大成中证红利指数证券投资基金
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：中国建设银行股份有限公司

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。

基金托管人中国建设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	大成中证红利指数			
基金主代码	090010			
基金运作方式	契约型开放式			
基金合同生效日	2010 年 2 月 2 日			
报告期末基金份额总额	994,927,054.78 份			
投资目标	通过严格的投资程序约束和数量化风险管理手段，紧密跟踪标的指数，追求指数投资偏离度和跟踪误差最小化，力争控制本基金净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.35%，年化跟踪误差不超过 4%。			
投资策略	本基金主要采取完全复制法，即按照标的指数的成份股组成及其权重构建投资组合，并根据标的指数成份股及其权重的变动进行相应调整。当预期成份股发生调整和成份股发生配股、增发、分红等行为时，以及其他特殊情况（如成份股流动性不足）对本基金跟踪标的指数的效果可能带来影响时，基金管理人可以使用其他适当的方法进行调整，以实现对跟踪误差的有效控制。			
业绩比较基准	中证红利指数×95%＋银行活期存款利率（税后）×5%			
风险收益特征	本基金属于股票基金，风险与收益水平高于混合基金、债券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	中国建设银行股份有限公司			
下属分级基金的基金简称	大成中证红利指数 A	大成中证红利指数 C	大成中证红利指数 E	大成中证红利指数 Y
下属分级基金的交易代码	090010	007801	022169	022927

报告期末下属分级基金的份额总额	895,156,881.11 份	51,944,385.83 份	35,376,773.22 份	12,449,014.62 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）			
	大成中证红利指数 A	大成中证红利指数 C	大成中证红利指数 E	大成中证红利指数 Y
1.本期已实现收益	34,771,260.44	2,093,563.64	919,449.87	522,247.03
2.本期利润	229,147,528.42	14,161,914.31	3,094,552.42	3,051,641.53
3.加权平均基金份额本期利润	0.2545	0.2572	0.0903	0.2544
4.期末基金资产净值	2,416,932,806.27	139,052,081.36	95,230,910.62	34,030,384.60
5.期末基金份额净值	2.7000	2.6769	2.6919	2.7336

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

大成中证红利指数 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	10.37%	0.95%	8.91%	0.96%	1.46%	-0.01%
过去六个月	-0.99%	0.92%	-3.86%	0.93%	2.87%	-0.01%
过去一年	3.82%	0.85%	0.63%	0.87%	3.19%	-0.02%
过去三年	17.34%	0.92%	6.34%	0.93%	11.00%	-0.01%
过去五年	23.80%	0.95%	4.89%	0.96%	18.91%	-0.01%
过去七年	67.91%	0.99%	29.98%	1.01%	37.93%	-0.02%
过去十年	112.95%	0.97%	38.75%	0.99%	74.20%	-0.02%
自基金合同生效起至今	196.00%	1.24%	73.56%	1.24%	122.44%	0.00%

大成中证红利指数 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	①－③	②－④

				④		
过去三个月	10.34%	0.95%	8.91%	0.96%	1.43%	-0.01%
过去六个月	-1.04%	0.92%	-3.86%	0.93%	2.82%	-0.01%
过去一年	3.72%	0.85%	0.63%	0.87%	3.09%	-0.02%
过去三年	17.00%	0.92%	6.34%	0.93%	10.66%	-0.01%
过去五年	23.19%	0.95%	4.89%	0.96%	18.30%	-0.01%
过去七年	66.58%	0.99%	29.98%	1.01%	36.60%	-0.02%
自基金合同生效起至今	67.52%	0.99%	30.28%	1.00%	37.24%	-0.01%

