

大成上证科创板综合指数增强型证券投资 基金 2026 年中期报告

2026 年 6 月 30 日

基金管理人：大成基金管理有限公司

基金托管人：中国农业银行股份有限公司

送出日期：2026 年 8 月 28 日

§ 1 重要提示及目录

1.1 重要提示

基金管理人的董事会、董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带的法律责任。本中期报告已经三分之二以上独立董事签字同意。

基金托管人中国农业银行股份有限公司根据本基金合同约定，于 2026 年 08 月 27 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书及其更新。

本报告财务资料未经审计。

本报告期自 2026 年 01 月 01 日起至 06 月 30 日止。

1.2 目录

§1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
§2 基金简介	5
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人和基金托管人	6
2.4 信息披露方式	6
2.5 其他相关资料	6
§3 主要财务指标和基金净值表现	6
3.1 主要会计数据和财务指标	6
3.2 基金净值表现	7
§4 管理人报告	9
4.1 基金管理人及基金经理情况	9
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	11
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	11
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明	11
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	12
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	12
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	13
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	13
§5 托管人报告	13
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	13
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	13
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	14
§6 半年度财务会计报告（未经审计）	14
6.1 资产负债表	14
6.2 利润表	15
6.3 净资产变动表	16
6.4 报表附注	18
§7 投资组合报告	39
7.1 期末基金资产组合情况	39
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	40
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细	41
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	49
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	50
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	51
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	51
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	51

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	51
7.10 本基金投资股指期货的投资政策	51
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	51
7.12 投资组合报告附注	51
§ 8 基金份额持有人信息.....	52
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	52
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	53
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	53
§ 9 开放式基金份额变动.....	53
§ 10 重大事件揭示	54
10.1 基金份额持有人大会决议	54
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	54
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	54
10.4 基金投资策略的改变	54
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	54
10.6 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况	54
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	55
10.8 其他重大事件	56
§ 11 影响投资者决策的其他重要信息	57
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	57
11.2 影响投资者决策的其他重要信息	57
§ 12 备查文件目录	57
12.1 备查文件目录	57
12.2 存放地点	57
12.3 查阅方式	57

§ 1 基金简介

1.1 基金基本情况

基金名称	大成上证科创板综合指数增强型证券投资基金	
基金简称	大成上证科创板综合指数增强	
基金主代码	023893	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2025 年 4 月 29 日	
基金管理人	大成基金管理有限公司	
基金托管人	中国农业银行股份有限公司	
报告期末基金份 额总额	29,352,289.98 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基 金简称	大成上证科创板综合指数增强 A	大成上证科创板综合指数增强 C
下属分级基金的交 易代码	023893	023894
报告期末下属分级 基金的份额总额	18,440,922.00 份	10,911,367.98 份

1.2 基金产品说明

投资目标	本基金为增强型股票指数基金，力争在对标的指数进行有效跟踪的基础上，实现超越目标指数的投资收益，谋求基金资产的长期增值。本基金力争使日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.5%，年化跟踪误差不超过 7.75%。
投资策略	标的指数：上证科创板综合指数 本基金在指数化投资的基础上通过数量化模型进行投资组合优化，在控制与业绩比较基准偏离风险的前提下，力争获得超越标的指数的投资收益。 一）股票投资策略 1、指数化投资策略 本基金将运用指数化的投资方法，通过研究标的指数成份股的构成及其权重确定本基金投资组合的基本构成和大致占比，并通过控制投资组合中成份股对标的指数中权重的偏离，以控制跟踪误差，进而达成对标的指数的跟踪目标。 2、指数增强型策略 3、股票组合调整 二）港股投资策略 三）债券投资策略 四）资产支持证券投资策略 五）股指期货的投资策略 六）国债期货投资策略 七）股票期权投资策略 八）融资及转融通证券出借业务投资策略

	九) 存托凭证投资策略
业绩比较基准	上证科创板综合指数收益率×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。本基金还可投资港股通标的股票，需承担港股通机制下因投资环境、投资标的、市场制度以及交易规则等差异带来的特有风险。同时本基金为指数基金，通过跟踪标的指数表现，具有与标的指数以及标的指数所代表的公司相似的风险收益特征。

1.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		大成基金管理有限公司	中国农业银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	段皓静	任航
	联系电话	0755-83183388	010-66060069
	电子邮箱	office@dcfund.com.cn	tgxxpl@abchina.com
客户服务电话		4008885558	95599
传真		0755-83199588	010-68121816
注册地址		广东省深圳市南山区海德三道1236号大成基金总部大厦5层、27-33层	北京市东城区建国门内大街69号
办公地址		广东省深圳市南山区海德三道1236号大成基金总部大厦5层、27-33层	北京市西城区复兴门内大街28号凯晨世贸中心东座F9
邮政编码		518054	100031
法定代表人		吴庆斌	谷澍

1.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《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

项目	名称	办公地址
注册登记机构	大成基金管理有限公司	广东省深圳市南山区海德三道1236号大成基金总部大厦5层、27-33层

§ 2 主要财务指标和基金净值表现

2.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2026年1月1日 - 2026年6月30日)	
	大成上证科创板综合指数增强 A	大成上证科创板综合指数增强 C
本期已实现收益	7,026,889.69	4,516,759.91

本期利润	12,544,512.68	7,563,367.44
加权平均基金份额本期利润	0.5278	0.4813
本期加权平均净值利润率	34.25%	31.42%
本期基金份额净值增长率	42.05%	41.77%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2026 年 6 月 30 日)	
期末可供分配利润	12,483,855.21	7,295,752.04
期末可供分配基金份额利润	0.6770	0.6686
期末基金资产净值	35,853,164.74	21,111,407.59
期末基金份额净值	1.9442	1.9348
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	94.42%	93.48%

注：1、本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用和信用减值损失后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

2、期末可供分配利润，采用期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数（为期末余额，不是当期发生数）。

3、所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

2.2 基金净值表现

2.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

大成上证科创板综合指数增强 A

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①－③	②－④
过去三个月	42.22%	2.04%	52.44%	2.24%	-10.22%	-0.20%
过去六个月	42.05%	1.92%	50.92%	2.11%	-8.87%	-0.19%
过去一年	86.03%	1.69%	98.19%	1.86%	-12.16%	-0.17%
自基金合同生效起至今	94.42%	1.58%	109.74%	1.76%	-15.32%	-0.18%

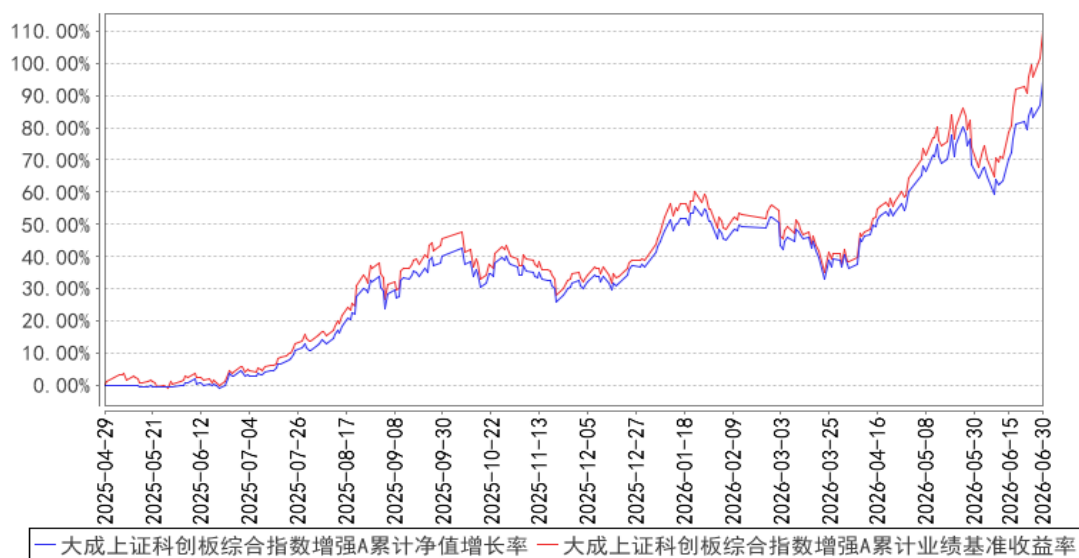
大成上证科创板综合指数增强 C

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①－③	②－④
过去三个月	42.08%	2.04%	52.44%	2.24%	-10.36%	-0.20%
过去六个月	41.77%	1.92%	50.92%	2.11%	-9.15%	-0.19%
过去一年	85.27%	1.69%	98.19%	1.86%	-12.92%	-0.17%

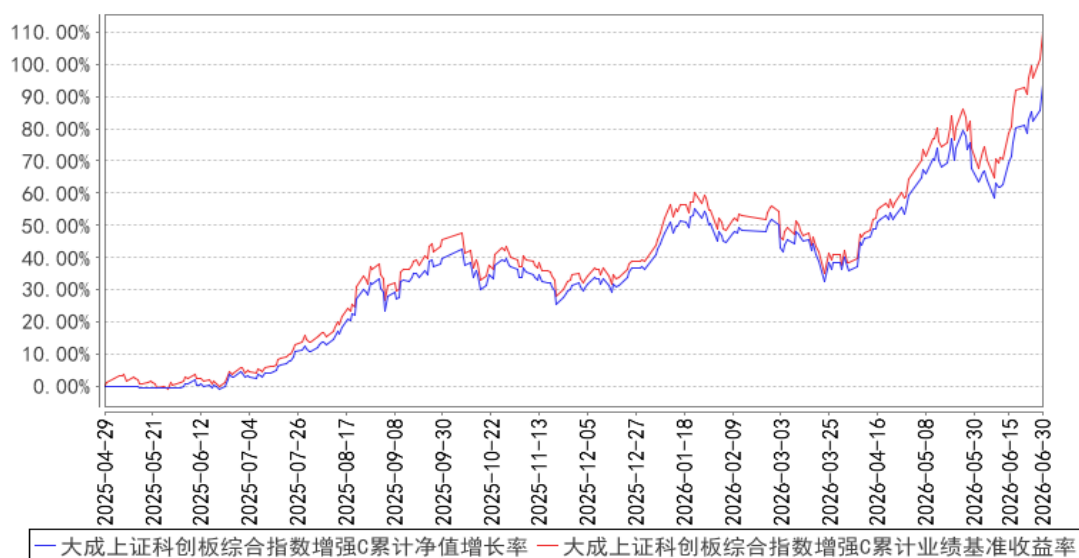
自基金合同生效 起至今	93.48%	1.58%	109.74%	1.76%	-16.26%	-0.18%
----------------	--------	-------	---------	-------	---------	--------

