

大成债券投资基金

2023 年第 2 季度报告

2023 年 6 月 30 日

基金管理人：大成基金管理有限公司

基金托管人：中国农业银行股份有限公司

报告送出日期：2023 年 7 月 20 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 07 月 19 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 04 月 01 日起至 06 月 30 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	1,628,690,629.72 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	1,060,315,075.82 份	568,375,553.90 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 4 月 1 日-2023 年 6 月 30 日）	
	大成债券 A/B	大成债券 C
1. 本期已实现收益	2, 578, 899. 96	923, 576. 34
2. 本期利润	2, 774, 050. 34	974, 142. 60
3. 加权平均基金份额本期利润	0. 0026	0. 0018
4. 期末基金资产净值	1, 123, 801, 500. 67	610, 277, 157. 23
5. 期末基金份额净值	1. 0599	1. 0737

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	0. 24%	0. 18%	1. 86%	0. 06%	-1. 62%	0. 12%
过去六个月	2. 39%	0. 18%	2. 55%	0. 05%	-0. 16%	0. 13%
过去一年	0. 20%	0. 19%	4. 39%	0. 08%	-4. 19%	0. 11%
过去三年	11. 92%	0. 25%	12. 47%	0. 09%	-0. 55%	0. 16%
过去五年	23. 64%	0. 21%	25. 88%	0. 10%	-2. 24%	0. 11%
自基金合同 生效起至今	248. 05%	0. 29%	108. 93%	0. 15%	139. 12%	0. 14%

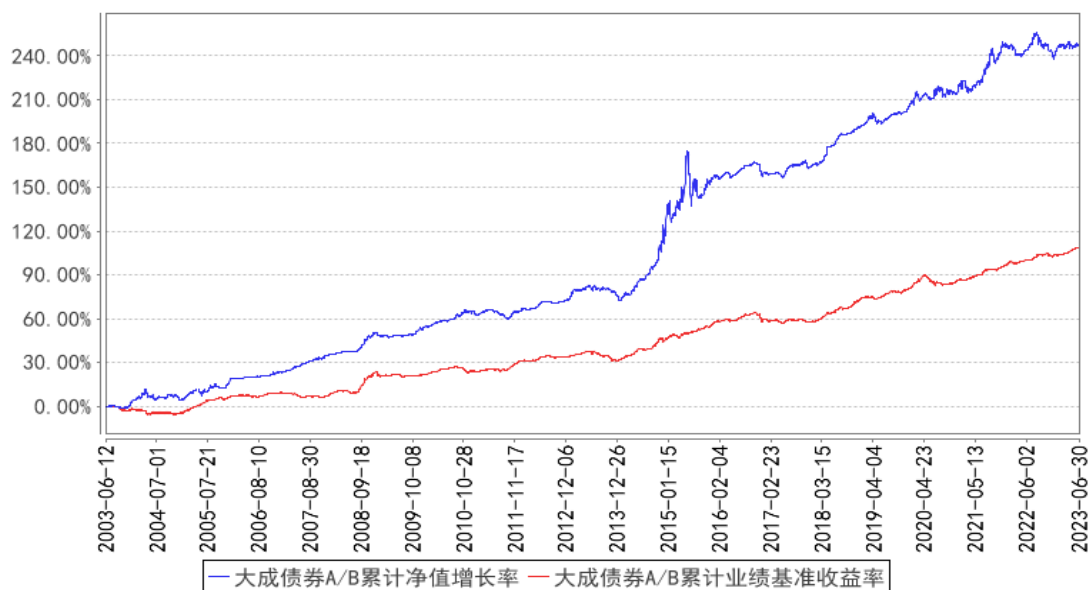
大成债券 C

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
----	--------	-------	-------	-------	-----	-----

