大成月添利理财债券型证券投资基金

2019年第一季度报告

基金管理人:大成基金管理有限公司
基金托管人:中国农业银行股份有限公司
报告送出日期:2019年4月19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。

基金托管人中国农业银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2019年4月18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2019年1月1日起至3月31日止。

§2 基金产品概况

基金简称	大成月添利理财债券
基金主代码	090021
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2012年9月20日
报告期末基金份额总额	14,311,755,223.30份
投资目标	以保持基金资产的安全性和适当流动性为首要目标，追求高于业绩比较基准的稳定收益。
投资策略	本基金通过平均剩余期限决策、类属配置、品种选择和其他行生工具投资策略四个层次进行投资管理，以实现超越投资基准的投资目标。
业绩比较基准	七天通知存款税后利率。
风险收益特征	本基金为债券型基金，为证券投资基金中的较低风险品种。本基金的风险和预期收益低于股票型基金、混合型基金，高于货币市场基金。
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	大成月添利债券A	大成月添利债券B	大成月添利债券E
下属分级基金的交易代码	090021	091021	001497
报告期末下属分级基金的份额总额	127,460,747.80份	14,166,843,496.89份	17,450,978.61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2019年1月1日－2019年3月31日		
	大成月添利债券A	大成月添利债券B	大成月添利债券E
1.本期已实现收益	1,024,928.44	114,435,696.39	137,198.74
2.本期利润	1,024,928.44	114,435,696.39	137,198.74
3.期末基金资产净值	127,460,747.80	14,166,843,496.89	17,450,978.61

注: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。由于本基金采用摊余成本法核算，因此，公允价值变动收益为零，本期已实现收益和本期利润的金额相等。

3.2 基金净值表现

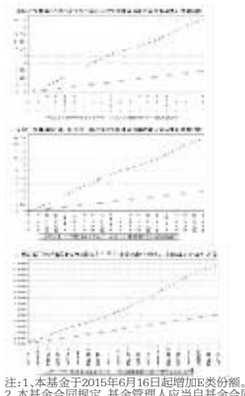
3.2.1 本报告期基金份额净值收益率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

大成月添利债券A						
阶段	净值收益率①	净值收益率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①－③	②－④
过去三个月	0.7412%	0.0004%	0.3329%	0.0000%	0.4083%	0.0004%
大成月添利债券B						
阶段	净值收益率①	净值收益率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①－③	②－④
过去三个月	0.8135%	0.0004%	0.3329%	0.0000%	0.4806%	0.0004%
大成月添利债券E						
阶段	净值收益率①	净值收益率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①－③	②－④
过去三个月	0.7414%	0.0004%	0.3329%	0.0000%	0.4085%	0.0004%

注:1、本基金根据每日基金收益情况，以基金净收益为基准，为投资者每日计算当日收益并分配，并在运作期期末集中支付。

2、本表净值收益率的计算所采取的运作周期，是以基金合同生效日为起始日并持有至报告期末的基金份额所经历的运作周期。

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



注:1、本基金于2015年6月16日起增加E类份额。

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		
陈会荣	本基金基金经理	2017年3月22日	－	12年	经济学学士。2004年7月至2007年10月就职于招商银行总行，任资产托管部年金小组组长，2007年10月加入大成基金管理有限公司，曾担任基金运营部基金助理会计师、基金运营部登记清算主管、固定收益总部助理研究员、固定收益总部基金经理助理。2016年8月6日起任大成景耀灵活配置混合型证券投资基金、大成丰财宝货币市场基金基金经理。2016年9月6日起任大成恒丰宝货币市场基金基金经理。2016年11月2日起任大成惠利纯债债券型证券投资基金、大成惠益纯债债券型证券投资基金基金经理。2017年3月1日起任大成惠祥定期开放纯债债券型证券投资基金基金经理。2017年3月22日起任大成月添利理财债券型证券投资基金、大成慧成货币市场基金和大成景旭纯债债券型证券投资基金基金经理。2018年3月14日起任大成月月盈短期理财债券型证券投资基金、大成添利宝货币市场基金基金经理。2018年8月17日起任大成现金增利货币市场基金基金经理。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。

