大成蓝筹稳健证券投资基金
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	大成蓝筹稳健混合
基金主代码	090003
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2004 年 6 月 3 日
报告期末基金份额总额	1,124,018,562.07 份
投资目标	通过精选符合本基金投资理念、流动性良好的证券，在控制非系统风险的前提下获取投资收益，同时辅助运用一系列数量分析方法，有效控制系统性风险，实现基金资产的中长期稳定增值。
投资策略	本基金资产配置策略利用修正的恒定比例投资组合保险策略（CPPI）来动态调整基金中股票、债券和现金的配置比例；行业配置采取较为积极的策略，以投资基准的行业权重为基础，以行业研究及比较分析为核心，通过适时增大或降低相应行业的投资权重，使整体投资表现跟上或超越投资基准；个股选择策略则采用蓝筹成分股优选策略，运用“价值－势头”选股方法，优选出被市场低估并有良好市场表现，处于价值回归阶段的天相 280 指数成分股投资；债券投资采用完全积极的投资策略，采用利率预测、久期管理、收益率曲线移动策略、相对价值评估、收益率利差策略、套利交易策略以及利用正逆回购进行杠杆操作等积极的投资策略。
业绩比较基准	沪深 300 指数收益率*85%+中债-国债总财富(1-3 年)指数收益率*15%
风险收益特征	本基金为混合型基金，其预期风险与收益水平低于股票

	型基金，高于债券型基金和货币市场基金。	
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	大成蓝筹稳健混合 A	大成蓝筹稳健混合 C
下属分级基金的交易代码	090003	019182
下属分级基金的前端交易代码	090003	-
下属分级基金的后端交易代码	091003	-
报告期末下属分级基金的份额总额	1,122,119,489.95 份	1,899,072.12 份

注：本基金业绩比较基准自 2026 年 9 月 21 日起由原“天相 280 指数*70%＋中债综合指数*30%”变更为“沪深 300 指数收益率*85%+中债-国债总财富(1-3 年)指数收益率*15%”。

§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）	
	大成蓝筹稳健混合 A	大成蓝筹稳健混合 C
1.本期已实现收益	2,856,502.93	4,704.38
2.本期利润	-246,200,285.35	-463,573.59
3.加权平均基金份额本期利润	-0.2172	-0.2213
4.期末基金资产净值	1,156,924,001.73	1,927,954.81
5.期末基金份额净值	1.0310	1.0152

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

大成蓝筹稳健混合 A

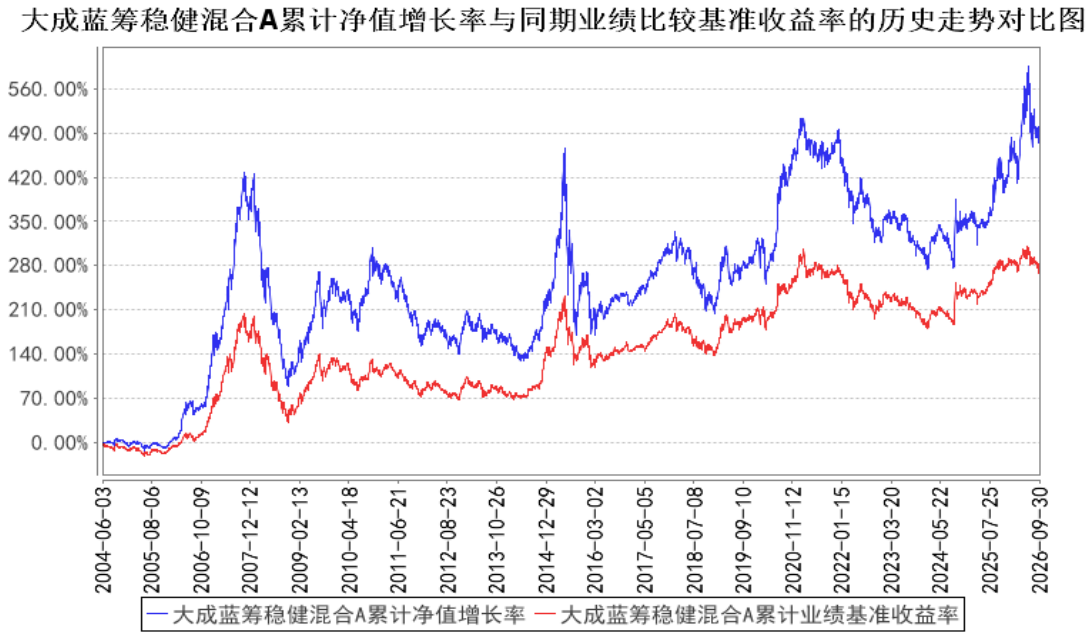
阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①－③	②－④
过去三个月	-17.32%	2.03%	-9.14%	0.93%	-8.18%	1.10%
过去六个月	10.76%	1.98%	-0.80%	0.92%	11.56%	1.06%
过去一年	7.62%	1.72%	-3.28%	0.81%	10.90%	0.91%
过去三年	37.34%	1.38%	18.96%	0.81%	18.38%	0.57%
过去五年	3.46%	1.25%	1.20%	0.80%	2.26%	0.45%
过去七年	53.18%	1.25%	27.40%	0.84%	25.78%	0.41%

