

大成月添利理财债券型证券投资基金 2020 年年度报告

2020 年 12 月 31 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

送出日期：2021 年 3 月 30 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。

基金托管人中国农业银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2021 年 03 月 29 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。

根据中国证监会关于规范理财债券基金业务的要求以及中国证监会 2020 年 3 月 20 日颁布的《关于修改部分证券期货规章的决定》的规定，经与中国农业银行股份有限公司协商一致，大成基金管理有限公司对旗下大成月添利理财债券型证券投资基金的《大成月添利理财债券型证券投资基金基金合同》（以下简称“《基金合同》”）相关条款进行了修改，并已报监管机构备案。本次《基金合同》修改涉及本基金资产配置比例、投资限制、申购和赎回价格、基金资产估值、收益分配、升降级业务、信息披露等内容。本次《基金合同》修改系根据相关法律法规、监管机构要求而开展，并已履行规定程序及相应信息披露义务，符合相关法律法规及《基金合同》的规定。

修改后的《基金合同》自 2020 年 6 月 30 日起生效。主要调整内容如下：自 2020 年 6 月 30 日起，本基金债券的估值方法不再采用“摊余成本法”，而是按照“市值法”计量基金资产净值。相应的，净值披露方式等内容同步调整。自 2020 年 6 月 30 日起，本基金的投资组合资产配置比例部分及投资组合限制部分增加“本基金投资于债券资产的比例不低于基金资产的 80%；本基金应当保持不低于基金资产净值的 5%的现金或到期日在一年以内的政府债券，其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。”的规定，本基金将按照《基金合同》的要求进行投资组合的调整。

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。

本报告财务资料已经审计。普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）为本基金出具了无保留意见的审计报告，请投资者注意阅读。

转型前大成月添利理财债券型证券投资基金本报告期自 2020 年 1 月 1 日起至 6 月 29 日止，转型后大成月添利理财债券型证券投资基金本报告期自 2020 年 6 月 30 日起至 12 月 31 日止。

1.2 目录

§1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
§2 基金简介	6
2.1 基金基本情况（转型后）	6
2.1 基金基本情况（转型前）	6
2.2 基金产品说明（转型后）	6
2.2 基金产品说明（转型前）	7
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(转型后)	7
2.5 其他相关资料(转型前)	8
§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况	8
3.1 主要会计数据和财务指标(转型后)	8
3.1 主要会计数据和财务指标(转型前)	9
3.2 基金净值表现（转型后）	11
3.2 基金净值表现（转型前）	15
3.3 过去三年基金的利润分配情况（转型后）	20
3.4 过去三年基金的利润分配情况（转型前）	20
§4 管理人报告	21
4.1 基金管理人及基金经理情况	21
4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明.....	23
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	24
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.....	25
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	25
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况.....	25
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	26
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	27
4.9 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.....	27
§5 托管人报告	27
5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明.....	27
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.....	28
5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见.....	28
§6 审计报告（转型后）	28
§6 审计报告（转型前）	30
§7 年度财务报表（转型后）	32

7.1 资产负债表	32
7.2 利润表	33
7.3 所有者权益（基金净值）变动表	34
7.4 报表附注	35
§7 年度财务报表（转型前）	55
7.1 资产负债表	55
7.2 利润表	57
7.3 所有者权益（基金净值）变动表	58
7.4 报表附注	59
§8 投资组合报告（转型后）	82
8.1 期末基金资产组合情况	82
8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	82
8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细	83
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动	83
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	83
8.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细	83
8.7 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	84
8.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细	84
8.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细	84
8.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	84
8.11 投资组合报告附注	84
§8 投资组合报告（转型前）	85
8.1 期末基金资产组合情况	85
8.2 债券回购融资情况	85
8.3 基金投资组合平均剩余期限	86
8.4 报告期内投资组合平均剩余存续期超过 240 天情况说明	86
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	86
8.6 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	87
8.7 “影子定价”与“摊余成本法”确定的基金资产净值的偏离	87
8.8 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	87
8.9 投资组合报告附注	87
§9 基金份额持有人信息（转型后）	88
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	88
9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	89
9.3 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	89
9.4 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理本人及其直系亲属持有本人管理的产品情况	89
§9 基金份额持有人信息（转型前）	89
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	89
9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	90
9.3 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	90
9.4 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理本人及其直系亲属持有本人管理的产品情况	91

§10 开放式基金份额变动（转型后）	91
§10 开放式基金份额变动（转型前）	91
§11 重大事件揭示	92
11.1 基金份额持有人大会决议	92
11.2 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.....	92
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	92
11.4 基金投资策略的改变	93
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	93
11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况.....	93
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况(转型后).....	93
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况(转型前).....	96
11.8 偏离度绝对值超过 0.5%的情况（转型前）	98
11.9 其他重大事件（转型后）	98
11.9 其他重大事件（转型前）	99
§12 影响投资者决策的其他重要信息	101
12.1 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	101
12.2 影响投资者决策的其他重要信息	101
§13 备查文件目录	101
13.1 备查文件目录	101
13.2 存放地点	102
13.3 查阅方式	102

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况（转型后）

基金名称	大成月添利理财债券型证券投资基金		
基金简称	大成月添利理财债券		
基金主代码	090021		
基金运作方式	契约型开放式		
基金合同生效日	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	中国农业银行股份有限公司		
报告期末基金份额总额	45,067,331.23 份		
基金合同存续期	不定期		
下属分级基金的基金简称	大成月添利债券 A	大成月添利债券 B	大成月添利债券 E
下属分级基金的交易代码	090021	091021	001497
报告期末下属分级基金的份额总额	37,838,679.55 份	7,228,516.26 份	135.42 份

2.1 基金基本情况（转型前）

基金名称	大成月添利理财债券型证券投资基金		
基金简称	大成月添利理财债券		
基金主代码	090021		
基金运作方式	契约型开放式		
基金合同生效日	2012 年 9 月 20 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		
报告期末基金份额总额	1,930,965,090.91 份		
基金合同存续期	不定期		
下属分级基金的基金简称	大成月添利债券 A	大成月添利债券 B	大成月添利债券 E
下属分级基金的交易代码	090021	091021	001497
报告期末下属分级基金的份额总额	59,413,258.98 份	1,867,242,164.81 份	4,309,667.12 份

2.2 基金产品说明（转型后）

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	本基金为债券型基金，为证券投资基金中的较低风险品种。本基金的风险和预期收益低于股票型基金、混合型基金，高于货币市场基金。

2.2 基金产品说明（转型前）

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	本基金为债券型基金，为证券投资基金中的较低风险品种。本基金的风险和预期收益低于股票型基金、混合型基金，高于货币市场基金。

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	中国农业银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	赵冰	秦一楠
	联系电话	0755-83183388	010-66060069
	电子邮箱	office@dcfund.com.cn	tgxxpl@abchina.com
客户服务电话		4008885558	95599
传真		0755-83199588	010-68121816
注册地址		深圳市福田区深南大道 7088 号招商银行大厦 32 层	北京市东城区建国门内大街 69 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 28 号凯晨世贸中心东座 F9
邮政编码		518040	100031
法定代表人		吴庆斌	周慕冰

注：中国农业银行股份有限公司法定代表人已于 2021 年 2 月 9 日变更为谷澍。

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《中国证券报》
登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	www.dcfund.com.cn
基金年度报告备置地点	基金管理人及基金托管人住所

2.5 其他相关资料(转型后)

项目	名称	办公地址
会计师事务所	普华永道中天会计师事务所 (特殊普通合伙)	上海市黄浦区湖滨路 202 号领展企业广场 2 座 11 楼

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
--------	------------	------------------------------

2.5 其他相关资料(转型前)

项目	名称	办公地址
会计师事务所	普华永道中天会计师事务所 (特殊普通合伙)	上海市黄浦区湖滨路 202 号领展企业广场 2 座 11 楼
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、基金净值表现及利润分配情况

3.1 主要会计数据和财务指标(转型后)

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	2020 年 6 月 30 日(基金合同生效日)-2020 年 12 月 31 日		
	大成月添利债券 A	大成月添利债券 B	大成月添利债券 E
本期已实现收益	281,264.31	1,122,126.03	876.28
本期利润	330,339.61	1,126,570.54	876.47
加权平均基金份额本期利润	0.0071	0.0079	0.0069
本期加权平均净值利润率	0.71%	0.79%	0.69%
本期基金份额净值增长率	0.74%	0.88%	3.17%
3.1.2 期末数据和指标	2020 年末		
期末可供分配利润	229,196.59	53,888.40	4.09
期末可供分配基金份额利润	0.0061	0.0075	0.0302
期末基金资产净值	38,118,338.15	7,292,057.79	139.71
期末基金份额净值	1.0074	1.0088	1.0317
3.1.3 累计期末指	2020 年末		

标			
基金份额 累计净值 增长率	0.74%	0.88%	3.17%

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。

2. 期末可供分配利润，采用期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数（为期末余额，不是当期发生数）。

3. 所述基金业绩指标不包括持有人交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

3.1 主要会计数据和财务指标(转型前)

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29日)			2019年			2018年		
	大成月 添利债 券 A	大成月添 利债券 B	大成月 添利债 券 E	大成月 添利债 券 A	大成月添 利债券 B	大成月 添利债 券 E	大成月 添利债 券 A	大成月添 利债券 B	大成月 添利债 券 E
本期已实现收益	726,216.74	107,396,608.60	77,276.07	2,836,409.98	369,812,757.80	356,968.68	5,606,158.78	416,174,402.64	1,048,274.52
本期利润	726,216.74	107,396,608.60	77,276.07	2,836,409.98	369,812,757.80	356,968.68	5,606,158.78	416,174,402.64	1,048,274.52
本期净	1.0472%	1.1921%	1.0469%	2.6641%	2.9624%	2.6641%	3.9948%	4.2953%	3.9942%

值 收 益 率									
3. 1. 2 期 末 数 据 和 指 标	2020 年 6 月 29 日			2019 年末			2018 年末		
期 末 基 金 资 产 净 值	59,413,258.98	1,867,242,164.81	4,309,667.12	76,843,858.79	9,787,245,819.06	7,994,160.02	189,854,088.69	14,053,448,932.74	20,265,811.14
期 末 基 金 份 额 净 值	1.0000	1.0000	1.0000	1.0000	1.0000	1.0000	1.0000	1.0000	1.0000
3. 1. 3 累 计 期 末 指 标	2020 年 6 月 29 日			2019 年末			2018 年末		
累 计 净 值 收 益	33.9476%	36.9855%	17.2527%	32.6627%	35.4890%	16.1283%	29.2203%	31.5910%	13.1150%

率									
---	--	--	--	--	--	--	--	--	--

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，由于本基金转型前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. 根据我公司 2015 年 6 月 12 日《关于大成月添利理财债券型证券投资基金增设基金份额类别及修订基金合同和托管协议的公告》，自 2015 年 6 月 16 日起，大成月添利理财债券型证券投资基金增设 E 类份额。本报告关于 E 类份额的指标计算起始日为 E 类份额的初始申购确认日。

3.2 基金净值表现（转型后）

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

大成月添利债券 A

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差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	0.48%	0.01%	0.34%	0.00%	0.14%	0.01%
过去六个月	0.74%	0.01%	0.68%	0.00%	0.06%	0.01%
自基金合同生效起至今	0.74%	0.01%	0.68%	0.00%	0.06%	0.01%

大成月添利债券 B

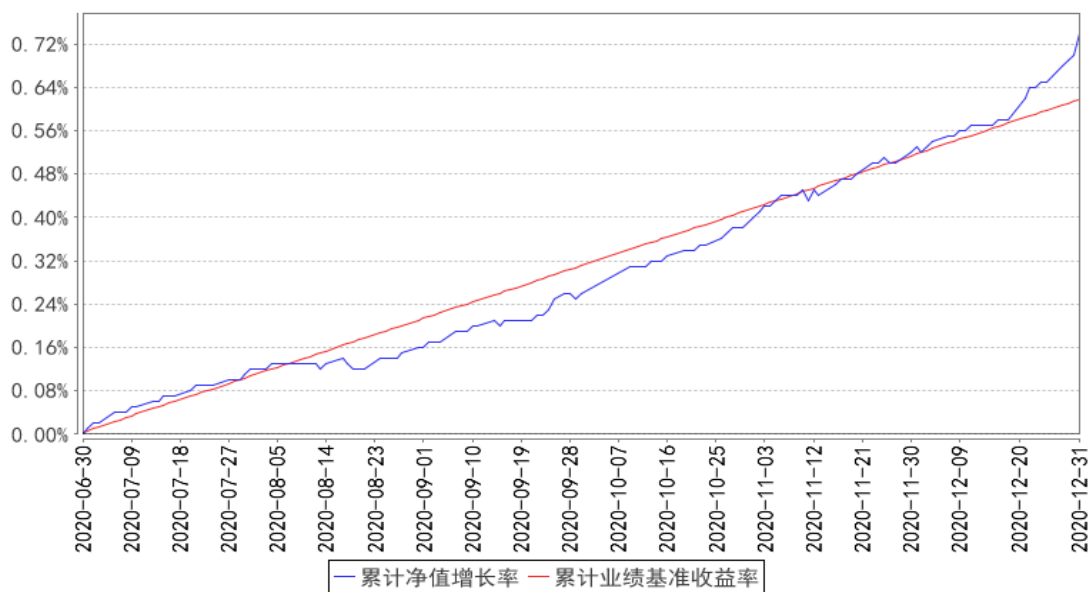
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	0.55%	0.01%	0.34%	0.00%	0.21%	0.01%
过去六个月	0.87%	0.01%	0.68%	0.00%	0.19%	0.01%
自基金合同生效起至今	0.88%	0.01%	0.68%	0.00%	0.20%	0.01%

大成月添利债券 E

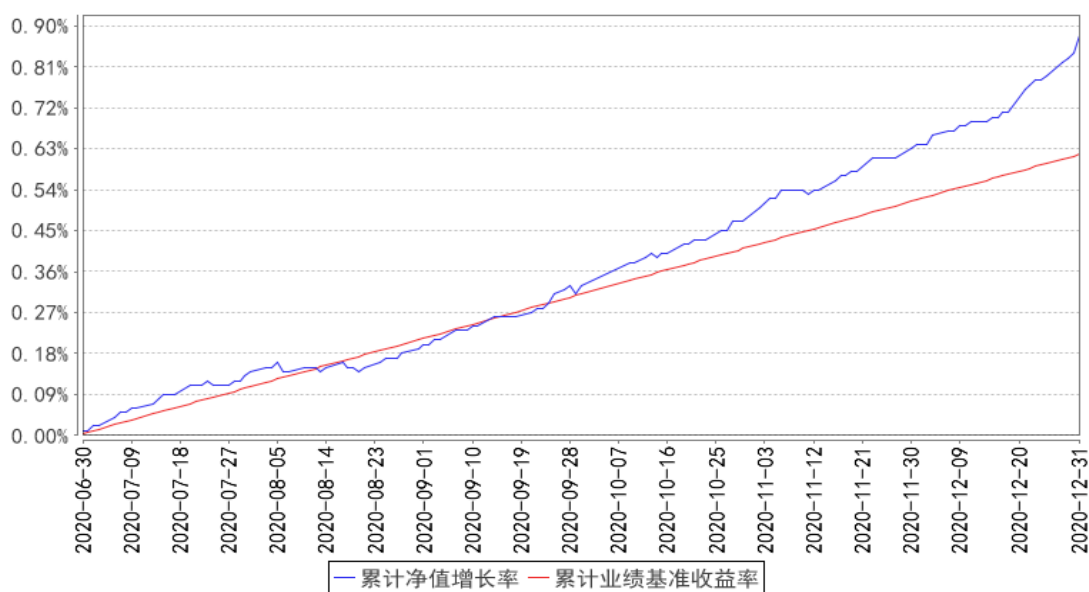
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	0.55%	0.01%	0.34%	0.00%	0.21%	0.01%
过去六个月	3.17%	0.19%	0.68%	0.00%	2.49%	0.19%
自基金合同生效起至今	3.17%	0.18%	0.68%	0.00%	2.49%	0.18%

