大成景旭纯债债券型证券投资基金
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：中国工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。

基金托管人中国工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	大成景旭纯债债券			
基金主代码	000152			
基金运作方式	契约型开放式			
基金合同生效日	2013 年 7 月 23 日			
报告期末基金份额总额	1,911,459,821.13 份			
投资目标	本基金为纯债基金，管理人主要通过分析影响债券市场的各类要素，对债券组合的平均久期、期限结构、类属品种进行有效配置，力争为投资人提供长期稳定的投资回报。			
投资策略	本基金将有效结合“自上而下”的资产配置策略以及“自下而上”的债券精选策略，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，灵活配置基金资产在各类资产之间的配置比例，并通过严谨的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	中债综合指数			
风险收益特征	本基金为较低风险、较低收益的债券型基金产品，其风险收益水平高于货币市场基金，但低于混合型基金和股票型基金。			
基金管理人	大成基金管理有限公司			
基金托管人	中国工商银行股份有限公司			
下属分级基金的基金简称	大成景旭纯债债券 A	大成景旭纯债债券 B	大成景旭纯债债券 C	大成景旭纯债债券 D
下属分级基金的交易代码	000152	006674	000153	020574
报告期末下属分级基金的份额总额	22,288,875.31 份	249,726,117.40 份	25,571,889.89 份	1,613,872,938.53 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）			
	大成景旭纯债债券 A	大成景旭纯债债券 B	大成景旭纯债债券 C	大成景旭纯债债券 D
1.本期已实现收益	123,186.72	1,168,125.83	111,900.37	8,419,544.50
2.本期利润	205,627.49	1,981,390.82	205,393.13	15,187,405.31
3.加权平均基金份额本期利润	0.0095	0.0096	0.0083	0.0107
4.期末基金资产净值	25,138,031.39	281,689,901.68	28,530,434.86	1,820,726,786.12
5.期末基金份额净值	1.1278	1.1280	1.1157	1.1282

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

大成景旭纯债债券 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	0.85%	0.03%	1.07%	0.03%	-0.22%	0.00%
过去六个月	1.83%	0.04%	2.27%	0.03%	-0.44%	0.01%
过去一年	2.83%	0.05%	3.67%	0.04%	-0.84%	0.01%
过去三年	9.79%	0.07%	13.25%	0.07%	-3.46%	0.00%
过去五年	16.63%	0.06%	22.36%	0.07%	-5.73%	-0.01%
过去七年	24.61%	0.07%	32.54%	0.07%	-7.93%	0.00%
过去十年	37.04%	0.07%	46.26%	0.07%	-9.22%	0.00%
自基金合同生效起至今	77.23%	0.08%	75.93%	0.08%	1.30%	0.00%

大成景旭纯债债券 B

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	0.85%	0.03%	1.07%	0.03%	-0.22%	0.00%

过去六个月	1.84%	0.04%	2.27%	0.03%	-0.43%	0.01%
过去一年	2.83%	0.05%	3.67%	0.04%	-0.84%	0.01%
过去三年	9.81%	0.07%	13.25%	0.07%	-3.44%	0.00%
过去五年	16.66%	0.06%	22.36%	0.07%	-5.70%	-0.01%
过去七年	24.65%	0.06%	32.54%	0.07%	-7.89%	-0.01%
自基金合同生效起至今	28.61%	0.06%	38.12%	0.07%	-9.51%	-0.01%

