

大成惠利纯债债券型证券投资基金

2018 第二季度 报告

2018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:兴业银行股份有限公司
重要提示:基金管理人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...

Table with 2 columns: 基金名称, 基金代码, 基金运作方式, etc.

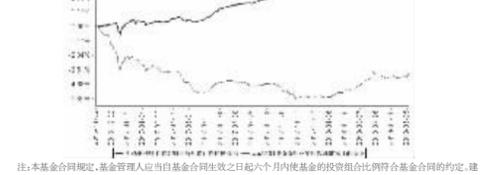
Table with 2 columns: 主要财务指标, 报告期: 2018年4月1日 - 2018年6月30日

注:1. 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...

注:2. 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。

注: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

注: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:本基金合同约定,基金管理人应当自基金合同生效之日起6个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的约定...

注:1. (任职日期、离任日期为基金管理人作出决定之日)

注:2. 基金经理的任期指自基金管理人聘任公告(证券投资基金信息披露管理办法)的相关规定

注:3. 本基金管理人严格遵守《证券投资基金法》等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...

注:4. 3.1 公平交易制度的执行情况

注:5. 3.2 异常交易行为的专项说明

注:6. 4.3 基金管理人持有本基金份额变动情况

注:7. 4.4 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

注:8. 4.5 影响投资者决策的其他重要信息

注:9. 4.6 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

注:10. 4.7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

注:11. 4.8 影响投资者决策的其他重要信息

注:12. 4.9 备查文件目录

注:13. 4.10 备查文件目录

注:14. 4.11 备查文件目录

注:15. 4.12 备查文件目录

注:16. 4.13 备查文件目录

注:17. 4.14 备查文件目录

注:18. 4.15 备查文件目录

注:19. 4.16 备查文件目录

注:20. 4.17 备查文件目录

注:21. 4.18 备查文件目录

注:22. 4.19 备查文件目录

注:23. 4.20 备查文件目录

注:24. 4.21 备查文件目录

注:25. 4.22 备查文件目录

注:26. 4.23 备查文件目录

注:27. 4.24 备查文件目录

注:28. 4.25 备查文件目录

注:29. 4.26 备查文件目录

注:30. 4.27 备查文件目录

注:31. 4.28 备查文件目录

注:32. 4.29 备查文件目录

注:33. 4.30 备查文件目录

注:34. 4.31 备查文件目录

注:35. 4.32 备查文件目录

注:36. 4.33 备查文件目录

注:37. 4.34 备查文件目录

注:38. 4.35 备查文件目录

注:39. 4.36 备查文件目录

注:40. 4.37 备查文件目录

注:41. 4.38 备查文件目录

注:42. 4.39 备查文件目录

Table with 2 columns: 序号, 项目, 金额(元), 占基金总资产比例(%)

注:1. 报告期末按行业分类的股票投资组合

注:2. 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

注: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

注:4. 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

注: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

注: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

注: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

注: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

注: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

注: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期权投资明细

注: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衍生品投资明细

注:12. 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其他资产投资明细

注:13. 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其他资产投资明细

注:14. 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其他资产投资明细

注:15. 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其他资产投资明细

注:16. 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其他资产投资明细

注:17. 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其他资产投资明细

注:18. 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其他资产投资明细

注:19. 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其他资产投资明细

注:20. 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其他资产投资明细

注:21. 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其他资产投资明细

注:22. 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其他资产投资明细

注:23. 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其他资产投资明细

注:24. 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其他资产投资明细

注:25. 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其他资产投资明细

注:26. 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其他资产投资明细

注:27. 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其他资产投资明细

注:28. 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其他资产投资明细

注:29. 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其他资产投资明细

注:30. 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其他资产投资明细

注:31. 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其他资产投资明细

注:32. 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其他资产投资明细

注:33. 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其他资产投资明细

注:34. 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其他资产投资明细

注:35. 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其他资产投资明细

注:36. 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其他资产投资明细

注:37. 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其他资产投资明细

注:38. 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其他资产投资明细

注:39. 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其他资产投资明细

注:40. 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其他资产投资明细

注:41. 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其他资产投资明细

注:42. 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其他资产投资明细

注:43. 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其他资产投资明细

注:44. 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其他资产投资明细

注:45. 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其他资产投资明细

注:46. 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其他资产投资明细

注:47. 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其他资产投资明细

注:48. 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其他资产投资明细

注:49. 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其他资产投资明细

注:50. 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其他资产投资明细

注:51. 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其他资产投资明细

注:52. 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其他资产投资明细

注:53. 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其他资产投资明细

注:54. 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其他资产投资明细

注:55. 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其他资产投资明细

注:56. 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其他资产投资明细

注:57. 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其他资产投资明细

注:58. 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其他资产投资明细

注:59. 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其他资产投资明细

大成惠明定期开放纯债债券型证券投资基金

2018 第二季度 报告

2018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:兴业银行股份有限公司
重要提示:基金管理人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...

Table with 2 columns: 基金名称, 基金代码, 基金运作方式, etc.

