大成添利宝货币市场基金

【2015】半年度报告摘要

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
送出日期:2015年8月27日

§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。本半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。

基金托管人兴业银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2015年8月25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。

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。

本半年度报告摘要摘自半年度报告正文,投资者欲了解详细内容,应阅读半年度报告正文。

本报告中财务资料未经审计 。

本报告期自2015年01月01日起至06月30日止。

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金简称	大成添利宝货币		
基金主代码	000724		
交易代码	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		
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		
报告期末基金份额总额	122,673,737.74份		
基金合同存续期	不定期		
下属分级基金的基金简称:	大成添利宝A	大成添利宝B	大成添利宝E
下属分级基金的交易代码:	000724	000725	000726
报告期末下属分级基金的份额总额	2,657,318.44份	73,829,142.87份	46,187,276.43份

2.2 基金产品说明

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。

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	兴业银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	杜鹏	张志永
	联系电话	0755-83183388	021-62677777
	电子邮箱	dupeng@dcfund.com.cn	zhangzhy@cib.com.cn
客户服务电话		4008885558	95561

2.4 信息披露方式

登载基金半年度报告正文的管理人互联网网址	http://www.dcfund.com.cn
基金半年度报告备置地点	深圳市福田区深南大道7088号招商银行大厦32层大成基金管理有限公司 上海江宁路168号兴业大厦20楼兴业银行股份有限公司

§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

基金级别	大成添利宝A	大成添利宝B	大成添利宝E
3.1.1 期间数据和指标	报告期(2015年1月1日 - 2015年6月30日)	报告期(2015年1月1日 - 2015年6月30日)	报告期(2015年1月1日 - 2015年6月30日)
本期已实现收益	28,931.96	1,197,128.00	991,095.74
本期利润	28,931.96	1,197,128.00	991,095.74
本期净值收益率	1.9125%	2.0344%	1.9634%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2015年6月30日)		
期末基金资产净值	2,657,318.44	73,829,142.87	46,187,276.43
期末基金份额净值	1.0000	1.0000	1.0000

注:1、本基金根据每日基金收益公告,以每万份基金份额收益为基准,为投资人每日计算收益并分配。

2、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	0.2823%	0.0005%	0.0288%	0.0000%	0.2535%	0.0005%
过去三个月	0.8802%	0.0010%	0.0873%	0.0000%	0.7929%	0.0010%
过去六个月	1.9125%	0.0014%	0.1736%	0.0000%	1.7389%	0.0014%
自基金合同生效起至今	3.9557%	0.0189%	0.3241%	0.0000%	3.6316%	0.0189%

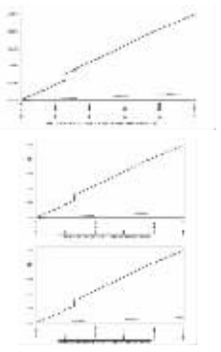
大成添利宝B

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	0.3018%	0.0005%	0.0288%	0.0000%	0.2730%	0.0005%
过去三个月	0.9410%	0.0010%	0.0873%	0.0000%	0.8537%	0.0010%
过去六个月	2.0344%	0.0014%	0.1736%	0.0000%	1.8608%	0.0014%
自基金合同生效起至今	4.1920%	0.0189%	0.3241%	0.0000%	3.8679%	0.0189%

大成添利宝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	0.2902%	0.0005%	0.0288%	0.0000%	0.2614%	0.0005%
过去三个月	0.9056%	0.0010%	0.0873%	0.0000%	0.8183%	0.0010%
过去六个月	1.9634%	0.0014%	0.1736%	0.0000%	1.7898%	0.0014%
自基金合同生效起至今	4.0572%	0.0189%	0.3241%	0.0000%	3.7331%	0.0189%

