大成中证 AAA 科技创新公司债交易型开放式指数证券投资基金
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 AAA 科技创新公司债 ETF
场内简称	科创债 ETF 大成
基金主代码	159113
交易代码	159113
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2025 年 9 月 17 日
报告期末基金份额总额	99,216,237.00 份
投资目标	紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化。力争本基金的净值增长率与业绩比较基准之间的日均偏离度的绝对值不超过 0.2%，年化跟踪误差不超过 2%。
投资策略	本基金为指数基金，主要采用代表性分层抽样复制策略，投资于标的指数中具有代表性的部分成份券，或选择非成份券作为替代，使得债券投资组合的总体特征（如久期、剩余期限分布和到期收益率等）与标的指数相似。 （一）分层抽样策略 分层抽样复制法指的是采用一定的抽样方法从构成指数的成份债券中抽取若干成份债券构成用于复制指数跟踪组合的方法。采取该方法可以在控制跟踪误差的基础上，进一步减少组合维护及再平衡所需的费用。 本基金将首先通过对标的指数中各成份债券的信用评级、历史流动性及收益率等进行分析，初步选择流动性较好的成份券作为备选，其次将通过对标的指数按照久期、剩余期限、信用等级、到期收益率以及债券发行主体等进行分层抽样，以使构建组合与标的指数在以上特征上尽可能相似，达到复制标的指数、降低交易成本的目的。

	由于采用抽样复制，本基金组合中的个券只数、权重与标的指数可能存在差异。此外本基金在控制跟踪误差的前提下，可通过风险可控的积极管理获得超额收益，以弥补基金费用等管理成本，控制与标的指数的偏离度。 （二）替代性策略 若成份券遇到包括但不限于债券还本派息、退市、流动性不足、债券到期等法规限制或组合优化需要等情况，基金管理人可以部分持有现金或在成份券及备选成份券外寻找其他债券构建替代组合，对指数进行跟踪复制。 替代组合的构建将以债券流动性为约束条件，按照与被替代债券久期相近、信用评级相似、到期收益率及剩余期限基本匹配为主要原则，控制替代组合与被替代债券的跟踪偏离度和跟踪误差最小化。 当指数成份券发生明显负面事件面临退市或违约风险，且指数编制机构暂未作出调整的，基金管理人应当按照持有人利益优先的原则，履行内部决策程序后及时对相关成份券进行调整。 （三）债券投资策略 （四）资产支持证券投资策略 （五）衍生品投资策略
业绩比较基准	中证 AAA 科技创新公司债指数收益率
风险收益特征	本基金属于债券型基金，其预期收益及预期风险水平高于货币市场基金，低于混合型基金与股票型基金。本基金属于指数基金，采用分层抽样复制法跟踪标的指数表现，具有与标的指数以及标的指数所代表的债券市场组合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	中国建设银行股份有限公司

§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）
1.本期已实现收益	48,569,835.40
2.本期利润	68,472,604.12
3.加权平均基金份额本期利润	0.7613
4.期末基金资产净值	10,176,859,041.79
5.期末基金份额净值	102.5725

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。

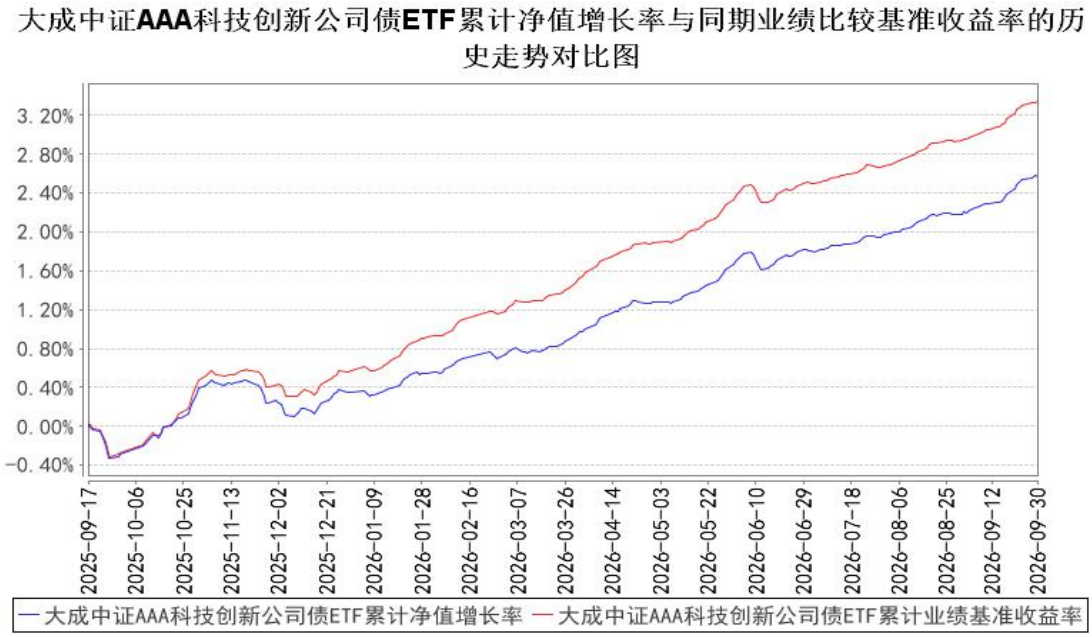
2、所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

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

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	0.74%	0.01%	0.80%	0.01%	-0.06%	0.00%
过去六个月	1.59%	0.02%	1.80%	0.02%	-0.21%	0.00%
过去一年	2.87%	0.02%	3.62%	0.02%	-0.75%	0.00%
自基金合同生效起至今	2.57%	0.03%	3.34%	0.03%	-0.77%	0.00%

