# 大成月添利理财债券型证券投资基金 2019年半年度报告摘要

2019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
送出日期:2019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。

基金托管人中国农业银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2019年8月26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2019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 | 11,924,865,198.77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 | 102,270,009.14份 | 11,809,691,362.24份 | 12,903,827.39份 |

2.2 基金产品说明

| | |
|---|---|
| 投资目标 | 以保持基金资产的安全性和适当流动性为首要目标,追求高于业绩比较基准的稳定收益。 |
| 投资策略 | 本基金通过平均剩余期限决策、类属配置、品种选择和其他衍生工具投资策略四个层次进行投资管理,以实现超越投资基准的投资目标。 |
| 业绩比较基准 | 七天通知存款税后利率。 |
| 风险收益特征 | 本基金为债券型基金,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 | 贺倩 |
| | 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 |

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 | www.dcfund.com.cn |
| 基金半年度报告备置地点 | 基金管理人及基金托管人住所 |

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位:人民币元

| 3.1.1 期间数据和指标 | 报告期(2019年1月1日-2019年6月30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 | 1,774,843.70 | 215,946,493.36 | 239,794.00 |
| 本期利润 | 1,774,843.70 | 215,946,493.36 | 239,794.00 |
| 本期净值收益率 | 1.4094% | 1.5556% | 1.4096% |
| 3.1.2 期末数据和指标 | 报告期末(2019年6月30日) | | |
| 期末基金资产净值 | 102,270,009.14 | 11,809,691,362.24 | 12,903,827.39 |
| 期末基金份额净值 | 1.0000 | 1.0000 | 1.0000 |

注:1.本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入(不含公允价值变动收益)扣除相关费用后的余额,本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益,由于本基金采用摊余成本法核算,因此,公允价值变动收益为零,本期已实现收益和本期利润的金额相等。

2.本基金于2015年6月16日起增加E类份额。

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值收益率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

大成月添利债券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 |
|---|---|---|---|---|---|---|
| 过去一个月 | 0.2115% | 0.0002% | 0.1110% | 0.0000% | 0.1005% | 0.0002% |
| 过去三个月 | 0.6635% | 0.0003% | 0.3366% | 0.0000% | 0.3269% | 0.0003% |
| 过去六个月 | 1.4094% | 0.0006% | 0.6695% | 0.0000% | 0.7399% | 0.0006% |
| 过去一年 | 3.1785% | 0.0012% | 1.3500% | 0.0000% | 1.8285% | 0.0012% |
| 过去三年 | 11.0485% | 0.0023% | 4.0481% | 0.0000% | 7.0004% | 0.0023% |
| 自基金合同生效起至今 | 31.0414% | 0.0093% | 9.1504% | 0.0000% | 21.8910% | 0.0093% |

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 |
|---|---|---|---|---|---|---|
| 过去一个月 | 0.2354% | 0.0002% | 0.1110% | 0.0000% | 0.1244% | 0.0002% |
| 过去三个月 | 0.7363% | 0.0003% | 0.3366% | 0.0000% | 0.3997% | 0.0003% |
| 过去六个月 | 1.5556% | 0.0006% | 0.6695% | 0.0000% | 0.8861% | 0.0006% |
| 过去一年 | 3.4777% | 0.0012% | 1.3500% | 0.0000% | 2.1277% | 0.0012% |
| 过去三年 | 12.0163% | 0.0023% | 4.0481% | 0.0000% | 7.9682% | 0.0023% |
| 自基金合同生效起至今 | 33.6378% | 0.0093% | 9.1504% | 0.0000% | 24.4874% | 0.0093% |

