

# 大成月添利理财债券型证券投资基金 2020 年第 2 季度报告

2020 年 6 月 30 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

报告送出日期：2020 年 7 月 21 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 2020 年 7 月 20 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。

根据中国证监会关于规范理财债券基金业务的要求以及中国证监会 2020 年 3 月 20 日颁布的《关于修改部分证券期货规章的决定》的规定，经与中国农业银行股份有限公司协商一致，大成基金管理有限公司对旗下大成月添利理财债券型证券投资基金的《大成月添利理财债券型证券投资基金基金合同》（以下简称“《基金合同》”）相关条款进行了修改，并已报监管机构备案。本次《基金合同》修改涉及本基金资产配置比例、投资限制、申购和赎回价格、基金资产估值、收益分配、升降级业务、信息披露等内容。本次《基金合同》修改系根据相关法律法规、监管机构要求而开展，并已履行规定程序及相应信息披露义务，符合相关法律法规及《基金合同》的规定。修改后的《基金合同》自 2020 年 6 月 30 日起生效。主要调整内容如下：自 2020 年 6 月 30 日起，本基金债券的估值方法不再采用“摊余成本法”，而是按照“市值法”计量基金资产净值。相应的，净值披露方式等内容同步调整。自 2020 年 6 月 30 日起，本基金的投资组合资产配置比例部分及投资组合限制部分增加“本基金投资于债券资产的比例不低于基金资产的 80%；本基金应当保持不低于基金资产净值的 5% 的现金或到期日在一年以内的政府债券，其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。”的规定，本基金将按照《基金合同》的要求进行投资组合的调整。

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 2020 年 4 月 1 日起至 6 月 30 日止。

## § 2 基金产品概况

### 2.1 基金基本情况（转型后）

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	2020 年 6 月 30 日		
报告期末基金份额总额	1,929,938,160.99 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	58,584,251.77 份	1,869,111,687.76 份	2,242,221.46 份

## 2.1 基金基本情况（转型前）

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	1,930,965,090.91 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	59,413,258.98 份	1,867,242,164.81 份	4,309,667.12 份

## § 3 主要财务指标和基金净值表现

### 3.1 主要财务指标（转型后）

单位：人民币元

主要财务指标	报告期（2020 年 6 月 30 日-2020 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
1. 本期已实现收益	2,910.91	107,898.57	94.71
2. 本期利润	2,910.91	107,898.57	94.71
3. 加权平均基金份额本期利润	0.0000	0.0001	0.0000
4. 期末基金资产净值	58,587,162.68	1,869,219,586.33	2,242,316.17
5. 期末基金份额净值	1.0000	1.0001	1.0000

注：1、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。

2、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。

### 3.1 主要财务指标（转型前）

单位：人民币元

主要财务指标	报告期（2020年4月1日-2020年6月29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	276,960.00	41,563,998.33	28,890.78
2. 本期利润	276,960.00	41,563,998.33	28,890.78
3. 期末基金资产净值	59,413,258.98	1,867,242,164.81	4,309,667.12

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（转型后）

#### 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

大成月添利债券 A

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差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
自基金合同生效起至今	0.00%	0.00%	0.00%	0.00%	0.00%	0.00%

大成月添利债券 B

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差	①-③	②-④
----	----------	-------------	------------	--------------	-----	-----

				④		
自基金合同生效起至今	0.01%	0.00%	0.00%	0.00%	0.01%	0.00%

大成月添利债券 E

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差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
自基金合同生效起至今	0.00%	0.00%	0.00%	0.00%	0.00%	0.00%

### 3.2.2 自基金转型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

1、本基金合同生效日为 2020 年 6 月 30 日，截至报告期末本基金合同生效未满一年。

2、按基金合同规定，大成月添利理财债券型证券投资基金应自基金合同生效（暨基金转型）日 2020 年 6 月 30 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。截至报告期末，本基金处于建仓期。

3、本基金合同生效后，截至报告期末只有一天收益数据，基金净值收益率与同期业绩基准收益率变动比较走势图无法展示，故此本次报告只披露数据，走势图不做展示。

## 3.2 基金净值表现（转型前）

### 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

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	0.4290%	0.0007%	0.3320%	0.0000%	0.0970%	0.0007%
过去六个月	1.0472%	0.0012%	0.6676%	0.0000%	0.3796%	0.0012%
过去一年	2.2179%	0.0010%	1.3445%	0.0000%	0.8734%	0.0010%
过去三年	10.0660%	0.0025%	4.0482%	0.0000%	6.0178%	0.0025%
过去五年	17.0855%	0.0038%	6.7482%	0.0000%	10.3373%	0.0038%
自基金合同生效起至今	33.9476%	0.0088%	10.4986%	0.0000%	23.4490%	0.0088%

