

大成添利宝货币市场基金
2015 年半年度报告
2015 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

送出日期：2015 年 8 月 27 日

§ 1 重要提示及目录

1.1 重要提示

基金管理人的董事会、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的法律责任。本半年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人兴业银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2015 年 8 月 25 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、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及其更新。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2015 年 01 月 01 日起至 06 月 30 日止。

1.2 目录

§1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示.....	2
1.2 目录.....	3
§2 基金简介	5
2.1 基金基本情况.....	5
2.2 基金产品说明.....	5
2.3 基金管理人和基金托管人.....	5
2.4 信息披露方式.....	6
2.5 其他相关资料.....	6
§3 主要财务指标和基金净值表现	6
3.1 主要会计数据和财务指标.....	6
3.2 基金净值表现.....	7
§4 管理人报告	9
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	9
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	12
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	12
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明.....	13
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	13
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	14
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	14
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明.....	14
§5 托管人报告	15
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	15
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明.....	15
5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见.....	15
§6 半年度财务会计报告（未经审计）	15
6.1 资产负债表.....	15
6.2 利润表.....	16
6.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	17
6.4 报表附注.....	18
§7 投资组合报告	32
7.1 期末基金资产组合情况.....	32
7.2 债券回购融资情况.....	32
7.3 基金投资组合平均剩余期限.....	33
7.4 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	34
7.5 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.....	34
7.6 “影子定价”与“摊余成本法”确定的基金资产净值的偏离.....	34
7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细.....	34
7.8 投资组合报告附注.....	35
§8 基金份额持有人信息	35
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	35
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	36
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况.....	36

§9 开放式基金份额变动	36
§10 重大事件揭示	37
10.1 基金份额持有人大会决议.....	37
10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动.....	37
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	38
10.4 基金投资策略的改变.....	38
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	38
10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况.....	38
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	38
10.8 偏离度绝对值超过 0.5%的情况.....	39
10.9 其他重大事件.....	39
§11 影响投资者决策的其他重要信息	41
§12 备查文件目录	41
12.1 备查文件目录.....	41
12.2 存放地点.....	41
12.3 查阅方式.....	41

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	大成添利宝货币市场基金		
基金简称	大成添利宝货币		
基金主代码	000724		
交易代码	000724		
基金运作方式	契约型开放式		
基金合同生效日	2014 年 7 月 28 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		
报告期末基金份额总额	122,673,737.74 份		
基金合同存续期	不定期		
下属分级基金的基金简称:	大成添利宝 A	大成添利宝 B	大成添利宝 E
下属分级基金的交易代码:	000724	000725	000726
报告期末下属分级基金的份额总额	2,657,318.44 份	73,829,142.87 份	46,187,276.43 份

2.2 基金产品说明

投资目标	在保持本金安全和资产流动性基础上追求较高的当期收益。
投资策略	本基金运用利率趋势评估策略、类属配置策略、平均剩余期限配置策略、银行协议存款和大量存单投资策略、流动性管理策略进行投资管理，以实现超越投资基准的投资目标。
业绩比较基准	银行活期存款利率（税后）
风险收益特征	本基金为货币市场基金，为证券投资基金中的低风险品种。本基金长期的风险和预期收益低于股票型基金、混合型基金、债券型基金。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目	基金管理人	基金托管人
名称	大成基金管理有限公司	兴业银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	杜鹏
	联系电话	0755-83183388
	电子邮箱	dupeng@dcfund.com.cn
客户服务电话	4008885558	95561
传真	0755-83199588	021-62159217
注册地址	深圳市福田区深南大道 7088 号招商银行大厦 32 层	福州市湖东路 154 号
办公地址	深圳市福田区深南大道 7088 号招商银行大厦 32 层	上海江宁路 168 号兴业大厦 20 楼

邮政编码	518040	200041
法定代表人	刘卓	高建平

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《证券时报》、《中国证券报》
登载基金半年度报告正文的管理人互联网网址	http://www.dcfund.com.cn
基金半年度报告备置地点	深圳市福田区深南大道 7088 号招商银行大厦 32 层大成基金管理有限公司 上海江宁路 168 号兴业大厦 20 楼兴业银行股份有限公司

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	大成基金管理有限公司	深圳市福田区深南大道 7088 号招商银行大厦 32 层

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

基金级别	大成添利宝 A	大成添利宝 B	大成添利宝 E
3.1.1 期间数据和指标	报告期(2015 年 1 月 1 日 - 2015 年 6 月 30 日)	报告期(2015 年 1 月 1 日 - 2015 年 6 月 30 日)	报告期(2015 年 1 月 1 日 - 2015 年 6 月 30 日)
本期已实现收益	28,931.96	1,197,128.00	991,095.74
本期利润	28,931.96	1,197,128.00	991,095.74
本期净值收益率	1.9125%	2.0344%	1.9634%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2015 年 6 月 30 日)		
期末基金资产净值	2,657,318.44	73,829,142.87	46,187,276.43
期末基金份额净值	1.0000	1.0000	1.0000
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2015 年 6 月 30 日)		
累计净值收益率	3.9557%	4.1920%	4.0572%

注：1、本基金根据每日基金收益公告，以每万份基金份额收益为基准，为投资人每日计算收益并分配。

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。由于货币市场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 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

大成添利宝 A

阶段	份额净值收益率①	份额净值收益率标准差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
过去一个月	0.2823%	0.0005%	0.0288%	0.0000%	0.2535%	0.0005%
过去三个月	0.8802%	0.0010%	0.0873%	0.0000%	0.7929%	0.0010%
过去六个月	1.9125%	0.0014%	0.1736%	0.0000%	1.7389%	0.0014%
自基金合同生效起至今	3.9557%	0.0189%	0.3241%	0.0000%	3.6316%	0.0189%

