

大成月月盈短期理财债券型证券投资基金  
2017 年半年度报告  
2017 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：中国银行股份有限公司

送出日期：2017 年 8 月 24 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。

基金托管人中国银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2017 年 8 月 22 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 2017 年 01 月 01 日起至 06 月 30 日止。

## 1.2 目录

<b>§1 重要提示及目录</b> .....	<b>2</b>
1.1 重要提示.....	2
1.2 目录.....	3
<b>§2 基金简介</b> .....	<b>6</b>
2.1 基金基本情况.....	6
2.2 基金产品说明.....	6
2.3 基金管理人和基金托管人.....	7
2.4 信息披露方式.....	7
2.5 其他相关资料.....	8
<b>§3 主要财务指标和基金净值表现</b> .....	<b>9</b>
3.1 主要会计数据和财务指标.....	9
3.2 基金净值表现.....	9
3.3 其他指标.....	12
<b>§4 管理人报告</b> .....	<b>13</b>
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	13
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	14
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	14
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.....	15
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	15
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	15
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	16
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.....	16
<b>§5 托管人报告</b> .....	<b>17</b>
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	17
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.....	17
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.....	17
<b>§6 半年度财务会计报告（未经审计）</b> .....	<b>18</b>
6.1 资产负债表.....	18
6.2 利润表.....	18
6.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	18
6.4 报表附注.....	20
<b>§7 投资组合报告</b> .....	<b>42</b>
7.1 期末基金资产组合情况.....	42
7.2 债券回购融资情况.....	42
7.3 基金投资组合平均剩余期限.....	43
7.4 报告期内投资组合平均剩余存续期超过 240 天情况说明.....	44
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	45
7.6 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.....	45
7.7 “影子定价”与“摊余成本法”确定的基金资产净值的偏离.....	46
7.8 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.....	46
7.9 投资组合报告附注.....	47
<b>§8 基金份额持有人信息</b> .....	<b>48</b>
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	48
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	49

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.....	50
<b>§ 9 开放式基金份额变动.....</b>	<b>51</b>
<b>§10 重大事件揭示.....</b>	<b>52</b>
10.1 基金份额持有人大会决议.....	52
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.....	52
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	52
10.4 基金投资策略的改变.....	52
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	52
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.....	52
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	52
10.8 偏离度绝对值超过 0.5%的情况.....	57
10.9 其他重大事件.....	57
<b>§11 影响投资者决策的其他重要信息.....</b>	<b>58</b>
11.1 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.....	58
11.2 影响投资者决策的其他重要信息.....	58
<b>§12 备查文件目录.....</b>	<b>59</b>
12.1 备查文件目录.....	59
12.2 存放地点.....	59
12.3 查阅方式.....	59

## §2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	大成月月盈短期理财债券型证券投资基金		
基金简称	大成月月盈短期理财债券		
基金主代码	090023		
交易代码	090023		
基金运作方式	契约型开放式		
基金合同生效日	2014 年 9 月 12 日		
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		
报告期末基金份额总额	9,914,652,253.08 份		
基金合同存续期	不定期		
下属分级基金的基金简称:	大成月月盈短期理财债券 A	大成月月盈短期理财债券 B	大成月月盈短期理财债券 E
下属分级基金的交易代码:	090023	091023	001516
报告期末下属分级基金的份额总额	75,042,952.88 份	8,300,369,856.20 份	1,539,239,444.00 份

### 2.2 基金产品说明

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、品种选择和其他衍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	本基金属于短期理财债券型证券投资基金，长期风险收益水平低于股票型基金、混合型基金，及普通债券型证券投资基金。

### 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	中国银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	罗登攀
	联系电话	0755-83183388
	电子邮箱	office@dcfund.com.cn
客户服务电话	4008885558	95566
传真	0755-83199588	010-66594942
注册地址	深圳市福田区深南大道 7088 号招商银行大厦 32 层	北京市西城区复兴门内大街 1 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	北京市西城区复兴门内大街 1 号

邮政编码	518040	100818
法定代表人	刘卓	田国立

## 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》、《上海证券报》、《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	基金管理人及基金托管人住所

## 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	大成月月盈短期理财债券 A	大成月月盈短期理财债券 B	大成月月盈短期理财债券 E
3.1.1 期间数据和指标	报告期( 2017 年 1 月 1 日 - 2017 年 6 月 30 日 )	报告期( 2017 年 1 月 1 日 - 2017 年 6 月 30 日 )	报告期( 2017 年 1 月 1 日 - 2017 年 6 月 30 日 )
本期已实现收益	600,610.44	145,994,961.42	18,022,919.22
本期利润	600,610.44	145,994,961.42	18,022,919.22
本期净值收益率	1.9873%	2.1364%	1.9715%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末( 2017 年 6 月 30 日 )		
期末基金资产净值	75,042,952.88	8,300,369,856.20	1,539,239,444.00
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( 2017 年 6 月 30 日 )		
累计净值收益率	11.4745%	12.3804%	7.1258%

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 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

大成月月盈短期理财债券 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	0.3877%	0.0011%	0.1110%	0.0000%	0.2767%	0.0011%
过去三个月	1.0579%	0.0009%	0.3366%	0.0000%	0.7213%	0.0009%
过去六个月	1.9873%	0.0022%	0.6695%	0.0000%	1.3178%	0.0022%
过去一年	3.3923%	0.0027%	1.3481%	0.0000%	2.0442%	0.0027%
自基金合同 生效起至今	11.4745%	0.0116%	3.7800%	0.0000%	7.6945%	0.0116%

大成月月盈短期理财债券 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	0.4149%	0.0011%	0.1110%	0.0000%	0.3039%	0.0011%
过去三个月	1.1339%	0.0009%	0.3366%	0.0000%	0.7973%	0.0009%
过去六个月	2.1364%	0.0022%	0.6695%	0.0000%	1.4669%	0.0022%
过去一年	3.6937%	0.0027%	1.3481%	0.0000%	2.3456%	0.0027%
自基金合同 生效起至今	12.3804%	0.0116%	3.7800%	0.0000%	8.6004%	0.0116%

