

# 大成元合双利债券型发起式证券投资基金 2023 年中期报告

2023 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：上海银行股份有限公司

送出日期：2023 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。

基金托管人上海银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2023 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 2023 年 01 月 01 日起至 06 月 30 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 主要财务指标和基金净值表现</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
<b>§ 4 管理人报告</b>	<b>9</b>
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	12
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	13
<b>§ 5 托管人报告</b>	<b>13</b>
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	13
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	13
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	14
<b>§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）</b>	<b>14</b>
6.1 资产负债表	14
6.2 利润表	15
6.3 净资产（基金净值）变动表	16
6.4 报表附注	17
<b>§ 7 投资组合报告</b>	<b>39</b>
7.1 期末基金资产组合情况	39
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	39
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	40
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	41
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	44
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	45
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	45
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	45

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 .....	45
7.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 .....	45
7.11 投资组合报告附注 .....	45
<b>§ 8 基金份额持有人信息 .....</b>	<b>46</b>
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....	46
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....	47
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 .....	47
8.4 发起式基金发起资金持有份额情况 .....	48
<b>§ 9 开放式基金份额变动 .....</b>	<b>48</b>
<b>§ 10 重大事件揭示 .....</b>	<b>48</b>
10.1 基金份额持有人大会决议 .....	48
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 .....	48
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....	49
10.4 基金投资策略的改变 .....	49
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....	49
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 .....	49
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	49
10.8 其他重大事件 .....	50
<b>§ 11 影响投资者决策的其他重要信息 .....</b>	<b>52</b>
11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况 .....	52
11.2 影响投资者决策的其他重要信息 .....	52
<b>§ 12 备查文件目录 .....</b>	<b>53</b>
12.1 备查文件目录 .....	53
12.2 存放地点 .....	53
12.3 查阅方式 .....	53

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	大成元合双利债券型发起式证券投资基金	
基金简称	大成元合双利债券发起式	
基金主代码	015898	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2022 年 9 月 8 日	
基金管理人	大成基金管理有限公司	
基金托管人	上海银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	219,587,697.27 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	大成元合双利债券发起式 A	大成元合双利债券发起式 C
下属分级基金的交易代码	015898	015899
报告期末下属分级基金的份额总额	219,577,227.49 份	10,469.78 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%+恒生指数收益率（使用估值汇率调整）*5%+中债综合全价指数收益率×80%+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	上海银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	段皓静	周直毅
	联系电话	0755-83183388	021-68475608
	电子邮箱	office@dcfund.com.cn	custody@boscn.com.cn
客户服务电话		4008885558	95594
传真		0755-83199588	021-68476901

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	中国（上海）自由贸易试验区 银城中路 168 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	中国（上海）自由贸易试验区 银城中路 168 号 27 层
邮政编码	518054	200120
法定代表人	吴庆斌	金煜

## 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(2023 年 1 月 1 日-2023 年 6 月 30 日)	
	大成元合双利债券发起式 A	大成元合双利债券发起式 C
本期已实现收益	153,713.70	64,722.13
本期利润	-33,135.98	28,916.98
加权平均基金份 额本期利润	-0.0003	0.0027
本期加权平均净 值利润率	-0.03%	0.28%
本期基金份额净 值增长率	-1.13%	-1.02%
3.1.2 期末数据 和指标	报告期末(2023 年 6 月 30 日)	
期末可供分配利 润	-9,866,785.94	-439.08

期末可供分配基金份额利润	-0.0449	-0.0419
期末基金资产净值	209,710,441.55	10,030.70
期末基金份额净值	0.9551	0.9581
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2023年6月30日)	
基金份额累计净值增长率	-4.49%	-4.19%

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

大成元合双利债券发起式 A

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	0.17%	0.25%	0.56%	0.14%	-0.39%	0.11%
过去三个月	0.08%	0.16%	0.14%	0.13%	-0.06%	0.03%
过去六个月	-1.13%	0.22%	0.93%	0.14%	-2.06%	0.08%
自基金合同生效起至今	-4.49%	0.23%	0.07%	0.17%	-4.56%	0.06%

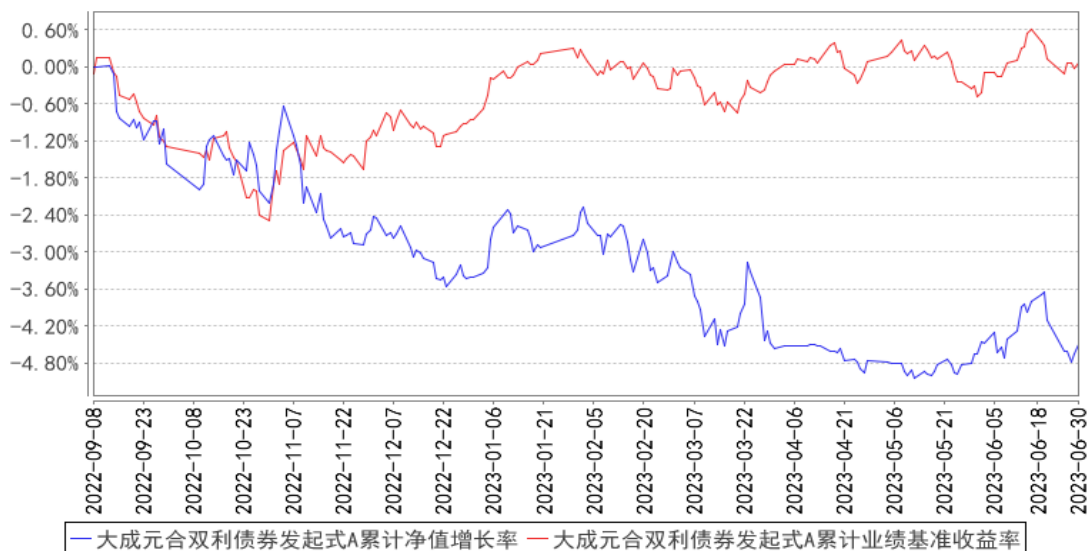
大成元合双利债券发起式 C

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	0.16%	0.25%	0.56%	0.14%	-0.40%	0.11%
过去三个月	0.06%	0.16%	0.14%	0.13%	-0.08%	0.03%
过去六个月	-1.02%	0.22%	0.93%	0.14%	-1.95%	0.08%
自基金合同生效	-4.19%	0.24%	0.07%	0.17%	-4.26%	0.07%

