

大成债券投资基金

2019年第二季度报告

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:2019年7月18日																																													
<p>1 重要提示</p> <p>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。</p> <p>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2019年7月17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。</p> <p>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,也不保证基金份额持有人的本金不受损失,或保证投资收益。投资者有风险,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。</p> <p>本报告期内无基金份额持有人诉讼。</p> <p>本报告期自2019年4月1日起至6月30日止。</p>																																													
<p>2 基金产品概况</p> <table><tr><td>基金简称</td><td>大成债券</td></tr><tr><td>基金代码</td><td>090002</td></tr><tr><td>场内简称</td><td>100002F</td></tr><tr><td>基金运作方式</td><td>契约型开放式</td></tr><tr><td>基金合同生效日</td><td>2003年12月21日</td></tr><tr><td>报告期末基金份额总额</td><td>3,419,526,569.42份</td></tr><tr><td>投资目标</td><td>在力争本金安全的前提下,通过积极主动的资产配置,力争实现基金资产的长期稳健增值。</td></tr><tr><td>投资策略</td><td>通过债券资产配置、类属资产配置和个券选择三个层次自上而下地进行投资管理,以实现投资目标。类属资产在保持期限匹配的均衡配置基础上,适当进行行业、品种、个券选择,以获取超额收益。债券资产在保持期限匹配的均衡配置基础上,适当进行行业、品种、个券选择,以获取超额收益。</td></tr><tr><td>业绩比较基准</td><td>中证综合债指数</td></tr><tr><td>风险收益特征</td><td>本基金为债券型基金,预期风险和预期收益低于股票型基金,其预期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。</td></tr><tr><td>基金管理人</td><td>大成基金管理有限公司</td></tr><tr><td>基金托管人</td><td>中国银行股份有限公司</td></tr><tr><td>下属分级基金的交易代码</td><td>大成债券A 090002C</td></tr><tr><td>下属分级基金的回款代码</td><td>090002D</td></tr><tr><td>跟踪标的下属分级基金的投资比例</td><td>2,666,123,062.07份 753,403,507.35份</td></tr></table>		基金简称	大成债券	基金代码	090002	场内简称	100002F	基金运作方式	契约型开放式	基金合同生效日	2003年12月21日	报告期末基金份额总额	3,419,526,569.42份	投资目标	在力争本金安全的前提下,通过积极主动的资产配置,力争实现基金资产的长期稳健增值。	投资策略	通过债券资产配置、类属资产配置和个券选择三个层次自上而下地进行投资管理,以实现投资目标。类属资产在保持期限匹配的均衡配置基础上,适当进行行业、品种、个券选择,以获取超额收益。债券资产在保持期限匹配的均衡配置基础上,适当进行行业、品种、个券选择,以获取超额收益。	业绩比较基准	中证综合债指数	风险收益特征	本基金为债券型基金,预期风险和预期收益低于股票型基金,其预期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	中国银行股份有限公司	下属分级基金的交易代码	大成债券A 090002C	下属分级基金的回款代码	090002D	跟踪标的下属分级基金的投资比例	2,666,123,062.07份 753,403,507.35份														
基金简称	大成债券																																												
基金代码	090002																																												
场内简称	100002F																																												
基金运作方式	契约型开放式																																												
基金合同生效日	2003年12月21日																																												
报告期末基金份额总额	3,419,526,569.42份																																												
投资目标	在力争本金安全的前提下,通过积极主动的资产配置,力争实现基金资产的长期稳健增值。																																												
投资策略	通过债券资产配置、类属资产配置和个券选择三个层次自上而下地进行投资管理,以实现投资目标。类属资产在保持期限匹配的均衡配置基础上,适当进行行业、品种、个券选择,以获取超额收益。债券资产在保持期限匹配的均衡配置基础上,适当进行行业、品种、个券选择,以获取超额收益。																																												
业绩比较基准	中证综合债指数																																												
风险收益特征	本基金为债券型基金,预期风险和预期收益低于股票型基金,其预期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	中国银行股份有限公司																																												
下属分级基金的交易代码	大成债券A 090002C																																												
下属分级基金的回款代码	090002D																																												
跟踪标的下属分级基金的投资比例	2,666,123,062.07份 753,403,507.35份																																												
<p>3 主要财务指标</p> <table><tr><td>主要财务指标</td><td>报告期末2019年4月1日至2019年6月30日</td><td>单位:人民币元</td></tr><tr><td>1.本期已实现收益</td><td>-7,129,796.26</td><td>-2,998,298.30</td></tr><tr><td>2.本期利润</td><td>-29,736,399.61</td><td>-11,236,212.34</td></tr><tr><td>3.加权平均基金份额本期利润</td><td>-0.0101</td><td>-0.0125</td></tr><tr><td>4.期末基金资产净值</td><td>2,776,136,812.17</td><td>796,016,022.44</td></tr><tr><td>5.期末基金份额净值</td><td>1.0000</td><td>1.0000</td></tr></table> <p>注:上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可能会低于所列数字。</p> <p>3.2 基金净值表现</p> <p>3.2.1 本基金净值增长率与业绩比较基准表现的比较</p> <table><tr><td>阶段</td><td>净值增长率①</td><td>净值增长率基准②</td><td>业绩比较基准收益率③</td><td>①-③</td><td>②-③</td></tr><tr><td>过去三个月</td><td>-0.89%</td><td>0.13%</td><td>0.33%</td><td>0.10%</td><td>-1.27%</td><td>0.08%</td></tr></table> <p>3.2.2 自基金合同生效以来本基金净值增长率与业绩比较基准表现的比较</p> <table><tr><td>阶段</td><td>净值增长率①</td><td>净值增长率基准②</td><td>业绩比较基准收益率③</td><td>①-③</td><td>②-③</td></tr><tr><td>过去三个月</td><td>-0.90%</td><td>0.13%</td><td>0.33%</td><td>0.10%</td><td>-1.34%</td><td>0.08%</td></tr></table>		主要财务指标	报告期末2019年4月1日至2019年6月30日	单位:人民币元	1.本期已实现收益	-7,129,796.26	-2,998,298.30	2.本期利润	-29,736,399.61	-11,236,212.34	3.加权平均基金份额本期利润	-0.0101	-0.0125	4.期末基金资产净值	2,776,136,812.17	796,016,022.44	5.期末基金份额净值	1.0000	1.0000	阶段	净值增长率①	净值增长率基准②	业绩比较基准收益率③	①-③	②-③	过去三个月	-0.89%	0.13%	0.33%	0.10%	-1.27%	0.08%	阶段	净值增长率①	净值增长率基准②	业绩比较基准收益率③	①-③	②-③	过去三个月	-0.90%	0.13%	0.33%	0.10%	-1.34%	0.08%
主要财务指标	报告期末2019年4月1日至2019年6月30日	单位:人民币元																																											
1.本期已实现收益	-7,129,796.26	-2,998,298.30																																											
2.本期利润	-29,736,399.61	-11,236,212.34																																											
3.加权平均基金份额本期利润	-0.0101	-0.0125																																											
4.期末基金资产净值	2,776,136,812.17	796,016,022.44																																											
5.期末基金份额净值	1.0000	1.0000																																											
阶段	净值增长率①	净值增长率基准②	业绩比较基准收益率③	①-③	②-③																																								
过去三个月	-0.89%	0.13%	0.33%	0.10%	-1.27%	0.08%																																							
阶段	净值增长率①	净值增长率基准②	业绩比较基准收益率③	①-③	②-③																																								
过去三个月	-0.90%	0.13%	0.33%	0.10%	-1.34%	0.08%																																							

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:2019年7月18日																																													
<p>1 重要提示</p> <p>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。</p> <p>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2019年7月17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。</p> <p>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,也不保证基金份额持有人的本金不受损失,或保证投资收益。投资者有风险,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。</p> <p>本报告期内无基金份额持有人诉讼。</p> <p>本报告期自2019年4月1日起至6月30日止。</p>																																													
<p>2 基金产品概况</p> <table><tr><td>基金简称</td><td>大成中债新综合指数(LOF)</td></tr><tr><td>基金代码</td><td>090050</td></tr><tr><td>场内简称</td><td>100050F</td></tr><tr><td>基金运作方式</td><td>契约型开放式</td></tr><tr><td>基金合同生效日</td><td>2019年3月26日</td></tr><tr><td>报告期末基金份额总额</td><td>951,453,552.08份</td></tr><tr><td>投资目标</td><td>本基金在追求基金资产长期增值的前提下,力争实现基金资产的长期稳健增值。</td></tr><tr><td>投资策略</td><td>本基金采用自上而下的资产配置策略,在保持基金资产流动性、安全性和收益性的前提下,通过积极主动的资产配置,力争实现基金资产的长期稳健增值。</td></tr><tr><td>业绩比较基准</td><td>中证综合债指数收益率×80%+人民币存款基准利率×20%</td></tr><tr><td>风险收益特征</td><td>本基金为债券型基金,预期风险和预期收益低于股票型基金,其预期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。</td></tr><tr><td>基金管理人</td><td>大成基金管理有限公司</td></tr><tr><td>基金托管人</td><td>中国银行股份有限公司</td></tr></table>		基金简称	大成中债新综合指数(LOF)	基金代码	090050	场内简称	100050F	基金运作方式	契约型开放式	基金合同生效日	2019年3月26日	报告期末基金份额总额	951,453,552.08份	投资目标	本基金在追求基金资产长期增值的前提下,力争实现基金资产的长期稳健增值。	投资策略	本基金采用自上而下的资产配置策略,在保持基金资产流动性、安全性和收益性的前提下,通过积极主动的资产配置,力争实现基金资产的长期稳健增值。	业绩比较基准	中证综合债指数收益率×80%+人民币存款基准利率×20%	风险收益特征	本基金为债券型基金,预期风险和预期收益低于股票型基金,其预期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	中国银行股份有限公司																				
基金简称	大成中债新综合指数(LOF)																																												
基金代码	090050																																												
场内简称	100050F																																												
基金运作方式	契约型开放式																																												
基金合同生效日	2019年3月26日																																												
报告期末基金份额总额	951,453,552.08份																																												
投资目标	本基金在追求基金资产长期增值的前提下,力争实现基金资产的长期稳健增值。																																												
投资策略	本基金采用自上而下的资产配置策略,在保持基金资产流动性、安全性和收益性的前提下,通过积极主动的资产配置,力争实现基金资产的长期稳健增值。																																												
业绩比较基准	中证综合债指数收益率×80%+人民币存款基准利率×20%																																												
风险收益特征	本基金为债券型基金,预期风险和预期收益低于股票型基金,其预期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	中国银行股份有限公司																																												
<p>3 主要财务指标</p> <table><tr><td>主要财务指标</td><td>报告期末2019年4月1日至2019年6月30日</td><td>单位:人民币元</td></tr><tr><td>1.本期已实现收益</td><td>6,294,417.15</td><td></td></tr><tr><td>2.本期利润</td><td>-15,877,966.44</td><td></td></tr><tr><td>3.加权平均基金份额本期利润</td><td>-0.0157</td><td></td></tr><tr><td>4.期末基金资产净值</td><td>895,690,247.56</td><td></td></tr><tr><td>5.期末基金份额净值</td><td>0.9607</td><td></td></tr></table> <p>注:上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可能会低于所列数字。</p> <p>3.2 基金净值表现</p> <p>3.2.1 本基金净值增长率与业绩比较基准表现的比较</p> <table><tr><td>阶段</td><td>净值增长率①</td><td>净值增长率基准②</td><td>业绩比较基准收益率③</td><td>①-③</td><td>②-③</td></tr><tr><td>过去三个月</td><td>-1.39%</td><td>0.08%</td><td>0.19%</td><td>1.02%</td><td>-1.68%</td><td>-0.14%</td></tr></table> <p>3.2.2 自基金合同生效以来本基金净值增长率与业绩比较基准表现的比较</p> <table><tr><td>阶段</td><td>净值增长率①</td><td>净值增长率基准②</td><td>业绩比较基准收益率③</td><td>①-③</td><td>②-③</td></tr><tr><td>过去三个月</td><td>-1.39%</td><td>0.08%</td><td>0.19%</td><td>1.02%</td><td>-1.68%</td><td>-0.14%</td></tr></table>		主要财务指标	报告期末2019年4月1日至2019年6月30日	单位:人民币元	1.本期已实现收益	6,294,417.15		2.本期利润	-15,877,966.44		3.加权平均基金份额本期利润	-0.0157		4.期末基金资产净值	895,690,247.56		5.期末基金份额净值	0.9607		阶段	净值增长率①	净值增长率基准②	业绩比较基准收益率③	①-③	②-③	过去三个月	-1.39%	0.08%	0.19%	1.02%	-1.68%	-0.14%	阶段	净值增长率①	净值增长率基准②	业绩比较基准收益率③	①-③	②-③	过去三个月	-1.39%	0.08%	0.19%	1.02%	-1.68%	-0.14%
主要财务指标	报告期末2019年4月1日至2019年6月30日	单位:人民币元																																											
1.本期已实现收益	6,294,417.15																																												
2.本期利润	-15,877,966.44																																												
3.加权平均基金份额本期利润	-0.0157																																												
4.期末基金资产净值	895,690,247.56																																												
5.期末基金份额净值	0.9607																																												
阶段	净值增长率①	净值增长率基准②	业绩比较基准收益率③	①-③	②-③																																								
过去三个月	-1.39%	0.08%	0.19%	1.02%	-1.68%	-0.14%																																							
阶段	净值增长率①	净值增长率基准②	业绩比较基准收益率③	①-③	②-③																																								
过去三个月	-1.39%	0.08%	0.19%	1.02%	-1.68%	-0.14%																																							

