大成月月盈短期理财债券型证券投资基金 2018年半年度报告摘要

基金管理人:大成基金管理有限公司

基金托管人:中国银行股份有限公司

送出日期:2018年8月29日

§1 重要提示

1.1 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。

基金托管人中国银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2018年8月28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2018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	大成月月盈短期理财债券		
基金主代码	090023		
基金运作方式	契约型开放式		
基金合同生效日	2014年9月12日		
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		
报告期末基金份额总额	31,383,395,856.22份		
基金合同存续期	不定期		
下属分级基金的基金简称:	大成月月盈短期理财债券A	大成月月盈短期理财债券B	大成月月盈短期理财债券E
下属分级基金的交易代码:	090023	091023	001516
报告期末下属分级基金的份额总额	214,009,724.05份	29,089,911,404.18份	2,079,474,727.99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	本基金属于短期理财债券型证券投资基金,长期风险收益水平低于股票型基金、混合型基金,及普通债券型证券投资基金。

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	中国银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	赵冰	王永民
	联系电话	0755-83183388	010-66594896
	电子邮箱	office@dcfund.com.cn	fcid@bankofchina.com
客户服务电话		4008885558	95566
传真		0755-83199588	010-66594942

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	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

基金级别	大成月月盈短期理财债券A	大成月月盈短期理财债券B	大成月月盈短期理财债券E
3.1.1 期间数据和指标	报告期(2018年1月1日－2018年6月30日)	报告期(2018年1月1日－2018年6月30日)	报告期(2018年1月1日－2018年6月30日)
本期已实现收益	6,981,555.20	531,438,850.62	65,534,603.07
本期利润	6,981,555.20	531,438,850.62	65,534,603.07
本期净值收益率	2.2148%	2.3669%	2.1915%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2018年6月30日)		
期末基金资产净值	214,009,724.05	29,089,911,404.18	2,079,474,727.99
期末基金份额净值	1.0000	1.0000	1.0000
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2018年6月30日)		
累计净值收益率	16.3978%	17.6832%	11.8571%

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 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

大成月月盈短期理财债券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1个月	0.3594%	0.0004%	0.1110%	0.0000%	0.2484%	0.0004%
过去三个月	1.0476%	0.0006%	0.3366%	0.0000%	0.7110%	0.0006%
过去六个月	2.2148%	0.0012%	0.6695%	0.0000%	1.5453%	0.0012%
过去一年	4.4483%	0.0020%	1.3500%	0.0000%	3.0983%	0.0020%
过去三年	11.7506%	0.0059%	4.0500%	0.0000%	7.7006%	0.0059%
自基金合同生效起至今	16.3978%	0.0100%	5.1300%	0.0000%	11.2678%	0.0100%

大成月月盈短期理财债券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	0.3887%	0.0004%	0.1110%	0.0000%	0.2777%	0.0004%
过去三个月	1.1264%	0.0006%	0.3366%	0.0000%	0.7898%	0.0006%
过去六个月	2.3669%	0.0012%	0.6695%	0.0000%	1.6974%	0.0012%
过去一年	4.7552%	0.0019%	1.3500%	0.0000%	3.4052%	0.0019%
过去三年	12.7270%	0.0059%	4.0500%	0.0000%	8.6770%	0.0059%
自基金合同生效起至今	17.6832%	0.0100%	5.1300%	0.0000%	12.5532%	0.0100%

大成月月盈短期理财债券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	0.3399%	0.0004%	0.1110%	0.0000%	0.2289%	0.0004%
过去三个月	1.0266%	0.0006%	0.3366%	0.0000%	0.6900%	0.0006%
过去六个月	2.1915%	0.0012%	0.6695%	0.0000%	1.5220%	0.0012%
过去一年	4.4271%	0.0019%	1.3500%	0.0000%	3.0771%	0.0019%
过去三年	11.7284%	0.0059%	4.0500%	0.0000%	7.6784%	0.0059%
自基金合同生效起至今	11.8571%	0.0059%	4.0944%	0.0000%	7.7627%	0.0059%

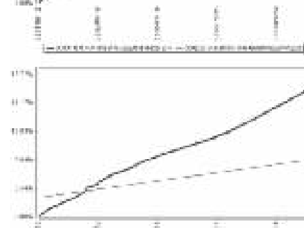
注:1、本基金根据每日基金收益情况,以基金净收益为基准,为投资者每日计算当日收益并分配,并在运作期期末集中支付。

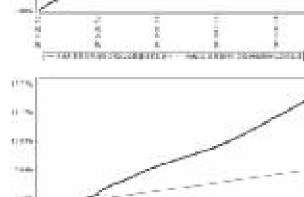
2、本表净值收益率的计算所采取的运作周期,是按各统计时间段计算以基金合同生效日为起始日并持有至报告期末的基金份额所经历的运作周期。

