大成北证50成份指数型发起式证券投资基金
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	大成北证 50 成份指数发起式
基金主代码	024161
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2025 年 5 月 27 日
报告期末基金份额总额	426,908,550.23 份
投资目标	本基金通过被动的指数化投资管理，紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差最小化。本基金力争日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.35%，年跟踪误差不超过 4%。
投资策略	本基金的标的指数：北证 50 成份指数 本基金采用完全复制标的指数的方法，进行被动指数化投资。股票投资组合的构建主要按照标的指数的成份股组成及其权重来拟合复制标的指数，并根据标的指数成份股及其权重的变动而进行相应调整，以复制和跟踪标的指数。本基金在严格控制基金的日均跟踪偏离度和年跟踪误差的前提下，力争获取与标的指数相似的投资收益。 由于标的指数编制方法调整、成份股及其权重发生变化（包括配送股、增发、临时调入及调出成份股等）的原因，或因基金的申购和赎回等对本基金跟踪标的指数的效果可能带来影响时，或因某些特殊情况导致流动性不足时，或其他原因导致无法有效复制和跟踪标的指数时，基金管理人可以对投资组合管理进行适当变通和调整，力求降低跟踪误差。

	如果标的指数成份股发生明显负面事件面临退市风险，且指数编制机构暂未作出调整的，基金管理人应当按照基金份额持有人利益优先原则，履行内部决策程序后及时对相关成份股进行调整。 一）股票投资策略 二）债券投资策略 三）资产支持证券投资策略 四）股指期货的交易策略 五）国债期货交易策略 六）股票期权投资策略 七）融资及转融通证券出借业务投资策略 八）存托凭证投资策略	
业绩比较基准	北证 50 成份指数收益率×95%+银行活期存款利率(税后)×5%	
风险收益特征	本基金是股票型基金，其预期风险与预期收益高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。本基金主要投资于标的指数成份股及备选成份股，具有与标的指数相似的风险收益特征。	
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	大成北证 50 成份指数发起式 A	大成北证 50 成份指数发起式 C
下属分级基金的交易代码	024161	024162
报告期末下属分级基金的份额总额	19,947,281.03 份	406,961,269.20 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）	
	大成北证 50 成份指数发起式 A	大成北证 50 成份指数发起式 C
1.本期已实现收益	-1,887,485.49	-19,781,242.90
2.本期利润	-3,021,951.40	-32,464,542.15
3.加权平均基金份额本期利润	-0.1475	-0.1518
4.期末基金资产净值	14,220,876.45	289,155,610.27
5.期末基金份额净值	0.7129	0.7105

