

# 大成添利宝货币市场基金 2024 年中期报告

2024 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：兴业银行股份有限公司

送出日期：2024 年 8 月 30 日

## § 1 重要提示及目录

### 1.1 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。本中期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。

基金托管人兴业银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2024 年 08 月 29 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。

本报告财务资料未经审计。

本报告期自 2024 年 01 月 01 日起至 06 月 30 日止。

## 1.2 目录

<b>§1 重要提示及目录</b> .....	<b>2</b>
1.1 重要提示.....	2
1.2 目录.....	3
<b>§2 基金简介</b> .....	<b>5</b>
2.1 基金基本情况.....	5
2.2 基金产品说明.....	5
2.3 基金管理人和基金托管人.....	5
2.4 信息披露方式.....	6
2.5 其他相关资料.....	6
<b>§3 主要财务指标和基金净值表现</b> .....	<b>6</b>
3.1 主要会计数据和财务指标.....	6
3.2 基金净值表现.....	7
<b>§4 管理人报告</b> .....	<b>10</b>
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	10
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	12
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	12
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.....	13
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	13
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	14
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	14
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.....	14
<b>§5 托管人报告</b> .....	<b>15</b>
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	15
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明.....	15
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见.....	15
<b>§6 半年度财务会计报告（未经审计）</b> .....	<b>15</b>
6.1 资产负债表.....	15
6.2 利润表.....	16
6.3 净资产变动表.....	18
6.4 报表附注.....	20
<b>§7 投资组合报告</b> .....	<b>41</b>
7.1 期末基金资产组合情况.....	41
7.2 债券回购融资情况.....	41
7.3 基金投资组合平均剩余期限.....	42
7.4 报告期内投资组合平均剩余存续期超过 240 天情况说明.....	42
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	43
7.6 期末按实际利率计算账面价值占基金资产净值比例大小排名的前十名债券投资明细.....	43
7.7 “影子定价”与按实际利率计算账面价值确定的基金资产净值的偏离.....	44
7.8 期末按实际利率计算的账面价值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.....	44
7.9 投资组合报告附注.....	44
<b>§8 基金份额持有人信息.....</b>	<b>45</b>
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	45
8.2 期末货币市场基金前十名份额持有人情况.....	46
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	46
8.4 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情况.....	46
<b>§9 开放式基金份额变动.....</b>	<b>47</b>
<b>§10 重大事件揭示.....</b>	<b>47</b>
10.1 基金份额持有人大会决议.....	47
10.2 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.....	47
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	48
10.4 基金投资策略的改变.....	48
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	48
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.....	48
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	48
10.8 偏离度绝对值超过 0.5%的情况.....	49
10.9 其他重大事件.....	49
<b>§11 影响投资者决策的其他重要信息.....</b>	<b>51</b>
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.....	51
11.2 影响投资者决策的其他重要信息.....	51
<b>§12 备查文件目录.....</b>	<b>51</b>
12.1 备查文件目录.....	51
12.2 存放地点.....	51
12.3 查阅方式.....	52

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	大成添利宝货币市场基金		
基金简称	大成添利宝货币		
基金主代码	000724		
基金运作方式	契约型开放式		
基金合同生效日	2014 年 7 月 28 日		
基金管理人	大成基金管理有限公司		
基金托管人	兴业银行股份有限公司		
报告期末基金份 额总额	41,517,970,857.93 份		
基金合同存续期	不定期		
下属分级基金的基 金简称	大成添利宝货币 A	大成添利宝货币 B	大成添利宝货币 E
下属分级基金的交 易代码	000724	000725	000726
报告期末下属分级 基金的份额总额	195,573,402.12 份	37,687,550,028.75 份	3,634,847,427.06 份

### 2.2 基金产品说明

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	本基金运用利率趋势评估策略、类属配置策略、平均剩余期限配置策略、银行协议存款和大额存单投资策略、流动性管理策略进行投资管理，以实现超越投资基准的投资目标。
业绩比较基准	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，为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。

### 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	兴业银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	段皓静
	联系电话	0755-83183388
	电子邮箱	office@dcfund.com.cn
客户服务电话	4008885558	95561
传真	0755-83199588	021-62159217
注册地址	广东省深圳市南山区海德三道 1236 号大成基金总部大厦 5 层、 27-33 层	福建省福州市台江区江滨中大 道 398 号兴业银行大厦
办公地址	广东省深圳市南山区海德三道 1236 号大成基金总部大厦 5 层、 27-33 层	上海市浦东新区银城路 167 号 4 楼
邮政编码	518054	200120

法定代表人	吴庆斌	吕家进
-------	-----	-----

## 2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《上海证券报》
登载基金中期报告正文的管理人互联网网址	www.dcfund.com.cn
基金中期报告备置地点	基金管理人及基金托管人住所

## 2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	大成基金管理有限公司	广东省深圳市南山区海德三道1236号大成基金总部大厦5层、27-33层

## § 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

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2024年1月1日-2024年6月30日)			
	大成添利宝货币 A	大成添利宝货币 B	大成添利宝货币 E	
本期已实现收益	2,567,524.34	257,297,969.07	34,249,548.31	
本期利润	2,567,524.34	257,297,969.07	34,249,548.31	
本期净值收益率	0.9722%	1.0928%	1.0225%	
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2024年6月30日)			
	期末基金资产净值	195,573,402.12	37,687,550,028.75	3,634,847,427.06
	期末基金份额净值	1.0000	1.0000	1.0000
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2024年6月30日)			
	累计净值收益率	29.4601%	32.5993%	30.7716%

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

除相关费用和信用减值损失后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益，由于本基金用实际利率法计算账面价值并用影子定价和偏离度加以控制的模式核算，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。

### 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

大成添利宝货币 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	0.1417%	0.0005%	0.0287%	0.0000%	0.1130%	0.0005%
过去三个月	0.4439%	0.0004%	0.0870%	0.0000%	0.3569%	0.0004%
过去六个月	0.9722%	0.0006%	0.1740%	0.0000%	0.7982%	0.0006%
过去一年	1.9283%	0.0007%	0.3505%	0.0000%	1.5778%	0.0007%
过去三年	5.3957%	0.0011%	1.0505%	0.0000%	4.3452%	0.0011%
自基金合同生效起至今	29.4601%	0.0067%	3.4746%	0.0000%	25.9855%	0.0067%

大成添利宝货币 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	0.1614%	0.0005%	0.0287%	0.0000%	0.1327%	0.0005%
过去三个月	0.5041%	0.0004%	0.0870%	0.0000%	0.4171%	0.0004%

过去六个月	1.0928%	0.0006%	0.1740%	0.0000%	0.9188 %	0.0006 %
过去一年	2.1717%	0.0007%	0.3505%	0.0000%	1.8212 %	0.0007 %
过去三年	6.1560%	0.0011%	1.0505%	0.0000%	5.1055 %	0.0011 %
自基金合同生效起 至今	32.5993 %	0.0067%	3.4746%	0.0000%	29.124 7%	0.0067 %

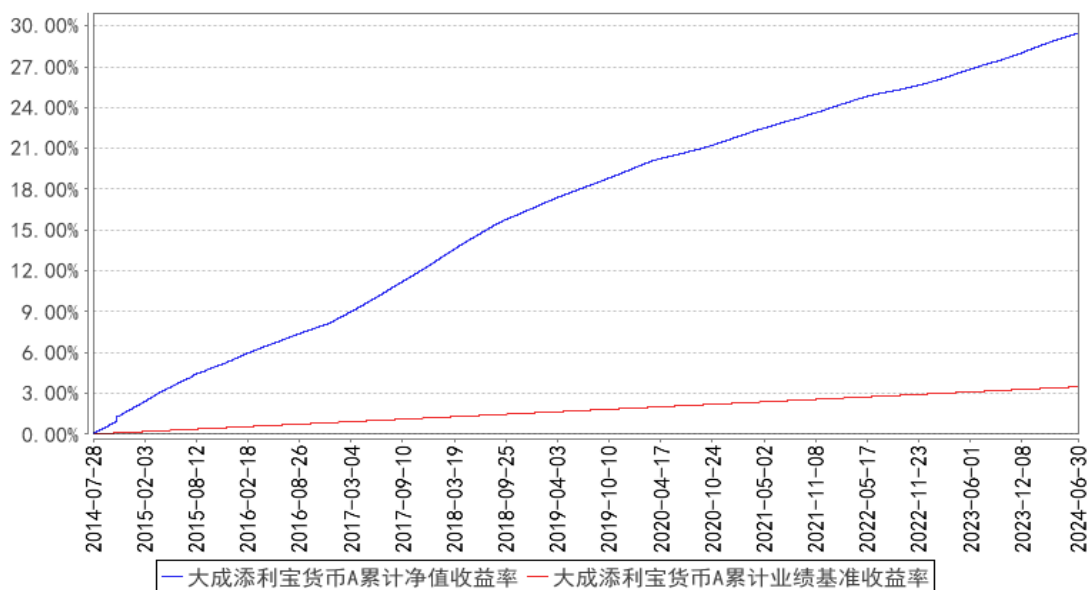
## 大成添利宝货币 E

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	0.1499%	0.0005%	0.0287%	0.0000%	0.1212 %	0.0005 %
过去三个月	0.4691%	0.0004%	0.0870%	0.0000%	0.3821 %	0.0004 %
过去六个月	1.0225%	0.0006%	0.1740%	0.0000%	0.8485 %	0.0006 %
过去一年	2.0289%	0.0007%	0.3505%	0.0000%	1.6784 %	0.0007 %
过去三年	5.7113%	0.0011%	1.0505%	0.0000%	4.6608 %	0.0011 %
自基金合同生效起 至今	30.7716 %	0.0067%	3.4746%	0.0000%	27.297 0%	0.0067 %