大成景旭纯债债券 C

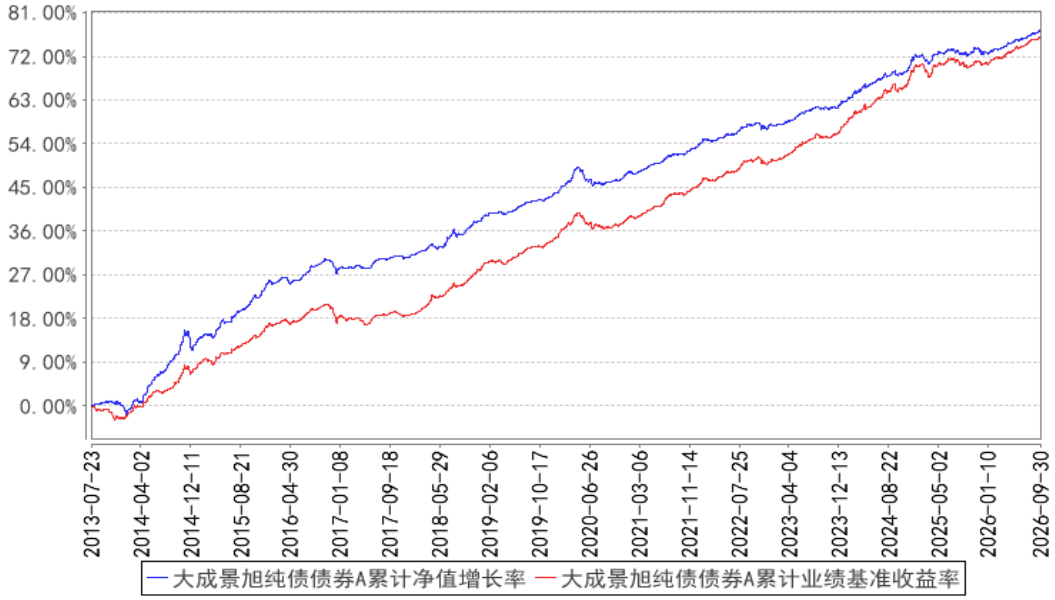
阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①－③	②－④
过去三个月	0.75%	0.03%	1.07%	0.03%	-0.32%	0.00%
过去六个月	1.64%	0.04%	2.27%	0.03%	-0.63%	0.01%
过去一年	2.42%	0.05%	3.67%	0.04%	-1.25%	0.01%
过去三年	8.44%	0.07%	13.25%	0.07%	-4.81%	0.00%
过去五年	14.29%	0.06%	22.36%	0.07%	-8.07%	-0.01%
过去七年	21.14%	0.06%	32.54%	0.07%	-11.40%	-0.01%
过去十年	31.69%	0.07%	46.26%	0.07%	-14.57%	0.00%
自基金合同生效起至今	68.67%	0.08%	75.93%	0.08%	-7.26%	0.00%

大成景旭纯债债券 D

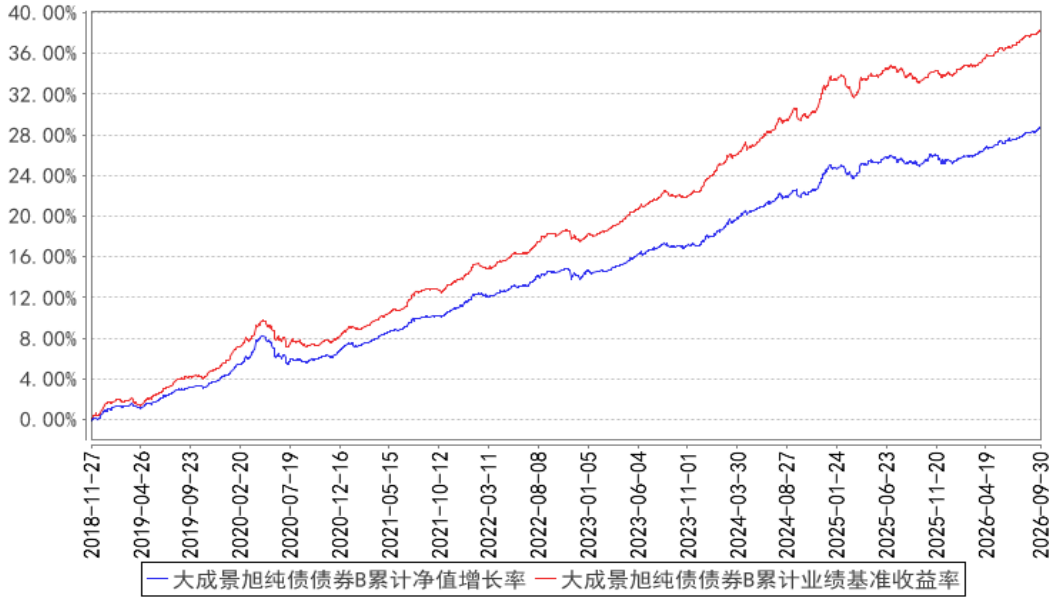
阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①－③	②－④
过去三个月	0.85%	0.03%	1.07%	0.03%	-0.22%	0.00%
过去六个月	1.85%	0.04%	2.27%	0.03%	-0.42%	0.01%
过去一年	2.84%	0.05%	3.67%	0.04%	-0.83%	0.01%
自基金合同生效起至今	8.51%	0.07%	10.69%	0.08%	-2.18%	-0.01%

