

大成中华沪深港 300 指数证券投资基金
(LOF)
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	10
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	19
§ 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	48
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	50
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	50
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	50

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	50
7.10 本基金投资股指期货的投资政策	50
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	50
7.12 投资组合报告附注	50
§ 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	52
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	52
§ 9 开放式基金份额变动	53
§ 10 重大事件揭示	53
10.1 基金份额持有人大会决议	53
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	53
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	53
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	54
10.8 其他重大事件	57
§ 11 影响投资者决策的其他重要信息	58
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	58
11.2 影响投资者决策的其他重要信息	58
§ 12 备查文件目录	58
12.1 备查文件目录	58
12.2 存放地点	58
12.3 查阅方式	58

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	大成中华沪深港 300 指数证券投资基金 (LOF)	
基金简称	大成中华沪深港 300 指数 (LOF)	
场内简称	沪深港 300LOF	
基金主代码	160925	
交易代码	160925	
基金运作方式	上市契约型开放式 (LOF)	
基金合同生效日	2019 年 3 月 20 日	
基金管理人	大成基金管理有限公司	
基金托管人	中国农业银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	20,652,831.14 份	
基金合同存续期	不定期	
基金份额上市的证券交易所	深圳证券交易所	
上市日期	2019 年 3 月 29 日	
下属分级基金的基金简称	大成中华沪深港 300 指数 (LOF) A	大成中华沪深港 300 指数 (LOF) C
下属分级基金的场内简称	沪深港 300LOF	-
下属分级基金的交易代码	160925	008973
报告期末下属分级基金的份额总额	18,967,890.28 份	1,684,940.86 份

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金进行被动式指数化投资，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，本基金日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.35%，年化跟踪误差不超过 4%。
投资策略	本基金主要按照标的指数的成份股及其权重构建基金股票投资组合，并根据标的指数成份股及其权重的变动进行相应调整。但因特殊情况或者因为法律法规的限制无法投资某只股票时，基金管理人将采用其他指数投资技术适当调整基金投资组合，以达到跟踪标的指数的目的。本基金通过港股通投资港股的策略是按照指数成份股组成及其权重构建基金股票投资组合，并根据标的指数成份股及其权重的变动进行相应调整。
业绩比较基准	中华交易服务沪深港 300 指数（人民币）收益率×95%+人民币活期存款利率（税后）×5%
风险收益特征	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。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股票市场

	相似的风险收益特征。本基金部分基金资产将投资于香港市场,除了需要承担与境内证券投资基金类似的市场波动风险等一般投资风险之外,本基金还面临汇率风险、香港市场风险等境外证券市场投资所面临的特别投资风险。
--	---

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		大成基金管理有限公司	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

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《中国证券报》
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

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	中国证券登记结算有限责任公司	北京市西城区太平桥大街17号

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2026年1月1日 - 2026年6月30日)	
	大成中华沪深港 300 指数 (LOF) A	大成中华沪深港 300 指数 (LOF) C
本期已实现收益	639,611.19	59,329.87
本期利润	-948,345.57	-99,960.78
加权平均基金份额本期利润	-0.0466	-0.0520
本期加权平均净值利润率	-3.45%	-3.88%
本期基金份额净值增长率	-3.74%	-3.79%
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	3,443,629.71	294,465.26
期末可供分配基金份额利润	0.1816	0.1748
期末基金资产净值	24,769,371.48	2,186,898.72
期末基金份额净值	1.3059	1.2979
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	30.59%	10.19%

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

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

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

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

大成中华沪深港 300 指数 (LOF) 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	1.89%	1.02%	1.35%	1.02%	0.54%	0.00%
过去六个月	-3.74%	1.00%	-4.45%	1.00%	0.71%	0.00%
过去一年	8.51%	0.92%	6.93%	0.92%	1.58%	0.00%
过去三年	26.11%	1.04%	20.38%	1.05%	5.73%	-0.01%
过去五年	-3.08%	1.11%	-10.57%	1.10%	7.49%	0.01%
过去七年	32.35%	1.12%	12.47%	1.11%	19.88%	0.01%
自基金合同生效起至今	30.59%	1.11%	12.37%	1.11%	18.22%	0.00%

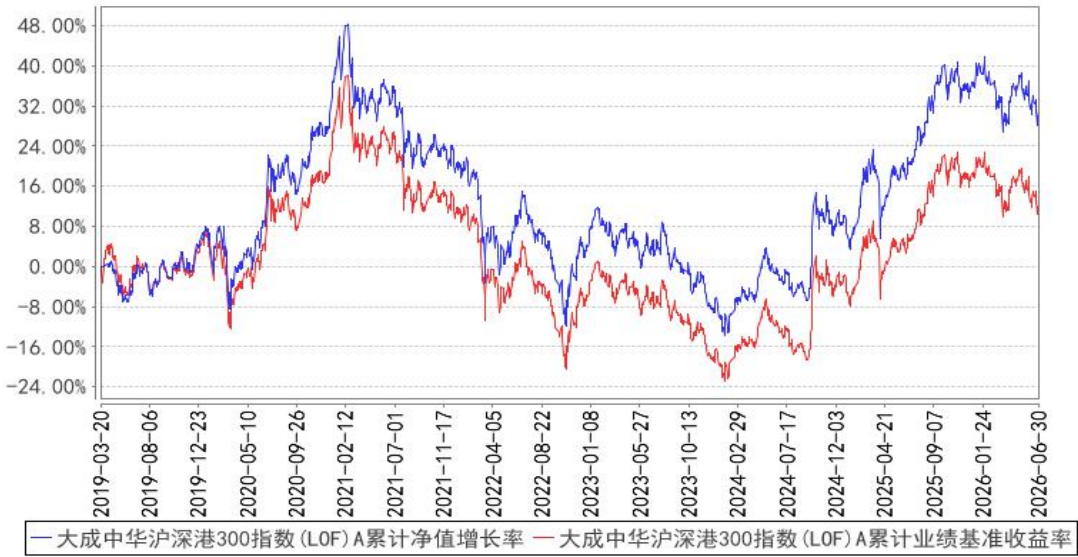
大成中华沪深港 300 指数 (LOF) C

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	1.86%	1.02%	1.35%	1.02%	0.51%	0.00%
过去六个月	-3.79%	1.00%	-4.45%	1.00%	0.66%	0.00%
过去一年	8.40%	0.92%	6.93%	0.92%	1.47%	0.00%

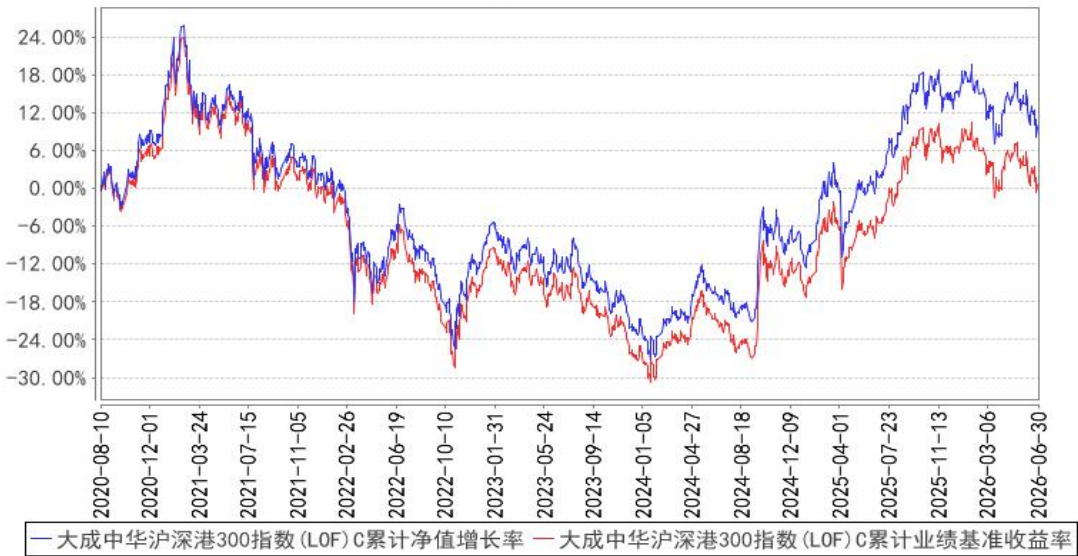
过去三年	25.68%	1.04%	20.38%	1.05%	5.30%	-0.01%
过去五年	-3.60%	1.11%	-10.57%	1.10%	6.97%	0.01%
自基金合同生效起 至今	10.19%	1.10%	0.93%	1.09%	9.26%	0.01%