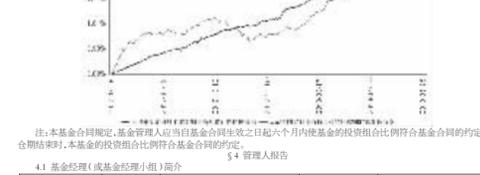
Table with 2 columns: 主要财务指标, 报告期: 2018年4月1日 - 2018年6月30日

注:1. 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...

注:2. 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。

注: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

注: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:本基金合同约定,基金管理人应当自基金合同生效之日起6个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的约定...

注:1. (任职日期、离任日期为基金管理人作出决定之日)

注:2. 基金经理的任期指自基金管理人聘任公告(证券投资基金信息披露管理办法)的相关规定

注:3. 本基金管理人严格遵守《证券投资基金法》等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...

注:4. 3.1 公平交易制度的执行情况

注:5. 3.2 异常交易行为的专项说明

注:6. 4.3 基金管理人持有本基金份额变动情况

注:7. 4.4 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

注:8. 4.5 影响投资者决策的其他重要信息

注:9. 4.6 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

注:10. 4.7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

注:11. 4.8 影响投资者决策的其他重要信息

注:12. 4.9 备查文件目录

注:13. 4.10 备查文件目录

注:14. 4.11 备查文件目录

注:15. 4.12 备查文件目录

注:16. 4.13 备查文件目录

注:17. 4.14 备查文件目录

注:18. 4.15 备查文件目录

注:19. 4.16 备查文件目录

注:20. 4.17 备查文件目录

注:21. 4.18 备查文件目录

注:22. 4.19 备查文件目录

注:23. 4.20 备查文件目录

注:24. 4.21 备查文件目录

注:25. 4.22 备查文件目录

注:26. 4.23 备查文件目录

注:27. 4.24 备查文件目录

注:28. 4.25 备查文件目录

注:29. 4.26 备查文件目录

注:30. 4.27 备查文件目录

注:31. 4.28 备查文件目录

注:32. 4.29 备查文件目录

注:33. 4.30 备查文件目录

注:34. 4.31 备查文件目录

注:35. 4.32 备查文件目录

注:36. 4.33 备查文件目录

注:37. 4.34 备查文件目录

注:38. 4.35 备查文件目录

注:39. 4.36 备查文件目录

注:40. 4.37 备查文件目录

注:41. 4.38 备查文件目录

注:42. 4.39 备查文件目录

情形:投资组合债券交易存在1笔同日反向交易,原因为投资策略:投资组合债券交易日反向交易的市场或比例、成交价格等交易数据较前次交易更不利于自身产生重大影响,且前次投资组合向然存在同日交易行为,但结合交易价差分布统计分析和在利益输送金额统计结果表明投资组合间不存在利益输送的可能性。

Table with 2 columns: 序号, 项目, 金额(元), 占基金总资产比例(%)

Table with 2 columns: 主要财务指标, 报告期: 2018年4月1日 - 2018年6月30日

注:1. 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...

注:2. 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。

注: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

注: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:本基金合同约定,基金管理人应当自基金合同生效之日起6个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的约定...

注:1. (任职日期、离任日期为基金管理人作出决定之日)

注:2. 基金经理的任期指自基金管理人聘任公告(证券投资基金信息披露管理办法)的相关规定

注:3. 本基金管理人严格遵守《证券投资基金法》等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...

注:4. 3.1 公平交易制度的执行情况

注:5. 3.2 异常交易行为的专项说明

注:6. 4.3 基金管理人持有本基金份额变动情况

注:7. 4.4 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

注:8. 4.5 影响投资者决策的其他重要信息

注:9. 4.6 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

注:10. 4.7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

注:11. 4.8 影响投资者决策的其他重要信息

注:12. 4.9 备查文件目录

注:13. 4.10 备查文件目录

注:14. 4.11 备查文件目录

注:15. 4.12 备查文件目录

注:16. 4.13 备查文件目录

注:17. 4.14 备查文件目录

注:18. 4.15 备查文件目录

注:19. 4.16 备查文件目录

注:20. 4.17 备查文件目录

注:21. 4.18 备查文件目录

注:22. 4.19 备查文件目录

注:23. 4.20 备查文件目录

注:24. 4.21 备查文件目录

注:25. 4.22 备查文件目录

注:26. 4.23 备查文件目录

注:27. 4.24 备查文件目录

注:28. 4.25 备查文件目录

注:29. 4.26 备查文件目录

注:30. 4.27 备查文件目录

注:31. 4.28 备查文件目录

注:32. 4.29 备查文件目录

注:33. 4.30 备查文件目录

注:34. 4.31 备查文件目录

注:35. 4.32 备查文件目录

注:36. 4.33 备查文件目录

注:37. 4.34 备查文件目录

注:38. 4.35 备查文件目录

注:39. 4.36 备查文件目录

注:40. 4.37 备查文件目录

注:41. 4.38 备查文件目录

注:42. 4.39 备查文件目录

基金管理人:大成基金管理有限公司
基金托管人:兴业银行股份有限公司
重要提示:基金管理人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...

注:1. 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...

注:2. 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。

注: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

注: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:本基金合同约定,基金管理人应当自基金合同生效之日起6个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的约定...

基金管理人:大成基金管理有限公司
基金托管人:兴业银行股份有限公司
重要提示:基金管理人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...