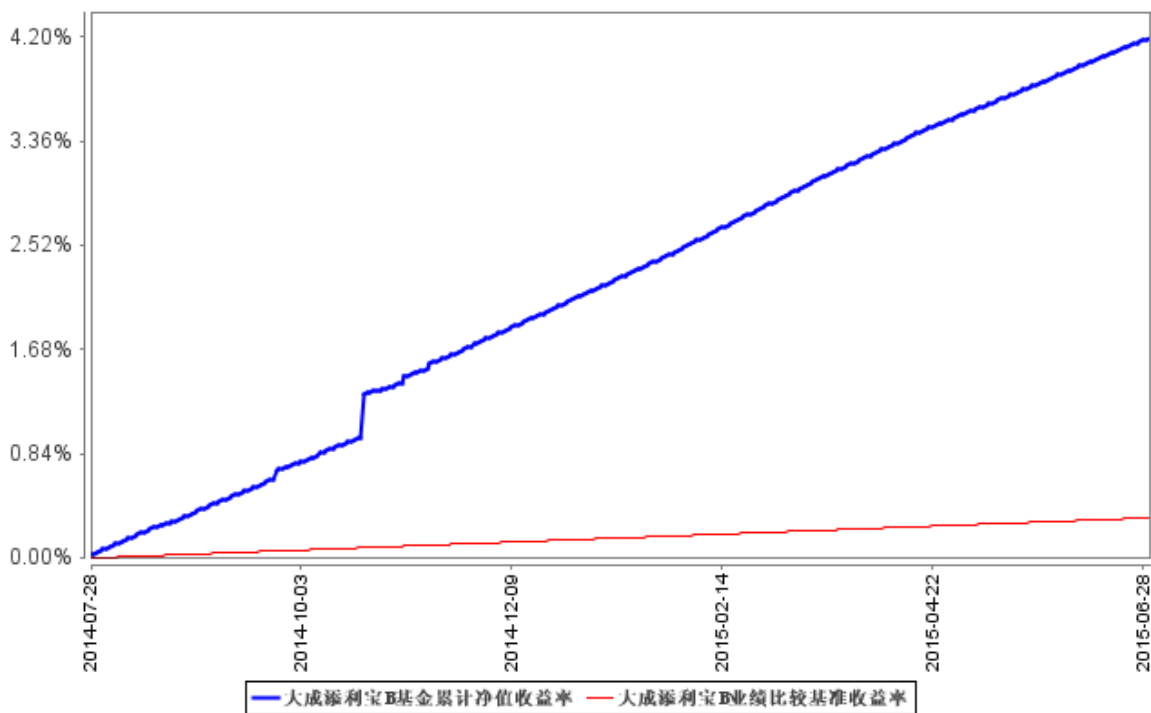
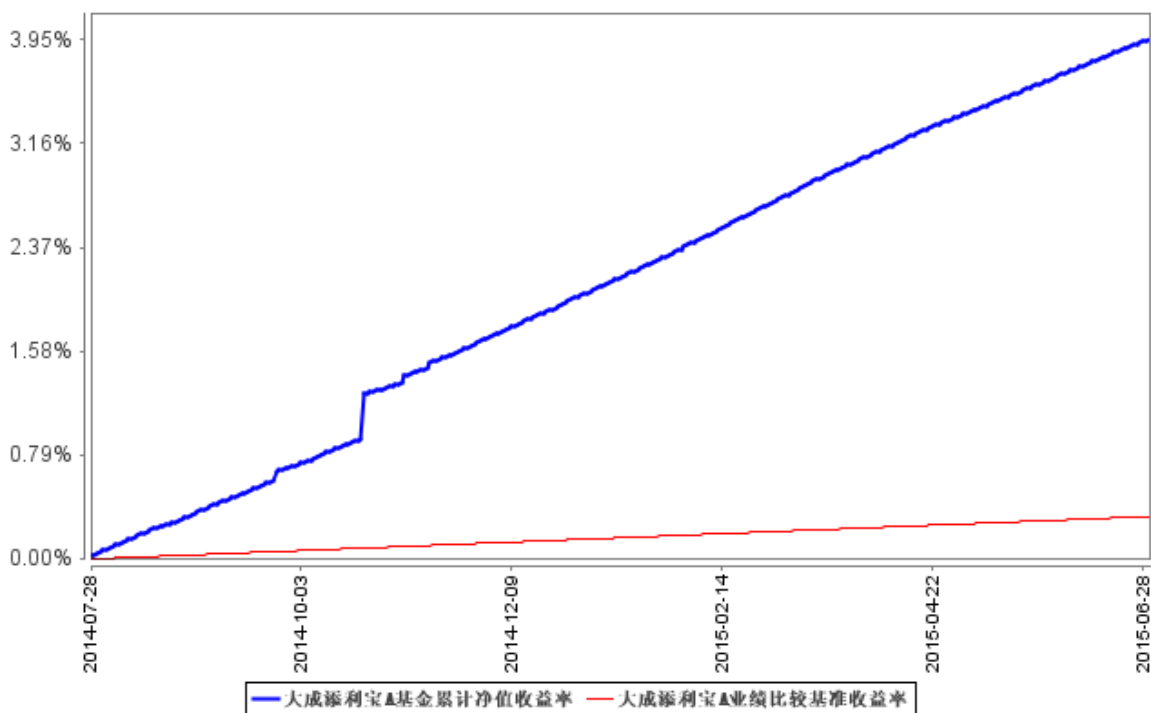
大成添利宝 B

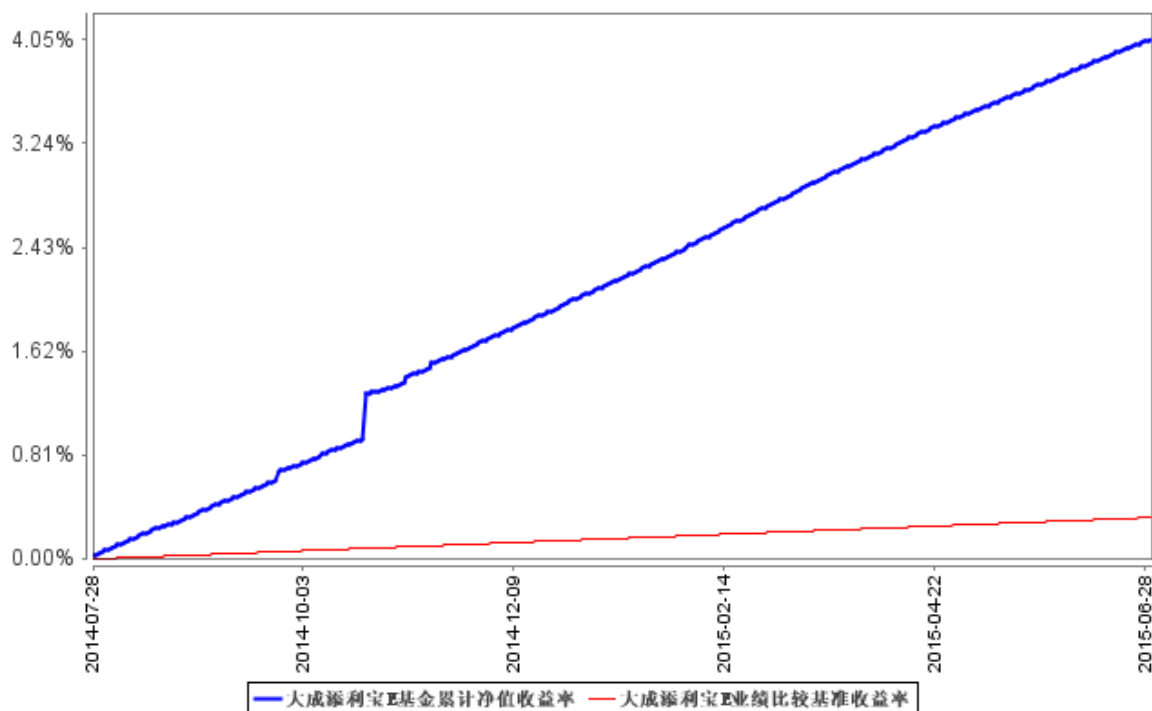
阶段	份额净值收益率①	份额净值收益率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去一个月	0.3018%	0.0005%	0.0288%	0.0000%	0.2730%	0.0005%
过去三个月	0.9410%	0.0010%	0.0873%	0.0000%	0.8537%	0.0010%
过去六个月	2.0344%	0.0014%	0.1736%	0.0000%	1.8608%	0.0014%
自基金合同生效起至今	4.1920%	0.0189%	0.3241%	0.0000%	3.8679%	0.0189%

大成添利宝 E

阶段	份额净值收益率①	份额净值收益率标准差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
过去一个月	0.2902%	0.0005%	0.0288%	0.0000%	0.2614%	0.0005%
过去三个月	0.9056%	0.0010%	0.0873%	0.0000%	0.8183%	0.0010%
过去六个月	1.9634%	0.0014%	0.1736%	0.0000%	1.7898%	0.0014%
自基金合同生效起至今	4.0572%	0.0189%	0.3241%	0.0000%	3.7331%	0.0189%

