

# 大成债券投资基金 2023 年中期报告

2023 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：中国农业银行股份有限公司

送出日期：2023 年 8 月 30 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。

基金托管人中国农业银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2023 年 8 月 29 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 2023 年 01 月 01 日起至 06 月 30 日止。

## 1.2 目录

<b>§ 1 重要提示及目录</b> .....	<b>2</b>
1.1 重要提示 .....	2
1.2 目录 .....	3
<b>§ 2 基金简介</b> .....	<b>5</b>
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
<b>§ 3 主要财务指标和基金净值表现</b> .....	<b>6</b>
3.1 主要会计数据和财务指标 .....	6
3.2 基金净值表现 .....	7
<b>§ 4 管理人报告</b> .....	<b>9</b>
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
<b>§ 5 托管人报告</b> .....	<b>13</b>
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等内容真实、准确和完整发表意见 .....	14
<b>§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）</b> .....	<b>14</b>
6.1 资产负债表 .....	14
6.2 利润表 .....	15
6.3 净资产（基金净值）变动表 .....	17
6.4 报表附注 .....	19
<b>§ 7 投资组合报告</b> .....	<b>41</b>
7.1 期末基金资产组合情况 .....	41
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合 .....	41
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 .....	42
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动 .....	42
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合 .....	43
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 .....	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 .....	44
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 .....	44

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 .....	44
7.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 .....	44
7.11 投资组合报告附注 .....	44
<b>§ 8 基金份额持有人信息 .....</b>	<b>48</b>
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....	48
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....	49
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 .....	49
<b>§ 9 开放式基金份额变动 .....</b>	<b>49</b>
<b>§ 10 重大事件揭示 .....</b>	<b>50</b>
10.1 基金份额持有人大会决议 .....	50
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 .....	50
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....	50
10.4 基金投资策略的改变 .....	50
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....	50
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 .....	50
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	50
10.8 其他重大事件 .....	53
<b>§ 11 影响投资者决策的其他重要信息 .....</b>	<b>53</b>
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 .....	53
11.2 影响投资者决策的其他重要信息 .....	53
<b>§ 12 备查文件目录 .....</b>	<b>54</b>
12.1 备查文件目录 .....	54
12.2 存放地点 .....	54
12.3 查阅方式 .....	54

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	大成债券投资基金	
基金简称	大成债券	
基金主代码	090002	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2003 年 6 月 12 日	
基金管理人	大成基金管理有限公司	
基金托管人	中国农业银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	1,628,690,629.72 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	大成债券 A/B	大成债券 C
下属分级基金的交易代码	090002	092002
下属分级基金的前端交易代码	090002	-
下属分级基金的后端交易代码	091002	-
报告期末下属分级基金的份额总额	1,060,315,075.82 份	568,375,553.90 份

### 2.2 基金产品说明

投资目标	在力保本金安全和保持资产流动性的基础上追求资产的长期稳定增值。
投资策略	通过整体资产配置、类属资产配置和个券选择三个层次自上而下地进行投资管理，以实现投资目标。类属资产部分按照修正的均值-方差模型在交易所国债、交易所企业债、银行间国债、银行间金融债之间实行最优配置。
业绩比较基准	中国债券总指数
风险收益特征	本基金为较低风险、较低收益的债券型基金产品，其风险收益水平高于货币市场基金，但低于混合型基金和股票型基金。

### 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	中国农业银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	段皓静	秦一楠
	联系电话	0755-83183388	010-66060069
	电子邮箱	office@dcfund.com.cn	tgxxpl@abchina.com
客户服务电话		4008885558	95599
传真		0755-83199588	010-68121816
注册地址		广东省深圳市南山区海德三道	北京市东城区建国门内大街 69

	1236 号大成基金总部大厦 5 层、27-33 层	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	北京市西城区复兴门内大街 28 号凯晨世贸中心东座 F9
邮政编码	518054	100031
法定代表人	吴庆斌	谷澍

## 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	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

## § 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(2023 年 1 月 1 日-2023 年 6 月 30 日)	
	大成债券 A/B	大成债券 C
本期已实现收益	6,411,954.76	3,111,780.36
本期利润	26,858,133.89	18,731,370.90
加权平均基金份额本期利润	0.0256	0.0297
本期加权平均净值利润率	2.43%	2.78%
本期基金份额净值增长率	2.39%	2.23%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2023 年 6 月 30 日)	
	期末可供分配利润	9,035,023.19
	期末可供分配基金份额利润	0.0159

期末基金资产净值	1,123,801,500.67	610,277,157.23
期末基金份额净值	1.0599	1.0737
3.1.3 累计期末指标	报告期末 (2023 年 6 月 30 日)	
基金份额累计净值增长率	248.05%	226.86%

注：1. 本期已实现收益指本期利息收入、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

大成债券 A/B

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	0.51%	0.15%	0.53%	0.08%	-0.02%	0.07%
过去三个月	0.24%	0.18%	1.86%	0.06%	-1.62%	0.12%
过去六个月	2.39%	0.18%	2.55%	0.05%	-0.16%	0.13%
过去一年	0.20%	0.19%	4.39%	0.08%	-4.19%	0.11%
过去三年	11.92%	0.25%	12.47%	0.09%	-0.55%	0.16%
自基金合同生效起至今	248.05%	0.29%	108.93%	0.15%	139.12%	0.14%

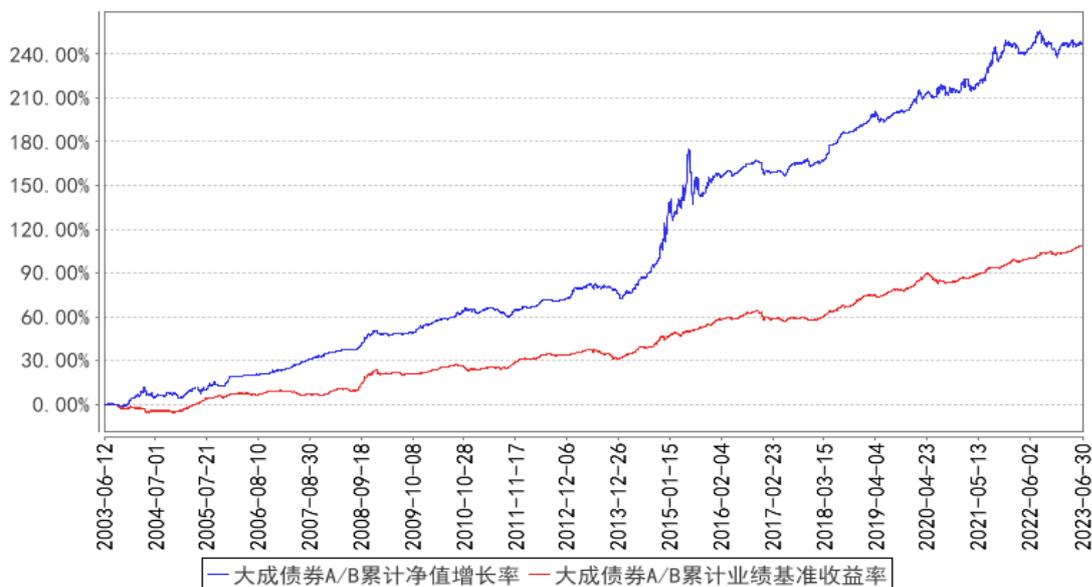
大成债券 C

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	0.49%	0.15%	0.53%	0.08%	-0.04%	0.07%
过去三个月	0.16%	0.18%	1.86%	0.06%	-1.70%	0.12%
过去六个月	2.23%	0.18%	2.55%	0.05%	-0.32%	0.13%

