

大成元吉增利债券型证券投资基金

2023 年第 4 季度报告

2023 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：中国工商银行股份有限公司

报告送出日期：2024 年 1 月 19 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。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2024 年 01 月 18 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 2023 年 10 月 01 日起至 12 月 31 日止。

§2 基金产品概况

| | | |
|-------------|---|------------|
| 基金简称 | 大成元吉增利债券 | |
| 基金主代码 | 010927 | |
| 基金运作方式 | 契约型开放式 | |
| 基金合同生效日 | 2021 年 8 月 17 日 | |
| 报告期末基金份额总额 | 972,069,810.70 份 | |
| 投资目标 | 在严格控制风险的基础上，通过积极主动的投资管理，追求基金资产的长期稳健增值，力争实现超越业绩比较基准的投资回报。 | |
| 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，预测债券类资产、货币市场工具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。 | |
| 业绩比较基准 | 沪深 300 指数收益率*10%+中债综合全价指数收益率×85%+金融机构人民币活期存款基准利率(税后)*5% | |
| 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。本基金若投资港股通标的股票，则需承担港股通机制下因投资环境、投资标的、市场制度以及交易规则等差异带来的特有风险。 | |
| 基金管理人 | 大成基金管理有限公司 | |
| 基金托管人 | 中国工商银行股份有限公司 | |
| 下属分级基金的基金简称 | 大成元吉增利债券 A | 大成元吉增利债券 C |

| | | |
|-----------------|------------------|----------------|
| 下属分级基金的交易代码 | 010927 | 010928 |
| 报告期末下属分级基金的份额总额 | 969,128,381.06 份 | 2,941,429.64 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（2023 年 10 月 1 日-2023 年 12 月 31 日） | |
|-----------------|---------------------------------------|---------------|
| | 大成元吉增利债券 A | 大成元吉增利债券 C |
| 1. 本期已实现收益 | -35,962,321.26 | -2,350,726.38 |
| 2. 本期利润 | -15,913,257.38 | -1,859,257.88 |
| 3. 加权平均基金份额本期利润 | -0.0135 | -0.0216 |
| 4. 期末基金资产净值 | 955,310,586.62 | 2,873,598.84 |
| 5. 期末基金份额净值 | 0.9857 | 0.9769 |

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

大成元吉增利债券 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 | -1.22% | 0.22% | -0.01% | 0.09% | -1.21% | 0.13% |
| 过去六个月 | -2.52% | 0.22% | -0.38% | 0.09% | -2.14% | 0.13% |
| 过去一年 | -0.45% | 0.22% | 0.63% | 0.08% | -1.08% | 0.14% |
| 自基金合同 生效起至今 | -1.43% | 0.20% | -0.73% | 0.11% | -0.70% | 0.09% |

大成元吉增利债券 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 |
|----|--------|---------------|----------------|-----------------------|-----|-----|
|----|--------|---------------|----------------|-----------------------|-----|-----|

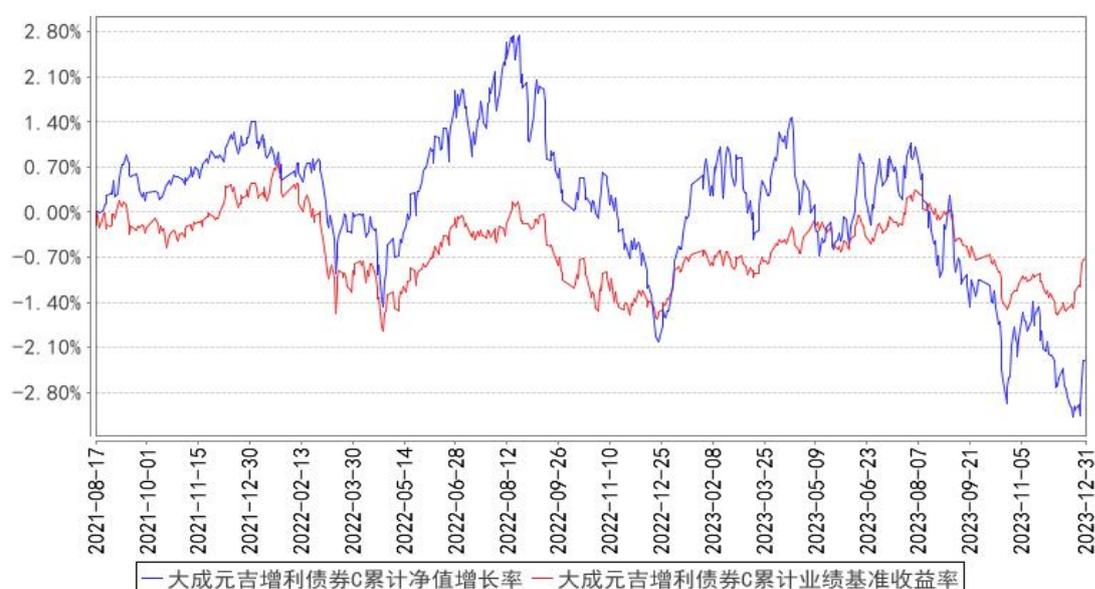
| | | | | | | |
|------------|--------|-------|--------|-------|--------|-------|
| 过去三个月 | -1.27% | 0.22% | -0.01% | 0.09% | -1.26% | 0.13% |
| 过去六个月 | -2.66% | 0.22% | -0.38% | 0.09% | -2.28% | 0.13% |
| 过去一年 | -0.79% | 0.23% | 0.63% | 0.08% | -1.42% | 0.15% |
| 自基金合同生效起至今 | -2.31% | 0.20% | -0.73% | 0.11% | -1.58% | 0.09% |

