大成中证A500交易型开放式指数证券投资基金
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：招商银行股份有限公司

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。

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

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

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

本报告财务资料未经审计。

本报告期自 2026 年 01 月 01 日起至 06 月 30 日止。

1.2 目录

§1 重要提示及目录 2

1.1 重要提示 2
1.2 目录 3

§2 基金简介 5

2.1 基金基本情况 5
2.2 基金产品说明 5
2.3 基金管理人和基金托管人 5
2.4 信息披露方式 6
2.5 其他相关资料 6

§3 主要财务指标和基金净值表现 6

3.1 主要会计数据和财务指标 6
3.2 基金净值表现 7

§4 管理人报告 7

4.1 基金管理人及基金经理情况 7
4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明 10
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明 10
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明 11
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望 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遵规守信情况声明 13
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、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的真实、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 41

7.1 期末基金资产组合情况 41
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合 41
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细 43
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动 55
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合 57
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 57
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 57
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 57

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 57
7.10 本基金投资股指期货的投资政策 57
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 57
7.12 投资组合报告附注 58

§8 基金份额持有人信息 59

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 59
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 59
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 59

§9 开放式基金份额变动 59

§10 重大事件揭示 60

10.1 基金份额持有人大会决议 60
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 60
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 60
10.4 基金投资策略的改变 60
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 60
10.6 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况 60
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 61
10.8 其他重大事件 61

§11 影响投资者决策的其他重要信息 63

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 63
11.2 影响投资者决策的其他重要信息 63

§12 备查文件目录 63

12.1 备查文件目录 63
12.2 存放地点 63
12.3 查阅方式 63

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	大成中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金
基金简称	大成中证 A500ETF
场内简称	中证 A500ETF 大成
基金主代码	159358
交易代码	159358
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2024 年 11 月 22 日
基金管理人	大成基金管理有限公司
基金托管人	招商银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	575,106,420.00 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	2024 年 11 月 29 日

2.2 基金产品说明

投资目标	紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化。在正常市场情况下，本基金的日均跟踪偏离度的绝对值争取不超过 0.2%，年跟踪误差争取不超过 2%。
投资策略	（一）股票投资策略 （二）衍生金融产品投资策略 （三）债券投资策略 （四）资产支持证券投资策略 （五）融资及转融通证券出借策略 （六）存托凭证投资策略
业绩比较基准	中证 A500 指数收益率
风险收益特征	本基金属于股票型基金，其预期收益及预期风险水平高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。 本基金为被动式投资的股票型指数基金，主要采用完全复制策略，跟踪中证 A500 指数，其风险收益特征与标的指数所表征的市场组合的风险收益特征相似。

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	招商银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	段皓静	张姗
	联系电话	0755-83183388	400-61-95555
	电子邮箱	office@dcfund.com.cn	zhangshan_1027@cmbchina.com
客户服务电话		4008885558	400-61-95555
传真		0755-83199588	0755-83195201
注册地址		广东省深圳市南山区海德三道	深圳市深南大道 7088 号招商银

	1236 号大成基金总部大厦 5 层、27-33 层	行大厦
办公地址	广东省深圳市南山区海德三道 1236 号大成基金总部大厦 5 层、27-33 层	深圳市深南大道 7088 号招商银行大厦
邮政编码	518054	518040
法定代表人	吴庆斌	缪建民

2.4 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

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)
本期已实现收益	217,102,945.97
本期利润	146,798,953.69
加权平均基金份额本期利润	0.1570
本期加权平均净值利润率	11.78%
本期基金份额净值增长率	13.43%
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	234,500,179.28
期末可供分配基金份额利润	0.4078
期末基金资产净值	828,446,753.56
期末基金份额净值	1.4405
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	44.05%

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）。

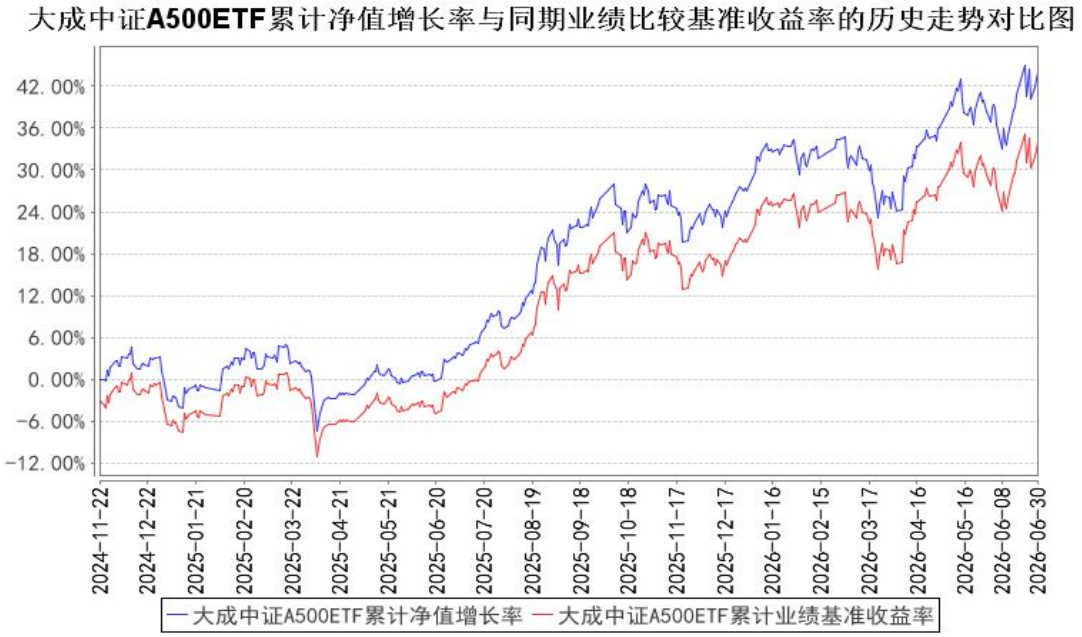
3、所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

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

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	15.63%	1.39%	14.26%	1.41%	1.37%	-0.02%
过去六个月	13.43%	1.27%	11.91%	1.29%	1.52%	-0.02%
过去一年	39.69%	1.13%	36.38%	1.14%	3.31%	-0.01%
自基金合同生效起至今	44.05%	1.10%	33.88%	1.13%	10.17%	-0.03%

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



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。

§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		
刘淼	本基金基金经理	2024 年 11 月 22 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。

4.1.3 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遵规守信情况的说明

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

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 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

上半年，国内经济整体运行平稳但"K 型分化"特征比较突出。GDP 累计同比增速 4.7%，落于年度目标区间内，节奏为前高后低。结构上，外需强于内需、新兴经济强于传统经济的格局贯穿始终，出口持续高增与高新技术制造业景气扩张构成主要支撑项。截至 6 月 30 日，A 股整体呈现“复合 N 型”走势，科技板块更是强势领涨。主要指数表现上，沪深 300 涨 7.55%，中证 500 涨 20.97%，中证 1000 涨 15.99%，创业板指涨 35.58%，科创 50 涨 64.25%。行业上（中信一级），电子、通信、建材涨幅居前；消费者服务、综合金融和综合表现萎靡。风格上，成长大幅占优。

报告期内，影响股票市场的核心变量可概括为：AI 产业景气度、中东地缘冲突与全球通胀、美联储货币政策变化、中美外交关系，以及国内政策对科技资产的定向支撑。阶段表现上，一月至二月底，市场延续去年末上行趋势，情绪与流动性改善共振，科技与周期双主线领涨。2 月 28 日美以联合打击伊朗，地缘风险骤升，霍尔木兹海峡航运严重受阻，油价推升，美联储释放偏鹰信号压缩降息空间。三月市场进入震荡调整阶段，高位资产调整尤为明显。四月上旬至五月中旬，先是美伊进入停火谈判窗口，尾部风险骤降，叠加 AI 硬件龙头一季报盈利高增兑现、DeepSeek V4 发布及国产算力订单上修共振，行情从超跌修复演变为具有盈利支撑的趋势性上行；然后是特朗普访华，中美元首达成"建设性战略稳定关系"共识，风险偏好推升至阶段性峰值，上证指数一度创十年新高。五月中旬至六月上旬，在重大事件兑现后，部分资金获利了结。叠加美国通胀和就业数据预期，美联储新主席沃什鹰派立场强化等，全球流动性预期边际收紧。分母端持续压制叠加 TMT 筹码拥挤，市场转入存量博弈。六月中下旬，在特朗普宣布取消对伊空袭后，地缘风险溢价系统性消退，油价回落，传统能源与红利资产的支撑逻辑被抽空；陆家嘴论坛与央行六项定向措施对科技资产集中背书，AI 算力板块共识度快速提升，资金从传统行业撤出转投科技，使得科技板块与红利资产之间形成近年极端的一次风格裂口。