3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

大成中华沪深港300指数(LOF)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



大成中华沪深港300指数(LOF)C累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



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

2、本基金自 2020 年 3 月 3 日起增设 C 类基金份额类别，C 类的净值增长率和业绩比较基准

收益率自 2020 年 8 月 10 日有份额之日开始计算。

§ 4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

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

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

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

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理） 期限		证券 从业 年限	说明
		任职日期	离任日期		
冉凌浩	本基金经理	2019 年 3 月 20 日	—	23 年	英国曼彻斯特大学商学院金融学硕士。2003 年 4 月至 2004 年 6 月就职于国信证券研究部，任研究员。2004 年 6 月至 2005 年 9 月就职于华西证券研究部，任高级研究员。2005 年 9 月加入大成基金管理有限公司，曾担任金融工程师、境外市场研究员及基金经理助理，现任国际业务部基金经理。2011 年 8 月 26 日起任大成标普 500 等权重指数型证券投资基金基金经理。2014 年 11 月 13 日起任大成纳斯达克 100 交易型开放式指数证券投资基金联接基金（QDII）（转型前为大成纳斯达克 100 指数证券投资基金）基金经理。2016 年 12 月 2 日至 2023 年

					3 月 14 日任大成恒生综合中小型股指期货基金 (QDII-LOF) 基金经理。2016 年 12 月 29 日至 2020 年 7 月 7 日任大成海外中国机会混合型证券投资基金 (LOF) 基金经理。2017 年 8 月 10 日起任大成恒生指数证券投资基金 (LOF) 基金经理。2019 年 3 月 20 日起任大成中华沪深港 300 指数证券投资基金 (LOF) 基金经理。2021 年 5 月 18 日起任大成恒生科技交易型开放式指数证券投资基金 (QDII) 基金经理。2021 年 9 月 9 日起任大成恒生科技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。2023 年 7 月 12 日起任大成纳斯达克 100 交易型开放式指数证券投资基金 (QDII) 基金经理。2024 年 5 月 29 日起任大成全球美元债债券型证券投资基金 (QDII) 基金经理。2024 年 6 月 18 日起任大成恒生医疗保健交易型开放式指数证券投资基金 (QDII) 基金经理。2025 年 6 月 24 日起担任大成恒生医疗保健交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金 (QDII) 基金经理。具有基金从业资格。国籍：中国
--	--	--	--	--	--

注：1、任职日期、离任日期为本基金管理人作出决定之日。

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

4.1.3 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理同时管理的产品情况

无。

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

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

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

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

4.3.2 异常交易行为的专项说明

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

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2026 年上半年，沪深港 300 指数整体小幅下行，市场内部呈现结构性分化格局。科技成长类成分股逆势走强；而占指数权重较高的金融、传统消费等蓝筹板块持续承压调整。导致其调整的原因有很多，主要有以下几方面：

从全球宏观经济运行格局来看，美国经济保持平稳增长态势，但整体增长力度温和，未出现强劲扩张的表现；中国经济长期向好的基本面没有改变，当前正处于结构转型深化、内需逐步修复的关键窗口，整体增长动能仍在积蓄过程中，消费与投资领域的数据修复斜率相对平缓。

从国际局势来看，中东地缘政治出现军事冲突，其过程起起伏伏，这对港股市场也造成了一定冲击。

货币政策维度，凯文·沃什于上半年正式就任美联储主席，尽管市场普遍认为其政策立场偏鹰派，但美联储上半年并未实际启动加息，仅阶段性存在加息预期升温的扰动。全球流动性环境尚未出现实质性收紧，对权益市场估值的压制更多体现为预期层面的波动。

产业主线是驱动本轮结构分化的核心力量。上半年全球 AI 产业投资持续加码，带动全球半导体产业链维持高景气度。半导体、算力、通信设备等科技板块的盈利预期持续上修，龙头企业订单落地、产能释放不断验证产业景气度，推动相关个股实现大幅上涨。这一产业趋势也导致 A 股

与港股市场走出明显的 K 形分化：市场资金与行情主线高度集中于 AI 科技链条，不在该产业链上的多数行业与个股普遍跑输市场。沪深港 300 指数作为覆盖沪深港三地的宽基指数，行业分布广泛且传统蓝筹权重占比较高，无法充分受益于单一科技赛道的行情，因此指数整体表现显著弱于科创 50、创业板指等纯成长风格指数，走势与主流大盘宽基指数基本相似。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末大成中华沪深港 300 指数 (LOF) A 的基金份额净值为 1.3059 元，本报告期基金份额净值增长率为-3.74%，同期业绩比较基准收益率为-4.45%；截至本报告期末大成中华沪深港 300 指数 (LOF) C 的基金份额净值为 1.2979 元，本报告期基金份额净值增长率为-3.79%，同期业绩比较基准收益率为-4.45%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

宏观层面，国内经济处于结构转型与内需修复阶段。新动能持续发力，AI 驱动的科技产业资本开支持续扩张，高端制造出口保持高景气，对整体增长形成重要支撑。下半年扩内需政策有望持续落地，将为经济平稳运行托底，也为指数中的传统权重板块提供基本面缓冲。

指数经历上半年调整后估值具备吸引力。市场极致 K 形分化大概率延续但边际收敛：科技成长产业趋势延续，全球 AI 资本开支支撑半导体、算力、通信设备等高景气，盈利加速兑现并向应用端扩散；传统蓝筹板块随政策与盈利边际改善；下半年行业轮动更趋均衡，沪深港 300 指数行业分布均衡，有望迎来阶段性修复。

本基金的投资目标是要复制基准指数的收益率，因此本基金将坚持被动化的投资理念，持续实施高效的组合管理策略、交易策略及风险控制方法，以期更好地跟踪指数，力争将跟踪误差控制在较低的水平。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

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

各投研部门、风险管理部负责关注相关投资品种的动态，评判基金持有的投资品种是否处于不活跃的交易状态或者最近交易日后经济环境发生了重大变化或证券发行机构发生了影响证券价格的重大事件，从而确定估值日需要进行估值测算或者调整的投资品种；提出合理的数量分析模型对需要进行估值测算或者调整的投资品种进行公允价值定价与计量；定期对估值政策和程序进行评价，以保证其持续适用；交易管理部负责关注相关投资品种的流动性状况，协助反馈其市场

交易信息；基金运营部负责日常的基金资产的估值业务，执行基金估值政策，并负责与托管人沟通估值调整事项；监察稽核部负责审核估值政策和程序的一致性，监督估值委员会工作流程中的风险控制，并负责估值调整事项的信息披露工作。

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

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

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

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

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

本基金在本报告期内，曾出现了连续 60 个工作日资产净值低于五千万元的情形。我公司已根据法律法规及基金合同要求拟定相关应对方案上报中国证券监督管理委员会。自 2024 年 6 月 28 日起，由本基金管理人承担本基金的固定费用。

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内，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。

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

本报告期内，本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。

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

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。

§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：大成中华沪深港 300 指数证券投资基金 (LOF)