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:2019年7月18日																																													
<p>1 重要提示</p> <p>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。</p> <p>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2019年7月17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。</p> <p>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,也不保证基金份额持有人的本金不受损失,或保证投资收益。投资者有风险,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。</p> <p>本报告期内无基金份额持有人诉讼。</p> <p>本报告期自2019年4月1日起至6月30日止。</p>																																													
<p>2 基金产品概况</p> <table><tr><td>基金简称</td><td>大成中债新综合指数(LOF)</td></tr><tr><td>基金代码</td><td>090050</td></tr><tr><td>场内简称</td><td>100050F</td></tr><tr><td>基金运作方式</td><td>契约型开放式</td></tr><tr><td>基金合同生效日</td><td>2019年3月26日</td></tr><tr><td>报告期末基金份额总额</td><td>951,453,552.08份</td></tr><tr><td>投资目标</td><td>本基金在追求基金资产长期增值的前提下,力争实现基金资产的长期稳健增值。</td></tr><tr><td>投资策略</td><td>本基金采用自上而下的资产配置策略,在保持基金资产流动性、安全性和收益性的前提下,通过积极主动的资产配置,力争实现基金资产的长期稳健增值。</td></tr><tr><td>业绩比较基准</td><td>中证综合债指数收益率×80%+人民币存款基准利率×20%</td></tr><tr><td>风险收益特征</td><td>本基金为债券型基金,预期风险和预期收益低于股票型基金,其预期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。</td></tr><tr><td>基金管理人</td><td>大成基金管理有限公司</td></tr><tr><td>基金托管人</td><td>中国银行股份有限公司</td></tr></table>		基金简称	大成中债新综合指数(LOF)	基金代码	090050	场内简称	100050F	基金运作方式	契约型开放式	基金合同生效日	2019年3月26日	报告期末基金份额总额	951,453,552.08份	投资目标	本基金在追求基金资产长期增值的前提下,力争实现基金资产的长期稳健增值。	投资策略	本基金采用自上而下的资产配置策略,在保持基金资产流动性、安全性和收益性的前提下,通过积极主动的资产配置,力争实现基金资产的长期稳健增值。	业绩比较基准	中证综合债指数收益率×80%+人民币存款基准利率×20%	风险收益特征	本基金为债券型基金,预期风险和预期收益低于股票型基金,其预期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	中国银行股份有限公司																				
基金简称	大成中债新综合指数(LOF)																																												
基金代码	090050																																												
场内简称	100050F																																												
基金运作方式	契约型开放式																																												
基金合同生效日	2019年3月26日																																												
报告期末基金份额总额	951,453,552.08份																																												
投资目标	本基金在追求基金资产长期增值的前提下,力争实现基金资产的长期稳健增值。																																												
投资策略	本基金采用自上而下的资产配置策略,在保持基金资产流动性、安全性和收益性的前提下,通过积极主动的资产配置,力争实现基金资产的长期稳健增值。																																												
业绩比较基准	中证综合债指数收益率×80%+人民币存款基准利率×20%																																												
风险收益特征	本基金为债券型基金,预期风险和预期收益低于股票型基金,其预期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	中国银行股份有限公司																																												
<p>3 主要财务指标</p> <table><tr><td>主要财务指标</td><td>报告期末2019年4月1日至2019年6月30日</td><td>单位:人民币元</td></tr><tr><td>1.本期已实现收益</td><td>6,294,417.15</td><td></td></tr><tr><td>2.本期利润</td><td>-15,877,966.44</td><td></td></tr><tr><td>3.加权平均基金份额本期利润</td><td>-0.0157</td><td></td></tr><tr><td>4.期末基金资产净值</td><td>895,690,247.56</td><td></td></tr><tr><td>5.期末基金份额净值</td><td>0.9607</td><td></td></tr></table> <p>注:上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可能会低于所列数字。</p> <p>3.2 基金净值表现</p> <p>3.2.1 本基金净值增长率与业绩比较基准表现的比较</p> <table><tr><td>阶段</td><td>净值增长率①</td><td>净值增长率基准②</td><td>业绩比较基准收益率③</td><td>①-③</td><td>②-③</td></tr><tr><td>过去三个月</td><td>-1.39%</td><td>0.08%</td><td>0.19%</td><td>1.02%</td><td>-1.68%</td><td>-0.14%</td></tr></table> <p>3.2.2 自基金合同生效以来本基金净值增长率与业绩比较基准表现的比较</p> <table><tr><td>阶段</td><td>净值增长率①</td><td>净值增长率基准②</td><td>业绩比较基准收益率③</td><td>①-③</td><td>②-③</td></tr><tr><td>过去三个月</td><td>-1.39%</td><td>0.08%</td><td>0.19%</td><td>1.02%</td><td>-1.68%</td><td>-0.14%</td></tr></table>		主要财务指标	报告期末2019年4月1日至2019年6月30日	单位:人民币元	1.本期已实现收益	6,294,417.15		2.本期利润	-15,877,966.44		3.加权平均基金份额本期利润	-0.0157		4.期末基金资产净值	895,690,247.56		5.期末基金份额净值	0.9607		阶段	净值增长率①	净值增长率基准②	业绩比较基准收益率③	①-③	②-③	过去三个月	-1.39%	0.08%	0.19%	1.02%	-1.68%	-0.14%	阶段	净值增长率①	净值增长率基准②	业绩比较基准收益率③	①-③	②-③	过去三个月	-1.39%	0.08%	0.19%	1.02%	-1.68%	-0.14%
主要财务指标	报告期末2019年4月1日至2019年6月30日	单位:人民币元																																											
1.本期已实现收益	6,294,417.15																																												
2.本期利润	-15,877,966.44																																												
3.加权平均基金份额本期利润	-0.0157																																												
4.期末基金资产净值	895,690,247.56																																												
5.期末基金份额净值	0.9607																																												
阶段	净值增长率①	净值增长率基准②	业绩比较基准收益率③	①-③	②-③																																								
过去三个月	-1.39%	0.08%	0.19%	1.02%	-1.68%	-0.14%																																							
阶段	净值增长率①	净值增长率基准②	业绩比较基准收益率③	①-③	②-③																																								
过去三个月	-1.39%	0.08%	0.19%	1.02%	-1.68%	-0.14%																																							

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:2019年7月18日																																													
<p>1 重要提示</p> <p>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。</p> <p>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2019年7月17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。</p> <p>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,也不保证基金份额持有人的本金不受损失,或保证投资收益。投资者有风险,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。</p> <p>本报告期内无基金份额持有人诉讼。</p> <p>本报告期自2019年4月1日起至6月30日止。</p>																																													
<p>2 基金产品概况</p> <table><tr><td>基金简称</td><td>大成中债新综合指数(LOF)</td></tr><tr><td>基金代码</td><td>090050</td></tr><tr><td>场内简称</td><td>100050F</td></tr><tr><td>基金运作方式</td><td>契约型开放式</td></tr><tr><td>基金合同生效日</td><td>2019年3月26日</td></tr><tr><td>报告期末基金份额总额</td><td>951,453,552.08份</td></tr><tr><td>投资目标</td><td>本基金在追求基金资产长期增值的前提下,力争实现基金资产的长期稳健增值。</td></tr><tr><td>投资策略</td><td>本基金采用自上而下的资产配置策略,在保持基金资产流动性、安全性和收益性的前提下,通过积极主动的资产配置,力争实现基金资产的长期稳健增值。</td></tr><tr><td>业绩比较基准</td><td>中证综合债指数收益率×80%+人民币存款基准利率×20%</td></tr><tr><td>风险收益特征</td><td>本基金为债券型基金,预期风险和预期收益低于股票型基金,其预期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。</td></tr><tr><td>基金管理人</td><td>大成基金管理有限公司</td></tr><tr><td>基金托管人</td><td>中国银行股份有限公司</td></tr></table>		基金简称	大成中债新综合指数(LOF)	基金代码	090050	场内简称	100050F	基金运作方式	契约型开放式	基金合同生效日	2019年3月26日	报告期末基金份额总额	951,453,552.08份	投资目标	本基金在追求基金资产长期增值的前提下,力争实现基金资产的长期稳健增值。	投资策略	本基金采用自上而下的资产配置策略,在保持基金资产流动性、安全性和收益性的前提下,通过积极主动的资产配置,力争实现基金资产的长期稳健增值。	业绩比较基准	中证综合债指数收益率×80%+人民币存款基准利率×20%	风险收益特征	本基金为债券型基金,预期风险和预期收益低于股票型基金,其预期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	中国银行股份有限公司																				
基金简称	大成中债新综合指数(LOF)																																												
基金代码	090050																																												
场内简称	100050F																																												
基金运作方式	契约型开放式																																												
基金合同生效日	2019年3月26日																																												
报告期末基金份额总额	951,453,552.08份																																												
投资目标	本基金在追求基金资产长期增值的前提下,力争实现基金资产的长期稳健增值。																																												
投资策略	本基金采用自上而下的资产配置策略,在保持基金资产流动性、安全性和收益性的前提下,通过积极主动的资产配置,力争实现基金资产的长期稳健增值。																																												
业绩比较基准	中证综合债指数收益率×80%+人民币存款基准利率×20%																																												
风险收益特征	本基金为债券型基金,预期风险和预期收益低于股票型基金,其预期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	中国银行股份有限公司																																												
<p>3 主要财务指标</p> <table><tr><td>主要财务指标</td><td>报告期末2019年4月1日至2019年6月30日</td><td>单位:人民币元</td></tr><tr><td>1.本期已实现收益</td><td>6,294,417.15</td><td></td></tr><tr><td>2.本期利润</td><td>-15,877,966.44</td><td></td></tr><tr><td>3.加权平均基金份额本期利润</td><td>-0.0157</td><td></td></tr><tr><td>4.期末基金资产净值</td><td>895,690,247.56</td><td></td></tr><tr><td>5.期末基金份额净值</td><td>0.9607</td><td></td></tr></table> <p>注:上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可能会低于所列数字。</p> <p>3.2 基金净值表现</p> <p>3.2.1 本基金净值增长率与业绩比较基准表现的比较</p> <table><tr><td>阶段</td><td>净值增长率①</td><td>净值增长率基准②</td><td>业绩比较基准收益率③</td><td>①-③</td><td>②-③</td></tr><tr><td>过去三个月</td><td>-1.39%</td><td>0.08%</td><td>0.19%</td><td>1.02%</td><td>-1.68%</td><td>-0.14%</td></tr></table> <p>3.2.2 自基金合同生效以来本基金净值增长率与业绩比较基准表现的比较</p> <table><tr><td>阶段</td><td>净值增长率①</td><td>净值增长率基准②</td><td>业绩比较基准收益率③</td><td>①-③</td><td>②-③</td></tr><tr><td>过去三个月</td><td>-1.39%</td><td>0.08%</td><td>0.19%</td><td>1.02%</td><td>-1.68%</td><td>-0.14%</td></tr></table>		主要财务指标	报告期末2019年4月1日至2019年6月30日	单位:人民币元	1.本期已实现收益	6,294,417.15		2.本期利润	-15,877,966.44		3.加权平均基金份额本期利润	-0.0157		4.期末基金资产净值	895,690,247.56		5.期末基金份额净值	0.9607		阶段	净值增长率①	净值增长率基准②	业绩比较基准收益率③	①-③	②-③	过去三个月	-1.39%	0.08%	0.19%	1.02%	-1.68%	-0.14%	阶段	净值增长率①	净值增长率基准②	业绩比较基准收益率③	①-③	②-③	过去三个月	-1.39%	0.08%	0.19%	1.02%	-1.68%	-0.14%
主要财务指标	报告期末2019年4月1日至2019年6月30日	单位:人民币元																																											
1.本期已实现收益	6,294,417.15																																												
2.本期利润	-15,877,966.44																																												
3.加权平均基金份额本期利润	-0.0157																																												
4.期末基金资产净值	895,690,247.56																																												
5.期末基金份额净值	0.9607																																												
阶段	净值增长率①	净值增长率基准②	业绩比较基准收益率③	①-③	②-③																																								
过去三个月	-1.39%	0.08%	0.19%	1.02%	-1.68%	-0.14%																																							
阶段	净值增长率①	净值增长率基准②	业绩比较基准收益率③	①-③	②-③																																								
过去三个月	-1.39%	0.08%	0.19%	1.02%	-1.68%	-0.14%																																							