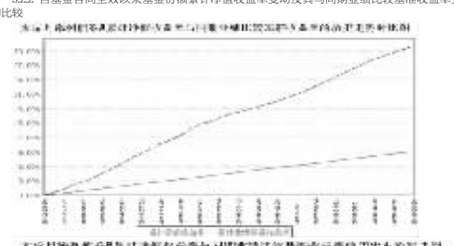
大成月添利债券E

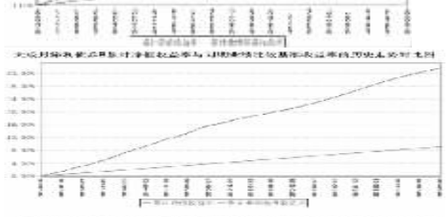
| 阶段 | 份额净值收益率① | 份额净值收益率标准差② | 业绩比较基准收益率③ | 业绩比较基准收益率标准差④ | ①-③ | ②-④ |
|---|---|---|---|---|---|---|
| 过去一个月 | 0.2115% | 0.0002% | 0.1110% | 0.0000% | 0.1005% | 0.0002% |
| 过去三个月 | 0.6634% | 0.0003% | 0.3366% | 0.0000% | 0.3268% | 0.0003% |
| 过去六个月 | 1.4096% | 0.0006% | 0.6695% | 0.0000% | 0.7401% | 0.0006% |
| 过去一年 | 3.1782% | 0.0012% | 1.3500% | 0.0000% | 1.8282% | 0.0012% |
| 过去三年 | 11.0449% | 0.0023% | 4.0481% | 0.0000% | 6.9968% | 0.0023% |
| 自基金合同生效起至今 | 14.7093% | 0.0041% | 5.4444% | 0.0000% | 9.2649% | 0.0041% |

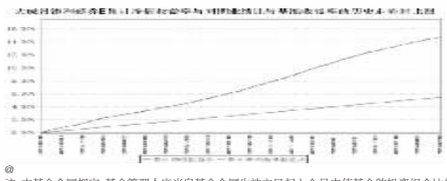
注:1.本基金根据每日基金收益情况,以基金净收益为基准,为投资者每日计算当日收益并分配,并在运作期期末集中支付。

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

3.2.2 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







@

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

§4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

大成基金管理有限公司经中国证监会证监基金字[1999]10号文批准,于1999年4月12日正式成立,是中国证监会批准成立的首批十家基金管理公司之一,注册资本为2亿元人民币,注册地为深圳。目前公司由三家股东组成,分别为中泰信托有限责任公司(50%)、光大证券股份有限公司(25%)、中国银河投资管理有限公司(25%)。主要业务是公募基金的募集、销售和管理,还具有全国社保基金投资管理、基本养老保险投资管理、受托管理保险资金、保险保障基金投资管理、特定客户资产管理和QDII业务资格。

经过二十年的稳健发展,公司形成了强大稳固的综合实力。公司旗下基金产品齐全、风格多样,构建了涵盖股票型基金、混合型基金、指数型基金、债券型基金和货币市场基金的完备产品线。截至2019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,5只QDII基金及68只开放式证券投资基金。

4.1.2 基金经理(或基金经理小组)及基金经理助理简介

| 姓名 | 职务 | 任本基金的基金经理(助理)期限 | | 证券从业年限 | 说明 |
|---|---|---|---|---|---|
| | | 任职日期 | 离任日期 | | |
| 陈会荣 | 本基金基金经理 | 2017年3月22日 | - | 12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。2016年8月6日至2018年10月20日任大成慧赢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日起任大成恒丰宝货币市场基金基金经理。2016年11月2日起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日起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、大成慧成货币市场基金和大成景旭纯债债券型证券投资基金基金经理。2018年3月14日起任大成月月盈短期理财债券型证券投资基金、大成添利宝货币市场基金基金经理。2018年8月17日起任大成现金增利货币市场基金基金经理。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 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 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

报告期内,基金管理人严格执行了公平交易的原则和制度。基金管理人运用统计分析方法和工具,对旗下所有投资组合间连续4个季度的日内、3日内及5日内股票及债券交易同向交易价差进行分析。分析结果表明:债券交易同向交易频率较低;部分股票同向交易溢价率较大主要来源于市场因素(如个股当日价格振幅较高)及组合经理交易时机选择,即投资组合成交时间不一致以及成交价格的日内较大变动导致个别些组合间的成交价格差异较大,但结合交易价差专项统计分析,未发现违反公平交易原则的异常情况。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

报告期内,基金管理人旗下所有投资组合未发现存在异常交易行为。主动投资组合间股票交易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;主动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。

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

2019年上半年,中国经济在下行压力逐步加大的同时,也表现出其体量优势和韧性,没有出现突然失速,经济数据保持在合理区间。短期资金面保持在合理宽裕,包商事件带来的资金面宽松是暂时的,但由此带来的相关投资主体风险偏好的下降将会持续。纵观上半年,隔夜回购利率均值约为2.16%,较年初下降16BP,7天回购加权利率均值约为2.65%,较年初下降10BP,14天回购加权利率均值约为2.85%,较年初下降20BP。1年期金融债收益率下行约2bp,1年AAA短期融资券下行约41bp,1年AA+短融品种下行约42bp,3月AAA存单下行约61BP,1年AAA存单下行约30BP。

