大成现金宝场内实时申赎货币市场基金 2018 年第3季度报告

2018年9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: 2018年10月25日

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2018年10月24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2018年7月1日起至9月30日止。

§ 2 基金产品概况

基金简称	大成现金宝货币			
基金主代码	519898			
基金运作方式	契约型开放式			
基金合同生效日	2013年3月27日			
报告期末基金份额总额	48, 365, 138, 876. 00 份			
投资目标	安全性和流动性优先,在此基础上社	安全性和流动性优先,在此基础上追求适度收益。		
投资策略	本基金通过结构化投资策略、分散化投资策略、利率趋势评估策略、			
	滚动配置策略和相对价值评估策略多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	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	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	金、混合型基金、债券型基金。		
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	现金宝 A 现金宝 B			
下属分级基金的交易代码	519898	519899		

报告期末下属分级基金的份额总额	32, 629, 942, 793. 00 份	15, 735, 196, 083. 00 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 2018 年 7 月 1 日 - 2018 年 9 月 30 日		
	现金宝 A	现金宝 B	
1. 本期已实现收益	2, 442, 147. 34	1, 289, 917. 82	
2. 本期利润	2, 442, 147. 34	1, 289, 917. 82	
3. 期末基金资产净值	326, 299, 427. 93	157, 351, 960. 83	

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 本报告期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

现金宝 A

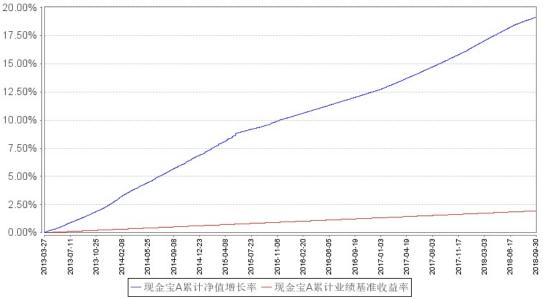
阶段	净值收益率①	净值收益率标准差②		业绩比较基准 收益率标准差 ④	1)-(3)	2-4
过去三个月	0. 6260%	0. 0016%	0. 0882%	0. 0000%	0. 5378%	0. 0016%
			TII 人 🕁 n			

现金宝 B

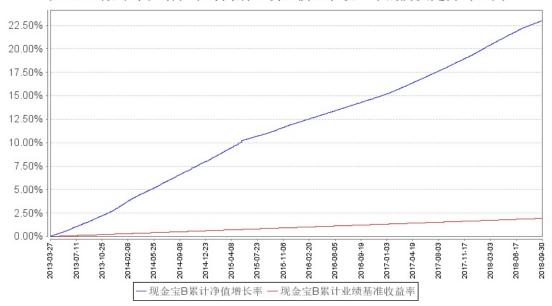
阶段	净值收益率①	净值收益率标 准差②	\	业绩比较基准 收益率标准差 ④		2-4
过去三个月	0. 7759%	0. 0015%	0. 0882%	0. 0000%	0. 6877%	0. 0015%

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

现金宝A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



现金宝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



注:本基金合同规定,基金管理人应当自基金合同生效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	江光月小左門	2.H HB
灶石		任职日期	离任日期	证券从业年限	说明
朱 哲 📗	本基金基金 经理	2016年8月29日	-	9 年	工商管理硕士。 2009 年 7 月 至 2010 年 9 月任中国银