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:2019年7月18日																																													
<p>1 重要提示</p> <p>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。</p> <p>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2019年7月17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。</p> <p>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,也不保证基金份额持有人的本金不受损失,或保证投资收益。投资者有风险,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。</p> <p>本报告期内无基金份额持有人诉讼。</p> <p>本报告期自2019年4月1日起至6月30日止。</p>																																													
<p>2 基金产品概况</p> <table><tr><td>基金简称</td><td>大成中债新综合指数(LOF)</td></tr><tr><td>基金代码</td><td>090050</td></tr><tr><td>场内简称</td><td>100050F</td></tr><tr><td>基金运作方式</td><td>契约型开放式</td></tr><tr><td>基金合同生效日</td><td>2019年3月26日</td></tr><tr><td>报告期末基金份额总额</td><td>951,453,552.08份</td></tr><tr><td>投资目标</td><td>本基金在追求基金资产长期增值的前提下,力争实现基金资产的长期稳健增值。</td></tr><tr><td>投资策略</td><td>本基金采用自上而下的资产配置策略,在保持基金资产流动性、安全性和收益性的前提下,通过积极主动的资产配置,力争实现基金资产的长期稳健增值。</td></tr><tr><td>业绩比较基准</td><td>中证综合债指数收益率×80%+人民币存款基准利率×20%</td></tr><tr><td>风险收益特征</td><td>本基金为债券型基金,预期风险和预期收益低于股票型基金,其预期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。</td></tr><tr><td>基金管理人</td><td>大成基金管理有限公司</td></tr><tr><td>基金托管人</td><td>中国银行股份有限公司</td></tr></table>		基金简称	大成中债新综合指数(LOF)	基金代码	090050	场内简称	100050F	基金运作方式	契约型开放式	基金合同生效日	2019年3月26日	报告期末基金份额总额	951,453,552.08份	投资目标	本基金在追求基金资产长期增值的前提下,力争实现基金资产的长期稳健增值。	投资策略	本基金采用自上而下的资产配置策略,在保持基金资产流动性、安全性和收益性的前提下,通过积极主动的资产配置,力争实现基金资产的长期稳健增值。	业绩比较基准	中证综合债指数收益率×80%+人民币存款基准利率×20%	风险收益特征	本基金为债券型基金,预期风险和预期收益低于股票型基金,其预期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	中国银行股份有限公司																				
基金简称	大成中债新综合指数(LOF)																																												
基金代码	090050																																												
场内简称	100050F																																												
基金运作方式	契约型开放式																																												
基金合同生效日	2019年3月26日																																												
报告期末基金份额总额	951,453,552.08份																																												
投资目标	本基金在追求基金资产长期增值的前提下,力争实现基金资产的长期稳健增值。																																												
投资策略	本基金采用自上而下的资产配置策略,在保持基金资产流动性、安全性和收益性的前提下,通过积极主动的资产配置,力争实现基金资产的长期稳健增值。																																												
业绩比较基准	中证综合债指数收益率×80%+人民币存款基准利率×20%																																												
风险收益特征	本基金为债券型基金,预期风险和预期收益低于股票型基金,其预期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	中国银行股份有限公司																																												
<p>3 主要财务指标</p> <table><tr><td>主要财务指标</td><td>报告期末2019年4月1日至2019年6月30日</td><td>单位:人民币元</td></tr><tr><td>1.本期已实现收益</td><td>6,294,417.15</td><td></td></tr><tr><td>2.本期利润</td><td>-15,877,966.44</td><td></td></tr><tr><td>3.加权平均基金份额本期利润</td><td>-0.0157</td><td></td></tr><tr><td>4.期末基金资产净值</td><td>895,690,247.56</td><td></td></tr><tr><td>5.期末基金份额净值</td><td>0.9607</td><td></td></tr></table> <p>注:上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可能会低于所列数字。</p> <p>3.2 基金净值表现</p> <p>3.2.1 本基金净值增长率与业绩比较基准表现的比较</p> <table><tr><td>阶段</td><td>净值增长率①</td><td>净值增长率基准②</td><td>业绩比较基准收益率③</td><td>①-③</td><td>②-③</td></tr><tr><td>过去三个月</td><td>-1.39%</td><td>0.08%</td><td>0.19%</td><td>1.02%</td><td>-1.68%</td><td>-0.14%</td></tr></table> <p>3.2.2 自基金合同生效以来本基金净值增长率与业绩比较基准表现的比较</p> <table><tr><td>阶段</td><td>净值增长率①</td><td>净值增长率基准②</td><td>业绩比较基准收益率③</td><td>①-③</td><td>②-③</td></tr><tr><td>过去三个月</td><td>-1.39%</td><td>0.08%</td><td>0.19%</td><td>1.02%</td><td>-1.68%</td><td>-0.14%</td></tr></table>		主要财务指标	报告期末2019年4月1日至2019年6月30日	单位:人民币元	1.本期已实现收益	6,294,417.15		2.本期利润	-15,877,966.44		3.加权平均基金份额本期利润	-0.0157		4.期末基金资产净值	895,690,247.56		5.期末基金份额净值	0.9607		阶段	净值增长率①	净值增长率基准②	业绩比较基准收益率③	①-③	②-③	过去三个月	-1.39%	0.08%	0.19%	1.02%	-1.68%	-0.14%	阶段	净值增长率①	净值增长率基准②	业绩比较基准收益率③	①-③	②-③	过去三个月	-1.39%	0.08%	0.19%	1.02%	-1.68%	-0.14%
主要财务指标	报告期末2019年4月1日至2019年6月30日	单位:人民币元																																											
1.本期已实现收益	6,294,417.15																																												
2.本期利润	-15,877,966.44																																												
3.加权平均基金份额本期利润	-0.0157																																												
4.期末基金资产净值	895,690,247.56																																												
5.期末基金份额净值	0.9607																																												
阶段	净值增长率①	净值增长率基准②	业绩比较基准收益率③	①-③	②-③																																								
过去三个月	-1.39%	0.08%	0.19%	1.02%	-1.68%	-0.14%																																							
阶段	净值增长率①	净值增长率基准②	业绩比较基准收益率③	①-③	②-③																																								
过去三个月	-1.39%	0.08%	0.19%	1.02%	-1.68%	-0.14%																																							

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:2019年7月18日																																													
<p>1 重要提示</p> <p>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。</p> <p>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2019年7月17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。</p> <p>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,也不保证基金份额持有人的本金不受损失,或保证投资收益。投资者有风险,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。</p> <p>本报告期内无基金份额持有人诉讼。</p> <p>本报告期自2019年4月1日起至6月30日止。</p>																																													
<p>2 基金产品概况</p> <table><tr><td>基金简称</td><td>大成中债新综合指数(LOF)</td></tr><tr><td>基金代码</td><td>090050</td></tr><tr><td>场内简称</td><td>100050F</td></tr><tr><td>基金运作方式</td><td>契约型开放式</td></tr><tr><td>基金合同生效日</td><td>2019年3月26日</td></tr><tr><td>报告期末基金份额总额</td><td>951,453,552.08份</td></tr><tr><td>投资目标</td><td>本基金在追求基金资产长期增值的前提下,力争实现基金资产的长期稳健增值。</td></tr><tr><td>投资策略</td><td>本基金采用自上而下的资产配置策略,在保持基金资产流动性、安全性和收益性的前提下,通过积极主动的资产配置,力争实现基金资产的长期稳健增值。</td></tr><tr><td>业绩比较基准</td><td>中证综合债指数收益率×80%+人民币存款基准利率×20%</td></tr><tr><td>风险收益特征</td><td>本基金为债券型基金,预期风险和预期收益低于股票型基金,其预期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。</td></tr><tr><td>基金管理人</td><td>大成基金管理有限公司</td></tr><tr><td>基金托管人</td><td>中国银行股份有限公司</td></tr></table>		基金简称	大成中债新综合指数(LOF)	基金代码	090050	场内简称	100050F	基金运作方式	契约型开放式	基金合同生效日	2019年3月26日	报告期末基金份额总额	951,453,552.08份	投资目标	本基金在追求基金资产长期增值的前提下,力争实现基金资产的长期稳健增值。	投资策略	本基金采用自上而下的资产配置策略,在保持基金资产流动性、安全性和收益性的前提下,通过积极主动的资产配置,力争实现基金资产的长期稳健增值。	业绩比较基准	中证综合债指数收益率×80%+人民币存款基准利率×20%	风险收益特征	本基金为债券型基金,预期风险和预期收益低于股票型基金,其预期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	中国银行股份有限公司																				
基金简称	大成中债新综合指数(LOF)																																												
基金代码	090050																																												
场内简称	100050F																																												
基金运作方式	契约型开放式																																												
基金合同生效日	2019年3月26日																																												
报告期末基金份额总额	951,453,552.08份																																												
投资目标	本基金在追求基金资产长期增值的前提下,力争实现基金资产的长期稳健增值。																																												
投资策略	本基金采用自上而下的资产配置策略,在保持基金资产流动性、安全性和收益性的前提下,通过积极主动的资产配置,力争实现基金资产的长期稳健增值。																																												
业绩比较基准	中证综合债指数收益率×80%+人民币存款基准利率×20%																																												
风险收益特征	本基金为债券型基金,预期风险和预期收益低于股票型基金,其预期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	中国银行股份有限公司																																												
<p>3 主要财务指标</p> <table><tr><td>主要财务指标</td><td>报告期末2019年4月1日至2019年6月30日</td><td>单位:人民币元</td></tr><tr><td>1.本期已实现收益</td><td>6,294,417.15</td><td></td></tr><tr><td>2.本期利润</td><td>-15,877,966.44</td><td></td></tr><tr><td>3.加权平均基金份额本期利润</td><td>-0.0157</td><td></td></tr><tr><td>4.期末基金资产净值</td><td>895,690,247.56</td><td></td></tr><tr><td>5.期末基金份额净值</td><td>0.9607</td><td></td></tr></table> <p>注:上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可能会低于所列数字。</p> <p>3.2 基金净值表现</p> <p>3.2.1 本基金净值增长率与业绩比较基准表现的比较</p> <table><tr><td>阶段</td><td>净值增长率①</td><td>净值增长率基准②</td><td>业绩比较基准收益率③</td><td>①-③</td><td>②-③</td></tr><tr><td>过去三个月</td><td>-1.39%</td><td>0.08%</td><td>0.19%</td><td>1.02%</td><td>-1.68%</td><td>-0.14%</td></tr></table> <p>3.2.2 自基金合同生效以来本基金净值增长率与业绩比较基准表现的比较</p> <table><tr><td>阶段</td><td>净值增长率①</td><td>净值增长率基准②</td><td>业绩比较基准收益率③</td><td>①-③</td><td>②-③</td></tr><tr><td>过去三个月</td><td>-1.39%</td><td>0.08%</td><td>0.19%</td><td>1.02%</td><td>-1.68%</td><td>-0.14%</td></tr></table>		主要财务指标	报告期末2019年4月1日至2019年6月30日	单位:人民币元	1.本期已实现收益	6,294,417.15		2.本期利润	-15,877,966.44		3.加权平均基金份额本期利润	-0.0157		4.期末基金资产净值	895,690,247.56		5.期末基金份额净值	0.9607		阶段	净值增长率①	净值增长率基准②	业绩比较基准收益率③	①-③	②-③	过去三个月	-1.39%	0.08%	0.19%	1.02%	-1.68%	-0.14%	阶段	净值增长率①	净值增长率基准②	业绩比较基准收益率③	①-③	②-③	过去三个月	-1.39%	0.08%	0.19%	1.02%	-1.68%	-0.14%
主要财务指标	报告期末2019年4月1日至2019年6月30日	单位:人民币元																																											
1.本期已实现收益	6,294,417.15																																												
2.本期利润	-15,877,966.44																																												
3.加权平均基金份额本期利润	-0.0157																																												
4.期末基金资产净值	895,690,247.56																																												
5.期末基金份额净值	0.9607																																												
阶段	净值增长率①	净值增长率基准②	业绩比较基准收益率③	①-③	②-③																																								
过去三个月	-1.39%	0.08%	0.19%	1.02%	-1.68%	-0.14%																																							
阶段	净值增长率①	净值增长率基准②	业绩比较基准收益率③	①-③	②-③																																								
过去三个月	-1.39%	0.08%	0.19%	1.02%	-1.68%	-0.14%																																							

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:2019年7月18日																																													
<p>1 重要提示</p> <p>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。</p> <p>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2019年7月17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。</p> <p>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,也不保证基金份额持有人的本金不受损失,或保证投资收益。投资者有风险,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。</p> <p>本报告期内无基金份额持有人诉讼。</p> <p>本报告期自2019年4月1日起至6月30日止。</p>																																													
<p>2 基金产品概况</p> <table><tr><td>基金简称</td><td>大成中债新综合指数(LOF)</td></tr><tr><td>基金代码</td><td>090050</td></tr><tr><td>场内简称</td><td>100050F</td></tr><tr><td>基金运作方式</td><td>契约型开放式</td></tr><tr><td>基金合同生效日</td><td>2019年3月26日</td></tr><tr><td>报告期末基金份额总额</td><td>951,453,552.08份</td></tr><tr><td>投资目标</td><td>本基金在追求基金资产长期增值的前提下,力争实现基金资产的长期稳健增值。</td></tr><tr><td>投资策略</td><td>本基金采用自上而下的资产配置策略,在保持基金资产流动性、安全性和收益性的前提下,通过积极主动的资产配置,力争实现基金资产的长期稳健增值。</td></tr><tr><td>业绩比较基准</td><td>中证综合债指数收益率×80%+人民币存款基准利率×20%</td></tr><tr><td>风险收益特征</td><td>本基金为债券型基金,预期风险和预期收益低于股票型基金,其预期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。</td></tr><tr><td>基金管理人</td><td>大成基金管理有限公司</td></tr><tr><td>基金托管人</td><td>中国银行股份有限公司</td></tr></table>		基金简称	大成中债新综合指数(LOF)	基金代码	090050	场内简称	100050F	基金运作方式	契约型开放式	基金合同生效日	2019年3月26日	报告期末基金份额总额	951,453,552.08份	投资目标	本基金在追求基金资产长期增值的前提下,力争实现基金资产的长期稳健增值。	投资策略	本基金采用自上而下的资产配置策略,在保持基金资产流动性、安全性和收益性的前提下,通过积极主动的资产配置,力争实现基金资产的长期稳健增值。	业绩比较基准	中证综合债指数收益率×80%+人民币存款基准利率×20%	风险收益特征	本基金为债券型基金,预期风险和预期收益低于股票型基金,其预期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	中国银行股份有限公司																				
基金简称	大成中债新综合指数(LOF)																																												
基金代码	090050																																												
场内简称	100050F																																												
基金运作方式	契约型开放式																																												
基金合同生效日	2019年3月26日																																												
报告期末基金份额总额	951,453,552.08份																																												
投资目标	本基金在追求基金资产长期增值的前提下,力争实现基金资产的长期稳健增值。																																												
投资策略	本基金采用自上而下的资产配置策略,在保持基金资产流动性、安全性和收益性的前提下,通过积极主动的资产配置,力争实现基金资产的长期稳健增值。																																												
业绩比较基准	中证综合债指数收益率×80%+人民币存款基准利率×20%																																												
风险收益特征	本基金为债券型基金,预期风险和预期收益低于股票型基金,其预期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	中国银行股份有限公司																																												
<p>3 主要财务指标</p> <table><tr><td>主要财务指标</td><td>报告期末2019年4月1日至2019年6月30日</td><td>单位:人民币元</td></tr><tr><td>1.本期已实现收益</td><td>6,294,417.15</td><td></td></tr><tr><td>2.本期利润</td><td>-15,877,966.44</td><td></td></tr><tr><td>3.加权平均基金份额本期利润</td><td>-0.0157</td><td></td></tr><tr><td>4.期末基金资产净值</td><td>895,690,247.56</td><td></td></tr><tr><td>5.期末基金份额净值</td><td>0.9607</td><td></td></tr></table> <p>注:上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可能会低于所列数字。</p> <p>3.2 基金净值表现</p> <p>3.2.1 本基金净值增长率与业绩比较基准表现的比较</p> <table><tr><td>阶段</td><td>净值增长率①</td><td>净值增长率基准②</td><td>业绩比较基准收益率③</td><td>①-③</td><td>②-③</td></tr><tr><td>过去三个月</td><td>-1.39%</td><td>0.08%</td><td>0.19%</td><td>1.02%</td><td>-1.68%</td><td>-0.14%</td></tr></table> <p>3.2.2 自基金合同生效以来本基金净值增长率与业绩比较基准表现的比较</p> <table><tr><td>阶段</td><td>净值增长率①</td><td>净值增长率基准②</td><td>业绩比较基准收益率③</td><td>①-③</td><td>②-③</td></tr><tr><td>过去三个月</td><td>-1.39%</td><td>0.08%</td><td>0.19%</td><td>1.02%</td><td>-1.68%</td><td>-0.14%</td></tr></table>		主要财务指标	报告期末2019年4月1日至2019年6月30日	单位:人民币元	1.本期已实现收益	6,294,417.15		2.本期利润	-15,877,966.44		3.加权平均基金份额本期利润	-0.0157		4.期末基金资产净值	895,690,247.56		5.期末基金份额净值	0.9607		阶段	净值增长率①	净值增长率基准②	业绩比较基准收益率③	①-③	②-③	过去三个月	-1.39%	0.08%	0.19%	1.02%	-1.68%	-0.14%	阶段	净值增长率①	净值增长率基准②	业绩比较基准收益率③	①-③	②-③	过去三个月	-1.39%	0.08%	0.19%	1.02%	-1.68%	-0.14%
主要财务指标	报告期末2019年4月1日至2019年6月30日	单位:人民币元																																											
1.本期已实现收益	6,294,417.15																																												
2.本期利润	-15,877,966.44																																												
3.加权平均基金份额本期利润	-0.0157																																												
4.期末基金资产净值	895,690,247.56																																												
5.期末基金份额净值	0.9607																																												
阶段	净值增长率①	净值增长率基准②	业绩比较基准收益率③	①-③	②-③																																								
过去三个月	-1.39%	0.08%	0.19%	1.02%	-1.68%	-0.14%																																							
阶段	净值增长率①	净值增长率基准②	业绩比较基准收益率③	①-③	②-③																																								
过去三个月	-1.39%	0.08%	0.19%	1.02%	-1.68%	-0.14%																																							

