

大成添利宝货币市场基金

[2017] 第一季度报告

基金管理人:大成基金管理有限公司 托管人:兴业银行股份有限公司 报告送达日期:2017年4月21日

§ 1 重要提示
基金管理人的董事会及监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，并对其实质性、准确性和完整性承担个别及连带法律责任。
基金托管人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，并对其实质性、准确性和完整性承担个别及连带法律责任。
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。投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。

本基金目前无财务数据。

报告期自2017年1月1日至3月31日。

§ 2 基本产品概况

序号	项目	占基金资产净值的比例(%)
1	报告期末货币市场基金余额	0.07
2	报告期末现金余额	0.00
3	报告期末货币市场基金余额	0.00
4	报告期末货币市场基金余额	0.00

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净资产比例的简单平均值。

本基金正常的融资余额不超过基金资产净值的20%的说明。

报告期末,本基金正回购的融资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情况

5.3.1 投资组合平均剩余期限基本情况

单位:天

序号	项目	占基金资产净值的比例(%)
1	报告期末货币市场基金余额	0.07
2	报告期末现金余额	0.00
3	报告期末货币市场基金余额	0.00
4	报告期末货币市场基金余额	0.00

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净资产比例的简单平均值。

本基金正常的融资余额不超过基金资产净值的20%的说明。

报告期末,本基金正回购的融资余额未超过基金资产净值的20%。

5.3.2 报告期末投资组合平均剩余期限分布比例

单位:天

序号	项目	占基金资产净值的比例(%)	占基金资产净值的比例(%)
1	0-90天内	20.00	0.00
2	90-180天	16.20	0.00
3	180-360天	56.40	0.00
4	360天以上-180天	3.47	0.00
5	180天以上-90天	0.03	0.00
6	90天以上-15天	0.73	0.00
7	15天以上-10天	0.00	0.00
8	10天以上-5天	0.00	0.00
9	5天以上-1天	0.00	0.00
10	1天以内	79.61	0.00

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净资产比例的简单平均值。

本基金正常的融资余额不超过基金资产净值的20%的说明。

报告期末,本基金正回购的融资余额未超过基金资产净值的20%。

5.3.3 报告期末投资组合平均剩余期限超过120天情况说明

无。

5.4 报告期内投资组合平均剩余期限超过240天情况说明

报告期内,本基金正回购的平均剩余期限未超过240天。

5.5 报告期内债券品种分布情况的债券投资组合

单位:元

序号	债券品种	债券成本(元)	占基金资产净值的比例(%)
1	国债	109,801,400.73	1.10
2	金融债	0.00	0.00
3	企业债	660,220,357.00	0.00
4	公司债	0.00	0.00
5	企业短期融资券	997,072,037.28	0.00
6	中期票据	0.00	0.00
7	资产支持证券	2,706,204,660.00	16.54
8	其他	0.00	0.00
9	合计	4,243,721,017.00	26.10

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净资产比例的简单平均值。

本基金正常的融资余额不超过基金资产净值的20%的说明。

报告期末,本基金正回购的融资余额未超过基金资产净值的20%。

5.6 报告期内债券组合平均剩余期限超过120天情况说明

无。

5.7 “影子定价”与“摊余成本法”确定的基金资产净值的偏离

单位:元

序号	债券品种	债券成本(元)	报告期平均剩余期限(天)	报告期平均剩余期限(天)	偏离比例(%)
1	国债	109,801,400.73	1.10	1.10	0.00
2	金融债	0.00	0.00	0.00	0.00
3	企业债	660,220,357.00	0.00	0.00	0.00
4	公司债	0.00	0.00	0.00	0.00
5	企业短期融资券	997,072,037.28	0.00	0.00	0.00
6	中期票据	0.00	0.00	0.00	0.00
7	资产支持证券	2,706,204,660.00	16.54	16.54	0.00
8	其他	0.00	0.00	0.00	0.00
9	合计	4,243,721,017.00	26.10	26.10	0.00

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净资产比例的简单平均值。

本基金正常的融资余额不超过基金资产净值的20%的说明。

报告期末,本基金正回购的融资余额未超过基金资产净值的20%。

5.8 基金投资组合平均剩余期限超过120天情况说明

无。

5.9 备查文件目录

5.1 基金经理(或基金经理小组)简介

5.2 基金投资组合情况

5.3 主要财务指标

5.4 管理人报告

5.5 投资组合报告

5.6 报告期回购购买情况

5.7 报告期内债券组合平均剩余期限超过120天情况说明

无。

5.8 影子定价与摊余成本法确定的基金资产净值的偏离

无。

5.9 备查文件目录

5.1 基金经理(或基金经理小组)简介

5.2 基金投资组合情况

5.3 主要财务指标

5.4 管理人报告

5.5 投资组合报告

5.6 报告期回购购买情况

5.7 报告期内债券组合平均剩余期限超过120天情况说明

无。

5.8 影子定价与摊余成本法确定的基金资产净值的偏离

无。

5.9 备查文件目录

5.1 基金经理(或基金经理小组)简介

5.2 基金投资组合情况

5.3 主要财务指标

5.4 管理人报告

5.5 投资组合报告

5.6 报告期回购购买情况

5.7 报告期内债券组合平均剩余期限超过120天情况说明

无。

5.8 影子定价与摊余成本法确定的基金资产净值的偏离

无。

5.9 备查文件目录

5.1 基金经理(或基金经理小组)简介

5.2 基金投资组合情况

5.3 主要财务指标

5.4 管理人报告

5.5 投资组合报告

5.6 报告期回购购买情况

5.7 报告期内债券组合平均剩余期限超过120天情况说明

无。

5.8 影子定价与摊余成本法确定的基金资产净值的偏离

无。

5.9 备查文件目录

5.1 基金经理(或基金经理小组)简介

5.2 基金投资组合情况

5.3 主要财务指标

5.4 管理人报告

5.5 投资组合报告

5.6 报告期回购购买情况

5.7 报告期内债券组合平均剩余期限超过120天情况说明

无。

5.8 影子定价与摊余成本法确定的基金资产净值的偏离

无。

5.9 备查文件目录

5.1 基金经理(或基金经理小组)简介

5.2 基金投资组合情况

5.3 主要财务指标