大成丰财宝货币市场基金

2019 第二季度 报告

2019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:中国银行股份有限公司
报告送出日期:2019年7月18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2019年7月17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2019年4月1日起至6月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	大成丰财宝货币	
基金主代码	000626	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2014年6月18日	
报告期末基金份额总额	14,241,285,982.95份	
投资目标	在有效控制投资组合风险,保持高流动性的基础上,力争获得高于业绩比较基准的投资回报。	
投资策略	本基金投资管理将充分运用收益率策略与估值策略相结合的方法,对各类可投资产进行合理的配置和选择,投资策略首先审慎考虑各类资产的收益性、流动性及风险性特征,在风险与收益的配比中,力求将各类风险降到最低,并在控制投资组合良好流动性的基础上为投资者获取稳定的收益。	
业绩比较基准	活期存款利率(税后)	
风险收益特征	本基金为货币市场基金,基金的风险和预期收益低于股票型基金、混合型基金、债券型基金。	
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	
下属分级基金的基金简称	大成丰财宝货币A	大成丰财宝货币B
下属分级基金的交易代码	000626	000627
报告期末下属分级基金的份额总额	13,902,485.67份	14,227,383,497.28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2019年4月1日 - 2019年6月30日	
	大成丰财宝货币A	大成丰财宝货币B
1.本期已实现收益	97,505.65	93,253,580.16
2.本期利润	97,505.65	93,253,580.16
3.期末基金资产净值	13,902,485.67	14,227,383,497.28

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。

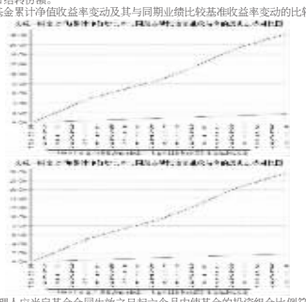
3.2 基金净值表现

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

大成丰财宝货币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	0.5995%	0.0003%	0.0873%	0.0000%	0.5122%	0.0003%
大成丰财宝货币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	0.6597%	0.0003%	0.0873%	0.0000%	0.5724%	0.0003%

注:本货币基金收益分配按日结转份额。

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: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

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	2016年8月6日	-	12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,2016年8月6日至2018年10月20日任大成景曜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日起任大成蕙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日起任大成月添利理财债券型证券投资基金,大成慧诚灵活市场基金和大成景短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

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 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。2019年2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不存在同日反向交易;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

2019年二季度国内经济总体保持平稳,但较一季度,经济增速出现了放缓的迹象。5月制造业PMI均为49.4,跌至荣枯线下方。4、5月工业增加值明显回落,固定资产投资增速有所下行,支撑一季度经济的房地产投资在二季度也初现走弱的迹象。二季度中美贸易摩擦再起波澜,外部环境较为复杂,出口有所下滑,消费方面,虽然4月份社会消费品零售同比增速下滑,但5月显著回升,显示消费韧性较强。

二季度央行延续了稳健偏宽松的货币政策,通过公开市场和定向降准等方式向市场注入流动性,银行间市场流动性总体保持合理充裕,回购利率保持低位,隔夜回购利率跌破1%,创下近年来新低,但市场流动性出现分层,结构性失衡较为明显。二季度债市市场利率保持较低水平,5月底至6月上旬短暂上行,6月下旬再度大幅下行。

二季度本基金继续采取稳健的投资策略,维持较短的久期,以流动性管理为主。在6月配置了部分3个月的AAA同业存单,适当拉长了久期。

4.5 报告期内基金的业绩表现

本报告期大成丰财宝货币A基金份额净值收益率为0.5995%,本报告期大成丰财宝货币B基金份额净值收益率为0.6597%,同期业绩比较基准收益率为0.0873%。

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	1,973,091,522.98	13.33
	其中:债券	1,973,091,522.98	13.33
	资产支持证券	-	-
2	买入返售金融资产	5,666,675,661.50	38.30
	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	7,116,995,104.27	48.10
4	其他资产	40,578,151.71	0.27
5	合计	14,797,340,440.46	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	1.51	
	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	550,056,524.97	3.86
	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