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

大成上证科创板综合指数增强A累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



大成上证科创板综合指数增强C累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



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

§ 3 管理人报告

3.1 基金管理人及基金经理情况

3.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

大成基金管理有限公司成立于 1999 年 4 月 12 日，注册资本人民币 2 亿元，是中国首批获准成立的“老十家”基金管理公司之一。公司总部位于深圳，同时设置了北方、华东和南方营销总部，在北京、上海等地开设有 5 家分公司。2009 年，公司在香港设立大成国际资产管理有限公司；2013 年，设立大成创新资本管理有限公司。

公司业务资质齐全，全面覆盖公募基金、机构投资、海外投资、财富管理、养老金管理等业务，还受全国社会保障基金理事会委托管理部分社保基金和基本养老保险基金。旗下大成国际资产管理公司具备 QFII、RQFII 等资格，是首批首家完成备案的能够提供港股通投资顾问服务的香港机构。

历经二十余年的磨砺和沉淀，大成基金形成了以长期投资能力为核心的竞争优势，打造了一支具有良好职业素养和丰富经验的资产管理队伍。公司目前已形成权益投资、固收投资、指数与期货投资、跨境投资、混合资产投资、大类资产配置六大投资团队，全面覆盖各类投资领域，综合实力不断提升，各项业务迅猛发展，管理资产种类位居同业前列。

3.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
刘旺	本基金基金经理	2025 年 4 月 29 日	—	8 年	香港中文大学理学(金融工程)硕士。2018 年 5 月加入大成基金管理有限公司，曾担任指数与期货投资部研究员兼基金经理助理，现任指数与期货投资部基金经理。2024 年 1 月 2 日起任大成沪深 300 指数增强型发起式证券投资基金基金经理。2024 年 11 月 15 日起任大成中证 1000 指数增强型发起式证券投资基金基金经理。2025 年 4 月 29 日起任大成上证科创板综合指数增强型证券投资基金基金经理。2025 年 12 月 4 日起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。具备基金从业资格。国籍：中国
夏高	本基金基金经理，指数与期货投资部	2025 年 4 月 29 日	—	15 年	清华大学工学博士。2011 年 1 月至 2012 年 5 月就职于博时基金管理有限公司，任股票投资部投资分析员。2012 年 7 月加入大成基金管理有限公司，曾担任数量与

	副总监				指数投资部高级数量分析师、基金经理助理、总监助理，现任指数与期货投资部副总监。2014 年 12 月 6 日至 2023 年 3 月 20 日任大成中证红利指数证券投资基金基金经理。2015 年 6 月 29 日至 2020 年 11 月 13 日担任大成中证互联网金融指数分级证券投资基金基金经理。2016 年 2 月 3 日起任大成中证 360 互联网+大数据 100 指数型证券投资基金基金经理。2017 年 3 月 21 日至 2021 年 4 月 27 日任大成智惠量化多策略灵活配置混合型证券投资基金基金经理。2020 年 9 月 18 日至 2022 年 10 月 17 日任大成动态量化配置策略混合型证券投资基金基金经理。2020 年 9 月 18 日至 2022 年 10 月 25 日任大成绝对收益策略混合型发起式证券投资基金基金经理。2021 年 2 月 23 日起任大成沪深 300 指数增强型发起式证券投资基金基金经理。2021 年 4 月 29 日至 2022 年 5 月 26 日任大成中证全指医疗保健设备与服务交易型开放式指数证券投资基金基金经理。2023 年 4 月 14 日起任大成动态量化配置策略混合型证券投资基金基金经理。2024 年 7 月 19 日起任大成中证 500 指数增强型证券投资基金基金经理。2025 年 4 月 29 日起任大成上证科创板综合指数增强型证券投资基金基金经理。2025 年 12 月 2 日起任大成中证 800 指数增强型发起式证券投资基金基金经理。2026 年 3 月 17 日起任大成招享汇智混合型证券投资基金基金经理。具有基金从业资格。国籍：中国
李子钰	本基金基金经理助理	2025 年 11 月 28 日	-	10 年	上海交通大学工程硕士。曾任博时基金管理有限公司信息技术部程序员、华泰证券股份有限公司研究所金融工程研究员。2023 年 10 月加入大成基金管理有限公司，曾任指数与期货投资部高级研究员，现任指数与期货投资部基金经理助理。2025 年 11 月 28 日起任大成沪深 300 指数增强型发起式证券投资基金、大成中证 500 指数增强型证券投资基金、大成中证 1000 指数增强型发起式证券投资基金、大成上证科创板综合指数增强型证券投资基金、大成智惠量化多策略灵活配置混合型证券投资基金基金经理助理，2025 年

					12 月 2 日起任大成中证 800 指数增强型发起式证券投资基金基金经理助理。具有基金从业资格。国籍：中国
--	--	--	--	--	--

注：1、任职日期、离任日期为本基金管理人作出决定之日。

2、证券从业年限的计算标准遵从中国证监会《证券基金经营机构董事、监事、高级管理人员及从业人员监督管理办法》的相关规定。

3.1.3 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理同时管理的产品情况

无。

3.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

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

3.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

3.3.1 公平交易制度的执行情况

报告期内，公司严格执行了公平交易的原则和制度。公司运用统计分析和工具，对旗下所有投资组合连续 4 个季度的日内、3 日内、5 日内及 10 日内股票及债券交易同向交易价差进行分析，针对同一基金经理管理的多个投资组合及公私募兼任基金经理管理的多个投资组合的投资交易行为加强了公平交易监测与分析，包括对不同时间窗下（同日、3 日、5 日、10 日）反向交易和同向交易价差监控的分析。分析结果表明：债券交易同向交易频率较低；部分股票同向交易溢价率较大主要来源于投资策略差异、市场因素（如个股当日价格振幅较高）及组合经理交易时机选择，同时结合交易价差专项统计分析，未发现违反公平交易原则的异常情况。

3.3.2 异常交易行为的专项说明

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

3.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

3.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2026 年上半年，国内经济在“稳增长、促转型”主线下延续温和复苏态势。据国家统计局初

步核算，上半年 GDP 同比增长 4.70%，其中一季度增长 5.0%，二季度增长 4.3%。财政政策持续发力，专项债加快发行支持重大项目与科技创新领域，货币政策保持稳健偏松，市场流动性整体充裕。

受益于流动性宽松环境与 AI 产业周期共振，上半年 A 股市场呈现结构性行情，科技成长主线突出。科创综指上半年上涨 53.99%，显著跑赢沪深 300 指数（上涨 7.55%），科创成长风格优势明显。板块方面，市场上半年主线聚焦 AI 产业链与硬科技领域，算力、半导体设备、先进材料等赛道轮番领涨，成长风格显著优于价值风格。一季度市场风格经历从科技成长到防御板块的快速切换，科创板冲高回落；二季度 AI 主题行情加速演绎，资金高度集中于科技赛道。科创板作为 A 股科技成长核心阵地，交易活跃度与资金关注度同步显著提升，行业内部分化亦明显加剧。

本基金上半年保持高仓位运作，严格约束大类风格因子暴露，通过多因子模型优选个股构建组合。后续本基金将持续坚守量化指数增强策略，以紧密跟踪基准指数为核心，通过数量化手段优选个股及构建组合，力争为持有人创造长期稳定的超额收益。

3.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末大成上证科创板综合指数增强 A 的基金份额净值为 1.9442 元，本报告期基金份额净值增长率为 42.05%，同期业绩比较基准收益率为 50.92%；截至本报告期末大成上证科创板综合指数增强 C 的基金份额净值为 1.9348 元，本报告期基金份额净值增长率为 41.77%，同期业绩比较基准收益率为 50.92%。

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，国内宏观经济有望延续温和复苏态势，科技创新支持政策持续加码，新质生产力培育加速推进，科创板企业盈利修复动能有望逐步增强。硬科技成长领域仍将是市场的核心投资主线，AI 产业链、半导体、高端装备、生物医药等方向景气度有望延续，但同时也需理性应对主题行情分化、估值波动及外部扰动等各类潜在风险。本基金将继续按照基金合同约定，保持高仓位运作，持续优化因子体系与多策略融合框架，升级精细化风控体系，力争在控制跟踪误差的前提下获得稳定超额收益。

3.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本基金管理人指导基金估值业务的领导小组为公司估值委员会，公司估值委员会主要负责估值政策和估值程序的制定、修订以及执行情况的监督。估值委员会由公司分管领导、各投研部门、交易管理部、风险管理部、监察稽核部、基金运营部指定人员组成。公司估值委员会的相关成员均具备相应的专业胜任能力和相关工作经历。

各投研部门、风险管理部负责关注相关投资品种的动态，评判基金持有的投资品种是否处于

不活跃的交易状态或者最近交易日后经济环境发生了重大变化或证券发行机构发生了影响证券价格的重大事件，从而确定估值日需要进行估值测算或者调整的投资品种；提出合理的数量分析模型对需要进行估值测算或者调整的投资品种进行公允价值定价与计量；定期对估值政策和程序进行评价，以保证其持续适用；交易管理部负责关注相关投资品种的流动性状况，协助反馈其市场交易信息；基金运营部负责日常的基金资产的估值业务，执行基金估值政策，并负责与托管人沟通估值调整事项；监察稽核部负责审核估值政策和程序的一致性，监督估值委员会工作流程中的风险控制，并负责估值调整事项的信息披露工作。

