

# 大成月月盈短期理财债券型证券投资基金 2020 年中期报告

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：中国银行股份有限公司

送出日期：2020 年 8 月 28 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。本中期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 2020 年 8 月 27 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。

大成月月盈短期理财债券型证券投资基金基金份额持有人大会于 2020 年 5 月 19 日至 2020 年 6 月 11 日以通讯方式召开，本次基金份额持有人大会于 2020 年 6 月 12 日决议通过了《关于大成月月盈短期理财债券型证券投资基金转型相关事项的议案》，正式实施日为 2020 年 8 月 4 日，具体详见 2020 年 6 月 13 日公告。

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。

本报告财务资料未经审计。

本报告期自 2020 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>5</b>
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
<b>§3 主要财务指标和基金净值表现</b> .....	<b>6</b>
3.1 主要会计数据和财务指标.....	6
3.2 基金净值表现.....	7
<b>§4 管理人报告</b> .....	<b>9</b>
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.....	11
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	11
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.....	12
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.....	13
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
<b>§5 托管人报告</b> .....	<b>14</b>
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	14
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.....	14
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见.....	14
<b>§6 半年度财务会计报告（未经审计）</b> .....	<b>14</b>
6.1 资产负债表.....	14
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
<b>§7 投资组合报告</b> .....	<b>35</b>
7.1 期末基金资产组合情况.....	35
7.2 债券回购融资情况.....	35
7.3 基金投资组合平均剩余期限.....	36
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.....	36
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	36
7.6 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.....	37

7.7 “影子定价”与“摊余成本法”确定的基金资产净值的偏离 .....	37
7.8 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 .....	37
7.9 投资组合报告附注 .....	38
<b>§8 基金份额持有人信息 .....</b>	<b>39</b>
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....	39
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....	40
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情况 .....	40
<b>§9 开放式基金份额变动 .....</b>	<b>40</b>
<b>§10 重大事件揭示 .....</b>	<b>40</b>
10.1 基金份额持有人大会决议 .....	40
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 .....	41
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....	41
10.4 基金投资策略的改变 .....	41
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....	41
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 .....	41
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	41
10.8 偏离度绝对值超过 0.5%的情况 .....	44
10.9 其他重大事件 .....	44
<b>§11 影响投资者决策的其他重要信息 .....</b>	<b>45</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 .....	45
11.2 影响投资者决策的其他重要信息 .....	46
<b>§12 备查文件目录 .....</b>	<b>46</b>
12.1 备查文件目录 .....	46
12.2 存放地点 .....	46
12.3 查阅方式 .....	46

## § 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		
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	8,427,612,871.03 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	59,981,296.10 份	8,285,379,281.27 份	82,252,293.66 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	赵冰
	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	吴庆斌	刘连舸

## 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》
登载基金中期报告正文的管理人互联网网址	www.dcfund.com.cn
基金中期报告备置地点	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

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2020年1月1日-2020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
本期已实现收益	780,332.59	162,094,553.87	1,106,568.00
本期利润	780,332.59	162,094,553.87	1,106,568.00
本期净值收益率	1.0668%	1.2188%	1.0528%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2020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
期末基金资产净值	59,981,296.10	8,285,379,281.27	82,252,293.66
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(2020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
累计净值收益率	22.7141%	24.7911%	17.9252%

注：1. 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。

2. 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，所涉及的相关累计数据计算起始日由原大成理财 21 天债券型发起式证券投资基金成立日变更为大成月月盈短期理财债券证券投资基金合同生效日。

### 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	0.1329%	0.0009%	0.1107%	0.0000%	0.0222%	0.0009%
过去三个月	0.4366%	0.0010%	0.3357%	0.0000%	0.1009%	0.0010%
过去六个月	1.0668%	0.0014%	0.6713%	0.0000%	0.3955%	0.0014%
过去一年	2.3201%	0.0014%	1.3519%	0.0000%	0.9682%	0.0014%
过去三年	10.1161%	0.0028%	4.0519%	0.0000%	6.0642%	0.0028%
自基金合同生效起至	22.7141%	0.0084%	7.8319%	0.0000%	14.8822%	0.0084%

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	0.1615%	0.0009%	0.1107%	0.0000%	0.0508%	0.0009%
过去三个月	0.5150%	0.0010%	0.3357%	0.0000%	0.1793%	0.0010%
过去六个月	1.2188%	0.0014%	0.6713%	0.0000%	0.5475%	0.0014%
过去一年	2.6229%	0.0014%	1.3519%	0.0000%	1.2710%	0.0014%
过去三年	11.0823%	0.0028%	4.0519%	0.0000%	7.0304%	0.0028%
自基金合同生效起至	24.7911%	0.0083%	7.8319%	0.0000%	16.9592%	0.0083%

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	0.1256%	0.0009%	0.1107%	0.0000%	0.0149%	0.0009%
过去三个月	0.4243%	0.0010%	0.3357%	0.0000%	0.0886%	0.0010%
过去六个月	1.0528%	0.0014%	0.6713%	0.0000%	0.3815%	0.0014%
过去一年	2.3088%	0.0014%	1.3519%	0.0000%	0.9569%	0.0014%
过去三年	10.0921%	0.0028%	4.0519%	0.0000%	6.0402%	0.0028%
自基金合同生效起至	17.9252%	0.0049%	6.1249%	0.0000%	11.8003%	0.0049%

