

大成现金宝场内实时申赎货币市场基金
2014 年半年度报告
2014 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

送出日期：2014 年 8 月 28 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。本半年度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。

基金托管人中国农业银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2014 年 8 月 26 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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2014 年 01 月 01 日起至 06 月 30 日止。

1.2 目录

§ 1 重要提示及目录	1
1.1 重要提示.....	1
1.2 目录.....	2
§ 2 基金简介	4
2.1 基金基本情况.....	4
2.2 基金产品说明.....	4
2.3 基金管理人和基金托管人.....	4
2.4 信息披露方式.....	5
2.5 其他相关资料.....	5
§ 3 主要财务指标和基金净值表现	5
3.1 主要会计数据和财务指标.....	5
3.2 基金净值表现.....	5
§ 4 管理人报告	7
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	7
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	9
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	9
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.....	10
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	10
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	10
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	11
§ 5 托管人报告	11
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	11
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.....	11
5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见.....	11
§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）	11
6.1 资产负债表.....	11
6.2 利润表.....	13
6.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	14
6.4 报表附注.....	15
§ 7 投资组合报告	28
7.1 期末基金资产组合情况.....	28
7.2 债券回购融资情况.....	28
7.3 基金投资组合平均剩余期限.....	29
7.4 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	30
7.5 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.....	30
7.6 “影子定价”与“摊余成本法”确定的基金资产净值的偏离.....	30
7.7 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明细.....	31
7.8 投资组合报告附注.....	31
§ 8 基金份额持有人信息	31
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	31
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	32
8.3 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.....	32
§ 9 开放式基金份额变动	32

§ 10 重大事件揭示	33
10.1 基金份额持有人大会决议.....	33
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.....	33
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	33
10.4 基金投资策略的改变.....	33
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	33
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.....	33
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	33
10.8 偏离度绝对值超过 0.5%的情况.....	35
10.9 其他重大事件.....	35
§ 11 影响投资者决策的其他重要信息	36
§ 12 备查文件目录	36
12.1 备查文件目录.....	36
12.2 存放地点.....	36
12.3 查阅方式.....	36

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	大成现金宝场内实时申赎货币市场基金	
基金简称	大成现金宝货币	
基金主代码	519898	
交易代码	519898	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2013 年 3 月 27 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	
报告期末基金份额总额	358,567,403,637.00 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称:	现金宝 A	现金宝 B
下属分级基金的交易代码:	519898	519899
报告期末下属分级基金的份额总额	210,489,964,679.00 份	148,077,438,958.00 份

2.2 基金产品说明

投资目标	安全性和流动性优先，在此基础上追求适度收益。
投资策略	本基金通过结构化投资策略、分散化投资策略、利率趋势评估策略、滚动配置策略和相对价值评估策略多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	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	中国农业银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	杜鹏	李芳菲
	联系电话	0755-83183388	010-66060069
	电子邮箱	dupeng@dcfund.com.cn	lifangfei@abchina.com
客户服务电话		4008885558	95599
传真		0755-83199588	010-68121816
注册地址		深圳市福田区深南大道 7088 号招商银行大厦 32 层	北京市东城区建国门内大街 69 号
办公地址		深圳市福田区深南大道 7088 号招商银行大厦 32 层	北京市西城区复兴门内大街 28 号凯晨世贸中心东座 F9
邮政编码		518040	100031
法定代表人		张树忠	蒋超良

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》、《中国证券报》、《证券时报》
登载基金半年度报告正文的管理人互联网网址	http://www.dcfund.com.cn
基金半年度报告备置地点	深圳市福田区深南大道 7088 号招商银行大厦 32 层大成基金管理有限公司 北京市西城区复兴门内大街 28 号凯晨世贸中心东座 F9 中国农业银行股份有限公司托管业务部

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	中国证券登记结算有限责任公司	北京市西城区太平桥大街 17 号

§ 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

基金级别	现金宝 A	现金宝 B
3.1.1 期间数据和指标	报告期(2014年1月1日 - 2014年6月30日)	报告期(2014年1月1日 - 2014年6月30日)
本期已实现收益	27,272,719.08	26,052,534.11
本期利润	27,272,719.08	26,052,534.11
本期净值收益率	2.1825%	2.4813%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2014年6月30日)	
期末基金资产净值	2,104,899,646.79	1,480,774,389.58
期末基金份额净值	0.01	0.01
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2014年6月30日)	
累计净值收益率	4.8762%	5.6585%

