

大成债券投资基金

2023 年第 1 季度报告

2023 年 3 月 31 日

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：2023 年 4 月 21 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 2023 年 04 月 20 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 2023 年 01 月 01 日起至 03 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	1,622,055,031.93 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	1,049,406,764.36 份	572,648,267.57 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（2023 年 1 月 1 日-2023 年 3 月 31 日）	
	大成债券 A/B	大成债券 C
1. 本期已实现收益	3,833,054.80	2,188,204.02
2. 本期利润	24,084,083.55	17,757,228.30
3. 加权平均基金份额本期利润	0.0232	0.0252
4. 期末基金资产净值	1,109,666,575.31	613,900,207.17
5. 期末基金份额净值	1.0574	1.0720

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、本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用和信用减值损失后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

大成债券 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	2.14%	0.18%	0.67%	0.04%	1.47%	0.14%
过去六个月	0.47%	0.17%	0.93%	0.09%	-0.46%	0.08%
过去一年	1.96%	0.18%	3.44%	0.08%	-1.48%	0.10%
过去三年	11.95%	0.24%	9.51%	0.10%	2.44%	0.14%
过去五年	28.76%	0.21%	26.95%	0.11%	1.81%	0.10%
自基金合同 生效起至今	247.23%	0.29%	105.11%	0.15%	142.12%	0.14%

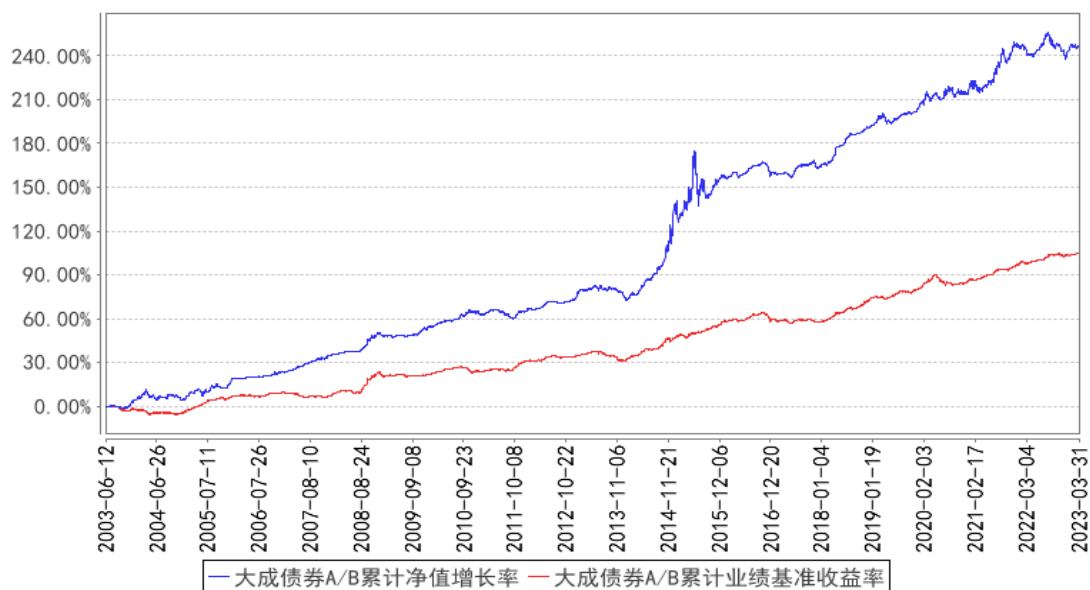
大成债券 C

阶段	净值增长率①	净值增长率	业绩比较基	业绩比较基	①－③	②－④
----	--------	-------	-------	-------	-----	-----