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
----	--------	-----------	------------	---------------	-----	-----

				④		
过去三个月	0.5007%	0.0007%	0.3320%	0.0000%	0.1687%	0.0007%
过去六个月	1.1921%	0.0012%	0.6676%	0.0000%	0.5245%	0.0012%
过去一年	2.5052%	0.0010%	1.3445%	0.0000%	1.1607%	0.0010%
过去三年	11.0156%	0.0025%	4.0482%	0.0000%	6.9674%	0.0025%
过去五年	18.7824%	0.0038%	6.7482%	0.0000%	12.0342%	0.0038%
自基金合同生效起至今	36.9855%	0.0088%	10.4986%	0.0000%	26.4869%	0.0088%

## 大成月添利债券 E

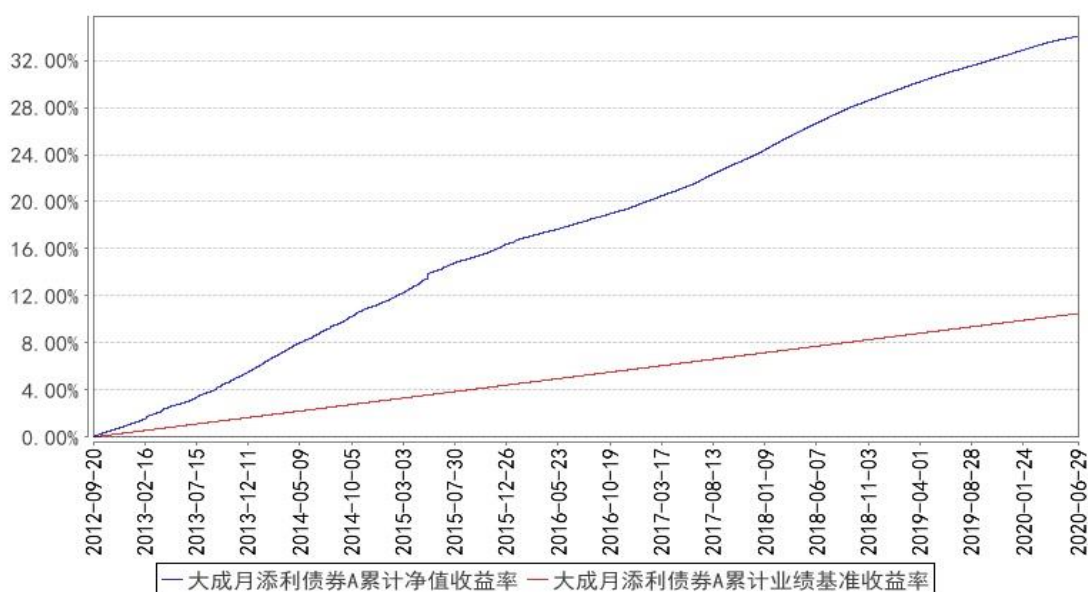
阶段	净值收益率①	净值收益率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去三个月	0.4287%	0.0007%	0.3320%	0.0000%	0.0967%	0.0007%
过去六个月	1.0469%	0.0012%	0.6676%	0.0000%	0.3793%	0.0012%
过去一年	2.2174%	0.0010%	1.3445%	0.0000%	0.8729%	0.0010%
过去三年	10.0656%	0.0025%	4.0482%	0.0000%	6.0174%	0.0025%
过去五年	17.0846%	0.0038%	6.7482%	0.0000%	10.3364%	0.0038%
自基金合同生效起至今	17.2527%	0.0039%	6.7926%	0.0000%	10.4601%	0.0039%

