大成中证电池主题交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金(原大成中证电池主题指数型发起式证券投资基金转型)
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：兴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。

基金托管人兴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。

转型前原大成中证电池主题指数型发起式证券投资基金本报告期自 2026 年 01 月 01 日起至 2026 年 01 月 22 日止，转型后大成中证电池主题交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金本报告期自 2026 年 01 月 23 日（基金合同生效日）起至 2026 年 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 6

2.1 基金基本情况（转型后） 6
2.1 基金基本情况（转型前） 6
2.2 基金产品说明（转型后） 7
2.2 基金产品说明（转型前） 10
2.3 基金管理人和基金托管人 11
2.4 信息披露方式 11
2.5 其他相关资料(转型后) 11
2.5 其他相关资料(转型前) 11

§3 主要财务指标和基金净值表现 11

3.1 主要会计数据和财务指标（转型后） 11
3.1 主要会计数据和财务指标(转型前) 12
3.2 基金净值表现（转型后） 13
3.2 基金净值表现（转型前） 14

§4 管理人报告 16

4.1 基金管理人及基金经理情况 16
4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明 18
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明 19
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 19
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望 20
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明 20
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明 21
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 21

§5 托管人报告 21

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明 21
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 21
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见 22

§6 半年度财务会计报告（未经审计)（转型后） 22

6.1 资产负债表 22
6.2 利润表 23
6.3 净资产变动表 24
6.4 报表附注 25

§6 半年度财务会计报告（未经审计)（转型前） 53

6.1 资产负债表 53
6.2 利润表 55
6.3 净资产变动表 56
6.4 报表附注 58
§7 投资组合报告（转型后） 83
7.1 期末基金资产组合情况 83
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合 84
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 85
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动 86
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合 87
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 88
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 88
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 88
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 88
7.10 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名基金投资明细 88
7.11 本基金投资股指期货的投资政策 88
7.12 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 88
7.13 投资组合报告附注 88
§7 投资组合报告（转型前） 89
7.1 期末基金资产组合情况 89
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合 90
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 91
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动 94
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合 95
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 95
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 95
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 95
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 96
7.10 本基金投资股指期货的投资政策 96
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 96
7.12 投资组合报告附注 96
§8 基金份额持有人信息（转型后） 97
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 97
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 97
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 98
8.4 发起式基金发起资金持有份额情况 98
§8 基金份额持有人信息（转型前） 98
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 98
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 99
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 99
8.4 发起式基金发起资金持有份额情况 100
§9 开放式基金份额变动（转型后） 100

§9 开放式基金份额变动（转型前） 100

§10 重大事件揭示 101

10.1 基金份额持有人大会决议 101
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 101
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 101
10.4 基金投资策略的改变 101
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 101
10.6 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况 102
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(转型后) 102
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(转型前) 103
10.8 其他重大事件（转型后） 104
10.8 其他重大事件（转型前） 105

§11 影响投资者决策的其他重要信息 105

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 105
11.2 影响投资者决策的其他重要信息 105

§12 备查文件目录 105

12.1 备查文件目录 105
12.2 存放地点 106
12.3 查阅方式 106

§1 基金简介

1.1 基金基本情况（转型后）

基金名称	大成中证电池主题交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金	
基金简称	大成中证电池主题 ETF 发起式联接	
基金主代码	015997	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2026 年 1 月 23 日	
基金管理人	大成基金管理有限公司	
基金托管人	兴业银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	387,412,159.50 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	大成中证电池主题 ETF 发起式联接 A	大成中证电池主题 ETF 发起式联接 C
下属分级基金的交易代码	015997	015998
报告期末下属分级基金的份额总额	84,835,981.25 份	302,576,178.25 份

1.1.1 目标基金基本情况（转型后）

基金名称	大成中证电池主题交易型开放式指数证券投资基金
基金主代码	159155
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2026 年 1 月 13 日
基金份额上市的证券交易所	深圳证券交易所
上市日期	2026 年 1 月 21 日
基金管理人名称	大成基金管理有限公司
基金托管人名称	兴业银行股份有限公司

1.1 基金基本情况（转型前）

基金名称	大成中证电池主题指数型发起式证券投资基金	
基金简称	大成中证电池主题指数发起式	
基金主代码	015997	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2022 年 6 月 28 日	
基金管理人	大成基金管理有限公司	
基金托管人	兴业银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	440,909,947.45 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基	大成中证电池主题指数发起式 A	大成中证电池主题指数发起式 C

金简称		
下属分级基金的交易代码	015997	015998
报告期末下属分级基金的份额总额	93,342,333.01 份	347,567,614.44 份

1.2 基金产品说明（转型后）

投资目标	通过投资于目标 ETF，紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化。
投资策略	（一）目标 ETF 投资策略 本基金主要通过交易所买卖或申购赎回的方式投资于目标 ETF。根据投资者申购、赎回的现金流情况，本基金将综合目标 ETF 的流动性、折溢价率、标的指数成份股流动性等因素分析，对投资组合进行监控和调整，密切跟踪标的指数。 在投资运作过程中，本基金将在综合考虑合规、风险、效率、成本等因素的基础上，决定采用一级市场申购赎回的方式或二级市场买卖的方式对目标 ETF 进行投资。 （二）股票投资策略 1、股票投资组合构建 本基金采用完全复制标的指数的方法，按照标的指数成份股组成及其权重构建股票投资组合。由于跟踪组合构建与标的指数组合构建存在差异，若出现较为特殊的情况（例如成份股停牌、股票流动性不足以及其他影响指数复制效果的因素），本基金将采用替代性的方法构建组合，使得跟踪组合尽可能近似于全复制组合，以减少对标的指数的跟踪误差。 2、股票投资组合的调整 本基金所构建的股票投资组合将根据中证电池主题指数成份股及其权重的变动而进行相应调整，本基金还将根据法律法规中的投资比例限制、申购赎回变动情况等，对其进行适时调整，以保证基金净值增长率与基准指数间的高度正相关和跟踪误差最小化。 （三）债券投资策略 1、本基金基于基金流动性管理和有效利用基金资产的需要进行债券投资。本基金将主要投资于流动性较好的国债、金融债、央行票据等债券以及参与债券回购投资，保证基金资产流动性，提高基金资产的投资收益。本基金将根据宏观经济形势、货币政策、证券市场变化等分析判断未来利率变化，结合债券定价技术，进行个券选择。 2、可转换债券/可交换债券兼具权益类证券与固定收益类证券的特性，具有抵御下行风险、分享股票价格上涨收益的特点。本基金主要从公司基本面分析、理论定价分析、债券发行条款、投资导向的变化等方面综合评估可转换债券/可交换债券投资价值，选取具有较高价值的可转换债券/可交换债券进行投资。本基金将着重对可转换债券/可交换债券对应的基础股票进行分析与研究，对那些有着较好盈利能力或成长前景的上市公司的可转换债券/可交换债券进行重点选择。可转换债券/可交换债券的投资的

	目的是保证基金资产流动性，有效利用基金资产，更好地降低跟踪误差。 （四）资产支持证券投资策略 本基金将重点对市场利率、发行条款、支持资产的构成及质量、提前偿还率、风险补偿收益和市场流动性等影响资产支持证券价值的因素进行分析，并辅助采用数量化定价模型，评估资产支持证券的相对投资价值并做出相应的投资决策。本基金将严格控制资产支持证券的总体投资规模并进行分散，以降低流动性风险。 （五）股指期货的投资策略 本基金在注重风险管理的前提下，根据风险管理的原则，以套期保值为目的，将适度运用股指期货。本基金利用股指期货流动性好、交易成本低和杠杆操作等特点，通过股指期货对本基金投资组合的跟踪效果进行及时、有效地调整和优化，并提高投资组合的运作效率等。 （六）国债期货投资策略 本基金投资国债期货将根据风险管理原则，以套期保值为目的，以回避市场风险，故国债期货空头的合约价值主要与债券组合的多头价值相对应。基金管理人通过对宏观经济和利率市场走势的分析与判断，并充分考虑国债期货的收益性、流动性及风险特征，通过资产配置，谨慎进行投资，以调整债券组合的久期，降低投资组合的整体风险。 （七）股票期权投资策略 在法律法规允许的范围内，本基金应当按照风险管理的原则，以套期保值为主要目的，基于谨慎原则运用股票期权对基金投资组合进行管理，以控制投资组合风险、提高投资效率，从而更好地实现本基金的投资目标。本基金将在有效控制风险的前提下，选择流动性好、交易活跃的期权合约进行投资。本基金将基于对证券市场的预判，并结合股指期权定价模型，选择估值合理的期权合约。 （八）融资及转融通证券出借业务投资策略 本基金在参与融资、转融通证券出借业务时将根据风险管理的原则，在法律法规允许的范围和比例内、风险可控的前提下，本着谨慎原则，参与融资和转融通证券出借业务。参与融资业务时，本基金将力争利用融资的杠杆作用，降低因申购造成基金仓位较低带来的跟踪误差，达到有效跟踪标的指数的目的。参与转融通证券出借业务时，本基金将从基金持有的融券标的股票中选择流动性好、交易活跃的股票作为转融通出借交易对象，力争为本基金份额持有人增厚投资收益。 （九）存托凭证投资策略 在控制风险的前提下，本基金将根据本基金的投资目标和股票投资策略，基于对基础证券投资价值的深入研究判断，进行存托凭证的投资。 随着证券市场投资工具的发展和丰富，基金管理人可在不改变投资目标的前提下，根据法律法规的有关规定，在履行适当程序后相应调整或更新投资策略，并公告。

业绩比较基准	中证电池主题指数收益率×95%+银行活期存款利率(税后)×5%
风险收益特征	本基金为大成中证电池主题 ETF 的联接基金，主要投资于目标 ETF，实现对业绩比较基准的紧密跟踪。因此，本基金的业绩表现与中证电池主题指数及目标 ETF 的表现密切相关。本基金的预期风险与预期收益水平高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。

1.2.1 目标基金产品说明（转型后）

投资目标	紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化。在正常市场情况下，本基金的日均跟踪偏离度的绝对值争取不超过 0.2%，年跟踪误差争取不超过 2%。
投资策略	（一）股票投资策略 本基金为完全被动式指数基金，采用完全复制法，即按照成份股在标的指数中的基准权重来构建指数化投资组合，并根据标的指数成份股及其权重的变化进行相应调整。当预期指数成份股发生调整和成份股发生配股、增发、分红等行为时，或因基金的申购和赎回等对本基金跟踪标的指数的效果可能带来影响时，或因某些特殊情况导致流动性不足时，或其他原因导致无法有效复制和跟踪标的指数时，基金管理人可以对投资组合管理进行适当变通和调整，从而使得投资组合紧密地跟踪标的指数。 如果标的指数成份股发生明显负面事件面临退市风险，且指数编制机构暂未作出调整的，基金管理人应当按照基金份额持有人利益优先原则，履行内部决策程序后及时对相关成份股进行调整。 在正常市场情况下，本基金的风险控制目标是追求日均跟踪偏离度的绝对值争取不超过 0.2%，年跟踪误差争取不超过 2%。如因标的指数编制规则调整等其他原因，导致基金跟踪偏离度和跟踪误差超过了上述范围，基金管理人应采取合理措施，避免跟踪偏离度和跟踪误差的进一步扩大。 （二）衍生金融产品投资策略 本基金可投资股指期货、股票期权、国债期货和其他经中国证监会允许的衍生金融产品。 本基金参与股指期货交易将力争利用股指期货的杠杆作用，以套期保值为目的，降低股票仓位频繁调整的交易成本和跟踪误差，达到有效跟踪标的指数的目的。本基金将根据风险管理的原则，采用流动性好、交易活跃的期货合约，对本基金投资组合进行及时、有效地调整和优化，提高投资组合的运作效率。 本基金投资股票期权，将根据风险管理的原则，以套期保值为主要目的，充分考虑股票期权的流动性和风险收益特征，在风险可控的前提下，适度参与股票期权投资。 本基金参与国债期货交易，应当根据风险管理的原则，以套期保值为主要目的。基金管理人将充分考虑国债期货的流动性和风险收益特征，在风险可控的前提下，适度参与国债期货交易。 （三）债券投资策略 本基金将主要以降低跟踪误差和投资组合流动性管理为目的，综合考虑流动性和收益性，构建本基金债券投资组合。

	（四）可转换债券和可交换债券投资策略 本基金在对可转换债券和可交换债券条款和标的公司基本面进行深入分析研究的基础上，利用定价模型进行估值分析，投资具有较高安全边际和良好流动性的可转换债券和可交换债券。 （五）资产支持证券投资策略 本基金将分析资产支持证券的资产特征，估计违约率和提前偿付比率，并利用收益率曲线和期权定价模型，对资产支持证券进行估值。本基金将通过对资产支持证券基础资产及结构设计的研究，结合多种定价模型，严格控制资产支持证券的总体投资规模并进行分散投资，以降低流动性风险。 （六）融资及转融通证券出借策略 为更好地实现投资目标，在加强风险防范并遵守审慎原则的前提下，本基金可根据投资管理的需要参与融资和转融通证券出借业务。参与融资业务时，本基金将力争利用融资的杠杆作用，提高基金的资金使用效率，以融入资金满足资金各项流动性需求或达到有效跟踪标的指数的目的。参与转融通证券出借业务时，本基金将在分析市场情况、投资者类型与结构、基金历史申赎情况、出借证券流动性情况等因素的基础上，合理确定出借证券的范围、期限和比例。未来在法律法规允许的前提下，本基金可根据相关法律法规规定参与融券业务。 （七）存托凭证投资策略 本基金将根据投资目标，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。 未来，随着市场的发展和基金管理运作的需要，基金管理人可以在不改变投资目标的前提下，遵循法律法规的规定，在履行适当程序后相应调整或更新投资策略，并在招募说明书更新中公告。
业绩比较基准	中证电池主题指数收益率
风险收益特征	本基金属于股票型基金，其预期收益及预期风险水平高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。 本基金为被动式投资的股票型指数基金，跟踪中证电池主题指数，其风险收益特征与标的指数所表征的市场组合的风险收益特征相似。

1.2 基金产品说明（转型前）

投资目标	本基金通过被动的指数化投资管理，紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差最小化。本基金力争日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.35%，年跟踪误差不超过 4%。
投资策略	本基金采用完全复制标的指数的方法，进行被动指数化投资。股票投资组合的构建主要按照标的指数的成份股组成及其权重来拟合复制标的指数，并根据标的指数成份股及其权重的变动而进行相应调整，以复制和跟踪标的指数。本基金在严格控制基金的日均跟踪偏离度和年跟踪误差的前提下，力争获取与标的指数相似的投资收益。
业绩比较基准	中证电池主题指数收益率×95%+银行活期存款利率(税后)×5%
风险收益特征	本基金是股票型基金，其预期风险与预期收益高于混合型基金、

