

大成元吉增利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：中国工商银行股份有限公司

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。

基金托管人中国工商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	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	13
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	14
§ 5 托管人报告	14
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	14
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内容的真实、准确和完整发表意见	14
§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）	14
6.1 资产负债表	14
6.2 利润表	16
6.3 净资产（基金净值）变动表	17
6.4 报表附注	18
§ 7 投资组合报告	46
7.1 期末基金资产组合情况	46
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	47
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	48
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	50
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	52
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	52

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	52
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	52
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	52
7.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	52
7.11 投资组合报告附注	53
§ 8 基金份额持有人信息	54
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	54
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	54
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	54
§ 9 开放式基金份额变动	55
§ 10 重大事件揭示	55
10.1 基金份额持有人大会决议	55
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	55
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	56
10.4 基金投资策略的改变	56
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	56
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	56
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	56
10.8 其他重大事件	57
§ 11 影响投资者决策的其他重要信息	58
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	58
11.2 影响投资者决策的其他重要信息	58
§ 12 备查文件目录	59
12.1 备查文件目录	59
12.2 存放地点	59
12.3 查阅方式	59

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	大成元吉增利债券型证券投资基金	
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	
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	
报告期末基金份 额总额	477,403,794.60 份	
基金合同存续期	不定期	
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	472,331,396.97 份	5,072,397.63 份

2.2 基金产品说明

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。

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	中国工商银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	段皓静	郭明
	联系电话	0755-83183388	010-66105799
	电子邮箱	office@dcfund.com.cn	custody@icbc.com.cn
客户服务电话		4008885558	95588
传真		0755-83199588	010-66105798
注册地址		广东省深圳市南山区海德三道	北京市西城区复兴门内大街 55

	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 55 号
邮政编码	518054	100140
法定代表人	吴庆斌	陈四清

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《上海证券报》
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)	
	大成元吉增利债券 A	大成元吉增利债券 C
本期已实现收益	-6,093.53	-18,186.21
本期利润	1,971,044.59	-28,936.12
加权平均基金份 额本期利润	0.0036	-0.0041
本期加权平均净 值利润率	0.35%	-0.41%
本期基金份额净 值增长率	0.62%	0.41%
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	4,073,462.55	25,947.44
期末可供分配基	0.0086	0.0051

金份额利润		
期末基金资产净值	482,623,107.28	5,164,904.44
期末基金份额净值	1.0218	1.0182
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	2.18%	1.82%

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

大成元吉增利债券 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	1.21%	0.24%	0.73%	0.10%	0.48%	0.14%
过去三个月	2.00%	0.22%	0.92%	0.14%	1.08%	0.08%
过去六个月	0.62%	0.20%	-0.52%	0.15%	1.14%	0.05%
自基金合同生效起至今	2.18%	0.16%	-0.07%	0.13%	2.25%	0.03%

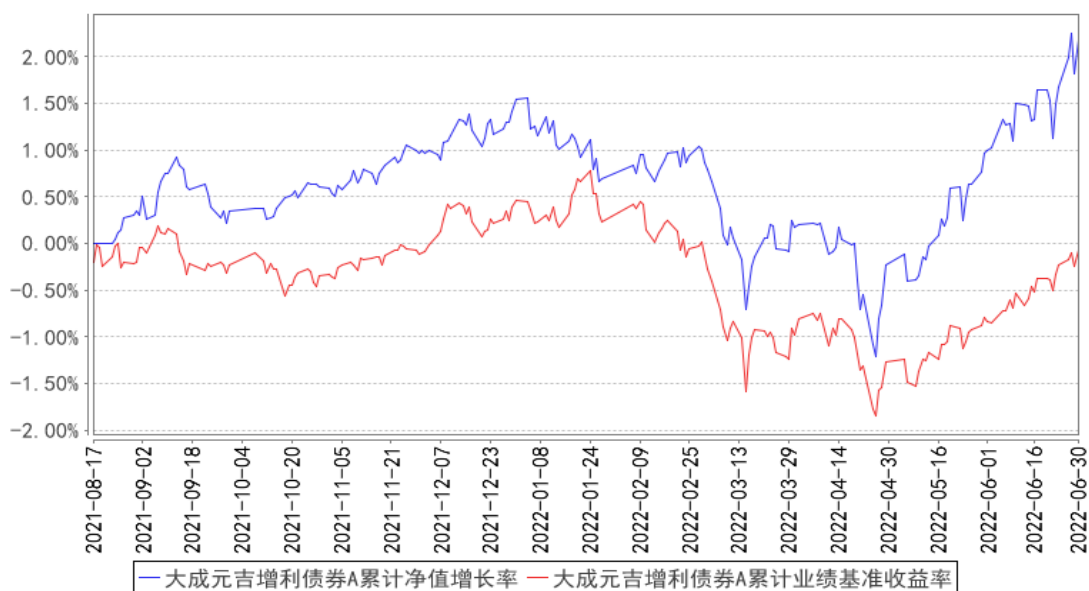
大成元吉增利债券 C

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
----	----------	-------------	------------	---------------	-----	-----

