

大成多元配置三个月持有期混合型基金中
基金（ETF-FOF）
2025 年第 4 季度报告

2025 年 12 月 31 日

基金管理人：大成基金管理有限公司

基金托管人：恒丰银行股份有限公司

报告送出日期：2026 年 1 月 22 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。

基金托管人恒丰银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2026 年 01 月 21 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 10 月 28 日（基金合同生效日）起至 12 月 31 日止。

§2 基金产品概况

| | |
|------------|-----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
| 基金简称 | 大成多元配置三个月持有混合（ETF-FOF） |
| 基金主代码 | 025521 |
| 基金运作方式 | 契约型开放式 |
| 基金合同生效日 | 2025 年 10 月 28 日 |
| 报告期末基金份额总额 | 219,571,910.50 份 |
| 投资目标 | 本基金以积极的投资风格进行长期资产配置，通过构建与收益风险水平相匹配的基金组合，在严格控制投资风险并保持良好流动性的前提下，追求基金资产的长期增值。 |
| 投资策略 | <p>（一）资产配置策略</p> <p>1、大类资产配置策略</p> <p>本基金属于混合型基金中基金，将根据基金合同约定的各类资产的目标配置比重进行资产配置。同时，基金经理将根据市场实际表现及预期判断，在基金合同约定的范围内对各大类资产配置比例进行动态调整。</p> <p>2、区域资产配置策略</p> <p>本基金将投资的资产分为境内资产和境外资产两类。基金管理人根据全球经济以及区域化经济发展进程，及不同国家或地区经济体的宏观经济状况、利率与汇率走势、各证券市场的发展变化、全球范围的资本流动情况等，并结合基金管理人对国家或地区的相对估值水平判断与金融市场风险预期，确定两类市场具体的资产配置比例。</p> <p>3、权益类基金资产配置策略</p> |

本基金原则上以境外市场、境内市场上的权益类资产为主要投资方向。通过大类资产配置策略最终决定权益类基金在本基金组合中的占比。

（二）基金投资策略

1、ETF 投资策略

本基金通过定量分析和定性分析相结合的方式，一方面通过严格的量化指标（包括日最大跟踪偏离度、累计跟踪偏离度、日均跟踪偏离度、跟踪误差、基金规模、日均成交额、开放申赎情况等）筛选出跟踪误差低、流动性较好的标的纳入投资范围，另一方面结合所选基金的基金管理人的 ETF 管理经验和风险监控能力进行二次研判，双重维度筛选出优质的 ETF 标的。

2、其他基金投资策略

基金管理人不同类型的基金和基金经理通过合理的多维度指标进行评估和验证。

在主动管理的权益基金选择上，基金管理人重点考察基金经理的投资风格和投资能力，包括但不限于历史收益率、历史波动率、最大回撤、换手率、持股集中度等，以及在不同市场环境下的适应性和稳定性。基金管理人将选择业绩相对优异、稳定，风险控制合理，与当前市场环境和投资目标相匹配的权益基金进行投资。

在被动权益基金选择上，基金管理人除需重点分析跟踪标的的指数外，还需重点考察基金规模、基金流动性、费率结构、跟踪误差等。指数基金具有高透明度、风格明确、费率较低、交易灵活等多重优势，适合进行战术资产配置。

（三）股票投资策略

本基金通过定量和定性相结合的方法精选个股，主要考察上市公司治理结构、核心竞争优势、市占率、成长性、盈利能力、现金流情况以及公司基本面变化等，综合评估上市公司的投资价值，优选具有较高投资价值的上市公司构建股票组合。

（四）债券投资策略

首先，根据宏观经济分析、资金面动向分析和投资人行为分析判断未来利率期限结构变化，并充分考虑组合的流动性管理的实际情况，配置债券组合的久期和债券组合结构；其次，结合信用分析、流动性分析、税收分析等综合影响确定债券组合的类属配置；再次，在上述基础上利用债券定价技术，进行个券选择，选择被低估的债券进行投资。在具体投资操作中，我们采用骑乘操作、放大操作、换券操作等灵活多样的操作方式，力求获取超额的投资收益。

