大成标普500等权重指数证券投资基金

2018年第三季度报告

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
报告送出日期:2018年10月25日

§1 重要提示

基金管理人的董事会及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责任。

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10月24日复核了本报告中的财务指标、净值表现和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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2018年7月1日起至9月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	大成标普500等权重指数QDII
基金主代码	096001
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2011年3月23日
报告期末基金份额总额	168,600,663.15份
投资目标	通过严格的投资纪律约束和数量化风险管理手段,实现基金投资组合对标的指数的有效跟踪,追求跟踪误差最小化。
投资策略	本基金将按照标的指数的成份股及其权重构建基金股票投资组合,并根据标的指数成份股及其权重的变动而进行相应调整。但在因特殊情况(如股票停牌、流动性不足)导致无法获得足够数量的股票时,基金管理人将搭配使用其他合理方法进行适当的替代。 本基金还可能将一定比例的基金资产投资于与标普500等权重指数相关的公募基金、上市交易型基金,以优化投资组合的建立,达到节约交易成本和有效追踪标的指数表现的目的。
业绩比较基准	标普500等权重指数(全收益指数)
风险收益特征	本基金为美国股票指数型证券投资基金,风险与预期收益高于混合型基金、债券基金以及货币市场基金,属于预期风险较高的产品。
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
境外资产托管人	英文名称:Bank of China (Hong Kong) Limited
	中文名称:中国银行(香港)有限公司

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位:人民币元

主要财务指标	报告期(2018年7月1日 - 2018年9月30日)
1.本期已实现收益	2,561,879.78
2.本期利润	22,778,514.03
3.加权平均基金份额本期利润	0.1433
4.期末基金资产净值	317,709,450.20
5.期末基金份额净值	1.884

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。

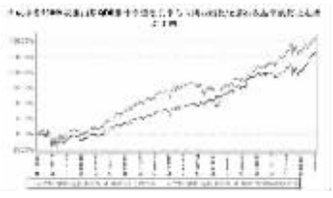
3.2 基金净值表现

3.2.1 本报告期基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	净值增长率①	净值增长率标准差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
过去三个月	8.59%	0.47%	5.42%	0.45%	3.17%	0.02%

注:同期业绩比较基准以美元计价,不包含人民币汇率变动等因素产生的效应。

3.2.2 自基金合同生效以来基金累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较



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 境外投资顾问为本基金提供投资建议的主要成员简介

无。

4.3 报告期内本基金运作遵规守信情况说明

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。

4.4 公平交易专项说明

4.4.1 公平交易制度的执行情况

根据《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》的规定,公司制订了《大成基金管理有限公司公平交易制度》、《大成基金管理有限公司异常交易监控与报告制度》。公司旗下投资组合严格按照制度的规定,参与股票、债券的一级市场申购、二级市场交易等投资管理活动,内容包括授权、研究分析、投资决策、交易执行、业绩评估等与投资管理活动相关的各个环节,研究部负责提供投资研究支持,投资部门负责投资决策,交易管理部负责实施交易并实时监控,监察稽核部负责事前监督、事中检查和事后稽核,风险管理部负责对交易情况进行合理性分析,通过多部门的协作互控,保证了公平交易的可操作、可稽核和可持续。

4.4.2 异常交易行为的专项说明

公司风险管理部定期对公司旗下所有投资组合间同向交易、反向交易等可能存在异常交易的行为进行分析。2018年3季度公司旗下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%的交易情形;投资组合间债券交易存在1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;投资组合间虽然存在同向交易行为,但结合交易价差分布统计分析和潜在利益输送金额统计结果表明投资组合间不存在利益输送的可能性。

4.5 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

2018年3季度,主要发达经济体的宏观经济保持了稳定增长,美国宏观经济出现了加速增长的势头,美国股票市场主要指数也创出了历史新高。

宏观经济数据表明美国3季度的经济增长状况较为理想。最新公布的2018年2季度年化季环比GDP增长率为4.2%,创下了2015年以来的最高值,侧面反映本轮美国经济周期达到了中后期的高速增长阶段。

3季度的其他经济指标也保持在较好的水平区间:9月份的制造业PMI指数保持在59.8的较高水平上;9月份的失业率为3.7%,创下了近50年来的新低;由于劳动力市场较佳及个人收入增速较好,因此密歇根大学消费者信心指数也达到了100.1的高位;同时,标普美国房价指数表明,美国主要城市的房价同比增速保持在6%左右,因此新屋营建市场状况也较佳。