大成月月盈短期理财债券 E

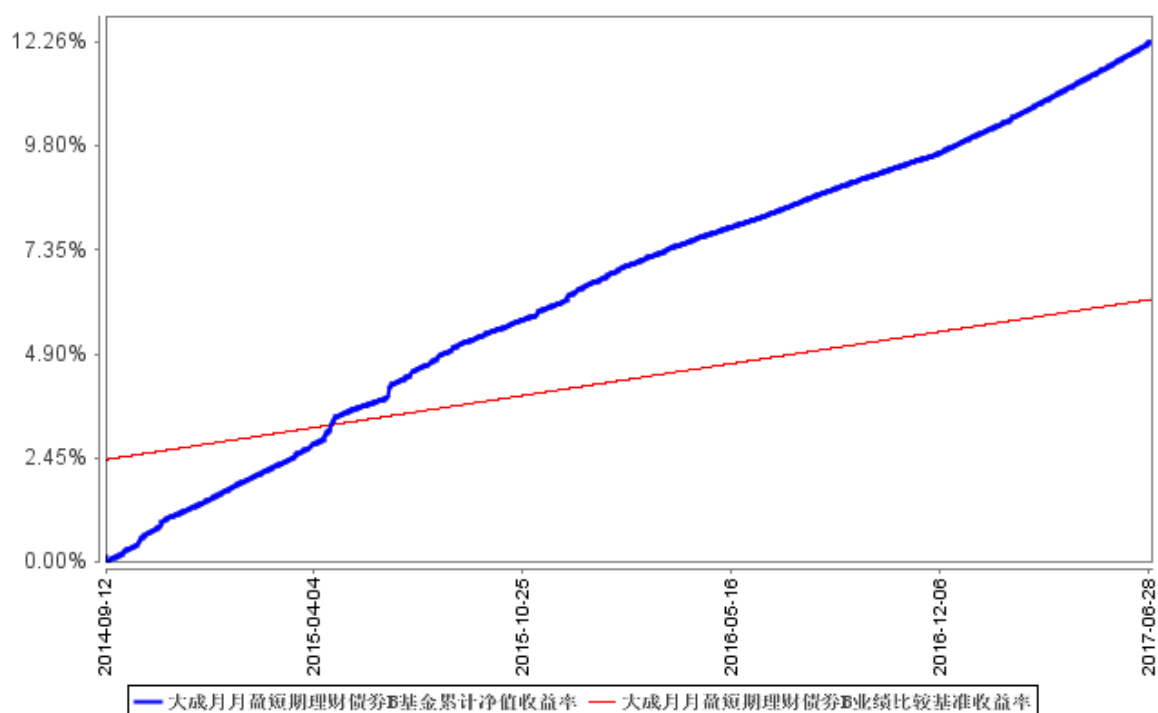
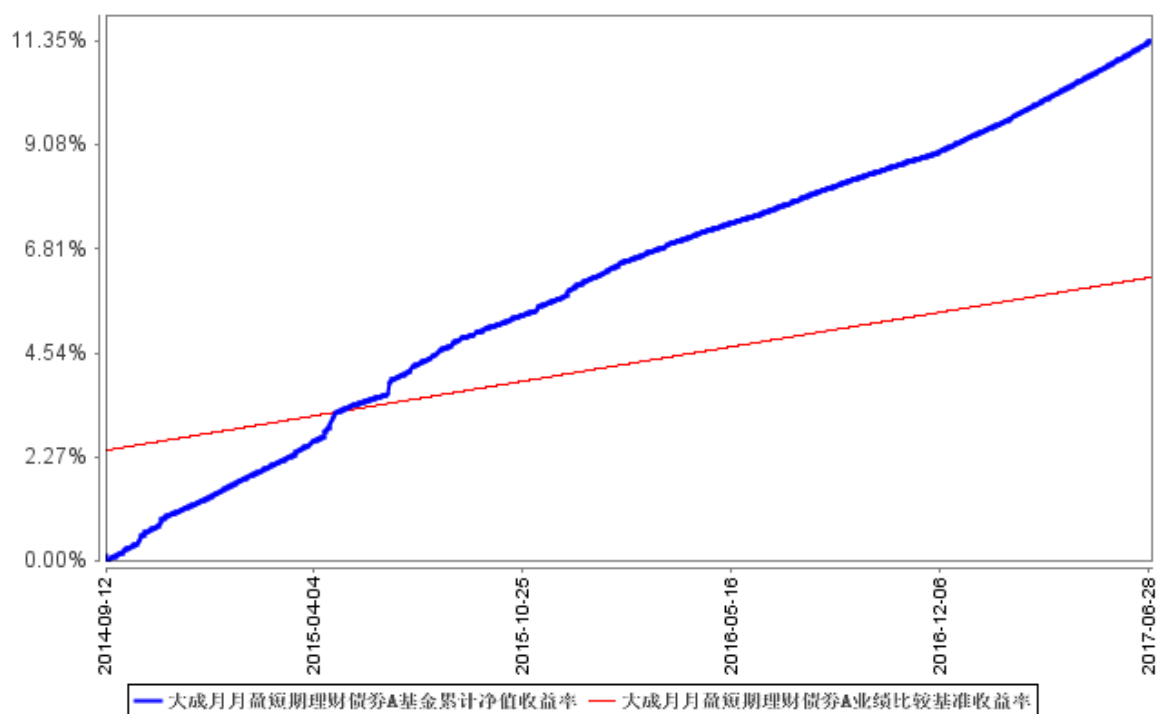
阶段	份额净值 收益率①	份额净值 收益率标 准差②	业绩比较 基准收益 率③	业绩比较基 准收益率标 准差④	①—③	②—④
过去一个月	0.3670%	0.0011%	0.1110%	0.0000%	0.2560%	0.0011%
过去三个月	1.0387%	0.0009%	0.3366%	0.0000%	0.7021%	0.0009%
过去六个月	1.9715%	0.0022%	0.6695%	0.0000%	1.3020%	0.0022%
过去一年	3.3827%	0.0027%	1.3481%	0.0000%	2.0346%	0.0027%
自基金合同 生效起至今	7.1258%	0.0069%	2.7444%	0.0000%	4.3814%	0.0069%

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。

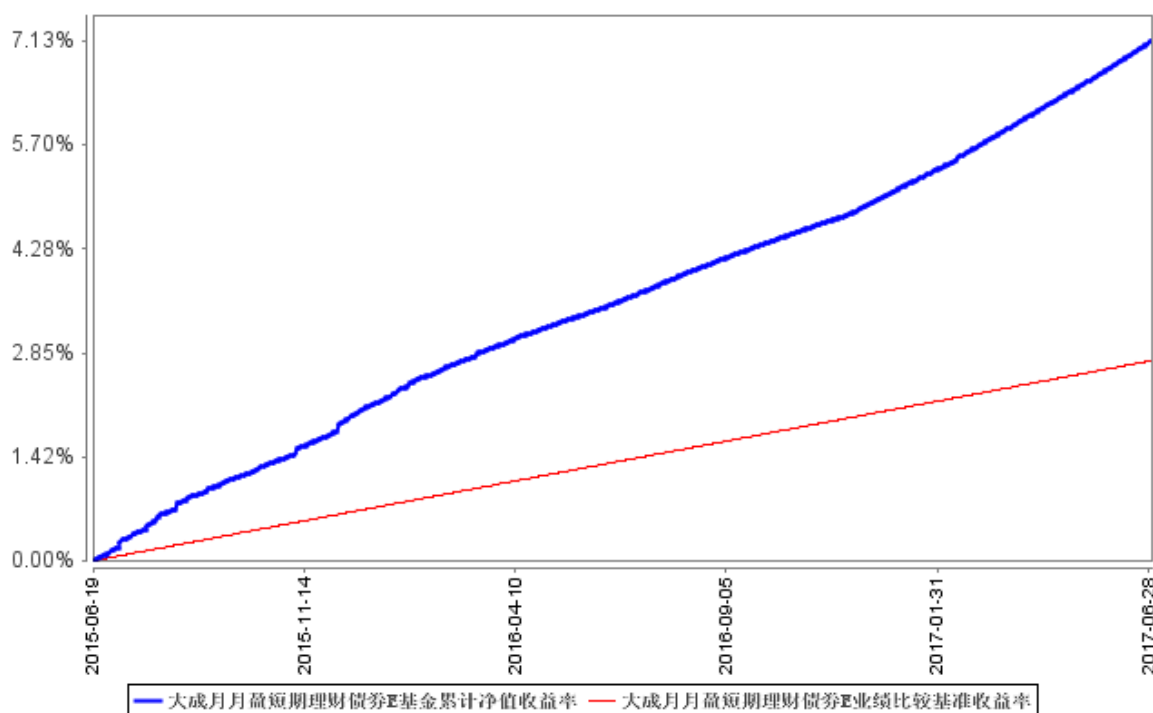
2、本表净值收益率的计算所采取的运作周期，是按各统计时间段计算以基金合同生效日为起始日并持有至报告期末的基金份额所经历的运作周期。

- 3、本基金自 2015 年 6 月 19 日起，新增 E 类份额。
- 4、本基金自 2014 年 9 月 12 日起由大成理财 21 天债券型发起式证券投资基金转为大成月月盈短期理财债券证券投资基金。

### 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. 按基金合同规定，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。截至报告期末，本基金的各项投资比例已达到基金合同中规定的各项比例。

2. 本基金自 2015 年 6 月 16 日起增设 E 类基金份额（E 类份额基金代码：001516）。

## §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。目前公司由三家股东组成，分别为中泰信托有限责任公司(50%)、光大证券股份有限公司(25%)、中国银河投资管理有限公司(25%)。主要业务是公募基金的募集、销售和管理，还具有全国社保基金投资管理、基本养老保险投资管理、受托管理保险资金、保险保障基金投资管理、特定客户资产管理和 QDII 业务资格。