注：1、本基金根据每日基金收益公告，以每百万份基金份额收益为基准，为投资人每日计算收益并分配。

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。

3.2 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

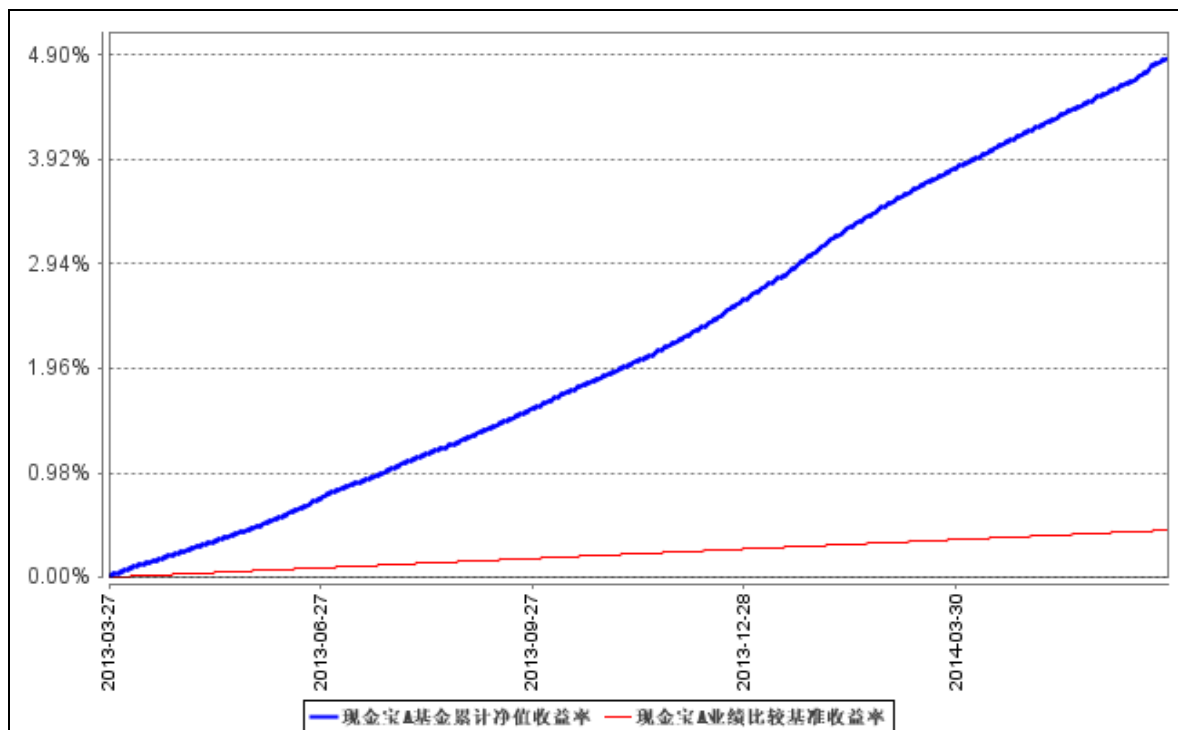
现金宝 A

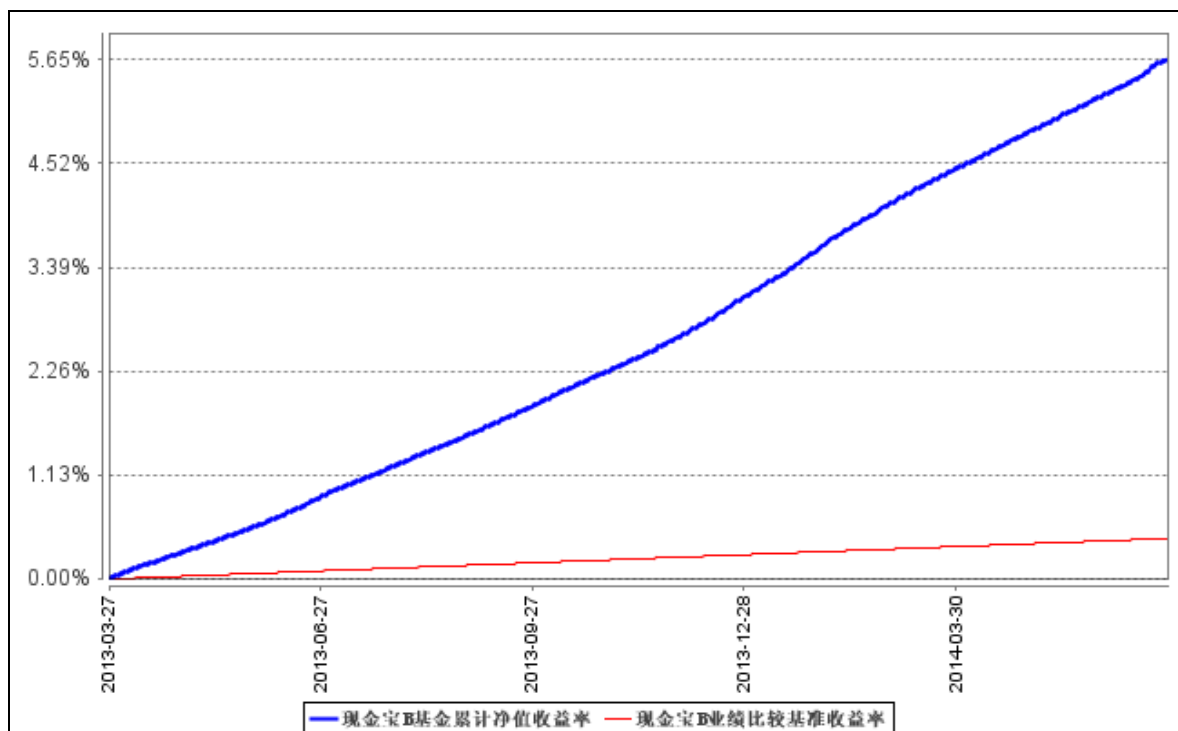
阶段	份额净值 收益率①	份额净值 收益率标 准差②	业绩比较 基准收益 率③	业绩比较基 准收益率标 准差④	①-③	②-④
过去一个月	0.3534%	0.0066%	0.0288%	0.0000%	0.3246%	0.0066%
过去三个月	0.9872%	0.0039%	0.0873%	0.0000%	0.8999%	0.0039%
过去六个月	2.1825%	0.0040%	0.1736%	0.0000%	2.0089%	0.0040%
过去一年	4.0653%	0.0033%	0.3500%	0.0000%	3.7153%	0.0033%
自基金合同 生效起至今	4.8762%	0.0033%	0.4421%	0.0000%	4.4341%	0.0033%

现金宝 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	0.4017%	0.0066%	0.0288%	0.0000%	0.3729%	0.0066%
过去三个月	1.1353%	0.0039%	0.0873%	0.0000%	1.0480%	0.0039%
过去六个月	2.4813%	0.0040%	0.1736%	0.0000%	2.3077%	0.0040%
过去一年	4.6821%	0.0033%	0.3500%	0.0000%	4.3321%	0.0033%