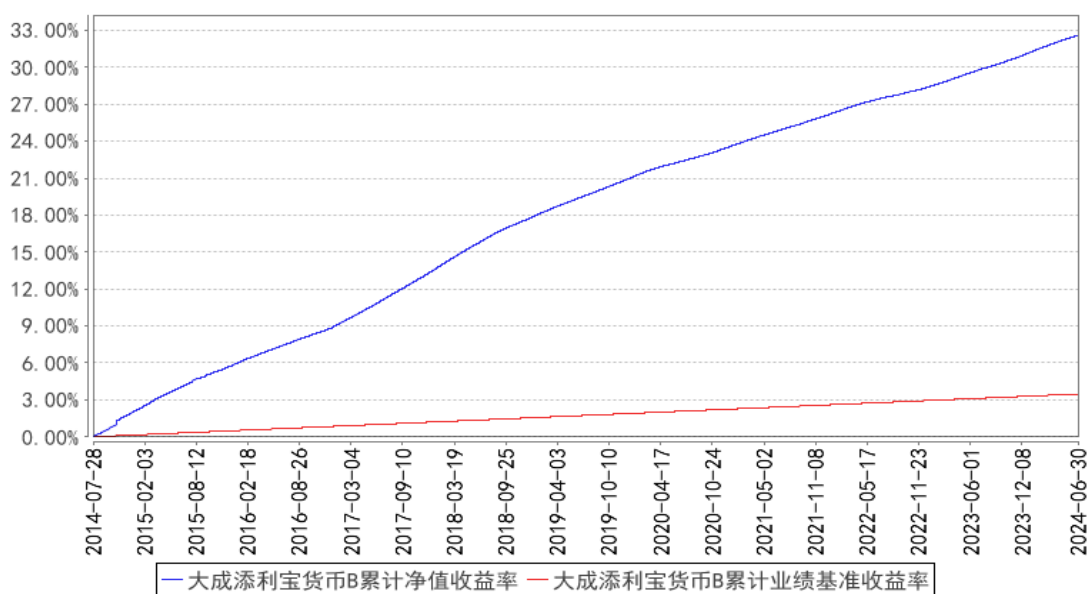


### 3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值收益率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

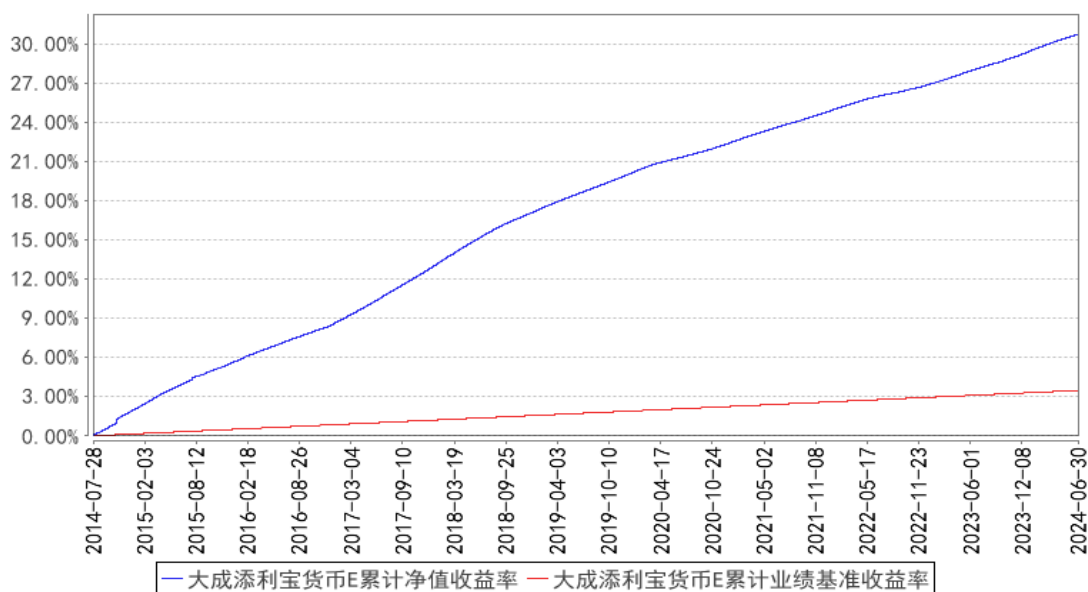
大成添利宝货币A累计净值收益率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



大成添利宝货币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



大成添利宝货币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：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成立于1999年4月12日，注册资本人民币2亿元，是中国首批获准成立的“老十家”基金管理公司之一。公司总部位于深圳，同时设置了北方、华东和南方营销总部，在北京、上海等地开设有5家分公司。2009年，公司在香港设立大成国际资产管理有限公司，大力拓展国际业务；2013年，设立大成创新资本管理有限公司，开拓专户及专项管理业务。公司业务资质齐全，全面覆盖公募基金、机构投资、海外投资、财富管理、养老金管理等业务，还受全国社会保障基金理事会委托管理部分社保基金和基本养老保险基金。旗下大成国际资产管理有限公司具备QFII、RQFII等资格，是首批首家完成备案的能够提供港股通投资顾问服务的香港机构。

历经二十余年的磨砺和沉淀，大成基金形成了以长期投资能力为核心的竞争优势，打造了一支具有良好职业素养和丰富经验的资产管理队伍。公司目前已形成权益投资、固收投资、指数与期货投资、跨境投资、混合资产投资、大类资产配置六大投资团队，全面覆盖各类投资领域，综合实力不断提升，各项业务迅猛发展，管理资产种类位居同业前列。

#### 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	证券从	说明

		(助理) 期限		业年限	
		任职日期	离任日期		
刘谢冰	本基金基金经理	2024年3月8日	-	11年	香港城市大学理学（应用经济学）硕士。2013年12月至2016年11月任广发证券资金管理部高级交易员。2016年12月至2023年8月任银华基金固定收益部基金经理。2023年8月加入大成基金管理有限公司，现任固定收益总部现金资产投资部副总监（总监助理级）。2024年3月8日起任大成中证同业存单AAA指数7天持有期证券投资基金、大成慧成货币市场基金、大成添利宝货币市场基金基金经理。2024年5月14日起任大成货币市场证券投资基金、大成丰财宝货币市场基金基金经理。具有基金从业资格。国籍：中国
陈会荣	本基金基金经理	2018年3月14日	2024年5月30日	17年	中央财经大学经济学学士。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、固定收益总部总监助理、固定收益总部副总监，现任国际业务部基金经理。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日至2024年5月30日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日至2022年8月9日任大成月添利一个月滚动持有中短债债券型证券投资基金（原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日任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2024年5月30

					<p>日任大成添利宝货币市场基金基金经理。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基金经理。2018年8月17日至2024年5月14日任大成现金增利货币市场基金基金经理。2019年9月20日至2024年5月30日任大成货币市场证券投资基金基金经理。2020年7月1日至2024年5月30日任大成惠祥纯债债券型证券投资基金基金经理。2020年7月1日至2021年11月12日任大成惠益纯债债券型证券投资基金基金经理。2020年8月17日至2022年3月4日任大成惠享一年定期开放债券型发起式证券投资基金基金经理。2022年11月30日至2024年5月30日任大成中证同业存单 AAA 指数 7 天持有期证券投资基金基金经理。2024年5月21日起任大成全球美元债债券型证券投资基金（QDII）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中国证监会《证券投资基金经营机构董事、监事、高级管理人员及从业人员监督管理办法》的相关规定。

#### 4.1.3 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理同时管理的产品情况

无。

#### 4.2 管理人对报告期内本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 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，公司严格执行了公平交易的原则和制度。公司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、5 日内及 10 日内股票及债券交易同向交易价差进行分析，针对同一基金经理管理的多个投资组合及公私募兼任基金经理管理的多个投资组合的投资交易行为加强了公平交易监测与分析，包括对不同时间窗下（同日、3 日、5 日、10 日）反向交易和同向交易价差监控的分析。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投资策略差异、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，同时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，公司旗下所有投资组合未发现存在异常交易行为。公司旗下投资组合间存在证券同日反向交易，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证券当日成交量 5% 的情形。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

