

大成安诚债券型证券投资基金 2022 年中期报告

2022 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：中国邮政储蓄银行股份有限公司

送出日期：2022 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。

基金托管人中国邮政储蓄银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2022 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 2022 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	12
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	12
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	12
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	13
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	14
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	14
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	15
§ 5 托管人报告	15
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	15
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	15
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	15
§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）	15
6.1 资产负债表	15
6.2 利润表	17
6.3 净资产（基金净值）变动表	18
6.4 报表附注	21
§ 7 投资组合报告	44
7.1 期末基金资产组合情况	44
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	45
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	45
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	45
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	45
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	46

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	46
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	46
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	46
7.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	46
7.11 投资组合报告附注	46
§ 8 基金份额持有人信息	48
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	48
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
§ 9 开放式基金份额变动	49
§ 10 重大事件揭示	49
10.1 基金份额持有人大会决议	49
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	49
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	51
§ 11 影响投资者决策的其他重要信息	52
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	52
11.2 影响投资者决策的其他重要信息	53
§ 12 备查文件目录	53
12.1 备查文件目录	53
12.2 存放地点	53
12.3 查阅方式	53

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	大成安诚债券型证券投资基金	
基金简称	大成安诚债券	
基金主代码	009396	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2020 年 11 月 4 日	
基金管理人	大成基金管理有限公司	
基金托管人	中国邮政储蓄银行股份有限公司	
报告期末基金份 额总额	11,489,443,082.58 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基 金简称	大成安诚债券 A	大成安诚债券 C
下属分级基金的交 易代码	009396	009397
报告期末下属分级 基金的份额总额	10,623,803,274.81 份	865,639,807.77 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	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。
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。

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	中国邮政储蓄银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	段皓静
	联系电话	0755-83183388
	电子邮箱	office@dcfund.com.cn
客户服务电话	4008885558	95580
传真	0755-83199588	010-68858120
注册地址	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	北京市西城区金融大街 3 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、	北京市西城区金融大街 3 号 A 座

	27-33 层	
邮政编码	518054	100808
法定代表人	吴庆斌	刘建军

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(2022 年 01 月 01 日-2022 年 06 月 30 日)		
	大成安诚债券 A	大成安诚债券 C	
本期已实现收益	142,582,052.49	2,189,914.20	
本期利润	116,200,802.97	2,604,933.43	
加权平均基金份额本期利润	0.0118	0.0177	
本期加权平均净值利润率	1.16%	1.70%	
本期基金份额净值增长率	1.34%	1.25%	
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2022 年 6 月 30 日)		
	期末可供分配利润	140,379,811.78	32,955,748.80
	期末可供分配基金份额利润	0.0132	0.0381
	期末基金资产净值	10,810,572,581.99	902,434,727.60
	期末基金份额净值	1.0176	1.0425

值		
3.1.3 累计期末指标	报告期末 (2022 年 6 月 30 日)	
基金份额累计净值增长率	7.47%	7.95%

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

大成安诚债券 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	0.10%	0.04%	-0.24%	0.03%	0.34%	0.01%
过去三个月	0.80%	0.04%	0.29%	0.04%	0.51%	0.00%
过去六个月	1.34%	0.05%	0.38%	0.05%	0.96%	0.00%
过去一年	3.40%	0.04%	1.83%	0.05%	1.57%	-0.01%
自基金合同生效起至今	7.47%	0.11%	2.90%	0.05%	4.57%	0.06%

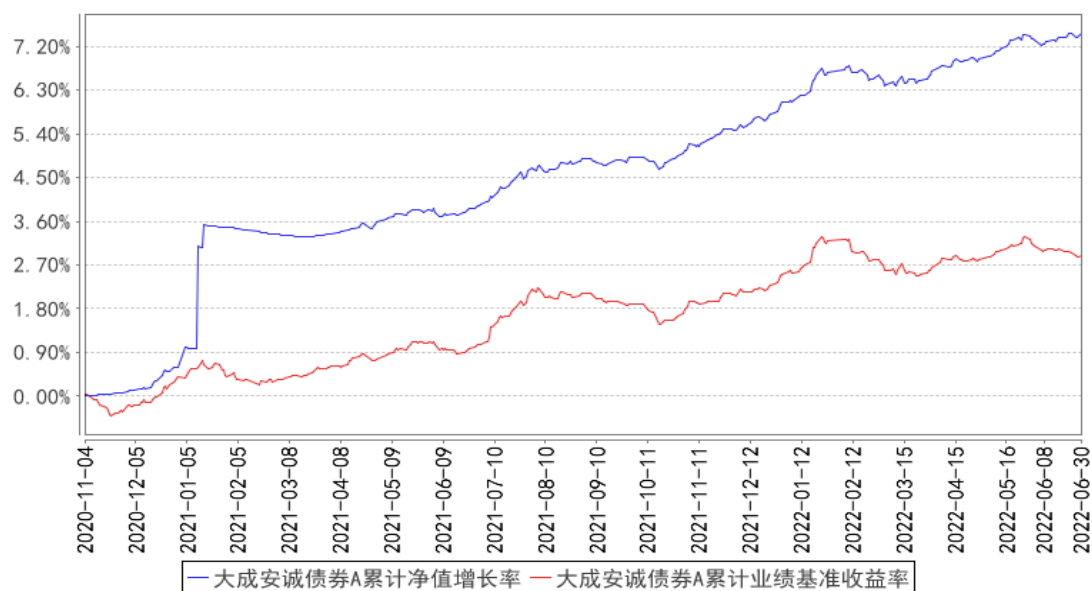
大成安诚债券 C

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	0.10%	0.04%	-0.24%	0.03%	0.34%	0.01%