本基金标的为中证 A500 指数。中证 A500 指数从各行业选取市值较大、流动性较好的 500 只证券作为指数样本，以反映各行业最具代表性上市公司证券的整体表现。本基金采用完全复制法进行投资，即原则上按照成份股在标的指数中的基准权重来构建指数化投资组合，并根据标的指数成份股及其权重的变化进行相应调整。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。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末本基金份额净值为 1.4405 元；本报告期基金份额净值增长率为 13.43%，业绩比较基准收益率为 11.91%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望下半年，宏观经济有望延续平稳运行但"供强需弱"的结构特征大概率延续，边际改善可能在于制造业补库意愿与产能利用率延续回升的共振。消费方面，以旧换新专项资金及促内需政策继续发力，但居民预防性储蓄倾向制约消费弹性，修复节奏或偏缓。投资方面，制造业投资受 AI 产业链与出口带动维持较高景气，海外渠道库存处于低位，回补需求对出口链构成持续拉动；专项债提速发行或带动基建投资边际改善；地产方面，全国层面的量价企稳仍需时间。出口方面，全球 AI 资本开支方兴未艾叠加海外补库需求升温，高技术出口链订单具备支撑。政策层面，货币适度宽松基调不变，下半年降准仍存空间；财政以落实为主，专项债加速拨付强化托底，若经济增速进一步偏离年度目标则增量政策出台的必要性将上升。价格端，CPI 有望在低位小幅企稳回升；PPI 同比转正但其中包含油价输入性因素，后续走势取决于内需修复力度。

对于股票市场，我们认为下半年有望维持震荡偏强格局。盈利层面，企业补库与设备更新周期共振，科技和先进制造贡献了盈利改善的主要增量，二季度以来部分传统行业利润降幅亦在收窄，整体仍处于盈利改善趋势中。流动性方面，居民理财到期再配置规模可观，年金和保险权益仓位仍有补配空间，海外长线资金对 A 股的配置意愿回升，总体对行情有所支撑。估值方面，从风险补偿角度看，沪深 300 隐含的权益风险溢价处于历史均值附近，整体定价并不昂贵；但部分板块虽经调整消化，估值分位数仍相对偏高，需留意业绩验证期波动。风险因素上，海外流动性的不确定是核心变量，同时，中东地缘局势也存在反复可能。风格上，近两年成长对价值的偏离幅度已处于历史极端区域，上半年的极端分化延续难度较大，下半年更可能呈现风格收敛而非彻底逆转，即科技主线在产业趋势未出现拐点前仍是核心配置方向，但前期涨幅落后板块的性价比正在修复，行业配置方向或将趋于均衡。

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

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

无。

§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

托管人声明:

招商银行具备完善的公司治理结构、内部稽核监控制度和风险控制制度，我行在履行托管职责中，严格遵守有关法律法规、托管协议的规定，尽职尽责地履行托管义务并安全保管托管资产。

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

招商银行根据法律法规、托管协议约定的投资监督条款，对托管产品的投资行为进行监督，

并根据监管要求履行报告义务。

招商银行按照托管协议约定的统一记账方法和会计处理原则，独立地设置、登录和保管本产品的全套账册，进行会计核算和资产估值并与管理人建立对账机制。

本中期报告中利润分配情况真实、准确。

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

本中期报告中财务指标、净值表现、财务会计报告、投资组合报告内容真实、准确，不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

§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：大成中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金

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	13,568,278.43	70,956,864.81
结算备付金		5,019.07	-
存出保证金		-	-
交易性金融资产	6.4.7.2	820,666,479.23	1,659,931,602.13
其中：股票投资		820,570,476.52	1,659,931,602.13
基金投资		-	-
债券投资		96,002.71	-
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		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.8	60,492.63	-
资产总计		834,300,269.36	1,730,888,466.94
负债和净资产	**附注号**	**本期末 2026 年 6 月 30 日**	**上年度末 2025 年 12 月 31 日**
负 债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-

衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付清算款		267.45	224,377.66
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		110,817.23	250,993.33
应付托管费		36,939.07	83,664.47
应付销售服务费		-	-
应付投资顾问费		-	-
应交税费		-	0.26
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.9	5,705,492.05	55,030,116.45
负债合计		5,853,515.80	55,589,152.17
净资产：			
实收基金	6.4.7.10	575,106,420.00	1,319,106,420.00
未分配利润	6.4.7.12	253,340,333.56	356,192,894.77
净资产合计		828,446,753.56	1,675,299,314.77
负债和净资产总计		834,300,269.36	1,730,888,466.94

注：报告截止日 2026 年 6 月 30 日，基金份额净值 1.4405 元，基金份额总额 575,106,420.00 份。

6.2 利润表

会计主体：大成中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金

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 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
一、营业总收入		148,203,909.23	58,958,719.75
1.利息收入		12,623.98	19,628.80
其中：存款利息收入	6.4.7.13	12,623.98	19,628.80
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）		218,622,193.37	29,172,103.80
其中：股票投资收益	6.4.7.14	210,791,161.00	-2,920,100.98
基金投资收益	6.4.7.15	-	-
债券投资收益	6.4.7.16	2.71	78,911.23
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	7,831,029.66	32,013,293.55
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	-70,303,992.28	28,047,596.10
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	-126,915.84	1,719,391.05
减：二、营业总支出		1,404,955.54	2,991,590.63
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	926,712.94	2,105,644.30
2. 托管费	6.4.10.2.2	308,904.29	701,881.48
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	-	-
4. 投资顾问费		-	-
5. 利息支出		-	-
其中:卖出回购金融资产支出		-	-
6. 信用减值损失	6.4.7.23	-	-
7. 税金及附加		-	0.15
8. 其他费用	6.4.7.24	169,338.31	184,064.70
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		146,798,953.69	55,967,129.12
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		146,798,953.69	55,967,129.12
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		146,798,953.69	55,967,129.12

6.3 净资产变动表

会计主体：大成中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金

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	1,319,106,420.00	-	356,192,894.77	1,675,299,314.77

二、本期期初净资产	1,319,106,420.00	-	356,192,894.77	1,675,299,314.77
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-744,000,000.00	-	-102,852,561.21	-846,852,561.21
（一）、综合收益总额	-	-	146,798,953.69	146,798,953.69
（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）	-744,000,000.00	-	-249,651,514.90	-993,651,514.90
其中：1.基金申购款	417,000,000.00	-	137,016,770.72	554,016,770.72
2.基金赎回款	-1,161,000,000.00	-	-386,668,285.62	-1,547,668,285.62
（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	575,106,420.00	-	253,340,333.56	828,446,753.56

项目	上年度可比期间 2025年1月1日至2025年6月30日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	3,389,106,420.00	-	48,014,014.87	3,437,120,434.87
二、本期期初净资产	3,389,106,420.00	-	48,014,014.87	3,437,120,434.87
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-1,020,000,000.00	-	25,904,855.35	-994,095,144.65
（一）、综合收益总额	-	-	55,967,129.12	55,967,129.12
（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）	-1,020,000,000.00	-	-30,062,273.77	-1,050,062,273.77

其中：1.基金申购款	741,000,000.00	-	-5,003,058.01	735,996,941.99
2. 基金赎回款	-1,761,000,000.00	-	-25,059,215.76	-1,786,059,215.76
（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	2,369,106,420.00	-	73,918,870.22	2,443,025,290.22

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署：

谭晓冈	范瑛	梁靖
基金管理人负责人	主管会计工作负责人	会计机构负责人

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

大成中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金（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[2024]1531 号文《关于准予大成中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金注册的批复》注册，由大成基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《大成中证 A500 交易型开放式指数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 2024 年 11 月 5 日至 2024 年 11 月 19 日，首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币 1,999,999,730.00 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（2024）验字第 70039092_H09 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 2024 年 11 月 22 日生效，基金合同生效日的基金份额总额为 2,000,106,420.00 份基金份额，其中认购资金利息折合 106,690.00 份基金份额。本基金为交易型开放式，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，注册登记机构为中国证券登记结算有限责任公司，基金托管人为招商银行股份有限公司。

本基金主要投资于标的指数成份股和备选成份股（含存托凭证，下同）。为更好地实现基金的投资目标，本基金可能会少量投资于国内依法发行上市的非标的指数成份股（包括主板、创业板、科创板及其他经中国证监会注册或核准上市的股票及存托凭证）、衍生工具（股指期货、股票期权、国债期货等）、债券资产（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（含分离交易可转债）、可交换债券及其他经中国证监会允许投资的债券）、货币市场工具、债券回购、资产支持证券、银行存款、同业存单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的相关规定）。本基金可根据法律法规的规定参与融资业务和转融通证券出借业务。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。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，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：本基金投资于标的指数成份股和备选成份股的资产比例不低于基金资产净值的 90%，且不低于非现金基金资产的 80%。每个交易日日终在扣除股指期货、国债期货、股票期权合约需缴纳的交易保证金后，应当保持不低于交易保证金一倍的现金，其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。如法律法规或监管机构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为中证 A500 指数收益率。

6.4.2 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。

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

（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第 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。

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	1,316,310.10
等于：本金	1,316,168.96
加：应计利息	141.14
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	12,251,968.33
等于：本金	12,251,597.60
加：应计利息	370.73
减：坏账准备	-
合计	13,568,278.43

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。

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		696,126,799.95	-	820,570,476.52	124,443,676.57
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-	-
债券	交易所市场	96,000.00	2.71	96,002.71	0.00
	银行间市场	-	-	-	-
	合计	96,000.00	2.71	96,002.71	0.00
资产支持证券		-	-	-	-
基金		-	-	-	-
其他		-	-	-	-
合计		696,222,799.95	2.71	820,666,479.23	124,443,676.57

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

单位：人民币元

项目	本期末 2026 年 6 月 30 日
应收利息	-
其他应收款	-
待摊费用	60,492.63
合计	60,492.63

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	-
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	-
应退退补款	5,548,132.36
预提费用	109,095.94
可退替代款	22,886.90
其他	25,376.85
合计	5,705,492.05

6.4.7.10 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	1,319,106,420.00	1,319,106,420.00
本期申购	417,000,000.00	417,000,000.00
本期赎回（以“-”号填列）	-1,161,000,000.00	-1,161,000,000.00
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	575,106,420.00	575,106,420.00