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		
石丽君	本基金基金经理	2025 年 12 月 5 日	-	7 年	北京大学经济学硕士。曾任平安银行深圳分行票据业务部票据营销岗、平安银行总行公司银行部公司产品营销管理岗。2019

					年 5 月加入大成基金管理有限公司，曾任固定收益总部研究员兼基金经理助理，现任固定收益总部基金经理。2025 年 12 月 5 日起任大成中证 AAA 科技创新公司债交易型开放式指数证券投资基金基金经理。具备基金从业资格。国籍：中国
万晓慧	本基金基金经理	2025 年 9 月 17 日	-	10 年	华威大学工商管理硕士。证券、保险资管从业年限 10 年。2007 年 7 月至 2013 年 7 月任毕马威华振会计师事务所审计部助理经理。2013 年 7 月至 2014 年 8 月任 NeoPhotonics Corporation 内审部经理。2016 年 5 月至 2018 年 12 月任大成基金管理有限公司固定收益总部研究员。2018 年 12 月至 2023 年 9 月任平安资产管理有限责任公司固定收益投资部投资经理。2023 年 10 月加入大成基金管理有限公司，现任固定收益总部债券投资一部基金经理。2024 年 4 月 26 日起任大成景安短融债券型证券投资基金基金经理。2024 年 4 月 26 日至 2025 年 12 月 16 日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基金经理。2024 年 7 月 1 日起任大成景宁一年定期开放债券型证券投资基金基金经理。2025 年 1 月 16 日起任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。2025 年 9 月 17 日起任大成中证 AAA 科技创新公司债交易型开放式指数证券投资基金基金经理。2026 年 8 月 5 日起任大成稳丰 3 个月持有期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

三季度国内债券市场震荡偏强，基本面仍是推动利率下行的底色支撑，资金面的均衡偏松、政策面的温和适度，亦是对机构做多情绪有所呵护，期间市场虽对利空消息的敏感度虽有上升，但趋势做多的情绪未根本逆转，叠加供给压力的边际增量有限，机构持债情绪从观望到形成合力加速，助推收益率曲线形态进一步呈现平坦化变动。

回顾 7 月债市行情，基本面延续“弱现实”境况，二季度 GDP、金融数据均表现偏弱，下旬多重消息形成行情突破的关键催化剂，在中小银行存款降息传闻、重要会议释放货币宽松政策积极表述、PMI 数据重回荣枯线下方等偏利多消息的驱动之下，长债点位形成了有效突破。8 月，高频数据表征外需虽有支撑，但内需仍处于弱修复的格局，下旬财政发力和政府债供给加速的预期升温，形成做多情绪边际扰动，但仍未形成推动利率向上反转的动能。9 月市场在季末效应的顾虑下总体保持审慎拉锯，多空双方围绕基本面定价的敏感度有所钝化，全月主线为宽货币预期升温、双节前流动性呵护、机构欠配与资产荒共振，中下旬长债再度形成点位突破，10 年、30 年国债一度下破 1.66%、2.10%，但月末政策组合拳落地叠加 PMI 重回扩张区间，机构止盈情绪也有所

部分显现。

科创债市场方面，本季度信用债行情整体表现延续稳健，并且随着 ETF 产品的运作日渐成熟，其负债端投资者结构与资产端成分券溢价在多数时段基本维持在均衡状态，最终正向循环形成了较为稳健的持有回报。

本基金成立以来始终坚持指数基金的策略定位，主要采用代表性分层抽样复制策略对业绩比较基准进行跟踪。组合投资目标和运作目标以跟踪误差最小化为目标，结合市场流动性紧密跟踪指数。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末本基金份额净值为 102.5725 元；本报告期基金份额净值增长率为 0.74%，业绩比较基准收益率为 0.80%。

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	9,735,142,663.46	95.61
	其中：债券	9,735,142,663.46	95.61
	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	417,892,014.19	4.10
	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	28,798,007.26	0.28
8	其他资产	476,194.61	0.00
9	合计	10,182,308,879.52	100.00

注：上述债券投资金额包括可退替代款估值增值（如有）。

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

无。

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

无。

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

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	115,734,568.17	1.14
2	央行票据	-	-
3	金融债券	1,154,635,821.93	11.35
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	8,311,039,561.02	81.67
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	153,732,712.34	1.51
10	合计	9,735,142,663.46	95.66

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	240213	23 鲁高 K2	1,900,000	195,540,347.94	1.92
2	524614	26CMGK01	1,900,000	192,711,273.97	1.89
3	524541	25 诚通 K1	1,700,000	180,717,917.80	1.78
4	244698	26 中证 K1	1,500,000	152,283,410.96	1.50
5	243736	25 国能 K2	1,300,000	130,737,758.91	1.28

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

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。

5.10.2 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	322,536.46
2	应收证券清算款	123,412.36
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	30,245.79

8	其他	-
9	合计	476,194.61

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

5.10.5.1 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。

5.10.5.2 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。

5.10.6 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

报告期期初基金份额总额	97,316,237.00
报告期期间基金总申购份额	16,910,000.00
减：报告期期间基金总赎回份额	15,010,000.00
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	99,216,237.00

§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中证 AAA 科技创新公司债交易型开放式指数证券投资基金的文件；

2、《大成中证 AAA 科技创新公司债交易型开放式指数证券投资基金基金合同》；

3、《大成中证 AAA 科技创新公司债交易型开放式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