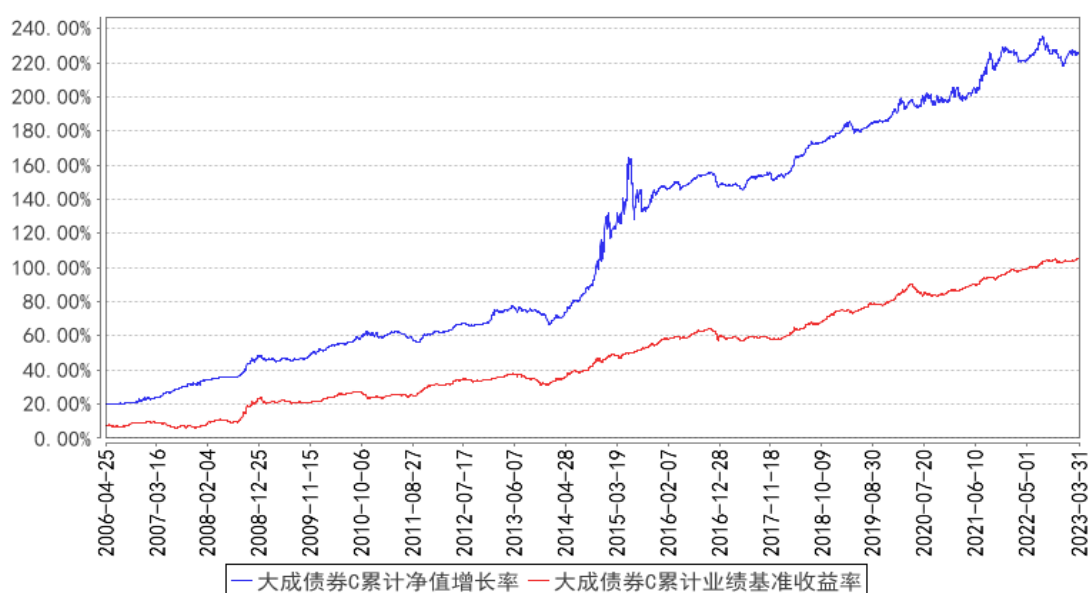
		标准差②	准收益率③	准收益率标准差④		
过去三个月	2.07%	0.18%	0.67%	0.04%	1.40%	0.14%
过去六个月	0.32%	0.17%	0.93%	0.09%	-0.61%	0.08%
过去一年	1.65%	0.18%	3.44%	0.08%	-1.79%	0.10%
过去三年	10.95%	0.24%	9.51%	0.10%	1.44%	0.14%
过去五年	26.84%	0.21%	26.95%	0.11%	-0.11%	0.10%
自基金合同生效起至今	226.34%	0.30%	105.11%	0.16%	121.23%	0.14%

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

大成债券A/B累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



大成债券C累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：1、本基金于 2006 年 4 月 24 日起推出持续性收费模式，将前端收费模式定义为 A 类收费模式，后端收费模式定义为 B 类收费模式，二者对应的基金份额简称“大成债券 A/B”；将持续性收费模式定义为 C 类收费模式，对应的基金份额简称“大成债券 C”。

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		
王立	本基金基金经理，总经理助理、固定收益总部总监	2009 年 5 月 23 日	—	21 年	中南财经大学经济学硕士。曾就职于申银万国证券股份有限公司、南京市商业银行资金营运中心。2005 年 4 月加入大成基金管理有限公司，曾担任固定收益总部总监助理、副总监、总监，现任总经理助理兼固定收益总部总监。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 日至 2020 年 10 月 15 日任大成景兴信用债债券型证券投资基金基金经理。 2014 年 9 月 3 日至 2016 年 11 月 23 日任大成景丰债券型证券投资基金（LOF）基金经理。2016 年 2 月 3 日至 2018 年 4 月 2 日任大成慧成货币市场基金基金经理。2020 年 12 月 16 日起任大成景盛一年定期开放债券型证券投资基金基金经理。2021 年 8 月 17 日起任大成元吉增利债券型证券投资基金基金经理。具有基金从业资格。国籍：中国
--	--	--	--	--	--

