信息披露 Disclosure

大成添益交易型货币市场基金

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 送出日期:2018年8月29日

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別及连带的法律责任。 本半年度报告已经三分之工以上独立董事客学同意,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9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

本于中医院上 度报告正文财务资料未经审计。 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

基金简称	大成添益交易型货币		
基金主代码	003252		
交易代码	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		
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	4,721,359,696.2	5份	
基金合同存续期	不定期		
基金份额上市的证券交易所	上海证券交易所		
上市日期	2016年10月20日		
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
下属分级基金的交易代码:	003252	003253	511690
报告期末下属分级基金的份额总额	7,319,541.86份	148,501.43份	4,713,891,652.96 份

注:1.本基金场外基金价额(A类,B类基金价额)简称"大成添益交易型货币 A""大成添益交易型货币B"基金价额净值为1.00元。 2.本基金化浆基金价%上市交易,简称为"交易货币",基金份额面值为100.00元。 元,本表所列E类价额数据面值已折算为1元。

投资目标 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。 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 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 组合平均期限范围确定类属资产配置。 3、组合平均剩余期限配置策略 基金根据对未要短期利率走势的研判。结合基金资产流动性的要求 加密调整组合久期。当预期短期利率上升时,降低组合久期,以规避资本 现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, 投资策略 J获得资本利得或锁定较高的利率水平。 4. 银行存款投资策略 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

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 日素的综合分析,对资金利率变动趋势进行评估,最大限度地优化存款期 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

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

动性监控管理指标,实现对基金资产流动性的实时管理。 b绩比较基准 P国人民银行公布的人民币活期存款基准利率(税后) X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 中国银行股份有限公司

基金半年度报告备置地点

			金额单位:人民
基金级别	大成添益交易型货币A	大成添益交易型货币 B	交易货币
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	163,550.75	4,252.18	109,285,159.89
本期利润	163,550.75	4,252.18	109,285,159.89
本期净值收益率	2.0428%	2.1647%	2.0426%
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	7,319,541.86	148,501.43	4,713,891,652.96
期末基金份额净值	1.0000	1.0000	1.0000

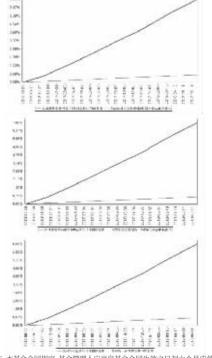
| 期末基金份額净值 | 10000 | 10000 | 10000 | 10000 | 注:1.本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入(不含公允价值变动收益)和除相关被用后的余额、本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益,由于货币市场基金采用推杂成本法核算,因此、公允价值变动收益为零,本期已实现收益和本期利润的金额相等。
2.本基金收益分配按日结转份额。

2. A 基金净值表现 3.2. 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

	份额净值	份额净值	业绩比较	业绩比较基		
阶段		收益率标	基准收益	准收益率标	(I) - (3)	2-4
	收益率①	准差②	率(3)	准差④		
过去一个 月	0.3236%	0.0010%	0.0288%	0.0000%	0.2948%	0.0010%
过去三个 月	0.9659%	0.0007%	0.0873%	0.0000%	0.8786%	0.0007%
过去六个 月	2.0428%	0.0009%	0.1736%	0.0000%	1.8692%	0.0009%
过去一年	4.0175%	0.0010%	0.3500%	0.0000%	3.6675%	0.0010%
自基金合 同生效起 至今	6.6312%	0.0016%	0.6135%	0.0000%	6.0177%	0.0016%
		大师	戈添益交易	型货币B		
阶段	份額净值 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	0.3434%	0.0010%	0.0288%	0.0000%	0.3146%	0.0010%
过去三个 月	1.0264%	0.0007%	0.0873%	0.0000%	0.9391%	0.0007%
过去六个 月	2.1647%	0.0009%	0.1736%	0.0000%	1.9911%	0.0009%
过去一年	4.2669%	0.0010%	0.3500%	0.0000%	3.9169%	0.0010%
自基金合						

