

大成景盛一年定期开放债券型证券投资基金
2024 年第 3 季度报告

2024 年 9 月 30 日

基金管理人：大成基金管理有限公司

基金托管人：中国银行股份有限公司

报告送出日期：2024 年 10 月 25 日

§1 重要提示

基金管理人的董事会及董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带责任。

基金托管人中国银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2024 年 10 月 24 日复核了本报告中的财务指标、净值表现和投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2024 年 07 月 01 日起至 09 月 30 日止。

§2 基金产品概况

基金简称	大成景盛一年定期开放债券
基金主代码	002946
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2016 年 11 月 8 日
报告期末基金份额总额	61,957,039.09 份
投资目标	在严格控制投资风险的基础上，通过积极主动的投资管理，力争实现基金资产长期稳定增值。
投资策略	<p>（一）封闭期投资策略</p> <p>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、货币类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。</p> <p>（二）开放期投资策略</p> <p>开放运作期内，本基金将保持较高的组合流动性，方便投资人安排投资。</p> <p>1、债券投资策略</p> <p>在遵守本基金有关投资限制与投资比例的前提下，将主要投资于高流动性的投资品种。本基金在开放期将重点考虑债券的安全性和流动性，确保组合债券有较高的变现能力，并严格控制基金组合的杠杆比例。</p> <p>2、流动性管理策略</p> <p>基金管理人将密切关注基金的申购赎回情况，对投资组合的现金比例进行结构化管理。同时，也会通过回</p>

	购的滚动操作和债券品种的期限结构搭配，有效分配基金的现金流，保持本基金在开放期的充分流动性。	
业绩比较基准	沪深 300 指数收益率×20%+中债综合指数（全价）收益率×80%	
风险收益特征	本基金为债券型基金，属于证券投资基金中的较低风险品种，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。	
基金管理人	大成基金管理有限公司	
基金托管人	中国银行股份有限公司	
下属分级基金的基金简称	大成景盛一年定期开放债券 A	大成景盛一年定期开放债券 C
下属分级基金的交易代码	002946	002947
报告期末下属分级基金的份额总额	61,315,070.91 份	641,968.18 份

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位：人民币元

主要财务指标	报告期（2024 年 7 月 1 日-2024 年 9 月 30 日）	
	大成景盛一年定期开放债券 A	大成景盛一年定期开放债券 C
1. 本期已实现收益	442,720.35	3,786.26
2. 本期利润	1,251,656.00	11,984.35
3. 加权平均基金份额本期利润	0.0204	0.0187
4. 期末基金资产净值	70,971,505.29	719,867.07
5. 期末基金份额净值	1.1575	1.1213

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、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

大成景盛一年定期开放债券 A

阶段	净值增长率①	净值增长率 标准差②	业绩比较基 准收益率③	业绩比较基 准收益率标 准差④	①—③	②—④

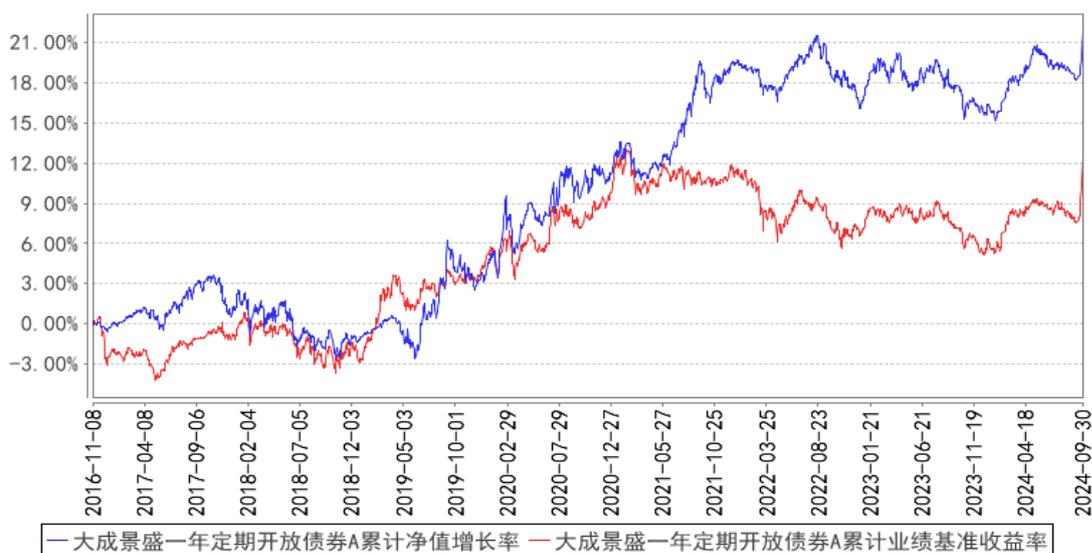
过去三个月	1.79%	0.22%	3.38%	0.28%	-1.59%	-0.06%
过去六个月	3.09%	0.20%	3.83%	0.22%	-0.74%	-0.02%
过去一年	3.39%	0.19%	4.84%	0.20%	-1.45%	-0.01%
过去三年	3.78%	0.20%	1.53%	0.21%	2.25%	-0.01%
过去五年	17.24%	0.25%	9.09%	0.23%	8.15%	0.02%
自基金合同 生效起至今	21.81%	0.25%	12.32%	0.23%	9.49%	0.02%

