大成月添利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:中国农业银行股份有限公司
送出日期:2018年8月29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	大成月添利理财债券		
基金主代码	0900021		
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	15,177,966,359.69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:	0900021	091021	001497
报告期末下属分级基金的份额总额	155,877,102.55份	14,996,614,050.65份	25,475,206.49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	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	大成月添利债券A	大成月添利债券B	大成月添利债券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	3,233,611.63	146,806,244.34	687,341.92
本期利润	3,233,611.63	146,806,244.34	687,341.92
本期净值收益率	2.2119%	2.3580%	2.2117%
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	155,877,102.55	14,996,614,050.65	25,475,206.49
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。

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 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	0.3445%	0.0002%	0.1110%	0.0000%	0.2335%	0.0002%
过去三个月	1.0571%	0.0005%	0.3366%	0.0000%	0.7205%	0.0005%
过去六个月	2.2119%	0.0007%	0.6695%	0.0000%	1.5424%	0.0007%
过去一年	4.3611%	0.0011%	1.3500%	0.0000%	3.0111%	0.0011%
过去三年	11.0168%	0.0045%	4.0500%	0.0000%	6.9668%	0.0045%
自基金合同生效起至今	27.0049%	0.0100%	7.8004%	0.0000%	19.2045%	0.0100%

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	0.3683%	0.0002%	0.1110%	0.0000%	0.2573%	0.0002%
过去三个月	1.1301%	0.0005%	0.3366%	0.0000%	0.7935%	0.0005%
过去六个月	2.3581%	0.0007%	0.6695%	0.0000%	1.6886%	0.0007%
过去一年	4.6630%	0.0011%	1.3500%	0.0000%	3.3130%	0.0011%
过去三年	11.9853%	0.0045%	4.0500%	0.0000%	7.9353%	0.0045%
自基金合同生效起至今	29.1468%	0.0100%	7.8004%	0.0000%	21.3464%	0.0100%

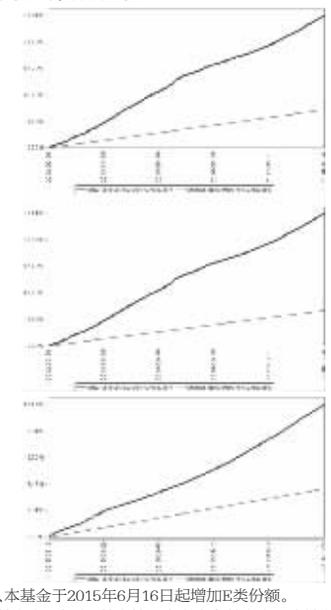
大成月添利债券E

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	0.3444%	0.0002%	0.1110%	0.0000%	0.2334%	0.0002%
过去三个月	1.0570%	0.0005%	0.3366%	0.0000%	0.7204%	0.0005%
过去六个月	2.2117%	0.0007%	0.6695%	0.0000%	1.5422%	0.0007%
过去一年	4.3615%	0.0011%	1.3500%	0.0000%	3.0115%	0.0011%
过去三年	11.0167%	0.0045%	4.0500%	0.0000%	6.9667%	0.0045%
自基金合同生效起至今	11.1761%	0.0046%	4.0944%	0.0000%	7.0817%	0.0046%

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,是按各统计时间阶段计算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、本基金于2015年6月16日起增加E类份额。

2、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。建仓期结束时,本基金的投资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		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
陈会荣先生	本基金基金经理	2017年3月22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日起任大成景耀灵活配置混合型证券投资基金基金经理,自2016年8月16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、大成基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

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;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

本报告期大成月添利债券A的基金份额净值收益率为2.2119%,本报告期大成月添利债券B的基金份额净值收益率为2.3580%, 本报告期大成月添利债券E的基金份额净值收益率为2.2117%, 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、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、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三名投资组合经理。

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;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150,727,197.89元,报告期内已分配利润150,727,197.89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

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 2018 年 1 月 1 日至 2018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: 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	5,512,697,022.76	2,633,686,874.59
结算备付金	-	-
存出保证金	-	-
交易性金融资产	7,630,786,758.48	1,572,777,476.37
其中:股票投资	-	-
基金投资	-	-
债券投资	7,630,786,758.48	1,572,777,476.37
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	2,019,448,349.17	119,600,299.40
应收证券清算款	-	-
应收利息	39,893,650.42	10,118,291.86
应收股利	-	-
应收申购款	250,414.26	-
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	-
资产总计	15,203,076,195.09	4,336,182,942.22
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	-	198,073,260.96
应付证券清算款	-	-
应付赎回款	-	-
应付管理人报酬	2,288,451.51	407,428.74
应付托管费	678,059.69	120,719.61
应付销售服务费	130,573.22	39,650.17
应付交易费用	109,930.31	25,480.88
应交税费	-	-
应付利息	-	127,854.56
应付利润	21,703,225.97	4,682,041.34
递延所得税负债	-	-
其他负债	199,594.70	291,610.00
负债合计	25,109,835.40	203,768,046.26
所有者权益:		
实收基金	15,177,966,359.69	4,132,414,895.96
未分配利润	-	-
所有者权益合计	15,177,966,359.69	4,132,414,895.96
负债和所有者权益总计	15,203,076,195.09	4,336,182,942.22