本基金的日常估值程序由基金运营部基金估值核算人员执行，并与托管人的估值结果核对一致。基金估值政策的议定和修改采用集体讨论机制，投资组合经理作为估值小组成员，对持仓证券的交易情况、信息披露情况保持应有的职业敏感，向估值委员会提供估值参考信息，参与估值政策讨论。对需采用特别估值程序的证券，基金管理人及时启动特别估值程序，由估值委员会讨论议定特别估值方案并与托管人沟通后由基金运营部具体执行。

本基金管理人参与估值流程各方之间不存在任何重大利益冲突。截止报告期末本基金管理人已与中央国债登记结算有限责任公司及中证指数有限公司签署服务协议，由中央国债登记结算有限责任公司按约定提供银行间交易的债券品种的估值数据，由中证指数有限公司按约定提供交易所交易的债券品种的估值数据和流通受限股票的折扣率数据。

3.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金管理人严格按照本基金基金合同的规定进行收益分配。本报告期内本基金无收益分配事项。

3.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

无。

§ 4 托管人报告

4.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内，中国农业银行股份有限公司（以下简称“本基金托管人”）在本基金的托管过程中，严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》及其他相关法律、法规的规定和基金合同、托管协议的约定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

4.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

本报告期内，本基金托管人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》及其他相关法律、

法规的规定和基金合同、托管协议的约定，对本基金的投资运作情况进行了必要的监督，对本基金的基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格计算、基金费用开支、利润分配等方面进行了复核，未发现基金管理人有关损害基金份额持有人利益的行为。

4.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

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

§ 5 半年度财务会计报告（未经审计）

5.1 资产负债表

会计主体：大成上证科创板综合指数增强型证券投资基金

报告截止日：2026 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2026 年 6 月 30 日	上年度末 2025 年 12 月 31 日
资 产：			
货币资金	6.4.7.1	4,643,173.35	5,020,694.14
结算备付金		485,621.04	332,714.29
存出保证金		203,640.00	172,910.40
交易性金融资产	6.4.7.2	51,724,441.70	57,684,007.60
其中：股票投资		51,691,408.31	57,658,839.80
基金投资		-	-
债券投资		33,033.39	25,167.80
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
其他投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
应收清算款		-	-
应收股利		-	-
应收申购款		199,766.28	24,508.20
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.8	-	-
资产总计		57,256,642.37	63,234,834.63
负债和净资产	附注号	本期末 2026 年 6 月 30 日	上年度末 2025 年 12 月 31 日
负 债：			

短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付清算款		-	-
应付赎回款		183,956.42	245,779.86
应付管理人报酬		35,094.25	47,025.85
应付托管费		4,386.78	5,878.20
应付销售服务费		6,551.87	8,316.50
应付投资顾问费		-	-
应交税费		7,703.21	6,969.23
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.9	54,377.51	28,000.00
负债合计		292,070.04	341,969.64
净资产：			
实收基金	6.4.7.10	29,352,289.98	46,001,886.85
未分配利润	6.4.7.12	27,612,282.35	16,890,978.14
净资产合计		56,964,572.33	62,892,864.99
负债和净资产总计		57,256,642.37	63,234,834.63

注：报告截止日 2026 年 6 月 30 日，基金份额总额 29,352,289.98 份。其中大成上证科创板综合指数增强 A 类基金份额总额为 18,440,922.00 份，基金份额净值 1.9442 元；大成上证科创板综合指数增强 C 类基金份额总额为 10,911,367.98 份，基金份额净值 1.9348 元。

5.2 利润表

会计主体：大成上证科创板综合指数增强型证券投资基金

本报告期：2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2025 年 4 月 29 日（基金 合同生效日）至 2025 年 6 月 30 日
一、营业总收入		20,482,718.35	8,934,741.77
1. 利息收入		6,833.43	205,764.54
其中：存款利息收入	6.4.7.13	6,833.43	162,550.44
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		-	43,214.10
其他利息收入		-	-

2. 投资收益（损失以“-”填列）		11,906,832.14	5,328,466.35
其中：股票投资收益	6.4.7.14	11,399,892.85	4,811,336.75
基金投资收益	6.4.7.15	-	-
债券投资收益	6.4.7.16	30,501.60	4.71
资产支持证券投资	6.4.7.17	-	-
收益			
贵金属投资收益	6.4.7.18	-	-
衍生工具收益	6.4.7.19	320,855.64	-57.79
股利收益	6.4.7.20	155,582.05	517,182.68
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	8,564,230.52	3,353,399.02
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	4,822.26	47,111.86
减：二、营业总支出		374,838.23	529,307.67
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	241,651.13	375,845.25
2. 托管费	6.4.10.2.2	30,206.35	46,980.69
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	47,939.02	73,479.29
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		1,155.64	0.02
8. 其他费用	6.4.7.24	53,886.09	33,002.42
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		20,107,880.12	8,405,434.10
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		20,107,880.12	8,405,434.10
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		20,107,880.12	8,405,434.10

5.3 净资产变动表

会计主体：大成上证科创板综合指数增强型证券投资基金

本报告期：2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日			
	实收基金	其他综合 收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	46,001,886.85	—	16,890,978.14	62,892,864.99
二、本期期初净资产	46,001,886.85	—	16,890,978.14	62,892,864.99
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-16,649,596.87	—	10,721,304.21	-5,928,292.66
（一）、综合收益总额	—	—	20,107,880.12	20,107,880.12
（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）	-16,649,596.87	—	-9,386,575.91	-26,036,172.78
其中：1. 基金申购款	22,590,747.95	—	13,076,335.39	35,667,083.34
2. 基金赎回款	-39,240,344.82	—	-22,462,911.30	-61,703,256.12
（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	29,352,289.98	—	27,612,282.35	56,964,572.33
项目	上年度可比期间 2025 年 4 月 29 日（基金合同生效日）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	—	—	—	—
二、本期期初净资产	389,373,541.46	—	—	389,373,541.46
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-269,998,375.27	—	5,349,345.33	-264,649,029.94
（一）、综合收	—	—	8,405,434.10	8,405,434.10

益总额				
（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）	-269,998,375.27	-	-3,056,088.77	-273,054,464.04
其中：1. 基金申购款	3,107,804.58	-	17,151.76	3,124,956.34
2. 基金赎回款	-273,106,179.85	-	-3,073,240.53	-276,179,420.38
（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	119,375,166.19	-	5,349,345.33	124,724,511.52

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署：

谭晓冈

基金管理人负责人

范瑛

主管会计工作负责人

梁靖

会计机构负责人

5.4 报表附注

5.4.1 基金基本情况

大成上证科创板综合指数增强型证券投资基金（以下简称“本基金”），系经中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）证监许可[2025]584 号文《关于准予大成上证科创板综合指数增强型证券投资基金注册的批复》注册，由大成基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《大成上证科创板综合指数增强型证券投资基金基金合同》作为发起人向社会公开募集，募集期为 2025 年 4 月 7 日至 2025 年 4 月 25 日，首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币 389,253,058.23 元，募集期结束经安永华明会计师事务所验证并出具安永华明（2025）验字第 70039092_H08 号验资报告后，向中国证监会报送基金备案材料。基金合同于 2025 年 4 月 29 日生效，基金合同生效日的基金份额总额为 389,373,541.46 份基金份额，其中认购资金利息折合 120,483.23 份基金份额。本基金为契约型开放式，存续期限不定。本基金的基金管理人为大成基金管理有限公司，注册登记机构为本基金管理人，基金托管人为中国农业银行股份有限公司。

本基金 A 类和 C 类基金份额分别设置代码。由于基金费用的不同，本基金 A 类基金份额和 C 类基金份额将分别计算基金份额净值。本基金根据认购/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。

本基金投资范围主要为标的指数成份股及备选成份股（含存托凭证，下同），此外，为更好地实现投资目标，本基金可少量投资于部分非成份股（包含主板、创业板、科创板及其他经中国证监会核准或注册上市的股票及存托凭证、港股通标的股票）、债券（包括国债、央行票据、金融债券、企业债券、公司债券、中期票据、短期融资券、超短期融资券、公开发行的次级债券、政府支持机构债券、政府支持债券、地方政府债券、可转换债券、可交换公司债券及其他经中国证监会允许投资的债券）、资产支持证券、债券回购、同业存单、银行存款（包括协议存款、定期存款及其他银行存款）、货币市场工具、股指期货、国债期货、股票期权、现金以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具。本基金可以根据有关法律法规的规定参与融资及转融通证券出借业务。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种（包括但不限于股指期货等金融衍生品），基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。

基金的投资组合比例为：股票资产投资比例不低于基金资产的 80%，其中投资于标的指数成份股和备选成份股的资产不低于非现金基金资产的 80%，投资于港股通标的股票的比例占股票资产的 0-50%；每个交易日日终在扣除股指期货、国债期货、股票期权合约需缴纳的交易保证金后，保持不低于基金资产净值 5% 的现金或到期日在一年以内的政府债券，其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。股指期货、国债期货、股票期权及其他金融工具的投资比例符合法律法规和监管机构的规定。如法律法规或中国证监会变更投资品种的投资比例限制，基金管理人在履行适当程序后，可以调整上述投资品种的投资比例。

本基金的业绩比较基准：上证科创板综合指数收益率 $\times$ 95%+银行活期存款利率（税后） $\times$ 5%。

5.4.2 会计报表的编制基础

本财务报表系按照财政部颁布的《企业会计准则——基本准则》以及其后颁布及修订的具体会计准则、解释以及《资产管理产品相关会计处理规定》和其他相关规定（统称“企业会计准则”）编制，同时，在信息披露和估值方面，也参考了中国证监会颁布的《中国证券监督管理委员会关于证券投资基金估值业务的指导意见》、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》、《公开募集证券投资基金信息披露内容与格式准则第 2 号——定期报告的内容与格式》、《证券投资基金信息披露编报规则第 3 号〈会计报表附注的编制及披露〉》，中国证券投资基金业协会发布的《公开募集