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



注:1、本基金合同生效日为2014年7月28日,截至报告期末本基金合同生效未满一年。

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。目前公司由四家股东组成,分别为中泰信托有限责任公司(48%)、光大证券股份有限公司(25%)、中国银河投资管理有限公司(25%)、广东证券股份有限公司(2%)。截至2015年6月30日,本基金管理人共管理5只ETF及1只ETF联接基金:大成中证100交易型开放式指数证券投资基金、深证成长40交易型开放式指数证券投资基金及大成深证成长40交易型开放式指数证券投资基金联接基金、中证500深市交易型开放式指数证券投资基金、中证500沪市交易型开放式指数证券投资基金、大成深证成份交易型开放式指数证券投资基金,2只QDII基金:大成标普500等权重指数证券投资基金、大成纳斯达克100指数证券投资基金及51只开放式证券投资基金:大成景丰债券型证券投资基金(LOF)、大成价值增长证券投资基金、大成债券投资基金、大成蓝筹稳健证券投资基金、大成精选增值混合型证券投资基金、大成货币市场证券投资基金、大成沪深300指数证券投资基金、大成财富管理2020生命周期证券投资基金、大成积极成长混合型证券投资基金、大成创新成长混合型证券投资基金(LOF)、大成景阳领先混合型证券投资基金、大成强化收益定期开放债券型证券投资基金、大成策略回报混合型证券投资基金、大成行业轮动混合型证券投资基金、大成中证红利指数证券投资基金、大成核心双动力混合型证券投资基金、大成竞争优势混合型证券投资基金、大成景恒保本混合型证券投资基金、大成内需增长混合型证券投资基金、大成可转债增强债券型证券投资基金、大成消费主题混合型证券投资基金、大成新锐产业混合型证券投资基金、大成优选混合型证券投资基金(LOF)、大成月添利理财债券型证券投资基金、大成现金增利货币市场证券投资基金、大成月月盈短期理财债券型证券投资基金、大成现金宝场内实时申赎货币市场基金、大成景安短融债券型证券投资基金、大成景兴信用债券型证券投资基金、大成景旭纯债债券型证券投资基金、大成景祥分级债券型证券投资基金、大成信用增利一年定期开放债券型证券投资基金、大成健康产业混合型证券投资基金、大成中小盘混合型证券投资基金(LOF)、大成灵活配置混合型证券投资基金、大成丰财宝货币市场基金、大成景益平稳收益混合型证券投资基金、大成添利宝货币市场基金、大成景利混合型证券投资基金、大成产业升级股票型证券投资基金(LOF)、大成高新技术产业股票型证券投资基金、大成景秀灵活配置混合型证券投资基金、大成互联网思维混合型证券投资基金、大成景明灵活配置混合型证券投资基金、大成景穗灵活配置混合型证券投资基金、大成景鹏灵活配置混合型证券投资基金、大成睿景灵活配置混合型证券投资基金、大成景源灵活配置混合型证券投资基金基金、大成景裕灵活配置混合型证券投资基金、大成中证互联网金融指数分级证券投资基金及大成正向回报灵活配置混合型证券投资基金 (本基金2015年7月8日成立)等。

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		
屈伟南先生	本基金基金经理	2014年7月28日	2015年6月30日	13年	工商管理硕士。曾任职于郑州纺织工学院,融通基金管理有限公司。2006年3月加入大成基金管理有限公司,历任基金会计、固定收益研究员、基金经理助理。2013年2月1日至2014年9月11日任大成理财21天债券型发起式证券投资基金基金经理。2013年3月27日至2015年6月30日任大成现金宝场内实时申赎货币市场基金基金经理。2013年11月19日至2015年5月26日任大成景祥分级债券型证券投资基金基金经理。2014年6月18日至2015年6月30日任大成丰财宝货币市场基金基金经理。2014年7月28日至2015年6月30日任大成添利宝货币市场基金基金经理。2014年9月12日至2015年6月30日任大成月月盈短期理财债券型证券投资基金基金经理。具有基金从业资格。国籍:中国
黄海峰先生	本基金基金经理	2015年3月21日	-	11年	南开大学经济学学士、2013年7月加入大成基金管理有限公司固定收益部。2013年10月14日起任大成现金宝场内实时申赎货币市场基金基金经理助理。2013年10月28日起大成景恒保本混合型证券投资基金基金经理助理。2014年3月18日起任大成强化收益债券型证券投资基金基金经理助理。2014年3月18日至2014年12月23日任大成货币市场证券投资基金基金经理助理。2014年6月23日至2014年12月23日任大成丰财宝货币市场基金基金经理助理。2014年6月26日起任大成景益平稳收益混合型证券投资基金基金经理助理。2014年12月24日起,任大成货币市场证券投资基金基金经理及大成丰财宝货币市场基金基金经理。2015年3月21日起,任大成添利宝货币市场基金及大成景兴信用债债券型证券投资基金基金经理。2015年3月27日起, 任大成景秀灵活配置混合型证券投资基金基金经理。2015年4月29日起,任大成景明灵活配置混合型证券投资基金基金经理。2015年5月4日起,任大成景穗灵活配置混合型证券投资基金基金经理。2015年5月15日起,任大成景源灵活配置混合型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。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

