大成标普 500 等权重指数证券投资基金
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：中国银行股份有限公司

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。

基金托管人中国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	大成标普 500 等权重指数（QDII）
基金主代码	096001
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2011 年 3 月 23 日
报告期末基金份额总额	430,759,926.42 份
投资目标	通过严格的投资纪律约束和数量化风险管理手段，实现基金投资组合对标的指数的有效跟踪，追求跟踪误差最小化。
投资策略	本基金将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。但在因特殊情况（如股票停牌、流动性不足）导致无法获得足够数量的股票时，基金管理人将搭配使用其他合理方法进行适当的替代。 本基金还可能将一定比例的基金资产投资于与标普 500 等权重指数相关的公募基金、上市交易型基金，以优化投资组合的建立，达到节约交易成本和有效追踪标的指数表现的目的。
业绩比较基准	标普 500 等权重指数（全收益指数）收益率

风险收益特征	本基金为美国股票指数型证券投资基金，风险与预期收益高于混合型基金、债券基金以及货币市场基金，属于预期风险较高的产品。	
基金管理人	大成基金管理有限公司	
基金托管人	中国银行股份有限公司	
下属分级基金的基金简称	大成标普 500 等权重指数(QDII)A	大成标普 500 等权重指数(QDII)C
下属分级基金的交易代码	096001	008401
报告期末下属分级基金的份额总额	326,262,647.39 份	104,497,279.03 份
境外资产托管人	英文名称：Bank of China (Hong Kong) Limited	
	中文名称：中国银行（香港）有限公司	

注：根据 2021 年 9 月 4 日基金管理人披露的《大成基金管理有限公司关于大成标普 500 等权重指数证券投资基金增设基金份额并修订基金合同、托管协议的公告》，自 2021 年 9 月 7 日起大成标普 500 等权重指数证券投资基金增加美元基金份额。本基金份额含人民币份额及美元份额（如有）。

§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）	
	大成标普 500 等权重指数(QDII)A	大成标普 500 等权重指数(QDII)C
1.本期已实现收益	4,357,486.81	1,162,164.72
2.本期利润	-26,225,072.55	-8,341,125.92
3.加权平均基金份额本期利润	-0.0957	-0.1051
4.期末基金资产净值	882,881,554.85	281,107,976.62
5.期末基金份额净值	2.7060	2.6901

