# 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 年中期报告

2026 年 6 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

送出日期：2026 年 8 月 28 日

# §1 重要提示及目录

## 1.1 重要提示

基金管理人的董事会、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的法律责任。本中期报告已经三分之二以上独立董事签字同意。

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 08 月 27 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、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及其更新。

本报告财务资料未经审计。

本报告期自 2026 年 01 月 01 日起至 06 月 30 日止。

## 1.2 目录

**§1 重要提示及目录 ..... 2**

1.1 重要提示 ..... 2
1.2 目录 ..... 3

**§2 基金简介 ..... 5**

2.1 基金基本情况 ..... 5
2.2 基金产品说明 ..... 5
2.3 基金管理人和基金托管人 ..... 6
2.4 信息披露方式 ..... 6
2.5 其他相关资料 ..... 6

**§3 主要财务指标和基金净值表现 ..... 7**

3.1 主要会计数据和财务指标 ..... 7
3.2 基金净值表现 ..... 7

**§4 管理人报告 ..... 8**

4.1 基金管理人及基金经理情况 ..... 8
4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明 ..... 10
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明 ..... 10
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明 ..... 11
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望 ..... 11
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明 ..... 12
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明 ..... 12
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明 ..... 12

**§5 托管人报告 ..... 13**

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明 ..... 13
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明 ..... 13
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见 ..... 13

**§6 半年度财务会计报告（未经审计） ..... 13**

6.1 资产负债表 ..... 13
6.2 利润表 ..... 14
6.3 净资产变动表 ..... 15
6.4 报表附注 ..... 16

**§7 投资组合报告 ..... 34**

7.1 期末基金资产组合情况 ..... 34
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合 ..... 34
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细 ..... 34
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动 ..... 34
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合 ..... 35
7.6 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 ..... 35
7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细 ..... 35
7.8 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贵金属投资明细 ..... 35

7.9 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 ..... 35
7.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 ..... 35
7.11 投资组合报告附注 ..... 36
**§8 基金份额持有人信息 ..... 36**
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 ..... 36
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 ..... 37
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况 ..... 37
**§9 开放式基金份额变动 ..... 37**
**§10 重大事件揭示 ..... 37**
10.1 基金份额持有人大会决议 ..... 37
10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动 ..... 37
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 ..... 38
10.4 基金投资策略的改变 ..... 38
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 ..... 38
10.6 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况 ..... 38
10.7 基金租用或者通过证券公司交易单元进行证券投资的相关情况 ..... 38
10.8 其他重大事件 ..... 40
**§11 影响投资者决策的其他重要信息 ..... 41**
11.1 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 ..... 41
11.2 影响投资者决策的其他重要信息 ..... 41
**§12 备查文件目录 ..... 41**
12.1 备查文件目录 ..... 41
12.2 存放地点 ..... 41
12.3 查阅方式 ..... 41

# §2 基金简介

## 2.1 基金基本情况

| | |
|---|---|
| 基金名称 | 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 |
| 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 |
| 报告期末基金份额总额 | 97,316,237.00 份 |
| 基金合同存续期 | 不定期 |
| 基金份额上市的证券交易所 | 深圳证券交易所 |
| 上市日期 | 2025 年 9 月 24 日 |

## 2.2 基金产品说明

| | |
|---|---|
| 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。<br>（一）分层抽样策略<br>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。<br>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。<br>（二）替代性策略<br>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。<br>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。<br>（三）债券投资策略<br>（四）资产支持证券投资策略<br>（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。 |

## 2.3 基金管理人和基金托管人

| 项目 | | 基金管理人 | 基金托管人 |
|---|---|---|---|
| 名称 | | 大成基金管理有限公司 | 中国建设银行股份有限公司 |
| 信息披露负责人 | 姓名 | 段皓静 | 王小飞 |
| | 联系电话 | 0755-83183388 | 021-60637103 |
| | 电子邮箱 | office@dcfund.com.cn | wangxiaofei.zh@ccb.com |
| 客户服务电话 | | 4008885558 | 021-60637228 |
| 传真 | | 0755-83199588 | 021-60635778 |
| 注册地址 | | 广东省深圳市南山区海德三道 1236 号大成基金总部大厦 5 层、27-33 层 | 北京市西城区金融大街 25 号 |
| 办公地址 | | 广东省深圳市南山区海德三道 1236 号大成基金总部大厦 5 层、27-33 层 | 北京市西城区闹市口大街 1 号院 1 号楼 |
| 邮政编码 | | 518054 | 100033 |
| 法定代表人 | | 吴庆斌 | 张金良 |

## 2.4 信息披露方式

| | |
|---|---|
| 本基金选定的信息披露报纸名称 | 《上海证券报》 |
| 登载基金中期报告的管理人互联网网址 | www.dcfund.com.cn |
| 基金中期报告置备地点 | 基金管理人及基金托管人住所 |

## 2.5 其他相关资料

| 项目 | 名称 | 办公地址 |
|---|---|---|
| 注册登记机构 | 中国证券登记结算有限责任公司 | 北京市西城区太平桥大街 17 号 |

# §3 主要财务指标和基金净值表现

## 3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

| 3.1.1 期间数据和指标 | 报告期(2026 年 1 月 1 日-2026 年 6 月 30 日) |
|---|---|
| 本期已实现收益 | 83,143,024.34 |
| 本期利润 | 134,182,996.18 |
| 加权平均基金份额本期利润 | 1.4520 |
| 本期加权平均净值利润率 | 1.44% |
| 本期基金份额净值增长率 | 1.47% |
| 3.1.2 期末数据和指标 | 报告期末(2026 年 6 月 30 日) |
| 期末可供分配利润 | 137,281,179.84 |
| 期末可供分配基金份额利润 | 1.4107 |
| 期末基金资产净值 | 9,908,970,667.97 |
| 期末基金份额净值 | 101.8224 |
| 3.1.3 累计期末指标 | 报告期末(2026 年 6 月 30 日) |
| 基金份额累计净值增长率 | 1.82% |

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、期末可供分配利润，采用期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数（为期末余额，不是当期发生数）。

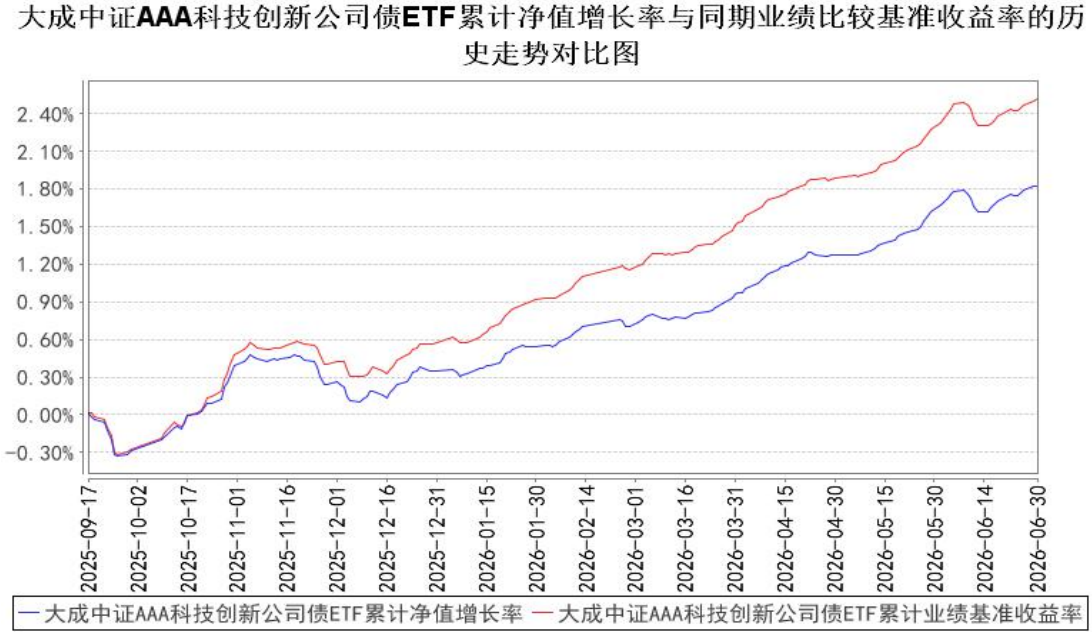
3、所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

