

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  
2025 年第 3 季度报告

2025 年 9 月 30 日

基金管理人：大成基金管理有限公司

基金托管人：华泰证券股份有限公司

报告送出日期：2025 年 10 月 28 日

§1 重要提示

基金管理人的董事会及董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带责任。

基金托管人华泰证券股份有限公司根据本基金合同规定，于 2025 年 10 月 27 日复核了本报告中的财务指标、净值表现和投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利。基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。

本报告中财务资料未经审计。  
本报告期自 2025 年 07 月 01 日起至 09 月 30 日止。

§2 基金产品概况

|            |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                        |
|------------|------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
| 基金简称       | 大成中证全指自由现金流 ETF                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                        |
| 场内简称       | 中证现金流 ETF                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                              |
| 基金主代码      | 159235                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                 |
| 交易代码       | 159235                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                 |
| 基金运作方式     | 交易型开放式                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                 |
| 基金合同生效日    | 2025 年 4 月 23 日                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                        |
| 报告期末基金份额总额 | 969,729,545.00 份                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                       |
| 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       | <p>（一）股票投资策略</p> <p>本基金为完全被动式指数基金，采用完全复制法，即按照成份股在标的指数中的基准权重来构建指数化投资组合，并根据标的指数成份股及其权重的变化进行相应调整。当预期指数成份股发生调整和成份股发生配股、增发、分红等行为时，或因基金的申购和赎回等对本基金跟踪标的指数的效果可能带来影响时，或因某些特殊情况导致流动性不足时，或其他原因导致无法有效复制和跟踪标的指数时，基金管理人可以对投资组合管理进行适当变通和调整，从而使得投资组合紧密地跟踪标的指数。</p> <p>如果标的指数成份股发生明显负面事件面临退市风险，且指数编制机构暂未作出调整的，基金管理人应当按照基金份额持有人利益优先原则，履行内部决策程序后及时对相关成份股进行调整。</p> <p>在正常市场情况下，本基金的风险控制目标是追求日均跟踪偏离度的绝对值争取不超过 0.2%，年跟踪误差争取不超过 2%。如因标的指数</p> |

|        |                                                                                                                                                          |
|--------|----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
|        | 编制规则调整等其他原因，导致基金跟踪偏离度和跟踪误差超过了上述范围，基金管理人应采取合理措施，避免跟踪偏离度和跟踪误差的进一步扩大。<br>(二) 衍生金融产品投资策略<br>(三) 债券投资策略<br>(四) 资产支持证券投资策略<br>(五) 融资及转融通证券出借策略<br>(六) 存托凭证投资策略 |
| 业绩比较基准 | 中证全指自由现金流指数收益率                                                                                                                                           |
| 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。<br>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，跟踪中证全指自由现金流指数，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。                                |
| 基金管理人  | 大成基金管理有限公司                                                                                                                                               |
| 基金托管人  | 华泰证券股份有限公司                                                                                                                                               |

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位：人民币元

| 主要财务指标          | 报告期（2025 年 7 月 1 日-2025 年 9 月 30 日） |
|-----------------|-------------------------------------|
| 1. 本期已实现收益      | 59,560,799.32                       |
| 2. 本期利润         | 80,720,599.92                       |
| 3. 加权平均基金份额本期利润 | 0.1123                              |
| 4. 期末基金资产净值     | 1,133,111,825.53                    |
| 5. 期末基金份额净值     | 1.1685                              |

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

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

3.2 基金净值表现

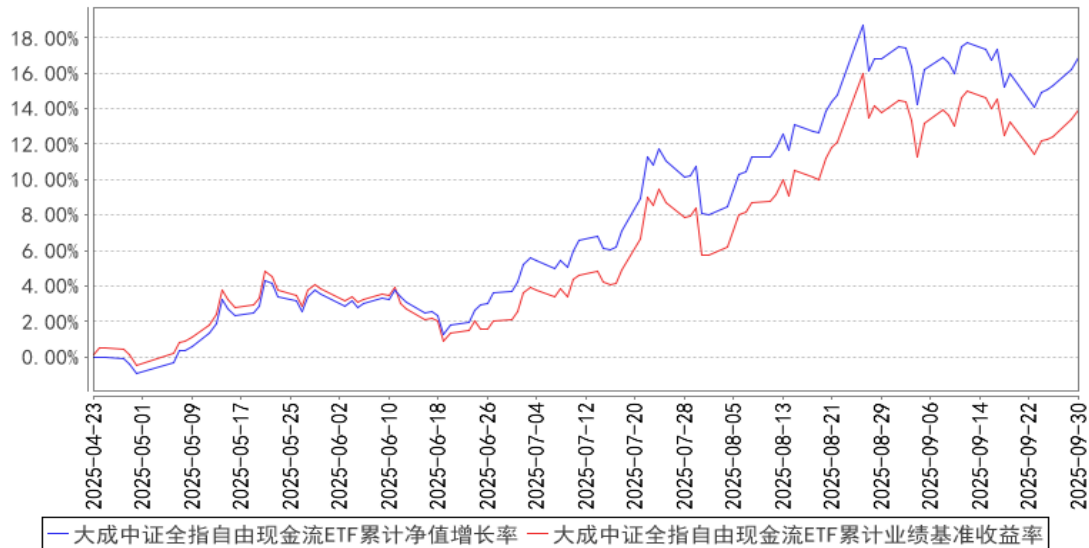
3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