（五）资产支持证券投资策略

本基金将通过对宏观经济、提前偿还率、资产池结构以及资产池资产所在行业景气变化等因素的研究，预测资

| | | |
|-----------------|--------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|-------------------------|
| | 产池未来现金流变化，并通过研究标的的证券发行条款，预测提前偿还率变化对标的的证券的久期与收益率的影响。在严格控制风险的情况下，结合信用研究和流动性管理，选择风险调整后收益高的品种进行投资，以期获得长期稳定收益。 (六) 存托凭证投资策略 在控制风险的前提下，本基金将根据本基金的投资目标和股票投资策略，基于对基础证券投资价值的深入研究判断，进行存托凭证的投资。 | |
| 业绩比较基准 | 中证 A500 指数收益率*55%+恒生指数收益率（使用估值汇率调整）*20%+上海黄金交易所 Au99.99 现货实盘合约收盘价收益率*10%+中债新综合全价（总值）指数收益率*15% | |
| 风险收益特征 | 本基金是混合型基金中基金，预期风险和预期收益高于债券型基金、货币市场基金、债券型基金中基金、货币型基金中基金，但低于股票型基金、股票型基金中基金。本基金若投资港股通标的股票，则需承担港股通机制下因投资环境、投资标的、市场制度以及交易规则等差异带来的特有风险。 | |
| 基金管理人 | 大成基金管理有限公司 | |
| 基金托管人 | 恒丰银行股份有限公司 | |
| 下属分级基金的基金简称 | 大成多元配置三个月持有混合（ETF-FOF）A | 大成多元配置三个月持有混合（ETF-FOF）C |
| 下属分级基金的交易代码 | 025521 | 025522 |
| 报告期末下属分级基金的份额总额 | 67,863,250.85 份 | 151,708,659.65 份 |

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位：人民币元

| 主要财务指标 | 报告期（2025 年 10 月 28 日 - 2025 年 12 月 31 日） | |
|-----------------|------------------------------------------|-------------------------|
| | 大成多元配置三个月持有混合（ETF-FOF）A | 大成多元配置三个月持有混合（ETF-FOF）C |
| 1. 本期已实现收益 | -1,218,032.16 | -2,825,118.45 |
| 2. 本期利润 | -507,983.46 | -1,240,815.88 |
| 3. 加权平均基金份额本期利润 | -0.0075 | -0.0082 |
| 4. 期末基金资产净值 | 67,352,351.06 | 150,460,970.87 |
| 5. 期末基金份额净值 | 0.9925 | 0.9918 |