## 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 | 份额净值增长率① | 份额净值增长率标准差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% | 0.02% | 0.99% | 0.02% | -0.14% | 0.00% |
| 过去六个月 | 1.47% | 0.02% | 1.93% | 0.02% | -0.46% | 0.00% |
| 自基金合同生效起至今 | 1.82% | 0.03% | 2.52% | 0.03% | -0.70% | 0.00% |

### 3.2.2 自基金合同生效以来基金份额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、本基金合同生效日为 2025 年 9 月 17 日，截止报告期末本基金合同生效未满一年。

2、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 基金管理人及基金经理情况

#### 4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

大成基金管理有限公司成立于 1999 年 4 月 12 日，注册资本人民币 2 亿元，是中国首批获准成立的“老十家”基金管理公司之一。公司总部位于深圳，同时设置了北方、华东和南方营销总部，在北京、上海等地开设有 5 家分公司。2009 年，公司在香港设立大成国际资产管理有限公司；2013 年，设立大成创新资本管理有限公司。

公司业务资质齐全，全面覆盖公募基金、机构投资、海外投资、财富管理、养老金管理等业务,还受全国社会保障基金理事会委托管理部分社保基金和基本养老保险基金。旗下大成国际资产管理公司具备 QFII、RQFII 等资格，是首批首家完成备案的能够提供港股通投资顾问服务的香港机构。

历经二十余年的磨砺和沉淀，大成基金形成了以长期投资能力为核心的竞争优势，打造了一支具有良好职业素养和丰富经验的资产管理队伍。公司目前已形成权益投资、固收投资、指数与期货投资、跨境投资、混合资产投资、大类资产配置六大投资团队，全面覆盖各类投资领域，综

合实力不断提升，各项业务迅猛发展，管理资产种类位居同业前列。

### 4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

| 姓名 | 职务 | 任本基金的基金经理（助理）期限 | | 证券从业年限 | 说明 |
|---|---|---|---|---|---|
| | | 任职日期 | 离任日期 | | |
| 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。具有基金从业资格。国籍：中国 |
| 苏瑞 | 本基金基金经理助理 | 2025 年 11 月 20 日 | - | 5 年 | 南开大学经济学硕士。曾任职于海港人寿保险股份有限公司（原恒大人寿保险有限公司）投资管理中心项目评审部。2021 年 3 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助理。2025 年 11 月 20 日起任大成景安短融债券型证券投资基金、大成景宁一年定期开放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、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助理。2025 年 11 月 20 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助理。具有基金从业资格。国籍：中国 |

| | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|
| 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 |

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。

### 4.1.3 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 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

### 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 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

### 4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

回顾 2026 年上半年，国内信用债市场整体表现偏强，其背后主要是基本面修复温和、资金面自发式宽松形成了双主线共振，“资产荒”行情再现。

一季度，债市总体维持震荡格局，利率曲线呈现陡峭化变动，信用利差则呈现主动压缩为主。市场对此的多空博弈部分来自于国内经济环境的韧性与政策定力。进入 3 月之后，资本市场受到宏观事件驱动影响的特征尤为显著。美伊冲突海外地缘事态的演绎多有反复，全球股票、债券、商品、汇率在此期间均受到幅度明显的冲击重挫，大多数资产承受着下跌压力。二季度后，国内经济 K 型复苏“外热内冷”分化特征更加显著，而同期国际外部输入型影响明显弱化，债市定价的主要逻辑也从事件型驱动向资金面主导过渡。在此期间，各品种债券收益率迎来趋势性下行。科创债市场方面，随着两轮创新型 ETF 工具产品的运作日渐成熟，投资者结构与类属资产价值在多数时段也已进入到均衡状态，市场运行效率明显提高，最终形成了稳健的正向循环。

本基金自成立以来，始终严格锚定指数型产品的策略定位，采用代表性分层抽样复制法跟踪业绩比较基准，将“跟踪误差最小化”作为组合运作的核心目标，紧密结合市场流动性变化完成指数跟踪任务。一季度，产品顺利完成建仓流程。我们重点围绕成份券与同主体非成份券溢价水平开展精细择券，优先选择估值定价合理的待偿期限段的债券，致力于降低不必要的建仓摩擦成本。二季度，组合一方面保持与指数久期高度匹配，降低跟踪误差；另一方面针对季末市场同类债券型 ETF 流通份额大幅增加的行情趋势变化，继续坚持低成本配置的原则，合理平衡资金与资产的交易节奏，在应对市场波动的同时，为广大投资者贡献可持续的区间回报。

### 4.4.2 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 101.8224 元；本报告期基金份额净值增长率为 1.47%，业绩比较基准收益率为 1.93%。

## 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望下半年，国内经济 K 型复苏的节奏平稳，叠加资产荒的底色不改，这依然对债市存在有利支撑，债市大幅回调的风险相对有限。但在低收益、低利差的新常态内，市场运行或多延续偏震荡的格局为主。

科创债作为信用债市场的细分品种，近年来受到政策鼓励，市场规模迎来快速扩容，并且指数成份券的发行人信用资质普遍良好稳定，中期来看，交易所 AAA 科创债依然是兼具跟随信用债 β 行情趋势机会和贡献 α 类属超额收益的高价值资产。本产品作为科创债 ETF 旨在紧密跟踪标的

指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化，成为助力广大投资者参与到科创债市场投资的有效工具。

## 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本基金管理人指导基金估值业务的领导小组为公司估值委员会，公司估值委员会主要负责估值政策和估值程序的制定、修订以及执行情况的监督。估值委员会由公司分管领导、各投研部门、交易管理部、风险管理部、监察稽核部、基金运营部指定人员组成。公司估值委员会的相关成员均具备相应的专业胜任能力和相关工作经历。

各投研部门、风险管理部负责关注相关投资品种的动态，评判基金持有的投资品种是否处于不活跃的交易状态或者最近交易日后经济环境发生了重大变化或证券发行机构发生了影响证券价格的重大事件，从而确定估值日需要进行估值测算或者调整的投资品种；提出合理的数量分析模型对需要进行估值测算或者调整的投资品种进行公允价值定价与计量；定期对估值政策和程序进行评价，以保证其持续适用；交易管理部负责关注相关投资品种的流动性状况，协助反馈其市场交易信息；基金运营部负责日常的基金资产的估值业务，执行基金估值政策，并负责与托管人沟通估值调整事项；监察稽核部负责审核估值政策和程序的一致性，监督估值委员会工作流程中的风险控制，并负责估值调整事项的信息披露工作。

本基金的日常估值程序由基金运营部基金估值核算人员执行，并与托管人的估值结果核对一致。基金估值政策的议定和修改采用集体讨论机制，投资组合经理作为估值小组成员，对持仓证券的交易情况、信息披露情况保持应有的职业敏感，向估值委员会提供估值参考信息，参与估值政策讨论。对需采用特别估值程序的证券，基金管理人及时启动特别估值程序，由估值委员会讨论议定特别估值方案并与托管人沟通后由基金运营部具体执行。