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

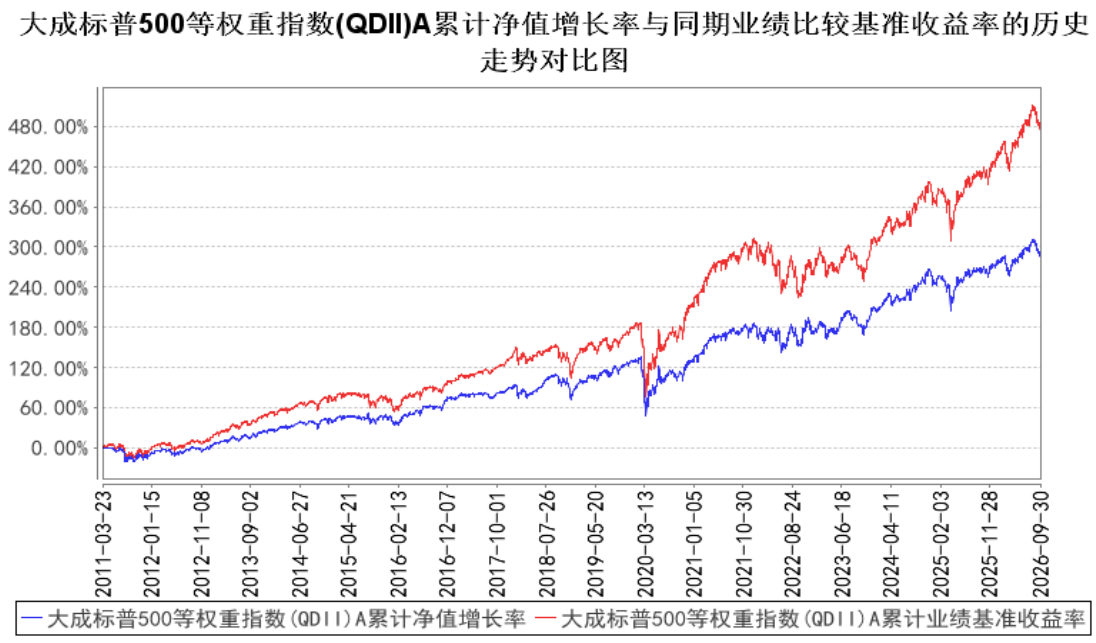
大成标普 500 等权重指数(QDII)A

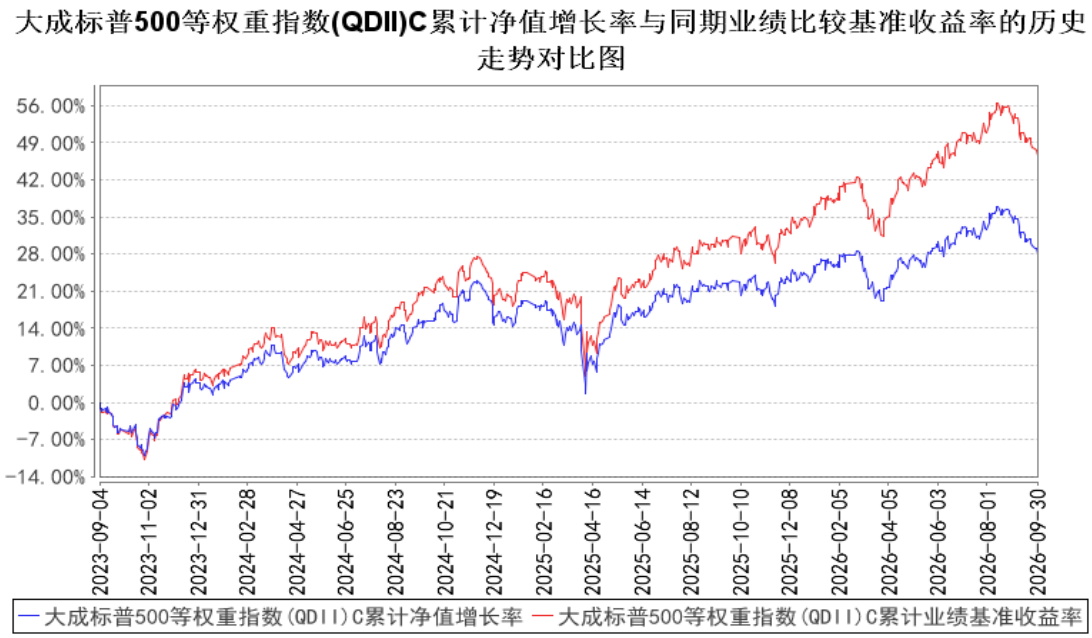
阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①－③	②－④
过去三个月	-2.88%	0.58%	-1.87%	0.61%	-1.01%	-0.03%
过去六个月	5.64%	0.62%	9.30%	0.67%	-3.66%	-0.05%
过去一年	4.35%	0.69%	11.56%	0.74%	-7.21%	-0.05%
过去三年	35.87%	0.82%	54.58%	0.88%	-18.71%	-0.06%
过去五年	43.72%	0.96%	52.30%	1.01%	-8.58%	-0.05%
过去七年	75.60%	1.23%	119.90%	1.30%	-44.30%	-0.07%
过去十年	137.26%	1.11%	201.16%	1.16%	-63.90%	-0.05%
自基金合同生效起至今	284.73%	1.07%	472.50%	1.13%	-187.77%	-0.06%

