# 大成深证成份交易型开放式指数证券投资基金

## 2018年第四季度报告

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
报告送出日期:2019年1月19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。

基金托管人中国农业银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2019年1月18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2018年10月1日起至12月31日止。

§2 基金产品概况

| | |
|---|---|
| 基金简称 | 大成深证ETF |
| 场内简称 | 深证ETF |
| 基金主代码 | 159943 |
| 交易代码 | 159943 |
| 基金运作方式 | 交易型开放式 |
| 基金合同生效日 | 2015年6月5日 |
| 报告期末基金份额总额 | 26,635,342.00份 |
| 投资目标 | 紧密跟踪标的指数,追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化。 |
| 投资策略 | 本基金采取完全复制法，即按照标的指数的成份股组成及其权重构建股票投资组合,并根据标的指数成份股及其权重的变动进行相应调整。<br>当预期成份股发生调整和成份股发生配股、增发、分红等行为时,或因基金的申购和赎回等对本基金跟踪标的指数的效果可能带来影响时，或因某些特殊情况导致流动性不足时，或其他原因导致无法有效复制和跟踪标的指数时,基金管理人可以对投资组合管理进行适当变通和调整,从而使得投资组合紧密地跟踪标的指数。 |
| 业绩比较基准 | 深证成份指数 |
| 风险收益特征 | 本基金为股票型指数基金,属于较高风险、较高预期收益的基金品种,其风险与预期收益高于混合基金、债券基金与货币市场基金。本基金采用完全复制法跟踪标的指数的表现,具有与标的指数、以及标的指数所代表的股票市场相依的风险收益特征。 |
| 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 |

§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(2018年10月1日 - 2018年12月31日) |
|---|---|
| 1.本期已实现收益 | -843,437.12 |
| 2.本期利润 | -32,532,333.48 |
| 3.加权平均基金份额本期利润 | -1.2344 |
| 4.期末基金资产净值 | 207,841,456.23 |
| 5.期末基金份额净值 | 7.803 |

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。

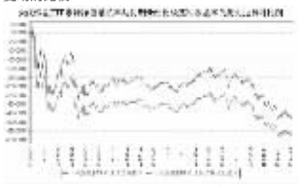
2、所述基金业绩指标不包括持有人交易基金的各项费用,计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

3.2 基金净值表现

3.2.1 本报告期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

| 阶段 | 净值增长率① | 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 | -13.65% | 1.80% | -13.82% | 1.83% | 0.17% | -0.03% |

3.2.2 自基金合同生效以来基金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



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

§4 管理人报告

4.1 基金经理(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 | | |
| 苏秉毅 | 本基金基金经理,数量与指数投资部副总监 | 2015年6月5日 | - | 14年 | 经济学硕士。2004年9月至2008年5月就职于华夏基金管理有限公司基金运作部。2008年加入大成基金管理有限公司,历任产品设计师、高级产品设计师、基金经理助理、基金经理。2012年8月28日至2014年1月23日任大成中证500沪市交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理。2014年1月24日至2014年2月17日任大成融通产业股票型证券投资基金基金经理。2012年2月9日至2014年9月11日任深证成长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基金经理。2012年8月24日起任中证500沪市交易型开放式指数证券投资基金基金经理。2013年1月1日至2015年8月25日任大成沪深300指数证券投资基金基金经理。2013年2月7日起任大成中证100交易型开放式指数证券投资基金基金经理。2015年6月5日起任大成深证成份交易型开放式指数证券投资基金基金经理。2015年6月29日起任大成中证互联网金融指数分级证券投资基金基金经理。2016年3月4日起任大成核心双动力混合型证券投资基金及大成沪深300指数证券投资基金基金经理。2018年6月26日起任大成景恒混合型证券投资基金基金经理。现任数量与指数投资部副总监。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

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

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、业绩评估等与投资管理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,通过多部门的协作互控,保证了公平交易的可操作、可稽核和可持续。

4.3.2 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。2018年4季度公司旗下主动投资组合间股票交易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%的交易情形;投资组合间债券交易不存在同日反向交易;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。