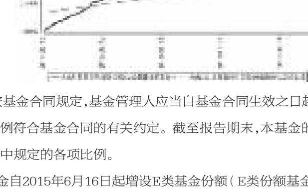
3、本基金自2015年6月19日起,新增E类份额。

4. 本基金自2014年9月12日起由大成理财21天债券型发起式证券投资基金转为大成月月盈短期理财债券证券投资基金。

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.按基金合同规定,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有关约定。截至报告期末,本基金的各项投资比例已达到基金合同中规定的各项比例。

2.本基金自2015年6月16日起增设E类基金份额(E类份额基金代码:001516)。

§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。

经过十多年的稳健发展,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2018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75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 任职日期	离任日期	证券从业年限	说明
陈会荣先生	本基金基金经理	2018年3月14日	－	11年	中央财经大学经济学学士。2007年10月加入大成基金管理有限公司,历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、固定收益总部基金经理。自2016年8月6日起任大成景穗灵活配置混合型证券投资基金基金经理,自2016年8月6日起任大成丰财宝货币市场基金基金经理,自2016年9月6日起任大成恒丰宝货币市场基金基金经理。自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,自2017年3月1日起任大成惠祥定期开放纯债债券型证券投资基金基金经理。自2017年3月22日起担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。自2018年3月14日起担任大成月月盈短期理财债券型证券投资基金及大成添利宝货币市场基金基金经理。具备基金从业资格。国籍:中国
张文平先生	本基金基金经理,固收研究部(隶属固定收益总部)副总监	2015年6月23日	2018年3月16日	6年	南京大学管理学硕士,注册会计师,证券从业年限6年。2009年10月至2011年5月就职于毕马威企业咨询有限公司南京分公司审计部;2011年起加入大成基金管理有限公司,曾任固定收益部助理研究员,现任固定收益总部研究部副总监。2013年11月25日至2015年3月5日担任大成景祥分级债券型证券投资基金基金经理助理。2015年3月7日至2016年11月18日担任大成景祥分级债券型证券投资基金基金经理。2015年6月23日至2018年3月16日任大成景裕灵活配置混合型证券投资基金基金经理。2015年7月1日至2017年3月18日任大成现金宝场内实时申赎货币市场基金基金经理。2015年7月1日至2018年3月16日任大成月月盈短期理财债券型证券投资基金基金经理。2015年11月24日至2018年3月16日任大成景沛灵活配置混合型证券投资基金基金经理。2016年5月23日至2018年3月12日任大成财富管理2020生命周期证券投资基金、大成策略回报混合型证券投资基金、大成创新成长混合型证券投资基金、大成积极成长混合型证券投资基金、大成价值增长证券投资基金、大成精选增值混合型证券投资基金、大成景阳领先混合型证券投资基金、大成竞争优势混合型证券投资基金、大成蓝筹稳健证券投资基金和大成优选混合型证券投资基金基金经理助理。2016年8月6日至2018年3月16日任大成添利宝货币市场基金基金经理。2016年9月6日至2018年3月16日任大成景安短期融债券型证券投资基金基金经理。2016年9月6日至2018年3月6日任大成现金增利货币市场基金基金经理。2016年9月20日至2018年3月16日任大成景辉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、李富强先生自2018年7月16日起任本基金基金经理。上述事项已按法规要求及公司相关制度办理,变更流程合法合规。

2、任职日期、离任日期为本基金管理人作出决定之日。

3、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;股票同向交易溢价率变动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变动导致个别组合间的成交价格存在一定差异,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存在1笔同日反向交易,原因为投资策略需要。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,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存在2笔同日反向交易,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。

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

2018年以来,为避免社融增速回落过快对实体经济的负面影响,资金面日渐宽松,纵观上半年,隔夜回购利率均值约为2.71%,较年初下降9BP,14天回购加权利率均值约为4.11%,较年初下降38BP。1年期金融债收益率下行约83bp,1年AAA短期融资券收益率下行约57bp。

本基金将继续以流动性为第一前提,在适时拉长久期并调整组合结构,努力提高组合静态收益。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本报告期大成月月盈短期理财债券A的基金份额净值收益率为2.2148%,本报告期大成月月盈短期理财债券B的基金份额净值收益率为2.3669%,本报告期大成月月盈短期理财债券E的基金份额净值收益率为2.1915%,同期业绩比较基准收益率为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

下半年,货币政策应该会延续当前的宽松状态,但随着中美贸易争端的升级以及社融增速的下降,经济增速放缓已被市场充分预期。在密集政策调控下,经济下行具体体现在宏观数据以前,利率债收益率下行的幅度将趋缓,而中低等级信用债的估值修复还需要相关政策配合带来的信用扩张。