大成中证红利指数 E

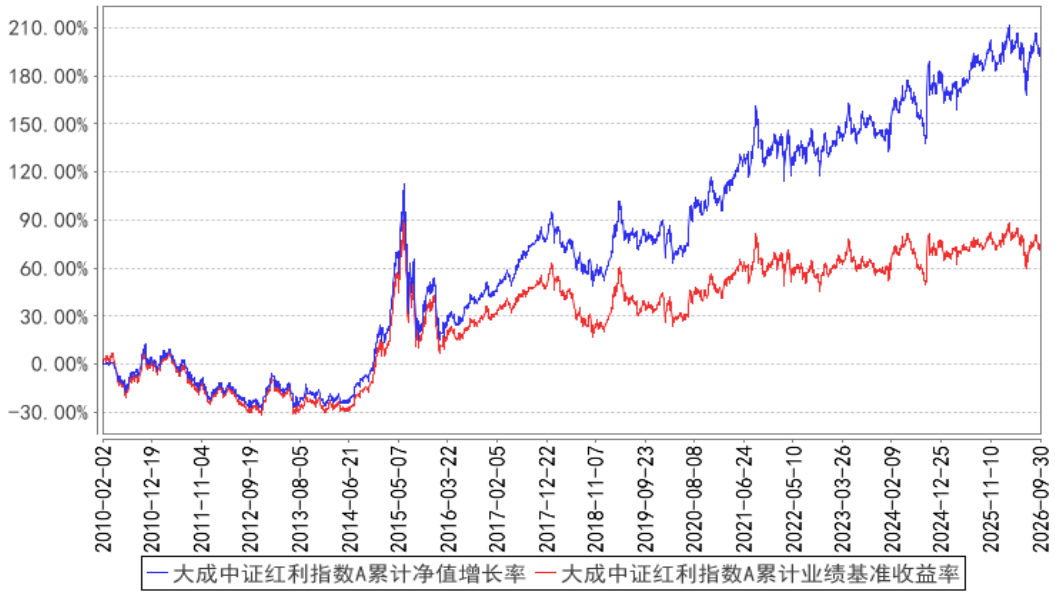
阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①－③	②－④
过去三个月	10.33%	0.95%	8.91%	0.96%	1.42%	-0.01%
过去六个月	-1.05%	0.92%	-3.86%	0.93%	2.81%	-0.01%
过去一年	3.68%	0.85%	0.63%	0.87%	3.05%	-0.02%
自基金合同生效起至今	22.77%	0.98%	14.99%	0.99%	7.78%	-0.01%

大成中证红利指数 Y

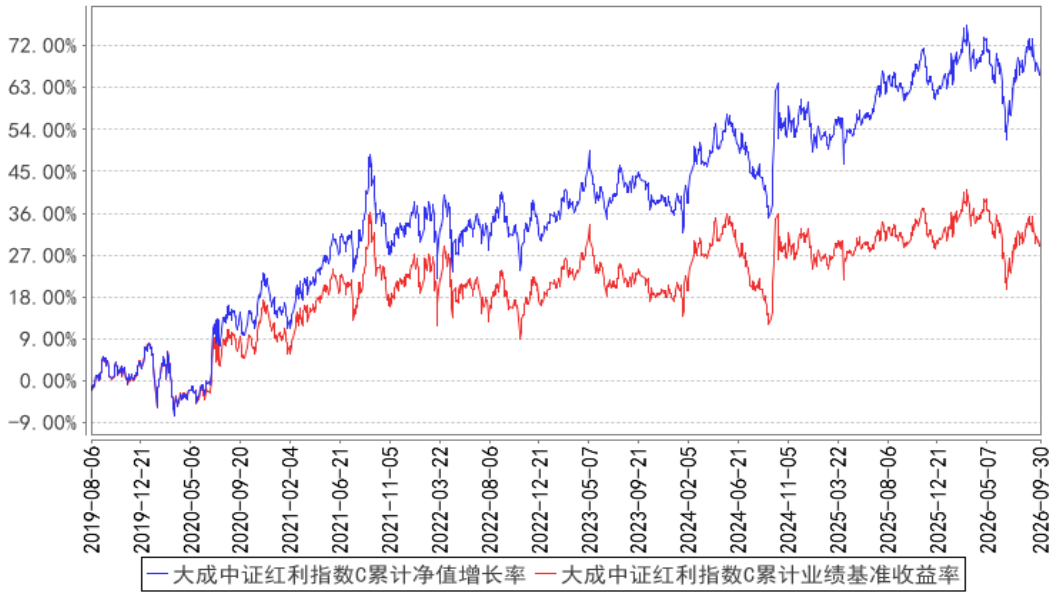
阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①－③	②－④
过去三个月	10.57%	0.95%	8.91%	0.96%	1.66%	-0.01%
过去六个月	-0.64%	0.92%	-3.86%	0.93%	3.22%	-0.01%
过去一年	4.55%	0.86%	0.63%	0.87%	3.92%	-0.01%
自基金合同生效起至今	7.29%	0.82%	-0.99%	0.83%	8.28%	-0.01%

