

# 大成稳安 60 天滚动持有债券型证券投资基金

## 2022 年年度报告

2022 年 12 月 31 日

基金管理人：大成基金管理有限公司

基金托管人：中国农业银行股份有限公司

送出日期：2023 年 3 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。本年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人中国农业银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2023 年 03 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。

本报告财务资料已经审计。安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）为本基金出具了无保留意见的审计报告，请投资者注意阅读。

本报告期自 2022 年 01 月 01 日起至 12 月 31 日止。

## 1.2 目录

<b>§ 1 重要提示及目录</b> .....	<b>2</b>
1.1 重要提示 .....	2
1.2 目录 .....	3
<b>§ 2 基金简介</b> .....	<b>5</b>
2.1 基金基本情况 .....	5
2.2 基金产品说明 .....	5
2.3 基金管理人和基金托管人 .....	5
2.4 信息披露方式 .....	6
2.5 其他相关资料 .....	6
<b>§ 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况</b> .....	<b>6</b>
3.1 主要会计数据和财务指标 .....	6
3.2 基金净值表现 .....	7
3.3 过去三年基金的利润分配情况 .....	10
<b>§ 4 管理人报告</b> .....	<b>10</b>
4.1 基金管理人及基金经理情况 .....	10
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 .....	13
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望 .....	16
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况 .....	17
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明 .....	18
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明 .....	18
4.9 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 .....	19
<b>§ 5 托管人报告</b> .....	<b>19</b>
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明 .....	19
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 .....	19
5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见 .....	19
<b>§ 6 审计报告</b> .....	<b>19</b>
<b>§ 7 年度财务报表</b> .....	<b>21</b>
7.1 资产负债表 .....	21
7.2 利润表 .....	22
7.3 净资产（基金净值）变动表 .....	24
7.4 报表附注 .....	27
<b>§ 8 投资组合报告</b> .....	<b>57</b>
8.1 期末基金资产组合情况 .....	57
8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合 .....	57
8.3 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 .....	57
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动 .....	58

8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合 .....	58
8.6 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 .....	58
8.7 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 .....	58
8.8 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 .....	59
8.9 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 .....	59
8.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 .....	59
8.11 投资组合报告附注 .....	59
<b>§ 9 基金份额持有人信息 .....</b>	<b>60</b>
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....	60
9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....	61
9.3 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 .....	61
9.4 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理本人及其直系亲属持有本人管理的产品情况 .....	61
<b>§ 10 开放式基金份额变动 .....</b>	<b>61</b>
<b>§ 11 重大事件揭示 .....</b>	<b>62</b>
11.1 基金份额持有人大会决议 .....	62
11.2 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 .....	62
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....	63
11.4 基金投资策略的改变 .....	63
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....	63
11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况 .....	63
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	63
11.8 其他重大事件 .....	65
<b>§ 12 影响投资者决策的其他重要信息 .....</b>	<b>67</b>
12.1 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 .....	67
12.2 影响投资者决策的其他重要信息 .....	67
<b>§ 13 备查文件目录 .....</b>	<b>67</b>
13.1 备查文件目录 .....	67
13.2 存放地点 .....	68
13.3 查阅方式 .....	68

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	大成稳安 60 天滚动持有债券型证券投资基金		
基金简称	大成稳安 60 天滚动持有债券		
基金主代码	013790		
基金运作方式	契约型开放式		
基金合同生效日	2021 年 12 月 9 日		
基金管理人	大成基金管理有限公司		
基金托管人	中国农业银行股份有限公司		
报告期末基金份 额总额	52,316,944.79 份		
基金合同存续期	不定期		
下属分级基金的基 金简称	大成稳安 60 天滚动持有债 券 A	大成稳安 60 天滚动持有 债券 C	大成稳安 60 天滚动持有 债券 E
下属分级基金的交 易代码	013790	013791	013792
报告期末下属分级 基金的份额总额	51,604,287.89 份	289,690.27 份	422,966.63 份

### 2.2 基金产品说明

投资目标	以保持基金资产的安全性和适当流动性为首要目标，追求高于业绩比较基准的稳定收益。
投资策略	本基金以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-新综合全价(1 年以下)指数收益率*90%+银行活期存款利率(税后)*10%
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	中国农业银行股份有限公司
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	95599
传真	0755-83199588	010-68121816
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	北京市东城区建国门内大街 69 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、	北京市西城区复兴门内大街 28 号凯晨世贸中心东座 F9

	27-33 层	
邮政编码	518054	100031
法定代表人	吴庆斌	谷澍

## 2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《上海证券报》
登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	www.dcfund.com.cn
基金年度报告备置地点	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
会计师事务所	安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）	北京市东城区东长安街 1 号东方广场安永大楼 17 层 01-12 室
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、基金净值表现及利润分配情况

### 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	2022 年			2021 年 12 月 9 日 (基金合同生效日)-2021 年 12 月 31 日		
	大成稳安 60 天滚动持有债券 A	大成稳安 60 天滚动持有债券 C	大成稳安 60 天滚动持有债券 E	大成稳安 60 天滚动持有债券 A	大成稳安 60 天滚动持有债券 C	大成稳安 60 天滚动持有债券 E
本期已实现收益	2,262,146.19	16,736.09	44,723.69	291,468.98	991.30	15,229.94
本期利润	2,163,195.04	15,268.30	48,182.19	387,477.79	1,347.55	20,465.19
加权平均基金份额本期利润	0.0296	0.0274	0.0347	0.0019	0.0018	0.0019
本期加权平均净值利润率	2.92%	2.70%	3.44%	0.19%	0.18%	0.19%
本期基金份额净值增长率	2.63%	2.45%	2.53%	0.19%	0.18%	0.19%
3.1.2 期末数据和指标	2022 年末			2021 年末		
期末可供分配利润	1,462,109.44	7,604.73	11,491.60	291,468.98	991.30	15,229.94
期末可供分配基金份额利润	0.0283	0.0263	0.0272	0.0014	0.0013	0.0014
期末基金资产净值	53,066,397.33	297,295.00	434,458.23	202,490,784.76	751,450.68	11,041,949.73
期末基金份额净值	1.0283	1.0263	1.0272	1.0019	1.0018	1.0019

3.1.3 累计期末指标	2022 年末			2021 年末		
基金份额累计净值增长率	2.83%	2.63%	2.72%	0.19%	0.18%	0.19%

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

大成稳安 60 天滚动持有债券 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
过去三个月	0.44%	0.02%	0.21%	0.02%	0.23%	0.00%
过去六个月	0.95%	0.02%	0.41%	0.01%	0.54%	0.01%
过去一年	2.63%	0.02%	1.34%	0.01%	1.29%	0.01%
自基金合同生效起至今	2.83%	0.02%	1.47%	0.01%	1.36%	0.01%

大成稳安 60 天滚动持有债券 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
过去三个月	0.40%	0.02%	0.21%	0.02%	0.19%	0.00%
过去六个月	0.87%	0.02%	0.41%	0.01%	0.46%	0.01%
过去一年	2.45%	0.02%	1.34%	0.01%	1.11%	0.01%
自基金合同生效起至今	2.63%	0.02%	1.47%	0.01%	1.16%	0.01%

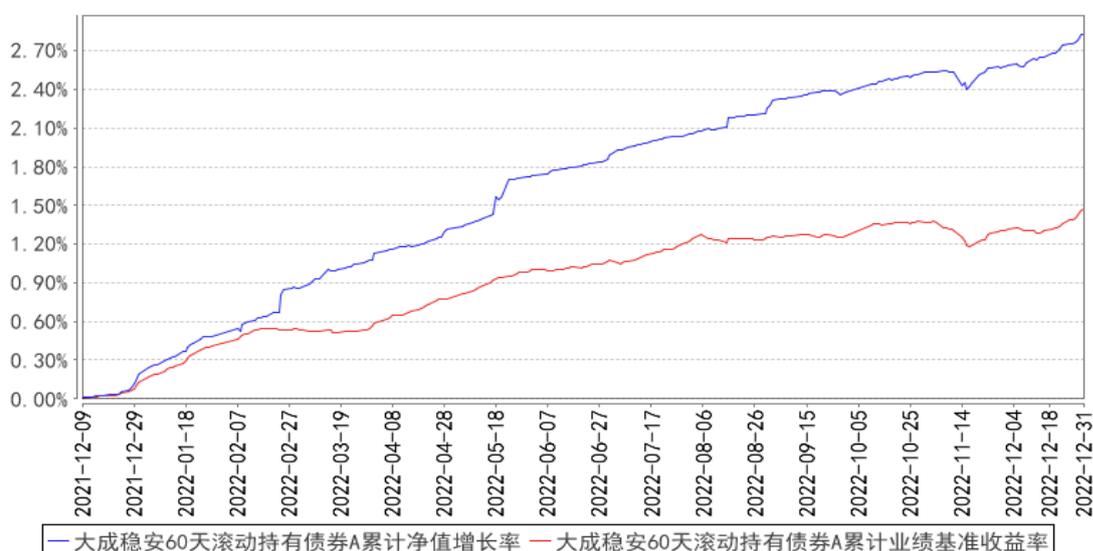
大成稳安 60 天滚动持有债券 E

阶段	份额净值	份额净值增	业绩比较	业绩比较基	①-③	②-④
----	------	-------	------	-------	-----	-----

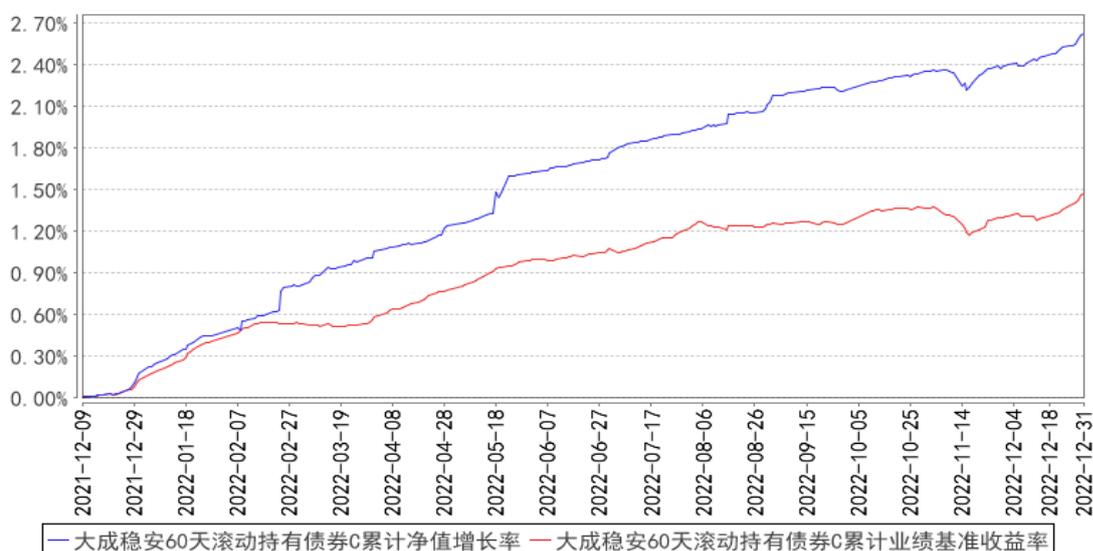
	增长率①	长率标准差 ②	基准收益 率③	准收益率标 准差④		
过去三个月	0.42%	0.02%	0.21%	0.02%	0.21%	0.00%
过去六个月	0.90%	0.02%	0.41%	0.01%	0.49%	0.01%
过去一年	2.53%	0.02%	1.34%	0.01%	1.19%	0.01%
自基金合同生效 起至今	2.72%	0.02%	1.47%	0.01%	1.25%	0.01%