注:本基金合同约定:"除发生巨额赎回的情况外,本基金债券正回购的资产余额在每个交易日均不得超过基金资产净值的20%;因发生巨额赎回致使本基金债券正回购的资金余额超过基金资产净值20%的,基金管理人应当在5个交易日内进行调整"。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	36
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	51
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	28

报告期内投资组合平均剩余期限超过120天情况说明

注: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。

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	47.98	3.86
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
2	30天(含)-60天	22.30	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
3	60天(含)-90天	32.64	-
	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)	0.69	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
合计		103.61	3.86

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

本报告期内无投资组合平均剩余存续期超过240天的情况。

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	470,147,508.34	3.30
2	央行票据	-	-
3	金融债券	260,157,225.63	1.83
	其中:政策性金融债	260,157,225.63	1.83
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	同业存单	1,242,786,789.01	8.73
8	其他	-	-
9	合计	1,973,091,522.98	13.85
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	111998147	19天津银行CD101	3,000,000	298,732,603.70	2.10
2	111909174	19浦发银行CD174	3,000,000	298,216,863.28	2.09
3	111803211	18农业银行CD211	3,000,000	298,145,399.65	2.09
4	180018	18附息国债18	2,200,000	220,145,209.86	1.55
5	160016	16附息国债16	2,000,000	200,021,884.41	1.40
6	111998722	19九江银行CD068	1,000,000	99,526,396.87	0.70
7	111910250	19兴业银行CD250	1,000,000	99,381,190.57	0.70
8	111813158	18浙商银行CD158	1,000,000	98,957,742.39	0.69
9	160420	16农发20	900,000	90,027,503.62	0.63
10	180209	18国开09	800,000	80,018,469.07	0.56

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	0.0145%
报告期内偏离度的最低值	-0.0070%
报告期内每个工作日偏离度的绝对值的简单平均值	0.0038%

报告期内负偏离度的绝对值达到0.25%情况说明

报告期内未发生负偏离度的绝对值达到0.25%的情况。

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。

1.本基金投资的前十名证券之一19浦发银行CD174(111909174.IB)的发行主体上海浦东发展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〕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。

2.本基金投资的前十名证券之一18浙商银行CD158(111813158.IB)的发行主体浙商银行股份有限公司于2018年11月9日因投资同业理财产品未尽职审查等,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〕11号)。本基金认为,对浙商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	40,573,141.72
4	应收申购款	5,009.99
5	其他应收款	-
6	待摊费用	-
7	其他	-
8	合计	40,578,151.71

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	大成丰财宝货币A	大成丰财宝货币B
报告期期初基金份额总额	12,636,497.47	14,133,927,098.17
报告期期间基金总申购份额	8,280,764.68	93,715,710.08
报告期期间基金总赎回份额	7,014,776.48	259,310.97
报告期期末基金份额总额	13,902,485.67	14,227,383,497.28

§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

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	20190401-20190630	14,133,927,098.17	93,456,399.11	-	14,227,383,497.28	99.90
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。

注:申购份额均为报告期内本基金进行收益分配,机构投资者选择红利再投资方式,其红利转换为基金份额的情况。

8.2 影响投资者决策的其他重要信息

根据我司于2019年7月6日发布的《大成基金管理有限公司高级管理人员变更公告》,经大成基金管理有限公司第六届董事会第三十三次会议审议通过,自2019年7月6日起,公司总经理由罗登攀变更为谭晓冈。具体详见公司相关公告。

§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招财宝货币市场基金的文件;

2、《大成丰财宝货币市场基金基金合同》;

3、《大成丰财宝货币市场基金托管协议》;