行金融班投资经理。2010年10月至2013年5月任薪安基公交易部第实易是2013年5月任薪安基分支易部实表别。2013年5月至2015年7月任城收益期基金经理。2015年8月加入无成联公益期。2015年8月加入无成联公益理。2016年8月加入无成联公益理。2016年8月加入无成政治量,2016年10月日本日本人成实时场理。为投资是金额产市超过。2016年9月6日尼任元发现在和大成实时场理。2016年9月6日尼任元发明开放投资基金经理。2016年9月10月12日运任大成财产基金经理。2016年10月12日起任大成家市均理。2016年10月12日起任大成家市均理。2016年10月12日起任大成家市均理。2016年10月12日起任大成家市均理。2016年10月12日起任大成家市均理。2016年1月月11日起任大成家安短融债	 		
理。2010年 10 月至 2013年5月 在嘉实基最员。 2013年5月 至2015年7月任舉基部 基金年8月 加入大理院收益理。 2016年8月 加入大理局定金经8月 295百节基明 295百节基明 2054年2月 成货对成型场域。 2016年2月 成发对场理。 2016年2月 29日年1年大城大成时场理。 2016年9月 6日起华年9月 6日起华年9月 6日起华,对被债券基金州,对被债券基金州,对债券基金州,对债券基金州,对债券基金州,对债券基金州,对债券基金利,对债券基金利,对债券基金经理。2016年起,参收债券基金经理。2016年起,必须基本金经理。2016年起,以成货币金经理。2016年起,2016年起,2018年3月 14日起任大大			行金融市场总
10 月至 2013 年 5 月 任嘉实基易会。 2013 年 5 月 任嘉实基易员。 2013 年 5 月 至 2015 年 8 月 至 2015 年 8 月 加入理程收益部基金会管理固定处经理 月 加入理程处查的总统 2016 年 8 月 29 日 步市 步 明 之 6 日 起 6 年 8 月 29 日 步市 步 明 表 2016 年 8 月 29 日 步市 步 明 表 2016 年 8 月 29 日 步市 步 明 表 2016 年 8 月 2016 年 9 月 6 日 起 年 9 月 6 日 起 年 2016 年 9 月 6 日 起 年 2016 年 2			部助理投资经
2013年5月 任嘉文基金交易部交5月 至2015年 7月任银华基金园企牧理。 7月任银华基金园企牧理。 2015年8月 加入大成聚公益型。 2016年8月 29日起市基金灵园。 2016年8月 29日起市基金灵园沿海上、成货投景型运动,在国发基金、活配置券投成则时基金。 发现或时市基金。 2016年1年次期开放资基金全理。 2016年9月 6日起任年定型证券投资自用明开发设备。 2016年1月期开放资本金、10月1日,10月			理。2010年
任嘉文基易员。 2013年5年 至2015年 7月任银华基 全国定收益部 基金经理。 2015年8月 加入大成是金育理图企经理。 2016年8月 加入大成必约理。 2016年8月 29日起作大成货资强企业。 2016年9月 6日起年年定理。 券投资现时场基。 全型。 2016年9月 6日起年年定则 养投资信息。 2016年9月 6日起年定时, 大成常市地理。 2016年1月, 10月12日运交易型货基金单 2016年2日, 11日日日本			10 月至
易部交易 5 月 至 2013 年 5 月 至 2015 年 7 月 任 4 年 基 金 量 经 2015 年 8 月 经 2015 年 8 月 经 管 理 8 月 经 管 理 8 月 全 管 理 6 年 1 起 6 年 1 起 6 年 1 是 6 年 1 是 6 年 1 是 6 年 1 是 6 年 1 是 6 年 1 是 6 年 1 是 6 年 1 是 6 年 1 是 6 年 1 是 6 年 1 是 6 年 1 日 月 1 是 6 年 1 日 日 1 日 2 日 2 是 6 年 1 日 日 1 日 2 日 2 是 6 年 1 日 日 1 日 2 日 2 是 6 年 1 日 2 日 2 日 4 年 1 日 2 日 4 日 2 日 2			2013年5月