	债券型基金与货币市场基金。本基金主要投资于标的指数成份股及备选成份股，具有与标的指数相似的风险收益特征。

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	兴业银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	段皓静	冯萌
	联系电话	0755-83183388	021-52629999-213310
	电子邮箱	office@dcfund.com.cn	fengmeng@cib.com.cn
客户服务电话		4008885558	95561
传真		0755-83199588	021-62159217
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	福建省福州市台江区江滨中大道 398 号兴业银行大厦
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	上海市浦东新区银城路 167 号 4 楼
邮政编码		518054	200120
法定代表人		吴庆斌	吕家进

1.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《上海证券报》
登载基金中期报告的管理人互联网网址	www.dcfund.com.cn
基金中期报告置备地点	基金管理人及基金托管人住所

1.5 其他相关资料(转型后)

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

1.5 其他相关资料(转型前)

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（转型后）

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	2026 年 1 月 23 日（基金合同生效日） - 2026 年 6 月 30 日	
	大成中证电池主题 ETF 发起式联接 A	大成中证电池主题 ETF 发起式联接 C
本期已实现收益	11,686,033.90	42,755,629.94
本期利润	3,825,042.67	13,567,399.93

加权平均基金份额本期利润	0.0446	0.0457
本期加权平均净值利润率	4.81%	4.99%
本期基金份额净值增长率	6.59%	6.44%
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	-4,286,786.46	-18,679,593.94
期末可供分配基金份额利润	-0.0505	-0.0617
期末基金资产净值	80,549,194.79	283,896,584.31
期末基金份额净值	0.9495	0.9383
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	6.59%	6.44%

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。

2.1 主要会计数据和财务指标(转型前)

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 1 月 22 日)	
	大成中证电池主题指数发起式 A	大成中证电池主题指数发起式 C
本期已实现收益	2,408,096.36	8,994,006.03
本期利润	869,344.52	4,187,540.78
加权平均基金份额本期利润	0.0092	0.0115
本期加权平均净值利润率	1.02%	1.29%
本期基金份额净值增长率	0.97%	0.96%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2026 年 1 月 22 日)	
期末可供分配利润	-15,582,284.13	-60,309,151.66
期末可供分配基金份额利润	-0.1669	-0.1735
期末基金资产净值	83,152,618.18	306,367,855.27
期末基金份额净值	0.8908	0.8815
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2026 年 1 月 22 日)	
基金份额累计净值增长率	-10.92%	-11.85%

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（转型后）

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

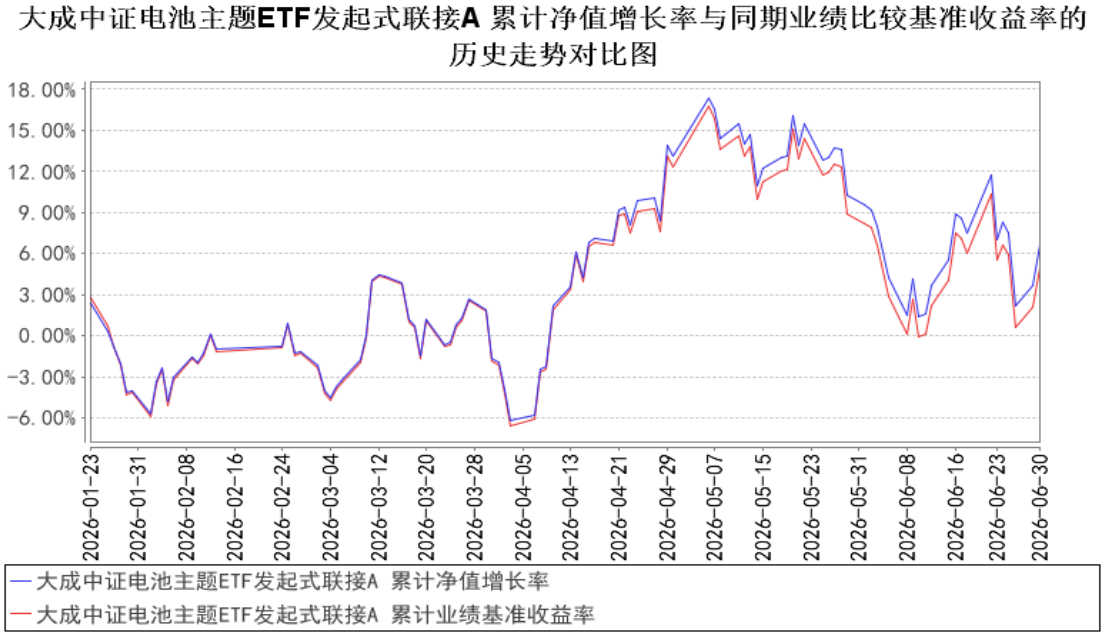
大成中证电池主题 ETF 发起式联接 A

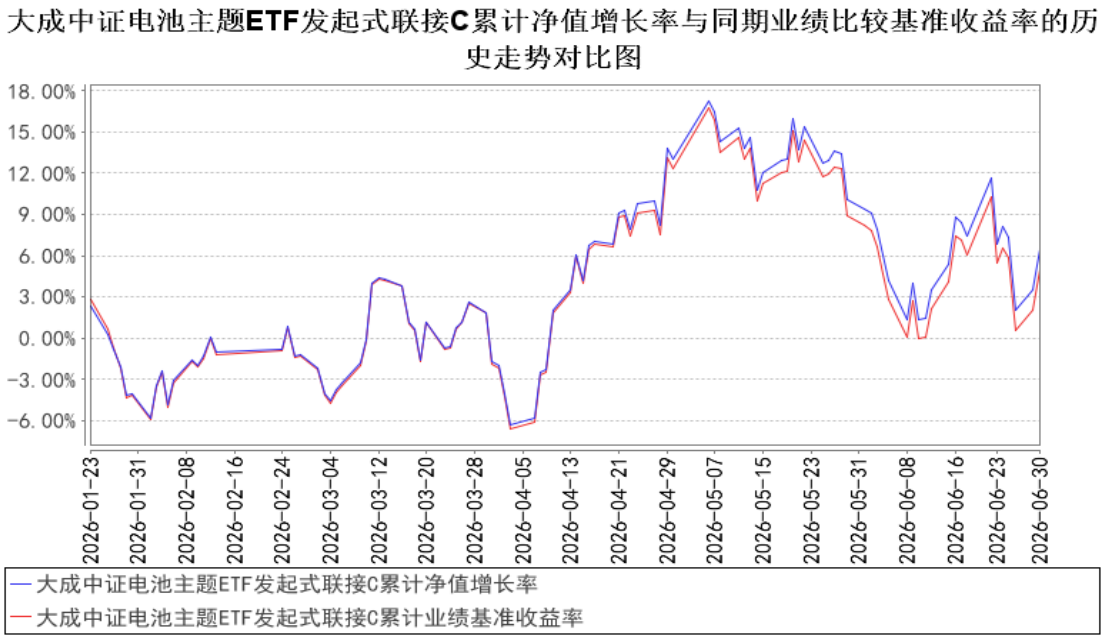
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①－③	②－④
过去三个月	8.37%	2.16%	6.97%	2.19%	1.40%	-0.03%
自基金合同生效起至今	6.59%	1.98%	4.96%	2.02%	1.63%	-0.04%

大成中证电池主题 ETF 发起式联接 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	8.29%	2.16%	6.97%	2.19%	1.32%	-0.03%
自基金合同生效起至今	6.44%	1.98%	4.96%	2.02%	1.48%	-0.04%

2.2.2 自基金转型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





注：1、本基金合同生效日（暨基金转型日）为 2026 年 1 月 23 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，本基金自基金合同生效之日起六个月内为建仓期。截至报告期末，本基金处于建仓期。

2.2 基金净值表现（转型前）

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

大成中证电池主题指数发起式 A

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①－③	②－④
过去三个月	8.70%	2.02%	8.25%	2.03%	0.45%	-0.01%
过去六个月	56.17%	2.17%	57.46%	2.25%	-1.29%	-0.08%
过去一年	67.29%	1.97%	67.84%	2.03%	-0.55%	-0.06%
过去三年	6.17%	1.99%	3.79%	2.08%	2.38%	-0.09%
自基金合同生效起至今	-10.92%	1.98%	-15.81%	2.08%	4.89%	-0.10%

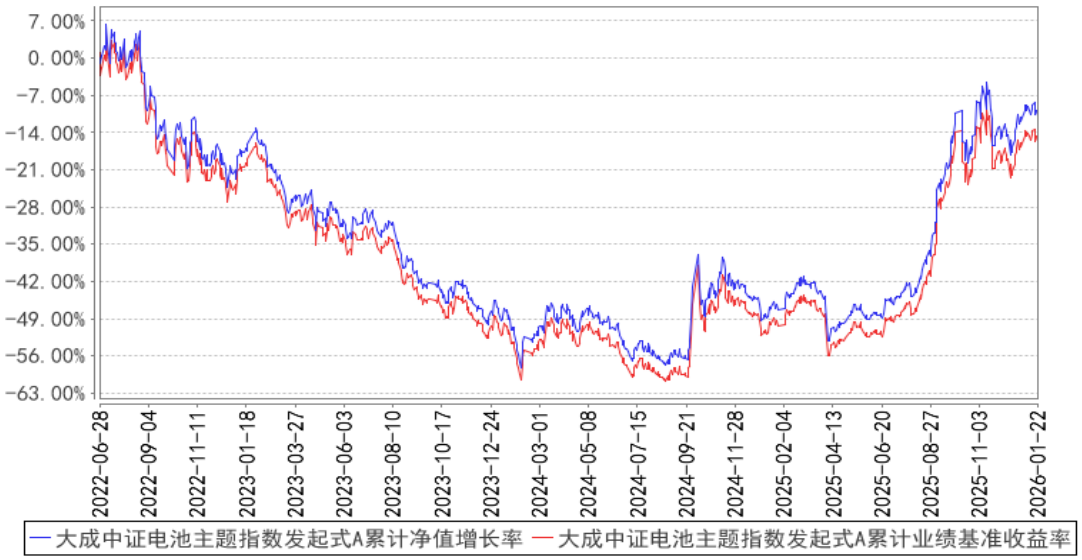
大成中证电池主题指数发起式 C

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①－③	②－④
过去三个月	8.63%	2.02%	8.25%	2.03%	0.38%	-0.01%

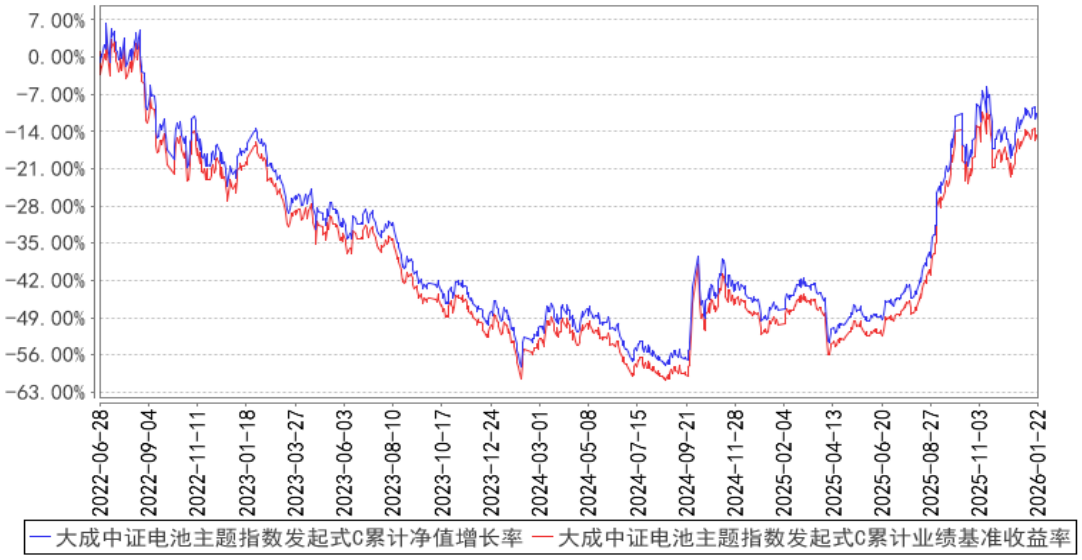
过去六个月	55.96%	2.17%	57.46%	2.25%	-1.50%	-0.08%
过去一年	66.79%	1.97%	67.84%	2.03%	-1.05%	-0.06%
过去三年	5.23%	1.99%	3.79%	2.08%	1.44%	-0.09%
自基金合同生效起至今	-11.85%	1.98%	-15.81%	2.08%	3.96%	-0.10%

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

大成中证电池主题指数发起式A累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



大成中证电池主题指数发起式C累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：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。

§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（转型后）

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		
郑少芳	本基金基金经理	2024 年 12 月 9 日	-	16 年	北京大学医学部理学硕士。2010 年 7 月加入大成基金管理有限公司，曾任研究部研究员、社保及养老投资管理部投资经理、权益专户投资部投资经理、总监助理，现任指数与期货投资部总监助理。2023 年 7 月 5 日至 2025 年 12 月 8 日兼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。2024 年 12 月 9 日起兼任大成沪深 300 指数证券投资基金、大成中证电池主题交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金（转型前为大成中证电池主题指数型发起式证券投资基金）、大成中证芯片产业指数型发起式证券投资基金基金经理。2025 年 3 月 10 日起兼任大成中证 A100 交易型开放式指数证券投资基金、大成中证上海环交所碳中和交易型开放式指数证券投资基金基金经理。

					2025 年 5 月 27 日起兼任大成北证 50 成份指数型发起式证券投资基金基金经理。2025 年 7 月 25 日起兼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、大成中证红利低波动 100 交易型开放式指数证券投资基金、大成中证工程机械主题交易型开放式指数证券投资基金基金经理。2026 年 1 月 13 日起兼任大成中证电池主题交易型开放式指数证券投资基金基金经理。2026 年 6 月 2 日起兼任大成国证机器人产业交易型开放式指数证券投资基金基金经理。2026 年 6 月 25 日起兼任大成中证红利低波动 100 交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金基金经理。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。

3.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介（转型前）

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		
郑少芳	本基金基金经理	2024 年 12 月 9 日	-	16 年	北京大学医学部理学硕士。2010 年 7 月加入大成基金管理有限公司，曾任研究部研究员、社保及养老投资管理部投资经理、权益专户投资部投资经理、总监助理，现任指数与期货投资部总监助理。2023 年 7 月 5 日至 2025 年 12 月 8 日兼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。2024 年 12 月 9 日起兼任大成沪深 300 指数证券投资基金、大成中证电池主题交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金（转型前为大成中证电池主题指数型发起式证券投资基金）、大成中证芯片产业指数型发起式证券投资基金基金经理。2025 年 3 月 10 日起兼任大成中证 A100 交易型开放式指数证券投资基金、大成中证上海环交所碳中和交易型开放式指数证券投资基金基金经理。2025 年 5 月 27 日起兼任大成北证 50 成份指数型发起式证券投资基金基金经理。2025 年 7 月 25 日起兼任大成中证全指医

					疗保健设备与服务交易型开放式指数证券投资基金、大成中证红利低波动 100 交易型开放式指数证券投资基金、大成中证工程机械主题交易型开放式指数证券投资基金基金经理。2026 年 1 月 13 日起兼任大成中证电池主题交易型开放式指数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（转型后）