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:2019年7月18日																																													
<p>1 重要提示</p> <p>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。</p> <p>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2019年7月17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。</p> <p>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,也不保证基金份额持有人的本金不受损失,或保证投资收益。投资者有风险,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。</p> <p>本报告期内无基金份额持有人诉讼。</p> <p>本报告期自2019年4月1日起至6月30日止。</p>																																													
<p>2 基金产品概况</p> <table><tr><td>基金简称</td><td>大成中债新综合指数(LOF)</td></tr><tr><td>基金代码</td><td>090050</td></tr><tr><td>场内简称</td><td>100050F</td></tr><tr><td>基金运作方式</td><td>契约型开放式</td></tr><tr><td>基金合同生效日</td><td>2019年3月26日</td></tr><tr><td>报告期末基金份额总额</td><td>951,453,552.08份</td></tr><tr><td>投资目标</td><td>本基金在追求基金资产长期增值的前提下,力争实现基金资产的长期稳健增值。</td></tr><tr><td>投资策略</td><td>本基金采用自上而下的资产配置策略,在保持基金资产流动性、安全性和收益性的前提下,通过积极主动的资产配置,力争实现基金资产的长期稳健增值。</td></tr><tr><td>业绩比较基准</td><td>中证综合债指数收益率×80%+人民币存款基准利率×20%</td></tr><tr><td>风险收益特征</td><td>本基金为债券型基金,预期风险和预期收益低于股票型基金,其预期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。</td></tr><tr><td>基金管理人</td><td>大成基金管理有限公司</td></tr><tr><td>基金托管人</td><td>中国银行股份有限公司</td></tr></table>		基金简称	大成中债新综合指数(LOF)	基金代码	090050	场内简称	100050F	基金运作方式	契约型开放式	基金合同生效日	2019年3月26日	报告期末基金份额总额	951,453,552.08份	投资目标	本基金在追求基金资产长期增值的前提下,力争实现基金资产的长期稳健增值。	投资策略	本基金采用自上而下的资产配置策略,在保持基金资产流动性、安全性和收益性的前提下,通过积极主动的资产配置,力争实现基金资产的长期稳健增值。	业绩比较基准	中证综合债指数收益率×80%+人民币存款基准利率×20%	风险收益特征	本基金为债券型基金,预期风险和预期收益低于股票型基金,其预期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	中国银行股份有限公司																				
基金简称	大成中债新综合指数(LOF)																																												
基金代码	090050																																												
场内简称	100050F																																												
基金运作方式	契约型开放式																																												
基金合同生效日	2019年3月26日																																												
报告期末基金份额总额	951,453,552.08份																																												
投资目标	本基金在追求基金资产长期增值的前提下,力争实现基金资产的长期稳健增值。																																												
投资策略	本基金采用自上而下的资产配置策略,在保持基金资产流动性、安全性和收益性的前提下,通过积极主动的资产配置,力争实现基金资产的长期稳健增值。																																												
业绩比较基准	中证综合债指数收益率×80%+人民币存款基准利率×20%																																												
风险收益特征	本基金为债券型基金,预期风险和预期收益低于股票型基金,其预期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	中国银行股份有限公司																																												
<p>3 主要财务指标</p> <table><tr><td>主要财务指标</td><td>报告期末2019年4月1日至2019年6月30日</td><td>单位:人民币元</td></tr><tr><td>1.本期已实现收益</td><td>6,294,417.15</td><td></td></tr><tr><td>2.本期利润</td><td>-15,877,966.44</td><td></td></tr><tr><td>3.加权平均基金份额本期利润</td><td>-0.0157</td><td></td></tr><tr><td>4.期末基金资产净值</td><td>895,690,247.56</td><td></td></tr><tr><td>5.期末基金份额净值</td><td>0.9607</td><td></td></tr></table> <p>注:上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可能会低于所列数字。</p> <p>3.2 基金净值表现</p> <p>3.2.1 本基金净值增长率与业绩比较基准表现的比较</p> <table><tr><td>阶段</td><td>净值增长率①</td><td>净值增长率基准②</td><td>业绩比较基准收益率③</td><td>①-③</td><td>②-③</td></tr><tr><td>过去三个月</td><td>-1.39%</td><td>0.08%</td><td>0.19%</td><td>1.02%</td><td>-1.68%</td><td>-0.14%</td></tr></table> <p>3.2.2 自基金合同生效以来本基金净值增长率与业绩比较基准表现的比较</p> <table><tr><td>阶段</td><td>净值增长率①</td><td>净值增长率基准②</td><td>业绩比较基准收益率③</td><td>①-③</td><td>②-③</td></tr><tr><td>过去三个月</td><td>-1.39%</td><td>0.08%</td><td>0.19%</td><td>1.02%</td><td>-1.68%</td><td>-0.14%</td></tr></table>		主要财务指标	报告期末2019年4月1日至2019年6月30日	单位:人民币元	1.本期已实现收益	6,294,417.15		2.本期利润	-15,877,966.44		3.加权平均基金份额本期利润	-0.0157		4.期末基金资产净值	895,690,247.56		5.期末基金份额净值	0.9607		阶段	净值增长率①	净值增长率基准②	业绩比较基准收益率③	①-③	②-③	过去三个月	-1.39%	0.08%	0.19%	1.02%	-1.68%	-0.14%	阶段	净值增长率①	净值增长率基准②	业绩比较基准收益率③	①-③	②-③	过去三个月	-1.39%	0.08%	0.19%	1.02%	-1.68%	-0.14%
主要财务指标	报告期末2019年4月1日至2019年6月30日	单位:人民币元																																											
1.本期已实现收益	6,294,417.15																																												
2.本期利润	-15,877,966.44																																												
3.加权平均基金份额本期利润	-0.0157																																												
4.期末基金资产净值	895,690,247.56																																												
5.期末基金份额净值	0.9607																																												
阶段	净值增长率①	净值增长率基准②	业绩比较基准收益率③	①-③	②-③																																								
过去三个月	-1.39%	0.08%	0.19%	1.02%	-1.68%	-0.14%																																							
阶段	净值增长率①	净值增长率基准②	业绩比较基准收益率③	①-③	②-③																																								
过去三个月	-1.39%	0.08%	0.19%	1.02%	-1.68%	-0.14%																																							

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:2019年7月18日																																													
<p>1 重要提示</p> <p>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。</p> <p>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2019年7月17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。</p> <p>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,也不保证基金份额持有人的本金不受损失,或保证投资收益。投资者有风险,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。</p> <p>本报告期内无基金份额持有人诉讼。</p> <p>本报告期自2019年4月1日起至6月30日止。</p>																																													
<p>2 基金产品概况</p> <table><tr><td>基金简称</td><td>大成中债新综合指数(LOF)</td></tr><tr><td>基金代码</td><td>090050</td></tr><tr><td>场内简称</td><td>100050F</td></tr><tr><td>基金运作方式</td><td>契约型开放式</td></tr><tr><td>基金合同生效日</td><td>2019年3月26日</td></tr><tr><td>报告期末基金份额总额</td><td>951,453,552.08份</td></tr><tr><td>投资目标</td><td>本基金在追求基金资产长期增值的前提下,力争实现基金资产的长期稳健增值。</td></tr><tr><td>投资策略</td><td>本基金采用自上而下的资产配置策略,在保持基金资产流动性、安全性和收益性的前提下,通过积极主动的资产配置,力争实现基金资产的长期稳健增值。</td></tr><tr><td>业绩比较基准</td><td>中证综合债指数收益率×80%+人民币存款基准利率×20%</td></tr><tr><td>风险收益特征</td><td>本基金为债券型基金,预期风险和预期收益低于股票型基金,其预期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。</td></tr><tr><td>基金管理人</td><td>大成基金管理有限公司</td></tr><tr><td>基金托管人</td><td>中国银行股份有限公司</td></tr></table>		基金简称	大成中债新综合指数(LOF)	基金代码	090050	场内简称	100050F	基金运作方式	契约型开放式	基金合同生效日	2019年3月26日	报告期末基金份额总额	951,453,552.08份	投资目标	本基金在追求基金资产长期增值的前提下,力争实现基金资产的长期稳健增值。	投资策略	本基金采用自上而下的资产配置策略,在保持基金资产流动性、安全性和收益性的前提下,通过积极主动的资产配置,力争实现基金资产的长期稳健增值。	业绩比较基准	中证综合债指数收益率×80%+人民币存款基准利率×20%	风险收益特征	本基金为债券型基金,预期风险和预期收益低于股票型基金,其预期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	中国银行股份有限公司																				
基金简称	大成中债新综合指数(LOF)																																												
基金代码	090050																																												
场内简称	100050F																																												
基金运作方式	契约型开放式																																												
基金合同生效日	2019年3月26日																																												
报告期末基金份额总额	951,453,552.08份																																												
投资目标	本基金在追求基金资产长期增值的前提下,力争实现基金资产的长期稳健增值。																																												
投资策略	本基金采用自上而下的资产配置策略,在保持基金资产流动性、安全性和收益性的前提下,通过积极主动的资产配置,力争实现基金资产的长期稳健增值。																																												
业绩比较基准	中证综合债指数收益率×80%+人民币存款基准利率×20%																																												
风险收益特征	本基金为债券型基金,预期风险和预期收益低于股票型基金,其预期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	中国银行股份有限公司																																												
<p>3 主要财务指标</p> <table><tr><td>主要财务指标</td><td>报告期末2019年4月1日至2019年6月30日</td><td>单位:人民币元</td></tr><tr><td>1.本期已实现收益</td><td>6,294,417.15</td><td></td></tr><tr><td>2.本期利润</td><td>-15,877,966.44</td><td></td></tr><tr><td>3.加权平均基金份额本期利润</td><td>-0.0157</td><td></td></tr><tr><td>4.期末基金资产净值</td><td>895,690,247.56</td><td></td></tr><tr><td>5.期末基金份额净值</td><td>0.9607</td><td></td></tr></table> <p>注:上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可能会低于所列数字。</p> <p>3.2 基金净值表现</p> <p>3.2.1 本基金净值增长率与业绩比较基准表现的比较</p> <table><tr><td>阶段</td><td>净值增长率①</td><td>净值增长率基准②</td><td>业绩比较基准收益率③</td><td>①-③</td><td>②-③</td></tr><tr><td>过去三个月</td><td>-1.39%</td><td>0.08%</td><td>0.19%</td><td>1.02%</td><td>-1.68%</td><td>-0.14%</td></tr></table> <p>3.2.2 自基金合同生效以来本基金净值增长率与业绩比较基准表现的比较</p> <table><tr><td>阶段</td><td>净值增长率①</td><td>净值增长率基准②</td><td>业绩比较基准收益率③</td><td>①-③</td><td>②-③</td></tr><tr><td>过去三个月</td><td>-1.39%</td><td>0.08%</td><td>0.19%</td><td>1.02%</td><td>-1.68%</td><td>-0.14%</td></tr></table>		主要财务指标	报告期末2019年4月1日至2019年6月30日	单位:人民币元	1.本期已实现收益	6,294,417.15		2.本期利润	-15,877,966.44		3.加权平均基金份额本期利润	-0.0157		4.期末基金资产净值	895,690,247.56		5.期末基金份额净值	0.9607		阶段	净值增长率①	净值增长率基准②	业绩比较基准收益率③	①-③	②-③	过去三个月	-1.39%	0.08%	0.19%	1.02%	-1.68%	-0.14%	阶段	净值增长率①	净值增长率基准②	业绩比较基准收益率③	①-③	②-③	过去三个月	-1.39%	0.08%	0.19%	1.02%	-1.68%	-0.14%
主要财务指标	报告期末2019年4月1日至2019年6月30日	单位:人民币元																																											
1.本期已实现收益	6,294,417.15																																												
2.本期利润	-15,877,966.44																																												
3.加权平均基金份额本期利润	-0.0157																																												
4.期末基金资产净值	895,690,247.56																																												
5.期末基金份额净值	0.9607																																												
阶段	净值增长率①	净值增长率基准②	业绩比较基准收益率③	①-③	②-③																																								
过去三个月	-1.39%	0.08%	0.19%	1.02%	-1.68%	-0.14%																																							
阶段	净值增长率①	净值增长率基准②	业绩比较基准收益率③	①-③	②-③																																								
过去三个月	-1.39%	0.08%	0.19%	1.02%	-1.68%	-0.14%																																							