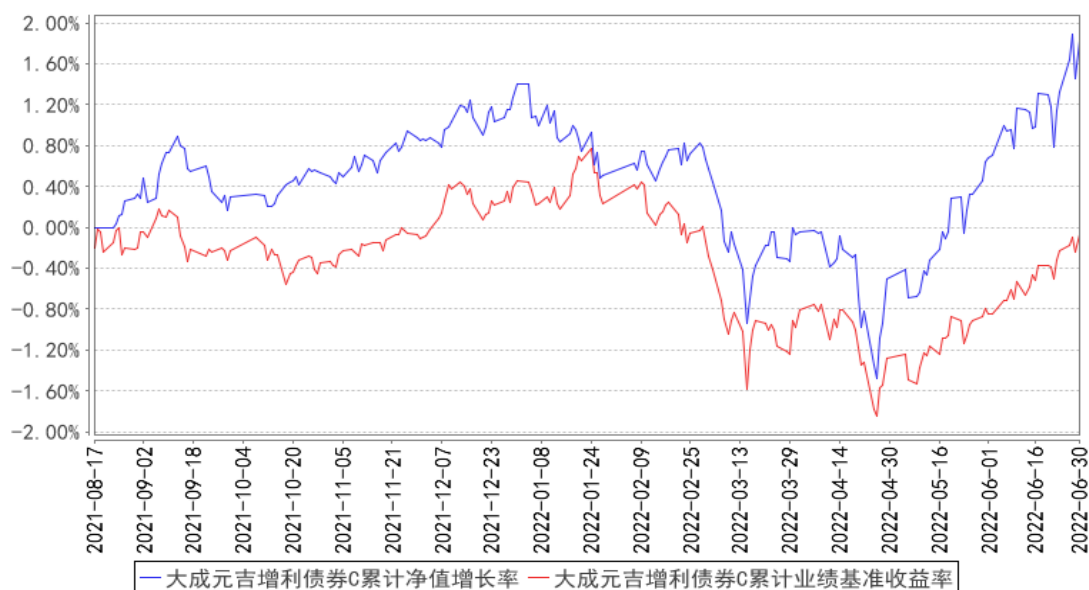
过去一个月	1.17%	0.24%	0.73%	0.10%	0.44%	0.14%
过去三个月	1.89%	0.22%	0.92%	0.14%	0.97%	0.08%
过去六个月	0.41%	0.20%	-0.52%	0.15%	0.93%	0.05%
自基金合同生效起 至今	1.82%	0.16%	-0.07%	0.13%	1.89%	0.03%

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：1、本基金合同生效日为 2021 年 8 月 17 日，截止报告期末本基金合同生效未满一年。

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		
王立	本基金基金经理，公司总经理助理、固定收益总部总监	2021 年 8 月 17 日	-	20 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，现任公司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 年初，随着稳增长、宽信用政策加码，经济初步企稳，社融数据实现开门红，年初的经济数据全线好于预期。债券收益率在一季度呈现“V”型走势，年初收益率伴随着货币宽松预期大幅下行，10 年国债收益率最低下行至 2.67%，随后在国内经济回升、海外美联储加息的双重影响下，收益率震荡上行至 2.85%。进入二季度，国内疫情意外升温，经济复苏势头被打断，在此背景下政策再次加码，央行于 4 月份再度降准释放流动性，资金利率显著下行。直至 5 月末上海开启复工复产，经济才企稳回升。债券市场收益率在二季度亦呈现震荡走势，4-5 月 10 年国债收益率震荡下行至 2.7%，5 月底再度回升至 2.84%。总体来看，上半年我国债市震荡走强，长端收益率在 2.65%-2.85% 窄幅震荡，期限利差走扩。

上半年权益市场发生了大幅的波动，1-4 月市场无差别下跌，所有权益指数大幅回调，其中创业板指最大回调幅度高达 36.64%，中证转债最大回调也接近 13%。尽管美联储加息推升了全球的衰退预期，但我们国内货币政策比较宽松，国内外流动性政策反向而行，随着海外边际影响逐步减缓，A 股在 4 月底企稳回升，核心的动力来自于国内政策的宽松和稳增长的持续发力，市场的情绪随着地产和汽车产业链提振补贴政策密集出台快速修复，推动 5-6 月的上涨行情，权益指数 V 型反转。回顾上半年的整体表现，上半年创业板指下跌 15.41%，沪深 300 下跌 9.22%，中证

500 下跌 12.3%，中证转债下跌 4.07%。

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，重纯债轻权益，组合通过高杠杆、提高组合久期，增配信用债等策略，增厚了组合收益。信用方面，我们高度重视信用风险，长期持有高等级信用债。权益资产投资方面，上半年一季度通过控制股票仓位，减少转债持仓，较好的控制了组合波动，但仍对给组合收益带来了负面影响。在 2 季度，我们将权益仓位整体上调，以公司投研团队自下而上精选、核心股票标的为主要持仓，努力把握行业和板块的轮动机会，同时也加仓了部分转债。

4.4.2 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 1.0218 元，本报告期基金份额净值增长率为 0.62%，同期业绩比较基准收益率为-0.52%；截至本报告期末大成元吉增利债券 C 的基金份额净值为 1.0182 元，本报告期基金份额净值增长率为 0.41%，同期业绩比较基准收益率为-0.52%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

下半年迈入疫后复苏，经济再次“闯关”。疫情有所缓和、复工复产开启，6-8 月在消费恢复、基建发力的支撑下经济增速有望逐步向潜在增速靠近，宏观基本面对债市的支撑减弱。再往后看，经济进一步上行的动能仍待明确，这一次是否能顺利“闯关”，取决于外需、逆周期政策与经济内生动能三者间的相对强弱变化。货币宽松基调不变，短期而言，疫情多点散发、地产风险事件发酵，流动性有望继续维持合理充裕偏高水平，资金利率继续保持中性偏低水平。

债市的区间震荡行情仍将延续，伴随着三季度后半段债券发行量季节性回升、经济弱复苏及资金面边际收敛，资产荒情况有望边际缓解。信用利差已经压缩历史极低水平，信用债方面不宜过度下沉博取收益。基于国内经济修复以及政策发力，权益的机会仍然是结构性的，主线仍然是企业盈利的逐步环比改善和充沛的流动性。市场风格逐步切换到盈利修复的中下游板块的可能性较大。转债市场的影响因素主要来自估值的压制和股票行情对正股的拉动，我们认为在权益市场向上的带动下，三季度转债行情亦会有较好的表现。

展望下半年，我们仍然看好资金宽松下的纯债资产稳定收益，并认为权益资产的投资将给组合带来明显增强。组合方面，票息策略，杠杆策略将是我们的主要策略，但久期管理可以更加灵活。低等级信用债利差保护不足，信用下沉仍需谨慎。权益资产方面，继续挖掘景气可持续、估值偏低或者合理的板块机会，另外也会向中下游等领域进行前期布局，我们看好下半年到明年行业逐步修复的机会，对上游板块中存在风险的板块和标的逐步兑现切换，追求持仓结构优化。