自基金合同 生效起至今	5.6585%	0.0033%	0.4421%	0.0000%	5.2164%	0.0033%

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、按基金合同规定，本基金投资组合的平均剩余期限在每个交易日不得超过 120 天；本基金与基金管理人管理的其他基金持有一家公司发行的证券总和，不超过该证券的 10%；本基金投资于定期存款的比例不得超过基金资产净值的 30%（有存款期限、但根据协议可提前支取且没有利息损失的银行存款，不受该比例限制）；本基金持有的剩余期限不超过 397 天但剩余存续期超过 397 天的浮动利率债券的摊余成本总计不得超过当日基金资产净值的 20%；本基金不得投资于以定期存款利率为基准利率的浮动利率债券；本基金买断式回购融入基础债券的剩余期限不得超过 397 天；在全国银行间同业市场中的债券回购最长期限为 1 年，债券回购到期后不得展期；本基金存放在具有基金托管资格的同一商业银行的存款，不得超过基金资产净值的 30%；存放在不具有基金托管资格的同一商业银行的存款，不得超过基金资产净值的 5%；基金的投资组合中保留的现金或者到期日在一年以内的政府债券的比例合计不低于基金资产净值的 5%；本基金投资于同一公司发行的短期企业债券及短期融资券的比例，合计不得超过基金资产净值的 10%；本基金持有的全部资产支持证券，其市值不得超过基金资产净值的 20%；本基金持有的同一（指同一信用级别）资产支持证券的比例，不得超过该资产支持证券规模的 10%；本基金投资于同一原始权益人的各类资产支持证券的比例，不得超过基金资产净值的 10%；本基金管理人管理的全部基金投资于同一原始权益人的各类资产支持证券，不得超过其各类资产支持证券合计规模的 10%；本基金债券正回购的资金余额在每个交易日均不得超过基金资产净值的 20%；