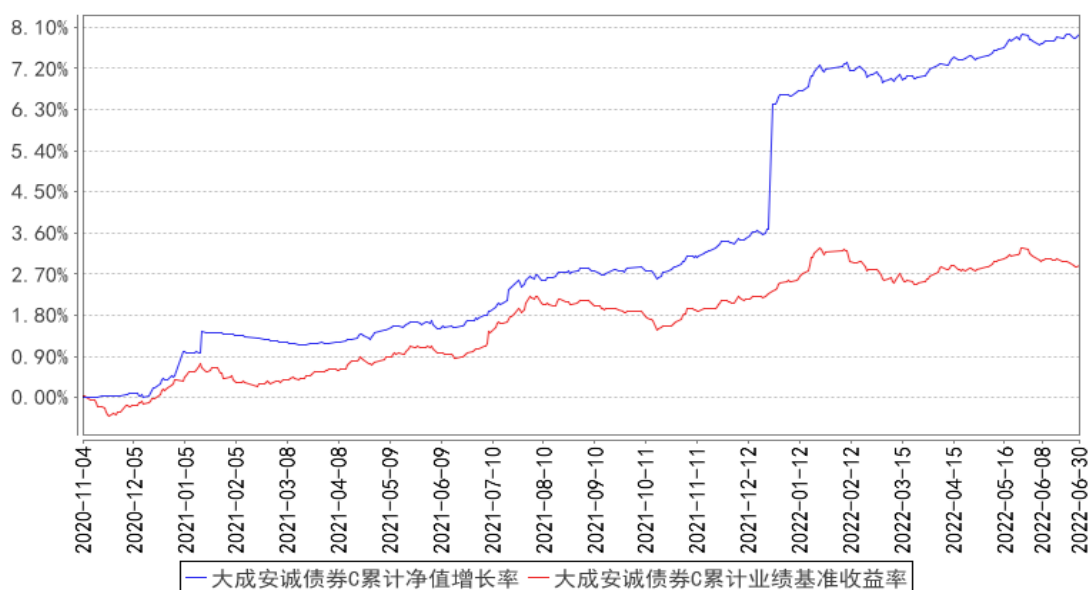
过去三个月	0.77%	0.04%	0.29%	0.04%	0.48%	0.00%
过去六个月	1.25%	0.05%	0.38%	0.05%	0.87%	0.00%
过去一年	6.11%	0.17%	1.83%	0.05%	4.28%	0.12%
自基金合同生效起 至今	7.95%	0.14%	2.90%	0.05%	5.05%	0.09%

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

大成安诚债券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



大成安诚债券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23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		
方锐	本基金基	2021年6	-	6年	北京大学经济学硕士。2015年7月至2016

	金经理	月 4 日			<p>年 11 月就职于中国人民银行深圳市中心支行，任货币信贷管理处科员。2016 年 11 月加入大成基金管理有限公司，先后担任固定收益总部助理研究员、基金经理。2018 年 11 月 6 日起任大成惠明定期开放纯债债券型证券投资基金、大成景荣债券型证券投资基金基金经理助理。2018 年 12 月 28 日起任大成价值增长证券投资基金基金经理助理。2020 年 11 月 6 日起任大成睿鑫股票型证券投资基金、大成高新技术产业股票型证券投资基金、大成睿裕六个月持有期股票型证券投资基金、大成互联网思维混合型证券投资基金基金经理助理。2018 年 12 月 28 日至 2020 年 9 月 7 日任大成景旭纯债债券型证券投资基金基金经理助理。2021 年 7 月 29 日起任大成消费精选股票型证券投资基金基金经理助理。2022 年 4 月 21 日起任大成专精特新混合型证券投资基金、大成悦享生活混合型证券投资基金、大成医药健康股票型证券投资基金、大成成长回报六个月持有期混合型证券投资基金、大成核心价值甄选混合型证券投资基金基金经理助理。2020 年 9 月 7 日起任大成彭博农发行债券 1-3 年指数证券投资基金、大成景旭纯债债券型证券投资基金基金经理。2020 年 10 月 30 日起任大成中债 1-3 年国开行债券指数证券投资基金基金经理。2021 年 6 月 4 月起任大成安诚债券型证券投资基金基金经理。2022 年 6 月 2 日起任大成景盈债券型证券投资基金基金经理。2022 年 7 月 27 日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。具备基金从业资格。国籍：中国</p>
方孝成	本基金基金经理	2020 年 11 月 4 日	2022 年 2 月 25 日	16 年	<p>中国人民大学经济学硕士。2000 年 7 月至 2001 年 12 月任新华社参编部编辑。2002 年 1 月至 2005 年 12 月任 J.D. Power (MacGraw Hill 集团成员) 市场研究部分析师。2006 年 1 月至 2009 年 1 月任大公国际资信评估有限公司金融机构部副总经理。2009 年 2 月至 2011 年 1 月任合众人寿保险股份有限公司风险管理部信用评级室主任。2011 年 2 月至 2015 年 9 月任合众资产管理股份有限公司固定收益投资部投资经理。2015 年 9 月至 2017 年 7 月任</p>

				<p>光大永明资产管理股份有限公司固定收益投资部执行总经理。2017 年 7 月加入大成基金管理有限公司。2017 年 11 月 8 日至 2020 年 10 月 29 日任大成景旭纯债债券型证券投资基金基金经理。2018 年 1 月 23 日至 2019 年 9 月 29 日任大成现金增利货币市场基金基金经理。2018 年 3 月 23 日至 2019 年 9 月 29 日任大成慧成货币市场基金基金经理。2018 年 8 月 28 日起任大成惠利纯债债券型证券投资基金基金经理。2018 年 12 月 27 日至今任大成惠明纯债债券型证券投资基金（原大成惠明定期开放纯债债券型证券投资基金）基金经理。2019 年 6 月 24 日至 2020 年 9 月 18 日任大成景盈债券型证券投资基金基金经理。2019 年 6 月 27 日起任大成中债 3-5 年国开行债券指数证券投资基金基金经理。2019 年 7 月 31 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 3 月 11 日至 2021 年 4 月 12 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 9 月 1 日至 2021 年 9 月 24 日任大成景轩中高等级债券型证券投资基金基金经理。2020 年 9 月 4 日至 2021 年 4 月 16 日任大成彭博巴克莱政策性银行债券 3-5 年指数证券投资基金基金经理。2020 年 11 月 4 日至 2022 年 2 月 25 日任大成安诚债券型证券投资基金基金经理。2020 年 12 月 9 日至 2022 年 5 月 19 日任大成惠嘉一年定期开放债券型证券投资基金基金经理。2021 年 3 月 29 日至 2022 年 5 月 19 日任大成彭博农发行债券 1-3 年指数证券投资基金基金经理。2021 年 11 月 3 日起任大成景荣债券型证券投资基金基金经理。2022 年 2 月 15 日起任大成惠信一年定期开放债券型发起式证券投资基金基金经理。2022 年 5 月 19 日起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。具备基金从业资格。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。

4.1.3 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，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存在 1 笔同日反向交易，原因为投资策略需要。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 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

2022 年上半年，宏观和政策层面仍然跌宕起伏。年初经济增长延续了去年下半年的下行压力，宽货币的预期较强，1 月央行调低政策利率点燃了市场做多情绪，市场处于较为火热状态。随后 1 月的信贷和社融数据较好，叠加 5.5% 的全年增长目标，使得市场的天平重新转向稳增长，收益率也出现了较为明显的调整。进入 3 月份，由于奥密克戎的隐匿性和高传染性，疫情开始在多个城