在上述宏观条件下,美股主要指数在3季度呈现继续上升的势头,并都创出了历史新高。从而使得在今年年初至3季度末的时期内,主要美股指数都取得了显著正收益。

由于宏观经济表现较好,美联储于9月份底又加息一次,当前联邦基金目标利率上限为2.25%,利率水平正在逐步走向正常化。

在3季度,美元汇率出现了明显上升,这利好于本基金净值表现。

本基金为被动型指数基金,其投资目标就是要复制指数的收益率。本基金将坚持被动型的指数化投资理念,持续实施高效的组合管理策略、交易策略及风险控制方法,以期更好地跟踪指数,力争将跟踪误差控制在较低的水平。

截止本报告期末,本基金份额资产净值为1.884元。本报告期内基金份额净值增长率为8.59%,同期业绩比较基准收益率5.42%,高于业绩比较基准的表现。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

无。

§5 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额(人民币元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	299,789,959.13	92.81
	其中:普通股	299,789,959.13	92.81
	优先股	-	-
	存托凭证	-	-
	房地产信托凭证	-	-
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
	其中:债券	-	-
	资产支持证券	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
	其中:远期	-	-
	期货	-	-
	期权	-	-
	权证	-	-
5	买入返售金融资产	-	-
	其中:买断式回购的买入返售金融资产	-	-
6	货币市场工具	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	21,265,134.79	6.58
8	其他资产	1,955,411.35	0.61
9	合计	323,010,505.27	100.00

5.2 报告期末在各个国家(地区)证券市场的股票及存托凭证投资分布

国家(地区)	公允价值(人民币元)	占基金资产净值比例(%)
美国	299,789,959.13	94.36
合计	299,789,959.13	94.36

5.3 报告期末按行业分类的股票及存托凭证投资组合

5.3.1 报告期末指数投资按行业分类的股票及存托凭证投资组合

行业类别	公允价值(人民币元)	占基金资产净值比例(%)
工业	41,949,129.58	13.20
医疗保健	39,448,337.35	12.42
信息技术	43,669,357.73	13.75
金融	38,793,672.29	12.21
消费者非必需品	45,331,852.57	14.27
消费者常用品	19,132,288.07	6.02
房地产	19,017,102.55	5.99
能源	18,938,572.75	5.96
公用事业	17,618,342.73	5.55
基础材料	14,122,135.00	4.44
电信服务	1,769,168.51	0.56
合计	299,789,959.13	94.36

注:以上分类采用全球行业分类标准(GICS)。

5.3.2 报告期末积极投资按行业分类的股票及存托凭证投资组合

无。

5.4 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票及存托凭证投资明细

5.4.1 报告期末指数投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票及存托凭证投资明细

序号	公司名称(英文)	公司名称(中文)	证券代码	所在证券市场	所属国家(地区)	数量(股)	公允价值(人民币元)	占基金资产净值比例(%)
1	Edwards Lifesciences Corp	Edwards Life-sciences 公司	EW UN	纽约交易所	美国	581	695,845.53	0.22
2	Alexion Pharmaceuti-cals Inc	Alexion 制药公司	ALXN UQ	纳斯达克证券交易所	美国	727	695,213.81	0.22
3	Cigna Corporation	信诺公司	CI UN	纽约交易所	美国	483	691,942.61	0.22
4	Viacom Inc B	维亚康姆公司	VIAB UQ	纳斯达克证券交易所	美国	2,977	691,383.81	0.22
5	Biogen Inc	百健	BIIB UQ	纳斯达克证券交易所	美国	283	687,828.71	0.22
6	Abbott Laboratories	雅培制药	ABT UN	纽约交易所	美国	1,359	685,830.37	0.22
7	Hess Corp	赫斯公司	HES UN	纽约交易所	美国	1,389	683,961.85	0.22
8	Concho Resources Inc	康丘资源公司	CXO UN	纽约交易所	美国	647	679,866.18	0.21
9	Walgreens Boots Alliance Inc	Walgreens Boots Alliance 公司	WBA UQ	纳斯达克证券交易所	美国	1,355	679,523.94	0.21
10	Kroger Co	克罗格公司	KR UN	纽约交易所	美国	3,389	678,659.15	0.21