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。

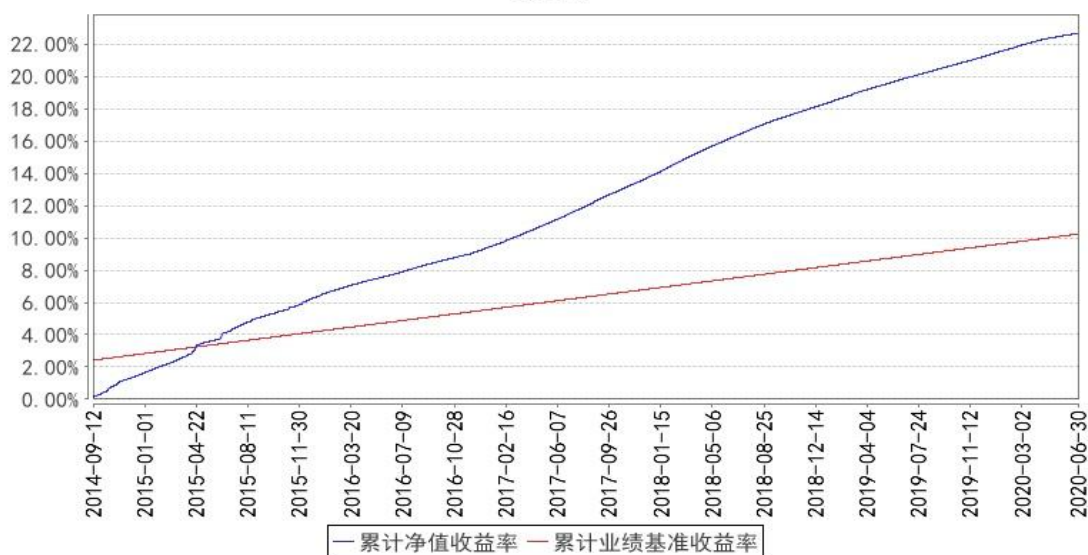
2、本表净值收益率的计算所采取的运作周期，是以基金合同生效日为起始日并持有至报告期末的基金份额所经历的运作周期。

3、本基金自 2015 年 6 月 19 日起，新增 E 类份额。

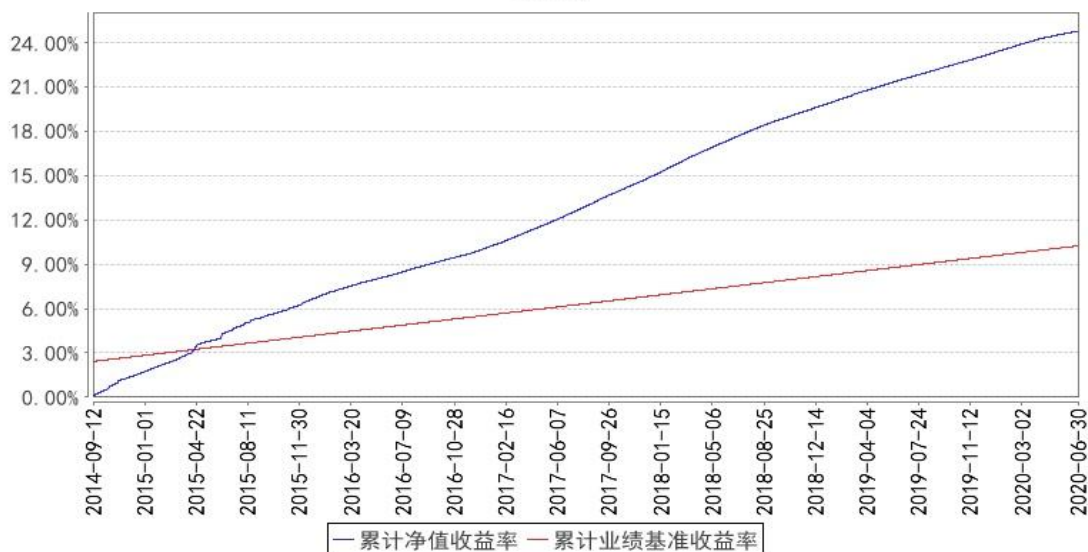
4、本基金自 2014 年 9 月 12 日起由大成理财 21 天债券型发起式证券投资基金转为大成月月盈短期理财债券证券投资基金，所涉及的相关数据计算起始日从本次年报开始由原大成理财 21 天债券型发起式证券投资基金成立日变更为大成月月盈短期理财债券证券投资基金合同生效日。

### 3.2.2 自基金合同生效以来基金份额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

大成月月盈短期理财债券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

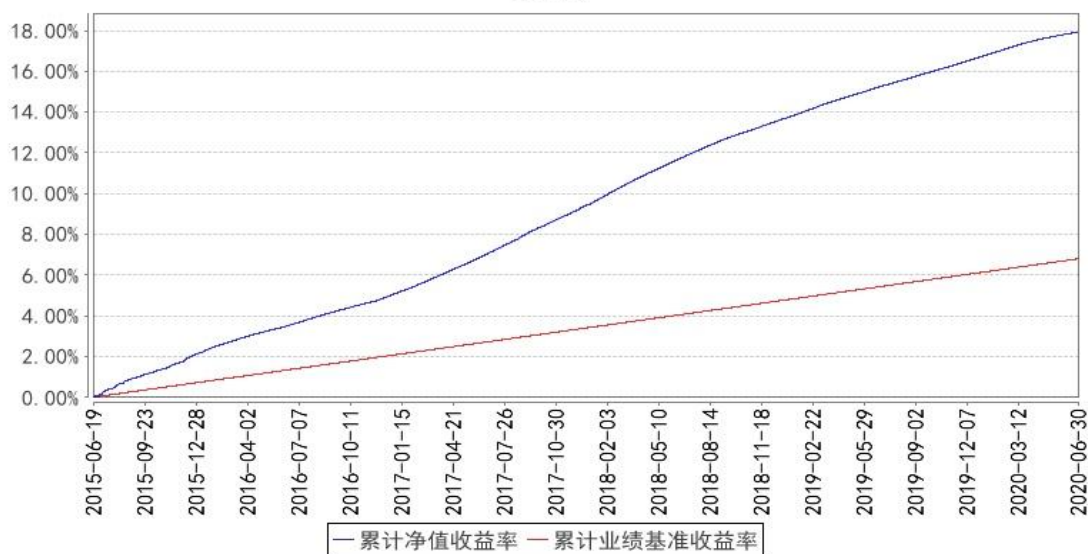


大成月月盈短期理财债券B累计净值收益率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图





大成月月盈短期理财债券E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。

经过二十年的稳健发展，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2020年6月30日，公司管理公募基金产品数量共103只。

#### 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		
陈会荣	本基金基金经理	2018年3月14日	2020年6月29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

					<p>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、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。</p> <p>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 日任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 日起任大成添利宝货币市场基金基金经理。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。2020 年 8 月 17 日起任大成惠享一年定期开放债券型发起式证券投资基金基金经理。具备基金从业资格。国籍：中国</p>
李富强	本基金基金经理	2018 年 7 月 16 日	-	6 年	<p>经济学硕士。2009 年 7 月至 2013 年 12 月任中国银行间市场交易商协会市场创新部高级助理。2014 年 1 月至 2017 年 7 月任北信瑞丰基金管理有限公司固定收益部基金经理。2017 年 7 月加入大成基金管理有限公司，任职于固定收益总部。2018 年 7 月 16 日至 2019 年 3 月 9 日任大成强化收益定期开放债券型证券投资基金基金经理。2018 年 7 月 16 日至 2019 年 3 月 2 日任大成景利混合型证券投资基金基金经</p>