本报告期内,本基金管理人严格遵守《证券法》、《证券投资基金法》、《大成添利宝货币市场基金基金合同》和其他有关法律法规的规定,在基金管理运作中,大成添利宝货币市场基金的投资范围、投资比例、投资组合、证券交易行为、信息披露等符合有关法律法规、行业监管规则和基金合同等规定,本基金没有发生重大违法违规行为,没有运用基金财产进行内幕交易和操纵市场行为以及进行有损基金投资人利益的关联交易,整体运作合法、合规。本基金将继续以取信于市场、取信于社会投资公众为宗旨,承诺将一如既往地本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金财产,在规范基金运作和严格控制投资风险的前提下,努力为基金份额持有人谋求最大利益。

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分析及相应交易情形的分析结果表明: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些组合间的成交价格差异较大。结合交易价差分布统计分析和潜在利益输送金额统计结果表明投资组合间不存在利益输送的可能性。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

公司风险管理部定期对公司旗下所有投资组合间同向交易、反向交易等可能存在异常交易的行为进行分析。2015上半年公司旗下主动投资组合间股票交易存在40笔同日反向交易,原因是投资组合投资策略需要。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,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%的仅有1笔,原因为投资策略需要;投资组合间存在1笔债券同日反向交易,原因为投资策略需要。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;投资组合间虽然存在同向交易行为,但结合交易价差分布统计分析和潜在利益输送金额统计结果表明投资组合间不存在利益输送的可能性。

4.4 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

2015年上半年,经济增长持续低迷,GDP同比增速仅为7%。上半年CPI同比增长1.3%,通胀水平总体可控。PPI同比增长-4.6%,跌幅继续扩大。在此背景下,监管层调整政策对冲经济下行风险和通缩风险的频率加快,货币政策方面,2015年上半年中央银行分别两次降低基准利率和存款准备金率,引导银行间回购利率和社会融资成本下行。此外,监管机构通过放松房地产政策提高房地产市场的成交活跃度,以期稳定房地产投资。

在宽松货币政策的指引下, 各类货币市场利率在二季度出现快速下行。7天回购均值由一季度的4.36%快速下降至2.5%。1年期金融债收益率和各评级短融收益率下行超过100bp,1-3个月shibor利率报价下行超过150bp,同业存款报价也多数为减点。

上半年本基金在投资管理过程中继续贯彻稳健操作的原则,高度重视组合的流动性管理和安全性管理。具体来说,本基金在和持有人积极沟通的基础上,灵活管理组合现金流的到期分布情况,并提高了短融的仓位。并把握半年末等关键时点进行了银行存款和逆回购投资。此外,本基金在一级市场进行了积极的投标,获取了良好的投资收益。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

报告期内本基金A类净值收益率为1.9125%,B类净值收益率2.0344%,E类净值收益率1.9634%%,期间业绩比较基准收益率为0.1736%。

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2015年下半年,在经济疲弱和股市去杠杆带来的风险偏好下降的背景下,债券市场总体面临的风险较小。本基金在三季度将在稳健操作的原则下,基于市场状况以及投资人结构变化的判断,合理安排逆回购、存款、短融及金融债的投资比例,以期为持有人获得稳定安全的回报。