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、本基金合同生效日为 2014 年 7 月 28 日，截至报告期末本基金合同生效未满一年。

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 6 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 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

大成基金管理有限公司经中国证监会证监基金字[1999]10 号文批准，于 1999 年 4 月 12 日正式成立，是中国证监会批准成立的首批十家基金管理公司之一，注册资本为 2 亿元人民币，注册地为深圳。目前公司由四家股东组成，分别为中泰信托有限责任公司(48%)、光大证券股份有限公司(25%)、中国银河投资管理有限公司(25%)、广东证券股份有限公司(2%)。截至 2015 年 6 月 30 日，本基金管理人共管理 5 只 ETF 及 1 只 ETF 联接基金：大成中证 100 交易型开放式指数证券投资基金、深证成长 40 交易型开放式指数证券投资基金及大成深证成长 40 交易型开放式指数证券投资基金联接基金、中证 500 深市交易型开放式指数证券投资基金、中证 500 沪市交易型开放式指数证券投资基金、大成深证成份交易型开放式指数证券投资基金，2 只 QDII 基金：大成标普 500 等权重指数证券投资基金、大成纳斯达克 100 指数证券投资基金及 51 只开放式证券投资基金：大成景丰债券型证券投资基金 (LOF)、大成价值增长证券投资基金、大成债券投资基金、大成蓝筹稳健证券投资基金、大成精选增值混合型证券投资基金、大成货币市场证券投资基金、大成沪深

300 指数证券投资基金、大成财富管理 2020 生命周期证券投资基金、大成积极成长混合型证券投资基金、大成创新成长混合型证券投资基金(LOF)、大成景阳领先混合型证券投资基金、大成强化收益定期开放债券型证券投资基金、大成策略回报混合型证券投资基金、大成行业轮动混合型证券投资基金、大成中证红利指数证券投资基金、大成核心双动力混合型证券投资基金、大成竞争优势混合型证券投资基金、大成景恒保本混合型证券投资基金、大成内需增长混合型证券投资基金、大成可转债增强债券型证券投资基金、大成消费主题混合型证券投资基金、大成新锐产业混合型证券投资基金、大成优选混合型证券投资基金 (LOF)、大成月添利理财债券型证券投资基金、大成现金增利货币市场证券投资基金、大成月月盈短期理财债券型证券投资基金、大成现金宝场内实时申赎货币市场基金、大成景安短融债券型证券投资基金、大成景兴信用债债券型证券投资基金、大成景旭纯债债券型证券投资基金、大成景祥分级债券型证券投资基金、大成信用增利一年定期开放债券型证券投资基金、大成健康产业混合型证券投资基金、大成中小盘混合型证券投资基金 (LOF)、大成灵活配置混合型证券投资基金、大成丰财宝货币市场基金、大成景益平稳收益混合型证券投资基金、大成添利宝货币市场基金、大成景利混合型证券投资基金、大成产业升级股票型证券投资基金 (LOF)、大成高新技术产业股票型证券投资基金、大成景秀灵活配置混合型证券投资基金、大成互联网思维混合型证券投资基金、大成景明灵活配置混合型证券投资基金、大成景穗灵活配置混合型证券投资基金、大成景鹏灵活配置混合型证券投资基金、大成睿景灵活配置混合型证券投资基金、大成景源灵活配置混合型证券投资基金基金、大成景裕灵活配置混合型证券投资基金、大成中证互联网金融指数分级证券投资基金及大成正向回报灵活配置混合型证券投资基金 (本基金 2015 年 7 月 8 日成立) 等。

4.1.2 基金经理 (或基金经理小组) 及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理 (助理) 期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
屈伟南先生	本基金基金经理	2014 年 7 月 28 日	2015 年 6 月 30 日	13 年	工商管理硕士。曾任职于郑州纺织工学院、融通基金管理有限公司。2006 年 3 月加入大成基金管理有限公司, 历任基金会计、固定收益研究员、基金经理助理。2013 年 2 月 1 日至 2014 年 9 月 11 日任大成理财 21 天债券型发起式证券投资基金基金经理。2013 年 3 月 27 日至 2015 年 6 月 30 日任大成

					现金宝场内实时申赎货币市场基金基金经理。2013年11月19日至2015年5月25日任大成景祥分级债券型证券投资基金基金经理。2014年6月18日至2015年6月30日任大成丰财宝货币市场基金基金经理。2014年7月28日至2015年6月30日任大成添利宝货币市场基金基金经理。2014年9月12日至2015年6月30日任大成月月盈短期理财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
黄海峰先生	本基金基金经理	2015年3月21日	-	11年	南开大学经济学学士，2013年7月加入大成基金管理有限公司固定收益部。2013年10月14日起任大成现金宝场内实时申赎货币市场基金基金经理助理。2013年10月28日起任大成景恒保本混合型证券投资基金基金经理助理。2014年3月18日起任大成强化收益债券型证券投资基金基金经理助理。2014年3月18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助理。2014年6月23日至2014年12月23日任大成丰财宝货币市场基金基金经理助理。2014年6月26日起任大成景益平稳收益混合型证券投资基金基金经理助理。2014年12月24日起，任大成货币市场证券投资基金基金经理及大成丰财宝货币市场基金基金经理。2015年3月21日起，任大成添利宝货币市场基金及大成景兴信用债债券型证券投资基金基金经理。2015年3月

					27 日起,任大成景秀灵活配置混合型证券投资基金基金经理。2015 年 4 月 29 日起,任大成景明灵活配置混合型证券投资基金基金经理。2015 年 5 月 4 日起,任大成景穗灵活配置混合型证券投资基金基金经理。2015 年 5 月 15 日起,任大成景源灵活配置混合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。

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

本报告期内,本基金管理人严格遵守《证券法》、《证券投资基金法》、《大成添利宝货币市场基金基金合同》和其他有关法律法规的规定,在基金管理运作中,大成添利宝货币市场基金的投资范围、投资比例、投资组合、证券交易行为、信息披露等符合有关法律法规、行业监管规则和基金合同等规定,本基金没有发生重大违法违规行为,没有运用基金财产进行内幕交易和操纵市场行为以及进行有损基金投资人利益的关联交易,整体运作合法、合规。本基金将继续以取信于市场、取信于社会投资公众为宗旨,承诺将一如既往地本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金财产,在规范基金运作和严格控制投资风险的前提下,努力为基金份额持有人谋求最大利益。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

报告期内,基金管理人严格执行了公平交易的原则和制度。基金管理人旗下所有投资组合间连续 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分析及相应交易情形的分析结果表明:债券交易同向交易频率较低;股票同向交易溢价率较大主要来源于市场因素(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组合间的成交价格差异较大。结合交易价差分布统计分析和潜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。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

公司风险管理部定期对公司旗下所有投资组合间同向交易、反向交易等可能存在异常交易的

行为进行分析。2015 上半年公司旗下主动投资组合间股票交易存在 40 笔同日反向交易，原因是投资组合投资策略需要。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，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% 的仅有 1 笔，原因为投资策略需要；投资组合间存在 1 笔债券同日反向交易，原因为投资策略需要。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；投资组合间虽然存在同向交易行为，但结合交易价差分布统计分析和潜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。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2015 年上半年，经济增长持续低迷，GDP 同比增速仅为 7%。上半年 CPI 同比增长 1.3%，通胀水平总体可控。PPI 同比增长-4.6%，跌幅继续扩大。在此背景下，监管层调整政策对冲经济下行风险和通缩风险的频率加快，货币政策方面，2015 年上半年中央银行分别两次降低基准利率和存款准备金率，引导银行间回购利率和社会融资成本下行。此外，监管机构通过放松房地产政策提高房地产市场的成交活跃度，以期稳定房地产投资。

