

大成国证石油天然气指数型发起式证券投资 基金 2026 年第 2 季度报告

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：中国工商银行股份有限公司

报告送出日期：2026 年 7 月 21 日

§1 重要提示

基金管理人的董事会及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责任。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同约定，于 2026 年 07 月 20 日复核了本报告中的财务指标、净值表现和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。

本报告中财务资料未经审计。
本报告期自 2026 年 04 月 01 日起至 06 月 30 日止。

§2 基金产品概况

基金简称	大成国证石油天然气指数型发起式
基金主代码	026715
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2026 年 2 月 12 日
报告期末基金份额总额	72,864,245.16 份
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。 由于标的指数编制方法调整、成份股及其权重发生变化（包括配送股、增发、临时调入及调出成份股等）的原因，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。 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。 （一）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国证石油天然气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。 在正常市场情况下，力争控制本基金的份额净值与业绩比较基准的收益率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%。如因指数编制规则调整或其他因素导致跟踪偏离度和跟踪误差超过上述范围，基金管理人应采取合理措施避免跟踪偏离度、跟踪误差进一步扩大。 （二）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和研究，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。 （三）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。 （四）股指期货的交易策略 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。 （五）国债期货交易策略 本基金参与国债期货交易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。 （六）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，并结合股指期货定价模型，选择估值合理的期权合约。 （七）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，本基金将综合市场环境、投资者结构、基金历史申赎情况、股票流动性等因素选取出借对象，力争为本基金份额持有人增厚投资收益。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。 （八）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	国证石油天然气指数收益率*95%+活期存款基准利率*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。	
基金管理人	大成基金管理有限公司	
基金托管人	中国工商银行股份有限公司	
下属分级基金的基金简称	大成国证石油天然气指数型发起式 A	大成国证石油天然气指数型发起式 C
下属分级基金的交易代码	026715	026716
报告期末下属分级基金的份额总额	25,867,713.70 份	46,996,531.46 份

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位：人民币元

主要财务指标	报告期（2026 年 4 月 1 日 - 2026 年 6 月 30 日）	
	大成国证石油天然气指数型发起式 A	大成国证石油天然气指数型发起式 C
1. 本期已实现收益	-5,047,268.30	-12,703,197.58
2. 本期利润	-4,489,109.94	-8,901,837.61
3. 加权平均基金份额本期利润	-0.1378	-0.1058
4. 期末基金资产净值	21,562,017.27	39,144,333.95
5. 期末基金份额净值	0.8335	0.8329

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

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

大成国证石油天然气指数型发起式 A

阶段	净值增长率①	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
----	--------	-----------	------------	---------------	-----	-----

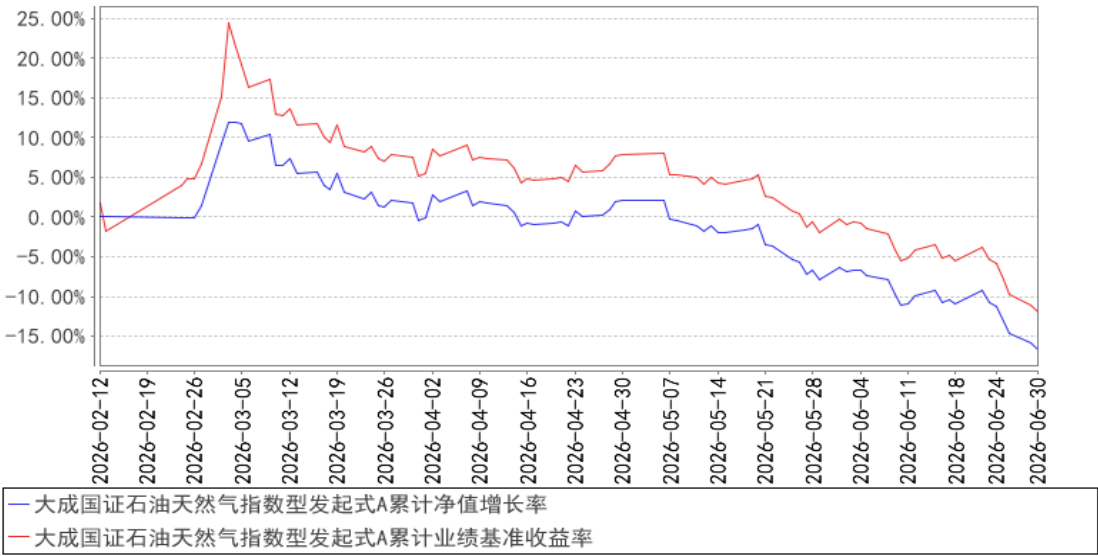
				④		
过去三个月	-16.22%	1.12%	-16.22%	1.13%	0.00%	-0.01%
自基金合同生效起至今	-16.65%	1.46%	-11.93%	1.89%	-4.72%	-0.43%