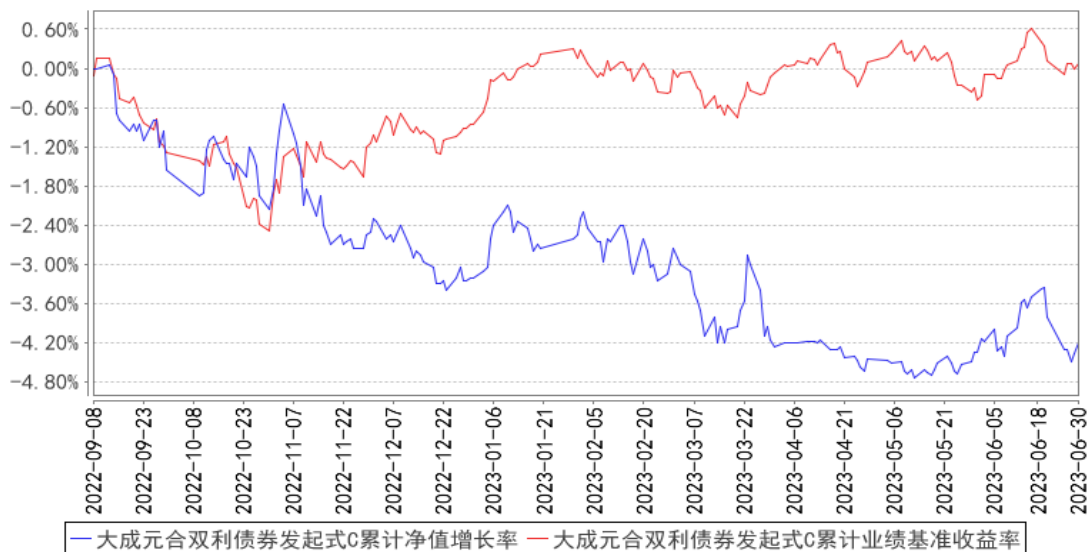
起至今						
-----	--	--	--	--	--	--

### 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

大成元合双利债券发起式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



大成元合双利债券发起式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2022年9月8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 24 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		
岳苗	本基金基金经理	2022 年 9 月 8 日	-	11 年	北京大学工程硕士。2012 年 9 月至 2015 年 6 月任申万宏源股份有限公司研究所（机构业务部）中小市值分析师。2015 年 6 月至 2019 年 3 月任光大永明资产管理股份有限公司权益投资部研究员。2019 年 4 月加入大成基金管理有限公司，曾担任大成景盛一年定期开放债券型证券投资基金、大成景荣债券型证券投资基金基金经理助理，现任固定收益总部基金经理。2021 年 11 月 29 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。2022 年 9 月 8 日起任大成元合双利债券型发起式证券投资基金基金经理。具备基金从业资格。国籍：中国
朱浩然	本基金基金经理	2023 年 4 月 19 日	-	11 年	中央财经大学经济学硕士。2012 年 7 月至 2015 年 7 月任华夏基金管理有限公司机构债券投资部研究员。2015 年 8 月至 2017 年 1 月历任上海毕朴斯投资管理合伙企业(有限合伙)固定收益部投资经理、副总经理。2017 年 2 月至 2022 年 5 月历

					任融通基金管理有限公司固定收益部专户投资经理、基金经理。2022 年 5 月加入大成基金管理有限公司，现任固定收益总部基金经理。2022 年 12 月 6 日起任大成惠利纯债债券型证券投资基金基金经理。2023 年 3 月 29 日起任大成惠泽一年定期开放债券型发起式证券投资基金基金经理。2023 年 4 月 19 日起任大成元合双利债券型发起式证券投资基金基金经理。具备基金从业资格。国籍：中国
--	--	--	--	--	---

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，公司严格执行了公平交易的原则和制度。公司运用统计分析方法和工具，对旗下所有投资组合间连续 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，公司旗下所有投资组合未发现存在异常交易行为。公司旗下所有投资组合参与的交易所公开竞价，未发生成交较少的单边交易量超过该股当日成交量 5% 的股票同日反向交易；主动投资组合间债券交易存在 1 笔同日反向交易，原因为流动性需要。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

2023 年以来，经济、金融数据经历了较大幅度的波动，一季度地产链条修复、社融高增、出行好转提振了经济复苏预期，但二季度经济体感明显下降，PMI 重回荣枯线。结构上，消费修复的斜率回落，服务消费较好而耐用消费品偏差。投资增速弱于预期，基建增速尚可但房地产投资偏弱，外需也边际走弱。

政策方面，央行在一季度末降低了存款准备金率，二季度尾声降低了政策利率水平，整体呈现了流动性偏宽松的局面，但社会融资总量增速有所回落，宽信用面临阻力。在偏弱的经济基本面背景下，业内预计货币政策仍有宽松空间。汇率贬值压力并非是货币政策放松的严格约束，货币政策当前重心还是在于提振内需。财政政策面临一定的约束，如地方隐性债务压力大、城投非标信用风险暴露、土地出让收入下滑、基建低效率等，但也有值得期待的空间，如隐性债务置换、专项金融工具，财政政策的操作力度，将会是影响经济预期的重要因素。

上半年债券市场整体表现偏强，10 年国债收益率再度回落至 2.64%，而超长端在保险年金等稳定资金的配置支撑、30 年国债期货产品上市等多重利好下，表现尤为突出，上半年较高点下行 20bp。信用债方面，多数时间亦处于利差快速压缩的牛市行情，一方面是上年末理财负反馈出现超调构建了极高的利差基础，另一方面是开门红季节性的配置需求走强，等级利差、品种利差均已回归至近三年内低点。

权益方面，市场上半年也跟随宏观经济演绎了大幅波动的态势，最强的开门红之后紧接着是宏观数据的快速掉头。整个上半年指数先涨后跌，最终沪深 300 下跌 0.75%，创业板指下跌 5.61%，上证综指表现相对较好，上涨 3.65%，指数整体表现偏弱。从板块效应看，上半年核心主线是 AI 带动的 TMT 行情和以中特估带动的低估值白马的重估行情，这两条主线贯穿整个上半年，也在短时间内快速演绎至高点。除此之外，其他新能源、顺周期以及消费医药板块行情都表现一般，资金在这些板块中快速轮动。相比股票指数的宽幅震荡，转债受益于债底的保护作用，整体表现稳定，上半年中证转债指数收涨 3.37%，最大回撤也仅有 3.34%，其中表现最好的是中低价位的转债。当前权益资产的性价比处于较高的位置，很多板块也已经跌回到 2022 年 4 月或者 10 月的水平，我们认为定价中包含了较多的悲观预期，反而是可以中长期布局的机会。