本基金管理人参与估值流程各方之间不存在任何重大利益冲突。截止报告期末本基金管理人已与中央国债登记结算有限责任公司及中证指数有限公司签署服务协议，由中央国债登记结算有限责任公司按约定提供银行间交易的债券品种的估值数据，由中证指数有限公司按约定提供交易所交易的债券品种的估值数据和流通受限股票的折扣率数据。

## 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金管理人严格按照本基金基金合同的规定进行收益分配。本报告期内本基金无收益分配事项。

## 4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

无。

# §5 托管人报告

## 5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期，中国建设银行股份有限公司在本基金的托管过程中，严格遵守了《证券投资基金法》、基金合同、托管协议和其他有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

## 5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

本报告期，本基金托管人按照国家有关规定、基金合同、托管协议和其他有关规定，对本基金的基金资产净值计算、基金费用开支等方面进行了认真的复核，对本基金的投资运作方面进行了监督，未发现基金管理人有损害基金份额持有人利益的行为。

报告期内，本基金利润分配情况符合法律法规和基金合同的相关约定。

## 5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人复核审查了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、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。

# §6 半年度财务会计报告（未经审计）

## 6.1 资产负债表

会计主体：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

报告截止日：2026 年 6 月 30 日

单位：人民币元

| 资 产 | 附注号 | 本期末<br>2026 年 6 月 30 日 | 上年度末<br>2025 年 12 月 31 日 |
|---|---|---|---|
| **资 产：** | | | |
| 货币资金 | 6.4.7.1 | 87,570,418.37 | 336,730,992.70 |
| 结算备付金 | | 21,201,414.82 | 37,650,546.24 |
| 存出保证金 | | 318,540.15 | 188,380.11 |
| 交易性金融资产 | 6.4.7.2 | 9,523,930,205.53 | 7,164,935,803.54 |
| 其中：股票投资 | | - | - |
| 基金投资 | | - | - |
| 债券投资 | | 9,523,930,205.53 | 7,164,935,803.54 |
| 资产支持证券投资 | | - | - |
| 贵金属投资 | | - | - |
| 其他投资 | | - | - |
| 衍生金融资产 | 6.4.7.3 | - | - |
| 买入返售金融资产 | 6.4.7.4 | 598,000,000.00 | 4,949,988,961.78 |
| 应收清算款 | | 1,525,742.22 | 3,104,871.69 |

| | | | |
|---|---|---|---|
| 应收股利 | | - | - |
| 应收申购款 | | - | - |
| 递延所得税资产 | | - | - |
| 其他资产 | 6.4.7.8 | 60,492.63 | - |
| 资产总计 | | 10,232,606,813.72 | 12,492,599,556.06 |
| **负债和净资产** | **附注号** | **本期末<br>2026 年 6 月 30 日** | **上年度末<br>2025 年 12 月 31 日** |
| **负 债：** | | | |
| 短期借款 | | - | - |
| 交易性金融负债 | | - | - |
| 衍生金融负债 | 6.4.7.3 | - | - |
| 卖出回购金融资产款 | | - | - |
| 应付清算款 | | 69,981,666.57 | 79,862,247.88 |
| 应付赎回款 | | - | - |
| 应付管理人报酬 | | 1,125,462.56 | 1,127,003.06 |
| 应付托管费 | | 375,154.18 | 375,667.71 |
| 应付销售服务费 | | - | - |
| 应付投资顾问费 | | - | - |
| 应交税费 | | 464,428.42 | 302,011.19 |
| 应付利润 | | - | - |
| 递延所得税负债 | | - | - |
| 其他负债 | 6.4.7.9 | 251,689,434.02 | 17,143,813.11 |
| 负债合计 | | 323,636,145.75 | 98,810,742.95 |
| **净资产：** | | | |
| 实收基金 | 6.4.7.10 | 9,731,630,035.42 | 12,350,631,738.93 |
| 未分配利润 | 6.4.7.12 | 177,340,632.55 | 43,157,074.18 |
| 净资产合计 | | 9,908,970,667.97 | 12,393,788,813.11 |
| 负债和净资产总计 | | 10,232,606,813.72 | 12,492,599,556.06 |

注：报告截止日 2026 年 6 月 30 日，基金份额净值 101.8224 元，基金份额总额 97,316,237.00 份。

## 6.2 利润表

会计主体：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

本报告期：2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日

单位：人民币元

| 项 目 | 附注号 | 本期<br>2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日 |
|---|---|---|
| **一、营业总收入** | | 143,926,276.27 |
| 1.利息收入 | | 8,634,630.04 |
| 其中：存款利息收入 | 6.4.7.13 | 298,482.80 |
| 债券利息收入 | | - |

| | | |
|---|---|---|
| 资产支持证券利息收入 | | - |
| 买入返售金融资产收入 | | 8,336,147.24 |
| 其他利息收入 | | - |
| 2.投资收益（损失以“-”填列） | | 82,855,578.04 |
| 其中：股票投资收益 | 6.4.7.14 | - |
| 基金投资收益 | 6.4.7.15 | - |
| 债券投资收益 | 6.4.7.16 | 82,855,578.04 |
| 资产支持证券投资收益 | 6.4.7.17 | - |
| 贵金属投资收益 | 6.4.7.18 | - |
| 衍生工具收益 | 6.4.7.19 | - |
| 股利收益 | 6.4.7.20 | - |
| 以摊余成本计量的金融资产终止确认产生的收益 | | - |
| 其他投资收益 | | - |
| 3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列） | 6.4.7.21 | 51,039,971.84 |
| 4.汇兑收益（损失以“-”号填列） | | - |
| 5.其他收入（损失以“-”号填列） | 6.4.7.22 | 1,396,096.35 |
| **减：二、营业总支出** | | 9,743,280.09 |
| 1．管理人报酬 | 6.4.10.2.1 | 6,977,468.17 |
| 2．托管费 | 6.4.10.2.2 | 2,325,822.71 |
| 3．销售服务费 | 6.4.10.2.3 | - |
| 4．投资顾问费 | | - |
| 5．利息支出 | | 3,780.97 |
| 其中：卖出回购金融资产支出 | | 3,780.97 |
| 6．信用减值损失 | 6.4.7.23 | - |
| 7．税金及附加 | | 277,180.34 |
| 8．其他费用 | 6.4.7.24 | 159,027.90 |
| **三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）** | | 134,182,996.18 |
| 减：所得税费用 | | - |
| **四、净利润（净亏损以“-”号填列）** | | 134,182,996.18 |
| **五、其他综合收益的税后净额** | | - |
| **六、综合收益总额** | | 134,182,996.18 |

## 6.3 净资产变动表

会计主体：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

本报告期：2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日

单位：人民币元

| 项目 | 本期<br>2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日 | | | |
|---|---|---|---|---|
| | 实收基金 | 其他综合收益 | 未分配利润 | 净资产合计 |
| 一、上期期末净 | 12,350,631,738 | - | 43,157,074.18 | 12,393,788,813.1 |

| | | | | |
|---|---|---|---|---|
| 资产 | .93 | | | 1 |
| 二、本期期初净资产 | 12,350,631,738.93 | - | 43,157,074.18 | 12,393,788,813.11 |
| 三、本期增减变动额(减少以“-”号填列) | -2,619,001,703.51 | - | 134,183,558.37 | -2,484,818,145.14 |
| (一)、综合收益总额 | - | - | 134,182,996.18 | 134,182,996.18 |
| (二)、本期基金份额交易产生的净资产变动数(净资产减少以“-”号填列) | -2,619,001,703.51 | - | 562.19 | -2,619,001,141.32 |
| 其中：1.基金申购款 | 3,667,002,388.55 | - | 56,047,520.52 | 3,723,049,909.07 |
| 2.基金赎回款 | -6,286,004,092.06 | - | -56,046,958.33 | -6,342,051,050.39 |
| (三)、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动(净资产减少以“-”号填列) | - | - | - | - |
| 四、本期期末净资产 | 9,731,630,035.42 | - | 177,340,632.55 | 9,908,970,667.97 |