经过十多年的稳健发展，公司形成了强大稳固的综合实力。公司旗下基金产品齐全、风格多样，构建了涵盖股票型基金、混合型基金、指数型基金、债券型基金和货币市场基金的完备产品线。截至 2017 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，4 只 QDII 基金及

74 只开放式证券投资基金。

#### 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		
张文平 先生	本基金基金 经理	2015 年 7 月 1 日	-	6 年	<p>南京大学管理学硕士，注册会 计师，2009 年 10 月至 2011 年 5 月就职于毕马威企业咨询 有限公司南京分公司审计部； 2011 年起加入大成基金管理 有限公司，历任固定收益部助 理研究员。2013 年 11 月 25 日至 2015 年 3 月 5 日担任大 成景祥分级债券型证券投资基 金基金经理助理。2015 年 3 月 7 日至 2016 年 11 月 18 日 担任大成景祥分级债券型证券 投资基金基金经理。2015 年 6 月 23 日起任大成景裕灵活 配置混合型证券投资基金基金 经理。2015 年 7 月 1 日至 2017 年 3 月 18 日任大成现金 宝场内实时申赎货币市场基金 基金经理。2015 年 7 月 1 日 起任大成月月盈短期理财债券 型证券投资基金基金经理。 2015 年 11 月 24 日起任大成 景沛灵活配置混合型证券投资 基金基金经理。2016 年 8 月</p>

					<p>6 日起任大成添利宝货币市场基金基金经理。2016 年 9 月 6 日起任大成景安短融债券型证券投资基金和大成现金增利货币市场基金基金经理。2016 年 9 月 20 日起任大成景辉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。</p> <p>国籍：中国。</p>
--	--	--	--	--	---

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

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 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。基金管理人运用统计分析方法和工具，对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进行分析。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些组合间的成交价格差异较大，但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，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存在 4 笔同日反向交易，原因为投资策略需要。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，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 6 笔同日反向交易，

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。

#### 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

2017 年上半年经济增长平稳，工业增速保持在 6.5%附近，由于食品价格涨幅偏低，整体通胀呈现温和态势。工业品价格小幅下跌，二季度 PPI 同比增速较一季度有所放缓。

金融数据看，企业整体融资需求出现了较明显的下降，一方面是由于金融监管加强使得表外融资减少，另一方面信贷额度受到控制，企业融资难度较大。

二季度银监会密集出台了多项监管文件，并派驻人员进场检查，展示了较强的去杠杆决心。在这种背景下，市场开始担心去杠杆的节奏和力度过大，市场抛盘加大，债券市场明显调整，带动债市一级发行难度明显加大，实体经济融资成本明显提升。在市场明显调整后，为稳定市场预期，监管通过及时的放松货币，并通过各种喊话缓和市场预期，取得了明显的效果，债券市场趋于稳定，其中信用债市场明显下行。

尽管银行出于考核的目的在季度末加大了揽存的力度，并明显提高了存款和存单的利率，但一季度末和二季度末资金市场总体平稳。

市场表现方面，上半年中债综合财富总值指数波动较小，下跌 0.12%。资金利率稳定，R007 均值约为 3.22%。利率债收益率先上后下，国开债各期限上行约 50-70bp。短融中票收益率上行 50-70bp，信用利差小幅扩大。

本组合在做好流动性管理基础上，灵活调整组合比例和结构，安排现金流到期情况，抓住有利时机建仓，提高组合静态收益，为持有人创造了一定的持有期回报。同时注重风险控制，保证了组合的安全。

##### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本报告期大成月月盈短期理财债券 A 的基金份额净值收益率为 1.9873%，本报告期大成月月盈短期理财债券 B 的基金份额净值收益率为 2.1364%，本报告期大成月月盈短期理财债券 E 的基金份额净值收益率为 1.9715%，同期业绩比较基准收益率为 0.6695%。

#### 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 2017 年下半年，经济增长和资金市场保持平稳的概率较大，金融监管的方向不会变，但是密切出台超预期政策的概率较小，监管机构之间可能会更注意监管协调。落实到债券市场，在基准利率调整概率很小的背景下，债市收益率易下难上，下行幅度取决于监管政策出台的力度和节奏，这仍需进一步观察。

本基金将继续维持稳健操作的风格，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、存单及金融债的投资比例，以期为持有人提供与基金合同相适应的回报。

#### 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、固定收益部、风险管理部、基金运营部、监察稽核部、委托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、固定收益部、风险管理部和委托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，截止报告期末未与外部估值定价服务机构签约。

#### 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。本报告期内本基金应分配利润 164,618,491.08 元，报告期内已分配利润 164,618,491.08 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

本报告期内，中国银行股份有限公司（以下称“本托管人”）在对大成月月盈短期理财债券型证券投资基金（以下称“本基金”）的托管过程中，严格遵守《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有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了应尽的义务。

### 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

本报告期内，本托管人根据《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，对本基金管理人的投资运作进行了必要的监督，对基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算以及基金费用开支等方面进行了认真地复核，未发现本基金管理人存在损害基金份额持有人利益的行为。

### 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

本报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告（注：财务会计报告中的“金融工具风险及管理”部分未在托管人复核范围内）、投资组合报告等数据真实、准确和完整。

## §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：大成月月盈短期理财债券型证券投资基金

报告截止日：2017年6月30日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2017年6月30日	上年度末 2016年12月31日
资产：			
银行存款	6.4.7.1	3,026,188,236.54	645,341,651.55
结算备付金		-	-
存出保证金		-	-
交易性金融资产	6.4.7.2	7,582,639,461.65	339,817,847.75
其中：股票投资		-	-
基金投资		-	-
债券投资		7,582,639,461.65	339,817,847.75
资产支持证券投资		-	-

贵金属投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	2,171,268,056.89	367,475,436.34
应收证券清算款		-	-
应收利息	6.4.7.5	43,389,699.10	5,500,418.48
应收股利		-	-
应收申购款		2,448,611.84	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	90,278.00	-
资产总计		12,826,024,344.02	1,358,135,354.12
负债和所有者权益	附注号	本期末 2017年6月30日	上年度末 2016年12月31日
负 债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		2,892,248,471.59	71,059,693.41
应付证券清算款		-	-
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		2,200,254.04	305,310.21
应付托管费		651,927.13	90,462.33
应付销售服务费		450,855.87	43,528.71
应付交易费用	6.4.7.7	192,102.15	47,713.88
应交税费		-	-
应付利息		621,049.27	12,613.14
应付利润		14,805,180.36	618,104.66
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	202,250.53	149,000.00
负债合计		2,911,372,090.94	72,326,426.34
所有者权益：			
实收基金	6.4.7.9	9,914,652,253.08	1,285,808,927.78
未分配利润	6.4.7.10	-	-
所有者权益合计		9,914,652,253.08	1,285,808,927.78
负债和所有者权益总计		12,826,024,344.02	1,358,135,354.12

注：报告截止日 2017 年 6 月 30 日，基金份额净值 1.0000 元，基金份额总额 9,914,652,253.08 份，其中 A 类基金份额总额为 75,042,952.88 份，B 类基金份额的份额总额为 8,300,369,856.20 份，E 类基金份额的份额总额为 1,539,239,444.00。

## 6.2 利润表

会计主体：大成月月盈短期理财债券型证券投资基金

本报告期：2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日
一、收入		194,827,928.89	7,567,952.86
1. 利息收入		192,863,876.55	6,763,402.60
其中：存款利息收入	6.4.7.11	93,491,825.54	1,810,539.56
债券利息收入		64,955,344.59	1,930,069.28
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		34,416,706.42	3,022,793.76
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		1,964,052.34	804,550.26
其中：股票投资收益	6.4.7.12	-	-
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.13	1,964,052.34	804,550.26
资产支持证券投资收益	6.4.7.13.1	-	-
贵金属投资收益	6.4.7.14	-	-
衍生工具收益	6.4.7.15	-	-
股利收益	6.4.7.16	-	-
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	-	-
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.18	-	-
减：二、费用		30,209,437.81	1,522,423.66
1. 管理人报酬	6.4.9.2.1	10,299,484.73	547,328.77
2. 托管费	6.4.9.2.2	3,051,699.09	162,171.40
3. 销售服务费	6.4.9.2.3	1,704,230.73	155,771.80
4. 交易费用	6.4.7.19	419.00	-
5. 利息支出		14,903,905.75	464,984.71
其中：卖出回购金融资产支出		14,903,905.75	464,984.71
6. 其他费用	6.4.7.20	249,698.51	192,166.98
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		164,618,491.08	6,045,529.20
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		164,618,491.08	6,045,529.20



