大成添利宝货币市场基金
2022年第2季度报告

2022年6月30日

基金管理人：大成基金管理有限公司

基金托管人：兴业银行股份有限公司

报告送出日期：2022年7月20日

§1 重要提示

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

基金托管人兴业银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2022 年 07 月 19 日复核了本报告中的财务指标、净值表现和投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2022 年 04 月 01 日起至 06 月 30 日止。

§2 基金产品概况

基金简称	大成添利宝货币		
基金主代码	000724		
基金运作方式	契约型开放式		
基金合同生效日	2014 年 7 月 28 日		
报告期末基金份额总额	2,464,661,001.10 份		
投资目标	在保持本金安全和资产流动性基础上追求较高的当期收益		
投资策略	本基金运用利率趋势评估策略、类属配置策略、平均剩余期限配置策略、银行协议存款和大额存单投资策略、流动性管理策略进行投资管理，以实现超越投资基准的投资目标。		
业绩比较基准	银行活期存款利率（税后）		
风险收益特征	本基金为货币市场基金，为证券投资基金中的低风险品种。本基金长期的风险和预期收益低于股票型基金、混合型基金、债券型基金。		
基金管理人	大成基金管理有限公司		
基金托管人	兴业银行股份有限公司		
下属分级基金的基金简称	大成添利宝货币 A	大成添利宝货币 B	大成添利宝货币 E
下属分级基金的交易代码	000724	000725	000726
报告期末下属分级基金的份额总额	7,278,139.20 份	1,337,325,314.64 份	1,120,057,547.26 份

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位：人民币元

主要财务指标	报告期（2022 年 4 月 1 日-2022 年 6 月 30 日）		
	大成添利宝货币 A	大成添利宝货币 B	大成添利宝货币 E
1.本期已实现收益	28,421.72	11,243,208.34	4,872,888.26
2.本期利润	28,421.72	11,243,208.34	4,872,888.26
3.期末基金资产净值	7,278,139.20	1,337,325,314.64	1,120,057,547.26

注：本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用和信用减值损失后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益，由于货币市场基金采用摊余成本法核算，因此，公允价值变动收益为零，本期已实现收益和本期利润的金额相等。

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值收益率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

大成添利宝货币 A

阶段	净值收益率①	净值收益率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①－③	②－④
过去三个月	0.3850%	0.0011%	0.0873%	0.0000%	0.2977%	0.0011%
过去六个月	0.8609%	0.0011%	0.1736%	0.0000%	0.6873%	0.0011%
过去一年	1.7870%	0.0012%	0.3500%	0.0000%	1.4370%	0.0012%
过去三年	5.9014%	0.0013%	1.0500%	0.0000%	4.8514%	0.0013%
过去五年	13.2937%	0.0025%	1.7500%	0.0000%	11.5437%	0.0025%
自基金合同生效起至今	25.0275%	0.0074%	2.7741%	0.0000%	22.2534%	0.0074%

大成添利宝货币 B

阶段	净值收益率①	净值收益率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①－③	②－④
过去三个月	0.4449%	0.0011%	0.0873%	0.0000%	0.3576%	0.0011%
过去六个月	0.9808%	0.0011%	0.1736%	0.0000%	0.8072%	0.0011%
过去一年	2.0314%	0.0012%	0.3500%	0.0000%	1.6814%	0.0012%
过去三年	6.6700%	0.0013%	1.0500%	0.0000%	5.6200%	0.0013%
过去五年	14.6665%	0.0025%	1.7500%	0.0000%	12.9165%	0.0025%
自基金合同生效起至今	27.4473%	0.0074%	2.7741%	0.0000%	24.6732%	0.0074%

