# 大成天享 3 个月持有期混合型证券投资基金
# 2026 年第 3 季度报告

2026 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：北京银行股份有限公司

报告送出日期：2026 年 10 月 27 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。

基金托管人北京银行股份有限公司根据本基金合同约定，于 2026 年 10 月 26 日复核了本报告中的财务指标、净值表现和投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2026 年 07 月 01 日起至 09 月 30 日止。

# §2 基金产品概况

| | |
|---|---|
| 基金简称 | 大成天享 3 个月持有期混合 |
| 基金主代码 | 027330 |
| 基金运作方式 | 契约型开放式 |
| 基金合同生效日 | 2026 年 5 月 28 日 |
| 报告期末基金份额总额 | 374,500,009.16 份 |
| 投资目标 | 本基金以严格控制风险和保持较高流动性为首要目标，追求高于业绩比较基准的稳定收益。 |
| 投资策略 | （一）大类资产配置策略<br>本基金通过对宏观经济环境、国家经济政策、股票市场风险、债券市场整体收益率曲线变化和资金供求关系等因素的分析，综合评价各类资产的市场趋势、预期风险收益水平和配置时机。在此基础上，本基金将积极、主动地确定权益类资产、固定收益类资产和现金等各类资产的配置比例并进行实时动态调整，以期在投资中达到风险和收益的优化平衡。<br>（二）债券投资策略<br>本基金的债券投资采取稳健的投资管理方式，获得与风险相匹配的投资收益，以实现在一定程度上规避股票市场的系统性风险和保证基金资产的流动性。本基金将以中长期利率趋势分析为基础，结合经济周期、宏观政策方向及收益率曲线分析，构造债券投资组合。在实际投资运作中，本基金将以利率债投资为主，信用债投资为辅，综合运用利率预期策略、套利交易策略、个券选择策略等，获取债券市场的长期稳定收益。 |

| | |
|---|---|
| | （1）利率预期策略<br>利率风险是债券投资最主要的风险来源和收益来源之一，衡量债券利率风险的核心指标是久期。本基金通过对宏观经济变量（包括国内生产总值、工业增长、货币信贷、固定资产投资、消费、外贸差额、财政收支、价格指数和汇率等）和宏观经济政策（包括货币政策、财政政策、产业政策、外贸和汇率政策等）进行分析，对未来较长的一段时间内的市场利率变化趋势进行预测，决定组合的久期。<br>（2）信用债投资策略<br>本基金可参与信用债投资，所投信用债的信用评级不低于 AA（包括资产支持证券，但不包括可转换债券（含可分离交易可转债）、可交换债券，下同）。<br>上述信用评级为债项信用评级；针对短期融资券、超短期融资券及无债项评级的其他信用债而言，具体指发行主体的信用评级。<br>（3）套利交易策略<br>本基金将在法律法规和监管机构许可的条件下，积极运用以下套利交易策略：<br>①回购套利策略包括回购跨市场套利以及不同回购期限之间的套利等。<br>②息差交易策略是指通过不断正回购融资并买入债券的策略，只要回购资金成本低于债券收益率，就可以达到适当放大债券组合规模并获利的套利目标。<br>③利差交易策略通过同时买进涨多（跌少）/卖出涨少（跌多）的债券，达到不受市场涨跌的直接影响、规避市场风险的效果。<br>（4）个券选择策略<br>在前述债券目标久期、信用债券配置比例确定基础上，本基金将选择最具有投资价值优势的债券品种进行投资以获得超额收益。具有以下一项或多项特征的债券，是本基金构建固定收益类资产组合的重点投资对象：<br>①符合上述投资策略的品种；<br>②具有套利空间的品种；<br>③价值低估的品种；<br>④符合风险管理指标的品种。<br>（三）股票投资策略<br>1、A 股投资策略<br>随着世界经济和中国经济的变革与发展，行业和公司所处的环境和竞争格局也发生着巨大而深刻的改变。国内经济结构转型、产业加速升级、信息化水平不断提升、企业效能增加、品牌逐步建立，传统产业和新兴产业共同为经济赋能，成为中国经济新的动力引擎，助力实现共同富裕的宏伟目标。<br>2、港股投资策略 |