### 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

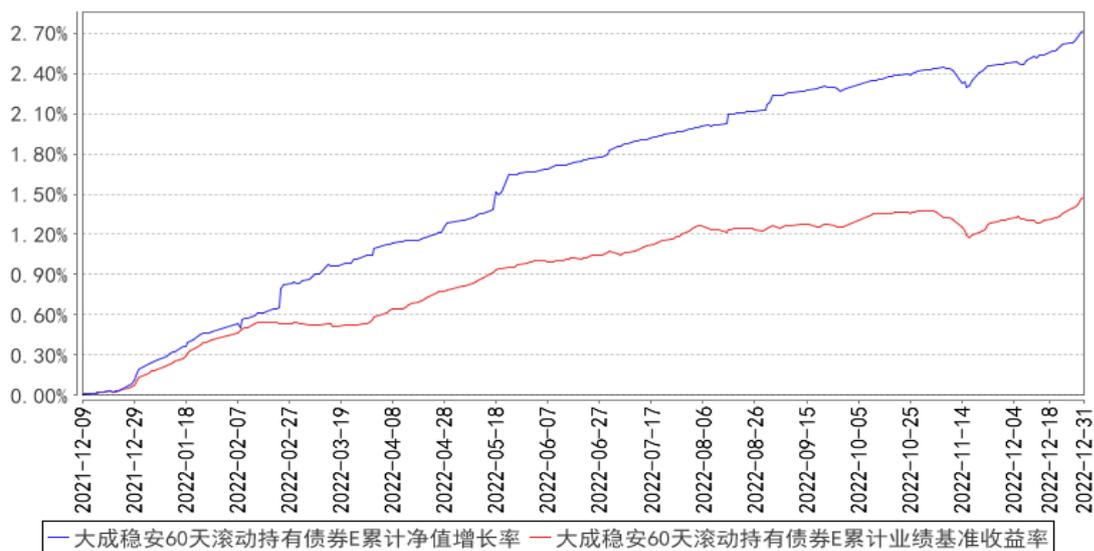
大成稳安60天滚动持有债券A累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



大成稳安60天滚动持有债券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



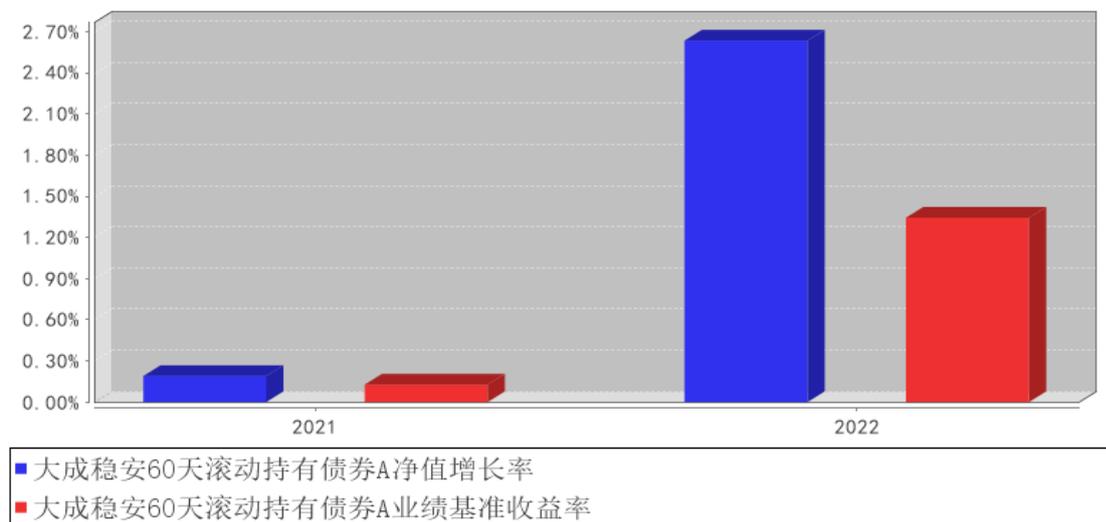
大成稳安60天滚动持有债券E累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



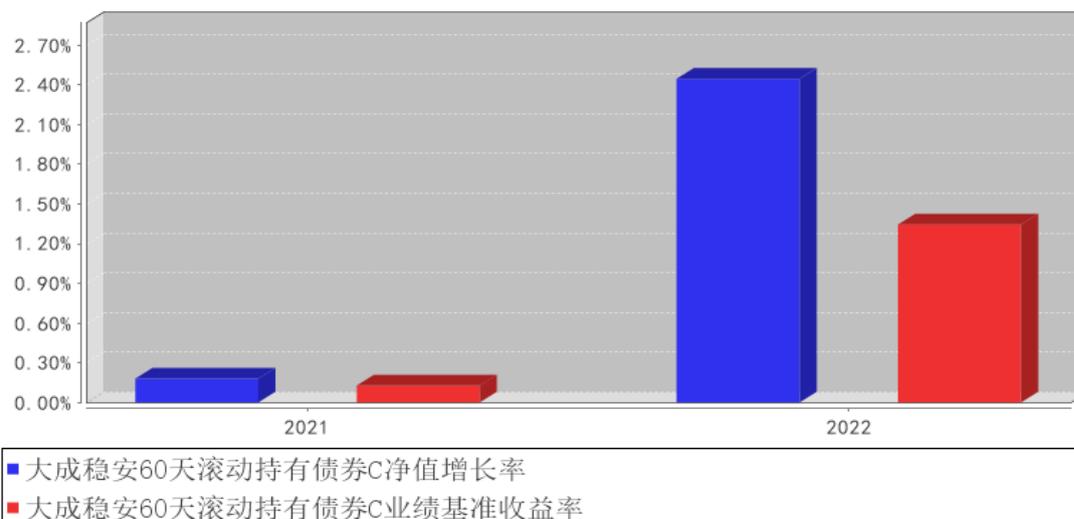
注：本基金合同规定，基金管理人应当自基金合同生效之日起六个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的约定。建仓期结束时，本基金的投资组合比例符合基金合同的约定。

### 3.2.3 自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

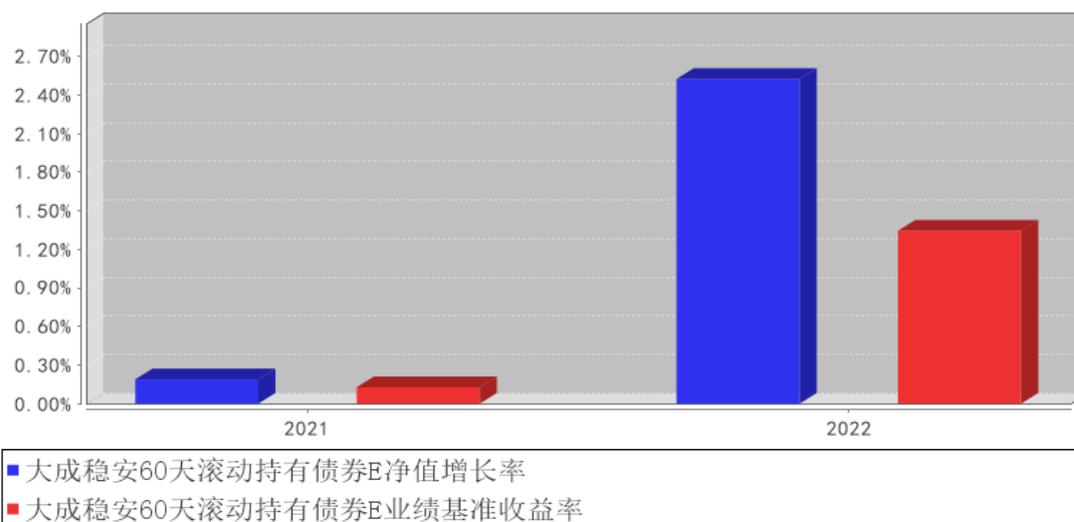
大成稳安60天滚动持有债券A基金每年净值增长率与同期业绩比较基准收益率的对比图



大成稳安60天滚动持有债券C基金每年净值增长率与同期业绩比较基准收益率的对比图



大成稳安60天滚动持有债券E基金每年净值增长率与同期业绩比较基准收益率的对比图



注：合同生效当年按实际存续期计算，不按整个自然年度进行折算。

### 3.3 过去三年基金的利润分配情况

无。

## § 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。

历经二十多年的发展，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		
汪伟	本基金基金经理	2021 年 12 月 9 日	-	9 年	暨南大学金融学硕士。曾担任广州证券资产管理部债券投资经理、金鹰基金集中交易部交易主管、广东南粤银行金融市场部债券投资经理、金鹰基金固定收益部基金经理。2019 年 5 月加入大成基金管理有限公司，任职于固定收益总部。2019 年 9 月 12 日至 2020 年 9 月 18 日任大成惠福纯债债券型证券投资基金基金经理。2019 年 9 月 12 日至 2022 年 6 月 7 日任大成景盈债券型证券投资基金基金经理。2019 年 10 月 15 日至 2020 年 10 月 30 日任大成中债 1-3 年国开行债券指数证券投资基金基金经理。2020 年 2 月 27 日至 2022 年 8 月 9 日任大成景泰纯债债券型证券投资基金基金经理。2020 年 2 月 28 日至 2022 年 8 月 9 日任大成景乐纯债债券型证券投资基金基金经理。2020 年 6 月 19 日起任大成景悦中短债债券型证券投资基金基金经理。2020 年 8 月 31 日至 2021 年 9 月 24 日任大成景优中短债债券型证券投资基金基金经理。2021 年 12 月 9 日起任大成稳安 60 天滚动持有债券型证券投资基金基金经理。2021 年 12 月 20 日起任大成惠源一年定期开放债券型发起式证券投资基金基金经理。2022 年 3 月 28 日起任大成稳益 90 天滚动持有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。

#### 4.1.4 基金经理薪酬机制

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 公平交易制度和控制方法

根据《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》的规定，公司制订了《大成基金管理有限公司公平交易制度》、《大成基金管理有限公司异常交易监控与报告制度》。公司旗下投资组合严格按照制度的规定，参与股票、债券的一级市场申购、二级市场交易等投资管理活动，内容包括授权、研究分析、投资决策、交易执行、业绩评估等与投资活动相关的各个环节。研究部负责提供投资研究支持，投资部门负责投资决策，交易管理部负责实施交易并实时监控，监察稽核部负责事前监督、事中检查和事后稽核，风险管理部负责对交易情况进行合理性分析，通过多部门的协作互控，保证了公平交易的可操作、可稽核和可持续。

#### 4.3.2 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。

#### 4.3.2.1 增加执行的基金经理公平交易制度执行情况及公平交易管理情况

无。

#### 4.3.3 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 8 笔同日反向交易，原因为流动性需要或投资策略需要。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 4 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 年国内债市缺乏趋势性机会，利率债全年整体呈现震荡格局，信用债在四季度行情的快速冲击后小幅走熊。

从收益率曲线的角度回顾，在全年衰退性宽松导致的流动性充裕的格局下，收益率曲线小幅陡峭化。利率债收益率曲线短端全年下行 10-15bp，中短端基本持平，中长端上行 5bp 左右。信用债收益率曲线短端全年基本持平，中短端上行 15bp，中端上行 25bp。

从时间线来回顾，全年行情整体可分为三段。一季度市场呈区间震荡走势，年初降息幅度超预期下各期限收益快速下探，但春节后市场在宽信用预期叠加楼市刺激加码以及通胀隐忧的多重冲击下加速调整；二至三季度伴随楼市持续低迷等因素继续压制经济修复进程、8 月 mlf 意外降息、市场风险偏好收缩理财加速扩容增配债券类资产，市场持续半年震荡走强；四季度因地产政策加码等因素，导致利率波动放大，扩容后的净值型理财加剧债市的负反馈，市场在赎回潮下快速下跌，至年末前半个月逐步反弹企稳。分季度来看：

一季度国内债市收益率先下后上并逐步企稳，整体呈区间震荡走势，各期限收益率季末相较季初整体持平。1 月国内债市开门红，行情向牛陡演绎。随着 2022 年专项债额度低于预期及去年 12 月社融数据继续不及预期，债市情绪逐步回暖。月中市场期待已久的降息落地再度点燃市场做多情绪，预期落地但降息 10bp 幅度超出市场此前普遍预期（5bp），且央行新闻发布会对于货币宽松的表态进一步助涨市场情绪，收益率曲线尤其是 5 年以内品种加速下行，最大下行幅度均超 20bp。直至春节前一周止盈压力下，市场回调企稳。2 月债市开启调整，收益率曲线整体上行 10bp 左右。春节后海外通胀预期进一步推升美债利率，国内债市情绪受外盘影响有所降温。随着 1 月大超预期的社融信贷数据公布，债市僵局就此打破，宽信用预期得以证实，债市集聚已久的调整压力开