大成添利宝货币 E

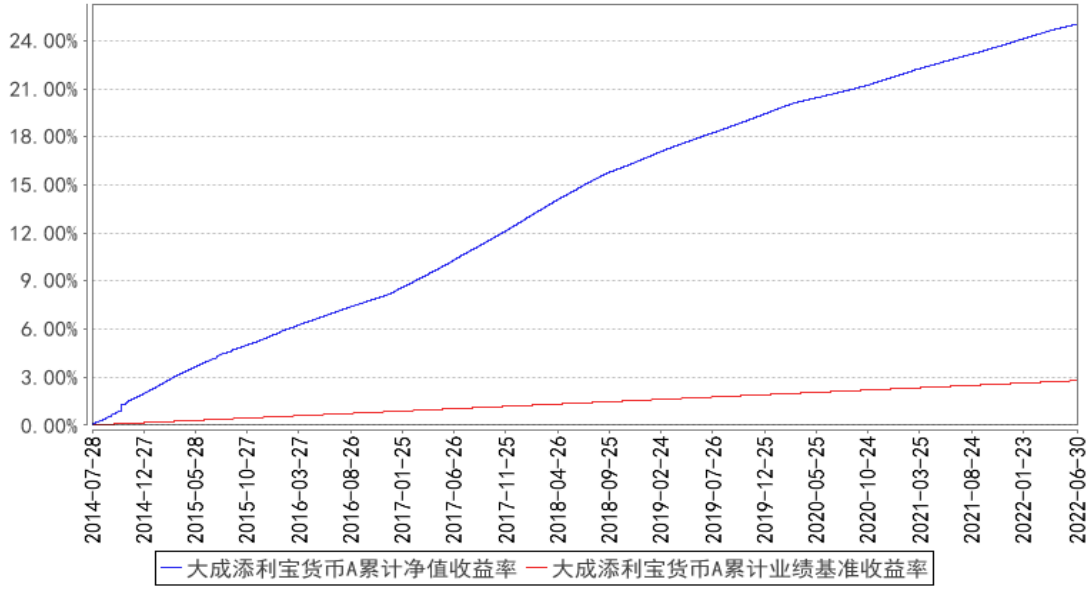
阶段	净值收益率①	净值收益率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①－③	②－④

过去三个月	0.4098%	0.0011%	0.0873%	0.0000%	0.3225%	0.0011%
过去六个月	0.9107%	0.0011%	0.1736%	0.0000%	0.7371%	0.0011%
过去一年	1.8886%	0.0012%	0.3500%	0.0000%	1.5386%	0.0012%
过去三年	6.2227%	0.0013%	1.0500%	0.0000%	5.1727%	0.0013%
过去五年	13.8662%	0.0025%	1.7500%	0.0000%	12.1162%	0.0025%
自基金合同生效起至今	26.0427%	0.0074%	2.7741%	0.0000%	23.2686%	0.0074%

