大成添利宝货币市场基金
2020年第2季度报告

2020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

报告送出日期：2020年7月21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。

基金托管人兴业银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2020年7月20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2020年4月1日起至6月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	大成添利宝货币		
基金主代码	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		
报告期末基金份额总额	18,455,868,097.55份		
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、银行协议存款和大额存单投资策略、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。		
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		
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	6,453,857.48份	16,846,311,894.74份	1,603,102,345.33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（2020 年 4 月 1 日-2020 年 6 月 30 日）		
	大成添利宝 A	大成添利宝 B	大成添利宝 E
1.本期已实现收益	29,325.75	151,758,657.86	7,439,670.88
2.本期利润	29,325.75	151,758,657.86	7,439,670.88
3.期末基金资产净值	6,453,857.48	16,846,311,894.74	1,603,102,345.33

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

大成添利宝 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③	业绩比较基准收益率标准差④	①－③	②－④
过去三个月	0.3749%	0.0005%	0.0870%	0.0000%	0.2879%	0.0005%
过去六个月	0.9517%	0.0013%	0.1740%	0.0000%	0.7777%	0.0013%
过去一年	2.1600%	0.0012%	0.3505%	0.0000%	1.8095%	0.0012%
过去三年	9.2911%	0.0023%	1.0505%	0.0000%	8.2406%	0.0023%
过去五年	16.0210%	0.0036%	1.7505%	0.0000%	14.2705%	0.0036%
自基金合同生效起至今	20.6104%	0.0083%	2.0746%	0.0000%	18.5358%	0.0083%

大成添利宝 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③	业绩比较基准收益率标准差④	①－③	②－④
过去三个月	0.4342%	0.0005%	0.0870%	0.0000%	0.3472%	0.0005%
过去六个月	1.0722%	0.0013%	0.1740%	0.0000%	0.8982%	0.0013%
过去一年	2.4091%	0.0012%	0.3505%	0.0000%	2.0586%	0.0012%
过去三年	10.0861%	0.0023%	1.0505%	0.0000%	9.0356%	0.0023%
过去五年	17.4336%	0.0036%	1.7505%	0.0000%	15.6831%	0.0036%
自基金合同生效起至今	22.3564%	0.0083%	2.0746%	0.0000%	20.2818%	0.0083%

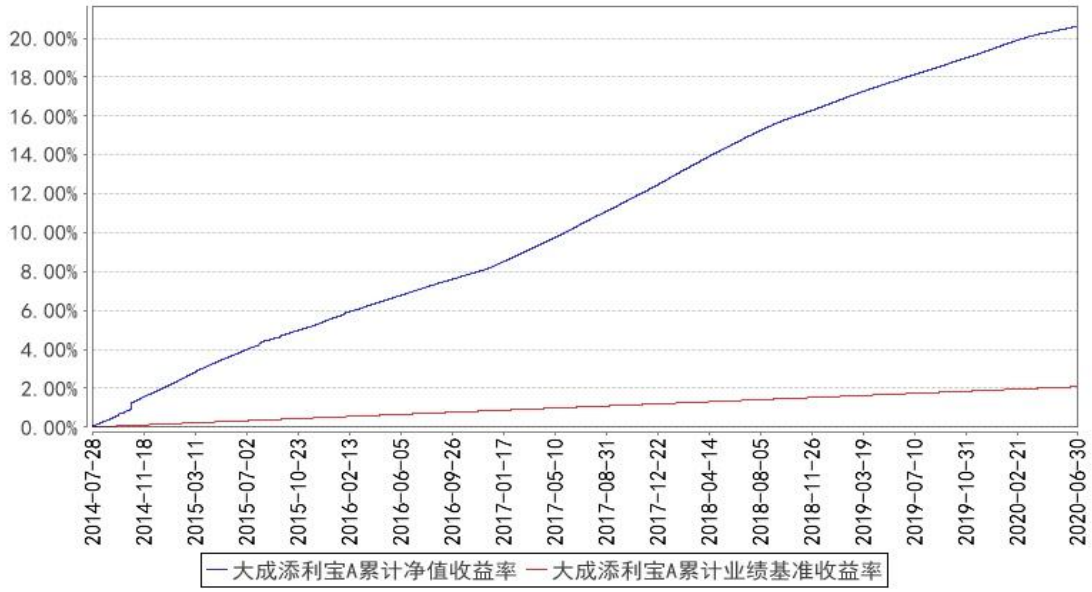
大成添利宝 E

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	0.3991%	0.0005%	0.0870%	0.0000%	0.3121%	0.0005%
过去六个月	1.0017%	0.0013%	0.1740%	0.0000%	0.8277%	0.0013%