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、社保基金及机构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、风险管理部和社保基金及机构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603,955,008.89元,报告期内已分配利润603,955,008.89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

本报告期内,中国银行股份有限公司(以下称"本托管人")在对大成月月盈短期理财债券型证券投资基金(以下称"本基金")的托管过程中,严格遵守《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有关规定,不存在损害基金份额持有人利益的行为,完全尽职尽责地履行了应尽的义务。

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

本报告期内,本托管人根据《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,对本基金管理人的投资运作进行了必要的监督,对基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算以及基金费用开支等方面进行了认真地复核,未发现本基金管理人存在损害基金份额持有人利益的行为。

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

本报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告(注:财务会计报告中的"金融工具风险及管理"部分未在托管人复核范围内)、投资组合报告等数据真实、准确和完整。

§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:大成月月盈短期理财债券型证券投资基金

报告截止日:2018年6月30日

单位:人民币元

资产	本期末 2018年6月30日	上年度末 2017年12月31日
资产:		
银行存款	16,313,367,978.72	12,873,378,864.33
结算备付金	－	－
存出保证金	－	－
交易性金融资产	14,442,283,536.86	9,217,296,625.89
其中:股票投资	－	－
基金投资	－	－
债券投资	14,442,283,536.86	9,217,296,625.89
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	2,101,737,392.63	1,500,481,200.00
应收证券清算款	－	－
应收利息	183,357,832.19	78,068,958.78
应收股利	－	－
应收申购款	60,000.00	－
递延所得税资产	－	－
其他资产	－	－
资产总计	33,040,806,740.40	23,669,225,649.00
负债和所有者权益	本期末 2018年6月30日	上年度末 2017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	1,599,503,516.04	5,972,093,691.98
应付证券清算款	－	－
应付赎回款	－	－
应付管理人报酬	7,801,252.60	3,319,635.76
应付托管费	2,311,482.23	983,595.77
应付销售服务费	868,145.93	838,673.58
应付交易费用	149,670.58	262,798.25
应交税费	180,354.44	－
应付利息	466,684.37	6,433,743.29
应付利润	45,895,294.98	24,638,307.46
递延所得税负债	－	－
其他负债	234,483.01	309,000.00
负债合计	1,657,410,884.18	6,008,879,446.09
所有者权益:		
实收基金	31,383,395,856.22	17,660,346,202.91
未分配利润	－	－
所有者权益合计	31,383,395,856.22	17,660,346,202.91
负债和所有者权益总计	33,040,806,740.40	23,669,225,649.00

注:报告截止日2018年6月30日,基金份额净值1.0000元,基金份额总额31,383,395,856.22份,其中A类基金份额总额为214,009,724.05份,B类基金份额的份额总额为29,089,911,404.18份,E类基金份额的份额总额为2,079,474,727.99份。

6.2 利润表

会计主体:大成月月盈短期理财债券型证券投资基金

本报告期:2018年1月1日至2018年6月30日

单位:人民币元

项 目	本期 2018年1月1日至2018年6月30日	上年度可比期间 2017年1月1日至2017年6月30日
一、收入	704,006,797.46	194,827,928.89
1.利息收入	694,585,317.30	192,863,876.55
其中:存款利息收入	382,549,145.11	93,491,825.54
债券利息收入	268,908,179.03	64,955,344.59
资产支持证券利息收入	－	－
买入返售金融资产收入	43,127,993.16	34,416,706.42
其他利息收入	－	－
2.投资收益(损失以"-"填列)	9,421,480.16	1,964,052.34
其中:股票投资收益	－	－
基金投资收益	－	－
债券投资收益	9,421,480.16	1,964,052.34
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	100,051,788.57	30,209,437.81
1. 管理人报酬	35,981,723.61	10,299,484.73
2. 托管费	10,661,251.45	3,051,699.09
3. 销售服务费	6,145,685.91	1,704,230.73
4. 交易费用	766.65	419.00
5. 利息支出	46,835,801.80	14,903,905.75
其中:卖出回购金融资产支出	46,835,801.80	14,903,905.75
6. 税金及附加	118,509.90	－
7. 其他费用	308,049.25	249,698.51
三、利润总额(亏损总额以"-"号填列)	603,955,008.89	164,618,491.08
减:所得税费用	－	－
四、净利润(净亏损以"-"号填列)	603,955,008.89	164,618,491.08