本季度股票市场震荡剧烈,季初便在诸多因素的共同作用下急速下跌,之后监管层及时应对救市,股市随之急剧反弹,之后又再缓步下行至年底。本季度市场基准沪深300指数大幅下跌12.45%,个股表现产生一定的分化。市值因子依然是区分度最为显著的因子,大部分市值较小的股票在季初下跌时实现了局部出清,在之后的超跌反弹行情中也涨幅较高,而大盘蓝筹则在季末因为行业利空消息的缘故表现较差。在行业方面,受经济周期影响较小的农林牧渔、综合等板块表现较好,而强周期行业如钢铁、煤炭等行业则表现不佳,医药行业因为带量采购的影响也跌幅较深。

本基金标的指数深成指下跌13.82%,跌幅略高于大盘。四季度,本基金申购赎回和份额交易情况均较为平稳。本基金基本保持满仓运作,严格根据标的指数成分股调整以及权重的变化及时调整投资组合。本季年化跟踪误差0.56%,日均偏离度0.02%,各项操作与指标均符合基金合同的要求。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末本基金份额净值为7.803元；本报告期基金份额净值增长率为-13.65%,业绩比较基准收益率为-13.82%.

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 | 权益投资 | 205,769,138.54 | 98.80 |
| | 其中:股票 | 205,769,138.54 | 98.80 |
| 2 | 基金投资 | - | - |
| 3 | 固定收益投资 | - | - |
| | 其中:债券 | - | - |
| | 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 | - | - |
| | 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 | 2,494,657.98 | 1.20 |
| 8 | 其他资产 | 6,726.83 | 0.00 |
| 9 | 合计 | 208,270,523.35 | 100.00 |

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.1 报告期末指数投资按行业分类的境内股票投资组合

| 代码 | 行业类别 | 公允价值(元) | 占基金资产净值比例(%) |
|---|---|---|---|
| A | 农、林、牧、渔业 | 6,003,354.72 | 2.89 |
| B | 采矿业 | 1,892,063.01 | 0.91 |
| C | 制造业 | 126,909,495.40 | 61.06 |
| D | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | 2,755,009.41 | 1.33 |
| E | 建筑业 | 2,333,237.98 | 1.12 |
| F | 批发和零售业 | 4,806,710.54 | 2.31 |
| G | 交通运输、仓储和邮政业 | 1,789,079.40 | 0.86 |
| H | 住宿和餐饮业 | - | - |
| I | 信息传输、软件和信息技术服务业 | 19,951,420.26 | 9.60 |
| J | 金融业 | 14,128,108.32 | 6.80 |
| K | 房地产业 | 12,682,467.15 | 6.10 |
| L | 租赁和商务服务业 | 3,386,654.98 | 1.63 |
| M | 科学研究和技术服务业 | 441,120.00 | 0.21 |
| N | 水利、环境和公共设施管理业 | 1,619,624.01 | 0.78 |
| O | 居民服务、修理和其他服务业 | - | - |
| P | 教育 | - | - |
| Q | 卫生和社会工作 | 2,984,856.44 | 1.44 |
| R | 文化、体育和娱乐业 | 3,734,413.32 | 1.80 |
| S | 综合 | 351,523.60 | 0.17 |
| | 合计 | 205,769,138.54 | 99.00 |

5.2.2 报告期末积极投资按行业分类的境内股票投资组合

| 代码 | 行业类别 | 公允价值(元) | 占基金资产净值比例(%) |
|---|---|---|---|
| A | 农、林、牧、渔业 | - | - |
| B | 采矿业 | - | - |
| C | 制造业 | - | - |
| D | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | - | - |
| E | 建筑业 | - | - |
| F | 批发和零售业 | - | - |
| G | 交通运输、仓储和邮政业 | - | - |
| H | 住宿和餐饮业 | - | - |
| I | 信息传输、软件和信息技术服务业 | - | - |
| J | 金融业 | - | - |
| K | 房地产业 | - | - |
| L | 租赁和商务服务业 | - | - |
| M | 科学研究和技术服务业 | - | - |
| N | 水利、环境和公共设施管理业 | - | - |
| O | 居民服务、修理和其他服务业 | - | - |
| P | 教育 | - | - |
| Q | 卫生和社会工作 | - | - |
| R | 文化、体育和娱乐业 | - | - |
| S | 综合 | - | - |
| | 合计 | - | - |