2、按基金合同规定，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有关约定。

§ 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经中国证监会证监基金字[1999]10 号文批准，于 1999 年 4 月 12 日正式成立，是中国证监会批准成立的首批十家基金管理公司之一，注册资本为 2 亿元人民币，注册

地为深圳。目前公司由四家股东组成，分别为中泰信托有限责任公司(48%)、光大证券股份有限公司(25%)、中国银河投资管理有限公司(25%)、广东证券股份有限公司(2%)。截至 2014 年 6 月 30 日，本基金管理人共管理 1 只封闭式证券投资基金：景福证券投资基金，4 只 ETF 及 1 只 ETF 联接基金：深证成长 40 交易型开放式指数证券投资基金、大成深证成长 40 交易型开放式指数证券投资基金联接基金、大成中证 500 沪市交易型开放式指数证券投资基金、大成中证 100 交易型开放式指数证券投资基金、大成中证 500 深市交易型开放式指数证券投资基金，1 只 QDII 基金：大成标普 500 等权重指数证券投资基金及 37 只开放式证券投资基金：大成景丰债券型证券投资基金（LOF）、大成价值增长证券投资基金、大成债券投资基金、大成蓝筹稳健证券投资基金、大成精选增值混合型证券投资基金、大成货币市场证券投资基金、大成沪深 300 指数证券投资基金、大成财富管理 2020 生命周期证券投资基金、大成积极成长股票型证券投资基金、大成创新成长混合型证券投资基金（LOF）、大成景阳领先股票型证券投资基金、大成强化收益债券型证券投资基金、大成策略回报股票型证券投资基金、大成行业轮动股票型证券投资基金、大成中证红利指数证券投资基金、大成核心双动力股票型证券投资基金、大成竞争优势股票型证券投资基金、大成内需增长股票型证券投资基金、大成消费主题股票型证券投资基金、大成可转债增强债券型证券投资基金、大成新锐产业股票型证券投资基金、大成景恒保本混合型证券投资基金、大成优选股票型证券投资基金（LOF）、大成现金增利货币市场基金、大成月添利理财债券型证券投资基金、大成理财 21 天债券型发起式基金、大成现金宝场内实时申赎货币市场基金、大成景安短融债券型证券投资基金、大成景兴信用债债券型证券投资基金、大成景旭纯债债券型证券投资基金、大成景祥分级债券型证券投资基金、大成中小盘股票型证券投资基金（LOF）、大成健康产业股票型证券投资基金、大成信用增利一年定期开放债券型证券投资基金、大成灵活配置混合型证券投资基金、大成招财宝货币市场基金、大成景益平稳收益混合型证券投资基金。

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（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
屈伟南先生	本基金基金经理	2013 年 3 月 27 日	-	12 年	工商管理硕士。曾任职于郑州纺织工学院、融通基金管理有限公司。2006 年 3 月加入大成基金管理有限公司，历任基金会计、固定收益研究员、基金经理助理。2013 年 2 月 1 日起任大成理财 21 天债券型发起式证券投资基金基金经理。2013 年 3 月 27 日起任大成现金宝场内实时申赎货币市场基金基金经理。2013 年 11 月 19 日起任大成景祥分级债券型证券投资基金基金经理。2014 年 6 月 18 日起任大成招财宝货币市场基金基金经理。2014 年 7 月 28 日起任大成添利宝货币市场基金基金经理。具有基金从业资格。国籍：中国
黄海峰先生	本基金基金经理助理	2013 年 10 月 14 日	-	10 年	南开大学经济学学士，2004 年 7 月至 2010 年 5 月就职于深圳农村商业银行，任资金部投资经理；2010 年 5 月至 2012 年 10 月就职于博时基金管理有限公司，任交易部交易员；2012 年 7 月至 2013 年 5 月就职于银华