				理。2018 年 7 月 16 日至 2020 年 3 月 11 日任大成景益平稳收益混合型证券投资基金基金经理。2018 年 7 月 16 日至 2019 年 9 月 29 日任大成景丰债券型证券投资基金 (LOF) 基金经理。2018 年 7 月 16 日至 2020 年 8 月 12 日任大成安汇金融债债券型证券投资基金 (转型前大成月月盈短期理财债券型证券投资基金)。2018 年 7 月 16 日起任大成可转债增强债券型证券投资基金、大成景盛一年定期开放债券型证券投资基金基金经理。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。2019 年 6 月 12 日起任大成景润灵活配置混合型证券投资基金基金经理。2019 年 9 月 26 日起任大成中债 1-3 年国开行债券指数证券投资基金基金经理。2019 年 11 月 25 日起任大成通嘉三年定期开放债券型证券投资基金基金经理。2019 年 12 月 9 日起任大成惠嘉一年定期开放债券型证券投资基金基金经理。2020 年 6 月 22 日起任大成惠兴一年定期开放债券型发起式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。

3、张俊杰先生自 2020 年 8 月 11 日起任本基金基金经理，李富强先生自 2020 年 8 月 12 日起不再担任本基金基金经理。上述事项已按法规要求及公司相关制度办理，变更流程合法合规。

#### 4.1.3 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理同时管理的产品情况

无。

#### 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；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 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

2020 年一季度受国内新冠肺炎病毒疫情影响，国内消费受到较为明显的冲击，随着年后制造业复工推迟，制造业供应链不畅通，工业企业生产也受到较大影响。中小企业受到的影响尤其严重，社会就业有较大压力。疫情在全球的快速扩散和不断恶化，也使得全球供应链条和外需增长速度承受较大的压力。二季度开始国内疫情基本受到控制，全国解禁人员流动，社会复工复产逐步开展。为应对疫情冲击，全球政府和央行都采取了宽松的财政政策和货币政策措施。一季度国内央行也加大流动性投放，降低政策利率，引导社会融资成本的下降。财政政策方面，也通过提高财政赤字率、发行特别国债、增加地方政府专项债券等措施托底经济增长，债券市场到期收益率大幅下行，股市宽幅震荡。二季度开始复产复工有序进行，4 月份以来各项经济数据呈现回暖迹象，工业增加值同比降幅持续收窄，银行间资金面开始边际收紧，疫情应对期间的阶段性金融支持政策开始逐步退出，从以疫情恐慌期间的货币政策退到基于疫情恐慌之后的基本面为基础的货币政策。随着疫情缓解、政策支持和基本面的逐步改善，二季度股市趋势上涨，债券到期收益率有所上行。

2020 上半年，本基金在在保障流动性及安全性的基础上，充分利用杠杆收益增强作用，抓住重要时点进行配置，并根据债券市场的波动合理地进行波段交易操作。

#### 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 1.0668%，同期业绩比较基准

收益率为 0.6713%，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 1.2188%，同期业绩比较基准收益率为 0.6713%，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 1.0528%，同期业绩比较基准收益率为 0.6713%。

#### 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 2020 年下半年，国内疫情影响逐步消退，经济增速逐步恢复，货币政策常态化且更加关注基本面的边际变化。国际疫情形势仍不容乐观，全球经济增长仍有较大压力。下半年国内经济仍将边际向好，但短期就业压力仍将较大，货币政策预计维持适度宽松，债券市场将宽幅震荡。

#### 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、数量与指数投资部、大类资产配置部、交易管理部、风险管理部、基金运营部、监察稽核部指定人员组成。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五名投资组合经理。

股票投资部、研究部、固定收益总部、数量与指数投资部、大类资产配置部、风险管理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；交易管理部负责关注相关投资品种的流动性状况，协助反馈其市场交易信息；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人员执行，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，投资组合经理作为估值小组成员，对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及中证指数有限公司签署服务协议，由中央国债登记结算有限责任公司按约定提供银行间同业市场的估值数据，由中证指数有限公司按约定提供交易所交易

的债券品种的估值数据和流通受限股票的折扣率数据。

#### 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 163,981,454.46 元，报告期内已分配利润 163,981,454.46 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、基金净值收益率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 托管人对本中期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：2020 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2020 年 6 月 30 日	上年度末 2019 年 12 月 31 日

<b>资产：</b>			
银行存款	6.4.3.1	1,250,749,584.03	6,879,166,531.22
结算备付金		146,920,555.56	17,142,857.14
存出保证金		10,107.83	-
交易性金融资产	6.4.3.2	5,623,996,671.96	8,499,447,160.67
其中：股票投资		-	-
基金投资		-	-
债券投资		5,623,996,671.96	8,499,447,160.67
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	6.4.3.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.3.4	1,408,966,193.45	1,499,303,328.95
应收证券清算款		-	-
应收利息	6.4.3.5	13,267,780.22	75,451,585.93
应收股利		-	-
应收申购款		10.00	433,870.30
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.3.6	-	-
资产总计		8,443,910,903.05	16,970,945,334.21
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2020年6月30日</b>	<b>上年度末 2019年12月31日</b>
<b>负 债：</b>			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.3.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	2,602,645,892.17
应付证券清算款		-	-
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		2,417,091.23	3,286,486.87
应付托管费		716,175.18	973,773.86
应付销售服务费		127,447.30	169,889.75
应付交易费用	6.4.3.7	161,908.89	98,818.21
应交税费		63,711.41	154,612.01
应付利息		-	404,515.02
应付利润		12,498,434.79	14,084,743.74
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.3.8	313,263.22	289,000.00
负债合计		16,298,032.02	2,622,107,731.63
<b>所有者权益：</b>			
实收基金	6.4.3.9	8,427,612,871.03	14,348,837,602.58
未分配利润	6.4.3.10	-	-
所有者权益合计		8,427,612,871.03	14,348,837,602.58
负债和所有者权益总计		8,443,910,903.05	16,970,945,334.21