| | |
|---|---|
| | 本基金所投资香港市场股票标的除适用上述股票投资策略外，还需关注：<br>（1）香港股票市场制度与中国内地股票市场存在的差异对股票投资价值的影响，比如行业分布、交易制度、市场流动性、投资者结构、市场波动性、涨跌停限制、估值与盈利回报等方面；<br>（2）人民币与港币之间的汇兑比率变化情况。<br>（四）可转换债券投资策略<br>可转换债券在分析基础股票的基本面、转债条款和市场面三方面因素的前提下，将敏感度指标（Delta、Vega 等）作为市场风险控制的主要技术指标，利用可转换债券溢价率来判断转债的股性，运用转换套利、溢折价、一级市场申购、纯债券价值及期权价值管理来积极投资，获取超额收益。<br>（五）可交换债券投资策略<br>可交换债券与可转换债券的区别在于换股期间用于交换的股票并非自身新发的股票，而是发行人持有的其他上市公司的股票。可交换债券同样具有股性和债性，其中债性与可转换债券相同，即选择持有可交换债券至到期以获取票面价值和票面利息；而对于股性的分析则需关注目标公司的股票价值。本基金将通过对目标公司股票的投资价值分析和可交换债券的纯债部分价值分析综合开展投资决策。<br>（六）股指期货投资策略<br>本基金在股指期货投资中将根据风险管理的原则，以套期保值为目的，在风险可控的前提下，参与股指期货的投资。<br>（七）国债期货投资策略<br>本基金投资国债期货将根据风险管理原则，以套期保值为目的，在风险可控的前提下，参与国债期货的投资。本基金将结合对宏观经济形势和政策趋势的判断，通过对债券市场和期货市场运行趋势、估值水平、流动性和波动水平等的研究，谨慎开展国债期货投资，通过多头或空头套期保值等策略进行操作，以达到组合风险管理的目标。<br>（八）股票期权投资策略<br>在法律法规允许的范围内，本基金应当按照风险管理的原则，以套期保值为主要目的，基于谨慎原则运用股票期权对基金投资组合进行管理，以控制投资组合风险、提高投资效率，从而更好地实现本基金的投资目标。本基金将在有效控制风险的前提下，选择流动性好、交易活跃的期权合约进行投资。<br>（九）存托凭证投资策略<br>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。<br>（十）基金投资策略<br>本基金可投资于股票型 ETF、本基金管理人旗下的股票型基金及计入权益类资产的混合型基金，不包括 QDII 基金、香港互认基金、基金中基金、其他可投资公募基金的非基金中基金、货币市场基金、同一基金经理管理的其他基金、非本基金管理人管理的基金（股票型 ETF 除外），其中计入权益类资产的混合型基金为至少满足以下一条标准的混合型基金：（1）基金合同约定的股票及存托凭证资产占基金资产的比例不低于 60%；（2）基金最近 4 期季度报告中披露的股票及存托凭证资产占基金资产的比例均不低于 60%。<br>（十一）信用衍生品投资策略<br>为了更好地管理债券投资的信用风险，本基金根据风险管理的原则，以风险对冲为目的，将适当参与信用衍生品的投资。本基金将在详细评估信用债风险状况的前提下，对比权衡个券风险收益与信用衍生品价格，构建信用风险对冲组合。持有期内，本基金会紧密跟踪信用利差与信用衍生品价格的动态变化，灵活调整对冲比例，追求经信用风险对冲后的投资回报最大化。<br>（十二）融资业务投资策略<br>本基金在参与融资业务时将根据风险管理的原则，在法律法规允许的范围和比例内、风险可控的前提下，根据投资管理需要参与融资业务。若相关融资业务法律法规发生变化，本基金将从其最新规定，以符合上述法律法规和监管要求的变化。 | |
| 业绩比较基准 | 中债-新综合全价(总值)指数收益率*80%+沪深 300 指数收益率*15%+活期存款基准利率*5% | |
| 风险收益特征 | 本基金是混合型证券投资基金，预期风险和预期收益高于债券型基金和货币市场基金、但低于股票型基金。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 | 北京银行股份有限公司 | |
| 下属分级基金的基金简称 | 大成天享 3 个月持有期混合 A | 大成天享 3 个月持有期混合 C |
| 下属分级基金的交易代码 | 027330 | 027331 |
| 报告期末下属分级基金的份额总额 | 162,847,726.03 份 | 211,652,283.13 份 |