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
2019年7月18日

大成恒丰宝货币市场基金

2019 第二季度 报告

2019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:恒丰银行股份有限公司
报告送出日期:2019年7月18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。

基金托管人恒丰银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2019年7月17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2019年4月1日起至6月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	大成恒丰宝货币		
基金主代码	001697		
基金运作方式	契约型开放式		
基金合同生效日	2015年8月4日		
报告期末基金份额总额	89,801,475.41份		
投资目标	在保持本金安全和资产流动性基础上追求较高的当期收益。		
投资策略	本基金通过对宏观经济、宏观政策、市场资金面供求等因素的综合分析,对资金利率变动趋势进行评估,最大限度地优化存款期限、回购和债券品种组合。基金管理人在评估各品种在流动性、收益率稳定性基础上,结合预先制定的组合平均期限范围确定类属资产配置,基金根据对未来短期利率走势的研判,结合基金资产流动性的要求动态调整组合久期,在确保安全性和流动性的前提下,通过不同商业银行和不同存款期限的选择,挖掘出利率相价较高的多家银行进行银行协议存款和大额存单的投资,在获取较高投资收益的同时尽量分散投资风险,提高存款及存单资产的流动性。在日常的投资管理过程中,本基金将会紧密关注市购与赎回资金变化情况,季节性资金流动等影响货币市场基金流动性管理的因素,建立组合流动性监控管理指标,实现对基金资产流动性的实时管理。		
业绩比较基准	银行活期存款利率(税后)		
风险收益特征	本基金为货币市场基金,与证券投资基金中的低风险品种,本基金长期的风险和预期收益低于股票型基金、混合型基金、债券型基金。		
基金管理人	大成基金管理有限公司		
基金托管人	恒丰银行股份有限公司		
下属分级基金的基金简称	大成恒丰宝货币A	大成恒丰宝货币B	大成恒丰宝货币E
下属分级基金的交易代码	001697	001698	001699
报告期末下属分级基金的份额总额	4,421,866.96份	6,238,567.21份	79,141,041.24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2019年4月1日 - 2019年6月30日		
	大成恒丰宝货币A	大成恒丰宝货币B	大成恒丰宝货币E
1.本期已实现收益	29,441.14	58,814.23	438,817.96
2.本期利润	29,441.14	58,814.23	438,817.96
3.期末基金资产净值	4,421,866.96	6,238,567.21	79,141,041.24

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。

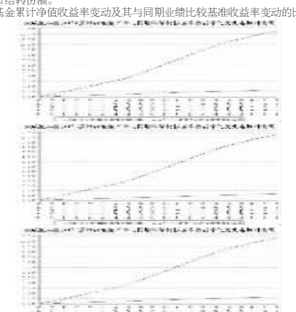
3.2 基金净值表现

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

大成恒丰宝货币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	0.5354%	0.0014%	0.0873%	0.0000%	0.4481%	0.0014%
大成恒丰宝货币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	0.5958%	0.0014%	0.0873%	0.0000%	0.5085%	0.0014%
大成恒丰宝货币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	0.5356%	0.0014%	0.0873%	0.0000%	0.4483%	0.0014%

注:本货币基金收益分配按日结转份额。

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: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,本基金的各项资产配置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		
欧阳亮	本基金基金经理	2019年1月25日	-	10年	管理学硕士,2009年9月至2011年7月曾任华泰联合证券研发所研究员,2011年7月加入大成基金管理有限公司,曾担任产品研发与金融工程部高级产品设计师、固定收益总部助理研究员、2018年3月30日起任大成丰财宝货币市场基金、大成惠利纯债债券型证券投资基金基金经理助理,2019年1月25日起任大成慧成货币市场基金、大成景安短融债券型证券投资基金、大成恒丰宝货币市场基金、大成惠益纯债债券型证券投资基金、大成惠祥定期开放纯债债券型证券投资基金基金经理,具有基金从业资格,国籍:中国
陈会荣	本基金基金经理	2016年9月6日	-	12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,2016年8月6日至2018年10月20日任大成景曜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日起任大成蕙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日起任大成月添利理财债券型证券投资基金,大成慧诚灵活市场基金和大成景短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