大成标普 500 等权重指数(QDII)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	-2.95%	0.58%	-1.87%	0.61%	-1.08%	-0.03%
过去六个月	5.48%	0.62%	9.30%	0.67%	-3.82%	-0.05%
过去一年	4.04%	0.69%	11.56%	0.74%	-7.52%	-0.05%
过去三年	34.95%	0.82%	54.58%	0.88%	-19.63%	-0.06%
自基金合同生效起至今	27.98%	0.82%	46.57%	0.88%	-18.59%	-0.06%

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

2、本基金自 2023 年 8 月 30 日起增设 C 类基金份额类别，C 类的净值增长率和业绩比较基准收益率自 2023 年 9 月 4 日有份额之日开始计算。

3、同期业绩比较基准以美元计价，不包含人民币汇率变动等因素产生的效应。

§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		
冉凌浩	本基金基金经理	2011 年 8 月 26 日	-	23 年	英国曼彻斯特大学商学院金融学硕士。2003 年 4 月至 2004 年 6 月就职于国信证券研究部，任研究员。2004 年 6 月至 2005 年 9 月就职于华西证券研究部，任高级研究员。2005 年 9 月加入大成基金管理有限公司，曾担任金融工程师、境外市场研究员及基金经理助理，现任国际业务部基金经理。2011 年 8 月 26 日起任大成标普 500 等权重指数型证券投资基金基金经理。2014 年 11 月 13 日起任大成纳斯达克 100 交易型开放式指数证券投资基金联接基金（QDII）（转型前为大成纳斯达克 100 指数证券投资基金）基金经理。2016 年 12 月 2 日至 2023 年 3 月 14 日任大成恒生综合中小型股指数基金

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

注：1、任职日期、离任日期为本基金管理人作出决定之日。

2、证券从业年限的计算标准遵从中国证监会《证券基金经营机构董事、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 报告期内本基金运作遵规守信情况说明

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业绩表现说明

2026 年第三季度，美股基本呈现小幅震荡的走势，但在十月初又创出了历史新高。三季度美股走势主要受以下因素影响：

从宏观经济来看，美国宏观经济依然保持着相对稳定的增长趋势。最新公布的第二季度 GDP 增速季环比折年率为 2.2%，而亚特兰大联储 GDPNow 模型预测第三季度 GDP 增速还要高于第二季度。从细分数据来看，个人消费与制造业 PMI 保持在非常景气的区间，就业数据也基本稳定，但通胀数据受高油价的影响有所波动。

从国际局势来看，中东地缘政治局势起起伏伏，这也造成了国际油价的波动，并会对通胀水平产生重要影响。

从货币政策来看，迫于通胀的压力，美联储在 9 月份加息 25BP，这是美联储三年来的首次加息行为，同时市场预期未来美联储还会有加息行为。

根据最新的财报，美股主要指数的二季度成份股盈利取得了较好的增长，这也是美股持续上涨的最重要支柱。

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

截至本报告期末大成标普 500 等权重指数(QDII)A 的基金份额净值为 2.7060 元，本报告期基金份额净值增长率为-2.88%，同期业绩比较基准收益率为-1.87%；截至本报告期末大成标普 500

等权重指数(QDII)C 的基金份额净值为 2.6901 元，本报告期基金份额净值增长率为-2.95%，同期业绩比较基准收益率为-1.87%。

4.5 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（人民币元）	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	1,082,558,128.56	90.51
	其中：普通股	1,082,558,128.56	90.51
	优先股	-	-
	存托凭证	-	-
	房地产信托凭证	-	-
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	资产支持证券	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
	其中：远期	-	-
	期货	-	-
	期权	-	-
	权证	-	-
5	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
6	货币市场工具	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	83,147,548.03	6.95
8	其他资产	30,394,810.32	2.54
9	合计	1,196,100,486.91	100.00

5.2 报告期末在各个国家（地区）证券市场的股票及存托凭证投资分布

国家（地区）	公允价值（人民币元）	占基金资产净值比例（%）
美国	1,082,558,128.56	93.00
合计	1,082,558,128.56	93.00