3.2.2 自基金转型以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

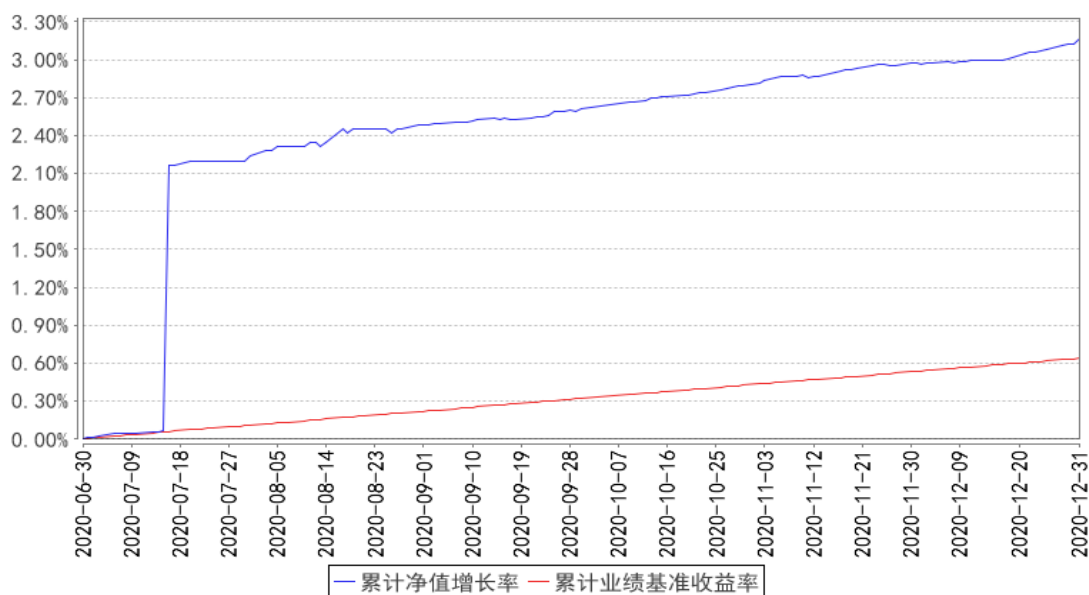
大成月添利债券A累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



大成月添利债券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



大成月添利债券E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

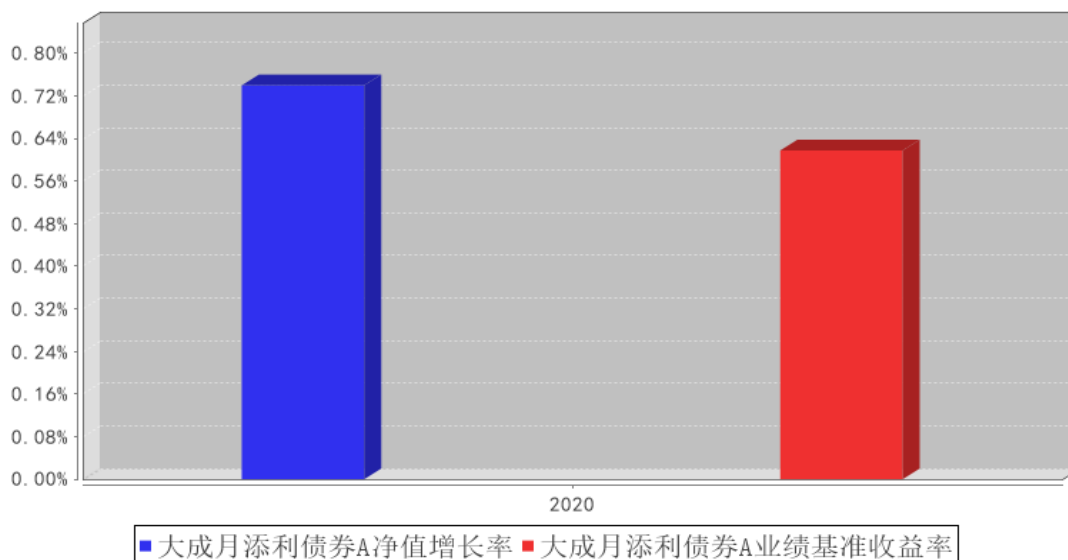


注：1、本基金修订后的基金合同生效日为 2020 年 6 月 30 日，截至报告期末本基金合同生效未满一年。

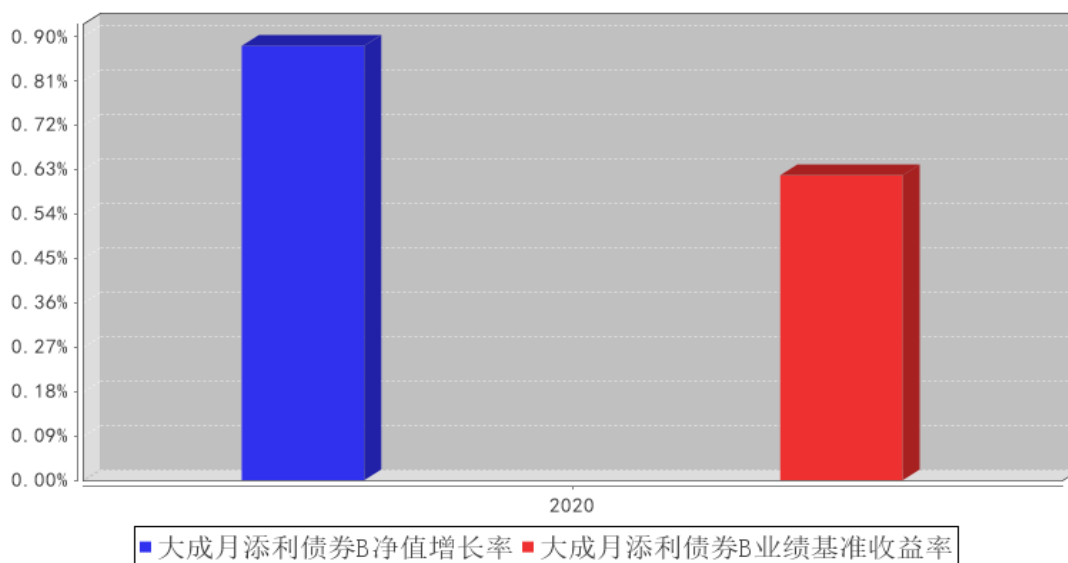
2、按基金合同规定，大成月添利理财债券型证券投资基金应自基金合同生效（暨基金转型）日 2020 年 6 月 30 日起六个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的约定。建仓期结束时，本基金的投资组合比例符合基金合同的约定。

3.2.3 自基金转型以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

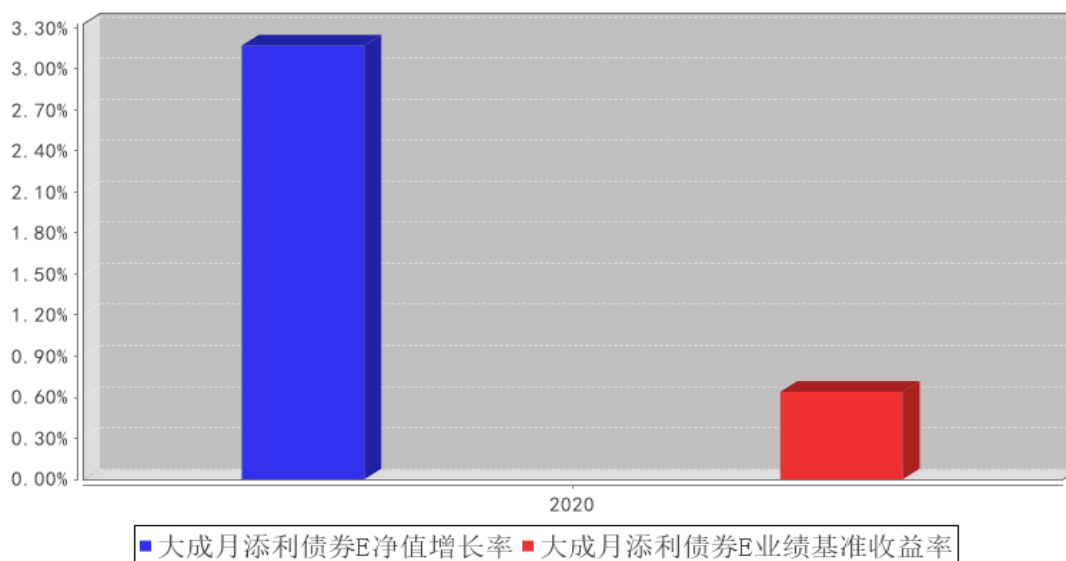
大成月添利债券A基金每年净值增长率与同期业绩比较基准收益率的对比图



大成月添利债券B基金每年净值增长率与同期业绩比较基准收益率的对比图



大成月添利债券E基金每年净值增长率与同期业绩比较基准收益率的对比图



注：合同生效当年按实际存续期计算，不按整个自然年度进行折算。

3.2 基金净值表现（转型前）

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

大成月添利债券 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
过去三个月	0.4290%	0.0007%	0.3320%	0.0000%	0.0970%	0.0007%
过去六个月	1.0472%	0.0012%	0.6676%	0.0000%	0.3796%	0.0012%
过去一年	2.2179%	0.0010%	1.3445%	0.0000%	0.8734%	0.0010%
过去三年	10.0660%	0.0025%	4.0482%	0.0000%	6.0178%	0.0025%
过去五年	17.0855%	0.0038%	6.7482%	0.0000%	10.3373%	0.0038%
自基金合同生效起至今	33.9476%	0.0088%	10.4986%	0.0000%	23.4490%	0.0088%

大成月添利债券 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
过去三个月	0.5007%	0.0007%	0.3320%	0.0000%	0.1687%	0.0007%
过去六个月	1.1921%	0.0012%	0.6676%	0.0000%	0.5245%	0.0012%
过去一年	2.5052%	0.0010%	1.3445%	0.0000%	1.1607%	0.0010%
过去三年	11.0156%	0.0025%	4.0482%	0.0000%	6.9674%	0.0025%
过去五年	18.7824%	0.0038%	6.7482%	0.0000%	12.0342%	0.0038%
自基金合同生效起至今	36.9855%	0.0088%	10.4986%	0.0000%	26.4869%	0.0088%

大成月添利债券 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
过去三个月	0.4287%	0.0007%	0.3320%	0.0000%	0.0967%	0.0007%
过去六个月	1.0469%	0.0012%	0.6676%	0.0000%	0.3793%	0.0012%
过去一年	2.2174%	0.0010%	1.3445%	0.0000%	0.8729%	0.0010%
过去三年	10.0656%	0.0025%	4.0482%	0.0000%	6.0174%	0.0025%

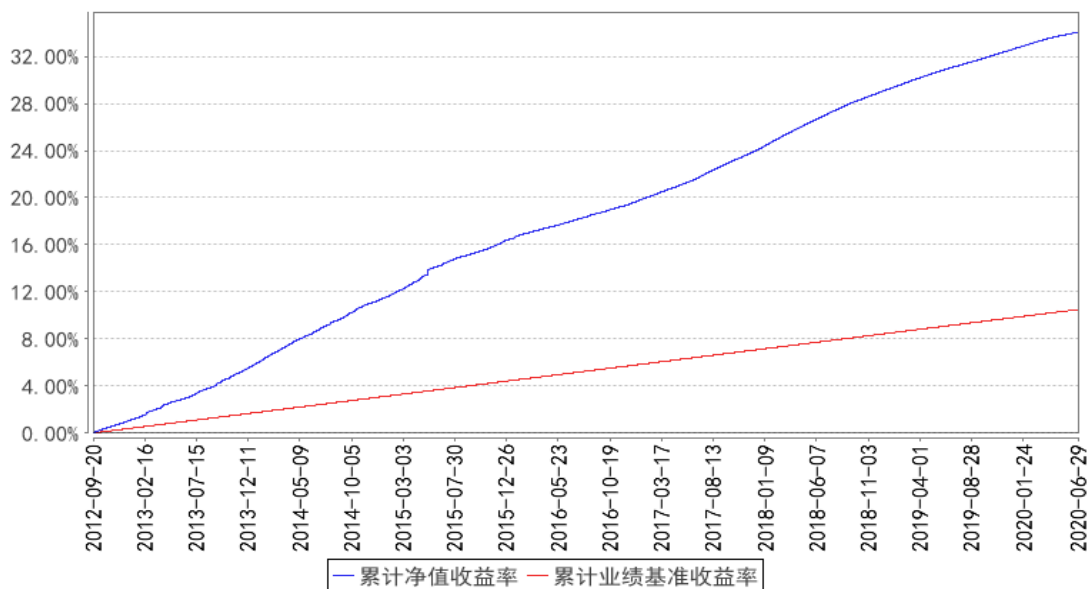
过去五年	17.0846 %	0.0038%	6.7482%	0.0000%	10.336 4%	0.0038 %
自基金合同生效起 至今	17.2527 %	0.0039%	6.7926%	0.0000%	10.460 1%	0.0039 %

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。

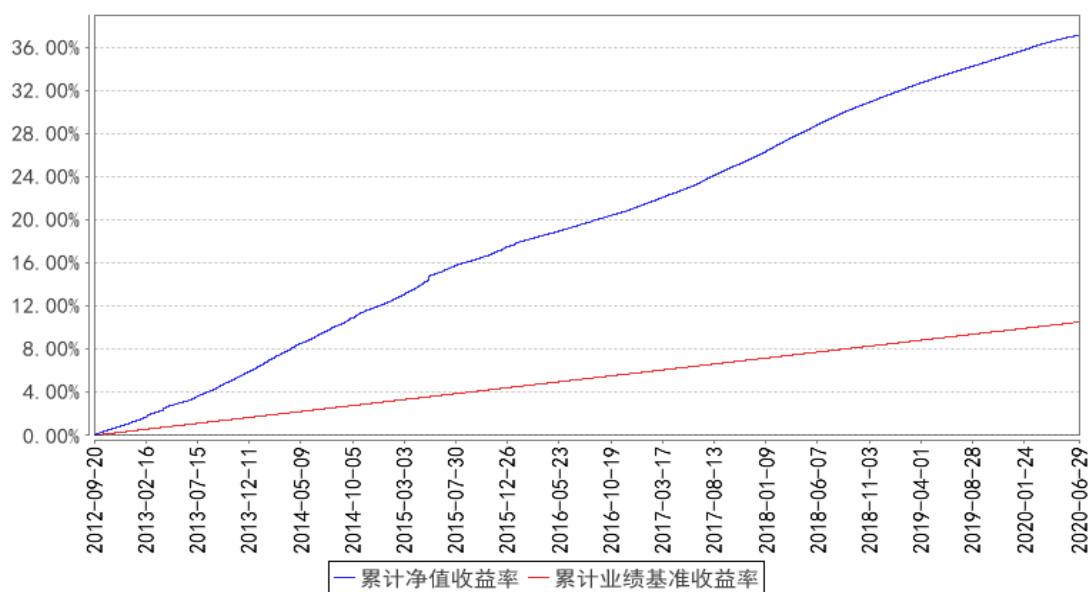
2、本表净值收益率的计算所采取的运作周期，是以修订前的基金合同生效日（2012年9月20日）为起始日并持有至报告期末（2020年6月29日）的基金份额所经历的运作周期。

