

大成景盛一年定期开放债券型证券投资基金

2021 年中期报告

2021 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：中国银行股份有限公司

送出日期：2021 年 8 月 31 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，并由董事长签发。

基金托管人中国银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2021 年 8 月 30 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 2021 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	5
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	6
3.1 主要会计数据和财务指标	6
3.2 基金净值表现	7
§ 4 管理人报告	9
4.1 基金管理人及基金经理情况	9
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	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	12
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	13
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	13
§ 5 托管人报告	13
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	13
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	14
5.3 托管人对本中期报告中财务信息内容的真实、准确和完整发表意见	14
§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）	14
6.1 资产负债表	14
6.2 利润表	15
6.3 所有者权益（基金净值）变动表	16
6.4 报表附注	17
§ 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	35
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	37
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	38
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	38

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	38
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	39
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	39
7.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	39
7.11 投资组合报告附注	39
§ 8 基金份额持有人信息	40
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	40
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	41
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	41
§ 9 开放式基金份额变动	41
§ 10 重大事件揭示	41
10.1 基金份额持有人大会决议	41
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	42
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	42
10.4 基金投资策略的改变	42
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	42
10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况	42
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	42
10.8 其他重大事件	45
§ 11 影响投资者决策的其他重要信息	45
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	45
11.2 影响投资者决策的其他重要信息	45
§ 12 备查文件目录	46
12.1 备查文件目录	46
12.2 存放地点	46
12.3 查阅方式	46

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	大成景盛一年定期开放债券型证券投资基金	
基金简称	大成景盛一年定期开放债券	
基金主代码	002946	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2016 年 11 月 8 日	
基金管理人	大成基金管理有限公司	
基金托管人	中国银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	111,768,758.32 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	大成景盛一年定期债券 A	大成景盛一年定期债券 C
下属分级基金的交易代码	002946	002947
报告期末下属分级基金的份 额总额	110,583,001.77 份	1,185,756.55 份

2.2 基金产品说明

投资目标	在严格控制投资风险的基础上，通过积极主动的投资管理，力争实现基金资产长期稳定增值。
投资策略	<p>（一）封闭期投资策略 本基金运用自上而下的宏观分析和自下而上的市场分析相结合的方法实现大类资产配置，把握不同的经济发展阶段各类资产的投资机会，根据宏观经济、基准利率水平等因素，预测债券类、货币类等大类资产的预期收益率水平，结合各类别资产的波动性以及流动性状况分析，进行大类资产配置。</p> <p>（二）开放期投资策略 开放运作期内，本基金将保持较高的组合流动性，方便投资人安排投资。</p> <p>1、债券投资策略 在遵守本基金有关投资限制与投资比例的前提下，将主要投资于高流动性的投资品种。本基金在开放期将重点考虑债券的安全性和流动性，确保组合债券有较高的变现能力，并严格控制基金组合的杠杆比例。</p> <p>2、流动性管理策略 基金管理人将密切关注基金的申购赎回情况，对投资组合的现金比例进行结构化管理。同时，也会通过回购的滚动操作和债券品种的期限结构搭配，有效分配基金的现金流，保持本基金在开放期的充分流动性。</p>
业绩比较基准	沪深 300 指数收益率×20%+中债综合指数（全价）收益率×80%
风险收益特征	本基金为债券型基金，属于证券投资基金中的较低风险品种，其预期风险与预期收益高于货币市场基金，低于混合型基金和股票型基金。

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	中国银行股份有限公司
信息披露 姓名	赵冰	许俊

负责人	联系电话	0755-83183388	010-66594319
	电子邮箱	office@dcfund.com.cn	fcid@bankofchina.com
客户服务电话		4008885558	95566
传真		0755-83199588	010-66594942
注册地址		深圳市福田区深南大道 7088 号招商银行大厦 32 层	北京市西城区复兴门内大街 1 号
办公地址		深圳市福田区深南大道 7088 号招商银行大厦 32 层	北京市西城区复兴门内大街 1 号
邮政编码		518040	100818
法定代表人		吴庆斌	刘连舸

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《中国证券报》
登载基金中期报告正文的管理人互联网网址	www.dcfund.com.cn
基金中期报告备置地点	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	大成基金管理有限公司	深圳市福田区深南大道 7088 号招商银行大厦 32 层

§ 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(2021年1月1日-2021年6月30日)	
	大成景盛一年定期债券 A	大成景盛一年定期债券 C
本期已实现收益	1,033,646.64	8,298.45
本期利润	2,037,953.63	18,868.31
加权平均基金份额本期利润	0.0184	0.0159
本期加权平均净值利润率	1.64%	1.44%
本期基金份额净值增长率	1.66%	1.45%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2021年6月30日)	
期末可供分配利润	14,970,634.48	135,681.24
期末可供分配基金份额利润	0.1354	0.1144
期末基金资产净值	125,553,636.25	1,321,437.79
期末基金份额净值	1.1354	1.1144

3.1.3 累计期末指标	报告期末(2021年6月30日)	
基金份额累计净值增长率	13.54%	11.44%

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

大成景盛一年定期债券 A

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
过去一个月	0.75%	0.19%	-0.43%	0.17%	1.18%	0.02%
过去三个月	2.19%	0.15%	1.09%	0.20%	1.10%	-0.05%
过去六个月	1.66%	0.22%	0.73%	0.27%	0.93%	-0.05%
过去一年	4.85%	0.29%	4.84%	0.26%	0.01%	0.03%
过去三年	15.04%	0.29%	13.45%	0.26%	1.59%	0.03%
自基金合同生效起至今	13.54%	0.28%	11.38%	0.24%	2.16%	0.04%