6.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体:大成月月盈短期理财债券型证券投资基金

本报告期:2018年1月1日 至 2018年6月30日

单位:人民币元

项目	本期 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)	17,660,346,202.91	－	17,660,346,202.91
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	－	603,955,008.89	603,955,008.89
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)	13,723,049,653.31	－	13,723,049,653.31
其中:1.基金申购款	30,870,715,813.70	－	30,870,715,813.70
2.基金赎回款	-17,147,666,160.39	－	-17,147,666,160.39
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)	－	-603,955,008.89	-603,955,008.89
五、期末所有者权益(基金净值)	31,383,395,856.22	－	31,383,395,856.22

项目	上年度可比期间 2017年1月1日至2017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)	1,285,808,927.78	－	1,285,808,927.78
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	－	164,618,491.08	164,618,491.08
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)	8,628,843,325.30	－	8,628,843,325.30
其中:1.基金申购款	13,431,484,607.17	－	13,431,484,607.17
2.基金赎回款	-4,802,641,281.87	－	-4,802,641,281.87
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)	－	-164,618,491.08	-164,618,491.08
五、期末所有者权益(基金净值)	9,914,652,253.08	－	9,914,652,253.08

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______ ______周立新______ ____崔伟____

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一致。

6.4.2 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2004]78号《财政部、国家税务总局关于证券投资基金税收政策的通知》、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行税额抵扣等增值税政策的通知》、国发[1985]19号发布和国务院令[2011]第588号修订的《中华人民共和国城市维护建设税暂行条例》、国务院令[2005]第448号《国务院关于修改〈征收教育费附加的暂行规定〉的决定》、深地税告[2011]6号《深圳市地方税务局关于代征地方教育附加的通告》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)本基金分别按实际缴纳的增值税额的7%、3%和2%缴纳城市维护建设税、教育费附加和地方教育费附加。

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

本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

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")	基金管理人、注册登记机构、基金销售机构
中国银行股份有限公司("中国银行")	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

本报告期内及上年度可比期间本基金无通过关联方交易单元进行的交易。

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

本基金本期及上年度可比期间未发生通过关联方交易单元进行的交易。

6.4.4.1.2 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 2018年1月1日至2018年6月30日	上年度可比期间 2017年1月1日至2017年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	35,981,723.61	10,299,484.73
其中:支付销售机构的客户维护费	232,862.57	15,430.02

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 X 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 2018年1月1日至2018年6月30日	上年度可比期间 2017年1月1日至2017年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	10,661,251.45	3,051,699.09

注:支付基金托管人中国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 X 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 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 大成月月盈短期理财债券A	大成月月盈短期理财债券B	大成月月盈短期理财债券E	合计
大成基金	7,987.70	1,160,970.54	4,457,095.86	5,626,054.10
中国银行	29,984.05	252.82	0.00	30,236.87
合计	37,971.75	1,161,223.36	4,457,095.86	5,656,290.97

获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2017年1月1日至2017年6月30日 当期发生的基金应支付的销售服务费 大成月月盈短期理财债券A	大成月月盈短期理财债券B	大成月月盈短期理财债券E	合计
大成基金	1,324,065.66	2,479.03	335,849.82	1,662,394.51
中国银行	－	27,391.23	－	27,391.23
合计	1,324,065.66	29,870.26	335,849.82	1,689,785.74

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级基金份额、B级基金份额和E级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:

对应级别日销售服务费=前一日对应级别基金资产净值×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

单位:人民币元

银行间市场交易的各关联方名称	本期 2018年1月1日至2018年6月30日 债券交易金额 基金买入	基金卖出	基金逆回购 交易金额	利息收入	基金正回购 交易金额	利息支出
中国银行	200,089,178.08	88,354,872.69	－	－	－	－

银行间市场交易的各关联方名称	上年度可比期间 2017年1月1日至2017年6月30日 债券交易金额 基金买入	基金卖出	基金逆回购 交易金额	利息收入	基金正回购 交易金额	利息支出
中国银行	244,722,710.34	－	－	－	－	－

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 2018年1月1日至2018年6月30日 大成月月盈短期理财债券A	大成月月盈短期理财债券B	大成月月盈短期理财债券E
基金合同生效日(2014年9月12日)持有的基金份额	－	－	－
期初持有的基金份额	－	30,331,061.10	－
期间申购/买入总份额	－	61,195,138.20	－
期间因拆分变动份额	－	－	－
减:期间赎回/卖出总份额	－	－	－
期末持有的基金份额	－	91,526,199.30	－
期末持有的基金份额占基金总份额比例	0.0000%	0.2916%	0.0000%

项目	上年度可比期间 2017年1月1日至2017年6月30日 大成月月盈短期理财债券A	大成月月盈短期理财债券B	大成月月盈短期理财债券E
基金合同生效日(2014年9月12日)持有的基金份额	－	－	－
期初持有的基金份额	－	－	－
期间申购/买入总份额	－	－	－
期间因拆分变动份额	－	－	－
减:期间赎回/卖出总份额	－	－	－
期末持有的基金份额	－	－	－
期末持有的基金份额占基金总份额比例	0.0000%	0.0000%	0.0000%