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署：

| 谭晓冈 | 范瑛 | 梁靖 |
|---|---|---|
| 基金管理人负责人 | 主管会计工作负责人 | 会计机构负责人 |

## 6.4 报表附注

### 6.4.1 基金基本情况

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(以下简称“本基金”)经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2025]1988 号《关于准予大成中证 AAA 科技创新公司债交易型开放式指数证券投资基金注册的批复》注册，由大成基金管理有限公司依

照《中华人民共和国证券投资基金法》和《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》负责公开募集。本基金为契约型开放式，存续期限不定，首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币 2,913,524,337.00 元，业经安永华明会计师事务所(特殊普通合伙)安永华明(2025)验字第 70039092_H19 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《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》于 2025 年 9 月 17 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 2,913,625,598.00 份基金份额，其中认购资金利息折合 101,261.00 份基金份额。本基金的基金管理人为大成基金管理有限公司，基金托管人为中国建设银行股份有限公司。

经深圳证券交易所(以下简称“深交所”)深证上[2025]1004 号文审核同意，本基金 2,913,625,598.00 份基金份额于 2025 年 9 月 24 日在深交所挂牌交易。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《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》的有关规定，本基金主要投资于标的指数成份债券和备选成份债券。为更好地实现基金的投资目标，本基金可以投资国内依法发行、上市的债券(包括国债、央行票据、地方政府债、金融债券、企业债券、公司债券、短期融资券、超短期融资券、中期票据、公开发行的次级债券、政府支持机构债、政府支持债券、可分离交易可转债的纯债部分)、资产支持证券、银行存款(包括协议存款、定期存款及其他银行存款)、同业存单、债券回购、国债期货、信用衍生品、货币市场工具以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具，但需符合中国证监会的相关规定。本基金的投资组合比例为：债券资产比例不低于基金资产的 80%；标的指数成份债券和备选成份债券的资产比例不低于基金资产净值的 90%，且不低于非现金基金资产的 80%。本基金每个交易日日终在扣除国债期货合约需缴纳的交易保证金后，应当保持不低于交易保证金一倍的现金。其中，现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款。本基金的业绩比较基准为：中证 AAA 科技创新公司债指数收益率。

### 6.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于 2006 年 2 月 15 日及以后期间颁布的《企业会计准则－基本准则》、各项具体会计准则、《资产管理产品相关会计处理规定》及其他相关规定（以下合称“企业会计准则”）、中国证券投资基金业协会（以下简称“中国基金业协会”）发布的《公开募集证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和中期报告>》、《证券投资基金会计核算业务指引》、本基金基金合同和在财务报表附注所列示的中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

本财务报表以持续经营为基础编制。

### 6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金 2026 年 6 月 30 日的财务状况以及 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日期间的经营成果和净资产变动情况等有关信息。

### 6.4.4 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

### 6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

#### 6.4.5.1 会计政策变更的说明

无。

#### 6.4.5.2 会计估计变更的说明

无。

#### 6.4.5.3 差错更正的说明

无。

### 6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128 号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2008]1 号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2016]140 号《关于明确金融房地产开发　教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税[2017]2 号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017]56 号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90 号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》、财政部、国家税务总局公告 2025 年第 4 号《关于国债等债券利息收入增值税政策的公告》、国务院令第 826 号《中华人民共和国增值税法实施条例》、财政部、税务总局公告 2026 年第 10 号《财政部　税务总局关于增值税法施行后增值税优惠政策衔接事项的公告》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1)资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人。2027 年 12 月 31 日前，资管产品管理人运营契约制资管产品过程中发生的增值税应税行为，可以选择适用简易计税方法，按照 3%的征收率缴纳增值税。对资管产品在 2018 年 1 月 1 日前运营过程中发生的增值税应税行为，未缴纳增值税的，不再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从资管产品管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。

2027 年 12 月 31 日前,对证券投资基金管理人运用基金资产买卖债券的转让收入免征增值税，对除持有金融债券外的金融同业往来利息收入亦免征增值税。自 2025 年 8 月 8 日起，对在该日期之后(含当日)新发行的国债、地方政府债券、金融债券的利息收入，恢复征收增值税。对在该日期之前已发行的国债、地方政府债券、金融债券(包含在 2025 年 8 月 8 日之后续发行的部分)的利

息收入，免征增值税直至债券到期。资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务，以 2018 年 1 月 1 日起产生的利息及利息性质的收入为销售额。

(2)对基金从证券市场中取得的收入，包括买卖债券的差价收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

(3)对基金取得的企业债券利息收入，应由发行债券的企业在向基金支付利息时代扣代缴 20%的个人所得税。

(4)本基金的城市维护建设税、教育费附加和地方教育附加等税费按照实际缴纳增值税额的适用比例计算缴纳。

## 6.4.7 重要财务报表项目的说明

### 6.4.7.1 货币资金

单位：人民币元

| 项目 | 本期末<br>2026 年 6 月 30 日 |
|---|---|
| 活期存款 | 87,570,418.37 |
| 等于：本金 | 87,549,944.21 |
| 加：应计利息 | 20,474.16 |
| 减：坏账准备 | - |
| 定期存款 | - |
| 等于：本金 | - |
| 加：应计利息 | - |
| 减：坏账准备 | - |
| 其中：存款期限 1 个月以内 | - |
| 存款期限 1-3 个月 | - |
| 存款期限 3 个月以上 | - |
| 其他存款 | - |
| 等于：本金 | - |
| 加：应计利息 | - |
| 减：坏账准备 | - |
| 合计 | 87,570,418.37 |

### 6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

| 项目 | | 本期末<br>2026 年 6 月 30 日 | | | |
|---|---|---|---|---|---|
| | | 成本 | 应计利息 | 公允价值 | 公允价值变动 |
| 股票 | | - | - | - | - |
| 贵金属投资-金交所黄金合约 | | - | - | - | - |
| 债券 | 交易所市 | 9,375,257,556.48 | 99,854,552.61 | 9,523,930,205.53 | 48,818,096.44 |

| | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|
| | 场 | | | | |
| | 银行间市场 | - | - | - | - |
| | 合计 | 9,375,257,556.48 | 99,854,552.61 | 9,523,930,205.53 | 48,818,096.44 |
| 资产支持证券 | | - | - | - | - |
| 基金 | | - | - | - | - |
| 其他 | | - | - | - | - |
| 合计 | | 9,375,257,556.48 | 99,854,552.61 | 9,523,930,205.53 | 48,818,096.44 |

### 6.4.7.3 衍生金融资产/负债

#### 6.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

无。

#### 6.4.7.3.2 期末基金持有的期货合约情况

无。

#### 6.4.7.3.3 期末基金持有的黄金衍生品情况

无。

### 6.4.7.4 买入返售金融资产

#### 6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

单位：人民币元

| 项目 | 本期末<br>2026 年 6 月 30 日 | |
|---|---|---|
| | 账面余额 | 其中：买断式逆回购 |
| 交易所市场 | 598,000,000.00 | - |
| 银行间市场 | - | - |
| 合计 | 598,000,000.00 | - |