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。在 2023 年上半年，本基金增配了 2 年左右信用债，利用金融债进行了波段操作，股票方面主要增配了 TMT 板块，我们基于行业的创新变化增配了相关的板块，但也考虑到板块的波动性，对标的

的未来成长性和估值进行严格限制，选择能够在未来几年兑现的细分领域和板块，同时，我们看好家电、汽车等制造业板块，对处于低位的医药消费板块亦进行了增配，这些也将是我们下半年的主要配置方向。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末大成元合双利债券发起式 A 的基金份额净值为 0.9551 元，本报告期基金份额净值增长率为-1.13%，同期业绩比较基准收益率为 0.93%；截至本报告期末大成元合双利债券发起式 C 的基金份额净值为 0.9581 元，本报告期基金份额净值增长率为-1.02%，同期业绩比较基准收益率为 0.93%。

#### 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 年下半年，市场分析经济仍将低位震荡，居民收入预期下降，购房需求谨慎，提前还贷难以缓解，在没有全面政策转向背景下，房地产链条难以扭转预期。消费派生于地产和居民就业，刺激消费难度较大，经济向上的关键看点还是财政政策。业内预计下半年流动性将维持宽松，套息交易仍有空间，但久期策略空间下降。纯债方面，我们将以票息策略优先，择机利用利率债和金融债进行波段操作。权益方面，我们认为定价已经包含了市场的悲观预期，性价比和安全边际较高，我们在当前的位置还是愿意保持较高的权益仓位，但是会对结构和标的进行严格把控，自下而上优选成长标的进行投资。

我们非常感谢基金份额持有人的信任和支持，我们将继续按照本基金合同和风险收益特征的要求，严格控制投资风险，积极进行资产配置，适时调整组合结构，研究新的投资品种和挖掘投资机会，力争获得与基金风险特征一致的收益回报给投资者。

#### 4.6 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、混合资产投资部、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八名投资组合经理。

股票投资部、固定收益总部、混合资产投资部、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,本托管人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同以及托管协议的有关约定,诚实、尽责地履行了基金托管人义务,不存在损害本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

本报告期,本托管人根据国家有关法律法规、基金合同、托管协议的规定,对本基金的投资运作、基金资产净值计算、基金费用开支等方面进行了必要的监督、复核和审查,未发现基金管理人有关损害基金份额持有人利益的行为。

报告期内,本基金未实施利润分配。

### 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，认为复核内容真实、准确、完整，不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

## § 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：大成元合双利债券型发起式证券投资基金

报告截止日：2023 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2023 年 6 月 30 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
<b>资产：</b>			
银行存款	6.4.7.1	271,977.19	264,494.01
结算备付金		198,738.97	142,153.73
存出保证金		23,512.12	3,781.16
交易性金融资产	6.4.7.2	289,429,877.71	9,899,914.14
其中：股票投资		39,317,065.80	1,865,505.86
基金投资		-	-
债券投资		250,112,811.91	8,034,408.28
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		724,231.62	-
应收股利		-	-
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.8	-	-
资产总计		290,648,337.61	10,310,343.04
<b>负债和净资产</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2023 年 6 月 30 日</b>	<b>上年度末 2022 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	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		80,065,039.79	549,852.34
应付清算款		683,079.05	10,762.61
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		51,832.81	2,478.61
应付托管费		8,638.79	413.10
应付销售服务费		0.90	-
应付投资顾问费		-	-
应交税费		15,295.07	0.17
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.9	103,978.95	58,390.93
负债合计		80,927,865.36	621,897.76
<b>净资产：</b>			
实收基金	6.4.7.10	219,587,697.27	10,029,316.24
其他综合收益	6.4.7.11	-	-
未分配利润	6.4.7.12	-9,867,225.02	-340,870.96
净资产合计		209,720,472.25	9,688,445.28
负债和净资产总计		290,648,337.61	10,310,343.04

注：报告截止日 2023 年 06 月 30 日，基金份额总额 219,587,697.27 份，其中大成元合双利债券发起式 A 基金份额总额为 219,577,227.49 份，基金份额净值 0.9551 元。大成元合双利债券发起式 C 基金份额总额为 10,469.78 份，基金份额净值 0.9581 元。

## 6.2 利润表

会计主体：大成元合双利债券型发起式证券投资基金

本报告期：2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
<b>一、营业总收入</b>		517,487.86
1. 利息收入		151,524.27
其中：存款利息收入	6.4.7.13	111,437.14
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		40,087.13
证券出借利息收入		-
其他利息收入		-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		588,618.42
其中：股票投资收益	6.4.7.14	-1,316,889.45
基金投资收益		-
债券投资收益	6.4.7.15	1,694,002.35

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	211,505.52
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	-222,654.83
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	-
<b>减：二、营业总支出</b>		521,706.86
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	167,129.86
2. 托管费	6.4.10.2.2	27,855.04
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	3,839.53
4. 投资顾问费		-
5. 利息支出		290,620.92
其中：卖出回购金融资产支出		290,620.92
6. 信用减值损失	6.4.7.22	-
7. 税金及附加		4,156.66
8. 其他费用	6.4.7.23	28,104.85
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		-4,219.00
减：所得税费用		-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		-4,219.00
<b>五、其他综合收益的税后净额</b>		-
<b>六、综合收益总额</b>		-4,219.00

### 6.3 净资产（基金净值）变动表

会计主体：大成元合双利债券型发起式证券投资基金

本报告期：2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 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）	10,029,316.24	-	-340,870.96	9,688,445.28
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)	10,029,316.24	-	-340,870.96	9,688,445.28
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	209,558,381.03	-	-9,526,354.06	200,032,026.97
(一)、综合收益总额	-	-	-4,219.00	-4,219.00
(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)	209,558,381.03	-	-9,522,135.06	200,036,245.97
其中：1. 基金申购款	418,355,450.47	-	-18,262,338.64	400,093,111.83
2. 基金赎回款	- 208,797,069.44	-	8,740,203.58	-200,056,865.86
(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)	219,587,697.27	-	-9,867,225.02	209,720,472.25

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

大成元合双利债券型发起式证券投资基金(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[2022]第 1003 号《关于准予大成元合双利债券型发起式证券

投资基金注册的批复》注册，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《大成元合双利债券型发起式证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型定期开放发起式，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 10,005,837.00 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(2022)第 0771 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《大成元合双利债券型发起式证券投资基金基金合同》于 2022 年 9 月 8 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 10,006,037.12 份基金份额，认购资金利息折合 200.12 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，基金托管人为上海银行股份有限公司。