市爆发，特别是 4 月之后上海疫情较为严重，经济几乎处于停摆状态，稳增长的压力陡然上升，货币政策维持宽松。4 月央行降准后，资金面持续维持宽松，债市收益率重新转为下行。进入 5 月下旬之后，国内疫情有显著好转，复产复工顺利推荐，市场关注的焦点重新转向稳增长政策的落地，债市收益率也重新迎来调整。

展望上半年，尽管收益率的走势一波三折，但债市整体波动幅度不大，10 年国债基本在 2.65%-2.9% 区间波动，中短端债券的波动幅度也基本在 50bp 以内，经历了 2020 年市场的学习效应，疫情对于债市的冲击明显减弱。

因此对于投资者而言，今年上半年波段交易空间变小，需要更专注确定性收益，提升组合的风险收益比。我们认为在震荡市中，中短期限的利率债风险可控，且具备不错的票息收益和骑乘收益，性价比相对较高。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。2022 年上半年本基金主动管理组合大类资产配置，积极把握 1.5-3 年期利率债的配置机会。同时，在资金面较为宽松的背景下，适度加杠杆以增强收益。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末大成安诚债券 A 的基金份额净值为 1.0176 元，本报告期基金份额净值增长率为 1.34%，同期业绩比较基准收益率为 0.38%；截至本报告期末大成安诚债券 C 的基金份额净值为 1.0425 元，本报告期基金份额净值增长率为 1.25%，同期业绩比较基准收益率为 0.38%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望下半年，我们认为经济重启后面临再闯关，多重压力仍在，复苏的空间仍有待观察。5 月下旬以来国内疫情好转，复产复工顺利推进，宏观政策加速落地，疫情防控更加精准有序。从过去经验来看，全面复工复产阶段经济的环比增速多数强于季节性水平，近期地产销售、汽车销售等终端需求端指标均有所回暖，经济周期将从疫情冲击下的衰退阶段迈向疫后复苏阶段。短期内在复工复产、政策落地的主线之下，3 季度经济环比向上具有确定性，不过中期而言经济依旧面临多重压力。当前我国经济仍面临外需放缓、库存高企、居民预期转弱等中期问题，度过环比修复阶段后经济的内生动能仍受到约束，增长动能仍显著低于 2020 年下半年-2021 年上半年。因此，政策仍将为经济保驾护航，虽然下半年政策面临通胀上行、外部紧缩等多重约束，但宏观政策仍有望保持积极，在多重约束下探寻空间。货币政策稳中偏松，流动性保持合理充裕，结构性政策做好加法；财政政策通过大规模留抵退税、以及加快财政支出进度的方式稳定宏观经济大盘，下半年增量政策仍有望相继决策推出。

在此背景下，我们认为下半年债市仍然不会显著摆脱区间震荡行情，趋势性机会空间有限。三季度利率超预期下行的风险主要来自疫情的反复、海外衰退提前、民企房地产系统性风险，利

率超预期上行的风险主要来自通胀加剧、政策超预期调整。具体到策略方面，我们认为杠杆策略仍然有效，久期策略灵活，稳健前提下积小胜为大胜。杠杆策略方面，全年来看仍然有效，但要选择合适的加杠杆时点。久期策略方面，建议保持区间震荡思路，快进快出，注意对赔率保护的要求。今年行情相对有限，保持稳健的前提下，积小胜为大胜，保障组合的骑乘策略和稳健收益。

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、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七名投资组合经理。

股票投资部、固定收益总部、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。本报告期内大成安诚债券 A 已

分配利润 218,233,986.69 元、大成安诚债券 C 已分配利润 575,057.97 元（A 类每十份基金份额分红 0.20 元，C 类每十份基金份额分红 0.20 元），符合基金合同规定的分红比例。

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，中国邮政储蓄银行股份有限公司（以下称“本托管人”）在大成安诚证券投资基金（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。

本报告期内，本基金共进行利润分配 21,880.90 万元。

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、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：大成安诚债券型证券投资基金

报告截止日：2022 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2022 年 6 月 30 日	上年度末 2021 年 12 月 31 日
资产：			
银行存款	6.4.7.1	18,397,941.63	3,384,953.00
结算备付金		-	-
存出保证金		-	-
交易性金融资产	6.4.7.2	11,698,205,773.67	9,140,708,000.00

其中：股票投资		-	-
基金投资		-	-
债券投资		11,698,205,773.67	9,140,708,000.00
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		-	-
应收股利		-	-
应收申购款		200.00	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.8	-	185,202,009.97
资产总计		11,716,603,915.30	9,329,294,962.97
负债和净资产	附注号	本期末 2022年6月30日	上年度末 2021年12月31日
负 债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	846,013,709.99
应付清算款		-	-
应付赎回款		416.76	-
应付管理人报酬		2,466,264.40	1,666,765.17
应付托管费		822,088.14	555,588.40
应付销售服务费		22,712.35	307.05
应付投资顾问费		-	-
应交税费		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.9	285,124.06	423,522.81
负债合计		3,596,605.71	848,659,893.42
净资产：			
实收基金	6.4.7.10	11,489,443,082.58	8,275,945,445.43
其他综合收益	6.4.7.11	-	-
未分配利润	6.4.7.12	223,564,227.01	204,689,624.12
净资产合计		11,713,007,309.59	8,480,635,069.55
负债和净资产总计		11,716,603,915.30	9,329,294,962.97

注：报告截止日 2022 年 06 月 30 日，基金份额总额 11,489,443,082.58 份，其中大成安诚债券 A 基金份额总额为 10,623,803,274.81 份，基金份额净值 1.0176 元。大成安诚债券 C 基金份额总额为 865,639,807.77 份，基金份额净值 1.0425 元。

6.2 利润表

会计主体：大成安诚债券型证券投资基金

本报告期：2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
一、营业总收入		144,299,685.18	8,507,047.49
1. 利息收入		595,140.55	4,589,503.13
其中：存款利息收入	6.4.7.13	30,647.39	12,376.39
债券利息收入		-	4,339,042.77
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		564,493.16	238,083.97
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		169,668,819.71	-105,722.73
其中：股票投资收益	6.4.7.14	-	-
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.15	169,668,819.71	-105,722.73
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	-	-
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	-25,966,230.29	4,022,762.73
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	1,955.21	504.36
减：二、营业总支出		25,493,948.78	736,389.70
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	15,139,602.77	441,951.38