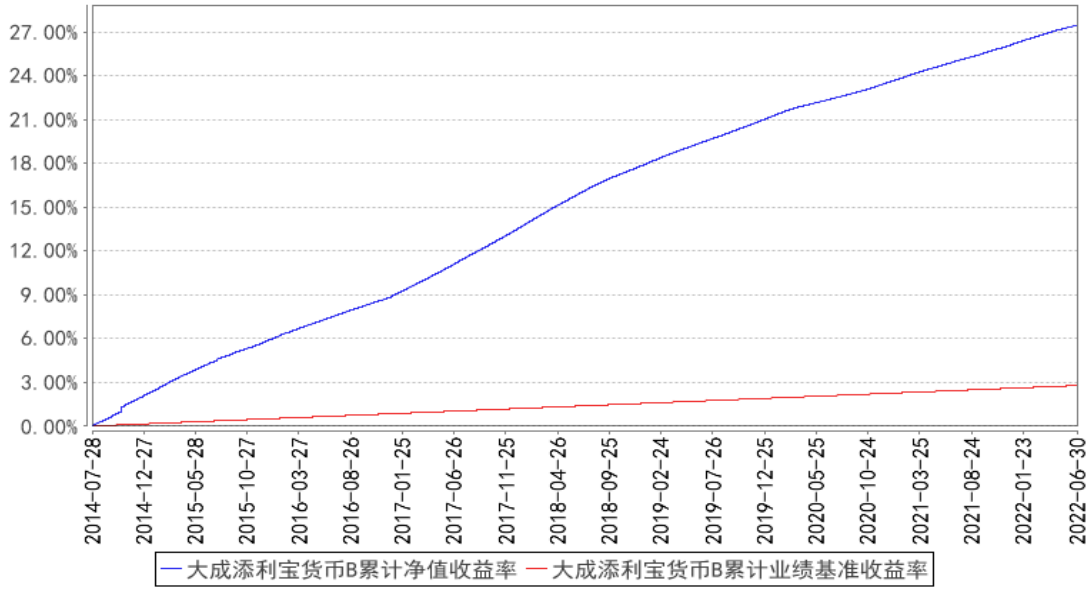
注：本货币基金收益分配按日结转份额。

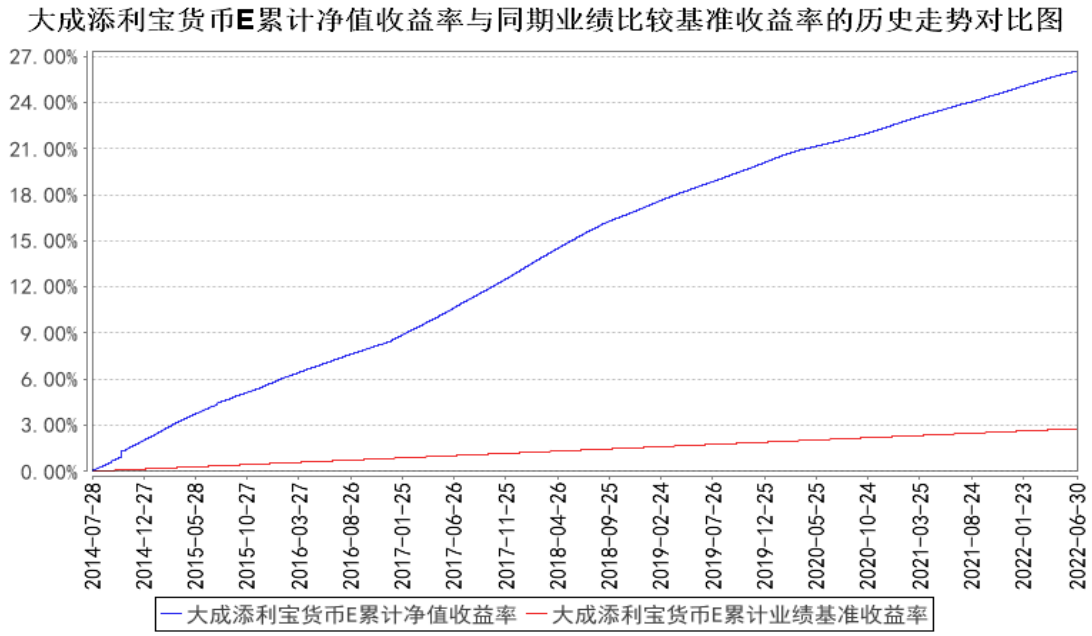
3.2.2 自基金合同生效以来基金累计净值收益率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

大成添利宝货币A累计净值收益率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



大成添利宝货币B累计净值收益率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图





注：本基金合同规定，基金管理人应当自基金合同生效之日起 6 个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的约定。建仓期结束时，本基金的投资组合比例符合基金合同的约定。

§4 管理人报告

4.1 基金经理（或基金经理小组）简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
陈会荣	本基金基金经理，固定收益总部副总监	2018 年 3 月 14 日	-	15 年	中央财经大学经济学学士。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、固定收益总部总监助理，现任固定收益总部副总监。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 日起任大成月添利一个月滚动持有中短债债券型证券投资基金（原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基金经理。2020 年 7 月 1 日至 2021 年 11 月 12 日任大成惠益纯债债券型证券投资基金基金经理。2020 年 8 月 17 日至 2022 年 3 月 4 日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。

