

大成景泰纯债债券型证券投资基金 2020 年第 4 季度报告

2020 年 12 月 31 日

基金管理人：大成基金管理有限公司

基金托管人：中国民生银行股份有限公司

报告送出日期：2021 年 1 月 22 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。

基金托管人中国民生银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2021 年 1 月 21 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 2020 年 10 月 01 日起至 12 月 31 日止。

§ 2 基金产品概况

| | |
|------------|---|
| 基金简称 | 大成景泰纯债债券 |
| 基金主代码 | 008747 |
| 基金运作方式 | 契约型开放式 |
| 基金合同生效日 | 2020 年 2 月 27 日 |
| 报告期末基金份额总额 | 56,475,404.68 份 |
| 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>本基金以中长期利率趋势分析为基础，结合经济周期、宏观政策方向及收益率曲线分析，实施积极的债券投资组合管理，以获取较高的债券组合投资收益。</p> <p>1、久期配置</p> <p>本基金通过对宏观经济变量(包括国内生产总值、工业增长、货币信贷、固定资产投资、消费、外贸差额、财政收支、价格指数和汇率等)和宏观经济政策(包括货币政策、财政政策、产业政策、外贸和汇率政策等)进行分析，对未来较长的一段时间内的市场利率变化趋势进行预测，决定组合的久期。</p> <p>2、债券类属配置</p> <p>本基金对不同类型固定收益品种的信用风险、税赋水平、市场流动性、市场风险等因素进行分析，研究同期限的国债、金融债、企业债、交易所和银行间市场投资品种的利差和变化趋势，制定债券类属配置策略，以获取不同债券类属之间利差变化所带来的投资收益。</p> |

| | | |
|-----------------|--|----------------|
| | <p>3、信用债投资策略</p> <p>本基金对于信用类固定收益品种的投资，将根据发行人的公司背景、行业特性、盈利能力、偿债能力、流动性等因素，对信用债进行信用风险评估，积极发掘信用利差具有相对投资机会的个券进行投资，并采取分散化投资策略，严格控制组合整体的违约风险水平。</p> <p>4、资产支持证券投资策略</p> <p>本基金将通过宏观经济、提前偿还率、资产池结构以及资产池资产所在行业景气变化等因素的研究，预测资产池未来现金流变化，并通过研究标的证券发行条款，预测提前偿还率变化对标的证券的久期与收益率的影响。在严格控制风险的情况下，结合信用研究和流动性管理，选择风险调整后收益高的品种进行投资，以期获得长期稳定收益。</p> <p>5、国债期货投资策略</p> <p>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。</p> <p>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。</p> <p>6、信用衍生品投资策略</p> <p>为了更好地管理债券投资的信用风险，本基金根据风险管理的原则，以风险对冲为目的，将适当参与信用衍生品的投资。本基金将在详细评估信用债风险状况的前提下，对比权衡个券风险收益与信用衍生品价格，构建信用风险对冲组合。持有期内，本基金将紧密跟踪信用利差与信用衍生品价格的动态变化，灵活调整对冲比例，追求经信用风险对冲后的投资回报最大化。</p> | |
| 业绩比较基准 | 中债综合全价指数收益率 | |
| 风险收益特征 | 本基金为债券型基金，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。 | |
| 基金管理人 | 大成基金管理有限公司 | |
| 基金托管人 | 中国民生银行股份有限公司 | |
| 下属分级基金的基金简称 | 大成景泰纯债债券 A | 大成景泰纯债债券 C |
| 下属分级基金的交易代码 | 008747 | 008748 |
| 报告期末下属分级基金的份额总额 | 47,657,305.72 份 | 8,818,098.96 份 |