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	2,019,377.88	2,104,981.50
结算备付金		70,639.39	8.64
存出保证金		1,354.52	956.92
交易性金融资产	6.4.7.2	25,150,296.87	29,363,151.75
其中：股票投资		25,150,296.87	29,363,151.75
基金投资		-	-
债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
其他投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
应收清算款		-	187,061.91
应收股利		43,272.33	29,083.76
应收申购款		11,300.96	8,546.24
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.8	-	-
资产总计		27,296,241.95	31,693,790.72
负 债 和 净 资 产			
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		2.31	-
应付赎回款		324,580.43	320,504.08
应付管理人报酬		11,480.83	13,522.96
应付托管费		2,296.15	2,704.62
应付销售服务费		198.49	270.75
应付投资顾问费		-	-
应交税费		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.9	1,413.54	833.64
负债合计		339,971.75	337,836.05
净资产：			
实收基金	6.4.7.10	20,652,831.14	23,125,407.64
未分配利润	6.4.7.12	6,303,439.06	8,230,547.03
净资产合计		26,956,270.20	31,355,954.67
负债和净资产总计		27,296,241.95	31,693,790.72

注：报告截止日 2026 年 6 月 30 日，基金份额总额 20,652,831.14 份。其中大成中华沪深港 300 指数 (LOF) A 类基金份额总额为 18,967,890.28 份，基金份额净值 1.3059 元；大成中华沪深港 300 指数 (LOF) C 类基金份额总额为 1,684,940.86 份，基金份额净值 1.2979 元。

6.2 利润表

会计主体：大成中华沪深港 300 指数证券投资基金 (LOF)

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 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
一、营业总收入		-954,603.15	3,383,786.38
1. 利息收入		4,452.30	6,055.70
其中：存款利息收入	6.4.7.13	4,452.30	6,055.70
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）		782,798.50	344,140.48
其中：股票投资收益	6.4.7.14	472,206.75	-141,860.21
基金投资收益	6.4.7.15	-	-
债券投资收益	6.4.7.16	-	-

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	310,591.75	486,000.69
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	-1,747,247.41	3,025,425.60
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	5,393.46	8,164.60
减：二、营业总支出		93,703.20	104,245.29
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	74,540.50	82,637.22
2. 托管费	6.4.10.2.2	14,908.12	16,527.43
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	1,279.05	2,107.30
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		-	-
8. 其他费用	6.4.7.24	2,975.53	2,973.34
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-1,048,306.35	3,279,541.09
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-1,048,306.35	3,279,541.09
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		-1,048,306.35	3,279,541.09

6.3 净资产变动表

会计主体：大成中华沪深港 300 指数证券投资基金 (LOF)

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	23,125,407.64	-	8,230,547.03	31,355,954.67
二、本期期初净资产	23,125,407.64	-	8,230,547.03	31,355,954.67
三、本期增减变动额 (减少以“-”号填列)	-2,472,576.50	-	-1,927,107.97	-4,399,684.47
(一)、综合收益总额	-	-	-1,048,306.35	-1,048,306.35
(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)	-2,472,576.50	-	-878,801.62	-3,351,378.12
其中：1. 基金申购款	3,965,539.90	-	1,366,544.48	5,332,084.38
2. 基金赎回款	-6,438,116.40	-	-2,245,346.10	-8,683,462.50
(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	20,652,831.14	-	6,303,439.06	26,956,270.20
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	30,669,820.41	-	2,863,036.47	33,532,856.88
二、本期期初净资产	30,669,820.41	-	2,863,036.47	33,532,856.88
三、本期增减变动额 (减少以“-”号填列)	-2,797,923.56	-	2,783,516.93	-14,406.63
(一)、综合收益总额	-	-	3,279,541.09	3,279,541.09
(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)	-2,797,923.56	-	-496,024.16	-3,293,947.72
其中：1. 基金申购款	7,218,066.51	-	1,154,964.89	8,373,031.40
2. 基金赎回款	-10,015,990.07	-	-1,650,989.05	-11,666,979.12
(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	27,871,896.85	-	5,646,553.40	33,518,450.25

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

大成中华沪深港 300 指数证券投资基金 (LOF) (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[2018]2130 号《关于准予大成中华沪深港 300 指数证券投资基金 (LOF) 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《大成中华沪深港 300 指数证券投资基金 (LOF) 基金合同》负责公开募集。本基金为上市契约型开放式 (LOF) 基金,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 1,967,654,798.00 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(2019)第 0120 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《大成中华沪深港 300 指数证券投资基金 (LOF) 基金合同》于 2019 年 3 月 20 日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为 1,968,326,601.16 份基金份额,其中认购资金利息折合 671,803.16 份基金份额。本基金的基金管理人为大成基金管理有限公司,基金托管人为中国农业银行股份有限公司。

经深圳证券交易所(以下简称“深交所”)深证上[2019]143 号文审核同意,本基金 8,136,323.00 份基金份额于 2019 年 3 月 29 日在深交所挂牌交易。未上市交易的基金份额托管在场外,基金份额持有人将其转托管至深交所场内后即可上市流通。

根据基金管理人大成基金管理有限公司于 2020 年 2 月 29 日发布的《关于大成中华沪深港 300 指数证券投资基金 (LOF) 增设 C 类基金份额并相应修订基金合同和托管协议的公告》及更新的《大成中华沪深港 300 指数证券投资基金 (LOF) 基金合同》的有关规定,自 2020 年 3 月 3 日起,对大成中华沪深港 300 指数证券投资基金 (LOF) 增设 C 类基金份额,原有基金份额转为 A 类基金份额。其中,在投资者申购时收取申购费用,不从本类别资产中计提销售服务费的基金份额,称为 A 类基金份额;投资者申购时不收取申购费用,而是从本类别基金资产中计提销售服务费的基金份额,称为 C 类基金份额。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《大成中华沪深港 300 指数证券投资基金 (LOF) 基金合同》的有关规定,本基金主要投资于具有良好流动性的金融工具,包括标的指数成份股(含存托凭证)、备选成份股(含存托凭证)、国内依法发行上市的股票(包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票)、存托凭证、港股通机制允许买卖的香港联交所上市的股票、债券(包括国债、金融债、企业债、公司债、次级债、可转换债券、分离交易可转债、央行票据、中期票

据、短期融资券、超短期融资券、地方政府债)、资产支持证券、债券回购、货币市场工具、银行存款、衍生工具(股指期货、权证)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)。本基金股票资产、存托凭证占基金资产的比例不低于 80%;投资于标的指数成份股(含存托凭证)和备选成份股(含存托凭证)的资产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合约需缴纳的交易保证金后,保持现金(不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等)或到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%;权证、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: 中华交易服务沪深港 300 指数(人民币)收益率 $\times 95\%$ +人民币活期存款利率(税后) $\times 5\%$ 。

6.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于 2006 年 2 月 15 日及以后期间颁布的《企业会计准则—基本准则》、各项具体会计准则、《资产管理产品相关会计处理规定》及其他相关规定(以下合称“企业会计准则”)、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)发布的《公开募集证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和中期报告>》、《证券投资基金会计核算业务指引》、本基金基金合同和在财务报表附注所列示的中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

本财务报表以持续经营为基础编制。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

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

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

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 会计政策变更的说明

无。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

无。

6.4.5.3 差错更正的说明

无。

6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128 号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通

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

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

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

(2) 对基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股票的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

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

的股息、红利收入继续暂减按 50% 计入应纳税所得额。上述所得统一适用 20% 的税率计征个人所得税。

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

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

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

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

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

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 货币资金

单位：人民币元

项目	本期末 2026 年 6 月 30 日
活期存款	2,019,377.88
等于：本金	2,019,166.93
加：应计利息	210.95
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	2,019,377.88

6.4.7.2 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		21,738,570.57	-	25,150,296.87	3,411,726.30
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-	-
债券	交易所市场	-	-	-	-
	银行间市场	-	-	-	-
	合计	-	-	-	-
资产支持证券		-	-	-	-
基金		-	-	-	-
其他		-	-	-	-
合计		21,738,570.57	-	25,150,296.87	3,411,726.30

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 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	520.58
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	892.96
其中：交易所市场	892.96
银行间市场	-
应付利息	-
合计	1,413.54

6.4.7.10 实收基金

金额单位：人民币元

大成中华沪深港 300 指数 (LOF) 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	20,968,464.24	20,968,464.24
本期申购	2,867,835.67	2,867,835.67
本期赎回（以“-”号填列）	-4,868,409.63	-4,868,409.63
基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算调整	-	-

