

# 大成添益交易型货币市场基金 2019 年第 2 季度报告

2019 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

报告送出日期：2019 年 7 月 18 日

## § 1 重要提示

基金管理人的董事会及董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带责任。

基金托管人中国银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2019 年 7 月 17 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 2019 年 4 月 1 日起至 6 月 30 日止。

## § 2 基金产品概况

基金简称	大成添益交易型货币
基金主代码	003252
交易代码	003252
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2016 年 9 月 29 日
报告期末基金份额总额	2,797,095,828.33 份
投资目标	严格控制投资组合风险，保持良好的组合流动性，力争实现超越业绩比较基准的投资回报。
投资策略	<p>1、利率趋势评估策略</p> <p>通过对宏观经济、宏观政策、市场资金面供求等因素的综合分析，对资金利率变动趋势进行评估，最大限度地优化存款期限、回购和债券品种组合。</p> <p>2、类属配置策略</p> <p>本基金管理人在评估各品种在流动性、收益率稳定性基础上，结合预先制定的组合平均期限范围确定类属资产配置。</p> <p>3、组合平均剩余期限配置策略</p>

	<p>基金根据对未来短期利率走势的研判, 结合基金资产流动性的要求动态调整组合久期。当预期短期利率上升时, 降低组合久期, 以规避资本损失或获得较高的再投资收益; 在预期短期利率下降时, 提高组合久期, 以获得资本利得或锁定较高的利率水平。</p> <p>4、银行存款投资策略</p> <p>银行存款是本基金的主要投资对象。在确保安全性和流动性的前提下, 通过不同商业银行和不同存款期限的选择, 挖掘出利率报价较高的多家银行进行银行存款的投资, 在获取较高投资收益的同时尽量分散投资风险, 提高存款资产的流动性。通过对宏观经济、宏观政策、市场资金面等因素的综合分析, 对资金利率变动趋势进行评估, 最大限度地优化存款期限。</p> <p>5、流动性管理策略</p> <p>在日常的投资管理过程中, 本基金将会紧密关注申购与赎回资金变化情况、季节性资金流动等影响货币市场基金流动性管理的因素, 建立组合流动性监控管理指标, 实现对基金资产流动性的实时管理。</p>		
业绩比较基准	中国人民银行公布的人民币活期存款基准利率 (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。		
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		
下属分级基金的基金简称	大成添益交易型货币 A	大成添益交易型货币 B	交易货币
下属分级基金的场内简称	-	-	交易货币
下属分级基金的交易代码	003252	003253	511690
报告期末下属分级基金的份额总额	6, 910, 083. 90 份	240, 039. 26 份	2, 789, 945, 705. 17 份

注: 1. 本基金场外基金份额 (A 类、B 类基金份额) 简称 “大成添益交易型货币 A” “大成添益交易型货币 B”, 基金份额净值为 1.00 元。

2. 本基金 E 类基金份额上市交易, 简称为 “交易货币”, 基金份额面值为 100.00 元, 本表所列 E 类份额数据面值已折算为 1 元。

### § 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 2019 年 4 月 1 日 - 2019 年 6 月 30 日		
	大成添益交易型货币 A	大成添益交易型货币 B	交易货币
1. 本期已实现收益	40,510.44	198,434.32	15,859,330.20
2. 本期利润	40,510.44	198,434.32	15,859,330.20
3. 期末基金资产净值	6,910,083.90	240,039.26	2,789,945,705.17

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 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

大成添益交易型货币 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③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	0.5680%	0.0003%	0.0873%	0.0000%	0.4807%	0.0003%

大成添益交易型货币 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③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	0.6278%	0.0003%	0.0873%	0.0000%	0.5405%	0.0003%