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

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

低于所列数字。

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

大成多元配置三个月持有混合（ETF-FOF）A

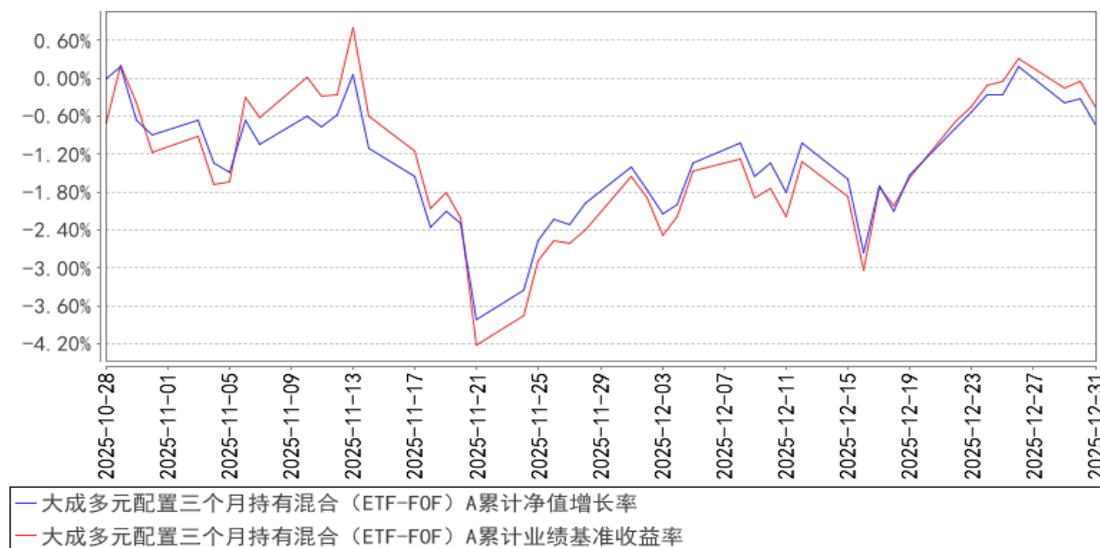
| 阶段 | 净值增长率① | 净值增长率标准差② | 业绩比较基准收益率③ | 业绩比较基准收益率标准差④ | ①-③ | ②-④ |
|------------|--------|-----------|------------|---------------|--------|--------|
| 自基金合同生效起至今 | -0.75% | 0.59% | -0.47% | 0.72% | -0.28% | -0.13% |

大成多元配置三个月持有混合（ETF-FOF）C

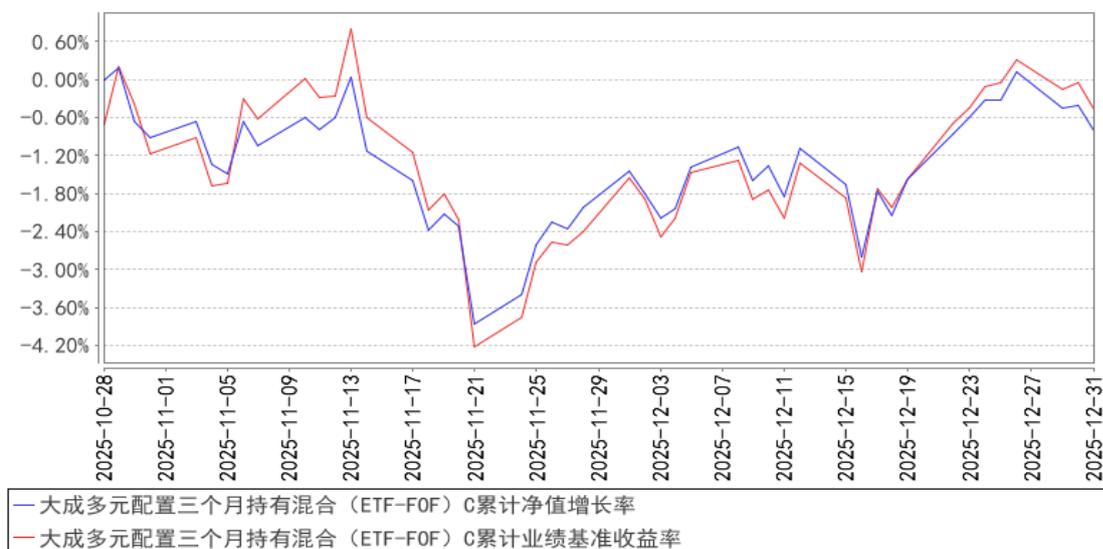
| 阶段 | 净值增长率① | 净值增长率标准差② | 业绩比较基准收益率③ | 业绩比较基准收益率标准差④ | ①-③ | ②-④ |
|------------|--------|-----------|------------|---------------|--------|--------|
| 自基金合同生效起至今 | -0.82% | 0.59% | -0.47% | 0.72% | -0.35% | -0.13% |