本期申购	-	-
本期赎回（以“-”号填列）	-	-
本期末	18,967,890.28	18,967,890.28

大成中华沪深港 300 指数 (LOF) 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	2,156,943.40	2,156,943.40
本期申购	1,097,704.23	1,097,704.23
本期赎回（以“-”号填列）	-1,569,706.77	-1,569,706.77
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	1,684,940.86	1,684,940.86

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

大成中华沪深港 300 指数 (LOF) A

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	3,133,896.52	4,343,906.54	7,477,803.06
本期期初	3,133,896.52	4,343,906.54	7,477,803.06
本期利润	639,611.19	-1,587,956.76	-948,345.57
本期基金份额交易产生的变动数	-329,878.00	-398,098.29	-727,976.29
其中：基金申购款	465,210.67	519,774.12	984,984.79
基金赎回款	-795,088.67	-917,872.41	-1,712,961.08
本期已分配利润	-	-	-
本期末	3,443,629.71	2,357,851.49	5,801,481.20

大成中华沪深港 300 指数 (LOF) C

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	309,584.89	443,159.08	752,743.97
本期期初	309,584.89	443,159.08	752,743.97
本期利润	59,329.87	-159,290.65	-99,960.78
本期基金份额交易产生的变动数	-74,449.50	-76,375.83	-150,825.33
其中：基金申购款	175,762.12	205,797.57	381,559.69
基金赎回款	-250,211.62	-282,173.40	-532,385.02
本期已分配利润	-	-	-

本期末	294,465.26	207,492.60	501,957.86
-----	------------	------------	------------

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 6 月 30 日
活期存款利息收入	4,414.32
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	35.47
其他	2.51
合计	4,452.30

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 6 月 30 日
股票投资收益——买卖股票差价收入	472,206.75
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	472,206.75

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 6 月 30 日
卖出股票成交总额	4,602,618.60
减：卖出股票成本总额	4,125,073.31
减：交易费用	5,338.54
买卖股票差价收入	472,206.75

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

无。

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 资产支持证券投资基金投资收益

6.4.7.17.1 资产支持证券投资基金投资收益项目构成

无。

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

无。

6.4.7.17.3 资产支持证券投资基金投资收益——赎回差价收入

无。

6.4.7.17.4 资产支持证券投资基金投资收益——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 6 月 30 日
----	---------------------------------------

股票投资产生的股利收益	310,591.75
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	310,591.75

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 6 月 30 日
1. 交易性金融资产	-1,747,247.41
股票投资	-1,747,247.41
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	-1,747,247.41

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 6 月 30 日
基金赎回费收入	5,393.46
合计	5,393.46

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 6 月 30 日
审计费用	—
信息披露费	—
证券出借违约金	—
深港通证券组合费	520.53
银行划款手续费	2,455.00
合计	2,975.53

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

无。

6.4.9 关联方、关联关系

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

本基金本报告期存在控制关系或者其他重大利害关系的关联方未发生变化。

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
大成基金管理有限公司（“大成基金”）	基金管理人、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。

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 股票交易

无。

6.4.10.1.2 债券交易

无。

6.4.10.1.3 债券回购交易

无。

6.4.10.1.4 基金交易

无。

6.4.10.1.5 权证交易

无。

6.4.10.1.6 应支付关联方的佣金

无。

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日	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	74,540.50	82,637.22
其中：应支付销售机构的客户维护费	34,962.88	37,772.59
应支付基金管理人的净管理费	39,577.62	44,864.63

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 6 月 30 日	上年度可比期间 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	14,908.12	16,527.43

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

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		
	大成中华沪深港 300 指数 (LOF) A	大成中华沪深港 300 指数 (LOF) C	合计
大成基金	-	44.42	44.42
合计	-	44.42	44.42
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		
	大成中华沪深港 300 指数 (LOF) A	大成中华沪深港 300 指数 (LOF) C	合计
大成基金	-	35.12	35.12
合计	-	35.12	35.12

注：C 类基金份额的销售服务费年费率为 0.10%。

销售服务费的计算方法如下：

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

H 为该类基金份额每日应计提的销售服务费

E 为该类基金份额前一日基金资产净值

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

无。

6.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

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

无。

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

无。

6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

无。

6.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

无。

6.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国农业银行	2,019,377.88	4,414.32	3,110,814.26	6,007.47

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 6 月 30 日）本基金持有的流通受限证券

6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

无。

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

无。

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

无。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

无。

6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

无。

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金为股票型基金，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包括股票投资、债券投资及权证投资等。本基金在日常经营活动中面临的与这些金融工具相关的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金部分基金资产投资于香港证券市场，基金净值除了会因香港证券市场波动等因素产生波动之外，还需面临汇率风险等投资海外市场的特殊风险。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中国农业银行股份有限公司，因而与银行存款相关的信用风险不重大。本基金在交易所进行的交易均以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，违约风险可能性很小；在银行间同业市场进行交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式进行限制以控制相应的信用风险。

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

本期末，本基金无债券投资(上年度末：同)。

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同约定剩余到期日均为一年以内且一般不计息，可赎回基金份额净值无固定到期日且不计息，因此账面余额一般即为未折现的合约到期现金流量。本报告期内，本基金未发生重大流动性风险事件。

6.4.13.4 市场风险

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

6.4.13.4.1 利率风险

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

本基金的基金管理人定期对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控，并通过调整投资组合的久期等方法对上述利率风险进行管理。

本基金持有及承担的大部分金融资产和金融负债不计息，因此本基金的收入及经营活动的现金流量在很大程度上独立于市场利率变化。本基金持有的利率敏感性资产主要为银行存款、结算备付金和存出保证金等。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2026 年 6 月 30 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					

货币资金	2,019,377.88	-	-	-	2,019,377.88
结算备付金	70,639.39	-	-	-	70,639.39
存出保证金	1,354.52	-	-	-	1,354.52
交易性金融资产	-	-	-	25,150,296.87	25,150,296.87
应收股利	-	-	-	43,272.33	43,272.33
应收申购款	250.00	-	-	11,050.96	11,300.96
资产总计	2,091,621.79	-	-	25,204,620.16	27,296,241.95
负债	-	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	324,580.43	324,580.43
应付管理人报酬	-	-	-	11,480.83	11,480.83
应付托管费	-	-	-	2,296.15	2,296.15
应付清算款	-	-	-	2.31	2.31
应付销售服务费	-	-	-	198.49	198.49
其他负债	-	-	-	1,413.54	1,413.54
负债总计	-	-	-	339,971.75	339,971.75
利率敏感度缺口	2,091,621.79	-	-	24,864,648.41	26,956,270.20
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	2,104,981.50	-	-	-	2,104,981.50
结算备付金	8.64	-	-	-	8.64
存出保证金	956.92	-	-	-	956.92
交易性金融资产	-	-	-	29,363,151.75	29,363,151.75
应收股利	-	-	-	29,083.76	29,083.76
应收申购款	221.00	-	-	8,325.24	8,546.24
应收清算款	-	-	-	187,061.91	187,061.91
资产总计	2,106,168.06	-	-	29,587,622.66	31,693,790.72
负债	-	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	320,504.08	320,504.08
应付管理人报酬	-	-	-	13,522.96	13,522.96
应付托管费	-	-	-	2,704.62	2,704.62
应付销售服务费	-	-	-	270.75	270.75
其他负债	-	-	-	833.64	833.64
负债总计	-	-	-	337,836.05	337,836.05
利率敏感度缺口	2,106,168.06	-	-	29,249,786.61	31,355,954.67

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，本基金未持有交易性债券投资和交易性资产支持证券投资(上年度末：同)，因此市场利率的变动对于本基金净资产无重大影响(上年度末：同)。

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。本基金持有不以记账本位币计价的资产，因此存在相应的外汇风险。本基金管理人每日对本基金的外汇头寸进行监控。