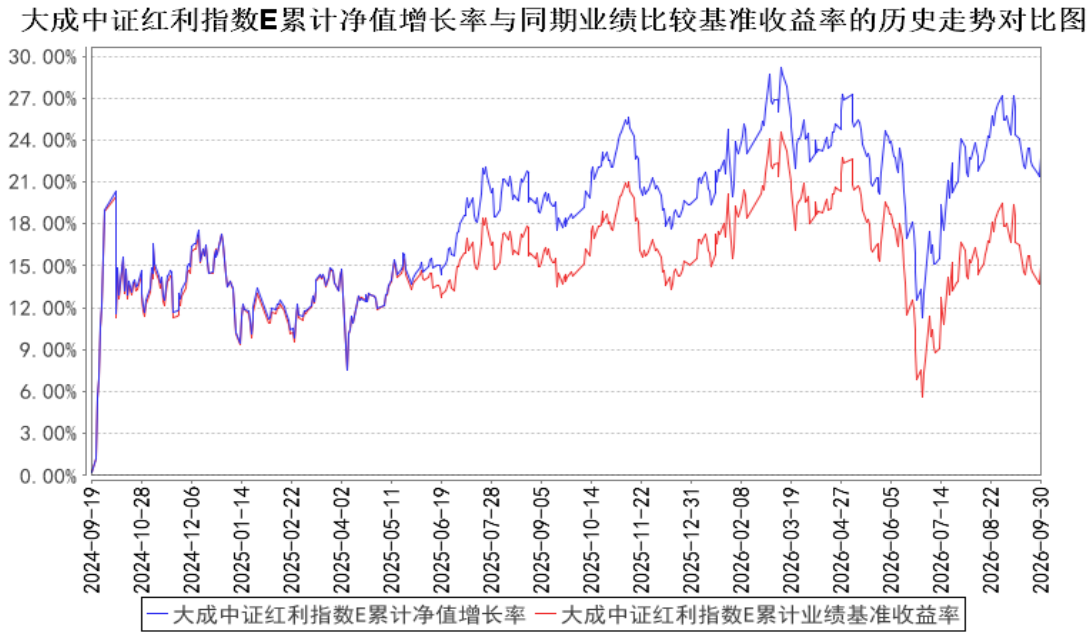
3.2.2 自基金合同生效以来基金累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

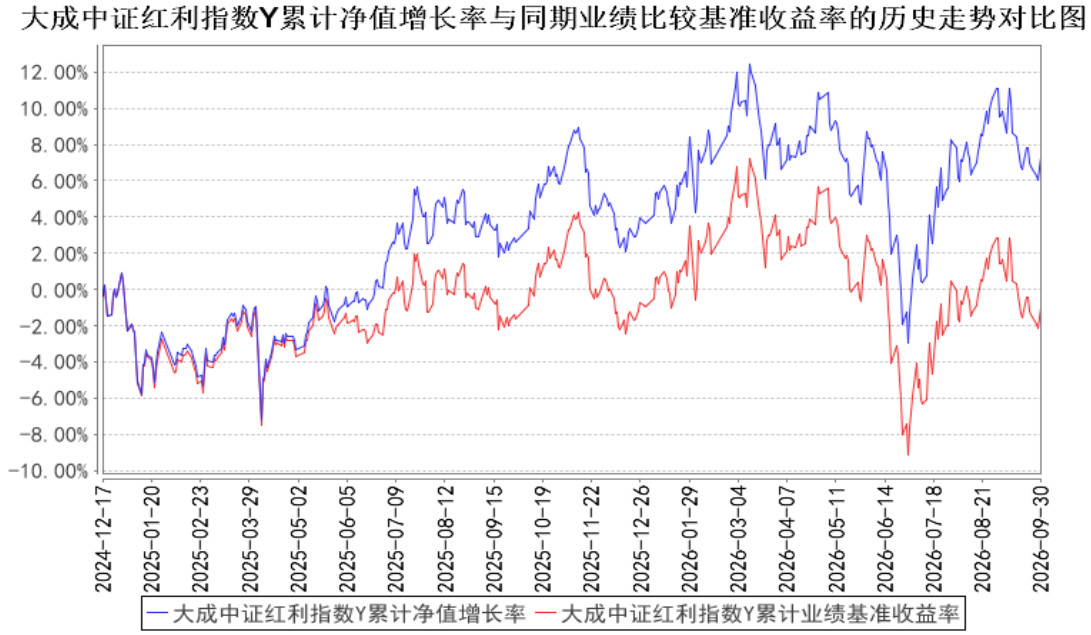
大成中证红利指数A累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