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:2019年7月18日																																													
<p>1 重要提示</p> <p>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。</p> <p>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2019年7月17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。</p> <p>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,也不保证基金份额持有人的本金不受损失,或保证投资收益。投资者有风险,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。</p> <p>本报告期内无基金份额持有人诉讼。</p> <p>本报告期自2019年4月1日起至6月30日止。</p>																																													
<p>2 基金产品概况</p> <table><tr><td>基金简称</td><td>大成中债新综合指数(LOF)</td></tr><tr><td>基金代码</td><td>090050</td></tr><tr><td>场内简称</td><td>100050F</td></tr><tr><td>基金运作方式</td><td>契约型开放式</td></tr><tr><td>基金合同生效日</td><td>2019年3月26日</td></tr><tr><td>报告期末基金份额总额</td><td>951,453,552.08份</td></tr><tr><td>投资目标</td><td>本基金在追求基金资产长期增值的前提下,力争实现基金资产的长期稳健增值。</td></tr><tr><td>投资策略</td><td>本基金采用自上而下的资产配置策略,在保持基金资产流动性、安全性和收益性的前提下,通过积极主动的资产配置,力争实现基金资产的长期稳健增值。</td></tr><tr><td>业绩比较基准</td><td>中证综合债指数收益率×80%+人民币存款基准利率×20%</td></tr><tr><td>风险收益特征</td><td>本基金为债券型基金,预期风险和预期收益低于股票型基金,其预期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。</td></tr><tr><td>基金管理人</td><td>大成基金管理有限公司</td></tr><tr><td>基金托管人</td><td>中国银行股份有限公司</td></tr></table>		基金简称	大成中债新综合指数(LOF)	基金代码	090050	场内简称	100050F	基金运作方式	契约型开放式	基金合同生效日	2019年3月26日	报告期末基金份额总额	951,453,552.08份	投资目标	本基金在追求基金资产长期增值的前提下,力争实现基金资产的长期稳健增值。	投资策略	本基金采用自上而下的资产配置策略,在保持基金资产流动性、安全性和收益性的前提下,通过积极主动的资产配置,力争实现基金资产的长期稳健增值。	业绩比较基准	中证综合债指数收益率×80%+人民币存款基准利率×20%	风险收益特征	本基金为债券型基金,预期风险和预期收益低于股票型基金,其预期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	中国银行股份有限公司																				
基金简称	大成中债新综合指数(LOF)																																												
基金代码	090050																																												
场内简称	100050F																																												
基金运作方式	契约型开放式																																												
基金合同生效日	2019年3月26日																																												
报告期末基金份额总额	951,453,552.08份																																												
投资目标	本基金在追求基金资产长期增值的前提下,力争实现基金资产的长期稳健增值。																																												
投资策略	本基金采用自上而下的资产配置策略,在保持基金资产流动性、安全性和收益性的前提下,通过积极主动的资产配置,力争实现基金资产的长期稳健增值。																																												
业绩比较基准	中证综合债指数收益率×80%+人民币存款基准利率×20%																																												
风险收益特征	本基金为债券型基金,预期风险和预期收益低于股票型基金,其预期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	中国银行股份有限公司																																												
<p>3 主要财务指标</p> <table><tr><td>主要财务指标</td><td>报告期末2019年4月1日至2019年6月30日</td><td>单位:人民币元</td></tr><tr><td>1.本期已实现收益</td><td>6,294,417.15</td><td></td></tr><tr><td>2.本期利润</td><td>-15,877,966.44</td><td></td></tr><tr><td>3.加权平均基金份额本期利润</td><td>-0.0157</td><td></td></tr><tr><td>4.期末基金资产净值</td><td>895,690,247.56</td><td></td></tr><tr><td>5.期末基金份额净值</td><td>0.9607</td><td></td></tr></table> <p>注:上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可能会低于所列数字。</p> <p>3.2 基金净值表现</p> <p>3.2.1 本基金净值增长率与业绩比较基准表现的比较</p> <table><tr><td>阶段</td><td>净值增长率①</td><td>净值增长率基准②</td><td>业绩比较基准收益率③</td><td>①-③</td><td>②-③</td></tr><tr><td>过去三个月</td><td>-1.39%</td><td>0.08%</td><td>0.19%</td><td>1.02%</td><td>-1.68%</td><td>-0.14%</td></tr></table> <p>3.2.2 自基金合同生效以来本基金净值增长率与业绩比较基准表现的比较</p> <table><tr><td>阶段</td><td>净值增长率①</td><td>净值增长率基准②</td><td>业绩比较基准收益率③</td><td>①-③</td><td>②-③</td></tr><tr><td>过去三个月</td><td>-1.39%</td><td>0.08%</td><td>0.19%</td><td>1.02%</td><td>-1.68%</td><td>-0.14%</td></tr></table>		主要财务指标	报告期末2019年4月1日至2019年6月30日	单位:人民币元	1.本期已实现收益	6,294,417.15		2.本期利润	-15,877,966.44		3.加权平均基金份额本期利润	-0.0157		4.期末基金资产净值	895,690,247.56		5.期末基金份额净值	0.9607		阶段	净值增长率①	净值增长率基准②	业绩比较基准收益率③	①-③	②-③	过去三个月	-1.39%	0.08%	0.19%	1.02%	-1.68%	-0.14%	阶段	净值增长率①	净值增长率基准②	业绩比较基准收益率③	①-③	②-③	过去三个月	-1.39%	0.08%	0.19%	1.02%	-1.68%	-0.14%
主要财务指标	报告期末2019年4月1日至2019年6月30日	单位:人民币元																																											
1.本期已实现收益	6,294,417.15																																												
2.本期利润	-15,877,966.44																																												
3.加权平均基金份额本期利润	-0.0157																																												
4.期末基金资产净值	895,690,247.56																																												
5.期末基金份额净值	0.9607																																												
阶段	净值增长率①	净值增长率基准②	业绩比较基准收益率③	①-③	②-③																																								
过去三个月	-1.39%	0.08%	0.19%	1.02%	-1.68%	-0.14%																																							
阶段	净值增长率①	净值增长率基准②	业绩比较基准收益率③	①-③	②-③																																								
过去三个月	-1.39%	0.08%	0.19%	1.02%	-1.68%	-0.14%																																							

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:2019年7月18日	
<p>1 重要提示</p> <p>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。</p> <p>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2019年7月17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。</p> <p>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,也不保证基金份额持有人的本金不受损失,或保证投资收益。投资者有风险,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。</p> <p>本报告期内无基金份额持有人诉讼。</p> <p>本报告期自2019年4</p>	

1.1 基金简介: 大成基金净值归一 简介					
姓名	职务	任自日期	离任日期	证券从业资格	说明
王立	本基金基金经理 基金合同生效日期	2019年7月12日	-	1797	2019年6月30日, 中国工商银行(上海)托管有限公司(以下简称“托管人”)根据《证券投资基金法》、《证券投资基金托管业务管理办法》、《证券投资基金托管业务实施细则(试行)》、《证券投资基金托管业务操作指引》、《证券投资基金

大成中华沪深港300指数证券投资基金(LOF)

2019年第二季度报告

K	建筑业	--	--	--
F	批发和零售业	--	--	--
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	15,147,479.46	0.42	--
J	金融业	10,649,034.32	0.30	--
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	571,806.30	0.02	--
P	教育、体育和娱乐业	--	--	--
Q	综合	--	--	--
R	文化、体育和娱乐业	--	--	--
S	综合	--	--	--
合计		46,890,238.57	1.29	--

5.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

5.2.1 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	000031	三一重工	1,159,400	16,394,962.00	0.16
2	000728	佳都科技	1,207,427	12,494,165.06	0.13
3	001128	常阴沙	1,014,982	7,836,461.04	0.08
4	300051	康泰生物	60,525	3,177,562.04	0.03
5	002142	宁波韵升	136,522	2,512,273.28	0.03
6	300069	炬力微	196,570	2,463,523.00	0.03
7	000070	特发信息	96,500	1,180,106.00	0.01
8	003808	欧陆环境	53,500	571,806.30	0.02

5.3 报告期末按债券品种和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	985,984,000.00	22.63
4	其中:政策性金融债	985,984,000.00	22.63
4.1	企业债券	819,415,462.06	22.66
5	企业中期票据	612,700,000.00	17.16
6	中期票据	1,210,171,000.00	30.03
7	可转债(含回售)	362,138,230.00	9.99
8	同业存单	--	--
9	其他	--	--
10	合计	4,089,416,633.80	114.45

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十名股票投资明细

序号	股票代码	债券名称	数量(张)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	190206	19国债06	1,600,000	161,286,000.00	4.62
2	190210	19国债10	1,600,000	160,512,000.00	4.49
3	170206	17国债06	1,000,000	100,380,000.00	2.82
4	190205	19国债05	1,000,000	97,956,000.00	2.74
5	101754003	17年国债第4003期	500,000	51,267,000.00	2.56

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

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	811,761,204.95	88.85
2	其中:股票	811,761,204.95	88.85
3	固定收益投资	--	--
4	其中:国债	--	--
5	资产支持证券	--	--
6	贵金属投资	--	--
6.1	金融衍生品投资	--	--
6.2	买入返售金融资产	--	--
7	其中:买断式回购的买入返售金融资产	--	--
7.1	银行存款和结算备付金合计	95,532,089.74	10.78
8	其他资产	3,387,456.88	0.37
9	合计	913,661,648.67	100.00

5.7 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.1 报告期末按数量加权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	6,646,126.00	0.74
B	采矿业	32,459,167.00	3.88
C	制造业	147,900,664.00	16.44
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	910,036.00	0.10
E	建筑业	10,390,036.00	1.15
F	批发和零售业	2,67,321.00	0.47
G	交通运输、仓储和邮政业	10,351,929.00	1.15
H	住宿和餐饮业	--	--
I	信息传输、软件和信息技术服务业	8,856,558.00	0.98
J	金融业	132,499,719.88	14.72
K	房地产业	18,348,366.00	2.09
L	租赁和商务服务业	6,54,222.00	0.08
M	科学研究和技术服务业	764,129.00	0.01
N	水利、环境和公共设施管理业	642,194.00	0.00
O	教育、体育和娱乐业	--	--
P	教育	--	--
Q	卫生和社会工作	2,280,817.30	0.25
R	文化、体育和娱乐业	1,281,222.00	0.14
S	综合	--	--
合计		370,529,421.58	41.22

5.2.2 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	383,431.28	0.04
B	采矿业	383,431.28	0.04
C	制造业	149,398.83	0.02
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	--	--
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	39,603.76	0.00
J	金融业	33,869.94	0.00
K	房地产业	--	--

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股指期货交易情况说明				
5.9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细				
无。				
5.9.2 本基金投资股指期货的投资政策				
无。				
5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明				
5.10.1 本期国债期货投资政策				
无。				
5.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细				
无。				
5.10.3 本期国债期货投资评价				
无。				
5.11 投资组合报告附注				
5.11.1 本基金投资的前十名证券的发行主体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、处罚的情况。				
报告期内本基金投资的前十名证券的发行主体无被监管部门立案调查的,或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情况。				
5.11.2 基金投资的前十名证券是否超出基金合同规定的备选股票库。				
无。				
5.11.3 其他资产构成				

序号	名称	金额(元)	占基金资产净值比例(%)
1	存出保证金	531,026.74	
2	应收证券清算款	-	
3	应收股利	-	
4	应收利息	61,804,897.66	
5	应收申购款	14,177,769.76	
6	其他应收款	-	
7	待摊费用	-	
8	其他	-	
9	合计	76,513,693.14	

5.11.4 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	110040	国债转债	24,006,872.00	0.67
2	127006	长债转债	20,193,074.13	0.57
3	128013	国债转债	20,149,442.66	0.56
4	113011	光大转债	17,500,800.00	0.49
5	110050	国债转债	17,198,354.00	0.48
6	113014	林转债	16,309,052.10	0.46
7	128044	招商转债	15,291,369.50	0.42
8	110048	银联转债	14,501,962.20	0.41
9	110049	苏宁转债	14,075,023.60	0.39
10	123013	17国转8	10,393,400.00	0.31
11	128046	郑商转债	9,281,726.32	0.26
12	113016	海尔转债	9,083,591.40	0.25
13	110038	济川转债	8,636,531.40	0.24
14	128045	华信转债	6,077,569.60	0.17
15	128048	银行转债	6,040,340.32	0.17
16	113010	招商转债	5,946,762.80	0.17

基金(LOF)

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	23,106.60	0.00
S	综合	-	-
合计		608,947.28	0.07

5.2 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(元)	占基金资产净值比例(%)
A 农林牧渔	6,64,080.37	0.06
B 采掘业	19,589,107.80	2.18
C 制造业	11,789,761.52	1.31
D 电力、热力、燃气及水生产和供应业	17,417,426.34	1.94
E 金融业	156,174,571.30	21.69
F 医疗保健	6,789,648.00	0.75
G 工业	20,036,603.63	2.23
H 信息技术	4,870,022.07	0.54
I 电信服务	92,389,440.68	10.27
J 公用事业	26,187,285.72	2.80
K 房地产业	46,159,808.18	5.18
合计	440,221,358.09	48.96

5.3 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	000001	工商银行	281,380	16,761,532.07	5.38
2	000006	万科A	743,000	42,361,863.40	47.1
3	601128	常熟银行	380,328	35,390,643.38	37.5
4	002829	汇川技术	437,000	38,364,214.14	34.0
5	000009	深宝安A	4,026,000	27,361,917.00	30.4
6	002110	中国平安	221,000	31,228,175.27	20.2
7	000616	贵州茅台	17,600	17,311,400.00	19.1
8	002818	工商地产	3,060,000	16,282,889.13	1.9
9	000001	招商局港口	216,000	15,515,960.94	1.8
10	000036	招商银行	82,300	15,028,860.90	1.6