**6.3 所有者权益（基金净值）变动表**

会计主体：大成月月盈短期理财债券型证券投资基金

本报告期：2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2017 年 1 月 1 日至 2017 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）	1,285,808,927.78	-	1,285,808,927.78
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	164,618,491.08	164,618,491.08
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	8,628,843,325.30	-	8,628,843,325.30
其中：1. 基金申购款	13,431,484,607.17	-	13,431,484,607.17
2. 基金赎回款	-4,802,641,281.87	-	-4,802,641,281.87
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-164,618,491.08	-164,618,491.08
五、期末所有者权益（基金净值）	9,914,652,253.08	-	9,914,652,253.08
项目	上年度可比期间 2016 年 1 月 1 日至 2016 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）	195,339,707.58	-	195,339,707.58
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	6,045,529.20	6,045,529.20
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	1,119,636,233.17	-	1,119,636,233.17
其中：1. 基金申购款	1,690,199,210.61	-	1,690,199,210.61
2. 基金赎回款	-570,562,977.44	-	-570,562,977.44
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-6,045,529.20	-6,045,529.20
五、期末所有者权益（基金净值）	1,314,975,940.75	-	1,314,975,940.75

值)			
----	--	--	--

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 - 至 - 财务报表由下列负责人签署：

_____ 罗登攀	_____ 周立新	_____ 崔伟
基金管理人负责人	主管会计工作负责人	会计机构负责人

## 6.4 报表附注

### 6.4.1 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

### 6.4.2 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2004]78号《财政部、国家税务总局关于证券投资基金税收政策的通知》、财税[2008]1号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2016]36号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1) 于 2016 年 5 月 1 日前，以发行基金方式募集资金不属于营业税征收范围，不征收营业税。对证券投资基金管理人运用基金买卖债券的差价收入免征营业税。自 2016 年 5 月 1 日起，金融业由缴纳营业税改为缴纳增值税。对证券投资基金管理人运用基金买卖债券的转让收入免征增值税，对国债、地方政府债以及金融同业往来利息收入亦免征增值税。

(2) 对基金从证券市场中取得的收入，包括买卖债券的差价收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

(3) 对基金取得的企业债券利息收入，应由发行债券的企业在向基金支付利息时代扣代缴 20% 的个人所得税。

### 6.4.3 重要财务报表项目的说明

#### 6.4.3.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2017 年 6 月 30 日
活期存款	6,188,236.54
定期存款	800,000,000.00
其中：存款期限 1-3 个月	800,000,000.00

存款期限 3 个月以上	-
其他存款	2, 220, 000, 000. 00
合计:	3, 026, 188, 236. 54

注：1. 其他存款为根据协议可提前支取且没有利息损失的协议存款。

#### 6.4.3.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末 2017 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	-	-	-	0. 0000%
	银行间市场	7, 582, 639, 461. 65	7, 589, 488, 560. 87	6, 849, 099. 22	0. 0691%
	合计	7, 582, 639, 461. 65	7, 589, 488, 560. 87	6, 849, 099. 22	0. 0691%

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。

#### 6.4.3.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末未持有衍生金融资产/负债。

#### 6.4.3.4 买入返售金融资产

##### 6.4.3.4.1 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 2017 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	2, 171, 268, 056. 89	-
合计	2, 171, 268, 056. 89	-

##### 6.4.3.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金于本期末无买断式逆回购交易中取得的债券。

#### 6.4.3.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2017 年 6 月 30 日
应收活期存款利息	1, 050. 15
应收定期存款利息	4, 950, 000. 00

应收其他存款利息	13,245,652.88
应收结算备付金利息	-
应收债券利息	17,216,676.08
应收买入返售证券利息	7,976,319.99
应收申购款利息	-
应收黄金合约拆借孳息	-
其他	-
合计	43,389,699.10

#### 6.4.3.6 其他资产

单位：人民币元

项目	本期末 2017年6月30日
其他应收款	90,278.00
待摊费用	-
合计	90,278.00

注：本基金本报告期末未持有其他资产。

#### 6.4.3.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2017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	192,102.15
合计	192,102.15

#### 6.4.3.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2017年6月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	-
预提费用	202,250.53
合计	202,250.53

## 6.4.3.9 实收基金

金额单位：人民币元

大成月月盈短期理财债券 A		
项目	本期 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	23,866,596.66	23,866,596.66
本期申购	65,927,660.19	65,927,660.19
本期赎回(以“-”号填列)	-14,751,303.97	-14,751,303.97
- 基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算变动份额	-	-
本期申购	-	-
本期赎回(以“-”号填列)	-	-
本期末	75,042,952.88	75,042,952.88

金额单位：人民币元

大成月月盈短期理财债券 B		
项目	本期 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	1,043,626,516.80	1,043,626,516.80
本期申购	10,140,179,788.64	10,140,179,788.64
本期赎回(以“-”号填列)	-2,883,436,449.24	-2,883,436,449.24
- 基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算变动份额	-	-
本期申购	-	-
本期赎回(以“-”号填列)	-	-
本期末	8,300,369,856.20	8,300,369,856.20

金额单位：人民币元

大成月月盈短期理财债券 E		
项目	本期 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	218,315,814.32	218,315,814.32
本期申购	3,225,377,158.34	3,225,377,158.34
本期赎回(以“-”号填列)	-1,904,453,528.66	-1,904,453,528.66
- 基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算变动份额	-	-
本期申购	-	-

本期赎回(以“-”号填列)	-	-
本期末	1,539,239,444.00	1,539,239,444.00

注：申购份额含红利再投和因份额升降级导致的强制调增份额，赎回份额含因份额升降级导致的强制调减份额。

#### 6.4.3.10 未分配利润

单位：人民币元

大成月月盈短期理财债券 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	600,610.44	-	600,610.44
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	-600,610.44	-	-600,610.44
本期末	-	-	-

单位：人民币元

大成月月盈短期理财债券 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	145,994,961.42	-	145,994,961.42
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	-145,994,961.42	-	-145,994,961.42
本期末	-	-	-

单位：人民币元

大成月月盈短期理财债券 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	18,022,919.22	-	18,022,919.22
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	-18,022,919.22	-	-18,022,919.22
本期末	-	-	-

**6.4.3.11 存款利息收入**

单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年6月30日
活期存款利息收入	64,662.82
定期存款利息收入	11,686,666.67
其他存款利息收入	81,740,496.05
结算备付金利息收入	-
其他	-
合计	93,491,825.54

**6.4.3.12 股票投资收益**

本报告期内本基金无股票投资收益。

**6.4.3.13 债券投资收益**

单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年6月30日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	8,007,791,132.61
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	7,973,661,104.57
减：应收利息总额	32,165,975.70
买卖债券差价收入	1,964,052.34

**6.4.3.13.1 资产支持证券投资收益**

本报告期内本基金无资产支持证券投资收益。

**6.4.3.14 贵金属投资收益**

本报告期内本基金无贵金属投资收益。

**6.4.3.15 衍生工具收益**

本报告期内本基金无衍生工具收益。

**6.4.3.16 股利收益**

本报告期内本基金无股利收益。

**6.4.3.17 公允价值变动收益**

本报告期内本基金无公允价值变动收益。

**6.4.3.18 其他收入**

本报告期内本基金无其他收入。

**6.4.3.19 交易费用**

单位：人民币元

项目	本期 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日
交易所市场交易费用	-
银行间市场交易费用	419.00
合计	419.00