#### 6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

无。

#### 6.4.7.4.3 按预期信用损失一般模型计提减值准备的说明

| |
|---|
| 无。 |

### 6.4.7.5 债权投资

#### 6.4.7.5.1 债权投资情况

无。

#### 6.4.7.5.2 债权投资减值准备计提情况

无。

### 6.4.7.6 其他债权投资

### 6.4.7.6.1 其他债权投资情况

无。

### 6.4.7.6.2 其他债权投资减值准备计提情况

无。

### 6.4.7.7 其他权益工具投资

### 6.4.7.7.1 其他权益工具投资情况

无。

### 6.4.7.7.2 报告期末其他权益工具投资情况

无。

### 6.4.7.8 其他资产

单位：人民币元

| 项目 | 本期末<br>2026 年 6 月 30 日 |
|---|---|
| 应收利息 | - |
| 其他应收款 | - |
| 待摊费用 | 60,492.63 |
| 合计 | 60,492.63 |

### 6.4.7.9 其他负债

单位：人民币元

| 项目 | 本期末<br>2026 年 6 月 30 日 |
|---|---|
| 应付券商交易单元保证金 | - |
| 应付赎回费 | - |
| 应付证券出借违约金 | - |
| 应付交易费用 | - |
| 其中：交易所市场 | - |
| 银行间市场 | - |
| 应付利息 | - |
| 应退退补款 | 78,603,649.42 |
| 预提费用 | 99,178.95 |
| 可退替代款 | 172,986,605.65 |
| 合计 | 251,689,434.02 |

### 6.4.7.10 实收基金

金额单位：人民币元

| 项目 | 本期<br>2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日 | |
|---|---|---|
| | 基金份额（份） | 账面金额 |

| | | |
|---|---|---|
| 上年度末 | 123,506,237.00 | 12,350,631,738.93 |
| 本期申购 | 36,670,000.00 | 3,667,002,388.55 |
| 本期赎回（以“-”号填列） | -62,860,000.00 | -6,286,004,092.06 |
| 基金拆分/份额折算前 | - | - |
| 基金拆分/份额折算调整 | - | - |
| 本期申购 | - | - |
| 本期赎回（以“-”号填列） | - | - |
| 本期末 | 97,316,237.00 | 9,731,630,035.42 |

### 6.4.7.11 其他综合收益

无。

### 6.4.7.12 未分配利润

单位：人民币元

| 项目 | 已实现部分 | 未实现部分 | 未分配利润合计 |
|---|---|---|---|
| 上年度末 | 62,946,026.22 | -19,788,952.04 | 43,157,074.18 |
| 本期期初 | 62,946,026.22 | -19,788,952.04 | 43,157,074.18 |
| 本期利润 | 83,143,024.34 | 51,039,971.84 | 134,182,996.18 |
| 本期基金份额交易产生的变动数 | -8,807,870.72 | 8,808,432.91 | 562.19 |
| 其中：基金申购款 | 44,334,729.86 | 11,712,790.66 | 56,047,520.52 |
| 基金赎回款 | -53,142,600.58 | -2,904,357.75 | -56,046,958.33 |
| 本期已分配利润 | - | - | - |
| 本期末 | 137,281,179.84 | 40,059,452.71 | 177,340,632.55 |

### 6.4.7.13 存款利息收入

单位：人民币元

| 项目 | 本期<br>2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日 |
|---|---|
| 活期存款利息收入 | 217,543.96 |
| 定期存款利息收入 | - |
| 其他存款利息收入 | - |
| 结算备付金利息收入 | 80,351.99 |
| 其他 | 586.85 |
| 合计 | 298,482.80 |

### 6.4.7.14 股票投资收益

### 6.4.7.14.1 股票投资收益项目构成

无。

### 6.4.7.14.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

无。

### 6.4.7.14.3 股票投资收益——赎回差价收入

无。

### 6.4.7.14.4 股票投资收益——申购差价收入

无。

### 6.4.7.14.5 股票投资收益——证券出借差价收入

无。

### 6.4.7.15 基金投资收益

无。

### 6.4.7.16 债券投资收益

### 6.4.7.16.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

| 项目 | 本期<br>2026年1月1日至2026年6月30日 |
|---|---|
| 债券投资收益——利息收入 | 84,532,562.40 |
| 债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入 | -1,676,984.36 |
| 债券投资收益——赎回差价收入 | - |
| 债券投资收益——申购差价收入 | - |
| 合计 | 82,855,578.04 |

### 6.4.7.16.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

| 项目 | 本期<br>2026年1月1日至2026年6月30日 |
|---|---|
| 卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额 | 2,826,721,309.72 |
| 减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额 | 2,789,899,695.36 |
| 减：应计利息总额 | 38,498,598.72 |
| 减：交易费用 | - |
| 买卖债券差价收入 | -1,676,984.36 |

### 6.4.7.16.3 债券投资收益——赎回差价收入

无。

### 6.4.7.16.4 债券投资收益——申购差价收入

无。

### 6.4.7.17 资产支持证券投资收益

#### 6.4.7.17.1 资产支持证券投资收益项目构成

无。

#### 6.4.7.17.2 资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入

无。

#### 6.4.7.17.3 资产支持证券投资收益——赎回差价收入

无。

#### 6.4.7.17.4 资产支持证券投资收益——申购差价收入

无。

### 6.4.7.18 贵金属投资收益

#### 6.4.7.18.1 贵金属投资收益项目构成

无。

#### 6.4.7.18.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

无。

#### 6.4.7.18.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

无。

#### 6.4.7.18.4 贵金属投资收益——申购差价收入

无。

### 6.4.7.19 衍生工具收益

#### 6.4.7.19.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

无。

#### 6.4.7.19.2 衍生工具收益——其他投资收益

无。

### 6.4.7.20 股利收益

无。

### 6.4.7.21 公允价值变动收益

单位：人民币元

| 项目名称 | 本期<br>2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日 |
|---|---|
| 1.交易性金融资产 | 51,039,971.84 |
| 股票投资 | - |
| 债券投资 | 51,039,971.84 |

| | |
|---|---|
| 资产支持证券投资 | - |
| 基金投资 | - |
| 贵金属投资 | - |
| 其他 | - |
| 2.衍生工具 | - |
| 权证投资 | - |
| 3.其他 | - |
| 减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税 | - |
| 合计 | 51,039,971.84 |

### 6.4.7.22 其他收入

单位：人民币元

| 项目 | 本期<br>2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日 |
|---|---|
| 基金赎回费收入 | - |
| 替代损益 | 1,396,096.35 |
| 合计 | 1,396,096.35 |

注：替代损益（如有）是指投资者采用可以现金替代或退补现金替代方式申购（赎回）本基金时，补入（卖出）被替代成分证券的实际买入成本（实际卖出金额）与申购（赎回）确认日估值的差额或强制退款的被替代成分证券在强制退款计算日与申购（赎回）确认日估值的差额。

### 6.4.7.23 信用减值损失

无。

### 6.4.7.24 其他费用

单位：人民币元

| 项目 | 本期<br>2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日 |
|---|---|
| 审计费用 | 39,671.58 |
| 信息披露费 | 59,507.37 |
| 证券出借违约金 | - |
| 银行划款手续费 | 341.58 |
| 其他 | 59,507.37 |
| 合计 | 159,027.90 |

### 6.4.7.25 分部报告

无。

## 6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

### 6.4.8.1 或有事项

无。

### 6.4.8.2 资产负债表日后事项

无。

### 6.4.9 关联方、关联关系

### 6.4.9.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

本基金本报告期存在控制关系或者其他重大利害关系的关联方未发生变化。

### 6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

| 关联方名称 | 与本基金的关系 |
| --- | --- |
| 大成基金管理有限公司（“大成基金”） | 基金管理人 |
| 中国建设银行股份有限公司（“建设银行”） | 基金托管人 |
| 光大证券股份有限公司（“光大证券”） | 基金管理人的股东、基金销售机构 |