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

大成元吉增利债券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



大成元吉增利债券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 | | |
| 王立 | 本基金基金经理， 总经理助理、固定收益总部总监 | 2021 年 8 月 17 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中国证监会《证券投资基金经营机构董事、监事、高级管理人员及从业人员监督管理办法》的相关规定。

4.1.1 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，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、5 日内及 10 日内股票及债券交易同向交易价差进行分析，针对同一基金经理管理的多个投资组合及公私募兼任基金经理管理的多个投资组合的投资交易行为加强了公平交易监测与分析，包括对不同时间窗下（同日、3 日、5 日、10 日）反向交易和同向交易价差监控的分析。分析结果表明：债券交易同向交易频率较低；部分股票同向交易溢价率较大主要来源于投资策略差异、市场因素（如个股当日价格振幅较高）及组合经理交易时机选择，同时结合交易价差专项统计分析，未发现违反公平交易原则的异常情况。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

报告期内，公司旗下所有投资组合未发现存在异常交易行为。公司旗下投资组合间存在股票同日反向交易，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不存在同日反向交易。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

2023 年四季度国内经济再度放缓，但在汇率、防空转等因素的影响下资金面有所收敛，债市呈现 M 型走势，先震荡后下行。10 月至 11 月，财政部超预期增发 1 万亿国债，同时美债收益率快速上行、央行重提防空转，资金面超预期收紧，长端利率高位震荡，一度突破 2.7% 的关键点位，曲线显著平坦化；进入 12 月后，一方面经济依然弱势运行，另一方面中央经济工作会议落地叠加存款利率下调，债市的做多情绪逐步释放，年末随着资金面边际转松，曲线陡峭化修复。

债券市场方面，四季度中债综合指数上涨 1.4%，中债国开债总指数上涨 1.19%，中债信用债总指数上涨 1.18%，10 年国债收益率保持震荡格局，波动区间为 2.56%-2.73%，季末较季初下行 12BP，利率曲线平坦化。信用债方面，则延续利差主动压缩的行情，尤其是在“一揽子化债”的行情驱动之下，以城投为突出代表的低等级非金融信用债收益率大幅下行。目前来看，债市各个品种曲线形态均表现平坦，而无论是信用利差、行业利差、等级利差、债项利差等溢价也已创近年内新低位置。

权益方面，受到美债收益率上行、经济波折式修复等因素的影响，四季度权益市场一波三折，风险偏好回落，转债在四季度全线收跌，其中低价转债展现出比较强的防御特点。四季度创业板指下跌 5.6%，沪深 300 下跌 7%，中证 500 下跌 4.6%，而中证转债下跌 3.22%。

本基金在严格控制风险的基础上，采取积极的组合策略进行投资运作。四季度本基金主动进行大类资产配置调整，充分利用杠杆策略，在纯债部分优先配置信用债资产，提升信用债投资比例，获得较好的投资收益。我们高度重视信用风险管理，主要持有中高等级信用债。但不足的是组合在 12 月的债券上涨行情中，久期仍偏谨慎。

非常遗憾的是，权益类资产四季度为组合贡献了负收益。从资产配置的角度看，四季度权益类资产显示出较好的风险收益比，但我们还是低估了市场杀跌的影响，在下跌中的减仓不够及时。12 月之后，市场流动性拐点尚未见到，我们对组合的要求从进攻转为防守，多寻找了底部标的，严格审视标的风险收益比，主要配置在大盘蓝筹或者大盘成长，行业比较分散在化工、有色、交运等。我们调整后的组合稳健性显著提升，但同时又保留了一定的向上弹性。转债部分我们在四季度重新调整了思路，增强组合稳健因子，将部分高价转债转为中低价转债为主。