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

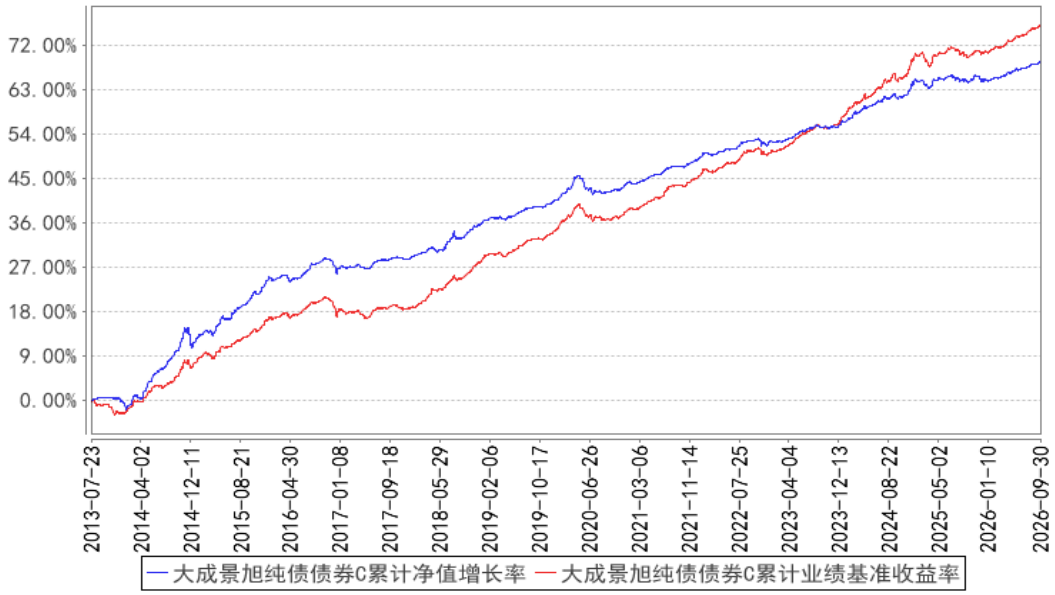
大成景旭纯债债券A累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



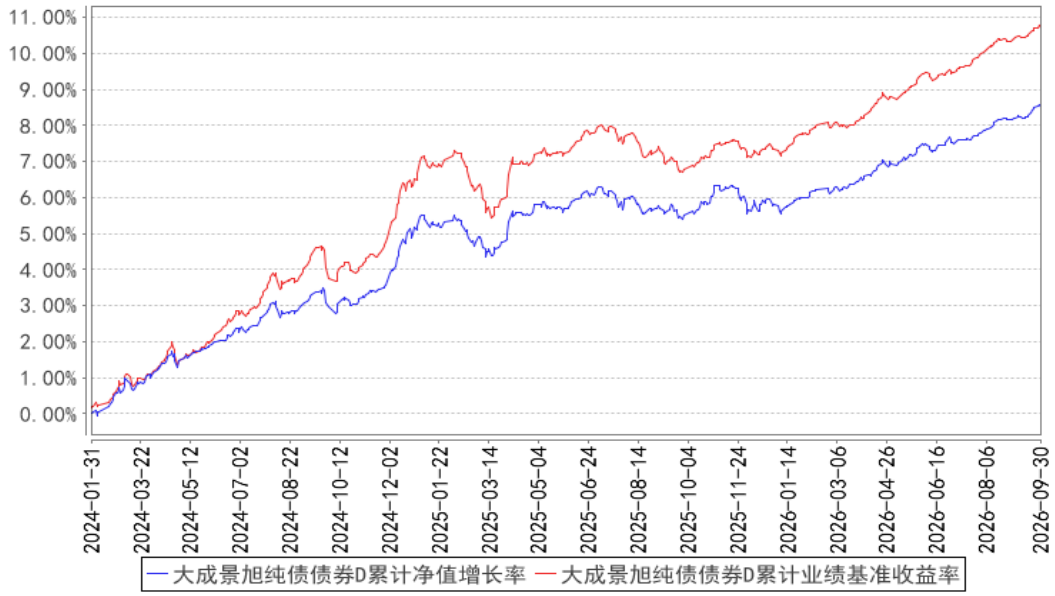
大成景旭纯债债券B累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