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

### 6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

### 6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

### 6.4.10.1.1 股票交易

无。

### 6.4.10.1.2 债券交易

金额单位：人民币元

| 关联方名称 | 本期<br>2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日 | |
| --- | --- | --- |
| | 成交金额 | 占当期债券<br>成交总额的比例（%） |
| 光大证券 | 1,331,118,360.00 | 18.07 |

### 6.4.10.1.3 债券回购交易

无。

### 6.4.10.1.4 基金交易

无。

### 6.4.10.1.5 权证交易

无。

### 6.4.10.1.6 应支付关联方的佣金

无。

### 6.4.10.2 关联方报酬

### 6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

| 项目 | 本期<br>2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日 |
|---|---|
| 当期发生的基金应支付的管理费 | 6,977,468.17 |
| 其中：应支付销售机构的客户维护费 | 154,878.43 |
| 应支付基金管理人的净管理费 | 6,822,589.74 |

注：本基金管理费年费率为 0.15%，每日计提，按月支付。其计算公式为：

日管理费＝前一日基金资产净值×管理费年费率/当年天数。

### 6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

| 项目 | 本期<br>2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日 |
|---|---|
| 当期发生的基金应支付的托管费 | 2,325,822.71 |

注：本基金托管费年费率为 0.05%，每日计提，按月支付。其计算公式为：

日托管费＝前一日基金资产净值×托管费年费率/当年天数。

### 6.4.10.2.3 销售服务费

无。

### 6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易

无。

### 6.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

### 6.4.10.4.1 与关联方通过约定申报方式进行的适用固定期限费率的证券出借业务的情况

无。

### 6.4.10.4.2 与关联方通过约定申报方式进行的适用市场化期限费率的证券出借业务的情况

无。

### 6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

### 6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

无。

### 6.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

份额单位：份

| 关联方名称 | 本期末<br>2026 年 6 月 30 日 | | 上年度末<br>2025年12月31日 | |
|---|---|---|---|---|
| | 持有的基金份额 | 持有的基金份额占基金总份额的比例（%） | 持有的基金份额 | 持有的基金份额占基金总份额的比例（%） |

| | | | | |
|---|---|---|---|---|
| 建设银行 | 6,000,000.00 | 6.17 | 6,000,000.00 | 4.86 |

注：除基金管理人之外的其他关联方投资本基金适用的交易费率与本基金法律文件规定一致。

### 6.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

| 关联方名称 | 本期<br>2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日 | |
|---|---|---|
| | 期末余额 | 当期利息收入 |
| 建设银行 | 87,570,418.37 | 217,543.96 |

注：本基金由基金托管人保管的银行存款，按银行约定利率计息。

### 6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

无。

### 6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

无。

### 6.4.11 利润分配情况

无。

### 6.4.12 期末（2026 年 6 月 30 日）本基金持有的流通受限证券

### 6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

无。

### 6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

无。

### 6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

### 6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

无。

### 6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

无。

### 6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

无。

### 6.4.13 金融工具风险及管理

### 6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

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。本基金的投资范围为具有良好流动性的及融工具。本基金在日常经营活动中面临的与这些金融工具相关的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金的基金管理人从事风险管理的主要目标是紧密跟踪标的指数，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%。

本基金的基金管理人奉行全面风险管理体系的建设，建立了以由高层监控(合规与风险管理委员会、公司投资风险控制委员会)、专业监控(监察稽核部、风险管理部)、部门互控、岗位自控构成的风险管理架构体系。本基金的基金管理人在董事会下设立合规与风险管理委员会，对公司整体运营风险进行监督，监督风险控制措施的执行；在管理层层面设立投资风险控制委员会，通过定期会议讨论涉及投资风险的重大议题，形成正式决议提交投委会；在业务操作层面，监察稽核部履行合规控制职责，通过定期、不定期检查内控制度的执行情况、对重大风险点以专项稽核的方式确保公司内控制度、流程得到贯彻执行。风险管理部履行风险量化评估分析职责。

本基金的基金管理人对于金融工具的风险管理方法主要是通过定性分析和定量分析的方法去估测各种风险产生的可能损失。从定性分析的角度出发，判断风险损失的严重程度和出现同类风险损失的频度。而从定量分析的角度出发，根据本基金的投资目标，结合基金资产所运用金融工具特征通过特定的风险量化指标、模型，日常的量化报告，确定风险损失的限度和相应置信程度，及时可靠地对各种风险进行监督、检查和评估，并通过相应决策，将风险控制在可承受的范围内。

### 6.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息等情况，导致基金资产损失和收益变化的风险。

本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的银行存款存放在本基金的托管人中国建设银行股份有限公司，因而与银行存款相关的信用风险不重大。本基金在交易所进行的交易均以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，违约风险可能性很小；在银行间同业市场进行交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式进行限制以控制相应的信用风险。

本基金的基金管理人建立了信用风险管理流程，通过对投资品种信用等级评估来控制证券发行人的信用风险。信用等级评估以内部信用评级为主，外部信用评级为辅。内部债券信用评级主要考察发行人的经营风险、财务风险和流动性风险，以及信用产品的条款和担保人的情况等。此外，本基金的基金管理人根据信用产品的内部评级，通过单只信用产品投资占基金资产净值的比例及占发行量的比例进行控制，通过分散化投资以分散信用风险。

本期末，本基金持有的除国债、央行票据和政策性金融债以外的债券占基金资产净值的比例为 93.22%(上年度末：53.51%)。

### 6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金在履行与金融负债有关的义务时遇到资金短缺的风险。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难或因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理的价格变现。

#### 6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》及《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》等有关法规的要求建立健全开放式基金流动性风险管理的内部控制体系，审慎评估各类资产的流动性，针对性制定流动性风险管理措施，对本基金组合资产的流动性风险进行管理。本基金的基金管理人采用监控基金组合资产持仓集中度指标、逆回购交易的到期日与交易对手的集中度、流动性受限资产比例、基金组合资产中 7 个工作日可变现资产的可变现价值以及压力测试等方式防范流动性风险。并于开放日对本基金的申购赎回情况进行监控，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配，确保本基金资产的变现能力与投资者赎回需求的匹配与平衡。本基金的基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。

本基金主要投资于交易所及银行间市场内交易的证券，除在附注“期末本基金持有的流通受限证券”中列示的部分基金资产流通暂时受限制外(如有)，其余均能及时变现。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券资产的公允价值。除附注“期末债券正回购交易中作为抵押的债券”中列示的卖出回购金融资产款余额(如有)将在 1 个月内到期且计息外，本基金于资产负债表日所持有的金融负债的合约约定剩余到期日均为一年以内且一般不计息，可赎回基金份额净值无固定到期日且不计息，因此账面余额一般即为未折现的合约到期现金流量。本报告期内，本基金未发生重大流动性风险事件。

### 6.4.13.4 市场风险

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动而发生波动的风险，包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

#### 6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。利率敏感性金融工具均面临由于市场利率上升而导致公允价值下降的风险，其中浮动利率类金融工具

还面临每个付息期间结束根据市场利率重新定价时对于未来现金流影响的风险。

本基金的基金管理人定期对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控，并通过调整投资组合的久期等方法对上述利率风险进行管理。