5.3.2 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	03311	中国银河国际	84,000	692,609.35	0.07
2	000908	海地发展	102,376	363,431.25	0.04
3	300762	航鼎胜	743	89,022.76	0.01
4	601698	中国国货	10,103	39,557.56	0.01
5	603963	松炅资源	1,612	37,264.06	0.00

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

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	国债逆回购				
2	央行票据				
3	其中:政策性金融债				
4	企业债				
5	企业短期融资券				
6	中期票据				
7	可转债(含交换债)				
8	同业存单				
9	其他				
10	合计			4,089,416,633.80	11.48

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	190006	19国债06	1,600,000	161,266,000.00	4.62
2	190210	19国债10	1,600,000	160,512,000.00	4.45
3	190206	19国债06	1,000,000	100,386,000.00	2.78
4	190205	19国债05	1,000,000	97,769,000.00	2.74
5	10175499	17国债09	500,000	51,267,000.00	2.26

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

序号	代码	项目	金额(元)	占基金资产净值比例(%)
1	权益投资	811,761,204.95	88.85	
2	其中:股票	811,761,204.95	88.85	

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

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基金投资明细

5.9 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股指期货投资明细

5.10 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国债期货投资明细

5.11 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

5.12 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.13 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

5.14 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

5.15 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

5.16 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

5.17 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

5.18 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

5.19 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

5.20 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

5.21 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

5.22 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

5.23 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

5.24 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

5.25 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

5.26 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

5.27 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

5.28 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

5.29 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

5.30 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

5.31 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

5.32 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

5.33 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

5.34 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

5.35 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

5.36 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

5.37 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

5.38 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

5.39 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

5.40 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

5.41 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

5.42 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

5.43 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

5.44 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

5.45 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

5.46 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

5.47 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

5.48 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

5.49 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

5.50 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

5.51 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

5.52 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

5.53 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

5.54 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

5.55 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

5.56 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

5.57 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

5.58 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

5.59 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

5.60 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

5.61 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

5.62 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

5.63 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

5.64 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

5.65 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

5.66 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

5.67 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

5.68 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

5.69 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

5.70 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

5.71 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

5.72 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

5.73 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

5.74 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

5.75 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

5.76 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

5.77 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

5.78 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

5.79 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

5.80 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

5.81 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

5.82 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

5.83 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

5.84 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

5.85 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

5.86 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

5.87 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

5.88 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

5.89 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

5.90 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

5.91 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

5.92 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

5.93 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

5.94 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

5.95 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

5.96 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

5.97 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

5.98 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

5.99 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

5.100 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

27	121030	医药保健	5,786,767.08	0.16
10	121004	文化传媒	5,437,500.03	0.15
10	110340	金融服务	5,031,500.00	0.14
20	110300	农林牧渔	4,385,367.63	0.13
23	110307	食品饮料	4,301,764.03	0.13
22	120010	医疗保健	4,163,973.37	0.13
23	110047	国防军工	3,281,496.37	0.12
22	120040	金融服务	2,927,654.87	0.09
26	120006	国防军工	2,536,260.00	0.08
26	110310	农林牧渔	2,507,184.00	0.07
27	110043	金融服务	2,544,352.03	0.07
29	120002	国防军工	2,248,200.76	0.06
29	120006	农林牧渔	1,597,712.00	0.04
30	120003	医疗保健	1,034,000.00	0.03
31	120004	国防军工	895,300.00	0.03
32	120007	食品饮料	846,700.00	0.03
33	120014	食品饮料	679,120.00	0.02
34	120011	医疗保健	1,117.00	0.00

5.1.15 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

5.1.1.6 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

由于涉及五户关联,分散之和合计可能有误差。

5.6 开放式基金份额变动

项目	大成债券A/B	大成债券C
报告期期初基金份额总额	2,836,161,627.56	970,079,061.01
报告期期间基金总申购份额	691,406,000.00	384,709,472.97
报告期期间基金总赎回份额	662,032,680.51	601,266,894.65
报告期期间基金净申购份额(份额减少以“-”填列)	2,666,123,900.07	753,492,639.33

7.1 基金管理人持有本基金基金份额变动情况

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

项目	大成债券A/B	大成债券C
报告期期初管理人持有的本基金份额	-	15,728.04
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	-	15,728.04
报告期期末持有的本基金基金份额占基金份额总额比例(%)	-	-

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

序号	交易方式	交易日期	交易份额(元)	交易金额(元)	适用费率(%)
1	申购	2019-04-04	15,728.04	15,728.04	-
合计			15,728.04	15,728.04	-

注:1.申购或赎回基金份额的,金额均为正;赎回或卖出基金份额的,金额均为负。
2.合计数据以绝对值计算。

3.红利发放日期合计数据

5.8 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

8.2 影响投资者决策的其他重要信息

根据公司于2019年7月6日发布的《大成基金管理有限公司高级管理人员变更公告》,经大成基金管理有限公司第二届第三十三次合伙人审议通过,自2019年7月6日起,公司总经理由罗黎明变更为陈强,具体信息见公司相关公告。

5.9 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债券投资基金的文件;
2.《大成债券投资基金基金合同》;
3.《大成债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.本报告期内在指定网站上披露的各种公告和报告。
9.2 存放地点