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

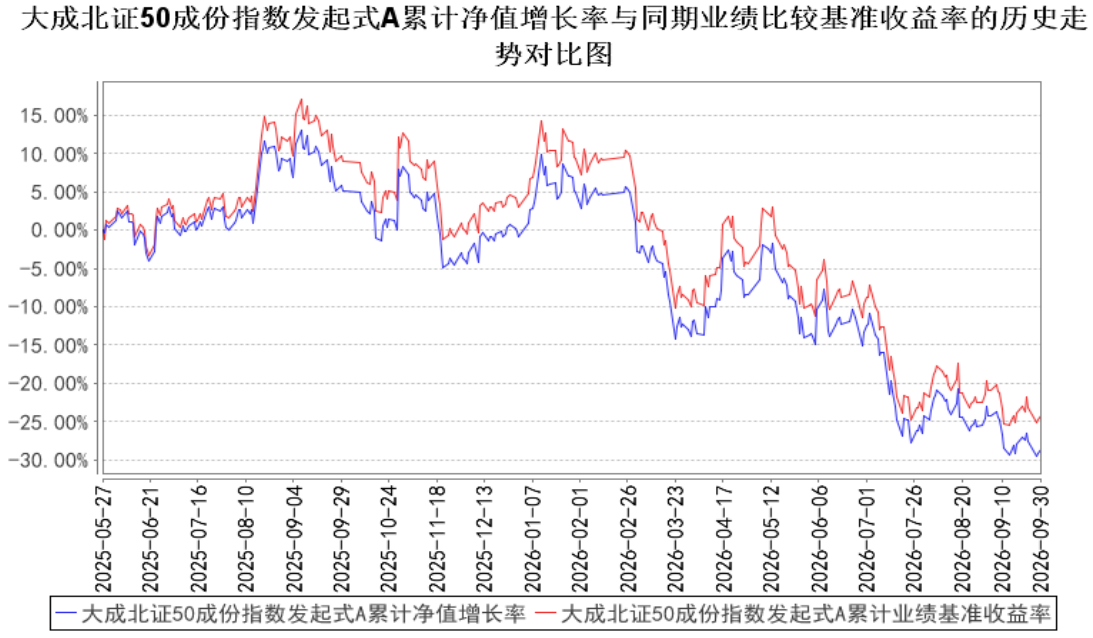
大成北证 50 成份指数发起式 A

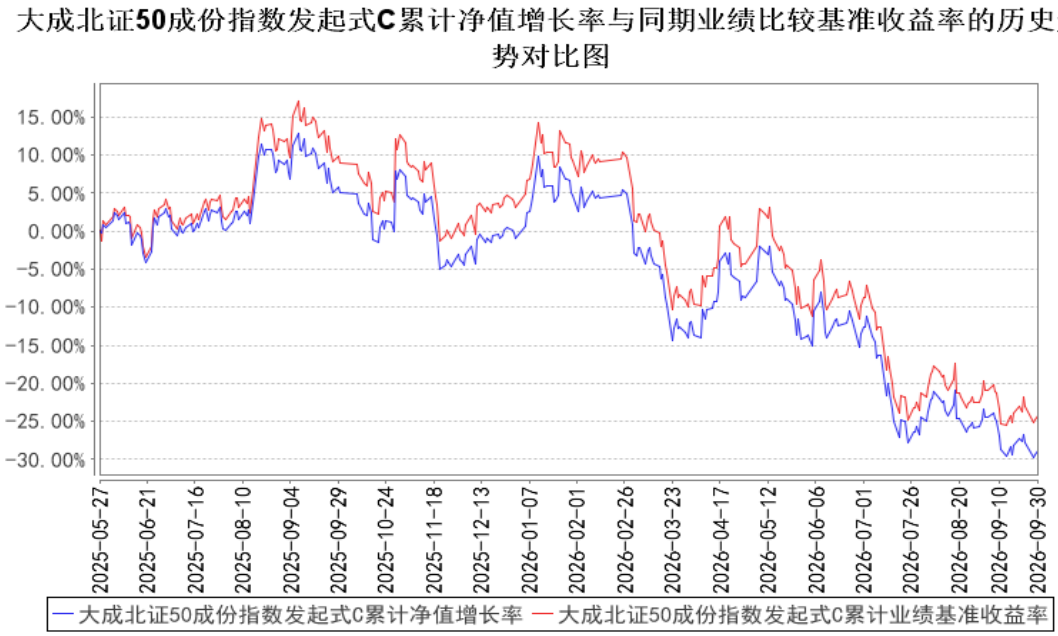
阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①－③	②－④
过去三个月	-17.75%	1.84%	-16.08%	1.88%	-1.67%	-0.04%
过去六个月	-17.23%	1.87%	-15.84%	1.90%	-1.39%	-0.03%
过去一年	-32.18%	1.80%	-30.51%	1.82%	-1.67%	-0.02%
自基金合同生效起至今	-28.71%	1.70%	-24.24%	1.75%	-4.47%	-0.05%

大成北证 50 成份指数发起式 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	-17.80%	1.84%	-16.08%	1.88%	-1.72%	-0.04%
过去六个月	-17.33%	1.87%	-15.84%	1.90%	-1.49%	-0.03%
过去一年	-32.35%	1.80%	-30.51%	1.82%	-1.84%	-0.02%
自基金合同生效起至今	-28.95%	1.70%	-24.24%	1.75%	-4.71%	-0.05%

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		
郑少芳	本基金基金经理	2025 年 5 月 27 日	-	16 年	北京大学医学部理学硕士。2010 年 7 月加入大成基金管理有限公司，曾任研究部研究员、社保及养老投资管理部投资经理、权益专户投资部投资经理、总监助理，现任指数与期货投资部总监助理。2023 年 7 月 5 日至 2025 年 12 月 8 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。2024 年 12 月 9 日起任大成沪深 300 指数证券投资基金、大成中证电池主题交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金（转型前为大成中证电池主题指数型发起式证券投资基金）、大成中证芯片产业指数型发起式证券投资基金基金经理。2025 年 3 月 10 日起任大成中证 A100 交易型开放式指数证券投资基金、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。2025 年 5 月 27 日起任大成北证 50 成份指数型发起式证券投资基金基金经理。2025 年 7

					月 25 日起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、大成中证红利低波动 100 交易型开放式指数证券投资基金、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。2026 年 1 月 13 日起任大成中证电池主题交易型开放式指数证券投资基金基金经理。2026 年 6 月 2 日起任大成国证机器人产业交易型开放式指数证券投资基金基金经理。2026 年 6 月 25 日起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发起式联接基金基金经理。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