5.2.3 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

无。

5.3 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

5.3.1 报告期末指数投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

| 序号 | 股票代码 | 股票名称 | 数量(股) | 公允价值(元) | 占基金资产净值比例(%) |
|---|---|---|---|---|---|
| 1 | 000651 | 格力电器 | 202,800 | 7,237,932.00 | 3.48 |
| 2 | 000333 | 美的集团 | 195,050 | 7,189,543.00 | 3.46 |
| 3 | 300498 | 温氏股份 | 161,804 | 4,236,028.72 | 2.04 |
| 4 | 000002 | 万科A | 171,600 | 4,087,512.00 | 1.97 |
| 5 | 000858 | 五粮液 | 78,000 | 3,968,640.00 | 1.91 |
| 6 | 002415 | 海康威视 | 148,625 | 3,828,589.00 | 1.84 |
| 7 | 000001 | 平安银行 | 355,900 | 3,338,342.00 | 1.61 |
| 8 | 000725 | 京东方A | 1,100,700 | 2,894,841.00 | 1.39 |
| 9 | 002304 | 洋河股份 | 23,962 | 2,269,680.64 | 1.09 |
| 10 | 300059 | 东方财富 | 165,967 | 2,008,200.70 | 0.97 |

5.3.2 报告期末积极投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名股票投资明细

| 序号 | 股票代码 | 股票名称 | 数量(股) | 公允价值(元) | 占基金资产净值比例(%) |
|---|---|---|---|---|---|
| 1 | 000693 | *ST华泽 | 26,800 | - | 0.00 |

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

无。

5.5 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债券投资明细

无。

5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券投资明细

无。

5.7 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。

5.8 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权证投资明细

无。

5.9 报告期末本基金投资的股指期货投资情况说明

5.9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

无。

5.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

无。

5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.10.1 本期国债期货投资政策

无。

5.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

无。

5.10.3 本期国债期货投资评价

无。

5.11 投资组合报告附注

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

本基金投资的前十名证券之一平安银行(000001.SZ)的发行主体平安银行股份有限公司于2018年7月26日因未按照规定履行客户身份识别义务等,受到中国人民银行处罚(银反洗罚决字(2018)2号)。平安银行为本基金跟踪标的指数的成份股。

5.11.2 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。

基金投资的前十名股票中,没有投资于超出基金合同规定备选股票库之外股票。

5.11.3 其他资产构成

| 序号 | 名称 | 金额(元) |
|---|---|---|
| 1 | 存出保证金 | 6,209.90 |
| 2 | 应收证券清算款 | - |
| 3 | 应收股利 | - |
| 4 | 应收利息 | 516.93 |
| 5 | 应收申购款 | - |
| 6 | 其他应收款 | - |
| 7 | 待摊费用 | - |
| 8 | 其他 | - |
| 9 | 合计 | 6,726.83 |

5.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

无。

5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

5.11.5.1 报告期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

无。

5.11.5.2 报告期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

| 序号 | 股票代码 | 股票名称 | 流通受限部分的公允价值(元) | 占基金资产净值比例(%) | 流通受限情况说明 |
|---|---|---|---|---|---|
| 1 | 000693 | *ST华泽 | - | 0.00 | 重大事项 |

5.11.6 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。

§6 开放式基金份额变动

单位:份

| | |
|---|---|
| 报告期期初基金份额总额 | 26,635,342.00 |
| 报告期期间基金总申购份额 | 300,000.00 |
| 减:报告期期间基金总赎回份额 | - |
| 报告期期间基金拆分变动份额 (份额减少以"-"填列) | - |
| 报告期期末基金份额总额 | 26,635,342.00 |

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

无。

7.2 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

无。

8.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§9 备查文件目录

9.1 备查文件目录

1、中国证监会批准设立大成深证成份交易型开放式指数证券投资基金的文件;

2、《大成深证成份交易型开放式指数证券投资基金基金合同》;

3、《大成深证成份交易型开放式指数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。

9.2 存放地点

备查文件存放在本基金管理人和托管人的住所。

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
2019年1月19日

# 大成添益交易型货币市场基金

## 2018年第四季度报告

基金管理人:大成基金管理有限公司
基金托管人:中国银行股份有限公司
报告送出日期:2019年1月19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。