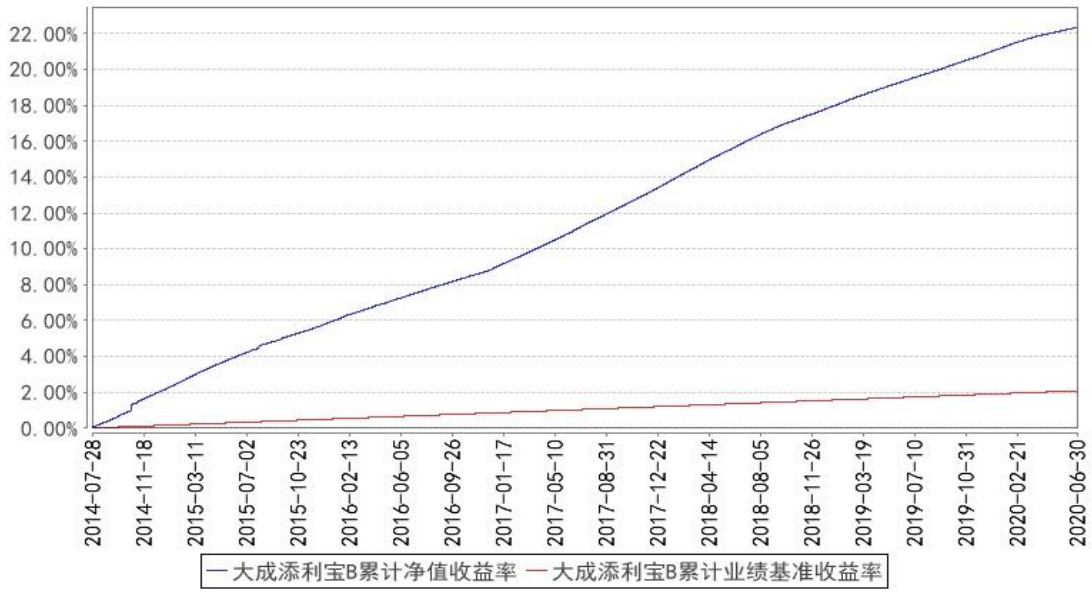
过去一年	2.2654%	0.0012%	0.3505%	0.0000%	1.9149%	0.0012%
过去三年	9.6241%	0.0023%	1.0505%	0.0000%	8.5736%	0.0023%
过去五年	16.6157%	0.0036%	1.7505%	0.0000%	14.8652%	0.0036%
自基金合同生效起至今	21.3470%	0.0083%	2.0746%	0.0000%	19.2724%	0.0083%

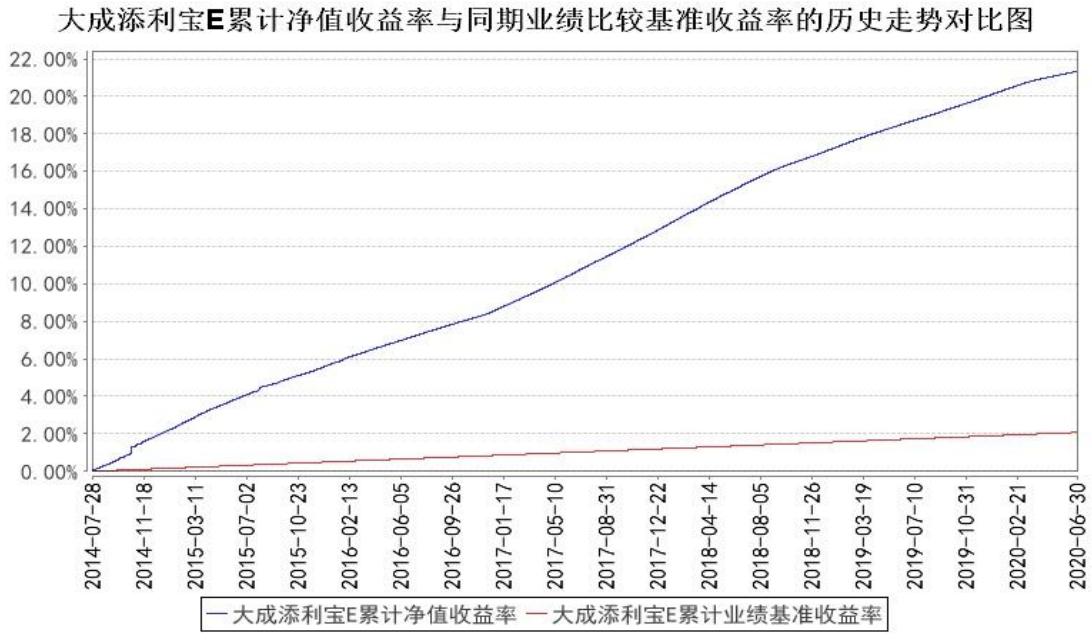
3.2.2 自基金合同生效以来基金累计净值收益率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