注：报告截止日 2020 年 06 月 30 日，基金份额总额 8,427,612,871.03 份，其中大成月月盈短期理财债券 A 基金份额总额为 59,981,296.10 份，基金份额净值 1.0000 元。大成月月盈短期理财债券 B 基金份额总额为 8,285,379,281.27 份，基金份额净值 1.0000 元。大成月月盈短期理财债券 E 基金份额总额为 82,252,293.66 份，基金份额净值 1.0000 元。

## 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：2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日
一、收入		205,358,094.16	426,094,954.76
1. 利息收入		205,503,024.88	425,998,250.44
其中：存款利息收入	6.4.3.11	93,209,828.41	232,838,722.96
债券利息收入		91,859,507.63	190,463,565.63
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		20,433,688.84	2,695,961.85
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		-144,930.72	96,704.32
其中：股票投资收益	6.4.3.12	-	-
基金投资收益	-	-	-
债券投资收益	6.4.3.13	-144,930.72	96,704.32
资产支持证券投资收益		-	-
贵金属投资收益	6.4.3.14	-	-
衍生工具收益	6.4.3.15	-	-
股利收益	6.4.3.16	-	-
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.3.17	-	-
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.3.18	-	-
减：二、费用		41,376,639.70	85,476,005.92
1. 管理人报酬	6.4.6.2.1	18,547,463.88	29,802,349.94
2. 托管费	6.4.6.2.2	5,495,544.80	8,830,325.95
3. 销售服务费	6.4.6.2.3	947,499.52	1,501,521.84
4. 交易费用	6.4.3.19	-	-
5. 利息支出		16,086,936.45	45,028,727.26
其中：卖出回购金融资产支出		16,086,936.45	45,028,727.26



6. 税金及附加		49,107.43	112,556.87
7. 其他费用	6.4.3.20	250,087.62	200,524.06
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		163,981,454.46	340,618,948.84
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		163,981,454.46	340,618,948.84

### 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：2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 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）	14,348,837,602.58	-	14,348,837,602.58
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	163,981,454.46	163,981,454.46
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）	-5,921,224,731.55	-	-5,921,224,731.55
其中：1. 基金申购款	700,801,669.54	-	700,801,669.54
2. 基金赎回款	-6,622,026,401.09	-	-6,622,026,401.09
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）	-	-163,981,454.46	-163,981,454.46
五、期末所有者权益（基金净值）	8,427,612,871.03	-	8,427,612,871.03
项目	上年度可比期间 2019 年 1 月 1 日至 2019 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）	22,856,155,851.14	-	22,856,155,851.14
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	340,618,948.84	340,618,948.84
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）	-5,458,518,085.91	-	-5,458,518,085.91
其中：1. 基金申购款	567,585,927.10	-	567,585,927.10
2. 基金赎回款	-6,026,104,013.01	-	-6,026,104,013.01
四、本期向基金份额持有人分	-	-340,618,948.84	-340,618,948.84

配利润产生的基金净值变动 (净值减少以“-”号填列)			
五、期末所有者权益(基金净值)	17,397,637,765.23	-	17,397,637,765.23

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署：

谭晓冈

周立新

刘亚林

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[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》、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》、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》、财税[2017]56 号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90 号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1) 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。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。

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。资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务，以 2018 年 1 月 1 日起产生的利息及利息性质的收入为销售额。

(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。

(4) 本基金的城市维护建设税、教育费附加和地方教育费附加等税费按照实际缴纳增值税额

的适用比例计算缴纳。

### 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 2020年6月30日
活期存款	30,749,584.03
定期存款	-
其中：存款期限1个月以内	-
存款期限1-3个月	-
存款期限3个月以上	-
其他存款	1,220,000,000.00
合计	1,250,749,584.03

注：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 2020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	50,222,225.37	50,270,000.00	47,774.63	0.0006
	银行间市场	5,573,774,446.59	5,575,588,000.00	1,813,553.41	0.0215
	合计	5,623,996,671.96	5,625,858,000.00	1,861,328.04	0.0221
资产支持证券	-	-	-	-	
合计	5,623,996,671.96	5,625,858,000.00	1,861,328.04	0.0221	

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

无。

#### 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 2020年6月30日
----	-------------------

	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	-	-
银行间市场	1,408,966,193.45	-
合计	1,408,966,193.45	-

#### 6.4.3.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

无。

#### 6.4.3.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2020年6月30日
应收活期存款利息	14,850.74
应收定期存款利息	-
应收其他存款利息	1,996,389.25
应收结算备付金利息	66,114.30
应收债券利息	11,007,967.14
应收资产支持证券利息	-
应收买入返售证券利息	182,454.29
应收申购款利息	-
应收黄金合约拆借孳息	-
应收出借证券利息	-
其他	4.50
合计	13,267,780.22

#### 6.4.3.6 其他资产

无。

#### 6.4.3.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2020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	161,908.89
合计	161,908.89

#### 6.4.3.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2020年6月30日
----	-------------------

应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	-
应付证券出借违约金	-
预提费用	263,263.22
其他	50,000.00
合计	313,263.22

#### 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 2020年1月1日至2020年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	84,794,356.00	84,794,356.00
本期申购	9,158,384.33	9,158,384.33
本期赎回（以“-”号填列）	-33,971,444.23	-33,971,444.23
-基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算调整	-	-
本期申购	-	-
本期赎回（以“-”号填列）	-	-
本期末	59,981,296.10	59,981,296.10

##### 大成月月盈短期理财债券 B

项目	本期 2020年1月1日至2020年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	14,155,906,921.43	14,155,906,921.43
本期申购	655,386,791.72	655,386,791.72
本期赎回（以“-”号填列）	-6,525,914,431.88	-6,525,914,431.88
-基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算调整	-	-
本期申购	-	-
本期赎回（以“-”号填列）	-	-
本期末	8,285,379,281.27	8,285,379,281.27

##### 大成月月盈短期理财债券 E

项目	本期 2020年1月1日至2020年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	108,136,325.15	108,136,325.15
本期申购	36,256,493.49	36,256,493.49
本期赎回（以“-”号填列）	-62,140,524.98	-62,140,524.98
-基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算调整	-	-
本期申购	-	-

本期赎回（以“-”号填列）	-	-
本期末	82,252,293.66	82,252,293.66

注：申购含红利再投份额(如有)、转换入份额(如有)，A类、B类基金份额申购含级别调整入份额(如有)。赎回含转换出份额(如有)，A类、B类基金份额赎回含级别调整出份额(如有)。