注：1、任职日期、离任日期为本基金管理人作出决定之日。

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

4.1.1 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理同时管理的产品情况

无。

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

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

4.3 公平交易专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

报告期内，公司严格执行了公平交易的原则和制度。公司运用统计分析方法和工具，对旗下所有投资组合连续 4 个季度的日内、3 日内及 5 日内股票及债券交易同向交易价差进行分析，针对同一基金经理管理的多个投资组合及公私募兼任基金经理管理的多个投资组合的投资交易行为加强了公平交易监测与分析，包括对不同时间窗下（同日、3 日、5 日、10 日）反向交易和同向交易价差监控的分析。分析结果表明：债券交易同向交易频率较低；部分股票同向交易溢价率较大主要来源于投资策略差异、市场因素（如个股当日价格振幅较高）及组合经理交易时机选择，即投资组合成交时间不一致以及成交价格的日内较大变动导致个别些组合间的成交价格差异较大，同时结合交易价差专项统计分析，未发现违反公平交易原则的异常情况。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

报告期内，公司旗下所有投资组合未发现存在异常交易行为。主动投资组合间股票交易存在 1 笔同日反向交易，原因为合规比例调整。主动型投资组合与指数型投资组合之间或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存在 1 笔同日反向交易，原因为流动性需要。投资组合间相邻交易日反向交易的市场成交比例、成交均价等交易结果数据表明该类交易不对市场产生重大影响，无异常。

4.4 报告期内基金的投资策略和运作分析

回顾一季度，年初受到防疫政策调整和疫情好转的影响，经济如期开启修复进程，但经济结构上有所分化，服务业表现好于制造业，经济距离恢复到疫情前的正常水平仍有相当长的距离，而稳增长政策较为温和。3 月海外银行业风险意外发酵，全球风险情绪回落。债市对经济的强复苏预期逐步转为温和复苏，央行降准使得市场对资金面的预期改善，长端利率温和回落。但在流动性环境整体合理充裕的背景下，关键时点的资金波动较 2022 年明显加大。

债券市场方面，一季度中债综合指数上涨 0.95%，中债金融债券总指数上涨 0.68%，中债信用债总指数上涨 1.48%，长端利率先上后下，10 年国债在 2.81%-2.93% 之间窄幅波动，季度末较季度初上行 2BP。信用债方面，得益于年初较高的信用利差水平和友好的供需关系，信用债一季度演绎了独立行情，收益率及利差均大幅下行，利差的压缩呈现先高资质后中等资质、先短端后长端的特征。

权益市场年初以来呈现普涨局面，1 月受益于疫情后我国经济恢复情况良好，叠加美国加息预期下降，美元走弱，人民币升值，北向大幅净买入。但 2-3 月份市场开始分化，一方面市场对于经济复苏的强度开始出现分歧，另一方面海外大厂带动 AI 等技术爆发提供结构性机会。转债市场的风险偏好年初大幅提升，整体一季度尤其是一月份高价转债奠定了大幅领先的基础。回顾一季度的整体表现，创业板指上涨 2.25%，沪深 300 上涨 4.63%，中证 500 上涨 8.11%，中证转债上涨 3.53%。

本基金在严格控制风险的基础上，采取积极的组合策略和严格的资产选择原则进行投资运作。2023 年一季度本基金主动进行大类资产配置调整，重点增持了可转债资产，纯债部分优先配置信用债资产，但整体久期保持中性偏谨慎。我们高度重视信用风险，主要持有中高等级信用债，并小幅提升高等级信用债投资比例，获得较好的持有期收益。可转债资产是一季度组合的重要收益贡献来源，四季度时，我们从大类资产的角度判断权益类资产的风险收益已显著好于纯债类资产，考虑到跨年后转债资产的机会，采取了提前左侧布局，该策略在一季度迎来收获季。但不可忽视的是，权益市场信心尚未充分恢复，而溢价率仍处于历史高位，转债在快速上涨后进入