5.4.2 报告期末积极投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名股票及存托凭证投资明细

无。

5.5 报告期末按债券信用等级分类的债券投资组合

无。

5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

无。

5.7 报告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

无。

5.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名金融衍生品投资明细

无。

5.9 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名基金投资明细

无。

5.10 投资组合报告附注

5.10.1 本基金投资的前十名证券的发行主体本期是否出现被监管部门立案调查,或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

报告期内基金投资的前十名证券的发行主体无被监管部门立案调查的,或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

5.10.2 基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库。

基金投资的前十名股票中,没有投资于超出基金合同规定备选股票库之外股票。

5.10.3 其他资产构成

序号	名称	金额(人民币元)
1	存出保证金	-
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	344,128.27
4	应收利息	2,425.43
5	应收申购款	1,553,878.97
6	其他应收款	-
7	待摊费用	54,978.68
8	其他	-
9	合计	1,955,411.35

5.10.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

无。

5.10.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

5.10.5.1 报告期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

无。

5.10.5.2 报告期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

无。

5.10.6 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。

§6 开放式基金份额变动

单位:份

报告期期初基金份额总额	139,770,596.75
报告期期间基金总申购份额	50,692,732.54
减:报告期期间基金总赎回份额	21,862,666.14
报告期期间基金拆分变动份额(份额减少以"-"填列)	-
报告期期末基金份额总额	168,600,663.15

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

无。

§8 影响投资者决策的其他重要信息

8.1 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

无。

8.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§9 备查文件目录

9.1 备查文件目录

1、中国证监会批准设立大成标普500等权重指数证券投资基金的文件;

2、《大成标普500等权重指数证券投资基金合同》;

3、《大成标普500等权重指数证券投资基金托管协议》;

4、大成基金管理有限公司批准文件、营业执照、公司章程;

5、本报告期内在指定报刊上披露的各种公告原稿。

9.2 存放地点

备查文件存放在本基金管理人和托管人的住所。

9.3 查阅方式

投资者可在营业时间免费查阅,或登录本基金管理人网站http://www.dcfund.com.cn进行查阅。

大成基金管理有限公司

2018年10月25日

大成月添利理财债券型证券投资基金

2018年第三季度报告

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
报告送出日期:2018年10月25日

§1 重要提示

基金管理人的董事会及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责任。

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10月24日复核了本报告中的财务指标、净值表现和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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2018年7月1日起至9月30日止。

§2 基金产品概况

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
报告期末基金份额总额	14,448,049,985.56份
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。
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
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	136,948,971.96份 / 14,289,815,000.96份 / 21,286,012.64份

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位:人民币元

主要财务指标	报告期2018年7月1日 - 2018年9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
1.本期已实现收益	1,267,925.76	150,154,610.21	204,073.71
2.本期利润	1,267,925.76	150,154,610.21	204,073.71
3.期末基金资产净值	136,948,971.96	14,289,815,000.96	21,286,012.64

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 本报告期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	净值收益率①	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
过去三个月	0.9476%	0.0007%	0.3403%	0.0000%	0.6073%	0.0007%

大成月添利债券B

阶段	净值收益率①	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
过去三个月	1.0213%	0.0007%	0.3403%	0.0000%	0.6810%	0.0007%

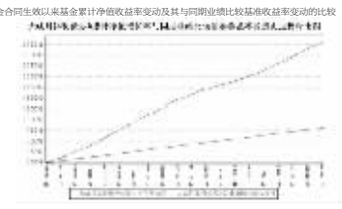
大成月添利债券E

阶段	净值收益率①	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
过去三个月	0.9475%	0.0007%	0.3403%	0.0000%	0.6072%	0.0007%

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.本基合合同规定,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 基金经理(或基金经理小组)简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		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	-	11年	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。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,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日起任大成惠祥定期开放纯债债券型证券投资基金基金经理。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。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
冉凌浩	本基金基金经理	2011年8月26日	-	15年	金融学硕士。2003年4月至2004年6月就职于国信证券研究部,任研究员。2004年6月至2005年9月就职于华西证券研究部,任高级研究员。2005年9月加入大成基金管理有限公司,历任金融工程师、境外市场研究员及基金经理助理。2011年8月26日起任大成标普500等权重指数型证券投资基金基金经理。2014年11月13日起任大成纳斯达克100指数证券投资基金基金经理。2016年12月2日起任大成恒生综合中小型股指数基金(QDII-LOF)基金经理。2016年12月29日起任大成海外中国机会混合型证券投资基金(LOF)基金经理。2017年8月10日起任大成恒生指数证券投资基金(LOF)基金经理。具有基金从业资格。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 境外投资顾问为本基金提供投资建议的主要成员简介