**6.4.3.20 其他费用**

单位：人民币元

项目	本期 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日
审计费用	44,630.98
信息披露费	148,765.71
其他	600.00
银行汇划费用	37,847.98
账户维护费	17,853.84
合计	249,698.51

**6.4.4 或有事项、资产负债表日后事项的说明****6.4.4.1 或有事项**

截至资产负债表日，本基金并无须作披露的或有事项。

**6.4.4.2 资产负债表日后事项**

截至本会计报表批准报出日，本基金并无须作披露的资产负债表日后事项。

**6.4.5 关联方关系**

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
中国银行股份有限公司（“中国银行”）	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
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

1. 下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

#### 6.4.5.1 通过关联方交易单元进行的交易

本基金本报告期及上年度可比期间未发生通过关联方交易单元进行的交易。

#### 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	上年度可比期间
	2017年1月1日至2017年6月30日	2016年1月1日至2016年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	10,299,484.73	547,328.77
其中：支付销售机构的客户维护费	15,430.02	35,247.08

注：支付基金管理人大成基金的管理人报酬按前一日基金资产净值 0.27% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日管理人报酬 = 前一日基金资产净值 X 0.27% / 当年天数。

##### 6.4.5.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2017年1月1日至2017年6月30日	2016年1月1日至2016年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	3,051,699.09	162,171.40

注：支付基金托管人中国银行的托管费按前一日基金资产净值 0.08% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日托管费 = 前一日基金资产净值 X 0.08% / 当年天数。

##### 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 2017年1月1日至2017年6月30日
----------------	----------------------------

	当期发生的基金应支付的销售服务费			
	大成月月盈短期理财债券 A	大成月月盈短期理财债券 B	大成月月盈短期理财债券 E	合计
大成基金	1,324,065.66	2,479.03	335,849.82	1,662,394.51
中国银行	-	27,391.23	-	27,391.23
合计	1,324,065.66	29,870.26	335,849.82	1,689,785.74
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间			
	2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日			
	当期发生的基金应支付的销售服务费			
	大成月月盈短期理财债券 A	大成月月盈短期理财债券 B	大成月月盈短期理财债券 E	合计
大成基金	5,775.05	14,657.83	67,400.97	87,833.85
中国银行	49,822.13	914.60	-	50,736.73
合计	55,597.18	15,572.43	67,400.97	138,570.58

注：支付基金销售机构的销售服务费按前一日基金资产净值的约定年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付给大成基金，再由大成基金计算并支付给各基金销售机构。A 级基金份额、B 级基金份额和 E 级基金份额约定的销售服务费年费率分别为 0.30%、0.01%和 0.30%。销售服务费的计算公式为：

对应级别日销售服务费 = 前一日对应级别基金资产净值 × 约定年费率 / 当年天数。

#### 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

单位：人民币元

本期						
2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日						
银行间市场交易的各关联方名称	债券交易金额		基金逆回购		基金正回购	
	基金买入	基金卖出	交易金额	利息收入	交易金额	利息支出
中国银行	244,722,710.34	-	-	-	-	-
上年度可比期间						
2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日						
银行间市场交易的各关联方名称	债券交易金额		基金逆回购		基金正回购	
	基金买入	基金卖出	交易金额	利息收入	交易金额	利息支出
中国银行	-	-	-	-	-	-

## 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固有资金投资本基金的情况

份额单位：份

项目	本期 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日		
	大成月月盈短期理 财债券 A	大成月月盈短期理 财债券 B	大成月月盈短期理 财债券 E
基金合同生效日（2014 年 9 月 12 日）持有的基金份额	-	-	-
期初持有的基金份额	-	-	-
期间申购/买入总份额	-	-	-
期间因拆分变动份额	-	-	-
减：期间赎回/卖出总份额	-	-	-
期末持有的基金份额	-	-	-
期末持有的基金份额 占基金总份额比例	0.0000%	0.0000%	0.0000%

项目	上年度可比期间 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日		
	大成月月盈短期理 财债券 A	大成月月盈短期理 财债券 B	大成月月盈短期理 财债券 E
基金合同生效日（2014 年 9 月 12 日）持有的基金份额	-	-	-
期初持有的基金份额	-	11,691,583.98	-
期间申购/买入总份额	-	187,971.87	-
期间因拆分变动份额	-	-	-
减：期间赎回/卖出总份额	-	-	-
期末持有的基金份额	-	11,879,555.85	-
期末持有的基金份额 占基金总份额比例	0.0000%	0.9000%	0.0000%

## 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

本基金本报告期末及上年度末除基金管理人以外的其他关联方未投资本基金。

## 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	上年度可比期间
	2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日	2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日

	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国银行	6,188,236.54	64,662.82	2,181,186.61	18,617.93

注：本基金的银行活期存款由基金托管人中国银行保管，按银行同业利率计息。

#### 6.4.5.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

金额单位：人民币元

本期 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日					
关联方名称	证券代码	证券名称	发行方式	基金在承销期内买入	
				数量（单位：份）	总金额
中国银行	011759051	17 华电 SCP008	公募	1,000,000	100,000,000.00
上年度可比期间 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日					
关联方名称	证券代码	证券名称	发行方式	基金在承销期内买入	
				数量（单位：份）	总金额
-	-	-	-	-	-

#### 6.4.5.7 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期及上年度可比期间无须作说明的其他关联交易事项。

#### 6.4.6 利润分配情况

金额单位：人民币元

##### 大成月月盈短期理财债券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
406,843.36	47,377.22	146,389.86	600,610.44	-

##### 大成月月盈短期理财债券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
124,448,888.15	10,262,349.26	11,283,724.01	145,994,961.42	-

##### 大成月月盈短期理财债券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
8,954,769.35	6,311,188.04	2,756,961.83	18,022,919.22	-

**6.4.7 期末（2017 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**

本基金本期末无因认购新发/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**

本基金本期末无暂时停牌等流通受限的股票。

**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 2017 年 06 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 2,892,248,471.59 元，是以如下债券作为抵押：

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	期末估值总值
011751051	17 光明 SCP002	2017-07-03	99.83	998,000.00	99,627,841.26
111798314	17 瑞丰银行 CD058	2017-07-03	99.31	2,489,000.00	247,172,551.25
111798328	17 晋商银行 CD037	2017-07-03	99.30	1,021,000.00	101,390,005.97
111798332	17 锦州银行 CD133	2017-07-03	99.31	1,837,000.00	182,438,040.46
111798335	17 厦门农商行 CD058	2017-07-03	99.31	511,000.00	50,746,811.12
120230	12 国开 30	2017-07-03	100.01	600,000.00	60,007,295.40
140225	14 国开 25	2017-07-03	100.12	400,000.00	40,049,251.77
011751055	17 浙能源 SCP002	2017-07-04	99.86	514,000.00	51,327,954.07
111792395	17 上海农商银行 CD054	2017-07-04	99.30	1,500,000.00	148,953,849.94
111798347	17 中原银行 CD089	2017-07-04	99.31	1,053,000.00	104,575,112.31
120233	12 国开 33	2017-07-04	100.03	479,000.00	47,916,699.65
160419	16 农发 19	2017-07-04	99.95	1,600,000.00	159,914,801.04
111780034	17 常熟农村商行 CD142	2017-07-05	98.95	1,021,000.00	101,023,026.90
111798332	17 锦州银行 CD133	2017-07-05	99.31	163,000.00	16,188,024.28
111799954	17 宁波银行 CD112	2017-07-05	98.94	3,750,000.00	371,011,509.07
011751026	17 中船 SCP001	2017-07-06	100.05	1,440,000.00	144,066,207.64
111714182	17 江苏银行 CD182	2017-07-06	98.94	1,822,000.00	180,266,149.27
111798344	17 江西银行 CD055	2017-07-06	99.31	3,106,000.00	308,466,211.65
120233	12 国开 33	2017-07-06	100.03	841,000.00	84,129,320.26
120240	12 国开 40	2017-07-06	100.08	650,000.00	65,050,550.94
140225	14 国开 25	2017-07-06	100.12	111,000.00	11,113,667.37

