# 大成丰享回报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：招商银行股份有限公司

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。

基金托管人招商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 | 大成丰享回报混合 | |
| 基金主代码 | 009653 | |
| 基金运作方式 | 契约型开放式 | |
| 基金合同生效日 | 2020 年 11 月 18 日 | |
| 报告期末基金份额总额 | 700,142,332.84 份 | |
| 投资目标 | 在严格控制风险的基础上，通过积极主动的投资管理，追求基金资产的长期稳健增值，力争实现超越业绩比较基准的投资回报。 | |
| 投资策略 | 本基金将采用“自上而下”的资产配置策略，在综合判断宏观经济基本面、证券市场走势等宏观因素的基础上，通过动态调整资产配置比例以控制基金资产整体风险。在个券投资方面采用“自下而上”精选策略，通过严谨个股选择、信用分析以及对券种收益水平、流动性的客观判断，综合运用多种投资策略，精选个券构建投资组合。 | |
| 业绩比较基准 | 沪深 300 指数收益率×10%+恒生指数收益率×5%+中债综合全价指数收益率×85% | |
| 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。 | |
| 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 | |
| 下属分级基金的基金简称 | 大成丰享回报混合 A | 大成丰享回报混合 C |
| 下属分级基金的交易代码 | 009653 | 009654 |
| 报告期末下属分级基金的份额总额 | 344,805,743.15 份 | 355,336,589.69 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） | |
|---|---|---|
| | 大成丰享回报混合 A | 大成丰享回报混合 C |
| 1.本期已实现收益 | 8,793,263.90 | 9,369,295.41 |
| 2.本期利润 | 17,269,828.69 | 18,730,896.66 |
| 3.加权平均基金份额本期利润 | 0.0518 | 0.0511 |
| 4.期末基金资产净值 | 417,666,686.87 | 420,436,230.99 |
| 5.期末基金份额净值 | 1.2113 | 1.1832 |

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

大成丰享回报混合 A

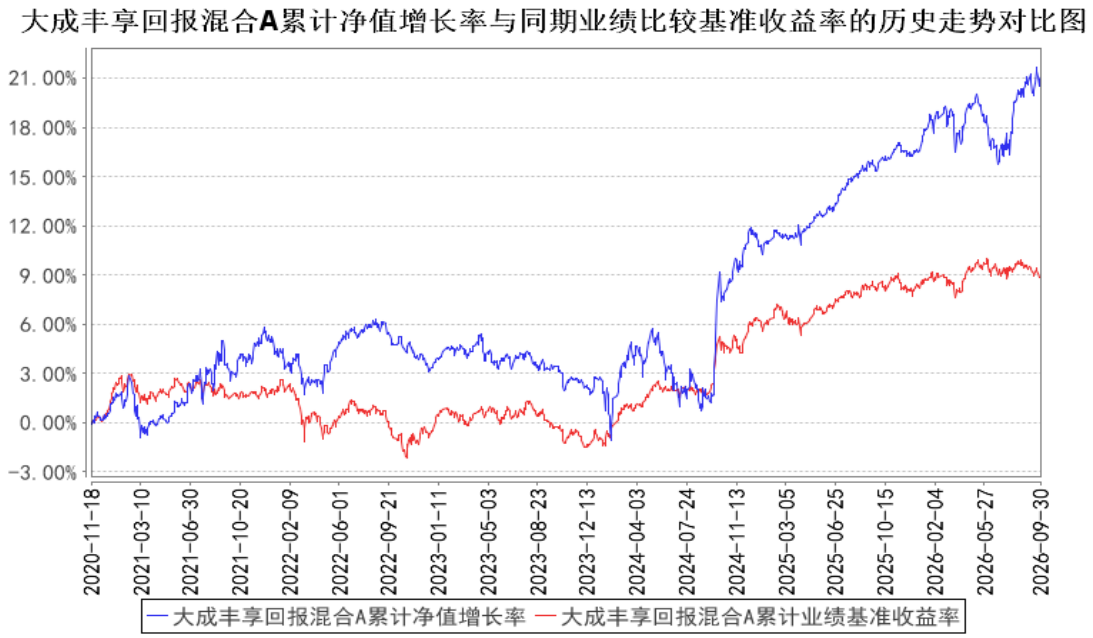
| 阶段 | 净值增长率① | 净值增长率标准差② | 业绩比较基准收益率③ | 业绩比较基准收益率标准差④ | ①－③ | ②－④ |
|---|---|---|---|---|---|---|
| 过去三个月 | 4.51% | 0.34% | -0.46% | 0.15% | 4.97% | 0.19% |
| 过去六个月 | 3.16% | 0.30% | 0.85% | 0.16% | 2.31% | 0.14% |
| 过去一年 | 4.58% | 0.26% | 0.39% | 0.16% | 4.19% | 0.10% |
| 过去三年 | 17.07% | 0.29% | 9.11% | 0.16% | 7.96% | 0.13% |
| 过去五年 | 17.51% | 0.25% | 7.13% | 0.17% | 10.38% | 0.08% |
| 自基金合同生效起至今 | 21.13% | 0.26% | 8.85% | 0.17% | 12.28% | 0.09% |