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。

4.6 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

本报告期内，本基金托管人在对本基金的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他法律法规和基金合同的有关规定，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

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，本基金的管理人——大成基金管理有限公司在本基金的投资运作、基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格计算、基金费用开支等问题上，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，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

本托管人依法对大成基金管理有限公司编制和披露的本基金 2022 年中期报告中财务指标、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进行了核查，以上内容真实、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：大成元吉增利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	709,849.64	762,744.37
结算备付金		9,556,895.05	494,492.53
存出保证金		25,848.22	26,535.34
交易性金融资产	6.4.7.2	627,942,081.68	779,426,771.35
其中：股票投资		96,432,624.89	72,206,700.85
基金投资		-	-
债券投资		531,509,456.79	707,220,070.50
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		32,670,359.89	23,572,422.55
应收股利		36,887.36	-
应收申购款		3,246.79	20.00
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.8	-	8,390,917.78
资产总计		670,945,168.63	812,673,903.92
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		147,214,795.08	129,167,523.75
应付清算款		32,675,199.77	23,599,073.01
应付赎回款		2,563,679.94	3,334,447.63
应付管理人报酬		339,841.85	442,376.25
应付托管费		84,960.46	110,594.10
应付销售服务费		1,795.50	5,308.66
应付投资顾问费		-	-
应交税费		55,367.91	58,158.19
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.9	221,516.40	218,445.51
负债合计		183,157,156.91	156,935,927.10
净资产：			
实收基金	6.4.7.10	477,403,794.60	645,737,168.61
其他综合收益	6.4.7.11	-	-
未分配利润	6.4.7.12	10,384,217.12	10,000,808.21
净资产合计		487,788,011.72	655,737,976.82
负债和净资产总计		670,945,168.63	812,673,903.92

注：报告截止日 2022 年 06 月 30 日，基金份额总额 477,403,794.60 份，其中大成元吉增利债券 A 基金份额总额为 472,331,396.97 份，基金份额净值 1.0218 元。大成元吉增利债券 C 基金份额总额为 5,072,397.63 份，基金份额净值 1.0182 元。

6.2 利润表

会计主体：大成元吉增利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
一、营业总收入		6,378,016.27
1. 利息收入		109,570.91
其中：存款利息收入	6.4.7.13	109,570.91
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		-
证券出借利息收入		-
其他利息收入		-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		4,290,595.97
其中：股票投资收益	6.4.7.14	-6,448,969.87
基金投资收益		-
债券投资收益	6.4.7.15	9,810,466.86
资产支持证券投资收益	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	929,098.98
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	1,966,388.21
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	11,461.18
减：二、营业总支出		4,435,907.80
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	2,246,894.54
2. 托管费	6.4.10.2.2	561,723.61
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	14,099.24
4. 投资顾问费		-
5. 利息支出		1,455,256.21
其中：卖出回购金融资产支出		1,455,256.21
6. 信用减值损失	6.4.7.22	-
7. 税金及附加		34,235.99
8. 其他费用	6.4.7.23	123,698.21
三、利润总额（亏损总额以“-”号 填列）		1,942,108.47
减：所得税费用		-

四、净利润（净亏损以“-”号填列）		1,942,108.47
五、其他综合收益的税后净额		-
六、综合收益总额		1,942,108.47

6.3 净资产（基金净值）变动表

会计主体：大成元吉增利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)	645,737,168.61	-	10,000,808.21	655,737,976.82
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)	645,737,168.61	-	10,000,808.21	655,737,976.82
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	-168,333,374.01	-	383,408.91	-167,949,965.10
(一)、综合收益总额	-	-	1,942,108.47	1,942,108.47
(二)、本期基金份额交易产生的基金净值变动数(净值减少以	-168,333,374.01	-	-1,558,699.56	-169,892,073.57

“-”号填列)				
其中:1. 基金申购款	473,671.44	-	3,570.84	477,242.28
2. 基金赎回款	-168,807,045.45	-	-1,562,270.40	-170,369,315.85
(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、本期末净资产(基金净值)	477,403,794.60	-	10,384,217.12	487,788,011.72

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

范瑛

孙蕊

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

大成元吉增利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 3104 号《关于准予大成元吉增利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《大成元吉

增利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 690,299,105.26 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(2021)第 0505 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《大成元吉增利债券型证券投资基金基金合同》于 2021 年 8 月 17 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 690,446,027.18 份基金份额，其中认购资金利息折合 146,921.92 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，基金托管人为中国工商银行股份有限公司。

根据《大成元吉增利债券型证券投资基金基金合同》和《大成元吉增利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、赎回费用、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/申购时收取前端认购/申购费用、赎回时收取赎回费用，且不从本类别基金资产中计提销售服务费的基金份额；C 类基金份额为从本类别基金资产中计提销售服务费，且不收取认购/申购费用、赎回时收取赎回费用的基金份额。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《大成元吉增利债券型证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的股票(包括主板、中小板、创业板及其他中国证监会允许基金投资的股票)、存托凭证、港股通标的股票、债券(包括国债、央行票据、地方政府债、金融债券、企业债券、公司债券、中期票据、短期融资券、超短期融资券、次级债券、政府支持机构债、政府支持债券、可转换债券(含分离交易可转债)、可交换债券及其他经中国证监会允许投资的债券)、资产支持证券、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、国债期货、信用衍生品，以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具，但须符合中国证监会的相关规定。本基金的投资组合比例为：投资于债券资产的比例不低于基金资产的 80%，投资于股票资产、存托凭证的比例不超过基金资产的 20%(其中投资于港股通标的股票占本基金股票资产的比例为 0%-50%)。每个交易日日终，在扣除国债期货合约需缴纳的交易保证金后应当保持不低于基金资产净值 5%的现金或者到期日在一年以内的政府债券，其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。本基金的业绩比较基准为：沪深 300 指数收益率 \times 10%+中债综合全价指数收益率 \times 85%+金融机构人民币活期存款基准利率(税后) \times 5%。

