

大成景润灵活配置混合型证券投资基金 2022 年第 3 季度报告

2022 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：中国银行股份有限公司

报告送出日期：2022 年 10 月 26 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。

基金托管人中国银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2022 年 10 月 25 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 2022 年 07 月 01 日起至 09 月 30 日止。

§ 2 基金产品概况

| | |
|------------|--|
| 基金简称 | 大成景润灵活配置混合 |
| 基金主代码 | 001364 |
| 基金运作方式 | 契约型开放式 |
| 基金合同生效日 | 2017 年 1 月 25 日 |
| 报告期末基金份额总额 | 148,929,254.15 份 |
| 投资目标 | 在严格控制风险的前提下，追求基金资产稳定增值。 |
| 投资策略 | 本基金将有采用“自上而下”的资产配置策略，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，通过动态调整资产配置比例以控制基金资产整体风险。在个券投资方面采用“自下而上”精选策略，通过严谨个股选择、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 | 三年期定期存款税后利率+2% |
| 风险收益特征 | 本基金为混合型基金，基金的风险与预期收益高于债券型基金和货币市场基金低于股票型基金，属于证券投资基金中的中高风险投资品种。 |
| 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 |

§ 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（2022 年 7 月 1 日-2022 年 9 月 30 日） |
|--------|-------------------------------------|

| | |
|-----------------|----------------|
| 1. 本期已实现收益 | -1,134,245.57 |
| 2. 本期利润 | -4,145,495.72 |
| 3. 加权平均基金份额本期利润 | -0.0229 |
| 4. 期末基金资产净值 | 152,429,023.23 |
| 5. 期末基金份额净值 | 1.023 |

注：1、所述基金业绩指标不包括持有人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。

2、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。

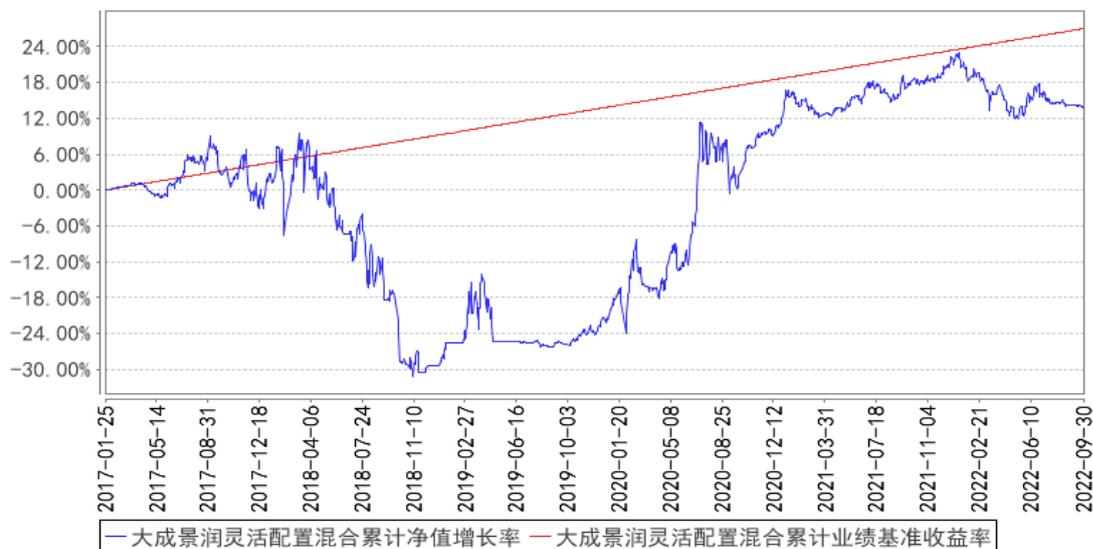
3.2 基金净值表现

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 | -2.13% | 0.21% | 0.95% | 0.01% | -3.08% | 0.20% |
| 过去六个月 | -2.22% | 0.43% | 1.91% | 0.01% | -4.13% | 0.42% |
| 过去一年 | -3.71% | 0.43% | 3.89% | 0.01% | -7.60% | 0.42% |
| 过去三年 | 53.26% | 0.82% | 12.64% | 0.01% | 40.62% | 0.81% |
| 过去五年 | 10.95% | 1.12% | 23.00% | 0.01% | -12.05% | 1.11% |
| 自基金合同 生效起至今 | 13.72% | 1.06% | 26.99% | 0.01% | -13.27% | 1.05% |