本基金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。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本报告期大成月添利债券A的基金份额净值收益率为1.4094%,本报告期大成月添利债券B的基金份额净值收益率为1.5556%,本报告期大成月添利债券E的基金份额净值收益率为1.4096%,同期业绩基准收益率为0.6695%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

全球经济增长预期降低,主要经济体开启新一轮的降息周期,中国经济将更多着眼于国内经济周期趋势。资金面预料将保持平稳宽松,但对货币政策工具的运用将会采取审慎的态度。

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、社保基金及机构投资部、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、社保基金及机构投资部、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可业市场的估值数据,由中证指数有限公司按约定提供交易所交易的债券品种的估值数据和流通受限股票的折扣率数据。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金管理人严格按照本基金基金合同的规定进行收益分配。据本基金基金合同中收益分配有关原则的规定:本基金根据每日基金收益情况,以基金净收益为基准,为投资者每日计算当日收益并分配,并在运作期期末集中支付。本报告期内本基金应分配利润217,961,131.06元,报告期内已分配利润217,961,131.06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

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《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2019年1月1日至2019年6月30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遵规守信、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《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

本托管人认为,大成基金管理有限公司的信息披露事务符合《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半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,未发现有损害基金持有人利益的行为。

§6 半年度财务会计报告(未经审计)

6.1 资产负债表

会计主体:大成月添利理财债券型证券投资基金

报告截止日:2019年6月30日

单位:人民币元

| 资产 | 本期末 2019年6月30日 | 上年度末 2018年12月31日 |
|---|---|---|
| 资产: | | |
| 银行存款 | 4,185,007,548.60 | 10,729,802,533.96 |
| 结算备付金 | 7,500,000.00 | - |
| 存出保证金 | - | - |
| 交易性金融资产 | 6,152,240,556.66 | 6,504,249,265.86 |
| 其中:股票投资 | - | - |
| 基金投资 | - | - |
| 债券投资 | 6,152,240,556.66 | 6,504,249,265.86 |
| 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 | 2,316,582,634.87 | - |
| 应收证券清算款 | - | - |
| 应收利息 | 44,537,278.26 | 78,537,859.31 |
| 应收股利 | - | - |
| 应收申购款 | 71,000.60 | - |
| 递延所得税资产 | - | - |
| 其他资产 | - | - |
| 资产总计 | 12,705,939,018.99 | 17,312,589,659.13 |
| 负债和所有者权益 | 本期末 2019年6月30日 | 上年度末 2018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 | 759,724,980.14 | 3,018,271,392.58 |
| 应付证券清算款 | - | - |
| 应付赎回款 | - | - |
| 应付管理人报酬 | 2,932,189.45 | 3,059,514.07 |
| 应付托管费 | 868,796.90 | 906,522.72 |
| 应付销售服务费 | 137,302.82 | 158,496.75 |
| 应付交易费用 | 100,332.96 | 103,819.83 |
| 应交税费 | - | - |
| 应付利息 | 92,283.82 | 2,376,842.66 |
| 应付利润 | 17,069,707.45 | 23,822,342.95 |
| 递延所得税负债 | - | - |
| 其他负债 | 148,226.68 | 321,895.00 |
| 负债合计 | 781,073,820.22 | 3,049,020,826.56 |
| 所有者权益: | | |
| 实收基金 | 11,924,865,198.77 | 14,263,568,832.57 |
| 未分配利润 | - | - |
| 所有者权益合计 | 11,924,865,198.77 | 14,263,568,832.57 |
| 负债和所有者权益总计 | 12,705,939,018.99 | 17,312,589,659.13 |

注:报告截止日2019年6月30日,基金份额总额11,924,865,198.77份,其中大成月添利债券A基金份额总额为102,270,009.14份,基金份额净值1元;大成月添利债券B基金份额总额为11,809,691,362.24份,基金份额净值1元;大成月添利债券E基金份额总额为12,903,827.39份,基金份额净值1元。