大成国证石油天然气指数型发起式 C

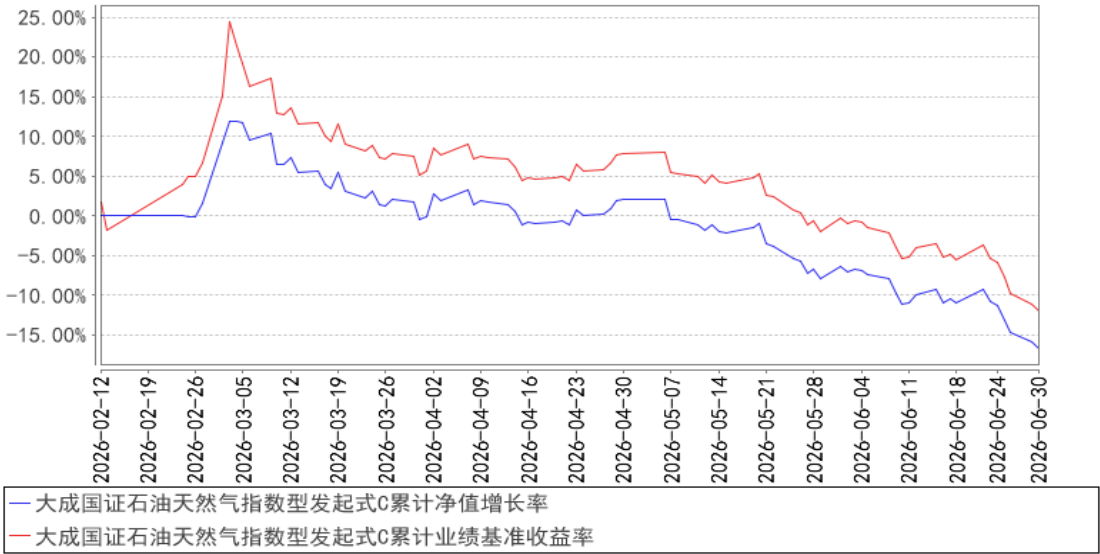
阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①－③	②－④
过去三个月	-16.27%	1.13%	-16.22%	1.13%	-0.05%	0.00%
自基金合同生效起至今	-16.71%	1.46%	-11.93%	1.89%	-4.78%	-0.43%

3.2.2 自基金合同生效以来基金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

大成国证石油天然气指数型发起式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



大成国证石油天然气指数型发起式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：1、本基金合同生效日为 2026 年 2 月 12 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。

§4 管理人报告

4.1 基金经理（或基金经理小组）简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
刘淼	本基金基金经理	2026 年 2 月 12 日	-	18 年	北京大学工商管理硕士。2008 年 4 月至 2011 年 5 月就职于招商基金管理有限公司，任基金核算部基金会计。2011 年 5 月加入大成基金管理有限公司，先后担任基金运营部基金会计、股票投资部投委会秘书兼风控员、数量与指数投资部数量分析师、指数与期货投资部基金经理、指数与期货投资部总监助理。2020 年 6 月 29 日至 2023 年 5 月 30 日任大成 MSCI 中国 A 股质优价值 100 交易型开放式指数证券投资基金基金经理。2020 年 6 月 29 日至 2023 年 6 月 14 日任大成 MSCI 中国 A 股质优价值 100 交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理。2020 年 6 月 29 日至 2025 年 12 月 19 日任深证成长 40 交易型开放式指数证券投资基金、大成深证成长 40 交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理。2020 年 6 月 29 日