3.2.2 自基金合同生效以来基金累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

大成景润灵活配置混合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规定。

§ 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 | | |
| 黄万青 | 本基金基金经理 | 2017年1月25日 | - | 26年 | 中国人民大学经济学硕士。曾任职于大鹏证券有限责任公司。1999年5月加入大成基金管理有限公司，曾担任研究部研究员、固定收益部高级研究员。2010年4月7日至2013年3月7日任景宏证券投资基金基金经理。2011年7月13日至2013年3月7日任大成行业轮动股票型证券投资基金基金经理。2011年3月8日至2011年6月5日任大成积极成长股票型证券投资基金基金经理。2011年3月8日至2011年6月5日任大成策略回报股票型证券投资基金基金经理。2015年4月28日至2019年6月15日任大成景秀灵活配置混合型证券投资基金基金经理。2015年11月30日至2017年3月18日任大成景辉灵活配置混合型证券投资基金基金经理。2016年5月25日至2020年12月4日任大成景荣债券型证券投资基金(原大成景荣保本混合型证券投资 |

| | | | | |
|-----|---------|-----------------|---|---|
| | | | | <p>资基金转型) 基金经理。2016 年 8 月 6 日至 2018 年 12 月 8 日任大成景源灵活配置混合型证券投资基金基金经理。2016 年 9 月 20 日至 2018 年 10 月 20 日任大成景穗灵活配置混合型证券投资基金基金经理。2016 年 9 月 29 日至 2018 年 11 月 19 日任大成景禄灵活配置混合型证券投资基金基金经理。2017 年 1 月 25 日起任大成景润灵活配置混合型证券投资基金基金经理。2017 年 3 月 18 日至 2018 年 11 月 9 日任大成景鹏灵活配置混合型证券投资基金基金经理。2019 年 6 月 21 日至 2020 年 5 月 21 日任大成景益平稳收益混合型证券投资基金基金经理。2019 年 6 月 21 日起任大成景禄灵活配置混合型证券投资基金基金经理。2019 年 7 月 18 日至 2020 年 9 月 18 日任大成惠福纯债债券型证券投资基金基金经理。2020 年 4 月 30 日起任大成趋势回报灵活配置混合型证券投资基金基金经理。2020 年 12 月 4 日至 2022 年 10 月 17 日任大成动态量化配置策略混合型证券投资基金基金经理。具有基金从业资格。国籍：中国</p> |
| 李富强 | 本基金基金经理 | 2019 年 6 月 12 日 | - | <p>8 年</p> <p>北京大学经济学硕士。2009 年 7 月至 2013 年 12 月任中国银行间市场交易商协会市场创新部高级助理。2014 年 1 月至 2017 年 7 月任北信瑞丰基金管理有限公司固定收益部基金经理。2017 年 7 月加入大成基金管理有限公司, 任职于固定收益总部。2018 年 7 月 16 日至 2019 年 3 月 9 日任大成强化收益定期开放债券型证券投资基金基金经理。2018 年 7 月 16 日至 2019 年 3 月 2 日任大成景利混合型证券投资基金基金经理。2018 年 7 月 16 日至 2020 年 3 月 11 日任大成景益平稳收益混合型证券投资基金基金经理。2018 年 7 月 16 日至 2019 年 9 月 29 日任大成景丰债券型证券投资基金 (LOF) 基金经理。2018 年 7 月 16 日至 2020 年 8 月 12 日任大成安汇金融债债券型证券投资基金 (转型前大成月月盈短期理财债券型证券投资基金)。2018 年 7 月 16 日起任大成可转债增强债券型证券投资基金基金经理。2018 年 7 月 16 日至 2020 年 12 月 18 日任大成景盛一年定期开放债券型证券投资</p> |