2024 年上半年国内经济总体稳健，但微观主体活力不足、外部环境错综复杂等结构性问题并未发生变化。一季度 GDP 增速 5.3% 实现开门红，二季度经济的斜率则有所放缓，GDP 增速回落至 4.7%。

货币政策仍然保持对实体经济的支撑，持续加大逆周期调节力度。央行于 1 月下旬宣布降准 0.5% 并下调再贷款和再贴现利率各 0.25%，2 月中旬 5Y LPR 利率超预期下调 25BP，4 月央行叫停“手工补息”。在央行的呵护下，实体经济融资成本有所下降，流动性环境总体合理充裕，非银机构资金面逐步改善。

债券市场方面，货币政策保持稳中偏松取向，同时在上半年政府债券发行偏慢的背景下金融机构的配置力量较强，债市整体延续牛市格局。年初至 4 月下旬，10 年国债收益率单边下行；随后在央行频频喊话关注长端利率风险的背景下，10 年国债收益率转为震荡格局。

本基金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，通过久期和杠杆策略为主，增厚组合收益。

### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本报告期大成添利宝货币 A 的基金份额净值收益率为 0.9722%，同期业绩比较基准收益率为 0.1740%，本报告期大成添利宝货币 B 的基金份额净值收益率为 1.0928%，同期业绩比较基准收益率为 0.1740%，本报告期大成添利宝货币 E 的基金份额净值收益率为 1.0225%，同期业绩比较基准收益率为 0.1740%。

## 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望下半年，虽然债券供给边际上升，且央行对长端利率保持密切关注或对债市形成影响，但中期来看，经济的转型升级离不开货币政策的支撑，实体经济融资成本仍有望继续下行，债市反转风险有限，仍具较好配置价值。

#### 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。估值委员会由公司各投研部门、交易管理部、风险管理部、监察稽核部、基金运营部指定人员组成。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八名投资组合经理。

各投研部门、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；交易管理部负责关注相关投资品种的流动性状况，协助反馈其市场交易信息；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人员执行，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，投资组合经理作为估值小组成员，对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及中证指数有限公司签署服务协议，由中央国债登记结算有限责任公司按约定提供银行间交易的债券品种的估值数据，由中证指数有限公司按约定提供交易所交易的债券品种的估值数据和流通受限股票的折扣率数据。

#### 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公告，以每万份基金份额收益为基准，为投资人每日计算基金收益并分配。本报告期内本基金应分配利润 294,115,041.72 元，报告期内已分配利润 294,115,041.72 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

报告期内，本托管人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，诚信、尽责地履行了基金托管人义务，不存在损害本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

报告期内，本托管人根据国家有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，对基金管理人在本基金的投资运作、基金资产净值的计算、基金收益的计算、基金费用开支等方面进行了必要的监督、复核和审查，未发现其存在任何损害本基金份额持有人利益的行为；基金管理人在报告期内，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 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人认真复核了本中期报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，认为其真实、准确和完整，不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

## § 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：大成添利宝货币市场基金

报告截止日：2024 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2024 年 6 月 30 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
<b>资产：</b>			
货币资金	6.4.7.1	18,834,938,768.32	4,097,884,202.01
结算备付金		-	1,318,834.34
存出保证金		-	-
交易性金融资产	6.4.7.2	16,071,111,182.14	10,606,390,848.31
其中：股票投资		-	-
基金投资		-	-
债券投资		16,071,111,182.14	10,456,293,862.01
资产支持证券投资		-	150,096,986.30
贵金属投资		-	-
其他投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	12,908,904,115.96	3,497,093,676.53

债权投资	6.4.7.5	-	-
其中：债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
其他投资		-	-
其他债权投资	6.4.7.6	-	-
其他权益工具投资	6.4.7.7	-	-
应收清算款		-	-
应收股利		-	-
应收申购款		109,010,782.57	41,301,394.21
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.8	-	-
资产总计		47,923,964,848.99	18,243,988,955.40
<b>负债和净资产</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2024年6月30日</b>	<b>上年度末 2023年12月31日</b>
<b>负 债：</b>			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		3,103,087,065.28	2,377,556,507.78
应付清算款		3,288,816,254.19	40,522,268.85
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		4,946,301.99	1,898,522.30
应付托管费		1,648,767.37	632,840.78
应付销售服务费		805,549.75	440,772.24
应付投资顾问费		-	-
应交税费		80,378.90	50,784.92
应付利润		6,056,144.99	3,477,047.10
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.9	553,528.59	411,434.18
负债合计		6,405,993,991.06	2,424,990,178.15
<b>净资产：</b>			
实收基金	6.4.7.10	41,517,970,857.93	15,818,998,777.25
未分配利润	6.4.7.12	-	-
净资产合计		41,517,970,857.93	15,818,998,777.25
负债和净资产总计		47,923,964,848.99	18,243,988,955.40

注：报告截止日 2024 年 06 月 30 日，基金份额总额 41,517,970,857.93 份，其中大成添利宝货币 A 基金份额总额为 195,573,402.12 份，基金份额净值 1.0000 元。大成添利宝货币 B 基金份额总额为 37,687,550,028.75 份，基金份额净值 1.0000 元。大成添利宝货币 E 基金份额总额为 3,634,847,427.06 份，基金份额净值 1.0000 元。

## 6.2 利润表

会计主体：大成添利宝货币市场基金



本报告期：2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
<b>一、营业总收入</b>		351,322,139.26	47,717,086.14
1. 利息收入		187,896,001.92	27,607,851.18
其中：存款利息收入	6.4.7.13	116,419,890.67	15,029,710.15
债券利息收入		-	-
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		71,476,111.25	12,578,141.03
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		163,426,137.34	20,109,234.96
其中：股票投资收益	6.4.7.14	-	-
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.15	161,718,841.86	20,109,234.96
资产支持证券投资	6.4.7.16	1,707,295.48	-
贵金属投资收益	6.4.7.17	-	-
衍生工具收益	6.4.7.18	-	-
股利收益	6.4.7.19	-	-
其他投资收益		-	-
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.20	-	-
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.21	-	-
<b>减：二、营业总支出</b>		57,207,097.54	7,382,502.94
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	20,772,888.43	3,866,150.36
其中：暂估管理人报酬		-	-
2. 托管费	6.4.10.2.2	6,924,296.19	1,370,669.95
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	4,065,303.28	1,146,845.55
4. 投资顾问费		-	-
5. 利息支出		25,192,806.86	842,369.59
其中：卖出回购金融资产支出		25,192,806.86	842,369.59
6. 信用减值损失	6.4.7.22	-	-
7. 税金及附加		28,840.95	775.89
8. 其他费用	6.4.7.23	222,961.83	155,691.60

三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		294,115,041.72	40,334,583.20
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		294,115,041.72	40,334,583.20
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		294,115,041.72	40,334,583.20

### 6.3 净资产变动表

会计主体：大成添利宝货币市场基金

本报告期：2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	15,818,998,777.25	-	-	15,818,998,777.25
二、本期期初净资产	15,818,998,777.25	-	-	15,818,998,777.25
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	25,698,972,080.68	-	-	25,698,972,080.68
（一）、综合收益总额	-	-	294,115,041.72	294,115,041.72
（二）、本期基金份额交易产生的净资产变动数（净资产减少以“-”号填列）	25,698,972,080.68	-	-	25,698,972,080.68
其中：1. 基金申购款	48,583,224,854.82	-	-	48,583,224,854.82
2. 基金赎回款	-22,884,252,774.14	-	-	-22,884,252,774.14
（三）、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动（净资产减少以“-”号填列）	-	-	-294,115,041.72	-294,115,041.72

四、本期期末净资产	41,517,970,857.93	-	-	41,517,970,857.93
项目	上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	2,387,885,785.42	-	-	2,387,885,785.42
二、本期期初净资产	2,387,885,785.42	-	-	2,387,885,785.42
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	4,221,425,973.21	-	-	4,221,425,973.21
(一)、综合收益总额	-	-	40,334,583.20	40,334,583.20
(二)、本期基金份额交易产生的净资产变动数(净资产减少以“-”号填列)	4,221,425,973.21	-	-	4,221,425,973.21
其中：1. 基金申购款	8,119,436,408.81	-	-	8,119,436,408.81
2. 基金赎回款	-3,898,010,435.60	-	-	-3,898,010,435.60
(三)、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动(净资产减少以“-”号填列)	-	-	-40,334,583.20	-40,334,583.20
四、本期期末净资产	6,609,311,758.63	-	-	6,609,311,758.63