4.2 管理人对投告期内本基金运作遵规守信情况的说明

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

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

4.3.2 异常交易行为的专项说明

报告期内，基金管理人旗下所有投资组合未发现存在异常交易行为。主动投资组合间股票交易不存在同日反向交易。主动型投资组合与指数型投资组合之间成指数型投资组合之间存在股票同日反向交易，但不存在参与交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量超过该股当日成交量5%的情形;主动投资组合间债券交易不存在同日反向交易。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 报告期内基金投资策略和运作分析

2019年一季度,相关数据显示国内经济仍处于探底阶段,货币政策导向仍处于合理充裕区间，税期及季末等关键时点成为短期扰动的关键窗口。纵观一季度，隔夜回购利率均值约为2.22%,较上季度下降9BP,14天回购加权利率均值约为2.83%,较上季度下降了22BP。1年期金融债收益率下行约20bp,1年AAA短期融资券下行约38bp,1年AA+短融品种下行约43bp。

本基金将以流动性为第一前提,根据组合特点在合理期限范围内配置组合资产,努力提高组合静态收益。

4.5 报告期内基金的业绩表现

本报告期大成月添利债券A基金份额净值收益率为0.7412%，本报告期大成月添利债券B基金份额净值收益率为0.8135%,本报告期大成月添利债券E基金份额净值收益率为0.7414%,同期业绩比较基准收益率为0.3329%。

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	固定收益投资	6,975,099,257.54	45.23
	其中:债券	6,975,099,257.54	45.23
	资产支持证券	－	－
2	买入返售金融资产	199,500,499.25	1.29
	其中:买断式回购的买入返售金融资产	－	－
3	银行存款和结算备付金合计	8,139,441,507.08	52.78
4	其他资产	108,411,291.40	0.70
5	合计	15,422,452,555.27	100.00

5.2 报告期债券回购融资情况

序号	项目	占基金资产净值比例(%)	
1	报告期内债券回购融资余额		17.27
	其中:买断式回购融资		－
序号	项目	金额(元)	占基金资产净值比例(%)
2	报告期末债券回购融资余额	1,091,014,451.87	7.62
	其中:买断式回购融资	－	－

债券正回购的资金余额超过基金资产净值的20%的说明

注:本基金合同约定:“本基金进入全国银行间同业市场进行债券回购的资金余额不得超过基金资产净值的40%”。本报告期内,本基金未发生超标情况。

5.3 基金投资组合平均剩余期限

5.3.1 投资组合平均剩余期限基本情况

项目	天数
报告期末投资组合平均剩余期限	97
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	135
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	71

报告期内投资组合平均剩余期限超过120天情况说明

注:本基金合同约定:“本基金投资组合的平均剩余期限在每个交易日均不得超过150天”。本报告期内,本基金未发生超标情况。

5.3.2 报告期末投资组合平均剩余期限分布比例

序号	平均剩余期限	各期限资产占基金资产净值的比例(%)	各期限负债占基金资产净值的比例(%)
1	30天以内	6.37	7.62
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	－	－
2	30天(含)—60天	11.61	－
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	－	－
3	60天(含)—90天	69.94	－
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	－	－
4	90天(含)—120天	1.40	－
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	－	－
5	120天(含)—397天(含)	17.69	－
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	－	－
合计		107.01	7.62

5.4 报告期内投资组合平均剩余存续期超过240天情况说明

无。

5.5 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	摊余成本(元)	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	228,974,697.15	1.60
2	央行票据	－	－
3	金融债券	545,654,792.32	3.81
	其中:政策性金融债	545,654,792.32	3.81
4	企业债券	－	－
5	企业短期融资券	－	－
6	中期票据	－	－
7	同业存单	6,200,469,768.07	43.32
8	其他	－	－
9	合计	6,975,099,257.54	48.74
10	剩余存续期超过397天的浮动利率债券	－	－