证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号——年度报告和中期报告》以及中国证监会和中国证券投资基金业协会颁布的其他相关规定。

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

5.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

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

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

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

5.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

5.4.5.1 会计政策变更的说明

无。

5.4.5.2 会计估计变更的说明

无。

5.4.5.3 差错更正的说明

无。

5.4.6 税项

(1) 增值税及附加

根据中华人民共和国主席令第四十一号《中华人民共和国增值税法》、中华人民共和国国务院令 826 号《中华人民共和国增值税法实施条例》及财政部、税务总局公告 2026 年第 10 号《关于增值税法施行后增值税优惠政策衔接事项的公告》的规定，资管产品运营过程中发生的应税交易，资管产品管理人为纳税人；自 2026 年 1 月 1 日至 2027 年 12 月 31 日，资管产品管理人运营契约制资管产品过程中发生的增值税应税行为，可以选择适用简易计税方法，按照 3% 的规定征收率计算缴纳增值税，公募证券投资基金（封闭式证券投资基金、开放式证券投资基金）管理人运用基金买卖股票、债券取得的收入及金融同业往来利息收入免征增值税，金融同业往来利息收入包括金融机构与人民银行所发生的资金往来业务、银行联行往来业务、金融机构间的资金往来业务，以及金融机构开展同业存款、同业借款、同业代付、买断式买入返售金融商品、质押式买入返售金融商品、同业存单，取得的利息收入；取得存款利息收入不属于应税交易，不征收增值税。

根据财政部、税务总局公告 2025 年第 4 号《关于国债等债券利息收入增值税政策的公告》的规定，自 2025 年 8 月 8 日起，对在该日期之后（含当日）新发行的国债、地方政府债券、金融债券的利息收入，恢复征收增值税。对在该日期之前已发行的国债、地方政府债券、金融债券（包

含在 2025 年 8 月 8 日之后续发行的部分) 的利息收入, 继续免征增值税直至债券到期。

增值税附加税包括城市维护建设税、教育费附加和地方教育附加, 以实际缴纳的增值税税额为计税依据, 分别按 7%、3% 和 2% 的比例缴纳城市维护建设税、教育费附加和地方教育附加。

(2) 企业所得税

根据财政部、国家税务总局财税[2004]78 号《财政部 国家税务总局关于证券投资基金税收政策的通知》的规定, 自 2004 年 1 月 1 日起, 对证券投资基金(封闭式证券投资基金, 开放式证券投资基金) 管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入, 继续免征企业所得税。

根据财政部、国家税务总局财税[2008]1 号《财政部 国家税务总局关于企业所得税若干优惠政策的通知》的规定, 对证券投资基金从证券市场中取得的收入, 包括买卖股票、债券的差价收入, 股权的股息、红利收入, 债券的利息收入及其他收入, 暂不征收企业所得税。

(3) 个人所得税

根据财政部、国家税务总局财税[2008]132 号《关于储蓄存款利息所得有关个人所得税政策的通知》的规定, 自 2008 年 10 月 9 日起, 对储蓄存款利息所得暂免征收个人所得税。

根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2012]85 号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》的规定, 自 2013 年 1 月 1 日起, 证券投资基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票, 持股期限在 1 个月以内(含 1 个月) 的, 其股息红利所得全额计入应纳税所得额; 持股期限在 1 个月以上至 1 年(含 1 年) 的, 暂减按 50% 计入应纳税所得额; 持股期限超过 1 年的, 暂减按 25% 计入应纳税所得额。上述所得统一适用 20% 的税率计征个人所得税。

根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2015]101 号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》的规定, 自 2015 年 9 月 8 日起, 证券投资基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票, 持股期限超过 1 年的, 股息红利所得暂免征收个人所得税。

(4) 印花税

经国务院批准, 财政部、国家税务总局研究决定, 自 2008 年 4 月 24 日起, 调整证券(股票) 交易印花税税率, 由原先的 3% 调整为 1%, 自 2008 年 9 月 19 日起, 调整由出让方按证券(股票) 交易印花税税率缴纳印花税, 受让方不再征收, 税率不变; 根据财政部、税务总局公告 2023 年第 39 号《关于减半征收证券交易印花税的公告》的规定, 自 2023 年 8 月 28 日起, 证券交易印花税实施减半征收。

(5) 境外投资

本基金运作过程中如有涉及的境外投资的税项问题, 根据财政部、国家税务总局、中国证监

会财税[2014]81 号《关于沪港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》、财税[2016]127 号《关于深港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》及其他境内外相关税务法规的规定和实务操作执行。

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	581,136.11
等于：本金	581,056.96
加：应计利息	79.15
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	4,062,037.24
等于：本金	4,061,937.38
加：应计利息	99.86
减：坏账准备	-
合计	4,643,173.35

注：其他存款为存放在证券经纪商专用存款账户的证券交易结算资金。

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		40,604,632.23	-	51,691,408.31	11,086,776.08
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-	-
债券	交易所市场	21,000.00	2.49	33,033.39	12,030.90
	银行间市场	-	-	-	-
	合计	21,000.00	2.49	33,033.39	12,030.90
资产支持证券		-	-	-	-
基金		-	-	-	-

其他	-	-	-	-
合计	40,625,632.23	2.49	51,724,441.70	11,098,806.98

5.4.7.3 衍生金融资产/负债

5.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

单位：人民币元

项目	本期末 2026 年 6 月 30 日			
	合同/名义 金额	公允价值		备注
		资产	负债	
利率衍生工具	-	-	-	-
货币衍生工具	-	-	-	-
权益衍生工具	1,675,600.00	-	-	-
其中：股指期货投资	1,675,600.00	-	-	-
其他衍生工具	-	-	-	-
合计	1,675,600.00	-	-	-

5.4.7.3.2 期末基金持有的期货合约情况

单位：人民币元

代码	名称	持仓量（买/卖）	合约市值	公允价值变动
IM2609	IM2609	1.00	1,697,000.00	21,400.00
合计				21,400.00
减：可抵销期货暂收款				21,400.00
净额				0.00

注：1、买入持仓量以正数表示，卖出持仓量以负数表示；

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

5.4.7.3.3 期末基金持有的黄金衍生品情况

无。

5.4.7.4 买入返售金融资产

5.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

无。

5.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

无。

5.4.7.4.3 按预期信用损失一般模型计提减值准备的说明

无。

5.4.7.5 债权投资

5.4.7.5.1 债权投资情况

无。

5.4.7.5.2 债权投资减值准备计提情况

无。

5.4.7.6 其他债权投资

5.4.7.6.1 其他债权投资情况

无。

5.4.7.6.2 其他债权投资减值准备计提情况

无。

5.4.7.7 其他权益工具投资

5.4.7.7.1 其他权益工具投资情况

无。

5.4.7.7.2 报告期末其他权益工具投资情况

无。

5.4.7.8 其他资产

无。

5.4.7.9 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2026 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	20.46
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	-

其中：交易所市场	-
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用	53,556.09
其他	800.96
合计	54,377.51

5.4.7.10 实收基金

金额单位：人民币元

大成上证科创板综合指数增强 A

项目	本期	
	2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	28,662,814.89	28,662,814.89
本期申购	10,327,404.79	10,327,404.79
本期赎回（以“-”号填列）	-20,549,297.68	-20,549,297.68
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	18,440,922.00	18,440,922.00

大成上证科创板综合指数增强 C

项目	本期	
	2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	17,339,071.96	17,339,071.96
本期申购	12,263,343.16	12,263,343.16
本期赎回（以“-”号填列）	-18,691,047.14	-18,691,047.14
基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算调整	-	-
本期申购	-	-
本期赎回（以“-”号填列）	-	-
本期末	10,911,367.98	10,911,367.98

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

大成上证科创板综合指数增强 A

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	10,581,569.01	-14,860.38	10,566,708.63
本期期初	10,581,569.01	-14,860.38	10,566,708.63

本期利润	7,026,889.69	5,517,622.99	12,544,512.68
本期基金份额交易产生的变动数	-5,124,603.49	-574,375.08	-5,698,978.57
其中：基金申购款	5,113,378.68	910,688.30	6,024,066.98
基金赎回款	-10,237,982.17	-1,485,063.38	-11,723,045.55
本期已分配利润	-	-	-
本期末	12,483,855.21	4,928,387.53	17,412,242.74

大成上证科创板综合指数增强 C

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	6,331,295.85	-7,026.34	6,324,269.51
本期期初	6,331,295.85	-7,026.34	6,324,269.51
本期利润	4,516,759.91	3,046,607.53	7,563,367.44
本期基金份额交易产生的变动数	-3,552,303.72	-135,293.62	-3,687,597.34
其中：基金申购款	5,964,082.18	1,088,186.23	7,052,268.41
基金赎回款	-9,516,385.90	-1,223,479.85	-10,739,865.75
本期已分配利润	-	-	-
本期末	7,295,752.04	2,904,287.57	10,200,039.61

5.4.7.13 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	2,317.99
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	1,644.25
结算备付金利息收入	2,870.42
其他	0.77
合计	6,833.43

5.4.7.14 股票投资收益

5.4.7.14.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2026年1月1日至2026年6月30日
股票投资收益——买卖股票差价收入	11,399,892.85
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	11,399,892.85

5.4.7.14.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
卖出股票成交总额	110,425,788.81
减：卖出股票成本总额	98,920,025.58
减：交易费用	105,870.38
买卖股票差价收入	11,399,892.85