基金托管人中国银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2019年1月18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2018年10月1日起至12月31日止。

§2 基金产品概况

| | |
|---|---|
| 基金简称 | 大成添益交易型货币 |
| 基金主代码 | 003252 |
| 基金运作方式 | 交易型开放式 |
| 基金合同生效日 | 2016年9月29日 |
| 报告期末基金份额总额 | 3,305,561,986.34份 |
| 投资目标 | 严格控制投资组合风险,保持良好的组合流动性,力争实现超越业绩比较基准的投资回报。 |
| 投资策略 | 1、利率趋势评估策略<br>通过对宏观经济、宏观政策、市场资金面供求等因素的综合分析,对资金利率变动趋势进行评估,最大限度地优化存款期限、回购和债券品种组合。<br>2、类属配置策略<br>本基金管理人在评估各品种在流动性、收益率稳定性基础上,结合预先制定的组合平均期限范围确定类属资产配置。<br>3、组合平均剩余期限配置策略<br>基金根据对未来短期利率走势的研判，结合基金资产流动性的要求动态调整组合久期。当预期短期利率上升时,降低组合久期,以规避资本损失或获得较高的再投资收益;在预期短期利率下降时,提高组合久期,以获得资本利得或锁定较高的利率水平。<br>4、银行存款投资策略<br>银行存款是本基金的主要投资对象。在确保安全性和流动性的前提下,通过不同商业银行和不同存款期限的选择，挖掘出利率报价较高的多家银行进行银行存款的投资,在获取较高投资收益的同时尽量分散投资风险,提高存款资产的流动性。通过对宏观经济、宏观政策、市场资金面等因素的综合分析,对资金利率变动趋势进行评估,最大限度地优化存款期限。<br>5、流动性管理策略<br>在日常的投资管理过程中，本基金将会紧密关注申购与赎回资金变化情况,季节性资金流动等影响货币市场基金流动性管理的因素,建立组合流动性监控管理指标,实现对基金资产流动性的实时管理。 |
| 业绩比较基准 | 中国人民银行公布的人民币活期存款基准利率(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 | 中国银行股份有限公司 |

| 下属分级基金的基金简称 | 大成添益交易型货币A | 大成添益交易型货币B | 交易货币 |
|---|---|---|---|
| 下属分级基金的场内简称 | - | - | 交易货币 |
| 下属分级基金的交易代码 | 003252 | 003253 | 511690 |
| 报告期末下属分级基金的份额总额 | 11,869,408.83份 | 10,170,748.80份 | 3,283,511,828.71份 |

注:1.本基金场外基金份额(A类、B类基金份额)简称"大成添益交易型货币A""大成添益交易型货币B",基金份额净值为1.00元。

2.本基金E类基金份额上市交易,简称为"交易货币",基金份额面值为100.00元,本表所列E类份额数据面值已折算为1元。

§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(2018年10月1日 - 2018年12月31日) | | |
|---|---|---|---|
| | 大成添益交易型货币A | 大成添益交易型货币B | 交易货币 |
| 1.本期已实现收益 | 86,518.98 | 113,121.71 | 29,017,723.30 |
| 2.本期利润 | 86,518.98 | 113,121.71 | 29,017,723.30 |
| 3.期末基金资产净值 | 11,869,408.83 | 10,170,748.80 | 3,283,511,828.71 |

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

3.2 基金净值表现

3.2.1 本报告期基金份额净值收益率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

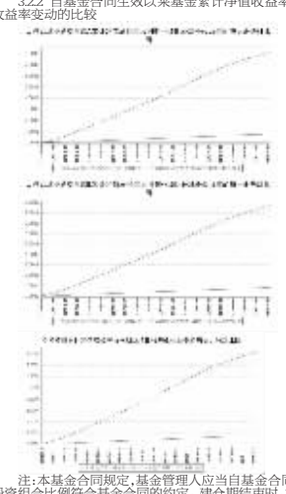
| 大成添益交易型货币A | | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|---|
| 阶段 | 净值收益率① | 净值收益率标准差② | 业绩比较基准收益率③ | 业绩比较基准收益率标准差④ | ①-③ | ②-④ |
| 过去三个月 | 0.6667% | 0.0009% | 0.0882% | 0.0000% | 0.5785% | 0.0009% |

| 大成添益交易型货币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 | 0.7278% | 0.0009% | 0.0882% | 0.0000% | 0.6396% | 0.0009% |

| 交易货币 | | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|---|
| 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 | 0.6662% | 0.0009% | 0.0882% | 0.0000% | 0.5780% | 0.0009% |