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

大成多元配置三个月持有混合（ETF-FOF）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



大成多元配置三个月持有混合（ETF-FOF）C 累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：1、本基金合同生效日为 2025 年 10 月 28 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 | | |
| 陈志伟 | 本基金基金经理 | 2025 年 10 月 28 日 | - | 9 年 | 北京大学经济学硕士、香港大学金融学硕士。证券、保险资管从业年限 9 年。2011 年 7 月至 2014 年 2 月任华润深国投信托有限公司证券投资部经理。2014 年 2 月至 2016 年 6 月任方正东亚信托有限公司对冲基金部总监。2016 年 6 月至 2020 年 4 月任鹏华资产管理有限公司投资管理部高级研究员。2020 年 5 月至 2023 年 6 月任生命保险资产管理有限公司组合管理部投资经理。2023 年 6 月加入大成基金管理有限公司，现任大类资产配置部基金经理。2023 年 8 月 4 日至 2025 年 9 月 26 日任大成颐享稳健养老目标一年持有期混合型发起式基金中基金（FOF）基金经理。2024 年 3 月 14 日至 2025 年 8 月 22 日任大成丰华稳健六个月持有期混合型发起式基金中基金（FOF）。2024 年 3 月 14 日起任大成养老目标日期 2040 三年 |

| | | | | | |
|--|--|--|--|--|------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
| | | | | | 持有期混合型证券投资基金（FOF）、大成颐禧积极养老目标五年持有期混合型发起式基金中基金（FOF）基金经理。2025 年 6 月 24 日起担任大成睿浦智选三个月持有期混合型发起式基金中基金（FOF）基金经理。2025 年 10 月 28 日起任大成多元配置三个月持有期混合型证券投资基金（ETF-FOF）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。

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

4.3.2 异常交易行为的专项说明

报告期内，公司旗下所有投资组合未发现存在异常交易行为。公司旗下投资组合间存在证券同日反向交易，但不存在参与交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当

日成交量 5% 的情形。投资组合间相邻交易日反向交易的市场成交比例、成交均价等交易结果数据表明该类交易不对市场产生重大影响，无异常。

4.4 报告期内基金的投资策略和运作分析

四季度国内外宏观环境保持稳定。12 月份中国制造业 PMI 指数为 50.1%，升至扩张区间，新订单指数为 50.8%，环比上升 1.6 个百分点，表明制造业市场需求有所改善。12 月份召开的中央经济工作会议指出，2026 年经济工作要坚持稳中求进、提质增效，继续实施更加积极的财政政策和适度宽松的货币政策，预计明年政策层面保持积极稳健。受到政府停摆等因素影响，美国经济四季度有所走弱，但仍保持平稳。美国 11 月非农数据差强人意，失业率有所抬升，通胀数据有所走低，但存在数据质量问题，需要持续观察。美联储在 10 月份、12 月两次降息 25BP，年内实现三次降息。

从大类资产表现来看，四季度资产表现分化。A 股延续涨势，但较三季度涨幅收窄，风格上有所分化，价值板块表现较好，成长板块在三季度大涨后震荡调整。港股表现较弱，恒生科技指数跌幅较大。债市受市场情绪及资金供需影响，表现较弱，超长端收益率大幅抬升，利率曲线陡峭化。海外资产方面，美股、欧股等海外权益资产震荡上涨。随着美联储降息，短端美债收益率回落，但长端基本稳定。商品表现分化，黄金、铜等金属品种延续涨势，原油价格相对疲软。

展望 2026 年，我们认为宏观政策稳中求进，对经济和市场进行托底，同时居民资产配置转向含权资产，国内权益市场下行风险可控，需要积极把握结构性机会，科技、高端制造、资源类板块仍是重要投资方向，但需要综合评估估值、市场情绪等因素，阶段性把握内需、顺周期等板块投资机会。债券收益率 2025 年有所回升，2026 年一季度预计受供需影响，但长期看债券仍是重要的稳健资产投资方向。美股当前估值偏高，但 AI 产业趋势方兴未艾，在降息周期下仍有较好的投资机会。商品层面，黄金配置价值近两年被市场充分演绎，在全球政治经济不确定的大环境下，黄金仍有较好的配置价值，但预期收益率应当降低。铜、铝等有色品种供给受限，同时需求端有增长，也是重要的投资方向。原油当前供需关系偏弱，需要在 2026 年下半年再评估。