大成景盛一年定期开放债券 C

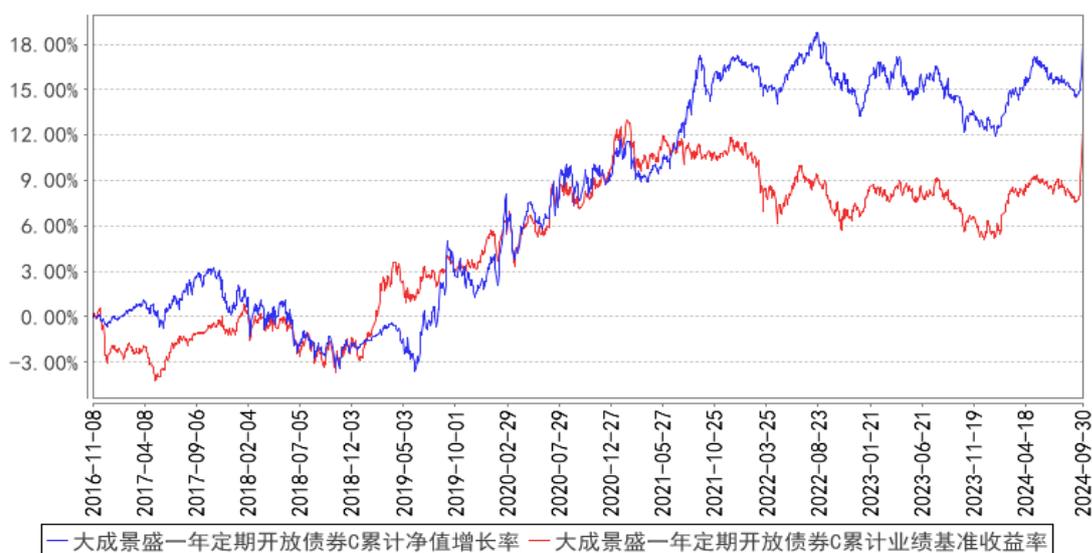
阶段	净值增长率①	净值增长率 标准差②	业绩比较基 准收益率③	业绩比较基 准收益率标 准差④	①-③	②-④
过去三个月	1.69%	0.22%	3.38%	0.28%	-1.69%	-0.06%
过去六个月	2.88%	0.20%	3.83%	0.22%	-0.95%	-0.02%
过去一年	2.96%	0.19%	4.84%	0.20%	-1.88%	-0.01%
过去三年	2.52%	0.20%	1.53%	0.21%	0.99%	-0.01%
过去五年	14.90%	0.25%	9.09%	0.23%	5.81%	0.02%
自基金合同 生效起至今	18.00%	0.25%	12.32%	0.23%	5.68%	0.02%

3.2.2 自基金合同生效以来基金累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

大成景盛一年定期开放债券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



大成景盛一年定期开放债券C累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



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

§4 管理人报告

4.1 基金经理（或基金经理小组）简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
王立	本基金基金经理， 首席固定	2020年12月 16日	-	22年	中南财经大学经济学硕士。曾就职于申银万国证券股份有限公司、南京市商业银行资金营运中心。2005年4月加入大