易部交易 5 月 至 2013 年 5 月 至 2015 年 7 月 任 4 年 基 金 量 经 2015 年 8 月 经 2015 年 8 月 经 管 理 8 月 经 管 理 8 月 全 管 理 6 年 1 起 6 年 1 起 6 年 1 是 6 年 1 是 6 年 1 是 6 年 1 是 6 年 1 是 6 年 1 是 6 年 1 是 6 年 1 是 6 年 1 是 6 年 1 是 6 年 1 是 6 年 1 日 月 1 是 6 年 1 日 日 1 日 2 日 2 是 6 年 1 日 日 1 日 2 日 2 是 6 年 1 日 日 1 日 2 日 2 是 6 年 1 日 2 日 2 日 4 年 1 日 2 日 4 日 2 日 2			任嘉实基金交
2013 年 5 月 至 2015 年 7 月任報华基 金 國定收益部 基金全理。 2015 年 8 月 加入大成基金 管理商定收益理。 2016 年 8 月 29 日起行大成货场。 天成置混查。 大成现。 为投资时事基金 全经。 有一年经理。 是2016 年 9 月 6 日起任大废明, 开放债基单利 一年定理证, 券投资基金基的, 大成信期开放。 债券基金基的。 是2016 年 10 月 12 日起在大成活态场。 基金基在 2016 年 10 月 12 日起在大成活态。 基金基本 2016 年 10 月 12 日起在大成活态。 基金基本 2016 年 10 月 12 日起在大成活态。 基金基本 2016 年 10 月 12 日起任大成活态。 基金基本 2016 年 3 月 14 日起任大			
至 2015 年 7 月任報华基金超级程。 2015 年 8 月 加入大成是全。 2015 年 8 月 加入大成联查司。 管理和收益理。 2016 年 8 月 29 日起市基金 8 月 29 日起市基金 8 月 29 日起市基金 5 元 五 元 五 元 元 五 元 元 元 元 元 元 元 元 元 元 元 元			
7月任银华基金经理。2015年8月加入大成基金管理。2016年8月加入大成基金管理和定收益司。任国定收益司。任国定收益司。2016年8月29日成市场证券投资最远。2016年8月29日成市场证券投资基金对人成实时基金工作定则是一个企业。2016年9月6日起生年定期开放债券基金基金经理。2016年10月12日起任大成添币市经理。2016年10月12日起任大成添币市经理。2018年3月14日起任大			
金国定收益部基金公理。 2015年8月加入大成基金管面定处益总管面之人成基金管面定处益是。 2016年8月29日起任大成货币市基。 2016年8月29日起行为证券投资基础和大成实时的基本分离实现的基金基金经现在实现的对于,			
基金经理。2015年8月加入大成基金管理有限公益总部基金管理有限公益总部基金8月29日起任大成货受量。2016年8月29日起任大成货受量。对成实验量。2016年8月29日起任大成货量。2016年9月6日起任大成实证券投资基金场内实证券投资基金经理。2016年20月12日担任大政货产。2016年20月12下温产业场资本金经理。2016年20月12下温产业场资本金经理。2016年20月12下温产业场资本金经理。2016年20月12下温产业场资本金经理。2018年3月14日起任大政货币单级基金基金经理。3月14日起任大大货			
2015年8月加入大成基金管理局限公司。任固定收益总部基金经理。2016年2016年在大成货资量。2016年2016年19月29日起币市场证券投资量。全国企业场,为实际场景企业场,为实际场景企业场,为实际场景。全国企业的企业,2016年9月6日起任大成最华一年定期,开放资基单利一年定定期,开放资基单利一年定,增加,一年定,增加,一年定,增加,一年定,增加,一年之时,增加,一年之时,增加,一年之时,增加,一年之时,增加,一年之时,增加,一年之时,增加,一年之时,增加,增加,一年之时,增加,增加,增加,增加,增加,增加,增加,增加,增加,增加,增加,增加,增加,			