6.4.13.4.2.1 外汇风险敞口

单位：人民币元

项目	本期末 2026 年 6 月 30 日			
	美元 折合人民币元	港币 折合人民币元	其他币种 折合人民币元	合计
以外币计价的资产				
交易性金融资产	-	10,416,681.84	-	10,416,681.84
资产合计	-	10,416,681.84	-	10,416,681.84
以外币计价的负债				
负债合计	-	-	-	-
资产负债表外 外汇风险敞口净额	-	10,416,681.84	-	10,416,681.84
项目	上年度末 2025 年 12 月 31 日			
	美元 折合人民币元	港币 折合人民币元	其他币种 折合人民币元	合计
以外币计价的资产				
交易性金融资产	-	14,522,636.15	-	14,522,636.15
资产合计	-	14,522,636.15	-	14,522,636.15

计		36.15		36.15
以外币计价的负债				
负债合计	-	-	-	-
资产负债表外 汇风险敞口净额	-	14,522,636.15	-	14,522,636.15

6.4.13.4.2.2 外汇风险的敏感性分析

假设	除汇率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）
	所有外币相对人民币升值 5%	520,834.08	726,131.76
	所有外币相对人民币贬值 5%	-520,834.08	-726,131.76

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。

本基金的基金管理人通过严格的投资纪律约束和数量化风险管理手段，实现基金投资组合对标的指数的有效跟踪，追求跟踪误差最小化。

本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险。本基金的投资组合比例为：股票资产、存托凭证占基金资产的比例不低于 80%；投资于标的指数成份股(含存托凭证)和备选成份股(含存托凭证)的资产不低于基金非现金资产的 90%；每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，保持现金(不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等)或到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%。此外，本基金的基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控，定期运用多种定量方法对基金进行风险度量，包括 VaR(Value at Risk) 指标等来测试本基金面临的潜在价格风险，及时可靠地对风险进行跟踪和控制。

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 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	25,150,296.87	93.30	29,363,151.75	93.64
交易性金融资产—基金投资	—	—	—	—
交易性金融资产—贵金属投资	—	—	—	—
衍生金融资产—权证投资	—	—	—	—
其他	—	—	—	—
合计	25,150,296.87	93.30	29,363,151.75	93.64

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除业绩比较基准以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2026 年 6 月 30 日）	上年度末（2025 年 12 月 31 日）
	业绩比较基准上升 5%	1,342,240.09	1,567,278.19
	业绩比较基准下降 5%	-1,342,240.09	-1,567,278.19

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 6 月 30 日	上年度末 2025 年 12 月 31 日
第一层次	25,150,296.87	29,241,774.15
第二层次	-	121,377.60
第三层次	-	-
合计	25,150,296.87	29,363,151.75

6.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

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

6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

于本期末，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融工具(上年度末：同)。

6.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

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

6.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

§ 7 投资组合报告

7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	25,150,296.87	92.14
	其中：股票	25,150,296.87	92.14
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-

	其中：债券	-	-
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	2,090,017.27	7.66
8	其他各项资产	55,927.81	0.20
9	合计	27,296,241.95	100.00

注：本基金通过深港通交易机制投资的港股公允价值为 10,416,681.84 元，占期末基金资产净值的比例为 38.64%。

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	101,015.22	0.37
B	采矿业	632,377.00	2.35
C	制造业	9,480,417.81	35.17
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	353,294.89	1.31
E	建筑业	135,521.00	0.50
F	批发和零售业	16,309.60	0.06
G	交通运输、仓储和邮政业	252,077.00	0.94
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	826,788.75	3.07
J	金融业	2,635,028.18	9.78
K	房地产业	26,578.00	0.10
L	租赁和商务服务业	62,234.00	0.23
M	科学研究和技术服务业	188,259.12	0.70
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	23,714.46	0.09
R	文化、体育和娱乐业	-	-

S	综合	-	-
	合计	14,733,615.03	54.66

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

无。

7.2.3 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

行业类别	公允价值（人民币）	占基金资产净值比例（%）
通讯	2,050,859.82	7.61
非必需消费品	1,514,433.33	5.62
必需消费品	286,980.05	1.06
能源	332,546.39	1.23
金融	4,048,599.21	15.02
房地产	393,896.38	1.46
医疗保健	352,919.88	1.31
工业	249,387.21	0.93
材料	216,129.98	0.80
科技	764,240.31	2.84
公用事业	206,689.28	0.77
政府	-	-
合计	10,416,681.84	38.64

注：以上分类采用彭博行业分类标准。

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	00700	腾讯控股	3,870	1,444,681.80	5.36
2	00005	汇丰控股	10,343	1,328,646.73	4.93
3	09988	阿里巴巴-W	11,700	943,544.95	3.50
4	300308	中际旭创	640	812,800.00	3.02
5	300750	宁德时代	1,640	644,536.40	2.39
6	601939	建设银行	5,400	52,002.00	0.19
6	00939	建设银行	73,000	511,671.49	1.90
7	300502	新易盛	896	543,872.00	2.02
8	601318	中国平安	6,601	315,131.74	1.17
8	02318	中国平安	4,500	199,527.65	0.74
9	688256	寒武纪	298	475,473.90	1.76
10	600519	贵州茅台	400	474,196.00	1.76
11	601398	工商银行	19,900	140,693.00	0.52
11	01398	工商银行	53,000	295,993.15	1.10
12	688981	中芯国际	1,200	190,584.00	0.71
12	00981	中芯国际	3,000	232,945.11	0.86

13	01299	友邦保险	6,400	397,170.54	1.47
14	600036	招商银行	7,600	269,800.00	1.00
14	03968	招商银行	3,000	117,045.80	0.43
15	601899	紫金矿业	10,200	256,428.00	0.95
15	02899	紫金矿业	4,000	95,193.08	0.35
16	603986	兆易创新	400	326,000.00	1.21
17	600941	中国移动	600	51,678.00	0.19
17	00941	中国移动	3,987	263,700.51	0.98
18	002594	比亚迪	1,700	135,490.00	0.50
18	01211	比亚迪股份	2,300	144,730.83	0.54
19	002371	北方华创	305	269,790.80	1.00
20	688041	海光信息	700	259,210.00	0.96
21	00388	香港交易所	789	248,758.80	0.92
22	601988	中国银行	8,800	50,336.00	0.19
22	03988	中国银行	41,000	177,696.64	0.66
23	000333	美的集团	3,000	226,590.00	0.84
24	03690	美团-W	3,747	222,930.29	0.83
25	002475	立讯精密	3,147	221,548.80	0.82
26	002384	东山精密	800	209,880.00	0.78
27	688012	中微公司	447	209,419.50	0.78
28	01810	小米集团-W	11,000	206,749.64	0.77
29	600900	长江电力	7,500	198,525.00	0.74
30	00883	中国海洋石油	11,098	195,867.89	0.73
31	000725	京东方 A	22,400	194,432.00	0.72
32	02888	渣打集团	1,050	192,974.44	0.72
33	603259	药明康德	1,512	188,259.12	0.70
34	01347	华虹宏力	1,000	186,911.96	0.69
35	601138	工业富联	2,400	173,160.00	0.64
36	600030	中信证券	6,000	172,380.00	0.64
37	601166	兴业银行	10,400	172,224.00	0.64
38	601328	交通银行	16,400	105,452.00	0.39
38	03328	交通银行	11,000	64,394.30	0.24
39	300059	东方财富	7,823	159,432.74	0.59
40	601857	中国石油	7,300	63,364.00	0.24
40	00857	中国石油股份	12,000	88,383.65	0.33
41	601628	中国人寿	1,000	35,350.00	0.13
41	02628	中国人寿	4,968	115,036.74	0.43
42	600276	恒瑞医药	2,768	144,046.72	0.53
43	300274	阳光电源	900	143,118.00	0.53
44	301308	江波龙	200	140,760.00	0.52
45	300476	胜宏科技	400	138,572.00	0.51
46	02378	保诚	1,550	138,125.51	0.51
47	601088	中国神华	1,700	66,368.00	0.25