过去六个 月	2.1647%	0.0009%	0.1736%	0.0000%	1.9911%	0.0009%
过去一年	4.2669%	0.0010%	0.3500%	0.0000%	3.9169%	0.0010%
自基金合 同生效起 至今	7.0805%	0.0016%	0.6135%	0.0000%	6.4670%	0.0016%
			交易货			
阶段	份額净值 收益率①	份額净值 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	0.3234%	0.0010%	0.0288%	0.0000%	0.2946%	0.0010%
过去三个 月	0.9655%	0.0007%	0.0873%	0.0000%	0.8782%	0.0007%
过去六个 月	2.0426%	0.0009%	0.1736%	0.0000%	1.8690%	0.0009%
过去一年	4.0169%	0.0010%	0.3500%	0.0000%	3.6669%	0.0010%
自基金合 同生效起	6.6584%	0.0020%	0.6135%	0.0000%	6.0449%	0.0020%

至今 3.2.2 目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 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。

基本乔夸陈地区时间进入发行。 产管理和CDIU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,构建了超盖股票型基金、混合型基金、指数型基金、债券型基金和 货市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ODII基金及75只开放式证券投资基金。

姓名	职务		王本基金的基金经理(助理)期 限		说明
		任职日期	离任日期	业年限	
朱哲先生	本基金经理	2016年10月12日	-	9年	中国社会经常正确管理题中,中国人 大学经济学产生、2006年7月至20169 任中国银行金融市总总规则要设置处理 现实局。2016年8月至2016年7月 现实局。2016年8月至2016年7月 现实局。2016年8月至2016年7月 基础规划,2016年8月至2016年7月 基础规划,2016年8月至2016年7月 基础规划,2016年8月至2016年7月 第二十年8月至2016年7月 第二十年8月至2016年7月 第二十年8月至2016年7日 第二十年8月至2016年7日 第二十年8月至2016年7日 第二十年8月至2016年7日 第二十年8月至2016年7月至18日 第二十年8月至2016年7月至18日 第二十年8月至2016年7月至18日 第二十年8月至2016年7月至18日至2016年7日 第二十年8月至2016年7月至18日至2016年7日 第二十年8月至2016年7月至18日至2016年7日 第二十年8月至2016年7月至18日至2016年7日

在:1、任职日期,尚任日期月4年基金百理人下旧价化之口。 2、证券从业年限的计算标准遵从行业协会(证券业价从业人员资格管理办法)的相关规定。 42 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、基金相影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、勤慰尽责的原则管理和运用基金资产,在规范基金运作和严格影明投资风险的前提下,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 4.31 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走缐小季度的自内。3日内及6日内股票及债券交易占则可多易修选进行分析。分析结果实时。倘身公园间向交易传递进行分析。分析结果实时。倘身公园间向交易传递进行分析。少有线事使。他与自价格根据较高)及 组合经理支贴时机选炼。银度领在设定时间不一般以及成交价格解解较完高)及 组合经理支贴时机选炼。银度资任为使农业时间不一般以及成交价格解解较高)及 组合经理支贴时机选炼。银度资金的证不一成以及成交价格解解较高)及

;期内已分配利润109,452,962.82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")在大成添益交易型货币市场基金(以下称"本基金")的环管过程中,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运治。全与即归某种据行了应用的义务

及其他有大広年达珠, 您就可由5月10日以下以下了个小人人 人利益的行为,完全尽职民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,基金会 "你见证法法证法法子"以图的监督。 对基金资产

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,基金合产 同租托管协议的规定,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,基金命值收益率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。
6.3 托管人对本半年度报告中纳务信息等内容的真实,准确和完整发表意见 本报告中的剪分指标,净值表现,收益分配情况,财务会计报告(注:财务会计报告(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。
6.4 等产收益核、比较多效公司组织不可证及基本