5.4.7.14.3 股票投资收益——证券出借差价收入

无。

5.4.7.15 基金投资收益

无。

5.4.7.16 债券投资收益

5.4.7.16.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2026年1月1日至2026年6月30日
债券投资收益——利息收入	12.13
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	30,489.47
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	30,501.60

5.4.7.16.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2026年1月1日至2026年6月30日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	82,503.83
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	52,000.00
减：应计利息总额	11.04
减：交易费用	3.32
买卖债券差价收入	30,489.47

5.4.7.16.3 债券投资收益——赎回差价收入

无。

5.4.7.16.4 债券投资收益——申购差价收入

无。

5.4.7.17 资产支持证券投资收益

5.4.7.17.1 资产支持证券投资收益项目构成

无。

5.4.7.17.2 资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入

无。

5.4.7.17.3 资产支持证券投资收益——赎回差价收入

无。

5.4.7.17.4 资产支持证券投资收益——申购差价收入

无。

5.4.7.18 贵金属投资收益

5.4.7.18.1 贵金属投资收益项目构成

无。

5.4.7.18.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

无。

5.4.7.18.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

无。

5.4.7.18.4 贵金属投资收益——申购差价收入

无。

5.4.7.19 衍生工具收益

5.4.7.19.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

无。

5.4.7.19.2 衍生工具收益——其他投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
股指期货投资收益	320,855.64

5.4.7.20 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
股票投资产生的股利收益	155,582.05
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	155,582.05
----	------------

5.4.7.21 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
1. 交易性金融资产	8,613,950.52
股票投资	8,611,086.02
债券投资	2,864.50
资产支持证券投资	-
基金投资	-
贵金属投资	-
其他	-
2. 衍生工具	-49,720.00
权证投资	-
期货投资	-49,720.00
3. 其他	-
减：应税金融商品公允价值变动 产生的预估增值税	-
合计	8,564,230.52

5.4.7.22 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
基金赎回费收入	4,085.64
基金转换费收入	736.62
合计	4,822.26

5.4.7.23 信用减值损失

无。

5.4.7.24 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
审计费用	13,884.51
信息披露费	39,671.58
证券出借违约金	-
银行划款手续费	330.00
合计	53,886.09

5.4.7.25 分部报告

无。

5.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

5.4.8.1 或有事项

无。

5.4.8.2 资产负债表日后事项

无。

5.4.9 关联方、关联关系

5.4.9.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

本基金本报告期存在控制关系或者其他重大利害关系的关联方未发生变化。

5.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
大成基金管理有限公司（“大成基金”）	基金管理人、注册登记机构、基金销售机构
中国农业银行股份有限公司（“中国农业银行”）	基金托管人、基金销售机构

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

无。

5.4.10.1.2 债券交易

无。

5.4.10.1.3 债券回购交易

无。

5.4.10.1.4 基金交易

无。

5.4.10.1.5 权证交易

无。

5.4.10.1.6 应支付关联方的佣金

无。

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	上年度可比期间
----	----	---------

	2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日	2025 年 4 月 29 日（基金合同生效日）至 2025 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	241,651.13	375,845.25
其中：应支付销售机构的客户维护费	114,850.03	184,714.43
应支付基金管理人的净管理费	126,801.10	191,130.82

注：本基金管理费年费率为 0.80%，每日计提，按月支付。其计算公式为：

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

5.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2025 年 4 月 29 日（基金合同生效日）至 2025 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	30,206.35	46,980.69

注：本基金托管费年费率为 0.10%，每日计提，按月支付。其计算公式为：

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

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 1 日至 2026 年 6 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	大成上证科创板综合 指数增强 A	大成上证科创板综合 指数增强 C	合计
大成基金	—	831.67	831.67
中国农业银行	—	21,368.58	21,368.58
合计	—	22,200.25	22,200.25
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2025 年 4 月 29 日（基金合同生效日）至 2025 年 6 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	大成上证科创板综合 指数增强 A	大成上证科创板综合 指数增强 C	合计
大成基金	—	0.02	0.02
中国农业银行	—	53,060.87	53,060.87

合计	-	53,060.89	53,060.89
----	---	-----------	-----------

注：C 类基金份额的销售服务费年费率为 0.40%。

销售服务费的计算方法如下：

$H = E \times \text{该类基金份额销售服务费年费率} \div \text{当年天数}$

H 为该类基金份额每日应计提的销售服务费

E 为该类基金份额前一日基金资产净值

5.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

无。

5.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

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

无。

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

无。

5.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

5.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

无。

5.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

无。

5.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2025 年 4 月 29 日（基金合同生效日）至 2025 年 6 月 30 日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国农业银行	581,136.11	2,317.99	6,962,205.61	30,642.28

注：本基金由基金托管人保管的银行存款，按银行约定利率计息。

5.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

无。

5.4.10.8 其他关联交易事项的说明

无。

5.4.11 利润分配情况

无。

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

5.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

6.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	受限期	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量（单位：股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
001248	华润新能源	2026 年 6 月 25 日	1 个月内（含）	新股未上市	10.11	10.11	1,000	10,110.00	10,110.00	-

5.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量（股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
688072	拓荆科技	2026 年 6 月 29 日	重大事项停牌	879.53	2026 年 7 月 13 日	890.99	200	62,328.20	175,906.00	-

5.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

5.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

无。

5.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

无。

5.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

无。

5.4.13 金融工具风险及管理

5.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金是股票型基金，其预期风险与预期收益高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。同时本基金为指数基金，主要投资于标的指数成份股及备选成份股，具有与标的指数相似的风险收益特征。本基金还可投资港股通标的股票，需承担港股通机制下因投资环境、投资标的、市场

制度以及交易规则等差异带来的特有风险。本基金在日常经营活动中面临的与这些金融工具相关的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金的基金管理人从事风险管理的主要目标是力争在对标的指数进行有效跟踪的基础上，实现超越目标指数的投资收益，谋求基金资产的长期增值。

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

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

5.4.13.2 信用风险

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

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

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

本期末，本基金持有的除国债、央行票据和政策性金融债以外的债券占基金资产净值的比例

为 0.06%(上年度末：0.04%)。

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、结算备付金及存出保证金等。

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	4,643,173.35	-	-	-	4,643,173.35
结算备付金	485,621.04	-	-	-	485,621.04
存出保证金	-	-	-	203,640.00	203,640.00
交易性金融资产	-	-	33,033.39	51,691,408.31	51,724,441.70
应收申购款	-	-	-	199,766.28	199,766.28
资产总计	5,128,794.39	-	33,033.39	52,094,814.59	57,256,642.37
负债					
应付赎回款	-	-	-	183,956.42	183,956.42
应付管理人报酬	-	-	-	35,094.25	35,094.25
应付托管费	-	-	-	4,386.78	4,386.78
应付销售服务费	-	-	-	6,551.87	6,551.87
应交税费	-	-	-	7,703.21	7,703.21
其他负债	-	-	-	54,377.51	54,377.51
负债总计	-	-	-	292,070.04	292,070.04
利率敏感度缺口	5,128,794.39	-	33,033.39	51,802,744.55	56,964,572.33
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	5,020,694.14	-	-	-	5,020,694.14
结算备付金	332,714.29	-	-	-	332,714.29
存出保证金	-	-	-	172,910.40	172,910.40
交易性金融资产	-	-	25,167.80	57,658,839.80	57,684,007.60
应收申购款	-	-	-	24,508.20	24,508.20
资产总计	5,353,408.43	-	25,167.80	57,856,258.40	63,234,834.63
负债					
应付赎回款	-	-	-	245,779.86	245,779.86
应付管理人报酬	-	-	-	47,025.85	47,025.85
应付托管费	-	-	-	5,878.20	5,878.20
应付销售服务费	-	-	-	8,316.50	8,316.50
应交税费	-	-	-	6,969.23	6,969.23
其他负债	-	-	-	28,000.00	28,000.00

负债总计	-	-	-	341,969.64	341,969.64
利率敏感度缺口	5,353,408.43	-	25,167.80	57,514,288.76	62,892,864.99

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 0.06%(上年度末：0.04%)，因此市场利率的变动对于本基金净资产无重大影响(上年度末：同)。

5.4.13.4.2 外汇风险

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

5.4.13.4.3 其他价格风险

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

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

本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险。本基金股票资产投资比例不低于基金资产的 80%，其中投资于标的指数成份股和备选成份股的资产不低于非现金基金资产的 80%，投资于港股通标的股票的比例占股票资产的 0-50%；每个交易日日终在扣除股指期货、国债期货、股票期权合约需缴纳的交易保证金后，保持不低于基金资产净值 5%的现金或到期日在一年以内的政府债券，其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。此外，本基金的基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控，定期运用多种定量方法对基金进行风险度量，包括 VaR(Value at Risk) 指标等来测试本基金面临的潜在价格风险，及时可靠地对风险进行跟踪和控制。

5.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2026 年 6 月 30 日		上年度末 2025年12月31日	
	公允价值	占基金资产净值 比例（%）	公允价值	占基金资产净值 比例（%）

交易性金融资产—股票投资	51,691,408.31	90.74	57,658,839.80	91.68
交易性金融资产—基金投资	—	—	—	—
交易性金融资产—债券投资	33,033.39	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	51,724,441.70	90.80	57,658,839.80	91.68

5.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除业绩比较基准以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2026 年 6 月 30 日）	上年度末（2025 年 12 月 31 日）
	业绩比较基准上升 5%	2,551,434.98	2,686,649.23
	业绩比较基准下降 5%	-2,551,434.98	-2,686,649.23

5.4.14 公允价值

5.4.14.1 金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属的层次，由对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次决定： 第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。 第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。 第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

5.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

5.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2026 年 6 月 30 日	上年度末 2025 年 12 月 31 日
---------------	------------------------	--------------------------

第一层次	51,538,425.70	56,974,087.29
第二层次	186,016.00	669,933.75
第三层次	—	39,986.56
合计	51,724,441.70	57,684,007.60