在宽松货币政策的指引下，各类货币市场利率在二季度出现快速下行。7 天回购均值由一季度的 4.36% 快速下降至 2.5%。1 年期金融债收益率和各评级短融收益率下行超过 100bp，1-3 个月 shibor 利率报价下行超过 150bp，同业存款报价也多数为减点。

上半年本基金在投资管理过程中继续贯彻稳健操作的原则，高度重视组合的流动性管理和安全性管理。具体来说，本基金在和持有人积极沟通的基础上，灵活管理组合现金流的到期分布情况，并提高了短融的仓位。并把握半年末等关键时点进行了银行存款和逆回购投资。此外，本基金在一级市场进行了积极的投标，获取了良好的投资收益。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

报告期内本基金 A 类净值收益率为 1.9125%，B 类净值收益率 2.0344%，E 类净值收益率 1.9634%，期间业绩比较基准收益率为 0.1736%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望 2015 年下半年，在经济疲弱和股市去杠杆带来的风险偏好下降的背景下，债券市场总体面临的风险较小。本基金在三季度将在稳健操作的原则下，基于市场状况以及投资人结构变化的判断，合理安排逆回购、存款、短融及金融债的投资比例，以期为持有人获得稳定安全的回报。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本基金管理人指导基金估值业务的领导小组为公司估值委员会，公司估值委员会主要负责估值政策和估值程序的制定、修订以及执行情况的监督。估值委员会由股票投资部、研究部、固定收益总部、风险管理部、基金运营部、监察稽核部、专户投资部指定人员组成。公司估值委员会的相关成员均具备相应的专业胜任能力和相关工作经历，估值委员会成员中包括两名投资组合经理。

股票投资部、研究部、固定收益总部、风险管理部和专户投资部负责关注相关投资品种的动态，评判基金持有的投资品种是否处于不活跃的交易状态或者最近交易日后经济环境发生了重大变化或证券发行机构发生了影响证券价格的重大事件，从而确定估值日需要进行估值测算或者调整的投资品种；提出合理的数量分析模型对需要进行估值测算或者调整的投资品种进行公允价值定价与计量；定期对估值政策和程序进行评价，以保证其持续适用；基金运营部负责日常的基金资产的估值业务，执行基金估值政策，并负责与托管行沟通估值调整事项；监察稽核部负责审核估值政策和程序的一致性，监督估值委员会工作流程中的风险控制，并负责估值调整事项的信息披露工作。

本基金的日常估值程序由基金运营部基金估值核算员执行，并与托管银行的估值结果核对一致。基金估值政策的议定和修改采用集体讨论机制，基金经理及投资经理作为估值小组成员，对本基金持仓证券的交易情况、信息披露情况保持应有的职业敏感，向估值委员会提供估值参考信息，参与估值政策讨论。对需采用特别估值程序的证券，基金管理人及时启动特别估值程序，由估值委员会讨论议定特别估值方案并与托管行沟通后由基金运营部具体执行。

本基金管理人参与估值流程各方之间不存在任何重大利益冲突。截止报告期末本基金管理人已与中央国债登记结算有限责任公司/中证指数有限公司签署服务协议，由其按约定提供在银行间同业市场交易的债券品种/在交易所市场上市交易或挂牌转让的固定收益品种（估值处理标准另有规定的除外）的估值数据。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金管理人严格按照本基金基金合同的规定进行收益分配。据本基金基金合同中收益分配有关原则的规定：本基金根据每日基金收益公告，以每万份基金份额收益为基准，为投资人每日计算收益并分配。本报告期内本基金应分配利润 2,217,155.70 元，报告期内已分配利润 2,217,155.70 元。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

无。

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

报告期内，本托管人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，诚信、尽责地履行了基金托管人义务，不存在损害本基金份额持有人利益的行为。

5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

报告期内，本托管人根据国家有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，对基金管理人在本基金的投资运作、基金资产净值的计算、基金收益的计算、基金费用开支等方面进行了必要的监督、复核和审查，未发现其存在任何损害本基金份额持有人利益的行为；基金管理人在报告期内，严格遵守了《证券投资基金法》等有关法律法规，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人认真复核了本年度报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，认为其真实、准确和完整，不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：大成添利宝货币市场基金

报告截止日：2015年6月30日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2015年6月30日	上年度末 2014年12月31日
资产：			
银行存款	6.4.2.1	44,362,687.62	67,824,000.88
结算备付金		50,000.00	19,500.00
存出保证金		-	-
交易性金融资产	6.4.2.2	50,004,014.03	39,943,944.37
其中：股票投资		-	-
基金投资		-	-
债券投资		50,004,014.03	39,943,944.37
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	6.4.2.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.2.4	36,800,295.20	-
应收证券清算款		-	-
应收利息	6.4.2.5	1,098,510.72	656,705.68

应收股利		-	-
应收申购款		601,933.34	3,551,155.61
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.2.6	-	196.00
资产总计		132,917,440.91	111,995,502.54
负债和所有者权益	附注号	本期末 2015年6月30日	上年度末 2014年12月31日
负 债:			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.2.3	-	-
卖出回购金融资产款		9,999,875.00	-
应付证券清算款		-	-
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		20,780.53	26,027.85
应付托管费		8,312.25	10,411.18
应付销售服务费		7,235.88	4,368.99
应付交易费用	6.4.2.7	5,086.27	9,880.04
应交税费		-	-
应付利息		481.16	-
应付利润		12,266.98	11,317.25
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.2.8	189,665.10	131,730.17
负债合计		10,243,703.17	193,735.48
所有者权益:			
实收基金	6.4.2.9	122,673,737.74	111,801,767.06
未分配利润	6.4.2.10	-	-
所有者权益合计		122,673,737.74	111,801,767.06
负债和所有者权益总计		132,917,440.91	111,995,502.54

注:报告截止日2015年6月30日,A级基金份额净值人民币1.00元,基金份额总额2,657,318.44份;B级基金份额净值人民币1.00元,基金份额总额73,829,142.87份;E级基金份额净值人民币1.00元,基金份额总额46,187,276.43份。基金份额总额122,673,737.74份。

6.2 利润表

会计主体:大成添利宝货币市场基金

本报告期:2015年1月1日至2015年6月30日

单位:人民币元

项 目	附注号	本期 2015年1月1日至2015年6月 30日
一、收入		2,631,351.31
1.利息收入		2,611,181.37

其中：存款利息收入	6.4.2.11	1,424,580.02
债券利息收入		779,339.60
资产支持证券利息收入		-
买入返售金融资产收入		407,261.75
其他利息收入		-
2.投资收益（损失以“-”填列）		20,169.94
其中：股票投资收益	6.4.2.12	-
基金投资收益		-
债券投资收益	6.4.2.13	20,169.94
资产支持证券投资收益	6.4.2.13.1	-
贵金属投资收益	6.4.2.14	-
衍生工具收益	6.4.2.15	-
股利收益	6.4.2.16	-
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.2.17	-
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.2.18	-
减：二、费用		414,195.61
1. 管理人报酬	6.4.5.2.1	112,458.69
2. 托管费	6.4.5.2.2	44,983.51
3. 销售服务费	6.4.5.2.3	43,009.64
4. 交易费用	6.4.2.19	-
5. 利息支出		45,992.49
其中：卖出回购金融资产支出		45,992.49
6. 其他费用	6.4.2.20	167,751.28
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		2,217,155.70
减：所得税费用		-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		2,217,155.70