加入大成基金管理和限公总部基金经理。 2016年8月 29日起市场证券投资更更不成货产基金。大成货资更现。 2016年8月 29日起市场证券投资量现买活配置投资业和大成货量则。 2016年现现,为政立电财货币市场基金基金经理。 2016年9月6日起任于成期开放放资券型证券投资基金基金经理。 2016年10月12日起任大成添益基金经理。2016年10月12日起任大发派而市场基金基金经理。2016年10月日2日起任大发派而市场基金基金经理。2018年3月14日起任大			
管理有限公司,任固定收益总部基金经理。2016年8月29日起任大成货币资惠,大成货币资惠。大成货币市基金、大成货币商基金、大成强混合业。 2016年 基础 2016年 9月6日起任 年定期开放债务基金和大成债务基金和大成债务基金和大成债务基金和一个年产型证券投资基金经理。2016年10月12日起任大成货币市场基金经理。2016年10月12日起任大发货币市场基金基金经理。2018年3月14日起任大大			
在固定收益总部基金经理。2016年8月29日起任大成货币基金、万成强币基金、大成强明灵活配置设施基金、大成强明之业券投资金。 大成或时中基金宝账货币市市基金基金经理。2016年9月6日起任年大成景华金和大成债害则开放债券型证券投资基金增加,一年定期开放债券基金基增利一年定期开放债券基金经理。2016年10月12日起任大成添商市场基金基金经理。2018年3月14日起任大			
部基金经理。2016年8月29日起任大成货证券投资基金、大成景明灵活配置资基金、大成景明灵活配置资基金和大成或时时重整金量。2016年9月6日起任大成景华金州开放债券基金和大成债用期开放债券基金和大成信用期开放债券基金和大成信用的一年定期开放债券基金经理。2016年10月12添益市场基金基金经理。2018年3月14日起任大成年3月14日起任大			
2016年8月 29日起任大成货币为证券投资基金、 大成景明灵活配置混合量。 大成现金型或为内实时中场基金主金经理。 2016年9月 6日起任年户成景华一年发期 开放债务基金和 大大年定期 开放债务基金和 大大年定期证券投资信用,用产的债务基本, 位债务型证券投资基金经理。 2016年 10月12日起任大成添益交易型货币。 基金基金经理。 2018年3月 14日起任大			
29 日起任大成货币市场证券投资基金、大成景景可灵活配置混合型证券投资基金和大成现金宝场内实时中场基金宝场内实时中场基金经理。 2016 年 9 月 6 日起任午定期开放债券型证券投资信用押开放债券型证券投资信用押放债券型证券投资信用用放债券型证券投资基金经理。2016 年 10 月 12 日起任大成添益交易型货币分基金基金经理。2018 年 3 月 14 日起任大			
成货币市场证券投资基金、 大成景明灵活配置混合型证券投资基金和 大成现金宝场 内实时申赎货币市场基金基 金经理。 2016年9月6日起任大成 景华一年定期 开放债券型证券投资基金和 大成信用增利 一年定期开放 债券型证券投资基金基金经 理。2016年 10月12日起 任大成添至 易型货币场 基金基金经理。 2018年3月 14日起任大			
券投资基金、 大成景明灵活 配置混合型证 券投资基金和 大成现金宝场 内实时申基金基 金经理。 2016 年 9 月 6 日起任大成 景华一年定期 开放债券型证 券投资基金和 大成信用利 一年定期开放 债券型证券投 资基金基金经 理。2016 年 10 月 12 日起 任大成添益交 易型货币场 基金基金经理。 2018 年 3 月 14 日起任大			
大成最明灵活 配置混合型证 券投资基金和 大成现金宝场 内实时申赎货 币市场基金基 金经理。 2016年9月6日起任大成 景华一年定期 开放债券型证 券投信用利 一年定期 开放债券型证券投资基金基绝 理。2016年 10月12日起 任大成添益交 易型货币市场 基金基金经理。 2018年3月 14日起任大			
券投资基金和大成现金宝场内实时申赎货币市场基金基金经理。2016年9月6日起任大成景华一年定期开放债券型证券投资基金和大成信用判入一年定期开放债券型证券投资基金基金经理。2016年10月12日起任大成添面市场基金基金经理。2018年3月14日起任大			大成景明灵活