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：

谭晓冈

范瑛

梁靖

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 基金基本情况

大成添利宝货币市场基金(以下简称“本基金”)经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2014]第 633 号《关于核准大成添利宝货币市场基金募集的批复》核准,由大成基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《大成添利宝货币市场基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式,存续期限不定,首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币 474,406,660.15 元,业经普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)普华永道中天验字(2014)第 369 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《大成添利宝货币市场基金基金合同》于 2014 年 7 月 28 日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为 474,431,562.82 份基金份额,其中认购资金利息折合 24,902.67 份基金份额。本基金的基金管理人为大成基金管理有限公司,基金托管人为兴业银行股份有限公司。

本基金根据销售方式或单个账户持有的基金份额数量等的不同,对投资人持有的基金份额进行分类。各类别分设不同的基金代码,按各自的费率收取销售服务费并分别公布每万份基金净收益和七日年化收益率,分为成 A 类、B 类和 E 类三类基金份额,三类基金份额根据不同的认申购金额限制和销售方式收取不同的销售服务费。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《大成添利宝货币市场基金基金合同》的有关规定,本基金主要投资于:现金;期限在 1 年以内(含 1 年)的银行存款、债券回购、中央银行票据、同业存单;剩余期限在 397 天以内(含 397 天)的债券、非金融企业债务融资工具、资产支持证券;中国证监会、人民银行认可的其它具有良好流动性货币市场工具。本基金投资业绩比较基准为:银行活期存款利率(税后)。

本财务报表由本基金的基金管理人大成基金管理有限公司于 2024 年 8 月 29 日批准报出。

### 6.4.2 会计报表的编制基础

本财务报表系按照财政部颁布的《企业会计准则——基本准则》以及其后颁布及修订的具体会计准则、应用指南、解释以及《资产管理产品相关会计处理规定》和其他相关规定(统称“企业会计准则”)编制,同时,在信息披露和估值方面,也参考了中国证监会颁布的《中国证券监督管理委员会关于证券投资基金估值业务的指导意见》、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》、《证券投资基金信息披露内容与格式准则》第 3 号《半年度报告的内容与格式》、《证券投资基金信息披露编报规则》第 3 号《会计报表附注的编制及披露》、《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和中期报告>》以及中国证监会和中国证券投资基金业协会颁布的其他相关规定。

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

#### 6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金于 2024 年 06 月 30 日的财务状况以及自 2024 年 01 月 01 日起至 2024 年 06 月 30 日止期间的经营成果和净资产变动情况等有关信息。

#### 6.4.4 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。

#### 6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

##### 6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期未发生会计政策变更。

##### 6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

##### 6.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

#### 6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128 号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、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项税额抵扣等增值税政策的通知》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)本基金的城市维护建设税、教育费附加和地方教育附加等税费按照实际缴纳增值税额的适用比例计算缴纳。

#### 6.4.7 重要财务报表项目的说明

##### 6.4.7.1 货币资金

单位:人民币元

项目	本期末 2024年6月30日
活期存款	6,105,712,738.20
等于: 本金	6,103,785,580.89
加: 应计利息	1,927,157.31
减: 坏账准备	-
定期存款	2,007,877,778.17
等于: 本金	2,000,000,000.00
加: 应计利息	7,877,778.17
减: 坏账准备	-
其中: 存款期限 1 个月以内	-
存款期限 1-3 个月	-
存款期限 3 个月以上	2,007,877,778.17
其他存款	10,721,348,251.95
等于: 本金	10,670,000,000.00
加: 应计利息	51,348,251.95
减: 坏账准备	-
合计	18,834,938,768.32

注: 其他存款为根据协议可提前支取且没有利息损失的协议存款。

##### 6.4.7.2 交易性金融资产

单位:人民币元

项目	本期末 2024年6月30日				
	按实际利率计算的账面价值	影子定价	偏离金额	偏离度 (%)	
债券	交易所市场	972,194,110.66	972,245,110.66	51,000.00	0.0001
	银行间市场	15,098,917,071.48	15,113,220,761.81	14,303,690.33	0.0345
	合计	16,071,111,182.14	16,085,465,872.47	14,354,690.33	0.0346
资产支持证券	-	-	-	-	
合计	16,071,111,182.14	16,085,465,872.47	14,354,690.33	0.0346	

注：1. 偏离金额=影子定价-摊余成本；

2. 偏离度=偏离金额/摊余成本法确定的基金资产净值。

### 6.4.7.3 衍生金融资产/负债

#### 6.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

无。

#### 6.4.7.3.2 期末基金持有的期货合约情况

无。

#### 6.4.7.3.3 期末基金持有的黄金衍生品情况

无。

### 6.4.7.4 买入返售金融资产

#### 6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

单位：人民币元

项目	本期末 2024年6月30日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	3,000,000,000.00	-
银行间市场	9,908,904,115.96	-
合计	12,908,904,115.96	-

#### 6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

无。

#### 6.4.7.4.3 按预期信用损失一般模型计提减值准备的说明

无。

### 6.4.7.5 债权投资

#### 6.4.7.5.1 债权投资情况

无。

#### 6.4.7.5.2 债权投资减值准备计提情况

无。

### 6.4.7.6 其他债权投资

#### 6.4.7.6.1 其他债权投资情况

无。

#### 6.4.7.6.2 其他债权投资减值准备计提情况

无。

## 6.4.7.7 其他权益工具投资

## 6.4.7.7.1 其他权益工具投资情况

无。

## 6.4.7.7.2 报告期末其他权益工具投资情况

无。

## 6.4.7.8 其他资产

无。

## 6.4.7.9 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2024年6月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	-
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	415,079.10
其中：交易所市场	-
银行间市场	415,079.10
应付利息	-
预提费用	123,672.44
其他	14,777.05
合计	553,528.59

## 6.4.7.10 实收基金

金额单位：人民币元

## 大成添利宝货币 A

项目	本期 2024年1月1日至2024年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	173,613,768.90	173,613,768.90
本期申购	1,974,601,304.24	1,974,601,304.24
本期赎回（以“-”号填列）	-1,952,641,671.02	-1,952,641,671.02
基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算调整	-	-
本期申购	-	-
本期赎回（以“-”号填列）	-	-
本期末	195,573,402.12	195,573,402.12

## 大成添利宝货币 B

项目	本期 2024年1月1日至2024年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	12,755,146,840.17	12,755,146,840.17



本期申购	39,297,162,864.71	39,297,162,864.71
本期赎回(以“-”号填列)	-14,364,759,676.13	-14,364,759,676.13
基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算调整	-	-
本期申购	-	-
本期赎回(以“-”号填列)	-	-
本期末	37,687,550,028.75	37,687,550,028.75

## 大成添利宝货币 E

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日	
	基金份额(份)	账面金额
上年度末	2,890,238,168.18	2,890,238,168.18
本期申购	7,311,460,685.87	7,311,460,685.87
本期赎回(以“-”号填列)	-6,566,851,426.99	-6,566,851,426.99
基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算调整	-	-
本期申购	-	-
本期赎回(以“-”号填列)	-	-
本期末	3,634,847,427.06	3,634,847,427.06

注：申购含红利再投份额(如有)、转换入份额(如有)；赎回含转换出份额(如有)。

## 6.4.7.11 其他综合收益

无。

## 6.4.7.12 未分配利润

单位：人民币元

## 大成添利宝货币 A

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-	-	-
本期期初	-	-	-
本期利润	2,567,524.34	-	2,567,524.34
本期基金份额交易产生的变动数	-	-	-
其中：基金申购款	-	-	-
基金赎回款	-	-	-
本期已分配利润	-2,567,524.34	-	-2,567,524.34
本期末	-	-	-

## 大成添利宝货币 B

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-	-	-
本期期初	-	-	-
本期利润	257,297,969.07	-	257,297,969.07
本期基金份额交易产	-	-	-

生的变动数			
其中：基金申购款	-	-	-
基金赎回款	-	-	-
本期已分配利润	-257,297,969.07	-	-257,297,969.07
本期末	-	-	-

## 大成添利宝货币 E

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-	-	-
本期期初	-	-	-
本期利润	34,249,548.31	-	34,249,548.31
本期基金份额交易产生的变动数	-	-	-
其中：基金申购款	-	-	-
基金赎回款	-	-	-
本期已分配利润	-34,249,548.31	-	-34,249,548.31
本期末	-	-	-

## 6.4.7.13 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年6月30日
活期存款利息收入	42,783,625.10
定期存款利息收入	7,877,778.17
其他存款利息收入	65,588,111.27
结算备付金利息收入	170,376.13
其他	-
合计	116,419,890.67

## 6.4.7.14 股票投资收益

无。

## 6.4.7.15 债券投资收益

## 6.4.7.15.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年6月30日
债券投资收益——利息收入	159,301,850.99
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	2,416,990.87
债券投资收益——赎回差价收入	-
债券投资收益——申购差价收入	-
合计	161,718,841.86