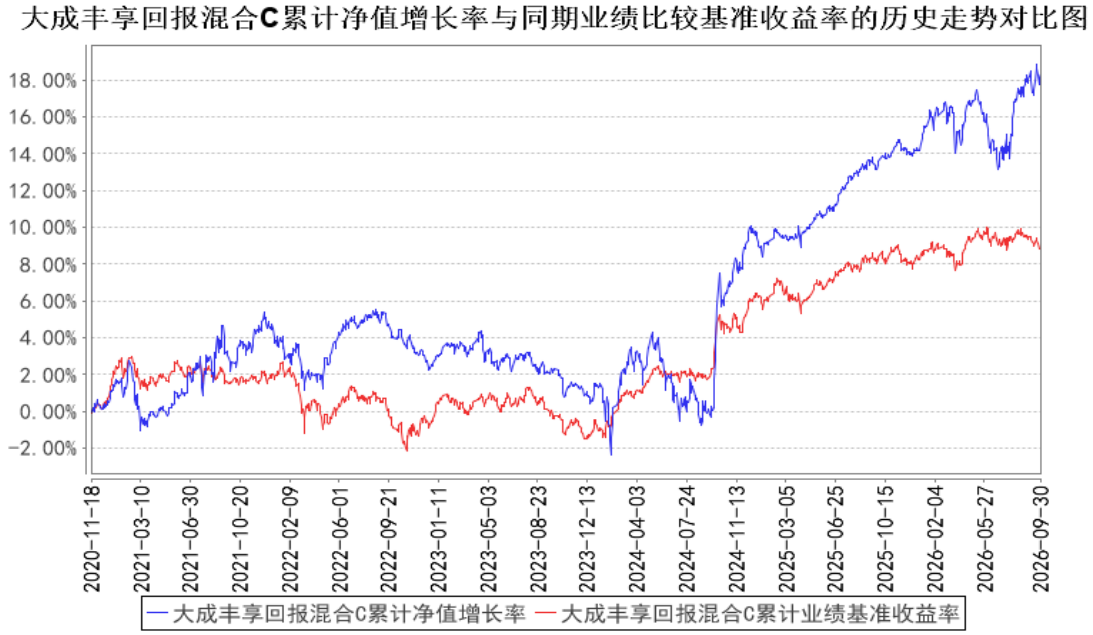
大成丰享回报混合 C

| 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 | 4.40% | 0.34% | -0.46% | 0.15% | 4.86% | 0.19% |
| 过去六个月 | 2.95% | 0.30% | 0.85% | 0.16% | 2.10% | 0.14% |
| 过去一年 | 4.16% | 0.26% | 0.39% | 0.16% | 3.77% | 0.10% |
| 过去三年 | 15.67% | 0.29% | 9.11% | 0.16% | 6.56% | 0.13% |
| 过去五年 | 15.19% | 0.25% | 7.13% | 0.17% | 8.06% | 0.08% |

| | | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|---|
| 自基金合同生效起至今 | 18.32% | 0.26% | 8.85% | 0.17% | 9.47% | 0.09% |

