

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  
报告送出日期：2019年7月18日

**1.1 重要提示**  
基金管理人的董事、监事、高级管理人员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。  
基金托管人的董事、监事、高级管理人员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。  
本报告期内，基金管理人和基金托管人严格按照基金合同的规定，履行了相互监督的职责。基金投资决策、基金交易行为等均符合基金合同的规定。

本基金报告期自2019年4月1日起至2019年6月30日止。

§ 1.2 基金产品概况

基金简称 大成债券 A

基金代码 00900002

基金运作方式 约定开放式

基金经理 陈晶晶

报告期起始日 2019年04月12日

报告期截止日 2019年06月12日

投资目标 在严格控制风险的前提下，追求资产的长期稳定增值。

投资策略 通过深入研究配置、类属资产配置和个券选择三个层次上不断地进行投资管理，以实现投资目标。类属资产部分按照正确的估值方法对不同类型的资产进行配置，交易组合策略，银行存款之外的其他品种将根据其未来表现、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。

业绩比较基准 中国国债指数

风险收益特征 本基金为债券型基金，较低风险的债券基金。其风险收益水平高于货币市场基金，但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 中国农业银行股份有限公司

下属分级基金的基金简称 大成债券A/B

大成债券C

下属分级基金的基金代码 00900002

00900002

下属分级基金的前一交易日份额 6,000,000,000.00

下属分级基金的下一交易日份额 6,000,000,000.00

报告期期间基金的利润 2,666,123,969.27份

763,402,630.16份

§ 3 主要财务指标和净值表现

单位：人民币元

主要财务指标 报告期(2019年04月01日 - 2019年06月30日)

大成债券A/B 大成债券C

1.本期已实现收益 -529,705.26 -2,396,290.30

2.本期利润 -29,726,609.31 -11,296,217.34

3.加权平均基金份额本期利润 -0.0103 -0.0126

4.期末基金份额净值 2,797,136,811.17 796,016,022.44

5.期末基金资产净值 1,0409 1,0406

注：1)本基金的赎回费用不包括持有人买入交易基金的各项费用，计入费用后实际收益率将低于所列数字。  
2)本期利润指报告期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用后的余额，本期利润不减去基金赎回费，即为本期已实现收益。  
3)本基金的净值增长率为扣除费用后的净值增长情况。  
4)本基金的净值增长率为扣除费用后的净值增长情况。