#### 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	780,332.59	-	780,332.59
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	-780,332.59	-	-780,332.59
本期末	-	-	-
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	162,094,553.87	-	162,094,553.87
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	-162,094,553.87	-	-162,094,553.87
本期末	-	-	-
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	1,106,568.00	-	1,106,568.00
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	-1,106,568.00	-	-1,106,568.00
本期末	-	-	-

#### 6.4.3.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期
	2020年1月1日至2020年6月30日
活期存款利息收入	15,582,747.08

定期存款利息收入	7,674,999.82
其他存款利息收入	69,393,207.46
结算备付金利息收入	558,794.98
其他	79.07
合计	93,209,828.41

#### 6.4.3.12 股票投资收益

无。

#### 6.4.3.13 债券投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年6月30日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	12,475,206,436.79
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	12,412,876,601.79
减：应收利息总额	62,474,765.72
买卖债券差价收入	-144,930.72

#### 6.4.3.14 贵金属投资收益

无。

#### 6.4.3.15 衍生工具收益

无。

#### 6.4.3.16 股利收益

无。

#### 6.4.3.17 公允价值变动收益

无。

#### 6.4.3.18 其他收入

无。

#### 6.4.3.19 交易费用

无。

#### 6.4.3.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期
	2020年1月1日至2020年6月30日
审计费用	74,590.88
信息披露费	59,672.34
证券出借违约金	-
银行划款手续费	47,224.40
账户维护费	18,000.00
其他	50,600.00
合计	250,087.62

#### 6.4.3.21 分部报告

无。

#### 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

无。

##### 6.4.4.2 资产负债表日后事项

根据本基金的基金管理人于 2020 年 6 月 13 日发布的《大成基金管理有限公司关于大成月月盈短期理财债券型证券投资基金基金份额持有人大会表决结果暨决议生效的公告》及中国证监会证监许可[2020]418 号《关于准予大成月月盈短期理财债券型证券投资基金变更注册的批复》，本基金于 2020 年 8 月 4 日转型为大成安汇金融债债券型证券投资基金，《大成月月盈理财债券型证券投资基金基金合同》自 2020 年 8 月 4 日起失效，《大成安汇金融债债券型证券投资基金基金合同》于同一起生效。



## 6.4.5 关联方关系

### 6.4.5.1 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

本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

### 6.4.5.2 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、基金销售机构、注册登记机构
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

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

## 6.4.6 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

### 6.4.6.1 通过关联方交易单元进行的交易

#### 6.4.6.1.1 股票交易

无。

#### 6.4.6.1.2 债券交易

无。

#### 6.4.6.1.3 债券回购交易

无。

#### 6.4.6.1.4 权证交易

无。

#### 6.4.6.1.5 应支付关联方的佣金

无。

## 6.4.6.2 关联方报酬

### 6.4.6.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日	2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	18,547,463.88	29,802,349.94
其中：支付销售机构的客户维护费	70,865.38	96,145.45

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 × 0.27% / 当年天数。

### 6.4.6.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日	2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	5,495,544.80	8,830,325.95

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 × 0.08% / 当年天数。

### 6.4.6.2.3 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			
	2020 年 1 月 1 日至 2020 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	3,586.60	677,958.53	76,626.53	758,171.66
中国银行	15,763.03	-	74,473.53	90,236.56
合计	19,349.63	677,958.53	151,100.06	848,408.22
	上年度可比期间			

获得销售服务费的各关联方名称	2019 年 1 月 1 日至 2019 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	4,131.52	1,090,075.88	137,159.75	1,231,367.15
中国银行	18,422.76	-	38,470.51	56,893.27
合计	22,554.28	1,090,075.88	175,630.26	1,288,260.42

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 类基金份额、B 类基金份额和 E 类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：

$$\text{各类基金份额日销售服务费} = \text{前一日该类别基金资产净值} \times \text{约定年费率} / \text{当年天数}。$$

#### 6.4.6.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

无。

#### 6.4.6.4 各关联方投资本基金的情况

##### 6.4.6.4.1 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	本期	本期
	2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日	2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日	2020 年 1 月 1 日至 2020 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	-	-	-
报告期初持有的基金份额	-	95,978,432.69	-
报告期间申购/买入总份额	-	1,061,487.73	-
报告期间因拆分变动份额	-	-	-
减：报告期间赎回/卖出总份额	-	97,039,920.42	-
报告期末持有的基金份额	-	0.00	-
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	-	0.0000%	-

项目	上年度可比期间	上年度可比期间	上年度可比期间
	2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日	2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日	2019 年 1 月 1 日至 2019 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	-	-	-
报告期初持有的基金份额	-	93,214,321.00	-
报告期间申购/买入总份额	-	1,464,101.80	-
报告期间因拆分变动份额	-	-	-
减：报告期间赎回/卖出总份 额	-	-	-
报告期末持有的基金份额	-	94,678,422.80	-
报告期末持有的基金份额 占基金总份额比例	-	0.5442%	-

注：基金管理人大成基金投资本基金适用的交易费率与本基金法律文件规定一致。

#### 6.4.6.4.2 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

无。

#### 6.4.6.5 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	
	2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日		2019 年 1 月 1 日至 2019 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	30,749,584.03	15,582,747.08	376,457,192.84	2,279,198.42

注：本基金由基金托管人保管的银行存款，按银行约定利率计息。

#### 6.4.6.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

无。

#### 6.4.6.7 其他关联交易事项的说明

无。

## 6.4.7 利润分配情况

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
751,249.11	60,247.86	-31,164.38	780,332.59	-
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
155,386,791.72	8,243,944.23	-1,536,182.08	162,094,553.87	-
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
1,021,572.98	103,957.51	-18,962.49	1,106,568.00	-

## 6.4.8 期末(2020年6月30日)本基金持有的流通受限证券

## 6.4.8.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

无。

## 6.4.8.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

无。

## 6.4.8.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

无。

## 6.4.9 金融工具风险及管理

## 6.4.9.1 风险管理政策和组织架构

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的。本基金在日常经营活动中面临的与这些金融工具相关的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金的基金管理人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。

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(合规与风险管理委员会、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与风险管理委员会，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。