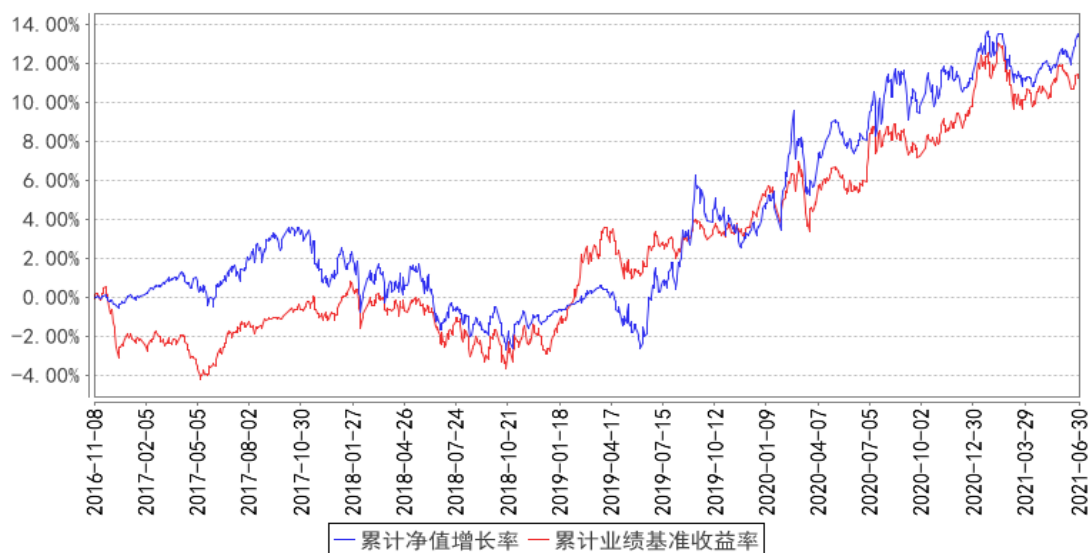
大成景盛一年定期债券 C

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
过去一个月	0.71%	0.19%	-0.43%	0.17%	1.14%	0.02%
过去三个月	2.08%	0.15%	1.09%	0.20%	0.99%	-0.05%
过去六个月	1.45%	0.22%	0.73%	0.27%	0.72%	-0.05%
过去一年	4.42%	0.29%	4.84%	0.26%	-0.42%	0.03%
过去三年	13.64%	0.29%	13.45%	0.26%	0.19%	0.03%
自基金合同生效起	11.44%	0.28%	11.38%	0.24%	0.06%	0.04%

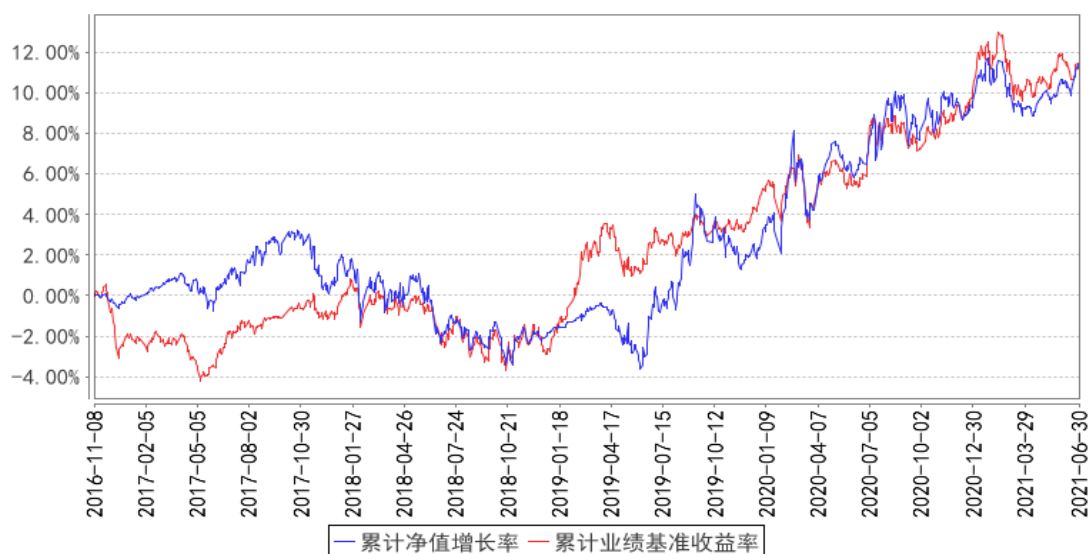
至今						
----	--	--	--	--	--	--

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

大成景盛一年定期债券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



大成景盛一年定期债券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



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经中国证监会证监基金字[1999]10 号文批准，于 1999 年 4 月 12 日正式成立，是中国证监会批准成立的首批十家基金管理公司之一，注册资本 2 亿元人民币，注册地广东省深圳市。目前公司由三家股东组成，分别为中泰信托有限责任公司(50%)、光大证券股份有限公司(25%)、中国银河投资管理有限公司(25%)。主要业务是公募基金的募集、销售和管理，还具有全国社保基金投资管理、基本养老保险投资管理、受托管理保险资金、保险保障基金投资管理、特定客户资产管理和 QDII 业务资格。

经过二十二年的稳健发展，公司形成了强大稳固的综合实力。公司旗下基金产品齐全、风格多样，构建了涵盖股票型基金、混合型基金、指数型基金、债券型基金和货币市场基金的完备产品线。截至 2021 年 6 月 30 日，本基金管理人共管理 9 只 ETF 及 3 只 ETF 联接基金，8 只 QDII 基金及 107 只开放式证券投资基金。

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		
岳苗	本基金基金经理助理	2020 年 10 月 19 日	-	9 年	工程硕士。2012 年 9 月至 2015 年 6 月任申万宏源股份有限公司研究所（机构业务部）中小市值分析师。2015 年 6 月至 2019 年 3 月任光大永明资产管理股份有限公司权益投资部研究员。2019 年 4 月加入大成基金管理有限公司，现任固定收益总部研究员兼基金经理助理。2020 年 10 月 19 日起任大成景盛一年定期开放债券型证券投资基金基金经理助理。2020 年 11 月 30 日起任大成景荣债券型证券投资基金基金经理助理。具备基金从业资格。国籍：中国
王立	本基金基金经理，公司总经理助理、固定收益总部总监	2020 年 12 月 16 日	-	19 年	经济学硕士。曾就职于申银万国证券股份有限公司、南京市商业银行资金营运中心。2005 年 4 月加入大成基金管理有限公司，曾担任固定收益总部总监助理、副总监、总监，现任公司总经理助理兼固定收益总部总监。2007 年 1 月 12 日至 2014 年 12 月 23 日任大成货币市场证券投资基金基金经理。2009 年 5 月 23 日起任大成债券投资基金基金经理。2012 年 11 月 20 日至

					2014 年 4 月 4 日任大成现金增利货币市场基金基金经理。2013 年 2 月 1 日至 2015 年 5 月 25 日任大成月添利理财债券型证券投资基金基金经理。2013 年 7 月 23 日至 2015 年 5 月 25 日任大成景旭纯债债券型证券投资基金基金经理。2014 年 9 月 3 日至 2020 年 10 月 15 日任大成景兴信用债券型证券投资基金基金经理。2014 年 9 月 3 日至 2016 年 11 月 23 日任大成景丰债券型证券投资基金 (LOF) 基金经理。2016 年 2 月 3 日至 2018 年 4 月 2 日任大成慧成货币市场基金基金经理。2020 年 12 月 16 日起任大成景盛一年定期开放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行业协会《证券业从业人员资格管理办法》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合规守信情况的说明

报告期内，本基金管理人严格遵守《证券法》、《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，基金管理人严格执行了公平交易的原则和制度。基金管理人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 日内及 5 日内股票及债券交易同向交易价差进行分析。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，即投资组合成交时间不一致以及成交价格的日内较大变动导致个别些组合间的成交价格差异较大，但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，基金管理人旗下所有投资组合未发现存在异常交易行为。主动投资组合间股票交易不存在同日反向交易。主动型投资组合与指数型投资组合之间或指数型投资组合之间存在股票

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股当日成交量 5%的情形；主动投资组合间债券交易存在 2 笔同日反向交易，原因为流动性需要。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