5.3 报告期末按行业分类的股票及存托凭证投资组合

5.3.1 报告期末指数投资按行业分类的股票及存托凭证投资组合

行业类别	公允价值（人民币元）	占基金资产净值比例(%)

通讯	53,756,311.18	4.62
非必需消费品	100,820,047.86	8.66
必需消费品	70,478,941.30	6.05
能源	44,906,629.33	3.86
金融	166,221,962.00	14.28
房地产	63,297,335.54	5.44
医疗保健	134,047,686.65	11.52
工业	172,379,834.35	14.81
材料	55,133,166.39	4.74
科技	156,810,262.31	13.47
公用事业	64,705,951.65	5.56
政府	-	-
合计	1,082,558,128.56	93.00

注：以上分类采用彭博行业分类标准。

5.3.2 报告期末积极投资按行业分类的股票及存托凭证投资组合

无。

5.4 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的权益投资明细

5.4.1 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及存托凭证投资明细

序号	公司名称(英文)	公司名称(中文)	证券代码	所在证券市场	所属国家（地区）	数量(股)	公允价值（人民币元）	占基金资产净值比例(%)
1	Moderna Inc	莫德纳公司	MRNA US	纳斯达克证券交易所	美国	2,476	3,211,318.04	0.28
2	Everpure Inc	爱惠浦股份有限公司	P US	美国纽约证券交易所	美国	3,460	3,047,624.67	0.26
3	Illumina Inc	因美纳公司	ILMN US	纳斯达克证券交易所	美国	1,638	3,019,263.43	0.26
4	Crowdstrike Holdings Inc	CrowdStrike 控股股份有限公司	CRWD US	纳斯达克证券交易所	美国	1,616	2,881,518.24	0.25
5	Revvity Inc	Revvity 股份有限公司	RVTY US	美国纽约证券交易所	美国	2,711	2,791,596.51	0.24
6	Datadog	数据狗	DDOG	纳斯达	美国	1,490	2,748,166.63	0.24

	Inc		US	克证券交易所				
7	Palo Alto Networks Inc	派拓网络公司	PANW US	纳斯达克证券交易所	美国	1,002	2,681,274.43	0.23
8	Advanced Micro Devices Inc	AMD公司	AMD US	纳斯达克证券交易所	美国	644	2,653,450.52	0.23
9	Mettler-Toledo International Inc	梅特勒-托利多国际股份有限公司	MTD US	美国纽约证券交易所	美国	260	2,645,863.83	0.23
10	Cadence Design Systems Inc	铿腾电子科技有限公司	CDNS US	纳斯达克证券交易所	美国	1,180	2,624,118.21	0.23

5.4.2 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及存托凭证投资明细

无。

5.5 报告期末按债券信用等级分类的债券投资组合

无。

5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名债券投资明细

无。

5.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名资产支持证券投资明细

无。

5.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名金融衍生品投资明细

无。

5.9 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

无。

5.10 投资组合报告附注

5.10.1 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。

5.10.2 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。

5.10.3 其他资产构成

序号	名称	金额（人民币元）
1	存出保证金	-
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	895,686.69
4	应收利息	-
5	应收申购款	29,499,123.63
6	其他应收款	-
7	其他	-
8	合计	30,394,810.32

5.10.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

无。

5.10.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

5.10.5.1 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。

5.10.5.2 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

无。

5.10.6 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	大成标普 500 等权重指数(QDII)A	大成标普 500 等权重指数(QDII)C
报告期期初基金份额总额	262,138,981.62	75,625,031.26
报告期期间基金总申购份额	78,962,224.04	40,982,649.39
减:报告期期间基金总赎回份额	14,838,558.27	12,110,401.62

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	326,262,647.39	104,497,279.03

注：大成标普 500 等权重指数 QDII 份额变动含人民币份额及美元份额（如有）。

§7 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标普 500 等权重指数证券投资基金的文件；

2、《大成标普 500 等权重指数证券投资基金基金合同》；

3、《大成标普 500 等权重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

2026 年 10 月 27 日