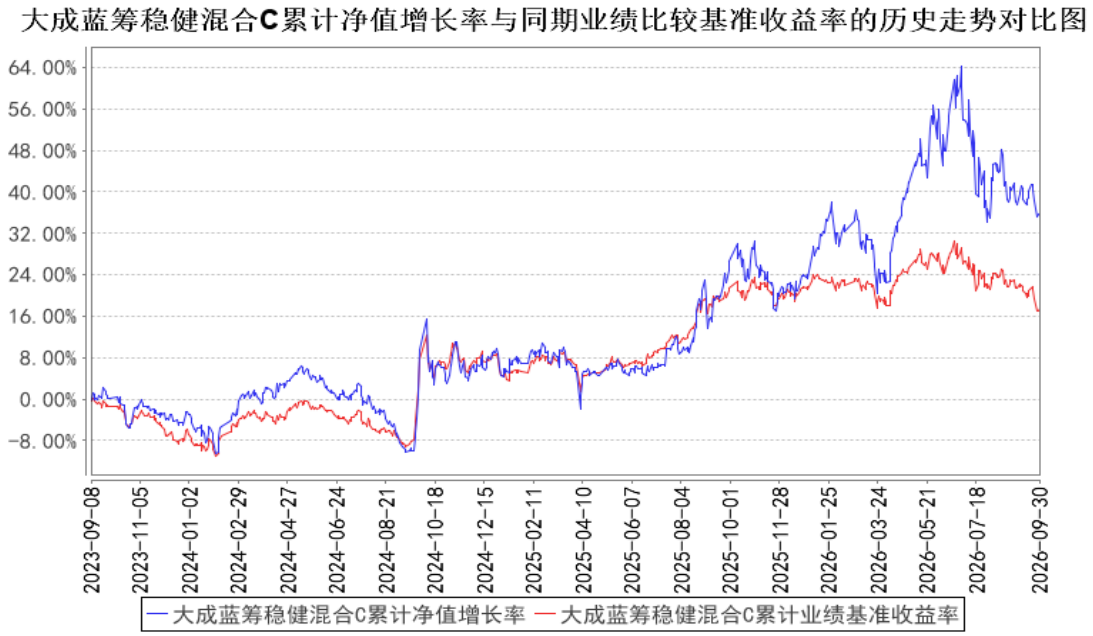
过去十年	75.68%	1.20%	52.38%	0.82%	23.30%	0.38%
自基金合同生效起至今	474.83%	1.48%	269.62%	1.10%	205.21%	0.38%

大成蓝筹稳健混合 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	-17.42%	2.03%	-9.14%	0.93%	-8.28%	1.10%
过去六个月	10.50%	1.97%	-0.80%	0.92%	11.30%	1.05%
过去一年	7.10%	1.72%	-3.28%	0.81%	10.38%	0.91%
过去三年	35.29%	1.38%	18.96%	0.81%	16.33%	0.57%
自基金合同生效起至今	35.56%	1.37%	17.42%	0.80%	18.14%	0.57%

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、本基金合同规定，基金管理人应当自基金合同生效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。依据本基金 2005 年 8 月 31 日《关于调整大成蓝筹稳健证券投资基金资产配置比例的公告》，本基金投资股票比例为基金资产净值的 30%～95%，投资债券比例为基金资产净值的 0%～65%，现金或到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%，法律法规另有规定时从其规定。

2、本基金自 2023 年 9 月 7 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从 2023 年 9 月 8 日 C 类有份额之日开始计算。

§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		
齐炜中	本基金基金经理	2021 年 6 月 21 日	-	14 年	英国约克大学金融学硕士。2012 年 7 月加入大成基金管理有限公司，曾担任研究部研究员、行业研究主管、大成积极成长混合型证券投资基金基金经理助理，现任股票投资部总监助理。2020 年 2 月 3 日起任大成消费主题混合型证券投资基金、大成景阳领先混合型证券投资基金基金经理。2021 年 3 月 17 日起任大成一带一路灵活配置混合型证券投资基金基金经理。2021 年 6 月 21 日起任大成蓝筹稳健证券投资基金基金经理。2022 年 11 月 18 日至 2025 年 1 月 9 日任大成消费机遇混