47	01088	中国神华	2,000	69,692.45	0.26
48	300394	天孚通信	448	135,600.64	0.50
49	300408	三环集团	800	133,520.00	0.50
50	601211	国泰海通	7,000	127,400.00	0.47
51	688008	澜起科技	400	123,960.00	0.46
52	002463	沪电股份	800	122,240.00	0.45
53	00669	创科实业	1,000	112,477.23	0.42
54	000651	格力电器	2,800	105,000.00	0.39
55	600183	生益科技	600	104,040.00	0.39
56	06160	百济神州	700	103,600.64	0.38
57	601601	中国太保	2,100	59,892.00	0.22
57	02601	中国太保	1,600	37,354.60	0.14
58	600919	江苏银行	9,000	97,020.00	0.36
59	603019	中科曙光	900	96,507.00	0.36
60	00016	新鸿基地产	984	95,977.55	0.36
61	603993	洛阳钼业	5,400	94,770.00	0.35
62	600150	中国船舶	2,785	94,105.15	0.35
63	600887	伊利股份	3,900	93,444.00	0.35
64	000338	潍柴动力	3,300	89,925.00	0.33
65	02388	中银香港	2,436	89,667.09	0.33
66	000858	五 粮 液	1,200	88,800.00	0.33
67	600028	中国石化	9,000	40,140.00	0.15
67	00386	中国石油化工 股份	13,901	48,294.85	0.18
68	00001	长和	1,485	85,449.03	0.32
69	600309	万华化学	1,200	82,092.00	0.30
70	601816	京沪高铁	18,100	81,993.00	0.30
71	300124	汇川技术	1,200	79,596.00	0.30
72	601728	中国电信	9,600	49,824.00	0.18
72	00728	中国电信	8,000	29,669.67	0.11
73	002415	海康威视	2,300	78,660.00	0.29
74	600690	海尔智家	2,300	46,943.00	0.17
74	06690	海尔智家	1,800	31,236.53	0.12
75	00992	联想集团	3,882	77,616.79	0.29
76	600111	北方稀土	1,600	76,880.00	0.29
77	02269	药明生物	2,500	75,129.58	0.28
78	000100	TCL 科技	12,860	74,845.20	0.28
79	601688	华泰证券	3,600	74,232.00	0.28
80	000988	华工科技	400	73,844.00	0.27
81	002916	深南电路	160	73,264.00	0.27
82	000063	中兴通讯	2,000	72,380.00	0.27
83	600000	浦发银行	8,200	70,602.00	0.26
84	002028	思源电气	400	69,200.00	0.26
85	01801	信达生物	1,000	69,136.58	0.26

86	01024	快手-W	1,900	68,650.19	0.25
87	300433	蓝思科技	1,200	64,392.00	0.24
88	600031	三一重工	3,700	63,936.00	0.24
89	00002	中电控股	992	63,069.24	0.23
90	002142	宁波银行	2,050	60,864.50	0.23
91	000792	盐湖股份	2,000	60,380.00	0.22
92	002050	三花智控	1,377	60,353.91	0.22
93	002714	牧原股份	1,718	60,112.82	0.22
94	000001	平安银行	5,960	59,898.00	0.22
95	688506	百利天恒	200	58,806.00	0.22
96	00175	吉利汽车	3,964	58,047.84	0.22
97	01113	长实集团	1,487	57,059.97	0.21
98	600406	国电南瑞	2,441	55,776.85	0.21
99	09987	百胜中国	200	55,517.72	0.21
100	601668	中国建筑	12,700	55,118.00	0.20
101	300760	迈瑞医疗	400	54,332.00	0.20
102	09992	泡泡玛特	400	53,745.87	0.20
103	601658	邮储银行	6,800	33,524.00	0.12
103	01658	邮储银行	5,000	19,846.37	0.07
104	601229	上海银行	6,100	52,948.00	0.20
105	300014	亿纬锂能	800	52,024.00	0.19
106	601998	中信银行	3,300	22,869.00	0.08
106	00998	中信银行	5,000	28,879.29	0.11
107	601919	中远海控	3,900	51,714.00	0.19
108	03692	翰森制药	2,000	51,452.90	0.19
109	01109	华润置地	1,957	50,992.57	0.19
110	600660	福耀玻璃	1,000	50,440.00	0.19
111	02328	中国财险	4,000	49,750.54	0.18
112	00006	电能实业	996	49,395.83	0.18
113	02020	安踏体育	800	49,368.38	0.18
114	600016	民生银行	15,300	49,266.00	0.18
115	002230	科大讯飞	1,200	49,008.00	0.18
116	601225	陕西煤业	2,400	48,840.00	0.18
117	601012	隆基绿能	3,692	48,439.04	0.18
118	600999	招商证券	2,240	47,264.00	0.18
119	002460	赣锋锂业	720	47,088.00	0.17
120	002352	顺丰控股	1,500	46,890.00	0.17
121	601985	中国核电	5,100	46,053.00	0.17
122	603501	豪威集团	475	45,053.75	0.17
123	601169	北京银行	9,100	44,590.00	0.17
124	01378	中国宏桥	2,500	43,557.78	0.16
125	300033	同花顺	180	43,380.00	0.16
126	02423	贝壳-W	1,300	42,409.56	0.16

127	002938	鹏鼎控股	400	42,152.00	0.16
128	000776	广发证券	1,800	42,120.00	0.16
129	000977	浪潮信息	600	42,000.00	0.16
130	300442	润泽科技	500	41,535.00	0.15
131	09633	农夫山泉	1,200	41,294.34	0.15
132	00288	万洲国际	5,721	41,192.80	0.15
133	300498	温氏股份	3,320	40,902.40	0.15
134	002049	紫光国微	460	40,825.00	0.15
135	688271	联影医疗	400	40,492.00	0.15
136	000425	徐工机械	5,000	40,450.00	0.15
137	601600	中国铝业	4,900	40,278.00	0.15
138	002600	领益智造	2,300	39,882.00	0.15
139	002837	英维克	500	39,780.00	0.15
140	09868	小鹏集团-W	900	39,592.85	0.15
141	601766	中国中车	7,500	39,000.00	0.14
142	000568	泸州老窖	500	38,760.00	0.14
143	600050	中国联通	9,600	38,400.00	0.14
144	601009	南京银行	3,800	37,582.00	0.14
145	000938	紫光股份	1,296	37,402.56	0.14
146	02057	中通快递-W	250	37,260.80	0.14
147	002466	天齐锂业	600	36,792.00	0.14
148	00003	香港中华煤气	6,393	36,092.16	0.13
149	00267	中信股份	3,913	36,059.53	0.13
150	02015	理想汽车-W	900	36,020.51	0.13
151	603288	海天味业	1,071	35,514.36	0.13
152	002179	中航光电	762	35,204.40	0.13
153	00083	信和置业	3,929	35,080.84	0.13
154	01519	极兔速递-W	4,800	34,853.17	0.13
155	000408	藏格矿业	500	34,660.00	0.13
156	601006	大秦铁路	7,400	34,114.00	0.13
157	002241	歌尔股份	1,500	33,795.00	0.13
158	601818	光大银行	11,500	33,235.00	0.12
159	600905	三峡能源	8,800	32,648.00	0.12
160	601100	恒立液压	300	32,268.00	0.12
161	601888	中国中免	600	32,226.00	0.12
162	000630	铜陵有色	5,000	31,800.00	0.12
163	600010	宝钢股份	13,900	30,997.00	0.11
164	600893	航发动力	800	30,672.00	0.11
165	601127	赛力斯	500	30,625.00	0.11
166	600809	山西汾酒	280	30,623.60	0.11
167	002625	光启技术	1,000	30,320.00	0.11
168	002027	分众传媒	6,200	30,008.00	0.11
169	601336	新华保险	500	29,830.00	0.11