179926	17 贴现国债 26	2017-07-06	99.45	200,000.00	19,889,208.50
011754085	17 苏交通 SCP013	2017-07-07	99.94	2,000,000.00	199,870,006.40
111798287	17 桂林银行 CD077	2017-07-07	99.31	2,106,000.00	209,144,361.58
111798328	17 晋商银行 CD037	2017-07-07	99.30	106,000.00	10,526,288.57
合计	-	-	-	30,318,000.00	3,014,864,746.67

#### 6.4.7.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2017 年 6 月 30 日止，本基金无从事证券交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款的余额。

### 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

本基金投资于各类固定收益类金融工具，属于低风险合理稳定收益品种。本基金的基金管理人从事风险管理的主要目标是争取将以上风险控制在限定的范围之内，使本基金在风险和收益之间取得最佳的平衡以实现“低风险、高流动性和持续稳定收益”的风险收益目标。

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

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息等情况，导致基金资产损失和收益变化的风险。

本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的银行存款

存放在本基金的托管行中国银行，与该银行存款相关的信用风险不重大。其他协议存款存放在民生银行、上海银行及中信银行，与银行存款相关的信用风险不重大。本基金在交易所进行的交易均以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，违约风险可能性很小；在银行间同业市场进行交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式进行限制以控制相应的信用风险。

本基金的基金管理人建立了信用风险管理流程，通过对投资品种信用等级评估来控制证券发行人的信用风险，且通过分散化投资以分散信用风险。

本基金债券投资的信用评级情况按《中国人民银行信用评级管理指导意见》设定的标准统计及汇总。

#### 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 2017 年 6 月 30 日	上年度末 2016 年 12 月 31 日
A-1	170,166,100.82	9,994,168.84
A-1 以下	-	-
未评级	7,412,473,360.83	329,823,678.91
合计	7,582,639,461.65	339,817,847.75

注：1. 债券评级取自第三方评级机构的债项评级。

2. 上述债券信用未评级为同业存单、政策性金融债和短期融资券。

3. 债券投资以净价列示。

#### 6.4.8.2.2 按长期信用评级列示的债券投资

本基金本期末未持有按长期信用评级列示的债券投资。

#### 6.4.8.3 流动性风险

流动性风险是指基金所持金融工具变现的难易程度。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 141 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,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 40%。

于 2017 年 6 月 30 日,除卖出回购金融资产款余额中有 2,892,248,471.59 元将在一个月以内到期且计息(该利息金额不重大)外,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,因此账面余额即约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 2017 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	3,026,188,236.54	-	-	-	-	3,026,188,236.54
交易性金融资产	7,552,658,370.13	29,981,091.52	-	-	-	7,582,639,461.65
买入返售金融资产	2,171,268,056.89	-	-	-	-	2,171,268,056.89
应收利息	-	-	-	-	43,389,699.10	43,389,699.10
应收申购款	-	-	-	-	2,448,611.84	2,448,611.84
其他资产	-	-	-	-	90,278.00	90,278.00
资产总计	12,750,114,663.56	29,981,091.52	-	-	45,928,588.94	12,826,024,344.02
负债						



卖出回购金融资产款	2,892,248,471.59	-	-	-	-	2,892,248,471.59
应付管理人报酬	-	-	-	-	2,200,254.04	2,200,254.04
应付托管费	-	-	-	-	651,927.13	651,927.13
应付销售服务费	-	-	-	-	450,855.87	450,855.87
应付交易费用	-	-	-	-	192,102.15	192,102.15
应付利息	-	-	-	-	621,049.27	621,049.27
应付利润	-	-	-	-	-14,805,180.36	14,805,180.36
其他负债	-	-	-	-	202,250.53	202,250.53
负债总计	2,892,248,471.59	-	-	-	-19,123,619.35	2,911,372,090.94
利率敏感度缺口	9,857,866,191.97	29,981,091.52	-	-	-26,804,969.59	9,914,652,253.08
上年度末 2016 年 12 月 31 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	645,341,651.55	-	-	-	-	645,341,651.55
交易性金融资产	309,830,459.04	29,987,388.71	-	-	-	339,817,847.75
买入返售金融资产	367,475,436.34	-	-	-	-	367,475,436.34
应收利息	-	-	-	-	5,500,418.48	5,500,418.48
其他资产	-	-	-	-	-	-
资产总计	1,322,647,546.93	29,987,388.71	-	-	5,500,418.48	1,358,135,354.12
负债						
卖出回购金融资产款	71,059,693.41	-	-	-	-	71,059,693.41
应付管理人报酬	-	-	-	-	305,310.21	305,310.21
应付托管费	-	-	-	-	90,462.33	90,462.33
应付销售服务费	-	-	-	-	43,528.71	43,528.71
应付交易费用	-	-	-	-	47,713.88	47,713.88
应付利息	-	-	-	-	12,613.14	12,613.14
应付利润	-	-	-	-	618,104.66	618,104.66
其他负债	-	-	-	-	149,000.00	149,000.00
负债总计	71,059,693.41	-	-	-	1,266,732.93	72,326,426.34
利率敏感度缺口	1,251,587,853.52	29,987,388.71	-	-	-4,233,685.55	1,285,808,927.78

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

#### 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：人民币万元)	
		本期末 2017 年 6 月 30 日	上年度末 2016 年 12 月 31 日

	市场利率下降 25 个基点	增加约 340	增加约 18
	市场利率上升 25 个基点	减少约 340	减少约 18

#### 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，因此无重大其他价格风险。

#### 6.4.9 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

根据财政部、国家税务总局于 2016 年 12 月 21 日颁布的财税[2016]140 号《关于明确金融房地产开发 教育辅助服务等增值税政策的通知》的规定：(1) 金融商品持有期间(含到期)取得的非保本收益(合同中未明确承诺到期本金可全部收回的投资收益)，不征收增值税；(2) 纳税人购入基金、信托、理财产品等各类资产管理产品持有至到期，不属于金融商品转让；(3) 资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人。上述政策自 2016 年 5 月 1 日起执行。

此外，根据财政部、国家税务总局于 2017 年 1 月 6 日颁布的财税[2017]2 号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》及 2017 年 6 月 30 日颁布的财税[2017]56 号《关于资管产品增值税有关问题的通知》的规定，资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为，暂适用简易计税方法，按照 3% 的征收率缴纳增值税。对资管产品在 2018 年 1 月 1 日前运营过程中发生的增值税应税行为，未缴纳增值税的，不再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从资管产品管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。上述税收政策对本基金截至本财务报表批准报出日止的财务状况和经营成果无影响。

## §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	7,582,639,461.65	59.1200
	其中：债券	7,582,639,461.65	59.1200
	资产支持证券	-	0.0000
2	买入返售金融资产	2,171,268,056.89	16.9300
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	0.0000
3	银行存款和结算备付金合计	3,026,188,236.54	23.5900
4	其他各项资产	45,928,588.94	0.3600
5	合计	12,826,024,344.02	100.0000

## 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		11.9600
	其中：买断式回购融资		0.0000
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	2,892,248,471.59	29.1700
	其中：买断式回购融资	-	0.0000

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

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。

## 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	58
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	74
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	17

### 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。

**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比例 (%)	各期限负债占基金资产净值比例 (%)
1	30 天以内	13.9200	29.1700
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	0.0000	0.0000
2	30 天(含)—60 天	78.2800	0.0000
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	0.0000	0.0000
3	60 天(含)—90 天	29.9000	0.0000
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	0.0000	0.0000
4	90 天(含)—120 天	1.5600	0.0000
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	0.0000	0.0000
5	120 天(含)—397 天(含)	5.2400	0.0000
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	0.0000	0.0000
合计		128.9000	29.1700