### 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：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 | | |
| 郑煌斌 | 本基金基金经理 | 2025 年 12 月 24 日 | - | 7 年 | 厦门大学经济学硕士。2019 年 6 月加入大成基金管理有限公司，曾担任交易管理部交易员、固定收益总部研究员、混合资产投资部基金经理助理，现任混合资产投资部基金经理。2025 年 12 月 24 日起任大成元享臻利债券型证券投资基金、大成丰享回报混合型证券投资基金基金经理。2026 年 6 月 8 日起任大成民享安盈一年持有期混合型证券投资基金基金经理。2026 年 9 月 4 日起任大成卓享一年持有期混合型证券投资基金基金经理。具有基金从业资格。国籍：中国 |
| 苏秉毅 | 本基金基金经理，混合资产投资部副总监 | 2024 年 1 月 29 日 | - | 22 年 | 清华大学经济学硕士。2004 年 9 月至 2008 年 5 月就职于华夏基金管理有限公司基金运作部。2008 年加入大成基金管理有限公司，曾担任规划发展部高级产品设计师、数量与指数投资部总监助理、指数与期货投资部副总监，现任混合资产投资部副总监。2012 年 8 月 28 日至 2014 年 1 月 23 日任大成中证 500 沪市交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理。2014 年 1 月 24 日至 2014 年 2 月 17 日任大成健康产业股票型证券投资基金基金经理。2012 年 2 月 9 日至 2014 年 9 月 11 日任深证成长 40 交易型开放式指数证券投资基金及大成深证成长 40 交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理。2012 年 8 月 24 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。2013 年 1 月 1 日至 2015 年 8 月 25 日任大成沪深 300 指数证券投资基金基金经理。2013 年 2 月 7 日至 2023 年 3 月 20 日任大成中证 100 交易型开放式指数证券投资基金基金经理。2015 年 6 月 5 日至 2023 年 4 月 10 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。2015 年 6 月 29 日至 2020 年 11 月 13 日任大成中证互联网金融指数分级证券投资基金基金经理。2016 年 3 月 4 日至 2023 年 4 月 19 日任大成沪深 300 指数证券投资基金基金经理。2016 年 3 月 4 日起任大成核心双动力混合型证券投资基金基金经理。2018 年 6 月 26 日起任大 |

| | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|
| | | | | | 成景恒混合型证券投资基金基金经理。2021 年 4 月 23 日至 2023 年 7 月 13 日任大成智惠量化多策略灵活配置混合型证券投资基金基金经理。2023 年 4 月 25 日起任大成卓享一年持有期混合型证券投资基金基金经理。2023 年 8 月 1 日至 2025 年 1 月 16 日任大成中证 1000 指数增强型发起式证券投资基金基金经理。2024 年 1 月 29 日起任大成丰享回报混合型证券投资基金基金经理。2024 年 12 月 9 日起任大成绝对收益策略混合型发起式证券投资基金基金经理。2025 年 11 月 4 日起任大成元享臻利债券型证券投资基金基金经理。2025 年 12 月 24 日起任大成元瑞诚利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

三季度，中东局势依然处于拉锯状态。油价不断攀升，继续推高通胀预期，美国长期国债收益率创出近年新高。AI 叙事也产生了一定变化，全球资本避险情绪抬头，部分境外股市大幅回调。和境外市场相比，境内资本市场表现有所不同，长债继续走牛，收益率创年内新低；股票市场则发生了强烈的风格切换。前期涨幅较大的科技股出现明显回调，带动创业板指等宽基指数走低。本季度沪深 300 指数下跌 12.49%，创业板指下跌 27.80%。而煤炭、石化、农业、银行等行业则走强上涨，部分对冲了科技行业的下跌。和上半年类似，本季度多数宽基指数涨跌幅主要由少数股票贡献，虽然指数整体下跌，但超过半数股票录得正收益。

本季度权益组合风格保持稳定，持有较多低位股票，市值维度和中盘股较为接近，仓位总体保持中高水平。除受益市场风格切换外，打新也是本季度基金收益重要来源。债券部分适当提升久期，结构上增加了超长期限品种的配置。

## 4.5 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末大成丰享回报混合 A 的基金份额净值为 1.2113 元，本报告期基金份额净值增长率为 4.51%，同期业绩比较基准收益率为-0.46%；截至本报告期末大成丰享回报混合 C 的基金份额净值为 1.1832 元，本报告期基金份额净值增长率为 4.40%，同期业绩比较基准收益率为-0.46%。