始释放。而后随着广州等城市的房贷利率的下调，楼市放松预期进一步强化，债市继续调整，10 年国债指标券利率一度回升至 2.85，一年期利率也受市场情绪和 2 月下旬的流动性影响下开始回升。3 月债市震荡企稳，除短端利率季节性延续升势以外，各期限基本持平。3 月市场整体陷入胶着，一方面 2 月社融的再度回落使得市场对于宽信用效果再起忧虑，而楼市销售的持续萎靡和房企违约范围的继续扩大，进一步加剧市场对信用修复持续性的悲观预期。另一方面国内环境变化使得经济阶段压力加剧，3 月 pmi 再度回落至收缩区间（49.5）。市场对于货币放松预期也在谨慎发酵，10 年国债本轮上行始终未能有效突破 2.85 的政策利率，主因即是对于货币政策仍有期待。不过 3 月央行并未如期开启宽松窗口，我们判断这既有 FED 开启加息周期导致美债大幅上行进而对内部宽松政策有一定制约，又有地缘政治冲突导致原油为代表大宗商品再度飙升，使得输入性通胀压力上升 ppi 居高不下。月内宽松预期的落空以及各地楼市政策的调整，对于利率下行也形成了制约，故 3 月债市整体维持震荡，走势胶着僵局短期难破。

二季度国内债市延续震荡，收益曲线显著陡峭化，其中短端收益率受益于流动性环境下行明显，中端及长端收益率先下后上整体呈区间震荡走势。截至季末，短端较季初下行 25bp，中端及长端收益率较季初整体持平，信用债整体优于利率债。4 月债市在现实与预期的矛盾中纠结反复，缺乏方向指引。从利率债收益曲线来看，仅两年内期限收益有显著下行，而中长端则震荡持平，收益率曲线呈显著陡峭化。两个层面现实与预期的矛盾，是 4 月债市陡峭化的主因。一是二季度经济开局压力陡增，加之地产修复进程依然较慢，债市在基本上获得支撑。但考虑到国内环境，尤其是下旬开始市场不敢过渡押注债市，中长端由此保持震荡。二是流动性层面，4 月因央行利调上缴和降准 0.25%，使得市场流动性极度充裕，回购利率和存单利率均回落至年初以来低位。充裕的流动性支撑使得资金向短端聚集，收益率曲线由此陡峭化，尤其是信用短端在 4 月一度出现资产荒的局面，这也是机构短久期票息策略的共识造就的结果。不过市场对于流动性的预期，也未呈现出过渡乐观，主因还是在于海外加息、汇率和 ppi 承压下，货币宽松制约增多，故首次 0.25%幅度的降准也体现了货币宽松的约束，因而市场对于后续流动的预期也更为理性。5 月债市情绪进一步提升，收益率曲线延续陡峭化下行，其中短端利率在充裕的流动性支撑下下行近 20bp，中端乃至长段利率在经济悲观预期下也有 10bp 的下行幅度。楼市的低迷等因素继续压制着经济修复进程，而 4 月跳水的社融数据和稳经济大盘会议中对经济压力的确认，进一步助涨了债市行情。6 月债市情绪逐步降温，收益率整体上行 10bp 左右，曲线小幅陡峭化调整。月初伴随 5 月 pmi 超预期以及复工复产开启，市场对于经济基本面复苏企稳预期增强，债市由此开启调整。中旬开始，在宽松的流动性环境支撑下，以及 5 月社融总量不错但结构依然欠佳，经济数据显示修复方向确立但节奏平缓，债市下跌动能趋缓，但亦缺乏上涨动力。下旬流动性逐步收敛，尤其是关键时点

非银流动性紧张加剧，但依然未能引起市场重视，债市僵局延续。直至月末，随着基本面修复预期加剧，市场再度打破僵局收益率突破上行，10 年国债再度攀升至年初以来的高位 2.85 附近，但信用债中短端表现仍相对较强。

三季度国内债市收益率曲线延续陡峭化下行，但下行幅度显著收缩。其中中长端品种在经济修复节奏偏弱的预期支撑下小幅下行 5-6bp，且震荡加剧。中短端品种在充裕的流动性环境支撑下下行 10bp 左右。7 月债市收益率加速陡峭化下行。此前市场预计的流动性逐步收敛的情况非但没有出现，反而宽松程度进一步加剧，银行间回购利率 dr001 进一步下行至 1% 的低位附近。财政支出的加速是流动性超预期的主要来源。6 月地方专项债发行募集的资金在 7 月支出形成流动性堰塞湖，进一步加剧了市场的宽松预期。同时政治局会议对于年内增长目标的淡化，也加深了市场对于经济悲观的预期程度，使得市场对于流动性宽松可维持时间也进一步乐观。加上 7 月地方债供给缺位和城投债供给缩量，供需缺口加剧配置压力，市场选择进一步做陡收益率曲线，长段利率也有近 10bp 下行。8 月 mlf 意外降息再度点燃债市做多情绪，收益率曲线低位区间再度下探 12-13bp。上半月债市长端利率窄幅震荡，月初偏弱的 pmi、台海事件对风险偏好的打压以及孱弱的社融均未能打破长端利率的震荡区间，绝对利率水平的偏低制约了长端利率下行空间。短端利率在月初流动性环境的支持下，再创年内新低，一年存单最低下行至 1.87%，但随后在资金利率收敛预期和空转套利的担忧下开始反弹。月中市场普遍预期 mlf 缩量续作，但央行超预期降息 10bp 使得收益率曲线加速下探并创年内新低，长端及超长端利率均已下行至近 20 年的最低位，随后在止盈压力下小幅回调。9 月债市开启调整，收益率曲线整体上行 15bp。上半月现券收益维持在历史低位窄幅震荡盘整，但从月中开始债市调整压力逐步显现。小幅收紧的市场流动性、逐步改善的信贷社融数据、略超市场预期经济表现，均对债市情绪形成了压制。而中美利差的严重倒挂，导致下旬汇率调整压力陡增，且一度跌穿 7.2 的关键位置，汇率对利率的累积压力也在下旬进一步加速对债市调整的助推。临近月末地产信贷政策进一步放松，叠加节前的避险情绪，债市进一步承压，10 年期国债一度调整触及政策利率水平。

四季度国内债市如期调整，下跌幅度较深且跌速较快。地产政策的加码等因素看似是本轮下跌的发令枪，但背后深层次的原因，其实是大半年宽松的流动性环境和经济下行压力下市场风险偏好急剧收缩，银行理财在此背景下大幅扩容，使得各类债券收益率均回落至历史极低位。而一旦利率出现波动，扩容后的净值型理财又容易加剧债市的负反馈效应，债市因此进入非稳态。10 月债市再度走强，收益率曲线整体下行 12bp。长假后流动性阶段充裕加之 9 月调整幅度尚可，市场情绪再度回暖。而对经济压制的担忧，助力市场情绪向好。中旬开始，MLF 等额续作降准预期落空，加之流动性收紧，市场小幅调整。下旬伴随楼市销售继续疲弱及市场风险偏好大幅回落，

债市延续十月回暖行情并重回收益低位区间。11 月债市开启大幅下跌模式，其中短端下跌幅度显著大于长端（1 年国债上行 40bp，10 年国债上行 25bp），收益率曲线熊平调整。月初资金面即出现异常收敛，且同业存单一级发行利率持续攀升，带动债市开启调整。而随着地产支撑等方面政策的陆续加码，债市下跌开始进入加速期。并由此触发负债端的负反馈，即债市快速下跌引发基金赎回并抛售资产进一步加剧债市调整，同时理财产品也因净值的回撤触发赎回加剧抛售，由此导致债市下跌加速，信用债跌幅显著超越利率债，信用利差快速走阔。而月中的降准预期落地，并未能提振市场，反而随着宽松预期落地，市场延续调整至月末。12 月债市先跌后涨，利率信用分化延续，曲线陡峭化修复。上半月债市在理财和基金的抛压下，延续 11 月以来的下跌走势。随着监管层对理财赎回问题的关注并及时出手维稳，加之央行加大流动性的投入市场流动性充裕跨年无忧，同时下半月理财高峰度过以及部分品种配置价值显现，债市在下半月开始连续回暖。利率债方面，月内呈震荡下行走势，中短端品种下半月回落幅度更大，收益率曲线整体陡峭化修复，全月来看长段利率下行 5bp 以内，中短端下行近 10bp。信用债方面，短端品种在上半月加速上行后，下半月基本修复回落至月初水平，中长端品种回落幅度有限且全月仍有逾 20bp 的上行空间。

产品投资策略：

稳安前三季度始终保持短久期高评级信用策略，以票息收益为稳定的基础收益，同时灵活把握长段利率债波动的机会予以增强组合收益。四季度进一步将组合久期压缩至 0.3 年附近规避市场调整。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末大成稳安 60 天滚动持有债券 A 的基金份额净值为 1.0283 元，本报告期基金份额净值增长率为 2.63%，同期业绩比较基准收益率为 1.34%；截至本报告期末大成稳安 60 天滚动持有债券 C 的基金份额净值为 1.0263 元，本报告期基金份额净值增长率为 2.45%，同期业绩比较基准收益率为 1.34%；截至本报告期末大成稳安 60 天滚动持有债券 E 的基金份额净值为 1.0272 元，本报告期基金份额净值增长率为 2.53%，同期业绩比较基准收益率为 1.34%。

#### 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 2023 年，随着理财赎回压力的缓解、宏观经济偏弱的现实仍待时间修复，且年初降息预期再度升温，债市有望在年初震荡企稳并存在一定的交易性机会，部分品种也存在稳定的配置价值。但考虑到经济活动正在逐步改善，在央行流动性保障的过程中资金面波动和分层也较难避免，并且理财赎回压力仍是市场不稳定的扰动因素，故对于市场的交易空间不宜高估。尤其是经过去年年末以来的持续修复，可期待的空间已经较为有限。

中期来看，随着地产支持政策的持续加码以及消费场景的恢复和消费意愿的提升对居民消费

的推动，去年拖累宏观经济的两个主要引擎投资和消费，均有望在政策助力下逐步修复，进而推动实体经济复苏。在经济增速向潜在增速回升的过程中，债券仍面临一定的调整压力。不过考虑到今年外需回落对经济修复的反向牵制，以及地产修复进程的不宜高估，实体经济或呈现出温和回升的趋势，那么利率上行的空间也较为有限。加之去年四季度的快速调整，使得当前债市已经具备一定的价值，故对于今年债市也不宜过度悲观。以中高评级中短久期信用为盾，以利率波动为矛，相信在 2023 年仍有较为稳健的可为空间。

#### 4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

本报告期内，依据相关的法律法规、基金合同以及内部监察稽核制度，本基金管理人对本基金运作、内部管理、制度执行及遵规守法情况进行了监察稽核。内部监察稽核的重点是：国家法律法规及行业监管规则的执行情况；基金合同的遵守情况；内部规章制度的执行情况；资讯管制和保密工作落实情况；员工职业操守规范情况，目的是规范基金财产的运作，防范和控制投资风险，确保经营业务的稳健运行和受托资产的安全完整，维护本基金份额持有人的合法权益。

（一）根据最新的法律法规、规章、规范性文件，本基金管理人及时制定了相应的公司制度，并对现有制度进行不断修订和完善，确保本基金管理人内控制度的适时性、全面性和合法合规性。同时，为保障制度的适时性，避免部分内控制度、业务规则与业务发展不相适应，报告期内本基金管理人组织各部门对内部管理制度作了进一步梳理和完善。

（二）全面加强风险监控，不断提高基金业务风险管理水平。为督促各部门完善并落实各项内控措施，公司严格执行风险控制管理员制度，健全内控工作协调机制及监督机制，并进一步加强投资风险数量化评价能力及事前风险防范能力，有效防范相关业务风险。同时，公司严格执行投资报备制度，建立了基金从业人员证券投资管理监控信息系统，将投资报备工作纳入常态。

（三）日常监察和专项监察相结合，确保监察稽核的有效性和深入性。本年度，公司继续对本基金销售、宣传等方面的材料、协议及其他法律资料等进行了严格审查，对本基金各项投资比例、投资权限、基金交易、股票投资限制、股票库维护等方面进行实时监控，同时，还专门针对基金投资交易（包括公平交易、转债投资、投资权限、投资比例、流动性风险、基金重仓股等）、基金运营（基金头寸、基金结算、登记清算等）、网上交易、基金销售等进行专项监察。通过日常监察，保证了公司监察的全面性、实时性，通过专项监察，及时发现并纠正了业务中的潜在风险，加强了业务部门和人员的风险意识，从而较好地预防了风险的发生。

（四）加强了对投资管理人员通讯工具在交易时间的集中管理，定期或不定期对投资管理人员的网络即时通讯记录、电话录音等进行抽查，有效的防范了各种形式的利益输送行为。

（五）以多种方式加强合规教育与培训，提高全公司的合规守法意识。及时向全公司传达与

基金相关的法律法规，并要求公司各部门贯彻到日常工作中。公司监察稽核部通过解答各业务部门提出的法律问题，提供法律依据，对于较为重大疑难法律事项及时咨询公司外部律师或监管部门，避免了业务发展中的盲目性，及时防范风险，维护了基金份额持有人的利益。