	收益投资 官兼社保 及养老投 资管理部 总监			成基金管理有限公司，曾担任固定收益总部总监助理、副总监、总监，现任首席固定收益投资官兼社保及养老投资管理部总监。2007 年 1 月 12 日至 2014 年 12 月 23 日任大成货币市场证券投资基金基金经理。2009 年 5 月 23 日起任大成债券投资基金基金经理。2012 年 11 月 20 日至 2014 年 4 月 4 日任大成现金增利货币市场基金基金经理。2013 年 2 月 1 日至 2015 年 5 月 25 日任大成月添利理财债券型证券投资基金基金经理。2013 年 7 月 23 日至 2015 年 5 月 25 日任大成景旭纯债债券型证券投资基金基金经理。2014 年 9 月 3 日至 2020 年 10 月 15 日任大成景兴信用债债券型证券投资基金基金经理。2014 年 9 月 3 日至 2016 年 11 月 23 日任大成景丰债券型证券投资基金（LOF）基金经理。2016 年 2 月 3 日至 2018 年 4 月 2 日任大成慧成货币市场基金基金经理。2020 年 12 月 16 日起任大成景盛一年定期开放债券型证券投资基金基金经理。2021 年 8 月 17 日起任大成元吉增利债券型证券投资基金基金经理。具有基金从业资格。国籍：中国
--	------------------------------------	--	--	--

注：1、任职日期、离任日期为本基金管理人作出决定之日。

2、证券从业年限的计算标准遵从中国证监会《证券投资基金经营机构董事、监事、高级管理人员及从业人员监督管理办法》的相关规定。

4.1.1 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理同时管理的产品情况

无。

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

报告期内，本基金管理人严格遵守《证券法》、《证券投资基金法》等有关法律法规及基金合同、基金招募说明书等有关基金法律文件的规定，以取信于市场、取信于社会投资公众为宗旨，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在规范基金运作和严格控制投资风险的前提下，为基金份额持有人谋求最大利益，无损害基金份额持有人利益的行为。

4.3 公平交易专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

报告期内，公司严格执行了公平交易的原则和制度。公司运用统计分析方法和工具，对旗下所有投资组合连续 4 个季度的日内、3 日内、5 日内及 10 日内股票及债券交易同向交易价差进行分析，针对同一基金经理管理的多个投资组合及公私募兼任基金经理管理的多个投资组合的投资交易行为加强了公平交易监测与分析，包括对不同时间窗下（同日、3 日、5 日、10 日）反向交易和同向交易价差监控的分析。分析结果表明：债券交易同向交易频率较低；部分股票同向交易溢价率较大主要来源于投资策略差异、市场因素（如个股当日价格振幅较高）及组合经理交易时机选择，同时结合交易价差专项统计分析，未发现违反公平交易原则的异常情况。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

报告期内，公司旗下所有投资组合未发现存在异常交易行为。公司旗下所有投资组合参与的交易所公开竞价交易中，同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的 5% 的交易共 1 次，为指数量化投资组合因投资策略需要和其他组合发生的反向交易，有关基金经理按规定履行了审批程序。投资组合间相邻交易日反向交易的市场成交比例、成交均价等交易结果数据表明该类交易不对市场产生重大影响，无异常。

4.4 报告期内基金的投资策略和运作分析

三季度以来，经济增速整体平稳，但居民部门预期改善缓慢，地产销售的疲弱已逐步向地产投资传导，PPI 同比增速也再度回落。在“经济运行出现一些新的情况和问题”的背景之下，9 月政治局会议明确了“加力推出增量政策”、“加大财政货币政策逆周期调节力度”的大方向。央行连续降准、降息，并降低存量房贷利率。三季度证券市场跌宕起伏。7-8 月债市顺势而为，收益率连续下行，而 9 月末风险偏好转换，股债跷跷板效应明显，股票市场大幅上涨，债券利率反弹，信用利差迅速扩大，并逐渐显示出超调迹象。转债资产在三季度先震荡回落，后与权益市场同步上涨，其中低价转债的振幅尤为明显。