## 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 | 217,164,627.83 | 25.87 |
| | 其中：股票 | 217,164,627.83 | 25.87 |
| 2 | 基金投资 | - | - |
| 3 | 固定收益投资 | 491,967,832.62 | 58.60 |
| | 其中：债券 | 491,967,832.62 | 58.60 |
| | 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 | 115,007,184.18 | 13.70 |
| | 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 | 11,954,057.09 | 1.42 |
| 8 | 其他资产 | 3,512,507.09 | 0.42 |
| 9 | 合计 | 839,606,208.81 | 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 | 2,155,916.00 | 0.26 |
| B | 采矿业 | 39,069.96 | 0.00 |
| C | 制造业 | 141,779,280.33 | 16.92 |
| D | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | 2,126,447.66 | 0.25 |
| E | 建筑业 | 2,778,080.00 | 0.33 |
| F | 批发和零售业 | 11,654,342.00 | 1.39 |
| G | 交通运输、仓储和邮政业 | 6,809,648.00 | 0.81 |
| H | 住宿和餐饮业 | - | - |
| I | 信息传输、软件和信息技术服务业 | 21,430,183.88 | 2.56 |
| J | 金融业 | 6,774,088.00 | 0.81 |
| K | 房地产业 | 11,833,224.00 | 1.41 |
| L | 租赁和商务服务业 | 1,957,368.00 | 0.23 |
| M | 科学研究和技术服务业 | - | - |
| N | 水利、环境和公共设施管理业 | 4,717,560.00 | 0.56 |
| O | 居民服务、修理和其他服务业 | - | - |
| P | 教育 | - | - |
| Q | 卫生和社会工作 | 3,109,420.00 | 0.37 |
| R | 文化、体育和娱乐业 | - | - |
| S | 综合 | - | - |
| | 合计 | 217,164,627.83 | 25.91 |

### 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 | 002468 | 申通快递 | 370,000 | 5,402,000.00 | 0.64 |
| 2 | 002705 | 新宝股份 | 423,600 | 4,922,232.00 | 0.59 |
| 3 | 000913 | 钱江摩托 | 436,400 | 4,669,480.00 | 0.56 |
| 4 | 002439 | 启明星辰 | 296,400 | 4,351,152.00 | 0.52 |
| 5 | 600252 | 中恒集团 | 1,966,400 | 4,326,080.00 | 0.52 |
| 6 | 688696 | 极米科技 | 50,478 | 4,280,029.62 | 0.51 |
| 7 | 002075 | 沙钢股份 | 1,137,200 | 4,002,944.00 | 0.48 |
| 8 | 600155 | 华创云信 | 666,400 | 3,945,088.00 | 0.47 |
| 9 | 002145 | 钛能化学 | 836,400 | 3,839,076.00 | 0.46 |
| 10 | 688825 | 长鑫科技 | 98,972 | 3,825,267.80 | 0.46 |

## 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 | 64,668,401.28 | 7.72 |
| 2 | 央行票据 | - | - |
| 3 | 金融债券 | 314,346,594.53 | 37.51 |
| | 其中：政策性金融债 | 164,506,306.86 | 19.63 |
| 4 | 企业债券 | 10,158,523.84 | 1.21 |
| 5 | 企业短期融资券 | - | - |
| 6 | 中期票据 | 71,727,242.75 | 8.56 |
| 7 | 可转债（可交换债） | - | - |
| 8 | 同业存单 | - | - |
| 9 | 其他 | 31,067,070.22 | 3.71 |
| 10 | 合计 | 491,967,832.62 | 58.70 |

## 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 | 240403 | 24 农发 03 | 500,000 | 50,774,534.25 | 6.06 |
| 2 | 09250207 | 25 国开清发 07 | 500,000 | 50,401,589.04 | 6.01 |
| 3 | 102680784 | 26 江西交投 MTN003 | 300,000 | 30,346,691.51 | 3.62 |
| 4 | 260410 | 26 农发 10 | 300,000 | 30,208,939.73 | 3.60 |
| 5 | 092280132 | 22 建行二级资本债 02B | 200,000 | 22,356,227.95 | 2.67 |

## 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

| 代码 | 名称 | 持仓量（买/卖） | 合约市值(元) | 公允价值变动（元） | 风险说明 |
|---|---|---|---|---|---|
| IM2610 | IM2610 | 10 | 14,598,800.00 | -537,186.67 | - |
| 公允价值变动总额合计（元） | | | | | -537,186.67 |
| 股指期货投资本期收益（元） | | | | | 3,706,887.19 |
| 股指期货投资本期公允价值变动（元） | | | | | 1,128,163.33 |

注：买入持仓量以正数表示，卖出持仓量以负数表示，单位为手。

### 5.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金投资股指期货将以投资组合避险和有效管理为目的，通过套期保值策略，对冲系统性风险，应对组合构建与调整中的流动性风险，力求风险收益的优化。

套期保值实质上是利用股指期货多空双向和杠杆放大的交易功能，改变投资组合的 beta，以达到适度增强收益或控制风险的目的。为此，套期保值策略分为多头套期保值和空头套期保值。

多头保值策略是指基于股市将要上涨的预期或建仓要求，需要在未来买入现货股票，为了控制股票买入成本而预先买入股指期货合约的操作；空头套期保值是指卖出期货合约来对冲股市系统性风险，控制与回避持有股票的风险的操作。