# §3 主要财务指标和基金净值表现

## 3.1 主要财务指标

单位：人民币元

| 主要财务指标 | 报告期（2026 年 7 月 1 日 - 2026 年 9 月 30 日） |
|---|---|

| | 大成天享 3 个月持有期混合 A | 大成天享 3 个月持有期混合 C |
|---|---|---|
| 1.本期已实现收益 | -158,836.26 | -429,051.98 |
| 2.本期利润 | -1,336,243.73 | -2,030,154.09 |
| 3.加权平均基金份额本期利润 | -0.0076 | -0.0086 |
| 4.期末基金资产净值 | 162,550,810.51 | 210,976,413.89 |
| 5.期末基金份额净值 | 0.9982 | 0.9968 |

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

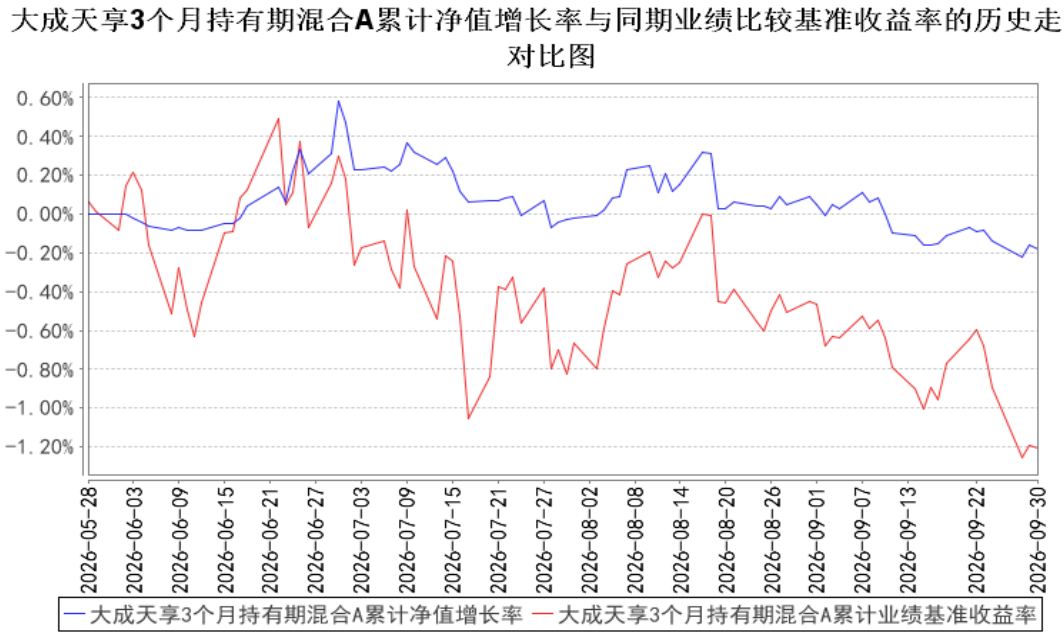
大成天享 3 个月持有期混合 A

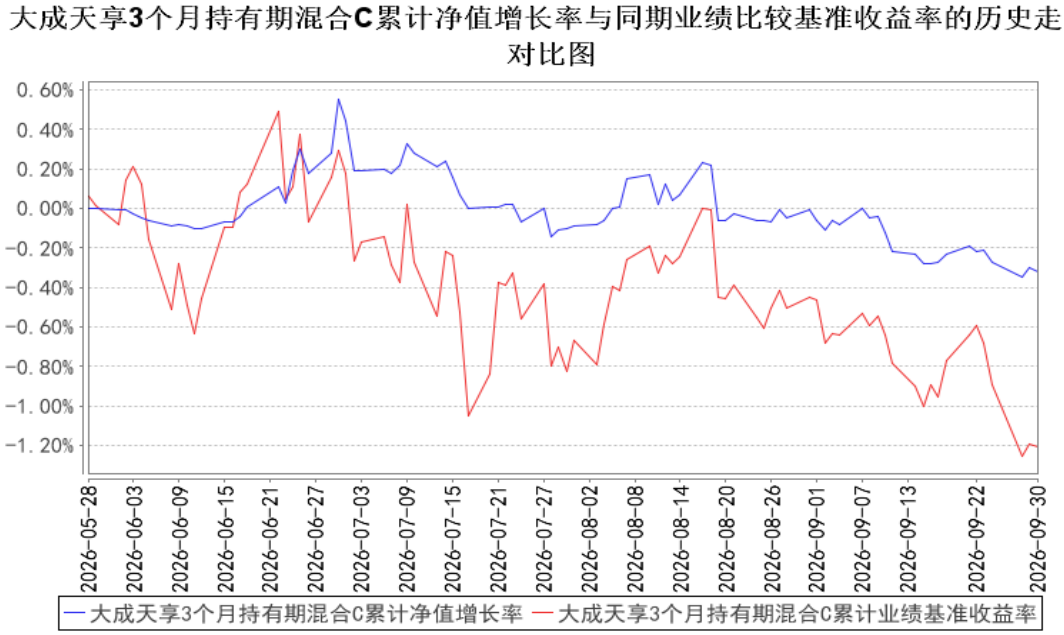
| 阶段 | 净值增长率① | 净值增长率标准差② | 业绩比较基准收益率③ | 业绩比较基准收益率标准差④ | ①－③ | ②－④ |
|---|---|---|---|---|---|---|
| 过去三个月 | -0.76% | 0.08% | -1.50% | 0.20% | 0.74% | -0.12% |
| 自基金合同生效起至今 | -0.18% | 0.08% | -1.21% | 0.21% | 1.03% | -0.13% |

大成天享 3 个月持有期混合 C

| 阶段 | 净值增长率① | 净值增长率标准差② | 业绩比较基准收益率③ | 业绩比较基准收益率标准差④ | ①－③ | ②－④ |
|---|---|---|---|---|---|---|
| 过去三个月 | -0.87% | 0.08% | -1.50% | 0.20% | 0.63% | -0.12% |
| 自基金合同生效起至今 | -0.32% | 0.08% | -1.21% | 0.21% | 0.89% | -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




注：1、本基金合同生效日为 2026 年 5 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 | | |