					至 2022 年 11 月 30 日任大成中证 500 深市交易型开放式指数证券投资基金基金经理。2021 年 4 月 30 日至 2025 年 7 月 29 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。2021 年 6 月 17 日起任大成中证红利指数证券投资基金基金经理。2021 年 9 月 2 日至 2022 年 12 月 8 日任中证 500 沪市交易型开放式指数证券投资基金基金经理。2021 年 9 月 2 日至 2025 年 3 月 17 日任大成中证 A100 交易型开放式指数证券投资基金（更名前为大成中证 100 交易型开放式指数证券投资基金）基金经理。2021 年 9 月 2 日至 2025 年 12 月 19 日任大成深证成份交易型开放式指数证券投资基金基金经理。2022 年 6 月 28 日至 2025 年 2 月 18 日任大成中证电池主题指数型发起式证券投资基金基金经理。2022 年 7 月 13 日至 2025 年 3 月 17 日任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。2022 年 10 月 13 日至 2023 年 10 月 20 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。2023 年 3 月 20 日起任大成有色金属期货交易型开放式指数证券投资基金、大成有色金属期货交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理。2023 年 4 月 14 日起任大成沪深 300 指数证券投资基金基金经理。2024 年 3 月 6 日起任大成中证 A50 交易型开放式指数证券投资基金基金经理。2024 年 4 月 8 日至 2025 年 7 月 29 日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基金经理。2024 年 4 月 23 日起任大成中证 A50 交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理。2024 年 5 月 24 日至 2025 年 2 月 18 日任大成中证芯片产业指数型发起式证券投资基金基金经理。2024 年 5 月 28 日至 2025 年 7 月 29 日任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。2024 年 11 月 12 日起任大成中证 A500 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 A500 指数型发起式证券投资基金）基金经理。2024 年 11 月 22 日起任
--	--	--	--	--	--

					大成中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金基金经理。2025 年 4 月 2 日起任大成深证 100 交易型开放式指数证券投资基金基金经理。2025 年 4 月 23 日起任大成中证全指自由现金流交易型开放式指数证券投资基金基金经理。2025 年 7 月 2 日起任大成中证全指自由现金流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。2025 年 7 月 16 日起担任大成创业板人工智能交易型开放式指数证券投资基金基金经理。2025 年 8 月 29 日起任大成创业板 50 交易型开放式指数证券投资基金基金经理。2025 年 9 月 23 日起任大成创业板 50 交易型开放式指数证券投资基金联接基金（转型前为大成创业板 50 指数型证券投资基金）基金经理。2025 年 10 月 21 日起任大成创业板人工智能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。2026 年 2 月 12 日起任大成国证石油天然气指数型发起式证券投资基金基金经理。2026 年 6 月 16 日起任大成上证科创板 50 成份指数型证券投资基金基金经理。具备基金从业资格。国籍：中国
--	--	--	--	--	---

注：1、任职日期、离任日期为本基金管理人作出决定之日。

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

4.1.1 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理同时管理的产品情况

无。

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

4.3 公平交易专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

报告期内，公司严格执行了公平交易的原则和制度。公司运用统计分析方法和工具，对旗下

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

4.3.2 异常交易行为的专项说明

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

4.4 报告期内基金的投资策略和运作分析

二季度，A 股市场波动显著，风格极致分化。收益方面，沪深 300 涨 11.90%；中证 500 涨 18.56%；中证 1000 涨 15.62%；创业板指涨 36.35%；科创 50 涨 75.74%。行业上，电子、通信、建材涨幅较高；消费者服务、农林牧渔和综合表现不佳。风格上，成长大幅占优。