姓名	产品类型	产品数量（只）	资产净值（元）	任职时间
郑少芳	公募基金	12	3,130,913,862.15	2024 年 12 月 9 日
	私募资产管理计划	1	2,040,328.54	2017 年 6 月 14 日
	其他组合	-	-	-
	合计	13	3,132,954,190.69	-

注：本报告期内，郑少芳已于 2026 年 6 月 10 日离任其管理的 1 个私募资产管理计划。

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（转型前）

姓名	产品类型	产品数量（只）	资产净值（元）	任职时间
郑少芳	公募基金	10	2,614,987,650.43	2024 年 12 月 9 日
	私募资产管理计划	2	1,950,646,296.21	2017 年 6 月 14 日
	其他组合	-	-	-
	合计	12	4,565,633,946.64	-

3.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

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。

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 股呈“先扬后抑再修复”三阶段走势，大部分宽基指数收红为主，市场成交持续活跃，6 月日均成交基本维持在 3 万亿以上。节奏上，1-2 月科技领涨，上证指数走出“17 连阳”；3-4 月初中东地缘冲突引发调整、资金转向高股息防御；4 月中旬起政策发力、叠加盈利修复驱动市场反弹。

行业表现层面，2026 年上半年，市场呈现典型“K 型”极致分化，超额收益高度集中于硬科技，通信、电子、建材等领涨，其中人工智能算力、光模块、PCB、存储、半导体国产替代为核心主线；商贸零售、食品饮料、传媒等承压，跌幅居前。底层支撑是盈利分层，以科创 50 为代表的科技成长盈利爆发式增长，与上证 50 为主的传统板块剪刀差走阔。

本基金以大成中证电池主题 ETF 作为其主要投资标的，业绩比较基准为中证电池主题指数收益率×95%+银行活期存款利率(税后)×5%。在投资运作过程中，本基金将在综合考虑合规、风险、效率、成本等因素的基础上，采用一级市场申购赎回的方式或二级市场买卖的方式对目标 ETF 进行投资。

中证电池主题指数从沪深市场中选取业务涉及动力电池、储能电池、消费电子电池以及相关产业链上下游的上市公司证券作为指数样本，以反映电池主题上市公司证券的整体表现。报告期

内，中证电池主题指数（931719.CSI，简称：CS 电池）涨跌幅+6.16%，碳酸锂仍处上行周期，储能高增，新技术（如固态电池、钠离子电池等）迎产业化验证元年。

运作层面上，本基金在报告期内基本保持满仓，并根据标的指数成份股调整以及权重的变化及时调整投资组合。各项操作和指标均符合基金合同的要求。

3.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至转型后报告期末大成中证电池主题 ETF 发起式联接 A 的基金份额净值为 0.9495 元，本报告期（2026 年 1 月 23 日-2026 年 6 月 30 日）基金份额净值增长率为 6.59%，同期业绩比较基准收益率为 4.96%；截至转型后报告期末大成中证电池主题 ETF 发起式联接 C 的基金份额净值为 0.9383 元，本报告期（2026 年 1 月 23 日-2026 年 6 月 30 日）基金份额净值增长率为 6.44%，同期业绩比较基准收益率为 4.96%。

截至转型前报告期末大成中证电池主题指数发起式 A 的基金份额净值为 0.8908 元，本报告期（2026 年 1 月 1 日-2026 年 1 月 22 日）基金份额净值增长率为 0.97%，同期业绩比较基准收益率为 0.96%；截至转型前报告期末大成中证电池主题指数发起式 C 的基金份额净值为 0.8815 元，本报告期（2026 年 1 月 1 日-2026 年 1 月 22 日）基金份额净值增长率为 0.96%，同期业绩比较基准收益率为 0.96%。

3.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望 2026 年下半年，我们判断市场震荡上行趋势未改但短期波动或加剧，市场后续或延续“K 型”分化，经济“新强旧弱”、CPI 偏弱、PPI 或回落；流动性上增量资金可期、外资流入节奏或有反复，海外美联储政策为主要扰动因素；国内政策端货币适度宽松。

组合管理上，我们将严格按照基金合同的相关约定，紧密跟踪标的指数，按照标的指数成分股组成及其权重的变化调整投资组合，努力实现跟踪误差的最小化。

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

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。

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

报告期内，本托管人根据自身能够获取的数据和信息，依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；基金管理人在报告期内，严格遵守了《证券投资基金法》等有关法律法规，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

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

本托管人根据自身能够获取的数据和信息，认真复核了本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，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。

§5 半年度财务会计报告（未经审计）（转型后）

5.1 资产负债表

会计主体：大成中证电池主题交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金

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
资 产：		
货币资金	6.4.7.1	18,748,308.06
结算备付金		523,608.27
存出保证金		403,835.10
交易性金融资产	6.4.7.2	344,938,756.24
其中：股票投资		707,797.96
基金投资		343,927,810.58
债券投资		303,147.70
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		2,120,198.34
应收股利		-
应收申购款		3,284,678.08
递延所得税资产		-
其他资产	6.4.7.8	187,717.98
资产总计		370,207,102.07
负债和净资产	**附注号**	**本期末 2026 年 6 月 30 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		6,924.14
应付赎回款		5,562,843.45

应付管理人报酬		8,602.40
应付托管费		1,720.49
应付销售服务费		68,102.71
应付投资顾问费		-
应交税费		13.92
应付利润		-
递延所得税负债		-
其他负债	6.4.7.9	113,115.86
负债合计		5,761,322.97
净资产：		
实收基金	6.4.7.10	387,412,159.50
未分配利润	6.4.7.12	-22,966,380.40
净资产合计		364,445,779.10
负债和净资产总计		370,207,102.07

注：报告截止日 2026 年 6 月 30 日，基金份额总额 387,412,159.50 份。其中大成中证电池主题 ETF 发起式联接 A 类基金份额总额为 84,835,981.25 份，基金份额净值 0.9495 元；大成中证电池主题 ETF 发起式联接 C 类基金份额总额为 302,576,178.25 份，基金份额净值 0.9383 元。

5.2 利润表

会计主体：大成中证电池主题交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金

本报告期：2026 年 1 月 23 日（基金合同生效日）至 2026 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2026 年 1 月 23 日（基金合同生效日）至 2026 年 6 月 30 日
一、营业总收入		17,886,667.30
1.利息收入		28,302.94
其中：存款利息收入	6.4.7.13	28,302.94
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）		54,497,349.09
其中：股票投资收益	6.4.7.14	52,623,473.74
基金投资收益	6.4.7.15	1,745,262.64
债券投资收益	6.4.7.16	153,299.21
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	-24,686.50

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	-37,049,221.24
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	410,236.51
减：二、营业总支出		494,224.70
1．管理人报酬	6.4.10.2.1	51,545.72
2．托管费	6.4.10.2.2	10,309.14
3．销售服务费	6.4.10.2.3	356,404.18
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		1.56
8．其他费用	6.4.7.24	75,964.10
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		17,392,442.60
减：所得税费用		-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		17,392,442.60
五、其他综合收益的税后净额		-
六、综合收益总额		17,392,442.60

5.3 净资产变动表

会计主体：大成中证电池主题交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金

本报告期：2026 年 1 月 23 日（基金合同生效日）至 2026 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 23 日（基金合同生效日）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	-	-	-	-
二、本期期初净资产	440,909,947.45	-	-51,389,474.00	389,520,473.45
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	-53,497,787.95	-	28,423,093.60	-25,074,694.35
（一）、综合收益总额	-	-	17,392,442.60	17,392,442.60

（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）	-53,497,787.95	-	11,030,651.00	-42,467,136.95
其中：1.基金申购款	800,893,210.83	-	-53,265,961.89	747,627,248.94
2.基金赎回款	-854,390,998.78	-	64,296,612.89	-790,094,385.89
（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	387,412,159.50	-	-22,966,380.40	364,445,779.10

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

5.4 报表附注

5.4.1 基金基本情况

大成中证电池主题交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金（以下简称“本基金”）是由原大成中证电池主题指数型发起式证券投资基金转型而来。根据大成基金管理有限公司于 2026 年 1 月 21 日发布的《关于大成中证电池主题指数型发起式证券投资基金变更为大成中证电池主题交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金并相应修订法律文件的公告》，经与基金托管人协商一致，大成基金管理有限公司对《大成中证电池主题指数型发起式证券投资基金基金合同》进行修订和补充，修订后的《大成中证电池主题交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金基金合同》自 2026 年 1 月 23 日起生效，原《大成中证电池主题指数型发起式证券投资基金基金合同》自同日起失效。本基金的基金管理人为大成基金管理有限公司，基金托管人为兴业银行股份有限公司。

根据《大成中证电池主题交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金招募说明书》和《大

成中证电池主题交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金基金合同》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。

本基金为大成中证电池主题交易型开放式指数证券投资基金（以下简称“目标 ETF”）的联接基金。目标 ETF 是采用完全复制法实现对中证电池主题指数紧密跟踪的全被动指数基金，本基金主要通过投资于目标 ETF 实现对业绩比较基准的紧密跟踪，力争使本基金日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.35%，年跟踪误差不超过 4%。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《大成中证电池主题交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金基金合同》的有关规定，本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，以目标 ETF 基金份额、标的指数的成份股及其备选成份股（均含存托凭证，下同）为主要投资对象。为更好地实现投资目标，本基金可少量投资于非成份股（包括主板、创业板、科创板及其他经中国证监会核准或注册上市的股票、存托凭证）、债券（包括国债、央行票据、金融债、企业债、公司债、公开发行的次级债、地方政府债券、中期票据、可转换债券（含分离交易可转债）、可交换债券、短期融资券等）、资产支持证券、债券回购、银行存款（包括协议存款、定期存款及其他银行存款）、同业存单、货币市场工具、股指期货、国债期货、股票期权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）。本基金将根据法律法规的规定参与融资和转融通证券出借业务。本基金的投资组合比例为：本基金投资于目标 ETF 的资产比例不低于基金资产净值的 90%；每个交易日日终在扣除股指期货、国债期货、股票期权保证金以后，本基金保留的现金或到期日在一年以内的政府债券投资比例不低于基金资产净值的 5%，其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。股指期货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：中证电池主题指数收益率×95%+银行活期存款利率（税后）×5%。

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 23 日（基金合同生效日）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 重要会计政策和会计估计

5.4.4.1 会计年度

本基金会计年度为公历 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。本财务报表的实际编制期间为 2026 年 1 月 23 日（基金合同生效日）至 2026 年 6 月 30 日止期间。

5.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

5.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

金融工具，是指形成一方的金融资产并形成其他方的金融负债或权益工具的合同。当本基金成为金融工具合同的一方时，确认相关的金融资产、金融负债或权益工具。

(1)金融资产

金融资产于初始确认时分类为：以摊余成本计量的金融资产、以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产及以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。金融资产的分类取决于本基金管理金融资产的业务模式和金融资产的合同现金流量特征。本基金现无金融资产分类为以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产。

债务工具

本基金持有的债务工具是指从发行方角度分析符合金融负债定义的工具，分别采用以下两种方式进行计量：

以摊余成本计量：

本基金管理以摊余成本计量的金融资产的业务模式为以收取合同现金流量为目标，且以摊余成本计量的金融资产的合同现金流量特征与基本借贷安排相一致，即在特定日期产生的现金流量，仅为对本金和以未偿付本金金额为基础的利息的支付。本基金持有的以摊余成本计量的金融资产主要为银行存款、买入返售金融资产和其他各类应收款项等。

以公允价值计量且其变动计入当期损益：

本基金将持有的未划分为以摊余成本计量的债务工具，以公允价值计量且其变动计入当期损

益。本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产主要为债券投资、资产支持证券投资和基金投资，在资产负债表中以交易性金融资产列示。

权益工具

权益工具是指从发行方角度分析符合权益定义的工具。本基金将对其没有控制、共同控制和重大影响的权益工具(主要为股票投资)按照公允价值计量且其变动计入当期损益，在资产负债表中列示为交易性金融资产。

(2)金融负债

金融负债于初始确认时分类为以摊余成本计量的金融负债和以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。本基金目前暂无金融负债分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。本基金持有的以摊余成本计量的金融负债包括卖出回购金融资产款和其他各类应付款项等。

(3)衍生金融工具

本基金将持有的衍生金融工具以公允价值计量且其变动计入当期损益，在资产负债表中列示为衍生金融资产/负债。

5.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

金融资产或金融负债在初始确认时以公允价值计量。对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和金融负债，相关交易费用计入当期损益；对于支付的价款中包含的债券或资产支持证券起息日或上次除息日至购买日止的利息，确认为应计利息，包含在交易性金融资产的账面价值中。对于其他类别的金融资产和金融负债，相关交易费用计入初始确认金额。

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，按照公允价值进行后续计量；对于应收款项和其他金融负债采用实际利率法，以摊余成本进行后续计量。

本基金对于以摊余成本计量的金融资产，以预期信用损失为基础确认损失准备。

本基金考虑在资产负债表日无须付出不必要的额外成本和努力即可获得的有关过去事项、当前状况以及对未来经济状况的预测等合理且有依据的信息，以发生违约的风险为权重，计算合同应收的现金流量与预期能收到的现金流量之间差额的现值的概率加权金额，确认预期信用损失。

于每个资产负债表日，本基金对于处于不同阶段的金融工具的预期信用损失分别进行计量。对于不含重大融资成分的应收款项，本基金运用简化计量方法，按照相当于整个存续期内的预期信用损失金额计量损失准备。除上述采用简化计量方法以外的金融工具，自初始确认后信用风险未显著增加的，处于第一阶段，本基金按照未来 12 个月内的预期信用损失计量损失准备；金融工具自初始确认后信用风险已显著增加但尚未发生信用减值的，处于第二阶段，本基金按照该工具

整个存续期的预期信用损失计量损失准备；金融工具自初始确认后已经发生信用减值的，处于第三阶段，本基金按照该工具整个存续期的预期信用损失计量损失准备。

对于在资产负债表日具有较低信用风险的金融工具，本基金假设其信用风险自初始确认后并未显著增加，认定为处于第一阶段的金融工具，按照未来 12 个月内的预期信用损失计量损失准备。

本基金对于处于第一阶段和第二阶段的金融工具，按照其未扣除减值准备的账面余额和实际利率计算利息收入。对于处于第三阶段的金融工具，按照其账面余额减已计提减值准备后的摊余成本和实际利率计算利息收入。

本基金将计提或转回的损失准备计入当期损益。

金融资产满足下列条件之一的，予以终止确认：(1)收取该金融资产现金流量的合同权利终止；(2)该金融资产已转移，且本基金将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方；或者(3)该金融资产已转移，虽然本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬，但是放弃了对该金融资产控制。

金融资产终止确认时，其账面价值与收到的对价的差额，计入当期损益。

当金融负债的现时义务全部或部分已经解除时，终止确认该金融负债或义务已解除的部分。终止确认部分的账面价值与支付的对价之间的差额，计入当期损益。

5.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

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

(1)存在活跃市场的金融工具按其估值日的市场交易价格确定公允价值；估值日无交易且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，按最近交易日的市场交易价格确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的市场交易价格不能真实反映公允价值的，应对市场交易价格进行调整，确定公允价值。与上述投资品种相同，但具有不同特征的，应以相同资产或负债的公允价值为基础，并在估值技术中考虑不同特征因素的影响。特征是指对资产出售或使用的限制等，如果该限制是针对资产持有者的，那么在估值技术中不应将该限制作为特征考虑。此外，基金管理人不应考虑因大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价。