回顾 2026 年三季度，A 股由“硬科技单边主导”转为“震荡调整、结构再平衡”。万得全 A 指数涨跌幅-13.33%，上证综合指数涨跌幅-6.16%，沪深 300 指数涨跌幅-12.49%，中证 500 指数涨跌幅-17.67%，中证 1000 指数涨跌幅-17.15%，创业板指涨跌幅-27.80%，科创综指涨跌幅-27.98%。与上半年“双创领先的 K 型分化”相反，估值与拥挤度高位叠加海外流动性预期转向，科技成长调整较深，大盘价值相对抗跌。

国内方面，经济运行总体平稳；报告期内制造业 PMI 逐月回升；8 月以人民币计价的出口同比增长 18.6%，外需韧性延续。政策取向积极：明确财政继续加力、货币环境保持适度宽松；9 月底人民银行将一年期 PSL 利率下调 25 个基点至 1.5%，同步扩大其支持领域并增加科技创新与技改再贷款额度。海外方面，美联储 9 月加息 25 个基点，通胀回落偏慢。

本基金标的指数为北证 50 成份指数。北证 50 成份指数由北交所规模大、流动性好的最具市场代表性的 50 只上市公司证券组成，以综合反映市场整体表现。报告期内，北证 50 成份指数涨跌幅-16.91%，延续调整态势。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。各项操作和指标均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北证 50 成份指数发起式 A 的基金份额净值为 0.7129 元，本报告期基金份额净值增长率为-17.75%，同期业绩比较基准收益率为-16.08%；截至本报告期末大成北证 50 成份指数发起式 C 的基金份额净值为 0.7105 元，本报告期基金份额净值增长率为-17.80%，同期业绩比较基准收益率为-16.08%。

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	270,344,482.93	88.54
	其中：股票	270,344,482.93	88.54
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	15,938,696.37	5.22
8	其他资产	19,047,843.40	6.24
9	合计	305,331,022.70	100.00

注：截至报告期末，本基金因规模变动导致投资于股票（含存托凭证）资产的比例低于基金资产的 90%。

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	4,926,466.96	1.62
C	制造业	237,463,104.13	78.27
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	4,056,309.36	1.34
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	23,898,602.48	7.88
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	270,344,482.93	89.11

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

无。

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	920045	蘅东光	51,106	26,217,378.00	8.64
2	920438	戈碧迦	184,019	20,315,697.60	6.70
3	920185	贝特瑞	719,847	14,864,840.55	4.90
4	920982	锦波生物	97,071	13,772,433.48	4.54
5	920599	同力股份	585,074	10,168,586.12	3.35
6	920493	并行科技	76,684	8,187,550.68	2.70
7	920077	吉林碳谷	619,523	8,165,313.14	2.69
8	920808	曙光数创	126,531	7,203,409.83	2.37
9	920809	安达科技	1,010,332	7,052,117.36	2.32
10	920368	连城数控	296,995	6,735,846.60	2.22

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

无。

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	-
2	应收证券清算款	-

3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	19,047,843.40
6	其他应收款	-
7	其他	-
8	合计	19,047,843.40

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

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	大成北证 50 成份指数发起式 A	大成北证 50 成份指数发起式 C
报告期期初基金份额总额	19,641,528.65	193,164,412.10
报告期期间基金总申购份额	8,803,922.89	368,177,689.89
减:报告期期间基金总赎回份额	8,498,170.51	154,380,832.79
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	19,947,281.03	406,961,269.20

§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	大成北证 50 成份指数发起式 A	大成北证 50 成份指数发起式 C
报告期期初管理人持有的本基金份额	10,000,361.14	-
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	10,000,361.14	-
报告期期末持有的本基金份额占基金总份额比例（%）	2.34	-

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

无。

§8 报告期末发起式基金发起资金持有份额情况

项目	持有份额总数	持有份额占基金总份额比例(%)	发起份额总数	发起份额占基金总份额比例(%)	发起份额承诺持有期限
基金管理人固有资金	10,000,361.14	2.34	10,000,361.14	2.34	3 年
基金管理人高级管理人员	-	-	-	-	-
基金经理等人员	2,259.89	0.00	-	-	-
基金管理人股东	-	-	-	-	-
其他	-	-	-	-	-
合计	10,002,621.03	2.34	10,000,361.14	2.34	3 年

§9 影响投资者决策的其他重要信息

9.1 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。

9.2 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。

§10 备查文件目录

10.1 备查文件目录

1、中国证监会批准设立大成北证 50 成份指数型发起式证券投资基金的文件；

2、《大成北证 50 成份指数型发起式证券投资基金基金合同》；

3、《大成北证 50 成份指数型发起式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。

10.2 存放地点

备查文件存放在本基金管理人和托管人的住所。

10.3 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