2021 年上半年，经济基本面继续保持强势修复，PPI 和 CPI 的剪刀差不断扩大，周期品价格从年初以来持续走高，在二季度由于监管的不断强调对大宗商品价格走高的关注，商品价格得以短期走低，一定程度上缓解了下游企业的成本压力，但目前看依然在较高的价格区间，已经远超 2009-2010 年水平。当下经济的热度既反映了疫情受限情况下供需错配的问题，也反映了全球大放水以及疫情逐步缓解后需求走高的预期。虽然广义流动性持续收缩，但收缩幅度放缓，而狭义流动性保持偏宽松的状态，也导致风险偏好明显走高。

整体来看，债券市场指数方面，上半年中债综合指数上涨 2.14%，中债金融债券总指数上涨 2.01%，中债信用债总指数上涨 2.15%。绝对收益水平来看，上半年利率债收益率先上后下，1、3、5、10 年国开债收益率分别下行 4bp、上行 2bp、下行 1bp、下行 5bp；信用债表现整体略好于利率债，信用利差有明显收窄，1、3、5 年 AA+ 中短期票据利率分别下行 36、42、44bp。

上半年权益市场呈 N 型走势，大小盘风格切换明显，上半年创业板指上涨 17.22，沪深 300 微涨 0.24%，权益指数分化较严重。这种大小盘风格切换源于年前抱团股瓦解，主要是资金驱动，6 月之后分化加剧，此外，国内外短期的流动性也对上半年行情产生较大影响。从行业上看，上半年周期板块表现最好，中游板块受益复苏逻辑有较高收入和利润增长趋势，但同时由于上游原材料的快速上涨，成本端压力快速上行，压低市场预期。下游板块受复苏传导较弱，消费修复缓慢。转债整体表现平稳，中证转债收涨 4.04%，得益于债市上半年表现较高，转债估值修复明显。

本基金在严格控制风险的基础上，采取积极的组合策略和严格的资产选择原则进行投资运作。2021 年上半年，本基金主动管理组合大类资产配置，因为我们对利率债市场观点的发生转变，组合适当拉长了久期，增持长久期利率债。同时高度重视信用风险，继续持有中高信用等级信用债，并精选信用个券以获得相对稳定的持有收益。可转债资产配置上更加多元化，更加关注自上而下的行业配置和自下而上的个券选择的结合。获利了结了部分涨幅较高或已经强制赎回的转债品种，并在次新转债中寻找新的布局机会。股票部分继续进行结构上的切换，精选质地优秀的制造业龙头，同时买入发行转债的优质标的，同时获取正股涨幅和配售收益。

我们非常感谢基金份额持有人的信任和支持，我们将继续按照本基金合同和风险收益特征的

要求，严格控制投资风险，积极进行资产配置，适时调整组合结构，研究新的投资品种和挖掘投资机会，力争获得与基金风险特征一致的收益回报给投资者。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末大成景盛一年定期债券 A 的基金份额净值为 1.1354 元，本报告期基金份额净值增长率为 1.66%，同期业绩比较基准收益率为 0.73%；截至本报告期末大成景盛一年定期债券 C 的基金份额净值为 1.1144 元，本报告期基金份额净值增长率为 1.45%，同期业绩比较基准收益率为 0.73%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

关于宏观经济的看法，我们认为未来一段时间经济处于从“全球复苏”向“正常化生产”演变的过程中，情绪上可能会出现从景气繁荣到正常化回落的落差，对市场节奏的把握比上半年更加重要。从短期角度讲，疫情后需求的恢复快于供给恢复，后续航空旅游放开、海外需求进一步恢复可能会再带来一波积极性需求拉升，如 Q2 受美国地产链需求影响的相关板块回暖明显，后续海外继续恢复很有可能在汽车、家电等领域都有带动。中期维度看，生产逐步恢复正常化之后，大宗价格会回到合理水平，但受到“碳中和”等限产影响，企业盈利相比 2020 年以及疫情前仍会大幅改善。目前中游的成本压力较大，大宗商品价格持续上涨不利于生产正常化，从产业链需求端和政策制定者角度看都不希望大宗价格继续上行。整体看全球的恢复，短期还有进一步景气向上冲击的可能，脉冲过后待生产供给正常化后，可能面临供需的不断调整，在从复苏到正常化转换的过程中市场还是面临冲高回落的压力。

基于对经济和行业景气度的判断，我们认为下半年依然保持结构性行情。整体市场走势要综合流动性、上市公司业绩和估值等三方面因素考虑，下半年整体行情可能前高后低，节奏上在 Q3 投资难度加大，看短期可能跟随中报仍有一波不错的行情，后续跟随经济结构调整会有变化。谨慎评估现在市场估值以及行业增长情况，比较认可的投资机会：中游的汽车（含传统和新能源汽车）、光伏板块、机械（下游景气不错的设备领域），中游板块上半年受到原材料涨价，毛利率有较大的压制，Q3Q4 可能有一定的修复，新能源和光伏相关的产业链供给紧张的环节也有一定的投资机会。科技和消费主要挖掘个股机会。

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。估值委员会由股票投资部、研究部、固定收益总部、数量与指数投资部、大类资产配置部、交易管理部、风险管理部、基金运营部、监察稽核部指定人员组成。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，

估值委员会成员中包括五名投资组合经理。

股票投资部、研究部、固定收益总部、数量与指数投资部、大类资产配置部、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，并负责与托管行沟通估值调整事项；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，并与托管银行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行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同业市场的估值数据，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

本报告期内，中国银行股份有限公司（以下称“本托管人”）在大成景盛一年定期开放债券型证券投资基金（以下称“本基金”）的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的有关规定，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

本报告期内，本托管人根据《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，对本基金管理人的投资运作进行了必要的监督，对基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算以及基金费用开支等方面进行了认真地复核，未发现本基金管理人存在损害基金份额持有人利益的行为。

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

本报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告（注：财务会计报告中的“金融工具风险及管理”、“关联方承销证券”、“关联方证券出借”部分未在托管人复核范围内）、投资组合报告等数据真实、准确和完整。

§ 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：大成景盛一年定期开放债券型证券投资基金

报告截止日：2021 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2021 年 6 月 30 日	上年度末 2020 年 12 月 31 日
资产：			
银行存款	6.4.3.1	4,992,509.88	1,385,772.22
结算备付金		2,511,330.10	1,949,063.27
存出保证金		11,415.35	2,644.39
交易性金融资产	6.4.3.2	134,742,379.96	147,081,958.24
其中：股票投资		17,885,295.36	14,035,774.60
基金投资		-	-
债券投资		116,857,084.60	133,046,183.64
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	6.4.3.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.3.4	4,300,000.00	-
应收证券清算款		354,877.83	-
应收利息	6.4.3.5	1,971,605.10	2,727,964.73
应收股利		-	-
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.3.6	-	-
资产总计		148,884,118.22	153,147,402.85