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。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末大成元吉增利债券 A 的基金份额净值为 0.9857 元，本报告期基金份额净值增长率为-1.22%，同期业绩比较基准收益率为-0.01%；大成元吉增利债券 C 的基金份额净值为 0.9769 元，本报告期基金份额净值增长率为-1.27%，同期业绩比较基准收益率为-0.01%。

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 | 155,295,676.70 | 13.44 |
| | 其中：股票 | 155,295,676.70 | 13.44 |
| 2 | 基金投资 | - | - |
| 3 | 固定收益投资 | 955,489,604.80 | 82.71 |
| | 其中：债券 | 955,489,604.80 | 82.71 |

| | | | |
|---|-------------------|------------------|--------|
| | 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 | 19,327,727.44 | 1.67 |
| 8 | 其他资产 | 25,139,245.19 | 2.18 |
| 9 | 合计 | 1,155,252,254.13 | 100.00 |

注：本基金通过深港通交易机制投资的港股公允价值为 5,316,045.11 元，占期末基金资产净值的比例为 0.55%。

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 | 2,877,689.00 | 0.30 |
| B | 采矿业 | 6,061,028.00 | 0.63 |
| C | 制造业 | 122,137,807.59 | 12.75 |
| D | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | 7,763,056.00 | 0.81 |
| E | 建筑业 | 675,182.00 | 0.07 |
| F | 批发和零售业 | 469,792.00 | 0.05 |
| G | 交通运输、仓储和邮政业 | 1,222,954.00 | 0.13 |
| H | 住宿和餐饮业 | - | - |
| I | 信息传输、软件和信息技术服务业 | 1,134,072.00 | 0.12 |
| J | 金融业 | - | - |
| K | 房地产业 | 1,152,944.00 | 0.12 |
| L | 租赁和商务服务业 | - | - |
| M | 科学研究和技术服务业 | 3,207,321.00 | 0.33 |
| N | 水利、环境和公共设施管理业 | 3,133,875.00 | 0.33 |
| O | 居民服务、修理和其他服务业 | - | - |
| P | 教育 | - | - |
| Q | 卫生和社会工作 | 143,911.00 | 0.02 |
| R | 文化、体育和娱乐业 | - | - |
| S | 综合 | - | - |
| | 合计 | 149,979,631.59 | 15.65 |

5.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

| 行业类别 | 公允价值（人民币） | 占基金资产净值比例（%） |
|--------|--------------|--------------|
| 通讯 | 834,809.86 | 0.09 |
| 非必需消费品 | - | - |
| 必需消费品 | 1,206,577.56 | 0.13 |

| | | |
|------|--------------|------|
| 能源 | - | - |
| 金融 | - | - |
| 房地产 | - | - |
| 医疗保健 | - | - |
| 工业 | - | - |
| 材料 | 1,394,704.30 | 0.15 |
| 科技 | 1,879,953.39 | 0.20 |
| 公用事业 | - | - |
| 政府 | - | - |
| 合计 | 5,316,045.11 | 0.55 |

注：以上分类采用彭博行业分类标准。

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 | 603035 | 常熟汽饰 | 405,900 | 7,659,333.00 | 0.80 |
| 2 | 002475 | 立讯精密 | 197,700 | 6,810,765.00 | 0.71 |
| 3 | 301004 | 嘉益股份 | 136,500 | 6,203,925.00 | 0.65 |
| 4 | 300791 | 仙乐健康 | 164,400 | 5,698,104.00 | 0.59 |
| 5 | 600483 | 福能股份 | 601,400 | 4,973,578.00 | 0.52 |
| 6 | 603878 | 武进不锈 | 657,700 | 4,965,635.00 | 0.52 |
| 7 | 002154 | 报喜鸟 | 826,100 | 4,692,248.00 | 0.49 |
| 8 | 000733 | 振华科技 | 76,000 | 4,471,840.00 | 0.47 |
| 9 | 600282 | 南钢股份 | 1,119,300 | 4,141,410.00 | 0.43 |
| 10 | 002738 | 中矿资源 | 90,800 | 3,387,748.00 | 0.35 |

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 | 59,105,968.16 | 6.17 |
| 2 | 央行票据 | - | - |
| 3 | 金融债券 | 215,976,232.49 | 22.54 |
| | 其中：政策性金融债 | 142,864,120.21 | 14.91 |
| 4 | 企业债券 | 182,492,480.87 | 19.05 |
| 5 | 企业短期融资券 | 30,552,005.47 | 3.19 |
| 6 | 中期票据 | 340,413,468.31 | 35.53 |
| 7 | 可转债（可交换债） | 107,036,786.64 | 11.17 |
| 8 | 同业存单 | 19,912,662.86 | 2.08 |
| 9 | 其他 | - | - |
| 10 | 合计 | 955,489,604.80 | 99.72 |