#### 6.4.9.2 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。本基金的活期银行存款存放在本基金的托管行中国银行，协议存款存放在具有基金托管资格的银行，因而与银行存款相关的信用风险不重大。本基金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；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。

本基金的基金管理人建立了信用风险管理流程，不投资于短期信用评级在 A-1 级以下或长期信用评级在 AAA 级以下的债券，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。

##### 6.4.9.2.1 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 2020 年 6 月 30 日	上年度末 2019 年 12 月 31 日
A-1	-	15,007,163.11
A-1 以下	-	-

未评级	1,469,887,152.28	1,381,119,012.91
合计	1,469,887,152.28	1,396,126,176.02

注：上述未评级债券为国债、政策性金融债和超短期融资券。

#### 6.4.9.2.2 按短期信用评级列示的同业存单投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2020年6月30日	上年度末 2019年12月31日
A-1	-	-
A-1 以下	-	-
未评级	4,093,852,986.73	6,350,093,384.85
合计	4,093,852,986.73	6,350,093,384.85

#### 6.4.9.2.3 按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2020年6月30日	上年度末 2019年12月31日
AAA	60,256,532.95	50,584,718.73
AAA 以下	-	-
未评级	-	702,642,881.07
合计	60,256,532.95	753,227,599.80

注：上述未评级债券为政策性金融债。

#### 6.4.9.3 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。

##### 6.4.9.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《货币市场基金监督管理办法》及《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》等有关法规的要求对本基金组合资产的流动性风险进行管理。本基金的基金管理人采用监控流动性受限资产比例、份额持有人集中度、调整平均剩余期限和平均剩余存续期、压力测试等方式防范流动性风险，并于开放日

对本基金的申购赎回情况进行监控，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配，确保本基金资产的变现能力与投资者赎回需求的匹配与平衡。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。于本期末，本基金持有的流动性受限资产的估值占基金资产净值的比例未超过 10%，本基金投资组合中现金、国债、中央银行票据、政策性金融债券以及 5 个交易日日内到期的其他金融工具占基金资产净值的比例合计不低于 30%，且本基金前 10 名份额持有人的持有份额合计占基金总份额的比例、投资组合的平均剩余期限及平均剩余存续期皆符合有关法规的要求。

本基金所持大部分证券为剩余期限较短、具有良好流动性的债券和货币市场工具，除在证券交易所的债券回购及返售交易，其余均在银行间同业市场交易，因此，除在“期末本基金持有的流通受限证券”中列示的部分基金资产流通暂时受限制外(如有)，均能够及时变现。本基金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，其上限一般不超过基金持有的债券资产的公允价值。除附注“期末债券正回购交易中作为抵押的债券”中列示的卖出回购金融资产款余额(如有)将在 1 个月内到期且计息外，本基金于资产负债表日所持有的金融负债的合同约定剩余到期日均为一年以内且一般不计息，可赎回基金份额净值无固定到期日且不计息，因此账面余额一般即为未折现的合约到期现金流量。

#### 6.4.9.4 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。

##### 6.4.9.4.1 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。



## 6.4.9.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2020 年 6 月 30 日	6 个月以内	6 个月-1 年	1-5 年	不计息	合计
资产					
银行存款	1,250,749,584.03	-	-	-	1,250,749,584.03
结算备付金	146,920,555.56	-	-	-	146,920,555.56
存出保证金	10,107.83	-	-	-	10,107.83
交易性金融资产	5,583,733,100.06	40,263,571.90	-	-	5,623,996,671.96
买入返售金融资产	1,408,966,193.45	-	-	-	1,408,966,193.45
应收利息	-	-	-	13,267,780.22	13,267,780.22
应收申购款	-	-	-	10.00	10.00
资产总计	8,390,379,540.93	40,263,571.90	-	13,267,790.22	8,443,910,903.05
负债					
应付管理人报酬	-	-	-	2,417,091.23	2,417,091.23
应付托管费	-	-	-	716,175.18	716,175.18
应付销售服务费	-	-	-	127,447.30	127,447.30
应付交易费用	-	-	-	161,908.89	161,908.89
应付利润	-	-	-	12,498,434.79	12,498,434.79
应交税费	-	-	-	63,711.41	63,711.41
其他负债	-	-	-	313,263.22	313,263.22
负债总计	-	-	-	16,298,032.02	16,298,032.02
利率敏感度缺口	8,390,379,540.93	40,263,571.90	-	-3,030,241.80	8,427,612,871.03
上年度末 2019 年 12 月 31 日	6 个月以内	6 个月-1 年	1-5 年	不计息	合计
资产					
银行存款	6,879,166,531.22	-	-	-	6,879,166,531.22
结算备付金	17,142,857.14	-	-	-	17,142,857.14
交易性金融资产	8,348,635,025.82	150,812,134.85	-	-	8,499,447,160.67
买入返售金融资产	1,499,303,328.95	-	-	-	1,499,303,328.95
应收利息	-	-	-	75,451,585.93	75,451,585.93
应收申购款	-	-	-	433,870.30	433,870.30
资产总计	16,744,247,743.13	150,812,134.85	-	75,885,456.23	16,970,945,334.21
负债					

应付管理人报酬	-	-	-	3,286,486.87	3,286,486.87
应付托管费	-	-	-	973,773.86	973,773.86
卖出回购金融资产款	2,602,645,892.17	-	-	-	2,602,645,892.17
应付销售服务费	-	-	-	169,889.75	169,889.75
应付交易费用	-	-	-	98,818.21	98,818.21
应付利息	-	-	-	404,515.02	404,515.02
应付利润	-	-	-	14,084,743.74	14,084,743.74
应交税费	-	-	-	154,612.01	154,612.01
其他负债	-	-	-	289,000.00	289,000.00
负债总计	2,602,645,892.17	-	-	19,461,839.46	2,622,107,731.63
利率敏感度缺口	14,141,601,850.96	150,812,134.85	-	56,423,616.77	14,348,837,602.58

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者予以分类。

#### 6.4.9.4.1.2 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		
	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（2020年6月30日）	上年度末（2019年12月31日）
分析	市场利率上升 25 个基点	-1,309,900.00	-6,020,000.00
	市场利率下降 25 个基点	1,310,800.00	6,030,000.00