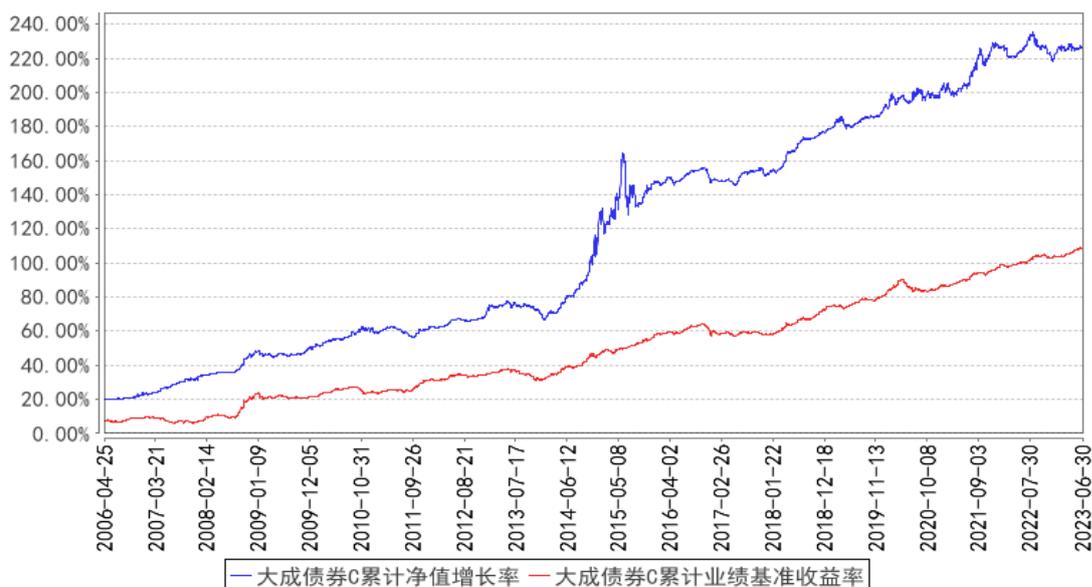
过去一年	-0.10%	0.19%	4.39%	0.08%	-4.49%	0.11%
过去三年	10.92%	0.25%	12.47%	0.09%	-1.55%	0.16%
自基金合同生效 起至今	226.86%	0.29%	108.93%	0.16%	117.93%	0.13%

### 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

大成债券A/B累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



大成债券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：1、本基金于 2006 年 4 月 24 日起推出持续性收费模式，将前端收费模式定义为 A 类收费模式，后端收费模式定义为 B 类收费模式，二者对应的基金份额简称“大成债券 A/B”；将持续性收费模式定义为 C 类收费模式，对应的基金份额简称“大成债券 C”。

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，注册资本为2亿元人民币，注册地为深圳。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%)。公司业务资质齐全，是全国同时具有境内、境外社保基金管理人资格和基本养老保险基金管理人资格的四家基金公司之一，全面涵盖公募基金、机构投资、海外投资、财富管理、养老金管理、私募股权投资等业务，旗下大成国际资产管理公司具备QFII、RQFII等资格。

历经24年的发展，大成基金形成了以长期投资能力为核心竞争优势，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。目前已形成权益、固定收益、量化投资、商品期货、境外投资、大类资产配置等六大投资团队，全面覆盖各类投资领域。

#### 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		
王立	本基金基金经理，总经理助理、固定收益总部总监	2009年5月23日	-	21年	中南财经大学经济学硕士。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债券型证券投资

					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。2021年8月17日起任大成元吉增利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，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，公司旗下所有投资组合未发现存在异常交易行为。公司旗下所有投资组合参与的交易所公开竞价，未发生成交较少的单边交易量超过该股当日成交量5%的股票同日反向交易；主动投资组合间债券交易存在1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

今年上半年，经济的修复一波三折，货币政策保持宽松，债市走出小牛市。年初政策预期较强，经济逐步从疫情中修复，10 年国债收益率震荡上行。三月两会确认了 5% 的经济增速目标，同时政策预期减弱，10 年国债收益率触顶回落。四月经济数据逐步转弱，PMI 重回荣枯线以下，社融增速震荡下行，经济的复苏边际放缓，央行随之加大了货币政策的宽松力度以支持实体经济，央行于五月下调通知存款和协定存款利率上限，于六月降息 10BP，10 年国债收益率快速下行至 2.62%。降息落地后，市场对于宽信用、稳增长政策的发力预期抬升，同时理财、基金等机构的止盈需求增加，带动 10 年国债收益率小幅回升。

具体到债市，上半年收益率整体下行，3Y/5Y/10Y 国债利率分别变动-18bp/-22bp/-20bp，10 年国债到期收益率的运行区间为 2.62%至 2.92%。受到保险和理财等机构负债端扩张、银行信贷对信用债供给形成挤出等因素的共同影响，信用债市场供需关系友好，叠加年初信用利差处于历史较高水平，上半年信用债收益率和信用利差呈现全面压缩态势，1Y/3Y/5Y 的 AAA 中票收益率分别变动-24bp/-39bp/-44bp，1Y/3Y/5Y 的 AA+中票收益率分别变动-44bp/-53bp/-54bp，1Y/3Y/5Y 的 AA 中票收益率分别变动-79bp/-58bp/-59bp。

转债方面，权益市场上半年先扬后抑。年初市场震荡上涨，3 月后宏观数据走弱对权益市场压力逐步显现，但 AI、机器人、智能驾驶等多种面向未来、具备想象空间的行业表现亮眼。六月中下旬由于部分大宗商品去库结束，政策转向初现端倪，中报预告等因素影响，市场交易的重心开始逐步切入有业绩兑现的主线。转债虽然估值高企，但在流动性友好、纯债机会成本很低的背景下，几乎没有发生比较大规模的主动压估值，整体的行情结构也类似于权益市场，转债中位数价格来到 123 元附近。上半年上证 50/沪深 300/中证 500/创业板指/中证转债的收益分别为-5.4%/-0.7%/2.3%/-5.6%/3.5%。

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。2023 年上半年本基金主动管理组合大类资产配置，整体提高了组合杠杆。利率方面通过对中长久期国债和政金债的波段管理，给组合增厚了收益。信用方面，我们高度重视信用风险，主要持有高等级信用债，并在上半年继续提升信用债投资比例。去年四季度时，我们从大类资产的角度判断权益类资产的风险收益已显著好于纯债类资产，考虑到跨年后转债资产的机会，采取了提前左侧布局，该策略在一季度迎来收获季，但不可忽视的是，权益市场信心尚未充分恢复，而可转债溢价率仍处于高位，转债仍在区间震荡中。二季度转债资产也受到了股票市场下跌的影响，整体来看上半年可转债投资收益是正贡献。上半年需要反思的是，组合在上半年的债券小牛市中利率

债久期拉得不够长，在二季度的股票市场下跌中控制波动方面仍需努力改进。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末大成债券 A/B 的基金份额净值为 1.0599 元，本报告期基金份额净值增长率为 2.39%，同期业绩比较基准收益率为 2.55%；截至本报告期末大成债券 C 的基金份额净值为 1.0737 元，本报告期基金份额净值增长率为 2.23%，同期业绩比较基准收益率为 2.55%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