报告期内，股票市场行情的内在逻辑可以概括为四个阶段：地缘压制下的缩量拉锯、风险缓释触发的成长修复、事件催化峰值与分母扰动的博弈，以及地缘溢价消退与政策共振下的风格极致加速。贯穿始终的矛盾是人工智能算力产业景气与传统资源、红利资产之间的对立。季度初，中东地缘冲突的冲击余波仍在，市场延续调整态势，资金观望情绪主导。指数基本上围绕关键关口震荡，但并未形成有效反弹。特朗普政府在“极限施压”与“谈判缓和”间的频繁切换，进一步扰乱了市场对宏观风险的定价秩序，A 股整体缩量拉锯。4 月 8 日后，由于美伊进入停火谈判窗口期，霍尔木兹海峡通行回升，尾部风险骤降，跨资产联动性回落，市场由此进入一轮以成长风格为核心的估值修复行情。前期超跌的科技板块反弹幅度居前，红利价值风格相对承压。这一轮行情并非纯粹的情绪修复，AI 产业链恰好步入一季度业绩验证期，硬件龙头盈利高增兑现了市场此前的预期差，叠加 DeepSeek V4 模型发布及国产算力订单上修，产业趋势与基本面确定性形成共振，驱动行情由超跌修复演变为具有盈利支撑的趋势性上行，日均成交额随之显著回升，市场情绪改善。5 月的特朗普访华以及中美元首构建“建设性战略稳定关系”共识落地后，外交层面的超预期进展将市场风险偏好推升至阶段性峰值，上证指数一度创十年新高。然而，重大利好兑现后市场即进入长达近一个月的震荡回调期。五月中至六月上旬调整的原因由外而内层层叠加：分母端，

美国通胀、非农数据全面超预期，鹰派新主席沃什履新后美联储全年降息预期基本被排除，10 年期美债收益率向上突破关口，市场进一步交易预防性加息可能，高利率环境对全球风险资产构成持续压制；流动性方面，内外部扰动在 6 月上旬集中释放；结构上，TMT 方向筹码拥挤，财报真空期缺乏新催化等等。部分资金从高拥挤的科技方向向煤炭、电力等低估值防御板块切换，市场进入存量博弈格局。转折出现在 6 月 11 日——特朗普宣布取消对伊空袭，美伊协议进入最终文本协调阶段，布油价格应声下跌，地缘风险溢价系统性消退。传统能源与红利板块估值的支撑之一是地缘溢价，溢价退潮后持仓资金从价值端被动向成长端腾挪，加速了风格的再平衡。此外，陆家嘴论坛与央行六项定向措施对科技资产给予背书，加之板块在前期震荡中完成了筹码净化，低摩擦启动条件与多重利好共振，推动科技在最后两周单边强势拉升，并与红利资产之间的形成巨大收益差，成为近年指数史上极端风格分化事件之一。

本基金标的指数为国证石油天然气指数。国证石油天然气指数反映沪深北交易所石油天然气产业相关上市公司的证券价格变化情况。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。运作层面上，本基金在报告期内基本保持满仓，各项操作符合基金合同的要求。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末大成国证石油天然气指数型发起式 A 的基金份额净值为 0.8335 元，本报告期基金份额净值增长率为-16.22%，同期业绩比较基准收益率为-16.22%；截至本报告期末大成国证石油天然气指数型发起式 C 的基金份额净值为 0.8329 元，本报告期基金份额净值增长率为-16.27%，同期业绩比较基准收益率为-16.22%。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

无。

§5 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额（元）	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	57,322,433.42	91.24
	其中：股票	57,322,433.42	91.24
2	基金投资	—	—
3	固定收益投资	116,403.36	0.19
	其中：债券	116,403.36	0.19

	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	5,191,637.61	8.26
8	其他资产	198,242.05	0.32
9	合计	62,828,716.44	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.1 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	29,321,876.60	48.30
C	制造业	12,974,049.82	21.37
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	8,453,811.00	13.93
E	建筑业	—	—
F	批发和零售业	610,895.00	1.01
G	交通运输、仓储和邮政业	5,951,691.00	9.80
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	—	—
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	57,312,323.42	94.41

5.2.2 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	—	—
C	制造业	—	—
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	10,110.00	0.02