4.2 报告期内本基金运作遵规守信情况说明

报告期内，本基金管理人严格遵守《证券法》、《证券投资基金法》等有关法律法规及基金合同、基金招募说明书等有关基金法律文件的规定，以取信于市场、取信于社会投资公众为宗旨，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在规范基金运作和严格控制投资风险的前提下，为基金份额持有人谋求最大利益，无损害基金份额持有人利益的行为。

4.3 公平交易专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

报告期内，基金管理人严格执行了公平交易的原则和制度。基金管理人运用统计分析方法和工具，对旗下所有投资组合间连续 4 个季度的日内、3 日内及 5 日内股票及债券交易同向交易价差进行分析，针对同一基金经理管理的多个投资组合及公私募兼任基金经理管理的多个投资组合的投资交易行为加强了公平交易监测与分析，包括对不同时间窗下（同日、3 日、5 日、10 日）反向交易和同向交易价差监控的分析。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投资策略差异、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，同时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。主动投资组合间不存在同日反向交易。主动型投资组合与指数型投资组合之间或指数型投资组合之间存在股票同日反向交易，但不存在参与交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量超过该股当日成交量 5%的情形；投资组合间相邻交易日反向交易的市场成交比例、成交均价等交易结果数据表明该类交易不对市场产生重大影响，无异常。

4.4 报告期内基金的投资策略和运作分析

2022 年二季度，为应对局部新冠疫情显著反弹对生产投资消费产生的较大影响，央行采取了合理充裕略高的货币政策，同时叠加留抵退税等财政前置措施等因素，资金中枢大幅下移，整个二季度，隔夜回购利率均值约为 1.51%，较上季度下行近 50BP，7 天回购加权利率均值约为 1.85%，较上季度下行 44BP。3 个月 AAA 存单收益率下行 55BP，3 个月 AA+存单收益率下行 55BP，1 年 AAA 存单收益率下行 28BP，1 年 AA+存单收益率下行 28BP，1 年期金融债收益率下行 27BP，1 年 AAA 短期融资券下行约 27bp，1 年 AA+短融品种下行约 27bp。

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

4.5 报告期内基金的业绩表现

本报告期大成添利宝货币 A 的基金份额净值收益率为 0.3850%,本报告期大成添利宝货币 B 的基金份额净值收益率为 0.4449%,本报告期大成添利宝货币 E 的基金份额净值收益率为 0.4098%,同期业绩比较基准收益率为 0.0873%。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

无。

§5 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额（元）	占基金总资产的比例（%）
1	固定收益投资	963,152,601.02	39.05
	其中：债券	963,152,601.02	39.05
	资产支持证券	-	-
2	买入返售金融资产	949,443,074.93	38.50

	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	549,545,819.09	22.28
4	其他资产	4,079,610.01	0.17
5	合计	2,466,221,105.05	100.00

5.2 报告期债券回购融资情况

序号	项目	占基金资产净值的比例（%）	
1	报告期内债券回购融资余额	0.48	
	其中：买断式回购融资	-	
序号	项目	金额（元）	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

本报告期内，本基金债券正回购的资金余额未超过基金资产净值的 20%。

5.3 基金投资组合平均剩余期限

5.3.1 投资组合平均剩余期限基本情况

项目	天数
报告期末投资组合平均剩余期限	32
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	43
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	9

报告期内投资组合平均剩余期限超过 120 天情况说明

本报告期内，本基金投资组合平均剩余期限未超过 120 天。

5.3.2 报告期末投资组合平均剩余期限分布比例

序号	平均剩余期限	各期限资产占基金资产净值的比例（%）	各期限负债占基金资产净值的比例（%）
1	30 天以内	71.74	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
2	30 天（含）—60 天	5.26	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
3	60 天（含）—90 天	15.00	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动	-	-

	利率债		
4	90 天（含）—120 天	6.90	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
5	120 天（含）—397 天（含）	0.81	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
合计		99.70	-