本基金主要投资于交易所及银行间市场交易的固定收益品种，因此存在相应的利率风险。

### 6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

| 本期末<br>2026 年 6 月 30 日 | 1 年以内 | 1-5 年 | 5 年以上 | 不计息 | 合计 |
|---|---|---|---|---|---|
| 资产 | | | | | |
| 货币资金 | 87,570,418.37 | - | - | - | 87,570,418.37 |
| 结算备付金 | 21,201,414.82 | - | - | - | 21,201,414.82 |
| 存出保证金 | 318,540.15 | - | - | - | 318,540.15 |
| 交易性金融资产 | 1,584,367,568.25 | 5,904,755,968.78 | 2,034,759,685.58 | 46,982.92 | 9,523,930,205.53 |
| 买入返售金融资产 | 598,000,000.00 | - | - | - | 598,000,000.00 |
| 应收清算款 | - | - | - | 1,525,742.22 | 1,525,742.22 |
| 其他资产 | - | - | - | 60,492.63 | 60,492.63 |
| 资产总计 | 2,291,457,941.59 | 5,904,755,968.78 | 2,034,759,685.58 | 1,633,217.77 | 10,232,606,813.72 |
| 负债 | | | | | |
| 应付管理人报酬 | - | - | - | 1,125,462.56 | 1,125,462.56 |
| 应付托管费 | - | - | - | 375,154.18 | 375,154.18 |
| 应付清算款 | - | - | - | 69,981,666.57 | 69,981,666.57 |
| 应交税费 | - | - | - | 464,428.42 | 464,428.42 |
| 其他负债 | - | - | - | 251,689,434.02 | 251,689,434.02 |
| 负债总计 | - | - | - | 323,636,145.75 | 323,636,145.75 |
| 利率敏感度缺口 | 2,291,457,941.59 | 5,904,755,968.78 | 2,034,759,685.58 | -322,002,927.98 | 9,908,970,667.97 |
| 上年度末<br>2025 年 12 月 31 日 | 1 年以内 | 1-5 年 | 5 年以上 | 不计息 | 合计 |
| 资产 | | | | | |
| 货币资金 | 336,730,992.70 | - | - | - | 336,730,992.70 |
| 结算备付金 | 37,650,546.24 | - | - | - | 37,650,546.24 |
| 存出保证金 | 188,380.11 | - | - | - | 188,380.11 |
| 交易性金融资产 | 1,122,814,345.24 | 4,618,661,809.12 | 1,423,423,939.74 | 35,709.44 | 7,164,935,803.54 |
| 买入返售金融资产 | 4,949,988,961.78 | - | - | - | 4,949,988,961.78 |
| 应收清算款 | - | - | - | 3,104,871.69 | 3,104,871.69 |
| 资产总计 | 6,447,373,226.07 | 4,618,661,809.12 | 1,423,423,939.74 | 3,140,581.13 | 12,492,599,556.06 |

| | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|
| 负债 | | | | | |
| 应付管理人报酬 | - | - | - | 1,127,003.06 | 1,127,003.06 |
| 应付托管费 | - | - | - | 375,667.71 | 375,667.71 |
| 应付清算款 | - | - | - | 79,862,247.88 | 79,862,247.88 |
| 应交税费 | - | - | - | 302,011.19 | 302,011.19 |
| 其他负债 | - | - | - | 17,143,813.11 | 17,143,813.11 |
| 负债总计 | - | - | - | 98,810,742.95 | 98,810,742.95 |
| 利率敏感度缺口 | 6,447,373,226.07 | 4,618,661,809.12 | 1,423,423,939.74 | -95,670,161.82 | 12,393,788,813.11 |

注：表中所示为本基金资产及负债的账面价值，并按照合约规定的利率重新定价日或到期日孰早者予以分类。

### 6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

| 假设 | 除市场利率以外的其他市场变量保持不变 | | |
|---|---|---|---|
| 分析 | 相关风险变量的变动 | 对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元） | |
| | | 本期末 （2026 年 6 月 30 日） | 上年度末 （2025 年 12 月 31 日 ） |
| | 市场利率上升 25 个基点 | -81,978,675.20 | -73,394,473.95 |
| | 市场利率下降 25 个基点 | 83,828,730.50 | 75,647,139.88 |

### 6.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无重大外汇风险。

### 6.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场交易的固定收益品种，因此无重大其他价格风险。

### 6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

无。

### 6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

无。

## 6.4.14 公允价值

### 6.4.14.1 金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属的层次，由对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次决定：

第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

### 6.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

#### 6.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

单位：人民币元

| 公允价值计量结果所属的层次 | 本期末<br>2026 年 6 月 30 日 | 上年度末<br>2025 年 12 月 31 日 |
|---|---|---|
| 第一层次 | - | - |
| 第二层次 | 9,523,930,205.53 | 7,164,935,803.54 |
| 第三层次 | - | - |
| 合计 | 9,523,930,205.53 | 7,164,935,803.54 |

#### 6.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

本基金以导致各层次之间转换的事项发生日为确认各层次之间转换的时点。

本基金本期及上年度可比期间持有的以公允价值计量的金融工具的公允价值所属层次未发生重大变动。

### 6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

于本期末，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融工具(上年度末：同)。

### 6.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括货币资金、应收款项和其他金融负债等，其账面价值与公允价值相差很小。

## 6.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

# §7 投资组合报告

## 7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

| 序号 | 项目 | 金额 | 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 | 9,523,930,205.53 | 93.07 |
| | 其中：债券 | 9,523,930,205.53 | 93.07 |
| | 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 | 598,000,000.00 | 5.84 |
| | 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 | 108,771,833.19 | 1.06 |
| 8 | 其他各项资产 | 1,904,775.00 | 0.02 |
| 9 | 合计 | 10,232,606,813.72 | 100.00 |

注：上述债券投资金额包括可退替代款估值增值（如有）。

## 7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

### 7.2.1 报告期末指数投资按行业分类的境内股票投资组合

无。

### 7.2.2 报告期末积极投资按行业分类的境内股票投资组合

无。

### 7.2.3 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

无。

## 7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

### 7.3.1 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所有股票投资明细

无。

### 7.3.2 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所有股票投资明细

无。

## 7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

### 7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

无。

### 7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

无。

### 7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

无。

## 7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

| 序号 | 债券品种 | 公允价值 | 占基金资产净值比例（%） |
|---|---|---|---|
| 1 | 国家债券 | 286,439,033.77 | 2.89 |
| 2 | 央行票据 | - | - |
| 3 | 金融债券 | 1,051,452,063.01 | 10.61 |
| | 其中：政策性金融债 | - | - |
| 4 | 企业债券 | 7,983,763,618.97 | 80.57 |
| 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 | 202,228,506.86 | 2.04 |
| 10 | 合计 | 9,523,883,222.61 | 96.11 |

## 7.6 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

金额单位：人民币元

| 序号 | 债券代码 | 债券名称 | 数量（张） | 公允价值 | 占基金资产净值比例（%） |
|---|---|---|---|---|---|
| 1 | 244698 | 26 中证 K1 | 2,000,000 | 202,162,191.78 | 2.04 |
| 2 | 243667 | 25 管网 SK | 1,600,000 | 162,192,657.54 | 1.64 |
| 3 | 243736 | 25 国能 K2 | 1,500,000 | 152,919,493.16 | 1.54 |
| 4 | 524541 | 25 诚通 K1 | 1,400,000 | 146,187,616.44 | 1.48 |
| 5 | 524614 | 26CMGK01 | 1,400,000 | 141,513,419.18 | 1.43 |

## 7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

无。

## 7.8 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贵金属投资明细

无。

## 7.9 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。

## 7.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

### 7.10.1 本期国债期货投资政策

无。

### 7.10.2 本期国债期货投资评价

无。

## 7.11 投资组合报告附注

### 7.11.1 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。

### 7.11.2 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。

### 7.11.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

| 序号 | 名称 | 金额 |
|---|---|---|
| 1 | 存出保证金 | 318,540.15 |
| 2 | 应收清算款 | 1,525,742.22 |
| 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 | 60,492.63 |
| 8 | 其他 | - |
| 9 | 合计 | 1,904,775.00 |