#### 4.7 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。

#### 4.8 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。

#### 4.9 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

无。

### § 5 托管人报告

#### 5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

在托管本基金的过程中，本基金托管人中国农业银行股份有限公司严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》相关法律法规的规定以及基金合同、托管协议的约定，对本基金基金管理人——大成基金管理有限公司 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日基金的投资运作，进行了认真、独立的会计核算和必要的投资监督，认真履行了托管人的义务，没有从事任何损害基金份额持有人利益的行为。

#### 5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

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

#### 5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

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

### § 6 审计报告

审计报告标题	审计报告
审计报告收件人	大成稳安 60 天滚动持有债券型证券投资基金全体基金份额持有人
审计意见	我们审计了大成稳安 60 天滚动持有债券型证券投资基金（以下简称“大成稳安 60 天债券基金”）的财务报表，包括 2022 年 12 月 31 日的资产负债表，2022 年度的利润表、净资产（基金净值）变动表以及相关财务报表附注。我们认为，后附的大成稳安 60 天债券基金的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则的规定编制，公允反映了大成稳安 60 天债券基金 2022 年 12 月 31 日的财务状况以及 2022 年度的经营成果和净值变动情况。

形成审计意见的基础	我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。审计报告的“注册会计师对财务报表审计的责任”部分进一步阐述了我们在这些准则下的责任。按照中国注册会计师职业道德守则，我们独立于大成稳安 60 天债券基金，并履行了职业道德方面的其他责任。我们相信，我们获取的审计证据是充分、适当的，为发表审计意见提供了基础。
其他信息	大成稳安 60 天债券基金管理层对其他信息负责。其他信息包括年度报告中涵盖的信息，但不包括财务报表和我们的审计报告。我们对财务报表发表的审计意见不涵盖其他信息，我们也不对其他信息发表任何形式的鉴证结论。结合我们对财务报表的审计，我们的责任是阅读其他信息，在此过程中，考虑其他信息是否与财务报表或我们在审计过程中了解到的情况存在重大不一致或者似乎存在重大错报。基于我们已执行的工作，如果我们确定其他信息存在重大错报，我们应当报告该事实。在这方面，我们无任何事项需要报告。
管理层和治理层对财务报表的责任	管理层负责按照企业会计准则的规定编制财务报表，使其实现公允反映，并设计、执行和维护必要的内部控制，以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。在编制财务报表时，管理层负责评估大成稳安 60 天债券基金的持续经营能力，披露与持续经营相关的事项（如适用），并运用持续经营假设，除非计划进行清算、终止运营或别无其他现实的选择。治理层负责监督大成稳安 60 天债券基金的财务报告过程。
注册会计师对财务报表审计的责任	我们的目标是对财务报表整体是否不存在由于舞弊或错误导致的重大错报获取合理保证，并出具包含审计意见的审计报告。合理保证是高水平的保证，但并不能保证按照审计准则执行的审计在某一重大错报存在时总能发现。错报可能由于舞弊或错误导致，如果合理预期错报单独或汇总起来可能影响财务报表使用者依据财务报表作出的经济决策，则通常认为错报是重大的。在按照审计准则执行审计工作的过程中，我们运用职业判断，并保持职业怀疑。同时，我们也执行以下工作：（1）识别和评估由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险，设计和实施审计程序以应对这些风险，并获取充分、适当的审计证据，作为发表审计意见的基础。由于舞弊可能涉及串通、伪造、故意遗漏、虚假陈述或凌驾于内部控制之上，未能发现由于舞弊导致的重大错报的风险高于未能发现由于错误导致的重大错报的风险。（2）了解与审计相关的内部控制，以设计恰当的审计程序，但目的并非对内部控制的有效性发表意见。（3）评价管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计及相关披露的合理性。（4）对管理层使用持续经营假设的恰当性得出结论。同时，根据获取的审计证据，就可能导致对大成稳安 60 天债券基金持续经营能力产生重大疑虑的事项或情况是否存在重大不确定性得出结论。如果我们得出结论认为存在重大不确定性，审计准则要求我们在审计报告中提请报表使用者注意财务报表中的

	相关披露：如果披露不充分，我们应当发表非无保留意见。我们的结论基于截至审计报告日可获得的信息。然而，未来的事项或情况可能导致大成稳安 60 天债券基金不能持续经营。（5）评价财务报表的总体列报（包括披露）、结构和内容，并评价财务报表是否公允反映相关交易和事项。我们与治理层就计划的审计范围、时间安排和重大审计发现等事项进行沟通，包括沟通我们在审计中识别出的值得关注的内部控制缺陷。	
会计师事务所的名称	安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）	
注册会计师的姓名	昌 华	吴嘉欣
会计师事务所的地址	北京市东城区东长安街1号东方广场安永大楼17层01-12室	
审计报告日期	2023年03月29日	

## § 7 年度财务报表

### 7.1 资产负债表

会计主体：大成稳安 60 天滚动持有债券型证券投资基金

报告截止日：2022 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2022 年 12 月 31 日	上年度末 2021 年 12 月 31 日
<b>资 产：</b>			
银行存款	7.4.7.1	304,398.21	394,490.30
结算备付金		1,743,880.12	2,907,539.68
存出保证金		326.00	201,520.00
交易性金融资产	7.4.7.2	51,944,889.35	233,574,000.00
其中：股票投资		-	-
基金投资		-	-
债券投资		51,944,889.35	233,574,000.00
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
其他投资		-	-
衍生金融资产	7.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	-	30,000,000.00
债权投资	7.4.7.5	-	-
其中：债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
其他投资		-	-
其他债权投资	7.4.7.6	-	-
其他权益工具投资	7.4.7.7	-	-
应收清算款		-	-
应收股利		-	-
应收申购款		1,825.21	-

递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.8	-	1,102,799.97
资产总计		53,995,318.89	268,180,349.95
<b>负债和净资产</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2022 年 12 月 31 日</b>	<b>上年度末 2021 年 12 月 31 日</b>
<b>负 债:</b>			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	7.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	53,849,788.07
应付清算款		-	-
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		9,187.83	25,792.72
应付托管费		2,296.94	6,448.19
应付销售服务费		89.99	754.99
应付投资顾问费		-	-
应交税费		6,234.92	5,040.64
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.9	179,358.65	8,340.17
负债合计		197,168.33	53,896,164.78
<b>净资产:</b>			
实收基金	7.4.7.10	52,316,944.79	213,874,894.64
其他综合收益	7.4.7.11	-	-
未分配利润	7.4.7.12	1,481,205.77	409,290.53
净资产合计		53,798,150.56	214,284,185.17
负债和净资产总计		53,995,318.89	268,180,349.95

注：（1）报告截止日 2022 年 12 月 31 日，基金份额总额 52,316,944.79 份，其中大成稳安 60 天滚动持有债券 A 基金份额 51,604,287.89 份，基金份额净值 1.0283 元；大成稳安 60 天滚动持有债券 C 基金份额 289,690.27 份，基金份额净值 1.0263 元；大成稳安 60 天滚动持有债券 E 基金份额 422,966.63 份，基金份额净值 1.0272 元。

（2）以下比较数据已根据本年《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〉》中的资产负债表格式的要求进行列示：上年末资产负债表中“应收利息”与“其他资产”项目的“本期末”余额合并列示在本期末资产负债表中“其他资产”项目的“上年度末”余额，上年末资产负债表中“应付交易费用”、“应付利息”与“其他负债”科目的“本期末”余额合并列示在本期末资产负债表“其他负债”项目的“上年度末”余额。

## 7.2 利润表

会计主体：大成稳安 60 天滚动持有债券型证券投资基金

本报告期：2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2021 年 12 月 9 日（基金 合同生效日）至 2021 年 12 月 31 日
<b>一、营业总收入</b>		2,719,458.56	469,283.96
1. 利息收入		747,709.75	367,683.65
其中：存款利息收入	7.4.7.13	601,192.87	123,044.95
债券利息收入		-	178,881.74
资产支持证券利息 收入		-	-
买入返售金融资产 收入		146,516.88	65,756.96
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-” 填列）		2,068,709.25	-
其中：股票投资收益	7.4.7.14	-	-
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.15	2,102,699.82	-
资产支持证券投资 收益	7.4.7.16	-	-
贵金属投资收益	7.4.7.17	-	-
衍生工具收益	7.4.7.18	-33,990.57	-
股利收益	7.4.7.19	-	-
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）	7.4.7.20	-96,960.44	101,600.31
4. 汇兑收益（损失以“-” 号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-” 号填列）	7.4.7.21	-	-
<b>减：二、营业总支出</b>		492,813.03	59,993.43
1. 管理人报酬	7.4.10.2.1	159,020.81	25,792.72
2. 托管费	7.4.10.2.2	39,755.15	6,448.19
3. 销售服务费	7.4.10.2.3	2,209.69	754.99
4. 投资顾问费		-	-
5. 利息支出		88,400.10	22,167.01
其中：卖出回购金融资产支		88,400.10	22,167.01

出			
6. 信用减值损失	7.4.7.22	-	-
7. 税金及附加		4,265.73	540.07
8. 其他费用	7.4.7.23	199,161.55	4,290.45
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		2,226,645.53	409,290.53
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		2,226,645.53	409,290.53
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		2,226,645.53	409,290.53

注：以下比较数据已根据本年《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>》中的利润表格式的要求进行列示：上年度可比期间利润表中“交易费用”项目与“其他费用”项目的“本期”金额合并列示在本期利润表中“其他费用”项目的“上年度可比期间”金额。

### 7.3 净资产（基金净值）变动表

会计主体：大成稳安 60 天滚动持有债券型证券投资基金

本报告期：2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 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）	213,874,894.64	-	409,290.53	214,284,185.17
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）	213,874,894.64	-	409,290.53	214,284,185.17
三、本期增减变动额（减）	-161,557,949.85	-	1,071,915.24	-160,486,034.61

少以“-”号填列)				
(一)、综合收益总额	-	-	2,226,645.53	2,226,645.53
(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)	-161,557,949.85	-	-1,154,730.29	-162,712,680.14
其中:1.基金申购款	40,506,020.09	-	526,136.16	41,032,156.25
2.基金赎回款	-202,063,969.94	-	-1,680,866.45	-203,744,836.39
(三)、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以“-”号填列)	-	-	-	-
(四)、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资产(基金净值)	52,316,944.79	-	1,481,205.77	53,798,150.56
项目	上年度可比期间 2021年12月9日(基金合同生效日)至2021年12月31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)	-	-	-	-
加:会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期初净资产(基金净值)	213,874,894.64	-	-	213,874,894.64
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	-	-	409,290.53	409,290.53
(一)、综合收益总额	-	-	409,290.53	409,290.53
(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)	-	-	-	-
其中:1.基金申购款	-	-	-	-
2.基金赎回款	-	-	-	-
(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)	213,874,894.64	-	409,290.53	214,284,185.17

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.4 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

## 7.4 报表附注

### 7.4.1 基金基本情况

大成稳安 60 天滚动持有债券型证券投资基金（以下简称“本基金”），系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[2021]3003 号文“关于准予大成稳安 60 天滚动持有债券型证券投资基金注册的批复”的核准，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《大成稳安 60 天滚动持有债券型证券投资基金基金合同》作为发起人向社会公开募集，募集期结束经安永华明会计师事务所验证并出具安永华明（2021）验字第 60469430\_H13 号验资报告后，向中国证监会报送基金备案材料。基金合同于 2021 年 12 月 09 日生效。本基金为契约型开放式，存续期限不定。本基金的基金管理人为大成基金管理有限公司，注册登记机构为本基金管理人，基金托管人为中国农业银行股份有限公司（以下简称“中国农业银行”）。设立时，本基金已收到的首次发售募集的有效认购资金扣除认购费后的净认购金额为人民币 213,810,896.89 元，折合 213,810,896.89 份基金份额；有效认购资金在首次发售募集期内产生的利息为人民币 63,997.75 元，折合 63,997.75 份基金份额。其中 A 类基金已收到的首次发售募