6.1 页广贝债表 会计主体:大成添益交易型货币市场基金 报告截止日: 2018年6月30日

遊 /位	本期末	上年度末
327)***	2018年6月30日	2017年12月31日
资产:		
银行存款	1,905,412,340.09	2,897,329,169.06
结算备付金	7,800.00	38,636.36
存出保证金	-	_
交易性金融资产	2,102,849,166.06	902,293,291.73
其中:股票投资	-	_
基金投资		_
债券投资	2,102,849,166.06	902,293,291.73
资产支持证券投资	-	-
贵金属投资	-	_
衍生金融资产	-	_
买人返售金融资产	770,376,595.57	596,626,414.94
应收证券清算款	-	-
应收利息	12,281,276.96	19,969,745.33
应收股利	_	_
应收申购款	100,000.00	_
递延所得税资产	_	_
其他资产	-	_
资产总计	4,791,027,178.68	4,416,257,257.42
	本期末	上年度末
负债和所有者权益	2018年6月30日	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	65,799,847.10	113,999,709.00
应付证券清算款	-	-
应付赎回款	-	_
应付管理人报酬	1,089,258.33	855,682.26
应付托管费	348,562.66	273,818.39
应付销售服务费	1,089,229.04	855,634.92
应付交易费用	34,003.43	32,502.07
应交税费	33,122.28	_
应付利息	21,734.82	56,437.44
应付利润	1,009,658.31	1,921,876.58
递延所得税负债	_	_
其他负债	242,066.46	309,000.00
负债合计	69,667,482,43	118,304,660.66
所有者权益:		, ,
实收基金	4,721,359,696.25	4,297,952,596.76
未分配利润	-,,,	-,,,,
所有者权益合计	4,721,359,696.25	4,297,952,596.76
负债和所有者权益总计	4,791,027,178.68	4,416,257,257.42

1,0000元,E类基金分额净值100,00元;基金分额净值1,0000元,B类基金分额净值 级基金分额户值100,00元;基金分额总额4,721,359,636,25份,下属分级基金分额总额分别为:A类基金分额总额7,319,541,86份,B类基金分额总额148,501,43份,E类基金分额总额4,713,891,652,96份,其中E类分额净值已折算为1元。

本报告期:2018年1月1日至2		单位:人民
	本期	上年度可比期间
项目	2018年1月1日至2018年6月	2017年1月1日至2017年6
	30日	月30日
一、收入	127,145,635.99	87,979,418.25
1.利息收入	127,137,246.52	87,964,792.32
其中:存款利息收入	86,135,503.67	62,262,476.19
债券利息收入	32,335,885.96	14,103,401.41
资产支持证券利息收入	-	-
买人返售金融资产收入	8,665,856.89	11,598,914.72
其他利息收入	-	_
2.投资收益(损失以"-"填列)	8,389.47	11,625.93
其中:股票投资收益	-	_
基金投资收益	-	_
债券投资收益	8,389.47	11,625.93
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)	-	3,000.00
减:二、费用	17,692,673.17	12,645,092.07
1. 管理人报酬	6,749,502.46	5,113,107.03
2. 托管费	2,159,840.81	1,636,194.21
3. 销售服务费	6,749,269.07	5,104,261.30
4. 交易费用	-	_
5. 利息支出	1,732,555.04	494,538.46
其中:卖出回购金融资产支出	1,732,555.04	494,538.46
6. 税金及附加	10,306.81	_
7. 其他费用	291,198.98	296,991.07
三、利润总额(亏损总额以"-"号	109,452,962.82	75,334,326.18
填列)	100,302,302	70,001,020.10
减:所得税费用	-	-
四、净利润(净亏损以"-"号填列)	109,452,962.82	75,334,326.18

单位:人民币元

项目 4,297,952,596 4,297,952,596. 基金净值 二、本期经营活动 生的基金净值变动 太期基金份額 产生的基金净值 423,407,099 (净值减少 其中:1.基金申购款 持有人分配利润? り基金净値変动 () -109.452.962.8 -109.452.962 、期末所有者权 4,721,359,6962 4,721,359,696.3 项目 3,188,444,7 (基金净值) 、本期经营活 的基金净值变 75,334,326. 75,334,32 本期基金份额 △生的基金净值 (净值减少)