大成中证红利指数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 2019 年 8 月 2 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 2019 年 8 月 6 日有份额之日开始计算。

3、本基金自 2024 年 9 月 13 日起增设 E 类基金份额类别，E 类的净值增长率和业绩比较基准收益率自 2024 年 9 月 19 日有份额之日开始计算。

4、本基金自 2024 年 12 月 13 日起增设 Y 类基金份额类别，Y 类的净值增长率和业绩比较基准收益率自 2024 年 12 月 17 日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		
刘淼	本基金基金经理	2021 年 6 月 17 日	-	18 年	北京大学工商管理硕士。2008 年 4 月至 2011 年 5 月就职于招商基金管理有限公司，任基金核算部基金会计。2011 年 5 月加入大成基金管理有限公司，先后担任基金运营部基金会计、股票投资部投委会秘书兼风控员、数量与指数投资部数量分析师、指数与期货投资部基金经理、指数与期货投资部总监助理。2020 年 6 月 29 日至 2023 年 5 月 30 日任大成 MSCI 中国 A 股质优价值 100 交易型开放式指数证券投资基金基金经理。2020 年 6 月 29 日至 2023 年 6 月 14 日任大成 MSCI 中国 A 股质优价值 100 交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理。2020 年 6 月 29 日至 2025 年 12 月 19 日任深证成长 40 交易型开放式指数证券投资基金、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。2020 年 6 月 29 日至 2022 年 11 月 30 日任大成中证 500 深市交易型开放式指数证券投资基金基金经理。2021 年 4 月 30 日至 2025 年 7 月 29 日任大成中证全指医疗保健设备与服务交易型开放式指数证券投资基金基金经理。2021 年 6 月 17 日起任大成中证红利指数证券投资基金基金经理。2021 年 9 月 2 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。2021 年 9 月 2 日至 2025 年 3 月 17 日任大成中证 A100 交易型开放式指数证券投资基金（更名前为大成中证 100 交易型开放式指数证券投资基金）基金经理。2021 年 9 月 2 日至 2025 年 12 月 19 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。2022 年 6 月 28 日至 2025 年 2 月 18 日任大成中证电池主题指数型发起式证券投资基金基金经理。2022 年 7 月 13 日至 2025 年 3 月 17 日任大成中证上海环交所碳中和交易型开放式指数证券投资基金基金经理。2022 年

					10 月 13 日至 2023 年 10 月 20 日任大成动态量化配置策略混合型证券投资基金基金经理。2023 年 3 月 20 日起任大成有色金属期货交易型开放式指数证券投资基金、大成有色金属期货交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理。2023 年 4 月 14 日起任大成沪深 300 指数证券投资基金基金经理。2024 年 3 月 6 日起任大成中证 A50 交易型开放式指数证券投资基金基金经理。2024 年 4 月 8 日至 2025 年 7 月 29 日任大成中证红利低波动 100 交易型开放式指数证券投资基金基金经理。2024 年 4 月 23 日起任大成中证 A50 交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理。2024 年 5 月 24 日至 2025 年 2 月 18 日任大成中证芯片产业指数型发起式证券投资基金基金经理。2024 年 5 月 28 日至 2025 年 7 月 29 日任大成中证工程机械主题交易型开放式指数证券投资基金基金经理。2024 年 11 月 12 日起任大成中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金（转型前为大成中证 A500 指数型发起式证券投资基金）基金经理。2024 年 11 月 22 日起任大成中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金基金经理。2025 年 4 月 2 日起任大成深证 100 交易型开放式指数证券投资基金基金经理。2025 年 4 月 23 日起任大成中证全指自由现金流交易型开放式指数证券投资基金基金经理。2025 年 7 月 2 日起任大成中证全指自由现金流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。2025 年 7 月 16 日起担任大成创业板人工智能交易型开放式指数证券投资基金基金经理。2025 年 8 月 29 日起任大成创业板 50 交易型开放式指数证券投资基金基金经理。2025 年 9 月 23 日起任大成创业板 50 交易型开放式指数证券投资基金联接基金（转型前为大成创业板 50 指数型证券投资基金）基金经理。2025 年 10 月 21 日起任大成创业板人工智能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。2026 年 2 月 12 日起任大成国证石油天然气指数型发起式证券投资基金基金经理。2026 年 6