6.2 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:2019年1月1日至2019年6月30日

单位:人民币元

| 项目 | 本期 2019年1月1日至2019年6月30日 | 上年度可比期间 2018年1月1日至2018年6月30日 |
|---|---|---|
| 一、收入 | 264,205,054.90 | 172,724,392.99 |
| 1.利息收入 | 264,202,717.31 | 172,704,202.68 |
| 其中:存款利息收入 | 156,422,000.54 | 93,984,523.03 |
| 债券利息收入 | 102,549,971.50 | 69,115,108.41 |
| 资产支持证券利息收入 | - | - |
| 买入返售金融资产收入 | 5,230,745.27 | 9,604,571.24 |
| 其他利息收入 | - | - |
| 2.投资收益(损失以"-"填列) | 2,337.59 | 20,190.31 |
| 其中:股票投资收益 | - | - |
| 基金投资收益 | - | - |
| 债券投资收益 | 2,337.59 | 20,190.31 |
| 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 | 46,243,923.84 | 21,997,195.10 |
| 1. 管理人报酬 | 18,896,473.10 | 8,736,077.10 |
| 2. 托管费 | 5,598,955.11 | 2,588,467.23 |
| 3. 销售服务费 | 906,066.62 | 581,756.10 |
| 4. 交易费用 | - | - |
| 5. 利息支出 | 20,649,036.73 | 9,851,648.72 |
| 其中:卖出回购金融资产支出 | 20,649,036.73 | 9,851,648.72 |
| 6. 税金及附加 | - | - |
| 7. 其他费用 | 193,392.28 | 239,245.95 |
| 三、利润总额(亏损总额以"-"号填列) | 217,961,131.06 | 150,727,197.89 |
| 减:所得税费用 | - | - |
| 四、净利润 (净亏损以"-"号填列) | 217,961,131.06 | 150,727,197.89 |

6.3 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:2019年1月1日至2019年6月30日

单位:人民币元

| 项目 | 本期 2019年1月1日至2019年6月30日 | | |
|---|---|---|---|
| | 实收基金 | 未分配利润 | 所有者权益合计 |
| 一、期初所有者权益(基金净值) | 14,263,568,832.57 | - | 14,263,568,832.57 |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动(本期利润) | - | 217,961,131.06 | 217,961,131.06 |
| 三、本期基金份额交易产生的基金净值变动(净值减少以"-"号填列) | -2,338,703,633.80 | - | -2,338,703,633.80 |
| 其中:1.基金申购款 | 280,570,518.71 | - | 280,570,518.71 |
| 2.基金赎回款 | -2,619,274,152.51 | - | -2,619,274,152.51 |
| 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) | - | -217,961,131.06 | -217,961,131.06 |
| 五、期末所有者权益(基金净值) | 11,924,865,198.77 | - | 11,924,865,198.77 |
| 项目 | 上年度可比期间 2018年1月1日至2018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) | 4,132,414,895.96 | - | 4,132,414,895.96 |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动(本期利润) | - | 150,727,197.89 | 150,727,197.89 |
| 三、本期基金份额交易产生的基金净值变动(净值减少以"-"号填列) | 11,045,551,463.73 | - | 11,045,551,463.73 |
| 其中:1.基金申购款 | 13,173,047,904.45 | - | 13,173,047,904.45 |
| 2.基金赎回款 | -2,127,496,440.72 | - | -2,127,496,440.72 |
| 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) | - | -150,727,197.89 | -150,727,197.89 |
| 五、期末所有者权益(基金净值) | 15,177,966,359.69 | - | 15,177,966,359.69 |

报表附注为财务报表的组成部分。

| | |
|---|---|
| 本报告6.1 | 至6.4财务报表由下列负责人签署: |

谭晓冈

周立新

刘亚林

基金管理人负责人

主管会计工作负责人

会计机构负责人

6.4 报表附注

6.4.1 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

6.4.2 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2008]1号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2016]36号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、财税[2016]140号《关于明确金融、房地产开发、教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税[2017]2号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017]56号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》及其他相关财税法规和实务操作,主要税项列示如下:

(1) 资管产品运营过程中发生的增值税应税行为,以资管产品管理人为增值税纳税人。资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为,暂适用简易计税方法,按照3%的征收率缴纳增值税。对资管产品在2018年1月1日前运营过程中发生的增值税应税行为,未缴纳增值税的,不再缴纳;已缴纳增值税的,已纳税额从资管产品管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。

对证券投资基金管理人运用基金买卖债券的转让收入免征增值税,对国债、地方政府债以及金融同业往来利息收入亦免征增值税。资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务,以2018年1月1日起产生的利息及利息性质的收入为销售额。