区间震荡。

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

4.5 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末大成债券 A/B 的基金份额净值为 1.0574 元，本报告期基金份额净值增长率为 2.14%；截至本报告期末大成债券 C 的基金份额净值为 1.0720 元，本报告期基金份额净值增长率为 2.07%。同期业绩比较基准收益率为 0.67%。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

无。

§5 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额（元）	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	36,234,712.77	1.59
	其中：股票	36,234,712.77	1.59
2	基金投资	—	—
3	固定收益投资	2,199,604,473.87	96.60
	其中：债券	2,199,604,473.87	96.60
	资产支持证券	—	—
4	贵金属投资	—	—
5	金融衍生品投资	—	—
6	买入返售金融资产	—	—
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	—	—
7	银行存款和结算备付金合计	16,185,225.46	0.71
8	其他资产	25,089,139.73	1.10
9	合计	2,277,113,551.83	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	—	—
B	采矿业	—	—

C	制造业	32,426,867.04	1.88
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	—	—
J	金融业	—	—
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	3,807,845.73	0.22
N	水利、环境和公共设施管理业	—	—
O	居民服务、修理和其他服务业	—	—
P	教育	—	—
Q	卫生和社会工作	—	—
R	文化、体育和娱乐业	—	—
S	综合	—	—
	合计	36,234,712.77	2.10

5.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

无。

5.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的股票投资明细

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

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	002078	太阳纸业	1,498,166	18,262,643.54	1.06
2	603298	杭叉集团	491,907	9,680,729.76	0.56
3	300416	苏试试验	137,517	3,807,845.73	0.22
4	600487	亨通光电	159,809	2,413,115.90	0.14
5	603667	五洲新春	105,096	1,332,617.28	0.08
6	002258	利尔化学	42,968	737,760.56	0.04

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	365,851,152.41	21.23
2	央行票据	—	—
3	金融债券	308,865,941.92	17.92
	其中：政策性金融债	154,675,273.97	8.97

4	企业债券	405,907,957.37	23.55
5	企业短期融资券	—	—
6	中期票据	658,851,567.48	38.23
7	可转债（可交换债）	460,127,854.69	26.70
8	同业存单	—	—
9	其他	—	—
10	合计	2,199,604,473.87	127.62

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	210316	21 进出 16	1,500,000	154,675,273.97	8.97
2	210008	21 付息国债 08	800,000	81,819,989.04	4.75
3	229965	22 贴现国债 65	600,000	59,862,514.29	3.47
4	101782001	17 河钢集 MTN007	500,000	51,176,178.08	2.97
5	220023	22 付息国债 23	500,000	50,236,452.05	2.91

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

无。

5.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

无。

5.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

无。

5.9 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.9.1 本期国债期货投资政策

无。

5.9.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

无。

5.9.3 本期国债期货投资评价

无。

5.10 投资组合报告附注

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

本基金投资的前十名证券的发行主体本期没有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。

5.10.2 基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库

无。

5.10.3 其他资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	41,863.24
2	应收证券清算款	24,978,717.32
3	应收股利	—
4	应收利息	—
5	应收申购款	68,559.17
6	其他应收款	—
7	其他	—
8	合计	25,089,139.73

5.10.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

序号	债券代码	债券名称	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	113650	博 22 转债	13,294,996.84	0.77
2	127058	科伦转债	12,474,531.82	0.72
3	113602	景 20 转债	12,460,838.71	0.72
4	110085	通 22 转债	11,594,919.89	0.67
5	128140	润建转债	11,229,329.82	0.65
6	127053	豪美转债	10,793,740.54	0.63
7	110055	伊力转债	10,770,957.32	0.62
8	127064	杭氧转债	10,017,365.77	0.58
9	110088	淮 22 转债	9,685,120.26	0.56
10	127024	盈峰转债	8,893,000.99	0.52
11	113598	法兰转债	8,800,193.93	0.51
12	110081	闻泰转债	8,057,098.79	0.47
13	123098	一品转债	7,642,517.22	0.44
14	113647	禾丰转债	7,240,483.52	0.42
15	113626	伯特转债	7,216,998.47	0.42