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 | 190311 | 19 进出 11 | 600,000 | 60,772,475.41 | 6.34 |
| 2 | 102380086 | 23 汕头投资 MTN001 | 300,000 | 31,861,561.64 | 3.33 |
| 3 | 092303003 | 23 进出口行二级 资本债 01 | 300,000 | 30,842,122.95 | 3.22 |
| 4 | 102382134 | 23 中原环保 MTN001 | 300,000 | 30,345,622.95 | 3.17 |
| 5 | 188713 | 21 保置 01 | 300,000 | 30,263,778.08 | 3.16 |

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） | | | | | -19,062.40 |
| 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

本期本组合结合债市波动环境，伺机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。

5.10 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的发行主体本期没有出现被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

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

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。

5.10.3 其他资产构成

| 序号 | 名称 | 金额（元） |
|----|---------|---------------|
| 1 | 存出保证金 | 116,680.33 |
| 2 | 应收证券清算款 | 25,022,552.96 |
| 3 | 应收股利 | - |
| 4 | 应收利息 | - |
| 5 | 应收申购款 | 11.90 |
| 6 | 其他应收款 | - |
| 7 | 其他 | - |
| 8 | 合计 | 25,139,245.19 |

5.10.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

| 序号 | 债券代码 | 债券名称 | 公允价值（元） | 占基金资产净值比例（%） |
|----|--------|-------|---------------|--------------|
| 1 | 113641 | 华友转债 | 11,533,407.01 | 1.20 |
| 2 | 128134 | 鸿路转债 | 8,544,992.98 | 0.89 |
| 3 | 118034 | 晶能转债 | 6,731,016.09 | 0.70 |
| 4 | 127018 | 本钢转债 | 6,311,709.15 | 0.66 |
| 5 | 110048 | 福能转债 | 6,188,153.19 | 0.65 |
| 6 | 113606 | 荣泰转债 | 5,754,940.47 | 0.60 |
| 7 | 127063 | 贵轮转债 | 5,521,246.73 | 0.58 |
| 8 | 111000 | 起帆转债 | 5,253,568.01 | 0.55 |
| 9 | 128132 | 交建转债 | 4,538,552.72 | 0.47 |
| 10 | 123108 | 乐普转 2 | 4,519,092.62 | 0.47 |
| 11 | 123114 | 三角转债 | 3,033,779.84 | 0.32 |
| 12 | 113530 | 大丰转债 | 2,848,831.24 | 0.30 |
| 13 | 113605 | 大参转债 | 2,348,533.68 | 0.25 |
| 14 | 128141 | 旺能转债 | 2,152,321.39 | 0.22 |
| 15 | 110076 | 华海转债 | 2,031,899.12 | 0.21 |
| 16 | 127015 | 希望转债 | 2,003,180.83 | 0.21 |
| 17 | 127043 | 川恒转债 | 1,960,206.29 | 0.20 |

| | | | | |
|----|--------|-------|--------------|------|
| 18 | 127049 | 希望转 2 | 1,928,733.55 | 0.20 |
| 19 | 128125 | 华阳转债 | 1,307,540.24 | 0.14 |
| 20 | 127045 | 牧原转债 | 740,645.48 | 0.08 |
| 21 | 113618 | 美诺转债 | 519,731.55 | 0.05 |
| 22 | 127038 | 国微转债 | 483,473.29 | 0.05 |
| 23 | 110086 | 精工转债 | 483,109.19 | 0.05 |
| 24 | 113048 | 晶科转债 | 388,661.29 | 0.04 |
| 25 | 110068 | 龙净转债 | 31,574.49 | 0.00 |

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 | 大成元吉增利债券 A | 大成元吉增利债券 C |
|---------------------------|------------------|----------------|
| 报告期期初基金份额总额 | 1,287,716,836.12 | 101,141,037.40 |
| 报告期期间基金总申购份额 | 40,585,268.10 | 9,534.85 |
| 减：报告期期间基金总赎回份额 | 359,173,723.16 | 98,209,142.61 |
| 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 | 969,128,381.06 | 2,941,429.64 |

§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 | 大成元吉增利债券 A | 大成元吉增利债券 C |
|--------------------------|----------------|------------|
| 报告期期初管理人持有的本基金份额 | 97,699,262.52 | - |
| 报告期期间买入/申购总份额 | 20,133,897.11 | - |
| 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 | 117,833,159.63 | - |
| 报告期期末持有的本基金份额占基金总份额比例（%） | 12.12 | - |

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 | 2023-11-07 | 20,133,897.11 | 20,000,000.00 | - |
| 合计 | | | 20,133,897.11 | 20,000,000.00 | |

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

无。

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元吉增利债券型证券投资基金的文件；
- 2、《大成元吉增利债券型证券投资基金基金合同》；
- 3、《大成元吉增利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。

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

2024 年 1 月 19 日