注：本基金合同生效日为 2014 年 7 月 28 日，本报告期自 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日止。截至报告日，本基金合同生效未满一年，本报告期的财务报表及报表附注均无同期对比数据，下同。

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：大成添利宝货币市场基金

本报告期：2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	111,801,767.06	-	111,801,767.06

项目		本期末 2015 年 6 月 30 日			
		摊余成本	影子定价	偏离金额	偏离度
债券	交易所市场	-	-	-	-
	银行间市场	50,004,014.03	50,246,000.00	241,985.97	0.1973%
	合计	50,004,014.03	50,246,000.00	241,985.97	0.1973%

注：1、 偏离金额=影子定价-摊余成本；

2、 偏离度=偏离金额/摊余成本法确定的基金资产净值。

6.4.2.3 衍生金融资产/负债

本基金于本报告期末未持有衍生金融资产/负债。

6.4.2.4 买入返售金融资产

6.4.2.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

单位：人民币元

项目	本期末 2015 年 6 月 30 日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
买入返售证券_银行间	36,800,295.20	-
合计	36,800,295.20	-

6.4.2.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金于本报告期末未持有买断式买入返售金融资产。

6.4.2.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2015 年 6 月 30 日
应收活期存款利息	2,215.98
应收定期存款利息	-
应收其他存款利息	323,167.25
应收结算备付金利息	22.50
应收债券利息	747,888.67
应收买入返售证券利息	25,216.32
应收申购款利息	-
应收黄金合约拆借孳息	-
其他	-

合计	1,098,510.72
----	--------------

6.4.2.6 其他资产

无。

6.4.2.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2015年6月30日
交易所市场应付交易费用	-
银行间市场应付交易费用	5,086.27
合计	5,086.27

6.4.2.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2015年6月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	-
银行手续费	1,814.57
预提费用	187,850.53
合计	189,665.10

6.4.2.9 实收基金

金额单位：人民币元

大成添利宝 A		
项目	本期 2015年1月1日至2015年6月30日	
	基金份额(份)	账面金额
上年度末	1,711,163.29	1,711,163.29
本期申购	8,046,018.35	8,046,018.35
本期赎回(以“-”号填列)	-7,099,863.20	-7,099,863.20
本期末	2,657,318.44	2,657,318.44

金额单位：人民币元

大成添利宝 B		
项目	本期 2015年1月1日至2015年6月30日	
	基金份额(份)	账面金额

上年度末	51,262,024.20	51,262,024.20
本期申购	60,891,606.05	60,891,606.05
本期赎回(以“-”号填列)	-38,324,487.38	-38,324,487.38
本期末	73,829,142.87	73,829,142.87

金额单位：人民币元

大成添利宝 E		
项目	本期 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	58,828,579.57	58,828,579.57
本期申购	241,675,029.29	241,675,029.29
本期赎回(以“-”号填列)	-254,316,332.43	-254,316,332.43
本期末	46,187,276.43	46,187,276.43

注：申购含红利再投份额，分级调整的基金份额和金额以及基金转入的份额和金额；本年赎回包含分级调整的基金份额和金额以及基金转出的份额和金额。

6.4.2.10 未分配利润

单位：人民币元

大成添利宝 A			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-	-	-
本期利润	28,931.96	-	28,931.96
本期基金份额交易产生的变动数	-	-	-
其中：基金申购款	-	-	-
基金赎回款	-	-	-
本期已分配利润	-28,931.96	-	-28,931.96
本期末	-	-	-

单位：人民币元

大成添利宝 B			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-	-	-
本期利润	1,197,128.00	-	1,197,128.00
本期基金份额交易产生的变动数	-	-	-
其中：基金申购款	-	-	-
基金赎回款	-	-	-
本期已分配利润	-1,197,128.00	-	-1,197,128.00
本期末	-	-	-

单位：人民币元

大成添利宝 E			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-	-	-
本期利润	991,095.74	-	991,095.74
本期基金份额交易产生的变动数	-	-	-
其中：基金申购款	-	-	-
基金赎回款	-	-	-
本期已分配利润	-991,095.74	-	-991,095.74
本期末	-	-	-

注：本基金基金份额净值保持为 1.00 元，根据每日基金收益情况，以基金净收益为基准，为投资人每日计算当日收益并全部分配。

6.4.2.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	33,537.74
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	1,390,873.32
结算备付金利息收入	168.96
其他	-
合计	1,424,580.02

6.4.2.12 股票投资收益

无。

6.4.2.13 债券投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	50,730,196.82
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	49,918,013.44
减：应收利息总额	792,013.44
买卖债券差价收入	20,169.94

6.4.2.13.1 资产支持证券投资收益

无。

6.4.2.14 贵金属投资收益

无。

6.4.2.15 衍生工具收益

无。

6.4.2.16 股利收益

无。

6.4.2.17 公允价值变动收益

无。

6.4.2.18 其他收入

无。

6.4.2.19 交易费用

无。

6.4.2.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期
	2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日
审计费用	19,835.79
信息披露费	119,014.74
其他	200.00
债券托管帐户维护费	18,000.00
银行划款手续费	10,700.75
合计	167,751.28

6.4.3 或有事项、资产负债表日后事项的说明**6.4.3.1 或有事项**

截至资产负债表日，本基金无需要说明的重大或有事项。

6.4.3.2 资产负债表日后事项

截至本会计报表批准报出日，本基金无需作披露的资产负债表日后事项。

6.4.4 关联方关系

6.4.4.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

无。

6.4.4.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
大成基金管理有限公司(“大成基金”)	基金管理人、注册登记机构、基金销售机构
兴业银行股份有限公司(“兴业银行”)	基金托管人、基金销售机构
中泰信托有限责任公司	基金管理人的股东
光大证券股份有限公司(“光大证券”)	基金管理人的股东、基金销售机构
中国银河投资管理有限公司	基金管理人的股东
广东证券股份有限公司(“广东证券”)	基金管理人的股东
大成国际资产管理有限公司(“大成国际”)	基金管理人的子公司
大成创新资本管理有限公司(“大成创新资本”)	基金管理人的合营企业

注：1、中国证监会于 2005 年 11 月 6 日作出对广东证券取消业务许可并责令关闭的行政处罚。

2、以下关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.5 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.5.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.5.1.1 股票交易

无。

6.4.5.1.2 权证交易

无。

6.4.5.1.3 应支付关联方的佣金

无。

6.4.5.2 关联方报酬

6.4.5.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	112,458.69
其中：支付销售机构的客户维护费	4,437.84

注：本基金的管理费按前一日基金资产净值的 0.20% 年费率计提。管理费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.20\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金管理人向基金托管人发送基金管理费划款指令，基金托管人复核后于次月前 3 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。若遇法定节假日、公休假等，支付日期顺延。

6.4.5.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期
	2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	44,983.51

注：本基金的托管费按前一日基金资产净值的 0.08% 的年费率计提。托管费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.08\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金管理人向基金托管人发送基金托管费划款指令，基金托管人复核后于次月前 3 个工作日内从基金财产中一次性支取。若遇法定节假日、公休日等，支付日期顺延。