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

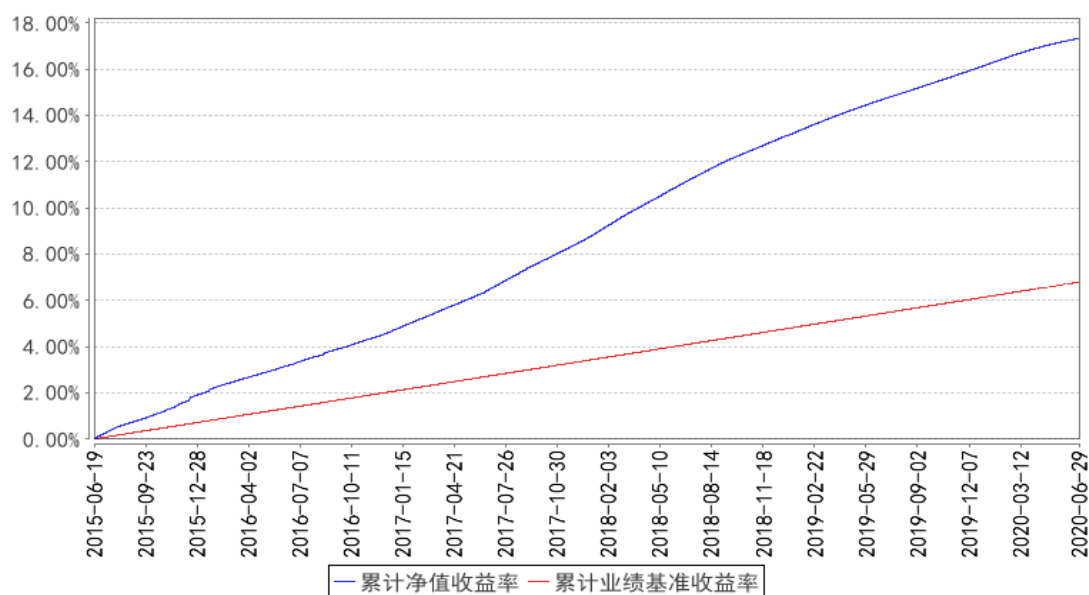
大成月添利债券A累计净值收益率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



大成月添利债券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



大成月添利债券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

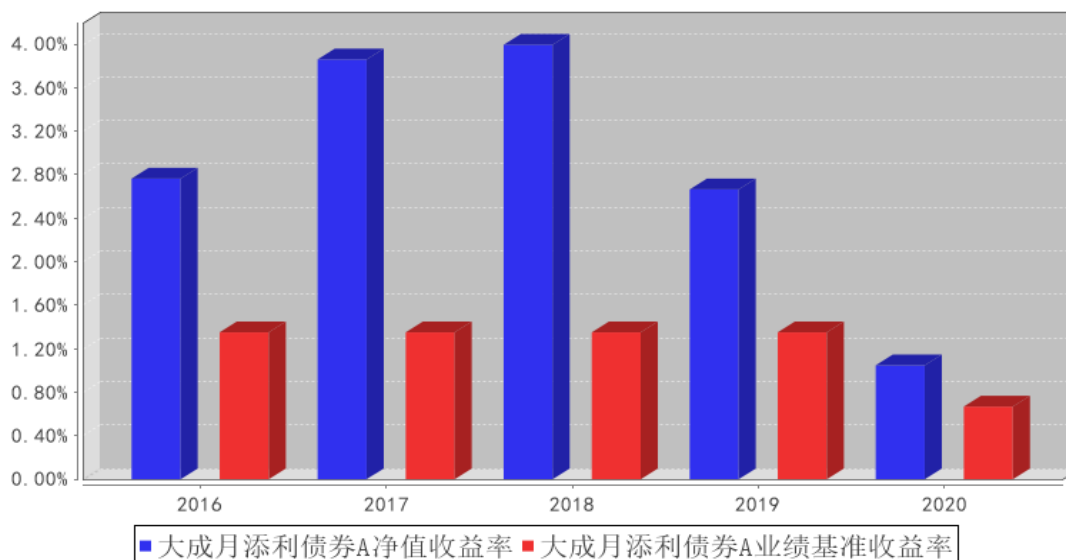


注：1、本基金于 2015 年 6 月 16 日起增加 E 类份额。

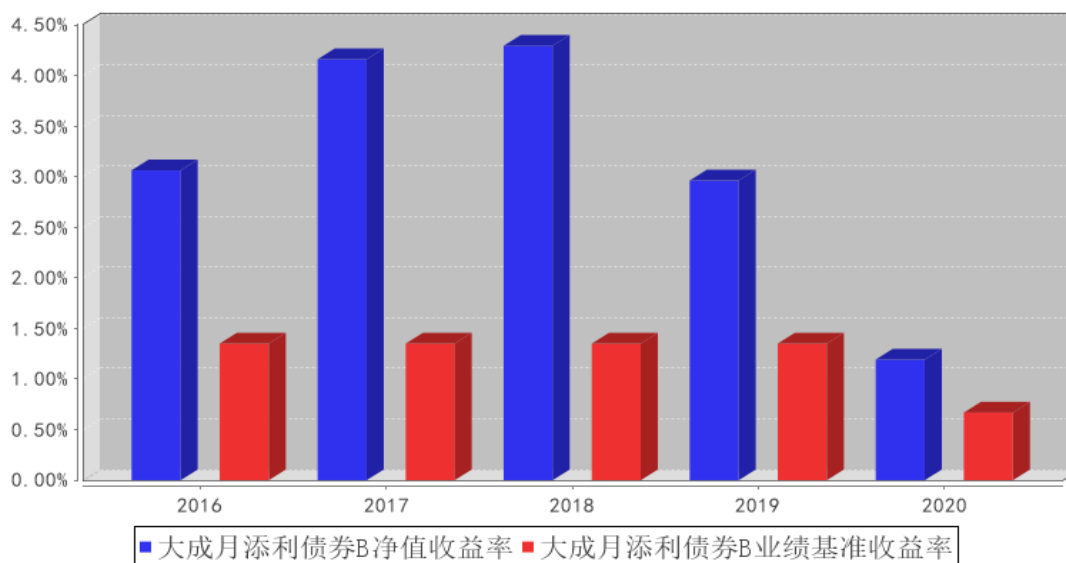
2、本基金合同规定，基金管理人应当自基金合同生效之日起六个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的约定。建仓期结束时，本基金的投资组合比例符合基金合同的约定。

3.2.3 过去五年基金每年净值收益率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

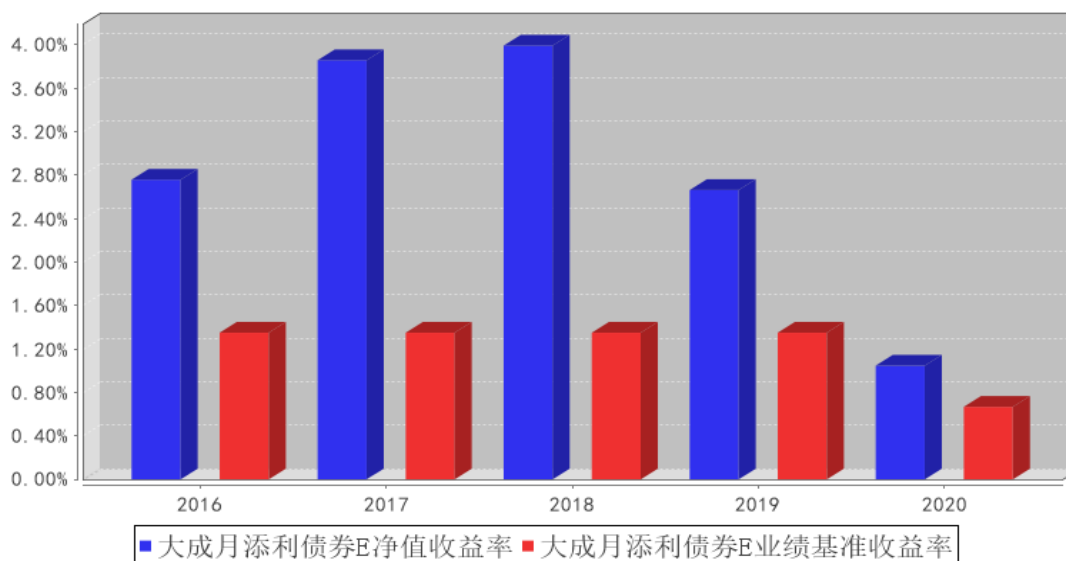
大成月添利债券A基金每年净值收益率与同期业绩比较基准收益率的对比图



大成月添利债券B基金每年净值收益率与同期业绩比较基准收益率的对比图



大成月添利债券E基金每年净值收益率与同期业绩比较基准收益率的对比图



3.3 过去三年基金的利润分配情况（转型后）

无。

3.4 过去三年基金的利润分配情况（转型前）

单位：人民币元

大成月添利债券 A

年度	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	年度利润 分配合计	备注
2020 年	712,126.55	46,089.41	-31,999.22	726,216.74	-
2019 年	2,604,428.35	430,648.90	-198,667.27	2,836,409.98	-
2018 年	4,423,195.03	1,078,121.68	104,842.07	5,606,158.78	-
合计	7,739,749.93	1,554,859.99	-125,824.42	9,168,785.50	-

大成月添利债券 B

年度	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	年度利润 分配合计	备注
2020 年	101,112,769.36	15,134,457.94	-8,850,618.70	107,396,608.60	-
2019 年	366,742,268.22	15,869,296.76	-12,798,807.18	369,812,757.80	-
2018 年	379,139,712.09	17,989,841.11	19,044,849.44	416,174,402.64	-
合计	846,994,749.67	48,993,595.81	-2,604,576.44	893,383,769.04	-

大成月添利债券 E

年度	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	年度利润 分配合计	备注
2020 年	69,226.63	10,640.85	-2,591.41	77,276.07	-

2019 年	313,217.84	62,969.95	-19,219.11	356,968.68	-
2018 年	722,502.12	335,162.30	-9,389.90	1,048,274.52	-
合计	1,104,946.59	408,773.10	-31,200.42	1,482,519.27	-

§ 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%)。公司业务资质齐全，是全国同时具有境内、境外社保基金管理人资格和基本养老保险基金管理人资格的四家基金公司之一，全面涵盖公募基金、机构投资、海外投资、财富管理、养老金管理、私募股权投资等业务，旗下大成国际资产管理公司具备 QFII、RQFII 以及 QFLP 等资格。

历经 21 年的发展，大成基金形成了以长期投资能力为核心竞争优势，打造了一支具有良好职业素养和丰富经验的资产管理队伍。目前已形成权益、固定收益、量化投资、商品期货、境外投资、大类资产配置等六大投资团队，全面覆盖各类投资领域。截至 2020 年 12 月 31 日，公司管理公募基金产品数量共 115 只。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介（转型后）

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	2017 年 3 月 22 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
--	--	--	--	--	---

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。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介（转型前）

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	2017 年 3 月 22 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
--	--	--	--	--	---

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。

4.1.3 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（转型后）

无。

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（转型前）

无。

4.1.4 基金经理薪酬机制（转型后）

无。

4.1.4 基金经理薪酬机制（转型前）

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 公平交易制度和控制方法

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，通过各部门的协作互控，保证了公平交易的可操作、可稽核和可持续。

4.3.2 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。

4.3.2.1 增加执行的基金经理公平交易制度执行情况及公平交易管理情况

无。

4.3.3 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 7 笔同日反向交易，原因为流动性需要或合规比例调整。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 5 笔同日反向交易，原因为流动性需要或合规比例调整。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 年伊始，突如其来的新型冠状病毒疫情给全球经济带来巨大冲击，各国央行纷纷配以宽松的货币政策，货币市场收益率大幅下行。随着疫情的有效控制和国民经济的逐步恢复，货币市场又迎来一轮快速调整。伴随一级市场供给增加及缴税延期等因素，资金价格走高。进入四季度由于社融的扩张以及监管等因素，一级市场同业存单发行利率一度上行明显，央行两次超量续作 MLF，同时，为平抑信用债违约和跨年时点的影响，央行加大了逆回购投放力度，使货币市场资产价格在宽松环境下显著下行。纵观全年，隔夜回购利率均值约为 1.66%，较去年下降 58BP，7 天回购加权利率均值约为 2.23%，较去年下降 44BP，14 天回购加权利率均值约为 2.42%，较去年下降 44BP。1 年期金融债收益率上行约 11bp，1 年 AAA 短期融资券上行约 1bp，1 年 AA+ 短融品种上行约 22bp。

本组合在全年关注期限利差和获取资本利得的机会，适时利用久期空间，以获取良好稳定的收益。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

转型后：截至本报告期末大成月添利债券 A 的基金份额净值为 1.0074 元，本报告期基金份额净值增长率为 0.74%；截至本报告期末大成月添利债券 B 的基金份额净值为 1.0088 元，本报告期基金份额净值增长率为 0.88%；截至本报告期末大成月添利债券 E 的基金份额净值为 1.0317 元，本报告期基金份额净值增长率为 3.17%。同期业绩比较基准收益率为 0.68%。

转型前：本报告期大成月添利债券 A 的基金份额净值收益率为 1.0472%，本报告期大成月添利债券 B 的基金份额净值收益率为 1.1921%，本报告期大成月添利债券 E 的基金份额净值收益率为 1.0469%，同期业绩比较基准收益率为 0.6676%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

工业生产边际走弱，加上疫情的反复，经济数据同比高企的预期得到修正，但基本面对债市的影响有所弱化，更关注资金面的变化。

4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

本报告期内，依据相关的法律法规、基金合同以及内部监察稽核制度，本基金管理人对本基金运作、内部管理、制度执行及遵规守法情况进行了监察稽核。内部监察稽核的重点是：国家法律法规及行业监管规则的执行情况；基金合同的遵守情况；内部规章制度的执行情况；资讯管制和保密工作落实情况；员工职业操守规范情况，目的是规范基金财产的运作，防范和控制投资风

险，确保经营业务的稳健运行和受托资产的安全完整，维护本基金份额持有人的合法权益。

（一）根据最新的法律法规、规章、规范性文件，本基金管理人及时制定了相应的公司制度，并对现有制度进行不断修订和完善，确保本基金管理人内控制度的适时性、全面性和合法合规性。同时，为保障制度的适时性，避免部分内控制度、业务规则与业务发展不相适应，报告期内本基金管理人组织各部门对内部管理制度作了进一步梳理和完善。

（二）全面加强风险监控，不断提高基金业务风险管理水平。为督促各部门完善并落实各项内控措施，公司严格执行风险控制管理员制度，健全内控工作协调机制及监督机制，并进一步加强投资风险数量化评价能力及事前风险防范能力，有效防范相关业务风险。同时，公司严格执行投资报备制度，建立了基金从业人员证券投资管理监控信息系统，将投资报备工作纳入常态。

（三）日常监察和专项监察相结合，确保监察稽核的有效性和深入性。本年度，公司继续对本基金销售、宣传等方面的材料、协议及其他法律资料等进行了严格审查，对本基金各项投资比例、投资权限、基金交易、股票投资限制、股票库维护等方面进行实时监控，同时，还专门针对基金投资交易（包括公平交易、转债投资、投资权限、投资比例、流动性风险、基金重仓股等）、基金运营（基金头寸、基金结算、登记清算等）、网上交易、基金销售等进行专项监察。通过日常监察，保证了公司监察的全面性、实时性，通过专项监察，及时发现并纠正了业务中的潜在风险，加强了业务部门和人员的风险意识，从而较好地预防了风险的发生。

（四）加强了对投资管理人员通讯工具在交易时间的集中管理，定期或不定期对投资管理人员的网络即时通讯记录、电话录音等进行抽查，有效的防范了各种形式的利益输送行为。

（五）以多种方式加强合规教育与培训，提高全公司的合规守法意识。及时向全公司传达与基金相关的法律法规，并要求公司各部门贯彻到日常工作中。公司监察稽核部通过解答各业务部门提出的法律问题，提供法律依据，对于较为重大疑难法律事项及时咨询公司外部律师或监管部门，避免了业务发展中的盲目性，及时防范风险，维护了基金份额持有人的利益。

4.7 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。

4.8 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。

转型后：本报告期内本基金无收益分配事项。

转型前：根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 108,200,101.41 元，报告期内已分配利润 108,200,101.41 元。

4.9 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

在托管本基金的过程中，本基金托管人中国农业银行股份有限公司严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》相关法律法规的规定以及基金合同、托管协议的约定，对本基金基金管理人——大成基金管理有限公司 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日基金的投资运作，进行了认真、独