大成现金宝场内实时申赎货币市场基金基金经理。 2016年9月6日起任大成景华一年定期开放债券型证券投资基金和大成信用增利一年定期开放债券型证券投资基金基金经理。2016年10月12日起任大成添益交易型货币市场基金基金经理。2018年3月14日起任大			配置混合型证
内实时申赎货币市场基金基金经理。 2016年9月6日起任大成景华一年定期开放债券型证券投资基金和大成信用增利一年定期开放债券型证券投资基金基金经理。2016年10月12日起任大成添益交易型货币市场基金基金经理。2018年3月14日起任大			券投资基金和
市市场基金基金经理。 2016年9月6日起任大成景华一年定期开放债券型证券投资基金和大成信用增利一年定期开放债券型证券投资基金基金经理。2016年10月12日起任大成添益交易型货币市场基金基金经理。2018年3月14日起任大			大成现金宝场
金经理。 2016年9月6日起任大成 景华一年定期 开放债券型证 券投资基金和 大成信用增利 一年定期开放 债券型证券投资基金基金经 理。2016年 10月12日起 任大成添益交 易型货币市场 基金基金经理。 2018年3月 14日起任大			内实时申赎货
2016年9月 6日起任大成 景华一年定期 开放债券型证 券投资基金和 大成信用增利 一年定期开放 债券型证券投 资基金基金经 理。2016年 10月12日起 任大成添益交 易型货币市场 基金基金经理。 2018年3月 14日起任大			币市场基金基
6 日起任大成 景华一年定期 开放债券型证 券投资基金和 大成信用增利 一年定期开放 债券型证券投 资基金基金经 理。2016 年 10 月 12 日起 任大成添益交 易型货币市场 基金基金经理。 2018 年 3 月 14 日起任大			金经理。
景华一年定期 开放债券型证 券投资基金和 大成信用增利 一年定期开放 债券型证券投 资基金基金经 理。2016 年 10 月 12 日起 任大成添益交 易型货币市场 基金基金经理。 2018 年 3 月 14 日起任大			2016年9月
开放债券型证券投资基金和大成信用增利一年定期开放债券型证券投资基金基金经理。2016年10月12日起任大成添益交易型货币市场基金基金经理。2018年3月14日起任大			6 日起任大成
券投资基金和 大成信用增利 一年定期开放 债券型证券投 资基金基金经 理。2016年 10月12日起 任大成添益交 易型货币市场 基金基金经理。 2018年3月 14日起任大			景华一年定期
大成信用增利 一年定期开放 债券型证券投 资基金基金经 理。2016 年 10 月 12 日起 任大成添益交 易型货币市场 基金基金经理。 2018 年 3 月 14 日起任大			开放债券型证
一年定期开放 债券型证券投 资基金基金经 理。2016 年 10 月 12 日起 任大成添益交 易型货币市场 基金基金经理。 2018 年 3 月 14 日起任大			券投资基金和
债券型证券投资基金基金经理。2016年 10月12日起任大成添益交易型货币市场基金基金经理。 2018年3月 14日起任大			大成信用增利
资基金基金经理。2016年 10月12日起 任大成添益交 易型货币市场 基金基金经理。 2018年3月 14日起任大			一年定期开放
理。2016年 10月12日起 任大成添益交 易型货币市场 基金基金经理。 2018年3月 14日起任大			债券型证券投
10月12日起 任大成添益交 易型货币市场 基金基金经理。 2018年3月 14日起任大			资基金基金经
任大成添益交 易型货币市场 基金基金经理。 2018 年 3 月 14 日起任大			理。2016年
易型货币市场 基金基金经理。 2018年3月 14日起任大			
基金基金经理。 2018 年 3 月 14 日起任大			
2018 年 3 月 14 日起任大			
14 日起任大			
成景安短融债			
			成景安短融债