				<p>基金管理有限公司,任固定收益部基金经理助理;2013年7月加入大成基金管理有限公司固定收益部。2013年10月14日起任大成现金宝场内实时申赎货币市场基金基金经理助理。2013年10月28日起大成景恒保本混合型证券投资基金基金经理助理。2014年3月18日起任大成强化收益债券型证券投资基金基金经理助理。2014年3月18日起任大成货币市场证券投资基金基金经理助理。2014年6月23日起任大成招财宝货币市场基金及大成景益平稳收益混合型证券投资基金基金经理助理。具有基金从业资格。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。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

本报告期内,本基金管理人严格遵守《证券法》、《证券投资基金法》、《大成现金宝场内实时申赎货币市场基金基金合同》和其他有关法律法规的规定,在基金管理运作中,大成现金宝场内实时申赎货币市场基金的投资范围、投资比例、投资组合、证券交易行为、信息披露等符合有关法律法规、行业监管规则和基金合同等规定,本基金没有发生重大违法违规行为,没有运用基金财产进行内幕交易和操纵市场行为以及进行有损基金投资人利益的关联交易,整体运作合法、合规。本基金将继续以取信于市场、取信于社会投资公众为宗旨,承诺将一如既往地本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金财产,在规范基金运作和严格控制投资风险的前提下,努力为基金份额持有人谋求最大利益。

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,基金管理人严格执行了公平交易的原则和制度。基金管理人旗下所有投资组合间连续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分析及相应交易情形的分析结果表明:债券交易同向交易频率较低;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组合间的成交价格差异较大。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。

4.3.2 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。2014年上半年公司旗下主动投资组合间股票交易存在11笔同日反向交易,原因是投资组合投资策略需要。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,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%的仅有3笔,原因为投资策略需要;投资组合间存在1笔债券同日反向交易,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 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

2014 年上半年，世界经济继续温和复苏。美国经济活动重新加速，第二季度 GDP 环比折年率增长 4.0%，欧元区经济则继续微弱复苏。我国受房地产开发投资增速放缓，经济增速持续下滑。一、二季度 GDP 增速分别为 7.4%和 7.5%，低于 2013 年的 7.7%。通胀方面，受食品价格影响，上半年 CPI 同比仅为 2.3%。受国内外需求的影响，PPI 上半年同比为-1.8%。因此，从整体宏观环境来看，对债券市场较为有利。在经济持续放缓、企业盈利下滑等背景下，央行态度较去年下半年明显好转。央行通过再贷款、定向降准等定向宽松的方式降低融资成本，同时在公开市场上持续保持净投放。上半年银行间 7 天回购利率均值由去年下半年的 4.36%降至 3.69%，3 月 SHIBOR 回落至 4.75%。各期限收益率亦出现大幅下行，其中 1 年国开债下行 120BP，AAA、AA+、AA 短融均下行 165BP 以上。

由于组合规模波动较大，一季度组合投资为存款为主，同时剩余期限相对较短。二季度，组合作出了较大调整，一方面加大了组合的剩余期限，同时提高了债券的投资比例。在类属配置方面，加大了短融和利率债的配置比例。在短融投资方面，主要以 AAA 和 AA+为主，兼顾了收益的提升和信用风险的防范，取得了较好的效果。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

报告期内本基金 A 类净值收益率为 2.1825%，B 类净值收益率 2.4813%，期间业绩比较基准收益率为 0.1736%。

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，由于主要城市地产销量同比持续大幅下降，发电增速未有明显改善，经济增速难以乐观。目前经济增长虽在“微刺激”政策的带动下呈现出复苏迹象，但这一复苏势头对稳增长政策高度依赖，并面临着来自地产和基数效应的压力，因而并不稳固。去年 3 季度，GDP 增速从去年 2 季度的 7.5%回升至 7.8%。这种基数的上升，会给今年 3 季度的经济和投资同比增速带来向下压力。在总需求回落的背景下，通胀总体不需担忧。在政府要求降低社会融资成本的指导理想下，预计下半年央行仍会保持政策的连续性和稳定性，坚持“总量稳定、结构优化”的取向，保持货币市场稳定。因此，目前短端信用和利率绝对收益率水平虽较年初大幅下行，但仍处历史高位，具有一定的配置价值。但随着经济的进一步下行，对于低评级短融的投资上应谨慎对待。