基金管理人依据对股市未来趋势的研判、本基金的风险收益目标以及投资组合的构成，决定是否对现有股票组合进行套期保值以及采用何种套期保值策略。

在构建套期保值组合过程中，基金管理人通过对股票组合的结构分析，分离组合的系统性风险（beta）及非系统性风险。基金管理人将关注股票组合 beta 值的易变性以及股指期货与指数之间基差波动对套期保值策略的干扰，通过大量数据分析与量化建模，确立最优套保比率。

在套期保值过程中，基金管理人将不断精细和不断修正套保策略，动态管理套期保值组合。主要工作包括，基于合理的保证金管理策略严格进行保证金管理；对投资组合 beta 系数的实时监控，全程评估套期保值的效果和基差风险，当组合 beta 值超过事先设定的 beta 容忍度时，需要

对套期保值组合进行及时调整；进行股指期货合约的提前平仓或展期决策管理。

## 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

国债期货作为利率衍生品的一种，有助于管理债券组合的久期、流动性和风险水平。基金管理人将按照相关法律法规的规定，结合对宏观经济形势和政策趋势的判断、对债券市场进行定性和定量分析。构建量化分析体系，对国债期货和现货的基差、国债期货的流动性、波动水平、套期保值的有效性等指标进行跟踪监控，在最大限度保证基金资产安全的基础上，力求实现所资产的长期稳定增值。为有效控制债券投资的系统性风险，本基金根据风险管理的原则，以套期保值为目的，适度运用国债期货进行投资，提高投资组合的运作效率。

### 5.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

| 代码 | 名称 | 持仓量（买/卖） | 合约市值(元) | 公允价值变动（元） | 风险指标说明 |
|---|---|---|---|---|---|
| TL2612 | TL2612 | -24 | -28,046,400.00 | -269,200.00 | - |
| 公允价值变动总额合计（元） | | | | | -269,200.00 |
| 国债期货投资本期收益（元） | | | | | -318,935.27 |
| 国债期货投资本期公允价值变动（元） | | | | | -195,520.00 |

注：买入持仓量以正数表示，卖出持仓量以负数表示，单位为手。

### 5.10.3 本期国债期货投资评价

为有效控制债券投资的系统性风险，本基金根据风险管理的原则，以套期保值为目的，适度运用国债期货进行投资，提高投资组合的运作效率。

## 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 20 浦发银行二级 02 的发行主体上海浦东发展银行股份有限公司于 2025 年 10 月 31 日因相关互联网贷款、代销等业务管理不审慎等受到国家金融监督管理总局处罚；于 2025 年 12 月 19 日因相关理财、代销等业务管理不审慎，员工管理不到位等受到国家金融监督管理总局处罚；于 2026 年 2 月 12 日因违反账户管理规定、违反清算管理规定、违反银行卡收单业务管理规定、违反反假货币业务管理规定、占压财政存款或资金、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〔2026〕27 号）。本基金认为，对上海浦东发展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 22 建行二级资本债 02B 的发行主体中国建设银行股份有限公司于 2026 年 2 月 14 日因违反账户管理规定、违反特约商户管理规定、违反人民币流通管理规定、违反反假货币业务管理规定、占压财政存款或资金、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〔2026〕5 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、重要信息系统应急管理不足等受到国家金融监督管理总局处罚。本基金认为，对中国建设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。

3、本基金投资的前十名证券 23 邮储银行二级资本债 01 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 | 2,787,228.83 |
| 2 | 应收证券清算款 | - |
| 3 | 应收股利 | - |
| 4 | 应收利息 | - |
| 5 | 应收申购款 | 725,278.26 |
| 6 | 其他应收款 | - |
| 7 | 其他 | - |
| 8 | 合计 | 3,512,507.09 |

## 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

| 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 | 688825 | 长鑫科技 | 3,825,267.80 | 0.46 | 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

| 项目 | 大成丰享回报混合 A | 大成丰享回报混合 C |
|---|---|---|
| 报告期期初基金份额总额 | 327,158,676.31 | 335,373,937.45 |
| 报告期期间基金总申购份额 | 24,168,075.03 | 210,134,966.52 |
| 减:报告期期间基金总赎回份额 | 6,521,008.19 | 190,172,314.28 |
| 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 | 344,805,743.15 | 355,336,589.69 |

## §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（%） |
| 个人 | 1 | 20260701-20260930 | 295,825,379.98 | - | - | 295,825,379.98 | 42.25 |
| 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

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丰享回报混合型证券投资基金的文件；

2、《大成丰享回报混合型证券投资基金基金合同》；

3、《大成丰享回报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**