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	—	—
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	10,110.00	0.02

5.2.3 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

无。

5.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的股票投资明细

5.3.1 报告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前十名股票投资明细

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	002353	杰瑞股份	60,400	9,211,000.00	15.17
2	601857	中国石油	876,300	7,606,284.00	12.53
3	600938	中国海油	244,984	6,651,315.60	10.96
4	600028	中国石化	1,467,300	6,544,158.00	10.78
5	601872	招商轮船	135,800	2,386,006.00	3.93
6	600256	广汇能源	432,200	2,135,068.00	3.52
7	600026	中远海能	114,600	2,055,924.00	3.39
8	605090	九丰能源	38,400	1,427,328.00	2.35
9	600803	新奥股份	87,300	1,379,340.00	2.27
10	601975	招商南油	340,600	1,270,438.00	2.09

5.3.2 报告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前五名股票投资明细

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	001248	华润新能源	1,000	10,110.00	0.02

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	公允价值（元）	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）	116,403.36	0.19
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	116,403.36	0.19

5.5 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债券投资明细

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	118068	迪威转债	740	116,403.36	0.19

5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券投资
明细

无。

5.7 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。

5.8 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权证投资明细

无。

5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

无。

5.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

无。

5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.10.1 本期国债期货投资政策

无。

5.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

无。

5.10.3 本期国债期货投资评价

无。

5.11 投资组合报告附注

5.11.1 本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。

5.11.2 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。

5.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	—
2	应收证券清算款	—
3	应收股利	—
4	应收利息	—
5	应收申购款	198,242.05
6	其他应收款	—
7	其他	—
8	合计	198,242.05

5.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

无。

5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

5.11.5.1 报告期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

无。

5.11.5.2 报告期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）	流通受限情况说明
1	001248	华润新能源	10,110.00	0.02	新股未上市

5.11.6 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。

§6 开放式基金份额变动

单位：份

项目	大成国证石油天然气指数 型发起式 A	大成国证石油天然气指数 型发起式 C
报告期期初基金份额总额	43,976,973.59	152,055,205.31
报告期期间基金总申购份额	5,282,147.11	24,154,489.12
减：报告期期间基金总赎回份额	23,391,407.00	129,213,162.97
报告期期间基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	—	—
报告期期末基金份额总额	25,867,713.70	46,996,531.46

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

单位：份

项目	大成国证石油天然气指数 型发起式 A	大成国证石油天然气指数 型发起式 C
报告期期初管理人持有的本基金份额	10,003,722.49	—
报告期期间买入/申购总份额	—	—
报告期期间卖出/赎回总份额	—	—
报告期期末管理人持有的本基金份额	10,003,722.49	—
报告期期末持有的本基金份额占基金总 份额比例（%）	13.73	—

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

序号	交易方式	交易日期	交易份额(份)	交易金额(元)	适用费率(%)
1	认购	2026-02-11	10,003,722.49	10,001,000.00	—
合计			10,003,722.49	10,001,000.00	

注：1、申购或者购买基金份额的，金额为正；赎回或者卖出基金份额的，金额为负。

2、合计数以绝对值填列。

3、红利再投为期间合计数。

4、本基金相关费率均依照法律文件规定收取。

§8 报告期末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	10,003,722.49	13.73	10,003,722.49	13.73	3 年
基金管理人高级管理人员	—	—	—	—	—
基金经理等人员	129.70	0.00	—	—	—
基金管理人股东	—	—	—	—	—
其他	—	—	—	—	—
合计	10,003,852.19	13.73	10,003,722.49	13.73	3 年

§9 影响投资者决策的其他重要信息

9.1 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。

9.2 影响投资者决策的其他重要信息

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。

§10 备查文件目录

10.1 备查文件目录

- 1、中国证监会批准设立大成国证石油天然气指数型发起式证券投资基金的文件；
- 2、《大成国证石油天然气指数型发起式证券投资基金基金合同》；
- 3、《大成国证石油天然气指数型发起式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。

10.2 存放地点

备查文件存放在本基金管理人和托管人的住所。

10.3 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 7 月 21 日