2. 托管费	6.4.10.2.2	5,046,534.32	147,317.08
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	73,671.18	5,538.49
4. 投资顾问费		-	-
5. 利息支出		5,086,568.18	52,250.27
其中：卖出回购金融资产支出		5,086,568.18	52,250.27
6. 信用减值损失	6.4.7.22	-	-
7. 税金及附加		-	-
8. 其他费用	6.4.7.23	147,572.33	89,332.48
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		118,805,736.40	7,770,657.79
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		118,805,736.40	7,770,657.79
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		118,805,736.40	7,770,657.79

6.3 净资产（基金净值）变动表

会计主体：大成安诚债券型证券投资基金

本报告期：2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 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)	8,275,945,445.43	-	204,689,624.12	8,480,635,069.55
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)	8,275,945,445.43	-	204,689,624.12	8,480,635,069.55
三、本期增减变动额(减)	3,213,497,637.15	-	18,874,602.89	3,232,372,240.04

少以“-”号填列)				
(一)、综合收益总额	-	-	118,805,736.40	118,805,736.40
(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)	3,213,497,637.15	-	118,877,911.15	3,332,375,548.30
其中:1.基金申购款	7,035,156,158.11	-	187,255,322.33	7,222,411,480.44
2.基金赎回款	-3,821,658,520.96	-	-68,377,411.18	-3,890,035,932.14
(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)	-	-	-218,809,044.66	-218,809,044.66
(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)	11,489,443,082.58	-	223,564,227.01	11,713,007,309.59
项目	上年度可比期间 2021年1月1日至2021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)	511,625.96	-	2,996.28	514,622.24
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)	511,625.96	-	2,996.28	514,622.24
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	4,379,143,787.91	-	158,973,692.01	4,538,117,479.92
(一)、综合收益总额	-	-	7,770,657.79	7,770,657.79
(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)	4,379,143,787.91	-	151,203,034.22	4,530,346,822.13
其中:1.基金申购款	4,394,478,101.66	-	151,385,923.78	4,545,864,025.44
2.基金赎回款	-15,334,313.75	-	-182,889.56	-15,517,203.31
(三)、本期向基金份额	-	-	-	-

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、本期末净资产(基金净值)	4,379,655,413.87	-	158,976,688.29	4,538,632,102.16

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：

<u>谭晓冈</u>	<u>范瑛</u>	<u>孙蕊</u>
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 基金基本情况

大成安诚债券型证券投资基金(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”)证监许可[2020]第 473 号《关于准予大成安诚债券型证券投资基金注册的批复》核准,由大成基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《大成安诚债券型证券投资基金基金合同》负责公开募集。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 205,120,200.39 元,业经普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)普华永道中天验字(2020)第 0786 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《大成安诚债券型证券投资基金基金合同》于 2020 年 11 月 4 日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为 205,123,911.59 份基金份额,其中认购资金利息折合 3,711.20 份基金份额。本基金的基金管理人为大成基金管理有限公司,基金托管人为中国邮政储蓄银行股份有限公司。

根据《大成安诚债券型证券投资基金基金合同》和《大成安诚债券型证券投资基金招募说明书》的有关规定,本基金根据认购/申购费用、销售服务费收取方式的不同,将基金份额分为不同

的类别。其中 A 类基金份额为在投资人认购/申购时收取认购/申购费用，而不从本类别基金资产中计提销售服务费的基金份额；C 类基金份额为在投资人认购/申购时不收取认购/申购费用，而从本类别基金资产中计提销售服务费。本基金 A 类基金份额和 C 类基金份额分别设置基金代码并分别计算基金份额净值。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《大成安诚债券型证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金的投资范围本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行和上市交易的国债、央行票据、金融债券、债券回购、银行存款(包括协议存款、定期存款及其他银行存款)、同业存单、货币市场工具以及经中国证监会允许基金投资的其他金融工具，但需符合中国证监会的相关规定。本基金不参与股票、可转债、可交换债、国债期货，也不参与除金融债券以外的信用债投资。本基金的投资组合比例为：本基金投资于债券资产比例不低于基金资产的 80%。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%。本基金的业绩比较基准为：中债综合全价指数收益率。

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》、各项具体会计准则及相关规定(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》、《大成安诚债券型证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 2022 年 6 月 30 日的财务状况以及自 2022 年 1 月 1 日起至 2022 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

除下文中涉及的变更外，本基金本报告期所采用的其他会计政策、会计估计与最近一期年度会计报表所采用的会计政策、会计估计一致。

一、金融资产和金融负债的分类

新金融工具准则

金融工具，是指形成一方的金融资产并形成其他方的金融负债或权益工具的合同。当本基金成为金融工具合同的一方时，确认相关的金融资产或金融负债。

(1) 金融资产

金融资产于初始确认时分类为：以摊余成本计量的金融资产、以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产及以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。金融资产的分类取决于本基金管理金融资产的商业模式和金融资产的合同现金流量特征。本基金现无金融资产分类为以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产。

债务工具

本基金持有的债务工具是指从发行方角度分析符合金融负债定义的工具，分别采用以下两种方式进行计量：

以摊余成本计量：

本基金管理以摊余成本计量的金融资产的商业模式为以收取合同现金流量为目标，且以摊余成本计量的金融资产的合同现金流量特征与基本借贷安排相一致，即在特定日期产生的现金流量，仅为对本金和以未偿付本金金额为基础的利息的支付。本基金持有的以摊余成本计量的金融资产主要为银行存款、买入返售金融资产和其他各类应收款项等。

以公允价值计量且其变动计入当期损益：

本基金将持有的未划分为以摊余成本计量的债务工具，以公允价值计量且其变动计入当期损益。本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产主要为债券投资，在资产负债表中以交易性金融资产列示。

(2) 金融负债

金融负债于初始确认时分类为以摊余成本计量的金融负债和以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。本基金目前暂无金融负债分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。本基金持有的以摊余成本计量的金融负债包括卖出回购金融资产款和其他各类应付款项等。原金融工具准则(截至 2021 年 12 月 31 日前适用的原金融工具准则)

本基金于 2022 年 1 月 1 日起执行新金融工具准则，但选择不重述比较信息。因此，比较信息继续适用本基金以前年度的如下会计政策。

(1) 金融资产的分类

金融资产于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、应收款项、可供出售金融资产及持有至到期投资。金融资产的分类取决于本基金对金融资产的持有意图和持有能力。本基金现无金融资产分类为可供出售金融资产及持有至到期投资。

本基金目前以交易目的持有的债券投资分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在资产负债表中以交易性金融资产列示。