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》、《大成元吉增利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

本基金 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日止期间的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 2022 年 6 月 30 日的财务状况以及 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日止期间的经营成果和净资产变动情况等有关信息。

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。

6.4.4.1 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。

权益工具

权益工具是指从发行方角度分析符合权益定义的工具。本基金将对其没有控制、共同控制和重大影响的权益工具(主要为股票投资)按照公允价值计量且其变动计入当期损益，在资产负债表中列示为交易性金融资产。

(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。

(3) 衍生金融工具

本基金将持有的衍生金融工具以公允价值计量且其变动计入当期损益，在资产负债表中列示为衍生金融资产/负债。

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股票投资、债券投资和衍生工具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。除衍生工具所产生的金融资产在资产负债表中以衍生金融资产列示外，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。

6.4.4.2. 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。

6.4.4.3 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及在适用情况下由基金管理人缴纳的增值税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。

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、结算备付金、存出保证金、应收利息、应收证券清算款和应收申购款,金额分别为 762,744.37 元、494,492.53 元、26,535.34 元、8,390,917.78 元、23,572,422.55 元和 20.00 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、结算备付金、存出保证金、其他资产-应收利息、应收清算款和应收申购款,金

额分别为 762,830.08 元、532,631.66 元、26,547.34 元、0.00 元、23,572,422.55 元和 20.00 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 779,426,771.35 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 787,779,452.29 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、应付证券清算款、应付赎回款、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、应付利息和其他负债-其他应付款，金额分别为 129,167,523.75 元、23,599,073.01 元、3,334,447.63 元、442,376.25 元、110,594.10 元、5,308.66 元、103,846.00 元、2,796.18 元和 2,503.33 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、应付清算款、应付赎回款、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、其他负债-应付利息和其他负债-其他应付款，金额分别为 129,170,319.93 元、23,599,073.01 元、3,334,447.63 元、442,376.25 元、110,594.10 元、5,308.66 元、103,846.00 元、0.00 元和 2,503.33 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[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[2014]81 号《财政部国家税务总局证监会关于沪港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》、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]127 号《财政部国家税务总局证监会关于深港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》、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。

对基金通过港股通投资香港联交所上市 H 股取得的股息红利，H 股公司应向中国证券登记结算有限责任公司(以下简称“中国结算”)提出申请，由中国结算向 H 股公司提供内地个人投资者名册，H 股公司按照 20% 的税率代扣个人所得税。基金通过港股通投资香港联交所上市的非 H 股取得的股息红利，由中国结算按照 20% 的税率代扣个人所得税。

(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。基金通过港股通买卖、继承、赠与联交所上市股票，按照香港特别行政区现行税法规定缴纳印花税。

(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 2022年6月30日
	活期存款
等于：本金	709,461.82
加：应计利息	387.82
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	709,849.64

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	90,644,675.36	-	96,432,624.89	5,787,949.53	
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	-	
债券	交易所市场	188,686,993.60	3,810,521.84	192,471,535.14	-25,980.30
	银行间市场	334,089,314.79	4,026,921.65	339,037,921.65	921,685.21
	合计	522,776,308.39	7,837,443.49	531,509,456.79	895,704.91
资产支持证券	-	-	-	-	
基金	-	-	-	-	
其他	-	-	-	-	
合计	613,420,983.75	7,837,443.49	627,942,081.68	6,683,654.44	

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	82,956.25
其中：交易所市场	59,745.85
银行间市场	23,210.40
应付利息	-
预提费用	138,560.15
合计	221,516.40

6.4.7.10 实收基金

金额单位：人民币元

大成元吉增利债券 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	631,374,714.99	631,374,714.99
本期申购	234,120.08	234,120.08
本期赎回（以“-”号填列）	-159,277,438.10	-159,277,438.10
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	472,331,396.97	472,331,396.97

大成元吉增利债券 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	14,362,453.62	14,362,453.62
本期申购	239,551.36	239,551.36
本期赎回（以“-”号填列）	-9,529,607.35	-9,529,607.35
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	5,072,397.63	5,072,397.63

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

大成元吉增利债券 A

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
本期期初	5,305,156.72	4,494,458.73	9,799,615.45
本期利润	-6,093.53	1,977,138.12	1,971,044.59
本期基金份额交易产生的变动数	-1,225,600.64	-253,349.09	-1,478,949.73
其中：基金申购款	1,725.93	533.37	2,259.30
基金赎回款	-1,227,326.57	-253,882.46	-1,481,209.03
本期已分配利润	-	-	-
本期末	4,073,462.55	6,218,247.76	10,291,710.31

大成元吉增利债券 C

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
本期期初	99,089.17	102,103.59	201,192.76
本期利润	-18,186.21	-10,749.91	-28,936.12
本期基金份额交易产生的变动数	-54,955.52	-24,794.31	-79,749.83
其中：基金申购款	1,163.16	148.38	1,311.54
基金赎回款	-56,118.68	-24,942.69	-81,061.37
本期已分配利润	-	-	-
本期末	25,947.44	66,559.37	92,506.81

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	3,972.79
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	105,261.06
其他	337.06
合计	109,570.91

6.4.7.14 股票投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年6月30日
卖出股票成交总额	65,485,267.35
减：卖出股票成本总额	71,701,042.29
减：交易费用	233,194.93
买卖股票差价收入	-6,448,969.87

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	10,581,176.06
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	-770,709.20
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	9,810,466.86

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	446,237,443.98
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	440,135,067.56
减：应计利息总额	6,866,398.18
减：交易费用	6,687.44
买卖债券差价收入	-770,709.20

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**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 2022年1月1日至2022年6月30日
股票投资产生的股利收益	929,098.98
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	929,098.98

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	1,966,388.21
股票投资	1,512,951.29
债券投资	453,436.92
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	1,966,388.21
----	--------------

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	11,457.52
基金转换费收入	3.66
合计	11,461.18