无。

4.3 报告期内本基金运作遵规守信情况说明

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 公平交易专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

根据《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》的规定,公司制订了《大成基金管理有限公司公平交易制度》、《大成基金管理有限公司异常交易监控与报告制度》。公司旗下投资组合严格按照制度的规定,参与股票、债券的一级市场申购、二级市场交易等投资管理活动,内容包括授权、研究分析、投资决策、交易执行、业绩评估等与投资管理活动相关的各个环节,研究部负责提供投资研究支持,投资部门负责投资决策,交易管理部负责实施交易并实时监控,监察稽核部负责事前监督、事中检查和事后稽核,风险管理部负责对交易情况进行合理性分析,通过多部门的协作互控,保证了公平交易的可操作、可稽核和可持续。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

公司风险管理部定期对公司旗下所有投资组合间同向交易、反向交易等可能存在异常交易的行为进行分析。2018年3季度公司旗下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%的交易情形;投资组合间债券交易存在1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;投资组合间虽然存在同向交易行为,但结合交易价差分布统计分析和潜在利益输送金额统计结果表明投资组合间不存在利益输送的可能性。

4.4 报告期内基金投资策略和运作分析

2018年3季度,投资和消费增速均下行,其中基建投资受制于资金来源和项目减少出现快速下跌,地产投资在低库存的背景下保持较高增速,制造业投资低位回升,但企业经营出现分化,下游、民营企业经营困难为后续制造业带来不确定性。由于居民杠杆较高导致消费被挤出,消费仍然缺乏支撑。整体看后续经济增长点一是基建投资的回升,二是制造业投资能否延续。近期通胀担忧逐步抬升,猪肉价格在经历2年下行周期后低位回升,会推动后续CPI上行,但在总体需求回落的环境下,价格上涨不可持续,预计不会对货币政策产生很大影响。国外方面,一是贸易摩擦不断升级,虽然我国对出口依赖度已经降低,但出口作为2017年经济正际改善的重要原因,对后续经济走势影响仍然较大;二是外国经济持续向好带动货币政策收紧,人民币汇率有贬值压力。7月中美贸易摩擦升级,三季度央行货币政策进一步放松,定向降准实施,MLF超额投放。国务院常务会议提出维持流动性合理充裕,积极财政政策更加积极,理财新规细则也有所放松,"宽货币+宽信用"格局和杠杆基调确立。银行间市场资金利率较为宽松,资金价格中枢整体较二季度大幅下行。

2018年三季度,本基金根据市场变化在保障流动性安全的基础上,在综合考虑基本面、货币政策和资金面变化的具体情况下,抓住重要时点进行配置相对低风险和高收益的投资品种,并根据债券市场的波动合理地进行交易操作。

4.5 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基金份额净值收益率为0.9321%,本报告期大成月月盈短期理财债券B基金份额净值收益率为1.0114%,本报告期大成月月盈短期理财债E基金份额净值收益率为0.9128%,同期业绩比较基准收益率为0.3403%。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

无。

§5 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	固定收益投资	5,089,633,360.89	32.79
	其中:债券	5,089,633,360.89	32.79
	资产支持证券	-	-
2	买入返售金融资产	601,236,661.86	3.87
	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	9,736,547,753.58	62.73
4	其他资产	92,975,808.30	0.60
5	合计	15,520,393,584.63	100.00

5.2 报告期债券回购融资情况

序号	项目	占基金资产净值比例(%)
1	报告期内债券回购融资余额	1.44
	其中:买断式回购融资	-
序号	项目	金额(元) / 占基金资产净值比例(%)
2	报告期末债券回购融资余额	1,038,127,802.81 / 7.19
	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。

5.3 基金投资组合平均剩余期限

5.3.1 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	111
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	115
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	54

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。

5.3.2 报告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	10.20	7.19
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
2	30天(含)—60天	11.85	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
3	60天(含)—90天	50.57	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
4	90天(含)—120天	-	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
5	120天(含)—397天(含)	34.15	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
合计		106.78	7.19