本基金为发起式基金，发起资金认购部分为 10,000,200.02 份基金份额，发起资金认购方承诺使用发起资金认购的基金份额持有期限不少于 3 年。

根据《大成元合双利债券型发起式证券投资基金基金合同》和《大成元合双利债券型发起式证券投资基金招募说明书》的有关规定，本基金根据认购/申购费用、销售服务费收取方式等的不同，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，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《大成元合双利债券型发起式证券投资基金基金合同》的有关规定，包括国内依法发行上市的股票(包括主板、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、公开发行的次级债券、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：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、存托凭证、可转换债券(含分离交易可转债)、可交换债券的比例合计不超过基金资产的 20%；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的 5%。本基金的业绩比较基准为：中债综合全价指数收益率\*80%+沪深 300 指数收益率\*10%+恒生指数收益率(使用估值汇率调整)\*5%+金融机构人民币活期存款基准利率(税后)\*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、《资产管理产品相关会计处理规定》及其他相关规定(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》、《大成元合双利债券型发起式证券投资基金基金合同》和在财务报表附注 6.4.4 所列示的中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

本财务报表以持续经营为基础编制。

## 6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合企业会计准则的要求,真实、完整地反映了本基金于 2023 年 6 月 30 日的财务状况以及自 2023 年 1 月 1 日起至 2023 年 6 月 30 日止期间的经营成果和净值变动情况。

## 6.4.4 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

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。

## 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

本基金本报告期未发生会计政策变更。

### 6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

### 6.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无重大会计差错更正。

## 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。

对基金通过深港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。基金通过深港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 2023 年 6 月 30 日
活期存款	271,977.19
等于：本金	271,820.86
加：应计利息	156.33
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	271,977.19

#### 6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 6 月 30 日				
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动	
股票	40,715,275.16	-	39,317,065.80	-1,398,209.36	
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	-	
债券	交易所市场	4,629,137.74	49,389.17	4,675,924.47	-2,602.44
	银行间市场	241,582,866.75	2,734,887.44	245,436,887.44	1,119,133.25
	合计	246,212,004.49	2,784,276.61	250,112,811.91	1,116,530.81
资产支持证券	-	-	-	-	
基金	-	-	-	-	
其他	-	-	-	-	
合计	286,927,279.65	2,784,276.61	289,429,877.71	-281,678.55	

#### 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 2023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	89,561.96
其中：交易所市场	75,295.79
银行间市场	14,266.17
应付利息	-
预提费用	14,416.99
合计	103,978.95

#### 6.4.7.10 实收基金

金额单位：人民币元

##### 大成元合双利债券发起式 A

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	10,029,296.24	10,029,296.24
本期申购	209,576,723.47	209,576,723.47
本期赎回（以“-”号填列）	-28,792.22	-28,792.22
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	219,577,227.49	219,577,227.49

##### 大成元合双利债券发起式 C

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	20.00	20.00
本期申购	208,778,727.00	208,778,727.00
本期赎回（以“-”号填列）	-208,768,277.22	-208,768,277.22
基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算调整	-	-
本期申购	-	-
本期赎回（以“-”号填列）	-	-
本期末	10,469.78	10,469.78

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

##### 大成元合双利债券发起式 A

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-281,578.58	-59,291.74	-340,870.32

本期利润	153,713.70	-186,849.68	-33,135.98
本期基金份额交易产生的变动数	-9,032,327.50	-460,452.14	-9,492,779.64
其中：基金申购款	-9,033,246.04	-460,375.60	-9,493,621.64
基金赎回款	918.54	-76.54	842.00
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-9,160,192.38	-706,593.56	-9,866,785.94

## 大成元合双利债券发起式 C

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-0.49	-0.15	-0.64
本期利润	64,722.13	-35,805.15	28,916.98
本期基金份额交易产生的变动数	-65,102.68	35,747.26	-29,355.42
其中：基金申购款	-7,724,812.89	-1,043,904.11	-8,768,717.00
基金赎回款	7,659,710.21	1,079,651.37	8,739,361.58
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-381.04	-58.04	-439.08

## 6.4.7.13 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年6月30日
活期存款利息收入	110,264.14
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	1,078.95
其他	94.05
合计	111,437.14

## 6.4.7.14 股票投资收益

## 6.4.7.14.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年6月30日
股票投资收益——买卖股票差价收入	-1,316,889.45
股票投资收益——赎回差价收入	-
股票投资收益——申购差价收入	-
股票投资收益——证券出借差价收入	-
合计	-1,316,889.45



## 6.4.7.14.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期
	2023年1月1日至2023年6月30日
卖出股票成交总额	32,095,770.53
减：卖出股票成本总额	33,273,724.32
减：交易费用	138,935.66
买卖股票差价收入	-1,316,889.45

## 6.4.7.14.3 股票投资收益——证券出借差价收入

无。

## 6.4.7.15 债券投资收益

## 6.4.7.15.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期
	2023年1月1日至2023年6月30日
债券投资收益——利息收入	1,718,089.78
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	-24,087.43
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	1,694,002.35

## 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
	2023年1月1日至2023年6月30日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	126,482,540.68
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	125,578,331.35
减：应计利息总额	922,226.71
减：交易费用	6,070.05
买卖债券差价收入	-24,087.43

## 6.4.7.15.3 债券投资收益——赎回差价收入

无。

## 6.4.7.15.4 债券投资收益——申购差价收入

无。

## 6.4.7.16 资产支持证券投资收益

## 6.4.7.16.1 资产支持证券投资收益项目构成

无。

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

无。

## 6.4.7.16.3 资产支持证券投资收益——赎回差价收入

无。

## 6.4.7.16.4 资产支持证券投资收益——申购差价收入

无。

## 6.4.7.17 贵金属投资收益

## 6.4.7.17.1 贵金属投资收益项目构成

无。

## 6.4.7.17.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

无。

## 6.4.7.17.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

无。

## 6.4.7.17.4 贵金属投资收益——申购差价收入

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
	2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
股票投资产生的股利收益	211,505.52
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	211,505.52

## 6.4.7.20 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期
	2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
1. 交易性金融资产	-222,654.83
股票投资	-1,354,753.78
债券投资	1,132,098.95
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	-222,654.83

## 6.4.7.21 其他收入

无。

## 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
	2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
审计费用	9,916.99
信息披露费	-
证券出借违约金	-
深港通证券组合费	14.86
银行划款手续费	4,673.00
账户维护费	13,500.00
合计	28,104.85

## 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
上海银行股份有限公司(“上海银行”)	基金托管人
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 2023年1月1日至2023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	61,711,983.27	59.24