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



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

§4 管理人报告

4.1 基金经理(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 | | |
| 朱哲 | 本基金基金经理 | 2016年10月12日 | - | 9年 | 工商管理硕士。2009年7月至2010年9月任中国银行金融市场总部助理投资经理。2010年10月至2013年5月任嘉实基金交易部交易员。2013年5月至2015年7月任银华基金固定收益部基金经理。2015年8月加入大成基金管理有限公司,任固定收益总部基金经理。2016年8月20日起任大成货币市场证券投资基金,大成纯利灵活配置混合型证券投资基金和大成现金宝场内实时申赎货币市场基金基金经理。2016年9月6日起任大成景华一年定期开放债券型证券投资基金和大成价用增利一年定期开放债券型证券投资基金基金经理。2016年10月12日起任大成添益交易型货币市场基金基金经理。2018年3月14日起任大成景安短融债券型证券投资基金基金经理。2018年11月16日起任大成景禄灵活配置混合型证券投资基金基金经理。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

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

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、业绩评估等与投资管理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，通过多部门的协作互控,保证了公平交易的可操作、可稽核和可持续。

4.3.2 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。2018年4季度公司旗下主动投资组合间股票交易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%的交易情形;投资组合间债券交易不存在同日反向交易;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 报告期内基金投资策略和运作分析

四季度经济数据延续下滑态势，工业增加值、固定资产投资、PPI等数据持续下滑。正如经济工作会议所述,央行也加强逆周期调控,继续保持资金面的整体宽松，而为了维系内外平衡,央行也保持了公开市场操作利率的稳定。因此整体来看四季度货币市场呈现宽松和窄幅波动的局面,1年以内债券、存单和货币市场利率基本低位震荡,而长债收益率在经济下滑的预期之下出现较大幅度下行。同时由于资金面稳定,因此杠杆操作导致期限和信用利差都大幅收窄。

本组合在做好流动性管理基础上,灵活调整组合比例和结构,在严格控制久期的同时谨慎操作,而在年末收益率上行时果断加仓,为投资者博取收益 。同时注重风险控制,保证了组合的安全。

4.5 报告期内基金的业绩表现

本报告期大成添益交易型货币A基金份额净值收益率为0.6667%,本报告期大成添益交易型货币B基金份额净值收益率为0.7278%,本报告期交易货币基金份额净值收益率为0.6662%,同期业绩比较基准收益率为0.0882%.

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 | 1,225,232,534.08 | 33.65 |
| | 其中:债券 | 1,225,232,534.08 | 33.65 |
| | 资产支持证券 | - | - |
| 2 | 买入返售金融资产 | 249,730,814.60 | 6.86 |
| | 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 | 2,148,852,874.50 | 59.02 |
| 4 | 其他资产 | 17,172,199.55 | 0.47 |
| 5 | 合计 | 3,640,988,422.73 | 100.00 |

5.2 报告期债券回购融资情况

| 序号 | 项目 | 占基金资产净值比例(%) |
|---|---|---|
| 1 | 报告期内债券回购融资余额 | 2.04 |
| | 其中:买断式回购融资 | - |
| 序号 | 项目 | 金额(元) | 占基金资产净值比例(%) |
| 2 | 报告期末债券回购融资余额 | 331,878,822.17 | 10.04 |
| | 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

无。

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 | 86 |
| 报告期内投资组合平均剩余期限最高值 | 89 |
| 报告期内投资组合平均剩余期限最低值 | 49 |

报告期内投资组合平均剩余期限超过120天情况说明

无。

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 | 11.33 | 10.04 |
| | 其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债 | - | - |
| 2 | 30天(含)—60天 | 4.81 | - |
| | 其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债 | - | - |
| 3 | 60天(含)—90天 | 72.64 | - |
| | 其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债 | - | - |
| 4 | 90天(含)—120天 | 6.50 | - |
| | 其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债 | - | - |
| 5 | 120天(含)—397天(含) | 14.34 | - |
| | 其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债 | - | - |
| 合计 | | 109.63 | 10.04 |