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、风险管理部、基金运营部、监察稽核部、专户投资部指定人员组成。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两名投资组合经理。

股票投资部、研究部、固定收益总部、风险管理部和专户投资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;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,基金经理及投资经理作为估值小组成员,对本基金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/中证指数有限公司签署服务协议, 由其按约定提供在银行间同业市场交易的债券品种/在交易所市场上市交易或挂牌转让的固定收益品种 (估值处理标准另有规定的除外)的估值数据。

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公告,以每万份基金份额收益为基准,为投资人每日计算收益并分配。本报告期内本基金应分配利润2,217,155.70元,报告期内已分配利润2,217,155.70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

报告期内,本托管人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定,诚信、尽责地履行了基金托管人义务,不存在损害本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遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

报告期内,本托管人根据国家有关法律法规、基金合同和托管协议的规定,对基金管理人在本基金的投资运作、基金资产净值的计算、基金收益的计算、基金费用开支等方面进行了必要的监督、复核和审查,未发现其存在任何损害本基金份额持有人利益的行为;基金管理人在报告期内,严格遵守了《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 托管人对本半年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人认真复核了本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、投资组合报告等内容,认为其真实、准确和完整,不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

§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:大成添利宝货币市场基金

报告截止日:2015年6月30日

单位:人民币元

资 产	本期末 2015年6月30日	上年度末 2014年12月31日
资 产:		
银行存款	44,362,687.62	67,824,000.88
结算备付金	50,000.00	19,500.00
存出保证金	-	-
交易性金融资产	50,004,014.03	39,943,944.37
其中:股票投资	-	-
基金投资	-	-
债券投资	50,004,014.03	39,943,944.37
资产支持证券投资	-	-
贵金属投资	-	-
衍生金融资产	-	-
买入返售金融资产	36,800,296.20	-
应收证券清算款	-	-
应收利息	1,098,510.72	656,705.68
应收股利	-	-
应收申购款	601,933.34	3,551,155.61
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	196.00
资产总计	132,917,440.91	111,995,502.54
负债和所有者权益	本期末 2015年6月30日	上年度末 2014年12月31日
负 债:		
短期借款	-	-
交易性金融负债	-	-
衍生金融负债	-	-
卖出回购金融资产款	9,999,875.00	-
应付证券清算款	-	-
应付赎回款	-	-
应付管理人报酬	20,780.53	26,027.85
应付托管费	8,312.25	10,411.18
应付销售服务费	7,235.88	4,368.99
应付交易费用	5,086.27	9,880.04
应交税费	-	-
应付利息	481.16	-
应付利润	12,266.98	11,317.25
递延所得税负债	-	-
其他负债	189,665.10	131,730.17
负债合计	10,243,703.17	193,735.48
所有者权益:		
实收基金	122,673,737.74	111,801,767.06
未分配利润	-	-
所有者权益合计	122,673,737.74	111,801,767.06
负债和所有者权益合计	132,917,440.91	111,995,502.54

注:报告截止日2015年6月30日,A级基金份额净值人民币1.00元,基金份额总额2,657,318.44份;B级基金份额净值人民币1.00元,基金份额总额73,829,142.87份;E级基金份额净值人民币1.00元,基金份额总额46,187,276.43份。基金份额总额122,673,737.74份。