集的有效认购资金扣除认购费后的净认购金额为人民币 202,039,912.25 元,折合 202,039,912.25 份基金份额;有效认购资金在首次发售募集期内产生的利息为人民币 63,394.72 元,折合 63,394.72 份基金份额。C 类基金已收到的首次发售募集的有效认购资金金额为人民币 749,998.54 元,折合 749,998.54 份基金份额;有效认购资金在首次发售募集期内产生的利息为人民币 104.59 元,折合 104.59 份基金份额。E 类基金已收到的首次发售募集的有效认购资金金额为人民币 11,020,986.10 元,折合 11,020,986.10 份基金份额;有效认购资金在首次发售募集期内产生的利息为人民币 498.44 元,折合 498.44 份基金份额。以上收到的实收基金共计人民币 213,874,894.64 元,折合 213,874,894.64 份基金份额。本基金的投资范围主要包括国内依法发行、上市的债券(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、短期融资券、超短期融资券、中期票据、公开发行的次级债券、政府支持机构债、政府支持债券、可分离交易可转债的纯债部分)、资产支持证券、现金、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、债券回购、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,但需符合中国证监会的相关规定。本基金不参与股票、可转换债券(可分离交易可转债中的纯债部分除外)、可交换债券的投资。如果法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种,基金管理人在履行适当程序后,可以将其纳入投资范围。本基金投资于债券资产的比例不低于基金资产的 80%;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,本基金应当保持不低于基金资产净值的 5%的现金或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。如法律法规或监管机构变更投资品种的投资比例限制,基金管理人在履行适当程序后,可以调整上述投资品种的投资比例。本基金的业绩比较基准为:中债-新综合全价(1 年以下)指数收益率\*90%+银行活期存款利率(税后)\*10%。

#### 7.4.2 会计报表的编制基础

本财务报表系按照财政部颁布的《企业会计准则——基本准则》以及其后颁布及修订的具体会计准则、应用指南、解释以及《资产管理产品相关会计处理规定》和其他相关规定(统称“企业会计准则”)编制,同时,在信息披露和估值方面,也参考了中国证监会颁布的《中国证券监督管理委员会关于证券投资基金估值业务的指导意见》、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》、《证券投资基金信息披露内容与格式准则》第 2 号《年度报告的内容与格式》、《证券投资基金信息披露编报规则》第 3 号《会计报表附注的编制及披露》、《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>》以及中国证监会和中国证券投资基金业协会颁布的其他相关规定。本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

### 7.4.3 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 12 月 31 日的财务状况以及 2022 年度的经营成果和净值变动情况。

### 7.4.4 重要会计政策和会计估计

#### 7.4.4.1 会计年度

本基金会计年度为公历 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

#### 7.4.4.2 记账本位币

本基金记账本位币和编制本财务报表所采用的货币均为人民币。除有特别说明外，均以人民币元为单位表示。

#### 7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

金融工具是指形成本基金的金融资产（或负债），并形成其他单位的金融负债（或资产）或权益工具的合同。（1）金融资产分类 本基金的金融资产于初始确认时根据管理金融资产的业务模式和金融资产的合同现金流量特征分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、以摊余成本计量的金融资产；（2）金融负债分类 本基金的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、以摊余成本计量的金融负债。

#### 7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

本基金于成为金融工具合同的一方时确认一项金融资产或金融负债。划分为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，以及不作为有效套期工具的衍生工具，按照取得时的公允价值作为初始确认金额，相关的交易费用在发生时计入当期损益。划分为以摊余成本计量的金融资产和金融负债，按照取得时的公允价值作为初始确认金额，相关交易费用计入其初始确认金额。对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，采用公允价值进行后续计量，所有公允价值变动计入当期损益。对于以摊余成本计量的金融资产，采用实际利率法确认利息收入，其终止确认、修改或减值产生的利得或损失，均计入当期损益。本基金以预期信用损失为基础，对以摊余成本计量的金融资产进行减值处理并确认损失准备。对于不含重大融资成分的应收款项，本基金运用简化计量方法，按照相当于整个存续期内的预期信用损失金额计量损失准备。除上述采用简化计量方法以外的金融资产，本基金在每个估值日评估其信用风险自初始确认后是否已经显著增加，如果信用风险自初始确认后未显著增加，处于第一阶段，本基金按照相当于未来 12 个月内预期信用损失的金额计量损失准备，并按照账面余额和实际利率计算利息收入；如果信用风险自初始确认后已显著增加但尚未发生信用减值的，处于第二阶段，本基金按照相当于整个存续期内预期信用损失的金额计量损失准备，并按照账面余额和实际利率计算利息收入；如果

初始确认后发生信用减值的，处于第三阶段，本基金按照相当于整个存续期内预期信用损失的金额计量损失准备，并按照摊余成本和实际利率计算利息收入。本基金在每个估值日评估相关金融工具的信用风险自初始确认后是否已显著增加。本基金以单项金融工具或者具有相似信用风险特征的金融工具组合为基础，通过比较金融工具在估值日发生违约的风险与在初始确认日发生违约的风险，以确定金融工具预计存续期内发生违约风险的变化情况。本基金计量金融工具预期信用损失的方法反映的因素包括：通过评价一系列可能的结果而确定的无偏概率加权平均金额、货币时间价值，以及在估值日无须付出不必要的额外成本或努力即可获得的有关过去事项、当前状况以及未来经济状况预测的合理且有依据的信息。当对金融资产预期未来现金流量具有不利影响的一项或多项事件发生时，该金融资产成为已发生信用减值的金融资产。当本基金不再合理预期能够全部或部分收回金融资产合同现金流量时，本基金直接减记该金融资产的账面余额。当收取该金融资产现金流量的合同权利终止，或该收取金融资产现金流量的权利已转移，且符合金融资产转移的终止确认条件的，金融资产将终止确认。本基金已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的，终止确认该金融资产；保留了金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬的，不终止确认该金融资产；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的，分别下列情况处理：放弃了对该金融资产控制的，终止确认该金融资产并确认产生的资产和负债；未放弃对该金融资产控制的，按照其继续涉入所转移金融资产的程度确认有关金融资产，并相应确认有关负债。对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债（含交易性金融负债和衍生金融负债），按照公允价值进行后续计量，所有公允价值变动均计入当期损益。对于以摊余成本计量的金融负债，采用实际利率法，按照摊余成本进行后续计量。如果金融负债的责任已履行、撤销或届满，则对金融负债进行终止确认。

#### 7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

公允价值，是指市场参与者在计量日发生的有序交易中，出售一项资产所能收到或者转移一项负债所需支付的价格。本基金以公允价值计量相关资产或负债，假定出售资产或者转移负债的有序交易在相关资产或负债的主要市场进行；不存在主要市场的，本基金假定该交易在相关资产或负债的最有利市场进行。主要市场（或最有利市场）是本基金在计量日能够进入的交易市场。本基金采用市场参与者在对该资产或负债定价时为实现其经济利益最大化所使用的假设。

在财务报表中以公允价值计量或披露的资产和负债，根据对公允价值计量整体而言具有重要意义的最低层次输入值，确定所属的公允价值层次：第一层次输入值，在计量日能够取得的相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价；第二层次输入值，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；第三层次输入值，相关资产或负债的不可观察输入值。

每个资产负债表日，本基金对在财务报表中确认的持续以公允价值计量的资产和负债进行重新评估，以确定是否在公允价值计量层次之间发生转换。

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和金融负债按如下原则确定公允价值并进行估值：

(1) 存在活跃市场的金融工具，按照估值日能够取得的相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价作为公允价值；估值日无报价且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，应采用最近交易日的报价确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的报价不能真实反映公允价值的，应对报价进行调整，确定公允价值。

与上述投资品种相同，但具有不同特征的，应以相同资产或负债的公允价值为基础，并在估值技术中考虑不同特征因素的影响。特征是指对资产出售或使用的限制等，如果该限制是针对资产持有者的，那么在估值技术中不应将该限制作为特征考虑。此外，基金管理人不应考虑因大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价；

(2) 不存在活跃市场的金融工具，应采用在当前情况下适用并且有足够可利用数据和其他信息支持的估值技术确定公允价值。采用估值技术确定公允价值时，应优先使用可观察输入值，只有在无法取得相关资产或负债可观察输入值或取得不切实可行的情况下，才使用不可观察输入值。

(3) 如有确凿证据表明按上述方法进行估值不能客观反映其公允价值的，基金管理人可根据具体情况与基金托管人商定后，按最能反映公允价值的方法估值。

(4) 如有新增事项，按国家最新规定估值。

#### 7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

当本基金具有抵销已确认金融资产和金融负债的法定权利，且该种法定权利现在是可执行的，同时本基金计划以净额结算或同时变现该金融资产和清偿该金融负债时，金融资产和金融负债以相互抵销后的金额在资产负债表内列示。除此以外，金融资产和金融负债在资产负债表内分别列示，不予相互抵销。

#### 7.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行基金份额所募集的总金额在扣除损益平准金分摊部分后的余额。由于申购和赎回引起的实收基金份额变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日确认。上述申购和赎回可以包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

#### 7.4.4.8 损益平准金

损益平准金包括已实现损益平准金和未实现损益平准金。已实现损益平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现收益/（损失）占基金净值比例计算

的金额。未实现损益平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未实现利得/(损失)占基金净值比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日确认。未实现损益平准金与已实现损益平准金均在“损益平准金”科目中核算，并于期末全额转入“未分配利润/(累计亏损)”。

#### 7.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

(1) 对于以摊余成本计量的金融资产，采用实际利率法计算的利息扣除在适用情况下的相关税费后的净额确认利息收入，计入当期损益。处置时，其处置价格扣除相关交易费用后的净额与账面价值之间的差额确认为投资收益。

(2) 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，相关交易费用直接计入投资收益。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产为债权投资的，在持有期间将按票面或合同利率计算的利息收入扣除在适用情况下的相关税费后的净额计入投资收益，扣除该部分利息后的公允价值变动额计入公允价值变动损益；除上述之外的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的公允价值变动形成的应计入当期损益的利得或损失扣除在适用情况下预估的增值税费后的净额计入公允价值变动损益。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的相关税费后的净额确认为投资收益。

(3) 其他收入在经济利益很可能流入从而导致资产增加或者负债减少、且经济利益的流入额能够可靠计量时确认。

#### 7.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬和托管费等费用按照权责发生制原则，在本基金接受相关服务的期间计入当期损益。以摊余成本计量的金融负债在持有期间确认的利息支出按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

#### 7.4.4.11 基金的收益分配政策

(1) 在符合有关基金分红条件的前提下，基金管理人可以根据实际情况进行收益分配，具体分配方案以公告为准，若《基金合同》生效不满 3 个月可不进行收益分配；(2) 本基金收益分配方式分为现金分红与红利再投资，投资者可选择现金红利或将现金红利自动转为相应类别的基金份额进行再投资；若投资者不选择，本基金默认的收益分配方式是现金分红；(3) 基金收益分配后各类基金份额净值不能低于面值，即基金收益分配基准日的基金份额净值减去每单位该类基金份额收益分配金额后不能低于面值；(4) 由于本基金 A 类基金份额不收取销售服务费，而 C 类基金份额及 E 类基金份额收取销售服务费，各基金份额类别对应的可供分配利润将有所不同。本基金同一类别每一基金份额享有同等分配权；(5) 对于收益分配方式为红利再投资的基金份

额，每份基金份额（原份额）所获得的红利再投资份额的运作期到期日，与该原份额的运作期到期日一致；（6）法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

#### 7.4.4.12 分部报告

无。

#### 7.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计

无。

### 7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

#### 7.4.5.1 会计政策变更的说明

##### 新金融工具准则

根据《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》、《企业会计准则第 37 号——金融工具列报》（统称“新金融工具准则”）、《关于进一步贯彻落实新金融工具相关会计准则的通知》的规定和相关法规的要求，本基金自 2022 年 1 月 1 日开始按照新金融工具准则进行会计处理。此外，本基金亦已执行财政部于 2022 年发布的《关于印发〈资产管理产品相关会计处理规定〉的通知》（财会〔2022〕14 号）。

新金融工具准则改变了金融资产的分类和计量方式，确定了三个主要的计量类别：摊余成本；以公允价值计量且其变动计入其他综合收益；以公允价值计量且其变动计入当期损益。本基金考虑自身业务模式，以及金融资产的合同现金流特征进行上述分类。

新金融工具准则要求金融资产减值计量由“已发生损失模型”改为“预期信用损失模型”，适用于以摊余成本计量的金融资产。金融资产减值计量的变更对于本基金的影响不重大。

本基金将基于实际利率法计提的金融工具的利息包含在相应金融工具的账面余额中，并反映在相关“银行存款”、“结算备付金”、“存出保证金”、“买入返售金融资产”、“卖出回购金融资产款”等项目中，不单独列示“应收利息”项目或“应付利息”项目。

“信用减值损失”项目，反映本基金计提金融工具信用损失准备所确认的信用损失。本基金将分类为以摊余成本计量的金融资产按照实际利率法计算的利息收入反映在“利息收入”项目中，其他项目的利息收入从“利息收入”项目调整至“投资收益”项目列示。