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

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	229,037,859.54	127,155,035.23	356,192,894.77
本期期初	229,037,859.54	127,155,035.23	356,192,894.77
本期利润	217,102,945.97	-70,303,992.28	146,798,953.69
本期基金份额交易产生的变动数	-211,640,626.23	-38,010,888.67	-249,651,514.90
其中：基金申购款	93,056,396.10	43,960,374.62	137,016,770.72
基金赎回款	-304,697,022.33	-81,971,263.29	-386,668,285.62
本期已分配利润	-	-	-
本期末	234,500,179.28	18,840,154.28	253,340,333.56

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	3,657.74
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	8,947.17
结算备付金利息收入	19.07
其他	-
合计	12,623.98

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	102,047,430.31
股票投资收益——赎回差价收入	108,743,730.69
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	210,791,161.00

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	1,018,979,153.29
减：卖出股票成本总额	916,014,647.73
减：交易费用	917,075.25
买卖股票差价收入	102,047,430.31

6.4.7.14.3 股票投资收益——赎回差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2026年1月1日至2026年6月30日
赎回基金份额对价总额	1,547,668,285.62
减：现金支付赎回款总额	799,866,894.62
减：赎回股票成本总额	639,057,660.31
减：交易费用	-
赎回差价收入	108,743,730.69

6.4.7.14.4 股票投资收益——申购差价收入

无。

6.4.7.14.5 股票投资收益——证券出借差价收入

无。

6.4.7.15 基金投资收益

无。

6.4.7.16 债券投资收益

6.4.7.16.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2026年1月1日至2026年6月30日
债券投资收益——利息收入	2.71
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	-
债券投资收益——赎回差价收入	-
债券投资收益——申购差价收入	-
合计	2.71

6.4.7.16.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

无。

6.4.7.16.3 债券投资收益——赎回差价收入

无。

6.4.7.16.4 债券投资收益——申购差价收入

无。

6.4.7.17 资产支持证券投资收益

6.4.7.17.1 资产支持证券投资收益项目构成

无。

6.4.7.17.2 资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入

无。

6.4.7.17.3 资产支持证券投资收益——赎回差价收入

无。

6.4.7.17.4 资产支持证券投资收益——申购差价收入

无。

6.4.7.18 贵金属投资收益

6.4.7.18.1 贵金属投资收益项目构成

无。

6.4.7.18.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

无。

6.4.7.18.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

无。

6.4.7.18.4 贵金属投资收益——申购差价收入

无。

6.4.7.19 衍生工具收益

6.4.7.19.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

无。

6.4.7.19.2 衍生工具收益——其他投资收益

无。

6.4.7.20 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
股票投资产生的股利收益	7,831,029.66
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	7,831,029.66

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	-70,303,992.28
股票投资	-70,303,992.28
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	-70,303,992.28

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	-
替代损益	-126,915.84
合计	-126,915.84

注：替代损益（如有）是指投资者采用可以现金替代或退补现金替代方式申购（赎回）本基金时，补入（卖出）被替代成分证券的实际买入成本（实际卖出金额）与申购（赎回）确认日估值的差额或强制退款的被替代成分证券在强制退款计算日与申购（赎回）确认日估值的差额。

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	39,671.58
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
银行划款手续费	735.00
其他	69,424.36
合计	169,338.31

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
招商银行股份有限公司（“招商银行”）	基金托管人
光大证券股份有限公司（“光大证券”）	基金管理人的股东、基金销售机构
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（“大成中证 A500ETF 发起式联接”）	本基金的联接基金

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	926,712.94	2,105,644.30
其中：应支付销售机构的客户维护费	48,399.44	167,120.17
应支付基金管理人的净管理费	878,313.50	1,938,524.13

注：本基金管理费年费率为 0.15%，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	308,904.29	701,881.48

注：本基金托管费年费率为 0.05%，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

无。

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

份额单位：份

关联方名称	本期末 2026 年 6 月 30 日		上年度末 2025年12月31日	
	持有的 基金份额	持有的基金份额 占基金总份额的 比例（%）	持有的 基金份额	持有的基金份额 占基金总份额的比 例（%）
大成中证 A500ETF 发起式联接	381,172,507.00	66.28	566,245,307.00	42.93
光大证券	-	-	900,000.00	0.07

注：除基金管理人之外的其他关联方投资本基金适用的交易费率与本基金法律文件规定一致。

6.4.10.6 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
招商银行	1,316,310.10	3,657.74	8,937,287.25	7,954.18

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

本报告期末，本基金因指数成份股原因持有基金托管人招商银行股份有限公司发行的证券招商银行（600036.SH）305,400 股（上年度末：714,900 股），估值总额为人民币 10,841,700.00 元（上年度末：30,097,290.00 元），占基金净资产的比例为 1.31%（上年度末：1.80%）。

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

金额单位：人民币元

6.4.12.1.1 受限证券类别：股票

证券代码	证券名称	成功认购日	受限期	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量（单位：股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
001220	世盟股份	2026 年 1 月 27 日	6 个月	新股锁定	28.00	27.78	57	1,596.00	1,583.46	-
001237	惠康科技	2026 年 5 月 15 日	6 个月	新股锁定	53.26	58.74	285	15,179.10	16,740.90	-
001248	华润新能源	2026 年 6 月 24 日	1 个月内（含）	新股未上市	10.11	10.11	13,389	135,362.79	135,362.79	-
001248	华润新能源	2026 年 6 月 24 日	6 个月	新股未上市	10.11	10.11	31,242	315,856.62	315,856.62	-
001257	盛龙股份	2026 年 3 月 24 日	6 个月	新股锁定	7.82	20.74	1,743	13,630.26	36,149.82	-
001312	福恩股	2026 年 4 月 14	6 个月	新股锁	18.38	16.78	134	2,462.92	2,248.52	-

	份	日		定						
001365	天海电子	2026 年 5 月 11 日	6 个月	新股锁定	27.19	31.31	719	19,549.61	22,511.89	-
001393	维通利	2026 年 5 月 8 日	6 个月	新股锁定	30.38	38.99	387	11,757.06	15,089.13	-
001399	惠科股份	2026 年 6 月 16 日	6 个月	新股锁定	10.12	27.73	4,885	49,436.20	135,461.05	-
301513	尚水智能	2026 年 4 月 10 日	6 个月	新股锁定	26.66	50.96	138	3,679.08	7,032.48	-
301531	春光集团	2026 年 4 月 28 日	6 个月	新股锁定	13.30	51.56	290	3,857.00	14,952.40	-
301599	理奇智能	2026 年 4 月 22 日	6 个月	新股锁定	13.91	32.47	433	6,023.03	14,059.51	-
301666	大普微	2026 年 4 月 8 日	6 个月	新股锁定	46.08	463.33	1,220	56,217.60	565,262.60	-
301669	高特电子	2026 年 6 月 2 日	6 个月	新股锁定	7.08	28.40	546	3,865.68	15,506.40	-
301680	固德电材	2026 年 2 月 27 日	6 个月	新股锁定	58.00	112.16	117	6,786.00	13,122.72	-
301682	宏明电子	2026 年 3 月 18 日	6 个月	新股锁定	69.66	160.06	714	49,737.24	114,282.84	-
301683	慧谷新	2026 年 3 月 24	6 个月	新股锁	78.38	121.77	96	7,524.48	11,689.92	-

	材	日		定						
301687	新广益	2025 年 12 月 24 日	6 个月	新股锁定	21.93	77.78	195	4,276.35	15,167.10	-
301696	三瑞智能	2026 年 3 月 31 日	6 个月	新股锁定	24.68	86.80	216	5,330.88	18,748.80	-
601112	振石股份	2026 年 1 月 21 日	6 个月	新股锁定	11.18	17.59	775	8,664.50	13,632.25	-
603284	林平发展	2026 年 2 月 3 日	6 个月	新股锁定	37.88	34.87	46	1,742.48	1,604.02	-
603293	埃泰克	2026 年 4 月 9 日	6 个月	新股锁定	33.49	33.93	72	2,411.28	2,442.96	-
603352	至信股份	2026 年 1 月 8 日	6 个月	新股锁定	21.88	25.52	112	2,450.56	2,858.24	-
603435	嘉德利	2026 年 5 月 15 日	6 个月	新股锁定	15.76	46.71	104	1,639.04	4,857.84	-
603459	红板科技	2026 年 3 月 31 日	6 个月	新股锁定	17.70	84.32	330	5,841.00	27,825.60	-
688635	长进光子	2026 年 5 月 20 日	6 个月	新股锁定	40.98	308.19	128	5,245.44	39,448.32	-
688712	北芯生命	2026 年 1 月 28 日	6 个月	新股锁定	17.52	35.92	234	4,099.68	8,405.28	-
688781	视涯科	2026 年 3 月 18	6 个月	新股锁	22.68	47.61	217	4,921.56	10,331.37	-