**7.4 报告期内投资组合平均剩余存续期超过 240 天情况说明**

注：本报告期内本基金均未发生投资组合平均剩余存续期超过 240 天的情况。

**7.5 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	19,889,208.50	0.2000
2	央行票据	-	0.0000
3	金融债券	477,086,447.25	4.8100
	其中：政策性金融债	477,086,447.25	4.8100
4	企业债券	-	0.0000
5	企业短期融资券	1,794,159,934.82	18.1000
6	中期票据	-	0.0000
7	同业存单	5,291,503,871.08	53.3700
8	其他	-	0.0000
9	合计	7,582,639,461.65	76.4800

## 7.6 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	111798344	17 江西银行 CD055	4,000,000	397,252,043.34	4.0100
2	111798314	17 瑞丰银行 CD058	3,800,000	377,362,673.67	3.8100
3	111799954	17 宁波银行 CD112	3,750,000	371,011,509.07	3.7400
4	111714182	17 江苏银行 CD182	3,500,000	346,285,138.55	3.4900
5	111798347	17 中原银行 CD089	3,000,000	297,934,792.91	3.0000
6	111798287	17 桂林银行 CD077	3,000,000	297,926,441.00	3.0000
7	111798265	17 温州银行 CD116	3,000,000	297,918,088.83	3.0000
8	111798328	17 晋商银行 CD037	3,000,000	297,913,827.52	3.0000
9	111780017	17 宁波银行 CD113	3,000,000	296,835,466.82	2.9900
10	011751026	17 中船 SCP001	2,700,000	270,124,139.32	2.7200

## 7.7 “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	-
报告期内偏离度的最高值	0.0691%
报告期内偏离度的最低值	-0.0186%
报告期内每个交易日偏离度的绝对值的简单平均值	0.0108%

## 报告期内负偏离度的绝对值达到 0.25%情况说明

本报告期内本基金均未发生负偏离度的绝对值达到 0.25%的情况。

## 报告期内正偏离度的绝对值达到 0.5%情况说明

本报告期内本基金均未发生正偏离度的绝对值达到 0.5%的情况。

## 7.8 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

本报告期末未持有资产支持证券。

## 7.9 投资组合报告附注

7.9.1 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 1.0000 元。

7.9.2 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。

### 7.9.3 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	43,389,699.10
4	应收申购款	2,448,611.84
5	其他应收款	90,278.00
6	待摊费用	-
7	其他	-
8	合计	45,928,588.94

### 7.9.4 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。

## §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
大成月月盈短期理财债券 A	5,920	12,676.17	35,733.45	0.0500%	75,007,219.43	99.9500%
大成月月盈短期理财债券 B	6	1,383,394,976.03	8,300,369,856.20	100.0000%	-	0.0000%
大成月月	43,346	35,510.53	-	0.0000%	1,539,239,444.00	100.0000%

盈短期理财债券 E						
合计	49,272	201,222.85	8,300,405,589.65	83.7200%	1,614,246,663.43	16.2800%

注：1、上述机构/个人投资者持有份额占总份额比例的计算中，对分级份额，比例的分母采用各自级别的份额，对合计数，比例的分母采用下属分级基金份额的合计数（即期末基金份额总额）。

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	大成月月盈短期理财债券 A	25,699.15	0.0342%
	大成月月盈短期理财债券 B	-	0.0000%
	大成月月盈短期理财债券 E	10,771.63	0.0007%
	合计	36,470.78	0.0004%

注：上述占基金总份额比例的计算中，对分级份额，比例的分母采用各自级别的份额，对合计数，比例的分母采用下属分级基金份额的合计数（即期末基金份额总额）。

### 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	大成月月盈短期理财债券 A	0
	大成月月盈短期理财债券 B	0
	大成月月盈短期理财债券 E	0
	合计	0
本基金基金经理持有本开放式基金	大成月月盈短期理财债券 A	0
	大成月月盈短期理财债券 B	0
	大成月月盈短期理财债券 E	0
	合计	0

## § 9 开放式基金份额变动

单位：份

	大成月月盈短期理财债券 A	大成月月盈短期理财债券 B	大成月月盈短期理财债券 E
基金合同生效日（2014 年 9 月 12 日）基金份额总额	35,756,883.12	145,202,557.59	-
本报告期期初基金份额总额	23,866,596.66	1,043,626,516.80	218,315,814.32
本报告期基金总申购份额	65,927,660.19	10,140,179,788.64	3,225,377,158.34
减：本报告期基金总赎回份额	14,751,303.97	2,883,436,449.24	1,904,453,528.66
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	75,042,952.88	8,300,369,856.20	1,539,239,444.00

## §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

1、基金管理人于 2017 年 2 月 18 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二十四次会议（以下简称“董事会”）审议通过，杜鹏女士不再担任公司督察长。董事会同时决议，同意在公司新督察长任职前，由公司总经理罗登攀先生代为履行督察长职务，代为履职时间不超过 90 日。基金管理人于 2017 年 5 月 17 日发布了《大成基金管理有限公司关于总经理继续代为履行督察长职务的公告》，经公司第六届董事会第二十六次会议审议通过，决定继续由总经理罗登攀先生代为履行督察长职务。代为履行职务的时间自董事会决议通过之日起不超过 90 日。

2、基金管理人于 2017 年 2 月 18 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二十四次会议审议通过，陈翔凯先生、谭晓冈先生和姚余栋先生担任公司副总经理。

## 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**

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、托管人的托管业务部门及其相关高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

**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	
安信证券	2	-	0.0000%	-	0.0000%	-
渤海证券	2	-	0.0000%	-	0.0000%	-
财富证券	1	-	0.0000%	-	0.0000%	-
长城证券	1	-	0.0000%	-	0.0000%	-
长江证券	1	-	0.0000%	-	0.0000%	-
东方证券	1	-	0.0000%	-	0.0000%	-
东海证券	1	-	0.0000%	-	0.0000%	-
东莞证券	1	-	0.0000%	-	0.0000%	-
东吴证券	1	-	0.0000%	-	0.0000%	-
东兴证券	1	-	0.0000%	-	0.0000%	-
方正证券	1	-	0.0000%	-	0.0000%	-
光大证券	2	-	0.0000%	-	0.0000%	-
广发证券	1	-	0.0000%	-	0.0000%	-
广州证券	1	-	0.0000%	-	0.0000%	-
国都证券	1	-	0.0000%	-	0.0000%	-
国海证券	1	-	0.0000%	-	0.0000%	-

国泰君安	1	-	0.0000%	-	0.0000%	-
国信证券	1	-	0.0000%	-	0.0000%	-
海通证券	2	-	0.0000%	-	0.0000%	-
恒泰证券	1	-	0.0000%	-	0.0000%	-
华宝证券	1	-	0.0000%	-	0.0000%	-
华福证券	1	-	0.0000%	-	0.0000%	-
华林证券	1	-	0.0000%	-	0.0000%	-
华泰证券	2	-	0.0000%	-	0.0000%	-
华鑫证券	1	-	0.0000%	-	0.0000%	-
江海证券	1	-	0.0000%	-	0.0000%	-
民生证券	1	-	0.0000%	-	0.0000%	-
民族证券	1	-	0.0000%	-	0.0000%	-
平安证券	1	-	0.0000%	-	0.0000%	-
申银万国	1	-	0.0000%	-	0.0000%	-
天源证券	1	-	0.0000%	-	0.0000%	-
万联证券	1	-	0.0000%	-	0.0000%	-
西南证券	1	-	0.0000%	-	0.0000%	-
湘财证券	1	-	0.0000%	-	0.0000%	-
银河证券	1	-	0.0000%	-	0.0000%	-
英大证券	1	-	0.0000%	-	0.0000%	-
招商证券	2	-	0.0000%	-	0.0000%	-
中航证券	1	-	0.0000%	-	0.0000%	-
中金公司	2	-	0.0000%	-	0.0000%	-
中泰证券	1	-	0.0000%	-	0.0000%	-
中投证券	3	-	0.0000%	-	0.0000%	-
中信建投证 券	1	-	0.0000%	-	0.0000%	-
中信证券	2	-	0.0000%	-	0.0000%	-
中银国际	1	-	0.0000%	-	0.0000%	-