170	00836	华润电力	2,000	29,391.73	0.11
171	600019	宝钢股份	5,400	29,322.00	0.11
172	000807	云铝股份	1,300	28,782.00	0.11
173	300450	先导智能	700	28,504.00	0.11
174	600989	宝丰能源	1,400	28,462.00	0.11
175	002001	新 和 成	988	28,078.96	0.10
176	600104	上汽集团	2,800	27,328.00	0.10
177	002422	科伦药业	700	26,964.00	0.10
178	02319	蒙牛乳业	1,925	26,901.82	0.10
179	01177	中国生物制药	7,000	26,812.14	0.10
180	01093	石药集团	4,425	26,788.04	0.10
181	00066	港铁公司	1,005	26,623.23	0.10
182	000538	云南白药	560	26,527.20	0.10
183	02382	舜宇光学科技	500	26,490.78	0.10
184	601390	中国中铁	6,300	26,271.00	0.10
185	01038	长江基建集团	500	25,926.22	0.10
186	00688	中国海外发展	2,454	25,704.95	0.10
187	600795	国电电力	5,500	25,685.00	0.10
188	00027	银河娱乐	1,000	25,552.74	0.09
189	600585	海螺水泥	1,500	25,425.00	0.09
190	600547	山东黄金	1,100	25,399.00	0.09
191	002648	卫星化学	1,080	25,369.20	0.09
192	601995	中金公司	700	25,305.00	0.09
193	600015	华夏银行	3,900	24,921.00	0.09
194	601669	中国电建	5,300	24,910.00	0.09
195	000166	申万宏源	5,600	24,640.00	0.09
196	00020	商汤-W	21,000	24,441.00	0.09
197	300418	昆仑万维	600	24,216.00	0.09
198	600346	恒力石化	1,340	23,731.40	0.09
199	300015	爱尔眼科	2,871	23,714.46	0.09
200	601066	中信建投	800	23,256.00	0.09
201	06618	京东健康	800	22,818.55	0.08
202	002311	海大集团	500	22,305.00	0.08
203	600436	片仔癀	200	21,856.00	0.08
204	000157	中联重科	3,100	21,607.00	0.08
205	000625	长安汽车	2,996	21,481.32	0.08
206	600760	中航沈飞	520	21,372.00	0.08
207	688111	金山办公	100	21,305.00	0.08
208	09660	地平线机器人 -W	6,000	21,262.10	0.08
209	00762	中国联通	4,000	21,227.36	0.08
210	00012	恒基地产	980	21,109.24	0.08
211	600438	通威股份	1,700	20,587.00	0.08
212	600886	国投电力	1,500	19,965.00	0.07

213	002236	大华股份	1,200	19,788.00	0.07
214	002493	荣盛石化	1,800	19,350.00	0.07
215	002074	国轩高科	700	19,257.00	0.07
216	003816	中国广核	4,879	19,076.89	0.07
217	002736	国信证券	1,900	18,981.00	0.07
218	000768	中航西飞	900	18,432.00	0.07
219	300803	指南针	200	18,334.00	0.07
220	000301	东方盛虹	1,600	18,320.00	0.07
221	00291	华润啤酒	988	18,260.95	0.07
222	01928	金沙中国有限公司	1,600	18,135.32	0.07
223	02688	新奥能源	500	17,570.77	0.07
224	01997	九龙仓置业	923	17,139.74	0.06
225	02313	申洲国际	500	17,093.06	0.06
226	000975	山金国际	1,000	17,000.00	0.06
227	00322	康师傅控股	2,000	16,988.84	0.06
228	601186	中国铁建	2,800	16,660.00	0.06
229	601881	中国银河	1,300	16,341.00	0.06
230	000963	华东医药	580	16,309.60	0.06
231	002920	德赛西威	200	16,300.00	0.06
232	605499	东鹏饮料	130	16,045.90	0.06
233	002304	洋河股份	400	15,260.00	0.06
234	002353	杰瑞股份	100	15,250.00	0.06
235	00004	九龙仓集团	950	14,934.72	0.06
236	601111	中国国航	2,400	14,520.00	0.05
237	001979	招商蛇口	2,200	14,146.00	0.05
238	601319	中国人保	2,000	13,520.00	0.05
239	000895	双汇发展	600	13,440.00	0.05
240	601898	中煤能源	1,100	13,398.00	0.05
241	01209	华润万象生活	400	12,743.37	0.05
242	601800	中国交建	2,200	12,562.00	0.05
243	000002	万科 A	4,200	12,432.00	0.05
244	02618	京东物流	1,200	12,246.56	0.05
245	601633	长城汽车	800	12,072.00	0.04
246	301269	华大九天	100	11,942.00	0.04
247	001965	招商公路	1,300	11,908.00	0.04
248	302132	中航成飞	200	11,664.00	0.04
249	00151	中国旺旺	3,869	11,391.82	0.04
250	01929	周大福	1,200	11,360.63	0.04
251	00135	昆仑能源	2,000	11,169.55	0.04
252	00241	阿里健康	4,021	10,756.71	0.04
253	01972	太古地产	600	10,704.01	0.04
254	300866	安克创新	100	10,450.00	0.04
255	000617	中油资本	1,580	10,412.20	0.04

256	00960	龙湖集团	1,933	10,039.86	0.04
257	600025	华能水电	1,100	9,779.00	0.04
258	300999	金龙鱼	400	9,304.00	0.03
259	06862	海底捞	1,000	9,224.00	0.03
260	00285	比亚迪电子	500	9,085.03	0.03
261	600018	上港集团	1,800	8,496.00	0.03
262	000596	古井贡酒	100	7,980.00	0.03
263	02259	紫金黄金国际	100	7,686.67	0.03
264	000708	中信特钢	600	7,572.00	0.03
265	001280	中国铀业	100	6,670.00	0.02
266	06969	思摩尔国际	1,000	6,097.22	0.02
267	01876	百威亚太	1,100	5,827.97	0.02
268	002709	天赐材料	100	5,143.00	0.02
269	301638	南网数字	200	4,810.00	0.02
270	300979	华利集团	100	2,975.00	0.01
271	002602	世纪华通	200	2,820.00	0.01
272	001391	国货航	600	2,442.00	0.01
273	301656	联合动力	100	1,723.00	0.01
274	001289	龙源电力	100	1,563.00	0.01

注：对于同时在 A+H 股上市的股票（如有），合并计算公允价值参与排序，并按照不同股票分别披露。

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

无。

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

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	603986	兆易创新	267,480.00	0.85
2	01347	华虹宏力	142,864.96	0.46
3	301308	江波龙	129,186.00	0.41
4	600183	生益科技	109,920.00	0.35
5	688008	澜起科技	107,540.00	0.34
6	600111	北方稀土	77,664.00	0.25
7	000988	华工科技	68,512.00	0.22
8	688506	百利天恒	52,998.00	0.17
9	600036	招商银行	43,616.00	0.14
10	002837	英维克	42,506.60	0.14
11	300502	新易盛	41,465.00	0.13
12	000630	铜陵有色	33,800.00	0.11
13	300033	同花顺	31,664.00	0.10

14	300450	先导智能	30,821.00	0.10
15	601318	中国平安	23,518.00	0.08
16	002074	国轩高科	20,139.00	0.06
17	601939	建设银行	1,832.00	0.01
17	00939	建设银行	15,434.05	0.05
18	002353	杰瑞股份	16,283.00	0.05
19	000333	美的集团	15,278.00	0.05
20	601138	工业富联	12,454.00	0.04

注：1. 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。

2. 对于同时在 A+H 股上市的股票（如有），合并计算公允价值参与排序，并按照不同股票分别披露。

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	00700	腾讯控股	251,582.28	0.80
2	09988	阿里巴巴-W	217,765.38	0.69
3	00005	汇丰控股	197,056.85	0.63
4	601939	建设银行	7,599.00	0.02
4	00939	建设银行	140,363.90	0.45
5	600036	招商银行	112,882.00	0.36
5	03968	招商银行	21,726.39	0.07
6	300308	中际旭创	132,000.00	0.42
7	601318	中国平安	70,022.00	0.22
7	02318	中国平安	58,478.18	0.19
8	09926	康方生物	110,330.71	0.35
9	601988	中国银行	13,639.00	0.04
9	03988	中国银行	89,326.11	0.28
10	02888	渣打集团	98,799.77	0.32
11	300502	新易盛	93,795.00	0.30
12	300750	宁德时代	83,789.00	0.27
13	601398	工商银行	26,861.00	0.09
13	01398	工商银行	47,684.76	0.15
14	01299	友邦保险	72,947.36	0.23
15	00011	恒生银行	69,017.20	0.22
16	688981	中芯国际	28,786.00	0.09
16	00981	中芯国际	33,953.07	0.11
17	002594	比亚迪	29,664.00	0.09
17	01211	比亚迪股份	25,916.75	0.08
18	601899	紫金矿业	53,440.00	0.17
19	601088	中国神华	28,818.00	0.09
19	01088	中国神华	19,080.69	0.06