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 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
审计费用	29,752.78
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
深港通证券组合费	43.23
银行划款手续费	15,794.83
账户维护费	18,600.00
合计	123,698.21

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
中国工商银行股份有限公司（“中国工商银行”）	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

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 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（%）
光大证券	64,706,195.03	40.47

6.4.10.1.2 债券交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2022年1月1日至2022年6月30日	
	成交金额	占当期债券 成交总额的比例（%）
光大证券	1,428,044.55	20.33

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 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（%）
光大证券	2,093,296,000.00	34.44

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 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	59,154.37	40.79	23,547.32	39.41
------	-----------	-------	-----------	-------

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，以扣除由中国证券登记结算有限责任公司收取的证管费和经手费的净额列示。

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
	2022年1月1日至2022年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	2,246,894.54
其中：支付销售机构的客户维护费	771,398.92

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 0.80%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：

$$\text{日管理人报酬} = \text{前一日基金资产净值} \times 0.80\% / \text{当年天数}。$$

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	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托管费	561,723.61

注：支付基金托管人中国工商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：

$$\text{日托管费} = \text{前一日基金资产净值} \times 0.20\% / \text{当年天数}$$

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		
	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		
	大成元吉增利债券 A	大成元吉增利债券 C	合计
大成基金	-	87.76	87.76
工商银行	-	11,507.36	11,507.36
合计	-	11,595.12	11,595.12

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将专门用于本基金 C 类基金份额的销售与基金份额持有人服务。在通常情况下，销售服务费按前一日基金资产净值的

0.4%年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 0.40\% / \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的销售服务费

E 为前一日的基金财产净值

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

无。

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自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
	大成元吉增利债券 A	大成元吉增利债券 C
基金合同生效日（2021年8月17日）持有的基金份额	-	-
报告期初持有的基金份额	55,916,553.73	-
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	55,916,553.73	-
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	11.71%	-

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	
	2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日	
	期末余额	当期利息收入
中国工商银行	709,849.64	3,972.79

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(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

金额单位：人民币元

6.4.12.1.2 受限证券类别：债券										
证券代码	证券名称	成功认购日	受限期	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量 (单位：张)	期末成本总额	期末估值总额	备注
113060	浙 22 转债	2022 年 6 月 17 日	1 个月内(含)	新债未上市	100.00	100.01	10	1,000.00	1,000.07	-

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 2022 年 06 月 30 日止，基金从事银行间债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额 62,714,795.08 元。以如下债券为质押：

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
012280548	22 海通恒信 SCP003	2022 年 7 月 1 日	100.92	100,000	10,091,901.37
101800479	18 十堰城投 MTN001	2022 年 7 月 1 日	102.61	100,000	10,260,539.73
101901165	19 鲁西化工 MTN001	2022 年 7 月 1 日	103.60	133,000	13,778,515.78
102000929	20 开封发投 MTN001	2022 年 7 月 1 日	101.01	89,000	8,990,157.24
101901183	19 越秀集团 MTN003	2022 年 7 月 4 日	103.61	239,000	24,763,726.35
合计				661,000	67,884,840.47

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末，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 84,500,000.00。于 2022 年 07 月 04 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

本基金为债券型基金，其预期风险与预期收益低于股票型基金、混合型基金，高于货币市场基金。本基金投资的金融工具主要为债券投资等。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。

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工商银行，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。

本基金债券投资的信用评级情况按《中国人民银行信用评级管理指导意见》设定的标准统计及汇总。

6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2022年6月30日	上年度末 2021年12月31日
A-1	-	-
A-1 以下	-	-
未评级	81,679,873.08	264,337,264.00
合计	81,679,873.08	264,337,264.00

注：未评级债券为国债、短期融资券。

6.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

无。

6.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

无。

6.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2022 年 6 月 30 日	上年度末 2021 年 12 月 31 日
AAA	350,791,821.66	301,632,000.00
AAA 以下	78,615,849.72	80,860,806.50
未评级	20,421,912.33	60,390,000.00
合计	449,829,583.71	442,882,806.50

注：未评级债券为国债。

6.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

无。

6.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

无。

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。本报告期内，本基金未发生重大流动性风险事件。

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	709,849.64	-	-	-	709,849.64
结算备付金	9,556,895.05	-	-	-	9,556,895.05
存出保证金	25,848.22	-	-	-	25,848.22
交易性金融资产	207,577,942.33	292,236,115.16	31,695,399.30	96,432,624.89	627,942,081.68
应收股利	-	-	-	36,887.36	36,887.36
应收申购款	-	-	-	3,246.79	3,246.79
应收清算款	-	-	-	32,670,359.89	32,670,359.89
资产总计	217,870,535.24	292,236,115.16	31,695,399.30	129,143,118.93	670,945,168.63
负债					
应付赎回款	-	-	-	2,563,679.94	2,563,679.94
应付管理人报酬	-	-	-	339,841.85	339,841.85
应付托管费	-	-	-	84,960.46	84,960.46
应付清算款	-	-	-	32,675,199.77	32,675,199.77
卖出回购金融资产款	147,214,795.08	-	-	-	147,214,795.08
应付销售服务费	-	-	-	1,795.50	1,795.50
应交税费	-	-	-	55,367.91	55,367.91