| 阶段    | 净值增长率<br>① | 净值增长率<br>标准差② | 业绩比较基<br>准收益率③ | 业绩比较基<br>准收益率标<br>准差④ | ①—③   | ②—④   |
|-------|------------|---------------|----------------|-----------------------|-------|-------|
| 过去三个月 | 12.67%     | 0.91%         | 11.60%         | 0.91%                 | 1.07% | 0.00% |

|                |        |       |        |       |       |        |
|----------------|--------|-------|--------|-------|-------|--------|
| 自基金合同<br>生效起至今 | 16.85% | 0.77% | 13.95% | 0.78% | 2.90% | -0.01% |
|----------------|--------|-------|--------|-------|-------|--------|

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

大成中证全指自由现金流ETF累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：1、本基金合同生效日为 2025 年 4 月 23 日，截止报告期末本基金合同生效未满一年。

2、本基金合同规定，本基金自基金合同生效之日起六个月内为建仓期。截至报告期末，本基金处于建仓期。

## §4 管理人报告

### 4.1 基金经理（或基金经理小组）简介

| 姓名 | 职务      | 任本基金的基金经理期限     |      | 证券从业年限 | 说明                                                                                                                                                                                                                                                |
|----|---------|-----------------|------|--------|---------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
|    |         | 任职日期            | 离任日期 |        |                                                                                                                                                                                                                                                   |
| 刘淼 | 本基金基金经理 | 2025 年 4 月 23 日 | —    | 17 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 |

|  |  |  |  |  |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                 |
|--|--|--|--|--|---------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
|  |  |  |  |  | <p>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 日起任深证成长 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 日起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</p> |
|--|--|--|--|--|---------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|

|  |  |  |  |  |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                            |
|--|--|--|--|--|------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
|  |  |  |  |  | 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(更名前为大成中证 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 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。

4.1.1 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理同时管理的产品情况

无。

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

4.3 公平交易专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

报告期内，公司严格执行了公平交易的原则和制度。公司运用统计分析方法和工具，对旗下所有投资组合连续 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。公司旗下所有投资组合参与的交易所公开竞价交易中，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的 5% 的交易共 1 次，为完全按照指数的构成比例进行投资的组合和其他组合发生的反向交易。投资组合间相邻交易日反向交易的市场成交比例、成交均价等交易结果数据表明该类交易不对市场产生重大影响，无异常。

#### 4.4 报告期内基金的投资策略和运作分析

三季度，A 股市场一路上扬，主要指数均有亮眼的表现。收益方面，沪深 300 涨 17.9%；中证 500 涨 25.31%；中证 1000 涨 19.17%；创业板指涨 50.40%；科创 50 涨 49.02%。行业上，通信、电子和有色金属涨幅较高；综合金融和银行是唯二录得负收益的行业。风格上，成长相对占优。报告期内，市场在宏观层面支撑不强的背景下持续超预期上涨，全 A 股票成交额中枢不断上台阶。整体看，流动性与风险偏好驱动了三季度市场表现。除此之外，海外科技板块上涨和“反内卷”政策也都对行情有所加持。这样的环境相对更利好流动性敏感的风格或板块，同时趋势力量得到强化，投资主线始终围绕成长风格、科技板块展开。阶段表现上，7、8 月份，市场热情逐渐升温，增量资金在上涨中保持净流入，偶有回调均呈现幅度小、时间短的特征，市场上行预期逐渐趋于一致。进入九月后，指数波动略有放大。A 股在第一周连续调整，但幅度不算大，拥挤度压力得到一定程度的缓解。月中，市场反弹并创阶段新高后进入整固期。不过，与此前不同的是，七八月领涨的人工智能板块在大盘突破前高时并未跟上节奏，且主题内部的强势细分发生切换；电池相关指数受益“反内卷”政策和技术进步等强势领涨。在中下旬震荡上行过程中，市场分歧逐渐累加。