20	01810	小米集团-W	47,786.95	0.15
----	-------	--------	-----------	------

注：1. 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。

2. 对于同时在 A+H 股上市的股票（如有），合并计算公允价值参与排序，并按照不同股票分别披露。

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	1,659,465.84
卖出股票收入（成交）总额	4,602,618.60

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

无。

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

无。

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建设银行的发行主体中国建设银行股份有限公司于 2025 年 9 月 12 日因个别信息系统开发测试不充分、信息科技外包管理存在不足等事项等受到国家金融监督管理

总局处罚；于 2026 年 2 月 14 日因违反账户管理规定、违反特约商户管理规定、违反人民币流通管理规定、违反反假货币业务管理规定、占压财政存款或资金、违反信用信息采集、提供、查询及相关管理规定、未按规定履行客户身份识别义务、未按规定保存客户身份资料和交易记录、未按规定报送大额交易报告或者可疑交易报告、与身份不明的客户进行交易等受到中国人民银行处罚（银罚决字（2026）5 号）；于 2026 年 6 月 5 日因重要信息系统投产变更风险管控不到位、重要信息系统应急管理不足等受到国家金融监督管理总局处罚。建设银行为本基金跟踪标的指数的成分券。

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	1,354.52
2	应收清算款	-
3	应收股利	43,272.33
4	应收利息	-
5	应收申购款	11,300.96
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	55,927.81

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

无。

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

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 (%)
大成中华沪深港 300 指数 (LOF) A	2,768	6,852.56	36,298.84	0.19	18,931,591.44	99.81
大成中华沪深港 300 指数 (LOF) C	490	3,438.65	0.00	0.00	1,684,940.86	100.00
合计	3,258	6,339.11	36,298.84	0.18	20,616,532.30	99.82

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	大成中华沪深港 300 指数 (LOF) A	30.88	0.0002
	大成中华沪深港 300 指数 (LOF) C	8.26	0.0005
	合计	39.14	0.0002

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	大成中华沪深港 300 指数 (LOF) A	0
	大成中华沪深港 300 指数 (LOF) C	0
	合计	0

本基金基金经理持有 本开放式基金	大成中华沪深港 300 指数 (LOF) A	0
	大成中华沪深港 300 指数 (LOF) C	0
	合计	0

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	大成中华沪深港 300 指数 (LOF) A	大成中华沪深港 300 指数 (LOF) C
基金合同生效日 (2019 年 3 月 20 日) 基金份额总额	1,968,326,601.16	—
本报告期期初基金 份额总额	20,968,464.24	2,156,943.40
本报告期基金总申 购份额	2,867,835.67	1,097,704.23
减：本报告期基金总 赎回份额	4,868,409.63	1,569,706.77
本报告期基金拆分 变动份额	—	—
本报告期期末基金 份额总额	18,967,890.28	1,684,940.86

§ 10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

无。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

一、基金管理人的重大人事变动

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

二、基金托管人的基金托管部门的重大人事变动

无。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内无涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

10.4 基金投资策略的改变

本基金投资策略在本报告期内没有重大改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金自基金合同生效日起聘请普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）为本基金提供审计服务，自 2024 年 12 月 11 日起，改聘容诚会计师事务所（特殊普通合伙）为本基金提供审计服务至今。

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

无。

10.6.4 托管人相关从业人员受调查或处罚等情况

无。

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

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 (%)	
国信证券	1	2,079,836.14	33.58	407.68	33.58	—
中信建投证券	2	1,559,714.96	25.18	305.73	25.18	—
招商证券	2	947,791.35	15.30	185.77	15.30	—
广发证券	2	818,868.32	13.22	160.52	13.22	—
国泰海通	3	787,482.00	12.71	154.35	12.71	—
爱建证券	1	—	—	—	—	—
财通证	1	—	—	—	—	—

券						
长江证 券	1	-	-	-	-	新 增 1 个
第一创 业	1	-	-	-	-	-
东北证 券	1	-	-	-	-	-
东财证 券	1	-	-	-	-	-
东方证 券	1	-	-	-	-	-
东吴证 券	1	-	-	-	-	-
东兴证 券	1	-	-	-	-	-
方正证 券	1	-	-	-	-	-
高盛中 国证券	1	-	-	-	-	-
光大证 券	2	-	-	-	-	-
国金证 券	2	-	-	-	-	-
国盛证 券	1	-	-	-	-	-
国投证 券	1	-	-	-	-	-
红塔证 券	1	-	-	-	-	-
华创证 券	1	-	-	-	-	-
华泰证 券	1	-	-	-	-	-
民生证 券	1	-	-	-	-	-
南京证 券	1	-	-	-	-	-
平安证 券	1	-	-	-	-	-
瑞银证 券	2	-	-	-	-	-
山西证 券	1	-	-	-	-	-

上海证券	1	-	-	-	-	-
申万宏源	1	-	-	-	-	-
天风证券	1	-	-	-	-	-
万和证券	0	-	-	-	-	退租 1 个
西部证券	1	-	-	-	-	-
信达证券	0	-	-	-	-	退租 1 个
兴业证券	2	-	-	-	-	-
野村东方国际证券	1	-	-	-	-	-
粤开证券	1	-	-	-	-	-
浙商证券	1	-	-	-	-	-
中国银河证券	3	-	-	-	-	-
中金公司	2	-	-	-	-	-
中泰证券	2	-	-	-	-	-
中信证券	4	-	-	-	-	-
中银国际证券	1	-	-	-	-	-

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

（一）筛选标准

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

（二）筛选流程

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

2、公司按照白名单与证券公司进行协议签署。

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

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	大成中华沪深港 300 指数证券投资基金 (LOF) (C 类份额) 基金产品资料概要更新	中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站	2026 年 06 月 30 日
2	大成中华沪深港 300 指数证券投资基金 (LOF) (A 类份额) 基金产品资料概要更新	中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站	2026 年 06 月 30 日
3	大成中华沪深港 300 指数证券投资基金 (LOF) 暂停申购、赎回及定投业务的公告	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 29 日
4	大成中华沪深港 300 指数证券投资基金 (LOF) 暂停申购、赎回及定投业务的公告	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 05 月 21 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	大成中华沪深港 300 指数证券投资基金 (LOF) 2026 年第 1 季度报告	中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站	2026 年 04 月 22 日
7	大成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
8	大成中华沪深港 300 指数证券投资基金 (LOF) 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 04 月 20 日
9	大成中华沪深港 300 指数证券投资基金 (LOF) 暂停申购、赎回及定投业务的公告	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 04 月 01 日
10	大成中华沪深港 300 指数证券投资基金 (LOF) 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
11	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
12	大成基金管理有限公司旗下公募基金	中国证监会基金电子披	2026 年 03 月 31 日

	通过证券公司证券交易及佣金支付情况（2025 年度）	露网站、规定报刊及本公司网站	
13	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
14	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
15	大成中华沪深港 300 指数证券投资基金 (LOF) 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
16	大成基金管理有限公司旗下 205 只公募基金 2025 年第 4 季度报告提示性公告	规定报刊	2026 年 01 月 22 日

§ 11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

无。

11.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§ 12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

- 1、中国证监会批准设立大成中华沪深港 300 指数证券投资基金 (LOF) 的文件；
- 2、《大成中华沪深港 300 指数证券投资基金 (LOF) 基金合同》；
- 3、《大成中华沪深港 300 指数证券投资基金 (LOF) 托管协议》；
- 4、大成基金管理有限公司批准文件、营业执照、公司章程；
- 5、本报告期内在规定报刊上披露的各种公告原稿。

12.2 存放地点

备查文件存放在本基金管理人和托管人的住所。

12.3 查阅方式

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

大成基金管理有限公司

2026 年 8 月 28 日