§ 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（2020 年 10 月 1 日-2020 年 12 月 31 日） | |
|-----------------|---------------------------------------|--------------|
| | 大成景泰纯债债券 A | 大成景泰纯债债券 C |
| 1. 本期已实现收益 | 300,968.02 | 68,585.37 |
| 2. 本期利润 | 442,135.13 | 99,378.26 |
| 3. 加权平均基金份额本期利润 | 0.0114 | 0.0080 |
| 4. 期末基金资产净值 | 48,939,817.94 | 9,024,987.56 |
| 5. 期末基金份额净值 | 1.0269 | 1.0235 |

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、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。

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

大成景泰纯债债券 A

| 阶段 | 净值增长率① | 净值增长率标准差② | 业绩比较基准收益率③ | 业绩比较基准收益率标准差④ | ①-③ | ②-④ |
|------------|--------|-----------|------------|---------------|-------|--------|
| 过去三个月 | 0.97% | 0.04% | 0.64% | 0.04% | 0.33% | 0.00% |
| 过去六个月 | 1.29% | 0.04% | -0.85% | 0.07% | 2.14% | -0.03% |
| 自基金合同生效起至今 | 2.69% | 0.06% | -1.28% | 0.09% | 3.97% | -0.03% |

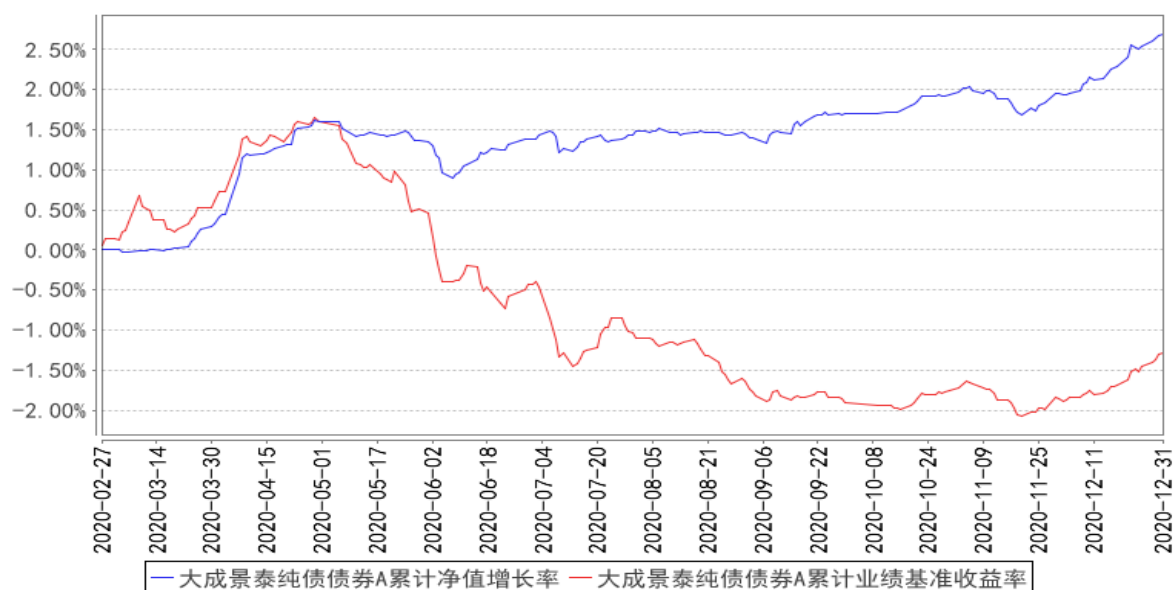
大成景泰纯债债券 C

| 阶段 | 净值增长率① | 净值增长率标准差② | 业绩比较基准收益率③ | 业绩比较基准收益率标准差④ | ①-③ | ②-④ |
|------------|--------|-----------|------------|---------------|-------|--------|
| 过去三个月 | 0.88% | 0.04% | 0.64% | 0.04% | 0.24% | 0.00% |
| 过去六个月 | 1.10% | 0.04% | -0.85% | 0.07% | 1.95% | -0.03% |
| 自基金合同生效起至今 | 2.35% | 0.06% | -1.28% | 0.09% | 3.63% | -0.03% |