(2) 对基金从证券市场中取得的收入,包括买卖债券的差价收入,债券的利息收入及其他收入,暂不征收企业所得税。

(3) 对基金取得的企业债券利息收入,应由发行债券的企业在向基金支付利息时代扣代缴20%的个人所得税。

(4) 本基金的城市维护建设税、教育费附加和地方教育费附加等税费按照实际缴纳增值税额的适用比例计算缴纳。

6.4.3 关联方关系

6.4.3.1 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。

6.4.3.2 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”) | 基金销售机构、基金管理人、注册登记机构 |
| 光大证券股份有限公司(“光大证券”) | 基金销售机构、基金管理人的股东 |
| 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 |

注:下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.4 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.4.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.4.1.1 股票交易

无。

6.4.4.1.2 债券交易

无。

6.4.4.1.3 债券回购交易

金额单位:人民币元

| 关联方名称 | 本期 2019年1月1日至2019年6月30日 | | 上年度可比期间 2018年1月1日至2018年6月30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 | 5,626,800,000.00 | 100.00 | - | - |

6.4.4.1.4 权证交易

无。

6.4.4.1.5 应支付关联方的佣金

无。

6.4.4.2 关联方报酬

6.4.4.2.1 基金管理费

单位:人民币元

| 项目 | 本期 2019年1月1日至2019年6月30日 | 上年度可比期间 2018年1月1日至2018年6月30日 |
|---|---|---|
| 当期发生的基金应支付的管理费 | 18,896,473.10 | 8,736,077.10 |
| 其中:支付销售机构的客户维护费 | 76,709.24 | 87,007.15 |

注:支付基金管理人大成基金的管理人报酬按前一日基金资产净值0.27%的年费率计提,逐日累计至每月月底,按月支付。其计算公式为:

日管理人报酬=前一日基金资产净值×0.27%/当年天数。

6.4.4.2.2 基金托管费

单位:人民币元

| 项目 | 本期 2019年1月1日至2019年6月30日 | 上年度可比期间 2018年1月1日至2018年6月30日 |
|---|---|---|
| 当期发生的基金应支付的托管费 | 5,598,955.11 | 2,588,467.23 |

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:

日托管费=前一日基金资产净值×0.08%/当年天数。

6.4.4.2.3 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 2019年1月1日至2019年6月30日 | | | |
|---|---|---|---|---|
| | 当期发生的基金应支付的销售服务费 | | | |
| | 大成月添利债券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 | 34,672.44 | - | - | 34,672.44 |
| 大成基金 | 4,099.37 | 692,504.99 | 25,294.38 | 721,898.74 |
| 合计 | 38,771.81 | 692,504.99 | 25,294.38 | 756,571.18 |
| 获得销售服务费的各关联方名称 | 上年度可比期间 2018年1月1日至2018年6月30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 | 5,620.68 | 314,494.02 | 46,347.03 | 366,461.73 |
| 中国农业银行 | 42,721.91 | - | - | 42,721.91 |
| 合计 | 48,342.59 | 314,494.02 | 46,347.03 | 409,183.64 |

注:支付基金销售机构的销售服务费按前一日基金资产净值的约定年费率计提,逐日累计至每月月底,按月支付给大成基金,再由大成基金计算并支付给各基金销售机构。A类基金份额、B类基金份额和E类基金份额约定的销售服务费年费率分别为0.30%、0.01%和0.30%。销售服务费的计算公式为:各类基金份额日销售服务费=前一日该类别基金资产净值×约定年费率/当年天数。

6.4.4.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

无。

6.4.4.4 各关联方投资本基金的情况

6.4.4.4.1 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 2019年1月1日至2019年6月30日 | 本期 2019年1月1日至2019年6月30日 | 本期 2019年1月1日至2019年6月30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 |
| 报告期初持有的基金份额 | - | 74,408,511.12 | - |
| 报告期间申购/买入总份额 | - | 1,184,675.10 | - |
| 报告期间因拆分变动份额 | - | - | - |
| 减:报告期间赎回/卖出总份额 | - | - | - |
| 报告期末持有的基金份额 | - | 75,593,186.22 | - |
| 报告期末持有的基金份额占基金总份额比例 | - | 0.6339% | - |
| 项目 | 上年度可比期间 2018年1月1日至2018年6月30日 | 上年度可比期间 2018年1月1日至2018年6月30日 | 上年度可比期间 2018年1月1日至2018年6月30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 |
| 报告期初持有的基金份额 | - | - | - |
| 报告期间申购/买入总份额 | - | 68,000,000.00 | - |
| 报告期间因拆分变动份额 | - | - | - |
| 减:报告期间赎回/卖出总份额 | - | - | - |
| 报告期末持有的基金份额 | - | 68,000,000.00 | - |
| 报告期末持有的基金份额占基金总份额比例 | - | 0.4500% | - |