根据新金融工具准则的衔接规定，对可比期间信息不予调整，首日执行新金融工具准则与原准则的差异追溯调整本报告期期初未分配利润。

于首次执行日（2022 年 1 月 1 日），原金融资产和金融负债账面价值调整为按照修订后金融工具确认和计量准则的规定进行分类和计量的新金融资产和金融负债账面价值的调节如下所述：

## 账面价值

## 银行存款

2021 年 12 月 31 日，按原金融工具准则列示的余额 394,490.30

重分类：转入自应收利息 247.07

重新计量：预期信用损失准备 -

2022 年 1 月 1 日，按新金融工具准则列示的余额 394,737.37

## 结算备付金

2021 年 12 月 31 日，按原金融工具准则列示的余额 2,907,539.68

重分类：转入自应收利息 10,099.93

重新计量：预期信用损失准备 -

2022 年 1 月 1 日，按新金融工具准则列示的余额 2,917,639.61

## 交易性金融资产

2021 年 12 月 31 日，按原金融工具准则列示的余额 233,574,000.00

重分类：转入自应收利息 1,048,961.21

2022 年 1 月 1 日，按新金融工具准则列示的余额 234,622,961.21

## 买入返售金融资产

2021 年 12 月 31 日，按原金融工具准则列示的余额 30,000,000.00

重分类：转入自应收利息 43,491.76

重新计量：预期信用损失准备 -

2022 年 1 月 1 日，按新金融工具准则列示的余额 30,043,491.76

## 应收利息

2021 年 12 月 31 日，按原金融工具准则列示的余额 1,102,799.97

重分类：转出至银行存款 -247.07

重分类：转出至结算备付金 -10,099.93

重分类：转出至存出保证金 -

重分类：转出至交易性金融资产 -1,048,961.21

重分类：转出至买入返售金融资产 -43,491.76

重分类：转出至应收申购款 -

重分类：转出至其他资产 -

2022 年 1 月 1 日，按新金融工具准则列示的余额 不适用

#### 卖出回购金融资产款

2021 年 12 月 31 日，按原金融工具准则列示的余额 53,849,788.07

重分类：转入自应付利息 5,155.45

2022 年 1 月 1 日，按新金融工具准则列示的余额 53,854,943.52

#### 应付利息

2021 年 12 月 31 日，按原金融工具准则列示的余额 5,155.45

重分类：转出至卖出回购金融资产款 -5,155.45

2022 年 1 月 1 日，按新金融工具准则列示的余额 不适用

除上述财务报表项目外，于首次执行日，新金融工具准则的执行对财务报表其他金融资产和金融负债项目无影响。

于首次执行日，新金融工具准则的执行对本基金金融资产计提的减值准备金额无重大影响。上述会计政策变更未导致本基金本期期初未分配利润的变化。

#### 7.4.5.2 会计估计变更的说明

无。

#### 7.4.5.3 差错更正的说明

无。

#### 7.4.6 税项

1、增值税 根据财政部、国家税务总局财税[2016]36 号文《关于全面推开营业税改增值税试点的通知》的规定，经国务院批准，自 2016 年 5 月 1 日起在全国范围内全面推开营业税改征增值税试点，金融业纳入试点范围，由缴纳营业税改为缴纳增值税。对证券投资基金（封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金）管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税；国债、地方政府债利息收入以及金融同业往来利息收入免征增值税；存款利息收入不征收增值税；根据财政部、国家税务总局财税[2016]46 号文《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》的规定，金融机构开展的质押式买入返售金融商品业务及持有政策性金融债券取得的利息收入属于金融同业往来利息收入；根据财政部、国家税务总局财税[2016]70 号文《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》的规定，金融机构开展的买断式买入返售金融商品业务、同业存款、同业存单以及持有金融债券取得的利息收入属于金融同业往来利息收入；根据财政部、国家税务总局财税[2016]140 号文《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》的规定，本基金运营过程中发生的增值税应税行为，以本基金的基金管理人为增值税纳税人；根据财政部、国家税务总局财税[2017]56 号文《关于资管产品增值税有关问题的通知》的

规定，证券投资基金的基金管理人运营证券投资基金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。对证券投资基金在 2018 年 1 月 1 日前运营过程中发生的增值税应税行为，未缴纳增值税的，不再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从证券投资基金的基金管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。增值税应税行为的销售额根据财政部、国家税务总局财税[2017]90 号文《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》的规定确定。

2、城市维护建设税、教育费附加、地方教育附加 根据《中华人民共和国城市维护建设税暂行条例（2011 年修订）》、《征收教育费附加的暂行规定（2011 年修订）》及相关地方教育附加的征收规定，凡缴纳消费税、增值税、营业税的单位和个人，都应当依照规定缴纳城市维护建设税、教育费附加（除按照相关规定缴纳农村教育事业费附加的单位外）及地方教育费附加。

3、企业所得税 根据财政部、国家税务总局财税[2004]78 号文《关于证券投资基金税收政策的通知》的规定，自 2004 年 1 月 1 日起，对证券投资基金（封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金）管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入，继续免征企业所得税；根据财政部、国家税务总局财税[2008]1 号文《关于企业所得税若干优惠政策的通知》的规定，对证券投资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，股权的股息、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。

4、个人所得税 根据财政部、国家税务总局财税[2008]132 号文《财政部、国家税务总局关于储蓄存款利息所得有关个人所得税政策的通知》的规定，自 2008 年 10 月 9 日起，对储蓄存款利息所得暂免征收个人所得税。

#### 7.4.7 重要财务报表项目的说明

##### 7.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2022 年 12 月 31 日	上年度末 2021 年 12 月 31 日
活期存款	304,398.21	394,490.30
等于：本金	304,161.25	394,490.30
加：应计利息	236.96	-
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	304,398.21	394,490.30

## 7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2022 年 12 月 31 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	2,906,665.47	58,897.81	2,958,607.81	-6,955.47
	银行间市场	48,229,004.66	745,681.54	48,986,281.54	11,595.34
	合计	51,135,670.13	804,579.35	51,944,889.35	4,639.87
资产支持证券	-	-	-	-	
基金	-	-	-	-	
其他	-	-	-	-	
合计	51,135,670.13	804,579.35	51,944,889.35	4,639.87	
项目	上年度末 2021 年 12 月 31 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	83,953,808.60	-	83,890,000.00	-63,808.60
	银行间市场	149,519,341.09	-	149,684,000.00	164,658.91
	合计	233,473,149.69	-	233,574,000.00	100,850.31
资产支持证券	-	-	-	-	
基金	-	-	-	-	
其他	0.00	-	-	-	
合计	233,473,149.69	-	233,574,000.00	100,850.31	

## 7.4.7.3 衍生金融资产/负债

## 7.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

单位：人民币元

项目	本期末 2022 年 12 月 31 日			备注
	合同/名义 金额	公允价值		
		资产	负债	
利率衍生工具	-	-	-	
货币衍生工具	-	-	-	

权益衍生工具	-	-	-	
其他衍生工具	-	-	-	
合计	-	-	-	
项目	上年度末 2021 年 12 月 31 日			
	合同/名义 金额	公允价值		备注
		资产	负债	
利率衍生工具	-10,076,750.00	-	-	
其中：国债期货投资	-10,076,750.00	-	-	
货币衍生工具	-	-	-	
权益衍生工具	-	-	-	
其他衍生工具	-	-	-	
合计	-10,076,750.00	-	-	

注：1. 于本期末，本基金未投资衍生工具（上年度末：本基金投资的国债期货持仓数量为 10 手，合约成本为人民币-10,076,750.00 元）；

2. 衍生金融资产项下的其他衍生工具为国债期货投资，净额为 0。在当日无负债结算制度下，结算准备金已包括所持国债期货合约产生的持仓损益，则衍生金融资产项下的国债期货投资与相关的期货暂收款（结算所得的持仓损益）之间按抵销后的净额为 0。

#### 7.4.7.3.2 期末基金持有的期货合约情况

无。

#### 7.4.7.3.3 期末基金持有的黄金衍生品情况

无。

#### 7.4.7.4 买入返售金融资产

##### 7.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

单位：人民币元

项目	本期末 2022 年 12 月 31 日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	-	-

银行间市场	-	-
合计	-	-
项目	上年度末	
	2021 年 12 月 31 日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	30,000,000.00	-
银行间市场	-	-
合计	30,000,000.00	-

#### 7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

无。

#### 7.4.7.4.3 按预期信用损失一般模型计提减值准备的说明

无。

#### 7.4.7.5 债权投资

##### 7.4.7.5.1 债权投资情况

无。

##### 7.4.7.5.2 债权投资减值准备计提情况

无。

#### 7.4.7.6 其他债权投资

##### 7.4.7.6.1 其他债权投资情况

无。

##### 7.4.7.6.2 其他债权投资减值准备计提情况

无。

#### 7.4.7.7 其他权益工具投资

##### 7.4.7.7.1 其他权益工具投资情况

无。

##### 7.4.7.7.2 报告期末其他权益工具投资情况

无。

## 7.4.7.8 其他资产

单位：人民币元

项目	本期末 2022 年 12 月 31 日	上年度末 2021 年 12 月 31 日
应收利息	-	1,102,799.97
其他应收款	-	-
待摊费用	-	-
合计	-	1,102,799.97

## 7.4.7.9 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2022 年 12 月 31 日	上年度末 2021 年 12 月 31 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	6,058.65	3,184.72
其中：交易所市场	-	-
银行间市场	6,058.65	3,184.72
应付利息	-	5,155.45
预提费用	164,000.00	-
其他	9,300.00	-
合计	179,358.65	8,340.17

## 7.4.7.10 实收基金

金额单位：人民币元

## 大成稳安 60 天滚动持有债券 A

项目	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	202,103,306.97	202,103,306.97
本期申购	39,972,507.87	39,972,507.87
本期赎回（以“-”号填列）	-190,471,526.95	-190,471,526.95
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	51,604,287.89	51,604,287.89

## 大成稳安 60 天滚动持有债券 C

项目	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	750,103.13	750,103.13
本期申购	218,435.08	218,435.08

本期赎回（以“-”号填列）	-678,847.94	-678,847.94
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	289,690.27	289,690.27

## 大成稳安 60 天滚动持有债券 E

项目	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	11,021,484.54	11,021,484.54
本期申购	315,077.14	315,077.14
本期赎回（以“-”号填列）	-10,913,595.05	-10,913,595.05
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	422,966.63	422,966.63

注：申购含红利再投份额（如有）、转换入份额（如有）、级别调整入份额（如有）；赎回含转出份额（如有）

## 7.4.7.11 其他综合收益

无。

## 7.4.7.12 未分配利润

单位：人民币元

## 大成稳安 60 天滚动持有债券 A

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
本期期初	291,468.98	96,008.81	387,477.79
本期利润	2,262,146.19	-98,951.15	2,163,195.04
本期基金份额交易产生的变动数	-1,001,001.19	-87,562.20	-1,088,563.39
其中：基金申购款	588,746.49	-69,799.70	518,946.79
基金赎回款	-1,589,747.68	-17,762.50	-1,607,510.18
本期已分配利润	-	-	-
本期末	1,552,613.98	-90,504.54	1,462,109.44

## 大成稳安 60 天滚动持有债券 C

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
本期期初	991.30	356.25	1,347.55
本期利润	16,736.09	-1,467.79	15,268.30
本期基金份额交易产生	-9,614.55	603.43	-9,011.12

的变动数			
其中：基金申购款	3,420.12	-455.32	2,964.80
基金赎回款	-13,034.67	1,058.75	-11,975.92
本期已分配利润	-	-	-
本期末	8,112.84	-508.11	7,604.73

## 大成稳安 60 天滚动持有债券 E

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
本期期初	15,229.94	5,235.25	20,465.19
本期利润	44,723.69	3,458.50	48,182.19
本期基金份额交易产生的变动数	-47,721.66	-9,434.12	-57,155.78
其中：基金申购款	4,656.35	-431.78	4,224.57
基金赎回款	-52,378.01	-9,002.34	-61,380.35
本期已分配利润	-	-	-
本期末	12,231.97	-740.37	11,491.60

## 7.4.7.13 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 12 月 31 日	上年度可比期间 2021 年 12 月 9 日（基金合同生效日）至 2021 年 12 月 31 日
活期存款利息收入	11,223.78	4,604.74
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	589,891.86	118,440.21
其他	77.23	-
合计	601,192.87	123,044.95