负债和所有者权益	附注号	本期末 2021 年 6 月 30 日	上年度末 2020 年 12 月 31 日
负 债:			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.3.3	-	-
卖出回购金融资产款		17,039,774.44	27,200,000.00
应付证券清算款		4,747,217.37	906,010.16
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		62,060.29	52,197.22
应付托管费		20,686.76	17,399.07
应付销售服务费		431.00	539.93
应付交易费用	6.4.3.7	28,690.11	15,139.05
应交税费		14,249.53	8,910.79
应付利息		2,632.12	-45.47
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.3.8	93,302.56	129,000.00
负债合计		22,009,044.18	28,329,150.75
所有者权益:			
实收基金	6.4.3.9	111,768,758.32	111,768,758.32
未分配利润	6.4.3.10	15,106,315.72	13,049,493.78
所有者权益合计		126,875,074.04	124,818,252.10
负债和所有者权益总计		148,884,118.22	153,147,402.85

注：报告截止日 2021 年 06 月 30 日，基金份额总额 111,768,758.32 份，其中大成景盛一年定期债券 A 基金份额总额为 110,583,001.77 份，基金份额净值 1.1354 元。大成景盛一年定期债券 C 基金份额总额为 1,185,756.55 份，基金份额净值 1.1144 元。

6.2 利润表

会计主体：大成景盛一年定期开放债券型证券投资基金

本报告期：2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日
一、收入		2,974,943.29	3,189,109.26
1. 利息收入		2,786,269.70	1,960,550.28
其中：存款利息收入	6.4.3.11	21,051.72	29,023.47
债券利息收入		2,765,217.98	1,931,526.81
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	-
证券出借利息收入		-	-

其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		-826,203.26	1,096,400.46
其中：股票投资收益	6.4.3.12	-836,890.66	674,692.83
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.3.13	-111,537.55	389,697.65
资产支持证券投资收益		-	-
贵金属投资收益	6.4.3.14	-	-
衍生工具收益	6.4.3.15	-	6,893.20
股利收益	6.4.3.16	122,224.95	25,116.78
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.3.17	1,014,876.85	132,158.52
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.3.18	-	-
减：二、费用		918,121.35	665,855.50
1. 管理人报酬	6.4.6.2.1	372,862.89	184,050.00
2. 托管费	6.4.6.2.2	124,287.62	61,350.01
3. 销售服务费	6.4.6.2.3	2,591.56	4,709.46
4. 交易费用	6.4.3.19	84,356.75	29,559.99
5. 利息支出		218,197.36	298,292.80
其中：卖出回购金融资产支出		218,197.36	298,292.80
6. 税金及附加		9,490.13	6,150.19
7. 其他费用	6.4.3.20	106,335.04	81,743.05
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		2,056,821.94	2,523,253.76
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		2,056,821.94	2,523,253.76

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：大成景盛一年定期开放债券型证券投资基金

本报告期：2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	111,768,758.32	13,049,493.78	124,818,252.10
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	2,056,821.94	2,056,821.94
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	-	-	-

其中：1. 基金申购款	-	-	-
2. 基金赎回款	-	-	-
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-	-
五、期末所有者权益（基金净值）	111,768,758.32	15,106,315.72	126,875,074.04
项目	上年度可比期间 2020年1月1日至2020年6月30日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	57,716,623.12	2,227,941.99	59,944,565.11
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	2,523,253.76	2,523,253.76
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	-	-	-
其中：1. 基金申购款	-	-	-
2. 基金赎回款	-	-	-
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-	-
五、期末所有者权益（基金净值）	57,716,623.12	4,751,195.75	62,467,818.87

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

周立新

刘亚林

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 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。

6.4.2 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[2012]85号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2015]101号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2016]36号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、

财税[2016]70号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、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》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。资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为，暂适用简易计税方法，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。

对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税，对国债、地方政府债以及金融同业往来利息收入亦免征增值税。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。资管产品管理人运营资管产品转让2017年12月31日前取得的非货物期货，可以选择按照实际买入价计算销售额，或者以2017年最后一个交易日的非货物期货结算价格作为买入价计算销售额。

(2) 对基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股票的股息、红利收入，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。对基金从上市公司取得的股息红利所得，持股期限在1个月以内(含1个月)的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在1个月以上至1年(含1年)的，暂减按50%计入应纳税所得额；持股期限超过1年的，暂免征收个人所得税。对基金持有的上市公司限售股，解禁后取得的股息、红利收入，按照上述规定计算纳税，持股时间自解禁日起计算；解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按50%计入应纳税所得额。上述所得统一适用20%的税率计征个人所得税。

(4) 基金卖出股票按0.1%的税率缴纳股票交易印花税，买入股票不征收股票交易印花税。

(5) 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。

6.4.3 重要财务报表项目的说明

6.4.3.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2021年6月30日
----	-------------------

活期存款	4,992,509.88
定期存款	-
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	-
合计	4,992,509.88

6.4.3.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 6 月 30 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	16,222,165.40	17,885,295.36	1,663,129.96
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	85,060,565.17	84,554,084.60
	银行间市场	32,109,680.97	32,303,000.00
	合计	117,170,246.14	116,857,084.60
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	133,392,411.54	134,742,379.96	1,349,968.42

6.4.3.3 衍生金融资产/负债

无。

6.4.3.4 买入返售金融资产

6.4.3.4.1 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 2021 年 6 月 30 日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	4,300,000.00	-
银行间市场	-	-
合计	4,300,000.00	-

6.4.3.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

无。

6.4.3.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2021年6月30日
应收活期存款利息	249.54
应收定期存款利息	-
应收其他存款利息	-
应收结算备付金利息	1,023.60
应收债券利息	1,970,327.37
应收资产支持证券利息	-
应收买入返售证券利息	-
应收申购款利息	-
应收黄金合约拆借孳息	-
应收出借证券利息	-
其他	4.59
合计	1,971,605.10

6.4.3.6 其他资产

无。

6.4.3.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2021年6月30日
交易所市场应付交易费用	28,089.55
银行间市场应付交易费用	600.56
合计	28,690.11

6.4.3.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2021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	-
预提费用	93,302.56
合计	93,302.56

6.4.3.9 实收基金

金额单位：人民币元

大成景盛一年定期债券 A

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额

上年度末	110,583,001.77	110,583,001.77
本期申购	-	-
本期赎回(以“-”号填列)	-	-
-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	110,583,001.77	110,583,001.77

大成景盛一年定期债券 C

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月30日	
	基金份额(份)	账面金额
上年度末	1,185,756.55	1,185,756.55
本期申购	-	-
本期赎回(以“-”号填列)	-	-
-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	1,185,756.55	1,185,756.55

注：1. 申购含红利再投份额(如有)、转换入份额(如有)；赎回含转换出份额(如有)。

2. 根据《大成景盛一年定期开放债券型证券投资基金招募说明书》和《大成景盛一年定期开放债券型证券投资基金基金合同》的相关规定，本基金以一年为一个运作周期，每个运作周期为自基金合同生效日(包括基金合同生效日)或每个开放期结束之日次日起(包括该日)至一年后的年度对日(如该日为非工作日，则顺延至下一工作日)的前一日止。在每个运作周期结束后进入开放期。基金每个开放期为5到20个工作日，每个开放期结束之日的次日起进入下一运作周期。

6.4.3.10 未分配利润

单位：人民币元

大成景盛一年定期债券 A

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	14,905,411.70	-1,972,730.85	12,932,680.85
本期利润	1,033,646.64	1,004,306.99	2,037,953.63
本期基金份额交易产生的变动数	-	-	-
其中：基金申购款	-	-	-
基金赎回款	-	-	-
本期已分配利润	-	-	-
本期末	15,939,058.34	-968,423.86	14,970,634.48