本基金持有的其他金融资产分类为应收款项，包括银行存款、买入返售金融资产和其他各类应收款项等。应收款项是指在活跃市场中没有报价、回收金额固定或可确定的非衍生金融资产。

(2) 金融负债的分类

金融负债于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债及其他金融负债。本基金目前暂无金融负债分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。本基金持有的其他金融负债包括卖出回购金融资产款和其他各类应付款项等。

二、金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

新金融工具准则

金融资产或金融负债在初始确认时以公允价值计量。对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和金融负债，相关交易费用计入当期损益；对于支付的价款中包含的债券起息日或上次除息日至购买日止的利息，确认为应计利息，包含在交易性金融资产的账面价值中。对于其他类别的金融资产和金融负债，相关交易费用计入初始确认金额。

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，按照公允价值进行后续计量；对于应收款项和其他金融负债采用实际利率法，以摊余成本进行后续计量。

本基金对于以摊余成本计量的金融资产，以预期信用损失为基础确认损失准备。

本基金考虑有关过去事项、当前状况以及对未来经济状况的预测等合理且有依据的信息，以发生违约的风险为权重，计算合同应收的现金流量与预期能收到的现金流量之间差额的现值的概率加权金额，确认预期信用损失。

于每个资产负债表日，本基金对于处于不同阶段的金融工具的预期信用损失分别进行计量。金融工具自初始确认后信用风险未显著增加的，处于第一阶段，本基金按照未来 12 个月内的预期信用损失计量损失准备；金融工具自初始确认后信用风险已显著增加但尚未发生信用减值的，处于第二阶段，本基金按照该工具整个存续期的预期信用损失计量损失准备；金融工具自初始确认后已经发生信用减值的，处于第三阶段，本基金按照该工具整个存续期的预期信用损失计量损失准备。

对于在资产负债表日具有较低信用风险的金融工具，本基金假设其信用风险自初始确认后并未显著增加，认定为处于第一阶段的金融工具，按照未来 12 个月内的预期信用损失计量损失准备。

本基金对于处于第一阶段和第二阶段的金融工具，按照其未扣除减值准备的账面余额和实际利率计算利息收入。对于处于第三阶段的金融工具，按照其账面余额减已计提减值准备后的摊余成本和实际利率计算利息收入。

对于其他各类应收款项，无论是否存在重大融资成分，本基金均按照整个存续期的预期信用

损失计量损失准备。

本基金将计提或转回的损失准备计入当期损益。

金融资产满足下列条件之一的，予以终止确认：(1) 收取该金融资产现金流量的合同权利终止；(2) 该金融资产已转移，且本基金将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方；或者(3) 该金融资产已转移，虽然本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬，但是放弃了对该金融资产控制。

金融资产终止确认时，其账面价值与收到的对价的差额，计入当期损益。

当金融负债的现时义务全部或部分已经解除时，终止确认该金融负债或义务已解除的部分。终止确认部分的账面价值与支付的对价之间的差额，计入当期损益。

原金融工具准则(截至 2021 年 12 月 31 日前适用的原金融工具准则)

本基金于 2022 年 1 月 1 日起执行新金融工具准则，但选择不重述比较信息。因此，比较信息继续适用本基金以前年度的如下会计政策。

金融资产或金融负债于本基金成为金融工具合同的一方时，按公允价值在资产负债表内确认。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，取得时发生的相关交易费用计入当期损益；对于支付的价款中包含的债券起息日或上次除息日至购买日止的利息，单独确认为应收项目。应收款项和其他金融负债的相关交易费用计入初始确认金额。

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，按照公允价值进行后续计量；对于应收款项和其他金融负债采用实际利率法，以摊余成本进行后续计量。

金融资产满足下列条件之一的，予以终止确认：(1) 收取该金融资产现金流量的合同权利终止；(2) 该金融资产已转移，且本基金将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方；或者(3) 该金融资产已转移，虽然本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬，但是放弃了对该金融资产控制。

金融资产终止确认时，其账面价值与收到的对价的差额，计入当期损益。

当金融负债的现时义务全部或部分已经解除时，终止确认该金融负债或义务已解除的部分。终止确认部分的账面价值与支付的对价之间的差额，计入当期损益。

三、收入/(损失)的确认和计量

新金融工具准则

股票投资在持有期间应取得的现金股利扣除由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额确认为投资收益。债券投资在持有期间应取得的按票面利率(对于贴现债为按发行价计算的利率)或合同利率计算的利息扣除在适用情况下由债券发行企业代扣代缴的个人所得税及由基金管理人缴纳

的增值税后的净额确认为投资收益。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在持有期间的公允价值变动确认为公允价值变动损益；于处置时，其处置价格与初始确认金额之间的差额扣除相关交易费用后的净额确认为投资收益，其中包括从公允价值变动损益结转的公允价值累计变动额。

应收款项在持有期间确认的利息收入按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

原金融工具准则(截至 2021 年 12 月 31 日前适用的原金融工具准则)

本基金于 2022 年 1 月 1 日起执行新金融工具准则，但选择不重述比较信息。因此，比较信息继续适用本基金以前年度的如下会计政策。

债券投资在持有期间应取得的按票面利率或者发行价计算的利息扣除在适用情况下由债券发行企业代扣代缴的个人所得税及由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为利息收入。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在持有期间的公允价值变动确认为公允价值变动损益；于处置时，其处置价格与初始确认金额之间的差额确认为投资收益，其中包括从公允价值变动损益结转的公允价值累计变动额。

应收款项在持有期间确认的利息收入按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

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

财政部于 2017 年颁布了修订后的《企业会计准则第 22 号——金融工具确认和计量》、《企业会计准则第 23 号——金融资产转移》、《企业会计准则第 24 号——套期会计》及《企业会计准则第 37 号——金融工具列报》(以下合称“新金融工具准则”)，财政部、中国银行保险监督管理委员会于 2020 年 12 月 30 日发布了《关于进一步贯彻落实新金融工具相关会计准则的通知》，公募证券投资基金自 2022 年 1 月 1 日起执行新金融工具准则。此外，中国证监会于 2022 年颁布了修订后的《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>》，本基金的基金管理人已采用上述准则及通知编制本基金财务报表，对本基金财务报表的影响列示如下：

(a) 金融工具

根据新金融工具准则的相关规定，本基金对于首次执行该准则的累积影响数调整 2022 年年初留存收益以及财务报表其他相关项目金额，2021 年度的比较财务报表未重列。于 2021 年 12 月 31 日及 2022 年 1 月 1 日，本基金均没有指定为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。