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。

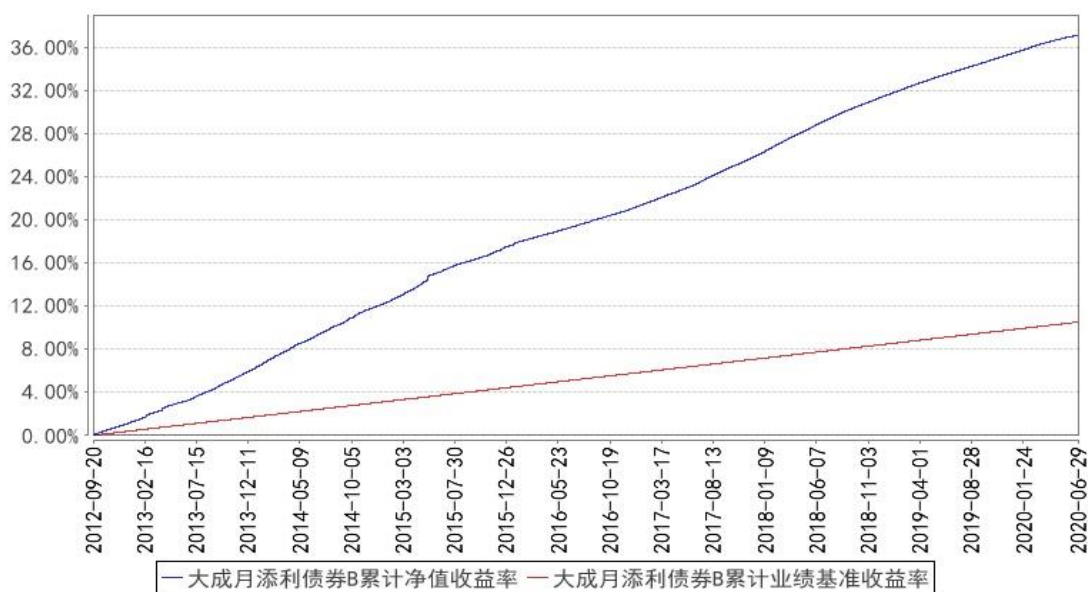
2、本表净值收益率的计算所采取的运作周期，是以基金合同生效日为起始日并持有至报告期末的基金份额所经历的运作周期。

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

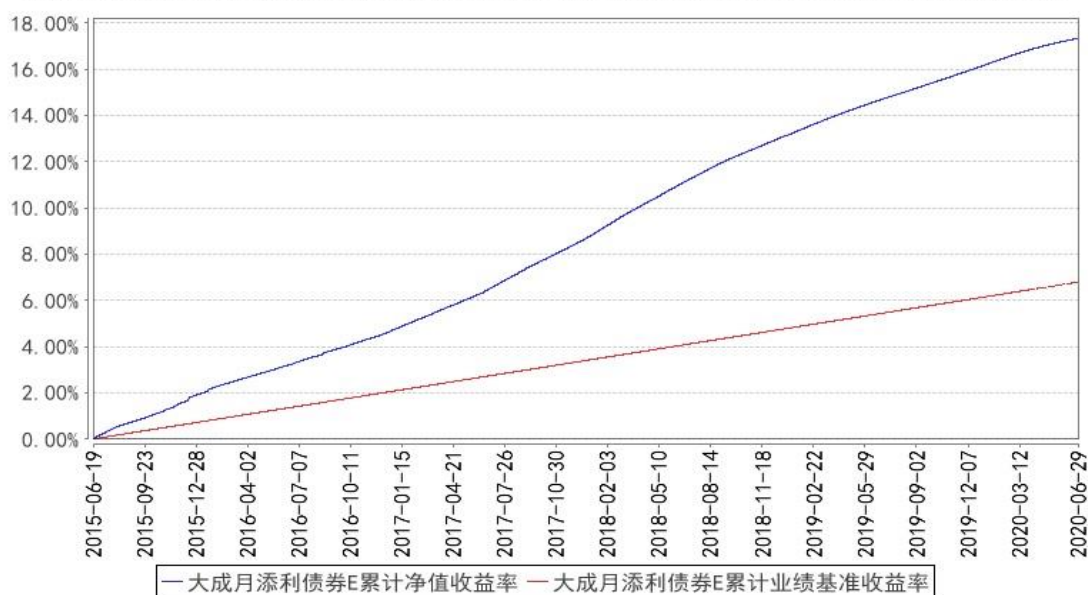
大成月添利债券A累计净值收益率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



大成月添利债券B累计净值收益率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



大成月添利债券E累计净值收益率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：1、本基金于 2015 年 6 月 16 日起增加 E 类份额。