5.4 报告期内投资组合平均剩余存续期超过 240 天情况说明

无。

5.5 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	摊余成本（元）	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	103,424,285.48	4.20
2	央行票据	-	-
3	金融债券	40,785,255.67	1.65
	其中：政策性金融债	40,785,255.67	1.65
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	130,244,908.31	5.28
6	中期票据	-	-
7	同业存单	688,698,151.56	27.94
8	其他	-	-
9	合计	963,152,601.02	39.08
10	剩余存续期超过 397 天的浮动利率债券	-	-

5.6 报告期末按摊余成本占基金资产净值比例大小排名的前十名债券投资明细

序号	债券代码	债券名称	债券数量（张）	摊余成本（元）	占基金资产净值比例（%）
1	112115208	21 民生银行 CD208	2,000,000	199,750,308.71	8.10
2	170014	17 附息国债 14	1,000,000	103,424,285.48	4.20
3	072210099	22 招商证券 CP004	1,000,000	100,017,493.39	4.06
4	112111166	21 平安银行 CD166	1,000,000	99,870,847.62	4.05
5	112105166	21 建设银行 CD166	1,000,000	99,718,116.13	4.05
6	112109252	21 浦发银行 CD252	1,000,000	99,697,217.50	4.05
7	112282323	22 重庆农村商行 CD139	500,000	49,928,363.00	2.03
8	210211	21 国开 11	400,000	40,785,255.67	1.65

9	112216002	22 上海银行 CD002	400,000	39,987,782.79	1.62
10	112185579	21 中原银行 CD253	300,000	29,959,648.91	1.22

5.7 “影子定价”与“摊余成本法”确定的基金资产净值的偏离

项目	偏离情况
报告期内偏离度的绝对值在 0.25（含）-0.5%间的次数	0
报告期内偏离度的最高值	0.0373%
报告期内偏离度的最低值	-0.0020%
报告期内每个工作日偏离度的绝对值的简单平均值	0.0179%

报告期内负偏离度的绝对值达到 0.25%情况说明

无。

报告期内正偏离度的绝对值达到 0.5%情况说明

无。

5.8 报告期末按摊余成本占基金资产净值比例大小排名的前十名资产支持证券投资明细

无。

5.9 投资组合报告附注

5.9.1 基金计价方法说明

本基金估值采用摊余成本法估值,即估值对象以买入成本列示，按票面利率或协议利率并考虑其买入时的溢价与折价，在其剩余存续期内按照实际利率法每日计提损益。本基金通过每日计算基金收益并分配的方式，使基金份额净值保持在人民币 1.00　元。

5.9.2 本基金投资的前十名证券的发行主体本期是否出现被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形

1、本基金投资的前十名证券之一 21 建设银行 CD166（112105166.IB）的发行主体中国建设银行股份有限公司于 2021 年 8 月 13 日因占压财政存款或者资金等，受到中国人民银行处罚（银罚字〔2021〕22 号），于 2022 年 3 月 21 日因贸易融资业务 EAST 数据存在偏差等，受到中国银行保险监督管理委员会处罚（银保监罚决字〔2022〕14 号）。本基金认为，对建设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 21 民生银行 CD208（112115208.IB）的发行主体中国民生

银行股份有限公司于2021年7月13日因监管发现问题屡查屡犯等，受到中国银行保险监督管理委员会处罚（银保监罚决字〔2021〕26号），于2022年3月21日因未报送贸易融资业务EAST数据等，受到中国银行保险监督管理委员会处罚（银保监罚决字〔2022〕20号）。本基金认为，对民生银行的处罚不会对其投资价值构成实质性负面影响。

3、本基金投资的前十名证券之一21浦发银行CD252（112109252.IB）的发行主体上海浦东发展银行股份有限公司于2021年7月13日因监管发现的问题屡查屡犯等，受到中国银行保险监督管理委员会处罚（银保监罚决字〔2021〕27号），于2022年3月21日因漏报逾期90天以上贷款余额EAST数据等，受到中国银行保险监督管理委员会处罚(银保监罚决字〔2022〕25号)。本基金认为，对浦发银行的处罚不会对其投资价值构成实质性负面影响。