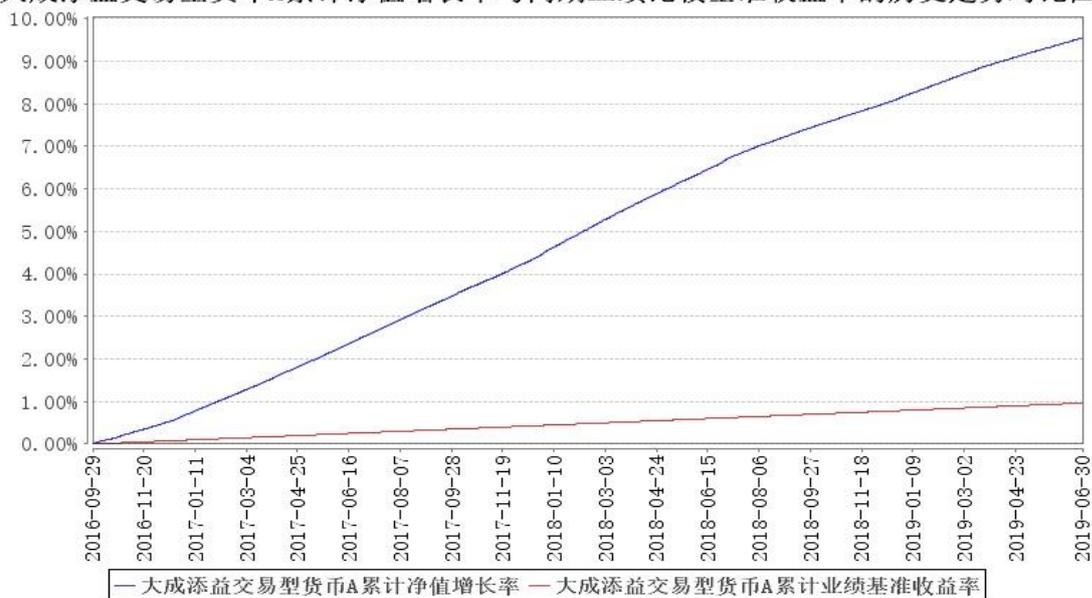
交易货币

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③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	0.5675%	0.0003%	0.0873%	0.0000%	0.4802%	0.0003%