6.4.5.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期			
	2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日			
	当期发生的基金应支付的销售服务费			
	大成添利宝 A	大成添利宝 B	大成添利宝 E	合计
大成基金	583.07	2,740.17	33,987.68	37,310.92
兴业银行	0.00	0.00	0.00	0.00
光大证券	26.64	0.00	22.72	49.36
合计	609.71	2,740.17	34,010.40	37,360.28

注：本基金 A 级基金份额的基金销售服务费按前一日基金资产净值的 0.25% 的年费率计提，B 级基金份额的基金销售服务费按前一日基金资产净值的 0.01% 的年费率计提，E 级基金份额的基金销售服务费按前一日基金资产净值的 0.15% 的年费率计提。销售服务费计提的计算公式具体如下：

$$H = E \times \text{年销售服务费率} \div \text{当年天数}$$

H 为每日该类基金份额应计提的基金销售服务费

E 为前一日该类基金份额的基金资产净值

基金销售服务费每日计提，按月支付。由基金管理人向基金托管人发送基金销售服务费划付指令，经基金托管人复核后于次月首日起 3 个工作日内从基金财产中一次性支付给注册登记机构，由注册登记机构代付给销售机构。

6.4.5.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金本报告期末与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。

6.4.5.4 各关联方投资本基金的情况

6.4.5.4.1 报告期内基金管理人运用自有资金投资本基金的情况

份额单位：份

项目	本期 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日		
	大成添利宝 A	大成添利宝 B	大成添利宝 E
基金合同生效日（2014 年 7 月 28 日）持有的基金份额	-	-	-
期初持有的基金份额	-	-	244.17
期间申购/买入总份额	-	-	0.00
期间因拆分变动份额	-	-	0.00
减：期间赎回/卖出总份额	-	-	244.17
期末持有的基金份额	-	-	0.00
期末持有的基金份额占基金总份额比例	-	-	0.0000%

注：基金管理人申赎本基金的费率与本基金法律文件规定一致。

6.4.5.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

大成添利宝 B

份额单位：份

关联方名称	本期末 2015 年 6 月 30 日		上年度末 2014 年 12 月 31 日	
	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例
大成创新资本	183,641.98	0.1497%	17,126,247.38	15.3184%

注：基金管理人子公司一大成创新资本申赎本基金的费率与本基金法律文件规定一致。

6.4.5.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日

	期末余额	当期利息收入
兴业银行	2,362,687.62	33,537.74

6.4.5.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期末在承销期内参与关联方承销证券。

6.4.5.7 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期无须作说明的其他关联交易事项。

6.4.6 利润分配情况

6.4.6.1 利润分配情况——货币市场基金

金额单位：人民币元

大成添利宝A

已按再投资形式转实收基金	直接通过应付赎回款转出金额	应付利润本年变动	本期利润分配合计	备注
28,843.01	-	88.95	28,931.96	-

大成添利宝B

已按再投资形式转实收基金	直接通过应付赎回款转出金额	应付利润本年变动	本期利润分配合计	备注
1,194,919.15	-	2,208.85	1,197,128.00	-

大成添利宝E

已按再投资形式转实收基金	直接通过应付赎回款转出金额	应付利润本年变动	本期利润分配合计	备注
992,443.81	-	-1,348.07	991,095.74	-

6.4.7 期末（2015年6月30日）本基金持有的流通受限证券

6.4.7.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

本基金于本报告期末未持有因认购新发/增发证券而流通受限的证券。

6.4.7.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金于本报告期末未持有暂时停牌的股票。

6.4.7.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.7.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末 2015 年 6 月 30 日止，本基金从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证

券款余额 9,999,875.00 元，是以如下债券作为质押：

金额单位：人民币元

债券代码	债券名称	回 购 到 期 日	期末估值单价	数量（张）	期末估值总额
071523002	15 长 城 证 券 CP002	2015-7-1	100.00	100,000	9,999,801.26
合计				100,000	9,999,801.26

6.4.7.3.2 交易所市场债券正回购

于本报告期末，本基金无从事交易所市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

6.4.8 金融工具风险及管理

6.4.8.1 风险管理政策和组织架构

本基金是货币市场基金，其风险和预期收益率低于股票基金、混合基金和普通债券型基金，属于预期风险收益水平较低的品种。本基金在日常经营活动中涉及的财务风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金管理人制定了政策和程序来识别及分析这些风险，并设定适当的风险限额及内部控制流程，通过可靠的管理及信息系统持续监控上述各类风险。

本基金的基金管理人奉行全面风险管理体系的建设，建立了以由高层监控(董事会合规审计和风险控制委员会、公司投资风险控制委员会)、专业监控(监察稽核部、风险管理部)、部门互控、岗位自控构成的风险管理架构体系。本基金的基金管理人在董事会下设立合规审计和风险控制委员会，对公司整体运营风险进行监督，监督风险控制措施的执行。在管理层层面设立投资风险控制委员会，通过定期会议讨论涉及投资风险的重大议题，形成正式决议提交投委会。在业务操作层面，监察稽核部履行合规控制职责，通过定期、不定期检查内控制度的执行情况、对重大风险点以专项稽核的方式确保公司内控制度、流程得到贯彻执行。风险管理部履行风险量化评估分析职责。

本基金的基金管理人对于金融工具的风险管理方法主要是通过定性分析和定量分析的方法去估测各种风险产生的可能损失。从定性分析的角度出发，判断风险损失的严重程度和出现同类风险损失的频度。而从定量分析的角度出发，根据本基金的投资目标，结合基金资产所运用金融工具特征通过特定的风险量化指标、模型，日常的量化报告，确定风险损失的限度和相应置信程度，及时可靠地对各种风险进行监督、检查和评估，并通过相应决策，将风险控制在可承受的范围内。

6.4.8.2 信用风险

6.4.8.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2015 年 6 月 30 日	上年度末 2014 年 12 月 31 日
A-1	39,994,409.38	19,974,593.65
A-1 以下	-	-
未评级	10,009,604.65	19,969,350.72
合计	50,004,014.03	39,943,944.37

6.4.8.2.2 按长期信用评级列示的债券投资

长期信用评级	本期末 2015 年 6 月 30 日	上年度末 2014 年 12 月 31 日
AAA	-	-
AAA 以下	-	-
未评级	-	-
合计	-	-

6.4.8.3 流动性风险

流动性风险是指基金在履行与金融负债有关的义务时遇到资金短缺的风险。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难或因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理的价格变现。

针对兑付赎回资金的流动性风险，本基金的基金管理人每日对本基金的申购赎回情况进行严密监控并预测流动性需求，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配。本基金的基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。

针对投资品种变现的流动性风险，本基金的基金管理人主要通过限制、跟踪和控制基金投资交易的不活跃品种(企业债或短期融资券)来实现。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 120 天，且能够通过出售所持有的银行间同业市场交易债券应对流动性需求。此外本基金还可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，除发生巨额赎回情形外，债券正回购的资金余额在每个交易日均不得超过基金资产净值的 20%。

于 2015 年 6 月 30 日，本基金所承担的全部金融负债的合同约定到期日均为一个月以内且不计息，可赎回基金份额净值(所有者权益)无固定到期日且不计息，因此账面余额即为未折现的合约到期现金流量。

6.4.8.4 市场风险

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动而发生波动的风险，包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