(i) 于 2022 年 1 月 1 日，本财务报表中金融资产和金融负债按照原金融工具准则和新金融工

具准则的规定进行分类和计量的结果对比表：

原金融工具准则下以摊余成本计量的金融资产为银行存款和应收利息，金额分别为 3,384,953.00 元和 185,202,009.97 元。新金融工具准则下以摊余成本计量的金融资产为银行存款和其他资产-应收利息，金额分别为 3,386,659.10 元和 0.00 元。

原金融工具准则下以公允价值计量且其变动计入当期损益计量的金融资产为交易性金融资产，金额为 9,140,708,000.00 元。新金融工具准则下以公允价值计量且其变动计入当期损益计量的金融资产为交易性金融资产，金额为 9,325,908,303.87 元。

原金融工具准则下以摊余成本计量的金融负债为卖出回购金融资产款、应付管理人报酬、应付托管费、应付销售服务费、应付交易费用和应付利息，金额分别为 846,013,709.99 元、1,666,765.17 元、555,588.40 元、307.05 元、129,078.25 元和 150,144.56 元。新金融工具准则下以摊余成本计量的金融负债为卖出回购金融资产款、应付管理人报酬、应付托管费、应付销售服务费、其他负债-应付交易费用和其他负债-应付利息，金额分别为 846,163,854.55 元、1,666,765.17 元、555,588.40 元、307.05 元、129,078.25 元和 0.00 元。

i) 于 2021 年 12 月 31 日，本基金持有的“银行存款”、“结算备付金”、“存出保证金”、“交易性金融资产”、“买入返售金融资产”、“卖出回购金融资产款”等对应的应计利息余额均列示在“应收利息”或“应付利息”科目中。于 2022 年 1 月 1 日，本基金根据新金融工具准则下的计量类别，将上述应计利息分别转入“银行存款”、“结算备付金”、“存出保证金”、“交易性金融资产”、“买入返售金融资产”、“卖出回购金融资产款”等科目项下列示，无期初留存收益影响。

(b) 修订后的《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>》

根据中国证监会于 2022 年颁布的修订后的《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>》，本基金的基金管理人在编制本财务报表时调整了部分财务报表科目的列报和披露，这些调整未对本基金财务报表产生重大影响。

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[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。

对证券投资基金管理人运用基金买卖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，包括买卖债券的差价收入，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。

(4) 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 2022 年 6 月 30 日
活期存款	18,397,941.63
等于：本金	18,396,582.42
加：应计利息	1,359.21
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	18,397,941.63

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2022年6月30日				
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动	
股票	-	-	-	-	
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	-	
债券	交易所市场	-	-	-	
	银行间市场	11,515,355,521.04	175,253,773.67	11,698,205,773.67	7,596,478.96
	合计	11,515,355,521.04	175,253,773.67	11,698,205,773.67	7,596,478.96
资产支持证券	-	-	-	-	
基金	-	-	-	-	
其他	-	-	-	-	
合计	11,515,355,521.04	175,253,773.67	11,698,205,773.67	7,596,478.96	

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 2022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	-
应付交易费用	151,851.73
其中：交易所市场	-
银行间市场	151,851.73

应付利息	-
预提费用	133,272.33
合计	285,124.06

6.4.7.10 实收基金

金额单位：人民币元

大成安诚债券 A

项目	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	8,056,632,655.14	8,056,632,655.14
本期申购	6,198,032,083.90	6,198,032,083.90
本期赎回（以“-”号填列）	-3,630,861,464.23	-3,630,861,464.23
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	10,623,803,274.81	10,623,803,274.81

大成安诚债券 C

项目	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	219,312,790.29	219,312,790.29
本期申购	837,124,074.21	837,124,074.21
本期赎回（以“-”号填列）	-190,797,056.73	-190,797,056.73
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	865,639,807.77	865,639,807.77

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

大成安诚债券 A

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
本期期初	149,246,478.45	44,594,998.88	193,841,477.33
本期利润	142,582,052.49	-26,381,249.52	116,200,802.97
本期基金份额交易产	66,785,267.53	28,175,746.04	94,961,013.57

生的变动数			
其中：基金申购款	107,627,907.05	46,286,216.32	153,914,123.37
基金赎回款	-40,842,639.52	-18,110,470.28	-58,953,109.80
本期已分配利润	-218,233,986.69	-	-218,233,986.69
本期末	140,379,811.78	46,389,495.40	186,769,307.18

大成安诚债券 C

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
本期期初	9,612,755.39	1,235,391.40	10,848,146.79
本期利润	2,189,914.20	415,019.23	2,604,933.43
本期基金份额交易产生的变动数	21,728,137.18	2,188,760.40	23,916,897.58
其中：基金申购款	30,182,729.27	3,158,469.69	33,341,198.96
基金赎回款	-8,454,592.09	-969,709.29	-9,424,301.38
本期已分配利润	-575,057.97	-	-575,057.97
本期末	32,955,748.80	3,839,171.03	36,794,919.83

6.4.7.13 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期
	2022年1月1日至2022年6月30日
活期存款利息收入	30,647.39
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	-
其他	-
合计	30,647.39

6.4.7.14 股票投资收益

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
	2022年1月1日至2022年6月30日
债券投资收益——利息收入	157,126,304.43
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	12,542,515.28
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	169,668,819.71

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 2022年1月1日至2022年6月30日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	16,256,847,249.59
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	16,056,667,949.71
减：应计利息总额	187,444,909.60
减：交易费用	191,875.00
买卖债券差价收入	12,542,515.28

6.4.7.16 资产支持证券投资收益

无。

6.4.7.17 贵金属投资收益

无。

6.4.7.18 衍生工具收益

无。

6.4.7.19 股利收益

无。

6.4.7.20 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2022年1月1日至2022年6月30日
1. 交易性金融资产	-25,966,230.29
股票投资	-
债券投资	-25,966,230.29
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	-25,966,230.29
----	----------------

6.4.7.21 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
基金赎回费收入	1,955.21
合计	1,955.21

注：本基金对投资人收取的赎回费，将全额计入基金资产。

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 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
审计费用	69,464.96
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
账户维护费	18,600.00
合计	147,572.33

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

本基金的基金管理人于 2022 年 7 月 8 日宣告 2022 年度第 2 次分红，向截至 2022 年 7 月 12 日止在本基金注册登记人大成基金管理有限公司登记在册的全体持有人，A 类基金按每 10 份基金份额派发红利 0.1000 元，C 类基金按每 10 份基金份额派发红利 0.1000 元。

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者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