5.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

本基金以导致各层次之间转换的事项发生日为确认各层次之间转换的时点。

对于证券交易所上市的证券，若出现重大事项停牌、交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)、或属于非公开发行等情况，本基金不会于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间将相关证券的公允价值列入第一层次；对于定期开放的基金投资，本基金不会于封闭期将相关基金列入第一层次；并根据估值调整中采用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度，确定相关投资的公允价值应属第二层次还是第三层次。

5.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

于本期末，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融工具(上年度末：同)。

5.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括货币资金、应收款项和其他金融负债等，其账面价值与公允价值相差很小。

5.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

§ 6 投资组合报告

6.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	51,691,408.31	90.28
	其中：股票	51,691,408.31	90.28
2	基金投资	—	—
3	固定收益投资	33,033.39	0.06
	其中：债券	33,033.39	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	5,128,794.39	8.96
8	其他各项资产	403,406.28	0.70
9	合计	57,256,642.37	100.00

6.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

6.2.1 报告期末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	36,596,418.89	64.24
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	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	9,989,337.63	17.54
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	966,305.79	1.70
N	水利、环境和公共设施管理业	105,108.00	0.18
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	47,657,170.31	83.66

6.2.2 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	83,776.00	0.15

	业		
B	采矿业	124,996.00	0.22
C	制造业	3,038,680.00	5.33
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	78,048.00	0.14
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	50,464.00	0.09
G	交通运输、仓储和邮政业	53,922.00	0.09
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	175,232.00	0.31
J	金融业	53,340.00	0.09
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	81,257.00	0.14
M	科学研究和技术服务业	275,048.00	0.48
N	水利、环境和公共设施管理业	11,723.00	0.02
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	7,752.00	0.01
S	综合	-	-
	合计	4,034,238.00	7.08

6.2.3 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

无。

6.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

6.3.1 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	688256	寒武纪	2,791	4,453,180.05	7.82
2	688041	海光信息	7,507	2,779,842.10	4.88
3	688361	中科飞测	2,900	1,247,000.00	2.19
4	688012	中微公司	2,312	1,083,172.00	1.90
5	688521	芯原股份	2,500	927,850.00	1.63

6	688008	澜起科技	2,965	918,853.50	1.61
7	688200	华峰测控	1,711	898,446.10	1.58
8	688981	中芯国际	5,045	801,246.90	1.41
9	688052	纳芯微	2,769	798,330.39	1.40
10	688110	东芯股份	3,900	794,430.00	1.39
11	688525	佰维存储	1,600	791,568.00	1.39
12	688469	芯联集成	73,100	775,591.00	1.36
13	688002	睿创微纳	4,925	761,848.25	1.34
14	688347	华虹宏力	1,735	583,480.50	1.02
15	688127	蓝特光学	5,894	575,254.40	1.01
16	688099	晶晨股份	5,400	555,660.00	0.98
17	688498	源杰科技	290	546,940.00	0.96
18	688120	华海清科	1,540	496,157.20	0.87
19	688279	峰岬科技	2,200	493,768.00	0.87
20	688536	思瑞浦	1,294	471,132.46	0.83
21	688388	嘉元科技	10,652	468,688.00	0.82
22	688652	京仪装备	2,300	460,391.00	0.81
23	688009	中国通号	86,633	412,373.08	0.72
24	688372	伟测科技	2,000	372,000.00	0.65
25	688131	皓元医药	3,700	350,020.00	0.61
26	688519	南亚新材	905	343,936.20	0.60
27	688630	芯碁微装	600	329,634.00	0.58
28	688378	奥来德	5,274	326,988.00	0.57
29	688188	柏楚电子	2,934	313,057.80	0.55
30	688234	天岳先进	1,800	312,318.00	0.55
31	688531	日联科技	1,722	306,240.48	0.54
32	688027	国盾量子	600	302,406.00	0.53
33	688047	龙芯中科	1,948	301,297.16	0.53
34	688126	沪硅产业	7,400	295,186.00	0.52
35	688660	电气风电	32,900	283,598.00	0.50
36	688653	康希通信	16,200	281,556.00	0.49
37	688772	珠海冠宇	14,264	280,002.32	0.49
38	688135	利扬芯片	6,600	277,728.00	0.49
39	688029	南微医学	3,798	272,696.40	0.48
40	688778	厦钨新能	5,000	272,000.00	0.48
41	688019	安集科技	800	271,568.00	0.48
42	688678	福立旺	10,840	262,002.80	0.46
43	688819	天能股份	11,552	256,454.40	0.45
44	688720	艾森股份	2,520	254,520.00	0.45
45	688239	航宇科技	4,200	251,286.00	0.44
46	688322	奥比中光	1,904	248,567.20	0.44
47	688400	凌云光	3,626	240,041.20	0.42
48	688387	信科移动	11,800	234,112.00	0.41

49	688261	东微半导	2,200	230,846.00	0.41
50	688475	萤石网络	8,412	230,068.20	0.40
51	688036	传音控股	3,900	229,905.00	0.40
52	688568	中科星图	5,543	229,868.21	0.40
53	688349	三一重能	15,100	229,218.00	0.40
54	688309	恒誉环保	3,700	225,256.00	0.40
55	688220	翱捷科技	1,800	223,776.00	0.39
56	688385	复旦微电	3,134	223,422.86	0.39
57	688266	泽璟制药	1,879	219,204.14	0.38
58	688100	威胜信息	7,030	215,047.70	0.38
59	688187	时代电气	3,089	212,090.74	0.37
60	688728	格科微	10,000	210,400.00	0.37
61	688375	国博电子	2,000	208,600.00	0.37
62	688257	新锐股份	2,000	203,800.00	0.36
63	688676	金盘科技	2,400	203,136.00	0.36
64	688386	泛亚微透	2,200	197,648.00	0.35
65	688230	芯导科技	2,500	197,025.00	0.35
66	688031	星环科技	1,700	195,806.00	0.34
67	688109	品茗科技	2,568	194,397.60	0.34
68	688295	中复神鹰	3,200	193,728.00	0.34
69	688172	燕东微	2,300	192,418.00	0.34
70	688208	道通科技	7,560	190,436.40	0.33
71	688799	华纳药厂	4,200	188,454.00	0.33
72	688183	生益电子	1,400	185,360.00	0.33
73	688087	英科再生	5,300	177,126.00	0.31
74	688072	拓荆科技	200	175,906.00	0.31
75	688656	浩欧博	1,800	174,186.00	0.31
76	688223	晶科能源	36,000	171,000.00	0.30
77	688196	卓越新能	4,742	170,237.80	0.30
78	688585	上纬新材	1,000	165,800.00	0.29
79	688518	联赢激光	5,343	165,098.70	0.29
80	688150	莱特光电	2,400	164,688.00	0.29
81	688617	惠泰医疗	900	163,404.00	0.29
82	688559	海目星	1,945	163,224.40	0.29
83	688538	和辉光电	62,329	162,055.40	0.28
84	688195	腾景科技	840	161,767.20	0.28
85	688599	天合光能	11,418	161,222.16	0.28
86	688097	博众精工	2,500	157,625.00	0.28
87	688708	佳驰科技	3,100	157,480.00	0.28
88	688766	普冉股份	200	153,320.00	0.27
89	688049	炬芯科技	3,245	152,222.95	0.27
90	688016	心脉医疗	1,700	150,688.00	0.26
91	688663	新风光	1,700	150,382.00	0.26

92	688758	赛分科技	6,800	149,668.00	0.26
93	688141	杰华特	947	145,364.50	0.26
94	688281	华秦科技	2,860	143,657.80	0.25
95	688523	航天环宇	2,700	141,480.00	0.25
96	688228	开普云	1,800	139,212.00	0.24
97	688215	瑞晟智能	3,455	138,752.80	0.24
98	688103	国力电子	1,850	137,658.50	0.24
99	688377	迪威尔	5,680	133,934.40	0.24
100	688578	艾力斯	1,200	131,040.00	0.23
101	688543	国科军工	3,280	129,396.00	0.23
102	688620	安凯微	7,900	127,980.00	0.22
103	688275	万润新能	1,000	127,550.00	0.22
104	688017	绿的谐波	300	125,358.00	0.22
105	688700	东威科技	1,400	125,160.00	0.22
106	688198	佰仁医疗	1,400	124,936.00	0.22
107	688603	天承科技	600	124,770.00	0.22
108	688779	五矿新能	15,383	124,756.13	0.22
109	688425	铁建重工	30,851	124,021.02	0.22
110	688577	浙海德曼	2,675	122,595.25	0.22
111	688219	会通股份	9,400	121,636.00	0.21
112	688105	诺唯赞	6,931	120,252.85	0.21
113	688235	百济神州	468	119,157.48	0.21
114	688689	银河微电	1,834	118,696.48	0.21
115	688182	灿勤科技	2,736	117,839.52	0.21
116	688177	百奥泰	6,920	116,394.40	0.20
117	688443	智翔金泰	4,900	113,925.00	0.20
118	688153	唯捷创芯	3,500	112,420.00	0.20
119	688432	有研硅	2,800	111,916.00	0.20
120	688313	仕佳光子	600	110,790.00	0.19
121	688345	博力威	1,900	110,352.00	0.19
122	688516	奥特维	1,900	109,041.00	0.19
123	688609	九联科技	9,900	108,999.00	0.19
124	688175	高凌信息	4,300	108,145.00	0.19
125	688262	国芯科技	2,500	108,075.00	0.19
126	688276	百克生物	7,700	107,338.00	0.19
127	688122	西部超导	1,708	107,279.48	0.19
128	688233	神工股份	500	107,210.00	0.19
129	688299	长阳科技	6,400	106,944.00	0.19
130	688225	亚信安全	8,500	105,570.00	0.19
131	688480	赛恩斯	1,200	105,108.00	0.18
132	688593	新相微	2,700	105,084.00	0.18
133	688398	赛特新材	4,000	103,640.00	0.18
134	688112	鼎阳科技	1,400	102,844.00	0.18