大成添利宝A累计净值收益率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



大成添利宝B累计净值收益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 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。截至报告期末，本基金因赎回导致投资的主体信用评级低于 AAA 的单一机构宁夏银行发行的金融工具占基金资产净值的比例被动超标。除此之外，报告期内本基金的其他各项投资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		
陈会荣	本基金基金经理	2018 年 3 月 14 日	-	13 年	经济学学士。2004 年 7 月至 2007 年 10 月就职于招商银行总行，任资产托管部年金小组组长。2007 年 10 月加入大成基金管理有限公司，曾担任基金运营部基金助理会计师、基金运营部登记清算主管、固定收益总部助理研究员、固定收益总部基金经理助理，现任固定收益总部总监助理。2016 年 8 月 6 日至 2018 年 10 月 20 日任大成景穗灵活配置混合型证券投资基金基金经理。2016 年 8 月 6 日起任大成丰财宝货币市场基金基金经理。2016 年 9 月 6 日至 2019 年 9 月 29 日任大成恒丰宝货币市场基金基金经理。2016 年 11 月 2 日至 2019 年 9 月 29 日任大成惠利纯债债券型证券投资基金、大成惠益纯债债券型证券投资基金基金经理。2017 年 3 月 1 日至 2019 年 9 月 29 日任大成惠祥纯

					债债券型证券投资基金（原大成惠祥定期开放纯债债券型证券投资基金转型）基金经理。2017年3月22日起任大成月添利理财债券型证券投资基金基金经理。2017年3月22日至2019年9月29日大成慧成货币市场基金基金经理。2017年3月22日至2020年3月11日任大成景旭纯债债券型证券投资基金基金经理。2018年3月14日至2020年6月29日任大成月月盈短期理财债券型证券投资基金、大成添利宝货币市场基金基金经理。2018年8月17日起任大成现金增利货币市场基金基金经理。2019年9月20日起任大成货币市场证券投资基金基金经理。2020年7月1日起任大成惠祥纯债债券型证券投资基金、大成惠益纯债债券型证券投资基金基金经理。具备基金从业资格。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 报告期内本基金运作遵规守信情况说明

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

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；部分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1笔同日反向交易，原因为组合流动性需要。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1笔同日反向交易，原因为组合流动性需要。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 报告期内基金的投资策略和运作分析

2020年二季度初，资金面继续宽松，市场预期资金利率中枢将显著下移，各期限货币市场工具收益率出现50-60BP不等的下行，进入6月，由于时点效应及一级市场供给增加等因素，货币市场又迎来一轮快速调整。纵观二季度，隔夜回购利率均值约为1.38%，较上季度下行85BP，7天回购加权利率均值约为1.76%，较上季度下行91BP。3个月AAA存单收益率下行68BP，3个月AA+存单收益率下行68BP，1年AAA存单收益率下行57BP，1年AA+存单收益率下行57BP，1年期金融债收益率下行31BP，1年AAA短期融资券下行约48bp，1年AA+短融品种下行约40bp。

本基金将以流动性为第一前提，根据组合特点在合理期限范围内配置组合资产，努力提高组合静态收益。

4.5 报告期内基金的业绩表现

本报告期大成添利宝A的基金份额净值收益率为0.3749%,本报告期大成添利宝B的基金份额净值收益率为0.4342%,本报告期大成添利宝E的基金份额净值收益率为0.3991%,同期业绩比较基准收益率为0.0870%。

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	5,327,141,847.63	27.60
	其中：债券	5,027,141,847.63	26.04
	资产支持证券	300,000,000.00	1.55
2	买入返售金融资产	2,956,628,354.94	15.32
	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	10,927,839,868.65	56.61
4	其他资产	91,478,140.05	0.47

5	合计	19,303,088,211.27	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		5.62
	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	838,106,940.94	4.54
	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，本基金债券正回购的资金余额未超过基金资产净值的 20%。

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	87
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	87
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	54