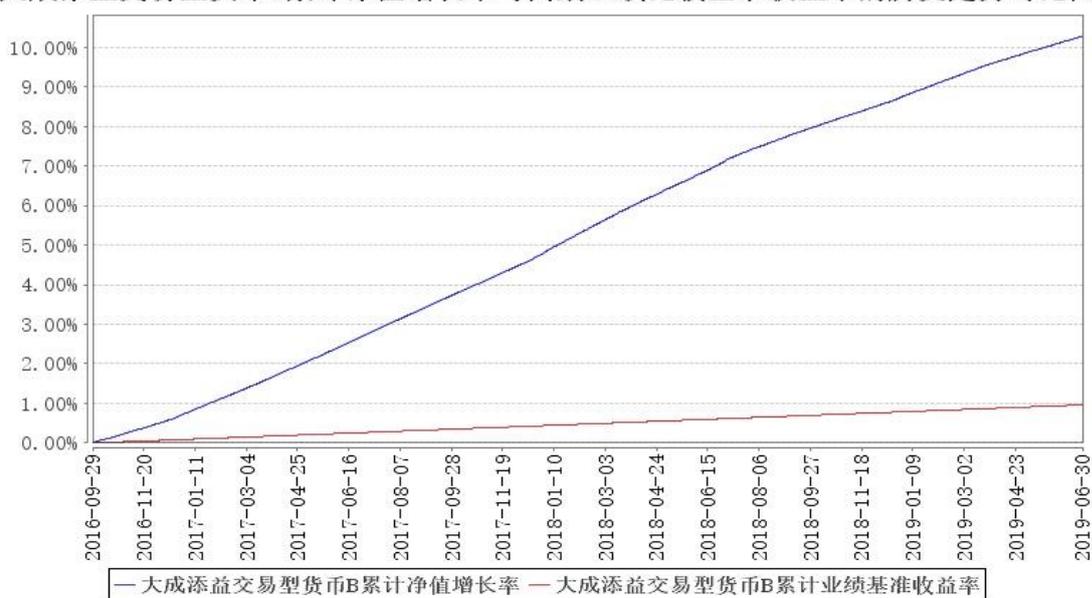
注：本货币基金收益分配按日结转份额。

##### 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

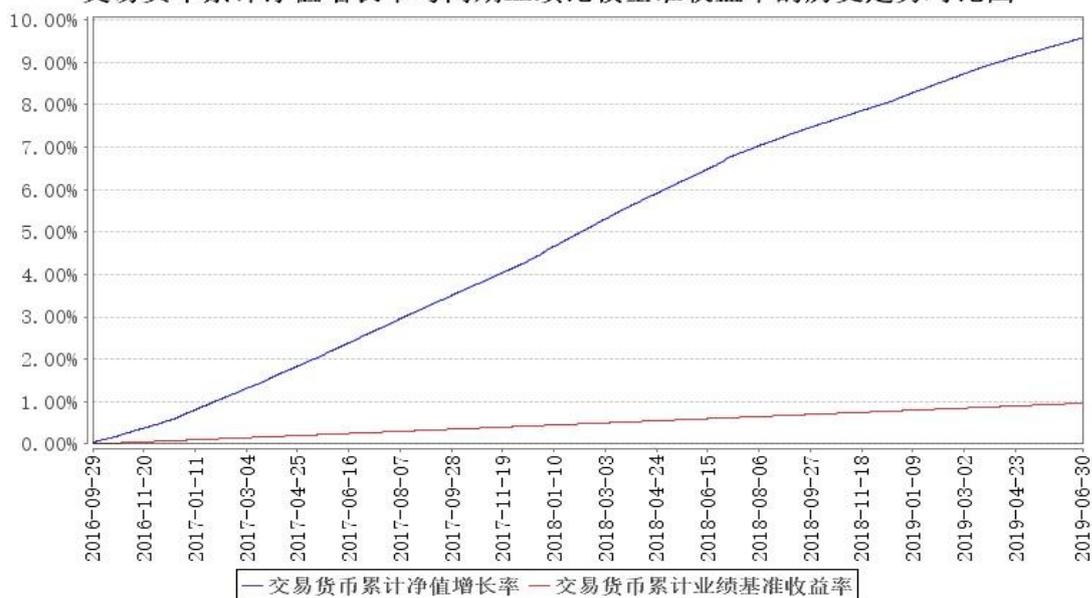
大成添益交易型货币A累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



大成添益交易型货币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



交易货币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之日起六个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的约定。建仓期结束时，本基金的投资组合比例符合基金合同的约定。

## § 4 管理人报告

### 4.1 基金经理（或基金经理小组）简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
朱哲	本基金基金经理	2016年10月12日	-	10年	工商管理硕士。2009年7月至2010年9月任中国银行金融市场总部助理投资经理。2010年10月至2013年5月任嘉实基金交易部交易员。2013年5月至2015年7月任银华基金固定收益部基金经理。2015年8月加入大成基金管理有限公司，任固定收益总部基金经理。2016

				<p>年 8 月 29 日起任大成货币市场证券投资基金基金经理和大成现金宝场内实时申赎货币市场基金基金经理。2016 年 8 月 29 日至 2019 年 3 月 2 日任大成景明灵活配置混合型证券投资基金基金经理。2016 年 9 月 6 日至 2019 年 3 月 19 日任大成景华一年定期开放债券型证券投资基金基金经理。2018 年 3 月 14 日至 2019 年 3 月 29 日任大成景安短融债券型证券投资基金基金经理。2016 年 9 月 6 日至 2019 年 6 月 15 日任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 11 月 16 日起任大成景禄灵活配置混合型证券投资基金基金经理。具有基金</p>
--	--	--	--	---

					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

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。2019 年 2 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不存在同日反向交易；投资组合间相邻交易日反向交易的市场成交比例、成交均价等交易结果数据表明该类交易不对市场产生重大影响，无异常；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