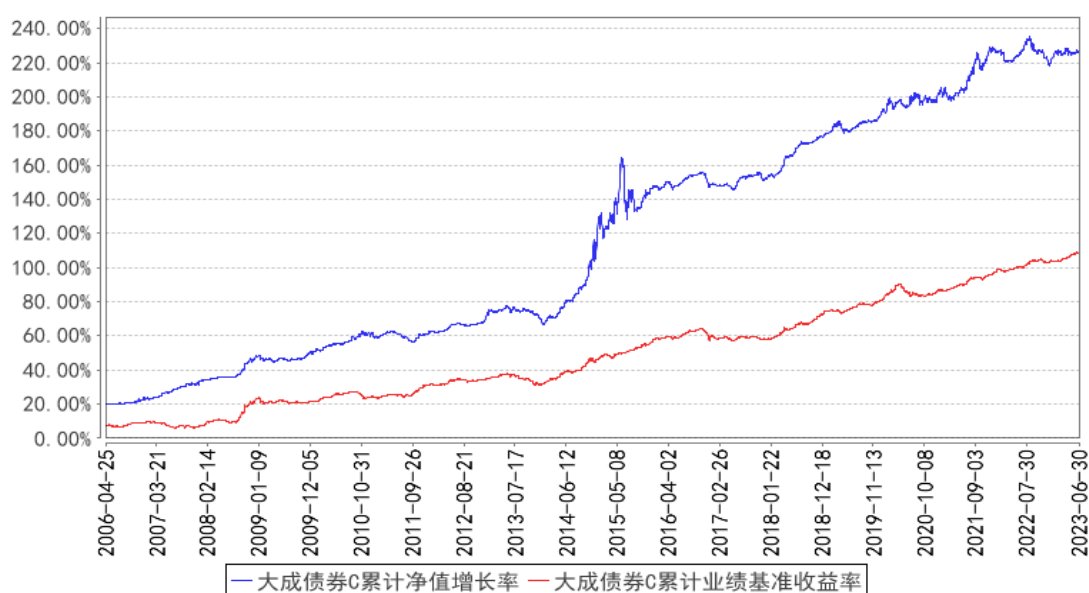
		标准差②	准收益率③	准收益率标准差④		
过去三个月	0.16%	0.18%	1.86%	0.06%	-1.70%	0.12%
过去六个月	2.23%	0.18%	2.55%	0.05%	-0.32%	0.13%
过去一年	-0.10%	0.19%	4.39%	0.08%	-4.49%	0.11%
过去三年	10.92%	0.25%	12.47%	0.09%	-1.55%	0.16%
过去五年	21.81%	0.21%	25.88%	0.10%	-4.07%	0.11%
自基金合同生效起至今	226.86%	0.29%	108.93%	0.16%	117.93%	0.13%

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。公司旗下所有投资组合参与的交易所公开竞价，未发生成交较少的单边交易量超过该股当日成交量 5% 的股票同日反向交易；主动投资组合间债券交易未发生同日反向交易。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 报告期内基金的投资策略和运作分析

2023 年二季度，经济的复苏势头未能延续，受到一季度的“透支效应”、以及政策发力节奏放缓等因素的影响，经济的下行压力再度显现，制造业 PMI 持续位于荣枯线以下，固定资产投资、工业增加值、社融等多项数据同比增速超预期回落，制造业与服务业表现分化，呈现“K”型复苏的格局，微观主体的信心与活力依然不足。随着信贷投放趋缓以及央行呵护资金面，资金利率在二季度逐步下行，此外央行也加大了逆周期调节的力度，在二季度持续推动存款利率下行，并于 6 月下调政策利率 10BP，降息后 10 年国债到期收益率下行至 2.62% 的上半年低点位置，但随后市场止盈情绪升温，债市在对稳增长政策预期的博弈中转为震荡。

债券市场方面，二季度中债综合指数上涨 1.67%，中债金融债券总指数上涨 1.7%，中债信用债总指数上涨 1.24%。10Y 国债收益率从 2.85% 震荡下行至 2.64%。受益于资金面的宽松，中短端利率下行幅度更大，利率曲线小幅陡峭化。信用总体利差保持震荡，中低等级信用债利差小幅走阔。

权益市场方面，低位震荡的经济数据不断与弱预期相互形成负反馈，美联储超预期的加息进程导致人民币贬值压力以及加剧北向流出，wind 全 A/上证 50/沪深 300/中证 1000 分别下跌 3.2%/6.38%/5.15%/3.98%。转债在二季度全线收跌，其中中低价转债跌幅明显小于高价转债，展现出比较强的防御特点。经济数据下修的影响已逐步隐含在权益类资产定价中。