大成景盛一年定期债券 C

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
----	-------	-------	---------

上年度末	137,872.17	-21,059.24	116,812.93
本期利润	8,298.45	10,569.86	18,868.31
本期基金份额交易产生的变动数	-	-	-
其中：基金申购款	-	-	-
基金赎回款	-	-	-
本期已分配利润	-	-	-
本期末	146,170.62	-10,489.38	135,681.24

6.4.3.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期	
	2021年1月1日至2021年6月30日	
活期存款利息收入		2,381.95
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		18,587.69
其他		82.08
合计		21,051.72

6.4.3.12 股票投资收益

单位：人民币元

项目	本期	
	2021年1月1日至2021年6月30日	
卖出股票成交总额		26,889,119.54
减：卖出股票成本总额		27,726,010.20
买卖股票差价收入		-836,890.66

6.4.3.13 债券投资收益

单位：人民币元

项目	本期	
	2021年1月1日至2021年6月30日	
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额		71,901,613.17
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额		69,242,242.69
减：应收利息总额		2,770,908.03
买卖债券差价收入		-111,537.55

6.4.3.14 贵金属投资收益

无。

6.4.3.15 衍生工具收益

无。

6.4.3.16 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月30日
股票投资产生的股利收益	122,224.95
其中：证券出借权益补偿收入	-
基金投资产生的股利收益	-
合计	122,224.95

6.4.3.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2021年1月1日至2021年6月30日
1. 交易性金融资产	1,014,876.85
股票投资	491,568.87
债券投资	523,307.98
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	1,014,876.85

6.4.3.18 其他收入

无。

6.4.3.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月30日
交易所市场交易费用	82,951.75
银行间市场交易费用	1,405.00
合计	84,356.75

6.4.3.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月30日
审计费用	24,795.19
信息披露费	59,507.37

证券出借违约金	-
银行划款手续费	3,432.48
账户维护费	18,000.00
其他	600.00
合计	106,335.04

6.4.3.21 分部报告

无。

6.4.4 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.4.1 或有事项

无。

6.4.4.2 资产负债表日后事项

无。

6.4.5 关联方关系

6.4.5.1 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其他重大利害关系的关联方未发生变化。

6.4.5.2 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、基金销售机构、注册登记机构
中国银行股份有限公司(“中国银行”)	基金托管人、基金销售机构
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。

6.4.6 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.6.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.6.1.1 股票交易

无。

6.4.6.1.2 债券交易

无。

6.4.6.1.3 债券回购交易

无。

6.4.6.1.4 权证交易

无。

6.4.6.1.5 应支付关联方的佣金

无。

6.4.6.2 关联方报酬

6.4.6.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2021年1月1日至2021年6月30日	2020年1月1日至2020年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	372,862.89	184,050.00
其中：支付销售机构的客户维护费	20,520.81	30,332.48

注：支付基金管理人大成基金的管理人报酬按前一日基金资产净值 0.60%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日管理人报酬 = 前一日基金资产净值 × 0.60% / 当年天数。

6.4.6.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2021年1月1日至2021年6月30日	2020年1月1日至2020年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	124,287.62	61,350.01

注：支付基金托管人中国银行的托管费按前一日基金资产净值 0.20%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日托管费 = 前一日基金资产净值 × 0.20% / 当年天数。

6.4.6.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期		
	2021年1月1日至2021年6月30日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	大成景盛一年定期债券	大成景盛一年定期债券	合计

	A	C	
大成基金	-	102.83	102.83
中国银行	-	771.56	771.56
合计	-	874.39	874.39
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	大成景盛一年定期债券 A	大成景盛一年定期债券 C	合计
大成基金	-	99.19	99.19
中国银行	-	803.80	803.80
合计	-	902.99	902.99

注：支付基金销售机构的销售服务费按前一日 C 类基金份额基金资产净值 0.40% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付给大成基金，再由大成基金计算并支付给各基金销售机构。其计算公式为：日销售服务费 = 前一日 C 类基金资产净值 × 0.40% / 当年天数。

6.4.6.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

无。

6.4.6.4 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

无。

6.4.6.5 各关联方投资本基金的情况

6.4.6.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

份额单位：份

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
		大成景盛一年定期债券 A
基金合同生效日（2016 年 11 月 8 日）持有的基金份额	0.00	-
报告期初持有的基金份额	17,997,660.19	-
报告期间申购/买入总份额	0.00	-
报告期间因拆分变动份额	0.00	-

减：报告期间赎回/卖出总份额	0.00	-
报告期末持有的基金份额	17,997,660.19	-
报告期末持有的基金份额 占基金总份额比例	16.10%	-
项目	上年度可比期间 2020年1月1日至2020年6 月30日	上年度可比期间 2020年1月1日至2020年6 月30日
	大成景盛一年定期债券 A	大成景盛一年定期债券 C
基金合同生效日（2016年11月8日）持有的基金份额	-	-
报告期初持有的基金份额	-	-
报告期间申购/买入总份额	-	-
报告期间因拆分变动份额	-	-
减：报告期间赎回/卖出总份额	-	-
报告期末持有的基金份额	-	-
报告期末持有的基金份额 占基金总份额比例	-	-

注：基金管理人大成基金投资本基金适用的交易费率与本基金法律文件规定一致。

6.4.6.5.2 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

无。

6.4.6.6 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 2021年1月1日至2021年6月30日		上年度可比期间 2020年1月1日至2020年6月30日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国银行	4,992,509.88	2,381.95	848,388.00	3,963.36

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。

6.4.6.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

无。

6.4.6.8 其他关联交易事项的说明

无。

6.4.7 利润分配情况

无。

6.4.8 期末(2021年6月30日)本基金持有的流通受限证券

6.4.8.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

6.4.8.1.2 受限证券类别：债券										
证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量(单位:张)	期末成本总额	期末估值总额	备注
113049	长汽转债	2021年6月10日	2021年07月08日	新债未上市	100.00	100.00	20	2,000.00	2,000.00	-
113050	南银转债	2021年6月16日	2021年7月1日	新债未上市	100.00	100.00	350	35,000.00	35,000.00	-
127038	国微转债	2021年6月10日	2021年07月14日	新债未上市	100.00	100.00	25	2,500.00	2,500.00	-

6.4.8.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

无。

6.4.8.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.8.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末，本基金从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额 17,039,774.44 元，是以如下债券作为抵押：

金额单位：人民币元

债券代码	债券名称	回购到期日	期末估值单价	数量(张)	期末估值总额
1680335	16 晋江城投债	2021年7月6日	60.35	100,000	6,035,000.00
1980010	19 新兴绿色债 01	2021年7月6日	101.09	100,000	10,109,000.00
210205	21 国开 05	2021年7月6日	101.25	32,000	3,240,000.00
合计				232,000	19,384,000.00