(2)当金融工具不存在活跃市场，采用在当前情况下适用并且有足够可利用数据和其他信息支持的估值技术确定公允价值。采用估值技术时，优先使用可观察输入值，只有在无法取得相关资产或负债可观察输入值或取得不切实可行的情况下，才可以使用不可观察输入值。

(3)如经济环境发生重大变化或证券发行人发生影响金融工具价格的重大事件，应对估值进行

调整并确定公允价值。

5.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

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

5.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行基金份额所募集的总金额在扣除损益平准金分摊部分后的余额。由于申购和赎回引起的实收基金变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日确认。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

本基金发行的份额作为可回售工具具备以下特征：(1)赋予基金份额持有人在基金清算时按比例份额获得该基金净资产的权利，这里所指基金净资产是扣除所有优先于该基金份额对基金资产要求权之后的剩余资产；这里所指按比例份额是清算时将基金的净资产分拆为金额相等的单位，并且将单位金额乘以基金份额持有人所持有的单位数量；(2)该工具所属的类别次于其他所有工具类别，即本基金份额在归属于该类别前无须转换为另一种工具，且在清算时对基金资产没有优先于其他工具的要求权；(3)该工具所属的类别中(该类别次于其他所有工具类别)，所有工具具有相同的特征(例如它们必须都具有可回售特征，并且用于计算回购或赎回价格的公式或其他方法都相同)；(4)除了发行方应当以现金或其他金融资产回购或赎回该基金份额的合同义务外，该工具不满足金融负债定义中的任何其他特征；(5)该工具在存续期内的预计现金流量总额，应当实质上基于该基金存续期内基金的损益、已确认净资产的变动、已确认和未确认净资产的公允价值变动(不包括本基金的任何影响)。

可回售工具，是指根据合同约定，持有方有权将该工具回售给发行方以获取现金或其他金融资产的权利，或者在未来某一不确定事项发生或者持有方死亡或退休时，自动回售给发行方的金融工具。

本基金没有同时具备下列特征的其他金融工具或合同：(1)现金流量总额实质上基于基金的损益、已确认净资产的变动、已确认和未确认净资产的公允价值变动(不包括该基金或合同的任何影响)；(2)实质上限制或固定了上述工具持有方所获得的剩余回报。

本基金将实收基金分类为权益工具，列报于净资产。

5.4.4.8 损益平准金

损益平准金包括已实现平准金和未实现平准金。已实现平准金指在申购或赎回基金份额时，

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

5.4.4.9 收入/（损失）的确认和计量

股票投资在持有期间应取得的现金股利扣除由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额确认为投资收益。债券投资和资产支持证券投资在持有期间应取得的按票面利率(对于贴现债为按发行价计算的利率)或合同利率计算的利息扣除在适用情况下由债券和资产支持证券发行企业代扣代缴的个人所得税及由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为投资收益。基金投资在持有期间应取得的红利于除权日确认为投资收益。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在持有期间的公允价值变动扣除按票面利率(对于贴现债为按发行价计算的利率)或合同利率计算的利息后的净额确认为公允价值变动损益；于处置时，其处置价格与初始确认金额之间的差额扣除相关交易费用及在适用情况下由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为投资收益，其中包括从公允价值变动损益结转的公允价值累计变动额。

应收款项在持有期间确认的利息收入按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

5.4.4.10 费用的确认和计量

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

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

5.4.4.11 基金的收益分配政策

本基金同一类别的每一基金份额享有同等分配权。本基金收益以现金形式分配，但基金份额持有人可选择现金红利或将现金红利按分红除权日的基金份额净值自动转为基金份额进行再投资。若期末未分配利润中的未实现部分为正数，包括基金经营活动产生的未实现损益以及基金份额交易产生的未实现平准金等，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润中的已实现部分；若期末未分配利润的未实现部分为负数，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润，即已实现部分相抵未实现部分后的余额。

经宣告的拟分配基金收益于分红除权日从净资产转出。

5.4.4.12 外币交易

无。

5.4.4.13 分部报告

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

(1)该组成部分能够在日常活动中产生收入、发生费用。

(2)本基金的基金管理人能够定期评价该组成部分的经营成果，以决定向其配置资源、评价其业绩。

(3)本基金能够取得该组成部分的财务状况、经营成果和现金流量等有关会计信息。

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

5.4.4.14 其他重要的会计政策和会计估计

根据本基金的估值原则和中国证监会允许的基金行业估值实务操作，本基金确定以下类别股票投资、基金投资、债券投资和资产支持证券的公允价值时采用的估值方法及其关键假设如下：

(1)对于证券交易所上市的股票和债券，若出现重大事项停牌或交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)等情况，本基金根据中国证监会公告[2017]13 号《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》，根据具体情况采用《关于发布中基协(AMAC)基金行业股票估值指数的通知》提供的指数收益法、市盈率法、现金流量折现法等估值技术进行估值。

(2)对于在锁定期内的非公开发行股票、首次公开发行股票时公司股东公开发售股份、通过大宗交易取得的带限售期的股票等流通受限股票，根据中国基金业协会中基协发[2017]6 号《关于发布<证券投资基金投资流通受限股票估值指引(试行)>的通知》之附件《证券投资基金投资流通受限股票估值指引(试行)》(以下简称“指引”)，按估值日在证券交易所上市交易的同一股票的公允价值扣除中证指数有限公司根据指引所独立提供的该流通受限股票剩余限售期对应的流动性折扣后的价值进行估值。

(3)对于在证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券和可交换债券除外)及在银行间同业市场交易的固定收益品种，根据中国证监会公告[2017]13 号《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》及中国基金业协会中基协字[2022]566 号《关于发布<关于固定收益品种的估值处理标准>的通知》之附件《关于固定收益品种的估值处理标准》采用估值技术确定公允价值。本基金持有的证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券和可交换债券除外)，按照中证指数有限公司所独立提供的估值结果确定公允价值。本基金持有的银行间同业市场

固定收益品种按照中债金融估值中心有限公司所独立提供的估值结果确定公允价值。

(4)对于基金投资，根据中基协发[2017]3 号《关于发布<基金中基金估值业务指引(试行)>的通知》之附件《基金中基金估值业务指引(试行)》所述方法估值。

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	18,748,308.06
等于：本金	18,746,415.90
加：应计利息	1,892.16
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	18,748,308.06

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		658,047.81	-	707,797.96	49,750.15
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-	-
债券	交易所市场	300,209.25	2,937.70	303,147.70	0.75
	银行间市场	-	-	-	-
	合计	300,209.25	2,937.70	303,147.70	0.75
资产支持证券		-	-	-	-
基金		338,192,279.87	-	343,927,810.58	5,735,530.71
其他		-	-	-	-
合计		339,150,536.93	2,937.70	344,938,756.24	5,785,281.61

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

无。

5.4.7.3.2 期末基金持有的期货合约情况

无。

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

单位：人民币元

项目	本期末 2026 年 6 月 30 日
应收利息	-
其他应收款	-

待摊费用	-
可收退补款	87,452.00
应收退补款	100,265.98
合计	187,717.98

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	185.04
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	31,107.96
其中：交易所市场	31,107.96
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用	81,822.86
合计	113,115.86

5.4.7.10 实收基金

金额单位：人民币元

大成中证电池主题 ETF 发起式联接 A

项目	本期 2026 年 1 月 23 日（基金合同生效日）至 2026 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
基金合同生效日	93,342,333.01	93,342,333.01
2026 年 1 月 23 日(基金合同生效日)至 2026 年 6 月 30 日基金份额折算调整	-	-
2026 年 1 月 23 日(基金合同生效日)至 2026 年 6 月 30 日未领取红利份额折算调整	-	-
2026 年 1 月 23 日(基金合同生效日)至 2026 年 6 月 30 日集中申购募集资金本金及利息	-	-
2026 年 1 月 23 日(基金合同生效日)至 2026 年 6 月 30 日基金拆分和集中申购完	-	-

成后		
本期申购	87,848,304.03	87,848,304.03
本期赎回（以“-”号填列）	-96,354,655.79	-96,354,655.79
本期末	84,835,981.25	84,835,981.25

大成中证电池主题 ETF 发起式联接 C

项目	本期 2026 年 1 月 23 日（基金合同生效日）至 2026 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
基金合同生效日	347,567,614.44	347,567,614.44
2026 年 1 月 23 日(基金合同生效日)至 2026 年 6 月 30 日基金份额折算调整	-	-
2026 年 1 月 23 日(基金合同生效日)至 2026 年 6 月 30 日未领取红利份额折算调整	-	-
2026 年 1 月 23 日(基金合同生效日)至 2026 年 6 月 30 日集中申购募集资金本金及利息	-	-
2026 年 1 月 23 日(基金合同生效日)至 2026 年 6 月 30 日基金拆分和集中申购完成后	-	-
本期申购	713,044,906.80	713,044,906.80
本期赎回（以“-”号填列）	-758,036,342.99	-758,036,342.99
本期末	302,576,178.25	302,576,178.25

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

大成中证电池主题 ETF 发起式联接 A

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计

基金合同生效日	-15,582,284.13	5,392,569.30	-10,189,714.83
本期期初	-15,582,284.13	5,392,569.30	-10,189,714.83
本期利润	11,686,033.90	-7,860,991.23	3,825,042.67
本期基金份额交易产生的变动数	444,890.87	1,632,994.83	2,077,885.70
其中：基金申购款	-4,362,711.96	-469,713.58	-4,832,425.54
基金赎回款	4,807,602.83	2,102,708.41	6,910,311.24
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-3,451,359.36	-835,427.10	-4,286,786.46

大成中证电池主题 ETF 发起式联接 C

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
基金合同生效日	-60,309,151.66	19,109,392.49	-41,199,759.17
本期期初	-60,309,151.66	19,109,392.49	-41,199,759.17
本期利润	42,755,629.94	-29,188,230.01	13,567,399.93
本期基金份额交易产生的变动数	2,488,380.83	6,464,384.47	8,952,765.30
其中：基金申购款	-41,572,460.37	-6,861,075.98	-48,433,536.35
基金赎回款	44,060,841.20	13,325,460.45	57,386,301.65
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-15,065,140.89	-3,614,453.05	-18,679,593.94

5.4.7.13 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 23 日（基金合同生效日）至 2026 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	27,053.38
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	500.63
其他	748.93
合计	28,302.94

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23日（基金合同生效日）至2026年6月30日
股票投资收益——买卖股票差价收入	8,541,740.94
股票投资收益——赎回差价收入	-
股票投资收益——申购差价收入	44,081,732.80
股票投资收益——证券出借差价收入	-

合计	52,623,473.74

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 23 日（基金合同生效日）至 2026 年 6 月 30 日
卖出股票成交总额	214,001,104.51
减：卖出股票成本总额	205,265,431.48
减：交易费用	193,932.09
买卖股票差价收入	8,541,740.94

5.4.7.14.3 股票投资收益——赎回差价收入

无。

5.4.7.14.4 股票投资收益——申购差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2026年1月23日（基金合同生效日）至2026年6月30日
申购基金份额总额	514,416,900.00
减：现金支付申购款总额	99,587,162.33
减：申购股票成本总额	370,748,004.87
减：交易费用	-
申购差价收入	44,081,732.80

5.4.7.14.5 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

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 23 日（基金合同生效日）至 2026 年 6 月 30 日
卖出/赎回基金成交总额	185,704,288.20
减：卖出/赎回基金成本总额	183,954,700.42
减：买卖基金差价收入应缴纳增值税额	-
减：交易费用	4,325.14
基金投资收益	1,745,262.64

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23日（基金合同生效日）至2026年6月30日

债券投资收益——利息收入	10,858.52
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	142,440.69
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	153,299.21

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23日（基金合同生效日）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	4,128,031.68
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	3,946,815.75
减：应计利息总额	38,759.75
减：交易费用	15.49
买卖债券差价收入	142,440.69

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

无。

5.4.7.20 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 23 日（基金合同生效日）至 2026 年 6 月 30 日
股票投资产生的股利收益	-24,686.50
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	-24,686.50

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 23 日（基金合同生效日）至 2026 年 6 月 30 日
1.交易性金融资产	-37,049,221.24
股票投资	-42,784,752.70
债券投资	0.75
资产支持证券投资	-
基金投资	5,735,530.71
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	-37,049,221.24

5.4.7.22 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 23 日（基金合同生效日）至 2026 年 6 月 30 日
基金赎回费收入	398,001.15
基金转换费收入	12,235.36
合计	410,236.51

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 23 日（基金合同生效日）至 2026 年 6 月 30 日
审计费用	19,603.11
信息披露费	52,274.43
证券出借违约金	-
银行划款手续费	4,086.56
合计	75,964.10

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
兴业银行股份有限公司(“兴业银行”)	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
大成中证电池主题交易型开放式指数证券投资基金(“大成中证电池主题 ETF”)	本基金的目标 ETF

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 23 日（基金合同生效日）至 2026 年 6 月 30 日	
	成交金额	占当期股票 成交总额的比例（%）
光大证券	63,327,071.35	18.94

5.4.10.1.2 债券交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2026 年 1 月 23 日（基金合同生效日）至 2026 年 6 月 30 日	
	成交金额	占当期债券 成交总额的比例（%）
光大证券	7,705,134.00	95.21

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23日（基金合同生效日）至2026年6月30日			
	当期 佣金	占当期佣金总量的比例（%）	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例（%）
光大证券	12,412.12	19.01	119.53	0.38

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 23 日（基金合同生效日）至 2026 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	51,545.72
其中：应支付销售机构的客户维护费	366,650.87
应支付基金管理人的净管理费	-315,105.15

注：本基金投资于目标 ETF 的部分不收取管理费，支付销售机构的客户维护费不因投资于基金管理人所管理的目标 ETF 而调减，因此应支付基金管理人的净管理费为负。本基金管理费年费率为 0.50%，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目标 ETF 基金份额部分后的余额(若为负数，则取零)×管理费年费率/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 23 日（基金合同生效日）至 2026 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	10,309.14

注：本基金投资于目标 ETF 的部分不收取托管费。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目标 ETF 基金份额部分后的余额(若为负数，则取零)×托管费年费率/当年天数。

5.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期 2026 年 1 月 23 日（基金合同生效日）至 2026 年 6 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	大成中证电池主题 ETF 发起式联接 A	大成中证电池主题 ETF 发起式联接 C	合计

大成基金	-	1,922.31	1,922.31
兴业银行	-	4,665.20	4,665.20
合计	-	6,587.51	6,587.51

注：C 类基金份额的销售服务费年费率为 0.30%。

销售服务费的计算方法如下：

H＝E×该类基金份额销售服务费年费率÷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 23 日（基金合同生效日）至 2026 年 6 月 30 日	
	大成中证电池主题 ETF 发起式联接 A	大成中证电池主题 ETF 发起式联接 C
基金合同生效日（ 2026 年 1 月 23 日）持有的基金份额	10,000,450.04	-
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	10,000,450.04	-
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	2.58%	-