4、本基金投资的前十名证券之一21平安银行CD166（112111166.IB）的发行主体平安银行股份有限公司于2022年3月21日因不良贷款余额EAST数据存在偏差等，受到中国银行保险监督管理委员会处罚（银保监罚决字〔2022〕24号）。本基金认为，对平安银行的处罚不会对其投资价值构成实质性负面影响。

5、本基金投资的前十名证券之一21国开11（210211.IB）的发行主体国家开发银行于2022年3月21日因未报送逾期90天以上贷款余额EAST数据等，受到中国银行保险监督管理委员会处罚（银保监罚决字〔2022〕8号）。本基金认为，对国家开发银行的处罚不会对其投资价值构成实质性负面影响。

6、本基金投资的前十名证券之一22上海银行CD002（112216002.IB）的发行主体上海银行股份有限公司于2022年2月14日因2015年3月至7月，该行同业投资业务违规接受第三方金融机构担保，受到中国银行保险监督管理委员会上海监管局处罚（沪银保监罚决字〔2022〕13号）。本基金认为，对上海银行的处罚不会对其投资价值构成实质性负面影响。

7、本基金投资的前十名证券之一22重庆农村商行CD139（112282323.IB）的发行主体重庆农村商业银行股份有限公司于2022年6月8日因未按照规定履行客户身份识别义务等，受到中国人民银行重庆营业管理部处罚（渝银罚〔2022〕2 号）。本基金认为，对重庆农商行的处罚不会对其投资价值构成实质性负面影响。

5.9.3 其他资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	-
2	应收证券清算款	-
3	应收利息	-
4	应收申购款	4,079,610.01
5	其他应收款	-

6	其他	-
7	合计	4,079,610.01

5.9.4 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入原因，分项之和与合计可能有尾差。

§6 开放式基金份额变动

单位：份

项目	大成添利宝货币 A	大成添利宝货币 B	大成添利宝货币 E
报告期期初基金份额总额	4,468,899.62	2,674,724,440.61	1,235,519,809.47
报告期期间基金总申购份额	9,398,071.12	3,405,887,365.54	685,848,789.42
报告期期间基金总赎回份额	6,588,831.54	4,743,286,491.51	801,311,051.63
报告期期末基金份额总额	7,278,139.20	1,337,325,314.64	1,120,057,547.26

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

无。

§8 影响投资者决策的其他重要信息

8.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

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	20220406-20220413	1,000,110,072.63	749,044.40	1,000,859,117.03	-	-
	2	20220616-20220630	-	700,858,645.01	-	700,858,645.01	28.44
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。							

8.2 影响投资者决策的其他重要信息

1.根据我司发布的《大成基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告》，经大成基金管理有限公司第七届董事会第十四次会议审议通过并履行必要程序，自 2022 年 4 月 15 日起，周立新先生因工作安排离任公司副总经理。具体事宜详见公司公告。

2.根据我司发布的《大成基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告》，经大成基金管理有限公司第七届董事会第十五次会议审议通过并履行必要程序，自 2022 年 6 月 1 日起，赵冰女士担任公司副总经理，段皓静女士担任公司督察长。自同日起赵冰女士离任公司督察长。具体事宜详见公司公告。

§9 备查文件目录

9.1 备查文件目录

1、中国证监会批准设立大成添利宝货币市场基金的文件；

2、《大成添利宝货币市场基金基金合同》；

3、《大成添利宝货币市场基金托管协议》；

4、大成基金管理有限公司批准文件、营业执照、公司章程；

5、本报告期内在规定报刊上披露的各种公告原稿。

9.2 存放地点

备查文件存放在本基金管理人和托管人的办公住所。

9.3 查阅方式

投资者可在营业时间免费查阅，或登录本基金管理人网站 http://www.dcfund.com.cn 进行查阅。

大成基金管理有限公司
2022 年 7 月 20 日