### 7.11.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

无。

### 7.11.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

#### 7.11.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

无。

#### 7.11.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

无。

### 7.11.6 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。

# §8 基金份额持有人信息

## 8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

| 持有人户数（户） | 户均持有的基金份额 | 持有人结构 | | | |
|---|---|---|---|---|---|
| | | 机构投资者 | | 个人投资者 | |
| | | 持有份额 | 占总份额比例（%） | 持有份额 | 占总份额比例（%） |
| 265 | 367,231.08 | 97,289,337.00 | 99.97 | 26,900.00 | 0.03 |

注：持有人户数为有效户数，即存量份额大于零的账户。

### 8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

无。

### 8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

| 项目 | 持有基金份额总量的数量区间（万份） |
|---|---|
| 本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金 | 0 |
| 本基金基金经理持有本开放式基金 | 0 |

## §9 开放式基金份额变动

单位：份

| | |
|---|---|
| 基金合同生效日（2025 年 9 月 17 日）基金份额总额 | 2,913,625,598.00 |
| 本报告期期初基金份额总额 | 123,506,237.00 |
| 本报告期基金总申购份额 | 36,670,000.00 |
| 减：本报告期基金总赎回份额 | 62,860,000.00 |
| 本报告期基金拆分变动份额 | - |
| 本报告期期末基金份额总额 | 97,316,237.00 |

## §10 重大事件揭示

### 10.1 基金份额持有人大会决议

无。

### 10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

一、基金管理人的重大人事变动

经大成基金管理有限公司 2026 年第一次临时股东会及公司九届四次监事会审议通过，同意选举郭向东先生为公司第九届监事会股东代表监事，监事会主席，任期自 2026 年 4 月 30 日之日起计算，与公司第九届监事会剩余任期一致。自郭向东先生的监事任职生效之日起，陈勇先生将不再担任公司监事、监事会主席职务。

二、基金托管人的基金托管部门的重大人事变动

无。

## 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内无涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

## 10.4 基金投资策略的改变

本基金投资策略在本报告期内没有重大改变。

## 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金自基金合同生效日起聘请容诚会计师事务所（特殊普通合伙）为本基金提供审计服务至今。

## 10.6 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况

### 10.6.1 管理人受调查或处罚等情况

本报告期内，基金管理人无受调查或处罚等情况。

### 10.6.2 管理人相关从业人员受调查或处罚等情况

本报告期内，基金管理人相关从业人员无受调查或处罚等情况。

### 10.6.3 托管人受调查或处罚等情况

无。

### 10.6.4 托管人相关从业人员受调查或处罚等情况

无。

## 10.7 基金租用或者通过证券公司交易单元进行证券投资的相关情况

### 10.7.1 基金租用或者通过证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

| 券商名称 | 交易单元数量 | 股票交易 | | 应支付该券商的佣金 | | 备注 |
|---|---|---|---|---|---|---|
| | | 成交金额 | 占当期股票成交总额的比例(%) | 佣金 | 占当期佣金总量的比例(%) | |
| 长江证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 光大证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 华泰证券 | 1 | - | - | - | - | 新增1个 |
| 兴业证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 野村东方国际证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 招商证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 中金公司 | 1 | - | - | - | - | - |
| 中信建投证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 中信证券 | 1 | - | - | - | - | - |

注：本基金采用托管人结算模式，本基金管理人负责选择证券经纪商，租用其交易单元作为本基金的交易单元。证券经纪商的选择标准和流程如下：

（一）筛选标准

大成基金管理有限公司（以下简称“公司”）严格按照《公开募集证券投资基金证券交易费用管理规定》要求制定了证券公司筛选标准，建立了证券公司尽职调查、证券公司负面筛查、备选池筛选机制，选择财务状况良好，经营行为规范，合规风控能力和交易、研究等服务能力较强的证券公司参与证券交易。

（二）筛选流程

1、经公司尽调符合条件的证券公司进入备选池，由股票投委会以公平、公正、公开为原则，结合定性及定量办法科学评估证券公司研究服务能力，形成证券公司白名单，并定期及不定期进行动态调整。

2、公司按照白名单与证券公司进行协议签署。

## 10.7.2 基金租用或者通过证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

| 券商名称 | 债券交易 | | 债券回购交易 | | 权证交易 | | 基金交易 | |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| | 成交金额 | 占当期债券成交总额的比例(%) | 成交金额 | 占当期债券回购成交总额的比例(%) | 成交金额 | 占当期权证成交总额的比例(%) | 成交金额 | 占当期基金成交总额的比例(%) |
| 光大证券 | 1,331,118,360.00 | 18.07 | - | - | - | - | - | - |
| 中信证券 | 6,036,110,758.00 | 81.93 | 38,725,319,000.00 | 100.00 | - | - | - | - |

## 10.8 其他重大事件

| 序号 | 公告事项 | 法定披露方式 | 法定披露日期 |
| --- | --- | --- | --- |
| 1 | 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产品资料概要更新 | 中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站 | 2026 年 06 月 30 日 |
| 2 | 关于大成基金旗下部分交易型开放式指数证券投资基金增加西部证券股份有限公司为申购赎回代办证券公司的公告 | 中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站 | 2026 年 06 月 01 日 |
| 3 | 关于大成基金旗下部分交易型开放式指数证券投资基金增加联储证券股份有限公司为申购赎回代办证券公司的公告 | 中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站 | 2026 年 06 月 01 日 |
| 4 | 2025 年度公募基金管理人以股东身份（通过公募基金持股）参与股东大会投票信息披露 | 中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站 | 2026 年 04 月 30 日 |
| 5 | 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 1 季度报告 | 中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站 | 2026 年 04 月 22 日 |
| 6 | 大成基金管理有限公司旗下 212 只公募基金 2026 年第 1 季度报告提示性公告 | 规定报刊 | 2026 年 04 月 22 日 |
| 7 | 大成基金管理有限公司旗下 205 只公募基金 2025 年年度报告提示性公告 | 规定报刊 | 2026 年 03 月 31 日 |
| 8 | 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 2025 年年度报告 | 中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站 | 2026 年 03 月 31 日 |
| 9 | 关于大成基金旗下部分交易型开放式指数证券投资基金增加渤海证券股份有限公司为申购赎回代办证券公司的公告 | 中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站 | 2026 年 03 月 27 日 |
| 10 | 关于大成基金旗下部分交易型开放式指数证券投资基金增加德邦证券股份有限公司为申购赎回代办证券公司的公告 | 中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站 | 2026 年 03 月 27 日 |
| 11 | 大成基金管理有限公司旗下部分 ETF 基金新增瑞银证券有限责任公司为申购赎回代办证券公司的公告 | 中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站 | 2026 年 03 月 10 日 |
| 12 | 大成基金管理有限公司提醒投资者谨防金融诈骗的公告 | 中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站 | 2026 年 02 月 14 日 |
| 13 | 大成基金管理有限公司提醒投资者谨防金融诈骗的公告 | 中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站 | 2026 年 01 月 30 日 |

| | | | |
|---|---|---|---|
| 14 | 大成基金管理有限公司旗下 205 只公募基金 2025 年第 4 季度报告提示性公告 | 规定报刊 | 2026 年 01 月 22 日 |
| 15 | 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 2025 年第 4 季度报告 | 中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站 | 2026 年 01 月 22 日 |

# §11 影响投资者决策的其他重要信息

## 11.1 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。

## 11.2 影响投资者决策的其他重要信息

| |
|---|
| 无。 |

# §12 备查文件目录

## 12.1 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。

## 12.2 存放地点

备查文件存放在本基金管理人和托管人的住所。

## 12.3 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 8 月 28 日