注:1、期间申购份额包含期间收益再投资份额,基金管理人大成基金管理有限公司于本报告期申购60,045,956.49份 红利再投资1,149,181.71份,申购本基金的费率与本基金法律文件规定一致。

2、期间申购/买入总份额含红利再投份额。

3、基金管理人大成基金管理有限公司发起认购本基金的交易委托中国银行办理,认购本基金的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

本基金本报告期末及上年度末除基金管理人以外的其他关联方未投资本基金。

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 2018年1月1日至2018年6月30日 期末余额	当期利息收入	上年度可比期间 2017年1月1日至2017年6月30日 期末余额	当期利息收入
中国银行	2,367,978.72	12,562.67	6,188,236.54	64,662.82

注:本基金的银行活期存款由基金托管人中国银行保管,按银行同业利率计息。

6.4.4.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

金额单位:人民币元

关联方名称	本期 2018年1月1日至2018年6月30日 证券代码	证券名称	发行方式	基金在承销期内买入 数量(单位:份)	总金额
－	－	－	－	－	－

关联方名称	上年度可比期间 2017年1月1日至2017年6月30日 证券代码	证券名称	发行方式	基金在承销期内买入 数量(单位:份)	总金额
中国银行	011759051	17华电SCP008	簿记建档集中配售	1,000,000	100,000,000.00

6.4.4.7 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期及上年度可比期间无须作说明的其他关联交易事项。

6.4.5 期末(2018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

本基金本期末无因认购新发/增发证券而流通受限的证券。

6.4.5.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金本期末无暂时停牌等流通受限的股票。

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2018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1,599,503,516.04元,是以如下债券作为质押:

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
111808166	18中信银行CD166	2018年7月2日	99.10	592,000	58,667,908.98
130229	13国开29	2018年7月2日	100.05	900,000	90,047,826.26
130421	13农发21	2018年7月2日	100.38	638,000	64,040,336.54
150214	15国开14	2018年7月2日	100.04	400,000	40,015,266.28
150418	15农发18	2018年7月2日	99.98	250,000	24,996,113.95
170207	17国开07	2018年7月2日	100.01	2,500,000	250,021,540.58
170410	17农发10	2018年7月2日	100.03	2,900,000	290,090,598.02
180307	18进出07	2018年7月2日	99.51	200,000	19,902,169.82
189918	18贴现国债18	2018年7月2日	99.84	1,700,000	169,731,197.60
189919	18贴现国债19	2018年7月2日	99.78	700,000	69,842,826.20
189921	18贴现国债21	2018年7月2日	99.67	1,700,000	169,443,978.10
130421	13农发21	2018年7月5日	100.38	1,160,000	116,436,975.53
170017	17附息国债17	2018年7月5日	100.05	1,600,000	160,082,488.74
180306	18进出06	2018年7月5日	99.57	800,000	79,652,731.56
180307	18进出07	2018年7月5日	99.51	300,000	29,853,254.74
合计				16,340,000	1,632,825,212.90

6.4.5.3.2 交易所市场债券正回购

本基金本报告期末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	14,442,283,536.86	43.7100
	其中:债券	14,442,283,536.86	43.7100
	资产支持证券	－	0.0000
2	买入返售金融资产	2,101,737,392.63	6.3600
	其中:买断式回购的买入返售金融资产	－	0.0000
3	银行存款和结算备付金合计	16,313,367,978.72	49.3700
4	其他各项资产	183,417,832.19	0.5600
5	合计	33,040,806,740.40	100.0000

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		12.3400
	其中:买断式回购融资		0.0000
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	1,599,503,516.04	5.1000
	其中:买断式回购融资	－	0.0000

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	100
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	102
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	34

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(%)
1	30天以内	9.9100	5.1000
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	0.0000	0.0000
2	30天(含)—60天	21.6900	0.0000
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	0.0000	0.0000
3	60天(含)—90天	44.7800	0.0000
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	0.0000	0.0000
4	90天(含)—120天	2.4300	0.0000
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	0.0000	0.0000
5	120天(含)—397天(含)	25.8800	0.0000
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	0.0000	0.0000
合计		104.7000	5.1000

7.4 报告期内投资组合平均剩余存续期超过240天情况说明

本报告期内本基金均未发生投资组合平均剩余存续期超过240天的情况。

7.5 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	569,100,490.64	1.8100
2	央行票据	－	0.0000
3	金融债券	1,105,445,826.46	3.5200
	其中:政策性金融债	1,105,445,826.46	3.5200
4	企业债券	－	0.0000
5	企业短期融资券	2,420,141,267.78	7.7100
6	中期票据	－	0.0000
7	同业存单	10,347,595,951.98	32.9700
8	其他	－	0.0000
9	合计	14,442,283,536.86	46.0200
10	剩余存续期超过397天的浮动利率债券	－	0.0000