报告期内投资组合平均剩余期限超过 120 天情况说明

本报告期内，本基金投资组合平均剩余期限未超过 120 天。

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	41.09	4.54
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
2	30 天（含）—60 天	4.82	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
3	60 天（含）—90 天	15.82	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
4	90 天（含）—120 天	10.72	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-

5	120天（含）—397天（含）	31.64	-
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
合计		104.09	4.54

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	639,552,085.08	3.47
2	央行票据	-	-
3	金融债券	571,536,868.58	3.10
	其中：政策性金融债	571,536,868.58	3.10
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	1,650,185,356.06	8.94
6	中期票据	-	-
7	同业存单	2,165,867,537.91	11.74
8	其他	-	-
9	合计	5,027,141,847.63	27.24
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名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	209920	20贴现国债20	4,000,000	399,626,532.06	2.17
2	072000090	20中信证券CP007	3,600,000	360,000,270.11	1.95
3	072000100	20中信证券CP008	3,000,000	300,000,589.40	1.63
4	112096428	20广东华兴银行CD125	2,700,000	269,907,116.81	1.46
5	012001826	20沪电力SCP010	2,500,000	250,001,990.66	1.35
6	209917	20贴现国债17	2,400,000	239,925,553.02	1.30
7	190211	19国开11	2,100,000	210,306,517.29	1.14

8	072000102	20国泰君安CP004	2,000,000	200,000,406.80	1.08
9	112097416	20洛阳银行CD043	2,000,000	198,903,736.23	1.08
10	112016129	20上海银行CD129	2,000,000	198,825,043.50	1.08

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	0.0630%
报告期内偏离度的最低值	-0.0277%
报告期内每个工作日偏离度的绝对值的简单平均值	0.0344%

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 报告期末按摊余成本占基金资产净值比例大小排名的前十名资产支持证券投资明细

序号	证券代码	证券名称	数量（份）	摊余成本（元）	占基金资产净值比例（%）
1	168649	信润03A1	2,000,000	200,000,000.00	1.08
2	168680	1欲晓A01	1,000,000	100,000,000.00	0.54

5.9 投资组合报告附注

5.9.1 基金计价方法说明

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

本基金投资的前十名证券的发行主体本期未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。

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	74,543,209.05
4	应收申购款	16,934,931.00
5	其他应收款	-
6	待摊费用	-
7	其他	-
8	合计	91,478,140.05

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	大成添利宝A	大成添利宝B	大成添利宝E
报告期期初基金份额总额	27,044,235.54	30,056,280,752.72	2,150,223,521.21
报告期期间基金总申购份额	9,722,464.04	21,592,236,824.28	1,043,350,891.66
报告期期间基金总赎回份额	30,312,842.10	34,802,205,682.26	1,590,472,067.54
报告期期末基金份额总额	6,453,857.48	16,846,311,894.74	1,603,102,345.33

§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	申购	2020-04-03	23,000,000.00	23,000,000.00	-
2	申购	2020-04-08	22,000,000.00	22,000,000.00	-
3	赎回	2020-04-23	-11,000,000.00	-11,000,000.00	-
4	赎回	2020-04-24	-14,000,000.00	-14,000,000.00	-
5	申购	2020-05-14	5,000,000.00	5,000,000.00	-
6	赎回	2020-05-15	-105,000,000.00	-105,000,000.00	-
7	赎回	2020-05-21	-5,500,000.00	-5,500,000.00	-
8	申购	2020-05-25	10,000,000.00	10,000,000.00	-

9	申购	2020-05-27	5,000,000.00	5,000,000.00	-
10	赎回	2020-06-04	-67,010,000.00	-67,010,000.00	-
11	申购	2020-06-05	2,003,347.30	2,003,347.30	-
12	赎回	2020-06-05	-2,990,000.00	-2,990,000.00	-
13	申购	2020-06-09	6,000,000.00	6,000,000.00	-
14	赎回	2020-06-12	-73,000,000.00	-73,000,000.00	-
15	赎回	2020-06-17	-2,800,000.00	-2,800,000.00	-
16	赎回	2020-06-17	-10,000,000.00	-10,000,000.00	-
17	赎回	2020-06-23	-21,000,000.00	-21,000,000.00	-
18	红利发放	2020-06-30	60.55	60.55	-
19	红利发放	2020-06-30	977,819.99	977,819.99	-
合计			386,281,227.84	386,281,227.84	

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

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。

9.2 存放地点

备查文件存放在本基金管理人和托管人的办公住所。

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
2020年7月21日