| | | | | | |
|--|--|--|--|--|---|
| | | | | | <p>资基金基金经理。2018 年 11 月 16 日起任大成景禄灵活配置混合型证券投资基金基金经理。2019 年 6 月 12 日起任大成景润灵活配置混合型证券投资基金基金经理。2019 年 9 月 26 日至 2020 年 11 月 3 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。2019 年 11 月 25 日起任大成通嘉三年定期开放债券型证券投资基金基金经理。2019 年 12 月 9 日起任大成惠嘉一年定期开放债券型证券投资基金基金经理。2020 年 6 月 22 日起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。2020 年 10 月 29 日起任大成趋势回报灵活配置混合型证券投资基金基金经理。2020 年 12 月 2 日至 2021 年 12 月 7 日任大成景荣债券型证券投资基金基金经理。2020 年 12 月 18 日至 2022 年 10 月 17 日任大成动态量化配置策略混合型证券投资基金基金经理。2021 年 4 月 8 日至 2022 年 5 月 23 日任大成惠恒一年定期开放债券型发起式证券投资基金基金经理。2021 年 4 月 13 日至 2022 年 5 月 23 日任大成惠泽一年定期开放债券型发起式证券投资基金基金经理。具有基金从业资格。国籍：中国</p> |
|--|--|--|--|--|---|

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。

4.1.1 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 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，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，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，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，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，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 1 笔同日反向交易，原因为合规比例调整。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

2022 年第 3 季度 A 股市场震荡下跌，上证指数跌 11.01%，沪深 300 指数跌 15.16%，创业板指跌 18.56%，科创 50 指数跌 15.04%，基本将 4 月份到 6 月份的反弹全部跌回去，成长风格跌幅更大。第 3 季度海内外都是不平静的一个季度，国内先后出现个别城市疫情反复和大部分地区的持续高温，这些都影响了正常的生产和投资者信心，虽然期间央行先后调降 MLF 和 LPR 以及政府出台全国性宽松的地产刺激政策，但经济整体需求相对疲软。海外方面，美国持续加息，美股美债持续下跌，地缘政治冲突加剧等。由于美元的强势导致其它货币的贬值，资金外流的担心对 A 股市场产生不小的冲击。本季度行业表现，只有煤炭小幅上涨，其它行业都是下跌，建筑材料、电力设备、电子、汽车等跌幅都在 17% 以上。

操作上，本基金由于对后面市场判断相对谨慎，在 7 月下旬大幅调降了仓位，适度控制了回撤，在市场没有趋势性的投资机会出现之前，控制仓位是比较好的对策。

债券市场方面，2022 年三季度国内经济增速环比有所企稳，但仍有较大压力。地产刺激政策在不断出台发力，但实际效果仍待观察。疫情的反复仍对消费形成约束。国际上，美国加息步伐有所加快，与此同时受到地缘政治冲突和欧洲能源紧缺影响，欧洲经济增长压力较大，未来国内出口增速预计也将受到一定影响。受美元走强影响，人民币汇率维稳在央行的工作目标中权重边

际增大。三季度央行下调了 OMO 和 MLF 利率，银行间市场资金面仍旧保持宽松，央行的货币政策宽松基调并没有明显改变。具体来看，三季度末相较上季度末，1 年期国开债下行 13bp，3 年期下行 22b，5 年期下行 14bp，7 年期下行 17bp，10 年期下行 12bp。2022 年三季度，严控信用风险，根据市场机会灵活调整基金组合久期，增强组合收益。

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 1.023 元；本报告期基金份额净值增长率为-2.13%，业绩比较基准收益率为 0.95%。

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 | 1,832,759.21 | 1.20 |
| | 其中：股票 | 1,832,759.21 | 1.20 |
| 2 | 基金投资 | - | - |
| 3 | 固定收益投资 | 94,145,220.30 | 61.45 |
| | 其中：债券 | 94,145,220.30 | 61.45 |
| | 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 | 48,961,089.91 | 31.96 |
| | 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 | 8,055,890.60 | 5.26 |
| 8 | 其他资产 | 220,399.85 | 0.14 |
| 9 | 合计 | 153,215,359.87 | 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

| 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 | 1,295,341.68 | 0.85 |
| C | 制造业 | 89,539.65 | 0.06 |
| D | 电力、热力、燃气及水生产和供应 | - | - |

| | | | |
|---|-----------------|--------------|------|
| | 业 | | |
| E | 建筑业 | | - |
| F | 批发和零售业 | | - |
| G | 交通运输、仓储和邮政业 | | - |
| H | 住宿和餐饮业 | | - |
| I | 信息传输、软件和信息技术服务业 | 436,943.84 | 0.29 |
| J | 金融业 | | - |
| K | 房地产业 | | - |
| L | 租赁和商务服务业 | | - |
| M | 科学研究和技术服务业 | | - |
| N | 水利、环境和公共设施管理业 | 10,934.04 | 0.01 |
| O | 居民服务、修理和其他服务业 | | - |
| P | 教育 | | - |
| Q | 卫生和社会工作 | | - |
| R | 文化、体育和娱乐业 | | - |
| S | 综合 | | - |
| | 合计 | 1,832,759.21 | 1.20 |