本基金于四季度成立，在此也感谢广大投资者的认可与信任。本基金为 ETF-FOF，主要投资于国内上市的 ETF 基金。近两年国内 ETF 市场快速发展，ETF 品种日益丰富，涵盖跨境、债券、权益宽基、风格、行业等，通过 ETF 做资产配置逐渐被市场重视。本基金将坚持大类资产配置策略，在抓住大类资产贝塔基础上通过风格配置、行业配置、券种配置等策略获取一定超额收益。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末大成多元配置三个月持有混合（ETF-FOF）A 的基金份额净值为 0.9925 元，

本报告期基金份额净值增长率为-0.75%，同期业绩比较基准收益率为-0.47%；截至本报告期末大成多元配置三个月持有混合（ETF-FOF）C 的基金份额净值为 0.9918 元，本报告期基金份额净值增长率为-0.82%，同期业绩比较基准收益率为-0.47%。

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 | - | - |
| | 其中：股票 | - | - |
| 2 | 基金投资 | 197,416,660.00 | 90.51 |
| 3 | 固定收益投资 | 10,462,945.21 | 4.80 |
| | 其中：债券 | 10,462,945.21 | 4.80 |
| | 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 | 10,202,867.05 | 4.68 |
| 8 | 其他资产 | 28,433.48 | 0.01 |
| 9 | 合计 | 218,110,905.74 | 100.00 |

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

无。

5.2.2 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

无。

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

| 序号 | 债券品种 | 公允价值（元） | 占基金资产净值比例（%） |
|----|------|---------|--------------|
|----|------|---------|--------------|

| | | | |
|----|-----------|---------------|------|
| 1 | 国家债券 | 8,048,241.10 | 3.70 |
| 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） | 2,414,704.11 | 1.11 |
| 8 | 同业存单 | - | - |
| 9 | 其他 | - | - |
| 10 | 合计 | 10,462,945.21 | 4.80 |

5.5 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

| 序号 | 债券代码 | 债券名称 | 数量（张） | 公允价值（元） | 占基金资产净值比例（%） |
|----|--------|----------|--------|--------------|--------------|
| 1 | 019785 | 25 国债 13 | 80,000 | 8,048,241.10 | 3.70 |
| 2 | 113052 | 兴业转债 | 20,000 | 2,414,704.11 | 1.11 |

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兴业转债的发行主体兴业银行股份有限公司于 2025 年 12 月 5 日因外包机构管理不到位、企业划型不准确等受到国家金融监督管理总局处罚。本基金认为，对兴业银行股份有限公司的处罚不会对其投资价值构成实质性负面影响。

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 | - |
| 3 | 应收股利 | 27,353.00 |
| 4 | 应收利息 | - |
| 5 | 应收申购款 | 1,080.48 |
| 6 | 其他应收款 | - |
| 7 | 其他 | - |
| 8 | 合计 | 28,433.48 |

5.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

| 序号 | 债券代码 | 债券名称 | 公允价值（元） | 占基金资产净值比例（%） |
|----|--------|------|--------------|--------------|
| 1 | 113052 | 兴业转债 | 2,414,704.11 | 1.11 |