7.6 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

金额单位:人民币元

序号	债券代码	债券名称	债券数量(张)	摊余成本	占基金资产净值比例(%)
1	111809196	18浦发银行CD196	13,000,000	1,273,463,697.61	4.0600
2	111811139	18平安银行CD139	6,000,000	595,825,197.00	1.9000
3	111815230	18民生银行CD230	5,000,000	496,767,011.32	1.5800
4	111809159	18浦发银行CD159	5,000,000	496,520,773.48	1.5800
4	111810249	18兴业银行CD249	5,000,000	496,520,773.48	1.5800
5	111808153	18中信银行CD153	5,000,000	496,460,999.61	1.5800
6	111899604	18大连银行CD104	5,000,000	495,116,469.66	1.5800
7	111899723	18盛京银行CD234	5,000,000	495,000,295.40	1.5800
8	111820086	18广发银行CD086	5,000,000	484,051,351.71	1.5400
9	111896207	18宁波银行CD074	3,000,000	298,890,389.48	0.9500
10	111899662	18厦门国际银行CD135	3,000,000	297,083,362.96	0.9500

7.7 "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	－
报告期内偏离度的最高值	0.1097%
报告期内偏离度的最低值	-0.0035%
报告期内每个交易日偏离度的绝对值的简单平均值	0.0417%

报告期内负偏离度的绝对值达到0.25%情况说明

本报告期内,本基金未发生超标情况。

报告期内正偏离度的绝对值达到0.5%情况说明

本报告期内,本基金未发生超标情况。

7.8 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

本报告期末未持有资产支持证券。

7.9 投资组合报告附注

7.9.1 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1.0000元。

7.9.2 本基金投资的前十名证券之一18浦发银行CD196(111809196)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。

本基金投资的前十名证券之一18平安银行CD139(111811139)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。

本基金投资的前十名证券之一18浦发银行CD159(111809159)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。

本基金投资的前十名证券之一18兴业银行CD249(111810249)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。

本基金投资的前十名证券之一18广发银行CD086(111820086)的发行主体广发银行股份有限公司于2017年11月17日因出具与事实不符的金融票证等,受到中国银行业监督管理委员会处罚(银监罚决字〔2017〕26号)。本基金认为,对广发银行的处罚不会对其投资价值构成实质性负面影响。

7.9.3 期末其他各项资产构成

单位:人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	－
2	应收证券清算款	－
3	应收利息	183,357,832.19
4	应收申购款	60,000.00
5	其他应收款	－
6	待摊费用	－
7	其他	－
8	合计	183,417,832.19

7.9.4 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。

§8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位:份

份额级别	持有人户数(户)	户均持有的基金份额	持有人结构 机构投资者 持有份额	占总份额比例	个人投资者 持有份额	占总份额比例
大成月月盈短期理财债券A	13,110	16,324.16	4,427,085.39	2.07%	209,582,638.66	97.93%
大成月月盈短期理财债券B	31	938,384,238.84	29,084,755,538.63	99.98%	5,155,865.55	0.02%
大成月月盈短期理财债券E	50,111	41,497.37	－	0.00%	2,079,474,727.99	100.00%
合计	63,252	496,164.48	29,089,182,624.02	92.69%	2,294,213,232.20	7.31%

注:1、上述机构/个人投资者持有份额占总份额比例的计算中,对分级份额,比例的分母采用各自级别的份额,对合计数,比例的分母采用下属分级基金份额的合计数(即期末基金份额总额)。

2、持有人户数为有效户数,即存量份额大于零的账户。

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数(份)	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	大成月月盈短期理财债券A	589,676.82	0.2755%
	大成月月盈短期理财债券B	－	0.0000%
	大成月月盈短期理财债券E	10,200.61	0.0005%
	合计	599,877.43	0.0019%

注:上述占基金总份额比例的计算中,对分级份额,比例的分母采用各自级别的份额,对合计数,比例的分母采用下属分级基金份额的合计数(即期末基金份额总额)。

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

项目	份额级别	持有基金份额总量的数量区间(万份)
本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	大成月月盈短期理财债券A	0
	大成月月盈短期理财债券B	0
	大成月月盈短期理财债券E	0
	合计	0
本基金基金经理持有本开放式基金	大成月月盈短期理财债券A	0
	大成月月盈短期理财债券B	0
	大成月月盈短期理财债券E	0
	合计	0