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

| 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 | 600938 | 中国海油 | 84,004 | 1,295,341.68 | 0.85 |
| 2 | 688052 | 纳芯微 | 1,392 | 403,192.80 | 0.26 |
| 3 | 301268 | 铭利达 | 568 | 25,719.04 | 0.02 |
| 4 | 301162 | 国能日新 | 334 | 22,177.60 | 0.01 |
| 5 | 301216 | 万凯新材 | 546 | 15,380.82 | 0.01 |
| 6 | 301150 | 中一科技 | 215 | 14,108.30 | 0.01 |
| 7 | 301248 | 杰创智能 | 472 | 11,573.44 | 0.01 |
| 8 | 301258 | 富士莱 | 295 | 11,522.70 | 0.01 |
| 9 | 301148 | 嘉戎技术 | 516 | 10,934.04 | 0.01 |
| 10 | 301279 | 金道科技 | 296 | 7,790.72 | 0.01 |

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 | 17,840,943.08 | 11.70 |
| 2 | 央行票据 | - | - |
| 3 | 金融债券 | 62,519,727.67 | 41.02 |

| | | | |
|----|-----------|---------------|-------|
| | 其中：政策性金融债 | 62,519,727.67 | 41.02 |
| 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 | 13,784,549.55 | 9.04 |
| 9 | 其他 | - | - |
| 10 | 合计 | 94,145,220.30 | 61.76 |

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 | 220215 | 22 国开 15 | 200,000 | 20,165,643.84 | 13.23 |
| 2 | 019664 | 21 国债 16 | 174,730 | 17,840,943.08 | 11.70 |
| 3 | 220303 | 22 进出 03 | 160,000 | 16,202,503.01 | 10.63 |
| 4 | 220404 | 22 农发 04 | 160,000 | 16,082,717.81 | 10.55 |
| 5 | 112211080 | 22 平安银行 CD080 | 140,000 | 13,784,549.55 | 9.04 |

5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券投资 明细

无。

5.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

无。

5.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

无。

5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

无。

5.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

无。

5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.10.1 本期国债期货投资政策

无。

5.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

| 代码 | 名称 | 持仓量（买/卖） | 合约市值(元) | 公允价值变动（元） | 风险指标说明 |
|-------------------|----|----------|---------|-----------|-------------|
| - | - | - | - | - | - |
| 公允价值变动总额合计（元） | | | | | - |
| 国债期货投资本期收益（元） | | | | | -165,899.70 |
| 国债期货投资本期公允价值变动（元） | | | | | - |

5.10.3 本期国债期货投资评价

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，适度运用国债期货进行投资，提高投资组合的运作效率。本期本组合结合债市波动环境，通过套保交易降低了由于债市波动造成的净值回撤，提高净值的稳定性。

5.11 投资组合报告附注

5.11.1 本基金投资的前十名证券的发行主体本期是否出现被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形

1、本基金投资的前十名证券之一 22 农发 04（220404.IB）的发行主体中国农业发展银行于 2022 年 3 月 21 日因漏报不良贷款余额 EAST 数据等，受到中国银行保险监督管理委员会处罚（银保监罚决字（2022）10 号）。本基金认为，对中国农业发展银行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之一 20 农发 05（200405.IB）的发行主体中国农业发展银行于 2022 年 3 月 21 日因漏报不良贷款余额 EAST 数据等，受到中国银行保险监督管理委员会处罚（银保监罚决字（2022）10 号）。本基金认为，对中国农业发展银行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之一 22 平安银行 CD080（112211080.IB）的发行主体平安银行股份有限公司于 2022 年 3 月 21 日因不良贷款余额 EAST 数据存在偏差等，受到中国银行保险监督管理委员会处罚（银保监罚决字（2022）24 号）。本基金认为，对平安银行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之一 22 进出 03（220303.IB）的发行主体中国进出口银行于 2022 年 3 月 21 日因漏报不良贷款余额 EAST 数据等，受到中国银行保险监督管理委员会处罚（银保监罚决字（2022）9 号）。本基金认为，对中国进出口银行的处罚不会对其投资价值构成实质性负面