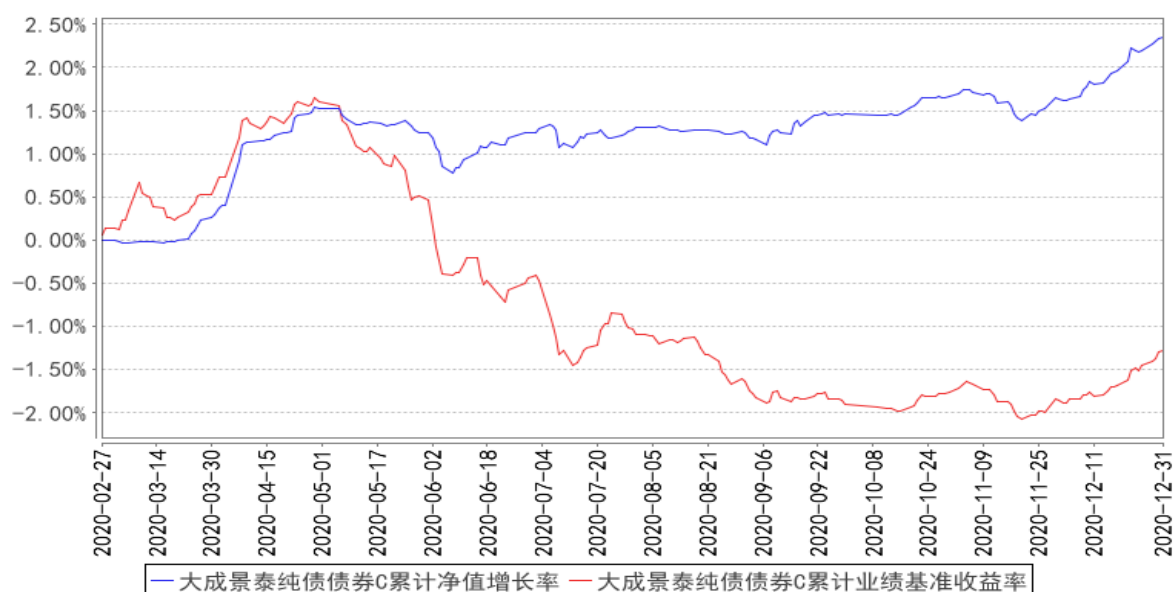
3.2.2 自基金合同生效以来基金累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益

率变动的比较

大成景泰纯债债券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



大成景泰纯债债券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：按基金合同规定，本基金自基金合同生效之日起 6 个月内为建仓期。建仓期结束时，本基金的投资组合比例符合基金合同的约定。

§ 4 管理人报告

4.1 基金经理（或基金经理小组）简介

| 姓名 | 职务 | 任本基金的基金经理期限 | | 证券从业年限 | 说明 |
|----|---------|-------------|------|--------|--------------------------------------|
| | | 任职日期 | 离任日期 | | |
| 汪伟 | 本基金基金经理 | 2020年2月27日 | - | 7年 | 金融学硕士。曾担任广州证券资产管理部债券投资经理、金鹰基金集中交易部交易 |