## 6.4.7.15.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年6月30日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	22,977,050,509.80
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	22,878,294,021.08
减：应计利息总额	96,339,497.85
减：交易费用	-
买卖债券差价收入	2,416,990.87

## 6.4.7.15.3 债券投资收益——赎回差价收入

无。

## 6.4.7.15.4 债券投资收益——申购差价收入

无。

## 6.4.7.16 资产支持证券投资收益

## 6.4.7.16.1 资产支持证券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年6月30日
资产支持证券投资收益——利息收入	1,707,295.48
资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入	-
资产支持证券投资收益——赎回差价收入	-
资产支持证券投资收益——申购差价收入	-
合计	1,707,295.48

## 6.4.7.16.2 资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年6月30日
卖出资产支持证券成交总额	151,483,890.41
减：卖出资产支持证券成本总额	150,000,000.00
减：应计利息总额	1,483,890.41
减：交易费用	-
资产支持证券投资收益	-

## 6.4.7.16.3 资产支持证券投资收益——赎回差价收入

无。

## 6.4.7.16.4 资产支持证券投资收益——申购差价收入

无。

## 6.4.7.17 贵金属投资收益

## 6.4.7.17.1 贵金属投资收益项目构成

无。

## 6.4.7.17.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

无。

## 6.4.7.17.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

无。

## 6.4.7.17.4 贵金属投资收益——申购差价收入

无。

## 6.4.7.18 衍生工具收益

## 6.4.7.18.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

无。

## 6.4.7.18.2 衍生工具收益——其他投资收益

无。

## 6.4.7.19 股利收益

无。

## 6.4.7.20 公允价值变动收益

无。

## 6.4.7.21 其他收入

无。

## 6.4.7.22 信用减值损失

无。

## 6.4.7.23 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年6月30日
审计费用	54,700.10
信息披露费	59,672.34
证券出借违约金	-
银行划款手续费	89,669.39
账户维护费	18,600.00
其他	320.00
合计	222,961.83

#### 6.4.7.24 分部报告

无。

#### 6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

##### 6.4.8.1 或有事项

无。

##### 6.4.8.2 资产负债表日后事项

无。

#### 6.4.9 关联方关系

##### 6.4.9.1 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者其他重大利害关系的关联方未发生变化。

##### 6.4.9.2 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
兴业银行股份有限公司（“兴业银行”）	基金托管人、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。

#### 6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

##### 6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

###### 6.4.10.1.1 股票交易

无。

###### 6.4.10.1.2 债券交易

无。

###### 6.4.10.1.3 债券回购交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2024年1月1日至2024年6月30日		上年度可比期间 2023年1月1日至2023年6月30日	
	成交金额	占当期债券回 购 成交总额的比 例（%）	成交金额	占当期债券回 购 成交总额的比 例（%）
光大证券	20,417,924,000.00	100.00	600,000.00	100.00

###### 6.4.10.1.4 权证交易

无。

**6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金**

无。

**6.4.10.2 关联方报酬****6.4.10.2.1 基金管理费**

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	20,772,888.43	3,866,150.36
其中：应支付销售机构的客户维护费	3,050,679.41	385,288.87
应支付基金管理人的净管理费	17,722,209.02	3,480,861.49

注：自 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 9 月 17 日止，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 0.20% 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 × 0.20% / 当年天数。

根据基金管理人大成基金于 2023 年 9 月 16 日发布的《大成基金管理有限公司关于大成添利宝货币市场基金降低基金管理费率并修订基金合同及托管协议的公告》，自 2023 年 9 月 18 日起，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 0.15% 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 × 0.15% / 当年天数。

**6.4.10.2.2 基金托管费**

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	6,924,296.19	1,370,669.95

注：自 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 5 月 25 日止，支付基金托管人兴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 × 0.08% / 当年天数。

根据基金管理人大成基金于 2023 年 5 月 24 日发布的《大成基金管理有限公司关于大成添利宝货币市场基金降低基金托管费率并修订基金合同及托管协议的公告》，自 2023 年 5 月 26 日起，支付基金托管人的托管费按前一日基金资产净值 0.05% 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 × 0.05% / 当年天数。

## 6.4.10.2.3 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 2024年1月1日至2024年6月30日			
	当期发生的基金应支付的销售服务费			
	大成添利宝货币 A	大成添利宝货币 B	大成添利宝货币 E	合计
大成基金	918.77	627,026.74	1,467,865.98	2,095,811.49
光大证券	-	73.21	-	73.21
兴业银行	-	84,470.95	20,752.90	105,223.85
合计	918.77	711,570.90	1,488,618.88	2,201,108.55
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2023年1月1日至2023年6月30日			
	当期发生的基金应支付的销售服务费			
	大成添利宝货币 A	大成添利宝货币 B	大成添利宝货币 E	合计
大成基金	1,114.77	90,552.77	522,032.79	613,700.33
光大证券	1.32	-	-	1.32
兴业银行	-	11,157.75	-	11,157.75
合计	1,116.09	101,710.52	522,032.79	624,859.40

注：支付基金销售机构的销售服务费按前一日 A 类基金份额、B 类基金份额和 E 类基金份额的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 类基金份额约定的销售服务费年费率分别为 0.25%、0.01%和 0.15%。其计算公式为：

日销售服务费 = 前一日 A/B/E 类基金份额的基金资产净值 × 约定年费率 / 当年天数。

## 6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

单位：人民币元

银行间市场交易的各关联方名称	本期 2024年1月1日至2024年6月30日					
	债券交易金额		基金逆回购		基金正回购	
	基金买入	基金卖出	交易金额	利息收入	交易金额	利息支出
兴业银行	-	-	-	-	2,922,000.00	261,945.66
银行间市场交易的各关联方名称	上年度可比期间 2023年1月1日至2023年6月30日					
	债券交易金额		基金逆回购		基金正回购	
	基金买入	基金卖出	交易金额	利息收入	交易金额	利息支出

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

#### 6.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

##### 6.4.10.4.1 与关联方通过约定申报方式进行的适用固定期限费率的证券出借业务的情况

无。

##### 6.4.10.4.2 与关联方通过约定申报方式进行的适用市场化期限费率的证券出借业务的情况

无。

#### 6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

##### 6.4.10.5.1 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	本期	本期
	2024年1月1日至 2024年6月30日	2024年1月1日至2024年6 月30日	2024年1月1日至 2024年6月30日
	大成添利宝货币 A	大成添利宝货币 B	大成添利宝货币 E
基金合同生效日 (2014年7月28日) 持有的基金份额	-	-	-
报告期初持有的基金 份额	-	4,136,499.56	-
报告期间申购/买入 总份额	-	696,090,849.95	-
报告期间因拆分变动 份额	-	-	-
减：报告期间赎回/ 卖出总份额	-	686,964,843.51	-
报告期末持有的基金 份额	-	13,262,506.00	-
报告期末持有的基金 份额 占基金总份额比例	-	0.03%	-
项目	上年度可比期间 2023年1月1日至 2023年6月30日	上年度可比期间 2023年1月1日至2023年6 月30日	上年度可比期间 2023年1月1日至 2023年6月30日
	大成添利宝货币 A	大成添利宝货币 B	大成添利宝货币 E
基金合同生效日 (2014年7月28日)	-	-	-



持有的基金份额			
报告期初持有的基金份额	-	-	-
报告期间申购/买入总份额	-	-	-
报告期间因拆分变动份额	-	-	-
减：报告期间赎回/卖出总份额	-	-	-
报告期末持有的基金份额	-	-	-
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	-	-	-

注：基金管理人大成基金投资本基金适用的交易费率与本基金法律文件规定一致。

#### 6.4.10.5.2 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

份额单位：份

大成添利宝货币 B

关联方名称	本期末 2024年6月30日		上年度末 2023年12月31日	
	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例 (%)	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例 (%)
兴业银行	883,382,817.62	2.13	-	-

#### 6.4.10.6 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 2024年1月1日至2024年6月30日		上年度可比期间 2023年1月1日至2023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
兴业银行	2,104,987,460.36	2,623,219.54	1,313,258.32	11,711.71

注：本基金由基金托管人保管的银行存款，按银行约定利率计息。

#### 6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

无。

#### 6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

无。

#### 6.4.11 利润分配情况

单位：人民币元

大成添利宝货币 A
-----------

已按再投资形式转 实收基金	直接通过应付 赎回款转出金额	应付利润 本年变动	本期利润分配合 计	备注
2,577,829.41	-	-10,305.07	2,567,524.34	-
大成添利宝货币 B				
已按再投资形式转 实收基金	直接通过应付 赎回款转出金额	应付利润 本年变动	本期利润分配合 计	备注
254,592,155.67	-	2,705,813.40	257,297,969.07	-
大成添利宝货币 E				
已按再投资形式转 实收基金	直接通过应付 赎回款转出金额	应付利润 本年变动	本期利润分配合 计	备注
34,365,958.75	-	-116,410.44	34,249,548.31	-