二季度在透支效应与去库存的影响下，经济环比下行幅度超出预期，K 型复苏结构分化的特点显著。展望下半年，由于疫后修复仍未结束、库存周期和价格周期的下行压力放缓、而政策也已适度发力，经济环比增速有望逐步趋于平稳。不过考虑到我国宏观政策力度温和，而外需周期、信用周期、库存周期仍无法形成向上的合力，同时本轮周期还伴随着潜在中枢下移的长期问题，市场主体信心的恢复需要更长时间，因此经济短期依然缺乏向上的弹性，周期的回升还需要更多的时间。

债市方面，由于经济依然缺乏内生动能，货币政策稳中偏松的格局延续，因此虽然债市收益率已处于较低水平，但大幅调整的风险有限，将保持低位震荡格局，仍然具备配置价值。下半年政策加码或扰动债市节奏，但考虑到保险、银行等配置机构的资产荒格局并未缓解，因此市场调整仍是参与机会。

信用债方面，目前经济修复有所波动，宽信用政策成效也有待观察，信用宽松政策暂不具备收缩基础，信用债环境仍相对友好。具体品种方面，城投债新一轮再融资债置换可期，目前来看无须大幅减配，但建议根据区域实力控制久期暴露；地产产业链及周期债基本面及利差不具显著优势，整体仅建议关注结构性机会；二永债仍兼具配置和交易价值，同样建议以区域实力维度进行择券。

可转债方面，虽然转债的溢价率和中位数价格已经行至高位，但我们认为估值风险不大，价格距离 1 月的“最强预期”时点还有 2%左右空间，策略上更偏向于自下而上择券，重视中高价制造业转债，整体择券思维侧重于绝对价格而非溢价率。

非常感谢基金份额持有人的信任和支持，2023 年下半年我们将积极进行资产配置，适时调整组合结构，纯债方面更加灵活，转债结构不断优化，努力挖掘投资机会，反思不足，吸取经验教训，力争获得与基金风险特征一致的收益回报给投资者。

#### 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、固定收益总部、

混合资产投资部、研究部、指数与期货投资部、大类资产配置部、权益专户投资部、国际业务部、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，估值委员会成员中包括八名投资组合经理。

股票投资部、固定收益总部、混合资产投资部、研究部、指数与期货投资部、大类资产配置部、权益专户投资部、国际业务部、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

在托管本基金的过程中，本基金托管人中国农业银行股份有限公司严格遵守《中华人民共和

《证券投资基金法》相关法律法规的规定以及基金合同、托管协议的约定，对本基金基金管理人—大成基金管理有限公司 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日基金的投资运作，进行了认真、独立的会计核算和必要的投资监督，认真履行了托管人的义务，没有从事任何损害基金份额持有人利益的行为。

## 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

本托管人认为，大成基金管理有限公司在本基金的投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支及利润分配等问题上，不存在损害基金份额持有人利益的行为；在报告期内，严格遵守了《中华人民共和国证券投资基金法》等有关法律法规，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

## 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

本托管人认为，大成基金管理有限公司的信息披露事务符合《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》及其他相关法律法规的规定，基金管理人所编制和披露的本基金中期报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告等信息真实、准确、完整，未发现现有损害基金持有人利益的行为。

# § 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：大成债券投资基金

报告截止日：2023 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2023 年 6 月 30 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
<b>资产：</b>			
银行存款	6.4.7.1	662,177.70	1,330,679.24
结算备付金		12,170,774.74	5,582,653.43
存出保证金		28,504.96	43,625.24
交易性金融资产	6.4.7.2	2,182,164,465.55	2,715,309,409.55
其中：股票投资		36,543,270.02	27,536,224.90
基金投资		-	-
债券投资		2,145,621,195.53	2,687,773,184.65
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	-	-
债权投资	6.4.7.5	-	-
其中：债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
其他投资		-	-
其他债权投资	6.4.7.6	-	-
其他权益工具投资	6.4.7.7	-	-
应收清算款		1,736,124.19	-
应收股利		-	-
应收申购款		50,069,275.35	116,871.00
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.8	-	-
资产总计		2,246,831,322.49	2,722,383,238.46
<b>负债和净资产</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2023年6月30日</b>	<b>上年度末 2022年12月31日</b>
<b>负 债：</b>			
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		494,833,768.22	615,706,960.83
应付清算款		11,944,665.43	597,317.19
应付赎回款		443,287.55	1,066,510.51
应付管理人报酬		982,061.26	1,310,270.03
应付托管费		280,588.93	374,362.88
应付销售服务费		142,417.37	255,008.98
应付投资顾问费		-	-
应交税费		3,656,908.28	3,704,382.52
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.9	468,967.55	494,818.01
负债合计		512,752,664.59	623,509,630.95
<b>净资产：</b>			
实收基金	6.4.7.10	1,628,690,629.72	2,014,787,534.88
其他综合收益	6.4.7.11	-	-
未分配利润	6.4.7.12	105,388,028.18	84,086,072.63
净资产合计		1,734,078,657.90	2,098,873,607.51
负债和净资产总计		2,246,831,322.49	2,722,383,238.46

注：报告截止日 2023 年 06 月 30 日，基金份额总额 1,628,690,629.72 份，其中大成债券 A/B 基金份额总额为 1,060,315,075.82 份，基金份额净值 1.0599 元。大成债券 C 基金份额总额为 568,375,553.90 份，基金份额净值 1.0737 元。

## 6.2 利润表

会计主体：大成债券投资基金

本报告期：2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
<b>一、营业总收入</b>		60,519,388.89	2,283,228.89
1. 利息收入		106,635.16	235,631.48
其中：存款利息收入	6.4.7.13	106,635.16	34,046.00
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		-	201,585.48
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		24,212,393.44	19,012,772.76
其中：股票投资收益	6.4.7.14	-370,130.80	-10,597,373.88
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.15	24,363,956.00	29,394,205.39
资产支持证券投资	6.4.7.16	-	-
贵金属投资收益	6.4.7.17	-	-
衍生工具收益	6.4.7.18	-	-
股利收益	6.4.7.19	218,568.24	215,941.25
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）	6.4.7.20	36,065,769.67	-17,143,314.02
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.21	134,590.62	178,138.67
<b>减：二、营业总支出</b>		14,929,884.10	16,196,303.60
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	6,197,799.24	9,114,407.59
2. 托管费	6.4.10.2.2	1,770,799.79	2,604,116.43
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	1,009,453.78	1,918,345.12
4. 投资顾问费		-	-
5. 利息支出		5,705,770.07	2,281,993.48

其中：卖出回购金融资产支出		5,705,770.07	2,281,993.48
6. 信用减值损失	6.4.7.22	-	-
7. 税金及附加		82,209.64	115,081.57
8. 其他费用	6.4.7.23	163,851.58	162,359.41
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		45,589,504.79	-13,913,074.71
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		45,589,504.79	-13,913,074.71
<b>五、其他综合收益的税后净额</b>		-	-
<b>六、综合收益总额</b>		45,589,504.79	-13,913,074.71

### 6.3 净资产（基金净值）变动表

会计主体：大成债券投资基金

本报告期：2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 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、上期期末净资产（基金净值）	2,014,787,534.88	-	84,086,072.63	2,098,873,607.51
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产（基金净值）	2,014,787,534.88	-	84,086,072.63	2,098,873,607.51
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	386,096,905.16	-	21,301,955.55	-364,794,949.61
（一）、综合收益总额	-	-	45,589,504.79	45,589,504.79
（二）、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）	386,096,905.16	-	-24,287,549.24	-410,384,454.40
其中：1. 基金申	183,338,952.63	-	10,982,910.73	194,321,863.36