本基金在严格控制风险的基础上，采取积极的组合策略进行投资运作。二季度本基金主动进行大类资产配置调整，充分利用杠杆策略，在纯债部分优先配置信用债资产，提升信用债投资比例，获得较好的投资收益。我们高度重视信用风险管理，主要持有中高等级信用债。本季度组合运用国债仓位进行了波段操作，获取部分超额收益，但不足的是组合在二季度的债券上涨行情中，久期仍偏谨慎。可转债资产上半年为组合贡献了正收益，但二季度在市场下跌中也有阶段性拖累。4-5 月组合对可转债资产进行了结构调整和小幅降仓，但 6 月份组合重点加仓了转债资产，同时小幅降低债券久期。从资产配置的角度看，10 年期国债阶段性下至 2.6% 的低位后，权益类资产的风险收益比显著好于纯债资产，而转债资产年初以来也表现出较好的攻守兼备的属性。但转债资产易受溢价率影响，后市操作仍需在市场过度乐观或悲观的时候保持清醒。

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 1.0599 元，本报告期基金份额净值增长率为 0.24%，同期业绩比较基准收益率为 1.86%；大成债券 C 的基金份额净值为 1.0737 元，本报告期基金份额净值增长率为 0.16%，同期业绩比较基准收益率为 1.86%。

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	36,543,270.02	1.63
	其中：股票	36,543,270.02	1.63
2	基金投资	—	—
3	固定收益投资	2,145,621,195.53	95.50
	其中：债券	2,145,621,195.53	95.50
	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	12,832,952.44	0.57
8	其他资产	51,833,904.50	2.31
9	合计	2,246,831,322.49	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	27,212,213.38	1.57
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	2,510,671.30	0.14
H	住宿和餐饮业	—	—
I	信息传输、软件和信息技术服务业	1,274,458.52	0.07
J	金融业	1,691,602.50	0.10
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	3,854,324.32	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	36,543,270.02	2.11

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	1,140,266	12,189,443.54	0.70
2	603298	杭叉集团	442,807	10,428,104.85	0.60
3	300416	苏试试验	178,772	3,854,324.32	0.22
4	601006	大秦铁路	337,910	2,510,671.30	0.14
5	600487	亨通光电	159,809	2,342,799.94	0.14
6	300827	上能电气	50,544	1,822,111.20	0.11
7	600919	江苏银行	230,150	1,691,602.50	0.10
8	002368	太极股份	30,956	1,274,458.52	0.07
9	600420	国药现代	38,065	429,753.85	0.02

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	356,108,622.98	20.54
2	央行票据	—	—
3	金融债券	270,688,616.38	15.61
	其中：政策性金融债	157,821,575.34	9.10
4	企业债券	388,983,717.12	22.43

5	企业短期融资券	30,072,977.05	1.73
6	中期票据	605,958,740.73	34.94
7	可转债（可交换债）	493,808,521.27	28.48
8	同业存单	—	—
9	其他	—	—
10	合计	2,145,621,195.53	123.73

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	157,821,575.34	9.10
2	220013	22 附息国债 13	1,100,000	110,248,311.48	6.36
3	220023	22 附息国债 23	500,000	50,569,630.14	2.92
4	210013	21 附息国债 13	400,000	41,669,150.68	2.40
5	102280648	22 通顺交投 MTN001	300,000	31,521,852.46	1.82

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之一江苏银行的发行主体江苏银行股份有限公司于 2023 年 2 月 10 日因违反账户管理规定、未按规定履行客户身份识别义务等，受到中国人民银行处罚（银罚决字（2023）1 号）。本基金认为，对江苏银行的处罚不会对其投资价值构成实质性负面影响。

5.10.2 基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库

本基金投资的前十名股票未超出基金合同规定的备选股票库。

5.10.3 其他资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	28,504.96
2	应收证券清算款	1,736,124.19
3	应收股利	—
4	应收利息	—
5	应收申购款	50,069,275.35
6	其他应收款	—
7	其他	—
8	合计	51,833,904.50