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 23 日（基金合同生效日）至 2026 年 6 月 30 日	
	期末余额	当期利息收入
兴业银行	18,748,308.06	27,053.38

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

于本期末，本基金持有 329,653,801.00 份目标 ETF 基金份额，占其份额的比例为 60.21%。

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
001220	世盟股份	2026 年 1 月 27 日	6 个月	新股锁定	28.00	27.78	57	1,596.00	1,583.46	-
301687	新广益	2025 年 12 月 24 日	6 个月	新股锁定	21.93	77.78	195	4,276.35	15,167.10	-
601112	振石股份	2026 年 1 月 21 日	6 个月	新股锁定	11.18	17.59	372	4,158.96	6,543.48	-

603352	至信股份	2026 年 1 月 8 日	6 个月	新股锁定	21.88	25.52	112	2,450.56	2,858.24	-
688712	北芯生命	2026 年 1 月 28 日	6 个月	新股锁定	17.52	35.92	234	4,099.68	8,405.28	-
688785	恒运昌	2026 年 1 月 20 日	6 个月	新股锁定	92.18	463.15	108	9,955.44	50,020.20	-

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

本基金属于交易型开放式指数证券投资基金联接基金，主要通过投资于目标 ETF 来实现对业绩比较基准的紧密跟踪。因此，本基金的业绩表现与中证电池主题指数及目标 ETF 的表现密切相关，其预期风险与预期收益高于混合基金、债券基金与货币市场基金。本基金在日常经营活动中面临的与这些金融工具相关的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金的基金管理人从事风险管理的主要目标是争取将以上风险控制在限定的范围之内，使本基金在风险和收益之间取得最佳的平衡以实现“紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差最小化”的风险收益目标。

本基金的基金管理人奉行全面风险管理体系的建设，建立了以由高层监控(合规与风险管理委员会、公司投资风险控制委员会)、专业监控(监察稽核部、风险管理部)、部门互控、岗位自控构成的风险管理架构体系。本基金的基金管理人在董事会下设立合规与风险管理委员会，对公司整体运营风险进行监督，监督风险控制措施的执行；在管理层层面设立投资风险控制委员会，通过

定期会议讨论涉及投资风险的重大议题，形成正式决议提交投委会；在业务操作层面，监察稽核部履行合规控制职责，通过定期、不定期检查内控制度的执行情况、对重大风险点以专项稽核的方式确保公司内控制度、流程得到贯彻执行。风险管理部履行风险量化评估分析职责。

本基金的基金管理人对于金融工具的风险管理方法主要是通过定性分析和定量分析的方法去估测各种风险产生的可能损失。从定性分析的角度出发，判断风险损失的严重程度和出现同类风险损失的频度。而从定量分析的角度出发，根据本基金的投资目标，结合基金资产所运用金融工具特征通过特定的风险量化指标、模型和日常的量化报告，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兴业银行股份有限公司，因而与银行存款相关的信用风险不重大。本基金在交易所进行的交易均以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，违约风险可能性很小；在银行间同业市场进行交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式进行限制以控制相应的信用风险。

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

本期末，本基金未持有除国债、央行票据和政策性金融债以外的债券(上年度末：本基金无债券投资)。

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约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、结算备付金和存出保证金等。

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	18,748,308.06	-	-	-	18,748,308.06
结算备付金	523,608.27	-	-	-	523,608.27
存出保证金	403,835.10	-	-	-	403,835.10
交易性金融资产	303,147.70	-	-	344,635,608.54	344,938,756.24
应收申购款	-	-	-	3,284,678.08	3,284,678.08
应收清算款	-	-	-	2,120,198.34	2,120,198.34
其他资产	-	-	-	187,717.98	187,717.98
资产总计	19,978,899.13	-	-	350,228,202.94	370,207,102.07
负债					
应付赎回款	-	-	-	5,562,843.45	5,562,843.45
应付管理人报酬	-	-	-	8,602.40	8,602.40
应付托管费	-	-	-	1,720.49	1,720.49
应付清算款	-	-	-	6,924.14	6,924.14
应付销售服务费	-	-	-	68,102.71	68,102.71
应交税费	-	-	-	13.92	13.92
其他负债	-	-	-	113,115.86	113,115.86
负债总计	-	-	-	5,761,322.97	5,761,322.97
利率敏感度缺口	19,978,899.13	-	-	344,466,879.97	364,445,779.10

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 0.08%，因此市场利率的变动对于本基金净资产无重大影响。

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。

本基金通过把全部或接近全部的基金资产投资于目标 ETF、标的指数成份股和备选成份股进行被动式指数化投资，本基金投资于目标 ETF 的资产比例不低于基金资产净值的 90%；每个交易日日终在扣除股指期货、国债期货、股票期权保证金以后，本基金保留的现金或到期日在一年以内的政府债券投资比例不低于基金资产净值的 5%，其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。股指期货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。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	
	公允价值	占基金资产净值比例（%）
交易性金融资产－股票投资	707,797.96	0.19
交易性金融资产－基金投资	343,927,810.58	94.37
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	344,635,608.54	94.56

5.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	出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）
	业绩比较基准上升 5%	17,875,010.00
	业绩比较基准下降 5%	-17,875,010.00

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
第一层次	344,551,030.78
第二层次	303,147.70
第三层次	84,577.76
合计	344,938,756.24

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。对于目标 ETF，若本基金因上述事项在目标 ETF 当日份额净值的基础上，对目标 ETF 的公允价值进行调整，则本基金在调整期间内将目标 ETF 的公允价值从第一层次转出。

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。

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 半年度财务会计报告（未经审计）（转型前）

6.1 资产负债表

会计主体：大成中证电池主题指数型发起式证券投资基金

报告截止日：2026 年 1 月 22 日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2026 年 1 月 22 日	上年度末 2025 年 12 月 31 日

资 产：			
货币资金	6.4.7.1	21,285,027.77	24,733,034.53
结算备付金		354,997.67	645,102.81
存出保证金		359,818.63	384,123.11
交易性金融资产	6.4.7.2	367,618,650.71	425,296,909.22
其中：股票投资		367,374,943.23	425,296,909.22
基金投资		-	-
债券投资		243,707.48	-
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		397,077.89	2,943,879.20
应收股利		-	-
应收申购款		6,942,392.63	6,744,698.47
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.8	-	-
资产总计		396,957,965.30	460,747,747.34
负债和净资产	**附注号**	**本期末 2026 年 1 月 22 日**	**上年度末 2025 年 12 月 31 日**
负 债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付清算款		-	-
应付赎回款		7,050,124.53	9,362,872.53
应付管理人报酬		125,422.61	200,389.92
应付托管费		25,084.52	40,077.97
应付销售服务费		59,756.60	99,173.37
应付投资顾问费		-	-
应交税费		0.23	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.9	177,103.36	146,731.03
负债合计		7,437,491.85	9,849,244.82
净资产：			
实收基金	6.4.7.10	440,909,947.45	515,401,496.65
未分配利润	6.4.7.12	-51,389,474.00	-64,502,994.13
净资产合计		389,520,473.45	450,898,502.52
负债和净资产总计		396,957,965.30	460,747,747.34

注：报告截止日 2026 年 1 月 22 日，基金份额总额 440,909,947.45 份。其中大成中证电池主题指

数发起式 A 类基金份额总额为 93,342,333.01 份，基金份额净值 0.8908 元；大成中证电池主题指数发起式 C 类基金份额总额为 347,567,614.44 份，基金份额净值 0.8815 元。

6.2 利润表

会计主体：大成中证电池主题指数型发起式证券投资基金

本报告期：2026 年 1 月 1 日至 2026 年 1 月 22 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 1 月 22 日	上年度可比期间 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
一、营业总收入		5,278,533.77	6,013,372.96
1.利息收入		5,059.29	12,059.97
其中：存款利息收入	6.4.7.13	5,059.29	12,059.97
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）		11,549,195.18	-5,332,299.66
其中：股票投资收益	6.4.7.14	11,477,265.34	-6,346,895.02
基金投资收益	6.4.7.15	-	-
债券投资收益	6.4.7.16	7.27	38,898.36
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	71,922.57	975,697.00
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	-6,345,217.09	11,289,811.92
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	69,496.39	43,800.73
减：二、营业总支出		221,648.47	451,866.90
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	125,422.61	240,684.26
2. 托管费	6.4.10.2.2	25,084.52	48,136.82

3．销售服务费	6.4.10.2.3	59,756.60	107,856.99
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		0.02	0.07
8．其他费用	6.4.7.24	11,384.72	55,188.76
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		5,056,885.30	5,561,506.06
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		5,056,885.30	5,561,506.06
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		5,056,885.30	5,561,506.06

6.3 净资产变动表

会计主体：大成中证电池主题指数型发起式证券投资基金

本报告期：2026 年 1 月 1 日至 2026 年 1 月 22 日

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 1 月 22 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	515,401,496.65	-	-64,502,994.13	450,898,502.52
二、本期期初净资产	515,401,496.65	-	-64,502,994.13	450,898,502.52
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-74,491,549.20	-	13,113,520.13	-61,378,029.07
（一）、综合收益总额	-	-	5,056,885.30	5,056,885.30
（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）	-74,491,549.20	-	8,056,634.83	-66,434,914.37
其中：1.基金申购款	164,076,726.66	-	-17,259,304.20	146,817,422.46
2．基金赎回款	-238,568,275.86	-	25,315,939.03	-213,252,336.83

（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	440,909,947.45	-	-51,389,474.00	389,520,473.45
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	183,966,518.74	-	-85,821,687.41	98,144,831.33
二、本期期初净资产	183,966,518.74	-	-85,821,687.41	98,144,831.33
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	202,881,922.99	-	-91,056,559.97	111,825,363.02
（一）、综合收益总额	-	-	5,561,506.06	5,561,506.06
（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）	202,881,922.99	-	-96,618,066.03	106,263,856.96
其中：1.基金申购款	519,813,464.08	-	-245,287,416.15	274,526,047.93
2.基金赎回款	-316,931,541.09	-	148,669,350.12	-168,262,190.97
（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	386,848,441.73	-	-176,878,247.38	209,970,194.35

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署：

谭晓冈　　范瑛　　梁靖

基金管理人负责人　　主管会计工作负责人　　会计机构负责人

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

大成中证电池主题指数型发起式证券投资基金(以下简称“本基金”)经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2022]1042 号《关于准予大成中证电池主题指数型发起式证券投资基金注册的批复》注册，由大成基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《大成中证电池主题指数型发起式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 14,197,196.88 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(2022)第 0475 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《大成中证电池主题指数型发起式证券投资基金基金合同》于 2022 年 6 月 28 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 14,197,847.83 份基金份额，其中认购资金利息折合 650.95 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，基金托管人为兴业银行股份有限公司。

本基金为发起式基金，发起资金认购部分为 10,000,450.04 份基金份额，发起资金认购方承诺使用发起资金认购的基金份额持有期限不少于 3 年。

根据《大成中证电池主题指数型发起式证券投资基金招募说明书》和《大成中证电池主题指数型发起式证券投资基金基金合同》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。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《大成中证电池主题指数型发起式证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金主要投资于标的指数成份股(含存托凭证)及其备选成份股(含存托凭证)。为更好地实现投资目标，本基金可少量投资于非成份股(包括创业板及其他经中国证监会核准或注册上市的股票、存托凭证)、债券(包括国债、央行票据、金融债、企业债、公司债、公开发行的次级债、地方政府债券、中期票据、可转换债券(含分离交易可转债)、可交换债券、短期融资券等)、资产支持证券、债券回购、银行存款(包括协议存款、定期存款及其他银行存款)、同业存单、货币市场工具、股指期货、国债期货、股票期权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)。本基金将根据法律法规的规定参与融资和

转融通证券出借业务。本基金的投资组合比例为：投资于股票资产(含存托凭证)占基金资产的比例不低于 90%；投资于标的指数的成份股及其备选成份股的比例不低于非现金基金资产的 80%；每个交易日日终在扣除股指期货、国债期货、股票期权保证金以后，本基金保留的现金或到期日在一年以内的政府债券投资比例不低于基金资产净值的 5%，其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。股指期货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。本基金投资业绩比较基准为：中证电池主题指数收益率×95%+银行活期存款利率(税后)×5%。

根据大成基金于 2026 年 1 月 21 日发布的《关于大成中证电池主题指数型发起式证券投资基金变更为大成中证电池主题交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金并相应修订法律文件的公告》，经与基金托管人协商一致，大成基金对《大成中证电池主题指数型发起式证券投资基金基金合同》相关条款进行了修订和补充，修订后的《大成中证电池主题交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金基金合同》自 2026 年 1 月 23 日起生效，原《大成中证电池主题指数型发起式证券投资基金基金合同》自同日起失效，本基金变更为大成中证电池主题交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金，存续期限为不定期。

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 1 月 22 日（基金合同失效前日）的财务状况以及自 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 1 月 22 日（基金合同失效前日）的经营成果和净资产变动情况等有关信息。

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

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 会计政策变更的说明

无。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

无。

6.4.5.3 差错更正的说明

无。

6.4.6 税项

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

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

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

(2)对基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股票的股息、红利收

入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

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

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

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

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

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

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

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 货币资金

单位：人民币元

项目	本期末 2026 年 1 月 22 日
活期存款	21,285,027.77
等于：本金	21,277,458.38
加：应计利息	7,569.39
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	21,285,027.77

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末 2026 年 1 月 22 日			
		成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票		324,540,440.38	-	367,374,943.23	42,834,502.85
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-	-
债券	交易所市场	243,700.00	7.48	243,707.48	0.00
	银行间市场	-	-	-	-
	合计	243,700.00	7.48	243,707.48	0.00
资产支持证券		-	-	-	-
基金		-	-	-	-
其他		-	-	-	-
合计		324,784,140.38	7.48	367,618,650.71	42,834,502.85

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

6.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

无。

6.4.7.3.2 期末基金持有的期货合约情况

无。

6.4.7.3.3 期末基金持有的黄金衍生品情况

无。

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

无。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

无。

6.4.7.4.3 按预期信用损失一般模型计提减值准备的说明

无。

6.4.7.5 债权投资

6.4.7.5.1 债权投资情况

无。

6.4.7.5.2 债权投资减值准备计提情况

无。

6.4.7.6 其他债权投资

6.4.7.6.1 其他债权投资情况

无。

6.4.7.6.2 其他债权投资减值准备计提情况

无。

6.4.7.7 其他权益工具投资

6.4.7.7.1 其他权益工具投资情况

无。

6.4.7.7.2 报告期末其他权益工具投资情况

无。

6.4.7.8 其他资产

无。

6.4.7.9 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2026 年 1 月 22 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	248.26
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	138,909.78
其中：交易所市场	138,909.78
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用	37,945.32
合计	177,103.36