6.4.8.3.2 交易所市场债券正回购

无。

6.4.8.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

无。

6.4.9 金融工具风险及管理

6.4.9.1 风险管理政策和组织架构

本基金为债券型证券投资基金，属于较低风险品种。本基金投资的金融工具主要为债券投资等。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争取将以上风险控制在限定的范围之内，使本基金在风险和收益之间取得最佳的平衡以实现“风险收益水平高于货币市场基金而低于混合基金和股票基金，谋求稳定和可持续的绝对收益”的风险收益目标。

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。

6.4.9.2 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行中国银行，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，且通过分散化投资以分散信用风险。

本基金债券投资的信用评级情况按《中国人民银行信用评级管理指导意见》设定的标准统计及汇总。

6.4.9.2.1 按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2021年6月30日	上年度末 2020年12月31日
AAA	100,563,000.00	105,417,600.00
AAA 以下	6,169,084.60	7,902,583.64
未评级	10,125,000.00	19,726,000.00
合计	116,857,084.60	133,046,183.64

注：未评级债券为政策性金融债。

6.4.9.3 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。

6.4.9.3.1 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。

于本期末[期末不在开放期，7 日可变现资产不受限]，本基金持有的流动性受限资产的估值占基

金资产净值的比例未超过 15%。

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同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。

6.4.9.4 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。

6.4.9.4.1 利率风险

利率风险是指金融工具的公允价值或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。

6.4.9.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2021 年 6 月 30 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	4,992,509.88	-	-	-	4,992,509.88
结算备付金	2,511,330.10	-	-	-	2,511,330.10
存出保证金	11,415.35	-	-	-	11,415.35
交易性金融资产	7,131,500.00	99,082,240.00	10,643,344.60	17,885,295.36	134,742,379.96
买入返售金融资产	4,300,000.00	-	-	-	4,300,000.00
应收利息	-	-	-	1,971,605.10	1,971,605.10
应收证券清算款	-	-	-	354,877.83	354,877.83
资产总计	18,946,755.33	99,082,240.00	10,643,344.60	20,211,778.29	148,884,118.22
负债					
应付管理人报酬	-	-	-	62,060.29	62,060.29
应付托管费	-	-	-	20,686.76	20,686.76

应付证券清算款	-	-	-	4,747,217.37	4,747,217.37
卖出回购金融资产款	17,039,774.44	-	-	-	17,039,774.44
应付销售服务费	-	-	-	431.00	431.00
应付交易费用	-	-	-	28,690.11	28,690.11
应付利息	-	-	-	2,632.12	2,632.12
应交税费	-	-	-	14,249.53	14,249.53
其他负债	-	-	-	93,302.56	93,302.56
负债总计	17,039,774.44	-	-	4,969,269.74	22,009,044.18
利率敏感度缺口	1,906,980.89	99,082,240.00	10,643,344.60	15,242,508.55	126,875,074.04
上年度末 2020 年 12 月 31 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	1,385,772.22	-	-	-	1,385,772.22
结算备付金	1,949,063.27	-	-	-	1,949,063.27
存出保证金	2,644.39	-	-	-	2,644.39
交易性金融资产	2,015,000.00	109,654,175.70	21,377,007.94	14,035,774.60	147,081,958.24
应收利息	-	-	-	2,727,964.73	2,727,964.73
资产总计	5,352,479.88	109,654,175.70	21,377,007.94	16,763,739.33	153,147,402.85
负债					
应付管理人报酬	-	-	-	52,197.22	52,197.22
应付托管费	-	-	-	17,399.07	17,399.07
应付证券清算款	-	-	-	906,010.16	906,010.16
卖出回购金融资产款	27,200,000.00	-	-	-	27,200,000.00
应付销售服务费	-	-	-	539.93	539.93
应付交易费用	-	-	-	15,139.05	15,139.05
应付利息	-	-	-	-45.47	-45.47
应交税费	-	-	-	8,910.79	8,910.79
其他负债	-	-	-	129,000.00	129,000.00
负债总计	27,200,000.00	-	-	1,129,150.75	28,329,150.75
利率敏感度缺口	-21,847,520.12	109,654,175.70	21,377,007.94	15,634,588.58	124,818,252.10

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

6.4.9.4.1.2 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		
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（2021 年 6 月 30 日）	上年度末（2020 年 12 月 31 日）	
分析	市场利率下降 25 个基点	512,344.32	760,029.20
	市场利率上升 25 个基点	-505,521.06	-749,075.25

6.4.9.4.2 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。

6.4.9.4.3 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股票和债券，所面临的其他价格风险来源于单个证券发行主体自身经营情况或特殊事项的影响，也可能来源于证券市场整体波动的影响。

本基金在封闭期内运用自上而下的宏观分析和自下而上的市场分析相结合的方法实现大类资产配置，把握不同的经济发展阶段各类资产的投资机会，根据宏观经济、基准利率水平等因素，预测债券类、货币类等大类资产的预期收益率水平，结合各类别资产的波动性以及流动性状况分析，进行大类资产配置。开放运作期内，本基金将保持较高的组合流动性，方便投资人安排投资。

本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险。本基金投资于债券资产比例不低于基金资产的 80%，权益类资产投资比例不高于基金资产的 20%，权证投资比例不高于基金资产净值的 3%。本基金开放期开始前一个月、开放期以及开放期结束后的一个月内，本基金投资比例可不受上述限制。在开放期内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，本基金持有的现金（不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等）或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%，在非开放期，本基金不受上述 5% 的限制；本基金在封闭运作周期内在扣除国债期货合约需缴纳的交易保证金后，应保持不低于交易保证金一倍的现金（不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等）。此外，本基金的基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控，定期运用多种定量方法对基金进行风险度量，包括 VaR(Value at Risk) 指标等来测试本基金面临的潜在价格风险，及时可靠地对风险进行跟踪和控制。

6.4.9.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 6 月 30 日		上年度末 2020 年 12 月 31 日	
	公允价值	占基金资产 净值比例 (%)	公允价值	占基金资产 净值比例 (%)
交易性金融资产—股票投资	17,885,295.36	14.10	14,035,774.60	11.24
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-

交易性金融资产—贵金属投资	-	-	-	-
衍生金融资产—权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	17,885,295.36	14.10	14,035,774.60	11.24

6.4.9.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

于本期末，本基金持有的交易性权益类投资公允价值占基金资产净值的比例为 14.10% (上年度末：11.24%)，因此除市场利率以外的市场价格因素的变动对于本基金资产净值无重大影响 (上年度末：同)。

6.4.10 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

无。

§ 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	17,885,295.36	12.01
	其中：股票	17,885,295.36	12.01
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	116,857,084.60	78.49
	其中：债券	116,857,084.60	78.49
	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	4,300,000.00	2.89
	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	7,503,839.98	5.04
8	其他各项资产	2,337,898.28	1.57
9	合计	148,884,118.22	100.00

7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

金额单位：人民币元

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	719,361.00	0.57
C	制造业	13,324,578.04	10.50
D	电力、热力、燃气及水生产和	608,084.32	0.48