中国邮政储蓄银行股份有限公司（“中国邮政储蓄银行”）	基金托管人
----------------------------	-------

注：以下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

无。

6.4.10.1.2 债券交易

无。

6.4.10.1.3 债券回购交易

无。

6.4.10.1.4 权证交易

无。

6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

无。

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 2022年1月1日至2022年6月30日	上年度可比期间 2021年1月1日至2021年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	15,139,602.77	441,951.38
其中：支付销售机构的客户维护费	80.97	1,480.45

注：本基金的管理费按前一日基金资产净值的0.30%年费率计提。管理费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.30\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计提，按月支付。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日	2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	5,046,534.32	147,317.08

注：本基金的托管费按前一日基金资产净值的 0.10% 的年费率计提。托管费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.10\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计提，按月支付。

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		
	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		
	大成安诚债券 A	大成安诚债券 C	合计
大成基金	-	73,607.47	73,607.47
合计	-	73,607.47	73,607.47
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间		
	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		
	大成安诚债券 A	大成安诚债券 C	合计
大成基金	-	2,248.58	2,248.58
合计	-	2,248.58	2,248.58

注：本基金 A 类基金份额不收取销售服务费。C 类基金份额的销售服务费按前一日 C 类基金资产净值的 0.10% 年费率计提，计算方法如下：

$$H = E \times 0.10\% \div \text{当年天数}$$

H 为 C 类基金份额每日应计提的销售服务费

E 为 C 类基金份额前一日基金资产净值

C 类基金份额销售服务费每日计提，按月支付。

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

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
邮政储蓄银行	-	-	-	-	3,228,500,000.00	420,249.80
上年度可比期间 2021 年 1 月 1 日至 2021 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
邮政储蓄银行	-	-	-	-	100,088,000.00	10,732.89

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 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
	大成安诚债券 A	大成安诚债券 C
基金合同生效日（2020 年 11 月 4 日）持有的基金份额	-	-
报告期初持有的基金份额	15,488,469.47	-
报告期间申购/买入总份额	0.00	-
报告期间因拆分变动份额	-	-
减：报告期间赎回/卖出总份额	15,488,469.47	-
报告期末持有的基金份额	0.00	-
报告期末持有的基金份额 占基金总份额比例	0.00%	-

项目	上年度可比期间 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
	大成安诚债券 A	大成安诚债券 C
基金合同生效日（2020 年 11 月 4 日）持有的基金份额	-	-
报告期初持有的基金份额	0.00	0.00
报告期间申购/买入总份额	33,960,419.72	792,314.55
报告期间因拆分变动份额	0.00	0.00
减：报告期间赎回/卖出总份 额	0.00	0.00
报告期末持有的基金份额	33,960,419.72	792,314.55
报告期末持有的基金份额 占基金总份额比例	0.78%	0.02%

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

份额单位：份

大成安诚债券 A

关联方名称	本期末 2022 年 6 月 30 日		上年度末 2021 年 12 月 31 日	
	持有的 基金份额	持有的基金份额 占基金总份 额的比例（%）	持有的 基金份额	持有的基金份额 占基金总份 额的比例（%）
中国邮政储蓄银行股 份有限公司	5,324,764,037.82	46.3400	2,399,917,807.63	29.0000

于本期末，持有的基金份额占基金总份额的比例计算中，分母采用本基金基金份额总额计算。

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 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2021 年 1 月 1 日至 2021 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
邮政储蓄银行	18,397,941.63	30,647.39	4,318,622.25	6,879.81

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

单位：人民币元

大成安诚债券 A								
序号	权益 登记日	除息日		每 10 份基 金份额分红 数	现金形式 发放总额	再投资形式 发放总额	本期利润 分配合计	备注
		场内	场外					
1	2022 年 3 月 21 日	-	2022 年 3 月 21 日	0.2000	216,278, 779.42	1,955,207. 27	218,233, 986.69	-
合计	-	-	-	0.2000	216,278, 779.42	1,955,207. 27	218,233, 986.69	-
大成安诚债券 C								
序号	权益 登记日	除息日		每 10 份基 金份额分红 数	现金形式 发放总额	再投资形式 发放总额	本期利润 分配合计	备注
		场内	场外					
1	2022 年 3 月 21 日	-	2022 年 3 月 21 日	0.2000	575,044. 99	12.98	575,057. 97	-
合计	-	-	-	0.2000	575,044. 99	12.98	575,057. 97	-

6.4.12 期末(2022 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

无。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

无。

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。本基金投资的金融工具主要为债券投资。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，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。

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，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。本基金的活期银行存款无定期/协议存款，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。

于本期末，本基金未持有除国债、央行票据和政策性金融债以外的债券。（上年度末：同）

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未来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 2022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	18,397,941.63	-	-	-	18,397,941.63
交易性金融资产	1,299,643,705.16	10,398,562,068.51	-	-	11,698,205,773.67
应收申购款	-	-	-	200.00	200.00
资产总计	1,318,041,646.79	10,398,562,068.51	-	200.00	11,716,603,915.30
负债					
应付赎回款	-	-	-	416.76	416.76
应付管理人报酬	-	-	-	2,466,264.40	2,466,264.40
应付托管费	-	-	-	822,088.14	822,088.14
应付销售服务费	-	-	-	22,712.35	22,712.35
其他负债	-	-	-	285,124.06	285,124.06
负债总计	-	-	-	3,596,605.71	3,596,605.71
利率敏感度缺口	1,318,041,646.79	10,398,562,068.51	-	-3,596,405.71	11,713,007,309.59
上年度末 2021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	3,384,953.00	-	-	-	3,384,953.00
交易性金融资产	500,646,000.00	8,350,415,000.00	289,647,000.00	-	9,140,708,000.00
其他资产	-	-	-	185,202,009.97	185,202,009.97
资产总计	504,030,953.00	8,350,415,000.00	289,647,000.00	185,202,009.97	9,329,294,962.97
负债					
应付管理人报酬	-	-	-	1,666,765.17	1,666,765.17
应付托管费	-	-	-	555,588.40	555,588.40
卖出回购金融资产款	846,013,709.99	-	-	-	846,013,709.99
应付销售服务费	-	-	-	307.05	307.05
其他负债	-	-	-	423,522.81	423,522.81
负债总计	846,013,709.99	-	-	2,646,183.43	848,659,893.42
利率敏感度缺口	-341,982,756.99	8,350,415,000.00	289,647,000.00	182,555,826.54	8,480,635,069.55

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		
	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（2022年6月30日）	上年度末（2021年12月31日）
分析	市场利率上升 25 个基点	-54,296,856.06	-51,913,761.43
	市场利率下降 25 个基点	54,755,550.88	52,466,481.33