购款				
2. 基金赎回款	- 569,435,857.79	-	-35,270,459.97	-604,706,317.76
(三)、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)	-	-	-	-
(四)、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资产(基金净值)	1,628,690,629. 72	-	105,388,028.18	1,734,078,657.9 0
项目	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 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、上期期末净资产(基金净值)	2,165,329,861. 96	-	247,340,433.80	2,412,670,295.7 6
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产(基金净值)	2,165,329,861. 96	-	247,340,433.80	2,412,670,295.7 6
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	-88,725,304.38	-	113,008,810.20	-201,734,114.58
(一)、综合收益总额	-	-	-13,913,074.71	-13,913,074.71
(二)、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)	-88,725,304.38	-	15,880,593.96	-72,844,710.42
其中：1. 基金申购款	782,195,365.32	-	68,997,883.38	851,193,248.70
2. 基金赎回款	-	-	-53,117,289.42	-924,037,959.12

	870,920,669.70			
(三)、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)	-	-	114,976,329.45	-114,976,329.45
(四)、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资产(基金净值)	2,076,604,557.58	-	134,331,623.60	2,210,936,181.18

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

基金管理人负责人

范瑛

主管会计工作负责人

孙蕊

会计机构负责人

## 6.4 报表附注

### 6.4.1 基金基本情况

大成债券投资基金(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”)证监基金字[2003]第 44 号《关于同意大成债券投资基金设立的批复》核准,由大成基金管理有限公司依照《证券投资基金管理暂行办法》及其实施细则、《开放式证券投资基金试点办法》等有关规定和《大成债券投资基金基金契约》(后更名为《大成债券投资基金基金合同》)发起,并于 2003 年 6 月 12 日募集成立。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 2,152,776,735.13 元,业经普华永道中天会计师事务所有限公司普华永道验字(2003)第 64 号验资报告予以验证。本基金的基金管理人为大成基金管理有限公司,基金托管人为中国农业银行股份有限公司。

根据修改后的《大成债券投资基金基金合同》并经中国证监会核准,自 2006 年 4 月 24 日起,本基金根据申购费用、赎回费用收取方式的不同,将基金份额分为不同的类别。在投资者申购时收取前端申购费用的,称为 A 类;在投资者赎回时收取后端申购费用的,称为 B 类;新增不收取前/后端申购费用、赎回费用,而是从本类别基金资产中计提销售服务费的基金类别,称为 C 类。本基金 A 类、B 类、C 类三种收费模式并存,由于基金费用的不同,本基金 A/B 类基金份额和 C 类基金份额分别计算基金份额净值,计算公式为计算日各类别基金资产净值除以计算日发售在外的

该类别基金份额总数。投资人可自由选择申购某一类别的基金份额，但各类别基金份额之间不能相互转换。

根据《关于增加大成债券投资基金 C 类份额赎回费的公告》，自 2009 年 8 月 28 日起投资人申请获得的 C 类基金份额，若持有期间小于 30 个自然日需要收取赎回费用。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《大成债券投资基金基金合同》的有关规定，本基金的投资范围为债券类资产投资部分(包括流动性良好的、国内市场依法发行及交易的国债、金融债、公司债、企业债、可转换债券、正逆回购等，以及中国证监会允许基金投资的其他金融工具)不低于基金资产总值 80%，本基金还可择机进行新股、存托凭证申购，但新股、存托凭证投资比例不超过基金资产总值 20%；所投资的新股、存托凭证上市流通后持有期不超过 1 年，所投资可转债转为股票后持有期不超过 1 年。本基金的业绩比较基准为：中国债券总指数。

#### 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”)、中国证监会颁布的《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>》、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《大成债券投资基金基金合同》和在财务报表附注 6.4.4 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于 2023 年 6 月 30 日的财务状况以及自 2023 年 1 月 1 日起至 2023 年 6 月 30 日止期间的经营成果和净值变动情况。

#### 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

本基金本报告期未发生会计政策变更。

##### 6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

##### 6.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无重大会计差错更正。

#### 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[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。

(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。

## 6.4.7 重要财务报表项目的说明

## 6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 6 月 30 日
活期存款	662,177.70
等于：本金	659,975.83
加：应计利息	2,201.87
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	662,177.70

## 6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 6 月 30 日				
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动	
股票	35,685,877.53	-	36,543,270.02	857,392.49	
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	-	
债券	交易所市场	898,354,248.70	6,863,532.12	886,377,858.27	-
	银行间市场	1,237,393,798.20	19,825,337.26	1,259,243,337.26	2,024,201.80
	合计	2,135,748,046.90	26,688,869.38	2,145,621,195.53	-
资产支持证券	-	-	-	-	
基金	-	-	-	-	
其他	-	-	-	-	
合计	2,171,433,924.43	26,688,869.38	2,182,164,465.55	-	
				15,958,328.26	

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

无。

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

无。

## 6.4.7.9 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	1,079.99
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	57,758.11
其中：交易所市场	14,611.03
银行间市场	43,147.08
应付利息	-
预提费用	408,395.94
其他	1,733.51
合计	468,967.55

## 6.4.7.10 实收基金

金额单位：人民币元

## 大成债券 A/B

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	1,141,410,229.47	1,141,410,229.47
本期申购	120,693,409.78	120,693,409.78
本期赎回（以“-”号填列）	-201,788,563.43	-201,788,563.43
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	1,060,315,075.82	1,060,315,075.82

## 大成债券 C

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	873,377,305.41	873,377,305.41
本期申购	62,645,542.85	62,645,542.85
本期赎回（以“-”号填列）	-367,647,294.36	-367,647,294.36
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	568,375,553.90	568,375,553.90

注：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)。

#### 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

##### 大成债券 A/B

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	16,513,941.38	23,663,830.86	40,177,772.24
本期利润	6,411,954.76	20,446,179.13	26,858,133.89
本期基金份额交易产生的变动数	-1,062,044.79	-2,487,436.49	-3,549,481.28
其中：基金申购款	2,230,543.89	4,285,966.30	6,516,510.19
基金赎回款	-3,292,588.68	-6,773,402.79	-10,065,991.47
本期已分配利润	-	-	-
本期末	21,863,851.35	41,622,573.50	63,486,424.85

##### 大成债券 C

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	9,816,790.01	34,091,510.38	43,908,300.39
本期利润	3,111,780.36	15,619,590.54	18,731,370.90
本期基金份额交易产生的变动数	-3,893,547.18	-16,844,520.78	-20,738,067.96
其中：基金申购款	968,403.40	3,497,997.14	4,466,400.54
基金赎回款	-4,861,950.58	-20,342,517.92	-25,204,468.50
本期已分配利润	-	-	-
本期末	9,035,023.19	32,866,580.14	41,901,603.33

#### 6.4.7.13 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期
	2023年1月1日至2023年6月30日
活期存款利息收入	11,606.59
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	94,746.23
其他	282.34
合计	106,635.16

#### 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

单位：人民币元

项目	本期
	2023年1月1日至2023年6月30日

股票投资收益——买卖股票差价收入	-370,130.80
股票投资收益——赎回差价收入	-
股票投资收益——申购差价收入	-
股票投资收益——证券出借差价收入	-
合计	-370,130.80

#### 6.4.7.14.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年6月30日
卖出股票成交总额	21,834,335.70
减：卖出股票成本总额	22,160,794.42
减：交易费用	43,672.08
买卖股票差价收入	-370,130.80

#### 6.4.7.14.3 股票投资收益——证券出借差价收入

无。

#### 6.4.7.15 债券投资收益

##### 6.4.7.15.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年6月30日
债券投资收益——利息收入	33,466,803.92
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	-9,102,847.92
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	24,363,956.00