#### 6.4.10.1.2 债券交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2023年1月1日至2023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	9,754,247.40	95.18

#### 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 2023年1月1日至2023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	52,335,000.00	100.00

#### 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 2023年1月1日至2023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	56,854.59	59.46	48,599.96	64.55

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。

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 2023年1月1日至2023年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	167,129.86
其中：支付销售机构的客户维护费	-

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 0.30% 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： $\text{日管理人报酬} = \text{前一日基金资产净值} \times 0.30\% / \text{当年天数}$ 。

##### 6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	27,855.04

注：支付基金托管人上海银行的托管费按前一日基金资产净值 0.05% 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： $\text{日托管费} = \text{前一日基金资产净值} \times 0.05\% / \text{当年天数}$ 。

##### 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 2023年1月1日至2023年6月30日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	大成元合双利债券发起 式 A	大成元合双利债券发起 式 C	合计
大成基金	-	3,839.53	3,839.53
合计	-	3,839.53	3,839.53

注：支付基金销售机构的销售服务费按前一日 C 类基金份额的基金资产净值 0.10% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付给大成基金，再由大成基金计算并支付给各基金销售机构。其计

算公式为：日销售服务费=前一日 C 类基金份额的基金资产净值 × 0.10%/ 当年天数。

#### 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固有资金投资本基金的情况

份额单位：份

项目	本期	本期
	2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日	2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
	大成元合双利债券发起式 A	大成元合双利债券发起式 C
基金合同生效日（2022 年 9 月 8 日）持有的基金份额	-	-
报告期初持有的基金份额	10,000,200.02	-
报告期间申购/买入总份额	-	10,449.32
报告期间因拆分变动份额	-	-
减：报告期间赎回/卖出总份额	-	-
报告期末持有的基金份额	10,000,200.02	10,449.32
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	4.55%	0.00%

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	
	2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日	
	期末余额	当期利息收入

上海银行	271,977.19	110,264.10
------	------------	------------

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（2023 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
127086	恒邦转债	2023 年 6 月 15 日	1 个月内（含）	新债未上市	100.00	100.01	10	1,000.00	1,000.08	-

##### 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 2023 年 6 月 30 日止，本基金从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额 79,065,039.79 元，是以如下债券作为抵押。

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
102000912	20 宿迁城投 MTN002	2023 年 7 月 5 日	101.87	100,000	10,187,327.87
102103246	21 常德城投 MTN003	2023 年 7 月 5 日	102.67	100,000	10,266,506.85
102280539	22 宣城国资 MTN001	2023 年 7 月 5 日	101.92	100,000	10,191,728.96
102280957	22 晋交投 MTN001	2023 年 7 月 5 日	100.55	100,000	10,055,043.72
102281665	22 陕煤化 MTN009	2023 年 7 月 5 日	103.27	100,000	10,326,767.12

102282040	22 九龙江 MTN001	2023 年 7 月 5 日	102.30	100,000	10,230,212.60
102282533	22 柯桥国资 MTN003	2023 年 7 月 5 日	102.47	100,000	10,247,200.00
102380891	23 萧山交投 MTN001	2023 年 7 月 5 日	101.04	76,000	7,678,755.93
1920074	19 东莞银行 二级	2023 年 7 月 5 日	104.95	100,000	10,495,054.79
2020002	20 杭州银行 永续债	2023 年 7 月 5 日	103.67	24,000	2,488,145.75
2020080	20 长沙银行 二级	2023 年 7 月 5 日	106.10	100,000	10,609,726.03
合计				1,000,000	102,776,469.62

#### 6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2023 年 6 月 30 日止，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 1,000,000.00 元，截至 2023 年 07 月 03 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上海银行股份有限公司，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。信用等级评估以内部信用评级为主，外部信用评级为辅。内部债券信用评级主要考察发行人的经营风险、财务风险和流动性风险，以及信用产品的条款和担保人的情况等。此外，本基金的基金管理人根据信用产品的内部评级，通过单只信用产品投资占基金资产净值的比例及占发行量的比例进行控制，通过分散化投资以分散信用风险。

本期末，本基金持有的除国债、央行票据和政策性金融债以外的债券占基金资产净值的比例为 112.38%(上年度末：0.44%)。

#### 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。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%，且本基金组合资产中 7 个工作日可变现资产未超过最近工作日确认的净赎回金额。

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 2023 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	271,977.19	-	-	-	271,977.19
结算备付金	198,738.97	-	-	-	198,738.97
存出保证金	23,512.12	-	-	-	23,512.12
交易性金融资产	12,709,178.65	215,881,149.45	21,522,483.81	39,317,065.80	289,429,877.71
应收清算款	-	-	-	724,231.62	724,231.62
资产总计	13,203,406.93	215,881,149.45	21,522,483.81	40,041,297.42	290,648,337.61
负债					
应付管理人报酬	-	-	-	51,832.81	51,832.81

应付托管费	-	-	-	8,638.79	8,638.79
应付清算款	-	-	-	683,079.05	683,079.05
卖出回购金融资产款	80,065,039.79	-	-	-	80,065,039.79
应付销售服务费	-	-	-	0.90	0.90
应交税费	-	-	-	15,295.07	15,295.07
其他负债	-	-	-	103,978.95	103,978.95
负债总计	80,065,039.79	-	-	862,825.57	80,927,865.36
利率敏感度缺口	-66,861,632.86	215,881,149.45	21,522,483.81	39,178,471.85	209,720,472.25
上年度末 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	264,494.01	-	-	-	264,494.01
结算备付金	142,153.73	-	-	-	142,153.73
存出保证金	3,781.16	-	-	-	3,781.16
交易性金融资产	3,224,689.76	4,377,612.21	432,106.31	1,865,505.86	9,899,914.14
资产总计	3,635,118.66	4,377,612.21	432,106.31	1,865,505.86	10,310,343.04
负债					
应付管理人报酬	-	-	-	2,478.61	2,478.61
应付托管费	-	-	-	413.10	413.10
应付清算款	-	-	-	10,762.61	10,762.61
卖出回购金融资产款	549,852.34	-	-	-	549,852.34
应交税费	-	-	-	0.17	0.17
其他负债	-	-	-	58,390.93	58,390.93
负债总计	549,852.34	-	-	72,045.42	621,897.76
利率敏感度缺口	3,085,266.32	4,377,612.21	432,106.31	1,793,460.44	9,688,445.28

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		
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（2023 年 6 月 30 日）	上年度末（2022 年 12 月 31 日）
	市场利率下降 25 个基点	1,169,089.74	38,644.64
市场利率上升 25 个基点	-1,160,133.64	-38,644.64	