立的会计核算和必要的投资监督，认真履行了托管人的义务，没有从事任何损害基金份额持有人利益的行为。

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

本托管人认为，大成基金管理有限公司在本基金的投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支及利润分配等问题上，不存在损害基金份额持有人利益的行为；在报告期内，严格遵守了《中华人民共和国证券投资基金法》等有关法律法规，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人认为，大成基金管理有限公司的信息披露事务符合《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》及其他相关法律法规的规定，基金管理人所编制和披露的本基金年度报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告等信息真实、准确、完整，未发现有关损害基金持有人利益的行为。

§ 6 审计报告（转型后）

审计报告标题	审计报告
审计报告收件人	大成月添利理财债券型证券投资基金全体基金份额持有人
审计意见	<p>(一)我们审计的内容</p> <p>我们审计了大成月添利理财债券型证券投资基金(以下简称“大成月添利理财债券基金”)的财务报表,包括2020年12月31日的资产负债表,2020年6月30日(修订后的基金合同生效日)至2020年12月31日止期间的利润表和所有者权益(基金净值)变动表以及财务报表附注。</p> <p>(二)我们的意见</p> <p>我们认为,后附的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则和在财务报表附注中所列示的中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制,公允反映了大成月添利理财债券基金2020年12月31日的财务状况以及2020年6月30日(修订后的基金合同生效日)至2020年12月31日止期间的经营成果和基金净值变动情况。</p>
形成审计意见的基础	我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。审计报告的“注册会计师对财务报表审计的责任”部分进一步阐述了我们在这些准则下的责任。我们相信,我们获取的

	<p>审计证据是充分、适当的，为发表审计意见提供了基础。</p> <p>按照中国注册会计师职业道德守则，我们独立于大成月添利理财债券基金，并履行了职业道德方面的其他责任。</p>
<p>管理层和治理层对财务报表的责任</p>	<p>大成月添利理财债券基金的基金管理人大成基金管理有限公司(以下简称“基金管理人”)管理层负责按照企业会计准则和中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制财务报表，使其实现公允反映，并设计、执行和维护必要的内部控制，以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。</p> <p>在编制财务报表时，基金管理人管理层负责评估大成月添利理财债券基金的持续经营能力，披露与持续经营相关的事项(如适用)，并运用持续经营假设，除非基金管理人管理层计划清算大成月添利理财债券基金、终止运营或别无其他现实的选择。</p> <p>基金管理人治理层负责监督大成月添利理财债券基金的财务报告过程。</p>
<p>注册会计师对财务报表审计的责任</p>	<p>我们的目标是对财务报表整体是否不存在由于舞弊或错误导致的重大错报获取合理保证，并出具包含审计意见的审计报告。合理保证是高水平的保证，但并不能保证按照审计准则执行的审计在某一重大错报存在时总能发现。错报可能由于舞弊或错误导致，如果合理预期错报单独或汇总起来可能影响财务报表使用者依据财务报表作出的经济决策，则通常认为错报是重大的。</p> <p>在按照审计准则执行审计工作的过程中，我们运用职业判断，并保持职业怀疑。同时，我们也执行以下工作：</p> <p>(一) 识别和评估由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险；设计和实施审计程序以应对这些风险，并获取充分、适当的审计证据，作为发表审计意见的基础。由于舞弊可能涉及串通、伪造、故意遗漏、虚假陈述或凌驾于内部控制之上，未能发现由于舞弊导致的重大错报的风险高于未能发现由于错误导致的重大错报的风险。</p> <p>(二) 了解与审计相关的内部控制，以设计恰当的审计程序，但目的并非对内部控制的有效性发表意见。</p> <p>(三) 评价基金管理人管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计及相关披露的合理性。</p> <p>(四) 对基金管理人管理层使用持续经营假设的恰当性得出结论。同时，根据获取的审计证据，就可能对大成月添利理财债券基金持续经营能力产生重大疑虑的事项或情况是否存在重大不确定性得出结论。如果我们得出结论认为存在重大不确定性，审计准则要求我们在审计报告中提请报表使用者注意财务报表中的相关披露；如果披露不充分，我们应当发表非无保留意见。我们的结论基于截至审计报告日可获得的信息。然而，未来的事项或情况可能导致大成月添利理财债券基金不能持续经营。</p> <p>(五) 评价财务报表的总体列报(包括披露)、结构和内容，</p>

	并评价财务报表是否公允反映相关交易和事项。 我们与基金管理人治理层就计划的审计范围、时间安排和重大审计发现等事项进行沟通，包括沟通我们在审计中识别出的值得关注的内部控制缺陷。	
会计师事务所的名称	普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)	
注册会计师的姓名	张振波	陈薇瑶
会计师事务所的地址	上海市黄浦区湖滨路 202 号领展企业广场 2 座 11 楼	
审计报告日期	2021 年 3 月 29 日	

§ 6 审计报告（转型前）

审计报告标题	审计报告
审计报告收件人	大成月添利理财债券型证券投资基金全体基金份额持有人
审计意见	<p>(一) 我们审计的内容</p> <p>我们审计了大成月添利理财债券型证券投资基金(以下简称“大成月添利理财债券基金”)的财务报表,包括 2020 年 6 月 29 日(原基金合同失效前日)的资产负债表,2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 29 日(原基金合同失效前日)止期间的利润表和所有者权益(基金净值)变动表以及财务报表附注。</p> <p>(二) 我们的意见</p> <p>我们认为,后附的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则和在财务报表附注中所列示的中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制,公允反映了大成月添利理财债券基金 2020 年 6 月 29 日(原基金合同失效前日)的财务状况以及 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 29 日(原基金合同失效前日)止期间的经营成果和基金净值变动情况。</p>
形成审计意见的基础	<p>我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。审计报告的“注册会计师对财务报表审计的责任”部分进一步阐述了我们在这些准则下的责任。我们相信,我们获取的审计证据是充分、适当的,为发表审计意见提供了基础。</p> <p>按照中国注册会计师职业道德守则,我们独立于大成月添利理财债券基金,并履行了职业道德方面的其他责任。</p>
管理层和治理层对财务报表的责任	<p>大成月添利理财债券基金的基金管理人大成基金管理有限公司(以下简称“基金管理人”)管理层负责按照企业会计准则和中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制财务报表,使其实现公允反映,并设计、执行和维护必要的内部控制,以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。</p> <p>在编制财务报表时,基金管理人管理层负责评估大成月添利理财债券基金的持续经营能力,披露与持续经营相关的事项(如适用),并运用持续经营假设,除非基金管理人管理层计</p>

	<p>划清算大成月添利理财债券基金、终止运营或别无其他现实的选择。</p> <p>基金管理人治理层负责监督大成月添利理财债券基金的财务报告过程。</p>
注册会计师对财务报表审计的责任	<p>我们的目标是对财务报表整体是否不存在由于舞弊或错误导致的重大错报获取合理保证，并出具包含审计意见的审计报告。合理保证是高水平的保证，但并不能保证按照审计准则执行的审计在某一重大错报存在时总能发现。错报可能由于舞弊或错误导致，如果合理预期错报单独或汇总起来可能影响财务报表使用者依据财务报表作出的经济决策，则通常认为错报是重大的。</p> <p>在按照审计准则执行审计工作的过程中，我们运用职业判断，并保持职业怀疑。同时，我们也执行以下工作：</p> <p>(一) 识别和评估由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险；设计和实施审计程序以应对这些风险，并获取充分、适当的审计证据，作为发表审计意见的基础。由于舞弊可能涉及串通、伪造、故意遗漏、虚假陈述或凌驾于内部控制之上，未能发现由于舞弊导致的重大错报的风险高于未能发现由于错误导致的重大错报的风险。</p> <p>(二) 了解与审计相关的内部控制，以设计恰当的审计程序，但目的并非对内部控制的有效性发表意见。</p> <p>(三) 评价基金管理人管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计及相关披露的合理性。</p> <p>(四) 对基金管理人管理层使用持续经营假设的恰当性得出结论。同时，根据获取的审计证据，就可能导致对大成月添利理财债券基金持续经营能力产生重大疑虑的事项或情况是否存在重大不确定性得出结论。如果我们得出结论认为存在重大不确定性，审计准则要求我们在审计报告中提请报表使用者注意财务报表中的相关披露；如果披露不充分，我们应当发表非无保留意见。我们的结论基于截至审计报告日可获得的信息。然而，未来的事项或情况可能导致大成月添利理财债券基金不能持续经营。</p> <p>(五) 评价财务报表的总体列报(包括披露)、结构和内容，并评价财务报表是否公允反映相关交易和事项。</p> <p>我们与基金管理人治理层就计划的审计范围、时间安排和重大审计发现等事项进行沟通，包括沟通我们在审计中识别出的值得关注的内部控制缺陷。</p>
会计师事务所的名称	普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)
注册会计师的姓名	张振波 陈薇瑶
会计师事务所的地址	上海市黄浦区湖滨路 202 号领展企业广场 2 座 11 楼
审计报告日期	2021 年 3 月 29 日

§ 7 年度财务报表（转型后）

7.1 资产负债表

会计主体：大成月添利理财债券型证券投资基金

报告截止日：2020 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2020 年 12 月 31 日
资产：		
银行存款	7.4.7.1	21,473.64
结算备付金		104,761.90
存出保证金		-
交易性金融资产	7.4.7.2	39,780,000.00
其中：股票投资		-
基金投资		-
债券投资		39,780,000.00
资产支持证券投资		-
贵金属投资		-
衍生金融资产	7.4.7.3	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	5,700,122.85
应收证券清算款		-
应收利息	7.4.7.5	56,409.93
应收股利		-
应收申购款		-
递延所得税资产		-
其他资产	7.4.7.6	-
资产总计		45,662,768.32
负债和所有者权益	附注号	本期末 2020 年 12 月 31 日
负债：		
短期借款		-
交易性金融负债		-
衍生金融负债	7.4.7.3	-
卖出回购金融资产款		-
应付证券清算款		-
应付赎回款		-
应付管理人报酬		11,356.29
应付托管费		3,364.83
应付销售服务费		10,195.69
应付交易费用	7.4.7.7	7,976.86
应交税费		-
应付利息		-

应付利润		-
递延所得税负债		-
其他负债	7.4.7.8	219,339.00
负债合计		252,232.67
所有者权益：		
实收基金	7.4.7.9	45,067,331.23
未分配利润	7.4.7.10	343,204.42
所有者权益合计		45,410,535.65
负债和所有者权益总计		45,662,768.32

注：1. 报告截止日 2020 年 12 月 31 日，大成月添利理财债券型证券投资基金 A 类基金份额净值 1.0074 元，大成月添利理财债券型证券投资基金 B 类基金份额净值 1.0088 元，大成月添利理财债券型证券投资基金 E 类基金份额净值 1.0317 元，大成月添利理财债券型证券投资基金基金份额总额 45,067,331.23 份，其中 A 类基金份额 37,838,679.55 份，B 类基金份额 7,228,516.26 份，E 类基金份额 135.42 份。

2. 本财务报表的实际编制期间为 2020 年 6 月 30 日(基金合同生效日)至 2020 年 12 月 31 日止期间。

7.2 利润表

会计主体：大成月添利理财债券型证券投资基金

本报告期：2020 年 6 月 30 日（基金合同生效日）至 2020 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2020 年 6 月 30 日（基金合同 生效日）至 2020 年 12 月 31 日
一、收入		2,013,051.16
1. 利息收入		2,273,127.73
其中：存款利息收入	7.4.7.11	673,246.55
债券利息收入		831,943.62
资产支持证券利息收入		-
买入返售金融资产收入		767,937.56
证券出借利息收入		-
其他利息收入		-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		-313,596.57
其中：股票投资收益	7.4.7.12	-
基金投资收益		-
债券投资收益	7.4.7.13	-313,596.57
资产支持证券投资收益		-
贵金属投资收益	7.4.7.14	-
衍生工具收益	7.4.7.15	-

股利收益	7.4.7.16	-
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.17	53,520.00
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.18	-
减：二、费用		555,264.54
1. 管理人报酬	7.4.10.2.1	241,120.53
2. 托管费	7.4.10.2.2	71,443.12
3. 销售服务费	7.4.10.2.3	77,517.43
4. 交易费用	7.4.7.19	3,100.00
5. 利息支出		50,632.22
其中：卖出回购金融资产支出		50,632.22
6. 税金及附加		570.71
7. 其他费用	7.4.7.20	110,880.53
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		1,457,786.62
减：所得税费用		-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		1,457,786.62

7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：大成月添利理财债券型证券投资基金

本报告期：2020年6月30日（基金合同生效日）至2020年12月31日

单位：人民币元

项目	本期 2020年6月30日（基金合同生效日）至2020年12月31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）	1,930,965,090.91	-	1,930,965,090.91
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	1,457,786.62	1,457,786.62
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）	-1,885,897,759.68	-1,114,582.20	-1,887,012,341.88
其中：1. 基金申购款	1,919,585.89	9.26	1,919,595.15
2. 基金赎回款	-1,887,817,345.57	-1,114,591.46	-1,888,931,937.03
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）			
五、期末所有者权益（基金净值）	45,067,331.23	343,204.42	45,410,535.65

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.4 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

7.4 报表附注

7.4.1 基金基本情况

大成月添利理财债券型证券投资基金(以下简称“本基金”)经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2012]第 1155 号《关于核准大成月添利理财债券型证券投资基金募集的批复》核准,由大成基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《大成月添利理财债券型证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式,存续期限不定。本基金的基金管理人为大成基金管理有限公司,基金托管人为中国农业银行股份有限公司。根据本基金的基金管理人于 2020 年 5 月 30 日发布的《大成基金管理有限公司关于大成月添利理财债券型证券投资基金修改基金合同并取消自动升降级业务的公告》,于 2020 年 6 月 30 日发布的《关于大成月添利理财债券型证券投资基金基金合同等法律文件生效的公告》以及中国证监会关于规范理财债券基金业务的要求以及中国证监会于 2020 年 3 月 20 日颁布的《关于修改部分证券期货规章的决定》的规定,经与基金托管人协商一致,大成基金管理有限公司对《大成月添利理财债券型证券投资基金基金合同》相关条款进行了修改,修改涉及本基金资产配置比例、投资限制、申购和赎回价格、基金资产估值、收益分配、升降级业务、信息披露等内容,修改后的基金合同自 2020 年 6 月 30 日起生效,原《大成月添利理财债券型证券投资基金基金合同》自同日起失效。

根据修改后的《大成月添利理财债券型证券投资基金基金合同》和修改后的《大成月添利理财债券型证券投资基金招募说明书》的规定,本基金根据投资者认(申)购本基金的金额,对投资者持有的基金份额按照不同的费率计提销售服务费用,因此形成 A 类、B 类和 E 类三类基金份额,三类基金份额分别设置基金代码,并单独公布基金份额净值。

本基金每份基金份额自基金合同生效日或申购确认日起每个月为一个运作期。每个运作期

到期日前，基金份额持有人不能提出赎回申请。每个运作期到期日，基金份额持有人可提出赎回申请。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和修改后的《大成月添利理财债券型证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金的投资范围为法律法规及监管机构允许投资的金融工具，包括现金，通知存款，短期融资券，一年以内(含一年)的银行定期存款、大额存单，期限在一年以内(含一年)的债券回购，期限在一年以内(含一年)的中央银行票据，剩余期限(或回售期限)在 397 天以内(含 397 天)的债券、资产支持证券、中期票据，中国证监会认可的其他具有良好流动性的固定收益类金融工具。本基金投资于债券资产的比例不低于基金资产的 80%；本基金应当保持不低于基金资产净值的 5%的现金或到期日在一年以内的政府债券，其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。本基金投资业绩比较基准为：七天通知存款税后利率。本基金投资业绩比较基准为：七天通知存款税后利率。