影响。

5、本基金投资的前十名证券之一 22 国开 15（220215.IB）的发行主体国家开发银行于 2022 年 3 月 21 日因未报送逾期 90 天以上贷款余额 EAST 数据等，受到中国银行保险监督管理委员会处罚（银保监罚决字（2022）8 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。

5.11.2 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

基金投资的前十名股票中，没有投资于超出基金合同规定备选股票库之外的股票。

5.11.3 其他资产构成

| 序号 | 名称 | 金额（元） |
|----|---------|------------|
| 1 | 存出保证金 | 176,713.72 |
| 2 | 应收证券清算款 | 43,233.43 |
| 3 | 应收股利 | - |
| 4 | 应收利息 | - |
| 5 | 应收申购款 | 452.70 |
| 6 | 其他应收款 | - |
| 7 | 其他 | - |
| 8 | 合计 | 220,399.85 |

5.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

无。

5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

| 序号 | 股票代码 | 股票名称 | 流通受限部分的公允价值（元） | 占基金资产净值比例（%） | 流通受限情况说明 |
|----|--------|------|----------------|--------------|----------|
| 1 | 600938 | 中国海油 | 1,295,341.68 | 0.85 | 新股锁定 |
| 2 | 688052 | 纳芯微 | 403,192.80 | 0.26 | 新股锁定 |
| 3 | 301268 | 铭利达 | 25,719.04 | 0.02 | 新股锁定 |
| 4 | 301162 | 国能日新 | 22,177.60 | 0.01 | 新股锁定 |
| 5 | 301150 | 中一科技 | 14,108.30 | 0.01 | 新股锁定 |
| 6 | 301248 | 杰创智能 | 11,573.44 | 0.01 | 新股锁定 |
| 7 | 301148 | 嘉戎技术 | 10,934.04 | 0.01 | 新股锁定 |
| 8 | 301279 | 金道科技 | 7,790.72 | 0.01 | 新股锁定 |

5.11.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入原因，分项之和与合计可能有尾差。

§ 6 开放式基金份额变动

单位：份

| | |
|---------------------------|----------------|
| 报告期期初基金份额总额 | 224,624,338.29 |
| 报告期期间基金总申购份额 | 50,544,569.93 |
| 减：报告期期间基金总赎回份额 | 126,239,654.07 |
| 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 | 148,929,254.15 |

§ 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

| | |
|--------------------------|---------------|
| 报告期期初管理人持有的本基金份额 | - |
| 报告期期间买入/申购总份额 | 45,852,682.93 |
| 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 | 45,852,682.93 |
| 报告期期末持有的本基金份额占基金总份额比例（%） | 30.79 |

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

| 序号 | 交易方式 | 交易日期 | 交易份额(份) | 交易金额(元) | 适用费率(%) |
|----|------|------------|---------------|---------------|---------|
| 1 | 申购 | 2022-09-27 | 45,852,682.93 | 47,000,000.00 | - |
| 合计 | | | 45,852,682.93 | 47,000,000.00 | |

注：1、申购或者购买基金份额的，金额为正；赎回或者卖出基金份额的，金额为负。

2、合计数以绝对值填列。

3、红利发放为期间合计数。

4、本基金相关费率均依照法律文件规定收取。

§ 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 | 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 | 持有基金份额比例 | 期初 | 申购 | 赎回 | 持有份额 |

| 者类别 | 号 | 达到或者超过 20% 的时间区间 | 份额 | 份额 | 份额 | | 比 (%) |
|---|---|-------------------|---------------|---------------|---------------|---------------|-------|
| 机构 | 1 | 20220701-20220920 | 54,369,747.90 | - | 54,369,747.90 | - | - |
| | 2 | 20220701-20220817 | 46,381,261.60 | - | 46,381,261.60 | - | - |
| | 3 | 20220701-20220930 | 93,370,132.36 | - | - | 93,370,132.36 | 62.69 |
| | 4 | 20220927-20220930 | - | 45,852,682.93 | - | 45,852,682.93 | 30.79 |
| 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

无。

§ 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润灵活配置混合型证券投资基金的文件；
- 2、《大成景润灵活配置混合型证券投资基金基金合同》；
- 3、《大成景润灵活配置混合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

2022 年 10 月 26 日