#### 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和负债，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 2023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	-	946,845.80	-	946,845.80
资产合计	-	946,845.80	-	946,845.80
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	-	946,845.80	-	946,845.80
项目	上年度末 2022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	-	221,620.30	-	221,620.30
资产合计	-	221,620.30	-	221,620.30
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	-	221,620.30	-	221,620.30

##### 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
----	------------------

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（2023 年 6 月 30 日）	上年度末（2022 年 12 月 31 日）
	港币相对人民币升值 5%	47,342.29	11,081.02
	港币相对人民币贬值 5%	-47,342.29	-11,081.02

#### 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。

#### 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 2023 年 6 月 30 日		上年度末 2022 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	39,317,065.80	18.75	1,865,505.86	19.25
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	39,317,065.80	18.75	1,865,505.86	19.25

#### 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净资产的比例为 18.75%，因此除市场利率和外汇净资产资产净值无重大影响。

#### 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 2023 年 6 月 30 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
第一层次	39,733,768.71	1,908,441.30
第二层次	249,696,109.00	7,991,472.84
第三层次	-	-
合计	289,429,877.71	9,899,914.14

###### 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。

###### 6.4.14.4 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资产和金融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	39,317,065.80	13.53
	其中：股票	39,317,065.80	13.53
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	250,112,811.91	86.05
	其中：债券	250,112,811.91	86.05
	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	470,716.16	0.16
8	其他各项资产	747,743.74	0.26
9	合计	290,648,337.61	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 946,845.80 元，占期末基金资产净值的比例为 0.45%。

### 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	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	27,095,747.08	12.92
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	702,328.00	0.33
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-

I	信息传输、软件和信息技术服务业	7,362,579.92	3.51
J	金融业	2,183,376.00	1.04
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
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	1,026,189.00	0.49
S	综合	-	-
	合计	38,370,220.00	18.30

### 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（%）
通讯	366,874.28	0.17
非必需消费品	-	-
必需消费品	-	-
能源	-	-
金融	-	-
房地产	-	-
医疗保健	579,971.52	0.28
工业	-	-
材料	-	-
科技	-	-
公用事业	-	-
政府	-	-
合计	946,845.80	0.45

注：以上分类采用彭博行业分类标准。

### 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	002920	德赛西威	17,700	2,757,837.00	1.32
2	688249	晶合集成	140,639	2,653,857.93	1.27
3	688036	传音控股	17,149	2,520,903.00	1.20
4	600276	恒瑞医药	51,500	2,466,850.00	1.18
5	688008	澜起科技	39,904	2,291,287.68	1.09
6	002475	立讯精密	58,600	1,901,570.00	0.91
7	000333	美的集团	31,500	1,855,980.00	0.88
8	688082	盛美上海	16,581	1,830,542.40	0.87



9	688018	乐鑫科技	13,883	1,802,291.06	0.86
10	688111	金山办公	3,690	1,742,491.80	0.83
11	688596	正帆科技	38,546	1,669,041.80	0.80
12	688568	中科星图	15,507	1,249,554.06	0.60
13	601319	中国人保	209,400	1,222,896.00	0.58
14	603596	伯特利	15,100	1,196,826.00	0.57
15	002415	海康威视	33,600	1,112,496.00	0.53
16	000858	五粮液	6,600	1,079,562.00	0.51
17	600498	烽火通信	52,757	1,074,660.09	0.51
18	300788	中信出版	30,900	1,026,189.00	0.49
19	601318	中国平安	20,700	960,480.00	0.46
20	002946	新乳业	63,500	911,225.00	0.43
21	600941	中国移动	9,000	839,700.00	0.40
22	002153	石基信息	51,100	715,400.00	0.34
23	688475	萤石网络	16,608	711,818.88	0.34
24	301015	百洋医药	25,300	702,328.00	0.33
25	603039	泛微网络	8,200	669,366.00	0.32
26	002841	视源股份	9,900	661,716.00	0.32
27	06606	诺辉健康	23,000	579,971.52	0.28
28	688012	中微公司	2,554	399,573.30	0.19
29	00700	腾讯控股	1,200	366,874.28	0.17
30	603444	吉比特	700	343,777.00	0.16

## 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	688008	澜起科技	3,065,244.69	31.64
2	688249	晶合集成	2,866,609.94	29.59
3	002920	德赛西威	2,823,680.00	29.14
4	600276	恒瑞医药	2,460,906.60	25.40
5	688082	盛美上海	2,419,363.95	24.97
6	688036	传音控股	2,278,523.49	23.52
7	688018	乐鑫科技	2,188,301.62	22.59
8	002415	海康威视	2,112,462.00	21.80
9	300788	中信出版	2,035,616.00	21.01
10	600498	烽火通信	2,032,390.70	20.98
11	688596	正帆科技	1,969,641.98	20.33
12	002475	立讯精密	1,814,291.88	18.73
13	000333	美的集团	1,799,200.00	18.57
14	688111	金山办公	1,677,466.74	17.31
15	000858	五粮液	1,651,636.00	17.05
16	300413	芒果超媒	1,587,600.00	16.39

17	603596	伯特利	1,522,791.00	15.72
18	601319	中国人保	1,396,302.00	14.41
19	688568	中科星图	1,352,434.69	13.96
20	600941	中国移动	1,297,553.00	13.39
21	000651	格力电器	1,205,388.00	12.44
22	002946	新乳业	1,125,101.00	11.61
23	601318	中国平安	1,094,441.00	11.30
24	600809	山西汾酒	1,089,952.00	11.25
25	002153	石基信息	1,036,245.20	10.70
26	603916	苏博特	963,299.49	9.94
27	688168	安博通	958,703.84	9.90
28	06606	诺辉健康	955,125.70	9.86
29	600570	恒生电子	944,839.00	9.75
30	002841	视源股份	921,623.00	9.51
31	600373	中文传媒	892,434.00	9.21
32	603986	兆易创新	886,803.00	9.15
33	301015	百洋医药	860,734.00	8.88
34	688475	萤石网络	849,710.69	8.77
35	001322	箭牌家居	795,583.00	8.21
36	688041	海光信息	732,651.09	7.56
37	603444	吉比特	728,867.00	7.52
38	688012	中微公司	717,781.60	7.41
39	00700	腾讯控股	717,666.85	7.41
40	605358	立昂微	710,051.00	7.33
41	603039	泛微网络	706,314.00	7.29
42	688223	晶科能源	627,643.45	6.48
43	300770	新媒股份	616,227.00	6.36
44	002121	科陆电子	552,785.00	5.71
45	600325	华发股份	504,315.00	5.21
46	688072	拓荆科技	452,955.54	4.68
47	688630	芯碁微装	447,983.51	4.62
48	688100	威胜信息	434,561.89	4.49
49	000088	盐田港	419,625.00	4.33
50	601577	长沙银行	416,490.00	4.30
51	000063	中兴通讯	398,148.00	4.11
52	601633	长城汽车	377,946.00	3.90
53	300133	华策影视	350,131.00	3.61
54	300474	景嘉微	344,980.00	3.56
55	000999	华润三九	317,177.00	3.27
56	002463	沪电股份	313,701.00	3.24
57	002916	深南电路	307,348.00	3.17
58	688507	索辰科技	293,014.16	3.02
59	300286	安科瑞	276,634.00	2.86