#### 6.4.9.4.2 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。

#### 6.4.9.4.3 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。

## 6.4.9.4.4 采用风险价值法管理风险

无。

## 6.4.10 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	5,623,996,671.96	66.60
	其中：债券	5,623,996,671.96	66.60
	资产支持证 券	-	-
2	买入返售金融资产	1,408,966,193.45	16.69
	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	1,397,670,139.59	16.55
4	其他各项资产	13,277,898.05	0.16
5	合计	8,443,910,903.05	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	12.97	
	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	-	-
	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	31
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	100
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

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的比例 (%)	各期限负债占基金资产净值的比例 (%)
1	30 天以内	47.04	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
2	30 天（含）—60 天	46.70	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
3	60 天（含）—90 天	1.54	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
4	90 天（含）—120 天	3.92	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
5	120 天（含）—397 天（含）	0.83	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
	合计	100.03	-

#### 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

无。

#### 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	359,567,272.75	4.27
2	央行票据	-	-
3	金融债券	40,263,571.90	0.48
	其中：政策性金融债	40,263,571.90	0.48
4	企业债券	50,222,225.37	0.60
5	企业短期融资券	1,070,056,307.63	12.70

6	中期票据	10,034,307.58	0.12
7	同业存单	4,093,852,986.73	48.58
8	其他	-	-
9	合计	5,623,996,671.96	66.73
10	剩余存续期超过 397 天的 浮动利率债券	-	-

### 7.6 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

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	111903094	19 农业银行 CD094	6,700,000	668,763,187.97	7.94
2	111910324	19 兴业银行 CD324	3,600,000	359,372,447.06	4.26
3	111903086	19 农业银行 CD086	3,300,000	329,723,130.39	3.91
4	111917053	19 光大银行 CD053	3,000,000	299,604,586.76	3.56
5	111909257	19 浦发银行 CD257	3,000,000	299,478,707.62	3.55
6	111909242	19 浦发银行 CD242	2,500,000	249,672,987.13	2.96
7	111909239	19 浦发银行 CD239	2,300,000	229,712,169.04	2.73
8	209920	20 贴现国债 20	2,100,000	209,790,773.66	2.49
9	011903101	19 鄂交投 SCP007	2,000,000	199,966,092.77	2.37
10	111906207	19 交通银行 CD207	2,000,000	199,644,638.47	2.37

### 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	0
报告期内偏离度的最高值	0.1142%
报告期内偏离度的最低值	0.0098%
报告期内每个交易日偏离度的绝对值的简单平均值	0.0626%

#### 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。

### 7.8 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

无。

## 7.9 投资组合报告附注

### 7.9.1 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。

### 7.9.2 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 19 交通银行 CD207 (111906207. IB) 的发行主体交通银行股份有限公司于 2019 年 12 月 27 日因授信审批不审慎等,受到中国银行保险监督管理委员会处罚(银保监罚决字(2019)24 号),于 2020 年 4 月 20 日因监管标准化数据(EAST)系统数据质量及数据报送存在违法违规行为,受到中国银行保险监督管理委员会处罚(银保监罚决字(2020)6 号)。本基金认为,对交通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 19 农业银行 CD094 (111903094. IB) 的发行主体中国农业银行股份有限公司于 2020 年 3 月 9 日因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(银保监罚决字(2020)3 号),于 2020 年 4 月 22 日因“两会一层”境外机构管理履职不到位等,受到中国银行保险监督管理委员会处罚(银保监罚决字(2020)11 号),因监管标准化数据(EAST)系统数据质量及数据报送存在违法违规行为,受到中国银行保险监督管理委员会处罚(银保监罚决字(2020)12 号)。本基金认为,对农业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 19 农业银行 CD086 (111903086. IB) 的发行主体中国农业银行股份有限公司于 2020 年 3 月 9 日因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(银保监罚决字(2020)3 号),于 2020 年 4 月 22 日因“两会一层”境外机构管理履职不到位等,受到中国银行保险监督管理委员会处罚(银保监罚决字(2020)11 号),因监管标准化数据(EAST)系统数据质量及数据报送存在违法违规行为,受到中国银行保险监督管理委员会处罚(银保监罚决字(2020)12 号)。本基金认为,对农业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 19 光大银行 CD053 (111917053. IB) 的发行主体中国光大银行股份有限公司于 2019 年 12 月 27 日因授信审批不审慎等,受到中国银行保险监督管理委员会处罚(银保监罚决字(2019)23 号),于 2020 年 2 月 10 日因未按规定履行客户身份识别义务等,受到中国人民银行处罚(银罚字(2020)14 号),于 2020 年 4 月 20 日因监管标准化数据(EAST)系统数据质量及数据报送存在违法违规行为,受到中国银行保险监督管理委员会处罚(银保监罚

决字〔2020〕5号)。本基金认为,对光大银行的处罚不会对其投资价值构成实质性负面影响。

### 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	10,107.83
2	应收证券清算款	-
3	应收利息	13,267,780.22
4	应收申购款	10.00
5	其他应收款	-
6	待摊费用	-
7	其他	-
8	合计	13,277,898.05

### 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	5,310	11,295.91	46,699.09	0.08	59,934,597.01	99.92
大成月月盈短期理财债券B	13	637,336,867.79	8,285,379,281.27	100.00	-	-
大成月月盈短期理财债券E	10,289	7,994.20	-	-	82,252,293.66	100.00
合计	15,612	539,816.35	8,285,425,980.36	98.31	142,186,890.67	1.69

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	273,463.49	0.4559
	大成月月盈短期理财债券 B	0.00	0.0000
	大成月月盈短期理财债券 E	10,737.37	0.0131
	合计	284,200.86	0.0034

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	0~10
	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

项目	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	84,794,356.00	14,155,906,921.43	108,136,325.15
本报告期基金总申购份额	9,158,384.33	655,386,791.72	36,256,493.49
减：本报告期基金总赎回份额	33,971,444.23	6,525,914,431.88	62,140,524.98
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	59,981,296.10	8,285,379,281.27	82,252,293.66

## § 10 重大事件揭示

### 10.1 基金份额持有人大会决议

大成月月盈短期理财债券型证券投资基金基金份额持有人大会于 2020 年 5 月 19 日至 2020



年 6 月 11 日以通讯方式召开，本次基金份额持有人大会于 2020 年 6 月 12 日决议通过了《关于大成月月盈短期理财债券型证券投资基金转型相关事项的议案》，正式实施日为 2020 年 8 月 4 日，具体详见 2020 年 6 月 13 日公告。