5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

无。

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 基金中基金

6.1 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基金投资明细

| 序号 | 基金代码 | 基金名称 | 运作方式 | 持有份额（份） | 公允价值（元） | 占基金资产净值比例（%） | 是否属于基金管理人及管理人关联方所管理的基金 |
|----|--------|--------------------|-------------|---------------|---------------|--------------|------------------------|
| 1 | 511220 | 海富通上证城投债 ETF | 交易型开放式(ETF) | 2,500,000.00 | 25,522,500.00 | 11.72 | 否 |
| 2 | 518880 | 华安黄金易(ETF) | 交易型开放式(ETF) | 1,500,000.00 | 13,951,500.00 | 6.41 | 否 |
| 3 | 159655 | 华夏标普500ETF(QDII) | 交易型开放式(ETF) | 7,500,000.00 | 13,612,500.00 | 6.25 | 否 |
| 4 | 513630 | 摩根标普港股通低波红利 ETF | 交易型开放式(ETF) | 8,000,000.00 | 12,840,000.00 | 5.89 | 否 |
| 5 | 159750 | 招商中证香港科技 ETF(QDII) | 交易型开放式(ETF) | 10,500,000.00 | 10,678,500.00 | 4.90 | 否 |
| 6 | 159338 | 国泰中证A500ETF | 交易型开放式(ETF) | 8,000,000.00 | 9,552,000.00 | 4.39 | 否 |
| 7 | 159740 | 大成恒生科技 ETF(QDII) | 交易型开放式(ETF) | 12,000,000.00 | 8,628,000.00 | 3.96 | 是 |
| 8 | 159980 | 大成有色金属期货 ETF | 交易型开放式(ETF) | 4,000,000.00 | 7,984,000.00 | 3.67 | 是 |
| 9 | 511030 | 平安中高等级公司债利因子 ETF | 交易型开放式(ETF) | 70,000.00 | 7,479,780.00 | 3.43 | 否 |
| 10 | 159738 | 云计算 ETF 华泰柏瑞 | 交易型开放式(ETF) | 3,300,000.00 | 6,299,700.00 | 2.89 | 否 |

6.1.1 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公开募集基础设施证券投资基金投资明细

无。

6.1.2 报告期末基金持有的全部公开募集基础设施证券投资基金情况

无。

6.2 当期交易及持有基金产生的费用

| 项目 | 本期费用 2025 年 10 月 28 日至 2025 年 12 月 31 日 | 其中：交易及持有基金管理人以及管理人关联方所管理基金产生的费用 |
|----|-----------------------------------------|---------------------------------|
| | | |

| | | |
|----------------------|------------|-----------|
| 当期交易基金产生的申购费(元) | - | - |
| 当期交易基金产生的赎回费(元) | - | - |
| 当期持有基金产生的应支付销售服务费(元) | - | - |
| 当期持有基金产生的应支付管理费(元) | 130,130.40 | 11,806.89 |
| 当期持有基金产生的应支付托管费(元) | 30,464.39 | 2,073.43 |
| 当期交易基金产生的交易费(元) | 114,857.52 | 8,562.08 |

6.3 本报告期持有的基金发生的重大影响事件

| |
|----|
| 无。 |
|----|

§ 7 开放式基金份额变动

单位：份

| 项目 | 大成多元配置三个月持有混合（ETF-FOF）A | 大成多元配置三个月持有混合（ETF-FOF）C |
|------------------------------------|-------------------------|-------------------------|
| 基金合同生效日(2025年10月28日)基金份额总额 | 67,731,725.06 | 151,238,711.19 |
| 基金合同生效日起至报告期期末基金总申购份额 | 131,525.79 | 469,948.46 |
| 减：基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回份额 | - | - |
| 基金合同生效日起至报告期期末基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列） | - | - |
| 报告期期末基金份额总额 | 67,863,250.85 | 151,708,659.65 |

§8 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

8.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

无。

8.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

无。

§ 9 影响投资者决策的其他重要信息

9.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

无。

9.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§10 备查文件目录

10.1 备查文件目录

- 1、中国证监会批准设立大成多元配置三个月持有期混合型基金中基金（ETF-FOF）的文件；
- 2、《大成多元配置三个月持有期混合型基金中基金（ETF-FOF）基金合同》；
- 3、《大成多元配置三个月持有期混合型基金中基金（ETF-FOF）托管协议》；
- 4、大成基金管理有限公司批准文件、营业执照、公司章程；
- 5、本报告期内在规定报刊上披露的各种公告原稿。

10.2 存放地点

备查文件存放在本基金管理人和托管人的住所。

10.3 查阅方式

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

大成基金管理有限公司

2026 年 1 月 22 日