6.2 利润表

会计主体:大成添利宝货币市场基金

本报告期:2015年1月1日至2015年6月30日

单位:人民币元

资 产	本期 2015年1月1日至2015年6月30日
一、收入	2,631,351.31
1.利息收入	2,611,181.37
其中:存款利息收入	1,424,580.02
债券利息收入	779,339.60
资产支持证券利息收入	-
买入返售金融资产收入	407,261.75
其他利息收入	-
2.投资收益(损失以"-"填列)	20,169.94
其中:股票投资收益	-
基金投资收益	-
债券投资收益	20,169.94
资产支持证券投资收益	-
贵金属投资收益	-
衍生工具收益	-
股利收益	-
3.公允价值变动收益(损失以"-"号填列)	-
4.汇兑收益(损失以"-"号填列)	-
5.其他收入(损失以"-"号填列)	-
减:二、费用	414,195.61
1. 管理人报酬	112,458.69
2. 托管费	44,983.51
3. 销售服务费	43,009.64
4. 交易费用	-
5. 利息支出	45,992.49
其中:卖出回购金融资产支出	45,992.49
6. 其他费用	167,751.28
三、利润总额(亏损总额以"-"号填列)	2,217,155.70
减:所得税费用	-
四、净利润(净亏损以"-"号填列)	2,217,155.70

注:本基金合同生效日为2014 年7月28日,本报告期自2015年1月1日至2015年6月30日止。截至报告日,本基金合同生效未满一年,本报告期的财务报表及报表附注均无同期对比数据,下同。

6.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体:大成添利宝货币市场基金

本报告期:2015年1月1日 至 2015年6月30日

单位:人民币元

项目	本期 2015年1月1日至2015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)	111,801,767.06	-	111,801,767.06
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	2,217,155.70	2,217,155.70
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)	10,871,970.68	-	10,871,970.68
其中:1.基金申购款	310,612,653.69	-	310,612,653.69
2.基金赎回款	-299,740,683.01	-	-299,740,683.01
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)	-	-2,217,155.70	-2,217,155.70
五、期末所有者权益(基金净值)	122,673,737.74	-	122,673,737.74

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:

_____罗登攀_____ _____肖剑_____ _____范瑛_____

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 会计政策和会计估计变更的说明

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一致。

6.4.2 关联方关系

6.4.2.1 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

无。

6.4.2.2 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、注册登记机构、基金销售机构
兴业银行股份有限公司("兴业银行")	基金托管人、基金销售机构
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
中国银河投资管理有限公司	基金管理人的股东
广东证券股份有限公司("广东证券")	基金管理人的股东
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
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

注:1、中国证监会于2005年11月6日作出对广东证券取消业务许可并责令关闭的行政处罚。

2、以下关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.3 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.3.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.3.1.1 股票交易

无。

6.4.3.1.2 权证交易

无。

6.4.3.1.3 应支付关联方的佣金

无。

6.4.3.2 关联方报酬

6.4.3.2.1 基金管理费

单位:人民币元

关联方名称	本期 2015年1月1日至2015年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	112,458.69
其中:支付销售机构的客户维护费	4,437.84

注:本基金的管理费按前一日基金资产净值的0.20%年费率计提。管理费的计算方法如下:

H=E×0.20%÷当年天数

H为每日应计提的基金管理费

E为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计算,逐日累计至每月月末,按月支付,由基金管理人向基金托管人发送基金管理费划款指令,基金托管人复核后于次月前3个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。若遇法定节假日、公休假等,支付日期顺延。

6.4.3.2.2 基金托管费

单位:人民币元

项目	本期 2015年1月1日至2015年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	44,983.51

注:本基金的托管费按前一日基金资产净值的0.08%的年费率计提。托管费的计算方法如下:

H=E×0.08%÷当年天数

H为每日应计提的基金托管费

E为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计算,逐日累计至每月月末,按月支付,由基金管理人向基金托管人发送基金托管费划款指令,基金托管人复核后于次月前3个工作日内从基金财产中一次性支取。若遇法定节假日、公休日等,支付日期顺延。

6.4.3.2.3 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 2015年1月1日至2015年6月30日			
	当期发生的基金应支付的销售服务费			
	大成添利宝A	大成添利宝B	大成添利宝E	合计
大成基金	583.07	2,740.17	33,987.68	37,310.92
兴业银行	0.00	0.00	0.00	0.00
光大证券	26.64	0.00	22.72	49.36
合计	609.71	2,740.17	34,010.40	37,360.28