##### 6.4.7.15.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年6月30日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	1,428,278,837.59
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	1,413,927,846.87
减：应计利息总额	23,415,195.54
减：交易费用	38,643.10

买卖债券差价收入	-9,102,847.92
----------	---------------

## 6.4.7.15.3 债券投资收益——赎回差价收入

无。

## 6.4.7.15.4 债券投资收益——申购差价收入

无。

## 6.4.7.16 资产支持证券投资收益

## 6.4.7.16.1 资产支持证券投资收益项目构成

无。

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

无。

## 6.4.7.16.3 资产支持证券投资收益——赎回差价收入

无。

## 6.4.7.16.4 资产支持证券投资收益——申购差价收入

无。

## 6.4.7.17 贵金属投资收益

## 6.4.7.17.1 贵金属投资收益项目构成

无。

## 6.4.7.17.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

无。

## 6.4.7.17.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

无。

## 6.4.7.17.4 贵金属投资收益——申购差价收入

无。

## 6.4.7.18 衍生工具收益

## 6.4.7.18.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

无。

## 6.4.7.18.2 衍生工具收益——其他投资收益

无。

## 6.4.7.19 股利收益

单位：人民币元

项目	本期
----	----

	2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
股票投资产生的股利收益	218,568.24
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	218,568.24

#### 6.4.7.20 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期
	2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
1. 交易性金融资产	36,065,769.67
股票投资	61,122.32
债券投资	36,004,647.35
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	36,065,769.67

#### 6.4.7.21 其他收入

单位：人民币元

项目	本期
	2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
基金赎回费收入	133,974.68
基金转换费收入	615.94
合计	134,590.62

注：1. 本基金的赎回费率按持有期间递减，不低于赎回费总额的 25% 归入基金资产。

2. 本基金的转换费由申购补差费和转出基金的赎回费两部分构成，其中不低于转出基金的赎回费的 25% 归入转出基金的基金资产。

#### 6.4.7.22 信用减值损失

无。

#### 6.4.7.23 其他费用

单位：人民币元

项目	本期
	2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
审计费用	49,588.57

信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
银行划款手续费	36,080.64
账户维护费	18,600.00
其他	75.00
合计	163,851.58

#### 6.4.7.24 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、注册登记机构、基金销售机构
中国农业银行股份有限公司(“中国农业银行”)	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。

#### 6.4.10 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

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2023年1月1日至2023年6月 30日		上年度可比期间 2022年1月1日至2022年6月30日	
	成交金额	占当期股票 成交总额的比 例(%)	成交金额	占当期股票 成交总额的比例 (%)
光大证券	21,834,335.70	100.00	103,496,139.11	100.00

##### 6.4.10.1.2 债券交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2023年1月1日至2023年6月30日		上年度可比期间 2022年1月1日至2022年6月30日	
	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 成交总额的比例 (%)
光大证券	755,203,848.52	94.94	748,407,821.73	73.92

#### 6.4.10.1.3 债券回购交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2023年1月1日至2023年6月30日		上年度可比期间 2022年1月1日至2022年6月30日	
	成交金额	占当期债券回 购 成交总额的比例 (%)	成交金额	占当期债券回 购 成交总额的比例 (%)
光大证券	14,218,422,000.00	100.00	2,400,872,000.00	100.00

#### 6.4.10.1.4 权证交易

无。

#### 6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2023年1月1日至2023年6月30日			
	当期 佣金	占当期佣金总量 的比例 (%)	期末应付佣金余 额	占期末应付佣金 总额的比例 (%)
光大证券	20,120.45	100.00	14,611.03	100.00
关联方名称	上年度可比期间 2022年1月1日至2022年6月30日			
	当期 佣金	占当期佣金总量 的比例 (%)	期末应付佣金余 额	占期末应付佣金 总额的比例 (%)
光大证券	94,550.80	100.00	22,603.04	100.00

注：1. 上述佣金参考市场价格经本基金的基金管理人与对方协商确定。

2. 该类佣金协议的服务范围还包括佣金收取方为本基金提供的证券投资研究成果和市场信息服务等。

#### 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	上年度可比期间
	2023年1月1日至2023年6	2022年1月1日至2022

	月 30 日	年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	6,197,799.24	9,114,407.59
其中：支付销售机构的客户维护费	1,025,431.79	1,742,781.20

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 0.70% 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 × 0.70% / 当年天数。

#### 6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	1,770,799.79	2,604,116.43

注：支付基金托管人中国农业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。

#### 6.4.10.2.3 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 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	大成债券 A/B	大成债券 C	合计
大成基金	-	379,961.71	379,961.71
光大证券	-	610.47	610.47
中国农业银行	-	22,238.97	22,238.97
合计	-	402,811.15	402,811.15
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	大成债券 A/B	大成债券 C	合计
大成基金	-	611,636.65	611,636.65
光大证券	-	631.47	631.47
中国农业银行	-	28,328.33	28,328.33
合计	-	640,596.45	640,596.45

注：支付基金销售机构的销售服务费按前一日持续性销售服务费收费模式下的 C 类基金份额对应

的基金资产净值 0.30% 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：

C 类基金份额日销售服务费 = 前一日 C 类基金资产净值 × 0.30% / 当年天数。

#### 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

单位：人民币元

本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日						
银行间市场交易的 各关联方名称	债券交易金额		基金逆回购		基金正回购	
	基金买入	基金卖出	交易金额	利息收入	交易金额	利息支出
中国农业银行	-	-	-	-	16,639,981,000.00	1,814,970.20
上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日						
银行间市场交易的 各关联方名称	债券交易金额		基金逆回购		基金正回购	
	基金买入	基金卖出	交易金额	利息收入	交易金额	利息支出
中国农业银行	-	-	-	-	5,650,016,000.00	485,505.06

#### 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

份额单位：份

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
	大成债券 A/B	大成债券 C
基金合同生效日（2003 年 6 月 12 日）持有的基金份额	-	-
报告期初持有的基金份额	16,243,086.10	-
报告期间申购/买入总份额	9,486,717.27	-
报告期间因拆分变动份额	-	-

减：报告期内赎回/卖出总份额	-	-
报告期末持有的基金份额	25,729,803.37	-
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	1.58%	-
项目	上年度可比期间 2022年1月1日至2022年6月30日	上年度可比期间 2022年1月1日至2022年6月30日
	大成债券 A/B	大成债券 C
基金合同生效日（2003年6月12日）持有的基金份额	-	-
报告期初持有的基金份额	18,743,086.10	-
报告期内申购/买入总份额	0.00	-
报告期内因拆分变动份额	-	-
减：报告期内赎回/卖出总份额	0.00	-
报告期末持有的基金份额	18,743,086.10	-
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	0.90%	-

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。

#### 6.4.10.5.2 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

无。

#### 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 2023年1月1日至2023年6月30日		上年度可比期间 2022年1月1日至2022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
中国农业银行	662,177.70	11,606.59	1,258,787.78	16,284.00

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（2023 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