其中:1.基金申购款 、本期向基金(有人分配利润) 的基金净值变动() -75,334,326. 值减少以"_"号: 、期末所有者权益 3,856,922,042 3,856,922,042 基金净值) 报表附注为 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 基金管理人负责人 主管会计工作负责人 会计机构负责

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

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。

0.42 06:39 根據財政部、国家稅务总局財稅12004178号《財政部、国家稅务总局关于证券 投资基金稅收政策的通知》、財稅1200811号《关于企业所得稅若干优惠政策的通 知》、財稅12016136号《关于全面推开营业稅改征增值稅试点的通知》、財稅120161 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 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

征地万教育附加的通告》及其他相关财税法规相议多操作,主要税项列示如下: (1) 簽管产品居营业相中发生的增值款应积行为, 设套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 中发生的增值税达税行力, 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。

外风151一向15理AVA用月707的項目被处239份额平155%。 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。资营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 为其价单位,最近公债等42%。 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。

1317-311-03422/0317-7-05187896。 (4)本基金分別按支际破绝的增值税额的7%、3%和2%缴纳城市维护建设税、教育教附加和地方教育教附加。 6.43 关账方关系 6.43.1 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

本基金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") 基金任管人基金销售机构 光大证券股份有限公司("光大证券") 基金管理人的股东、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 期内本基金不存在通过关联方交易单元进行的股票交易。

本报告期内本基金不存在通过关联方交易单元进行的债券交易。

6.4.4.1.3 债券回购交易 本报告期内本基金不存在通过关联方交易单元进行的债券回购交易

不能在1997年建立个平年通过文联方交易单元进行的权证交易。 6.44.14 权证交易 本报告期内本基金不存在通过关联方交易单元进行的权证交易。 6.44.1.5 应支付关联方的佣金

6.4.4.2 关联方报酬

6.4.4.2.1 基金管理	费	
		单位:人民币
est en	本期	上年度可比期间
项目	2018年1月1日至2018年6月30日	2017年1月1日至2017年6月30日
当期发生的基金应支付	6,749,502.46	5,113,107.03
的管理费	6,749,502.46	6,113,107.03
其中: 支付销售机构的	440 440 00	477 040 00
客户维护费	116,143.29	177,218.39
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0.25%

年费率计提,该日累计至每月月底,按月支付。其计篇公式为

	一日基金资产净值 × 0.25 费	5% / 当年天数。	
		单位:人民市	力元
项目	本期	上年度可比期间	
州目	2018年1月1日至2018年6月30日	2017年1月1日至2017年6月30日	
当期发生的基金应支付	2.159.840.81	1.636.194.21	

生,支付其全托管人由国银行的托管费按前一日其全资产净值0.08%的任费家

D.4.4.2.0 H1 E/10073	,,4			单位:人民		
			本期			
THE COUNTY AND ADDRESS OF THE CASE.		2018年1月1日至2018年6月30日				
获得销售服务费的		当期发生的基	金应支付的销售服	另费		
各关联方名称	大成添益交易	大成添益交	obs ET About	合计		
	型货币A	易型货币B	交易货币	台げ		
中国银行	2,244.38	2.96	975,689.35	977,936.69		
大成基金	276.56	0.33	_	276.89		
光大证券	_	-	512,134.78	512,134.78		
合计	2,520.94	3.29	1,487,824.13	1,490,348.36		
		上台	F度可比期间			
获得销售服务费的	2017年1月1日至2017年6月30日					
条美联方名称 各美联方名称		当期发生的基	金应支付的销售服	另旁费		
台大联月名标	大成添益交易	大成添益交	交易货币	合计		
	型货币A	易型货币B	父侧风印	급기		
光大证券	-	-	543,256.01	543,256.01		
中国银行	9,161.99	25.90	-	9,187.89		
大成基金	1,089.72	342.06	1,054,505.20	1,055,936.98		
合计	10,251.71	367.96	1,597,761.21	1,608,380.88		

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 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 別为0.25%、0.01%和0.25%。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