注:本基金A级基金份额的基金销售服务费按前一日基金资产净值的0.25%的年费率计提,B级基金份额的基金销售服务费按前一日基金资产净值的0.01%的年费率计提,E级基金份额的基金销售服务费按前一日基金资产净值的0.15%的年费率计提。销售服务费计提的计算公式具体如下:

H=E×年销售服务费率÷当年天数

H为每日该类基金份额应计提的基金销售服务费

E为前一日该类基金份额的基金资产净值

基金销售服务费每日计提,按月支付。由基金管理人向基金托管人发送基金销售服务费划付指令,经基金托管人复核后于次月首日起3个工作日内从基金财产中一次性支付给注册登记机构, 由注册登记机构代付给销售机构。

6.4.3.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金本报告期末与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。

6.4.3.4 各关联方投资本基金的情况

6.4.3.4.1 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 2015年1月1日 至2015年6月30日		
	大成添利宝A	大成添利宝B	大成添利宝E
基金合同生效日 (2014年7月28日)持有的基金份额	-	-	-
期初持有的基金份额	-	-	244.17
期间申购/买入总份额	-	-	0.00
期间因拆分变动份额	-	-	0.00
减:期间赎回/卖出总份额	-	-	244.17
期末持有的基金份额	-	-	0.00
期末持有的基金份额占基金总份额比例	-	-	0.0000%

注:基金管理人申赎本基金的费率与本基金法律文件规定一致。

6.4.3.4.2 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

大成添利宝B

份额单位:份

关联方名称	本期末 2015年6月30日		上年度末 2014年12月31日	
	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例
大成创新资本	183,641.98	0.1497%	17,126,247.38	15.3184%

注:基金管理人子公司-大成创新资本申赎本基金的费率与本基金法律文件规定一致。

6.4.3.5 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 2015年1月1日至2015年6月30日	
	期末余额	当期利息收入
兴业银行	2,362,687.62	33,537.74

6.4.3.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期未在承销期内参与关联方承销证券。

6.4.3.7 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期无须作说明的其他关联交易事项。

6.4.4 期末(2015年6月30日)本基金持有的流通受限证券

6.4.4.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

本基金于本报告期末未持有因认购新发/增发证券而流通受限的证券。

6.4.4.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金于本报告期末未持有暂时停牌的股票。

6.4.4.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.4.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末2015年6月30日止,本基金从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额9,999,875.00元,是以如下债券作为质押:

金额单位:人民币元

	债券名称	回购到期日	期末估值单价	数量(张)	期末估值总额
071523002	15长城证券CP002	2015-7-1	100.00	100,000	9,999,801.26
合计				100,000	9,999,801.26

6.4.4.3.2 交易所市场债券正回购

于本报告期末,本基金无从事交易所市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

§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	50,004,014.03	37.62
	其中:债券	50,004,014.03	37.62
	资产支持证券	-	-
2	买入返售金融资产	36,800,296.20	27.69
	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	44,412,687.62	33.41
4	其他各项资产	1,700,444.06	1.28
5	合计	132,917,440.91	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	3.00
	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	9,999,875.00 / 8.15
	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

本报告期内无债券正回购的资金余额超过基金资产净值的20%的情况。

7.1 基金投资组合平均剩余期限

7.1.1 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	71
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	111
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	24

报告期内投资组合平均剩余期限超过180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120天",本报告期内,本基金未发生超标情况。

7.1.2 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	74.25	8.15
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	0.00
2	30天(含)-60天	-	0.00
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	0.00
3	60天(含)-90天	8.16	0.00
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	0.00
4	90天(含)-180天	-	0.00
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	0.00
5	180天(含)-397天(含)	24.45	0.00
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	0.00
合计		106.96	8.15

7.2 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	-	0.00
2	央行票据	-	0.00
3	金融债券	10,009,604.65	8.16
	其中:政策性金融债	10,009,604.65	8.16
4	企业债券	-	0.00
5	企业短期融资券	39,994,409.38