	技	日		定						
688785	恒运昌	2026 年 1 月 20 日	6 个月	新股锁定	92.18	463.15	116	10,692.88	53,725.40	-
688797	臻宝科技	2026 年 6 月 16 日	6 个月	新股锁定	44.56	468.67	207	9,223.92	97,014.69	-
688808	联讯仪器	2026 年 4 月 16 日	6 个月	新股锁定	81.88	1,584.33	163	13,346.44	258,245.79	-
688811	有研复材	2026 年 4 月 1 日	6 个月	新股锁定	6.41	24.13	834	5,345.94	20,124.42	-
688813	泰金新能	2026 年 3 月 24 日	6 个月	新股锁定	26.28	172.09	234	6,149.52	40,269.06	-
688816	易思维	2026 年 2 月 4 日	6 个月	新股锁定	55.95	57.10	177	9,903.15	10,106.70	-
688818	电科蓝天	2026 年 2 月 3 日	6 个月	新股锁定	9.47	70.14	1,717	16,259.99	120,430.38	-
688820	盛合晶微	2026 年 4 月 13 日	6 个月	新股锁定	19.68	141.49	1,694	33,337.92	239,684.06	-

6.4.12.1.2 受限证券类别：债券

证券代码	证券名称	成功认购日	受限期	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量（单位：张）	期末成本总额	期末估值总额	备注
111025	圣泉转债	2026 年 6 月 25 日	1 个月内（含）	新债未上	100.00	100.00	520	52,000.00	52,000.68	-

				市						
113704	春风转债	2026年6月10日	1个月内（含）	新债未上市	100.00	100.00	440	44,000.00	44,002.03	-

6.4.12.2 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	832.00	2026年7月13日	890.99	4,881	1,417,580.26	4,060,992.00	-

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

本基金属于股票型基金，其预期收益及预期风险水平高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。本基金为被动式投资的股票型指数基金，主要采用完全复制策略，跟踪中证 A500 指数，其风险收益特征与标的指数所表征的市场组合的风险收益特征相似。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招商银行股份有限公司，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 0.01%(上年度末：本基金无债券投资)。

6.4.13.3 流动性风险

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

6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》及《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》等有关法规的要求建立健全开放式基金流动性风险管理的内

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

本基金主要投资于交易所及银行间市场内交易的证券，除在附注“期末本基金持有的流通受限证券”中列示的部分基金资产流通暂时受限制外(如有)，其余均能及时变现。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券资产的公允价值。除附注“期末债券正回购交易中作为抵押的债券”中列示的卖出回购金融资产款余额(如有)将在 1 个月内到期且计息外，本基金于资产负债表日所持有的金融负债的合约约定剩余到期日均为一年以内且一般不计息，可赎回基金份额净值无固定到期日且不计息，因此账面余额一般即为未折现的合约到期现金流量。本报告期内，本基金未发生重大流动性风险事件。

6.4.13.4 市场风险

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

6.4.13.4.1 利率风险

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

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

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

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2026 年 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	13,568,278.43	-	-	-	13,568,278.43
结算备付金	5,019.07	-	-	-	5,019.07
交易性金融资产	-	-	96,002.71	820,570,476.52	820,666,479.23
其他资产	-	-	-	60,492.63	60,492.63
资产总计	13,573,297.50	-	96,002.71	820,630,969.15	834,300,269.36
负债					
应付管理人报酬	-	-	-	110,817.23	110,817.23
应付托管费	-	-	-	36,939.07	36,939.07
应付清算款	-	-	-	267.45	267.45
其他负债	-	-	-	5,705,492.05	5,705,492.05
负债总计	-	-	-	5,853,515.80	5,853,515.80
利率敏感度缺口	13,573,297.50	-	96,002.71	814,777,453.35	828,446,753.56
上年度末 2025 年 12 月 31 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
货币资金	70,956,864.81	-	-	-	70,956,864.81
交易性金融资产	-	-	-	1,659,931,602.13	1,659,931,602.13
资产总计	70,956,864.81	-	-	1,659,931,602.13	1,730,888,466.94
负债					
应付管理人报酬	-	-	-	250,993.33	250,993.33
应付托管费	-	-	-	83,664.47	83,664.47
应付清算款	-	-	-	224,377.66	224,377.66
应交税费	-	-	-	0.26	0.26
其他负债	-	-	-	55,030,116.45	55,030,116.45
负债总计	-	-	-	55,589,152.17	55,589,152.17
利率敏感度缺口	70,956,864.81	-	-	1,604,342,449.96	1,675,299,314.77

注：表中所示为本基金资产及负债的账面价值，并按照合约规定的利率重新定价日或到期日孰早者予以分类。

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

于本期末，本基金持有的交易性债券投资和交易性资产支持证券投资公允价值占净资产的比例为 0.01%(上年度末：无)，因此市场利率的变动对于本基金净资产无重大影响(上年度末：同)。

6.4.13.4.2 外汇风险

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

6.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以

外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市的股票，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。

本基金采用完全复制法跟踪中证 A500 指数，以完全按照标的指数成份股组成及其权重构建基金股票投资组合为原则，通过指数化分散投资降低其他价格风险。本基金投资于标的指数成份股和备选成份股的资产比例不低于基金资产净值的 90%，且不低于非现金基金资产的 80%。每个交易日日终在扣除股指期货、国债期货、股票期权合约需缴纳的交易保证金后，应当保持不低于交易保证金一倍的现金，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。

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	820,570,476.52	99.05	1,659,931,602.13	99.08
交易性金融资产－基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产－债券投资	96,002.71	0.01	-	-
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	820,666,479.23	99.06	1,659,931,602.13	99.08

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%	40,983,667.95	83,210,482.15
	业绩比较基准下降5%	-40,983,667.95	-83,210,482.15

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	814,087,649.19	1,646,001,318.81
第二层次	4,608,214.12	13,034,879.04
第三层次	1,970,615.92	895,404.28
合计	820,666,479.23	1,659,931,602.13

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	820,570,476.52	98.35
	其中：股票	820,570,476.52	98.35
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	96,002.71	0.01
	其中：债券	96,002.71	0.01
	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	13,573,297.50	1.63
8	其他各项资产	60,492.63	0.01
9	合计	834,300,269.36	100.00

注：上述股票投资金额包括可退替代款估值增值（如有）。

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	2,572,733.00	0.31
B	采矿业	33,648,595.40	4.06
C	制造业	578,594,360.04	69.84
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	17,815,217.00	2.15
E	建筑业	9,965,340.68	1.20
F	批发和零售业	6,290,006.00	0.76
G	交通运输、仓储和邮政业	18,224,132.36	2.20
H	住宿和餐饮业	381,668.00	0.05
I	信息传输、软件和	45,770,155.29	5.52

	信息技术服务业		
J	金融业	79,219,525.84	9.56
K	房地产业	4,575,004.00	0.55
L	租赁和商务服务业	5,916,589.08	0.71
M	科学研究和技术服务业	9,786,164.00	1.18
N	水利、环境和公共设施管理业	1,405,773.96	0.17
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	273,960.00	0.03
Q	卫生和社会工作	1,598,035.54	0.19
R	文化、体育和娱乐业	627,467.00	0.08
S	综合	1,478,692.00	0.18
	合计	818,143,419.19	98.76

7.2.2 报告期末积极投资按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	36,149.82	0.00
C	制造业	1,932,882.64	0.23
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	451,219.41	0.05
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	1,583.46	0.00
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	-	-
J	金融业	-	-
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	2,421,835.33	0.29

7.2.3 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

无。

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	300308	中际旭创	27,700	35,179,000.00	4.25
2	300750	宁德时代	65,379	25,694,600.79	3.10
3	300502	新易盛	34,432	20,900,224.00	2.52
4	600519	贵州茅台	15,370	18,220,981.30	2.20
5	603986	兆易创新	16,500	13,447,500.00	1.62
6	601318	中国平安	263,000	12,555,620.00	1.52
7	688256	寒武纪	7,765	12,389,445.75	1.50
8	600036	招商银行	305,400	10,841,700.00	1.31
9	601899	紫金矿业	406,500	10,219,410.00	1.23
10	002371	北方华创	10,567	9,347,145.52	1.13
11	000333	美的集团	120,100	9,071,153.00	1.09
12	002475	立讯精密	125,800	8,856,320.00	1.07
13	688008	澜起科技	28,100	8,708,190.00	1.05
14	688012	中微公司	18,218	8,535,133.00	1.03
15	688041	海光信息	22,796	8,441,358.80	1.02
16	002384	东山精密	31,600	8,290,260.00	1.00
17	600900	长江电力	301,800	7,988,646.00	0.96
18	688981	中芯国际	49,331	7,834,749.42	0.95
19	000725	京东方 A	896,900	7,785,092.00	0.94
20	603259	药明康德	61,100	7,607,561.00	0.92
21	601166	兴业银行	417,703	6,917,161.68	0.83
22	600030	中信证券	240,700	6,915,311.00	0.83
23	300059	东方财富	312,132	6,361,250.16	0.77
24	600183	生益科技	36,000	6,242,400.00	0.75
25	600276	恒瑞医药	110,140	5,731,685.60	0.69
26	300274	阳光电源	35,800	5,692,916.00	0.69
27	601398	工商银行	798,200	5,643,274.00	0.68
28	300408	三环集团	33,100	5,524,390.00	0.67
29	002594	比亚迪	66,923	5,333,763.10	0.64
30	600487	亨通光电	48,600	5,313,924.00	0.64
31	300476	胜宏科技	15,100	5,231,093.00	0.63
32	002463	沪电股份	33,200	5,072,960.00	0.61