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

基金买人 交易金額 利息支出 基金买人 易金额 利息支出

6.4.4.4 各关联方投资本基金 6.44.4 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况 本基金本报告期内基金管理人未运用固有资金投资本基金。 6.44.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金。 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

2018年1月1日至2018年6月30日 2017年1月1日至2017年6月3 6.4.4.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况 ★場告期内太其全未在承销期内参与关联方承销证券

644.7 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 64.5 期末(2018年6月30日)本基金持有的流通受限证券 64.5.1 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。

7 小岛 (1967年) 1 小岛 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65,799,847.10元,是以如下债券作为质押

金额单位:人民币元

700.00 68.555.745.

2018年半年度报告摘要

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

《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
序号	项目	金額	占基金总资产 的比例(%)
1	固定收益投资	2,102,849,166.06	43.89
	其中:债券	2,102,849,166.06	43.89
	资产支持证券	-	0.00
2	买人返售金融资产	770,376,595.57	16.08
	其中:买断式回购的买人返售金融 资产	-	0.00
3	银行存款和结算备付金合计	1,905,420,140.09	39.77
4	其他各项资产	12,381,276.96	0.26
5	合计	4,791,027,178.68	100.00
7.2	债券回购融资情况		desired (As. 1 mm)

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 在本报告期内本货币市场基金债券正回购的资金余额未超过资产净值的

20%。 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

报告期内投资组合平均剩余期限最低值 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

120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	18.87	1.39
	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	16.24	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	50.09	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	0.00	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)	16.02	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		101.21	1.39

本报告期内,本基金投资组合平均剩余存续期未超过240天。 7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

	金	:额单位:人民
债券品种	摊余成本	占基金资产净 值比例(%)
国家债券	199,350,597.62	4.22
央行票据	-	0.00
金融债券	50,016,691.50	1.06
其中:政策性金融债	50,016,691.50	1.06
企业债券	-	0.00
企业短期融资券	320,073,239.82	6.78
中期票据	-	0.00
同业存单	1,533,408,637.12	32.48
其他	-	0.00
合计	2,102,849,166.06	44.54
剩余存续期超过397天的浮动利率债 券	-	0.00
	国家债券 央行票据 金融债券 其中主或维性金融债 企业债券 企业短期融资券 中期票据 同业存单 其他 合计 剩余存续期超过397天的浮动利率值	横穿品幹 横余成本 国家债券 199,360,567,627 199,360,567,627 199,360,567,627 199,360,567,627 199,360,567,622 199,360,369 190,369

债券代码 寄养数量係 排余成本 2,000.0 198 781 322 2,000,0 198,237,722 1.850.0 183.547.179 1,500,0 148,759,377 1 300 0 130 074 049 1,000,0 100,001,3684 1.000.0 96.781.767.6 1,000,0

股告期内偏离度的绝对值在0.25 (含)-0.5%间的

本报告期内。本基金未发生负偏离度的绝对值达到0.25%的情况。

本报告期内,本基金未发生正偏离度的绝对值达到0.5%的情况。 7.8 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

79 投资组合报告附注: 79 投资组合报告附注: 79.1 本基金估值采用摊余成本法估值,即估值对象以买人成本列示,按票面利率或协议利率并考虑其买人时的溢价与折价,在其剩余存续期内按照实际利率 7.9.2 本基金投资的前十名证券之一18兴业银行CD238 (111810238)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浦发银行CD193 (111809193) 的发行主体 本基並及資的制下有能勢之一16max限1751850、1166851850、1252 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(银反洗罚决等 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CD263(111810263)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浦发银行CD181(111809181)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

。 7.9.3 期末其他各项资产构成

ij.	金额	名称	序号
_		存出保证金	1
_		应收证券清算款	2
12,281,276.96		应收利息	3
100,000.00		应收申购款	4
_		其他应收款	5
_		待摊费用	6
_		其他	7
12,381,276.96		合计	8