2、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。

## § 4 管理人报告

### 4.1 基金经理（或基金经理小组）简介（转型后）

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	2020年06月30日	-	13年	经济学学士。2004年7月至2007年10月就职于招商银行总行，任资产托管部年

				<p>金小组组长。2007 年 10 月加入大成基金管理有限公司，曾担任基金运营部基金助理、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，现任固定收益总部总监助理。2016 年 8 月 6 日至 2018 年 10 月 20 日任大成景穗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 日至 2019 年 9 月 29 日任大成恒丰宝货币市场基金基金经理。2016 年 11 月 2 日至 2019 年 9 月 29 日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 日至 2019 年 9 月 29 日任大成惠祥纯债债券型证券投资基金(原大成惠祥定期开放纯债债券型证券投资基金转型)基金经理。2017 年 3 月 22 日起任大成月添利理财债券型证券投资基金基金经理。2017 年 3 月 22 日至 2019 年 9 月 29 日大成慧成货币市场基金基金经理。2017 年 3 月 22 日至 2020 年 3 月 11 日任大成景旭纯债债券型证券投资基金基金经理。2018 年 3 月 14 日至 2020 年 6 月 29 日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。2019 年 9 月 20 日起任大成货币市场证券投资基金基金经理。2020 年 7 月 1 日起任大成惠祥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。具备基金从业资格。国籍：中国</p>
--	--	--	--	--

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。

#### 4.1 基金经理（或基金经理小组）简介（转型前）

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	-	13 年	经济学学士。2004 年 7 月至 2007 年 10 月就职于招商银行总行，任资产托管部年金小组组长。2007 年 10 月加入大成基金管理有限公司，曾担任基金运营部基金助理、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，现任固定收益总部总监助理。2016 年 8 月 6 日至 2018 年 10 月 20 日任大成景穗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 日至 2019 年 9 月 29 日任大成恒丰宝货币市场基金基金经理。2016 年 11 月 2 日至 2019 年 9 月 29 日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 日至 2019 年 9 月 29 日任大成惠祥纯债债券型证券投资基金(原大成惠祥定期开放纯债债券型证券投资基金转型)基金经理。2017 年 3 月 22 日起任大成月添利理财债券型证券投资基金基金经理。2017 年 3 月 22 日至 2019 年 9 月 29 日大成慧成货币市场基金基金经理。2017 年 3 月 22 日至 2020 年 3 月 11 日任大成景旭纯债债券型证券投资基金基金经理。2018 年 3 月 14 日至 2020 年 6 月 29 日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。2019 年 9 月 20 日起任大成货币市场证券投资基金基金经理。2020 年 7 月 1 日起任大成惠祥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。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 管理人对报告期内基金运作合规守信情况的说明

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 公平交易专项说明

##### 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；部分股票同向交易溢价率较大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较大变动导致个别些组合间的成交价格差异较大，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，原因为组合流动性需要。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 1 笔同日反向交易，原因为组合流动性需要。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 报告期内基金的投资策略和运作分析

2020 年二季度初，资金面继续宽松，市场预期资金利率中枢将显著下移，各期限货币市场工具收益率出现 50-60BP 不等的下行，进入 6 月，由于时点效应及一级市场供给增加等因素，货币市场又迎来一轮快速调整。纵观二季度，隔夜回购利率均值约为 1.38%，较上季度下行 85BP，7 天回购加权利率均值约为 1.76%，较上季度下行 91BP。3 个月 AAA 存单收益率下行 68BP，3 个月 AA+存单收益率下行 68BP，1 年 AAA 存单收益率下行 57BP，1 年 AA+存单收益率下行 57BP，1 年期金融债收益率下行 31BP，1 年 AAA 短期融资券下行约 48bp，1 年 AA+短融品种下行约 40bp。

本基金将以流动性为第一前提，根据组合特点在合理期限范围内配置组合资产，努力提高组合静态收益。

#### 4.5 报告期内基金的业绩表现

转型后：截至本报告期末大成月添利债券 A 的基金份额净值为 1.0000 元，本报告期基金份额净值增长率为 0.00%；截至本报告期末大成月添利债券 B 的基金份额净值为 1.0001 元，本报告期基金份额净值增长率为 0.01%；截至本报告期末大成月添利债券 E 的基金份额净值为 1.0000 元，本报告期基金份额净值增长率为 0.00%。同期业绩比较基准收益率为 0.00%。