33	601211	国泰海通	278,700	5,072,340.00	0.61
34	300394	天孚通信	16,106	4,874,964.08	0.59
35	688525	佰维存储	9,500	4,699,935.00	0.57
36	000988	华工科技	24,800	4,578,328.00	0.55
37	688498	源杰科技	2,400	4,526,400.00	0.55
38	301308	江波龙	6,400	4,504,320.00	0.54
39	600176	中国巨石	59,300	4,321,784.00	0.52
40	601288	农业银行	708,900	4,303,023.00	0.52
41	601328	交通银行	658,000	4,230,940.00	0.51
42	000651	格力电器	110,500	4,143,750.00	0.50
43	600522	中天科技	67,300	4,083,764.00	0.49
44	688072	拓荆科技	4,881	4,060,992.00	0.49
45	603019	中科曙光	36,100	3,871,003.00	0.47
46	688521	芯原股份	10,400	3,859,856.00	0.47
47	603993	洛阳钼业	215,500	3,782,025.00	0.46
48	600150	中国船舶	111,436	3,765,422.44	0.45
49	600887	伊利股份	156,200	3,742,552.00	0.45
50	300604	长川科技	10,900	3,721,478.00	0.45
51	600584	长电科技	35,300	3,655,315.00	0.44
52	000338	潍柴动力	132,600	3,613,350.00	0.44
53	000858	五 粮 液	47,800	3,537,200.00	0.43
54	688347	华虹宏力	10,300	3,463,890.00	0.42
55	601816	京沪高铁	724,300	3,281,079.00	0.40
56	688120	华海清科	9,959	3,208,590.62	0.39
57	600309	万华化学	46,500	3,181,065.00	0.38
58	002916	深南电路	6,890	3,154,931.00	0.38
59	300124	汇川技术	46,902	3,111,009.66	0.38
60	002415	海康威视	90,400	3,091,680.00	0.37
61	002008	大族激光	20,400	3,062,244.00	0.37
62	002281	光迅科技	11,900	3,057,586.00	0.37
63	600111	北方稀土	62,600	3,007,930.00	0.36
64	000100	TCL 科技	513,200	2,986,824.00	0.36
65	000063	中兴通讯	79,600	2,880,724.00	0.35
66	300136	信维通信	24,000	2,862,000.00	0.35
67	600000	浦发银行	328,800	2,830,968.00	0.34
68	300857	协创数据	8,300	2,821,170.00	0.34
69	600089	特变电工	124,560	2,802,600.00	0.34
70	601857	中国石油	319,580	2,773,954.40	0.33
71	002028	思源电气	15,400	2,664,200.00	0.32
72	601088	中国神华	67,700	2,643,008.00	0.32
73	300433	蓝思科技	49,000	2,629,340.00	0.32
74	600031	三一重工	146,300	2,528,064.00	0.31
75	300014	亿纬锂能	37,600	2,445,128.00	0.30

76	002050	三花智控	55,300	2,423,799.00	0.29
77	601601	中国太保	84,600	2,412,792.00	0.29
78	000001	平安银行	239,300	2,404,965.00	0.29
79	300475	香农芯创	8,000	2,400,000.00	0.29
80	000792	盐湖股份	78,400	2,366,896.00	0.29
81	002714	牧原股份	67,300	2,354,827.00	0.28
82	600549	厦门钨业	27,600	2,351,520.00	0.28
83	300223	北京君正	9,400	2,339,660.00	0.28
84	002353	杰瑞股份	15,100	2,302,750.00	0.28
85	002156	通富微电	29,900	2,268,513.00	0.27
86	600406	国电南瑞	99,213	2,267,017.05	0.27
87	601668	中国建筑	509,700	2,212,098.00	0.27
88	000657	中钨高新	22,600	2,163,272.00	0.26
89	002436	兴森科技	42,000	2,139,900.00	0.26
90	601919	中远海控	155,000	2,055,300.00	0.25
91	002602	世纪华通	145,400	2,050,140.00	0.25
92	300760	迈瑞医疗	14,900	2,023,867.00	0.24
93	601988	中国银行	353,100	2,019,732.00	0.24
94	300054	鼎龙股份	18,900	2,002,833.00	0.24
95	600660	福耀玻璃	39,600	1,997,424.00	0.24
96	603501	豪威集团	21,000	1,991,850.00	0.24
97	601728	中国电信	383,100	1,988,289.00	0.24
98	601012	隆基绿能	149,600	1,962,752.00	0.24
99	601225	陕西煤业	95,700	1,947,495.00	0.24
100	002230	科大讯飞	47,300	1,931,732.00	0.23
101	600941	中国移动	22,400	1,929,312.00	0.23
102	600690	海尔智家	92,556	1,889,067.96	0.23
103	300757	罗博特科	3,000	1,857,000.00	0.22
104	002352	顺丰控股	59,300	1,853,718.00	0.22
105	002460	赣锋锂业	28,100	1,837,740.00	0.22
106	601985	中国核电	202,900	1,832,187.00	0.22
107	002938	鹏鼎控股	17,200	1,812,536.00	0.22
108	002709	天赐材料	35,200	1,810,336.00	0.22
109	603799	华友钴业	37,500	1,809,750.00	0.22
110	688777	中控技术	15,268	1,793,990.00	0.22
111	000977	浪潮信息	25,500	1,785,000.00	0.22
112	600160	巨化股份	33,300	1,765,233.00	0.21
113	300033	同花顺	7,280	1,754,480.00	0.21
114	300442	润泽科技	20,300	1,686,321.00	0.20
115	002851	麦格米特	9,900	1,655,082.00	0.20
116	000425	徐工机械	202,200	1,635,798.00	0.20
117	000938	紫光股份	56,500	1,630,590.00	0.20
118	002202	金风科技	68,000	1,625,200.00	0.20

119	688126	沪硅产业	40,700	1,623,523.00	0.20
120	601600	中国铝业	195,700	1,608,654.00	0.19
121	600938	中国海油	59,100	1,604,565.00	0.19
122	600028	中国石化	359,500	1,603,370.00	0.19
123	300567	精测电子	5,000	1,588,000.00	0.19
124	300346	南大光电	17,063	1,580,886.95	0.19
125	002466	天齐锂业	25,700	1,575,924.00	0.19
126	600460	士兰微	28,600	1,563,276.00	0.19
127	002600	领益智造	90,100	1,562,334.00	0.19
128	601766	中国中车	300,100	1,560,520.00	0.19
129	600050	中国联通	385,800	1,543,200.00	0.19
130	300661	圣邦股份	10,612	1,522,609.76	0.18
131	002837	英维克	18,920	1,505,275.20	0.18
132	002080	中材科技	16,600	1,494,000.00	0.18
133	002049	紫光国微	16,740	1,485,675.00	0.18
134	002185	华天科技	65,800	1,467,998.00	0.18
135	688002	睿创微纳	9,465	1,464,140.85	0.18
136	002138	顺络电子	20,000	1,462,000.00	0.18
137	601628	中国人寿	41,200	1,456,420.00	0.18
138	002179	中航光电	31,300	1,446,060.00	0.17
139	002407	多氟多	28,420	1,427,536.60	0.17
140	601100	恒立液压	13,183	1,417,963.48	0.17
141	000568	泸州老窖	18,200	1,410,864.00	0.17
142	601872	招商轮船	79,800	1,402,086.00	0.17
143	600879	航天电子	65,300	1,390,237.00	0.17
144	002241	歌尔股份	61,400	1,383,342.00	0.17
145	300395	菲利华	10,300	1,377,419.00	0.17
146	603288	海天味业	41,264	1,368,314.24	0.17
147	601006	大秦铁路	293,900	1,354,879.00	0.16
148	000408	藏格矿业	19,400	1,344,808.00	0.16
149	601658	邮储银行	272,200	1,341,946.00	0.16
150	300390	天华新能	14,300	1,337,193.00	0.16
151	605117	德业股份	12,548	1,332,346.64	0.16
152	688017	绿的谐波	3,156	1,318,766.16	0.16
153	688469	芯联集成	123,900	1,314,579.00	0.16
154	600905	三峡能源	352,500	1,307,775.00	0.16
155	688396	华润微	13,378	1,305,023.90	0.16
156	601888	中国中免	24,168	1,298,063.28	0.16
157	600489	中金黄金	71,700	1,294,185.00	0.16
158	002625	光启技术	42,636	1,292,723.52	0.16
159	000630	铜陵有色	198,400	1,261,824.00	0.15
160	688271	联影医疗	12,439	1,259,199.97	0.15
161	600893	航发动力	32,800	1,257,552.00	0.15