§9 开放式基金份额变动

单位:份

	大成月月盈短期理财债券A	大成月月盈短期理财债券B	大成月月盈短期理财债券E
基金合同生效日(2014年9月12日)基金份额总额	35,756,883.12	145,202,557.59	－
本报告期期初基金份额总额	180,497,323.31	14,889,242,261.93	2,590,606,617.67
本报告期基金总申购份额	794,442,680.71	25,095,791,089.11	4,980,482,043.88
减:本报告期基金总赎回份额	760,930,279.97	10,895,121,946.86	5,491,613,933.56
本报告期基金拆分变动份额(份额减少以"-"填列)	－	－	－
本报告期期末基金份额总额	214,009,724.05	29,089,911,404.18	2,079,474,727.99

§10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

报告期内无基金份额持有人大会决议。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本报告期内,基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内没有涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

10.4 基金投资策略的改变

基金投资策略在本报告期内没有重大改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金聘任的为本基金审计的会计师事务所为普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙),该事务所自基金合同生效日起为本基金提供审计服务至今。

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内,基金管理人、基金托管人的托管业务部门及其高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位:人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易 成交金额	占当期股票成交总额的比例	应支付该券商的佣金 佣金	占当期佣金总量的比例	备注
安信证券	2	－	0.0000%	－	0.0000%	－
渤海证券	2	－	0.0000%	－	0.0000%	－
财富证券	1	－	0.0000%	－	0.0000%	－
长城证券	1	－	0.0000%	－	0.0000%	－
长江证券	1	－	0.0000%	－	0.0000%	－
东方证券	1	－	0.0000%	－	0.0000%	－
东海证券	1	－	0.0000%	－	0.0000%	－
东莞证券	1	－	0.0000%	－	0.0000%	－
东吴证券	1	－	0.0000%	－	0.0000%	－
东兴证券	1	－	0.0000%	－	0.0000%	－
方正证券	1	－	0.0000%	－	0.0000%	－
光大证券	2	－	0.0000%	－	0.0000%	－
广发证券	1	－	0.0000%	－	0.0000%	－
广州证券	1	－	0.0000%	－	0.0000%	－
国都证券	1	－	0.0000%	－	0.0000%	－
国海证券	1	－	0.0000%	－	0.0000%	－
国泰君安	1	－	0.0000%	－	0.0000%	－
国信证券	1	－	0.0000%	－	0.0000%	－
海通证券	2	－	0.0000%	－	0.0000%	－
恒泰证券	1	－	0.0000%	－	0.0000%	－
华宝证券	1	－	0.0000%	－	0.0000%	－
华福证券	1	－	0.0000%	－	0.0000%	－
华林证券	1	－	0.0000%	－	0.0000%	－
华泰证券	2	－	0.0000%	－	0.0000%	－
华鑫证券	1	－	0.0000%	－	0.0000%	－
江海证券	1	－	0.0000%	－	0.0000%	－
民生证券	1	－	0.0000%	－	0.0000%	－
民族证券	1	－	0.0000%	－	0.0000%	－
平安证券	1	－	0.0000%	－	0.0000%	－
申银万国	1	－	0.0000%	－	0.0000%	－
太平洋证券	1	－	0.0000%	－	0.0000%	－
天源证券	1	－	0.0000%	－	0.0000%	－
万联证券	1	－	0.0000%	－	0.0000%	－
西南证券	1	－	0.0000%	－	0.0000%	－
湘财证券	1	－	0.0000%	－	0.0000%	－
银河证券	1	－	0.0000%	－	0.0000%	－
英大证券	1	－	0.0000%	－	0.0000%	－
招商证券	2	－	0.0000%	－	0.0000%	－
中航证券	1	－	0.0000%	－	0.0000%	－
中金公司	2	－	0.0000%	－	0.0000%	－
中泰证券	1	－	0.0000%	－	0.0000%	－
中投证券	3	－	0.0000%	－	0.0000%	－
中信建投证券	1	－	0.0000%	－	0.0000%	－
中信证券	2	－	0.0000%	－	0.0000%	－
中银国际	1	－	0.0000%	－	0.0000%	－

注:根据中国证监会颁布的《关于完善证券投资基金交易席位制度有关问题的通知》(证监基金字[2007]48号)的有关规定,本公司制定了租用证券公司交易单元的选择标准和程序。租用证券公司交易单元的选择标准主要包括:

(一)财务状况良好,最近一年无重大违规行为;

(二)经营行为规范,内控制度健全,能满足各投资组合运作的保密性要求;

(三)研究实力较强,能提供包括研究报告、路演服务、协助进行上市公司调研等研究服务;

(四)具备各投资组合运作所需的高效、安全的通讯条件,有足够的交易和清算能力,满足各投资组合证券交易需要;

(五)能提供投资组合运作、管理所需的其他券商服务;