#### 6.4.12 期末（2024 年 6 月 30 日）本基金持有的流通受限证券

##### 6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

6.4.12.1.2 受限证券类别：债券										
证券 代码	证 券 名 称	成 功 认 购 日	受 限 期	流 通 受 限 类 型	认 购 价 格	期 末 估 值 单 价	数 量 （ 单 位： 张）	期 末 成 本 总 额	期 末 估 值 总 额	备 注
14879 0	2 4 广 发 D 6	202 4 年 6 月 24 日	1 个 月 内 （ 含）	新 债 未 上 市	100.0 0	100.0 3	1,800,00 0	180,000,000.0 0	180,054,680.5 4	-

##### 6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

无。

##### 6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

###### 6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末 2024 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 3,103,087,065.28 元，是以如下债券作为抵押：

金额单位：人民币元

债券代码	债券名称	回购到期日	期末估值单 价	数量（张）	期末估值总额
072410049	24 平安证 券 CP005	2024 年 7 月 1 日	100.32	1,053,000	105,638,996.66
112303155	23 农业银	2024 年 7 月 1	99.88	500,000	49,940,538.16

	行 CD155	日			
112304037	23 中国银行 CD037	2024 年 7 月 1 日	99.60	500,000	49,797,647.23
112306259	23 交通银行 CD259	2024 年 7 月 1 日	99.36	3,200,000	317,957,361.69
112309245	23 浦发银行 CD245	2024 年 7 月 1 日	98.85	400,000	39,538,810.41
112311175	23 平安银行 CD175	2024 年 7 月 1 日	98.76	1,800,000	177,762,704.77
112311176	23 平安银行 CD176	2024 年 7 月 1 日	98.75	320,000	31,598,566.84
112317171	23 光大银行 CD171	2024 年 7 月 1 日	99.89	114,000	11,387,859.84
112317182	23 光大银行 CD182	2024 年 7 月 1 日	99.76	214,000	21,348,651.63
112403035	24 农业银行 CD035	2024 年 7 月 1 日	98.55	2,513,000	247,653,868.05
112403037	24 农业银行 CD037	2024 年 7 月 1 日	98.49	1,471,000	144,885,768.62
112403045	24 农业银行 CD045	2024 年 7 月 1 日	98.96	500,000	49,481,785.45
112403153	24 农业银行 CD153	2024 年 7 月 1 日	99.11	2,000,000	198,228,661.97
112409101	24 浦发银行 CD101	2024 年 7 月 1 日	98.40	828,000	81,477,107.91
112415069	24 民生银行 CD069	2024 年 7 月 1 日	99.14	2,300,000	228,011,696.17
112415241	24 民生银行 CD241	2024 年 7 月 1 日	99.11	1,768,000	175,227,131.36
112419093	24 恒丰银行 CD093	2024 年 7 月 1 日	98.43	979,000	96,362,860.59
112420136	24 广发银行 CD136	2024 年 7 月 1 日	99.26	1,900,000	188,600,652.81
112493106	24 广西北部湾银行 CD054	2024 年 7 月 1 日	99.64	2,000,000	199,283,330.58
112494324	24 广西北部湾银行 CD070	2024 年 7 月 1 日	99.56	1,979,000	197,021,100.33
112496262	24 广州农村商业银行 CD034	2024 年 7 月 1 日	99.42	1,899,000	188,790,311.53
230213	23 国开 13	2024 年 7 月 1 日	100.94	5,299,000	534,862,837.21

合计				33,537,000	3,334,858,249.81
----	--	--	--	------------	------------------

#### 6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

无。

#### 6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

无。

### 6.4.13 金融工具风险及管理

#### 6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金是货币市场基金，其风险和预期收益率低于股票基金、混合基金和普通债券型基金，属于预期风险收益水平较低的品种。本基金投资的金融工具主要为存款和债券投资等。本基金在日常经营活动中涉及的财务风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金管理人制定了政策和程序来识别及分析这些风险，并设定适当的风险限额及内部控制流程，通过可靠的管理及信息系统持续监控上述各类风险。

本基金的基金管理人奉行全面风险管理体系的建设，建立了以由高层监控(合规与风险管理委员会、公司投资风险控制委员会)、专业监控(监察稽核部、风险管理部)、部门互控、岗位自控构成的风险管理架构体系。本基金的基金管理人在董事会下设立合规与风险管理委员会，对公司整体运营风险进行监督，监督风险控制措施的执行。在管理层层面设立投资风险控制委员会，通过定期会议讨论涉及投资风险的重大议题，形成正式决议提交投委会。在业务操作层面，监察稽核部履行合规控制职责，通过定期、不定期检查内控制度的执行情况、对重大风险点以专项稽核的方式确保公司内控制度、流程得到贯彻执行。风险管理部履行风险量化评估分析职责。

本基金的基金管理人对于金融工具的风险管理方法主要是通过定性分析和定量分析的方法去估测各种风险产生的可能损失。从定性分析的角度出发，判断风险损失的严重程度和出现同类风险损失的频度。而从定量分析的角度出发，根据本基金的投资目标，结合基金资产所运用金融工具特征通过特定的风险量化指标、模型，日常的量化报告，确定风险损失的限度和相应置信程度，及时可靠地对各种风险进行监督、检查和评估，并通过相应决策，将风险控制在可承受的范围内。

#### 6.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息等情况，导致基金资产损失和收益变化的风险。

本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的银行存款存放在本基金的托管人兴业银行股份有限公司，因而与银行存款相关的信用风险不重大。本基金在交易所进行的交易均以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，

违约风险可能性很小；在银行间同业市场进行交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式进行限制以控制相应的信用风险。

本基金的基金管理人建立了信用风险管理流程，通过对投资品种信用等级评估来控制证券发行人的信用风险。信用等级评估以内部信用评级为主，外部信用评级为辅。内部债券信用评级主要考察发行人的经营风险、财务风险和流动性风险，以及信用产品的条款和担保人的情况等。此外，本基金的基金管理人根据信用产品的内部评级，通过单只信用产品投资占基金资产净值的比例及占发行量的比例进行控制，通过分散化投资以分散信用风险。

本期末，本基金持有的除国债、央行票据和政策性金融债以外的债券占基金资产净值的比例为 35.53%(上年度末：60.68%)。

### 6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金在履行与金融负债有关的义务时遇到资金短缺的风险。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难或因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理的价格变现。

#### 6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《货币市场基金监督管理办法》及《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》等有关法规的要求对本基金组合资产的流动性风险进行管理。本基金的基金管理人采用监控流动性受限资产比例、份额持有人集中度、调整平均剩余期限和平均剩余存续期、压力测试等方式防范流动性风险，并于开放日对本基金的申购赎回情况进行监控，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配，确保本基金资产的变现能力与投资者赎回需求的匹配与平衡。本基金的基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款，约定在非正常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。于本期末，本基金持有的流动性受限资产的估值占基金资产净值的比例未超过 10%，本基金投资组合中现金、国债、中央银行票据、政策性金融债券以及 5 个交易日内到期的其他金融工具占基金资产净值的比例合计不低于 30%，且本基金前 10 名份额持有人的持有份额合计占基金总份额的比例、投资组合的平均剩余期限及平均剩余存续期皆符合有关法规的要求。

本基金所持大部分证券为剩余期限较短、具有良好流动性的债券和货币市场工具，除在证券交易所的债券回购及返售交易，其余均在银行间同业市场交易，因此，除在附注“期末本基金持有的流通受限证券”中列示的部分基金资产流通暂时受限制外(如有)，均能够及时变现。本基金

可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券资产的公允价值。除附注“期末债券正回购交易中作为抵押的债券”中列示的卖出回购金融资产款余额(如有)将在 1 个月内到期且计息外，本基金于资产负债表日所持有的金融负债的合同约定剩余到期日均为一年以内且一般不计息，可赎回基金份额净值无固定到期日且不计息，因此账面余额一般即为未折现的合约到期现金流量。

#### 6.4.13.4 市场风险

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动而发生波动的风险，包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

##### 6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指金融工具的公允价值或现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。利率敏感性金融工具均面临由于市场利率上升而导致公允价值下降的风险，其中浮动利率类金融工具还面临每个付息期间结束根据市场利率重新定价时对于未来现金流影响的风险。

本基金主要投资于银行间同业市场交易的固定收益品种，因此存在相应的利率风险。本基金的基金管理人每日通过“影子定价”对本基金面临的市场风险进行监控，定期对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控，并通过调整投资组合的久期等方法对上述利率风险进行管理。