135	688472	阿特斯	9,300	100,626.00	0.18
136	688013	天臣医疗	4,009	98,902.03	0.17
137	688128	中国电研	4,100	97,334.00	0.17
138	688455	科捷智能	5,200	97,032.00	0.17
139	688569	铁科轨道	6,000	96,900.00	0.17
140	688505	复旦张江	12,900	95,202.00	0.17
141	688683	莱尔科技	2,500	94,800.00	0.17
142	688499	利元亨	1,800	94,590.00	0.17
143	688626	翔宇医疗	2,100	92,946.00	0.16
144	688798	艾为电子	1,267	92,896.44	0.16
145	688588	凌志软件	10,100	91,809.00	0.16
146	688269	凯立新材	2,808	89,041.68	0.16
147	688267	中触媒	4,489	88,433.30	0.16
148	688212	澳华内镜	3,000	88,200.00	0.15
149	688082	盛美上海	200	86,400.00	0.15
150	688111	金山办公	400	85,220.00	0.15
151	688553	汇宇制药	7,892	83,891.96	0.15
152	688211	中科微至	2,400	82,608.00	0.15
153	688289	圣湘生物	5,700	82,080.00	0.14
154	688366	昊海生科	2,843	82,077.41	0.14
155	688800	瑞可达	840	80,614.80	0.14
156	688592	司南导航	1,900	78,736.00	0.14
157	688199	久日新材	2,247	77,588.91	0.14
158	688218	江苏北人	1,400	76,944.00	0.14
159	688191	智洋创新	2,133	76,148.10	0.13
160	688169	石头科技	800	75,976.00	0.13
161	688529	豪森智能	4,700	73,931.00	0.13
162	688522	纳睿雷达	3,640	72,872.80	0.13
163	688737	中自科技	3,800	72,732.00	0.13
164	688023	安恒信息	1,965	72,154.80	0.13
165	688557	兰剑智能	2,308	71,617.24	0.13
166	688561	奇安信	2,984	71,556.32	0.13
167	688063	派能科技	1,278	68,079.06	0.12
168	688357	建龙微纳	2,300	67,781.00	0.12
169	688687	凯因科技	4,090	66,707.90	0.12
170	688007	光峰科技	4,927	65,529.10	0.12
171	688410	山外山	4,544	65,251.84	0.11
172	688139	海尔生物	2,411	63,698.62	0.11
173	688236	春立医疗	4,300	62,178.00	0.11
174	688606	奥泰生物	1,500	61,620.00	0.11
175	688409	富创精密	200	61,250.00	0.11
176	688517	金冠电气	3,400	59,432.00	0.10
177	688258	卓易信息	500	59,270.00	0.10

178	688389	普门科技	6,000	58,740.00	0.10
179	688395	正弦电气	2,600	57,460.00	0.10
180	688098	申联生物	6,600	56,694.00	0.10
181	688148	芳源股份	6,500	55,770.00	0.10
182	688252	天德钰	2,237	53,688.00	0.09
183	688380	中微半导	800	52,728.00	0.09
184	688238	和元生物	9,700	52,574.00	0.09
185	688231	隆达股份	1,430	52,523.90	0.09
186	688548	广钢气体	1,000	52,100.00	0.09
187	688692	达梦数据	200	48,858.00	0.09
188	688526	科前生物	3,969	48,024.90	0.08
189	688392	骄成超声	200	45,436.00	0.08
190	688321	微芯生物	1,600	42,128.00	0.07
191	688090	瑞松科技	390	41,515.50	0.07
192	688600	皖仪科技	1,200	39,936.00	0.07
193	688628	优利德	400	39,576.00	0.07
194	688277	天智航	2,300	39,330.00	0.07
195	688682	霍莱沃	1,000	38,900.00	0.07
196	688018	乐鑫科技	300	38,376.00	0.07
197	688383	新益昌	200	37,608.00	0.07
198	688337	普源精电	500	37,465.00	0.07
199	688015	交控科技	2,389	36,742.82	0.06
200	688615	合合信息	300	33,930.00	0.06
201	688108	赛诺医疗	1,800	33,354.00	0.06
202	688566	吉贝尔	1,300	33,267.00	0.06
203	688365	光云科技	2,000	31,540.00	0.06
204	688119	中钢洛耐	6,600	31,350.00	0.06
205	688248	南网科技	453	31,338.54	0.06
206	688563	航材股份	600	30,738.00	0.05
207	688334	西高院	1,660	30,112.40	0.05
208	688665	四方光电	436	28,645.20	0.05
209	688697	纽威数控	2,100	28,539.00	0.05
210	688085	三友医疗	2,020	24,179.40	0.04
211	688173	希荻微	1,200	22,968.00	0.04
212	688722	同益中	1,500	22,755.00	0.04
213	688319	欧林生物	500	21,990.00	0.04
214	688711	宏微科技	474	21,543.30	0.04
215	688210	统联精密	471	19,080.21	0.03
216	688486	龙迅股份	280	17,802.40	0.03
217	688117	圣诺生物	600	16,218.00	0.03
218	688336	三生国健	305	16,195.50	0.03
219	688162	巨一科技	600	14,184.00	0.02
220	688107	安路科技	300	13,680.00	0.02

221	688278	特宝生物	200	10,880.00	0.02
222	688391	钜泉科技	300	10,761.00	0.02
223	688315	诺禾致源	800	10,008.00	0.02
224	688575	亚辉龙	1,100	9,636.00	0.02
225	688161	威高骨科	200	4,196.00	0.01
226	688717	艾罗能源	21	1,733.97	0.00

6.3.2 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	301285	鸿日达	1,500	165,495.00	0.29
2	300857	协创数据	400	135,960.00	0.24
3	301393	昊帆生物	1,700	110,109.00	0.19
4	301280	珠城科技	2,000	101,140.00	0.18
5	300661	圣邦股份	700	100,436.00	0.18
6	301165	锐捷网络	1,200	96,540.00	0.17
7	300496	中科创达	1,500	92,685.00	0.16
8	003043	华亚智能	900	89,451.00	0.16
9	603228	景旺电子	1,200	86,892.00	0.15
10	002402	和而泰	3,300	85,239.00	0.15
11	300501	海顺新材	6,700	85,090.00	0.15
12	300498	温氏股份	6,800	83,776.00	0.15
13	301326	捷邦科技	600	83,622.00	0.15
14	300347	泰格医药	1,700	81,600.00	0.14
15	300842	帝科股份	900	80,253.00	0.14
16	300953	震裕科技	600	80,220.00	0.14
17	002027	分众传媒	16,200	78,408.00	0.14
18	300450	先导智能	1,900	77,368.00	0.14
19	301613	新铝时代	2,100	76,503.00	0.13
20	300207	欣旺达	4,000	75,960.00	0.13
21	002532	天山铝业	6,700	71,891.00	0.13
22	300793	佳禾智能	6,200	69,750.00	0.12
23	002543	万和电气	11,200	69,664.00	0.12
24	300012	华测检测	5,000	69,300.00	0.12
25	001286	陕西能源	6,700	67,938.00	0.12
26	300797	钢研纳克	4,800	63,648.00	0.11
27	300073	当升科技	1,300	62,452.00	0.11
28	301087	可孚医疗	1,300	61,945.00	0.11
29	300748	金力永磁	2,000	61,700.00	0.11
30	002250	联化科技	4,500	61,515.00	0.11
31	300284	苏交科	12,100	60,500.00	0.11
32	301039	中集车辆	8,500	59,925.00	0.11
33	000426	兴业银锡	1,800	59,328.00	0.10

34	001314	亿道信息	900	55,620.00	0.10
35	002340	格林美	8,400	55,524.00	0.10
36	300539	横河精密	2,700	54,999.00	0.10
37	300428	立中集团	3,000	54,540.00	0.10
38	002320	海峡股份	8,600	53,922.00	0.09
39	002948	青岛银行	10,500	53,340.00	0.09
40	300765	石药创新	1,800	49,014.00	0.09
41	001389	广合科技	200	47,450.00	0.08
42	300515	三德科技	3,500	45,675.00	0.08
43	300413	芒果超媒	3,100	45,353.00	0.08
44	300146	汤臣倍健	5,000	45,200.00	0.08
45	300724	捷佳伟创	600	42,360.00	0.07
46	300999	金龙鱼	1,800	41,868.00	0.07
47	300102	乾照光电	1,600	41,664.00	0.07
48	300261	雅本化学	8,900	39,783.00	0.07
49	300691	联合光电	2,400	37,944.00	0.07
50	600693	东百集团	4,600	36,064.00	0.06
51	601168	西部矿业	1,300	35,282.00	0.06
52	301371	敷尔佳	1,200	31,200.00	0.05
53	000807	云铝股份	1,200	26,568.00	0.05
54	002653	海思科	400	26,536.00	0.05
55	002602	世纪华通	1,800	25,380.00	0.04
56	300233	金城医药	1,900	23,560.00	0.04
57	603992	松霖科技	600	19,440.00	0.03
58	300740	水羊股份	1,000	18,410.00	0.03
59	002979	雷赛智能	300	16,734.00	0.03
60	603367	辰欣药业	1,300	16,679.00	0.03
61	603507	振江股份	500	16,445.00	0.03
62	601699	潞安环能	1,100	15,708.00	0.03
63	301002	崧盛股份	400	15,440.00	0.03
64	600595	中孚实业	2,600	14,612.00	0.03
65	605056	咸亨国际	900	14,400.00	0.03
66	300590	移为通信	1,000	14,350.00	0.03
67	300852	四会富仕	200	13,848.00	0.02
68	002953	日丰股份	1,500	13,080.00	0.02
69	000933	神火股份	600	12,720.00	0.02
70	301316	慧博云通	300	11,814.00	0.02
71	300388	节能国祯	1,900	11,723.00	0.02
72	300848	美瑞新材	800	11,160.00	0.02
73	001248	华润新能源	1,000	10,110.00	0.02
74	605299	舒华体育	600	8,010.00	0.01
75	605358	立昂微	100	7,760.00	0.01
76	600977	中国电影	600	7,752.00	0.01

