150,395.44
卖出股票收入（成交）总额	518,553,310.24

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。

6.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

无。

6.6 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。

6.7 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。

6.8 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。

6.9 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。

6.10 本基金投资股指期货的投资政策

本基金在进行股指期货投资时，将根据风险管理的原则，以套期保值为主要目的，在风险可控的前提下，本着谨慎原则，参与股指期货的投资，以管理投资组合的系统性风险，改善组合的风险收益特性。套期保值将主要采用流动性好、交易活跃的期货合约。本基金在进行股指期货投资时，将通过对证券市场和期货市场运行趋势的研究，并结合股指期货的定价模型寻求其合理的估值水平。本季度股指期货的投资符合既定的投资政策和投资目标。

6.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

6.11.1 本期国债期货投资政策

无。

6.11.2 本期国债期货投资评价

无。

6.12 投资组合报告附注

6.12.1 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。

6.12.2 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。

6.12.3 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	495,293.50
2	应收清算款	1,384,308.80
3	应收股利	—
4	应收利息	—
5	应收申购款	231,385.50
6	其他应收款	—
7	待摊费用	—
8	其他	—
9	合计	2,110,987.80

6.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

无。

6.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

无。

6.12.6 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。

§ 7 基金份额持有人信息

7.1 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 (%)
大成动态量化配置策略混合 A	8,426	3,505.79	569,972.37	1.93	28,969,850.52	98.07
大成动态量化配置策略混合 C	3,765	9,433.50	1,059,417.97	2.98	34,457,725.32	97.02
合计	12,191	5,336.47	1,629,390.34	2.50	63,427,575.84	97.50

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。

7.2 盈利投资者数量占比

项目	过去一年（2025 年 7 月 1 日-2026 年 6 月 30 日）
盈利投资者数量占比（%）	88.43

7.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数（份）	占基金总份额比例（%）
基金管理人所有从业人员持有本基金	大成动态量化配置策略混合 A	941,278.38	3.1865
	大成动态量化配置策略混合 C	14,153.70	0.0399
	合计	955,432.08	1.4686

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）。

7.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

项目	份额级别	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	大成动态量化配置策略混合 A	10~50
	大成动态量化配置策略混合 C	0
	合计	10~50
本基金基金经理持有本开放式基金	大成动态量化配置策略混合 A	50~100
	大成动态量化配置策略混合 C	0
	合计	50~100

§ 8 开放式基金份额变动

单位：份

项目	大成动态量化配置策略混合 A	大成动态量化配置策略混合 C
基金合同生效日（2016 年 9 月 20 日）基金份额总额	560,560,675.30	—
本报告期期初基金份额总额	28,577,241.89	36,968,680.13
本报告期基金总申	32,957,163.63	85,715,064.23

购份额		
减：本报告期基金总赎回份额	31,994,582.63	87,166,601.07
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	29,539,822.89	35,517,143.29

§ 9 重大事件揭示

9.1 基金份额持有人大会决议

无。

9.2 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。

9.3 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。

9.4 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。

9.5 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。

9.6 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况

9.6.1 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。

9.6.2 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。

9.6.3 托管人受调查或处罚等情况

无。

9.6.4 托管人相关从业人员受调查或处罚等情况

无。

9.7 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

9.7.1 基金租用或者通过证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例 (%)	佣金	占当期佣金总量的比例 (%)	
中信建投证券	2	365,461,991.73	35.33	166,650.62	35.33	—
野村东方国际证券	1	230,394,805.63	22.27	105,060.03	22.27	—
财通证券	1	178,367,250.80	17.24	81,335.43	17.24	—
国盛证券	1	102,622,127.76	9.92	46,795.68	9.92	—
华创证券	1	59,175,200.04	5.72	26,983.81	5.72	—
西部证券	1	42,517,257.05	4.11	19,387.95	4.11	—
兴业证券	2	37,156,744.50	3.59	16,943.54	3.59	—
浙商证券	1	18,756,764.96	1.81	8,553.12	1.81	—
爱建证券	1	—	—	—	—	—
长江证券	1	—	—	—	—	新增 1 个
第一创业	1	—	—	—	—	—
东北证券	1	—	—	—	—	—
东财证券	1	—	—	—	—	—
东方证券	1	—	—	—	—	—
东吴证券	1	—	—	—	—	—
东兴证券	1	—	—	—	—	—
方正证券	1	—	—	—	—	—
高盛中国证券	1	—	—	—	—	—
光大证券	2	—	—	—	—	—
广发证券	2	—	—	—	—	—
国金证券	2	—	—	—	—	—
国泰海通	3	—	—	—	—	—
国投证券	1	—	—	—	—	—
国信证券	1	—	—	—	—	—

红塔证券	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
信达证券	0	-	-	-	-	退租 1 个
粤开证券	1	-	-	-	-	-
招商证券	2	-	-	-	-	-
中国银河 证券	3	-	-	-	-	-
中金公司	2	-	-	-	-	-
中泰证券	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。

9.7.2 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 (%)
华创证券	45,321.30	54.60	-	-	-	-	-	-
西部证券	37,681.96	45.40	-	-	-	-	-	-

9.8 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	大成动态量化配置策略混合型证券投资基金(C类份额)基金产品资料概要更新	中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站	2026年06月30日
2	大成动态量化配置策略混合型证券投资基金(A类份额)基金产品资料概要更新	中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站	2026年06月30日
3	大成基金管理有限公司关于旗下部分基金估值调整情况的公告	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06月26日
4	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
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	大成动态量化配置策略混合型证券投资基金2026年第1季度报告	中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站	2026年04月22日
7	大成动态量化配置策略混合型证券投资基金2025年年度报告	中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站	2026年03月31日
8	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
9	大成基金管理有限公司旗下公募基金通过证券公司证券交易及佣金支付情况（2025年度）	中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站	2026年03月31日
10	大成基金管理有限公司提醒投资者谨防金融诈骗的公告	中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站	2026年02月14日

11	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
12	大成动态量化配置策略混合型证券投资基金 2025 年第 4 季度报告	中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站	2026 年 01 月 22 日
13	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

§ 10 影响投资者决策的其他重要信息

10.1 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。

10.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§ 11 备查文件目录

11.1 备查文件目录

- 1、中国证监会批准设立大成动态量化配置策略混合型证券投资基金的文件；
- 2、《大成动态量化配置策略混合型证券投资基金基金合同》；
- 3、《大成动态量化配置策略混合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。

11.2 存放地点

备查文件存放在本基金管理人和托管人的住所。

11.3 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