5.6 报告期末按摊余成本占基金资产净值比例大小排序的前十名债券投资明细

序号	债券代码	债券名称	债券数量(张)	摊余成本(元)	占基金资产净值比例(%)
1	111872114	18徽商银行CD200	5,000,000	496,213,618.87	3.47
2	180407	18农发07	4,270,000	427,555,142.68	2.99
3	111993950	19天津银行CD023	4,000,000	397,440,010.62	2.78
4	111993855	19长沙银行CD055	3,000,000	298,112,482.18	2.08
5	111819458	18恒丰银行CD458	2,500,000	248,927,505.19	1.74
6	111916070	19上海银行CD070	2,500,000	248,569,797.47	1.74
7	111821279	18渤海银行CD279	2,400,000	238,748,892.77	1.67
8	199911	19国开债11	2,200,000	219,014,914.92	1.53
9	111884252	18南京银行CD107	2,000,000	198,775,304.33	1.39
10	111920042	19广发银行CD042	2,000,000	198,769,662.57	1.39

5.7 “影子定价”与“摊余成本法”确定的基金资产净值的偏离

项目	偏离情况
报告期内偏离度的绝对值在0.25(含)－0.5%间的次数	0
报告期内偏离度的最高值	0.0784%
报告期内偏离度的最低值	0.0347%
报告期内每个工作日偏离度的绝对值的简单平均值	0.0579%

报告期内负偏离度的绝对值达到0.25%情况说明

无。

报告期内正偏离度的绝对值达到0.5%情况说明

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十名资产支持证券投资明细

无。

5.9 投资组合报告附注

5.9.1 本基金估值采用摊余成本法估值,即估值对象以买入成本列示,按票面利率或协议利率并考虑其买入时的溢价与折价,在其剩余存续期内按照实际利率法每日计提损益。本基金通过每日计算基金收益并分配的方式,使基金份额净值保持在人民币1.00元

5.9.2 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一18渤海银行CD279(111821279.IB)的发行主体渤海银行股份有限公司于2018年11月9日因理财及自营投资资金违规用于缴交上地款等,受到中国银行保险监督管理委员会处罚(银保监银罚决字(2018)9号)。本基金认为,对渤海银行的处罚不会对其投资价值构成实质性负面影响。

5.9.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	－
2	应收证券清算款	－
3	应收利息	108,054,406.40
4	应收申购款	356,885.00
5	其他应收款	－
6	待摊费用	－
7	其他	－
8	合计	108,411,291.40

5.9.4 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	大成月添利债券A	大成月添利债券B	大成月添利债券E
报告期期初基金份额总额	189,854,088.69	14,053,448,932.74	20,265,811.14
报告期期间基金总申购份额	37,178,201.74	123,550,407.26	7,050,551.83
报告期期间基金总赎回份额	99,571,542.63	10,155,843.11	9,865,384.36
报告期期末基金份额总额	127,460,747.80	14,166,843,496.89	17,450,978.61

§7 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(份)	交易金额(元)	适用费率(%)
1	红利发放	2019-03-22	610,245.74	610,245.74	－
合计			610,245.74	610,245.74	

注:红利发放为期间合计数。本基金为短期理财基金,故申购、赎回费率均为0.00%。

§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	序号	报告期内持有基金份额变化情况				报告期末持有基金情况	
		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	20190101－20190331	3,560,949,680.27	34,644,127.19	－	3,595,593,807.46	25.12
	2	20190101－20190331	3,109,529,054.82	25,288,194.53	－	3,134,817,249.35	21.9
个人	－	－	－	－	－	－	－

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月添利理财债券型证券投资基金的文件;

2、《大成月添利理财债券型证券投资基金基金合同》;

3、《大成月添利理财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、本报告期内在指定报刊上披露的各种公告原稿。

9.2 存放地点

本季度报告存放在本基金管理人和托管人的办公住所。

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
2019年4月19日

大成债券投资基金

2019年第一季度报告

基金管理人:大成基金管理有限公司
基金托管人:中国农业银行股份有限公司
报告送出日期:2019年4月19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。

基金托管人中国农业银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2019年4月18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2019年1月1日起至3月31日止。