| 成琦 | 本基金基金经理 | 2026 年 5 月 28 日 | - | 9 年 | 中国财政科学研究院经济学硕士。2017 年 8 月加入大成基金管理有限公司，曾担 |

| | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|
| | | | | | 任固定收益总部研究员、基金经理助理，现任固定收益总部债券投资二部基金经理。2023 年 1 月 3 日起任大成可转债增强债券型证券投资基金基金经理。2024 年 4 月 26 日起任大成元合双利债券型发起式证券投资基金基金经理。2025 年 5 月 30 日起任大成恒享夏盛一年定期开放混合型证券投资基金基金经理。2025 年 8 月 6 日起任大成景荣债券型证券投资基金基金经理。2026 年 4 月 23 日起任大成天启稳利债券型证券投资基金基金经理。2026 年 4 月 28 日起任大成天宁混合型证券投资基金基金经理。2026 年 5 月 28 日起任大成天享 3 个月持有期混合型证券投资基金基金经理。2026 年 9 月 4 日起任大成稳丰 3 个月持有期债券型证券投资基金基金经理。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《证券基金经营机构董事、监事、高级管理人员及从业人员监督管理办法》的相关规定。

### 4.1.1 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理同时管理的产品情况

无。

## 4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

报告期内，本基金管理人严格遵守《中华人民共和国证券法》、《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 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

2026 年三季度，中国宏观经济基本面延续了结构分化的态势。二产稳步修复、三产景气回落，内外需分化。整体来看，出口延续强劲表现，成为支撑经济的主要亮点；而投资增长低位徘徊，尤其是房地产新开工、施工面积及投资持续负增长，短期暂时难以提供向上驱动。消费方面，服务类消费阶段性回暖，但汽车、耐用品等商品消费恢复仍较为缓慢，价格端呈现温和修复。政策层面，逆周期调节信号密集释放，货币政策强调适度宽松，后半季度财政支出节奏加快，准财政工具和“六张网”项目加速落地，四季度政策效果的实物转化成为关注重点。外部环境方面，美欧等主要经济体货币政策继续趋紧，人民币汇率阶段性升破 6.70。整体来看，三季度中国经济在外需带动下边际改善，但内需修复依然缓慢，政策宽松助推量稳价升。