162	600673	东阳光	37,200	1,249,176.00	0.15
163	600010	包钢股份	557,700	1,243,671.00	0.15
164	601127	赛力斯	20,200	1,237,250.00	0.15
165	300058	蓝色光标	88,480	1,217,484.80	0.15
166	002273	水晶光电	34,300	1,216,964.00	0.15
167	601689	拓普集团	21,500	1,213,030.00	0.15
168	688111	金山办公	5,687	1,211,615.35	0.15
169	002027	分众传媒	249,500	1,207,580.00	0.15
170	300037	新宙邦	13,000	1,207,050.00	0.15
171	600118	中国卫星	14,600	1,197,930.00	0.14
172	300751	迈为股份	4,200	1,186,332.00	0.14
173	600019	宝钢股份	215,100	1,167,993.00	0.14
174	600760	中航沈飞	28,136	1,156,389.60	0.14
175	000426	兴业银锡	35,000	1,153,600.00	0.14
176	000807	云铝股份	51,300	1,135,782.00	0.14
177	601168	西部矿业	41,200	1,118,168.00	0.13
178	600362	江西铜业	25,800	1,117,140.00	0.13
179	600104	上汽集团	113,482	1,107,584.32	0.13
180	300450	先导智能	27,200	1,107,584.00	0.13
181	600989	宝丰能源	54,300	1,103,919.00	0.13
182	688099	晶晨股份	10,634	1,094,238.60	0.13
183	601727	上海电气	155,700	1,089,900.00	0.13
184	600875	东方电气	37,700	1,084,629.00	0.13
185	600988	赤峰黄金	41,100	1,081,752.00	0.13
186	002001	新 和 成	38,000	1,079,960.00	0.13
187	605589	圣泉集团	16,700	1,061,619.00	0.13
188	601390	中国中铁	252,700	1,053,759.00	0.13
189	600667	太极实业	36,100	1,053,398.00	0.13
190	002422	科伦药业	27,300	1,051,596.00	0.13
191	600885	宏发股份	30,462	1,050,634.38	0.13
192	002738	中矿资源	17,800	1,050,022.00	0.13
193	000538	云南白药	22,100	1,046,877.00	0.13
194	000960	锡业股份	24,500	1,045,905.00	0.13
195	002126	银轮股份	21,000	1,045,800.00	0.13
196	600547	山东黄金	44,700	1,032,123.00	0.12
197	600392	盛和资源	34,600	1,030,042.00	0.12
198	600795	国电电力	219,900	1,026,933.00	0.12
199	000831	中国稀土	18,400	1,021,016.00	0.12
200	600418	江淮汽车	39,000	1,007,370.00	0.12
201	600585	海螺水泥	59,300	1,005,135.00	0.12
202	601669	中国电建	212,600	999,220.00	0.12
203	002648	卫星化学	41,700	979,533.00	0.12
204	300316	晶盛机电	16,200	978,480.00	0.12

205	600141	兴发集团	20,800	976,976.00	0.12
206	002812	恩捷股份	14,500	970,195.00	0.12
207	002129	TCL 中环	79,925	960,698.50	0.12
208	600096	云天化	31,400	954,560.00	0.12
209	300015	爱尔眼科	115,045	950,271.70	0.11
210	601179	中国西电	63,400	945,928.00	0.11
211	301358	湖南裕能	12,400	940,788.00	0.11
212	600482	中国动力	28,201	924,992.80	0.11
213	600346	恒力石化	52,100	922,691.00	0.11
214	300782	卓胜微	8,420	922,663.60	0.11
215	601868	中国能建	345,200	921,684.00	0.11
216	002195	岩山科技	140,055	915,959.70	0.11
217	000066	中国长城	47,600	906,780.00	0.11
218	002558	巨人网络	32,800	903,968.00	0.11
219	600497	驰宏锌锗	74,600	903,406.00	0.11
220	600580	卧龙电驱	27,200	900,320.00	0.11
221	300418	昆仑万维	22,300	900,028.00	0.11
222	000625	长安汽车	122,600	879,042.00	0.11
223	600066	宇通客车	32,700	876,687.00	0.11
224	600426	华鲁恒升	36,600	875,472.00	0.11
225	600157	永泰能源	538,100	866,341.00	0.10
226	002532	天山铝业	80,000	858,400.00	0.10
227	600895	张江高科	23,000	856,750.00	0.10
228	600221	海航控股	634,000	855,900.00	0.10
229	000157	中联重科	122,400	853,128.00	0.10
230	600711	盛屯矿业	76,300	837,011.00	0.10
231	002340	格林美	125,800	831,538.00	0.10
232	605499	东鹏饮料	6,720	829,449.60	0.10
233	000933	神火股份	38,900	824,680.00	0.10
234	600011	华能国际	108,500	823,515.00	0.10
235	600048	保利发展	177,300	820,899.00	0.10
236	688036	传音控股	13,919	820,525.05	0.10
237	300803	指南针	8,900	815,863.00	0.10
238	600143	金发科技	52,700	814,215.00	0.10
239	600438	通威股份	66,500	805,315.00	0.10
240	002821	凯莱英	4,960	803,520.00	0.10
241	600436	片仔癀	7,350	803,208.00	0.10
242	300017	网宿科技	61,700	802,717.00	0.10
243	600115	中国东航	210,100	800,481.00	0.10
244	002236	大华股份	48,300	796,467.00	0.10
245	002493	荣盛石化	73,900	794,425.00	0.10
246	002131	利欧股份	167,000	793,250.00	0.10
247	600570	恒生电子	37,400	792,506.00	0.10

248	600886	国投电力	59,300	789,283.00	0.10
249	002456	欧菲光	82,975	784,943.50	0.09
250	600352	浙江龙盛	64,400	779,884.00	0.09
251	603659	璞泰来	26,500	766,645.00	0.09
252	601233	桐昆股份	35,200	762,080.00	0.09
253	688047	龙芯中科	4,918	760,667.06	0.09
254	003816	中国广核	194,200	759,322.00	0.09
255	300339	润和软件	19,700	758,647.00	0.09
256	601058	赛轮轮胎	65,100	750,603.00	0.09
257	601360	三六零	86,200	749,078.00	0.09
258	000301	东方盛虹	65,400	748,830.00	0.09
259	688213	思特威	6,992	748,633.44	0.09
260	300759	康龙化成	25,700	743,501.00	0.09
261	600026	中远海能	41,250	740,025.00	0.09
262	002074	国轩高科	26,900	740,019.00	0.09
263	688578	艾力斯	6,706	732,295.20	0.09
264	002555	三七互娱	38,300	722,721.00	0.09
265	688122	西部超导	11,486	721,435.66	0.09
266	688235	百济神州	2,803	713,671.83	0.09
267	300438	鹏辉能源	8,600	712,510.00	0.09
268	600009	上海机场	30,600	706,860.00	0.09
269	600196	复星医药	31,300	703,311.00	0.08
270	000768	中航西飞	34,300	702,464.00	0.08
271	000975	山金国际	41,100	698,700.00	0.08
272	002472	双环传动	16,800	697,368.00	0.08
273	601111	中国国航	115,000	695,750.00	0.08
274	300207	欣旺达	36,500	693,135.00	0.08
275	300001	特锐德	18,300	692,289.00	0.08
276	603129	春风动力	2,700	690,660.00	0.08
277	600029	南方航空	133,000	688,940.00	0.08
278	002517	恺英网络	42,300	687,375.00	0.08
279	600415	小商品城	67,600	686,816.00	0.08
280	002601	龙佰集团	41,300	680,624.00	0.08
281	600674	川投能源	48,000	680,160.00	0.08
282	300458	全志科技	17,200	678,712.00	0.08
283	600219	南山铝业	170,000	678,300.00	0.08
284	601186	中国铁建	113,600	675,920.00	0.08
285	002128	电投能源	29,100	672,792.00	0.08
286	601877	正泰电器	26,700	669,369.00	0.08
287	600233	圆通速递	42,300	666,225.00	0.08
288	002595	豪迈科技	14,270	664,982.00	0.08
289	601117	中国化学	90,400	664,440.00	0.08
290	300115	长盈精密	23,500	656,590.00	0.08

291	301236	软通动力	15,300	649,485.00	0.08
292	002155	湖南黄金	27,200	649,264.00	0.08
293	600372	中航机载	59,800	648,830.00	0.08
294	600839	四川长虹	91,100	635,878.00	0.08
295	300454	深信服	6,500	625,300.00	0.08
296	002465	海格通信	48,900	624,453.00	0.08
297	300568	星源材质	33,200	621,504.00	0.08
298	688506	百利天恒	2,103	618,345.09	0.07
299	000963	华东医药	21,700	610,204.00	0.07
300	300347	泰格医药	12,700	609,600.00	0.07
301	603650	彤程新材	6,200	607,476.00	0.07
302	600741	华域汽车	39,000	605,280.00	0.07
303	000547	航天发展	31,500	603,225.00	0.07
304	300024	机器人	30,800	595,364.00	0.07
305	002130	沃尔核材	31,000	587,760.00	0.07
306	002920	德赛西威	7,200	586,800.00	0.07
307	300012	华测检测	41,600	576,576.00	0.07
308	002497	雅化集团	28,300	576,471.00	0.07
309	688676	金盘科技	6,800	575,552.00	0.07
310	688331	荣昌生物	4,400	573,144.00	0.07
311	001979	招商蛇口	88,900	571,627.00	0.07
312	000878	云南铜业	35,900	570,092.00	0.07
313	300866	安克创新	5,441	568,584.50	0.07
314	300083	创世纪	41,200	561,144.00	0.07
315	002414	高德红外	42,300	560,898.00	0.07
316	000034	神州数码	20,140	558,885.00	0.07
317	002432	九安医疗	7,900	558,372.00	0.07
318	002271	东方雨虹	47,000	557,890.00	0.07
319	300496	中科创达	9,000	556,110.00	0.07
320	002444	巨星科技	17,700	550,470.00	0.07
321	601021	春秋航空	12,042	548,874.36	0.07
322	300763	锦浪科技	6,000	542,100.00	0.07
323	300474	景嘉微	8,900	538,272.00	0.06
324	000733	振华科技	9,500	538,080.00	0.06
325	603979	金诚信	9,100	537,173.00	0.06
326	601319	中国人保	78,900	533,364.00	0.06
327	688266	泽璟制药	4,555	531,386.30	0.06
328	000661	长春高新	7,912	526,939.20	0.06
329	002025	航天电器	6,900	525,918.00	0.06
330	600699	均胜电子	24,200	522,962.00	0.06
331	300748	金力永磁	16,900	521,365.00	0.06
332	002756	永兴材料	9,200	521,088.00	0.06
333	601615	明阳智能	44,800	518,336.00	0.06