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	110085	通 22 转债	19,817,611.28	1.14
2	113650	博 22 转债	12,795,793.60	0.74
3	113602	景 20 转债	12,791,079.53	0.74
4	128140	润建转债	12,186,482.54	0.70
5	128023	亚太转债	10,660,307.07	0.61
6	111010	立昂转债	10,615,026.46	0.61
7	127058	科伦转债	10,528,200.09	0.61
8	123165	回天转债	10,176,081.99	0.59
9	113059	福莱转债	9,893,072.26	0.57
10	110081	闻泰转债	9,598,566.60	0.55
11	110088	淮 22 转债	9,341,248.34	0.54
12	127024	盈峰转债	8,715,611.07	0.50
13	127053	豪美转债	8,483,499.20	0.49
14	110068	龙净转债	8,256,551.30	0.48
15	113661	福 22 转债	8,221,503.87	0.47
16	113623	凤 21 转债	8,136,912.02	0.47
17	113598	法兰转债	7,928,864.16	0.46
18	118014	高测转债	7,628,123.93	0.44
19	113063	赛轮转债	7,101,211.47	0.41

20	127064	杭氧转债	6,823,661.42	0.39
21	113045	环旭转债	6,791,646.43	0.39
22	123088	威唐转债	6,703,890.02	0.39
23	113647	禾丰转债	5,875,276.81	0.34
24	123071	天能转债	5,678,520.19	0.33
25	128141	旺能转债	5,659,869.61	0.33
26	113055	成银转债	5,575,273.41	0.32
27	113655	欧 22 转债	5,343,575.13	0.31
28	127032	苏行转债	5,216,874.81	0.30
29	110062	烽火转债	5,147,750.21	0.30
30	110090	爱迪转债	5,125,697.69	0.30
31	123164	法本转债	5,036,530.42	0.29
32	123107	温氏转债	4,922,108.31	0.28
33	128142	新乳转债	4,751,164.78	0.27
34	110079	杭银转债	4,646,598.81	0.27
35	113654	永 02 转债	4,615,025.64	0.27
36	123156	博汇转债	4,546,608.84	0.26
37	123142	申昊转债	4,522,047.51	0.26
38	113637	华翔转债	4,388,831.12	0.25
39	113658	密卫转债	4,382,122.56	0.25
40	127073	天赐转债	4,308,732.42	0.25
41	110076	华海转债	4,226,868.71	0.24
42	127072	博实转债	3,893,144.58	0.22
43	123099	普利转债	3,866,000.20	0.22
44	110082	宏发转债	3,816,991.18	0.22
45	110086	精工转债	3,798,983.39	0.22
46	127027	能化转债	3,593,118.81	0.21
47	110055	伊力转债	3,510,888.08	0.20
48	123114	三角转债	3,487,143.31	0.20
49	111007	永和转债	3,469,612.55	0.20
50	113636	甬金转债	3,428,787.96	0.20
51	113046	金田转债	3,404,901.71	0.20
52	128095	恩捷转债	3,396,650.05	0.20
53	113594	淳中转债	3,373,924.97	0.19
54	111004	明新转债	3,274,119.33	0.19
55	123085	万顺转 2	3,084,260.36	0.18
56	127066	科利转债	3,047,059.06	0.18
57	110083	苏租转债	2,777,216.84	0.16
58	127046	百润转债	2,734,555.48	0.16
59	113504	艾华转债	2,718,495.98	0.16
60	110048	福能转债	2,685,953.72	0.15
61	127006	敖东转债	2,651,448.07	0.15