| | | | | | |
|----|---------|-----------------|---|------|--|
| | | | | | <p>主管、广东南粤银行金融市场部债券投资经理、金鹰基金固定收益部基金经理。</p> <p>2019 年 5 月加入大成基金管理有限公司，任职于固定收益总部。2019 年 9 月 12 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。2019 年 9 月 12 日起任大成景盈债券型证券投资基金基金经理。2019 年 10 月 15 日至 2020 年 10 月 30 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。2020 年 2 月 27 日起任大成景泰纯债债券型证券投资基金基金经理。2020 年 2 月 28 日起任大成景乐纯债债券型证券投资基金基金经理。2020 年 6 月 19 日起任大成景悦中短债债券型证券投资基金基金经理。2020 年 8 月 31 日起任大成景优中短债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</p> |
| 孙丹 | 本基金基金经理 | 2020 年 2 月 27 日 | - | 12 年 | <p>经济学硕士。2008 年至 2012 年任景顺长城产品开发部产品经理。2012 年至 2014 年任华夏基金机构债券投资部研究员。</p> <p>2014 年 5 月加入大成基金管理有限公司，曾担任固定收益总部信用策略及宏观利率研究员、大成景辉灵活配置混合型证券投资基金、大成景荣保本混合型证券投资基金、大成景兴信用债债券型证券投资基金、大成景秀灵活配置混合型证券投资基金、大成景源灵活配置混合型证券投资基金基金经理助理，现任固定收益总部总监助理。2018 年 3 月 12 日起任大成策略回报混合型证券投资基金、大成创新成长混合型证券投资基金 (LOF)、大成积极成长混合型证券投资基金、大成精选增值混合型证券投资基金、大成景阳领先混合型证券投资基金、大成竞争优势混合型证券投资基金、大成蓝筹稳健证券投资基金、大成优选混合型证券投资基金 (LOF) 基金经理助理。2020 年 7 月 1 日起任大成价值增长证券投资基金、大成多策略灵活配置混合型证券投资基金 (LOF)、大成一带一路灵活配置混合型证券投资基金、大成内需增长混合型证券投资基金、大成睿景灵活配置混合型证券投资基金、大成盛世精选灵活配置混合型证券投资基金、大成国企改革灵活配置混合型证券投资基金、</p> |

| | | | | |
|--|--|--|--|--|
| | | | | <p>大成行业轮动混合型证券投资基金、大成灵活配置混合型证券投资基金、大成产业升级股票型证券投资基金 (LOF)、大成健康产业混合型证券投资基金、大成正向回报灵活配置混合型证券投资基金、大成国家安全主题灵活配置混合型证券投资基金、大成新锐产业混合型证券投资基金、大成消费主题混合型证券投资基金基金经理助理。2020 年 11 月 6 日起任大成科技消费股票型证券投资基金、大成科创主题 3 年封闭运作灵活配置混合型证券投资基金、大成中小盘混合型证券投资基金 (LOF)、大成睿享混合型证券投资基金、大成行业先锋混合型证券投资基金基金经理助理。2017 年 5 月 8 日起任大成景尚灵活配置混合型证券投资基金、大成景兴信用债债券型证券投资基金基金经理。2017 年 5 月 8 日至 2019 年 10 月 31 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基金转型) 基金经理。2017 年 5 月 31 日至 2020 年 10 月 20 日任大成惠裕定期开放纯债债券型证券投资基金基金经理。2017 年 6 月 2 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 6 月 2 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。2017 年 6 月 2 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。2017 年 6 月 6 日至 2019 年 9 月 29 日任大成惠明定期开放纯债债券型证券投资基金基金经理。2018 年 3 月 14 日至 2018 年 11 月 30 日任大成景辉灵活配置混合型证券投资基金基金经理。2018 年 3 月 14 日至 2018 年 11 月 30 日任大成景沛灵活配置混合型证券投资基金基金经理。2018 年 3 月 14 日至 2018 年 7 月 20 日任大成景裕灵活配置混合型证券投资基金基金经理。2018 年 3 月 14 日起任大成财富管理 2020 生命周期证券投资基金基金经理。2019 年 7 月 31 日至 2020 年 5 月 23 日任大成景丰债券型证券投资基金 (LOF) 基金经理。2020 年 2 月 27 日起任大成景泰纯债债券型证券投资基金基金经理。2020 年 3 月 5 日起任大成恒享混合型证</p> |
|--|--|--|--|--|