本财务报表由本基金的基金管理人大成基金管理有限公司于 2021 年 3 月 29 日批准报出。

7.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于 2006 年 2 月 15 日及以后期间颁布的《企业会计准则—基本准则》、各项具体会计准则及相关规定(以下合称“企业会计准则”)、中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和中期报告>》、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《大成月添利理财债券型证券投资基金基金合同》和在财务报表附注 7.4.4 所列示的中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

本财务报表以持续经营为基础编制。

7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2020 年 6 月 30 日(基金合同生效日)至 2020 年 12 月 31 日止期间的财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金 2020 年 12 月 31 日的财务状况以及 2020 年 6 月 30 日(基金合同生效日)至 2020 年 12 月 31 日止期间的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

7.4.4 重要会计政策和会计估计

7.4.4.1 会计年度

本基金会计年度为公历 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。本期财务报表的实际编制期间为 2020 年 6 月 30 日(基金合同生效日)至 2020 年 12 月 31 日。

7.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

(1) 金融资产的分类

金融资产于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、应收款项、可供出售金融资产及持有至到期投资。金融资产的分类取决于本基金对金融资产的持有意图和持有能力。本基金现无金融资产分类为可供出售金融资产及持有至到期投资。

本基金目前以交易目的持有的债券投资分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在资产负债表中以交易性金融资产列示。

本基金持有的其他金融资产分类为应收款项，包括银行存款、买入返售金融资产和其他各类应收款项等。应收款项是指在活跃市场中没有报价、回收金额固定或可确定的非衍生金融资产。

(2) 金融负债的分类

金融负债于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债及其他金融负债。本基金目前暂无金融负债分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。本基金持有的其他金融负债包括卖出回购金融资产款和其他各类应付款项等。

7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

金融资产或金融负债于本基金成为金融工具合同的一方时，按公允价值在资产负债表内确认。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，取得时发生的相关交易费用计入当期损益；对于支付的价款中包含的债券起息日或上次除息日至购买日止的利息，单独确认为应收项目。应收款项和其他金融负债的相关交易费用计入初始确认金额。

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，按照公允价值进行后续计量；对于应收款项和其他金融负债采用实际利率法，以摊余成本进行后续计量。

金融资产满足下列条件之一的，予以终止确认：(1) 收取该金融资产现金流量的合同权利终止；(2) 该金融资产已转移，且本基金将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方；或者(3) 该金融资产已转移，虽然本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬，但是放弃了对该金融资产控制。

金融资产终止确认时，其账面价值与收到的对价的差额，计入当期损益。

当金融负债的现时义务全部或部分已经解除时，终止确认该金融负债或义务已解除的部分。终止确认部分的账面价值与支付的对价之间的差额，计入当期损益。

7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

本基金持有的债券投资按如下原则确定公允价值并进行估值：

(1) 存在活跃市场的金融工具按其估值日的市场交易价格确定公允价值；估值日无交易且最

近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，按最近交易日的市场交易价格确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的市场交易价格不能真实反映公允价值的，应对市场交易价格进行调整，确定公允价值。与上述投资品种相同，但具有不同特征的，应以相同资产或负债的公允价值为基础，并在估值技术中考虑不同特征因素的影响。特征是指对资产出售或使用的限制等，如果该限制是针对资产持有者的，那么在估值技术中不应将该限制作为特征考虑。此外，基金管理人不应考虑因大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价。

(2) 当金融工具不存在活跃市场，采用在当前情况下适用并且有足够可利用数据和其他信息支持的估值技术确定公允价值。采用估值技术时，优先使用可观察输入值，只有在无法取得相关资产或负债可观察输入值或取得不切实可行的情况下，才可以使用不可观察输入值。

(3) 如经济环境发生重大变化或证券发行人发生影响金融工具价格的重大事件，应对估值进行调整并确定公允价值。

7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

本基金持有的资产和承担的负债基本为金融资产和金融负债。当本基金 1) 具有抵销已确认金额的法定权利且该种法定权利现在是可执行的；且 2) 交易双方准备按净额结算时，金融资产与金融负债按抵销后的净额在资产负债表中列示。

7.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行基金份额所募集的总金额在扣除损益平准金分摊部分后的余额。由于申购和赎回引起的实收基金变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日认列。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

7.4.4.8 损益平准金

损益平准金包括已实现平准金和未实现平准金。已实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现损益占基金净值比例计算的金额。未实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未实现损益占基金净值比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日认列，并于期末全额转入未分配利润/(累计亏损)。

7.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

债券投资在持有期间应取得的按票面利率或者发行价计算的利息扣除在适用情况下由债券发行企业代扣代缴的个人所得税及由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为利息收入。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在持有期间的公允价值变动确认为公允价值变动损益；于处置时，其处置价格与初始确认金额之间的差额确认为投资收益，其中包括从公

允价值变动损益结转的公允价值累计变动额。

应收款项在持有期间确认的利息收入按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

7.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬、托管费和销售服务费在费用涵盖期间按基金合同约定的费率和计算方法逐日确认。

其他金融负债在持有期间确认的利息支出按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

7.4.4.11 基金的收益分配政策

本基金同一类别的每一基金份额享有同等分配权。本基金收益以现金形式分配，但基金份额持有人可选择现金红利或将现金红利按分红除权日的基金份额净值自动转为基金份额进行再投资。若期末未分配利润中的未实现部分为正数，包括基金经营活动产生的未实现损益以及基金份额交易产生的未实现平准金等，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润中的已实现部分；若期末未分配利润的未实现部分为负数，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润，即已实现部分相抵未实现部分后的余额。

经宣告的拟分配基金收益于分红除权日从所有者权益转出。

7.4.4.12 分部报告

本基金以内部组织结构、管理要求、内部报告制度为依据确定经营分部，以经营分部为基础确定报告分部并披露分部信息。经营分部是指本基金内同时满足下列条件的组成部分：(1) 该组成部分能够在日常活动中产生收入、发生费用；(2) 本基金的基金管理人能够定期评价该组成部分的经营成果，以决定向其配置资源、评价其业绩；(3) 本基金能够取得该组成部分的财务状况、经营成果和现金流量等有关会计信息。如果两个或多个经营分部具有相似的经济特征，并且满足一定条件的，则合并为一个经营分部。

本基金目前以一个单一的经营分部运作，不需要披露分部信息。

7.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计

根据本基金的估值原则和中国证监会允许的基金行业估值实务操作，本基金确定以下类别债券投资的公允价值时采用的估值方法及其关键假设如下：

对于在证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券、可交换债券和私募债券除外)及在银行间同业市场交易的固定收益品种，根据中国证监会公告[2017]13号《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》及《中国证券投资基金业协会估值核算工作小组关于2015年1

季度固定收益品种的估值处理标准》采用估值技术确定公允价值。本基金持有的证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券、可交换债券和私募债券除外)，按照中证指数有限公司所独立提供的估值结果确定公允价值。本基金持有的银行间同业市场固定收益品种按照中债金融估值中心有限公司所独立提供的估值结果确定公允价值。

7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

7.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期未发生会计政策变更。

7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

7.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

7.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、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》、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附加等税费按照实际缴纳增值税额的适用比例计算缴纳。

7.4.7 重要财务报表项目的说明

7.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2020年12月31日	
	活期存款	21,473.64
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	-	
合计	21,473.64	

7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2020年12月31日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	-	-	-
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	-	-
	银行间市场	39,726,480.00	39,780,000.00
	合计	39,726,480.00	39,780,000.00
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	39,726,480.00	39,780,000.00	53,520.00

7.4.7.3 衍生金融资产/负债

无。

7.4.7.4 买入返售金融资产

7.4.7.4.1 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12月31日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	-	-

银行间市场	5,700,122.85	-
合计	5,700,122.85	-

7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

无。

7.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2020年12月31日
应收活期存款利息	3,303.91
应收定期存款利息	-
应收其他存款利息	-
应收结算备付金利息	51.81
应收债券利息	52,694.51
应收资产支持证券利息	-
应收买入返售证券利息	359.70
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	-
合计	56,409.93

7.4.7.6 其他资产

无。

7.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2020年12月31日
交易所市场应付交易费用	-
银行间市场应付交易费用	7,976.86
合计	7,976.86

7.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2020年12月31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	219,000.00
其他应付款	339.00
合计	219,339.00

7.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

大成月添利债券 A

项目	本期 2020 年 6 月 30 日（基金合同生效日）至 2020 年 12 月 31 日	
	基金份额（份）	账面金额
基金合同生效日	59,413,258.98	59,413,258.98
本期申购	48,008.55	48,008.55
本期赎回（以“-”号填列）	-21,622,587.98	-21,622,587.98
本期末	37,838,679.55	37,838,679.55

大成月添利债券 B

项目	本期 2020 年 6 月 30 日（基金合同生效日）至 2020 年 12 月 31 日	
	基金份额（份）	账面金额
基金合同生效日	1,867,242,164.81	1,867,242,164.81
本期申购	1,869,522.95	1,869,522.95
本期赎回（以“-”号填列）	-1,861,883,171.50	-1,861,883,171.50
本期末	7,228,516.26	7,228,516.26

大成月添利债券 E

项目	本期 2020 年 6 月 30 日（基金合同生效日）至 2020 年 12 月 31 日	
	基金份额（份）	账面金额
基金合同生效日	4,309,667.12	4,309,667.12
本期申购	2,054.39	2,054.39
本期赎回（以“-”号填列）	-4,311,586.09	-4,311,586.09
本期末	135.42	135.42

注：申购含红利再投份额(如有)、转换入份额(如有)；赎回含转换出份额(如有)。

7.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

大成月添利债券 A

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
基金合同生效日	-	-	-
本期利润	281,264.31	49,075.30	330,339.61
本期基金份额交易产生的变动数	-52,067.72	1,386.71	-50,681.01
其中：基金申购款	6.14	0.42	6.56
基金赎回款	-52,073.86	1,386.29	-50,687.57
本期已分配利润	-	-	-
本期末	229,196.59	50,462.01	279,658.60

大成月添利债券 B

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
基金合同生效日	-	-	-
本期利润	1,122,126.03	4,444.51	1,126,570.54
本期基金份额交易产生的变动数	-1,068,237.63	5,208.62	-1,063,029.01
其中：基金申购款	-	-	-
基金赎回款	-1,068,237.63	5,208.62	-1,063,029.01
本期已分配利润	-	-	-
本期末	53,888.40	9,653.13	63,541.53

大成月添利债券 E

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
基金合同生效日	-	-	-
本期利润	876.28	0.19	876.47
本期基金份额交易产生的变动数	-872.19	0.01	-872.18
其中：基金申	2.69	0.01	2.70

购款			
基金赎回款	-874.88	-	-874.88
本期已分配利润	-	-	-
本期末	4.09	0.20	4.29

7.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期	
	2020年6月30日（基金合同生效日）至2020年12月31日	
活期存款利息收入		377,633.98
定期存款利息收入		-
其他存款利息收入		292,708.31
结算备付金利息收入		2,904.26
其他		-
合计		673,246.55

7.4.7.12 股票投资收益

无。

7.4.7.13 债券投资收益

单位：人民币元

项目	本期	
	2020年6月30日（基金合同生效日）至2020年12月31日	
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额		204,240,601.77
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额		199,970,496.57
减：应收利息总额		4,583,701.77
买卖债券差价收入		-313,596.57

7.4.7.14 贵金属投资收益

无。

7.4.7.15 衍生工具收益

无。

7.4.7.16 股利收益

无。

7.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期
	2020年6月30日（基金合同生效日）至2020年12月31日
1. 交易性金融资产	53,520.00
股票投资	-
债券投资	53,520.00
资产支持证券投资	-
基金投资	-
贵金属投资	-
其他	-
2. 衍生工具	-
权证投资	-
3. 其他	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税	-
合计	53,520.00

7.4.7.18 其他收入

无。

7.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期
	2020年6月30日（基金合同生效日）至2020年12月31日
交易所市场交易费用	-
银行间市场交易费用	3,100.00
合计	3,100.00

7.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期
	2020年6月30日（基金合同生效日）至2020年12月31日
审计费用	20,765.69
信息披露费	60,655.53
证券出借违约金	-
银行划款手续费	10,760.31
账户维护费	18,099.00
其他	600.00
合计	110,880.53

7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

7.4.8.1 或有事项

无。

7.4.8.2 资产负债表日后事项

无。

7.4.9 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、基金销售机构、注册登记机构
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
中国农业银行股份有限公司（“中国农业银行”）	基金托管人、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
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
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

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。

7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

7.4.10.1.1 股票交易

无。

7.4.10.1.2 债券交易

无。

7.4.10.1.3 债券回购交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2020年6月30日（基金合同生效日）至2020年12月31日	
	成交金额	占当期债券回购 成交总额的比例（%）
光大证券	78,900,000.00	100.00

7.4.10.1.4 权证交易

无。

7.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

无。

7.4.10.2 关联方报酬

7.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2020年6月30日（基金合同生效日）至2020年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	241,120.53
其中：支付销售机构的客户维护费	28,087.54

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：

$$\text{日管理人报酬} = \text{前一日基金资产净值} \times 0.27\% / \text{当年天数}。$$

7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2020年6月30日（基金合同生效日）至2020年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	71,443.12

注：支付基金托管人中国农业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：

$$\text{日托管费} = \text{前一日基金资产净值} \times 0.08\% / \text{当年天数}。$$

7.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各	本期 2020年6月30日（基金合同生效日）至2020年12月31日

关联方名称	当期发生的基金应支付的销售服务费			
	大成月添利债券 A	大成月添利债券 B	大成月添利债券 E	合计
大成基金	2,158.69	6,565.30	188.92	8,912.91
中国农业银行	20,541.21	-	-	20,541.21
合计	22,699.90	6,565.30	188.92	29,454.12

注：支付基金销售机构的销售服务费按前一日各类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：

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

7.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

无。

7.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

7.4.10.4.1 与关联方通过约定申报方式进行的适用固定期限费率的证券出借业务的情况

无。

7.4.10.4.2 与关联方通过约定申报方式进行的适用市场化期限费率的证券出借业务的情况

无。

7.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

7.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用自有资金投资本基金的情况

份额单位：份

项目	本期 2020年6月30日(基金合同生效日)至 2020年12月31日	本期 2020年6月30日(基金合同生效日)至2020年12月 31日	本期 2020年6月30日(基金合同生效日)至 2020年12月31日
		大成月添利债券 A	大成月添利债券 B

基金合同生效日 (2020年6月30日) 持有的基金份额	-	77,609,333.97	-
报告期初持有的基金份额	-	-	-
报告期间申购/买入 总份额	-	71,851.34	-
报告期间因拆分变动 份额	-	-	-
减: 报告期间赎回/卖 出总份额	-	77,681,185.31	-
报告期末持有的基金 份额	-	-	-
报告期末持有的基金 份额 占基金总份额比例	-	-	-

注: 1. 期间申购/买入总份额含红利再投, 期间赎回/卖出总份额含转出份额。

2. 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。

7.4.10.5.2 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。

7.4.10.6 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 2020年6月30日(基金合同生效日)至2020年12月 31日	
	期末余额	当期利息收入
中国农业银行	21,473.64	377,633.98

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。

7.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

无。

7.4.10.8 其他关联交易事项的说明

无。

7.4.11 利润分配情况

无。

7.4.12 期末(2020 年 12 月 31 日)本基金持有的流通受限证券

7.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

无。

7.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

无。

7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

无。

7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

无。

7.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

无。

7.4.13 金融工具风险及管理

7.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金为债券型证券投资基金，其长期预期风险和预期收益低于股票型、混合型基金，高于货币市场基金。本基金投资的金融工具主要为债券投资等。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从事风险管理的主要目标是在严格控制投资风险的基础上，通过积极主动的投资管理，力争实现基金资产长期稳定增值。

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。

7.4.13.2 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人中国农业银行，因而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。

于本期末，本基金未持有除国债、央行票据和政策性金融债以外的债券。

7.4.13.3 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于运作期到期日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。