5.4 报告期内投资组合平均剩余存续期超过240天情况说明

无。

5.5 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	摊余成本(元)	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	223,747,333.54	1.55
2	央行票据	-	-
3	金融债券	520,604,668.43	3.60
	其中:政策性金融债	520,604,668.43	3.60
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	同业存单	4,345,281,358.92	30.08
8	其他	-	-
9	合计	5,089,633,360.89	35.23
10	剩余存续期超过397天的浮动利率债券	-	-

5.6 报告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

序号	债券代码	债券名称	债券数量(张)	摊余成本(元)	占基金资产净值比例(%)
1	111815482	18民生银行CD482	5,000,000	497,023,485.07	3.44
2	111885703	18东莞农村商业银行CD094	4,000,000	397,576,325.72	2.75
3	111885390	18成都农商银行CD016	3,000,000	299,589,987.35	2.07
4	111885670	18盛京银行CD396	3,000,000	298,162,432.37	2.06
5	111821294	18渤海银行CD294	3,000,000	295,639,695.13	2.05
6	111809192	18浦发银行CD192	2,500,000	247,604,159.18	1.71
6	111818175	18华夏银行CD175	2,500,000	247,604,159.18	1.71
7	150223	15国开23	2,400,000	240,072,178.90	1.66
8	111821279	18渤海银行CD279	2,400,000	234,502,080.03	1.62
9	111884755	18东莞银行CD109	2,000,000	198,898,907.57	1.38
10	111809196	18浦发银行CD196	2,000,000	198,078,767.61	1.37

5.7 "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	0
报告期内偏离度的最高值	0.1464%
报告期内偏离度的最低值	0.0129%
报告期内每个工作日偏离度的绝对值的简单平均值	0.0843%

报告期内负偏离度的绝对值达到0.25%情况说明

无。

报告期内正偏离度的绝对值达到0.5%情况说明

无。

5.8 报告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

无。

5.9 投资组合报告附注

5.9.1 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摊销。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1.00元

5.9.2 本基金投资的前十名证券的发行主体本期是否出现被监管部门立案调查,或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

本基金投资的前十名证券之一18浦发银行CD192(111809192)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。

5.9.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	-
2	应收证券清算款	-
3	应收利息	92,975,808.30
4	应收申购款	-
5	其他应收款	-
6	待摊费用	-
7	其他	-
8	合计	92,975,808.30

5.9.4 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。

§6 开放式基金份额变动

单位:份

项目	大成月添利债券A	大成月添利债券B	大成月添利债券E
报告期期初基金份额总额	155,877,102.55	14,996,614,050.65	25,475,206.49
报告期期间基金总申购份额	42,165,867.99	194,436,458.16	13,420,530.69
报告期期间基金总赎回份额	61,093,998.58	901,235,507.85	17,609,724.54
报告期期末基金份额总额	136,948,971.96	14,289,815,000.96	21,286,012.64

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

序号	交易方式	交易日期	交易份额(份)	交易金额(元)	适用费率(%)
1	申购	2018-07-04	5,000,000.00	5,000,000.00	-
2	红利发放	2018-09-04	764,906.12	764,906.12	-
合计			5,764,906.12	5,764,906.12	

注:1.申购或者购买基金份额的,金额为正;赎回或者卖出基金份额的,金额为负。

2.红利发放为期间合计数。

§8 影响投资者决策的其他重要信息

8.1 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	序号	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
		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		持有份额	份额占比(%)
机构	1	20180701-2018 0930	3,500,250.306.77	29,514,858.88	-		3,529,765,165.65	24.43
	2	20180701-2018 0930	3,050,570,198.73	32,316,376.13	-		3,082,886,574.86	21.34
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。								

8.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§9 备查文件目录

9.1 备查文件目录

1.中国证监会批准设立大成月添利理财债券型证券投资基金的文件;

2.《大成月添利理财债券型证券投资基金合同》;

3.《大成月添利理财债券型证券投资基金托管协议》;

4.大成基金管理有限公司批准文件、营业执照、公司章程;

5.本报告期内在指定报刊上披露的各种公告原稿。

9.2 存放地点

本季度报告存放在本基金管理人和托管人的办公住所。

9.3 查阅方式

投资者可在营业时间免费查阅,或登录本基金管理人网站http://www.dcfund.com.cn进行查阅。

大成基金管理有限公司

2018年10月25日

大成月月盈短期理财债券型证券投资基金

2018年第三季度报告

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
报告送出日期:2018年10月25日

§1 重要提示

基金管理人的董事会及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责任。

基金托管人中国