本基金在严格控制风险的基础上，采取积极的组合策略进行投资运作。3 季度主动降低了组合债券久期和杠杆，在季末下跌中保护了债券投资收益。9 月底，组合在卖出利率债的同时增配了股票和转债资产，进行了大类资产配置切换。股票方面，我们对持仓行业和板块进行再均衡，增持了家电、汽车、计算机电子等行业。相关政策的推出极大地提振了市场信心，权益类资产风险降低，但短期市场涨幅过快，仍需重新审视个券标的的风险收益比，继续寻找给组合贡献正收益的机会。

非常感谢持有人的信任和支持，我们将继续按照本基金合同的要求，严格控制投资风险，积极进行资产配置，挖掘投资机会，力争获得与基金风险特征一致的收益回报。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末大成景盛一年定期开放债券 A 的基金份额净值为 1.1575 元，本报告期基金份额净值增长率为 1.79%，同期业绩比较基准收益率为 3.38%；截至本报告期末大成景盛一年定期开放债券 C 的基金份额净值为 1.1213 元，本报告期基金份额净值增长率为 1.69%，同期业绩比较基准收益率为 3.38%。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

无。

§5 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额（元）	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	11,965,307.00	14.44
	其中：股票	11,965,307.00	14.44
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	63,096,890.89	76.17
	其中：债券	63,096,890.89	76.17
	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	4,776,504.49	5.77
8	其他资产	3,003,375.14	3.63
9	合计	82,842,077.52	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	1,158,682.00	1.62
C	制造业	6,725,265.92	9.38
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	61,488.00	0.09
E	建筑业	-	-

F	批发和零售业	93,285.00	0.13
G	交通运输、仓储和邮政业	644,627.00	0.90
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	-	-
J	金融业	3,175,383.08	4.43
K	房地产业	93,100.00	0.13
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	13,476.00	0.02
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	-	-
S	综合	-	-
	合计	11,965,307.00	16.69

5.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

无。

5.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的股票投资明细

5.3.1 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	601665	齐鲁银行	298,600	1,546,748.00	2.16
2	000651	格力电器	21,000	1,006,740.00	1.40
3	601872	招商轮船	80,000	643,200.00	0.90
4	002422	科伦药业	18,900	604,800.00	0.84
5	601077	渝农商行	106,900	581,536.00	0.81
6	688012	中微公司	2,899	475,436.00	0.66
7	600028	中国石化	68,100	473,976.00	0.66
8	000100	TCL 科技	99,050	453,649.00	0.63
9	000063	中兴通讯	14,400	448,560.00	0.63
10	300274	阳光电源	4,080	406,286.40	0.57

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	20,843,828.35	29.07
	其中：政策性金融债	20,843,828.35	29.07
4	企业债券	35,911,794.80	50.09

5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	6,341,267.74	8.85
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	63,096,890.89	88.01

5.5 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	200219	20 国开 19	100,000	10,525,650.27	14.68
2	210316	21 进出 16	100,000	10,318,178.08	14.39
3	115940	GY 锡铁 02	50,000	5,191,086.03	7.24
4	148582	24 深创投 01	50,000	5,176,073.15	7.22
5	148577	24 招租 K1	50,000	5,134,646.30	7.16

5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券投资 明细

无。

5.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

无。

5.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

无。

5.9 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.9.1 本期国债期货投资政策

为有效控制债券投资的系统性风险，本基金根据风险管理的原则，以套期保值为目的，适度运用国债期货，提高投资组合的运作效率。

在国债期货投资时，本基金将首先分析国债期货各合约价格与最便宜可交割券的关系，选择定价合理的国债期货合约，其次，考虑国债期货各合约的流动性情况，最终确定与现货组合的合适匹配，以达到风险管理的目标。

5.9.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

代码	名称	持仓量（买/卖）	合约市值（元）	公允价值变动（元）	风险指标说明
-	-	-	-	-	-
公允价值变动总额合计（元）					-
国债期货投资本期收益（元）					14,629.60