§2 基金产品概况

基金简称	大成债券
基金主代码	090002
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2003年6月12日
报告期末基金份额总额	3,806,630,678.56份
投资目标	在力保本金安全和保持资产流动性的基础上追求资产的长期稳定增值
投资策略	通过整体资产配置、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。类属资产部分按照修正的均值－方差模型在交易所国债、交易所企业债、银行间国债、银行间金融债之间实行最优配置。
业绩比较基准	中国债券总指数
风险收益特征	本基金为较低风险、较低收益的债券型基金产品,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
下属分级基金的交易代码	090002	092002
下属分级基金的前端交易代码	090002	－
下属分级基金的后端交易代码	091002	－
报告期末下属分级基金的份额总额	2,836,551,627.55份	970,079,051.01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(2019年1月1日－2019年3月31日)	
	大成债券A/B	大成债券C
1.本期已实现收益	36,610,451.69	13,017,846.23
2.本期利润	51,967,423.85	18,833,538.70
3.加权平均基金份额本期利润	0.0243	0.0244
4.期末基金资产净值	2,979,015,432.99	1,034,905,146.64
5.期末基金份额净值	1.0502	1.0668

注:1、所述基金业绩指标不包括持有人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。

2、本表净值收益率的计算所采取的运作周期,是以基金合同生效日为起始日并持有至报告期末的基金份额所经历的运作周期。

3.2 基金净值表现

3.2.1 本报告期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

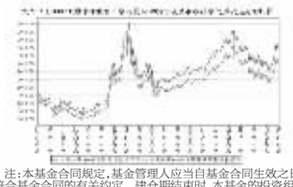
大成债券A/B

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	2.47%	0.19%	1.11%	0.09%	1.36%	0.10%

大成债券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	2.40%	0.19%	1.11%	0.09%	1.29%	0.10%

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



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有关约定。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,固定收益总部总监	2009年5月23日	－	17年	经济学硕士,曾任职于中银万国证券股份有限公司,南京商业银行资金营运中心。2005年4月加入大成基金管理有限公司,曾担任大成货币市场基金基金经理助理,现任固定收益总部总监。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日起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。具有基金从业资格。国籍:中国

注:1、任职日期、离任日期为本基金管理人作出决定之日。

2、证券从业年限的计算标准遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

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

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

4.3.2 异常交易行为的专项说明

报告期内,基金管理人旗下所有投资组合未发现存在异常交易行为。主动投资组合间股票交易不存在同日反向交易。主动型投资组合与指数型投资组合之间成指数型投资组合之间存在股票同日反向交易,但不存在参与交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量超过该股当日成交量5%的情形;主动投资组合间债券交易不存在同日反向交易。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 报告期内基金投资策略和运作分析

2019年1季度,经济预期有所变化,尽管目前下行的趋势仍未逆转,但开年基建有回升迹象,房地产在施工的带动下短期仍有支撑,更为重要的是1月社融增速开始见底回升,前期宽信用的政策开始逐渐收效,未来社融增速大概率脱去年单边下行趋势,开始震荡回升,自此信用周期企稳。货币政策方面,总体维持了去年4季度较为宽松的基调,但并未进一步加码;通胀方面,PPI维持低位,CPI在猪价的带动下,有较强的回升预期,但短期内仍然较为温和。海外方面则总体对债券市场较为有利,欧美主要国家央行纷纷转鸽,海外主要发达国家长债收益率下行明显,全球经济衰退预期降温。

在各种多空因素的交织下,1季度债券收益率总体呈震荡走势,信用债表现好于利率债,10年国开债收益率下行6bp,3年AAA中票收益率下行19BP。具体到市场指数方面,1季度中债综合指数上涨1.16%,中债金融债券总指数上涨0.99%,中债信用债总指数上涨1.48%。

权益方面,受基本面因素影响1季度权益大涨,一方面是无风险利率维持低位,另一方面前期宽信用政策开始见效,市场风险偏好明显改变,1季度上证综指上涨23.93%,深圳成指上涨36.84%,创业板指上涨35.43%。中证转债指数上涨17.48%。

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	10,030,000.00	0.25
2	央行票据	－	－
3	金融债券	805,113,059.70	20.06
	其中:政策性金融债	805,113,059.70	20.06
4	企业债券	790,232,735.70	19.69
5	企业短期融资券	593,294,000.00	14.78
6	中期票据	1,192,004,000.00	29.70
7	可转债(可交换债)	520,468,873.22	12.97
8	同业存单	－	－
9	其他	－	－
10	合计	3,911,142,668.62	97.44