60	605068	明新旭腾	259,264.00	2.68
61	003000	劲仔食品	218,162.00	2.25
62	688668	鼎通科技	211,298.00	2.18
63	688088	虹软科技	209,164.28	2.16
64	600642	申能股份	208,740.00	2.15
65	600419	天润乳业	207,104.00	2.14
66	600933	爱柯迪	198,747.00	2.05
67	300908	仲景食品	198,370.00	2.05
68	300059	东方财富	198,090.00	2.04
69	002430	杭氧股份	196,367.00	2.03

注：1、本项中“本期累计买入金额”按买入成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

#### 7.4.2 累计卖出金额超期初基金资产净值 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	300413	芒果超媒	1,767,186.00	18.24
2	000651	格力电器	1,098,859.00	11.34
3	600809	山西汾酒	1,014,155.00	10.47
4	603916	苏博特	1,007,321.68	10.40
5	600498	烽火通信	984,920.67	10.17
6	600373	中文传媒	982,129.00	10.14
7	300788	中信出版	914,485.00	9.44
8	603986	兆易创新	864,294.00	8.92
9	600570	恒生电子	791,311.00	8.17
10	002415	海康威视	767,108.00	7.92
11	688168	安博通	741,037.57	7.65
12	001322	箭牌家居	726,351.60	7.50
13	605358	立昂微	704,435.00	7.27
14	603596	伯特利	699,600.00	7.22
15	300770	新媒股份	657,214.00	6.78
16	600325	华发股份	656,025.00	6.77
17	688041	海光信息	568,578.78	5.87
18	002121	科陆电子	521,788.00	5.39
19	688223	晶科能源	520,481.50	5.37
20	688082	盛美上海	512,890.54	5.29
21	688072	拓荆科技	489,473.20	5.05
22	000858	五粮液	461,296.00	4.76
23	688100	威胜信息	447,766.63	4.62
24	688630	芯碁微装	447,372.22	4.62
25	688008	澜起科技	431,269.35	4.45
26	00700	腾讯控股	411,136.10	4.24

27	601577	长沙银行	388,517.00	4.01
28	000088	盐田港	387,510.00	4.00
29	601633	长城汽车	377,855.00	3.90
30	600941	中国移动	375,729.00	3.88
31	000063	中兴通讯	357,660.00	3.69
32	300133	华策影视	353,563.00	3.65
33	06606	诺辉健康	335,539.40	3.46
34	603444	吉比特	335,059.00	3.46
35	000999	华润三九	334,602.00	3.45
36	002430	杭氧股份	322,710.00	3.33
37	000568	泸州老窖	321,818.00	3.32
38	688012	中微公司	316,707.61	3.27
39	002463	沪电股份	311,065.00	3.21
40	300474	景嘉微	310,759.00	3.21
41	002916	深南电路	299,896.42	3.10
42	603027	千禾味业	297,142.00	3.07
43	688507	索辰科技	295,140.20	3.05
44	688596	正帆科技	293,115.62	3.03
45	688018	乐鑫科技	264,722.30	2.73
46	300286	安科瑞	255,778.00	2.64
47	003000	劲仔食品	253,042.00	2.61
48	605068	明新旭腾	248,312.00	2.56
49	688088	虹软科技	226,624.82	2.34
50	300718	长盛轴承	215,348.00	2.22
51	600642	申能股份	202,566.00	2.09
52	300908	仲景食品	202,424.00	2.09
53	300776	帝尔激光	198,679.00	2.05
54	002841	视源股份	195,654.00	2.02

注：本项中“本期累计卖出金额”按卖出成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

#### 7.4.3 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	72,080,038.04
卖出股票收入（成交）总额	32,095,770.53

注：上述金额均指成交金额（成交单价乘以成交数量），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	4,258,221.48	2.03
2	央行票据	-	-
3	金融债券	72,307,302.64	34.48

	其中：政策性金融债	10,174,590.16	4.85
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	173,129,584.80	82.55
7	可转债（可交换债）	417,702.99	0.20
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	250,112,811.91	119.26

#### 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	2020080	20 长沙银行 二级	100,000	10,609,726.03	5.06
2	1920074	19 东莞银行 二级	100,000	10,495,054.79	5.00
3	2020002	20 杭州银行 永续债	100,000	10,367,273.97	4.94
4	102101905	21 大唐集 MTN004	100,000	10,345,244.93	4.93
5	102281665	22 陕煤化 MTN009	100,000	10,326,767.12	4.92

#### 7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

无。

#### 7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

无。

#### 7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

无。

#### 7.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

##### 7.10.1 本期国债期货投资政策

无。

##### 7.10.2 本期国债期货投资评价

无。

#### 7.11 投资组合报告附注

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

1、本基金投资的前十名证券之一 20 江苏银行永续债的发行主体江苏银行股份有限公司于

2023 年 2 月 10 日因违反账户管理规定、未按规定履行客户身份识别义务等，受到中国人民银行处罚（银罚决字〔2023〕1 号）。本基金认为，对江苏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 20 长沙银行二级的发行主体长沙银行股份有限公司于 2023 年 1 月 31 日因未按规定保存客户身份资料和交易记录、未按规定报送大额交易报告或者可疑交易报告受到中国人民银行长沙中心支行处罚（长银罚决字〔2023〕1 号）。本基金认为，对长沙银行的处罚不会对其投资价值构成实质性负面影响。

### 7.11.2 基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库

本基金投资的前十名股票未超出基金合同规定的备选股票库。

### 7.11.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	23,512.12
2	应收清算款	724,231.62
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	747,743.74