其他负债	-	-	-	221,516.40	221,516.40
负债总计	147,214,795.08	-	-	35,942,361.83	183,157,156.91
利率敏感度缺口	70,655,740.16	292,236,115.16	31,695,399.30	93,200,757.10	487,788,011.72
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	762,744.37	-	-	-	762,744.37
结算备付金	494,492.53	-	-	-	494,492.53
存出保证金	26,535.34	-	-	-	26,535.34
交易性金融资产	395,524,264.00	290,962,510.40	20,733,296.10	72,206,700.85	779,426,771.35
应收申购款	-	-	-	20.00	20.00
应收证券清算款	-	-	-	23,572,422.55	23,572,422.55
其他资产	-	-	-	8,390,917.78	8,390,917.78
资产总计	396,808,036.24	290,962,510.40	20,733,296.10	104,170,061.18	812,673,903.92
负债					
应付赎回款	-	-	-	3,334,447.63	3,334,447.63
应付管理人报酬	-	-	-	442,376.25	442,376.25
应付托管费	-	-	-	110,594.10	110,594.10
应付证券清算款	-	-	-	23,599,073.01	23,599,073.01
卖出回购金融资产款	129,167,523.75	-	-	-	129,167,523.75
应付销售服务费	-	-	-	5,308.66	5,308.66
应交税费	-	-	-	58,158.19	58,158.19
其他负债	-	-	-	218,445.51	218,445.51
负债总计	129,167,523.75	-	-	27,768,403.35	156,935,927.10
利率敏感度缺口	267,640,512.49	290,962,510.40	20,733,296.10	76,401,657.83	655,737,976.82

注：表中所示为本基金资产及负债的账面价值，并按照合同约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	市场利率下降 25 个基点	1,518,869.88	1,764,825.12
	市场利率上升 25 个基点	-1,507,279.94	-1,747,214.58

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。本基金持有不以记账本位币计价的资产，因此存在相应的外汇风险。本基金管理人每日对本基金的外汇头寸进行监控。

6.4.13.4.2.1 外汇风险敞口

单位：人民币元

项目	本期末 2022年6月30日			
	美元 折合人民币 元	港币 折合人民币元	其他币种 折合人民币元	合计
以外币计价的 资产				
交易性金融资产	-	645,223.75	-	645,223.75
资产合计	-	645,223.75	-	645,223.75
以外币计价的 负债				
负债合计	-	-	-	-
资产负债表外 外汇风险敞口净 额	-	645,223.75	-	645,223.75
项目	上年度末 2021年12月31日			
	美元 折合人民币 元	港币 折合人民币元	其他币种 折合人民币元	合计
以外币计价的 资产				
交易性金融资产	-	677,469.90	-	677,469.90
资产合计	-	677,469.90	-	677,469.90
以外币计价的 负债				
负债合计	-	-	-	-
资产负债表外 外汇风险敞口净 额	-	677,469.90	-	677,469.90

6.4.13.4.2.2 外汇风险的敏感性分析

假设	除汇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	港币相对人民币升值 5%	32,261.19	33,873.50
	港币相对人民币贬值 5%	-32,261.19	-33,873.50

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，采用“自上而下”的策略，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市场价格风险。

本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险。本基金投资于债券的比例不低于基金资产的 80%；投资于股票资产、存托凭证的比例不超过基金资产的 20%（其中投资于港股通标的股票占本基金股票资产的比例为 0%-50%）。本基金每个交易日日终在扣除国债期货合约需缴纳的交易保证金后，持有现金（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 5%。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 2022年6月30日	上年度末 2021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	96,432,624.89	19.77	72,206,700.85	11.01
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	96,432,624.89	19.77	72,206,700.85	11.01

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资产净值的比例为 19.77%（上年度末：11.01%），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资产净值无重大影响（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 2022 年 6 月 30 日	上年度末 2021 年 12 月 31 日
第一层次	97,975,034.39	72,210,507.35
第二层次	529,967,047.29	707,216,264.00
第三层次	-	-
合计	627,942,081.68	779,426,771.35

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、债券和基金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

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	96,432,624.89	14.37
	其中：股票	96,432,624.89	14.37
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	531,509,456.79	79.22
	其中：债券	531,509,456.79	79.22
	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	10,266,744.69	1.53
8	其他各项资产	32,736,342.26	4.88
9	合计	670,945,168.63	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 645,223.75 元，占期末基金资产净值的比例为 0.13%。

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	1,029,525.00	0.21
B	采矿业	8,902,937.00	1.83
C	制造业	66,259,575.46	13.58
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	2,144,539.00	0.44
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	3,970,549.80	0.81
H	住宿和餐饮业	20,802.00	0.00
I	信息传输、软件和信息技术服务业	1,035,170.68	0.21
J	金融业	1,390,413.00	0.29
K	房地产业	3,217,780.00	0.66
L	租赁和商务服务业	4,472,256.00	0.92
M	科学研究和技术服务业	2,264,958.20	0.46
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	1,078,895.00	0.22
S	综合	-	-
	合计	95,787,401.14	19.64

7.2.2 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（%）
通信服务	-	-
非日常生活消费品	-	-
日常消费品	-	-
能源	265,793.05	0.05
金融	-	-
医疗保健	-	-
工业	379,430.70	0.08
信息技术	-	-
原材料	-	-
房地产	-	-
公用事业	-	-
合计	645,223.75	0.13

注：以上分类采用全球行业分类标准（GICS）。

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	601888	中国中免	19,200	4,472,256.00	0.92
2	600256	广汇能源	420,800	4,435,232.00	0.91
3	603279	景津装备	132,400	4,105,724.00	0.84
4	600378	昊华科技	106,300	4,094,676.00	0.84
5	601058	赛轮轮胎	335,580	3,781,986.60	0.78
6	688639	华恒生物	27,591	3,633,182.88	0.74
7	002475	立讯精密	104,500	3,531,055.00	0.72
8	002271	东方雨虹	66,100	3,402,167.00	0.70
9	300760	迈瑞医疗	8,400	2,630,880.00	0.54
10	601615	明阳智能	67,000	2,264,600.00	0.46
11	601666	平煤股份	160,600	2,182,554.00	0.45
12	601117	中国化学	227,900	2,144,539.00	0.44
13	600328	中盐化工	87,500	2,060,625.00	0.42
14	601877	正泰电器	52,500	1,878,450.00	0.39
15	300772	运达股份	72,400	1,841,856.00	0.38
16	001914	招商积余	100,400	1,804,188.00	0.37
17	603259	药明康德	17,300	1,799,027.00	0.37
18	300724	捷佳伟创	19,500	1,742,325.00	0.36
19	603486	科沃斯	14,000	1,706,460.00	0.35
20	601872	招商轮船	289,100	1,665,216.00	0.34
21	600690	海尔智家	56,600	1,554,236.00	0.32
22	688297	中航无人机	27,746	1,475,532.28	0.30
23	603799	华友钴业	14,040	1,342,504.80	0.28
24	603260	合盛硅业	11,200	1,321,152.00	0.27
25	688267	中触媒股份	36,532	1,221,264.76	0.25
26	603916	苏博特	47,200	1,203,128.00	0.25
27	603392	万泰生物	7,500	1,164,750.00	0.24
28	002138	顺络电子	42,400	1,155,400.00	0.24
29	000938	紫光股份	55,700	1,080,580.00	0.22
30	000681	视觉中国	75,500	1,078,895.00	0.22
31	600988	赤峰黄金	66,000	1,052,700.00	0.22
32	300979	华利集团	14,200	1,037,736.00	0.21
33	300761	立华股份	25,900	1,029,525.00	0.21
34	000651	格力电器	26,900	907,068.00	0.19
35	300580	贝斯特	42,700	889,014.00	0.18
36	600383	金地集团	61,400	825,216.00	0.17
37	300470	中密控股	23,300	822,257.00	0.17
38	002241	歌尔股份	24,200	813,120.00	0.17