					月 16 日起任大成上证科创板 50 成份指数型证券投资基金基金经理。2026 年 7 月 16 日起任大成国证价值 100 指数型证券投资基金基金经理。具备基金从业资格。国籍：中国
孙雨	本基金基金经理，指数与期货投资部执行总监	2025 年 10 月 31 日	-	12 年	中央财经大学经济学硕士。曾任深圳证券交易所信息管理部市场分析师、创金合信基金管理有限公司量化指数与国际部基金经理、申万菱信基金管理有限公司指数投资部基金经理助理、国泰海通证券股份有限公司研究所首席分析师。2025 年 8 月加入大成基金管理有限公司，现任指数与期货投资部执行总监。2025 年 10 月 31 日起任大成中证 A50 交易型开放式指数证券投资基金、大成中证红利指数证券投资基金、大成中证全指医疗保健设备与服务交易型开放式指数证券投资基金、大成中证红利低波动 100 交易型开放式指数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，A 股市场整体震荡下行。收益方面，沪深 300 跌 12.49%；中证 500 跌 17.67%；中证 1000 跌 17.15%；创业板指跌 27.80%；科创 50 跌 30.70%。行业上（申万分类），煤炭、石油石化、农林牧渔涨幅居前；电子、通信和建筑材料表现不佳。风格上，大盘、价值相对占优，上一季度形成的极端成长占优格局在本季完成反向收敛。

报告期内，市场行情的内在逻辑可以概括为四个阶段，依次是交易端去杠杆主导的集中下行，分母端改善驱动与政策面托底下的修复，海外长端利率二次冲击引发的震荡下移，以及长假和季末扰动造成的再度回落。贯穿整个季度的核心矛盾，是流动性环境尤其长端美债利率对高久期资产的压制与人工智能产业景气能否延续之间的博弈。同时，科技筹码的拥挤度与杠杆敞口决定了回撤深度。分阶段看，7 月份，A 股市场在科技行情走到极致后进行了一次剧烈的向下修正。该板块经过大幅上涨后，筹码集中度与融资规模均处于高位，估值与持仓高度绑定于“AI 景气延续”这一单一假设。这种结构下，对海外算力需求的质疑、韩国杠杆 ETF 监管新规与地缘冲击便构成下跌的触发条件。而进一步放大跌幅的是筹码被动减仓与保证金约束相互强化形成的负反馈，高久期、高估值方向首当其冲。直到成交与融资余额快速去化、杠杆压力释放，叠加稳市资金入场，下行才在月底趋于收敛。8 月中上旬，市场以修复为主。不过，本轮行情并非源于新的产业或政策逻辑，而是负反馈链条被切断，杠杆与拥挤度出清较为充分后，抛压自然衰竭。同时，海外加息预期因就业数据转弱而出现回落，外部约束同步缓和；政策面也起到了托底作用。因此，这轮行情带有明显的"位置修复"特征，表现为行业涨幅排序与前期跌幅高度负相关，印证改善的只是估值与筹码，而非主线的置信度。8 月下旬至 9 月中旬，市场转入震荡，重心温和下移。约束来

自海外的定价锚，长端利率不降反升、曲线熊陡，长久期资产所需的风险补偿随之抬升，高估值成长方向受损较重。更关键的是，同样面对利率上行时，美股基本走平，A 股成长板块的调整更深，说明外部冲击只决定方向，放大回撤的则是资产拥挤度。结构上，出于避险考虑，类债属性强的行业如银行、公用事业在这段时间表现相对占优。9 月下旬，国庆长假临近与季末压力叠加，股指再度走弱。跨假期风险溢价抬升，量能持续萎缩，月末全市场进入普跌行情，防御类资产抗跌性突出。

本基金标的指数为中证红利指数。中证红利指数从沪深市场中选取现金股息率高、分红稳定、具有一定规模及流动性的 100 只上市公司证券作为指数样本，以反映沪深市场高红利上市公司证券的整体表现。本基金采取完全复制法进行投资，即原则上按照标的指数的成份股组成及其权重构建投资组合，并根据标的指数成份股及其权重的变动进行相应调整。运作层面上，本基金在报告期内基本保持满仓，各项操作符合基金合同的要求。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末大成中证红利指数 A 的基金份额净值为 2.7000 元，本报告期基金份额净值增长率为 10.37%，同期业绩比较基准收益率为 8.91%；截至本报告期末大成中证红利指数 C 的基金份额净值为 2.6769 元，本报告期基金份额净值增长率为 10.34%，同期业绩比较基准收益率为 8.91%；截至本报告期末大成中证红利指数 E 的基金份额净值为 2.6919 元，本报告期基金份额净值增长率为 10.33%，同期业绩比较基准收益率为 8.91%；截至本报告期末大成中证红利指数 Y 的基金份额净值为 2.7336 元，本报告期基金份额净值增长率为 10.57%，同期业绩比较基准收益率为 8.91%。