转型前：本报告期大成月添利债券 A 的基金份额净值收益率为 0.4290%，本报告期大成月添利

债券 B 的基金份额净值收益率为 0.5007%，本报告期大成月添利债券 E 的基金份额净值收益率为 0.4287%，同期业绩比较基准收益率为 0.3320%。

#### 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（转型后）

#### 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	权益投资	-	-
	其中：股票	-	-
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	742,742,034.12	38.44
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	1,188,378,660.71	61.51
8	其他资产	862,588.53	0.04
9	合计	1,931,983,283.36	100.00

#### 5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

##### 5.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

无。

##### 5.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

无。

#### 5.3 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投资明细

无。

#### 5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

无。

#### 5.5 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。

#### 5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券投资 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五名贵金属投资明细

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权证投资明细

无。

#### 5.9 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

##### 5.9.1 本期国债期货投资政策

无。

##### 5.9.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

无。

##### 5.9.3 本期国债期货投资评价

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。

本基金投资的前十名证券的发行主体本期未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。

### 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（元）
1	存出保证金	-
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	862,588.53
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	862,588.53

### 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

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。

## § 5 投资组合报告（转型前）

### 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	-	-
	其中：债券	-	-
	资产支持证 券	-	-
2	买入返售金融资产	742,742,034.12	38.39
	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	1,191,326,030.69	61.57
4	其他资产	731,525.54	0.04

5	合计	1,934,799,590.35	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	20.53	
	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	-	-
	其中：买断式回购融资	-	-

### 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	6
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	87
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	3

### 报告期内投资组合平均剩余期限超过 120 天情况说明

无。

### 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	100.16	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
2	30 天 (含) — 60 天	-	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
3	60 天 (含) — 90 天	-	-
	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）	-	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
	合计	100.16	-

#### 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

无。

#### 5.6 报告期末按摊余成本占基金资产净值比例大小排名的前十名债券投资明细

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

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	0.0906%
报告期内偏离度的最低值	-0.0004%
报告期内每个工作日偏离度的绝对值的简单平均值	0.0402%

#### 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 报告期末按摊余成本占基金资产净值比例大小排名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 1.00 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的发行主体本期未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。

### 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	731,525.54
4	应收申购款	-
5	其他应收款	-
6	待摊费用	-
7	其他	-
8	合计	731,525.54

### 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(转型后)

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
基金合同生效日(2020年6月30日)基金份额总额	59,413,258.98	1,867,242,164.81	4,309,667.12
基金合同生效日起至报告期期末基金总申购份额	44,939.66	1,869,522.95	1,947.09
减:基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回份额	873,946.87	-	2,069,392.75
基金合同生效日起至报告期期末基金拆分变动份额(份额减少以“-”填列)	-	-	-
报告期期末基金份额总额	58,584,251.77	1,869,111,687.76	2,242,221.46

## §6 开放式基金份额变动(转型前)



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	69,401,426.12	9,629,762,552.71	7,737,473.00
报告期期间基金总申购份额	2,123,163.17	36,883,222.57	1,273,786.47
报告期期间基金总赎回份额	12,111,330.31	7,799,403,610.47	4,701,592.35
报告期期末基金份额总额	59,413,258.98	1,867,242,164.81	4,309,667.12

## § 7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况（转型后）

### 7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

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
基金合同生效日(2020年6月30日)管理人持有的本基金份额	-	77,681,185.31	-
基金合同生效日起至报告期期末买入/申购总份额	-	-	-
基金合同生效日起至报告期期末卖出/赎回总份额	-	-	-
报告期期末管理人持有的本基金份额	-	77,681,185.31	-
报告期期末持有的本基金份额占基金总份额比例(%)	-	4.03	-

### 7.2 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	红利发放	2020年06月30日	71,851.34	71,851.34	-
合计			71,851.34	71,851.34	

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、合计数以绝对值填列。

3、红利发放为期间合计数。

## § 7 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细（转型前）

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	红利发放	2020年06月29日	432,392.32	432,392.32	-
合计			432,392.32	432,392.32	

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、合计数以绝对值填列。

3、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	报告期内持有基金份额变化情况				报告期末持有基金情况		
	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	持有份额	份额占比(%)
机构	1	20200616-20200630	1,057,552,482.99	6,858,765.71	-	1,064,411,248.70	55.15
	2	20200401-20200622	3,224,437,310.51	12,143,628.49	3,236,580,939.00	-	-
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。							

### 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

2020 年 7 月 21 日