-			
			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。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

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

根据《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》的规定,公司制订了《大成基金管理有限公司公平交易制度》、《大成基金管理有限公司异常交易监控与报告制度》。公司旗下投资组合严格按照制度的规定,参与股票、债券的一级市场申购、二级市场交易等投资管理活动,内容包括授权、研究分析、投资决策、交易执行、业绩评估等与投资管理活动相关的各个环节。研究部负责提供投资研究支持,投资部门负责投资决策,交易管理部负责实施交易并实时监控,监察稽核部负责事前监督、事中检查和事后稽核,风险管理部负责对交易情况进行合理性分析,通过多部门的协作互控,保证了公平交易的可操作、可稽核和可持续。

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。2018年3季度公司旗下主动投资组合间股票交易不存在同日反向交易;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%的交易情形;投资组合间债券交易存在1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;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 报告期内基金投资策略和运作分析

三季度经济下行压力有所加大,基建投资进一步回落,带动固定资产投资累计同比增速从上 第 6页 共 11页 半年的 6.0%回落至 8 月份的 5.5%,但房地产开发投资和制造业投资保持了较好的韧性,截止 8 月两者的累计同比增速分别为 10.1%和 7.5%。外贸方面,出口额(以美元计)同比增速 8 月回 落至 9.8%,后续随着中美贸易摩擦的负面影响逐步体现,出口增速可能进一步回落。新增社会融资延续下降趋势,但速度放缓,得益于新增信贷有所放量,而非标融资快速下滑的势头也有所收敛,截止 8 月社会融资规模存量同比增速下降至 10.14%,较半年末低 0.3 个百分点。

主要受食品价格上行的影响,三季度 CPI 有所回升,8月 CPI 同比涨幅达到 2.3%,处在近一年来的较高水平。受基数走高的影响,三季度 PPI 有所回落,8月份同比涨幅为 4.1%。整体来看通胀压力有所上升,但仍处在温和区间。

7月初央行年内第三次下调存款准备金率,释放资金约7000亿元,使得三季度资金面进一步宽松。

市场表现方面,三季度银行间质押式回购隔夜加权平均利率约为 2.35%,较二季度下降约 38BP,7 天质押式回购加权平均利率约为 2.67%,比二季度下降 72BP。3 个月、6 个月和 1 年的 AAA 级金融债收益率收于 2.85%、3.29%和 3.55%,分别下行 78BP、67BP 和 69BP。

三季度本基金以保障流动性为前提,并选择在收益率相对高点适度配置偏长期限的资产,增厚收益率。

4.5 报告期内基金的业绩表现

本报告期现金宝 A 基金份额净值收益率为 0.6260%, 本报告期现金宝 B 基金份额净值收益率为 0.7759%, 同期业绩比较基准收益率为 0.0882%。

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	固定收益投资	99, 956, 723. 40	20. 51
	其中:债券	99, 956, 723. 40	20. 51
	资产支持证 券	_	_
2	买入返售金融资产	192, 444, 625. 92	39. 48
	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	188, 491, 264. 83	38. 67

4	其他资产	6, 535, 292. 83	1.34
5	合计	487, 427, 906. 98	100.00

5.2 报告期债券回购融资情况

序号	项目	占基金资产净值比例	(%)
1	报告期内债券回购融资余额		0. 28
	其中: 买断式回购融资		_
序号	项目	金额(元)	占基金资产净值 比例(%)
2	报告期末债券回购融资余额	_	_
	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

无。

5.3 基金投资组合平均剩余期限

5.3.1 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	48
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	60
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	16

报告期内投资组合平均剩余期限超过120天情况说明

无。

5.3.2 报告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	各期限负债占基金资产净
		值的比例(%)	值的比例(%)
1	30 天以内	47. 40	_
	其中:剩余存续期超过397天的浮动		
	利率债	_	_
2	30 天(含)—60 天	30. 61	_
	其中:剩余存续期超过397天的浮动		
	利率债		
3	60 天(含)—90 天	8. 25	_
	其中:剩余存续期超过397天的浮动		
	利率债	_	_
4	90 天(含)—120 天	_	_
	其中: 剩余存续期超过397天的浮动		
	利率债		_