截至本报告期末 2023 年 6 月 30 日止，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 360,636,244.86 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
180027	18 付息国债 27	2023 年 7 月 3 日	104.57	200,000	20,914,652.17
210002	21 付息国债 02	2023 年 7 月 3 日	103.11	300,000	30,932,163.93
210004	21 付息国债 04	2023 年 7 月 3 日	101.40	100,000	10,140,180.33
210013	21 付息国债 13	2023 年 7 月 3 日	104.17	400,000	41,669,150.68
210015	21 付息国债 15	2023 年 7 月 3 日	101.97	200,000	20,394,893.15
220013	22 付息国债 13	2023 年 7 月 3 日	100.23	943,000	94,512,870.66
220020	22 付息国债 20	2023 年 7 月 3 日	101.51	200,000	20,301,128.77
220021	22 付息国债 21	2023 年 7 月 3 日	102.09	300,000	30,627,805.48
220023	22 付息国债 23	2023 年 7 月 3 日	101.14	500,000	50,569,630.14
210316	21 进出 16	2023 年 7 月 4 日	105.21	589,000	61,971,271.92
210316	21 进出 16	2023 年 7 月 6 日	105.21	112,000	11,784,010.96
合计				3,844,000	393,817,758.19

###### 6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2023 年 6 月 30 日止，本基金从事证券交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额 134,197,523.36 元，截至 2023 年 07 月 03 日到期。该类交易要求本基金转入质押库的债券，按证券交易所规定的比例折算为标准券后，不低于债券回购交易的余额。

#### 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

本基金为债券型证券投资基金，属于中等风险品种。本基金投资的金融工具主要为债券投资和新股等。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。

#### 6.4.13.2 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农业银行股份有限公司，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 94.10% (上年度末：98.74%)。

### 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。于本期末，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。

#### 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 2023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	662,177.70	-	-	-	662,177.70
结算备付金	12,170,774.74	-	-	-	12,170,774.74
存出保证金	28,504.96	-	-	-	28,504.96
交易性金融资产	637,007,806.82	1,215,637,503.48	292,975,885.23	36,543,270.02	2,182,164,465.55
应收申购款	-	-	-	50,069,275.35	50,069,275.35
应收清算款	-	-	-	1,736,124.19	1,736,124.19
资产总计	649,869,264.22	1,215,637,503.48	292,975,885.23	88,348,669.56	2,246,831,322.49
负债					
应付赎回款	-	-	-	443,287.55	443,287.55
应付管理人报酬	-	-	-	982,061.26	982,061.26
应付托管费	-	-	-	280,588.93	280,588.93
应付清算款	-	-	-	11,944,665.43	11,944,665.43
卖出回购金融资产款	494,833,768.22	-	-	-	494,833,768.22
应付销售服务费	-	-	-	142,417.37	142,417.37
应交税费	-	-	-	3,656,908.28	3,656,908.28
其他负债	-	-	-	468,967.55	468,967.55
负债总计	494,833,768.22	-	-	17,918,896.37	512,752,664.59
利率敏感度缺口	155,035,496.00	1,215,637,503.48	292,975,885.23	70,429,773.19	1,734,078,657.90
上年度末 2022年12月31	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计

日					
资产					
银行存款	1,330,679.24	-	-	-	1,330,679.24
结算备付金	5,582,653.43	-	-	-	5,582,653.43
存出保证金	43,625.24	-	-	-	43,625.24
交易性金融资产	1,020,622,679.69	1,329,455,672.55	337,694,832.41	27,536,224.90	2,715,309,409.55
应收申购款	-	-	-	116,871.00	116,871.00
资产总计	1,027,579,637.60	1,329,455,672.55	337,694,832.41	27,653,095.90	2,722,383,238.46
负债					
应付赎回款	-	-	-	1,066,510.51	1,066,510.51
应付管理人报酬	-	-	-	1,310,270.03	1,310,270.03
应付托管费	-	-	-	374,362.88	374,362.88
应付清算款	-	-	-	597,317.19	597,317.19
卖出回购金融资产款	615,706,960.83	-	-	-	615,706,960.83
应付销售服务费	-	-	-	255,008.98	255,008.98
应交税费	-	-	-	3,704,382.52	3,704,382.52
其他负债	-	-	-	494,818.01	494,818.01
负债总计	615,706,960.83	-	-	7,802,670.12	623,509,630.95
利率敏感度缺口	411,872,676.77	1,329,455,672.55	337,694,832.41	19,850,425.78	2,098,873,607.51

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（2023年6月30日）	上年度末（2022年12月31日）
	市场利率上升 25 个基点	-6,187,931.90	-8,102,889.45
市场利率下降 25 个基点	6,242,831.74	8,175,874.27	

#### 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。

本基金的基金管理人在构建和管理投资组合的过程中，通过对宏观经济情况及政策的分析，结合证券市场运行情况，做出资产配置及组合构建的决定；通过对单个证券的定性分析及定量分析，选择符合基金合同约定范围的投资品种进行投资。本基金的基金管理人定期结合宏观及微观环境的变化，对投资策略、资产配置、投资组合进行修正，来主动应对可能发生的其他价格风险。

本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险。本基金投资于债券类资产部分不低于基金资产总值的 80%，同时还可择机进行新股申购，但新股投资比例不超过基金资产总值的 20%。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。

#### 6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 6 月 30 日		上年度末 2022 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	36,543,270.02	2.11	27,536,224.90	1.31
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	36,543,270.02	2.11	27,536,224.90	1.31

#### 6.4.13.4.3.2 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净资产的比例为 2.11% (上年度末：1.31%)，因此除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素的变动对于本基金净资产无重大影响 (上年度末：同)。

## 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 2023 年 6 月 30 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
第一层次	530,351,791.29	390,086,986.68
第二层次	1,651,812,674.26	2,325,222,422.87
第三层次	-	-
合计	2,182,164,465.55	2,715,309,409.55

#### 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。

对于证券交易所上市的股票和债券，若出现重大事项停牌、交易不活跃（包括涨跌停时的交易不活跃）、或属于非公开发行等情况，本基金不会于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间将相关股票和债券的公允价值列入第一层次；并根据估值调整中采用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度，确定相关股票和债券的公允价值应属第二层次还是第三层次。

#### 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资产（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应收款项和其他金融负债，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	36,543,270.02	1.63
	其中：股票	36,543,270.02	1.63
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	2,145,621,195.53	95.50
	其中：债券	2,145,621,195.53	95.50
	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	-	-
	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	12,832,952.44	0.57
8	其他各项资产	51,833,904.50	2.31
9	合计	2,246,831,322.49	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	-	-
C	制造业	27,212,213.38	1.57
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	2,510,671.30	0.14
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	1,274,458.52	0.07
J	金融业	1,691,602.50	0.10
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	3,854,324.32	0.22
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-

0	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	36,543,270.02	2.11

### 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	002078	太阳纸业	1,140,266	12,189,443.54	0.70
2	603298	杭叉集团	442,807	10,428,104.85	0.60
3	300416	苏试试验	178,772	3,854,324.32	0.22
4	601006	大秦铁路	337,910	2,510,671.30	0.14
5	600487	亨通光电	159,809	2,342,799.94	0.14
6	300827	上能电气	50,544	1,822,111.20	0.11
7	600919	江苏银行	230,150	1,691,602.50	0.10
8	002368	太极股份	30,956	1,274,458.52	0.07
9	600420	国药现代	38,065	429,753.85	0.02

### 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	603298	杭叉集团	8,869,083.21	0.42
2	300416	苏试试验	4,308,407.61	0.21
3	002368	太极股份	3,649,832.00	0.17
4	600420	国药现代	3,622,786.44	0.17
5	600901	江苏金租	2,990,304.02	0.14
6	601006	大秦铁路	2,726,933.70	0.13
7	300827	上能电气	2,014,430.92	0.10
8	600919	江苏银行	1,808,979.00	0.09
9	300682	朗新科技	1,115,960.32	0.05