本基金标的指数为中证全指自由现金流指数。中证全指自由现金流指数选取 100 只自由现金流率较高的上市公司证券作为指数样本，以反映现金流创造能力较强的上市公司证券的整体表现。本基金采取完全复制法进行投资，即原则上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而进行相应调整。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。

#### 4.5 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 1.1685 元；本报告期基金份额净值增长率为 12.67%，业绩比较基准收益率为 11.60%。

#### 4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

无。

### §5 投资组合报告

#### 5.1 报告期末基金资产组合情况

| 序号 | 项目                | 金额（元）            | 占基金总资产的比例（%） |
|----|-------------------|------------------|--------------|
| 1  | 权益投资              | 1,123,392,318.86 | 99.11        |
|    | 其中：股票             | 1,123,392,318.86 | 99.11        |
| 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      | 10,075,391.36    | 0.89         |
| 8  | 其他资产              | 42,317.56        | 0.00         |
| 9  | 合计                | 1,133,510,027.78 | 100.00       |

注：上述股票投资金额包括可退替代款估值增值（如有）。

#### 5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

##### 5.2.1 报告期末指数投资按行业分类的境内股票投资组合

| 代码 | 行业类别             | 公允价值（元）        | 占基金资产净值比例（%） |
|----|------------------|----------------|--------------|
| A  | 农、林、牧、渔业         | 896,662.00     | 0.08         |
| B  | 采矿业              | 207,110,794.50 | 18.28        |
| C  | 制造业              | 703,201,241.92 | 62.06        |
| D  | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | 4,358,996.00   | 0.38         |
| E  | 建筑业              | —              | —            |
| F  | 批发和零售业           | 26,080,534.00  | 2.30         |
| G  | 交通运输、仓储和邮政业      | 169,632,001.13 | 14.97        |
| H  | 住宿和餐饮业           | 4,492,080.00   | 0.40         |
| I  | 信息传输、软件和信息技术服    | 1,328,040.00   | 0.12         |

|   |               |                  |       |
|---|---------------|------------------|-------|
|   | 务业            |                  |       |
| J | 金融业           | -                | -     |
| K | 房地产业          | -                | -     |
| L | 租赁和商务服务业      | 2,521,090.00     | 0.22  |
| 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     | 3,473,612.00     | 0.31  |
| S | 综合            | -                | -     |
|   | 合计            | 1,123,095,051.55 | 99.12 |

### 5.2.2 报告期末积极投资按行业分类的境内股票投资组合

| 代码 | 行业类别             | 公允价值（元）    | 占基金资产净值比例（%） |
|----|------------------|------------|--------------|
| A  | 农、林、牧、渔业         | -          | -            |
| B  | 采矿业              | -          | -            |
| C  | 制造业              | 265,410.68 | 0.02         |
| D  | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | -          | -            |
| E  | 建筑业              | -          | -            |
| F  | 批发和零售业           | 18,627.99  | 0.00         |
| G  | 交通运输、仓储和邮政业      | -          | -            |
| H  | 住宿和餐饮业           | -          | -            |
| I  | 信息传输、软件和信息技术服务业  | -          | -            |
| J  | 金融业              | -          | -            |
| K  | 房地产业             | -          | -            |
| L  | 租赁和商务服务业         | -          | -            |
| M  | 科学研究和技术服务业       | 13,408.64  | 0.00         |
| 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               | 297,447.31 | 0.03         |

### 5.2.3 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

无。

## 5.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的股票投资明细

### 5.3.1 报告期末指数投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投

### 资明细

| 序号 | 股票代码   | 股票名称   | 数量（股）     | 公允价值（元）        | 占基金资产净值比例（%） |
|----|--------|--------|-----------|----------------|--------------|
| 1  | 600938 | 中国海油   | 4,324,050 | 112,987,426.50 | 9.97         |
| 2  | 000333 | 美的集团   | 1,207,700 | 87,751,482.00  | 7.74         |
| 3  | 000651 | 格力电器   | 1,984,600 | 78,828,312.00  | 6.96         |
| 4  | 000858 | 五粮液    | 618,300   | 75,111,084.00  | 6.63         |
| 5  | 601919 | 中远海控   | 5,187,310 | 74,386,025.40  | 6.56         |
| 6  | 603993 | 洛阳钼业   | 3,701,400 | 58,111,980.00  | 5.13         |
| 7  | 000100 | TCL 科技 | 9,112,300 | 39,274,013.00  | 3.47         |
| 8  | 601600 | 中国铝业   | 4,624,700 | 38,107,528.00  | 3.36         |
| 9  | 002352 | 顺丰控股   | 878,981   | 35,449,303.73  | 3.13         |
| 10 | 601225 | 陕西煤业   | 1,617,300 | 32,346,000.00  | 2.85         |