在权益市场方面，AI 供需、中东地缘、国内政策是影响 Q4 市场走势的三大关键因素，当前尚不明朗，仍需密切跟踪。在结构方面，关注具有中国优势的 AI 产业链产能瓶颈领域，关注内需政策发力的可能。此外，当前市场呈现出口强，投资和消费弱的格局，若外需回落，内需呵护概率提升，因此关注政策呵护消费和地产的可能。

债券市场方面，在弱现实基本面与宽货币预期驱动下，整体呈现短端小幅上行、中长端收益率显著下行的特征，收益率曲线加速平坦化，长端、超长端国债表现强势，配置需求持续释放。短端则因季末流动性扰动及资金面阶段性收敛。信用债方面，低评级与中长久期产品下行幅度更大，整体利差显著收窄。当前，违约风险继续处于低位，三季度无新增首次违约主体，隐含评级下调明显下降。展望后续，政策落地、政府债供给节奏和资金面变动仍是影响长短端利差和市场波动的核心变量。

在产品运作方面，权益方面关注科技板块，在非 AI 行业，继续自下而上，配置基本面逻辑扎实的龙头标的。债券方面维持票息为本、逢调整配置久期资产的思路。本基金秉持稳健运作的投

资原则，在积累充足安全垫、夯实组合风险缓冲空间的基础上，稳步开展仓位布局，并结合市场行情变化灵活开展择时调仓操作。

### 4.5 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末大成天享 3 个月持有期混合 A 的基金份额净值为 0.9982 元，本报告期基金份额净值增长率为-0.76%，同期业绩比较基准收益率为-1.50%；截至本报告期末大成天享 3 个月持有期混合 C 的基金份额净值为 0.9968 元，本报告期基金份额净值增长率为-0.87%，同期业绩比较基准收益率为-1.50%。

### 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 | 5,100,283.01 | 1.36 |
| | 其中：股票 | 5,100,283.01 | 1.36 |
| 2 | 基金投资 | 595,652.60 | 0.16 |
| 3 | 固定收益投资 | 351,036,117.75 | 93.84 |
| | 其中：债券 | 351,036,117.75 | 93.84 |
| | 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 | 6,998,369.87 | 1.87 |
| | 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 | 9,842,246.57 | 2.63 |
| 8 | 其他资产 | 510,921.38 | 0.14 |
| 9 | 合计 | 374,083,591.18 | 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

| 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 | 4,034,295.01 | 1.08 |
| D | 电力、热力、燃气及水生产和供应 | - | - |

| | | | |
|---|---|---|---|
| | 业 | | |
| E | 建筑业 | 576,180.00 | 0.15 |
| F | 批发和零售业 | - | - |
| G | 交通运输、仓储和邮政业 | - | - |
| H | 住宿和餐饮业 | - | - |
| I | 信息传输、软件和信息技术服务业 | - | - |
| J | 金融业 | 121,660.00 | 0.03 |
| 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 | 368,148.00 | 0.10 |
| 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 | 5,100,283.01 | 1.37 |

## 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

| 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 | 002452 | 长高电气 | 56,700 | 644,679.00 | 0.17 |
| 2 | 603730 | 岱美股份 | 61,300 | 603,805.00 | 0.16 |
| 3 | 003001 | 中岩大地 | 29,700 | 576,180.00 | 0.15 |
| 4 | 603186 | 华正新材 | 2,100 | 446,586.00 | 0.12 |
| 5 | 002636 | 金安国纪 | 5,355 | 425,454.75 | 0.11 |
| 6 | 688676 | 金盘科技 | 6,259 | 385,116.27 | 0.10 |
| 7 | 603259 | 药明康德 | 2,200 | 368,148.00 | 0.10 |
| 8 | 688090 | 瑞松科技 | 4,362 | 337,095.36 | 0.09 |
| 9 | 301165 | 锐捷网络 | 3,200 | 322,368.00 | 0.09 |
| 10 | 002281 | 光迅科技 | 1,900 | 313,272.00 | 0.08 |