7.4.13.3.1 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》及《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》等有关法规的要求建立健全开放式基金流动性风险管理的内部控制体系，审慎评估各类资产的流动性，针对性制定流动性风险管理措施，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基金组合资产持仓集中度指标、逆回购交易的到期日与交易对手的集中度、流动性受限资产比例、基金组合资产中 7 个工作日可变现资产的可变现价值以及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 15%。

本基金主要投资于交易所及银行间市场内交易的证券，除在附注“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)，其余均能及时变现。此外，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。

7.4.13.4 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。

7.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指金融工具的公允价值或未来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。

本基金的基金管理人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。

本基金主要投资于交易所及银行间市场交易的固定收益品种，因此存在相应的利率风险。

7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2020 年 12 月 31 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	21,473.64	-	-	-	21,473.64
结算备付金	104,761.90	-	-	-	104,761.90
交易性金融资产	39,780,000.00	-	-	-	39,780,000.00
买入返售金融资产	5,700,122.85	-	-	-	5,700,122.85
应收利息	-	-	-	56,409.93	56,409.93
资产总计	45,606,358.39	-	-	56,409.93	45,662,768.32
负债					
应付管理人报酬	-	-	-	11,356.29	11,356.29

应付托管费	-	-	-	3,364.83	3,364.83
应付销售服务费	-	-	-	10,195.69	10,195.69
应付交易费用	-	-	-	7,976.86	7,976.86
其他负债	-	-	-	219,339.00	219,339.00
负债总计	-	-	-	252,232.67	252,232.67
利率敏感度缺口	45,606,358.39	-	-	-195,822.74	45,410,535.65

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。

7.4.13.4.1.2 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12月31日）
分析	市场利率下降25个基点	20,088.88
	市场利率上升25个基点	-20,068.62

7.4.13.4.2 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。

7.4.13.4.3 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。本基金主要投资于证券交易所上市或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。

7.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

(1) 公允价值

(a) 金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属的层次，由对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次决定：

第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

(b) 持续的以公允价值计量的金融工具

(i) 各层次金融工具公允价值

于本期末，本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产中属于第二层次的余额为 39,780,000.00 元，无属于第一或第三层次的余额。

(ii) 公允价值所属层次间的重大变动

本基金以导致各层次之间转换的事项发生日为确认各层次之间转换的时点。

本基金本期持有的以公允价值计量的金融工具的公允价值所属层次未发生重大变动。

(iii) 第三层次公允价值余额和本期变动金额

无。

(c) 非持续的以公允价值计量的金融工具

于本期末，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产。

(d) 不以公允价值计量的金融工具

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括应收款项和其他金融负债，其账面价值与公允价值相差很小。

(2) 除公允价值外，截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

§ 7 年度财务报表（转型前）

7.1 资产负债表

会计主体：大成月添利理财债券型证券投资基金

报告截止日：2020 年 6 月 29 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2020 年 6 月 29 日	上年度末 2019 年 12 月 31 日
资产：			
银行存款	7.4.7.1	1,191,326,030.69	5,417,078,691.80
结算备付金		-	1,904,761.90
存出保证金		-	-
交易性金融资产	7.4.7.2	-	4,321,277,846.08
其中：股票投资		-	-
基金投资		-	-

债券投资		-	4,321,277,846.08
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	7.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	742,742,034.12	1,204,271,366.40
应收证券清算款		-	-
应收利息	7.4.7.5	731,525.54	38,674,944.70
应收股利		-	-
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.6	-	-
资产总计		1,934,799,590.35	10,983,207,610.88
负债和所有者权益	附注号	本期末 2020年6月29日	上年度末 2019年12月31日
负 债:			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	7.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	1,096,775,604.97
应付证券清算款		-	-
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		1,172,876.88	2,302,839.52
应付托管费		347,519.06	682,322.84
应付销售服务费		58,795.42	106,773.81
应付交易费用	7.4.7.7	196,765.70	154,719.35
应交税费		-	-
应付利息		207.54	126,393.26
应付利润		1,920,440.06	10,805,649.39
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.8	137,894.78	169,469.87
负债合计		3,834,499.44	1,111,123,773.01
所有者权益:			
实收基金	7.4.7.9	1,930,965,090.91	9,872,083,837.87
未分配利润	7.4.7.10	-	-
所有者权益合计		1,930,965,090.91	9,872,083,837.87
负债和所有者权益总计		1,934,799,590.35	10,983,207,610.88

注：1. 报告截止日 2020 年 6 月 29 日(原基金合同失效前日)，大成月添利理财债券型证券投资基金基金份额净值 1.0000 元 大成月添利理财债券型证券投资基金基金份额总额 1,930,965,090.91 份，其中 A 类基金份额 59,413,258.98 份， B 类基金份额 1,867,242,164.81 份， E 类基金份额 4,309,667.12 份。

2. 本财务报表的实际编制期间为 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 29 日(原基金合同失效前日)

止期间。

7.2 利润表

会计主体：大成月添利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 29 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期	上年度可比期间
		2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 29 日	2019 年 1 月 1 日至 2019 年 12 月 31 日
一、收入		136,529,267.73	457,566,615.31
1. 利息收入		136,646,619.26	457,497,325.38
其中：存款利息收入	7.4.7.11	74,306,480.75	246,069,269.55
债券利息收入		49,394,703.71	190,440,378.91
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		12,945,434.80	20,987,676.92
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		-117,351.53	69,289.93
其中：股票投资收益	7.4.7.12	-	-
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.13	-117,351.53	69,289.93
资产支持证券投资		-	-
收益		-	-
贵金属投资收益	7.4.7.14	-	-
衍生工具收益	7.4.7.15	-	-
股利收益	7.4.7.16	-	-
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.17	-	-
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.18	-	-
减：二、费用		28,329,166.32	84,560,478.85
1. 管理人报酬	7.4.10.2.1	12,023,090.86	34,279,324.85
2. 托管费	7.4.10.2.2	3,562,397.28	10,156,837.32
3. 销售服务费	7.4.10.2.3	554,449.33	1,616,313.26
4. 交易费用	7.4.7.19	-	-
5. 利息支出		11,993,822.92	38,109,110.43
其中：卖出回购金融资产支出		11,993,822.92	38,109,110.43

6. 税金及附加		-	-
7. 其他费用	7.4.7.20	195,405.93	398,892.99
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		108,200,101.41	373,006,136.46
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		108,200,101.41	373,006,136.46

7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：大成月添利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 29 日

单位：人民币元

项目	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 29 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）	9,872,083,837.87	-	9,872,083,837.87
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	108,200,101.41	108,200,101.41
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）	-7,941,118,746.96	-	-7,941,118,746.96
其中：1. 基金申购款	911,190,133.58	-	911,190,133.58
2. 基金赎回款	-8,852,308,880.54	-	-8,852,308,880.54
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）	-	-108,200,101.41	-108,200,101.41
五、期末所有者权益（基金净值）	1,930,965,090.91	-	1,930,965,090.91
项目	上年度可比期间 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 12 月 31 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者	14,263,568,832.57	-	14,263,568,832.57

权益(基金净值)			
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	373,006,136.46	373,006,136.46
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)	-4,391,484,994.70	-	-4,391,484,994.70
其中:1.基金申购款	1,950,359,911.29	-	1,950,359,911.29
2.基金赎回款	-6,341,844,905.99	-	-6,341,844,905.99
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)	-	-373,006,136.46	-373,006,136.46
五、期末所有者权益(基金净值)	9,872,083,837.87	-	9,872,083,837.87

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.4 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

7.4 报表附注

7.4.1 基金基本情况

大成月添利理财债券型证券投资基金(以下简称“本基金”)经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2012]第 1155 号《关于核准大成月添利理财债券型证券投资基金募集的批复》核准,由大成基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《大成月添利理财债券型证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式,存续期限不定,首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币 5,117,943,444.16 元,业经普华永道中天会计师事务所有限公司普华永道中天验字(2012)第 369 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《大成月添利理财债券型证券投资基金基金合同》于 2012 年 9 月 20 日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为 5,118,524,089.71 份基金份额,其中认购资金利息折合 580,645.55 份基

基金份额。本基金的基金管理人为大成基金管理有限公司，基金托管人为中国农业银行股份有限公司。

本基金根据投资者认(申)购本基金的金额，对投资者持有的基金份额按照不同的费率计提销售服务费用，因此形成 A 类、B 类和 E 类三类基金份额，三类基金份额分别设置基金代码，并单独公布每万份基金净收益和 7 日年化收益率。本基金每份基金份额自基金合同生效日或申购确认日起每一个月为一个运作期，运作期到期日前不得赎回。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《大成月添利理财债券型证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金的投资范围为法律法规及监管机构允许投资的金融工具，包括现金，通知存款，短期融资券，一年以内(含一年)的银行定期存款、大额存单，期限在一年以内(含一年)的债券回购，期限在一年以内(含一年)的中央银行票据，剩余期限(或回售期限)在 397 天以内(含 397 天)的债券、资产支持证券、中期票据，中国证监会认可的其他具有良好流动性的固定收益类金融工具。本基金投资业绩比较基准为：七天通知存款税后利率。

根据基金管理人大成基金管理有限公司于 2020 年 5 月 30 日发布的《大成基金管理有限公司关于大成月添利理财债券型证券投资基金修改基金合同并取消自动升降级业务的公告》中国证监会关于规范理财债券基金业务的要求以及中国证监会于 2020 年 3 月 20 日颁布的《关于修改部分证券期货规章的决定》的规定，经与中国农业银行股份有限公司协商一致，大成基金管理有限公司对《大成月添利理财债券型证券投资基金基金合同》相关条款进行了修改，修改后的基金合同自 2020 年 6 月 30 日起生效，原《大成月添利理财债券型证券投资基金基金合同》于同日起失效。

本财务报表由本基金的基金管理人大成基金管理有限公司于 2021 年 3 月 29 日批准报出。

7.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于 2006 年 2 月 15 日及以后期间颁布的《企业会计准则—基本准则》、各项具体会计准则及相关规定(以下合称“企业会计准则”)、中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和中期报告>》、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《大成月添利理财债券型证券投资基金基金合同》和在财务报表附注 7.4.4 所列示的中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

经中国证监会批准，基金管理人大成基金管理有限公司在对本基金基金合同进行修改后将继续运作本基金，存续期限不定，因此本基金财务报表仍以持续经营假设为编制基础。

7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 29 日(原基金合同失效前日)止期间的财务报表符合企业会计准则的要求,真实、完整地反映了本基金 2020 年 6 月 29 日(原基金合同失效前日)的财务状况以及 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 29 日(原基金合同失效前日)止期间的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

7.4.4 重要会计政策和会计估计

7.4.4.1 会计年度

本基金会计年度为公历 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。本期财务报表的实际编制期间为 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 29 日(原基金合同失效前日)止。

7.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

(1) 金融资产的分类

金融资产于初始确认时分类为:以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、应收款项、可供出售金融资产及持有至到期投资。金融资产的分类取决于本基金对金融资产的持有意图和持有能力。本基金现无金融资产分类为可供出售金融资产及持有至到期投资。

本基金目前以交易目的持有的债券投资分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在资产负债表中以交易性金融资产列示。

本基金持有的其他金融资产分类为应收款项,包括银行存款、买入返售金融资产和其他各类应收款项等。应收款项是指在活跃市场中没有报价、回收金额固定或可确定的非衍生金融资产。

(2) 金融负债的分类

金融负债于初始确认时分类为:以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债及其他金融负债。本基金目前暂无金融负债分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。本基金持有的其他金融负债包括卖出回购金融资产款和其他各类应付款项等。

7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

金融资产或金融负债于本基金成为金融工具合同的一方时,按公允价值在资产负债表内确认。对于取得债券投资支付的价款中包含的债券起息日或上次除息日至购买日止的利息,单独确认为应收项目。应收款项和其他金融负债的相关交易费用计入初始确认金额。

债券投资按票面利率或商定利率每日计提应收利息,按实际利率法在其剩余期限内摊销其买入时的溢价或折价;同时于每一计价日计算影子价格,以避免债券投资的账面价值与公允价值的

差异导致基金资产净值发生重大偏离。对于应收款项和其他金融负债采用实际利率法，以摊余成本进行后续计量。

金融资产满足下列条件之一的，予以终止确认：(1) 收取该金融资产现金流量的合同权利终止；(2) 该金融资产已转移，且本基金将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方；或者(3) 该金融资产已转移，虽然本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬，但是放弃了对该金融资产控制。

金融资产终止确认时，其账面价值与收到的对价的差额，计入当期损益。

当金融负债的现时义务全部或部分已经解除时，终止确认该金融负债或义务已解除的部分。终止确认部分的账面价值与支付的对价之间的差额，计入当期损益。

7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

为了避免投资组合的账面价值与公允价值的差异导致基金资产净值发生重大偏离，从而对基金持有人的利益产生稀释或不公平的结果，基金管理人于每一计价日采用投资组合的公允价值计算影子价格。当影子价格确定的基金资产净值与摊余成本法计算的基金资产净值的偏离度绝对值达到或超过 0.25%时，基金管理人应根据相关法律法规采取相应措施，使基金资产净值更能公允地反映基金投资组合价值。

计算影子价格时按如下原则确定债券投资的公允价值：

(1) 存在活跃市场的金融工具按其估值日的市场交易价格确定公允价值；估值日无交易且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，按最近交易日的市场交易价格确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的市场交易价格不能真实反映公允价值的，应对市场交易价格进行调整，确定公允价值。与上述投资品种相同，但具有不同特征的，应以相同资产或负债的公允价值为基础，并在估值技术中考虑不同特征因素的影响。特征是指对资产出售或使用的限制等，如果该限制是针对资产持有者的，那么在估值技术中不应将该限制作为特征考虑。此外，基金管理人不应考虑因大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价。

(2) 当金融工具不存在活跃市场，采用在当前情况下适用并且有足够可利用数据和其他信息支持的估值技术确定公允价值。采用估值技术时，优先使用可观察输入值，只有在无法取得相关资产或负债可观察输入值或取得不切实可行的情况下，才可以使用不可观察输入值。

(3) 如经济环境发生重大变化或证券发行人发生影响金融工具价格的重大事件，应对估值进行调整并确定公允价值。

7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

本基金持有的资产和承担的负债基本为金融资产和金融负债。当本基金 1) 具有抵销已确认

金额的法定权利且该种法定权利现在是可执行的；且 2) 交易双方准备按净额结算时，金融资产与金融负债按抵销后的净额在资产负债表中列示。

7.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行基金份额所募集的总金额。每份基金份额面值为 1.00 元。由于申购和赎回引起的实收基金变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日认列。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少，以及因类别调整而引起的 A 类和 B 类基金份额之间的转换所产生的实收基金变动。

7.4.4.8 收入/(损失)的确认和计量

债券投资在持有期间按实际利率计算确定的金额扣除在适用情况下由债券发行企业代扣代缴的个人所得税及由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为利息收入。

债券投资处置时其处置价格扣除相关交易费用后的净额与账面价值之间的差额确认为投资收益。

应收款项在持有期间确认的利息收入按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

7.4.4.9 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬、托管费和销售服务费在费用涵盖期间按基金合同约定的费率和计算方法逐日确认。

其他金融负债在持有期间确认的利息支出按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

7.4.4.10 基金的收益分配政策

本基金同一类别的每一基金份额享有同等分配权。申购的基金份额享有确认当日的分红权益，而赎回的基金份额不享有确认当日的分红权益。本基金以份额面值 1.00 元固定份额净值交易方式，每日计算当日收益并全部分配结转至应付收益科目，每个运作期末以红利再投资方式集中支付累计收益。

7.4.4.11 分部报告

本基金以内部组织结构、管理要求、内部报告制度为依据确定经营分部，以经营分部为基础确定报告分部并披露分部信息。经营分部是指本基金内同时满足下列条件的组成部分：(1) 该组成部分能够在日常活动中产生收入、发生费用；(2) 本基金的基金管理人能够定期评价该组成部分的经营成果，以决定向其配置资源、评价其业绩；(3) 本基金能够取得该组成部分的财务状况、经营成果和现金流量等有关会计信息。如果两个或多个经营分部具有相似的经济特征，并且满足