### 5.3.2 报告期末积极投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名股票投

#### 资明细

| 序号 | 股票代码   | 股票名称 | 数量（股） | 公允价值（元）    | 占基金资产净值比例（%） |
|----|--------|------|-------|------------|--------------|
| 1  | 301656 | 联合动力 | 6,286 | 156,898.56 | 0.01         |
| 2  | 301575 | 艾芬达  | 1,252 | 67,516.20  | 0.01         |
| 3  | 301632 | 广东建科 | 656   | 13,408.64  | 0.00         |
| 4  | 301491 | 汉桑科技 | 245   | 13,305.95  | 0.00         |
| 5  | 301563 | 云汉芯城 | 110   | 9,388.50   | 0.00         |

### 5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

无。

### 5.5 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

无。

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

#### 明细

无。

### 5.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

无。

### 5.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

无。

### 5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

无。

5.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

无。

5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.10.1 本期国债期货投资政策

无。

5.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

无。

5.10.3 本期国债期货投资评价

无。

5.11 投资组合报告附注

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

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

5.11.2 基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库

本基金投资的前十名股票未超出基金合同规定的备选股票库。

5.11.3 其他资产构成

| 序号 | 名称      | 金额（元）     |
|----|---------|-----------|
| 1  | 存出保证金   | -         |
| 2  | 应收证券清算款 | 1,407.82  |
| 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    | 40,909.74 |
| 8  | 其他      | -         |
| 9  | 合计      | 42,317.56 |

5.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

无。

5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

5.11.5.1 报告期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

无。

5.11.5.2 报告期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

| 序号 | 股票代码   | 股票名称 | 流通受限部分的公允价值（元） | 占基金资产净值比例（%） | 流通受限情况说明 |
|----|--------|------|----------------|--------------|----------|
| 1  | 301656 | 联合动力 | 156,898.56     | 0.01         | 新股锁定     |
| 2  | 301632 | 广东建科 | 13,408.64      | 0.00         | 新股锁定     |
| 3  | 301491 | 汉桑科技 | 13,305.95      | 0.00         | 新股锁定     |
| 4  | 301563 | 云汉芯城 | 9,388.50       | 0.00         | 新股锁定     |
| 5  | 301575 | 艾芬达  | 5,496.12       | 0.00         | 新股锁定     |

5.11.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入原因，分项之和与合计可能有尾差。

§6 开放式基金份额变动

单位：份

|                           |                |
|---------------------------|----------------|
| 报告期期初基金份额总额               | 393,729,545.00 |
| 报告期期间基金总申购份额              | 630,000,000.00 |
| 减：报告期期间基金总赎回份额            | 54,000,000.00  |
| 报告期期间基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列） | -              |
| 报告期期末基金份额总额               | 969,729,545.00 |

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

无。

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

无。

§8 影响投资者决策的其他重要信息

8.1 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 (%) |
| 目标基金的联接基金                                                                                                                   | 1              | 20250711-20250930        | -    | 328,541,604.00 | 42,700,000.00 | 285,841,604.00 | 29.48    |
| 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。 |                |                          |      |                |               |                |          |

8.2 影响投资者决策的其他重要信息

2025 年 9 月 26 日，公司召开大成基金管理有限公司 2025 年第一次临时股东会，审议通过《关于公司董事会换届的议案》，选举吴庆斌先生、杨红女士、林昌先生、宋立志先生担任公司第九届董事会董事；选举杨飞先生、王亚坤先生、谢丹夏先生、江涛女士担任公司第九届董事会独立董事；推举谭晓冈先生担任公司第九届董事会专职董事。第九届董事会董事任期为三年，自本次股东会决议生效之日起计算。

§9 备查文件目录

9.1 备查文件目录

- 1、中国证监会批准设立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的文件；
- 2、《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合同》；
- 3、《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。

9.2 存放地点

备查文件存放在本基金管理人和托管人的住所。

9.3 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

2025 年 10 月 28 日