本报告期内存放在基金管理人和本托管人的住所。
9.3 查阅方式

投资者可在本报告期内免费查阅,或登录基金管理人网站<http://www.dcfund.com.cn>进行查阅。

大成基金管理有限公司
2019年7月18日

无。

5.1 重要提示

5.1.1 报告期末本基金的投资组合及投资情况

5.1.1.1 报告期末本基金投资组合资产配置情况

5.1.1.2 报告期末本基金投资组合资产配置情况

5.1.1.3 报告期末本基金投资组合资产配置情况

5.1.1.4 报告期末本基金投资组合资产配置情况

5.1.1.5 报告期末本基金投资组合资产配置情况

5.1.1.6 报告期末本基金投资组合资产配置情况

5.1.1.7 报告期末本基金投资组合资产配置情况

5.1.1.8 报告期末本基金投资组合资产配置情况

5.1.1.9 报告期末本基金投资组合资产配置情况

5.1.1.10 报告期末本基金投资组合资产配置情况

5.1.1.11 报告期末本基金投资组合资产配置情况

5.1.1.12 报告期末本基金投资组合资产配置情况

5.1.1.13 报告期末本基金投资组合资产配置情况

5.1.1.14 报告期末本基金投资组合资产配置情况

5.1.1.15 报告期末本基金投资组合资产配置情况

5.1.1.16 报告期末本基金投资组合资产配置情况

5.1.1.17 报告期末本基金投资组合资产配置情况

5.1.1.18 报告期末本基金投资组合资产配置情况

5.1.1.19 报告期末本基金投资组合资产配置情况

5.1.1.20 报告期末本基金投资组合资产配置情况

5.1.1.21 报告期末本基金投资组合资产配置情况

5.1.1.22 报告期末本基金投资组合资产配置情况

5.1.1.23 报告期末本基金投资组合资产配置情况

5.1.1.24 报告期末本基金投资组合资产配置情况

5.1.1.25 报告期末本基金投资组合资产配置情况

5.1.1.26 报告期末本基金投资组合资产配置情况

5.1.1.27 报告期末本基金投资组合资产配置情况

5.1.1.28 报告期末本基金投资组合资产配置情况

5.1.1.29 报告期末本基金投资组合资产配置情况

5.1.1.30 报告期末本基金投资组合资产配置情况

5.1.1.31 报告期末本基金投资组合资产配置情况

5.1.1.32 报告期末本基金投资组合资产配置情况

5.1.1.33 报告期末本基金投资组合资产配置情况

5.1.1.34 报告期末本基金投资组合资产配置情况

5.1.1.35 报告期末本基金投资组合资产配置情况

5.1.1.36 报告期末本基金投资组合资产配置情况

5.1.1.37 报告期末本基金投资组合资产配置情况

5.1.1.38 报告期末本基金投资组合资产配置情况

5.1.1.39 报告期末本基金投资组合资产配置情况

5.1.1.40 报告期末本基金投资组合资产配置情况

5.1.1.41 报告期末本基金投资组合资产配置情况

5.1.1.42 报告期末本基金投资组合资产配置情况

5.1.1.43 报告期末本基金投资组合资产配置情况

5.1.1.44 报告期末本基金投资组合资产配置情况

5.1.1.45 报告期末本基金投资组合资产配置情况

5.1.1.46 报告期末本基金投资组合资产配置情况

5.1.1.47 报告期末本基金投资组合资产配置情况

5.1.1.48 报告期末本基金投资组合资产配置情况

5.1.1.49 报告期末本基金投资组合资产配置情况

5.1.1.50 报告期末本基金投资组合资产配置情况

5.1.1.51 报告期末本基金投资组合资产配置情况

5.1.1.52 报告期末本基金投资组合资产配置情况

5.1.1.53 报告期末本基金投资组合资产配置情况

5.1.1.54 报告期末本基金投资组合资产配置情况

5.1.1.55 报告期末本基金投资组合资产配置情况

5.1.1.56 报告期末本基金投资组合资产配置情况

5.1.1.57 报告期末本基金投资组合资产配置情况

5.1.1.58 报告期末本基金投资组合资产配置情况

5.1.1.59 报告期末本基金投资组合资产配置情况

5.1.1.60 报告期末本基金投资组合资产配置情况

5.1.1.61 报告期末本基金投资组合资产配置情况

5.1.1.62 报告期末本基金投资组合资产配置情况

5.1.1.63 报告期末本基金投资组合资产配置情况

5.1.1.64 报告期末本基金投资组合资产配置情况

5.1.1.65 报告期末本基金投资组合资产配置情况

5.1.1.66 报告期末本基金投资组合资产配置情况

5.1.1.67 报告期末本基金投资组合资产配置情况

5.1.1.68 报告期末本基金投资组合资产配置情况

5.1.1.69 报告期末本基金投资组合资产配置情况

5.1.1.70 报告期末本基金投资组合资产配置情况

5.1.1.71 报告期末本基金投资组合资产配置情况

5.1.1.72 报告期末本基金投资组合资产配置情况

5.1.1.73 报告期末本基金投资组合资产配置情况

5.1.1.74 报告期末本基金投资组合资产配置情况

5.1.1.75 报告期末本基金投资组合资产配置情况

5.1.1.76 报告期末本基金投资组合资产配置情况

5.1.1.77 报告期末本基金投资组合资产配置情况

5.1.1.78 报告期末本基金投资组合资产配置情况

5.1.1.79 报告期末本基金投资组合资产配置情况

5.1.1.80 报告期末本基金投资组合资产配置情况

5.1.1.81 报告期末本基金投资组合资产配置情况

5.1.1.82 报告期末本基金投资组合资产配置情况

5.1.1.83 报告期末本基金投资组合资产配置情况

5.1.1.84 报告期末本基金投资组合资产配置情况

5.1.1.85 报告期末本基金投资组合资产配置情况

5.1.1.86 报告期末本基金投资组合资产配置情况

5.1.1.87 报告期末本基金投资组合资产配置情况

5.1.1.88 报告期末本基金投资组合资产配置情况

5.1.1.89 报告期末本基金投资组合资产配置情况

5.1.1.90 报告期末本基金投资组合资产配置情况

5.1.1.91 报告期末本基金投资组合资产配置情况

5.1.1.92 报告期末本基金投资组合资产配置情况

5.1.1.93 报告期末本基金投资组合资产配置情况

5.1.1.94 报告期末本基金投资组合资产配置情况

5.1.1.95 报告期末本基金投资组合资产配置情况

5.1.1.96 报告期末本基金投资组合资产配置情况

5.1.1.97 报告期末本基金投资组合资产配置情况

5.1.1.98 报告期末本基金投资组合资产配置情况

5.1.1.99 报告期末本基金投资组合资产配置情况

5.1.1.100 报告期末本基金投资组合资产配置情况

5.1.1.101 报告期末本基金投资组合资产配置情况

5.1.1.102 报告期末本基金投资组合资产配置情况

5.1.1.103 报告期末本基金投资组合资产配置情况

5.1.1.104 报告期末本基金投资组合资产配置情况

5.1.1.105 报告期末本基金投资组合资产配置情况

5.1.1.106 报告期末本基金投资组合资产配置情况

5.1.1.107 报告期末本基金投资组合资产配置情况

5.1.1.108 报告期末本基金投资组合资产配置情况

5.1.1.109 报告期末本基金投资组合资产配置情况

5.1.1.110 报告期末本基金投资组合资产配置情况

5.1.1.111 报告期末本基金投资组合资产配置情况

5.1.1.112 报告期末本基金投资组合资产配置情况

5.1.1.113 报告期末本基金投资组合资产配置情况

5.1.1.114 报告期末本基金投资组合资产配置情况

5.1.1.115 报告期末本基金投资组合资产配置情况

5.1.1.116 报告期末本基金投资组合资产配置情况

5.1.1.117 报告期末本基金投资组合资产配置情况

5.1.1.118 报告期末本基金投资组合资产配置情况

5.1.1.119 报告期末本基金投资组合资产配置情况

5.1.1.120 报告期末本基金投资组合资产配置情况

5.1.1.121 报告期末本基金投资组合资产配置情况

5.1.1.122 报告期末本基金投资组合资产配置情况

5.1.1.123 报告期末本基金投资组合资产配置情况

5.1.1.124 报告期末本基金投资组合资产配置情况

5.1.1.125 报告期末本基金投资组合资产配置情况

5.1.1.126 报告期末本基金投资组合资产配置情况

5.1.1.127 报告期末本基金投资组合资产配置情况

5.1.1.128 报告期末本基金投资组合资产配置情况

5.1.1.129 报告期末本基金投资组合资产配置情况

5.1.1.130 报告期末本基金投资组合资产配置情况

5.1.1.131 报告期末本基金投资组合资产配置情况

5.1.1.132 报告期末本基金投资组合资产配置情况

5.1.1.133 报告期末本基金投资组合资产配置情况

5.1.1.134 报告期末本基金投资组合资产配置情况

5.1.1.135 报告期末本基金投资组合资产配置情况

5.1.1.136 报告期末本基金投资组合资产配置情况

5.1.1.137 报告期末本基金投资组合资产配置情况

5.1.1.138 报告期末本基金投资组合资产配置情况

5.1.1.139 报告期末本基金投资组合资产配置情况

5.1.1.140 报告期末本基金投资组合资产配置情况

5.1.1.141 报告期末本基金投资组合资产配置情况

5.1.1.142 报告期末本基金投资组合资产配置情况

5.1.1.143 报告期末本基金投资组合资产配置情况

5.1.1.144 报告期末本基金投资组合资产配置情况

5.1.1.145 报告期末本基金投资组合资产配置情况

5.1.1.146 报告期末本基金投资组合资产配置情况

5.1.1.147 报告期末本基金投资组合资产配置情况

5.1.1.148 报告期末本基金投资组合资产配置情况

5.1.1.149 报告期末本基金投资组合资产配置情况

5.1.1.150 报告期末本基金投资组合资产配置情况

5.1.1.151 报告期末本基金投资组合资产配置情况

5.1.1.152 报告期末本基金投资组合资产配置情况

5.1.1.153 报告期末本基金投资组合资产配置情况

5.1.1.154 报告期末本基金投资组合资产配置情况

5.1.1.155 报告期末本基金投资组合资产配置情况

5.1.1.156 报告期末本基金投资组合资产配置情况

5.1.1.157 报告期末本基金投资组合资产配置情况

5.1.1.158 报告期末本基金投资组合资产配置情况

5.1.1.159 报告期末本基金投资组合资产配置情况

5.1.1.160 报告期末本基金投资组合资产配置情况

5.1.1.161 报告期末本基金投资组合资产配置情况

5.1.1.162 报告期末本基金投资组合资产配置情况

5.1.1.163 报告期末本基金投资组合资产配置情况

5.1.1.164 报告期末本基金投资组合资产配置情况

5.1.1.165 报告期末本基金投资组合资产配置情况

5.1.1.166 报告期末本基金投资组合资产配置情况

5.1.1.167 报告期末本基金投资组合资产配置情况

5.1.1.168 报告期末本基金投资组合资产配置情况

5.1.1.169 报告期末本基金投资组合资产配置情况

5.1.1.170 报告期末本基金投资组合资产配置情况

5.1.1.171 报告期末本基金投资组合资产配置情况

5.1.1.172 报告期末本基金投资组合资产配置情况

5.1.1.173 报告期末本基金投资组合资产配置情况

5.1.1.174 报告期末本基金投资组合资产配置情况

5.1.1.175 报告期末本基金投资组合资产配置情况

5.1.1.176 报告期末本基金投资组合资产配置情况

5.1.1.177 报告期末本基金投资组合资产配置情况

5.1.1.178 报告期末本基金投资组合资产配置情况

5.1.1.179 报告期末本基金投资组合资产配置情况

5.1.1.180 报告期末本基金投资组合资产配置情况

5.1.1.181 报告期末本基金投资组合资产配置情况

5.1.1.182 报告期末本基金投资组合资产配置情况

5.1.1.183 报告期末本基金投资组合资产配置情况

5.1.1.184 报告期末本基金投资组合资产配置情况

5.1.1.185 报告期末本基金投资组合资产配置情况

5.1.1.186 报告期末本基金投资组合资产配置情况

5.1.1.187 报告期末本基金投资组合资产配置情况

5.1.1.188 报告期末本基金投资组合资产配置情况

5.1.1.189 报告期末本基金投资组合资产配置情况

5.1.1.190 报告期末本基金投资组合资产配置情况

5.1.1.191 报告期末本基金投资组合资产配置情况

5.1.1.192 报告期末本基金投资组合资产配置情况

5.1.1.193 报告期末本基金投资组合资产配置情况

5.1.1.194 报告期末本基金投资组合资产配置情况

5.1.1.195 报告期末本基金投资组合资产配置情况

5.1.1.196 报告期末本基金投资组合资产配置情况

5.1.1.197 报告期末本基金投资组合资产配置情况

5.1.1.198 报告期末本基金投资组合资产配置情况

5.1.1.199 报告期末本基金投资组合资产配置情况

5.1.1.200 报告期末本基金投资组合资产配置情况

5.1.1.201 报告期末本基金投资组合资产配置情况

5.1.1.202 报告期末本基金投资组合资产配置情况

5.1.1.203 报告期末本基金投资组合资产配置情况

5.1.1.204 报告期末本基金投资组合资产配置情况

5.1.1.205 报告期末本基金投资组合资产配置情况

5.1.1.206 报告期末本基金投资组合资产配置情况

5.1.1.207 报告期末本基金投资组合资产配置情况

5.1.1.208 报告期末本基金投资组合资产配置情况

5.1.1.209 报告期末本基金投资组合资产配置情况

5.1.1.210 报告期末本基金投资组合资产配置情况

5.1.1.211 报告期末本基金投资组合资产配置情况

5.1.1.212 报告期末本基金投资组合资产配置情况

5.1.1.213 报告期末本基金投资组合资产配置情况

5.1.1.214 报告期末本基金投资组合资产配置情况

5.1.1.215 报告期末本基金投资组合资产配置情况

5.1.1.216 报告期末本基金投资组合资产配置情况

5.1.1.217 报告期末本基金投资组合资产配置情况

5.1.1.218 报告期末本基金投资组合资产配置情况

5.1.1.219 报告期末本基金投资组合资产配置情况

5.1.1.220 报告期末本基金投资组合资产配置情况

5.1.1.221 报告期末本基金投资组合资产配置情况

5.1.1.222 报告期末本基金投资组合资产配置情况

5.1.1.223 报告期末本基金投资组合资产配置情况

5.1.1.224 报告期末本基金投资组合资产配置情况

5.1.1.225 报告期末本基金投资组合资产配置情况

5.1.1.226 报告期末本基金投资组合资产配置情况

5.1.1.227 报告期末本基金投资组合资产配置情况

5.1.1.228 报告期末本基金投资组合资产配置情况

5.1.1.229 报告期末本基金投资组合资产配置情况

5.1.1.230 报告期末本基金投资组合资产配置情况

5.1.1.231 报告期末本基金投资组合资产配置情况

5.1.1.232 报告期末本基金投资组合资产配置情况

5.1.1.233 报告期末本基金投资组合资产配置情况

5.1.1.234 报告期末本基金投资组合资产配置情况

5.1.1.235 报告期末本基金投资组合资产配置情况

5.1.1.236 报告期末本基金投资组合资产配置情况

5.1.1.237 报告期末本基金投资组合资产配置情况

5.1.1.238 报告期末本基金投资组合资产配置情况

5.1.1.239 报告期末本基金投资组合资产配置情况

5.1.1.240 报告期末本基金投资组合资产配置情况

5.1.1.241 报告期末本基金投资组合资产配置情况

5.1.1.242 报告期末本基金投资组合资产配置情况

5.1.1.243 报告期末本基金投资组合资产配置情况

5.1.1.244 报告期末本基金投资组合资产配置情况

5.1.1.245 报告期末本基金投资组合资产配置情况

5.1.1.246 报告期末本基金投资组合资产配置情况

5.1.1.247 报告期末本基金投资组合资产配置情况

5.1.1.248 报告期末本基金投资组合资产配置情况

5.1.1.249 报告期末本基金投资组合资产配置情况

5.1.1.250 报告期末本基金投资组合资产配置情况

5.1.1.251 报告期末本基金投资组合资产配置情况

5.1.1.252 报告期末本基金投资组合资产配置情况

5.1.1.253 报告期末本基金投资组合资产配置情况

5.1.1.254 报告期末本基金投资组合资产配置情况

5.1.1.255 报告期末本基金投资组合资产配置情况

5.1.1.256 报告期末本基金投资组合资产配置情况

5.1.1.257 报告期末本基金投资组合资产配置情况

5.1.1.258 报告期末本基金投资组合资产配置情况

5.1.1.259 报告期末本基金投资组合资产配置情况

5.1.1.260 报告期末本基金投资组合资产配置情况

5.1.1.261 报告期末本基金投资组合资产配置情况

5.1.1.262 报告期末本基金投资组合资产配置情况

5.1.1.263 报告期末本基金投资组合资产配置情况

5.1.1.264 报告期末本基金投资组合资产配置情况

5.1.1.265 报告期末本基金投资组合资产配置情况

5.1.1.266 报告期末本基金投资组合资产配置情况

5.1.1.267 报告期末本基金投资组合资产配置情况

5.1.1.268 报告期末本基金投资组合资产配置情况

5.1.1.269 报告期末本基金投资组合资产配置情况

5.1.1.270 报告期末本基金投资组合资产配置情况

5.1.1.271 报告期末本基金投资组合资产配置情况

5.1.1.272 报告期末本基金投资组合资产配置情况

5.1.1.273 报告期末本基金投资组合资产配置情况

5.1.1.274 报告期末本基金投资组合资产配置情况

5.1.1.275 报告期末本基金投资组合资产配置情况

5.1.1.276 报告期末本基金投资组合资产配置情况

5.1.1.277 报告期末本基金投资组合资产配置情况

5.1.1.278 报告期末本基金投资组合资产配置情况

5.1.1.279 报告期末本基金投资组合资产配置情况

5.1.1.280 报告期末本基金投资组合资产配置情况

5.1.1.281 报告期末本基金投资组合资产配置情况

5.1.1.282 报告期末本基金投资组合资产配置情况

5.1.1.283 报告期末本基金投资组合资产配置情况

5.1.1.284 报告期末本基金投资组合资产配置情况

5.1.1.285 报告期末本基金投资组合资产配置情况

5.1.1.286 报告期末本基金投资组合资产配置情况

5.1.1.287 报告期末本基金投资组合资产配置情况

5.1.1.288 报告期末本基金投资组合资产配置情况

5.1.1.289 报告期末本基金投资组合资产配置情况

5.1.1.290 报告期末本基金投资组合资产配置情况

5.1.1.291 报告期末本基金投资组合资产配置情况

5.1.1.292 报告期末本基金投资组合资产配置情况

5.1.1.293 报告期末本基金投资组合资产配置情况

5.1.1.294 报告期末本基金投资组合资产配置情况

5.1.1.295 报告期末本基金投资组合资产配置情况

5.1.1.296 报告期末本基金投资组合资产配置情况

5.1.1.297 报告期末本基金投资组合资产配置情况

5.1.1.298 报告期末本基金投资组合资产配置情况

5.1.1.299 报告期末本基金投资组合资产配置情况

5.1.1.300 报告期末本基金投资组合资产配置情况

5.1.1.301 报告期末本基金投资组合资产配置情况

5.1.1.302 报告期末本基金投资组合资产配置情况

5.1.1.303 报告期末本基金投资组合资产配置情况

5.1.1.304 报告期末本基金投资组合资产配置情况

5.1.1.305 报告期末本基金投资组合资产配置情况

5.1.1.306 报告期末本基金投资组合资产配置情况