					合型证券投资基金基金经理。2023 年 4 月 25 日至 2026 年 8 月 17 日任大成新兴活力混合型证券投资基金基金经理。2023 年 6 月 13 日起任大成至诚鑫选混合型证券投资基金基金经理。2024 年 8 月 5 日起任大成内需增长混合型证券投资基金基金经理。2025 年 8 月 20 日起任大成悦享生活混合型证券投资基金、大成消费精选股票型证券投资基金基金经理。2026 年 9 月 16 日起任大成新锐产业混合型证券投资基金基金经理。具备基金从业资格。国籍：中国
赵蓬	本基金基金经理	2023 年 8 月 4 日	-	10 年	北京大学经济学硕士。2016 年 2 月至 2019 年 2 月任华泰证券研究所研究员。2019 年 2 月加入大成基金管理有限公司，曾担任研究部研究员、基金经理助理、基金经理，现任股票投资部基金经理。2023 年 8 月 4 日起任大成蓝筹稳健证券投资基金基金经理。2024 年 4 月 25 日起任大成盛世精选灵活配置混合型证券投资基金基金经理。2026 年 8 月 7 日起任大成新兴活力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
黄涛	本基金基金经理	2024 年 1 月 3 日	-	8 年	同济大学工学硕士。曾任广发证券股份有限公司发展研究中心研究员、招商证券资产管理有限公司权益投资部研究员。2021 年 3 月加入大成基金管理有限公司，曾担任研究部研究员、消费研究主管、基金经理助理，现任研究部基金经理。2024 年 1 月 3 日起任大成蓝筹稳健证券投资基金基金经理。2024 年 11 月 18 日起任大成消费机遇混合型证券投资基金基金经理。2026 年 9 月 4 日起任大成成长领航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

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，科技成长板块在海外市场波动、地缘政治扰动以及国内流动性等影响下调整更多，而价值板块获得较好修复。指数层面，上证指数下跌 6.16%，沪深 300 指数下跌 12.49%，中证 500 下跌 17.67%，创业板指下跌 27.80%，科创 50 下跌 30.70%。行业层面，煤炭、石油石化、农林牧渔、银行等涨幅居前，电子、通信、建筑材料、电力设备等跌幅居前。

回到本基金操作上，我们仍然保持高仓位运作，也仍然是基于我们的核心框架在积累公司和评估风险。我们对部分风险暴露和定价上性价比下降的公司做了减持，也对部分底层资产定价低估且经营及预期有改善的公司做了增持。上游资源品领域，关键品种的重要性仍然确定。科技创新是重要的方向，随着一系列关键卡脖子环节的突破，越来越多的公司在产品力上逐步走向领先，相关产业的价值链正在发生重构。内需作为经济活动的重要环节，部分领域经营压力最大的时候

已经过去。我们仍然会将精力聚焦于核心能力适应创新和效率等方向的优质公司，我们对精力投入持乐观态度。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末大成蓝筹稳健混合 A 的基金份额净值为 1.0310 元，本报告期基金份额净值增长率为-17.32%，同期业绩比较基准收益率为-9.14%；截至本报告期末大成蓝筹稳健混合 C 的基金份额净值为 1.0152 元，本报告期基金份额净值增长率为-17.42%，同期业绩比较基准收益率为-9.14%。

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	1,060,260,194.13	89.73
	其中：股票	1,060,260,194.13	89.73
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	108,001,707.38	9.14
8	其他资产	13,314,175.96	1.13
9	合计	1,181,576,077.47	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	11,746,728.00	1.01
B	采矿业	127,470,613.11	11.00
C	制造业	649,745,082.30	56.07
D	电力、热力、燃气及水生产和供应	477,758.60	0.04

	业		
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	944,074.00	0.08
G	交通运输、仓储和邮政业	85,490,142.60	7.38
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	26,526,799.52	2.29
J	金融业	49,016,744.00	4.23
K	房地产业	38,216,702.00	3.30
L	租赁和商务服务业	426,420.00	0.04
M	科学研究和技术服务业	70,199,130.00	6.06
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	1,060,260,194.13	91.49

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	000338	潍柴动力	3,213,200	80,651,320.00	6.96
2	002463	沪电股份	687,700	79,725,061.00	6.88
3	600026	中远海能	3,510,010	72,165,805.60	6.23
4	603259	药明康德	419,500	70,199,130.00	6.06
5	000333	美的集团	869,033	69,609,543.30	6.01
6	300236	上海新阳	645,950	54,789,479.00	4.73
7	601077	渝农商行	7,304,900	49,015,879.00	4.23
8	300394	天孚通信	186,120	48,534,512.40	4.19
9	603893	瑞芯微	219,100	47,231,387.00	4.08
10	600188	兖矿能源	2,381,895	46,304,038.80	4.00

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渝农商行的发行主体重庆农村商业银行股份有限公司于 2025 年 12 月 25 日因贷款“三查”不尽职、对大额风险损失的调查和问责不到位、非现场统计数据差错、未核实保证金来源、滚动开票等受到国家金融监督管理总局重庆监管局处罚（渝金管罚决字〔2025〕29 号）。本基金认为，对重庆农村商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	491,438.79
2	应收证券清算款	12,788,065.34
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	34,671.83
6	其他应收款	-
7	其他	-
8	合计	13,314,175.96

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	大成蓝筹稳健混合 A	大成蓝筹稳健混合 C
报告期期初基金份额总额	1,150,401,995.70	2,117,570.69
报告期期间基金总申购份额	6,213,084.37	493,719.35
减:报告期期间基金总赎回份额	34,495,590.12	712,217.92
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	1,122,119,489.95	1,899,072.12

§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蓝筹稳健证券投资基金的文件；

2、《大成蓝筹稳健证券投资基金基金合同》；

3、《大成蓝筹稳健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