注:报告截止日2018年6月30日,基金份额净值1.000元,基金份额总额15,177,966,359.69份,其中A类基金份额的份额总额为155,877,102.55份,B类基金份额的份额总额为14,996,614,050.65份,E类基金份额的份额总额为25,475,206.49份。

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: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	172,724,392.99	11,479,247.13
1.利息收入	172,704,202.68	11,478,969.47
其中:存款利息收入	93,984,523.03	6,651,439.99
债券利息收入	69,115,108.41	2,241,310.83
资产支持证券利息收入	-	-
买入返售金融资产收入	9,604,571.24	2,586,218.69
其他利息收入	-	-
2.投资收益(损失以 "-" 填列)	20,190.31	277.66
其中:股票投资收益	-	-
基金投资收益	-	-
债券投资收益	20,190.31	277.66
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	21,997,195.10	1,679,856.57
1. 管理人报酬	8,736,077.10	687,546.92
2. 托管费	2,588,467.23	203,717.55
3. 销售服务费	581,756.10	173,034.92
4. 交易费用	-	-
5. 利息支出	9,851,648.72	393,704.46
其中:卖出回购金融资产支出	9,851,648.72	393,704.46
6. 税金及附加	-	-
7. 其他费用	239,245.95	221,852.72
三、利润总额(亏损总额以 "-" 号填列)	150,727,197.89	9,799,390.56
减:所得税费用	-	-
四、净利润(净亏损以 "-" 号填列)	150,727,197.89	9,799,390.56

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: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)	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数 (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数 (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
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)	543,347,437.25	-	543,347,437.25
二、本期经营活动产生的基金净值变动数 (本期利润)	-	9,799,390.56	9,799,390.56
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)	783,352,046.84	-	783,352,046.84
其中:1.基金申购款	1,322,747,322.79	-	1,322,747,322.79
2.基金赎回款	-539,395,275.95	-	-539,395,275.95
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)	-	-9,799,390.56	-9,799,390.56
五、期末所有者权益(基金净值)	1,326,699,484.09	-	1,326,699,484.09

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相一致。

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

本报告期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。

6.4.4.2 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	8,736,077.10	687,546.92
其中:支付销售机构的客户维护费	87,007.15	73,683.64

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	2,588,467.23	203,717.55

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 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	0.00	0.00	42,721.91
合计	48,342.59	314,494.02	46,347.03	409,183.64
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	16,787.43	5,853.10	19,192.91	41,833.44
中国农业银行	-	68,598.27	1,182.90	69,781.17
合计	16,787.43	74,451.37	20,375.81	111,614.61

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:

日销售服务费=前一日基金资产净值 X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

本基金本报告期内及上年度可比期间未发生与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。

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		
	大成月添利债券A	大成月添利债券B	大成月添利债券E
基金合同生效日 (2012年9月20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		68,000,000.00	-
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	-	68,000,000.00	-
期末持有的基金份额 占基金总份额比例	0.0000%	0.4500%	0.0000%
项目	上年度可比期间 2017年1月1日至2017年6月30日		
	大成月添利债券A	大成月添利债券B	大成月添利债券E
基金合同生效日 (2012年9月20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		150,000,000.00	-
期间因拆分变动份额	-	-	-
减:期间赎回/卖出总份额	-	150,000,000.00	-
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:基金管理人大成基金在本年度申购和赎回本基金通过直销中心办理,申购、赎回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

本基金本报告期末除基金管理人之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		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	期末余额	当期利息收入
中国农业银行	2,697,022.76	12,797.35	281,167.72	16,799.79

注:本基金的银行存款由基金托管人中国农业银行保管,按约定利率计息。

6.4.4.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本报告期及上年度可比期间本基金未在承销期内参与关联方承销证券。

6.4.4.7 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。

6.4.5 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

于本报告期末,本基金未持有因认购新发或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

于本报告期末,本基金未持有暂时停牌等流通受限股票。

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

本基金本报告期末无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。

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	7,630,786,758.48	50.19
	其中:债券	7,630,786,758.48	50.19
	资产支持证券	-	0.00
2	买入返售金融资产	2,019,448,349.17	13.28
	其中:买断式回购的买入返售金融资产	-	0.00
3	银行存款和结算备付金合计	5,512,697,022.76	36.26
4	其他各项资产	40,144,064.68	0.26
5	合计	15,203,076,195.09	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	8.53	
	其中:买断式回购融资	0.00	
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	-	0.00
	其中:买断式回购融资	-	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	92
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	107
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	36

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	13.98	0.00
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	0.00	0.00
2	30天(含)—60天	4.64	0.00
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	0.00	0.00
3	60天(含)—90天	51.08	0.00
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	0.00	0.00
4	90天(含)—120天	2.65	0.00
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	0.00	0.00
5	120天(含)—397天(含)	27.55	0.00
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	0.00	0.00
合计		99.90	0.00

报告期内负偏离度的绝对值达到0.25%情况说明

本基金报告期内未发生负偏离度的