6.4.7.10 实收基金

金额单位：人民币元

大成中证电池主题指数发起式 A

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 1 月 22 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	98,365,240.84	98,365,240.84
本期申购	17,616,244.59	17,616,244.59
本期赎回（以“-”号填列）	-22,639,152.42	-22,639,152.42
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	93,342,333.01	93,342,333.01

大成中证电池主题指数发起式 C

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 1 月 22 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	417,036,255.81	417,036,255.81
本期申购	146,460,482.07	146,460,482.07
本期赎回（以“-”号填列）	-215,929,123.44	-215,929,123.44
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	347,567,614.44	347,567,614.44

注：申购含红利再投份额(如有)、转换入份额(如有)；赎回含转换出份额(如有)。

6.4.7.11 其他综合收益

无。

6.4.7.12 未分配利润

单位：人民币元

大成中证电池主题指数发起式 A

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-18,913,715.89	7,329,058.55	-11,584,657.34
本期期初	-18,913,715.89	7,329,058.55	-11,584,657.34
本期利润	2,408,096.36	-1,538,751.84	869,344.52
本期基金份额交易产生的变动数	923,335.40	-397,737.41	525,597.99
其中：基金申购款	-3,102,195.38	1,410,461.83	-1,691,733.55
基金赎回款	4,025,530.78	-1,808,199.24	2,217,331.54
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-15,582,284.13	5,392,569.30	-10,189,714.83

大成中证电池主题指数发起式 C

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-82,753,248.74	29,834,911.95	-52,918,336.79
本期期初	-82,753,248.74	29,834,911.95	-52,918,336.79
本期利润	8,994,006.03	-4,806,465.25	4,187,540.78
本期基金份额交易产生的变动数	13,450,091.05	-5,919,054.21	7,531,036.84
其中：基金申购款	-26,784,764.21	11,217,193.56	-15,567,570.65
基金赎回款	40,234,855.26	-17,136,247.77	23,098,607.49
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-60,309,151.66	19,109,392.49	-41,199,759.17

6.4.7.13 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 1 月 22 日
活期存款利息收入	4,874.22
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	106.92
其他	78.15
合计	5,059.29

6.4.7.14 股票投资收益

6.4.7.14.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2026年1月1日至2026年1月22日
股票投资收益——买卖股票差价收入	11,477,265.34
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	11,477,265.34

6.4.7.14.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 1 月 22 日
卖出股票成交总额	84,181,631.53
减：卖出股票成本总额	72,634,953.52
减：交易费用	69,412.67
买卖股票差价收入	11,477,265.34

6.4.7.14.3 股票投资收益——证券出借差价收入

无。

6.4.7.15 基金投资收益

无。

6.4.7.16 债券投资收益

6.4.7.16.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2026年1月1日至2026年1月22日
债券投资收益——利息收入	7.27
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	-
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	7.27

6.4.7.16.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

无。

6.4.7.16.3 债券投资收益——赎回差价收入

无。

6.4.7.16.4 债券投资收益——申购差价收入

无。

6.4.7.17 资产支持证券投资收益

6.4.7.17.1 资产支持证券投资收益项目构成

无。

6.4.7.17.2 资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入

无。

6.4.7.17.3 资产支持证券投资收益——赎回差价收入

无。

6.4.7.17.4 资产支持证券投资收益——申购差价收入

无。

6.4.7.18 贵金属投资收益

6.4.7.18.1 贵金属投资收益项目构成

无。

6.4.7.18.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

无。

6.4.7.18.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

无。

6.4.7.18.4 贵金属投资收益——申购差价收入

无。

6.4.7.19 衍生工具收益

6.4.7.19.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

无。

6.4.7.19.2 衍生工具收益——其他投资收益

无。

6.4.7.20 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 1 月 22 日
股票投资产生的股利收益	71,922.57
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	71,922.57

6.4.7.21 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 1 月 22 日
1.交易性金融资产	-6,345,217.09
股票投资	-6,345,217.09
债券投资	-
资产支持证券投资	-
基金投资	-
贵金属投资	-
其他	-
2.衍生工具	-
权证投资	-
3.其他	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税	-
合计	-6,345,217.09

6.4.7.22 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 1 月 22 日
基金赎回费收入	65,783.54
基金转换费收入	3,712.85
合计	69,496.39

6.4.7.23 信用减值损失

无。

6.4.7.24 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 1 月 22 日
审计费用	2,712.38
信息披露费	7,232.94
证券出借违约金	-
银行划款手续费	1,439.40
合计	11,384.72

6.4.7.25 分部报告

无。

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 或有事项

无。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

1、《大成中证电池主题交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金基金合同》自 2026 年 1 月 23 日起生效，《大成中证电池主题指数型发起式证券投资基金基金合同》于当日失效，本基金变更为大成中证电池主题交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金；

2、截至本财务报表批准报出日，除上述事项外，本基金无其他需要披露的资产负债表日后事项。

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

兴业银行股份有限公司（“兴业银行”）	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

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 1 月 22 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	16,835,206.04	16.02	29,073,801.80	23.36

6.4.10.1.2 债券交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 1 月 22 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	占当期债券成交总额的比例（%）	成交金额	占当期债券成交总额的比例（%）
光大证券	-	-	5,692,466.00	94.81

6.4.10.1.3 债券回购交易

无。

6.4.10.1.4 基金交易

无。

6.4.10.1.5 权证交易

无。

6.4.10.1.6 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2026年1月1日至2026年1月22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	3,299.66	16.07	24,406.49	17.57
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	5,698.43	23.43	4,553.45	25.39

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

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

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 1 月 22 日	上年度可比期间 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	125,422.61	240,684.26
其中：应支付销售机构的客户维护费	60,207.73	108,870.49
应支付基金管理人的净管理费	65,214.88	131,813.77

注：本基金管理费年费率为 0.50%，每日计提，按月支付。其计算公式为：

日管理费＝前一日基金资产净值×管理费年费率/当年天数。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 1 月 22 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	25,084.52	48,136.82

注：本基金托管费年费率为 0.10%，每日计提，按月支付。其计算公式为：

日托管费＝前一日基金资产净值×托管费年费率/当年天数。

6.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

	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 1 月 22 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	大成中证电池主题指数发起式 A	大成中证电池主题指数发起式 C	合计
大成基金	-	329.33	329.33
兴业银行	-	590.06	590.06
合计	-	919.39	919.39
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	大成中证电池主题指数发起式 A	大成中证电池主题指数发起式 C	合计
大成基金	-	659.76	659.76
兴业银行	-	90.42	90.42
合计	-	750.18	750.18

注：C 类基金份额的销售服务费年费率为 0.30%。

销售服务费的计算方法如下：

H＝E×该类基金份额销售服务费年费率÷当年天数

H 为该类基金份额每日应计提的销售服务费

E 为该类基金份额前一日基金资产净值

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

无。

6.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

6.4.10.4.1 与关联方通过约定申报方式进行的适用固定期限费率的证券出借业务的情况

无。

6.4.10.4.2 与关联方通过约定申报方式进行的适用市场化期限费率的证券出借业务的情况

无。

6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

份额单位：份

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 1 月 22 日	
	大成中证电池主题指数发起式 A	大成中证电池主题指数发起式 C
基金合同生效日（ 2022 年 6 月 28 日）持有的基金份额	-	-
报告期初持有的基金份额	10,000,450.04	-
报告期间申购/买入总份额	-	-
报告期间因拆分变动份额	-	-
减：报告期间赎回/卖出总份额	-	-
报告期末持有的基金份额	10,000,450.04	-
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	2.27%	-
项目	上年度可比期间 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日	
	大成中证电池主题指数发起式 A	大成中证电池主题指数发起式 C
基金合同生效日（ 2022 年 6 月 28 日）持有的基金份额	-	-
报告期初持有的基金份额	10,000,450.04	-
报告期间申购/买入总份额	-	-
报告期间因拆分变动份额	-	-
减：报告期间赎回/卖出总份额	-	-
报告期末持有的基金份额	10,000,450.04	-
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	2.59%	-

注：基金管理人大成基金投资本基金适用的交易费率与本基金法律文件规定一致。

6.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

无。

6.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 1 月 22 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
兴业银行	21,285,027.77	4,874.22	76,183,091.34	11,923.23

注：本基金由基金托管人保管的银行存款，按银行约定利率计息。

6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

无。

6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

无。

6.4.11 利润分配情况

无。

6.4.12 期末（2026 年 1 月 22 日）本基金持有的流通受限证券

6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

6.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	受限期	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量（单位：股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
001221	悍高集团	2025 年 7 月 23 日	6 个月	新股锁定	15.43	68.32	83	1,280.69	5,670.56	-
001233	海安集团	2025 年 11 月 18 日	6 个月	新股锁定	48.00	70.76	330	15,840.00	23,350.80	-
001280	中国铀业	2025 年 11 月 25 日	6 个月	新股锁定	17.89	64.48	2,080	37,211.20	134,118.40	-

001285	瑞立科密	2025年9月23日	6个月	新股锁定	42.28	58.57	31	1,310.68	1,815.67	-
001369	双欣材料	2025年12月23日	6个月	新股锁定	6.85	11.88	790	5,411.50	9,385.20	-
001386	马可波罗	2025年10月15日	6个月	新股锁定	13.75	23.42	334	4,592.50	7,822.28	-
001396	誉帆科技	2025年12月23日	6个月	新股锁定	22.29	34.58	69	1,538.01	2,386.02	-
301449	天溯计量	2025年12月16日	6个月	新股锁定	36.80	65.73	112	4,121.60	7,361.76	-
301491	汉桑科技	2025年7月29日	6个月	新股锁定	28.91	59.02	104	3,006.64	6,138.08	-
301563	云汉芯城	2025年9月23日	6个月	新股锁定	27.00	180.70	96	2,592.00	17,347.20	-
301575	艾芬达	2025年9月3日	6个月	新股锁定	27.69	52.57	73	2,021.37	3,837.61	-
301584	建发致新	2025年9月18日	6个月	新股锁定	7.05	29.54	373	2,629.65	11,018.42	-
301609	山大电力	2025年7月16日	6个月	新股锁定	14.66	52.27	169	2,477.54	8,833.63	-
301632	广东建科	2025年8月5日	6个月	新股锁定	6.56	24.77	304	1,994.24	7,530.08	-

301638	南网数字	2025 年 11 月 11 日	6 个月	新股锁定	5.69	16.82	2,011	11,442.59	33,825.02	-
301656	联合动力	2025 年 9 月 17 日	6 个月	新股锁定	12.48	27.19	786	9,809.28	21,371.34	-
301667	纳百川	2025 年 12 月 10 日	6 个月	新股锁定	22.63	59.15	151	3,417.13	8,931.65	-
301668	昊创瑞通	2025 年 9 月 15 日	6 个月	新股锁定	21.00	53.10	95	1,995.00	5,044.50	-
301687	新广益	2025 年 12 月 24 日	6 个月	新股锁定	21.93	47.49	195	4,276.35	9,260.55	-
601112	振石股份	2026 年 1 月 21 日	6 个月	新股未上市	11.18	11.18	372	4,158.96	4,158.96	-
601112	振石股份	2026 年 1 月 21 日	1 个月内（含）	新股未上市	11.18	11.18	3,347	37,419.46	37,419.46	-
603092	德力佳	2025 年 10 月 30 日	6 个月	新股锁定	46.68	64.22	138	6,441.84	8,862.36	-
603175	超颖电子	2025 年 10 月 17 日	6 个月	新股锁定	17.08	51.07	73	1,246.84	3,728.11	-
603248	锡华科技	2025 年 12 月 16 日	6 个月	新股锁定	10.10	17.36	260	2,626.00	4,513.60	-
603334	丰倍	2025 年 10	6 个月	新股	24.49	39.00	88	2,155.12	3,432.00	-

	生物	月 29 日		锁定						
603352	至信股份	2026 年 1 月 8 日	6 个月	新股锁定	21.88	35.64	112	2,450.56	3,991.68	-
603376	大明电子	2025 年 10 月 28 日	6 个月	新股锁定	12.55	28.18	111	1,393.05	3,127.98	-
688727	恒坤新材	2025 年 11 月 11 日	6 个月	新股锁定	14.99	44.37	563	8,439.37	24,980.31	-
688759	必贝特	2025 年 10 月 21 日	6 个月	新股锁定	17.78	44.27	442	7,858.76	19,567.34	-
688783	西安奕材	2025 年 10 月 20 日	6 个月	新股锁定	8.62	20.47	259	2,232.58	5,301.73	-
688785	恒运昌	2026 年 1 月 20 日	6 个月	新股未上市	92.18	92.18	108	9,955.44	9,955.44	-
688785	恒运昌	2026 年 1 月 20 日	1 个月内（含）	新股未上市	92.18	92.18	970	89,414.60	89,414.60	-
688790	昂瑞微	2025 年 12 月 9 日	6 个月	新股锁定	83.06	127.74	56	4,651.36	7,153.44	-
688795	摩尔线程	2025 年 11 月 26 日	6 个月	新股锁定	114.28	443.73	64	7,313.92	28,398.72	-
688796	百奥赛图	2025 年 12 月 2 日	6 个月	新股锁定	26.68	52.87	423	11,285.64	22,364.01	-

688802	沐曦股份	2025 年 12 月 9 日	6 个月	新股锁定	104.66	410.69	36	3,767.76	14,784.84	-
688805	健信超导	2025 年 12 月 17 日	6 个月	新股锁定	18.58	38.64	265	4,923.70	10,239.60	-
688807	优迅股份	2025 年 12 月 10 日	6 个月	新股锁定	51.66	150.67	131	6,767.46	19,737.77	-
688809	强一股份	2025 年 12 月 23 日	6 个月	新股锁定	85.09	271.50	147	12,508.23	39,910.50	-
6.4.12.1.2 受限证券类别：债券										
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：张）	期末成本总额	期末估值总额	备注
127112	尚太转债	2026 年 1 月 16 日	1 个月内（含）	新债未上市	100.00	100.00	2,437	243,700.00	243,707.48	-

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

本基金为股票型基金，其长期平均风险和预期收益率高于混合型基金、债券型基金及货币市场基金。同时本基金为指数型基金，被动跟踪标的指数的表现，具有与标的指数以及标的指数所代表的公司相似的风险收益特征。本基金投资的金融工具主要为股票投资。本基金在日常经营活动中面临的与这些金融工具相关的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金的基金管理人从事风险管理的主要目标是争取将以上风险控制在限定的范围之内，紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化。

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

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

6.4.13.2 信用风险

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

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

本基金的基金管理人建立了信用风险管理流程，通过对投资品种信用等级评估来控制证券发行人的信用风险。信用等级评估以内部信用评级为主，外部信用评级为辅。内部债券信用评级主

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

本期末，本基金未持有除国债、央行票据和政策性金融债以外的债券(上年度末：本基金无债券投资)。

6.4.13.3 流动性风险

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

6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》及《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》等有关法规的要求建立健全开放式基金流动性风险管理的内部控制体系，审慎评估各类资产的流动性，针对性制定流动性风险管理措施，对本基金组合资产的流动性风险进行管理。本基金的基金管理人采用监控基金组合资产持仓集中度指标、逆回购交易的到期日与交易对手的集中度、流动性受限资产比例、基金组合资产中 7 个工作日可变现资产的可变现价值以及压力测试等方式防范流动性风险。并于开放日对本基金的申购赎回情况进行监控，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配，确保本基金资产的变现能力与投资者赎回需求的匹配与平衡。本基金的基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。