大成景旭纯债债券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



大成景旭纯债债券D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 2018 年 11 月 22 日起增设 B 类基金份额类别，B 类的净值增长率和业绩比较基准收益率自 2018 年 11 月 27 日有份额之日开始计算。

3、本基金自 2024 年 1 月 18 日起增设 D 类基金份额类别，D 类的净值增长率和业绩比较基准收益率自 2024 年 1 月 31 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		
方锐	本基金基金经理	2020 年 9 月 7 日	-	10 年	北京大学经济学硕士。2015 年 7 月至 2016 年 11 月就职于中国人民银行深圳市中心支行，任货币信贷管理处科员。2016 年 11 月加入大成基金管理有限公司，曾担任固定收益总部助理研究员、基金经理助理，现任固定收益总部债券投资一部基金经理。2020 年 9 月 7 日至 2024 年 3 月 8 日任大成彭博农发行债券 1-3 年指数证券投资基金基金经理。2020 年 9 月 7 日起任大成景旭纯债债券型证券投资基金基金经理。2020 年 10 月 30 日至 2024 年 1 月 17 日任大成中债 1-3 年国开行债券指数证券投资基金基金经理。2021 年 6 月 4 日至 2025 年 4 月 16 日任大成安诚债券型证券投资基金基金经理。2022 年 6 月 2 日至 2024 年 5 月 23 日任大成景盈债券型证券投资基金基金经理。2022 年 7 月 27 日任大成惠兴一年定期开放债券型发起式证券投资基金基金经理。2022 年 12 月 4 日起任大成稳益 90 天滚动持有债券型证券投资基金基金经理。2023 年 8 月 25 日至 2024 年 9 月 6 日任大成景信债券型证券投资基金基金经理。2023 年 10 月 27 日起任大成稳安 60 天滚动持有债券型证券投资基金基金经理。2023 年 11 月 9 日至 2025 年 1 月 7 日任大成景熙利率债债券型证券投资基金基金经理。2024 年 3 月 14 日起任大成惠业一年定期开放债券型发起式证券投资基金基金经理。2024 年 5 月 17 日至 2026 年 6 月 17 日任大成惠瑞一年定期开放债券型发起式证券投资基金基金经理。2024 年 9 月 19 日起任大成稳康 6 个月持有期债券型证券投资基金基金经理。2025 年 7 月 10 日起任大成月添利一个月滚动持有中短债债券型证券投资基金、大成深证基准做市信用债交易型开放式指数证券投资基金基金经理。2026 年 4 月 15 日起任大成中债 1-3 年国开行债券指数证券投资基金基金经理。具备基金从业资格。国籍：中国
范昕	本基金基金经理	2025 年 5 月 16 日	-	9 年	麻省理工学院金融学硕士。2017 年 5 月至 2021 年 10 月任乐瑞资产宏观组高级研究员、基金经理助理。2021 年 10 月加入

					大成基金管理有限公司，现任固定收益总部基金经理。2024 年 9 月 25 日起任大成彭博农发行债券 1-3 年指数证券投资基金、大成惠裕定期开放纯债债券型证券投资基金、大成景盈债券型证券投资基金基金经理。2025 年 4 月 14 日起任大成安诚债券型证券投资基金基金经理。2025 年 5 月 16 日起任大成景旭纯债债券型证券投资基金基金经理。2026 年 4 月 15 日起任大成景苏利率债债券型证券投资基金基金经理。具备基金从业资格。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