	供应业		
E	建筑业	625,464.00	0.49
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	135,160.00	0.11
J	金融业	857,791.00	0.68
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	1,215,432.00	0.96
Q	卫生和社会工作	399,425.00	0.31
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	17,885,295.36	14.10

7.2.2 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

金额单位：人民币元

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	601877	正泰电器	36,500	1,218,370.00	0.96
2	605098	行动教育	21,600	1,215,432.00	0.96
3	603187	海容冷链	19,040	816,435.20	0.64
4	603486	科沃斯	3,000	684,240.00	0.54
5	002824	和胜股份	19,200	676,992.00	0.53
6	002415	海康威视	10,300	664,350.00	0.52
7	601899	紫金矿业	66,900	648,261.00	0.51
8	601117	中国化学	71,400	625,464.00	0.49
9	601636	旗滨集团	33,300	618,048.00	0.49
10	601633	长城汽车	14,100	614,619.00	0.48
11	600483	福能股份	57,968	608,084.32	0.48
12	002791	坚朗五金	3,100	601,555.00	0.47
13	300871	回盛生物	15,300	596,700.00	0.47
14	300888	稳健医疗	4,500	556,290.00	0.44
15	300979	华利集团	3,900	444,210.00	0.35

16	300395	菲利华	8,500	409,870.00	0.32
17	603882	金域医学	2,500	399,425.00	0.31
18	603659	璞泰来	2,500	341,500.00	0.27
19	002614	奥佳华	14,500	328,135.00	0.26
20	600038	中直股份	6,000	316,440.00	0.25
21	000301	东方盛虹	15,000	313,500.00	0.25
22	600919	江苏银行	44,000	312,400.00	0.25
23	600036	招商银行	5,400	292,626.00	0.23
24	300363	博腾股份	3,400	286,008.00	0.23
25	601166	兴业银行	12,300	252,765.00	0.20
26	600104	上汽集团	11,000	241,670.00	0.19
27	688036	传音控股	1,118	234,221.00	0.18
28	002353	杰瑞股份	5,200	232,440.00	0.18
29	002340	格林美	24,200	226,270.00	0.18
30	002835	同为股份	17,500	219,275.00	0.17
31	688598	金博股份	748	201,212.00	0.16
32	300316	晶盛机电	3,800	191,900.00	0.15
33	002612	朗姿股份	3,500	189,070.00	0.15
34	688363	华熙生物	564	156,713.04	0.12
35	002049	紫光国微	1,000	154,190.00	0.12
36	600196	复星医药	2,000	144,260.00	0.11
37	600703	三安光电	4,500	144,225.00	0.11
38	000625	长安汽车	5,300	139,284.00	0.11
39	002709	天赐材料	1,300	138,554.00	0.11
40	002230	科大讯飞	2,000	135,160.00	0.11
41	002884	凌霄泵业	5,720	133,218.80	0.10
42	002262	恩华药业	8,300	127,405.00	0.10
43	300857	协创数据	4,500	125,640.00	0.10
44	002242	九阳股份	3,800	123,462.00	0.10
45	300724	捷佳伟创	1,000	116,010.00	0.09
46	300747	锐科激光	1,000	114,060.00	0.09
47	300750	宁德时代	200	106,960.00	0.08
48	300122	智飞生物	500	93,365.00	0.07
49	601225	陕西煤业	6,000	71,100.00	0.06
50	002643	万润股份	3,800	67,564.00	0.05
51	003021	兆威机电	1,000	61,080.00	0.05
52	002372	伟星新材	2,700	55,809.00	0.04
53	000902	新洋丰	2,700	42,201.00	0.03
54	600741	华域汽车	1,600	42,032.00	0.03
55	003016	欣贺股份	900	14,409.00	0.01
56	002311	海大集团	10	816.00	0.00

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	600483	福能股份	1,103,415.67	0.88
2	605098	行动教育	983,272.00	0.79
3	300837	浙矿股份	818,234.00	0.66
4	300871	回盛生物	788,594.00	0.63
5	300888	稳健医疗	788,458.00	0.63
6	688018	乐鑫科技	746,936.04	0.60
7	603187	海容冷链	738,226.80	0.59
8	002791	坚朗五金	719,406.38	0.58
9	601899	紫金矿业	708,924.00	0.57
10	002824	和胜股份	703,168.00	0.56
11	601877	正泰电器	642,109.00	0.51
12	600176	中国巨石	603,326.00	0.48
13	601633	长城汽车	597,249.00	0.48
14	603039	泛微网络	571,576.32	0.46
15	600600	青岛啤酒	554,470.00	0.44
16	601636	旗滨集团	542,890.00	0.43
17	601117	中国化学	541,754.23	0.43
18	002835	同为股份	511,286.00	0.41
19	603136	天目湖	505,276.23	0.40
20	601166	兴业银行	504,193.00	0.40

注：本期累计买入金额按买入成交金额（成交单价乘以成交数量），不考虑相关交易费用。

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	300747	锐科激光	1,187,086.00	0.95
2	688018	乐鑫科技	850,319.58	0.68
3	300837	浙矿股份	774,086.00	0.62
4	600600	青岛啤酒	669,232.00	0.54
5	601877	正泰电器	635,963.00	0.51
6	603708	家家悦	611,981.00	0.49
7	600029	南方航空	605,895.00	0.49
8	600660	福耀玻璃	572,914.80	0.46
9	603039	泛微网络	555,378.10	0.44
10	601899	紫金矿业	541,113.00	0.43
11	600483	福能股份	483,020.04	0.39
12	600176	中国巨石	471,582.92	0.38
13	603136	天目湖	466,210.37	0.37

14	002916	深南电路	458,058.90	0.37
15	603596	伯特利	428,873.00	0.34
16	002352	顺丰控股	426,512.00	0.34
17	002709	天赐材料	417,713.00	0.33
18	600031	三一重工	405,024.00	0.32
19	603218	日月股份	392,567.60	0.31
20	600741	华域汽车	385,937.00	0.31

注：本期累计卖出金额指卖出成交金额（成交单价乘以成交数量），不考虑相关交易费用。

7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	31,083,962.09
卖出股票收入（成交）总额	26,889,119.54

注：上述金额均指成交金额（成交单价乘以成交数量），不考虑相关交易费用。

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	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	10,125,000.00	7.98
	其中：政策性金融债	10,125,000.00	7.98
4	企业债券	106,074,400.00	83.61
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	657,684.60	0.52
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	116,857,084.60	92.10

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	122179	12 科环 03	100,000	10,223,000.00	8.06
2	210205	21 国开 05	100,000	10,125,000.00	7.98
3	1980010	19 新兴绿色 债 01	100,000	10,109,000.00	7.97
4	143195	18 格地 02	100,000	9,973,000.00	7.86
5	127488	PR 惠通投	100,000	6,135,000.00	4.84

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

为有效控制债券投资的系统性风险，本基金根据风险管理的原则，以套期保值为目的，适度运用国债期货，提高投资组合的运作效率。

在国债期货投资时，本基金将首先分析国债期货各合约价格与最便宜可交割券的关系，选择定价合理的国债期货合约，其次，考虑国债期货各合约的流动性情况，最终确定与现货组合的合适匹配，以达到风险管理的目标。