### 7.11.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

无。

### 7.11.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

无。

### 7.11.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入原因，分项之和与合计可能有尾差。

## § 8 基金份额持有人信息

### 8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额级别	持有人户数	户均持有的基金份额	持有人结构	
			机构投资者	个人投资者

	(户)		持有份额	占总份 额比例 (%)	持有份额	占总 份额 比例 (%)
大成元合 双利债券 发起式 A	68	3,229,076.87	219,489,044.68	99.96	88,182.81	0.04
大成元合 双利债券 发起式 C	12	872.48	10,449.32	99.80	20.46	0.20
合计	80	2,744,846.22	219,499,494.00	99.96	88,203.27	0.04

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	大成元合双利债券发起式 A	87,903.06	0.0400
	大成元合双利债券发起式 C	5.00	0.0478
	合计	87,908.06	0.0400

注：上述占基金总份额比例的计算中，对分级份额，比例的分母采用各自级别的份额，对合计数，比例的分母采用下属分级基金份额的合计数（即期末基金份额总额）。

## 8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

项目	份额级别	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、 基金投资和研究部门负 责人持有本开放式基金	大成元合双利债券发起式 A	0
	大成元合双利债券发起式 C	0
	合计	0
本基金基金经理持有本 开放式基金	大成元合双利债券发起式 A	0~10
	大成元合双利债券发起式 C	0
	合计	0~10

## 8.4 发起式基金发起资金持有份额情况

项目	持有份额总数	持有份额占基金总份额比例 (%)	发起份额总数	发起份额占基金总份额比例 (%)	发起份额承诺持有期限
基金管理人固有资金	10,010,649.34	4.56	10,000,200.02	4.55	3 年
基金管理人高级管理人员	-	-	-	-	-
基金经理等人员	87,908.06	0.04	-	-	-
基金管理人股东	-	-	-	-	-
其他	-	-	-	-	-
合计	10,098,557.40	4.60	10,000,200.02	4.55	3 年

## § 9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	大成元合双利债券发起式 A	大成元合双利债券发起式 C
基金合同生效日 (2022 年 9 月 8 日) 基金份额总额	10,006,017.12	20.00
本报告期期初基金份额总额	10,029,296.24	20.00
本报告期基金总申购份额	209,576,723.47	208,778,727.00
减：本报告期基金总赎回份额	28,792.22	208,768,277.22
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	219,577,227.49	10,469.78

## § 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



经大成基金管理有限公司第八届董事会第二次会议审议通过，自 2023 年 3 月 25 日起，温智敏先生不再担任公司副总经理职务；聘请石国武先生担任公司副总经理，任期自 2023 年 3 月 25 日起，至公司第八届董事会任期届满之日止。具体详见我司发布的《大成基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告》。

## 二、基金托管人的基金托管部门的重大人事变动

2023 年 3 月，项寅同志担任上海银行股份有限公司资产托管部副总经理职务，上述人事变动已进行备案、公告。

### 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内，无涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。

### 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

#### 10.6.1 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。

#### 10.6.2 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，本基金托管人的托管业务部门及其相关高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

### 10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

#### 10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例 (%)	佣金	占当期佣金总量的比例 (%)	
光大证券	1	61,711,983.27	59.24	56,854.59	59.46	-
申万宏源	2	42,463,825.30	40.76	38,760.77	40.54	-
招商证券	1	-	-	-	-	-

注：1. 租用券商专用交易单元的选择标准和程序：根据中国证监会颁布的《关于完善证券投资

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：

- (1) 财务状况良好，最近一年无重大违规行为；
- (2) 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；
- (3) 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；
- (4) 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；
- (5) 能提供投资组合运作、管理所需的其他券商服务；
- (6) 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：本报告期内新增交易单元：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	9,754,247.40	95.18	52,335,000.00	100.00	-	-
申万宏源	493,482.56	4.82	-	-	-	-

### 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	2023年6月30日
2	关于大成元合双利债券型发起式证券投资基金暂停大额申购（含定期定额申购）及基金转换转入的公告	中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站	2023年6月28日
3	大成基金管理有限公司关于旗下部	中国证监会基金电子披	2023年5月30日

	分基金增加珠海盈米基金销售有限公司为销售机构的公告	露网站、规定报刊及本公司网站	
4	大成基金管理有限公司关于旗下部分基金增加上海中欧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	2023 年 5 月 24 日
5	大成基金管理有限公司关于旗下部分基金增加上海天天基金销售有限公司为销售机构的公告	中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站	2023 年 5 月 11 日
6	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	2023 年 4 月 27 日
7	大成元合双利债券型发起式证券投资基金更新招募说明书	中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站	2023 年 4 月 21 日
8	大成元合双利债券型发起式证券投资基金(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	2023 年 4 月 21 日
9	大成元合双利债券型发起式证券投资基金(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	2023 年 4 月 21 日
10	大成元合双利债券型发起式证券投资基金 2023 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	2023 年 4 月 21 日
11	大成元合双利债券型发起式证券投资基金增聘基金经理公告	中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站	2023 年 4 月 20 日
12	关于大成元合双利债券型发起式证券投资基金提高份额净值精度的公告	中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站	2023 年 4 月 14 日
13	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	2023 年 4 月 7 日
14	大成元合双利债券型发起式证券投资基金 2022 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	2023 年 3 月 30 日
15	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	2023 年 3 月 27 日
16	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	2023 年 3 月 27 日
17	大成基金管理有限公司关于养老金客户通过直销柜台申购旗下基金费率优惠的公告	中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站	2023 年 3 月 24 日

18	大成基金管理有限公司关于旗下部分基金增加北京汇成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	2023 年 3 月 20 日
19	大成基金管理有限公司关于旗下部分基金增加诺亚正行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	2023 年 3 月 20 日
20	大成基金管理有限公司关于旗下部分基金增加上海好买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	2023 年 3 月 20 日
21	大成基金管理有限公司关于旗下部分基金增加嘉实财富管理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	2023 年 3 月 16 日
22	大成基金管理有限公司关于旗下部分基金增加玄元保险代理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	2023 年 3 月 10 日
23	大成元合双利债券型发起式证券投资基金 2022 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	2023 年 1 月 18 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	20230406-20230413	0.00	208,768,267.22	208,768,267.22	0.00	0.00
	2	20230101-20230404	10,000,200.02	10,449.32	0.00	10,010,649.34	4.56
	3	20230406-20230630	0.00	209,488,844.66	0.00	209,488,844.66	95.40
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合双利债券型发起式证券投资基金的文件；
- 2、《大成元合双利债券型发起式证券投资基金基金合同》；
- 3、《大成元合双利债券型发起式证券投资基金基金托管协议》；
- 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

2023 年 8 月 30 日