5.1.1.307 报告期末本基金投资组合资产配置情况

5.1.1.308 报告期末本基金投资组合资产配置情况

5.1.1.309 报告期末本基金投资组合资产配置情况

5.1.1.310 报告期末本基金投资组合资产配置情况

5.1.1.311 报告期末本基金投资组合资产配置情况

5.1.1.312 报告期末本基金投资组合资产配置情况

5.1.1.313 报告期末本基金投资组合资产配置情况

5.1.1.314 报告期末本基金投资组合资产配置情况

5.1.1.315 报告期末本基金投资组合资产配置情况

5.1.1.316 报告期末本基金投资组合资产配置情况

5.1.1.317 报告期末本基金投资组合资产配置情况

5.1.1.318 报告期末本基金投资组合资产配置情况

5.1.1.319 报告期末本基金投资组合资产配置情况

5.1.1.320 报告期末本基金投资组合资产配置情况

5.1.1.321 报告期末本基金投资组合资产配置情况

5.1.1.322 报告期末本基金投资组合资产配置情况

5.1.1.323 报告期末本基金投资组合资产配置情况

5.1.1.324 报告期末本基金投资组合资产配置情况

5.1.1.325 报告期末本基金投资组合资产配置情况

5.1.1.326 报告期末本基金投资组合资产配置情况

5.1.1.327 报告期末本基金投资组合资产配置情况

5.1.1.328 报告期末本基金投资组合资产配置情况

5.1.1.329 报告期末本基金投资组合资产配置情况

5.1.1.330 报告期末本基金投资组合资产配置情况

5.1.1.331 报告期末本基金投资组合资产配置情况

5.1.1.332 报告期末本基金投资组合资产配置情况

5.1.1.333 报告期末本基金投资组合资产配置情况

5.1.1.334 报告期末本基金投资组合资产配置情况

5.1.1.335 报告期末本基金投资组合资产配置情况

5.1.1.336 报告期末本基金投资组合资产配置情况

5.1.1.337 报告期末本基金投资组合资产配置情况

5.1.1.338 报告期末本基金投资组合资产配置情况

5.1.1.339 报告期末本基金投资组合资产配置情况

5.1.1.340 报告期末本基金投资组合资产配置情况

5.1.1.341 报告期末本基金投资组合资产配置情况

5.1.1.342 报告期末本基金投资组合资产配置情况

5.1.1.343 报告期末本基金投资组合资产配置情况

5.1.1.344 报告期末本基金投资组合资产配置情况

5.1.1.345 报告期末本基金投资组合资产配置情况

5.1.1.346 报告期末本基金投资组合资产配置情况

5.1.1.347 报告期末本基金投资组合资产配置情况

5.1.1.348 报告期末本基金投资组合资产配置情况

5.1.1.349 报告期末本基金投资组合资产配置情况

5.1.1.350 报告期末本基金投资组合资产配置情况

5.1.1.351 报告期末本基金投资组合资产配置情况

5.1.1.352 报告期末本基金投资组合资产配置情况

5.1.1.353 报告期末本基金投资组合资产配置情况

5.1.1.354 报告期末本基金投资组合资产配置情况

5.1.1.355 报告期末本基金投资组合资产配置情况

5.1.1.356 报告期末本基金投资组合资产配置情况

5.1.1.357 报告期末本基金投资组合资产配置情况

5.1.1.358 报告期末本基金投资组合资产配置情况

5.1.1.359 报告期末本基金投资组合资产配置情况

5.1.1.360 报告期末本基金投资组合资产配置情况

5.1.1.361 报告期末本基金投资组合资产配置情况

5.1.1.362 报告期末本基金投资组合资产配置情况

5.1.1.363 报告期末本基金投资组合资产配置情况

5.1.1.364 报告期末本基金投资组合资产配置情况

5.1.1.365 报告期末本基金投资组合资产配置情况

5.1.1.366 报告期末本基金投资组合资产配置情况

5.1.1.367 报告期末本基金投资组合资产配置情况

5.1.1.368 报告期末本基金投资组合资产配置情况

5.1.1.369 报告期末本基金投资组合资产配置情况

5.1.1.370 报告期末本基金投资组合资产配置情况

5.1.1.371 报告期末本基金投资组合资产配置情况

5.1.1.372 报告期末本基金投资组合资产配置情况

5.1.1.373 报告期末本基金投资组合资产配置情况

5.1.1.374 报告期末本基金投资组合资产配置情况

5.1.1.375 报告期末本基金投资组合资产配置情况

5.1.1.376 报告期末本基金投资组合资产配置情况

5.1.1.377 报告期末本基金投资组合资产配置情况

5.1.1.378 报告期末本基金投资组合资产配置情况

5.1.1.379 报告期末本基金投资组合资产配置情况

5.1.1.380 报告期末本基金投资组合资产配置情况

5.1.1.381 报告期末本基金投资组合资产配置情况

5.1.1.382 报告期末本基金投资组合资产配置情况

5.1.1.383 报告期末本基金投资组合资产配置情况

5.1.1.384 报告期末本基金投资组合资产配置情况

5.1.1.385 报告期末本基金投资组合资产配置情况

5.1.1.386 报告期末本基金投资组合资产配置情况

5.1.1.387 报告期末本基金投资组合资产配置情况

5.1.1.388 报告期末本基金投资组合资产配置情况

5.1.1.389 报告期末本基金投资组合资产配置情况

5.1.1.390 报告期末本基金投资组合资产配置情况

5.1.1.391 报告期末本基金投资组合资产配置情况

5.1.1.392 报告期末本基金投资组合资产配置情况

5.1.1.393 报告期末本基金投资组合资产配置情况

5.1.1.394 报告期末本基金投资组合资产配置情况

5.1.1.395 报告期末本基金投资组合资产配置情况

5.1.1.396 报告期末本基金投资组合资产配置情况

5.1.1.397 报告期末本基金投资组合资产配置情况

5.1.1.398 报告期末本基金投资组合资产配置情况

5.1.1.399 报告期末本基金投资组合资产配置情况

5.1.1.400 报告期末本基金投资组合资产配置情况

5.1.1.401 报告期末本基金投资组合资产配置情况

5.1.1.402 报告期末本基金投资组合资产配置情况

5.1.1.403 报告期末本基金投资组合资产配置情况

5.1.1.404 报告期末本基金投资组合资产配置情况

5.1.1.405 报告期末本基金投资组合资产配置情况

5.1.1.406 报告期末本基金投资组合资产配置情况

5.1.1.407 报告期末本基金投资组合资产配置情况

5.1.1.408 报告期末本基金投资组合资产配置情况

5.1.1.409 报告期末本基金投资组合资产配置情况

5.1.1.410 报告期末本基金投资组合资产配置情况

5.1.1.411 报告期末本基金投资组合资产配置情况

5.1.1.412 报告期末本基金投资组合资产配置情况

5.1.1.413 报告期末本基金投资组合资产配置情况

5.1.1.414 报告期末本基金投资组合资产配置情况

5.1.1.415 报告期末本基金投资组合资产配置情况

5.1.1.416 报告期末本基金投资组合资产配置情况

5.1.1.417 报告期末本基金投资组合资产配置情况

5.1.1.418 报告期末本基金投资组合资产配置情况

5.1.1.419 报告期末本基金投资组合资产配置情况

5.1.1.420 报告期末本基金投资组合资产配置情况

5.1.1.421 报告期末本基金投资组合资产配置情况

5.1.1.422 报告期末本基金投资组合资产配置情况

5.1.1.423 报告期末本基金投资组合资产配置情况

5.1.1.424 报告期末本基金投资组合资产配置情况

5.1.1.425 报告期末本基金投资组合资产配置情况

5.1.1.426 报告期末本基金投资组合资产配置情况

5.1.1.427 报告期末本基金投资组合资产配置情况

5.1.1.428 报告期末本基金投资组合资产配置情况

5.1.1.429 报告期末本基金投资组合资产配置情况

5.1.1.430 报告期末本基金投资组合资产配置情况

5.1.1.431 报告期末本基金投资组合资产配置情况

5.1.1.432 报告期末本基金投资组合资产配置情况

5.1.1.433 报告期末本基金投资组合资产配置情况

5.1.1.434 报告期末本基金投资组合资产配置情况

5.1.1.435 报告期末本基金投资组合资产配置情况

5.1.1.436 报告期末本基金投资组合资产配置情况

5.1.1.437 报告期末本基金投资组合资产配置情况

5.1.1.438 报告期末本基金投资组合资产配置情况

5.1.1.439 报告期末本基金投资组合资产配置情况

5.1.1.440 报告期末本基金投资组合资产配置情况

5.1.1.441 报告期末本基金投资组合资产配置情况

5.1.1.442 报告期末本基金投资组合资产配置情况

5.1.1.443 报告期末本基金投资组合资产配置情况

5.1.1.444 报告期末本基金投资组合资产配置情况

5.1.1.445 报告期末本基金投资组合资产配置情况

5.1.1.446 报告期末本基金投资组合资产配置情况

5.1.1.447 报告期末本基金投资组合资产配置情况

5.1.1.448 报告期末本基金投资组合资产配置情况

5.1.1.449 报告期末本基金投资组合资产配置情况

5.1.1.450 报告期末本基金投资组合资产配置情况

5.1.1.451 报告期末本基金投资组合资产配置情况

5.1.1.452 报告期末本基金投资组合资产配置情况

5.1.1.453 报告期末本基金投资组合资产配置情况

5.1.1.454 报告期末本基金投资组合资产配置情况

5.1.1.455 报告期末本基金投资组合资产配置情况

5.1.1.456 报告期末本基金投资组合资产配置情况

5.1.1.457 报告期末本基金投资组合资产配置情况

5.1.1.458 报告期末本基金投资组合资产配置情况

5.1.1.459 报告期末本基金投资组合资产配置情况

5.1.1.460 报告期末本基金投资组合资产配置情况

5.1.1.461 报告期末本基金投资组合资产配置情况

5.1.1.462 报告期末本基金投资组合资产配置情况

5.1.1.463 报告期末本基金投资组合资产配置情况

5.1.1.464 报告期末本基金投资组合资产配置情况

5.1.1.465 报告期末本基金投资组合资产配置情况

5.1.1.466 报告期末本基金投资组合资产配置情况

5.1.1.467 报告期末本基金投资组合资产配置情况

5.1.1.468 报告期末本基金投资组合资产配置情况

5.1.1.469 报告期末本基金投资组合资产配置情况

5.1.1.470 报告期末本基金投资组合资产配置情况

5.1.1.471 报告期末本基金投资组合资产配置情况

5.1.1.472 报告期末本基金投资组合资产配置情况

5.1.1.473 报告期末本基金投资组合资产配置情况

5.1.1.474 报告期末本基金投资组合资产配置情况

5.1.1.475 报告期末本基金投资组合资产配置情况

5.1.1.476 报告期末本基金投资组合资产配置情况

5.1.1.477 报告期末本基金投资组合资产配置情况

5.1.1.478 报告期末本基金投资组合资产配置情况

5.1.1.479 报告期末本基金投资组合资产配置情况

5.1.1.480 报告期末本基金投资组合资产配置情况

5.1.1.481 报告期末本基金投资组合资产配置情况

5.1.1.482 报告期末本基金投资组合资产配置情况

5.1.1.483 报告期末本基金投资组合资产配置情况

5.1.1.484 报告期末本基金投资组合资产配置情况

5.1.1.485 报告期末本基金投资组合资产配置情况

5.1.1.486 报告期末本基金投资组合资产配置情况

5.1.1.487 报告期末本基金投资组合资产配置情况

5.1.1.488 报告期末本基金投资组合资产配置情况

5.1.1.489 报告期末本基金投资组合资产配置情况

5.1.1.490 报告期末本基金投资组合资产配置情况

5.1.1.491 报告期末本基金投资组合资产配置情况

5.1.1.492 报告期末本基金投资组合资产配置情况

5.1.1.493 报告期末本基金投资组合资产配置情况

5.1.1.494 报告期末本基金投资组合资产配置情况

5.1.1.495 报告期末本基金投资组合资产配置情况

5.1.1.4

大成中证100交易型开放式指数证券投资基金

2019年第二季度报告

5.10.3 本期国债期货投资评价					
无。					
5.11 投资组合报告摘要					
5.11.1 本基金投资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交通银行(601328.SH)的发行主体交通银行股份有限公司于2019年7月20日因违反投资者适当性义务,受中国银保监会行政处罚(银保罚决字〔2019〕12号),于2019年10月9日因违反投资者适当性义务,被银保监会行政处罚(银保罚决字〔2019〕12号),受中国银保监会行政处罚委员会处罚(银保罚决字决字〔2018〕12号),且被银保监会行政处罚委员会处罚(银保罚决字决字〔2018〕12号),且被银保监会行政处罚委员会处罚(银保罚决字决字〔2018〕12号)。					
5.11.2 基金投资的前十名股票是否属于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约定的备选股票库。					
5.11.3 其他资产构成					
序号	名称	金额(元)			
1	存在保证金	60057			
2	应收证券清算款	-			
3	应收股利	-			
4	应收利息	106.99			
5	其他应收款	-			
6	其他流动资产	-			
7	待摊费用	-			
8	其他	-			
9	合计	70354			
5.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细					
5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明					
5.11.6 报告期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明					
5.11.7 报告期末积极投资前十名股票中存在流通受限情况的说明					
序号	股票代码	股票名称	公允价值(元)	公允价值占净值比例(%)	流通受限情况说明
1	600485	四川成渝	77,604.48	0.21	重大事项停牌
2	601026	华能水电	29,469.36	0.08	新披露受限
5.11.8 投资组合报告附注的其他文字描述部分					
本基金无重大关联方、关联方之间及与计划可能有联系。					
5.12 基金资产变动情况					
					单位:元
报告期内基金资产变动					25,285,812.00
报告期内基金总申购份额					-
报告期内基金总赎回份额					4,000,000.00
报告期内基金资产变动对基金份额净值的影响(份额减少=“赎回”)					-
报告期内基金资产变动					21,285,812.00
5.7 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基金份额变动情况					
7.2 基金管理人持有本基金基金份额变动明细					
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					
8.2 影响投资者决策的其他重要信息					
根据我司于2019年7月10日发布的《大成基金管理有限公司公告变更公司更名公告》,经大成基金管理人第六届董事会议第三十三次会议审议通过,自2019年7月6日起,公司现更名为大成国际,具体详见公司相关公告。					
9 备查文件目录					
9.1 备查文件目录					
1、中国证监会核准设立大成中证100交易开放式指数证券投资基金的文件;					
2、大成中证100交易开放式指数证券投资基金的基金合同;					
3、大成中证100交易开放式指数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、大成基金在指定报刊上披露的公司公告。					
9.2 存底地址					
本季度报告存放在本基金管理人办公人员的住所。					
9.3 查询方式					
投资者可在指定的时间免费查阅,或登录本基金管理人网站http://www.dcfund.com.cn进行查询。					
大成基金管理有限公司					

大成债券投资基金

2019年第二季度报告

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	—	—
B	采矿业	20,685.85	0.06
C	制造业	77,604.48	0.21
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	—	—
E	建筑业	—	—
F	房地产业	—	—
G	批发和零售业	—	—
H	交通运输、仓储和邮政业	—	—
I	住宿和餐饮业	—	—
J	信息传输、软件和信息技术服务业	14,796.24	0.04
K	金融业	29,465.36	0.08
L	房地产业	—	—
M	租赁和商务服务业	—	—
N	科学研究和技术服务业	—	—
O	水利、环境和公共设施管理业	—	—
P	居民服务、修理和其他服务业	—	—
Q	教育	—	—
R	卫生和社会工作	—	—
S	文化、体育和娱乐业	—	—
T	综合	—	—
	合计	142,541.93	0.39

5.2.3 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

5.3 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

5.3.1 报告期末指数投资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	601318	中国平安	44,588	3,960,946.98	10.87
2	600519	贵州茅台	2,136	2,071,250.00	5.70
3	600808	新恒顺	44,261	1,568,110.78	4.28
4	601199	兴业银行	62,276	1,129,046.32	3.13
5	000961	格力电器	19,794	1,088,120.00	2.99
6	000333	美的集团	19,017	886,222.62	2.71
7	000858	五粮液	8,916	946,133.36	2.60
8	600276	恒顺达药	12,002	844,272.00	2.32
9	600887	伊利股份	26,142	839,944.23	2.31
10	601328	交通银行	133,486	816,928.20	2.26

5.3.2 报告期末主动投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名股票投资明细

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	600486	华信凯慈	13,473	77,604.48	0.21
2	601288	红塔集团	6,516	29,465.36	0.08
3	600090	南油能源	5,327	20,685.85	0.06
4	600166	中国通海	3,772	14,796.24	0.04

5.4 报告期末按债券品种和分类的债券投资组合

5.4.1 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

5.4.2 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

5.4.3 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

5.4.4 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

5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓量和损益明细