334	002078	太阳纸业	41,500	518,335.00	0.06
335	300073	当升科技	10,700	514,028.00	0.06
336	300142	沃森生物	39,500	513,105.00	0.06
337	300432	富临精工	25,500	512,295.00	0.06
338	601677	明泰铝业	30,600	507,960.00	0.06
339	603606	东方电缆	12,220	507,252.20	0.06
340	600039	四川路桥	64,524	504,577.68	0.06
341	300919	中伟新材	11,500	503,125.00	0.06
342	000423	东阿阿胶	11,066	501,953.76	0.06
343	601800	中国交建	87,700	500,767.00	0.06
344	000002	万　科A	167,900	496,984.00	0.06
345	002252	上海莱士	113,900	494,326.00	0.06
346	300724	捷佳伟创	7,000	494,200.00	0.06
347	603087	甘李药业	8,700	493,812.00	0.06
348	600226	亨通股份	51,300	491,967.00	0.06
349	688608	恒玄科技	2,931	490,033.89	0.06
350	688599	天合光能	34,700	489,964.00	0.06
351	688169	石头科技	5,153	489,380.41	0.06
352	688223	晶科能源	101,500	482,125.00	0.06
353	002064	华峰化学	48,900	464,061.00	0.06
354	600588	用友网络	50,500	463,590.00	0.06
355	601633	长城汽车	30,700	463,263.00	0.06
356	688390	固德威	4,262	462,469.62	0.06
357	001965	招商公路	50,200	459,832.00	0.06
358	000786	北新建材	25,300	457,677.00	0.06
359	002831	裕同科技	12,700	451,612.00	0.05
360	300677	英科医疗	11,200	438,704.00	0.05
361	002294	信立泰	13,700	436,893.00	0.05
362	688180	君实生物	12,900	436,278.00	0.05
363	000519	中兵红箭	20,700	436,149.00	0.05
364	603806	福斯特	25,900	434,861.00	0.05
365	300972	万辰集团	2,500	433,525.00	0.05
366	601618	中国中冶	176,300	430,172.00	0.05
367	600177	雅戈尔	57,100	429,963.00	0.05
368	600516	方大炭素	69,500	428,815.00	0.05
369	688188	柏楚电子	4,012	428,080.40	0.05
370	601607	上海医药	27,740	427,196.00	0.05
371	688065	凯赛生物	8,900	425,865.00	0.05
372	002176	江特电机	42,200	422,422.00	0.05
373	000623	吉林敖东	23,700	420,201.00	0.05
374	300558	贝达药业	6,400	416,448.00	0.05
375	603260	合盛硅业	8,600	415,036.00	0.05
376	302132	中航成飞	7,100	414,072.00	0.05

377	000617	中油资本	62,500	411,875.00	0.05
378	300699	光威复材	14,300	409,695.00	0.05
379	002085	万丰奥威	36,700	407,003.00	0.05
380	002318	久立特材	16,900	403,910.00	0.05
381	300832	新产业	9,600	403,200.00	0.05
382	300251	光线传媒	36,200	401,458.00	0.05
383	002459	晶澳科技	48,900	396,090.00	0.05
384	002065	东华软件	55,400	395,556.00	0.05
385	301550	斯菱智驱	4,300	393,149.00	0.05
386	002266	浙富控股	77,350	391,391.00	0.05
387	600085	同仁堂	16,900	390,559.00	0.05
388	600499	科达制造	28,300	390,540.00	0.05
389	300342	天银机电	8,300	390,100.00	0.05
390	688472	阿特斯	35,937	388,838.34	0.05
391	002044	美年健康	77,300	388,819.00	0.05
392	300409	道氏技术	19,400	386,642.00	0.05
393	600515	海南机场	141,100	386,614.00	0.05
394	605090	九丰能源	10,400	386,568.00	0.05
395	603596	伯特利	15,532	385,814.88	0.05
396	688617	惠泰医疗	2,121	385,088.76	0.05
397	688005	容百科技	12,560	384,336.00	0.05
398	000400	许继电气	17,600	381,920.00	0.05
399	002223	鱼跃医疗	14,800	379,768.00	0.05
400	002405	四维图新	58,600	379,142.00	0.05
401	300003	乐普医疗	31,800	376,830.00	0.05
402	600521	华海药业	26,000	374,400.00	0.05
403	000032	深桑达A	15,000	374,250.00	0.05
404	600862	中航高科	20,700	373,221.00	0.05
405	000415	渤海租赁	91,500	372,405.00	0.04
406	601216	君正集团	83,400	371,964.00	0.04
407	000683	博源化工	64,372	370,782.72	0.04
408	000039	中集集团	45,600	369,816.00	0.04
409	000999	华润三九	16,390	368,611.10	0.04
410	600803	新奥股份	23,000	363,400.00	0.04
411	600704	物产中大	76,636	361,721.92	0.04
412	603766	隆鑫通用	30,300	361,479.00	0.04
413	603605	珀莱雅	6,000	359,520.00	0.04
414	600312	平高电气	20,200	356,732.00	0.04
415	600018	上港集团	74,700	352,584.00	0.04
416	688116	天奈科技	9,200	351,440.00	0.04
417	000887	中鼎股份	19,500	348,855.00	0.04
418	600765	中航重机	27,000	348,840.00	0.04
419	600332	白云山	17,400	348,696.00	0.04

420	000967	盈峰环境	33,100	348,543.00	0.04
421	300122	智飞生物	29,400	343,686.00	0.04
422	600166	福田汽车	117,300	341,343.00	0.04
423	600153	建发股份	43,000	340,990.00	0.04
424	000830	鲁西化工	28,100	337,200.00	0.04
425	002410	广联达	40,800	332,928.00	0.04
426	002007	华兰生物	27,200	331,568.00	0.04
427	300896	爱美客	3,800	331,360.00	0.04
428	600323	瀚蓝环境	12,046	330,783.16	0.04
429	601799	星宇股份	3,600	326,232.00	0.04
430	688114	华大智造	6,200	316,696.00	0.04
431	603568	伟明环保	20,360	313,136.80	0.04
432	600486	扬农化工	6,150	311,805.00	0.04
433	002603	以岭药业	20,700	310,500.00	0.04
434	600398	海澜之家	59,300	310,139.00	0.04
435	688009	中国通号	64,000	304,640.00	0.04
436	601000	唐山港	73,100	303,365.00	0.04
437	600529	山东药玻	16,400	302,580.00	0.04
438	601018	宁波港	96,000	302,400.00	0.04
439	002389	航天彩虹	17,000	302,090.00	0.04
440	603486	科沃斯	5,900	299,425.00	0.04
441	600208	衢州发展	104,900	296,867.00	0.04
442	000738	航发控制	16,200	296,298.00	0.04
443	600008	首创环保	108,600	295,392.00	0.04
444	000932	华菱钢铁	84,700	293,909.00	0.04
445	600316	洪都航空	10,500	293,370.00	0.04
446	600998	九州通	62,300	292,187.00	0.04
447	600170	上海建工	131,600	292,152.00	0.04
448	600161	天坛生物	24,500	283,710.00	0.03
449	600820	隧道股份	54,300	282,903.00	0.03
450	300118	东方日升	22,600	281,370.00	0.03
451	603885	吉祥航空	27,100	278,859.00	0.03
452	601238	广汽集团	54,700	277,876.00	0.03
453	002607	中公教育	152,200	273,960.00	0.03
454	688303	大全能源	15,539	270,844.77	0.03
455	603816	顾家家居	12,100	270,556.00	0.03
456	603939	益丰药房	14,896	267,830.08	0.03
457	688166	博瑞医药	7,500	262,575.00	0.03
458	300049	福瑞医科	6,700	260,496.00	0.03
459	600763	通策医疗	7,643	258,944.84	0.03
460	601567	三星电气	17,300	258,462.00	0.03
461	300573	兴齐眼药	6,314	257,358.64	0.03
462	600038	中直股份	10,000	252,900.00	0.03

463	601880	辽港股份	181,600	250,608.00	0.03
464	603392	万泰生物	9,260	249,742.20	0.03
465	300676	华大基因	7,100	248,926.00	0.03
466	600535	天士力	18,500	244,755.00	0.03
467	600511	国药股份	9,200	239,568.00	0.03
468	600816	建元信托	97,200	237,168.00	0.03
469	002244	滨江集团	30,600	232,560.00	0.03
470	300100	双林股份	8,300	230,574.00	0.03
471	601155	新城控股	22,400	229,824.00	0.03
472	000833	粤桂股份	9,800	229,516.00	0.03
473	688063	派能科技	4,300	229,061.00	0.03
474	002120	韵达股份	35,800	227,688.00	0.03
475	300144	宋城演艺	38,900	226,009.00	0.03
476	000998	隆平高科	28,900	217,906.00	0.03
477	002544	普天科技	11,700	213,174.00	0.03
478	601866	中远海发	96,300	212,823.00	0.03
479	600064	南京高科	29,800	212,474.00	0.03
480	600635	大众公用	47,600	203,728.00	0.02
481	600754	锦江酒店	11,200	201,488.00	0.02
482	000035	中国天楹	41,300	199,479.00	0.02
483	300457	赢合科技	9,400	198,152.00	0.02
484	600655	豫园股份	47,900	196,869.00	0.02
485	300601	康泰生物	16,500	187,110.00	0.02
486	600004	白云机场	25,600	185,856.00	0.02
487	603899	晨光股份	8,900	183,607.00	0.02
488	600663	陆家嘴	29,000	182,120.00	0.02
489	600258	首旅酒店	16,500	180,180.00	0.02
490	600859	王府井	19,500	179,010.00	0.02
491	002091	江苏国泰	24,200	174,966.00	0.02
492	300070	碧水源	53,600	170,984.00	0.02
493	000069	华侨城 A	99,300	162,852.00	0.02
494	600864	哈投股份	30,700	159,333.00	0.02
495	301078	孩子王	21,900	148,044.00	0.02
496	002292	奥飞娱乐	22,000	144,320.00	0.02
497	603833	欧派家居	4,600	138,506.00	0.02
498	002891	中宠股份	4,900	130,928.00	0.02
499	600325	华发股份	54,300	125,433.00	0.02
500	002572	索菲亚	14,200	103,660.00	0.01