3.2.1 本报告期内基金的利润分配情况

本基金本报告期未进行利润分配。

3.2.2 本基金当期营业收入以及影响营业收入的各因素分析

本基金营业收入为0元。

3.2.3 本基金当期营业成本以及影响营业成本的各因素分析

本基金营业成本为0元。

3.2.4 本基金当期营业税金及附加以及影响营业税金及附加的各因素分析

本基金营业税金及附加为0元。

3.2.5 本基金当期销售费用以及影响销售费用的各因素分析

本基金销售费用为0元。

3.2.6 本基金当期管理费用以及影响管理费用的各因素分析

本基金管理费用为0元。

3.2.7 本基金当期财务费用以及影响财务费用的各因素分析

本基金财务费用为0元。

3.2.8 本基金当期投资收益以及影响投资收益的各因素分析

本基金投资收益为0元。

3.2.9 本基金当期公允价值变动损益以及影响公允价值变动损益的各因素分析

本基金公允价值变动损益为0元。

3.2.10 本基金当期投资损失以及影响投资损失的各因素分析

本基金投资损失为0元。

3.2.11 本基金当期信用减值损失以及影响信用减值损失的各因素分析

本基金信用减值损失为0元。

3.2.12 本基金当期资产减值损失以及影响资产减值损失的各因素分析

本基金资产减值损失为0元。

3.2.13 本基金当期其他业务收入以及影响其他业务收入的各因素分析

本基金其他业务收入为0元。

3.2.14 本基金当期其他业务成本以及影响其他业务成本的各因素分析

本基金其他业务成本为0元。

3.2.15 本基金当期其他业务毛利以及影响其他业务毛利的各因素分析

本基金其他业务毛利为0元。

3.2.16 本基金当期其他业务净利以及影响其他业务净利的各因素分析

本基金其他业务净利为0元。

3.2.17 本基金当期其他业务税金及附加以及影响其他业务税金及附加的各因素分析

本基金其他业务税金及附加为0元。

3.2.18 本基金当期其他业务所得税费用以及影响其他业务所得税费用的各因素分析

本基金其他业务所得税费用为0元。

3.2.19 本基金当期其他业务净利润以及影响其他业务净利润的各因素分析

本基金其他业务净利润为0元。

3.2.20 本基金当期其他业务综合收益总额以及影响其他业务综合收益总额的各因素分析

本基金其他业务综合收益总额为0元。

3.2.21 本基金当期营业收入以及影响营业收入的各因素分析

本基金营业收入为0元。

3.2.22 本基金当期营业成本以及影响营业成本的各因素分析

本基金营业成本为0元。

3.2.23 本基金当期营业税金及附加以及影响营业税金及附加的各因素分析

本基金营业税金及附加为0元。

3.2.24 本基金当期管理费用以及影响管理费用的各因素分析

本基金管理费用为0元。

3.2.25 本基金当期财务费用以及影响财务费用的各因素分析

本基金财务费用为0元。

3.2.26 本基金当期投资收益以及影响投资收益的各因素分析

本基金投资收益为0元。

3.2.27 本基金当期公允价值变动损益以及影响公允价值变动损益的各因素分析

本基金公允价值变动损益为0元。

3.2.28 本基金当期投资损失以及影响投资损失的各因素分析

本基金投资损失为0元。

3.2.29 本基金当期信用减值损失以及影响信用减值损失的各因素分析

本基金信用减值损失为0元。

3.2.30 本基金当期资产减值损失以及影响资产减值损失的各因素分析

本基金资产减值损失为0元。

3.2.31 本基金当期其他业务收入以及影响其他业务收入的各因素分析

本基金其他业务收入为0元。

3.2.32 本基金当期其他业务成本以及影响其他业务成本的各因素分析

本基金其他业务成本为0元。

3.2.33 本基金当期其他业务毛利以及影响其他业务毛利的各因素分析

本基金其他业务毛利为0元。

3.2.34 本基金当期其他业务净利润以及影响其他业务净利润的各因素分析

本基金其他业务净利润为0元。

3.2.35 本基金当期其他业务综合收益总额以及影响其他业务综合收益总额的各因素分析

本基金其他业务综合收益总额为0元。

3.2.36 本基金当期营业收入以及影响营业收入的各因素分析

本基金营业收入为0元。

3.2.37 本基金当期营业成本以及影响营业成本的各因素分析

本基金营业成本为0元。

3.2.38 本基金当期营业税金及附加以及影响营业税金及附加的各因素分析

本基金营业税金及附加为0元。

3.2.39 本基金当期管理费用以及影响管理费用的各因素分析

本基金管理费用为0元。

3.2.40 本基金当期财务费用以及影响财务费用的各因素分析

本基金财务费用为0元。

3.2.41 本基金当期投资收益以及影响投资收益的各因素分析

本基金投资收益为0元。

3.2.42 本基金当期公允价值变动损益以及影响公允价值变动损益的各因素分析

本基金公允价值变动损益为0元。

3.2.43 本基金当期投资损失以及影响投资损失的各因素分析

本基金投资损失为0元。

3.2.44 本基金当期信用减值损失以及影响信用减值损失的各因素分析

本基金信用减值损失为0元。

3.2.45 本基金当期资产减值损失以及影响资产减值损失的各因素分析

本基金资产减值损失为0元。

3.2.46 本基金当期其他业务收入以及影响其他业务收入的各因素分析

本基金其他业务收入为0元。

3.2.47 本基金当期其他业务成本以及影响其他业务成本的各因素分析

本基金其他业务成本为0元。

3.2.48 本基金当期其他业务毛利以及影响其他业务毛利的各因素分析

本基金其他业务毛利为0元。

3.2.49 本基金当期其他业务净利润以及影响其他业务净利润的各因素分析

本基金其他业务净利润为0元。

3.2.50 本基金当期其他业务综合收益总额以及影响其他业务综合收益总额的各因素分析

本基金其他业务综合收益总额为0元。

3.2.51 本基金当期营业收入以及影响营业收入的各因素分析

本基金营业收入为0元。

3.2.52 本基金当期营业成本以及影响营业成本的各因素分析

本基金营业成本为0元。

3.2.53 本基金当期营业税金及附加以及影响营业税金及附加的各因素分析

本基金营业税金及附加为0元。

3.2.54 本基金当期管理费用以及影响管理费用的各因素分析

本基金管理费用为0元。

3.2.55 本基金当期财务费用以及影响财务费用的各因素分析

本基金财务费用为0元。

3.2.56 本基金当期投资收益以及影响投资收益的各因素分析

本基金投资收益为0元。

3.2.57 本基金当期公允价值变动损益以及影响公允价值变动损益的各因素分析

本基金公允价值变动损益为0元。

3.2.58 本基金当期投资损失以及影响投资损失的各因素分析

本基金投资损失为0元。

3.2.59 本基金当期信用减值损失以及影响信用减值损失的各因素分析

本基金信用减值损失为0元。

3.2.60 本基金当期资产减值损失以及影响资产减值损失的各因素分析