国债期货投资本期公允价值变动（元）	-
-------------------	---

注：买入持仓量以正数表示，卖出持仓量以负数表示，单位为手。

5.9.3 本期国债期货投资评价

本期组合结合债市环境，通过少量国债期货套保交易降低了组合波动，提高运作效率。

5.10 投资组合报告附注

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

本基金投资的前十名证券之一齐鲁银行的发行主体齐鲁银行股份有限公司于 2023 年 12 月 28 日因关联交易贷款管理不到位、小微企业划型管理不到位、流动资金贷款管理不到位等受到国家金融监督管理总局山东监管局处罚（鲁金罚决字〔2023〕86 号）。本基金认为，对齐鲁银行股份有限公司的处罚不会对其投资价值构成实质性负面影响。

5.10.2 基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库

本基金投资的前十名股票未超出基金合同规定的备选股票库。

5.10.3 其他资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	3,375.14
2	应收证券清算款	3,000,000.00
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	其他	-
8	合计	3,003,375.14

5.10.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

序号	债券代码	债券名称	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	113060	浙 22 转债	428,020.69	0.60
2	113619	世运转债	397,554.09	0.55
3	113066	平煤转债	391,241.81	0.55
4	113043	财通转债	387,012.70	0.54
5	118013	道通转债	381,724.82	0.53
6	123050	聚飞转债	380,451.20	0.53
7	113662	豪能转债	377,351.43	0.53
8	127043	川恒转债	376,625.46	0.53

9	110089	兴发转债	374,908.67	0.52
10	113065	齐鲁转债	369,160.01	0.51
11	113654	永 02 转债	349,732.73	0.49
12	113615	金诚转债	316,971.01	0.44
13	111014	李子转债	306,575.72	0.43
14	127100	神码转债	297,184.58	0.41
15	110090	爱迪转债	204,766.81	0.29
16	123219	宇瞳转债	191,514.08	0.27
17	113640	苏利转债	186,430.37	0.26
18	123180	浙矿转债	179,425.63	0.25
19	110055	伊力转债	151,410.99	0.21
20	118032	建龙转债	143,556.81	0.20
21	123194	百洋转债	17,666.08	0.02
22	123101	拓斯转债	16,323.16	0.02
23	113563	柳药转债	15,955.50	0.02
24	113033	利群转债	15,720.88	0.02
25	113659	莱克转债	15,582.81	0.02
26	113682	益丰转债	15,475.42	0.02
27	127085	韵达转债	15,355.43	0.02
28	113047	旗滨转债	14,826.50	0.02
29	113627	太平转债	14,721.90	0.02
30	113519	长久转债	8,020.45	0.01

5.10.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

无。

5.10.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入原因，分项之和与合计可能有尾差。

§6 开放式基金份额变动

单位：份

项目	大成景盛一年定期开放债券 A	大成景盛一年定期开放债券 C
报告期期初基金份额总额	61,315,070.91	641,968.18
报告期期间基金总申购份额	-	-
减：报告期期间基金总赎回份额	-	-
报告期期间基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-	-
报告期期末基金份额总额	61,315,070.91	641,968.18

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

单位：份

项目	大成景盛一年定期开放债券 A	大成景盛一年定期开放债券 C
报告期期初管理人持有的本基金份额	52,866,328.68	-
报告期期间买入/申购总份额	-	-
报告期期间卖出/赎回总份额	-	-
报告期期末管理人持有的本基金份额	52,866,328.68	-
报告期期末持有的本基金份额占基金总份额比例 (%)	85.33	-

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

无。

§8 影响投资者决策的其他重要信息

8.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

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	20240701-20240930	52,866,328.68	-	-	52,866,328.68	85.33
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。							

8.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§9 备查文件目录

9.1 备查文件目录

- 1、中国证监会批准设立大成景盛一年定期开放债券型证券投资基金的文件；
- 2、《大成景盛一年定期开放债券型证券投资基金基金合同》；
- 3、《大成景盛一年定期开放债券型证券投资基金托管协议》；

- 4、大成基金管理有限公司批准文件、营业执照、公司章程；
- 5、本报告期内在规定报刊上披露的各种公告原稿。

9.2 存放地点

备查文件存放在本基金管理人和托管人的住所。

9.3 查阅方式

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

大成基金管理有限公司

2024 年 10 月 25 日