## 7.4.7.14 股票投资收益

## 7.4.7.14.1 股票投资收益项目构成

无。

## 7.4.7.14.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

无。

## 7.4.7.14.3 股票投资收益——证券出借差价收入

无。

## 7.4.7.15 债券投资收益

## 7.4.7.15.1 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12月31 日	上年度可比期间 2021年12月9日（基金合同生效 日）至2021年12月31日
债券投资收益——利息收入	1,672,548.22	-
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	430,151.60	-
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	2,102,699.82	0.00

## 7.4.7.15.2 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12月31 日	上年度可比期间 2021年12月9日（基金合同生效 日）至2021年12月31日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	1,039,113,714.09	-
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	1,027,030,502.14	-
减：应计利息总额	11,629,826.04	-
减：交易费用	23,234.31	-
买卖债券差价收入	430,151.60	0.00

## 7.4.7.15.3 债券投资收益——赎回差价收入

无。

## 7.4.7.15.4 债券投资收益——申购差价收入

无。

## 7.4.7.16 资产支持证券投资收益

## 7.4.7.16.1 资产支持证券投资收益项目构成

无。

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

无。

## 7.4.7.16.3 资产支持证券投资收益——赎回差价收入

无。

## 7.4.7.16.4 资产支持证券投资收益——申购差价收入

无。

## 7.4.7.17 贵金属投资收益

## 7.4.7.17.1 贵金属投资收益项目构成

无。

## 7.4.7.17.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

无。

## 7.4.7.17.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

无。

## 7.4.7.17.4 贵金属投资收益——申购差价收入

无。

## 7.4.7.18 衍生工具收益

## 7.4.7.18.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

无。

## 7.4.7.18.2 衍生工具收益——其他投资收益

单位：人民币元

项目	本期收益金额	上年度可比期间
	2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日	收益金额 2021 年 12 月 9 日（基金合同生效日）至 2021 年 12 月 31 日
国债期货投资收益	-33,990.57	-

## 7.4.7.19 股利收益

无。

## 7.4.7.20 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 12 月 31 日	上年度可比期间 2021 年 12 月 9 日(基金合 同生效日)至 2021 年 12 月 31 日
1. 交易性金融资产	-96,210.44	100,850.31
股票投资	-	-
债券投资	-96,210.44	100,850.31
资产支持证券投资	-	-
基金投资	-	-
贵金属投资	-	-
其他	-	-
2. 衍生工具	-750.00	750.00
权证投资	-	-
期货投资	-750.00	750.00
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	-96,960.44	101,600.31

## 7.4.7.21 其他收入

无。

## 7.4.7.22 信用减值损失

无。

## 7.4.7.23 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2021 年 12 月 9 日(基金合同生效日) 至 2021 年 12 月 31 日
审计费用	44,000.00	-
信息披露费	120,000.00	-
证券出借违约金	-	-
银行划款手续费	11,608.63	1,644.72
账户维护费	23,552.92	-
其他	-	400.00
交易费用	-	2,245.73
合计	199,161.55	4,290.45

#### 7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

##### 7.4.8.1 或有事项

无。

##### 7.4.8.2 资产负债表日后事项

无。

#### 7.4.9 关联方关系

关联方名称	与本基金的关系
大成基金管理有限公司（“大成基金”）	基金管理人、注册登记机构、基金销售机构
中国农业银行股份有限公司（“中国农业银行”）	基金托管人、基金代销机构
中泰信托有限责任公司	基金管理人的股东
光大证券股份有限公司（“光大证券”）	基金管理人的股东
中国银河投资管理有限公司	基金管理人的股东
大成国际资产管理有限公司（“大成国际”）	基金管理人的子公司
大成创新资本管理有限公司（“大成创新资本”）	基金管理人的合营企业

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。

#### 7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

无。

##### 7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

###### 7.4.10.1.1 股票交易

无。

###### 7.4.10.1.2 债券交易

无。

###### 7.4.10.1.3 债券回购交易

无。

###### 7.4.10.1.4 权证交易

无。

###### 7.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

无。

## 7.4.10.2 关联方报酬

## 7.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2021 年 12 月 9 日（基金合同生效日）至 2021 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的管理费	159,020.81	25,792.72
其中：支付销售机构的客户维护费	49,762.41	11,866.87

注：基金管理费每日计提，按月支付。基金管理费按前一日的基金资产净值的 0.20% 的年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 0.20\% / \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日基金资产净值

## 7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2021 年 12 月 9 日（基金合同生效日）至 2021 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的托管费	39,755.15	6,448.19

注：基金托管费每日计提，按月支付。基金托管人的基金托管费按基金财产净值的 0.05% 年费率计提。计算方法如下： $H = E \times 0.05\% / \text{当年天数}$  H 为每日应计提的基金托管费 E 为前一日的基金财产净值

## 7.4.10.2.3 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 12 月 31 日			
	当期发生的基金应支付的销售服务费			
	大成稳安 60 天滚动持有债券 A	大成稳安 60 天滚动持有债券 C	大成稳安 60 天滚动持有债券 E	合计
大成基金	-	2.29	247.26	249.55
中国农业银行	-	1,038.06	808.44	1,846.50
合计	-	1,040.35	1,055.70	2,096.05
获得销售服务费的各	上年度可比期间			

关联方名称	2021 年 12 月 9 日（基金合同生效日）至 2021 年 12 月 31 日			
	当期发生的基金应支付的销售服务费			
	大成稳安 60 天滚动持有债券 A	大成稳安 60 天滚动持有债券 C	大成稳安 60 天滚动持有债券 E	合计
大成基金	-	-	138.91	138.91
中国农业银行	-	-	312.70	312.70
合计	-	-	451.61	451.61

注：本基金分设 A 类基金份额、C 类基金份额和 E 类基金份额。本基金对各类基金份额设置不同的销售服务费率。本基金 A 类基金不收取销售服务费，C 类基金份额的年费率为 0.20%，E 类基金份额的年费率为 0.10%。在通常情况下，某级的销售服务费按前一日该级基金资产净值计提。计算方法如下：

$$H=E \times R / \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金销售服务费

E 为前一日的基金财产净值

R 为该级基金对应的销售服务费年费率

#### 7.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

无。

#### 7.4.10.4 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

##### 7.4.10.4.1 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。

##### 7.4.10.4.2 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。

#### 7.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

##### 7.4.10.5.1 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 12 月 31 日	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日
	大成稳安 60 天滚动持有债券 A	大成稳安 60 天滚动持有债券 C	大成稳安 60 天滚动持有债券 E
基金合同生效日	-	-	-

(2021年12月9日)持有的基金份额			
报告期初持有的基金份额	-	-	-
报告期内申购/买入总份额	39,464,985.19	-	-
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	39,464,985.19	-	-
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	75.43%	-	-
项目	上年度可比期间 2021年12月9日(基金合同生效日)至2021年12月31日	上年度可比期间 2021年12月9日(基金合同生效日)至 2021年12月31日	上年度可比期间 2021年12月9日(基金合同生效日)至 2021年12月31日
	大成稳安60天滚动持有债券A	大成稳安60天滚动持有债券C	大成稳安60天滚动持有债券E
基金合同生效日(2021年12月9日)持有的基金份额	-	-	-
报告期初持有的基金份额	-	-	-
报告期内申购/买入总份额	-	-	-
报告期内因拆分变动份额	-	-	-
减: 报告期内赎回/卖出总份额	-	-	-
报告期末持有的基金份额	-	-	-
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	-	-	-

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。

#### 7.4.10.5.2 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。

## 7.4.10.6 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 12 月 31 日		上年度可比期间 2021 年 12 月 9 日（基金合同生效日）至 2021 年 12 月 31 日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国农业银行	304,398.21	11,223.78	394,490.30	4,604.74

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。

## 7.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

无。

## 7.4.10.8 其他关联交易事项的说明

无。

## 7.4.11 利润分配情况

无。

## 7.4.12 期末（2022 年 12 月 31 日）本基金持有的流通受限证券

## 7.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

无。

## 7.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

无。

## 7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

## 7.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

无。

## 7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

无。

## 7.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

无。

## 7.4.13 金融工具风险及管理

## 7.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金在日常经营活动由金融工具产生的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金管理人制定了政策和程序来识别及分析这些风险，并设定适当的风险限额及内部控制流程，

通过可靠的管理及信息系统持续监控上述各类风险。

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。

#### 7.4.13.2 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存放在本基金的托管行中国农业银行，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。

##### 7.4.13.2.1 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 12 月 31 日	上年度末 2021 年 12 月 31 日
A-1	-	-
A-1 以下	-	-
未评级	24,982,932.10	89,934,000.00
合计	24,982,932.10	89,934,000.00

注：1. 债券评级取自第三方评级机构的债项评级。2. 未评级债券为债券期限在一年及一年以内的

国债、超短期融资券。

#### 7.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

无。

#### 7.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2022 年 12 月 31 日	上年度末 2021 年 12 月 31 日
A-1	-	-
A-1 以下	-	-
未评级	-	19,484,000.00
合计	-	19,484,000.00

注：1. 债券评级取自第三方评级机构的债项评级。

#### 7.4.13.2.4 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 12 月 31 日	上年度末 2021 年 12 月 31 日
AAA	16,593,672.32	103,104,800.00
AAA 以下	-	-
未评级	10,368,284.93	21,051,200.00
合计	26,961,957.25	124,156,000.00

注：1. 债券评级取自第三方评级机构的债项评级。2. 未评级债券为债券期限大于一年的政策性金融债。

#### 7.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

无。

#### 7.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

无。

#### 7.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指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。

### 7.4.13.3.1 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，约定在非正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。

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。

### 7.4.13.4 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。

#### 7.4.13.4.1 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。

#### 7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2022 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	304,398.21	-	-	-	304,398.21
结算备付金	1,743,880.12	-	-	-	1,743,880.12
存出保证金	326.00	-	-	-	326.00
交易性金融资产	29,015,617.03	22,929,272.32	-	-	51,944,889.35
应收申购款	-	-	-	1,825.21	1,825.21
资产总计	31,064,221.36	22,929,272.32	-	1,825.21	53,995,318.89
负债					
应付管理人报酬	-	-	-	9,187.83	9,187.83
应付托管费	-	-	-	2,296.94	2,296.94
应付销售服务费	-	-	-	89.99	89.99
应交税费	-	-	-	6,234.92	6,234.92
其他负债	-	-	-	179,358.65	179,358.65
负债总计	-	-	-	197,168.33	197,168.33
利率敏感度缺口	31,064,221.36	22,929,272.32	-	-195,343.12	53,798,150.56
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	394,490.30	-	-	-	394,490.30
结算备付金	2,907,539.68	-	-	-	2,907,539.68
存出保证金	201,520.00	-	-	-	201,520.00
交易性金融资产	163,013,000.00	70,561,000.00	-	-	233,574,000.00
买入返售金融资产	30,000,000.00	-	-	-	30,000,000.00
其他资产	-	-	-	1,102,799.97	1,102,799.97
资产总计	196,516,549.98	70,561,000.00	-	1,102,799.97	268,180,349.95
负债					
应付管理人报酬	-	-	-	25,792.72	25,792.72
应付托管费	-	-	-	6,448.19	6,448.19
卖出回购金融资产款	53,849,788.07	-	-	-	53,849,788.07
应付销售服务费	-	-	-	754.99	754.99
应交税费	-	-	-	5,040.64	5,040.64
其他负债	-	-	-	8,340.17	8,340.17
负债总计	53,849,788.07	-	-	46,376.71	53,896,164.78
利率敏感度缺口	142,666,761.91	70,561,000.00	-	1,056,423.26	214,284,185.17

注：表中所示为本基金资产及负债的公允价值，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。

#### 7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	除市场利率以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2022 年 12 月 31 日）	上年度末（2021 年 12 月

			31 日 )
	利率上升 25 个基准点	-75,835.76	-710,446.59
	利率下降 25 个基准点	76,172.32	715,445.98

#### 7.4.13.4.2 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。本基金持有的金融工具均以人民币计价，因此无重大外汇风险。

#### 7.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险主要为市场价格风险，市场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债券，所面临的最大市场价格风险由所持有的金融工具的公允价值决定。本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险，并且本基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控。

本基金投资组合的资产配置范围为：本基金投资于债券资产的比例不低于基金资产的 80%；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，本基金应当保持不低于基金资产净值的 5% 的现金或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。如法律法规或监管机构变更投资品种的投资比例限制，基金管理人在履行适当程序后，可以调整上述投资品种的投资比例。

##### 7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

无。

##### 7.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

于 2022 年 12 月 31 日，本基金未持有交易性权益类投资（上年度末：同），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。