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。本基金持有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固定收益品种，因此无重大其他价格风险。

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

无。

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

无。

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 2022 年 6 月 30 日	上年度末 2021 年 12 月 31 日
第一层次	-	-
第二层次	11,698,205,773.67	9,140,708,000.00
第三层次	-	-
合计	11,698,205,773.67	9,140,708,000.00

6.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

对于公开市场交易的证券等投资，若出现交易不活跃、非公开发行等情况，本基金不会于交易不活跃期间及限售期间将相关投资的公允价值列入第一层次，并根据估值调整中采用的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，确定相关投资的公允价值应属第二层次或第三层次。

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

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	-	-
	其中：股票	-	-
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	11,698,205,773.67	99.84
	其中：债券	11,698,205,773.67	99.84
	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	18,397,941.63	0.16
8	其他各项资产	200.00	0.00
9	合计	11,716,603,915.30	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

无。

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

无。

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

无。

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

无。

7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

无。

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	438,760,342.86	3.75
2	央行票据	-	-
3	金融债券	11,259,445,430.81	96.13
	其中：政策性金融债	11,259,445,430.81	96.13
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	11,698,205,773.67	99.87

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	092118003	21 农发清发 03	9,500,000	977,486,232.88	8.35
2	150218	15 国开 18	8,400,000	891,680,942.47	7.61
3	092218001	22 农发清发 01	8,600,000	865,663,041.10	7.39
4	210402	21 农发 02	8,300,000	849,660,767.12	7.25
5	210313	21 进出 13	7,200,000	736,557,632.88	6.29

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

1、本基金投资的前十名证券中的 21 农发清发 03（092118003.IB）、22 农发清发 01（092218001.IB）、21 农发 02（210402.IB）、20 农发 07（200407.IB）、16 农发 05（160405.IB）、16 农发 17（160417.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 21 进出 13 (210313. IB) 的发行主体中国进出口银行于 2021 年 7 月 13 日因违规投资企业股权等，受到中国银行保险监督管理委员会处罚(银保监罚决字(2021)31 号)，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。

3、本基金投资的前十名证券之一 20 进出 05 (200305. IB) 的发行主体中国进出口银行于 2021 年 7 月 13 日因违规投资企业股权等，受到中国银行保险监督管理委员会处罚(银保监罚决字(2021)31 号)，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。

4、本基金投资的前十名证券之一 15 国开 18 (150218. 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、本基金投资的前十名证券之一 20 国开 08 (200208. 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。

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	-
2	应收清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	200.00
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-

9	合计	200.00
---	----	--------

7.11.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

无。

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 (%)
大成安诚债券 A	14	758,843,091.06	10,623,803,099.45	100.00	175.36	-
大成安诚债券 C	224	3,864,463.43	865,317,488.41	99.96	322,319.36	0.04
合计	238	48,274,970.94	11,489,120,587.86	100.00	322,494.72	0.00

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	大成安诚债券 A	53.87	0.0000
	大成安诚债券 C	62.34	0.0000
	合计	116.21	0.0000

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、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	大成安诚债券 A	0
	大成安诚债券 C	0
	合计	0
本基金基金经理持有本开放式基金	大成安诚债券 A	0
	大成安诚债券 C	0
	合计	0

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	大成安诚债券 A	大成安诚债券 C
基金合同生效日 (2020 年 11 月 4 日) 基金份额总额	70,000,071.13	135,123,840.46
本报告期期初基金份额总额	8,056,632,655.14	219,312,790.29
本报告期基金总申购份额	6,198,032,083.90	837,124,074.21
减：本报告期基金总赎回份额	3,630,861,464.23	190,797,056.73
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	10,623,803,274.81	865,639,807.77

§ 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

1. 根据我司发布的《大成基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告》，经大成基金

管理有限公司第七届董事会第十四次会议审议通过并履行必要程序，自 2022 年 4 月 15 日起，周立新先生因工作安排离任公司副总经理。具体事宜详见公司公告。

2. 根据我司发布的《大成基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告》，经大成基金管理有限公司第七届董事会第十五次会议审议通过并履行必要程序，自 2022 年 6 月 1 日起，赵冰女士担任公司副总经理，段皓静女士担任公司督察长。自同日起赵冰女士离任公司督察长。具体事宜详见公司公告。

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，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 (%)	
广发证券	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：本报告期内本基金新增交易单元：无。本报告期内本基金退租交易单元：无。

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

无。

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	2022年06月30日
2	大成基金管理有限公司关于旗下部分基金增加兴业银行股份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	2022年06月13日
3	大成基金管理有限公司关于旗下部分基金增加北京新浪仓石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	2022年05月17日
4	大成基金管理有限公司关于旗下部分基金增加北京雪球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	2022年05月06日
5	大成安诚债券型证券投资基金 2022 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	2022年04月22日
6	大成基金管理有限公司关于旗下部分基金增加上海天天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	2022年04月06日
7	大成安诚债券型证券投资基金 2021 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	2022年03月29日
8	关于大成安诚债券型证券投资基金恢复大额申购及基金转换转入业务公告	中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站	2022年03月22日
9	大成基金管理有限公司关于大成安诚债券型证券投资基金 2022 年度第 1 次分红的公告	中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站	2022年03月17日
10	关于大成安诚债券型证券投资基金暂停大额申购（含定期定额申购）及基	中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本	2022年03月15日

	金转换转入业务的公告	公司网站	
11	大成安诚债券型证券投资基金(C类份额)基金产品资料概要更新	中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站	2022年03月01日
12	大成安诚债券型证券投资基金(A类份额)基金产品资料概要更新	中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站	2022年03月01日
13	大成安诚债券型证券投资基金更新招募说明书	中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站	2022年03月01日
14	大成安诚债券型证券投资基金变更基金经理公告	中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站	2022年02月26日
15	大成基金管理有限公司关于公司固有资金拟申购旗下偏股型公募基金的公告	中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站	2022年01月27日
16	大成安诚债券型证券投资基金 2021 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	2022年01月21日
17	大成基金管理有限公司关于旗下部分基金增加上海利得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	2022年01月06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	20220324-20220627	1,165,961,365.25	971,777,757.37	0.00	2,137,739,122.62	18.61
	2	20220101-20220630	2,399,917,807.63	2,924,846,230.19	0.00	5,324,764,037.82	46.34
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安诚债券型证券投资基金的文件；
- 2、《大成安诚债券型证券投资基金基金合同》；
- 3、《大成安诚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

2022 年 8 月 30 日