16	110068	龙净转债	7,201,049.73	0.42
17	111004	明新转债	6,883,689.51	0.40
18	123071	天能转债	6,636,926.57	0.39
19	128141	旺能转债	5,837,737.68	0.34
20	113655	欧 22 转债	5,683,516.27	0.33
21	113055	成银转债	5,643,580.68	0.33
22	110053	苏银转债	5,606,905.53	0.33
23	123025	精测转债	5,285,161.60	0.31
24	110090	爱迪转债	5,270,498.73	0.31
25	113582	火炬转债	5,127,960.58	0.30
26	123107	温氏转债	5,029,902.29	0.29
27	118014	高测转债	5,008,659.98	0.29
28	128142	新乳转债	4,816,228.91	0.28
29	113623	凤 21 转债	4,809,710.98	0.28
30	113658	密卫转债	4,664,774.41	0.27
31	113025	明泰转债	4,611,633.05	0.27
32	113585	寿仙转债	4,601,557.92	0.27
33	113654	永 02 转债	4,545,016.61	0.26
34	127066	科利转债	4,378,708.38	0.25
35	110076	华海转债	4,249,132.72	0.25
36	127073	天赐转债	4,240,004.86	0.25
37	113534	鼎胜转债	4,164,164.38	0.24
38	123099	普利转债	3,978,445.32	0.23
39	127072	博实转债	3,928,061.41	0.23
40	110086	精工转债	3,843,975.03	0.22
41	113047	旗滨转债	3,842,901.57	0.22
42	127069	小熊转债	3,673,203.28	0.21
43	128078	太极转债	3,634,749.45	0.21
44	123114	三角转债	3,478,758.54	0.20
45	113046	金田转债	3,445,974.98	0.20
46	113636	甬金转债	3,419,129.38	0.20
47	110047	山鹰转债	3,219,408.09	0.19
48	123156	博汇转债	3,209,112.42	0.19
49	118003	华兴转债	3,171,116.22	0.18
50	123085	万顺转 2	3,086,475.43	0.18
51	113504	艾华转债	2,929,128.99	0.17
52	127033	中装转 2	2,899,873.93	0.17
53	110048	福能转债	2,895,096.91	0.17
54	110083	苏租转债	2,801,727.29	0.16
55	113615	金诚转债	2,752,071.16	0.16
56	127055	精装转债	2,734,158.14	0.16
57	113057	中银转债	2,709,750.28	0.16

58	123158	宙邦转债	2,667,289.98	0.15
59	127006	敖东转债	2,597,755.01	0.15
60	128135	洽洽转债	2,517,246.23	0.15
61	110064	建工转债	2,458,511.72	0.14
62	128136	立讯转债	2,448,498.33	0.14
63	113024	核建转债	2,410,012.16	0.14
64	113053	隆 22 转债	2,312,551.09	0.13
65	110079	杭银转债	2,303,035.81	0.13
66	127061	美锦转债	2,302,394.04	0.13
67	123078	飞凯转债	2,270,938.08	0.13
68	110062	烽火转债	2,218,883.58	0.13
69	127035	濮耐转债	2,103,201.72	0.12
70	113049	长汽转债	1,889,795.95	0.11
71	128034	江银转债	1,836,000.90	0.11
72	110045	海澜转债	1,738,749.58	0.10
73	113542	好客转债	1,693,759.66	0.10
74	128125	华阳转债	1,685,252.91	0.10
75	113641	华友转债	1,534,588.93	0.09
76	127036	三花转债	1,530,061.73	0.09
77	123088	威唐转债	1,517,521.15	0.09
78	113050	南银转债	1,508,937.68	0.09
79	127038	国微转债	1,498,786.30	0.09
80	111002	特纸转债	1,287,949.32	0.07
81	113044	大秦转债	1,278,217.18	0.07
82	127030	盛虹转债	1,237,738.75	0.07
83	123063	大禹转债	1,191,365.89	0.07
84	123083	朗新转债	1,176,247.37	0.07
85	127032	苏行转债	1,170,249.39	0.07
86	111006	嵘泰转债	1,144,558.85	0.07
87	123144	裕兴转债	1,108,453.71	0.06
88	118020	芳源转债	1,100,256.71	0.06
89	113609	永安转债	1,035,834.87	0.06
90	111000	起帆转债	1,017,102.52	0.06
91	118013	道通转债	1,011,204.72	0.06
92	128017	金禾转债	989,539.45	0.06
93	128121	宏川转债	980,573.11	0.06
94	127047	帝欧转债	974,199.07	0.06
95	123092	天壕转债	952,151.01	0.06
96	111005	富春转债	952,113.55	0.06
97	123121	帝尔转债	921,264.86	0.05
98	123132	回盛转债	805,730.98	0.05
99	127063	贵轮转债	800,755.95	0.05