注：本期累计买入金额指买入成交金额（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	002078	太阳纸业	10,052,742.00	0.48
2	600901	江苏金租	3,110,588.49	0.15
3	600420	国药现代	2,897,187.45	0.14
4	002368	太极股份	1,880,681.00	0.09
5	603667	五洲新春	1,182,638.66	0.06
6	300682	朗新科技	1,015,157.60	0.05
7	603298	杭叉集团	1,004,071.00	0.05
8	002258	利尔化学	550,396.40	0.03
9	300827	上能电气	140,873.10	0.01

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	31,106,717.22
卖出股票收入（成交）总额	21,834,335.70

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	356,108,622.98	20.54
2	央行票据	-	-
3	金融债券	270,688,616.38	15.61
	其中：政策性金融债	157,821,575.34	9.10
4	企业债券	388,983,717.12	22.43
5	企业短期融资券	30,072,977.05	1.73
6	中期票据	605,958,740.73	34.94
7	可转债（可交换债）	493,808,521.27	28.48
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	2,145,621,195.53	123.73

#### 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	210316	21 进出 16	1,500,000	157,821,575.34	9.10
2	220013	22 付息国债 13	1,100,000	110,248,311.48	6.36
3	220023	22 付息国债 23	500,000	50,569,630.14	2.92
4	210013	21 付息国债 13	400,000	41,669,150.68	2.40

5	102280648	22 通顺交投 MTN001	300,000	31,521,852.46	1.82
---	-----------	-------------------	---------	---------------	------

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之一江苏银行的发行主体江苏银行股份有限公司于 2023 年 2 月 10 日因违反账户管理规定、未按规定履行客户身份识别义务等，受到中国人民银行处罚（银罚决字（2023）1 号）。本基金认为，对江苏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	28,504.96
2	应收清算款	1,736,124.19
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	50,069,275.35
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	51,833,904.50

## 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	110085	通 22 转债	19,817,611.28	1.14
2	113650	博 22 转债	12,795,793.60	0.74
3	113602	景 20 转债	12,791,079.53	0.74
4	128140	润建转债	12,186,482.54	0.70
5	128023	亚太转债	10,660,307.07	0.61
6	111010	立昂转债	10,615,026.46	0.61
7	127058	科伦转债	10,528,200.09	0.61
8	123165	回天转债	10,176,081.99	0.59
9	113059	福莱转债	9,893,072.26	0.57
10	110081	闻泰转债	9,598,566.60	0.55
11	110088	淮 22 转债	9,341,248.34	0.54
12	127024	盈峰转债	8,715,611.07	0.50
13	127053	豪美转债	8,483,499.20	0.49
14	110068	龙净转债	8,256,551.30	0.48
15	113661	福 22 转债	8,221,503.87	0.47
16	113623	凤 21 转债	8,136,912.02	0.47
17	113598	法兰转债	7,928,864.16	0.46
18	118014	高测转债	7,628,123.93	0.44
19	113063	赛轮转债	7,101,211.47	0.41
20	127064	杭氧转债	6,823,661.42	0.39
21	113045	环旭转债	6,791,646.43	0.39
22	123088	威唐转债	6,703,890.02	0.39
23	113647	禾丰转债	5,875,276.81	0.34
24	123071	天能转债	5,678,520.19	0.33
25	128141	旺能转债	5,659,869.61	0.33
26	113055	成银转债	5,575,273.41	0.32
27	113655	欧 22 转债	5,343,575.13	0.31
28	127032	苏行转债	5,216,874.81	0.30
29	110062	烽火转债	5,147,750.21	0.30
30	110090	爱迪转债	5,125,697.69	0.30
31	123164	法本转债	5,036,530.42	0.29
32	123107	温氏转债	4,922,108.31	0.28
33	128142	新乳转债	4,751,164.78	0.27
34	110079	杭银转债	4,646,598.81	0.27
35	113654	永 02 转债	4,615,025.64	0.27
36	123156	博汇转债	4,546,608.84	0.26
37	123142	申昊转债	4,522,047.51	0.26
38	113637	华翔转债	4,388,831.12	0.25
39	113658	密卫转债	4,382,122.56	0.25
40	127073	天赐转债	4,308,732.42	0.25

41	110076	华海转债	4,226,868.71	0.24
42	127072	博实转债	3,893,144.58	0.22
43	123099	普利转债	3,866,000.20	0.22
44	110082	宏发转债	3,816,991.18	0.22
45	110086	精工转债	3,798,983.39	0.22
46	127027	能化转债	3,593,118.81	0.21
47	110055	伊力转债	3,510,888.08	0.20
48	123114	三角转债	3,487,143.31	0.20
49	111007	永和转债	3,469,612.55	0.20
50	113636	甬金转债	3,428,787.96	0.20
51	113046	金田转债	3,404,901.71	0.20
52	128095	恩捷转债	3,396,650.05	0.20
53	113594	淳中转债	3,373,924.97	0.19
54	111004	明新转债	3,274,119.33	0.19
55	123085	万顺转 2	3,084,260.36	0.18
56	127066	科利转债	3,047,059.06	0.18
57	110083	苏租转债	2,777,216.84	0.16
58	127046	百润转债	2,734,555.48	0.16
59	113504	艾华转债	2,718,495.98	0.16
60	110048	福能转债	2,685,953.72	0.15
61	127006	敖东转债	2,651,448.07	0.15
62	113044	大秦转债	2,615,285.96	0.15
63	127069	小熊转债	2,563,170.60	0.15
64	123120	隆华转债	2,516,743.17	0.15
65	113626	伯特转债	2,513,906.05	0.14
66	128135	洽洽转债	2,505,536.07	0.14
67	113024	核建转债	2,483,153.87	0.14
68	128136	立讯转债	2,481,130.19	0.14
69	128111	中矿转债	2,478,263.80	0.14
70	110064	建工转债	2,444,415.49	0.14
71	113053	隆 22 转债	2,142,032.01	0.12
72	113039	嘉泽转债	2,128,263.21	0.12
73	123078	飞凯转债	2,109,057.40	0.12
74	113025	明泰转债	2,044,235.70	0.12
75	127035	濮耐转债	2,039,246.59	0.12
76	127065	瑞鹄转债	1,909,609.46	0.11
77	113062	常银转债	1,876,890.47	0.11
78	123158	宙邦转债	1,843,421.85	0.11
79	111009	盛泰转债	1,836,066.46	0.11
80	113049	长汽转债	1,832,785.62	0.11
81	110045	海澜转债	1,822,781.26	0.11
82	113047	旗滨转债	1,797,312.66	0.10
83	128034	江银转债	1,781,472.65	0.10