一定条件的，则合并为一个经营分部。

本基金目前以一个单一的经营分部运作，不需要披露分部信息。

7.4.4.12 其他重要的会计政策和会计估计

根据本基金的估值原则和中国证监会允许的基金行业估值实务操作，本基金计算影子价格过程中确定债券投资的公允价值时采用的估值方法及其关键假设如下：

对于在证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券、可交换债券和私募债券除外)及在银行间同业市场交易的固定收益品种，根据中国证监会公告[2017]13号《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》及《中国证券投资基金业协会估值核算工作小组关于2015年1季度固定收益品种的估值处理标准》采用估值技术确定公允价值。本基金持有的证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券、可交换债券和私募债券除外)，按照中证指数有限公司所独立提供的估值结果确定公允价值。本基金持有的银行间同业市场固定收益品种按照中债金融估值中心有限公司所独立提供的估值结果确定公允价值。

7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

7.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期未发生会计政策变更。

7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

7.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

7.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、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》、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附加等税费按照实际缴纳增值税额的适用比例计算缴纳。

7.4.7 重要财务报表项目的说明

7.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2020 年 6 月 29 日	上年度末 2019 年 12 月 31 日
活期存款	411,326,030.69	2,078,691.80
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	780,000,000.00	5,415,000,000.00
合计	1,191,326,030.69	5,417,078,691.80

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。

7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2020 年 6 月 29 日			
	摊余成本	影子定价	偏离金额	偏离度 (%)
债券	交易所市场	-	-	-
	银行间市场	-	-	-
	合计	-	-	-
资产支持证券	-	-	-	-
合计	-	-	-	-

项目		上年度末 2019 年 12 月 31 日			
		摊余成本	影子定价	偏离金额	偏离度 (%)
债券	交易所市场	-	-	-	-
	银行间市场	4,321,277,846.08	4,325,119,600.00	3,841,753.92	0.0389
	合计	4,321,277,846.08	4,325,119,600.00	3,841,753.92	0.0389
资产支持证券		-	-	-	-
合计		4,321,277,846.08	4,325,119,600.00	3,841,753.92	0.0389

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。

7.4.7.3 衍生金融资产/负债

无。

7.4.7.4 买入返售金融资产

7.4.7.4.1 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 29 日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	-	-
银行间市场	742,742,034.12	-
合计	742,742,034.12	-
项目	上年度末 2019 年 12 月 31 日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	-	-
银行间市场	1,204,271,366.40	-
合计	1,204,271,366.40	-

7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

无。

7.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2020 年 6 月 29 日	上年度末 2019 年 12 月 31 日
应收活期存款利息	89,690.64	73,346.67
应收定期存款利息	-	-

应收其他存款利息	212,000.02	28,133,599.17
应收结算备付金利息	-	942.81
应收债券利息	-	9,692,422.65
应收资产支持证券利息	-	-
应收买入返售证券利息	429,834.88	774,633.40
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	-	-
合计	731,525.54	38,674,944.70

7.4.7.6 其他资产

无。

7.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2020年6月29日	上年度末 2019年12月31日
交易所市场应付交易费用	-	-
银行间市场应付交易费用	196,765.70	154,719.35
合计	196,765.70	154,719.35

7.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2020年6月29日	上年度末 2019年12月31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	137,479.78	164,000.00
其他应付款	415.00	5,469.87
合计	137,894.78	169,469.87

7.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

大成月添利债券 A

项目	本期 2020年1月1日至2020年6月29日	
	基金份额(份)	账面金额
上年度末	76,843,858.79	76,843,858.79
本期申购	7,348,470.77	7,348,470.77
本期赎回(以“-”号填列)	-24,779,070.58	-24,779,070.58
本期末	59,413,258.98	59,413,258.98

大成月添利债券 B

项目	本期
----	----

	2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 29 日	
	基金份额 (份)	账面金额
上年度末	9,787,245,819.06	9,787,245,819.06
本期申购	901,132,769.36	901,132,769.36
本期赎回 (以“-”号填列)	-8,821,136,423.61	-8,821,136,423.61
本期末	1,867,242,164.81	1,867,242,164.81

大成月添利债券 E

项目	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 29 日	
	基金份额 (份)	账面金额
上年度末	7,994,160.02	7,994,160.02
本期申购	2,708,893.45	2,708,893.45
本期赎回 (以“-”号填列)	-6,393,386.35	-6,393,386.35
本期末	4,309,667.12	4,309,667.12

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)。

7.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

大成月添利债券 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	726,216.74	-	726,216.74
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	-726,216.74	-	-726,216.74
本期末	-	-	-

大成月添利债券 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	107,396,608.60	-	107,396,608.60
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	-107,396,608.60		-107,396,608.60
本期末			

大成月添利债券 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	77,276.07		77,276.07
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	-77,276.07		-77,276.07
本期末			

7.4.7.11 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29日	上年度可比期间 2019年1月1日至2019年12月31日
活期存款利息收入	28,637,641.92	1,337,999.75
定期存款利息收入		
其他存款利息收入	45,516,520.29	244,417,634.60
结算备付金利息收入	152,318.54	313,635.20
其他		
合计	74,306,480.75	246,069,269.55

7.4.7.12 股票投资收益

无。

7.4.7.13 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29日	上年度可比期间 2019年1月1日至2019年12月31日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	8,178,420,382.09	19,975,559,335.04

减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	8,162,054,197.01	19,927,715,740.28
减：应收利息总额	16,483,536.61	47,774,304.83
买卖债券差价收入	-117,351.53	69,289.93

7.4.7.14 贵金属投资收益

无。

7.4.7.15 衍生工具收益

无。

7.4.7.16 股利收益

无。

7.4.7.17 公允价值变动收益

无。

7.4.7.18 其他收入

无。

7.4.7.19 交易费用

无。

7.4.7.20 其他费用

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29日	2019年1月1日至2019年12月31日
审计费用	69,234.31	155,000.00
信息披露费	59,344.47	120,000.00
证券出借违约金	-	-
银行划款手续费	48,326.15	86,692.99
账户维护费	17,901.00	36,000.00
其他	600.00	1,200.00
合计	195,405.93	398,892.99

7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

7.4.8.1 或有事项

无。

7.4.8.2 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 30 日发布的《关于大成月添利理财债券型证券投资基金基金合同等法律文件生效的公告》以及于 2020 年 5 月 30 日发布的《大成基金管理有限公司关于大成月添利理财债券型证券投资基金修改基金合同并取消自动升降级业务的公告》，修改后的《大成月添利理财债券型证券投资基金基金合同》自 2020 年 6 月 30 日起生效。

7.4.9 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、基金销售机构、注册登记机构
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
中国农业银行股份有限公司（“中国农业银行”）	基金托管人、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
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
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

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。

7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

7.4.10.1.1 股票交易

无。

7.4.10.1.2 债券交易

无。

7.4.10.1.3 债券回购交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 29 日		上年度可比期间 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 12 月 31 日	
	成交金额	占当期债券回购 成交总额的比例 (%)	成交金额	占当期债券回购 成交总额的比例 (%)
光大证券	16,395,300,000.00	100.00	54,695,000,000.00	100.00

7.4.10.1.4 权证交易

无。

7.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

无。

7.4.10.2 关联方报酬

7.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年6 月29日	上年度可比期间 2019年1月1日至2019年 12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	12,023,090.86	34,279,324.85
其中：支付销售机构的客户维护费	42,566.02	132,321.21

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：

$$\text{日管理人报酬} = \text{前一日基金资产净值} \times 0.27\% / \text{当年天数}。$$

7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年6 月29日	上年度可比期间 2019年1月1日至2019年 12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	3,562,397.28	10,156,837.32

注：支付基金托管行中国农业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：

$$\text{日托管费} = \text{前一日基金资产净值} \times 0.08\% / \text{当年天数}。$$

7.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各	本期 2020年1月1日至2020年6月29日

关联方名称	当期发生的基金应支付的销售服务费			
	大成月添利债券 A	大成月添利债券 B	大成月添利债券 E	合计
中国农业银行	27,248.59	-	-	27,248.59
大成基金	2,802.39	441,525.74	10,829.97	455,158.10
合计	30,050.98	441,525.74	10,829.97	482,406.69
获得销售服务费的各 关联方名称	上年度可比期间 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 12 月 31 日			
	当期发生的基金应支付的销售服务费			
	大成月添利债券 A	大成月添利债券 B	大成月添利债券 E	合计
	大成基金	725,803.50	564,628.00	14,470.62
中国农业银行	65,665.71	-	-	65,665.71
合计	791,469.21	564,628.00	14,470.62	1,370,567.83

注：支付基金销售机构的销售服务费按前一日各类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：

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

7.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

无。

7.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

7.4.10.4.1 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 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 29 日	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 29 日	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 29 日
	大成月添利债券 A	大成月添利债券 B	大成月添利债券 E
基金合同生效日 (2012 年 9 月 20 日) 持有的基金份额	-	-	-
报告期初持有的基金 份额	-	76,635,216.68	-
报告期间申购/买入	-	974,117.29	-

总份额			
报告期内因拆分变动份额	-	-	-
减：报告期内赎回/卖出总份额	-	-	-
报告期末持有的基金份额	-	77,609,333.97	-
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	-	4.02%	-
项目	上年度可比期间 2019年1月1日至 2019年12月31日	上年度可比期间 2019年1月1日至2019年 12月31日	上年度可比期间 2019年1月1日至 2019年12月31日
	大成月添利债券 A	大成月添利债券 B	大成月添利债券 E
基金合同生效日 (2012年9月20日) 持有的基金份额	-	0.00	-
报告期初持有的基金份额	-	74,408,511.12	-
报告期内申购/买入总份额	-	2,226,705.56	-
报告期内因拆分变动份额	-	0.00	-
减：报告期内赎回/卖出总份额	-	0.00	-
报告期末持有的基金份额	-	76,635,216.68	-
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	-	0.78%	-

7.4.10.4.2 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。

7.4.10.5 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 2020年1月1日至2020年6月29日		上年度可比期间 2019年1月1日至2019年12月31日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入

中国农业银行	411,326,030.69	28,637,641.92	2,078,691.80	1,337,999.75
--------	----------------	---------------	--------------	--------------

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。

7.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

无。

7.4.10.7 其他关联交易事项的说明

无。

7.4.11 利润分配情况

单位：人民币元

大成月添利债券 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
712,126.55	46,089.41	-31,999.22	726,216.74	-
大成月添利债券 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
101,112,769.36	15,134,457.94	-8,850,618.70	107,396,608.60	-
大成月添利债券 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
69,226.63	10,640.85	-2,591.41	77,276.07	-

7.4.12 期末(2020年6月29日)本基金持有的流通受限证券

7.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

无。

7.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

无。

7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

无。

7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

无。

7.4.13 金融工具风险及管理

7.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金为债券型基金，属于较低风险品种。本基金投资的金融工具主要为存款和债券投资等。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“风险收益水平高于货币市场基金而低于混合基金和股票基金，追求高于业绩比较基准的稳定收益”的投资目标。

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（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。

7.4.13.2 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人中国农业银行；其他协议存款存放在具有基金托管资格的银行和大型股份制商业银行，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。

7.4.13.2.1 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29日	上年度末 2019年12月31日
A-1	-	-
A-1 以下	-	-
未评级	-	487,676,103.22
合计	-	487,676,103.22

注：上述未评级债券为国债和政策性金融债。

7.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

无。

7.4.13.2.3 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29日	上年度末 2019年12月31日
A-1	-	-
A-1 以下	-	-
未评级	-	3,763,412,756.45
合计	-	3,763,412,756.45

7.4.13.2.4 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29日	上年度末 2019年12月31日
AAA	-	-
AAA 以下	-	-
未评级	-	70,188,986.41
合计	-	70,188,986.41

注：上述未评级债券为政策性金融债。

7.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

无。

7.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

无。

7.4.13.3 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。

7.4.13.3.1 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，除在附注“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。

7.4.13.4 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。

7.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指金融工具的公允价值或未来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。

7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位: 人民币元

本期末 2020 年 6 月 29 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	1,191,326,030.69	-	-	-	1,191,326,030.69
买入返售金融资产	742,742,034.12	-	-	-	742,742,034.12
应收利息	-	-	-	731,525.54	731,525.54
资产总计	1,934,068,064.81	-	-	731,525.54	1,934,799,590.35
负债					
应付管理人报酬	-	-	-	1,172,876.88	1,172,876.88
应付托管费	-	-	-	347,519.06	347,519.06
应付销售服务费	-	-	-	58,795.42	58,795.42
应付交易费用	-	-	-	196,765.70	196,765.70
应付利息	-	-	-	207.54	207.54
应付利润	-	-	-	1,920,440.06	1,920,440.06
其他负债	-	-	-	137,894.78	137,894.78
负债总计	-	-	-	3,834,499.44	3,834,499.44
利率敏感度缺口	1,934,068,064.81	-	-	-3,102,973.90	1,930,965,090.91

	81				
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	5,417,078,691.80	-	-	-	5,417,078,691.80
结算备付金	1,904,761.90	-	-	-	1,904,761.90
交易性金融资产	4,321,277,846.08	-	-	-	4,321,277,846.08
买入返售金融资产	1,204,271,366.40	-	-	-	1,204,271,366.40
应收利息	-	-	-	38,674,944.70	38,674,944.70
资产总计	10,944,532,666.18	-	-	38,674,944.70	10,983,207,610.88
负债					
应付管理人报酬	-	-	-	2,302,839.52	2,302,839.52
应付托管费	-	-	-	682,322.84	682,322.84
卖出回购金融资产款	1,096,775,604.97	-	-	-	1,096,775,604.97
应付销售服务费	-	-	-	106,773.81	106,773.81
应付交易费用	-	-	-	154,719.35	154,719.35
应付利息	-	-	-	126,393.26	126,393.26
应付利润	-	-	-	10,805,649.39	10,805,649.39
其他负债	-	-	-	169,469.87	169,469.87
负债总计	1,096,775,604.97	-	-	14,348,168.04	1,111,123,773.01
利率敏感度缺口	9,847,757,061.21	-	-	24,326,776.66	9,872,083,837.87

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。

7.4.13.4.1.2 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29日）	上年度末（2019年12月31日）
分析	市场利率下降 25 个基点	-	3,335,968.52
	市场利率上升 25 个基点	-	-3,329,859.91

	基点		
--	----	--	--

注：于本期末，本基金未持有交易性债券投资，因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响。

7.4.13.4.2 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。

7.4.13.4.3 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。

7.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

(1) 公允价值

(a) 金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属的层次，由对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次决定：

第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

(b) 持续的以公允价值计量的金融工具

(i) 各层次金融工具公允价值

于本期末，本基金未持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产(上年度末：第二层次 4,321,277,846.08 元，无第一或第三层次)。

(ii) 公允价值所属层次间的重大变动

本基金以导致各层次之间转换的事项发生日为确认各层次之间转换的时点。

本基金本期及上年度可比期间持有的以公允价值计量的金融工具的公允价值所属层次未发生重大变动。

(iii) 第三层次公允价值余额和本期变动金额

无。

(c) 非持续的以公允价值计量的金融工具

于本期末，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产(上年度末：同)。

(d) 不以公允价值计量的金融工具

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括应收款项和其他金融负债，其账面价值与公允价值相差很小。

(2) 其他

除公允价值和增值税外，截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

§ 8 投资组合报告（转型后）

8.1 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	权益投资	-	-
	其中：股票	-	-
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	39,780,000.00	87.12
	其中：债券	39,780,000.00	87.12
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	5,700,122.85	12.48
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	126,235.54	0.28
8	其他各项资产	56,409.93	0.12
9	合计	45,662,768.32	100.00

8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

8.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

无。

8.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

无。

8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

无。

8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

8.4.1 累计买入金额超出期末基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

无。

8.4.2 累计卖出金额超出期末基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

无。

8.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

无。

8.5 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	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
1	国家债券	39,780,000.00	87.60
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	39,780,000.00	87.60