##### 6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2024 年 6 月 30 日	6 个月以内	6 个月-1 年	1-5 年	不计息	合计
资产					
货币资金	15,271,514,727.08	3,563,424,041.24	-	-	18,834,938,768.32
交易性金融资产	14,265,777,929.29	1,805,333,252.85	-	-	16,071,111,182.14
买入返售金融资产	12,908,904,115.96	-	-	-	12,908,904,115.96
应收申购款	-	-	-	109,010,782.57	109,010,782.57
资产总计	42,446,196,772.33	5,368,757,294.09	-	-109,010,782.57	47,923,964,848.99
负债					
应付管理人报酬	-	-	-	4,946,301.99	4,946,301.99
应付托管费	-	-	-	1,648,767.37	1,648,767.37
应付清算款	-	-	-	3,288,816,254.19	3,288,816,254.19
卖出回购金融资产款	3,103,087,065.28	-	-	-	3,103,087,065.28

应付销售服务费	-	-	-	805,549.75	805,549.75
应付利润	-	-	-	6,056,144.99	6,056,144.99
应交税费	-	-	-	80,378.90	80,378.90
其他负债	-	-	-	553,528.59	553,528.59
负债总计	3,103,087,065.28	-	-	3,302,906,925.78	6,405,993,991.06
利率敏感度缺口	39,343,109,707.05	5,368,757,294.09	-	-3,193,896,143.21	41,517,970,857.93
上年度末 2023 年 12 月 31 日	6 个月以内	6 个月 -1 年	1-5 年	不计息	合计
资产					
货币资金	3,597,464,063.17	500,420,138.84	-	-	4,097,884,202.01
结算备付金	1,318,834.34	-	-	-	1,318,834.34
交易性金融资产	9,704,937,817.43	901,453,030.88	-	-	10,606,390,848.31
买入返售金融资产	3,497,093,676.53	-	-	-	3,497,093,676.53
应收申购款	-	-	-	41,301,394.21	41,301,394.21
资产总计	16,800,814,391.47	1,401,873,169.72	-	41,301,394.21	18,243,988,955.40
负债					
应付管理人报酬	-	-	-	1,898,522.30	1,898,522.30
应付托管费	-	-	-	632,840.78	632,840.78
应付清算款	-	-	-	40,522,268.85	40,522,268.85
卖出回购金融资产款	2,377,556,507.78	-	-	-	2,377,556,507.78
应付销售服务费	-	-	-	440,772.24	440,772.24
应付利润	-	-	-	3,477,047.10	3,477,047.10
应交税费	-	-	-	50,784.92	50,784.92
其他负债	-	-	-	411,434.18	411,434.18
负债总计	2,377,556,507.78	-	-	47,433,670.37	2,424,990,178.15
利率敏感度缺口	14,423,257,883.69	1,401,873,169.72	-	-6,132,276.16	15,818,998,777.25

注：表中所示为本基金资产及负债的账面价值，并按照合约规定的利率重新定价日或到期日孰早者予以分类。

#### 6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	除市场利率以外的其他市场变量保持不变	
分析	相关风险变量的变	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）

	动	本期末（2024 年 6 月 30 日）	上年度末（2023 年 12 月 31 日）
	市场利率上升 25 个基点		-12,255,429.96
市场利率下降 25 个基点		12,280,367.00	8,834,568.46

#### 6.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无重大外汇风险。

#### 6.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于协议存款和银行间同业市场交易的固定收益品种，因此无重大其他价格风险。

##### 6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

无。

##### 6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

无。

#### 6.4.14 公允价值

##### 6.4.14.1 金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属的层次，由对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次决定：

第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

##### 6.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

###### 6.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2024 年 6 月 30 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
第一层次	-	-



第二层次	16,071,111,182.14	10,606,390,848.31
第三层次	-	-
合计	16,071,111,182.14	10,606,390,848.31

#### 6.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

本基金以导致各层次之间转换的事项发生日为确认各层次之间转换的时点。

本基金本期及上年度可比期间持有的以公允价值计量的金融工具的公允价值所属层次未发生重大变动。

#### 6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

于本期末，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产(上年度末：同)。

#### 6.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括应收款项和其他金融负债，其账面价值与公允价值相差很小。

#### 6.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

## § 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	16,071,111,182.14	33.53
	其中：债券	16,071,111,182.14	33.53
	资产支持证 券	-	-
2	买入返售金融资产	12,908,904,115.96	26.94
	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	18,834,938,768.32	39.30
4	其他各项资产	109,010,782.57	0.23
5	合计	47,923,964,848.99	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	9.36

	其中：买断式回购融资		-
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	3,103,087,065.28	7.47
	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

无。

## 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	88
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	108
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	62

### 报告期内投资组合平均剩余期限超过 120 天情况说明

无。

### 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	49.47	15.39
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	1.81	-
2	30 天（含）—60 天	6.74	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
3	60 天（含）—90 天	18.91	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
4	90 天（含）—120 天	7.25	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
5	120 天（含）—397 天（含）	32.59	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
	合计	114.96	15.39

### 7.4 报告期内投资组合平均剩余存续期超过 240 天情况说明

无。

## 7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	按实际利率计算的账面价值	占基金资产净值比例 (%)
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	2,290,206,726.84	5.52
	其中：政策性金融债	1,318,012,616.18	3.17
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	2,469,950,413.04	5.95
6	中期票据	51,004,076.67	0.12
7	同业存单	11,259,949,965.59	27.12
8	其他	-	-
9	合计	16,071,111,182.14	38.71
10	剩余存续期超过 397 天的浮动利率债券	757,024,208.16	1.82

## 7.6 期末按实际利率计算账面价值占基金资产净值比例大小排名的前十名债券投资明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	债券数量(张)	按实际利率计算的账面价值(元)	占基金资产净值比例 (%)
1	230213	23 国开 13	7,500,000	757,024,208.16	1.82
2	210409	21 农发 09	5,600,000	560,988,408.02	1.35
3	012481379	24 电网 SCP017	4,800,000	481,248,126.95	1.16
4	112403035	24 农业银行 CD035	3,600,000	354,776,730.99	0.85
5	112306259	23 交通银行 CD259	3,200,000	317,957,361.69	0.77
6	012480785	24 中石化 SCP001	3,000,000	301,810,615.51	0.73
7	112481532	24 南京银行 CD158	3,000,000	298,728,283.70	0.72
8	112481582	24 长沙银行 CD143	3,000,000	298,653,749.44	0.72
9	112496262	24 广州农村商业银行 CD034	3,000,000	298,246,937.65	0.72
10	072410090	24 银河证券 CP004	2,900,000	290,173,454.76	0.70

### 7.7 “影子定价”与按实际利率计算账面价值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	0.0709%
报告期内偏离度的最低值	0.0314%
报告期内每个交易日偏离度的绝对值的简单平均值	0.0460%

#### 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。

### 7.8 期末按实际利率计算的账面价值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。

### 7.9 投资组合报告附注

#### 7.9.1 基金计价方法说明

本基金按照实际利率法计算金融资产的账面价值，并使用影子定价和偏离度加以控制。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 1.0000 元。

#### 7.9.2 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 24 广州农村商业银行 CD034 的发行主体广州农村商业银行股份有限公司于 2024 年 2 月 5 日因未办妥抵押预告、登记即发放个人住房按揭贷款、线上消费贷款资金流入证券领域等受到国家金融监督管理总局广东监管局处罚（粤金罚决字（2024）14 号）。本基金认为，对广州农商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 23 交通银行 CD259 的发行主体交通银行股份有限公司于 2024 年 6 月 3 日因安全测试存在薄弱环节、运行管理存在漏洞、数据安全管理工作不足、灾备管理不足等受到国家金融监督管理总局处罚（金罚决字（2024）29 号）。本基金认为，对交通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 24 长沙银行 CD143 的发行主体长沙银行股份有限公司于 2023 年 9 月 27 日因未按规定进行执业登记和管理、未对销售过程关键环节以现场录音录像的方法予以记录受到国家金融监督管理总局湖南监管局处罚（湘金罚决字（2023）4 号）；于 2023 年 11 月 10 日因违规提供土地储备融资且接受地方政府兜底、通过理财违规发放项目融资，且投

后管理未尽职导致资金挪用于缴纳土地保证金等受到国家金融监督管理总局湖南监管局处罚（湘金罚决字〔2023〕20号）。本基金认为，对长沙银行的处罚不会对其投资价值构成实质性负面影响。

4、本基金投资的前十名证券之一 24 农业银行 CD035 的发行主体中国农业银行股份有限公司于 2023 年 8 月 15 日因农户贷款发放后流入房地产企业、农村个人生产经营贷款贷后管理不到位等，受到国家金融监督管理总局处罚（金罚决字〔2023〕8号）；于 2023 年 11 月 16 日因流动资金贷款被用于固定资产投资、贷款受托支付问题整改不到位、贷款风险分类不准确等受到国家金融监督管理总局处罚（金罚决字〔2023〕21号）。本基金认为，对农业银行的处罚不会对其投资价值构成实质性负面影响。