84	128125	华阳转债	1,705,366.09	0.10
85	113542	好客转债	1,696,729.41	0.10
86	127020	中金转债	1,676,571.93	0.10
87	128132	交建转债	1,628,219.06	0.09
88	118003	华兴转债	1,562,024.62	0.09
89	110058	永鼎转债	1,520,514.41	0.09
90	113050	南银转债	1,489,493.57	0.09
91	113641	华友转债	1,461,555.99	0.08
92	127033	中装转 2	1,405,614.09	0.08
93	127055	精装转债	1,348,515.89	0.08
94	111002	特纸转债	1,263,046.58	0.07
95	113638	台 21 转债	1,236,521.40	0.07
96	123063	大禹转债	1,211,265.20	0.07
97	127030	盛虹转债	1,144,362.91	0.07
98	127018	本钢转债	1,123,372.22	0.06
99	113662	豪能转债	1,107,736.81	0.06
100	123144	裕兴转债	1,062,666.18	0.06
101	123113	仙乐转债	1,057,735.50	0.06
102	118020	芳源转债	1,032,841.37	0.06
103	127051	博杰转债	983,946.50	0.06
104	113609	永安转债	979,771.20	0.06
105	128074	游族转债	961,225.89	0.06
106	111005	富春转债	933,840.01	0.05
107	123092	天壕转债	909,348.38	0.05
108	123121	帝尔转债	896,110.83	0.05
109	110091	合力转债	861,162.35	0.05
110	127047	帝欧转债	840,593.36	0.05
111	127012	招路转债	834,655.16	0.05
112	127063	贵轮转债	833,718.82	0.05
113	128134	鸿路转债	816,003.79	0.05
114	110073	国投转债	805,939.16	0.05
115	123132	回盛转债	780,912.66	0.05
116	132026	G 三峡 EB2	774,736.03	0.04
117	127056	中特转债	677,512.46	0.04
118	123150	九强转债	658,622.57	0.04
119	127036	三花转债	551,317.89	0.03
120	113615	金诚转债	542,310.23	0.03
121	113519	长久转债	523,072.49	0.03
122	118019	金盘转债	510,917.48	0.03
123	128121	宏川转债	501,414.79	0.03
124	113644	艾迪转债	500,657.12	0.03
125	128071	合兴转债	487,509.97	0.03
126	127042	嘉美转债	485,210.56	0.03

127	128035	大族转债	481,592.30	0.03
128	127022	恒逸转债	471,787.89	0.03
129	127067	恒逸转 2	470,868.05	0.03
130	128017	金禾转债	408,209.60	0.02
131	123056	雪榕转债	385,973.43	0.02
132	113625	江山转债	385,117.38	0.02
133	113048	晶科转债	349,347.55	0.02
134	128137	洁美转债	292,003.52	0.02
135	128116	瑞达转债	262,416.44	0.02
136	113643	风语转债	238,779.26	0.01
137	113060	浙 22 转债	217,718.83	0.01
138	113633	科沃转债	212,800.18	0.01
139	110061	川投转债	208,134.26	0.01
140	128122	兴森转债	193,348.05	0.01
141	113563	柳药转债	153,642.79	0.01
142	111000	起帆转债	98,627.70	0.01
143	123130	设研转债	80,333.49	0.00

#### 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 (%)
大成债券 A/B	34,770	30,495.11	655,707,437.52	61.84	404,607,638.30	38.16
大成债券 C	13,293	42,757.51	437,621,502.28	77.00	130,754,051.62	23.00
合计	48,063	33,886.58	1,093,328,939.80	67.13	535,361,689.92	32.87

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	大成债券 A/B	333,859.74	0.0315
	大成债券 C	808.30	0.0001
	合计	334,668.04	0.0205

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	大成债券 A/B	0
	大成债券 C	0
	合计	0
本基金基金经理持有本开放式基金	大成债券 A/B	0
	大成债券 C	0
	合计	0

## § 9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	大成债券 A/B	大成债券 C
基金合同生效日（2003年6月12日）基金份额总额	2,152,776,735.13	-
本报告期期初基金份额总额	1,141,410,229.47	873,377,305.41
本报告期基金总申购份额	120,693,409.78	62,645,542.85
减：本报告期基金总赎回份额	201,788,563.43	367,647,294.36
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期末基金份额总额	1,060,315,075.82	568,375,553.90

## § 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第八届董事会第二次会议审议通过，自 2023 年 3 月 25 日起，温智敏先生不再担任公司副总经理职务；聘请石国武先生担任公司副总经理，任期自 2023 年 3 月 25 日起，至公司第八届董事会任期届满之日止。具体详见我司发布的《大成基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告》。

#### 二、基金托管人的基金托管部门的重大人事变动

本报告期内，基金托管人的基金托管部门无重大人事变动。

### 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内，无涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。

### 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

#### 10.6.1 管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，基金管理人及其相关高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

#### 10.6.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

无。

### 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 (%)	

光大证券	2	21,834,335.70	100.00	20,120.45	100.00	-
爱建证券	1	-	-	-	-	-
安信证券	1	-	-	-	-	-
川财证券	1	-	-	-	-	-
第一创业	1	-	-	-	-	-
东北证券	2	-	-	-	-	-
东财证券	1	-	-	-	-	-
东方证券	1	-	-	-	-	-
东吴证券	1	-	-	-	-	-
东兴证券	1	-	-	-	-	-
东亚前海	1	-	-	-	-	-
方正证券	1	-	-	-	-	-
高华证券	1	-	-	-	-	-
广发证券	1	-	-	-	-	-
国金证券	2	-	-	-	-	-
国盛证券	1	-	-	-	-	-
国泰君安	3	-	-	-	-	-
国信证券	1	-	-	-	-	-
海通证券	1	-	-	-	-	-
红塔证券	1	-	-	-	-	-
华创证券	1	-	-	-	-	-
华泰证券	1	-	-	-	-	-
华西证券	1	-	-	-	-	-
民生证券	1	-	-	-	-	-
南京证券	1	-	-	-	-	-
平安证券	1	-	-	-	-	-
瑞银证券	2	-	-	-	-	-
山西证券	1	-	-	-	-	-
上海证券	1	-	-	-	-	-
申万宏源	1	-	-	-	-	-
世纪证券	1	-	-	-	-	-
天风证券	2	-	-	-	-	-
万和证券	1	-	-	-	-	-
西部证券	1	-	-	-	-	-
湘财证券	1	-	-	-	-	-
信达证券	2	-	-	-	-	-
兴业证券	2	-	-	-	-	-
粤开证券	1	-	-	-	-	-
招商证券	2	-	-	-	-	-
浙商证券	1	-	-	-	-	-
中国银河 证券	4	-	-	-	-	-
中金公司	2	-	-	-	-	-

中泰证券	2	-	-	-	-	-
中信建投 证券	2	-	-	-	-	-
中信证券	3	-	-	-	-	-
中银国际 证券	1	-	-	-	-	-
中原证券	1	-	-	-	-	-

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：

- (1) 财务状况良好，最近一年无重大违规行为；
- (2) 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；
- (3) 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；
- (4) 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；
- (5) 能提供投资组合运作、管理所需的其他券商服务；
- (6) 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专用席位。

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：

本报告期内新增交易单元：无；

本报告期内退租交易单元：申万宏源西部、中金公司。

### 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(%)
光大证券	755,203,848.52	94.94	14,218,422,000.00	100.00	-	-
招商证券	40,229,800.00	5.06	-	-	-	-

## 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	关于再次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	2023 年 6 月 30 日
2	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	2023 年 4 月 27 日
3	大成债券投资基金 2023 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	2023 年 4 月 21 日
4	大成债券投资基金 2022 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	2023 年 3 月 30 日
5	大成基金管理有限公司关于旗下部分基金增加博时财富基金销售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	2023 年 3 月 28 日
6	大成基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告	中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站	2023 年 3 月 27 日
7	大成基金管理有限公司关于旗下部分基金增加上海中欧财富基金销售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	2023 年 3 月 27 日
8	大成基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告	中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站	2023 年 3 月 27 日
9	大成基金管理有限公司关于养老金客户通过直销柜台申购旗下基金费率优惠的公告	中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站	2023 年 3 月 24 日
10	大成债券投资基金 2022 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	2023 年 1 月 18 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债券投资基金的文件；
- 2、《大成债券投资基金基金合同》；
- 3、《大成债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

2023 年 8 月 30 日