77	600558	大西洋	1,500	7,410.00	0.01
78	600489	中金黄金	400	7,220.00	0.01
79	000408	藏格矿业	100	6,932.00	0.01
80	300129	泰胜风能	800	6,840.00	0.01
81	002752	昇兴股份	1,200	6,624.00	0.01
82	600989	宝丰能源	300	6,099.00	0.01
83	002738	中矿资源	100	5,899.00	0.01
84	002215	诺普信	700	5,761.00	0.01
85	300115	长盈精密	200	5,588.00	0.01
86	600988	赤峰黄金	200	5,264.00	0.01
87	000561	烽火电子	600	4,440.00	0.01
88	002414	高德红外	300	3,978.00	0.01
89	002876	三利谱	100	3,521.00	0.01
90	000415	渤海租赁	700	2,849.00	0.01
91	600711	盛屯矿业	200	2,194.00	0.00
92	603216	梦天家居	100	2,057.00	0.00
93	300134	大富科技	200	1,710.00	0.00
94	600010	包钢股份	700	1,561.00	0.00
95	600288	大恒科技	100	1,330.00	0.00
96	601600	中国铝业	100	822.00	0.00
97	002121	科陆电子	100	545.00	0.00
98	600808	马钢股份	100	250.00	0.00

6.4 报告期内股票投资组合的重大变动

6.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	688041	海光信息	1,180,700.27	1.88
2	688516	奥特维	883,157.34	1.40
3	688127	蓝特光学	810,885.37	1.29
4	688195	腾景科技	790,264.13	1.26
5	688660	电气风电	775,611.56	1.23
6	688777	中控技术	761,851.92	1.21
7	688361	中科飞测	727,796.30	1.16
8	688102	斯瑞新材	719,922.13	1.14
9	688385	复旦微电	711,396.15	1.13
10	688008	澜起科技	708,298.00	1.13
11	688183	生益电子	694,844.68	1.10
12	688388	嘉元科技	675,130.88	1.07
13	688110	东芯股份	620,069.56	0.99
14	688469	芯联集成	598,608.99	0.95
15	688331	荣昌生物	567,119.47	0.90
16	688548	广钢气体	560,166.20	0.89

17	688521	芯原股份	559,733.12	0.89
18	688711	宏微科技	558,874.43	0.89
19	688568	中科星图	553,386.22	0.88
20	688626	翔宇医疗	549,527.05	0.87

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

6.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	688041	海光信息	2,483,605.31	3.95
2	688008	澜起科技	1,762,736.36	2.80
3	688256	寒武纪	1,354,402.00	2.15
4	688331	荣昌生物	1,228,914.50	1.95
5	688072	拓荆科技	1,212,430.11	1.93
6	688777	中控技术	1,190,128.55	1.89
7	688702	盛科通信	1,035,406.83	1.65
8	688347	华虹宏力	966,084.41	1.54
9	688766	普冉股份	883,801.58	1.41
10	688123	聚辰股份	859,943.80	1.37
11	688615	合合信息	850,803.47	1.35
12	688271	联影医疗	836,414.15	1.33
13	688516	奥特维	812,926.72	1.29
14	688111	金山办公	802,725.75	1.28
15	688449	联芸科技	788,222.62	1.25
16	688981	中芯国际	786,740.99	1.25
17	688578	艾力斯	780,933.88	1.24
18	688183	生益电子	780,101.80	1.24
19	688102	斯瑞新材	779,555.24	1.24
20	688187	时代电气	772,424.92	1.23

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

6.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	84,341,508.07
卖出股票收入（成交）总额	110,425,788.81

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

6.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

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）	33,033.39	0.06
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	33,033.39	0.06

6.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

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	118068	迪威转债	210	33,033.39	0.06

6.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

无。

6.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

无。

6.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

无。

6.10 本基金投资股指期货的投资政策

本基金在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。

6.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

6.11.1 本期国债期货投资政策

无。

6.11.2 本期国债期货投资评价

无。

6.12 投资组合报告附注

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

本基金投资的前十名证券的发行主体本期没有出现被监管部门立案调查，或在报告编制日前

一年内受到公开谴责、处罚的情形。

6.12.2 基金投资的前十名股票是否超出基金合同约定的备选股票库

本基金投资的前十名股票未超出基金合同规定的备选股票库。

6.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	203,640.00
2	应收清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	199,766.28
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	403,406.28

6.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

无。

6.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

6.12.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

无。

6.12.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

无。

6.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入原因，分项之和与合计可能有尾差。

§ 7 基金份额持有人信息

7.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额级别	持有人户数 (户)	户均持有的基 金份额	持有人结构			
			机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总份 额比例 (%)	持有份额	占总份 额比例 (%)
大成上证 科创板综 合指数增	851	21,669.71	0.00	0.00	18,440,922.00	100.00

强 A						
大成上证科创板综合指数增强 C	923	11,821.63	0.00	0.00	10,911,367.98	100.00
合计	1,774	16,545.82	0.00	0.00	29,352,289.98	100.00

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

2、持有人户数为有效户数，即存量份额大于零的账户。

7.2 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	大成上证科创板综合指数增强 A	135,487.89	0.7347
	大成上证科创板综合指数增强 C	321,647.65	2.9478
	合计	457,135.54	1.5574

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

7.3 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	大成上证科创板综合指数增强 A	10~50
	大成上证科创板综合指数增强 C	0
	合计	10~50
本基金基金经理持有本开放式基金	大成上证科创板综合指数增强 A	0
	大成上证科创板综合指数增强 C	0
	合计	0

§ 8 开放式基金份额变动

单位：份

项目	大成上证科创板综合指数增强 A	大成上证科创板综合指数增强 C
基金合同生效日 （2025 年 4 月 29）	217,739,276.57	171,634,264.89

日) 基金份额总额		
本报告期期初基金份额总额	28,662,814.89	17,339,071.96
本报告期基金总申购份额	10,327,404.79	12,263,343.16
减: 本报告期基金总赎回份额	20,549,297.68	18,691,047.14
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	18,440,922.00	10,911,367.98

§ 9 重大事件揭示

9.1 基金份额持有人大会决议

无。

9.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

一、基金管理人的重大人事变动

经大成基金管理有限公司 2026 年第一次临时股东会及公司九届四次监事会审议通过，同意选举郭向东先生为公司第九届监事会股东代表监事，监事会主席，任期自 2026 年 4 月 30 日之日起计算，与公司第九届监事会剩余任期一致。自郭向东先生的监事任职生效之日起，陈勇先生将不再担任公司监事、监事会主席职务。

二、基金托管人的基金托管部门的重大人事变动

无。

9.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内无涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

9.4 基金投资策略的改变

本基金投资策略在本报告期内没有重大改变。

9.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

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

9.6 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况

9.6.1 管理人受调查或处罚等情况

本报告期内，基金管理人无受调查或处罚等情况。

9.6.2 管理人相关从业人员受调查或处罚等情况

本报告期内，基金管理人相关从业人员无受调查或处罚等情况。

9.6.3 托管人受调查或处罚等情况

无。

9.6.4 托管人相关从业人员受调查或处罚等情况

无。

9.7 基金租用或者通过证券公司交易单元进行证券投资的相关情况

9.7.1 基金租用或者通过证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例 (%)	佣金	占当期佣金总量的比例 (%)	
华西证券	3	194,746,536.88	100.00	38,170.53	100.00	-

注：本基金采用证券公司交易结算模式，本基金管理人负责选择证券经纪商，使用其交易单元作为本基金的交易单元。证券经纪商的选择标准和流程如下：

（一）筛选标准

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

（二）筛选流程

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

2、公司按照白名单与证券公司进行协议签署。

9.7.2 基金租用或者通过证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易		基金交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例	成交金额	占当期基金成交总额的比例

		(%)		比例 (%)		额的比例 (%)		额的比例 (%)
华西证券	82,503.83	100.00	—	—	—	—	—	—

9.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	大成基金管理有限公司关于旗下部分基金估值调整情况的公告	中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站	2026 年 06 月 26 日
2	大成上证科创板综合指数增强型证券投资基金(C 类份额)基金产品资料概要更新	中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站	2026 年 05 月 29 日
3	大成上证科创板综合指数增强型证券投资基金(A 类份额)基金产品资料概要更新	中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站	2026 年 05 月 29 日
4	大成上证科创板综合指数增强型证券投资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 05 月 29 日
5	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
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	大成上证科创板综合指数增强型证券投资基金 2026 年第 1 季度报告	中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站	2026 年 04 月 22 日
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	大成上证科创板综合指数增强型证券投资基金 2025 年年度报告	中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站	2026 年 03 月 31 日
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
13	大成上证科创板综合指数增强型证	中国证监会基金电子披	2026 年 01 月 22 日

	券投资基金 2025 年第 4 季度报告	露网站、规定报刊及本 公司网站	
--	----------------------	--------------------	--

§ 10 影响投资者决策的其他重要信息

10.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

无。

10.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§ 11 备查文件目录

11.1 备查文件目录

- 1、中国证监会批准设立大成上证科创板综合指数增强型证券投资基金的文件；
- 2、《大成上证科创板综合指数增强型证券投资基金基金合同》；
- 3、《大成上证科创板综合指数增强型证券投资基金托管协议》；
- 4、大成基金管理有限公司批准文件、营业执照、公司章程；
- 5、本报告期内在规定报刊上披露的各种公告原稿。

11.2 存放地点

备查文件存放在本基金管理人和托管人的住所。

11.3 查阅方式

投资者可在营业时间免费查阅，或登录本基金管理人网站 <http://www.dcfund.com.cn> 进行查阅。

大成基金管理有限公司

2026 年 8 月 28 日