| | | | | | |
|--|--|--|--|--|--|
| | | | | | 券投资基金基金经理。2020 年 3 月 31 日起任大成民稳增长混合型证券投资基金基金经理。2020 年 4 月 26 日起任大成景瑞稳健配置混合型证券投资基金基金经理。2020 年 8 月 21 日起任大成景和债券型证券投资基金基金经理。2020 年 9 月 3 日起任大成汇享一年持有期混合型证券投资基金基金经理。2020 年 9 月 23 日起任大成尊享 18 个月定期开放混合型证券投资基金基金经理。2020 年 11 月 16 日起任大成卓享一年持有期混合型证券投资基金基金经理。2020 年 11 月 18 日起任大成丰享回报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 |
|--|--|--|--|--|--|

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。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存在 3 笔同日反向交易，原因为流动性需要或合规比例调整。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，原因为流动性需要或合规比例调整。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

2020 年四季度，国内债市收益先上后下，整体呈震荡下行态势，截至年末长端利率下行 20bp 左右，中短端下行 30bp 左右，收益率曲线小幅陡峭化。具体来看，11 月末之前债市仍在延续 5 月以来的熊市行情，阶段性偏紧的银行间流动性、一级市场的供给压力、持续复苏的经济运行走势以及市场的风险偏好，均对债市形成压制。尤其是 11 月开始的存单发行利率不断走高，推升整条收益率曲线加速熊平。转折出现在 11 月下旬，出现企业信用违约事件，为防止非银流动性受违约冲击，mlf 增加操作频次及量，同时交易所巨量资金投放直接供给非银需求。进入 12 月以后，mlf 继续超额续作、公开市场 14 天跨年持续投放、交易所倒数第二个交易日也再现投放呵护，加之年末财政资金集中下拨，使得 12 月流动性较为充裕。于此同时债市一级供给压力也逐步缓和，供需逆转下债市反弹修复，且收益率曲线开启陡峭化。信用债在信用违约事件冲击后，评级利差走阔，信用风险偏好持续回落。

景泰纯债组合久期控制在 2 年内，组合底层资产全部集中在中短久期政策性金融债，在把握住稳定票息收益的同时获得了曲线陡峭化过程中的资本利得。同时积极使用国债期货和长端利率债价差操作，把握住四季度市场反弹行情。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末大成景泰纯债债券 A 的基金份额净值为 1.0269 元，本报告期基金份额净值增长率为 0.97%；截至本报告期末大成景泰纯债债券 C 的基金份额净值为 1.0235 元，本报告期基金份额净值增长率为 0.88%。同期业绩比较基准收益率为 0.64%。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

无。

§ 5 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

| 序号 | 项目 | 金额（元） | 占基金总资产的比例（%） |
|----|-------------------|---------------|--------------|
| 1 | 权益投资 | - | - |
| | 其中：股票 | - | - |
| 2 | 基金投资 | - | - |
| 3 | 固定收益投资 | 50,045,000.00 | 86.14 |
| | 其中：债券 | 50,045,000.00 | 86.14 |
| | 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 | 737,219.97 | 1.27 |
| 8 | 其他资产 | 7,318,126.73 | 12.60 |
| 9 | 合计 | 58,100,346.70 | 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

无。

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 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

无。

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

| 序号 | 债券品种 | 公允价值（元） | 占基金资产净值比例（%） |
|----|-----------|---------------|--------------|
| 1 | 国家债券 | - | - |
| 2 | 央行票据 | - | - |
| 3 | 金融债券 | 50,045,000.00 | 86.34 |
| | 其中：政策性金融债 | 50,045,000.00 | 86.34 |
| 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 | - | - |

| | | | |
|----|----|---------------|-------|
| 9 | 其他 | - | - |
| 10 | 合计 | 50,045,000.00 | 86.34 |