由于中美贸易摩擦等原因，二季度全球整体经济增速都较一季度有所下行，中国工业增加值和投资增速也未能延续一季度的反弹态势，重新开始下滑。美联储降息预期大幅提高，全球国债收益率都有所下降，欧洲多国国债进入负收益率区间。而为了向中小银行等机构提供融资便利，

央行加大了公开市场投放，导致二季度末资金利率水平连续创下近几年的新低，6 月份银行间隔夜回购平均利率下行至 2% 以下。

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。同时注重风险控制，保证了组合的安全。

#### 4.5 报告期内基金的业绩表现

本报告期大成添益交易型货币 A 基金份额净值收益率为 0.5680%，本报告期大成添益交易型货币 B 基金份额净值收益率为 0.6278%，本报告期交易货币基金份额净值收益率为 0.5675%，同期业绩比较基准收益率为 0.0873%。

#### 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	814,679,813.02	29.10
	其中：债券	814,679,813.02	29.10
	资产支持证券	-	-
	券	-	-
2	买入返售金融资产	1,104,796,292.69	39.47
	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	876,333,998.30	31.31
4	其他资产	3,355,139.56	0.12
5	合计	2,799,165,243.57	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	1.06	
	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	75
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	77
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	18

#### 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值的比例 (%)	各期限负债占基金资产净值的比例 (%)
1	30 天以内	52.83	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
2	30 天（含）—60 天	10.34	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
3	60 天（含）—90 天	9.51	-
	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）	27.28	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
	合计	99.96	-

#### 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

序号	债券品种	摊余成本（元）	占基金资产净值比例 (%)
1	国家债券	116,493,311.72	4.16
2	央行票据	-	-
3	金融债券	30,137,878.94	1.08
	其中：政策性金融债	30,137,878.94	1.08

4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	同业存单	668,048,622.36	23.88
8	其他	-	-
9	合计	814,679,813.02	29.13
10	剩余存续期超过 397 天的浮动利率债券	-	-

#### 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（%）
1	111808268	18 中信银行 CD268	1,500,000	149,698,048.78	5.35
2	111813116	18 浙商银行 CD116	1,200,000	119,831,212.17	4.28
3	111809283	18 浦发银行 CD283	1,000,000	99,403,305.33	3.55
4	199921	19 贴现国债 21	600,000	59,784,516.12	2.14
5	199925	19 贴现国债 25	570,000	56,708,795.60	2.03
6	111815349	18 民生银行 CD349	500,000	49,927,441.35	1.78
7	111815573	18 民生银行 CD573	500,000	49,886,104.94	1.78
8	111815593	18 民生银行 CD593	500,000	49,829,624.12	1.78
9	111815598	18 民生银行 CD598	500,000	49,826,216.20	1.78
10	111809367	18 浦发银行 CD367	400,000	39,864,023.87	1.43

#### 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	0.0131%
报告期内偏离度的最低值	-0.0044%
报告期内每个工作日偏离度的绝对值的简单平均值	0.0029%

#### 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 1.00 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。**

1、本基金投资的前十名证券之一 18 中信银行 CD268 (111808268. IB) 的发行主体中信银行股份有限公司于 2018 年 11 月 19 日因理财资金违规缴纳土地款等,受到中国银行保险监督管理委员会处罚(银保监银罚决字〔2018〕14 号)。本基金认为,对中信银行的处罚不会对其投资价值构成实质性负面影响。

2、本基金投资的前十名证券之一 18 浙商银行 CD116 (111813116. IB) 的发行主体浙商银行股份有限公司于 2018 年 11 月 9 日因投资同业理财产品未尽审查等,受到中国银行保险监督管理委员会处罚(银保监银罚决字〔2018〕11 号)。本基金认为,对浙商银行的处罚不会对其投资价值构成实质性负面影响。

3、本基金投资的前十名证券之一 18 浦发银行 CD367 (111809367. IB) 的发行主体上海浦东发展银行股份有限公司于 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。