6.4.8.4.1 利率风险

利率风险是指金融工具的公允价值或现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。利率敏感性金融工具均面临由于市场利率上升而导致公允价值下降的风险，其中浮动利率类金融工具还面临每个付息期间结束根据市场利率重新定价时对于未来现金流影响的风险。

本基金主要投资于银行间同业市场交易的固定收益品种，因此存在相应的利率风险。本基金的基金管理人每日通过“影子定价”对本基金面临的市场风险进行监控，定期对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控，并通过调整投资组合的久期等方法对上述利率风险进行管理。

6.4.8.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2015年6月 30日	6个月以内	6个月-1年	1-5年	5年 以上	不计息	合计
资产						
银行存款	44,362,687.62	-	-	-	-	44,362,687.62
结算备付金	50,000.00	-	-	-	-	50,000.00
交易性金融 资产	20,009,405.91	29,994,608.12	-	-	-	50,004,014.03
买入返售金 融资产	36,800,295.20	-	-	-	-	36,800,295.20
应收利息	-	-	-	-	1,098,510.72	1,098,510.72
应收申购款	-	-	-	-	601,933.34	601,933.34
资产总计	101,222,388.73	29,994,608.12	-	-	1,700,444.06	132,917,440.91
负债						
卖出回购金 融资产款	9,999,875.00	-	-	-	-	9,999,875.00
应付管理人 报酬	-	-	-	-	20,780.53	20,780.53
应付托管费	-	-	-	-	8,312.25	8,312.25
应付销售服 务费	-	-	-	-	7,235.88	7,235.88
应付交易费 用	-	-	-	-	5,086.27	5,086.27
应付利息	-	-	-	-	481.16	481.16
应付利润	-	-	-	-	12,266.98	12,266.98
其他负债	-	-	-	-	189,665.10	189,665.10
负债总计	9,999,875.00	-	-	-	243,828.17	10,243,703.17
利率敏感度 缺口	91,222,513.73	29,994,608.12	-	-	1,456,615.89	122,673,737.74
上年度末	6个月以内	6个月-1年	1-5	5年	不计息	合计

2014 年 12 月 31 日			年	以上		
资产						
银行存款	67,824,000.88		-	-	-	67,824,000.88
结算备付金	19,500.00		-	-	-	19,500.00
交易性金融资产		39,943,944.37	-	-	-	39,943,944.37
应收利息			-	-	656,705.68	656,705.68
应收申购款			-	-	3,551,155.61	3,551,155.61
其他资产			-	-	196.00	196.00
资产总计	67,843,500.88	39,943,944.37	-	-	4,208,057.29	111,995,502.54
负债						
应付管理人报酬			-	-	26,027.85	26,027.85
应付托管费			-	-	10,411.18	10,411.18
应付销售服务费			-	-	4,368.99	4,368.99
应付交易费用			-	-	9,880.04	9,880.04
应付利润			-	-	11,317.25	11,317.25
其他负债			-	-	131,730.17	131,730.17
负债总计			-	-	193,735.48	193,735.48
利率敏感度缺口	67,843,500.88	39,943,944.37	-	-	4,014,321.81	111,801,767.06

注：表中所示为本基金资产及负债的账面价值，并按照合约规定的利率重新定价日或到期日孰早予以分类。

6.4.8.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	除市场利率以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末 2015 年 6 月 30 日	上年度末 2014 年 12 月 31 日
	1. 市场利率下降 25 个基点	60,940.00	200,000.00
2. 市场利率上升 25 个基点	-60,729.00	-200,000.00	

6.4.8.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无重大外汇风险。

6.4.8.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于银行间同业市场交易的固定收益品种，因此无重大市场价格风险。

6.4.9 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

无。

§ 7 投资组合报告**7.1 期末基金资产组合情况**

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	固定收益投资	50,004,014.03	37.62
	其中：债券	50,004,014.03	37.62
	资产支持证券	-	-
2	买入返售金融资产	36,800,295.20	27.69
	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	44,412,687.62	33.41
4	其他各项资产	1,700,444.06	1.28
5	合计	132,917,440.91	100.00

7.2 债券回购融资情况

金额单位：人民币元

序号	项目	占基金资产净值的比例 (%)	
1	报告期内债券回购融资余额	3.00	
	其中：买断式回购融资	-	
序号	项目	金额	占基金资产净值的比例 (%)
2	报告期末债券回购融资余额	9,999,875.00	8.15

其中：买断式回购融资	-	-
------------	---	---

注：报告期内债券回购融资余额占基金资产净值的比例为报告期内每个交易日融资余额占资产净值比例的简单平均值。

债券正回购的资金余额超过基金资产净值的 20% 的说明

本报告期内无债券正回购的资金余额超过基金资产净值的 20% 的情况。

7.3 基金投资组合平均剩余期限

7.3.1 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	71
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	111
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	24

报告期内投资组合平均剩余期限超过 180 天情况说明

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 120 天”，本报告期内，本基金未发生超标情况。

7.3.2 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	74.35	8.15
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	0.00
2	30 天(含)—60 天	-	0.00
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	0.00
3	60 天(含)—90 天	8.16	0.00
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	0.00
4	90 天(含)—180 天	-	0.00
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	0.00
5	180 天(含)—397 天(含)	24.45	0.00
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	0.00
合计		106.96	8.15

7.4 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	摊余成本	占基金资产净值比例 (%)
1	国家债券	-	0.00
2	央行票据	-	0.00
3	金融债券	10,009,604.65	8.16
	其中：政策性金融债	10,009,604.65	8.16
4	企业债券	-	0.00
5	企业短期融资券	39,994,409.38	32.60
6	中期票据	-	0.00
7	其他	-	0.00
8	合计	50,004,014.03	40.76
9	剩余存续期超过 397 天的浮动利率债券	-	0.00

7.5 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

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	债券数量(张)	摊余成本	占基金资产净值比例 (%)
1	140444	14 农发 44	100,000	10,009,604.65	8.16
2	041555008	15 中山兴中 CP001	100,000	10,000,585.85	8.15
3	071523002	15 长城证券 CP002	100,000	9,999,801.26	8.15
4	041572004	15 江阴公 CP001	100,000	9,997,052.22	8.15
5	041558035	15 通泰 CP001	100,000	9,996,970.05	8.15

7.6 “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	20
报告期内偏离度的最高值	0.2976%
报告期内偏离度的最低值	-0.0603%
报告期内每个交易日偏离度的绝对值的简单平均值	0.0965%

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7.8 投资组合报告附注

7.8.1 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。

7.8.2 本报告期内不存在基金持有剩余期限小于 397 天但剩余存续期超过 397 天的浮动利率债券的摊余成本超过当日基金资产净值的 20%的情况。

7.8.3 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。

7.8.4 期末其他各项资产构成

单位:人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	-
2	应收证券清算款	-
3	应收利息	1,098,510.72
4	应收申购款	601,933.34
5	其他应收款	-
6	待摊费用	-
7	其他	-
8	合计	1,700,444.06

7.8.5 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。

§ 8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位:份

份额级别	持有人户数(户)	户均持有的基金份额	持有人结构			
			机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例
大成添利宝 A	886	2,999.23	1,644.26	0.06%	2,655,674.18	99.94%
大成添利宝 B	30	2,460,971.43	68,312,151.70	92.53%	5,516,991.17	7.47%
大成	38,753	1,191.84	537.60	0.00%	46,186,738.83	100.00%