5 120天(含)—397天(含)	13. 23	_
其中:剩余存续期超过397天的浮动		
利率债	_	
合计	99. 50	_

5.4 报告期内投资组合平均剩余存续期超过240天情况说明

无。

5.5 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

	16日初年16世界16日 16日 16日 16日 16日 16日 16日 16日 16日 16日				
序	债券品种	摊余成本 (元)	占基金资产净		
号	以分	Y#示/X/平(儿)	值比例(%)		
1	国家债券	_	_		
2	央行票据	_	_		
3	金融债券	30, 046, 172. 68	6. 21		
	其中: 政策性金融债	30, 046, 172. 68	6. 21		
4	企业债券	_	_		
5	企业短期融资券	60, 006, 403. 81	12.41		
6	中期票据	_	_		
7	同业存单	9, 904, 146. 91	2.05		
8	其他	_	_		
9	合计	99, 956, 723. 40	20. 67		
10	剩余存续期超过397天的浮动				
10	利率债券	_	_		

5.6 报告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

	序号	债券代码	债券名称	债券数量(张)	摊余成本(元)	占基金资产净 值比例(%)
						压,60/1 (/0/
	1	011800710	18 国电 SCP004	300, 000	30, 004, 251. 40	6. 20
	2	011800912	18 三峡 SCP002	300, 000	30, 002, 152. 41	6. 20
	3	170413	17 农发 13	200, 000	20, 038, 380. 40	4. 14
	4	150223	15 国开 23	100, 000	10, 007, 792. 28	2.07
	5	111809193	18 浦发银行	100, 000	9, 904, 146. 91	2. 05
			CD193		100, 000 9, 904, 146. 91	2.05

5.7 "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	0
报告期内偏离度的最高值	0. 0982%
报告期内偏离度的最低值	0. 0562%
报告期内每个工作日偏离度的绝对值的简单平均值	0. 0729%

报告期内负偏离度的绝对值达到 0.25%情况说明

无。

报告期内正偏离度的绝对值达到 0.5%情况说明

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十名资产支持证券投资明细

无。

5.9 投资组合报告附注

- 5.9.1 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 0.01 元
- 5.9.2 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 18 浦发银行 CD193(111809193)的发行主体上海浦东发展银行股份有限公司于 2018 年 2 月 12 日因以贷转存、虚增存贷款等,受到中国银行业监督管理委员会处罚(银监罚决字(2018)4 号);于 2018 年 7 月 26 日因未按照规定履行客户身份识别义务等,受到中国人民银行处罚(银反洗罚决字(2018)3 号)。本基金认为,对浦发银行的处罚不会对其投资价值构成实质性负面影响。

5.9.3 其他资产构成

31 31 3 7 7	32/ 13/24	
序号	名称	金额 (元)
1	存出保证金	316, 360. 51
2	应收证券清算款	2, 439. 73
3	应收利息	2, 168, 952. 02
4	应收申购款	4, 047, 540. 57
5	其他应收款	_
6	待摊费用	_
7	其他	_
8	合计	6, 535, 292. 83

5.9.4 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。

§ 6 开放式基金份额变动

单位: 份

项目	现金宝 A	现金宝 B
报告期期初基金份额总额	36, 241, 089, 851. 00	17, 888, 857, 334. 00

报告期期间基金总申购份额	88, 728, 944, 655. 00	10, 953, 988, 099. 00
报告期期间基金总赎回份额	92, 340, 091, 713. 00	13, 107, 649, 350. 00
报告期期末基金份额总额	32, 629, 942, 793. 00	15, 735, 196, 083. 00

§7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现金宝场内实时申赎货币市场基金的文件;
- 2、《大成现金宝场内实时申赎货币市场基金基金合同》;
- 3、《大成现金宝场内实时申赎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。

9.2 存放地点

备查文件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 2018 年 10 月 25 日