本基金主要投资于交易所及银行间市场内交易的证券，除在附注“期末本基金持有的流通受限证券”中列示的部分基金资产流通暂时受限制外(如有)，其余均能及时变现。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券资产的公允价值。除附注“期末债券正回购交易中作为抵押的债券”中列示的卖出回购金融资产款余额(如有)将在 1 个月内到期且计息外，本基金于资产负债表日所持有的金融负债的合约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、结算备付金和存出保证金等。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2026 年 1 月 22 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
货币资金	21,285,027.77	-	-	-	21,285,027.77
结算备付金	354,997.67	-	-	-	354,997.67
存出保证金	359,818.63	-	-	-	359,818.63
交易性金融资产	-	-	243,707.48	367,374,943.23	367,618,650.71
应收申购款	-	-	-	6,942,392.63	6,942,392.63
应收清算款	-	-	-	397,077.89	397,077.89
资产总计	21,999,844.07	-	243,707.48	374,714,413.75	396,957,965.30
负债					
应付赎回款	-	-	-	7,050,124.53	7,050,124.53
应付管理人报酬	-	-	-	125,422.61	125,422.61
应付托管费	-	-	-	25,084.52	25,084.52
应付销售服务费	-	-	-	59,756.60	59,756.60
应交税费	-	-	-	0.23	0.23
其他负债	-	-	-	177,103.36	177,103.36
负债总计	-	-	-	7,437,491.85	7,437,491.85
利率敏感度缺口	21,999,844.07	-	243,707.48	367,276,921.90	389,520,473.45
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	24,733,034.53	-	-	-	24,733,034.53
结算备付金	645,102.81	-	-	-	645,102.81
存出保证金	384,123.11	-	-	-	384,123.11
交易性金融资产	-	-	-	425,296,909.22	425,296,909.22
应收申购款	-	-	-	6,744,698.47	6,744,698.47
应收清算款	-	-	-	2,943,879.20	2,943,879.20
资产总计	25,762,260.45	-	-	434,985,486.89	460,747,747.34

负债					
应付赎回款	-	-	-	9,362,872.53	9,362,872.53
应付管理人报酬	-	-	-	200,389.92	200,389.92
应付托管费	-	-	-	40,077.97	40,077.97
应付销售服务费	-	-	-	99,173.37	99,173.37
其他负债	-	-	-	146,731.03	146,731.03
负债总计	-	-	-	9,849,244.82	9,849,244.82
利率敏感度缺口	25,762,260.45	-	-	425,136,242.07	450,898,502.52

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 0.06%（上年度末：无），因此市场利率的变动对于本基金净资产无重大影响（上年度末：同）。

6.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无重大外汇风险。

6.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市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。

本基金采用完全复制标的指数的方法，进行被动指数化投资，按照成份股在标的指数中的基准权重构建指数化投资组合，并根据标的指数成份股及其权重的变化进行相应调整。当预期成份股发生调整或成份股发生配股、增发、分红等行为时，或因基金的申购和赎回等对本基金跟踪标的指数的效果可能带来影响时，或因某些特殊情况导致流动性不足时，或其他原因导致无法有效复制和跟踪标的指数时，基金管理人可以对投资组合管理进行适当变通和调整，力求降低跟踪误差。

本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险。本基金股票(含存托凭证)投资比例不低于基金资产的 90%；投资于标的指数成份股及备选成份股的比例不低于非现金基金资产的 80%；每个交易日日终在扣除股指期货、国债期货、股票期权保证金后，本基金保留的现金或到期日在一年以内的政府债券投资比例不低于基金资产净值的 5%，其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。股指期货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。此外，

本基金的基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控，定期运用多种定量方法对基金进行风险度量，包括 VaR(Value at Risk)指标等来测试本基金面临的潜在价格风险，及时可靠地对风险进行跟踪和控制。

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2026 年 1 月 22 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	367,374,943.23	94.31	425,296,909.22	94.32
交易性金融资产－基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产－债券投资	243,707.48	0.06	-	-
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	367,618,650.71	94.38	425,296,909.22	94.32

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 1 月 22 日）	上年度末 （2025 年 12 月 31 日 ）
	业绩比较基准上升 5%	19,421,436.61	21,917,800.00
	业绩比较基准下降 5%	-19,421,436.61	-21,917,800.00

6.4.14 公允价值

6.4.14.1 金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属的层次，由对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次决定：

第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

6.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

6.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2026 年 1 月 22 日	上年度末 2025 年 12 月 31 日
第一层次	366,688,852.01	424,853,913.37
第二层次	384,655.94	-
第三层次	545,142.76	442,995.85
合计	367,618,650.71	425,296,909.22

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（转型后）

7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	707,797.96	0.19
	其中：股票	707,797.96	0.19
2	基金投资	343,927,810.58	92.90
3	固定收益投资	303,147.70	0.08
	其中：债券	303,147.70	0.08
	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	19,271,916.33	5.21
8	其他各项资产	5,996,429.50	1.62
9	合计	370,207,102.07	100.00

7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	699,361.50	0.19
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	1,583.46	0.00
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	-	-
J	金融业	6,853.00	0.00
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-

S	综合	-	-
	合计	707,797.96	0.19

7.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

无。

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	002050	三花智控	1,400	61,362.00	0.02
2	300014	亿纬锂能	900	58,527.00	0.02
3	688785	恒运昌	108	50,020.20	0.01
4	301511	德福科技	200	28,770.00	0.01
5	300450	先导智能	700	28,504.00	0.01
6	300037	新宙邦	300	27,855.00	0.01
7	002812	恩捷股份	400	26,764.00	0.01
8	002126	银轮股份	500	24,900.00	0.01
9	301358	湖南裕能	300	22,761.00	0.01
10	002340	格林美	3,200	21,152.00	0.01
11	002245	蔚蓝锂芯	1,100	20,581.00	0.01
12	603659	璞泰来	700	20,251.00	0.01
13	002074	国轩高科	700	19,257.00	0.01
14	002850	科达利	100	18,930.00	0.01
15	300001	特锐德	500	18,915.00	0.01
16	300207	欣旺达	900	17,091.00	0.00
17	300438	鹏辉能源	200	16,570.00	0.00
18	301687	新广益	195	15,167.10	0.00
19	300568	星源材质	800	14,976.00	0.00
20	605117	德业股份	140	14,865.20	0.00
21	300073	当升科技	300	14,412.00	0.00
22	300919	中伟新材	300	13,125.00	0.00
23	002335	科华数据	300	12,735.00	0.00
24	300432	富临精工	600	12,054.00	0.00
25	688778	厦钨新能	200	10,880.00	0.00
26	300409	道氏技术	500	9,965.00	0.00
27	001301	尚太科技	100	9,351.00	0.00
28	688005	容百科技	300	9,180.00	0.00
29	300763	锦浪科技	100	9,035.00	0.00
30	688712	北芯生命	234	8,405.28	0.00
31	688116	天奈科技	200	7,640.00	0.00
32	688006	杭可科技	200	7,310.00	0.00
33	000973	佛塑科技	500	7,175.00	0.00
34	000009	中国宝安	1,100	6,853.00	0.00

35	601112	振石股份	372	6,543.48	0.00
36	300827	上能电气	200	6,158.00	0.00
37	002518	科士达	100	5,359.00	0.00
38	688567	孚能科技	500	5,250.00	0.00
39	688819	天能股份	200	4,440.00	0.00
40	688472	阿特斯	400	4,328.00	0.00
41	300457	赢合科技	200	4,216.00	0.00
42	603352	至信股份	112	2,858.24	0.00
43	301656	联合动力	100	1,723.00	0.00
44	001220	世盟股份	57	1,583.46	0.00

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 累计买入金额超出期末基金资产净值 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	占期末基金资产净值比例(%)
1	300750	宁德时代	11,632,979.80	3.19
2	300274	阳光电源	10,397,817.00	2.85
3	002050	三花智控	9,571,353.00	2.63
4	300014	亿纬锂能	7,228,648.00	1.98
5	002709	天赐材料	6,270,462.86	1.72
6	300450	先导智能	4,793,852.00	1.32
7	300390	天华新能	4,710,671.52	1.29
8	300953	震裕科技	4,328,437.96	1.19
9	002126	银轮股份	4,289,376.00	1.18
10	002812	恩捷股份	3,910,635.00	1.07
11	002340	格林美	3,695,663.00	1.01
12	300763	锦浪科技	3,645,117.00	1.00
13	002407	多氟多	3,610,532.80	0.99
14	300207	欣旺达	3,384,428.00	0.93
15	301358	湖南裕能	3,356,677.00	0.92
16	002074	国轩高科	3,264,562.00	0.90
17	300037	新宙邦	2,732,341.00	0.75
18	300073	当升科技	2,496,854.00	0.69
19	002850	科达利	2,493,941.00	0.68
20	301511	德福科技	2,381,171.00	0.65

注：本期累计买入金额指买入成交金额（成交单价乘以成交数量），不考虑相关交易费用。

7.4.2 累计卖出金额超出期末基金资产净值 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	占期末基金资产净值比例(%)
1	300750	宁德时代	19,060,607.80	5.23
2	300274	阳光电源	14,258,679.34	3.91

3	002050	三花智控	11,537,076.00	3.17
4	300014	亿纬锂能	9,150,553.04	2.51
5	605117	德业股份	7,968,077.00	2.19
6	603659	璞泰来	7,878,775.90	2.16
7	002709	天赐材料	7,696,046.00	2.11
8	600699	均胜电子	7,414,760.00	2.03
9	300450	先导智能	6,508,433.30	1.79
10	688472	阿特斯	6,347,658.19	1.74
11	002340	格林美	4,667,425.00	1.28
12	688778	厦钨新能	4,657,206.62	1.28
13	002850	科达利	4,547,474.00	1.25
14	002126	银轮股份	4,547,088.00	1.25
15	002074	国轩高科	4,387,359.00	1.20
16	002812	恩捷股份	4,283,624.00	1.18
17	300390	天华新能	4,212,056.20	1.16
18	300037	新宙邦	4,084,446.80	1.12
19	688005	容百科技	4,077,347.78	1.12
20	002407	多氟多	4,058,309.60	1.11

注：本期累计卖出金额指卖出成交金额（成交单价乘以成交数量），不考虑相关交易费用。

7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	120,355,696.78
卖出股票收入（成交）总额	214,001,104.51

注：本项中“买入股票的成本(成交)总额”及“卖出股票的收入(成交)总额”均按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	303,147.70	0.08
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	303,147.70	0.08

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（张）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	019792	25 国债 19	3,000	303,147.70	0.08

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 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名基金投资明细

金额单位：人民币元

序号	基金名称	基金类型	运作方式	管理人	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	大成中证电池主题 ETF	股票型	交易型开放式	大成基金管理有限公司	343,927,810.58	94.37

7.11 本基金投资股指期货的投资政策

无。

7.12 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.12.1 本期国债期货投资政策

无。

7.12.2 本期国债期货投资评价

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	403,835.10
2	应收清算款	2,120,198.34
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	3,284,678.08
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	187,717.98
9	合计	5,996,429.50

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值	占基金资产净值比例（%）	流通受限情况说明
1	688785	恒运昌	50,020.20	0.01	新股锁定

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。

§7 投资组合报告（转型前）

7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	367,374,943.23	92.55
	其中：股票	367,374,943.23	92.55
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	243,707.48	0.06
	其中：债券	243,707.48	0.06
	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	21,640,025.44	5.45

8	其他各项资产	7,699,289.15	1.94
9	合计	396,957,965.30	100.00

7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 报告期末指数投资按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	356,544,086.01	91.53
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	3,262,714.00	0.84
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	-	-
J	金融业	4,521,825.00	1.16
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	2,360,227.00	0.61
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	366,688,852.01	94.14

7.2.2 报告期末积极投资按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	134,118.40	0.03
C	制造业	450,140.31	0.12

D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	28,365.62	0.01
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	33,825.02	0.01
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	39,641.87	0.01
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	686,091.22	0.18

7.2.3 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

无。

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	300750	宁德时代	91,600	31,675,280.00	8.13
2	300274	阳光电源	194,984	31,271,533.92	8.03
3	002050	三花智控	552,400	30,950,972.00	7.95
4	300014	亿纬锂能	307,104	19,915,694.40	5.11
5	300450	先导智能	270,500	15,526,700.00	3.99
6	002709	天赐材料	351,300	15,313,167.00	3.93
7	002340	格林美	1,262,100	11,434,626.00	2.94
8	002074	国轩高科	267,300	10,646,559.00	2.73

9	002407	多氟多	293,740	9,196,999.40	2.36
10	300207	欣旺达	364,700	8,851,269.00	2.27
11	002126	银轮股份	208,200	8,380,050.00	2.15
12	002850	科达利	47,300	7,855,111.00	2.02
13	605117	德业股份	89,600	7,804,160.00	2.00
14	603659	璞泰来	263,534	7,597,685.22	1.95
15	301358	湖南裕能	112,700	7,502,439.00	1.93
16	002812	恩捷股份	145,400	7,409,584.00	1.90
17	300390	天华新能	143,560	7,330,173.60	1.88
18	600699	均胜电子	241,100	7,295,686.00	1.87
19	300037	新宙邦	129,200	7,273,960.00	1.87
20	300073	当升科技	107,500	6,543,525.00	1.68
21	300919	中伟新材	115,760	6,176,953.60	1.59
22	688472	阿特斯	363,989	5,889,342.02	1.51
23	300409	道氏技术	193,000	5,849,830.00	1.50
24	002335	科华数据	89,100	5,540,238.00	1.42
25	300001	特锐德	182,300	5,250,240.00	1.35
26	300568	星源材质	332,600	4,879,242.00	1.25
27	300432	富临精工	253,180	4,861,056.00	1.25
28	300763	锦浪科技	59,000	4,741,830.00	1.22
29	300953	震裕科技	25,700	4,633,196.00	1.19
30	688778	厦钨新能	49,844	4,623,031.00	1.19
31	000009	中国宝安	445,500	4,521,825.00	1.16
32	300438	鹏辉能源	87,006	3,904,829.28	1.00
33	688005	容百科技	123,519	3,712,981.14	0.95
34	603063	禾望电气	113,000	3,534,640.00	0.91
35	688772	珠海冠宇	167,523	3,521,333.46	0.90
36	688116	天奈科技	72,480	3,509,481.60	0.90
37	002518	科士达	57,500	3,312,000.00	0.85
38	300827	上能电气	82,480	3,266,208.00	0.84
39	600995	南网储能	236,600	3,262,714.00	0.84
40	001301	尚太科技	38,700	3,103,353.00	0.80
41	688567	孚能科技	181,038	2,789,795.58	0.72
42	300457	赢合科技	95,600	2,757,104.00	0.71
43	920185	贝特瑞	83,522	2,615,909.04	0.67
44	301511	德福科技	77,800	2,427,360.00	0.62
45	688248	南网科技	41,900	2,360,227.00	0.61
46	688006	杭可科技	59,655	1,897,625.55	0.49
47	688032	禾迈股份	12,286	1,299,858.80	0.33
48	301238	瑞泰新材	54,300	1,179,396.00	0.30
49	688819	天能股份	33,646	1,174,245.40	0.30
50	301658	首航新能	10,200	317,832.00	0.08