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	170205	17国开05	1,000,000	101,240,000.00	2.52
2	101754060	17丰台国资MTN001	900,000	92,214,000.00	2.30
3	041800166	18成都高新CP001	800,000	80,776,000.00	2.01
4	101552044	15乐园万家MTN001	800,000	80,712,000.00	2.01
5	123006	东财转债	446,082	75,775,949.34	1.89

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的发行主体未出现本期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。

5.11.2 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。

无。

5.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	130,135.29
2	应收证券清算款	17,663,324.94
3	应收股利	－
4	应收利息	72,385,779.20
5	应收申购款	30,213,890.14
6	其他应收款	－
7	待摊费用	－
8	其他	－
9	合计	120,393,129.57

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	123006	东财转债	75,775,949.34	1.89
2	113015	隆基转债	32,920,174.40	0.82
3	113018	常熟转债	31,788,062.60	0.79
4	113011	光大转债	31,689,186.90	0.79
5	127005	长证转债	27,760,310.85	0.69
6	113014	林洋转债	18,750,158.20	0.47
7	128044	岭南转债	13,784,995.84	0.34
8	113517	曙光转债	10,559,393.60	0.26
9	113013	国君转债	10,533,753.60	0.26
10	110038	济川转债	10,219,249.80	0.25
11	132013	17宝武EB	10,104,930.00	0.25
12	132005	15国资EB	10,053,007.00	0.25
13	128013	洪涛转债	9,865,000.00	0.25
14	128045	机电转债	9,280,289.70	0.23
15	113504	艾华转债	6,961,640.20	0.17
16	110045	海澜转债	6,653,902.00	0.17
17	113507	天马转债	6,267,282.00	0.16
18	113512	景旺转债	6,050,322.80	0.15
19	128016	雨虹转债	5,875,704.90	0.15
20	128027	崇达转债	5,717,334.70	0.14
21	113518	顾家转债	5,527,350.00	0.14
22	110043	无锡转债	4,392,000.00	0.11
23	123008	康泰转债	3,611,032.05	0.09
24	132004	15国盛EB	1,958,800.00	0.05
25	128035	大族转债	1,688,941.95	0.04
26	113508	新风转债	1,682,621.40	0.04
27	110044	广电转债	1,609,700.00	0.04
28	113515	高能转债	1,422,788.40	0.04
29	128033	迪龙转债	538,500.00	0.01
30	113019	玲珑转债	451,880.00	0.01
31	110041	蒙电转债	374,842.00	0.01
32	128034	江银转债	366,093.00	0.01
33	128030	天康转债	338,549.40	0.01
34	128042	凯中转债	246,394.72	0.01
35	110040	生益转债	241,380.00	0.01
36	110034	九州转债	220,840.00	0.01

5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

无。

5.11.6 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。

§6 开放式基金份额变动

单位:份

项目	大成债券A/B	大成债券C
报告期期初基金份额总额	1,427,020,878.30	533,896,538.29
报告期期间基金总申购份额	1,925,261,872.63	1,116,892,682.58
减:报告期期间基金总赎回份额	515,731,123.38	680,710,169.86
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	2,836,551,627.55	970,079,051.01

§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

无。

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

无。

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、本报告期内在指定报刊上披露的各种公告原稿。

9.2 存放地点

本季度报告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
2019年4月19日

大成中证100交易型开放式指数证券投资基金

2019年第一季度报告

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4月19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2019年4月18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2019年1月1日起至3月31日止。

§2 基金产品概况

基金简称	大成中证100ETF
场内简称	100ETF
基金主代码	159923
交易代码	159923
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2013年2月7日
报告期末基金份额总额	25,285,812.00份
投资目标	本基金进行被动式指数化投资,紧密跟踪标的指数,追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化。
投资策略	本基金为被动式指数基金,采取完全复制法,即按照标的指数的成份股组成及其权重构建股票投资组合，并根据标的指数成份股及其权重的变动进行相应调整。 当预期成份股发生调整和成份股发生配股、增发、分红等行为时，或因基金的申购和赎回等对本基金跟踪标的指数的效果可能带