## 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 | 34,403,609.03 | 9.21 |
| 2 | 央行票据 | - | - |
| 3 | 金融债券 | 116,508,345.21 | 31.19 |
| | 其中：政策性金融债 | 20,346,057.54 | 5.45 |

| | | | |
|---|---|---|---|
| 4 | 企业债券 | 23,177,835.07 | 6.21 |
| 5 | 企业短期融资券 | - | - |
| 6 | 中期票据 | 176,946,328.44 | 47.37 |
| 7 | 可转债（可交换债） | - | - |
| 8 | 同业存单 | - | - |
| 9 | 其他 | - | - |
| 10 | 合计 | 351,036,117.75 | 93.98 |

## 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 | 232680009 | 26 工行二级资本债 02BC | 300,000 | 30,362,161.64 | 8.13 |
| 2 | 232680012 | 26 邮储银行二级资本债 01BC | 250,000 | 25,302,830.14 | 6.77 |
| 3 | 102381546 | 23 汇金 MTN004 | 200,000 | 20,599,101.37 | 5.51 |
| 4 | 102484542 | 24 深圳国控 MTN001 | 200,000 | 20,563,318.36 | 5.51 |
| 5 | 102584929 | 25 电网 MTN035 | 200,000 | 20,421,391.78 | 5.47 |

## 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

1、本基金投资的前十名证券 26 工行二级资本债 02BC 的发行主体中国工商银行股份有限公司于 2025 年 12 月 10 日因违反金融统计相关规定、违反账户管理规定、违反清算管理规定、违反特约商户实名制管理规定、违反反假货币业务管理规定、违反信用信息采集、提供、查询及相关管理规定、未按规定履行客户身份识别义务、未按规定保存客户身份资料和交易记录、未按规定报送大额交易报告或者可疑交易报告、与身份不明的客户进行交易等受到中国人民银行处罚（银罚决字〔2025〕110 号）；于 2026 年 6 月 5 日因重要信息系统投产变更风险管控不到位、未按规定报告重要信息系统突发事件等受到国家金融监督管理总局处罚。本基金认为，对中国工商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。

2、本基金投资的前十名证券 26 邮储银行二级资本债 01BC 的发行主体中国邮政储蓄银行股份有限公司于 2025 年 9 月 30 日因相关贷款业务、互联网贷款业务、绩效考核、合作业务等管理不审慎等受到国家金融监督管理总局处罚；于 2026 年 9 月 8 日因违反金融统计管理规定、违反账户管理规定、违反银行卡收单业务管理规定、违反数据安全管理规定、违反反假货币业务管理规定、占压财政存款或者资金、违反信用信息采集、提供、查询及相关管理规定、未按规定履行客户身份识别义务、未按规定报送大额交易报告或者可疑交易报告、与身份不明的客户进行交易等受到中国人民银行处罚（银罚决字〔2026〕88 号）。本基金认为，对中国邮政储蓄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约定的备选股票库

本基金投资的前十名股票未超出基金合同规定的备选股票库。

### 5.11.3 其他资产构成

| 序号 | 名称 | 金额（元） |
| --- | --- | --- |
| 1 | 存出保证金 | 98,919.35 |
| 2 | 应收证券清算款 | 412,002.03 |

| | | |
|---|---|---|
| 3 | 应收股利 | - |
| 4 | 应收利息 | - |
| 5 | 应收申购款 | - |
| 6 | 其他应收款 | - |
| 7 | 其他 | - |
| 8 | 合计 | 510,921.38 |

### 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

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 开放式基金份额变动

单位：份

| 项目 | 大成天享 3 个月持有期混合 A | 大成天享 3 个月持有期混合 C |
|---|---|---|
| 报告期期初基金份额总额 | 178,309,704.60 | 244,240,578.38 |
| 报告期期间基金总申购份额 | 995.52 | 10,348.22 |
| 减:报告期期间基金总赎回份额 | 15,462,974.09 | 32,598,643.47 |
| 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 | 162,847,726.03 | 211,652,283.13 |

## §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

无。

## 8.2 影响投资者决策的其他重要信息

2026 年 9 月 1 日，公司召开大成基金管理有限公司第九届董事会第五次会议，审议通过《关于姚余栋先生辞去公司副总经理职务的议案》，同意姚余栋先生自董事会决议作出之日起辞去公司副总经理职务。

# §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天享 3 个月持有期混合型证券投资基金的文件；

2、《大成天享 3 个月持有期混合型证券投资基金基金合同》；

3、《大成天享 3 个月持有期混合型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**

**2026 年 10 月 27 日**