7.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

无。

7.10.3 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之一 21 国开 05（210205.IB）的发行主体国家开发银行于 2020 年 12 月 25 日因为违规的政府购买服务项目提供融资等，受到中国银行保险监督管理委员会处罚（银保监罚决字（2020）67 号）。本基金认为，对国家开发银行的处罚不会对其投资价值构成实质性负面影响。

7.11.2 基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库

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	11,415.35
2	应收证券清算款	354,877.83
3	应收股利	-
4	应收利息	1,971,605.10

5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	2,337,898.28

7.11.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
1	113040	星宇转债	478,844.60	0.38
2	128046	利尔转债	139,340.00	0.11

7.11.5 期末前十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

份额级别	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 (%)
大成景盛一年定期债券 A	313	353,300.33	97,513,102.78	88.18	13,069,898.99	11.82
大成景盛一年定期债券 C	64	18,527.45	-	-	1,185,756.55	100.00
合计	377	296,468.85	97,513,102.78	87.25	14,255,655.54	12.75

注：1、上述机构/个人投资者持有份额占总份额比例的计算中，对分级份额，比例的分母采用各自级别的份额，对合计数，比例的分母采用下属分级基金份额的合计数（即期末基金份额总额）。

2、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

项目	份额级别	持有份额总数（份）	占基金总份额比例（%）
基金管理人所有从业人员持有本基金	大成景盛一年定期债券 A	27,151.31	0.0246
	大成景盛一年定期债券 C	1.00	0.0001
	合计	27,152.31	0.0243

注：上述占基金总份额比例的计算中，对分级份额，比例的分母采用各自级别的份额，对合计数，比例的分母采用下属分级基金份额的合计数（即期末基金份额总额）。

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	份额级别	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和部门负责人持有本开放式基金	大成景盛一年定期债券 A	0
	大成景盛一年定期债券 C	0
	合计	0
本基金基金经理持有本开放式基金	大成景盛一年定期债券 A	0
	大成景盛一年定期债券 C	0
	合计	0

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	大成景盛一年定期债券 A	大成景盛一年定期债券 C
基金合同生效日（2016 年 11 月 8 日）基金份额总额	1,142,922,739.82	54,996,565.51
本报告期期初基金份额总额	110,583,001.77	1,185,756.55
本报告期基金总申购份额	-	-
减：本报告期基金总赎回份额	-	-
本报告期基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-	-
本报告期期末基金份额总额	110,583,001.77	1,185,756.55

§ 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**

基金管理人报告期内无重大人事变动。

二、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本报告期内，无涉及本基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

无。

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

本基金聘任的为本基金审计的会计师事务所为普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)，该事务所自基金合同生效日起为本基金提供审计服务至今。

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，基金管理人、托管人的托管业务部门及其相关高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况**10.7.1 基金租用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	2	32,236,305.22	57.72%	29,378.15	57.72%	-
招商证券	3	22,005,881.04	39.40%	20,054.21	39.40%	-
国泰君安	1	1,369,955.00	2.45%	1,248.65	2.45%	-
东莞证券	1	234,861.00	0.42%	214.00	0.42%	-
安信证券	2	-	-	-	-	-
渤海证券	1	-	-	-	-	-
财信证券	1	-	-	-	-	-
长城证券	1	-	-	-	-	-

东方证券	1	-	-	-	-	-
东海证券	1	-	-	-	-	-
东吴证券	1	-	-	-	-	-
东兴证券	1	-	-	-	-	-
方正证券	1	-	-	-	-	-
光大证券	2	-	-	-	-	-
广发证券	1	-	-	-	-	-
广州证券	1	-	-	-	-	-
国都证券	1	-	-	-	-	-
国海证券	1	-	-	-	-	-
国信证券	1	-	-	-	-	-
海通证券	2	-	-	-	-	-
恒泰证券	1	-	-	-	-	-
华宝证券	1	-	-	-	-	-
华福证券	1	-	-	-	-	-
华林证券	1	-	-	-	-	-
华泰证券	2	-	-	-	-	-
华西证券	1	-	-	-	-	-
华鑫证券	1	-	-	-	-	-
江海证券	1	-	-	-	-	-
开源证券	1	-	-	-	-	-
民生证券	1	-	-	-	-	-
摩根大通	1	-	-	-	-	-
平安证券	1	-	-	-	-	-
申万宏源	1	-	-	-	-	-
太平洋证券	1	-	-	-	-	-
万联证券	1	-	-	-	-	-
西南证券	1	-	-	-	-	-
湘财证券	1	-	-	-	-	-

中国银河证 券	1	-	-	-	-	-
中金财富	2	-	-	-	-	-
中金公司	2	-	-	-	-	-
中信建投证 券	1	-	-	-	-	-
中信证券	2	-	-	-	-	-

注：1、根据中国证监会颁布的《关于完善证券投资基金交易席位制度有关问题的通知》（证监基金字[2007]48号）的有关规定，本公司制定了租用证券公司交易单元的选择标准和程序。

租用证券公司交易单元的选择标准主要包括：

- （一）财务状况良好，最近一年无重大违规行为；
- （二）经营行为规范，内控制度健全，能满足各投资组合运作的保密性要求；
- （三）研究实力较强，能提供包括研究报告、路演服务、协助进行上市公司调研等研究服务；
- （四）具备各投资组合运作所需的高效、安全的通讯条件，有足够的交易和清算能力，满足各投资组合证券交易需要；
- （五）能提供投资组合运作、管理所需的其他券商服务；
- （六）相关基金合同、资产管理合同以及法律法规规定的其他条件。

租用证券公司交易单元的程序：首先根据租用证券公司交易单元的选择标准形成《券商服务评价表》，然后根据评分高低进行选择基金交易单元。

2、本报告期内本基金租用证券公司交易单元的变更情况如下：

本报告期内本基金退出交易单元：摩根大通；

本报告期内本基金新增交易单元：中泰证券。

10.7.2 基金租用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	
	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
长江证券	13,666,140.80	73.14%	2,083,700,000.00	100.00%	-	-
招商证券	5,017,909.69	26.86%	-	-	-	-

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	关于提请投资者及时更新已过期身份证件或者身份证明文件的公告	中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站	2021 年 6 月 30 日
2	大成景盛一年定期开放债券型证券投资基金 2021 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	2021 年 4 月 22 日
3	大成景盛一年定期开放债券型证券投资基金 2020 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	2021 年 3 月 30 日
4	大成基金管理有限公司关于旗下部分基金增加中国中金财富证券有限公司为销售机构的公告	中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站	2021 年 3 月 25 日
5	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	2021 年 3 月 23 日
6	大成景盛一年定期开放债券型证券投资基金第四季度报告	中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站	2021 年 1 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

投资者类别	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 (%)
机构	1	20210101-20210630	25,281,019.06	-	-	25,281,019.06	22.62

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。

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景盛一年定期开放债券型证券投资基金的文件；
- 2、《大成景盛一年定期开放债券型证券投资基金基金合同》；
- 3、《大成景盛一年定期开放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。

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

2021 年 8 月 31 日