注:基金管理人大成基金投资本基金适用的交易费率与本基金法律文件规定一致。

6.4.4.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

无。

6.4.4.5 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 2019年1月1日至2019年6月30日 | | | |
|---|---|---|---|---|
| | 期末余额 | 当期利息收入 | 期末余额 | 当期利息收入 |
| 中国农业银行 | 3,007,548.60 | 877,983.49 | 2,697,022.76 | 12,797.35 |

注:本基金由基金托管人保管的银行存款,按银行约定利率计息。

6.4.4.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

无。

6.4.4.7 其他关联交易事项的说明

无。

6.4.5 期末(2019年6月30日)本基金持有的流通受限证券

6.4.5.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

无。

6.4.5.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

无。

6.4.5.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.5.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末2019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759,724,980.14元,是以如下债券作为抵押:

金额单位:人民币元

| 债券代码 | 债券名称 | 回购到期日 | 期末估值单价 | 数量(张) | 期末估值总额 |
|---|---|---|---|---|---|
| 111918196 | 19华夏银行CD196 | 2019年7月1日 | 99.37 | 1,277,000 | 126,900,869.22 |
| 180018 | 18附息国债18 | 2019年7月1日 | 100.06 | 400,000 | 40,025,971.68 |
| 199922 | 19贴现国债22 | 2019年7月1日 | 99.60 | 1,500,000 | 149,403,250.20 |
| 199923 | 19贴现国债23 | 2019年7月1日 | 99.51 | 4,100,000 | 407,988,672.19 |
| 199924 | 19贴现国债24 | 2019年7月1日 | 98.84 | 400,000 | 39,537,121.53 |
| 199925 | 19贴现国债25 | 2019年7月1日 | 99.50 | 120,000 | 11,939,994.32 |
| 合计 | | | | 7,797,000 | 775,795,879.14 |

6.4.5.3.2 交易所市场债券正回购

无。

§7 投资组合报告

7.1 期末基金资产组合情况

金额单位:人民币元

| 序号 | 项目 | 金额 | 占基金总资产的比例(%) |
|---|---|---|---|
| 1 | 固定收益投资 | 6,152,240,556.66 | 48.42 |
| | 其中:债券 | 6,152,240,556.66 | 48.42 |
| | 资产支持证券 | - | - |
| 2 | 买入返售金融资产 | 2,316,582,634.87 | 18.23 |
| | 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 | 4,192,507,548.60 | 33.00 |
| 4 | 其他各项资产 | 44,608,278.86 | 0.35 |
| 5 | 合计 | 12,705,939,018.99 | 100.00 |

7.2 债券回购融资情况

金额单位:人民币元

| 序号 | 项目 | 占基金资产净值的比例(%) |
|---|---|---|
| 1 | 报告期内债券回购融资余额 | 12.06 |
| | 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 | 759,724,980.14 | 6.37 |
| | 其中:买断式回购融资 | - | - |

注:报告期内债券回购融资余额占基金资产净值的比例为报告期内每个交易日融资余额占资产净值比例的简单平均值。

债券正回购的资金余额超过基金资产净值的20%的说明

本基金合同约定:“本基金进入全国银行间同业市场进行债券回购的资金余额不得超过基金资产净值的40%”。本报告期内,本基金未发生超标情况。

7.3 基金投资组合平均剩余期限

7.3.1 投资组合平均剩余期限基本情况

| 项目 | 天数 |
|---|---|
| 报告期末投资组合平均剩余期限 | 105 |
| 报告期内投资组合平均剩余期限最高值 | 135 |
| 报告期内投资组合平均剩余期限最低值 | 43 |

报告期内投资组合平均剩余期限超过120天情况说明

本基金合同约定:“本基金投资组合的平均剩余期限在每个交易日均不得超过150天”,本报告期内,本基金未发生超标情况。

7.3.2 期末投资组合平均剩余期限分布比例

| 序号 | 平均剩余期限 | 各期限资产占基金资产净值的比例(%) | 各期限负债占基金资产净值的比例(%