39	002821	凯莱英	2,700	780,300.00	0.16
40	603897	长城科技	24,800	772,520.00	0.16
41	603722	阿科力	15,200	766,536.00	0.16
42	300059	东方财富	30,020	762,508.00	0.16
43	002895	川恒股份	21,600	730,296.00	0.15
44	002352	顺丰控股	12,900	719,949.00	0.15
45	600031	三一重工	36,800	701,408.00	0.14
46	603112	华翔股份	45,700	681,387.00	0.14
47	601966	玲珑轮胎	26,400	669,768.00	0.14
48	300363	博腾股份	8,000	623,920.00	0.13
49	600285	羚锐制药	47,500	595,175.00	0.12
50	002371	北方华创	2,100	581,952.00	0.12
51	688777	中控技术	7,993	581,570.68	0.12
52	300401	花园生物	32,600	565,284.00	0.12
53	603676	卫信康	53,000	534,240.00	0.11
54	600233	圆通速递	26,100	532,179.00	0.11
55	603986	兆易创新	3,700	526,177.00	0.11
56	601898	中煤能源	48,600	504,468.00	0.10
57	688012	中微半导体设备	4,206	491,050.50	0.10
58	000933	神火股份	37,300	487,884.00	0.10
59	600188	兖矿能源	12,300	485,604.00	0.10
60	300873	海晨股份	17,140	484,547.80	0.10
61	688105	诺唯赞生物	5,488	465,931.20	0.10
62	600406	国电南瑞	16,800	453,600.00	0.09
63	000002	万科 A	21,100	432,550.00	0.09
64	688388	嘉元科技	5,000	424,350.00	0.09
65	01072	东方电气	47,200	379,430.70	0.08
66	002078	太阳纸业	30,000	369,300.00	0.08
67	000683	远兴能源	34,200	359,442.00	0.07
68	601838	成都银行	20,500	339,890.00	0.07
69	688626	翔宇医疗	9,792	325,681.92	0.07
70	002353	杰瑞股份	7,000	282,100.00	0.06
71	00883	中国海洋石油	30,000	265,793.05	0.05
72	002120	韵达股份	15,300	261,018.00	0.05
73	000625	长安汽车	14,950	258,934.00	0.05
74	603993	洛阳钼业	42,300	242,379.00	0.05
75	300481	濮阳惠成	10,300	242,050.00	0.05
76	600009	上海机场	4,200	238,140.00	0.05
77	300750	宁德时代	400	213,600.00	0.04
78	002372	伟星新材	8,000	192,320.00	0.04
79	601318	中国平安	4,100	191,429.00	0.04
80	605499	东鹏饮料	1,100	187,946.00	0.04

81	688408	中信博新能源	1,364	126,142.72	0.03
82	003038	鑫铂股份	2,400	120,960.00	0.02
83	002312	川发龙蟒	6,900	119,094.00	0.02
84	300850	新强联	1,200	106,836.00	0.02
85	600048	保利发展	6,100	106,506.00	0.02
86	600733	北汽蓝谷	10,400	96,408.00	0.02
87	301219	腾远钴业	1,000	92,480.00	0.02
88	603297	永新光学	800	89,368.00	0.02
89	002709	天赐材料	1,400	86,884.00	0.02
90	300450	先导智能	1,200	75,816.00	0.02
91	601919	中远海控	5,000	69,500.00	0.01
92	300037	新宙邦	1,200	63,072.00	0.01
93	600460	士兰微	1,100	57,200.00	0.01
94	600111	北方稀土	1,600	56,256.00	0.01
95	600612	老凤祥	1,200	50,136.00	0.01
96	002968	新大正	2,000	49,320.00	0.01
97	601878	浙商证券	4,300	48,934.00	0.01
98	600030	中信证券	2,200	47,652.00	0.01
99	300358	楚天科技	2,600	46,254.00	0.01
100	605068	明新旭腾	1,700	39,695.00	0.01
101	301073	君亭酒店	300	20,802.00	0.00
102	002876	三利谱	100	4,002.00	0.00
103	002415	海康威视	100	3,620.00	0.00

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	601666	平煤股份	4,949,675.06	0.75
2	601877	正泰电器	3,975,107.00	0.61
3	601888	中国中免	3,366,083.00	0.51
4	300760	迈瑞医疗	2,707,134.00	0.41
5	688267	中触媒股份	2,576,537.63	0.39
6	601117	中国化学	2,224,431.00	0.34
7	601872	招商轮船	1,916,690.80	0.29
8	600328	中盐化工	1,898,765.38	0.29
9	603259	药明康德	1,870,374.00	0.29
10	000681	视觉中国	1,800,764.00	0.27
11	300724	捷佳伟创	1,688,117.00	0.26
12	601058	赛轮轮胎	1,640,873.00	0.25
13	600988	赤峰黄金	1,632,686.00	0.25
14	002293	罗莱生活	1,614,935.30	0.25