62	113044	大秦转债	2,615,285.96	0.15
63	127069	小熊转债	2,563,170.60	0.15
64	123120	隆华转债	2,516,743.17	0.15
65	113626	伯特转债	2,513,906.05	0.14
66	128135	洽洽转债	2,505,536.07	0.14
67	113024	核建转债	2,483,153.87	0.14
68	128136	立讯转债	2,481,130.19	0.14
69	128111	中矿转债	2,478,263.80	0.14
70	110064	建工转债	2,444,415.49	0.14
71	113053	隆 22 转债	2,142,032.01	0.12
72	113039	嘉泽转债	2,128,263.21	0.12
73	123078	飞凯转债	2,109,057.40	0.12
74	113025	明泰转债	2,044,235.70	0.12
75	127035	濮耐转债	2,039,246.59	0.12
76	127065	瑞鹄转债	1,909,609.46	0.11
77	113062	常银转债	1,876,890.47	0.11
78	123158	宙邦转债	1,843,421.85	0.11
79	111009	盛泰转债	1,836,066.46	0.11
80	113049	长汽转债	1,832,785.62	0.11
81	110045	海澜转债	1,822,781.26	0.11
82	113047	旗滨转债	1,797,312.66	0.10
83	128034	江银转债	1,781,472.65	0.10
84	128125	华阳转债	1,705,366.09	0.10
85	113542	好客转债	1,696,729.41	0.10
86	127020	中金转债	1,676,571.93	0.10
87	128132	交建转债	1,628,219.06	0.09
88	118003	华兴转债	1,562,024.62	0.09
89	110058	永鼎转债	1,520,514.41	0.09
90	113050	南银转债	1,489,493.57	0.09
91	113641	华友转债	1,461,555.99	0.08
92	127033	中装转 2	1,405,614.09	0.08
93	127055	精装转债	1,348,515.89	0.08
94	111002	特纸转债	1,263,046.58	0.07
95	113638	台 21 转债	1,236,521.40	0.07
96	123063	大禹转债	1,211,265.20	0.07
97	127030	盛虹转债	1,144,362.91	0.07
98	127018	本钢转债	1,123,372.22	0.06
99	113662	豪能转债	1,107,736.81	0.06
100	123144	裕兴转债	1,062,666.18	0.06
101	123113	仙乐转债	1,057,735.50	0.06
102	118020	芳源转债	1,032,841.37	0.06
103	127051	博杰转债	983,946.50	0.06

104	113609	永安转债	979,771.20	0.06
105	128074	游族转债	961,225.89	0.06
106	111005	富春转债	933,840.01	0.05
107	123092	天壕转债	909,348.38	0.05
108	123121	帝尔转债	896,110.83	0.05
109	110091	合力转债	861,162.35	0.05
110	127047	帝欧转债	840,593.36	0.05
111	127012	招路转债	834,655.16	0.05
112	127063	贵轮转债	833,718.82	0.05
113	128134	鸿路转债	816,003.79	0.05
114	110073	国投转债	805,939.16	0.05
115	123132	回盛转债	780,912.66	0.05
116	132026	G 三峡 EB2	774,736.03	0.04
117	127056	中特转债	677,512.46	0.04
118	123150	九强转债	658,622.57	0.04
119	127036	三花转债	551,317.89	0.03
120	113615	金诚转债	542,310.23	0.03
121	113519	长久转债	523,072.49	0.03
122	118019	金盘转债	510,917.48	0.03
123	128121	宏川转债	501,414.79	0.03
124	113644	艾迪转债	500,657.12	0.03
125	128071	合兴转债	487,509.97	0.03
126	127042	嘉美转债	485,210.56	0.03
127	128035	大族转债	481,592.30	0.03
128	127022	恒逸转债	471,787.89	0.03
129	127067	恒逸转 2	470,868.05	0.03
130	128017	金禾转债	408,209.60	0.02
131	123056	雪榕转债	385,973.43	0.02
132	113625	江山转债	385,117.38	0.02
133	113048	晶科转债	349,347.55	0.02
134	128137	洁美转债	292,003.52	0.02
135	128116	瑞达转债	262,416.44	0.02
136	113643	风语转债	238,779.26	0.01
137	113060	浙 22 转债	217,718.83	0.01
138	113633	科沃转债	212,800.18	0.01
139	110061	川投转债	208,134.26	0.01
140	128122	兴森转债	193,348.05	0.01
141	113563	柳药转债	153,642.79	0.01
142	111000	起帆转债	98,627.70	0.01
143	123130	设研转债	80,333.49	0.00

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	1,049,406,764.36	572,648,267.57
报告期期间基金总申购份额	53,703,441.51	54,101,671.99
减：报告期期间基金总赎回份额	42,795,130.05	58,374,385.66
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	1,060,315,075.82	568,375,553.90

§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	25,729,803.37	-
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	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（%）	1.58	-

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 7 月 20 日