三季度经济动能略有放缓，7-8 月制造业 PMI 回落至荣枯线以下，结构上动能分化依然显著，外需强于内需，生产端强于需求端。宏观政策加大逆周期调节力度，央行通过增加隔夜逆回购操作稳定资金面，三季度资金利率较为平稳，债券市场也表现良好，10 年国债收益率由 1.74%下行至 1.68%，收益率曲线平坦化。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末大成景旭纯债债券 A 的基金份额净值为 1.1278 元，本报告期基金份额净值增长率为 0.85%，同期业绩比较基准收益率为 1.07%；截至本报告期末大成景旭纯债债券 B 的基金份额净值为 1.1280 元，本报告期基金份额净值增长率为 0.85%，同期业绩比较基准收益率为 1.07%；截至本报告期末大成景旭纯债债券 C 的基金份额净值为 1.1157 元，本报告期基金份额净值增长率为 0.75%，同期业绩比较基准收益率为 1.07%；截至本报告期末大成景旭纯债债券 D 的基金份额净值为 1.1282 元，本报告期基金份额净值增长率为 0.85%，同期业绩比较基准收益率为 1.07%。

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	-	-
	其中：股票	-	-
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	2,088,572,141.58	96.83
	其中：债券	2,088,572,141.58	96.83
	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	68,002,663.20	3.15
	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	392,700.25	0.02
8	其他资产	56,072.21	0.00
9	合计	2,157,023,577.24	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

无。

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

无。

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	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	1,206,151,208.10	55.94
	其中：政策性金融债	469,884,632.76	21.79
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	882,420,933.48	40.93
10	合计	2,088,572,141.58	96.87

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	170415	17 农发 15	600,000	61,869,978.08	2.87
2	240202	24 国开 02	600,000	61,196,728.77	2.84
3	220315	22 进出 15	600,000	61,127,375.34	2.84
4	220208	22 国开 08	600,000	61,055,145.21	2.83
5	220407	22 农发 07	600,000	60,786,164.38	2.82

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国债期货交易情况说明

5.9.1 本期国债期货投资政策

无。

5.9.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

无。

5.9.3 本期国债期货投资评价

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

1、本基金投资的前十名证券 24 浦发银行债 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 24 上海银行债 01 的发行主体上海银行股份有限公司于 2026 年 1 月 28 日因以贷收费、隐匿不良贷款、提供虚假的文件资料、代销业务严重违反审慎经营规则、流动资金贷款违规被挪用、存在未按要求开放系统权限等情况，阻碍现场检查、流动资金贷款管理严重违反审慎经营规则、同业投资业务未将最终债务人纳入授信、同业客户未纳入集团统一授信等受到国家金融监督管理总局上海监管局处罚；于 2026 年 8 月 3 日因银行承兑汇票业务背景审

查不严、贷款管理严重违反审慎经营规则、部分业务手续费收入会计核算不规范、未开立独立的代理保险业务佣金收取账户等受到国家金融监督管理总局上海监管局处罚（沪金罚决字〔2026〕109 号）。本基金认为，对上海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 24 建行债 02BC 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。

4、本基金投资的前十名证券 24 重庆银行小微债 01 的发行主体重庆银行股份有限公司于 2025 年 10 月 22 日因贷款“三查”不尽职、投资业务不审慎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〕23 号）。本基金认为，对重庆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。

5.10.2 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（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	56,072.21
6	其他应收款	-
7	其他	-
8	合计	56,072.21

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

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	大成景旭纯债债券 A	大成景旭纯债债券 B	大成景旭纯债债券 C	大成景旭纯债债券 D
报告期期初基金份额总额	21,015,154.20	187,494,140.81	24,240,110.34	720,081,678.24
报告期期间基金总申购份额	2,434,041.18	62,231,976.59	2,415,505.12	893,791,260.29
减:报告期期间基金总赎回份额	1,160,320.07	-	1,083,725.57	-
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	22,288,875.31	249,726,117.40	25,571,889.89	1,613,872,938.53

§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	大成景旭纯债债券 A	大成景旭纯债债券 B	大成景旭纯债债券 C	大成景旭纯债债券 D
报告期期初管理人持有的本基金份额	-	-	-	9,156.10
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	-	-	-	9,156.10
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

投资者类	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（%）

别							
机	1	20260701-20260930	446,667,768.45	-	-	446,667,768.45	23.37
构	2	20260717-20260930	-	893,774,761.58	-	893,774,761.58	46.76
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景旭纯债债券型证券投资基金的文件；

2、《大成景旭纯债债券型证券投资基金基金合同》；

3、《大成景旭纯债债券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