(六)相关基金合同、资产管理合同以及法律法规规定的其他条件。

租用证券公司交易单元的程序:首先根据租用证券公司交易单元的选择标准形成《券商服务评价表》,然后根据评分高低进行选择基金交易单元。

本报告期内本基金租用证券公司交易单元的变更情况如下:

本报告期内增加交易单元:太平洋证券。本报告期内退租交易单元:无。

10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位:人民币元

券商名称	债券交易 成交金额	占当期债券成交总额的比例	债券回购交易 成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	权证交易 成交金额	占当期权证成交总额的比例
安信证券	－	0.0000%	－	0.0000%	－	0.0000%
渤海证券	－	0.0000%	－	0.0000%	－	0.0000%
财富证券	－	0.0000%	－	0.0000%	－	0.0000%
长城证券	－	0.0000%	－	0.0000%	－	0.0000%
长江证券	－	0.0000%	－	0.0000%	－	0.0000%
东方证券	－	0.0000%	－	0.0000%	－	0.0000%
东海证券	－	0.0000%	－	0.0000%	－	0.0000%
东莞证券	－	0.0000%	－	0.0000%	－	0.0000%
东吴证券	－	0.0000%	－	0.0000%	－	0.0000%
东兴证券	－	0.0000%	－	0.0000%	－	0.0000%
方正证券	－	0.0000%	－	0.0000%	－	0.0000%
光大证券	－	0.0000%	－	0.0000%	－	0.0000%
广发证券	－	0.0000%	－	0.0000%	－	0.0000%
广州证券	－	0.0000%	－	0.0000%	－	0.0000%
国都证券	－	0.0000%	－	0.0000%	－	0.0000%
国海证券	－	0.0000%	－	0.0000%	－	0.0000%
国泰君安	－	0.0000%	－	0.0000%	－	0.0000%
国信证券	－	0.0000%	－	0.0000%	－	0.0000%
海通证券	－	0.0000%	－	0.0000%	－	0.0000%
恒泰证券	－	0.0000%	－	0.0000%	－	0.0000%
华宝证券	－	0.0000%	－	0.0000%	－	0.0000%
华福证券	－	0.0000%	－	0.0000%	－	0.0000%
华林证券	－	0.0000%	－	0.0000%	－	0.0000%
华泰证券	－	0.0000%	－	0.0000%	－	0.0000%
华鑫证券	－	0.0000%	－	0.0000%	－	0.0000%
江海证券	－	0.0000%	－	0.0000%	－	0.0000%
民生证券	－	0.0000%	－	0.0000%	－	0.0000%
民族证券	－	0.0000%	－	0.0000%	－	0.0000%
平安证券	－	0.0000%	－	0.0000%	－	0.0000%
申银万国	－	0.0000%	－	0.0000%	－	0.0000%
太平洋证券	－	0.0000%	－	0.0000%	－	0.0000%
天源证券	－	0.0000%	－	0.0000%	－	0.0000%
万联证券	－	0.0000%	－	0.0000%	－	0.0000%
西南证券	－	0.0000%	－	0.0000%	－	0.0000%
湘财证券	－	0.0000%	－	0.0000%	－	0.0000%
银河证券	－	0.0000%	－	0.0000%	－	0.0000%
英大证券	－	0.0000%	－	0.0000%	－	0.0000%
招商证券	－	0.0000%	－	0.0000%	－	0.0000%
中航证券	－	0.0000%	－	0.0000%	－	0.0000%
中金公司	－	0.0000%	－	0.0000%	－	0.0000%
中泰证券	－	0.0000%	－	0.0000%	－	0.0000%
中投证券	－	0.0000%	－	0.0000%	－	0.0000%
中信建投证券	－	0.0000%	－	0.0000%	－	0.0000%
中信证券	－	0.0000%	－	0.0000%	－	0.0000%
中银国际	－	0.0000%	－	0.0000%	－	0.0000%

10.8 偏离度绝对值超过0.5%的情况

本基金本报告期内无偏离度绝对值超过0.5%的情况。

§11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 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 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	报告期末持有基金情况 持有份额	份额占比
机构	1	20180108-20180109	3,500,000,000.00	69,298,812.65	3,569,298,812.65	－	0.00%
	－	－	－	－	－	－	－
个人							
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。							

11.2 影响投资者决策的其他重要信息

根据《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》的要求,本基金管理人经与基金托管人协商一致,对本基金基金合同的有关条款进行了修改,主要在前言、释义、投资交易限制、申购与赎回管理、基金估值管理、信息披露等方面对流动性风险管控措施进行明确,具体内容详见2018年3月27日基金管理人网站披露的相关公告和修订更新后的法律文件。

大成基金管理有限公司

2018年8月29日