《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			持有人结构				
額	持有人	户均持有的	机构投资者	ŕ	个人投资者	f	
級別	户数 (户)	基金份额	持有份额	占总份额 比例	持有份额	占总份额 比例	
大成添益交易型货币A	257	28,480.71	3,132,880.76	42.80%	4,186,661.10	57.20%	
大成添益交易型货币B	11	13,500.13	30,215.10	20.35%	118,286.33	79.65%	
交易货币	8,745	539,038.50	1,702,657,665.05	36.12%	3,011,233,987.91	63.88%	
合 计	9,013	523,838.87	1,705,820,760.91	36.13%	3,015,538,935.34	63.87%	
注:1	、上述村	几构/个人书	资者持有份额占	总份额出	:例的计算中,对	分级份额	

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 2、持有人户数为有效户数,即存量份额大于零的账户。

为人民币1元,折算后为人民币100元,本表所列E类份额面值数据还原为人民币1

8.2 期末上市基金前十名持有人

序号	持有人名称	持有份额(份)	占上市总份额比例	
1	中银国际证券有限责任公司	182,207,800.00	3.87%	
2	中信建投证券股份有限公司	117,259,600.00	2.49%	
3	马永玲	69,104,700.00	1.47%	
4	上海艾方资产管理有限公司 -		4.400	
	艾方锐进多空1号投资基金	67,456,600.00	1.43%	
5	五矿经易期货有限公司 – 五矿	F4 400 000 00	1.09%	
	经易民生元葵1号资产管理计划	51,409,000.00	1.09%	
6	北京天象道通资产管理有限公		1.09%	
	司 - 赢稳七号私募证券投资基	51,190,000.00		
	金			
	中国民生信托有限公司 – 民生		1.07%	
7	信托 – 蓝筹优势9期证券投资集	50,497,900.00		
	合资金信托计划			
	中国民生信托有限公司 - 民生	47,458,800.00		
8	信托 - 蓝筹优势17期证券投资		1.01%	
	集合资金信托计划			
9	太平资管 - 建设银行 - 太平资	46,931,700.00	1.00%	
	产量化7号资管产品	46,931,700.00		
10	招商证券股份有限公司	44,019,300.00	0.93%	

持有人 2、本基金E类基金份额面值为人民币100元。 8.3 期末货币市场基金前十名份额持有人情况

子写	行有人尖別	行刊的開(的)	C1757070015C191
1	券商类机构	182,207,800.00	3.86
2	券商类机构	117,259,600.00	2.48
3	个人	69,104,700.00	1.46
4	基金类机构	67,456,600.00	1.43
5	其他机构	51,409,000.00	1.09
6	基金类机构	51,190,000.00	1.08
7	信托类机构	50,497,900.00	1.07
8	信托类机构	47,458,800.00	1.01
9	保险类机构	46,931,700.00	0.99
10	券商类机构	44,019,300.00	0.93

8.4 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 0.00009 有本基金 交易货币

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

8.5 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 公司高级管理人员、基 有本开放式基金 x基金基金经理持有本: 大成添絲交易型(交易货币 《9 开放式基金份额变动

	A	市B	交易货币
基金合同生效日 (2016年9 月29日)基金份額总額	78,651,770.58	435,078,833.28	2,551,546,000.00
本报告期期初基金份额总额	10,613,041.99	231,831.02	4,287,107,723.75
本报告期基金总申购份额	4,880,815.47	855,000.67	4,825,291,722.82
减:本报告期基金总赎回份 额	8,174,315.60	938,330.26	4,398,507,793.61
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	7,319,541.86	148,501.43	4,713,891,652.96

10.1 基金份额持有人大会决议

0.2 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、基金托管业务的重大诉讼事项 10.4 基金投资策略的改变

本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或 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 或处罚。

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 与当期佣金 成交金額 成交总额的 比例 **矢城证券**

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

和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

(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。 本报告期内本基金退租交易单元:无;新增交易单元:太平洋证券。 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 ·当期债券 成交金物 比例 的比例 江证券

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

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

版的公人,另外,成人也是对政权会或他的任何性的生态处。如安东、产生或自己人生与企业 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、信息按案等方面对流动性风险管控措施进行明确,具体内等 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