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	001280	中国铀业	2,080	134,118.40	0.03
2	688785	恒运昌	1,078	99,370.04	0.03
3	601112	振石股份	3,719	41,578.42	0.01
4	688809	强一股份	147	39,910.50	0.01
5	301638	南网数字	2,011	33,825.02	0.01
6	688795	摩尔线程	64	28,398.72	0.01
7	688727	恒坤新材	563	24,980.31	0.01
8	001233	海安集团	330	23,350.80	0.01
9	688796	百奥赛图	423	22,364.01	0.01
10	301656	联合动力	786	21,371.34	0.01
11	688807	优迅股份	131	19,737.77	0.01
12	688759	必贝特	442	19,567.34	0.01
13	301563	云汉芯城	96	17,347.20	0.00
14	688802	沐曦股份	36	14,784.84	0.00
15	301584	建发致新	373	11,018.42	0.00
16	688805	健信超导	265	10,239.60	0.00
17	001369	双欣材料	790	9,385.20	0.00
18	301687	新广益	195	9,260.55	0.00
19	301667	纳百川	151	8,931.65	0.00
20	603092	德力佳	138	8,862.36	0.00
21	301609	山大电力	169	8,833.63	0.00
22	001386	马可波罗	334	7,822.28	0.00
23	301632	广东建科	304	7,530.08	0.00
24	301449	天溯计量	112	7,361.76	0.00
25	688790	昂瑞微	56	7,153.44	0.00
26	301491	汉桑科技	104	6,138.08	0.00
27	001221	悍高集团	83	5,670.56	0.00
28	688783	西安奕材	259	5,301.73	0.00
29	301668	昊创瑞通	95	5,044.50	0.00
30	603248	锡华科技	260	4,513.60	0.00
31	603352	至信股份	112	3,991.68	0.00
32	301575	艾芬达	73	3,837.61	0.00
33	603175	超颖电子	73	3,728.11	0.00
34	603334	丰倍生物	88	3,432.00	0.00
35	603376	大明电子	111	3,127.98	0.00
36	001396	誉帆科技	69	2,386.02	0.00
37	001285	瑞立科密	31	1,815.67	0.00

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	300274	阳光电源	1,841,083.00	0.41
2	002050	三花智控	1,805,859.38	0.40
3	300750	宁德时代	1,799,298.00	0.40
4	300014	亿纬锂能	1,168,986.00	0.26
5	300450	先导智能	898,413.00	0.20
6	002709	天赐材料	860,611.00	0.19
7	002340	格林美	644,635.00	0.14
8	002074	国轩高科	611,269.00	0.14
9	002407	多氟多	527,532.00	0.12
10	300207	欣旺达	505,751.00	0.11
11	002126	银轮股份	477,832.00	0.11
12	002850	科达利	448,062.00	0.10
13	002812	恩捷股份	434,466.00	0.10
14	605117	德业股份	426,910.00	0.09
15	603659	璞泰来	421,214.00	0.09
16	600699	均胜电子	414,472.00	0.09
17	300390	天华新能	408,662.00	0.09
18	300037	新宙邦	406,775.00	0.09
19	301358	湖南裕能	404,872.00	0.09
20	300073	当升科技	377,708.00	0.08

注：本期累计买入金额指买入成交金额（成交单价乘以成交数量），不考虑相关交易费用。

7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	300750	宁德时代	7,527,004.00	1.67
2	300274	阳光电源	7,358,733.00	1.63
3	002050	三花智控	7,090,629.00	1.57
4	300014	亿纬锂能	4,752,550.00	1.05
5	002709	天赐材料	3,556,680.00	0.79
6	300450	先导智能	3,435,881.00	0.76
7	002340	格林美	2,492,938.00	0.55
8	002074	国轩高科	2,436,138.00	0.54
9	002407	多氟多	2,204,405.96	0.49
10	300207	欣旺达	2,097,916.68	0.47
11	002126	银轮股份	1,842,263.00	0.41
12	002812	恩捷股份	1,779,311.00	0.39

13	300390	天华新能	1,760,828.00	0.39
14	605117	德业股份	1,744,654.00	0.39
15	002850	科达利	1,732,270.00	0.38
16	600699	均胜电子	1,688,457.00	0.37
17	603659	璞泰来	1,632,453.00	0.36
18	301358	湖南裕能	1,599,331.00	0.35
19	300037	新宙邦	1,580,401.00	0.35
20	300073	当升科技	1,466,456.00	0.33

注：本期累计卖出金额指卖出成交金额（成交单价乘以成交数量），不考虑相关交易费用。

7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	21,058,204.62
卖出股票收入（成交）总额	84,181,631.53

注：本项中“买入股票的成本(成交)总额”及“卖出股票的收入(成交)总额”均按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	-	-
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）	243,707.48	0.06
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	243,707.48	0.06

7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	127112	尚太转债	2,437	243,707.48	0.06

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

无。

7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

无。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

无。

7.10 本基金投资股指期货的投资政策

无。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.11.1 本期国债期货投资政策

无。

7.11.2 本期国债期货投资评价

无。

7.12 投资组合报告附注

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

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

7.12.2 基金投资的前十名股票是否超出基金合同约定的备选股票库

本基金投资的前十名股票未超出基金合同规定的备选股票库。

7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	359,818.63
2	应收清算款	397,077.89
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	6,942,392.63
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	7,699,289.15

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

无。

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

7.12.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

无。

7.12.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值	占基金资产净值比例（%）	流通受限情况说明
1	001280	中国铀业	134,118.40	0.03	新股锁定
2	688785	恒运昌	99,370.04	0.03	新股未上市
3	601112	振石股份	41,578.42	0.01	新股未上市
4	688809	强一股份	39,910.50	0.01	新股锁定
5	301638	南网数字	33,825.02	0.01	新股锁定

7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入原因，分项之和与合计可能有尾差。

§8 基金份额持有人信息（转型后）

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额级别	持有人户数（户）	户均持有的基金份额	持有人结构			
			机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总份额比例（%）	持有份额	占总份额比例（%）
大成中证电池主题 ETF 发起式联接 A	7,204	11,776.23	10,000,450.04	11.79	74,835,531.21	88.21
大成中证电池主题 ETF 发起式联接 C	43,927	6,888.16	0.00	0.00	302,576,178.25	100.00
合计	51,131	7,576.85	10,000,450.04	2.58	377,411,709.46	97.42

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	大成中证电池主题 ETF 发起式联接 A	107,928.98	0.1272
	大成中证电池主题 ETF 发起	21,180.07	0.0070

人员持有本基金	式联接 C		
	合计	129,109.05	0.0333

注：上述占基金总份额比例的计算中，对分级份额，比例的分母采用各自级别的份额，对合计数，比例的分母采用下属分级基金份额的合计数（即期末基金份额总额）。

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

项目	份额级别	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	大成中证电池主题 ETF 发起式联接 A	0~10
	大成中证电池主题 ETF 发起式联接 C	0
	合计	0~10
本基金基金经理持有本开放式基金	大成中证电池主题 ETF 发起式联接 A	0
	大成中证电池主题 ETF 发起式联接 C	0
	合计	0

8.4 发起式基金发起资金持有份额情况

项目	持有份额总数	持有份额占基金总份额比例(%)	发起份额总数	发起份额占基金总份额比例(%)	发起份额承诺持有期限
基金管理人固有资金	10,000,450.04	2.58	10,000,450.04	2.58	3 年
基金管理人高级管理人员	10,001.80	0.00	-	-	-
基金经理等人员	119,107.25	0.03	-	-	-
基金管理人股东	-	-	-	-	-
其他	-	-	-	-	-
合计	10,129,559.09	2.61	10,000,450.04	2.58	3 年

§8 基金份额持有人信息（转型前）

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	户均持有的基	持有人结构

	户数（户）	金份额	机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总份额比例（%）	持有份额	占总份额比例（%）
大成中证电池主题指数发起式 A	8,424	11,080.52	10,000,450.04	10.71	83,341,882.97	89.29
大成中证电池主题指数发起式 C	38,893	8,936.51	0.00	0.00	347,567,614.44	100.00
合计	47,317	9,318.21	10,000,450.04	2.27	430,909,497.41	97.73

注：1、上述机构/个人投资者持有份额占总份额比例的计算中，对分级份额，比例的分母采用各自级别的份额，对合计数，比例的分母采用下属分级基金份额的合计数（即期末基金份额总额）。

2、持有人户数为有效户数，即存量份额大于零的账户。

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数（份）	占基金总份额比例（%）
基金管理人所有从业人员持有本基金	大成中证电池主题指数发起式 A	40,028.53	0.0429
	大成中证电池主题指数发起式 C	19,045.04	0.0055
	合计	59,073.57	0.0134

注：上述占基金总份额比例的计算中，对分级份额，比例的分母采用各自级别的份额，对合计数，比例的分母采用下属分级基金份额的合计数（即期末基金份额总额）。

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

项目	份额级别	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	大成中证电池主题指数发起式 A	0~10
	大成中证电池主题指数发起式 C	0
	合计	0~10
本基金基金经理持有本开放式基金	大成中证电池主题指数发起式 A	0
	大成中证电池主题指数发起式 C	0

	合计	0

8.4 发起式基金发起资金持有份额情况

项目	持有份额总数	持有份额占基金总份额比例(%)	发起份额总数	发起份额占基金总份额比例(%)	发起份额承诺持有期限
基金管理人固有资金	10,000,450.04	2.27	10,000,450.04	2.27	3 年
基金管理人高级管理人员	10,001.80	0.00	-	-	-
基金经理等人员	49,071.77	0.01	-	-	-
基金管理人股东	-	-	-	-	-
其他	-	-	-	-	-
合计	10,059,523.61	2.28	10,000,450.04	2.27	3 年

§9 开放式基金份额变动（转型后）

单位：份

项目	大成中证电池主题 ETF 发起式联接 A	大成中证电池主题 ETF 发起式联接 C
基金合同生效日（2026 年 1 月 23 日）基金份额总额	93,342,333.01	347,567,614.44
基金合同生效日起至报告期期末基金总申购份额	87,848,304.03	713,044,906.80
减：基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回份额	96,354,655.79	758,036,342.99
基金合同生效日起至报告期期末基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	84,835,981.25	302,576,178.25

§9 开放式基金份额变动（转型前）

单位：份

项目	大成中证电池主题指数发起式 A	大成中证电池主题指数发起式 C

基金合同生效日（2022 年 6 月 28 日）基金份额总额	13,703,644.97	494,202.86
本报告期期初基金份额总额	98,365,240.84	417,036,255.81
本报告期基金总申购份额	17,616,244.59	146,460,482.07
减：本报告期基金总赎回份额	22,639,152.42	215,929,123.44
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	93,342,333.01	347,567,614.44

§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

报告期内托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内无涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

10.4 基金投资策略的改变

本基金投资策略在本报告期内没有重大改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金自基金合同生效日起聘请容诚会计师事务所（特殊普通合伙）为本基金提供审计服务至今。

10.6 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况

10.6.1 管理人受调查或处罚等情况

本报告期内，基金管理人无受调查或处罚等情况。

10.6.2 管理人相关从业人员受调查或处罚等情况

本报告期内，基金管理人相关从业人员无受调查或处罚等情况。

10.6.3 托管人受调查或处罚等情况

报告期内，本基金托管人在开展基金托管业务过程中无受调查或处罚等情况。

10.6.4 托管人相关从业人员受调查或处罚等情况

报告期内，本基金托管人相关从业人员在开展基金托管业务过程中无受调查或处罚等情况。

10.7 基金租用或者通过证券公司交易单元进行证券投资的相关情况(转型后)

10.7.1 基金租用或者通过证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例(%)	佣金	占当期佣金总量的比例(%)	
招商证券	1	268,289,939.39	80.25	52,584.74	80.52	-
光大证券	1	63,327,071.35	18.94	12,412.12	19.01	-
广发证券	1	2,682,973.91	0.80	308.55	0.47	-
国信证券	1	-	-	-	-	-

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

（一）筛选标准

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

（二）筛选流程

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

2、公司按照白名单与证券公司进行协议签署。

10.7.2 基金租用或者通过证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易		基金交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例(%)	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例(%)	成交金额	占当期权证成交总额的比例(%)	成交金额	占当期基金成交总额的比例(%)
招商证券	387,489.64	4.79	-	-	-	-	30,075,687.19	100.00
光大证券	7,705,134.00	95.21	-	-	-	-	-	-

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(转型前)

10.7.1 基金租用或者通过证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例(%)	佣金	占当期佣金总量的比例(%)	
招商证券	1	87,457,728.04	83.23	17,141.67	83.49	-
光大证券	1	16,835,206.04	16.02	3,299.66	16.07	-
广发证券	1	781,557.41	0.74	89.87	0.44	-
国信证券	1	-	-	-	-	-

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

（一）筛选标准

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

（二）筛选流程

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

2、公司按照白名单与证券公司进行协议签署。

10.7.2 基金租用或者通过证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

无。

10.8 其他重大事件（转型后）

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	大成中证电池主题交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金(A类份额)基金产品资料概要更新	中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站	2026 年 06 月 30 日
2	大成中证电池主题交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金(C类份额)基金产品资料概要更新	中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站	2026 年 06 月 30 日
3	大成中证电池主题交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金(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
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	大成中证电池主题交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金(原大成中证电池主题指数型发起式证券投资基金)2026 年第 1 季度报告	中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站	2026 年 04 月 22 日
6	大成基金管理有限公司旗下 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
7	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
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	大成中证电池主题指数型发起式证券投资基金 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
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	大成中证电池主题交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金(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 01 月 23 日

13	大成中证电池主题交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金(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 01 月 23 日
14	大成中证电池主题交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金更新招募说明书	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 23 日

10.8 其他重大事件（转型前）

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	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
2	大成中证电池主题指数型发起式证券投资基金 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
3	关于大成中证电池主题指数型发起式证券投资基金变更为大成中证电池主题交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金并相应修订法律文件的公告	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 21 日
4	大成中证电池主题交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金基金合同	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 21 日
5	大成中证电池主题交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金托管协议	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 21 日
6	关于大成中证电池主题交易型开放式指数证券投资基金提前结束募集的公告	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 09 日

§11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

无。

11.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

1、中国证监会批准设立大成中证电池主题指数型发起式证券投资基金的文件；

2、《大成中证电池主题指数型发起式证券投资基金基金合同》；

3、《大成中证电池主题指数型发起式证券投资基金托管协议》；

4、《大成中证电池主题交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金基金合同》；

5、《大成中证电池主题交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金托管协议》；

6、《关于大成中证电池主题指数型发起式证券投资基金变更为大成中证电池主题交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金并相应修订法律文件的公告》；

7、大成基金管理有限公司批准文件、营业执照、公司章程；

8、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