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。

本报告期内本基金租用证券公司交易单元的变更情况如下：

本报告期内增加交易单元：无。本报告期内退租交易单元：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

无。

### 10.8 偏离度绝对值超过 0.5%的情况

注：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	关于大成基金管理有限公司旗下部分基金增加上海基煜基金销售有限公司为销售机构的公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2017年6月28日
2	大成基金管理有限公司关于旗下部分基金增加上海利得基金销售有限公司为销售机构的公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2017年6月27日
3	大成基金关于旗下部分基金增加北京肯特瑞财富投资管理有限公司为销售机构的公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2017年6月21日
4	大成基金关于旗下部分基金增加平安证券股份有限公司为销售机构的公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2017年6月16日
5	关于大成基金管理有限公司旗下部分基金增加北京植信基金销售有限公司为销售机构的公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2017年6月14日
6	关于大成月月盈短期理财债券型证券投资基金增加深圳众禄金融控股股份有限公司为销售机构的公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2017年6月7日
7	大成基金管理有限公司关于旗下基金持有的“中文在线”股票估值调整的公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2017年6月2日
8	大成基金管理有限公司关于旗下基金持有的“三诺生物”股票估	中国证监会指定报刊及本公司网站	2017年6月2日

	值调整的公告		
9	大成基金管理有限公司关于旗下基金持有的“乐视网”股票估值调整的公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2017年6月2日
10	大成基金管理有限公司关于旗下基金投资非公开发行的公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2017年5月27日
11	大成基金管理有限公司关于旗下部分基金估值调整的公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2017年5月24日
12	关于大成月月盈短期理财债券型证券投资基金“端午节”假期前暂停申购业务公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2017年5月23日
13	大成基金管理有限公司关于总经理继续代为履行督察长职务的公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2017年5月17日
14	关于大成基金管理有限公司旗下部分基金增加上海银行股份有限公司为销售机构的公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2017年5月12日
15	大成基金管理有限公司关于旗下部分基金估值调整的公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2017年5月12日
16	大成基金关于旗下部分基金增加北京虹点基金销售有限公司为销售机构的公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2017年5月6日
17	关于大成月月盈短期理财债券型证券投资基金恢复大额申购业务公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2017年5月5日
18	大成基金管理有限公司关于调整网上直销系统建行直联渠道基金交易费率优惠的公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2017年5月4日
19	大成基金管理有限公司关于《上海证券交易所分级基金业务管理指引》实施的风险提示公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2017年4月29日
20	大成基金管理有限公司关于旗下基金投资非公开发行的公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2017年4月28日
21	大成基金管理有限公司关于《上海证券交易所分级基金业务管理指引》实施的风险提示公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2017年4月28日
22	大成月月盈短期理财债券型证券投资基金更新招募说明书（2017年1期）-摘要	中国证监会指定报刊及本公司网站	2017年4月27日
23	大成月月盈短期理财债券型证券投资基金更新招募说明书（2017年1期）	中国证监会指定报刊及本公司网站	2017年4月27日
24	大成基金管理有限公司关于《上海证券交易所分级基金业务管理	中国证监会指定报刊及本公司网站	2017年4月27日

	指引》实施的风险提示公告		
25	大成基金管理有限公司关于《上海证券交易所分级基金业务管理指引》实施的风险提示公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2017 年 4 月 26 日
26	关于大成月月盈短期理财债券型证券投资基金“劳动节”假期前暂停申购业务公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2017 年 4 月 25 日
27	大成基金管理有限公司关于公司旗下部分基金估值调整的公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2017 年 4 月 22 日
28	大成月月盈短期理财债券型证券投资基金 2017 年第 1 季度报告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2017 年 4 月 21 日
29	大成基金管理有限公司关于公司旗下部分基金估值调整的公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2017 年 4 月 18 日
30	大成基金管理有限公司关于撤销北京理财中心的公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2017 年 4 月 14 日
31	关于大成基金管理有限公司旗下部分基金增加方正证券股份有限公司为销售机构的公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2017 年 4 月 11 日
32	大成基金管理有限公司关于旗下基金投资非公开发行股票的公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2017 年 4 月 1 日
33	关于大成基金管理有限公司旗下部分基金增加上海基煜基金销售有限公司为销售机构的公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2017 年 3 月 31 日
34	关于大成月月盈短期理财债券型证券投资基金“清明节”假期前暂停申购业务公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2017 年 3 月 29 日
35	大成基金管理有限公司更正公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2017 年 3 月 29 日
36	大成月月盈短期理财债券型证券投资基金 2016 年年度报告摘要	中国证监会指定报刊及本公司网站	2017 年 3 月 25 日
37	大成月月盈短期理财债券型证券投资基金 2016 年年度报告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2017 年 3 月 25 日
38	关于增加北京恒天明泽基金销售有限公司为开放式基金销售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	2017 年 3 月 25 日
39	大成基金管理有限公司关于公司旗下部分基金估值调整的公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2017 年 3 月 17 日
40	关于大成月月盈短期理财债券型证券投资基金暂停大额申购业务公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2017 年 3 月 8 日
41	大成基金管理有限公司关于调整网上直销系统招行直联渠道基金交易费率优惠的公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2017 年 3 月 8 日
42	关于大成基金管理有限公司旗下	中国证监会指定报刊及本公	2017 年 3 月

	部分基金增加长沙银行股份有限公司为销售机构的公告	司网站	7 日
43	大成基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告（姚余栋）	中国证监会指定报刊及本公司网站	2017 年 2 月 18 日
44	大成基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告（谭晓冈）	中国证监会指定报刊及本公司网站	2017 年 2 月 18 日
45	大成基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告（杜鹏）	中国证监会指定报刊及本公司网站	2017 年 2 月 18 日
46	大成基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告（陈翔凯）	中国证监会指定报刊及本公司网站	2017 年 2 月 18 日
47	关于大成月月盈短期理财债券型证券投资基金恢复大额申购业务公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2017 年 2 月 16 日
48	关于大成基金管理有限公司旗下部分基金增加汉口银行股份有限公司为销售机构的公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2017 年 2 月 15 日
49	大成基金管理有限公司关于公司旗下部分基金估值调整的公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2017 年 2 月 11 日
50	关于大成月月盈短期理财债券型证券投资基金“春节”假期前暂停申购业务公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2017 年 1 月 23 日
51	大成基金管理有限公司关于旗下基金投资非公开发行股票的公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2017 年 1 月 19 日
52	大成基金管理有限公司关于旗下部分基金增加万联证券有限责任公司为销售机构的公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2017 年 1 月 17 日
53	大成基金管理有限公司关于公司旗下部分基金估值调整的公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2017 年 1 月 17 日
54	关于大成基金管理有限公司旗下部分基金增加郑州银行股份有限公司为销售机构的公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2017 年 1 月 11 日
55	大成基金管理有限公司关于通过网上直销系统适用渠道大成钱柜交易实施费率优惠活动的公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2017 年 1 月 11 日
56	关于大成月月盈短期理财债券型证券投资基金暂停大额申购业务公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2017 年 1 月 10 日
57	关于大成基金管理有限公司撤销西安分公司的公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2017 年 1 月 6 日
58	大成基金管理有限公司关于旗下基金实行网上直销申购费率优惠的公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2017 年 1 月 3 日

## §11 影响投资者决策的其他重要信息

### 11.1 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	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	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	20170101-20170630	1,003,081,279.26	8,123,158,488.49	2,538,065,480.29	6,588,174,287.46	66.45%
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。							

### 11.2 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、《关于大成月月盈短期理财债券型证券投资基金份额持有人大会决议生效的公告》；
- 2、《大成月月盈短期理财债券型证券投资基金基金合同》；
- 3、《大成月月盈短期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。

### 12.2 存放地点

备查文件存放在本基金管理人和托管人住所。

### 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。

投资者对本报告书如有疑问，可咨询本基金管理人大成基金管理有限公司。

客户服务中心电话：400-888-5558（免长途通话费用）

国际互联网网址：<http://www.dcfund.com.cn>

大成基金管理有限公司

2017 年 8 月 24 日