100	127056	中特转债	690,424.61	0.04
101	127043	川恒转债	621,420.37	0.04
102	118019	金盘转债	563,558.14	0.03
103	110057	现代转债	529,050.60	0.03
104	123130	设研转债	527,442.17	0.03
105	113045	环旭转债	523,018.73	0.03
106	127022	恒逸转债	506,516.37	0.03
107	127067	恒逸转 2	503,488.13	0.03
108	128105	长集转债	502,535.59	0.03
109	113519	长久转债	499,892.63	0.03
110	110072	广汇转债	497,227.84	0.03
111	127042	嘉美转债	494,197.35	0.03
112	128071	合兴转债	493,958.26	0.03
113	127027	靖远转债	487,196.87	0.03
114	128035	大族转债	483,727.18	0.03
115	113644	艾迪转债	477,133.17	0.03
116	128023	亚太转债	469,310.42	0.03
117	113625	江山转债	394,966.55	0.02
118	123056	雪榕转债	380,585.78	0.02
119	123148	上能转债	377,602.68	0.02
120	123133	佩蒂转债	314,853.77	0.02
121	127018	本钢转债	300,493.49	0.02
122	128116	瑞达转债	265,937.33	0.02
123	113643	风语转债	250,263.96	0.01
124	113062	常银转债	236,399.00	0.01
125	113060	浙 22 转债	219,919.61	0.01
126	113633	科沃转债	211,591.10	0.01
127	113563	柳药转债	151,543.36	0.01

5.10.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

无。

5.10.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入原因，分项之和与合计可能有尾差。

§6 开放式基金份额变动

单位：份

项目	大成债券 A/B	大成债券 C
报告期期初基金份额总额	1,141,410,229.47	873,377,305.41

报告期期间基金总申购份额	66,989,968.27	8,543,870.86
减:报告期期间基金总赎回份额	158,993,433.38	309,272,908.70
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	1,049,406,764.36	572,648,267.57

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

单位: 份

项目	大成债券 A/B	大成债券 C
报告期期初管理人持有的本基金份额	16,243,086.10	-
报告期期间买入/申购总份额	9,486,717.27	-
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	25,729,803.37	-
报告期期末持有的本基金份额占基金总份额比例(%)	1.59	-

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(份)	交易金额(元)	适用费率(%)
1	申购	2023-03-16	9,486,717.27	10,000,000.00	-
合计			9,486,717.27	10,000,000.00	

注: 1、申购或者购买基金份额的, 金额为正; 赎回或者卖出基金份额的, 金额为负。

2、合计数以绝对值填列。

3、红利发放为期间合计数。

4、本基金相关费率均依照法律文件规定收取。

§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

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

高级管理人员变更的公告》。

§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、本报告期内在规定报刊上披露的各种公告原稿。

9.2 存放地点

本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

2023 年 4 月 21 日