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	301666	大普微	1,220	565,262.60	0.07
2	001248	华润新能源	44,631	451,219.41	0.05

3	688808	联讯仪器	163	258,245.79	0.03
4	688820	盛合晶微	1,694	239,684.06	0.03
5	001399	惠科股份	4,885	135,461.05	0.02
6	688818	电科蓝天	1,717	120,430.38	0.01
7	301682	宏明电子	714	114,282.84	0.01
8	688797	臻宝科技	207	97,014.69	0.01
9	688785	恒运昌	116	53,725.40	0.01
10	688813	泰金新能	234	40,269.06	0.00
11	688635	长进光子	128	39,448.32	0.00
12	001257	盛龙股份	1,743	36,149.82	0.00
13	603459	红板科技	330	27,825.60	0.00
14	001365	天海电子	719	22,511.89	0.00
15	688811	有研复材	834	20,124.42	0.00
16	301696	三瑞智能	216	18,748.80	0.00
17	001237	惠康科技	285	16,740.90	0.00
18	301669	高特电子	546	15,506.40	0.00
19	301687	新广益	195	15,167.10	0.00
20	001393	维通利	387	15,089.13	0.00
21	301531	春光集团	290	14,952.40	0.00
22	301599	理奇智能	433	14,059.51	0.00
23	601112	振石股份	775	13,632.25	0.00
24	301680	固德电材	117	13,122.72	0.00
25	301683	慧谷新材	96	11,689.92	0.00
26	688781	视涯科技	217	10,331.37	0.00
27	688816	易思维	177	10,106.70	0.00
28	688712	北芯生命	234	8,405.28	0.00
29	301513	尚水智能	138	7,032.48	0.00
30	603435	嘉德利	104	4,857.84	0.00
31	603352	至信股份	112	2,858.24	0.00
32	603293	埃泰克	72	2,442.96	0.00
33	001312	福恩股份	134	2,248.52	0.00
34	603284	林平发展	46	1,604.02	0.00
35	001220	世盟股份	57	1,583.46	0.00

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 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	600519	贵州茅台	28,186,423.00	1.68
2	688041	海光信息	13,791,182.27	0.82
3	601318	中国平安	13,641,833.00	0.81
4	601899	紫金矿业	11,433,356.00	0.68
5	600036	招商银行	9,620,301.00	0.57

6	002371	北方华创	7,844,182.00	0.47
7	300750	宁德时代	7,359,116.93	0.44
8	688008	澜起科技	7,311,366.57	0.44
9	688981	中芯国际	6,873,859.25	0.41
10	601166	兴业银行	6,690,862.00	0.40
11	600900	长江电力	6,336,339.00	0.38
12	603986	兆易创新	5,803,356.00	0.35
13	600030	中信证券	5,494,646.40	0.33
14	600436	片仔癀	5,353,614.75	0.32
15	600276	恒瑞医药	5,283,860.00	0.32
16	601398	工商银行	4,744,598.00	0.28
17	300394	天孚通信	4,574,678.00	0.27
18	601211	国泰海通	4,449,154.00	0.27
19	603259	药明康德	4,392,639.00	0.26
20	600309	万华化学	4,313,399.00	0.26

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

7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	600519	贵州茅台	56,675,680.94	3.38
2	601318	中国平安	34,008,567.00	2.03
3	601899	紫金矿业	30,547,262.00	1.82
4	600036	招商银行	24,948,582.50	1.49
5	688041	海光信息	22,248,786.53	1.33
6	600900	长江电力	16,987,315.00	1.01
7	601166	兴业银行	16,770,533.25	1.00
8	688981	中芯国际	14,459,624.17	0.86
9	688008	澜起科技	14,271,290.41	0.85
10	600030	中信证券	13,962,188.70	0.83
11	603986	兆易创新	13,692,668.69	0.82
12	600276	恒瑞医药	13,353,331.55	0.80
13	603259	药明康德	12,822,634.43	0.77
14	688256	寒武纪	12,760,983.64	0.76
15	601398	工商银行	12,447,275.00	0.74
16	300308	中际旭创	11,984,722.00	0.72
17	601211	国泰海通	10,990,290.20	0.66
18	688012	中微公司	10,890,910.28	0.65
19	601288	农业银行	10,152,290.00	0.61
20	603993	洛阳钼业	10,001,099.00	0.60

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

7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	550,653,682.87
卖出股票收入（成交）总额	1,018,979,153.29

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

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	96,002.71	0.01
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	96,002.71	0.01

7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	111025	圣泉转债	520	52,000.68	0.01
2	113704	春风转债	440	44,002.03	0.01

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招商银行的发行主体招商银行股份有限公司于 2025 年 9 月 12 日因数据安全管理不到位等受到国家金融监督管理总局处罚；于 2026 年 7 月 17 日因部分机构未纳入并表管理范围、未从银行集团层面对同一客户统一授信等受到国家金融监督管理总局处罚。招商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	-
2	应收清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	60,492.63
8	其他	-
9	合计	60,492.63

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

无。

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

7.12.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

无。

7.12.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值	占基金资产净值比例（%）	流通受限情况说明
1	301666	大普微	565,262.60	0.07	新股锁定
2	001248	华润新能源	451,219.41	0.05	新股未上市
3	688808	联讯仪器	258,245.79	0.03	新股锁定

4	688820	盛合晶微	239,684.06	0.03	新股锁定
5	001399	惠科股份	135,461.05	0.02	新股锁定

7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入原因，分项之和与合计可能有尾差。

§8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

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		招商银行股份有限公司－大成中证 A500 指数型发起式证券投资基金	
		持有份额	占总份额比例（%）	持有份额	占总份额比例（%）	持有份额	占总份额比例（%）
1,714	335,534.67	151,508,678.00	26.34	42,425,235.00	7.38	381,172,507.00	66.28

注：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

无。

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	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	0
本基金基金经理持有本开放式基金	0

§9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2024 年 11 月 22 日）基金份额总额	2,000,106,420.00
本报告期期初基金份额总额	1,319,106,420.00
本报告期基金总申购份额	417,000,000.00
减：本报告期基金总赎回份额	1,161,000,000.00
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	575,106,420.00

§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

本报告期内，基金托管人无重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内无涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

10.4 基金投资策略的改变

本基金投资策略在本报告期内没有重大改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金自基金合同生效日起聘请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。

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

本报告期内，基金托管人没有受到监管部门调查或处罚。

10.6.4 托管人相关从业人员受调查或处罚等情况

本报告期内，基金托管人相关从业人员没有受到监管部门调查或处罚。

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(%)	
长江证券	4	1,566,756,251.89	100.00	307,087.75	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。

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	大成中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金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	关于大成基金旗下部分交易型开放式指数证券投资基金增加国盛证券股份有限公司为申购赎回代办证券公司的公告	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 01 日
3	关于大成基金旗下部分交易型开放式指数证券投资基金增加西部证券股份有限公司为申购赎回代办证券公司的公告	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 01 日

4	2025 年度公募基金管理人以股东身份（通过公募基金持股）参与股东大会投票信息披露	中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站	2026 年 04 月 30 日
5	大成中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金 2026 年第 1 季度报告	中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站	2026 年 04 月 22 日
6	大成基金管理有限公司旗下 212 只公募基金 2026 年第 1 季度报告提示性公告	规定报刊	2026 年 04 月 22 日
7	关于大成基金旗下部分交易型开放式指数证券投资基金增加西南证券股份有限公司为申购赎回代办证券公司的公告	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 20 日
8	关于大成基金旗下部分交易型开放式指数证券投资基金增加粤开证券股份有限公司为申购赎回代办证券公司的公告	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 20 日
9	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
10	大成中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金 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
11	关于大成基金旗下部分交易型开放式指数证券投资基金增加德邦证券股份有限公司为申购赎回代办证券公司的公告	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 03 月 27 日
12	大成基金管理有限公司旗下部分 ETF 基金新增瑞银证券有限责任公司为申购赎回代办证券公司的公告	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 03 月 10 日
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	大成中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金 2025 年第 4 季度报告	中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站	2026 年 01 月 22 日
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
17	大成中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金基金产品资料概要更新	中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站	2026 年 01 月 05 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

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过 20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比（%）
机构	1	20260101-20260114	339,894,416.00	-	339,894,416.00	-	-
目标基金的联接基金	1	20260101-20260630	566,245,307.00	283,218,000.00	468,290,800.00	381,172,507.00	66.28
产品特有风险							
当基金份额持有人占比过于集中时，可能会因某单一基金份额持有人大额赎回而引发基金净值剧烈波动的风险，甚至有可能引起基金的流动性风险，基金管理人可能无法及时变现基金资产以应对基金份额持有人的赎回申请，基金份额持有人可能无法及时赎回持有的全部基金份额。							

11.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

1、中国证监会批准设立大成中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金的文件；

2、《大成中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》；

3、《大成中证 A500 交易型开放式指数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。

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