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 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。研究部负责提供投研研究支持,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。2019年2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不存在同日反向交易;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

2019年二季度国内经济总体保持平稳,但较一季度,经济增速出现了放缓的迹象。5、6月制造业PMI均为49.4,跌至荣枯线下方。4、5月工业增加值明显回落,固定资产投资增速有所下行,支撑一季度经济的房地产投资在二季度也初现走弱的迹象。二季度中美贸易摩擦再起波澜,外部环境较为复杂,出口有所下滑,消费方面,虽然4月份社会消费品零售同比增速下滑,但5月显著回升,显示消费韧性较强。

二季度央行延续了稳健偏宽松的货币政策,通过公开市场和定向降准等方式向市场注入流动性,银行间市场流动性总体保持合理充裕,回购利率保持低位,隔夜回购利率跌破1%,创下近年来新低,但市场流动性出现分层,结构性失衡较为明显。二季度债市市场利率保持较低水平,5月底至6月上旬短暂上行,6月下旬再度大幅下行。

二季度本基金继续采取稳健的投资策略,维持较短的久期,以流动性管理为主。在6月配置了部分3个月的AAA同业存单,适当拉长了久期。

4.5 报告期内基金的业绩表现

本报告期大成恒丰宝货币A基金份额净值收益率为0.5354%,本报告期大成恒丰宝货币B基金份额净值收益率为0.5958%,本报告期大成恒丰宝货币E基金份额净值收益率为0.5356%,同期业绩比较基准收益率为0.0873%。

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	43,598,540.31	48.46
	其中:债券	43,598,540.31	48.46
	资产支持证券	-	-
2	买入返售金融资产	28,000,362.00	31.12
	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	17,622,842.79	19.59
4	其他资产	745,720.93	0.83
5	合计	89,967,466.03	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	6.06	
	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	-	-

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

注:无。

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	83
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	24

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	56.37	-
	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	21.03	-
	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)	21.95	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
合计		99.35	-

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	5,000,000.00	5.57
2	央行票据	-	-
3	金融债券	9,972,724.62	11.11
	其中:政策性金融债	9,972,724.62	11.11
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	同业存单	28,625,815.69	31.88
8	其他	-	-
9	合计	43,598,540.31	48.55
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	190302	19进出02	100,000	9,972,724.62	11.11
2	111909175	19浦发银行CD175	100,000	9,940,705.12	11.07
3	111915146	19民生银行CD146	100,000	9,743,046.19	10.85
4	111913041	19浙商银行CD041	90,000	8,942,064.38	9.96
5	199913	19抗现债13	50,000	5,000,000.00	5.57

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	0.0589%
报告期内偏离度的最低值	-0.0100%
报告期内每个工作日偏离度的绝对值的简单平均值	0.0183%

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。

1.本基金投资的前十名证券之一19浙商银行CD041(111913041.IB)的发行主体浙商银行股份有限公司于2018年11月9日因投资同业理财产品未尽职审查等,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〕11号)。本基金认为,对浙商银行的处罚不会对其投资价值构成实质性负面影响。

2.本基金投资的前十名证券之一19浦发银行CD175(111909175.IB)的发行主体上海浦东发展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〕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。

3.本基金投资的前十名证券之一19民生银行CD146(111915146.IB)的发行主体中国民生银行股份有限公司于2018年11月9日因贷款业务严重违反审慎经营规则等,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〕5号、银保监银罚决字〔2018〕8号)。本基金认为,对民生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	718.81
2	应收证券清算款	-
3	应收利息	96,173.37
4	应收申购款	648,828.75
5	其他应收款	-
6	待摊费用	-
7	其他	-
8	合计	745,720.93

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