4、本基金投资的前十名证券之一 18 浦发银行 CD283 (111809283. IB) 的发行主体上海浦东发展银行股份有限公司于 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、本基金投资的前十名证券之一 18 民生银行 CD598 (111815598. IB) 的发行主体中国民生银行股份有限公司于 2018 年 11 月 9 日因贷款业务严重违反审慎经营规则等,受到中国银行保险监督管理委员会处罚(银保监银罚决字〔2018〕5 号、银保监银罚决字〔2018〕8 号)。本基金认为,对民生银行的处罚不会对其投资价值构成实质性负面影响。

6、本基金投资的前十名证券之一 18 民生银行 CD593 (111815593. IB) 的发行主体中国民生

银行股份有限公司于 2018 年 11 月 9 日因贷款业务严重违反审慎经营规则等，受到中国银行保险监督管理委员会处罚（银保监银罚决字（2018）5 号、银保监银罚决字（2018）8 号）。本基金认为，对民生银行的处罚不会对其投资价值构成实质性负面影响。

7、本基金投资的前十名证券之一 18 民生银行 CD573（111815573.IB）的发行主体中国民生银行股份有限公司于 2018 年 11 月 9 日因贷款业务严重违反审慎经营规则等，受到中国银行保险监督管理委员会处罚（银保监银罚决字（2018）5 号、银保监银罚决字（2018）8 号）。本基金认为，对民生银行的处罚不会对其投资价值构成实质性负面影响。

8、本基金投资的前十名证券之一 18 民生银行 CD349（111815349.IB）的发行主体中国民生银行股份有限公司于 2018 年 11 月 9 日因贷款业务严重违反审慎经营规则等，受到中国银行保险监督管理委员会处罚（银保监银罚决字（2018）5 号、银保监银罚决字（2018）8 号）。本基金认为，对民生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

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	-
2	应收证券清算款	-
3	应收利息	3,355,139.56
4	应收申购款	-
5	其他应收款	-
6	待摊费用	-
7	其他	-
8	合计	3,355,139.56

### 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	大成添益交易型货币 A	大成添益交易型货币 B	交易货币
报告期期初基金份额总额	7,212,131.94	60,272,490.13	2,937,393,858.46
报告期期间基金总申购份额	1,657,633.89	51,311,308.26	306,575,613.21
报告期期间基金总赎回份额	1,959,681.93	111,343,759.13	454,023,766.50
报告期期末基金份额总额	6,910,083.90	240,039.26	2,789,945,705.17

注：本基金基金合同生效于 2016 年 9 月 29 日，本基金的份额折算日为基金合同生效当日。折算后本基金场内份额（E 类基金份额）的份额面值为 100.00 元。

## § 7 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

序号	交易方式	交易日期	交易份额(份)	交易金额(元)	适用费率(%)
1	赎回	2019-04-10	2,000,000.00	-2,000,000.00	-
2	赎回	2019-04-16	8,000,000.00	-8,000,000.00	-
3	赎回	2019-04-16	10,000,000.00	-10,000,000.00	-
4	申购	2019-06-06	3,000,000.00	3,000,000.00	-
5	赎回	2019-06-18	2,000,000.00	-2,000,000.00	-
6	赎回	2019-06-25	1,000,000.00	-1,000,000.00	-
7	红利发放	2019-06-28	28,193.37	28,193.37	-
合计			26,028,193.37	26,028,193.37	

注:1、申购或者购买基金份额的,金额为正;赎回或者卖出基金份额的,金额为负。

- 2、合计数以绝对值填列。
- 3、红利发放为期间合计数。

## § 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

根据我司于 2019 年 7 月 6 日发布的《大成基金管理有限公司高级管理人员变更公告》,经大成基金管理有限公司第六届董事会第三十三次会议审议通过,自 2019 年 7 月 6 日起,公司总经理由罗登攀变更为谭晓冈。具体详见公司相关公告。

## § 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添益交易型货币市场基金的文件;
- 2、《大成添益交易型货币市场基金基金合同》;
- 3、《大成添益交易型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  
2019 年 7 月 18 日