8.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
1	209961	20 贴现国债 61	400,000	39,780,000.00	87.60

8.7 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

无。

8.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

无。

8.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

无。

8.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

无。

8.11 投资组合报告附注**8.11.1 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没有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。

8.11.2 基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库

本基金投资的前十名股票未超出基金合同规定的备选股票库。

8.11.3 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	应收股利	-
4	应收利息	56,409.93
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-

8	其他	-
9	合计	56,409.93

8.11.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

无。

8.11.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

无。

8.11.6 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 投资组合报告（转型前）

8.1 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	-	-
	其中：债券	-	-
	资产支持证 券	-	-
2	买入返售金融资产	742,742,034.12	38.39
	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	1,191,326,030.69	61.57
4	其他各项资产	731,525.54	0.04
5	合计	1,934,799,590.35	100.00

8.2 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	16.32	
	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。

8.3 基金投资组合平均剩余期限

8.3.1 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	6
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	3

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。

8.3.2 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	100.16	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
2	30 天（含）—60 天	-	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
3	60 天（含）—90 天	-	-
	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）	-	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
	合计	100.16	-

8.4 报告期内投资组合平均剩余存续期超过 240 天情况说明

本报告期内，本基金未发生超标情况。

8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

无。

8.6 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

无。

8.7 “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	0.0906%
报告期内偏离度的最低值	-0.0004%
报告期内每个交易日偏离度的绝对值的简单平均值	0.0478%

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。

8.8 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。

8.9 投资组合报告附注

8.9.1 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。

8.9.2 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

本基金投资的前十名证券的发行主体本期没有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。

8.9.3 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	731,525.54
4	应收申购款	-
5	其他应收款	-
6	待摊费用	-
7	其他	-
8	合计	731,525.54

8.9.4 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。

§9 基金份额持有人信息（转型后）

9.1 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（%）
大成月添利债券A	5,020	7,537.59	105,917.93	0.28	37,732,761.62	99.72
大成月添利债券B	1	7,228,516.26	7,228,516.26	100.00	-	-
大成月添利债券E	9	15.05	-	-	135.42	100.00

合计	5,030	8,959.71	7,334,434.19	16.27	37,732,897.04	83.73
----	-------	----------	--------------	-------	---------------	-------

9.2 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	大成月添利债券 A	113.30	0.0003
	大成月添利债券 B	-	-
	大成月添利债券 E	9.73	7.1851
	合计	123.03	0.0003

9.3 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	大成月添利债券 A	0
	大成月添利债券 B	0
	大成月添利债券 E	0
	合计	0
本基金基金经理持有本开放式基金	大成月添利债券 A	0
	大成月添利债券 B	0
	大成月添利债券 E	0
	合计	0

9.4 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理本人及其直系亲属持有本人管理的产情况

无。

§9 基金份额持有人信息（转型前）

9.1 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	6,002	9,898.91	106,454.40	0.18	59,306,804.58	99.82

月添利债券 A						
大成月添利债券 B	9	207,471,351.65	1,867,242,164.81	100.00	-	-
大成月添利债券 E	359	12,004.64	-	-	4,309,667.12	100.00
合计	6,370	303,134.24	1,867,348,619.21	96.71	63,616,471.70	3.29

9.2 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	大成月添利债券 A	60,619.37	0.1020
	大成月添利债券 B	-	-
	大成月添利债券 E	10.00	0.0002
	合计	60,629.37	0.0031

9.3 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	大成月添利债券 A	0
	大成月添利债券 B	0
	大成月添利债券 E	0
	合计	0
本基金基金经理持有	大成月添利债券 A	0

本开放式基金	大成月添利债券 B	0
	大成月添利债券 E	0
	合计	0

9.4 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理本人及其直系亲属持有本人管理的产情况

无。

§ 10 开放式基金份额变动（转型后）

单位：份

项目	大成月添利债券 A	大成月添利债券 B	大成月添利债券 E
基金合同生效日（2020 年 6 月 30 日）基金份额总额	59,413,258.98	1,867,242,164.81	4,309,667.12
基金合同生效日起至报告期期末基金总申购份额	48,008.55	1,869,522.95	2,054.39
减：基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回份额	21,622,587.98	1,861,883,171.50	4,311,586.09
基金合同生效日起至报告期期末基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-	-	-
本报告期期末基金份额总额	37,838,679.55	7,228,516.26	135.42

§ 10 开放式基金份额变动（转型前）

单位：份

项目	大成月添利债券 A	大成月添利债券 B	大成月添利债券 E
基金合同生效日（2012 年 9 月 20 日）基金份额总额	3,418,972,083.65	1,699,552,006.06	-

本报告期期初基金份额总额	76,843,858.79	9,787,245,819.06	7,994,160.02
本报告期基金总申购份额	7,348,470.77	901,132,769.36	2,708,893.45
减：本报告期基金总赎回份额	24,779,070.58	8,821,136,423.61	6,393,386.35
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	59,413,258.98	1,867,242,164.81	4,309,667.12

注：本基金修订前的基金合同生效日为 2012 年 9 月 20 日，于 2015 年 6 月 16 日起增加 E 类份额。红利再投资作为本期申购资金的来源，统一计入本期总申购份额，不单独列示。

§ 11 重大事件揭示

11.1 基金份额持有人大会决议

无。

11.2 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

1. 2020 年 12 月 28 日，经大成基金管理有限公司 2020 年第一次临时股东会审议通过，选举林昌先生担任公司股东董事，翟斌先生不再担任公司股东董事。

2. 2020 年 12 月 28 日，经大成基金管理有限公司第七届董事会第八次会议审议通过，选举林昌先生担任公司第七届董事会副董事长，同时，选举其担任第七届董事会合规与风险管理委员会委员，第七届董事会审计委员会委员。翟斌先生不再担任公司第七届董事会副董事长、第七届董事会合规与风险管理委员会委员、第七届董事会审计委员会委员。

上述变更详见公司相关公告。

二、基金托管人的基金托管部门的重大人事变动

2020 年 8 月，中国农业银行总行决定刘琳任托管业务部副总裁。

11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

无。

11.4 基金投资策略的改变

根据中国证监会关于规范理财债券基金业务的要求以及中国证监会 2020 年 3 月 20 日颁布的《关于修改部分证券期货规章的决定》的规定，自 2020 年 6 月 30 日起，本基金的投资组合资产配置比例部分及投资组合限制部分增加“本基金投资于债券资产的比例不低于基金资产的 80%；本基金应当保持不低于基金资产净值的 5%的现金或到期日在一年以内的政府债券，其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。”的规定，本基金将按照《基金合同》的要求进行投资组合的调整。

11.5 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)，本年度支付的审计费用为 9 万元。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。

11.6 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、托管人及其相关高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况(转型后)

11.7.1 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	
爱建证券	1	-	-	-	-	-
安信证券	1	-	-	-	-	-
川财证券	1	-	-	-	-	-
第一创业	1	-	-	-	-	-
东北证券	2	-	-	-	-	-
东方证券	1	-	-	-	-	-
东吴证券	1	-	-	-	-	-
东兴证券	1	-	-	-	-	-
方正证券	1	-	-	-	-	-

高华证券	1	-	-	-	-	-
光大证券	2	-	-	-	-	-
广发证券	2	-	-	-	-	-
国金证券	2	-	-	-	-	-
国盛证券	1	-	-	-	-	-
国泰君安	3	-	-	-	-	-
国信证券	1	-	-	-	-	-
海通证券	1	-	-	-	-	-
红塔证券	1	-	-	-	-	-
华创证券	1	-	-	-	-	-
华泰证券	1	-	-	-	-	-
华西证券	1	-	-	-	-	-
联讯证券	1	-	-	-	-	-
民生证券	1	-	-	-	-	-
南京证券	1	-	-	-	-	-
平安证券	1	-	-	-	-	-
瑞银证券	2	-	-	-	-	-
山西证券	1	-	-	-	-	-
上海证券	1	-	-	-	-	-
申万宏源	2	-	-	-	-	-
世纪证券	1	-	-	-	-	-
天风证券	2	-	-	-	-	-
万和证券	1	-	-	-	-	-
西部证券	1	-	-	-	-	-
西藏东财	1	-	-	-	-	-
湘财证券	1	-	-	-	-	-
信达证券	1	-	-	-	-	-
兴业证券	2	-	-	-	-	-
招商证券	2	-	-	-	-	-

浙商证券	1	-	-	-	-	-
中国银河证 券	4	-	-	-	-	-
中金公司	3	-	-	-	-	-
中泰证券	2	-	-	-	-	-
中信建投证 券	2	-	-	-	-	-
中信证券	2	-	-	-	-	-
中银国际证 券	1	-	-	-	-	-
中原证券	1	-	-	-	-	-

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：

- (1) 财务状况良好，最近一年无重大违规行为；
- (2) 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；
- (3) 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；
- (4) 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；
- (5) 能提供投资组合运作、管理所需的其他券商服务；
- (6) 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专用席位。

本报告期内增加交易单元：信达证券。本报告期内退租交易单元：无。

11.7.2 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的比例

光大证券	-	-	78,900,000.00	100.00%	-	-
------	---	---	---------------	---------	---	---

11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况(转型前)

11.7.1 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	
爱建证券	1	-	-	-	-	-
安信证券	1	-	-	-	-	-
川财证券	1	-	-	-	-	-
第一创业	1	-	-	-	-	-
东北证券	2	-	-	-	-	-
东方证券	1	-	-	-	-	-
东吴证券	1	-	-	-	-	-
东兴证券	1	-	-	-	-	-
方正证券	1	-	-	-	-	-
高华证券	1	-	-	-	-	-
光大证券	2	-	-	-	-	-
广发证券	2	-	-	-	-	-
国金证券	2	-	-	-	-	-
国盛证券	1	-	-	-	-	-
国泰君安	3	-	-	-	-	-
国信证券	1	-	-	-	-	-
海通证券	1	-	-	-	-	-
红塔证券	1	-	-	-	-	-
华创证券	1	-	-	-	-	-
华泰证券	1	-	-	-	-	-
华西证券	1	-	-	-	-	-
联讯证券	1	-	-	-	-	-

民生证券	1	-	-	-	-	-
南京证券	1	-	-	-	-	-
平安证券	1	-	-	-	-	-
瑞银证券	2	-	-	-	-	-
山西证券	1	-	-	-	-	-
上海证券	1	-	-	-	-	-
申万宏源	2	-	-	-	-	-
世纪证券	1	-	-	-	-	-
天风证券	2	-	-	-	-	-
万和证券	1	-	-	-	-	-
西部证券	1	-	-	-	-	-
西藏东财	1	-	-	-	-	-
湘财证券	1	-	-	-	-	-
信达证券	1	-	-	-	-	-
兴业证券	2	-	-	-	-	-
招商证券	2	-	-	-	-	-
浙商证券	1	-	-	-	-	-
中国银河证 券	4	-	-	-	-	-
中金公司	3	-	-	-	-	-
中泰证券	2	-	-	-	-	-
中信建投证 券	2	-	-	-	-	-
中信证券	2	-	-	-	-	-
中银国际证 券	1	-	-	-	-	-
中原证券	1	-	-	-	-	-

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：

- (1) 财务状况良好，最近一年无重大违规行为；
- (2) 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；
- (3) 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；
- (4) 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；
- (5) 能提供投资组合运作、管理所需的其他券商服务；
- (6) 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专用席位。

本报告期内本基金退租的交易单元：长城证券，新增交易单元：无。

11.7.2 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的比例
光大证券	-	-	16,395,300,000.00	100.00%	-	-

11.8 偏离度绝对值超过 0.5%的情况（转型前）

本基金本报告期内无偏离度绝对值超过 0.5%的情况。

11.9 其他重大事件（转型后）

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	关于再次提请投资者及时更新已过期身份证件或者身份证明文件的公告	中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站	2020 年 12 月 31 日
2	大成基金管理有限公司关于提示泰诚财富基金销售（大连）有限公司代销客户及时办理转托管业务的公告	中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站	2020 年 12 月 17 日
3	大成月添利理财债券型证券投资基金第三季度报告	中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站	2020 年 10 月 28 日
4	大成月添利理财债券型证券投资基金招募说明书更新	中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站	2020 年 10 月 17 日

5	大成月添利理财债券型证券投资基金基金产品资料概要更新	中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站	2020 年 8 月 27 日
6	大成月添利理财债券型证券投资基金基金产品资料概要更新	中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站	2020 年 8 月 27 日
7	大成月添利理财债券型证券投资基金基金产品资料概要更新	中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站	2020 年 8 月 27 日
8	大成月添利理财债券型证券投资基金中期报告	中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站	2020 年 8 月 28 日
9	大成月添利理财债券型证券投资基金第二季度报告	中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站	2020 年 7 月 21 日
10	关于大成月添利理财债券型证券投资基金 A、B、E 类份额增加北京汇成基金有限公司为销售机构的公告	中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站	2020 年 7 月 6 日
11	关于再次提请投资者及时更新已过期身份证件或者身份证明文件的公告	中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站	2020 年 7 月 1 日
12	大成月添利理财债券型证券投资基金招募说明书摘要更新	中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站	2020 年 6 月 30 日
13	大成月添利理财债券型证券投资基金招募说明书更新	中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站	2020 年 6 月 30 日
14	关于大成月添利理财债券型证券投资基金基金合同等法律文件生效的公告	中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站	2020 年 6 月 30 日

11.9 其他重大事件（转型前）

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	关于大成月添利理财债券型证券投资基金修改基金合同并取消自动升降级业务的第二次提示性公告	中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站	2020-06-02
2	关于大成月添利理财债券型证券投资基金修改基金合同并取消自动升降级业务的提示性公告	中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站	2020-06-01
3	大成基金管理有限公司关于大成月添利理财债券型证券投资基金修改基金合同并取消自动升降级业务的公告	中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站	2020-05-30
4	关于大成月添利理财债券型证券投资基金调整大额申购及转换转入金额限	中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本	2020-05-30

	额的公告	公司网站	
5	大成月添利理财债券型证券投资基金托管协议	中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站	2020-05-30
6	大成月添利理财债券型证券投资基金基金合同	中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站	2020-05-30
7	大成月添利理财债券 2019 年年度报告	中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站	2020-04-29
8	大成基金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	中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站	2020-04-25
9	大成月添利理财债券基金劳动节假期前暂停申购及基金转换转入业务公告	中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站	2020-04-23
10	大成月添利理财债券 2020 年第一季度报告	中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站	2020-04-21
11	大成月添利理财债券基金清明节假期前暂停申购及基金转换转入业务公告	中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站	2020-03-31
12	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	中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站	2020-03-25
13	大成基金管理有限公司关于注销南京分公司的公告	中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站	2020-03-21
14	大成基金管理有限公司关于注销青岛分公司的公告	中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站	2020-02-29
15	大成基金关于 APP 交易平台汇款交易费率优惠的公告	中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站	2020-02-26
16	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	中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站	2020-01-30
17	大成月添利理财债券基金春节假期前暂停申购及基金转换转入业务公告	中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站	2020-01-17
18	大成月添利理财债券 2019 年第四季度报告	中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站	2020-01-17

§ 12 影响投资者决策的其他重要信息

12.1 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	20200714-20200805	71,402,866.22	972,173.61	72,375,039.83	-	-
	2	20200616-20200713	1,050,123,988.08	14,287,260.62	1,064,411,248.70	-	-
	3	20200101-20200622	3,201,911,580.59	34,669,358.41	3,236,580,939.00	-	-
	4	20200707-20200723	200,000,000.00	2,513,349.42	202,513,349.42	-	-
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。							

12.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§ 13 备查文件目录

13.1 备查文件目录

- 1、中国证监会批准设立大成月添利理财债券型证券投资基金的文件；
- 2、《大成月添利理财债券型证券投资基金基金合同》；
- 3、《大成月添利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。

13.2 存放地点

备查文件存放在本基金管理人和托管人的住所。

13.3 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

2021 年 3 月 30 日