15	601615	明阳智能	1,574,068.00	0.24
16	603486	科沃斯	1,556,617.00	0.24
17	688297	中航无人机	1,500,074.97	0.23
18	000651	格力电器	1,403,025.00	0.21
19	600690	海尔智家	1,328,862.00	0.20
20	300772	运达股份	1,295,986.00	0.20

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	301073	君亭酒店	4,720,358.00	0.72
2	002876	三利谱	3,335,656.50	0.51
3	300115	长盈精密	3,328,334.24	0.51
4	601666	平煤股份	3,222,945.00	0.49
5	600153	建发股份	2,909,049.00	0.44
6	600406	国电南瑞	2,528,683.00	0.39
7	300331	苏大维格	2,460,990.00	0.38
8	000002	万科 A	1,347,016.00	0.21
8	02202	万科企业	599,559.50	0.09
9	002293	罗莱生活	1,360,888.00	0.21
10	601877	正泰电器	1,350,667.00	0.21
11	600438	通威股份	1,297,424.00	0.20
12	600256	广汇能源	1,219,289.00	0.19
13	00941	中国移动	1,215,399.23	0.19
14	601088	中国神华	836,033.00	0.13
14	01088	中国神华	316,801.81	0.05
15	000425	徐工机械	1,139,702.00	0.17
16	603799	华友钴业	1,118,974.00	0.17
17	002929	润建股份	1,013,458.00	0.15
18	600938	中国海油	1,521.00	0.00
18	00883	中国海洋石油	992,728.68	0.15
19	601899	紫金矿业	651,251.00	0.10
19	02899	紫金矿业	293,272.27	0.04
20	000063	中兴通讯	926,477.00	0.14

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	94,414,015.04
卖出股票收入（成交）总额	65,485,267.35

注：本项中“买入股票的成本(成交)总额”及“卖出股票的收入(成交)总额”均按买卖成交金额

（成交单价乘以成交数量）填列，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	31,452,102.12	6.45
2	央行票据	-	-
3	金融债券	94,209,406.03	19.31
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	159,813,164.28	32.76
5	企业短期融资券	60,563,403.84	12.42
6	中期票据	183,927,970.95	37.71
7	可转债（可交换债）	1,543,409.57	0.32
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	531,509,456.79	108.96

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	101901183	19 越秀集团 MTN003	300,000	31,084,175.34	6.37
2	101782001	17 河钢集 MTN007	300,000	30,114,825.21	6.17
3	101901165	19 鲁西化工 MTN001	200,000	20,719,572.60	4.25
4	155552	19 鲁能 01	200,000	20,587,309.59	4.22
5	127450	16 晋城投	500,000	20,541,701.37	4.21

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

基金投资的前十名证券的发行主体本期未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。

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	25,848.22
2	应收清算款	32,670,359.89
3	应收股利	36,887.36
4	应收利息	-
5	应收申购款	3,246.79
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	32,736,342.26

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	123121	帝尔转债	392,880.18	0.08
2	128140	润建转债	294,631.65	0.06
3	110053	苏银转债	251,958.96	0.05
4	113050	南银转债	245,368.05	0.05
5	123103	震安转债	48,401.20	0.01

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 (%)
大成元吉增利债券 A	869	543,534.40	175,863,212.88	37.23	296,468,184.09	62.77
大成元吉增利债券 C	382	13,278.53	-	-	5,072,397.63	100.00
合计	1,251	381,617.74	175,863,212.88	36.84	301,540,581.72	63.16

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	大成元吉增利债券 A	0.00	0.0000
	大成元吉增利债券 C	55,027.32	1.0848
	合计	55,027.32	0.0115

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、基金投资和研发部门负责人持有本开放式基金	大成元吉增利债券 A	0
	大成元吉增利债券 C	0
	合计	0
本基金基金经理持有	大成元吉增利债券 A	0

本开放式基金	大成元吉增利债券 C	0
	合计	0

§ 9 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
基金合同生效日 (2021 年 8 月 17 日) 基金份额总额	664,396,359.35	26,049,667.83
本报告期期初基金份额总额	631,374,714.99	14,362,453.62
本报告期基金总申购份额	234,120.08	239,551.36
减：本报告期基金总赎回份额	159,277,438.10	9,529,607.35
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	472,331,396.97	5,072,397.63

§ 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

无

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 (%)	
光大证券	1	64,706,195.03	40.47	59,154.37	40.79	-
长江证券	1	48,160,611.75	30.12	43,886.36	30.26	-
招商证券	2	47,030,949.57	29.41	41,995.14	28.96	-
东方证券	1	-	-	-	-	-
海通证券	1	-	-	-	-	-
申万宏源	1	-	-	-	-	-
中金公司	1	-	-	-	-	-
中信证券	1	-	-	-	-	-

注：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。

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：

本报告期内增加交易单元：无。本报告期内退租交易单元：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

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	1,428,044.55	20.33	2,093,296,000.00	34.44	-	-
长江证券	4,478,978.50	63.77	1,034,900,000.00	17.03	-	-
招商证券	1,116,509.20	15.90	2,949,300,000.00	48.53	-	-

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	大成元吉增利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05月31日
3	大成元吉增利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05月31日
4	大成基金管理有限公司关于旗下部分基金增加腾安基金销售(深圳)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30日
5	大成基金管理有限公司关于旗下部分基金增加招商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05月25日
6	大成元吉增利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

7	大成基金管理有限公司关于旗下部分基金增加宁波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 03 月 29 日
8	大成元吉增利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
9	大成基金管理有限公司关于旗下部分基金增加北京中植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 03 月 25 日
10	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
11	大成基金管理有限公司关于旗下部分基金增加中信百信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 01 月 25 日
12	大成元吉增利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

§ 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	20220621-20220630	100,003,500.00	0.00	0.00	100,003,500.00	20.95
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。

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