5、本基金投资的前十名证券之一 24 银河证券 CP004 的发行主体中国银河证券股份有限公司于 2024 年 2 月 2 日因未按规定履行客户身份识别义务、未按规定报送大额交易报告或者可疑交易报告受到中国人民银行处罚（银罚决字〔2024〕1号）。本基金认为，对中国银河的处罚不会对其投资价值构成实质性负面影响。

### 7.9.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	-
2	应收清算款	-
3	应收利息	-
4	应收申购款	109,010,782.57
5	其他应收款	-
6	待摊费用	-
7	其他	-
8	合计	109,010,782.57

### 7.9.4 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。

## § 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

份额单位：份

份额级别	持有人户数	户均持有的基金份额	持有人结构	
			机构投资者	个人投资者

	(户)		持有份额	占总 份额 比例 (%)	持有份额	占总 份额 比例 (%)
大成添利宝货币 A	47,269	4,137.46	7,155,953.94	3.66	188,417,448.18	96.34
大成添利宝货币 B	2,370	15,901,919.84	37,667,829,374.64	99.95	19,720,654.11	0.05
大成添利宝货币 E	463,389	7,844.05	52,573,153.20	1.45	3,582,274,273.86	98.55
合计	513,028	80,927.30	37,727,558,481.78	90.87	3,790,412,376.15	9.13

注：1、上述机构/个人投资者持有份额占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（即期末基金份额总额）。

2、持有人户数为有效户数，即存量份额大于零的账户。

## 8.2 期末货币市场基金前十名份额持有人情况

序号	持有人类别	持有份额（份）	占总份额比例（%）
1	银行类机构	1,005,791,105.23	2.42
2	券商类机构	1,002,512,479.83	2.41
3	券商类机构	904,176,552.43	2.18
4	银行类机构	809,885,536.79	1.95
5	银行类机构	803,387,082.92	1.94
6	银行类机构	802,296,937.46	1.93
7	银行类机构	706,625,824.20	1.70
8	银行类机构	706,113,363.13	1.70
9	银行类机构	705,205,207.35	1.70
10	券商类机构	608,264,995.72	1.47

## 8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数（份）	占基金总份额比例（%）
基金管理人所有从业人员持有本基金	大成添利宝货币 A	2,199.89	0.0011
	大成添利宝货币 B	687,249.80	0.0018
	大成添利宝货币 E	9,488,992.41	0.2611
	合计	10,178,442.10	0.0245

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（即期末基金份额总额）。

## 8.4 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情况

项目	份额级别	持有基金份额总量的数量区间（万份）
----	------	-------------------

本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	大成添利宝货币 A	0
	大成添利宝货币 B	0
	大成添利宝货币 E	>100
	合计	>100
本基金基金经理持有本开放式基金	大成添利宝货币 A	0
	大成添利宝货币 B	0~10
	大成添利宝货币 E	0
	合计	0~10

## § 9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	大成添利宝货币 A	大成添利宝货币 B	大成添利宝货币 E
基金合同生效日（2014 年 7 月 28 日）基金份额总额	53,024,889.42	376,021,250.00	45,385,423.40
本报告期期初基金份额总额	173,613,768.90	12,755,146,840.17	2,890,238,168.18
本报告期基金总申购份额	1,974,601,304.24	39,297,162,864.71	7,311,460,685.87
减：本报告期基金总赎回份额	1,952,641,671.02	14,364,759,676.13	6,566,851,426.99
本报告期基金拆分变动份额	-	-	-
本报告期期末基金份额总额	195,573,402.12	37,687,550,028.75	3,634,847,427.06

## § 10 重大事件揭示

### 10.1 基金份额持有人大会决议

无。

### 10.2 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

一、基金管理人的重大人事变动

无。

二、基金托管人的基金托管部门的重大人事变动

报告期内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

本报告期内无涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

### 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天会计师事务所(特殊普通合伙)。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

#### 10.6.1 管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，基金管理人及其相关高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

#### 10.6.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

报告期内本基金托管人的托管业务部门及其相关高级管理人员未受到监管部门的稽查或处罚。

### 10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

#### 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	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例 (%)	佣金	占当期佣金总量的比例 (%)	
光大证券	1	-	-	-	-	-
招商证券	1	-	-	-	-	-

注：本基金采用托管人结算模式，本基金管理人负责选择证券经纪商，租用其交易单元作为本基金的交易单元。证券经纪商的选择标准如下：

- (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等研究服务；
- (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) 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。

租用交易单元的使用流程为：首先根据证券经纪商选择标准形成《券商服务评价表》，然后根据评分高低进行本基金交易单元选择。



## 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

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例(%)	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例(%)	成交金额	占当期权证成交总额的比例(%)
光大证券	-	-	20,417,924,000.00	100.00	-	-

## 10.8 偏离度绝对值超过 0.5%的情况

无。

## 10.9 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	大成添利宝货币市场基金(E类份额)基金产品资料概要更新	中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站	2024年6月28日
2	大成添利宝货币市场基金(B类份额)基金产品资料概要更新	中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站	2024年6月28日
3	大成添利宝货币市场基金(A类份额)基金产品资料概要更新	中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站	2024年6月28日
4	大成基金管理有限公司关于旗下部分基金增加东兴证券股份有限公司为销售机构的公告	中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站	2024年6月28日
5	大成基金管理有限公司关于提请投资者及时更新已过期身份证件及其他身份基本信息的公告	中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站	2024年6月28日
6	大成基金管理有限公司关于旗下部分基金增加北京创金启富基金销售有限公司为销售机构的公告	中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站	2024年6月25日
7	大成基金管理有限公司关于旗下部分基金增加招商银行股份有限公司为销售机构的公告	中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站	2024年6月19日
8	大成基金管理有限公司关于暂停海银基金销售有限公司办理相关销售业务的公告	中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站	2024年6月12日
9	大成添利宝货币市场基金更新招募说明书	中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站	2024年6月4日
10	大成添利宝货币市场基金(E类份额)基金产品资料概要更新	中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本	2024年6月4日

		公司网站	
11	大成添利宝货币市场基金(B类份额)基金产品资料概要更新	中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站	2024年6月4日
12	大成添利宝货币市场基金(A类份额)基金产品资料概要更新	中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站	2024年6月4日
13	大成添利宝货币市场基金变更基金经理公告	中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站	2024年5月31日
14	大成基金管理有限公司关于旗下部分基金增加江苏银行股份有限公司为销售机构的公告	中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站	2024年5月30日
15	大成基金管理有限公司关于旗下部分基金增加中国邮政储蓄银行股份有限公司为代销机构的公告	中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站	2024年5月30日
16	大成添利宝货币市场基金A、B类份额增加部分代销机构的公告	中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站	2024年5月14日
17	大成基金管理有限公司关于旗下部分基金增加部分代销机构的公告	中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站	2024年5月14日
18	关于大成添利宝货币市场基金调整大额申购(含定期定额申购)及基金转换转入业务的公告	中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站	2024年4月26日
19	大成基金管理有限公司关于旗下部分基金增加新华信通基金销售有限公司为销售机构的公告	中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站	2024年4月26日
20	大成添利宝货币市场基金2024年第1季度报告	中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站	2024年4月19日
21	大成基金管理有限公司提醒投资者谨防金融诈骗的公告	中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站	2024年4月2日
22	大成添利宝货币市场基金2023年年度报告	中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站	2024年3月29日
23	大成添利宝货币市场基金更新招募说明书	中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站	2024年3月12日
24	大成添利宝货币市场基金(B类份额)基金产品资料概要更新	中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站	2024年3月12日
25	大成添利宝货币市场基金(E类份额)	中国证监会基金电子披	2024年3月12日

	基金产品资料概要更新	露网站、规定报刊及本公司网站	
26	大成添利宝货币市场基金(A类份额)基金产品资料概要更新	中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站	2024年3月12日
27	大成添利宝货币市场基金增聘基金经理公告	中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站	2024年3月9日
28	大成添利宝货币市场基金B类份额增加浙商银行股份有限公司为销售机构的公告	中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站	2024年1月30日
29	大成基金管理有限公司提醒投资者谨防金融诈骗的公告	中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站	2024年1月23日
30	大成基金管理有限公司关于旗下部分基金增加中信银行股份有限公司为销售机构的公告	中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站	2024年1月22日
31	大成添利宝货币市场基金2023年第4季度报告	中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站	2024年1月19日

## § 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

无。

### 11.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

## § 12 备查文件目录

### 12.1 备查文件目录

- 1、中国证监会批准设立大成添利宝货币市场基金的文件；
- 2、《大成添利宝货币市场基金基金合同》；
- 3、《大成添利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、本报告期内在规定报刊上披露的各种公告原稿。

### 12.2 存放地点

备查文件存放在本基金管理人和托管人的住所。

### 12.3 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

2024 年 8 月 30 日