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 | 92,749,287.46 | 2.81 |
| 2 | 央行票据 | - | - |
| 3 | 金融债券 | 100,177,092.62 | 3.03 |
| | 其中:政策性金融债 | 100,177,092.62 | 3.03 |
| 4 | 企业债券 | - | - |
| 5 | 企业短期融资券 | - | - |
| 6 | 中期票据 | - | - |
| 7 | 同业存单 | 1,032,306,154.00 | 31.23 |
| 8 | 其他 | - | - |
| 9 | 合计 | 1,225,232,534.08 | 37.07 |
| 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序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 | 111815626 | 18民生银行CD626 | 2,200,000 | 218,638,916.40 | 6.61 |
| 2 | 111810616 | 18兴业银行CD616 | 2,000,000 | 198,443,699.21 | 6.00 |
| 3 | 111811249 | 18平安银行CD249 | 1,500,000 | 149,171,202.78 | 4.51 |
| 4 | 111815625 | 18民生银行CD625 | 1,000,000 | 99,382,213.45 | 3.01 |
| 5 | 111809399 | 18浦发银行CD399 | 1,000,000 | 99,372,550.70 | 3.01 |
| 6 | 111899861 | 18盛京银行CD241 | 1,000,000 | 99,013,637.44 | 3.00 |
| 7 | 111899833 | 18宁波银行CD118 | 900,000 | 89,112,273.66 | 2.70 |
| 8 | 111880063 | 18大连银行CD108 | 800,000 | 79,171,660.36 | 2.40 |
| 9 | 1402202 | 14国开02 | 600,000 | 60,070,347.93 | 1.82 |
| 10 | 189949 | 18贴现国债49 | 530,000 | 52,909,871.31 | 1.60 |

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 | 0.0539% |
| 报告期内偏离度的最低值 | -0.0075% |
| 报告期内每个工作日偏离度的绝对值的简单平均值 | 0.0364% |

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 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序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 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摊益。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一18浦发银行CD399(111809399.IB)的发行主体上海浦东发展银行股份有限公司于2018年2月12日因以贷转存、虚增存贷款等,受到中国银行业监督管理委员会处罚(银监罚决字〔2018〕4号);于2018年7月26日因未按照规定履行客户身份识别义务等，受到中国人民银行处罚（银反洗罚决字〔2018〕3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。

2、本基金投资的前十名证券之一18平安银行CD249(111811249.IB)的发行主体平安银行股份有限公司于2018年7月26日因未按照规定履行客户身份识别义务等,受到中国人民银行处罚(银反洗罚决字〔2018〕2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。

3、本基金投资的前十名证券之一18兴业银行CD616(111810616.IB)的发行主体兴业银行股份有限公司于2018年4月19日因重大关联交易未按规定审查审批且未向监管部门报告等，受到中国银行保险监督管理委员会处罚（银保监银罚决字〔2018〕1号）。本基金认为,对兴业银行的处罚不会对其投资价值构成实质性负面影响。

4、本基金投资的前十名证券之一18民生银行CD626(111815626.IB)的发行主体中国民生银行股份有限公司于2018年11月9日因贷款业务严重违反审慎经营规则等,受到中国银行保险监督管理委员会处罚(银保监银罚决字〔2018〕5号、银保监银罚决字〔2018〕8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。

5、本基金投资的前十名证券之一18民生银行CD625(111815625.IB)的发行主体中国民生银行股份有限公司于2018年11月9日因贷款业务严重违反审慎经营规则等,受到中国银行保险监督管理委员会处罚(银保监银罚决字〔2018〕5号、银保监银罚决字〔2018〕8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。

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 | 17,172,199.55 |
| 4 | 应收申购款 | - |
| 5 | 其他应收款 | - |
| 6 | 待摊费用 | - |
| 7 | 其他 | - |
| 8 | 合计 | 17,172,199.55 |

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 | 大成添益交易型货币A | 大成添益交易型货币B | 交易货币 |
|---|---|---|---|
| 报告期期初基金份额总额 | 15,617,871.41 | 108,473.31 | 4,931,324,099