添利宝 E						
合计	39,669	3,092.43	68,314,333.56	55.69%	54,359,404.18	44.31%

注：1、下属分级基金份额比例的分母采用各自级别的份额，合计数比例的分母采用各分级基金份额的合计数。

2、持有人户数为有效户数，即存量份额大于零的账户。

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数（份）	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	大成添利宝 A	107.17	0.0040%
	大成添利宝 B	-	0.0000%
	大成添利宝 E	1,934,493.14	4.1884%
	合计	1,934,600.31	1.5770%

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

项目	份额级别	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	大成添利宝 A	0
	大成添利宝 B	0
	大成添利宝 E	0~10
	合计	0~10
本基金基金经理持有本开放式基金	大成添利宝 A	0
	大成添利宝 B	0
	大成添利宝 E	0
	合计	0

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

	大成添利宝 A	大成添利宝 B	大成添利宝 E

基金合同生效日（2014 年 7 月 28 日）基金份额总额	53,024,889.42	376,021,250.00	45,385,423.40
本报告期期初基金份额总额	1,711,163.29	51,262,024.20	58,828,579.57
本报告期基金总申购份额	8,046,018.35	60,891,606.05	241,675,029.29
减：本报告期基金总赎回份额	7,099,863.20	38,324,487.38	254,316,332.43
本报告期基金拆分变动份额 （份额减少以“-”填列）	-	-	-
本报告期期末基金份额总额	2,657,318.44	73,829,142.87	46,187,276.43

注：红利再投资和基金转换转入作为本期申购资金的来源，统一计入本期总申购份额，基金转换转出作为本期赎回资金的支付，统一计入本期总赎回份额，不单独列示。

§ 10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

报告期内无基金份额持有人大会决议。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

一、基金管理人的重大人事变动

1、基金管理人于 2015 年 1 月 13 日发布了《大成基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告》，经大成基金管理有限公司第六届董事会第一次会议审议通过，刘彩晖女士不再担任公司副总经理。

2、基金管理人于 2015 年 1 月 22 日发布了《大成基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告》，经大成基金管理有限公司第六届董事会第一次会议审议通过，由肖剑先生、钟鸣远先生任公司副总经理。

3、基金管理人于 2015 年 5 月 5 日发布了《大成基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告》，经大成基金管理有限公司第六届董事会第六次会议审议通过，刘明先生不再担任公司副总经理。

4、基金管理人于 2015 年 5 月 16 日发布了《大成基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告》，经大成基金管理有限公司第六届董事会第七次会议审议通过，肖冰先生不再担任公司副总经理。

二、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

无。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内没有涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

10.4 基金投资策略的改变

本基金投资策略在本报告期内没有重大改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金聘任的为本基金审计的会计师事务所为普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)，该事务所自基金合同生效日起为本基金提供审计服务至今。

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期，本基金管理人、托管人及高级管理人员未受到监管部门稽查或处罚。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
光大证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
招商证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-

注：根据中国证监会颁布的《关于完善证券投资基金交易席位制度有关问题的通知》（证监基金字[2007]48号）的有关规定，本公司制定了租用证券公司交易单元的选择标准和程序。

租用证券公司交易单元的选择标准主要包括：

- （一）财务状况良好，最近一年无重大违规行为；
- （二）经营行为规范，内控制度健全，能满足各投资组合运作的保密性要求；
- （三）研究实力较强，能提供包括研究报告、路演服务、协助进行上市公司调研等研究服务；
- （四）具备各投资组合运作所需的高效、安全的通讯条件，有足够的交易和清算能力，满足各投资组合证券交易需要；
- （五）能提供投资组合运作、管理所需的其他券商服务；

(六) 相关基金合同、资产管理合同以及法律法规规定的其他条件。

租用证券公司交易单元的程序：首先根据租用证券公司交易单元的选择标准形成《券商服务评价表》，然后根据评分高低进行选择基金交易单元。

本报告期内增加基金交易单元：无。本报告期内本基金退租席位：无。

10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例
光大证券	-	0.00%	15,000,000.00	100.00%	-	0.00%
招商证券	-	0.00%	-	-	-	0.00%

10.8 偏离度绝对值超过 0.5%的情况

本基金本报告期内无偏离度绝对值超过 0.5%的情况。

10.9 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	大成基金管理有限公司关于旗下部分基金增加张家港农商行为代销机构的公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2015/1/9
2	大成基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2015/1/13
3	大成基金管理有限公司关于网上交易银联通系统升级暂停服务的公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2015/1/14
4	大成添利宝货币市场基金 2014 年第 4 季度报告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2015/1/21
5	大成基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告（肖剑）	中国证监会指定报刊及本公司网站	2015/1/22
6	大成基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告（钟鸣远）	中国证监会指定报刊及本公司网站	2015/1/22
7	大成基金管理有限公司关于旗下部分基金增加上海天天基金销售有限公司为代销机构的公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2015/1/24
8	大成基金管理有限公司关于旗下部分基金增加上海天天基金销售有限公司为代销机构的公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2015/1/24

9	大成基金管理有限公司关于网上交易银联通支付通道升级暂停服务的公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2015/1/28
10	大成基金管理有限公司关于网上交易银联通银行通道升级暂停服务的更新公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2015/1/30
11	关于大成添利宝货币市场基金“春节”假期前暂停申购（定期定额申购除外）及基金转换转入业务公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2015/2/12
12	大成基金管理有限公司关于网上交易银联通银行通道恢复服务的公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2015/3/2
13	大成添利宝货币市场基金更新招募说明书（2015 年 1 期）	中国证监会指定报刊及本公司网站	2015/3/13
14	大成添利宝货币市场基金更新招募说明书摘要（2015 年 1 期）	中国证监会指定报刊及本公司网站	2015/3/13
15	大成基金管理有限公司关于调整网上直销基金转换及定投最低交易限额的公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2015/3/13
16	大成添利宝货币市场基金增聘基金经理公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2015/3/21
17	大成基金管理有限公司关于旗下证券投资基金估值调整情况的公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2015/3/25
18	大成添利宝货币市场基金 2014 年年度报告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2015/3/28
19	大成添利宝货币市场基金 2014 年年度报告摘要	中国证监会指定报刊及本公司网站	2015/3/28
20	大成基金管理有限公司关于网上直销交易平台银联通富滇银行支付通道暂停服务的公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2015/3/28
21	大成添利宝货币市场基金 2015 年第 1 季度报告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2015/4/18
22	关于大成添利宝货币市场基金“劳动节”假期前暂停申购（定期定额申购除外）及基金转换转入业务公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2015/4/27
23	大成基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2015/5/5
24	大成基金管理有限公司关于调整网上直销银联支付交易费率率的公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2015/5/8
25	关于大成基金官方网站及交易系统升级维护的公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2015/5/15
26	大成基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2015/5/16
27	大成基金管理有限公司关于增加北京钱景财富投资管理有限公司为开放式基金代销机构并开通相关业务的公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2015/5/19
28	关于在北京市开展打击以私募投资基金为名从事非法集资专项整治行动的通告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2015/6/24

§ 11 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§ 12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

- 1、中国证监会批准设立大成添利宝货币市场基金的文件；
- 2、《大成添利宝货币市场基金基金合同》；
- 3、《大成添利宝货币市场基金托管协议》；
- 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。

12.2 存放地点

本年度报告存放在本基金管理人和托管人的办公住所。

12.3 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
2015年8月27日