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 | 190202 | 19 国开 02 | 100,000 | 10,046,000.00 | 17.33 |
| 2 | 190407 | 19 农发 07 | 100,000 | 10,036,000.00 | 17.31 |
| 3 | 190303 | 19 进出 03 | 100,000 | 10,027,000.00 | 17.30 |
| 4 | 200201 | 20 国开 01 | 100,000 | 10,001,000.00 | 17.25 |
| 5 | 092018001 | 20 农发清发 01 | 100,000 | 9,935,000.00 | 17.14 |

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

无。

5.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

无。

5.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

无。

5.9 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.9.1 本期国债期货投资政策

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。

5.9.2 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） | 77,282.44 |
| 国债期货投资本期公允价值变动（元） | - |

5.9.3 本期国债期货投资评价

积极使用国债期货多头操作把握住了四季市场的反弹行情。

5.10 投资组合报告附注

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

本基金投资的前十名证券中的 19 国开 02（190202.IB）、20 国开 01（200201.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。

5.10.2 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股票。

5.10.3 其他资产构成

| 序号 | 名称 | 金额（元） |
|----|---------|--------------|
| 1 | 存出保证金 | 6,253.15 |
| 2 | 应收证券清算款 | 6,202,499.73 |
| 3 | 应收股利 | - |
| 4 | 应收利息 | 1,106,123.85 |
| 5 | 应收申购款 | 3,250.00 |
| 6 | 其他应收款 | - |
| 7 | 待摊费用 | - |
| 8 | 其他 | - |
| 9 | 合计 | 7,318,126.73 |

5.10.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

无。

5.10.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

无。

5.10.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入原因，分项之和与合计可能有尾差。

§ 6 开放式基金份额变动

单位：份

| 项目 | 大成景泰纯债债券 A | 大成景泰纯债债券 C |
|---------------------------|---------------|---------------|
| 报告期期初基金份额总额 | 36,645,073.52 | 14,439,536.36 |
| 报告期期间基金总申购份额 | 15,790,044.91 | 2,962,680.70 |
| 减：报告期期间基金总赎回份额 | 4,777,812.71 | 8,584,118.10 |
| 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 | 47,657,305.72 | 8,818,098.96 |

§ 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

| 项目 | 大成景泰纯债债券 A | 大成景泰纯债债券 C |
|--------------------------|---------------|------------|
| 报告期期初管理人持有的本基金份额 | 24,665,919.95 | - |
| 报告期期间买入/申购总份额 | 15,690,275.26 | - |
| 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 | 40,356,195.21 | - |
| 报告期期末持有的本基金份额占基金总份额比例（%） | 71.46 | - |

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 | 2020-12-03 | 5,885,411.56 | 6,000,000.00 | - |
| 2 | 申购 | 2020-12-08 | 9,804,863.70 | 10,000,000.00 | - |
| 合计 | | | 15,690,275.26 | 16,000,000.00 | |

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、500 万元（含）以上认申购及转换按单笔计固定费用，不使用费率比例计算，计费规则与基金法律文件规定一致。

§ 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 | 20201001-20201231 | 24,665,919.95 | 15,690,275.26 | - | 40,356,195.21 | 71.46 |
| - | - | - | - | - | - | - | - |
| 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

1. 2020 年 12 月 28 日，经大成基金管理有限公司 2020 年第一次临时股东会审议通过，选举林昌先生担任公司股东董事，翟斌先生不再担任公司股东董事。

2. 2020 年 12 月 28 日，经大成基金管理有限公司第七届董事会第八次会议审议通过，选举林昌先生担任公司第七届董事会副董事长，同时，选举其担任第七届董事会合规与风险管理委员会委员，第七届董事会审计委员会委员。翟斌先生不再担任公司第七届董事会副董事长、第七届董事会合规与风险管理委员会委员、第七届董事会审计委员会委员。

§ 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泰纯债债券型证券投资基金的文件；
- 2、《大成景泰纯债债券型证券投资基金基金合同》；
- 3、《大成景泰纯债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、本报告期内在指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

2021 年 1 月 22 日