## 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

无。

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

无。

## 10.4 基金投资策略的改变

本基金投资策略在本报告期内未发生重大改变。

## 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

本报告期内，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	-	-	-	-	-
渤海证券	1	-	-	-	-	-
财富证券	1	-	-	-	-	-
长城证券	1	-	-	-	-	-
长江证券	2	-	-	-	-	-

东方证券	1	-	-	-	-	-
东海证券	1	-	-	-	-	-
东吴证券	1	-	-	-	-	-
东兴证券	1	-	-	-	-	-
东莞证券	1	-	-	-	-	-
方正证券	1	-	-	-	-	-
光大证券	2	-	-	-	-	-
广发证券	1	-	-	-	-	-
广州证券	1	-	-	-	-	-
国都证券	1	-	-	-	-	-
国海证券	1	-	-	-	-	-
国泰君安	1	-	-	-	-	-
国信证券	1	-	-	-	-	-
海通证券	2	-	-	-	-	-
恒泰证券	1	-	-	-	-	-
华宝证券	1	-	-	-	-	-
华福证券	1	-	-	-	-	-
华林证券	1	-	-	-	-	-
华泰证券	2	-	-	-	-	-
华西证券	1	-	-	-	-	-
华鑫证券	1	-	-	-	-	-
江海证券	1	-	-	-	-	-
民生证券	1	-	-	-	-	-
平安证券	1	-	-	-	-	-
申万宏源	1	-	-	-	-	-
太平洋证券	1	-	-	-	-	-
万联证券	1	-	-	-	-	-
西南证券	1	-	-	-	-	-
湘财证券	1	-	-	-	-	-

英大证券	1	-	-	-	-	-
招商证券	3	-	-	-	-	-
中国银河证 券	1	-	-	-	-	-
中国中投证 券	2	-	-	-	-	-
中金公司	2	-	-	-	-	-
中泰证券	1	-	-	-	-	-
中信建投证 券	1	-	-	-	-	-
中信证券	2	-	-	-	-	-

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：招商证券。本报告期内退租交易单元：九州证券。

### 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

				比例		的比例
长江证券	-	-	78,965,500,000.00	100.00%	-	-

### 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	关于大成月月盈短期理财债券型证券投资基金恢复申购及基金转换转入业务的公告	证券时报、中国证监会基金电子披露网站及本公司网站	2020年6月24日
2	大成基金管理有限公司关于大成月月盈短期理财债券型证券投资基金基金份额持有人大会表决结果暨决议生效的公告	证券时报、中国证监会基金电子披露网站及本公司网站	2020年6月16日
3	《大成基金管理有限公司关于大成月月盈短期理财债券型证券投资基金基金份额持有人大会表决结果暨决议生效的公告》的更正公告	证券时报、中国证监会基金电子披露网站及本公司网站	2020年6月16日
4	大成基金管理有限公司关于大成月月盈短期理财债券型证券投资基金基金份额持有人大会表决结果暨决议生效的公告（2020年8月4日起合同生效）	证券时报、中国证监会基金电子披露网站及本公司网站	2020年6月13日
5	关于大成月月盈短期理财债券型证券投资基金暂停申购及基金转换转入业务公告	证券时报、中国证监会基金电子披露网站及本公司网站	2020年6月4日
6	大成基金管理有限公司关于以通讯方式召开大成月月盈短期理财债券型证券投资基金基金份额持有人大会的第二次提示性公告	证券时报、中国证监会基金电子披露网站及本公司网站	2020年5月15日
7	大成基金管理有限公司关于以通讯方式召开大成月月盈短期理财债券型证券投资基金基金份额持有人大会的第一次提示性公告	证券时报、中国证监会基金电子披露网站及本公司网站	2020年5月14日
8	大成基金管理有限公司关于以通讯方式召开大成月月盈短期理财债券型证券投资基金基金份额持有人大会的公告	证券时报、中国证监会基金电子披露网站及本公司网站	2020年5月13日
9	大成月月盈短期理财债券型证券投资基金 2019 年年度报告	证券时报、中国证监会基金电子披露网站及本公司网站	2020年4月29日
10	大成基金管理有限公司关于终止泰诚财富基金销售（大连）有限公司办理相关销售业务的公告	证券时报、中国证监会基金电子披露网站及本公司网站	2020年4月25日
11	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及基金转	证券时报、中国证监会基金电子披露网站及	2020年4月23日

	换转入业务公告	本公司网站	
12	大成月月盈短期理财债券型证券投资基金 2020 年第 1 季度报告	证券时报、中国证监会基金电子披露网站及本公司网站	2020 年 4 月 22 日
13	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及基金转换转入业务公告	证券时报、中国证监会基金电子披露网站及本公司网站	2020 年 3 月 31 日
14	大成基金管理有限公司关于延迟披露旗下公募基金 2019 年年度报告的公告	证券时报、中国证监会基金电子披露网站及本公司网站	2020 年 3 月 25 日
15	大成基金管理有限公司关于注销南京分公司的公告	证券时报、中国证监会基金电子披露网站及本公司网站	2020 年 3 月 21 日
16	大成基金管理有限公司关于注销青岛分公司的公告	证券时报、中国证监会基金电子披露网站及本公司网站	2020 年 2 月 29 日
17	大成基金管理有限公司关于 APP 交易平台汇款交易费率优惠的公告	证券时报、中国证监会基金电子披露网站及本公司网站	2020 年 2 月 26 日
18	大成基金管理有限公司关于 2020 年春节假期延长期间调整公司公募基金开放时间等相关事宜的公告	证券时报、中国证监会基金电子披露网站及本公司网站	2020 年 1 月 30 日
19	大成月月盈短期理财债券型证券投资基金 2019 年第 4 季度报告	证券时报、中国证监会基金电子披露网站及本公司网站	2020 年 1 月 17 日
20	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及基金转换转入业务公告	证券时报、中国证监会基金电子披露网站及本公司网站	2020 年 1 月 17 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	20200529-20200630	2,646,215.145.89	30,197,582.22	-	2,676,412,728.11	31.76
	2	20200101-20200630	4,193,514.008.06	45,123,149.88	2,035,979,078.19	2,202,658,079.75	26.14

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、中国证监会批准设立大成月月盈短期理财债券型证券投资基金的文件；
- 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的住所。

### 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

2020 年 8 月 28 日