#### 7.4.14 公允价值

##### 7.4.14.1 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。

#### 7.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

##### 7.4.14.2.1 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 12 月 31 日	上年度末 2021 年 12 月 31 日
第一层次	-	83,890,000.00
第二层次	51,944,889.35	149,684,000.00
第三层次	-	-
合计	51,944,889.35	233,574,000.00

##### 7.4.14.2.2 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。

##### 7.4.14.2.3 第三层次公允价值余额及变动情况

###### 7.4.14.2.3.1 第三层次公允价值余额及变动情况

无。

###### 7.4.14.2.3.2 使用重要不可观察输入值的第三层次公允价值计量的情况

无。

##### 7.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

本基金本报告期末及上年度末均未持有非持续的以公允价值计量的金融工具。

##### 7.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

本基金持有的不以公允价值计量的金融工具为以摊余成本计量的金融资产和金融负债，这些金融工具因其剩余期限较短，所以其账面价值与公允价值相若。

#### 7.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

##### 1、承诺事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的承诺事项。

## 2、其他事项

截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

## 3、财务报表的批准

本财务报表已于 2023 年 3 月 29 日经本基金的基金管理人批准。

## § 8 投资组合报告

### 8.1 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	51,944,889.35	96.20
	其中：债券	51,944,889.35	96.20
	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	2,048,278.33	3.79
8	其他各项资产	2,151.21	0.00
9	合计	53,995,318.89	100.00

### 8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

#### 8.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

无。

#### 8.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

无。

### 8.3 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。

## 8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

### 8.4.1 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。

### 8.4.2 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。

### 8.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

无。

## 8.5 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	12,942,977.04	24.06
2	央行票据	-	-
3	金融债券	10,368,284.93	19.27
	其中：政策性金融债	10,368,284.93	19.27
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	12,039,955.06	22.38
6	中期票据	16,593,672.32	30.84
7	可转债（可交换债）	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	51,944,889.35	96.56

## 8.6 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	210202	21 国开 02	100,000	10,368,284.93	19.27
2	229961	22 贴现国债 61	100,000	9,984,369.23	18.56
3	101900223	19 川能投 MTN002	40,000	4,231,254.79	7.87
4	102100011	21 南昌城投 MTN001	40,000	4,164,880.00	7.74
5	102100302	21 川高速 MTN002	40,000	4,164,852.60	7.74

## 8.7 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。

## 8.8 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。

## 8.9 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。

## 8.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

### 8.10.1 本期国债期货投资政策

本基金投资国债期货将根据风险管理原则，以套期保值为目的，以回避市场风险，故国债期货空头的合约价值主要与债券组合的多头价值相对应。基金管理人通过动态管理国债期货合约数量，以萃取相应债券组合的超额收益。

### 8.10.2 本期国债期货投资评价

在年内几轮利率快速上行的调整过程中（2月、6月、9月、11月），通过国债期货的风险对冲，有效保持了产品净值的稳定。

## 8.11 投资组合报告附注

### 8.11.1 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之一 21 国开 02（210202.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。

2、本基金投资的前十名证券之一 22 招商证券 CP005（072210136.IB）的发行主体招商证券股份有限公司于 2022 年 8 月 12 日收到中国证券监督管理委员会《立案告知书》（证监立案字 0382022020 号），因公司 2014 年在开展上海飞乐股份有限公司（现中安科股份有限公司）独立财务顾问业务工作期间未勤勉尽责，涉嫌违法违规，根据《中华人民共和国证券法》《中华人民共和国行政处罚法》等法律法规，中国证监会决定对公司立案；于 2022 年 9 月 19 日收到中国证监会《行政处罚决定书》（〔2022〕50 号），受到中国证监会处罚。本基金认为，对招商证券的处罚不会对其投资价值构成实质性负面影响。

### 8.11.2 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。

## 8.11.3 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	326.00
2	应收清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	1,825.21
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	2,151.21

## 8.11.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

无。

## 8.11.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

无。

## 8.11.6 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。

## §9 基金份额持有人信息

## 9.1 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 (%)
大成稳安 60 天滚动 持有债券 A	246	209,773.53	39,464,985.19	76.48	12,139,302.70	23.52
大成稳安 60 天滚动 持有债券 C	77	3,762.21	-	-	289,690.27	100.00
大成稳安	74	5,715.77	-	-	422,966.63	100.00

60 天滚动持有债券 E						
合计	397	131,780.72	39,464,985.19	75.43	12,851,959.60	24.57

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。

## 9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

无。

## 9.3 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	大成稳安 60 天滚动持有债券 A	0
	大成稳安 60 天滚动持有债券 C	0
	大成稳安 60 天滚动持有债券 E	0
	合计	0
本基金基金经理持有本开放式基金	大成稳安 60 天滚动持有债券 A	0
	大成稳安 60 天滚动持有债券 C	0
	大成稳安 60 天滚动持有债券 E	0
	合计	0

## 9.4 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理本人及其直系亲属持有本人管理的产情况

无。

## § 10 开放式基金份额变动

单位：份

项目	大成稳安 60 天滚动持有债券 A	大成稳安 60 天滚动持有债券 C	大成稳安 60 天滚动持有债券 E
基金合同生效日（2021 年 12 月 9 日）基金	202,103,306.97	750,103.13	11,021,484.54

份额总额			
本报告期期初基金份额总额	202,103,306.97	750,103.13	11,021,484.54
本报告期基金总申购份额	39,972,507.87	218,435.08	315,077.14
减：本报告期基金总赎回份额	190,471,526.95	678,847.94	10,913,595.05
本报告期基金拆分变动份额	-	-	-
本报告期期末基金份额总额	51,604,287.89	289,690.27	422,966.63

## § 11 重大事件揭示

### 11.1 基金份额持有人大会决议

无。

### 11.2 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。

3. 大成基金管理有限公司于 2022 年 11 月 26 日召开公司 2022 年第二次临时股东会，审议通过《关于董事会换届选举的议案》，选举吴庆斌、林昌、谭晓冈、杨红、宋立志担任公司第八届董事会董事；选举胡维翊、杨晓帆、卢锋、江涛担任公司第八届董事会独立董事。其中，吴庆斌、林昌、谭晓冈、胡维翊、杨晓帆连任公司董事，李超、郭向东、金李、黄隽不再担任公司董事。

#### 二、基金托管人的基金托管部门的重大人事变动

1. 2022 年 3 月，中国农业银行总行决定王霄勇任托管业务部总裁。

2. 2022 年 3 月，中国农业银行总行决定王洪滨任托管业务部高级专家。

### 11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

无。

### 11.4 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。

### 11.5 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安永华明会计师事务所（特殊普通合伙），本年度应支付的审计费用为 44,000.00 元整。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。

### 11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

#### 11.6.1 管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，基金管理人及其相关高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

#### 11.6.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本基金托管人及其高级管理人员在开展基金托管业务过程中无受稽查或处罚等情况。

### 11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

#### 11.7.1 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 (%)	
爱建证券	1	-	-	-	-	-
安信证券	1	-	-	-	-	-
川财证券	1	-	-	-	-	-
第一创业	1	-	-	-	-	-
东北证券	2	-	-	-	-	-
东财证券	1	-	-	-	-	-
东方证券	1	-	-	-	-	-
东吴证券	1	-	-	-	-	-
东兴证券	1	-	-	-	-	-
东亚前海	1	-	-	-	-	-
方正证券	1	-	-	-	-	-
高华证券	1	-	-	-	-	-
光大证券	2	-	-	-	-	-
广发证券	1	-	-	-	-	-
国金证券	2	-	-	-	-	-
国盛证券	1	-	-	-	-	-

国泰君安	3	-	-	-	-	-
国信证券	1	-	-	-	-	-
海通证券	1	-	-	-	-	-
红塔证券	1	-	-	-	-	-
华创证券	1	-	-	-	-	-
华泰证券	1	-	-	-	-	-
华西证券	1	-	-	-	-	-
民生证券	1	-	-	-	-	-
南京证券	1	-	-	-	-	-
平安证券	1	-	-	-	-	-
瑞银证券	2	-	-	-	-	-
山西证券	1	-	-	-	-	-
上海证券	1	-	-	-	-	-
申万宏源	1	-	-	-	-	-
申万宏源 西部	1	-	-	-	-	-
世纪证券	1	-	-	-	-	-
天风证券	2	-	-	-	-	-
万和证券	1	-	-	-	-	-
西部证券	1	-	-	-	-	-
湘财证券	1	-	-	-	-	-
信达证券	2	-	-	-	-	-
兴业证券	2	-	-	-	-	-
粤开证券	1	-	-	-	-	-
招商证券	2	-	-	-	-	-
浙商证券	1	-	-	-	-	-
中国银河 证券	4	-	-	-	-	-
中金公司	3	-	-	-	-	-
中泰证券	2	-	-	-	-	-
中信建投 证券	2	-	-	-	-	-
中信证券	3	-	-	-	-	-
中银国际 证券	1	-	-	-	-	-
中原证券	1	-	-	-	-	-

注：1、根据中国证监会颁布的《关于完善证券投资基金交易席位制度有关问题的通知》（证监基金字[2007]48号）的有关规定，本公司制定了租用证券公司交易单元的选择标准和程序。

租用证券公司交易单元的选择标准主要包括：

- （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:

本报告期内增加交易单元:中信证券、东亚前海;

本报告期内退租交易单元:广发证券。

### 11.7.2 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(%)
国泰君安	16,058,020.00	16.95	-	-	-	-
招商证券	78,675,748.60	83.05	290,900,000.00	100.00	-	-

### 11.8 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12月31日
2	大成基金管理有限公司关于网上直销系统开展邮储银行支付渠道费率优惠活动的公告	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12月30日
3	大成稳安 60 天滚动持有债券型证券投资基金 E 类份额增加蚂蚁(杭州)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11月3日
4	大成稳安 60 天滚动持有债券型证券投资基金 2022 年第 3 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10月26日
5	大成基金管理有限公司提醒投资者谨防金融诈骗的公告	中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站	2022年8月31日

6	大成稳安 60 天滚动持有债券型证券投资基金 2022 年中期报告	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 8 月 30 日
7	大成稳安 60 天滚动持有债券型证券投资基金 (E 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 8 月 26 日
8	大成稳安 60 天滚动持有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 8 月 26 日
9	大成稳安 60 天滚动持有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 8 月 26 日
10	大成基金管理有限公司关于旗下部分基金增加上海中正达广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 8 月 4 日
11	大成基金管理有限公司住所变更公告	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 7 月 30 日
12	大成稳安 60 天滚动持有债券型证券投资基金 2022 年第 2 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 7 月 20 日
13	大成基金管理有限公司关于旗下部分基金增加泰信财富基金销售有限公司为销售机构的公告	中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站	2022 年 7 月 7 日
14	大成基金管理有限公司关于终止北京晟视天下基金销售有限公司、北京唐鼎耀华基金销售有限公司、北京植信基金销售有限公司办理旗下基金相关销售业务的公告	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 7 月 1 日
15	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 6 月 30 日
16	大成稳安 60 天滚动持有债券型证券投资基金 A、C 类份额增加蚂蚁 (杭州) 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 6 月 17 日
17	大成基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告	中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站	2022 年 6 月 2 日
18	大成稳安 60 天滚动持有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 4 月 22 日
19	大成基金管理有限公司关于旗下部分基金增加和讯信息科技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 4 月 19 日

20	大成基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告	中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站	2022 年 4 月 16 日
21	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 3 月 29 日
22	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 1 月 27 日
23	关于大成稳安 60 天滚动持有债券型证券投资基金开放日常申购、赎回、转换及定额投资业务的公告	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 1 月 27 日
24	大成基金管理有限公司关于旗下公开募集证券投资基金执行新金融工具相关会计准则的公告	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 1 月 1 日

## § 12 影响投资者决策的其他重要信息

### 12.1 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	20220429-20221231	0.00	39,464,985.19	0.00	39,464,985.19	75.43
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。							

### 12.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

## § 13 备查文件目录

### 13.1 备查文件目录

- 1、中国证监会批准设立大成稳安 60 天滚动持有债券型证券投资基金的文件；
- 2、《大成稳安 60 天滚动持有债券型证券投资基金基金合同》；
- 3、《大成稳安 60 天滚动持有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。

### 13.2 存放地点

备查文件存放在本基金管理人和托管人的住所。

### 13.3 查阅方式

投资者可在营业时间免费查阅,或登录本基金管理人网站 <http://www.dcfund.com.cn> 进行查阅。

大成基金管理有限公司

2023 年 3 月 30 日