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	2,536,411,837.40	94.35
	其中：股票	2,536,411,837.40	94.35
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	150,483,075.96	5.60
8	其他资产	1,485,689.61	0.06
9	合计	2,688,380,602.97	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.1 报告期末指数投资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	660,463,134.13	24.60
C	制造业	568,540,818.15	21.17
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	43,070,321.63	1.60
E	建筑业	68,485,872.28	2.55
F	批发和零售业	51,139,514.98	1.90
G	交通运输、仓储和邮政业	295,419,582.10	11.00
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	646,908,187.88	24.09
K	房地产业	21,270,929.52	0.79
L	租赁和商务服务业	69,518,379.62	2.59
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	22,045,008.40	0.82
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	88,011,068.70	3.28
S	综合	-	-
	合计	2,534,872,817.39	94.40

5.2.2 报告期末积极投资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	39,069.96	0.00
C	制造业	950,076.23	0.04
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	549,873.82	0.02
E	建筑业	-	-
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	-	-
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	-	-
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	1,539,020.01	0.06

5.2.3 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	601919	中远海控	4,972,330	81,397,042.10	3.03
2	600256	广汇能源	8,885,650	59,267,285.50	2.21
3	603565	中谷物流	4,703,524	54,513,843.16	2.03
4	600188	兖矿能源	2,524,615	49,078,515.60	1.83
5	600546	山煤国际	3,688,203	48,389,223.36	1.80
6	601699	潞安环能	3,153,919	47,592,637.71	1.77
7	601168	西部矿业	1,206,100	42,635,635.00	1.59
8	601101	昊华能源	3,312,580	42,169,143.40	1.57
9	601225	陕西煤业	1,620,000	42,168,600.00	1.57
10	600985	淮北矿业	2,633,057	41,786,614.59	1.56

5.3.2 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	001248	华润新能源	58,873	549,873.82	0.02
2	301666	大普微	1,220	403,990.80	0.02
3	001399	惠科股份	6,488	126,580.88	0.00
4	301569	联亚药业	8,321	58,247.00	0.00

5	301660	粤芯半导体	3,205	38,492.05	0.00

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。

5.11.2 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	71,767.41
2	应收证券清算款	55,520.87
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	1,358,401.33
6	其他应收款	-
7	其他	-
8	合计	1,485,689.61

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

5.11.5.1 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。

5.11.5.2 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

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	001248	华润新能源	549,873.82	0.02	新股锁定
2	301666	大普微	403,990.80	0.02	新股锁定
3	001399	惠科股份	126,580.88	0.00	新股锁定
4	301569	联亚药业	58,247.00	0.00	新股未上市
5	301660	粤芯半导体	38,492.05	0.00	新股未上市

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	大成中证红利指数 A	大成中证红利指数 C	大成中证红利指数 E	大成中证红利指数 Y
报告期期初基金份额总额	896,475,073.06	51,763,968.49	6,242,519.06	11,032,134.72
报告期期间基金总申购份额	59,672,940.17	20,634,912.05	37,670,101.81	3,252,816.37
减:报告期期间基金总赎回份额	60,991,132.12	20,454,494.71	8,535,847.65	1,835,936.47
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	895,156,881.11	51,944,385.83	35,376,773.22	12,449,014.62

§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

单位：份

项目	大成中证红利指数 A	大成中证红利指数 C	大成中证红利指数 E	大成中证红利指数 Y
报告期期初管理人持有的本基金份额	-	-	4,560.59	-
报告期期间买入/申购总份额	-	-	-	-
报告期期间卖出/赎回总份额	-	-	-	-
报告期期末管理人持有的本基金份额	-	-	4,560.59	-
报告期期末持有的本基金份额占基金总份额比例（%）	-	-	0.00	-

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中证红利指数证券投资基金的文件；

2、《大成中证红利指数证券投资基金基金合同》；

3、《大成中证红利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