基于上述分析，2014 年下半年，组合仍将保持长久期的策略，在类属配置方面，我们将密切跟踪市场的变化，在充分做好流动性管理的前提下，继续保持短融的配置比例。同时密切关注同业存款政策的变化和新股发行节奏，力争在保持组合流动性的前提下，提升客户申赎体验，为投资者带来长期稳定的投资收益。

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。估值委员会由股票投资部、研究部、固定收益部、风险管理部、基金运营部、监察稽核部、委托投资部指定人员组成。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两名投资组合经理。

股票投资部、研究部、固定收益部、风险管理部和委托投资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；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，基金经理及投资经理作为估值小组成员，对本基金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，截止报告期末未与外部估值定价服务机构签约。

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，以每百万份基金份额收益为基准，为投资人每日计算收益并分配。本报告期内本基金应分配利润 53,325,253.19 元，报告期内已分配利润 53,325,253.19 元。

§ 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

在托管大成现金宝场内实时申赎货币市场基金的过程中，本基金托管人—中国农业银行股份有限公司严格遵守《证券投资基金法》相关法律法规的规定以及《大成现金宝场内实时申赎货币市场基金基金合同》、《大成现金宝场内实时申赎货币市场基金托管协议》的约定，对大成现金宝场内实时申赎货币市场基金管理人—大成基金管理有限公司 2014 年 1 月 1 日至 2014 年 6 月 30 日基金的投资运作，进行了认真、独立的会计核算和必要的投资监督，认真履行了托管人的义务，没有从事任何损害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

本托管人认为，大成基金管理有限公司在大成现金宝场内实时申赎货币市场基金的投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支及利润分配等问题上，不存在损害基金份额持有人利益的行为；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 托管人对本半年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人认为，大成基金管理有限公司的信息披露事务符合《证券投资基金信息披露管理办法》及其他相关法律法规的规定，基金管理人所编制和披露的大成现金宝场内实时申赎货币市场基金半年度报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告等信息真实、准确、完整，未发现有损害基金持有人利益的行为。

§ 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：大成现金宝场内实时申赎货币市场基金

报告截止日：2014 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2014年6月30日	上年度末 2013年12月31日
资产：			
银行存款	6.4.3.1	1,289,883,607.22	1,258,207,782.51
结算备付金		33,801,313.40	11,249,845.15
存出保证金		-	-
交易性金融资产	6.4.3.2	1,680,832,901.48	389,983,400.46
其中：股票投资		-	-
基金投资		-	-
债券投资		1,680,832,901.48	389,983,400.46
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	6.4.3.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.3.4	1,057,103,932.60	898,100,462.15
应收证券清算款		200,036,968.04	-
应收利息	6.4.3.5	23,176,643.80	11,884,305.63
应收股利		-	-
应收申购款		260,213,112.38	512,261,965.60
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.3.6	-	10,267.62
资产总计		4,545,048,478.92	3,081,698,029.12
负债和所有者权益	附注号	本期末 2014年6月30日	上年度末 2013年12月31日
负债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.3.3	-	-
卖出回购金融资产款		559,799,400.10	146,804,486.60
应付证券清算款		-	270,000,000.00
应付赎回款		397,073,316.41	29,452,992.13
应付管理人报酬		707,460.41	261,338.15
应付托管费		209,617.90	77,433.53
应付销售服务费		353,075.78	142,065.41
应付交易费用	6.4.3.7	61,842.94	18,047.69
应交税费		-	-
应付利息		45,331.95	12,762.30
应付利润		432,594.14	318,787.99
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.3.8	691,802.92	254,927.62
负债合计		959,374,442.55	447,342,841.42
所有者权益：			
实收基金	6.4.3.9	3,585,674,036.37	2,634,355,187.70
未分配利润	6.4.3.10	-	-

所有者权益合计		3,585,674,036.37	2,634,355,187.70
负债和所有者权益总计		4,545,048,478.92	3,081,698,029.12

注:报告截止日 2014 年 6 月 30 日, A 级基金份额净值 0.01 元, 基金份额总额 210,489,964,679.00 份; B 级基金份额净值 0.01 元, 基金份额总额 148,077,438,958.00 份。基金份额总额 358,567,403,637.00 份。

6.2 利润表

会计主体:大成现金宝场内实时申赎货币市场基金

本报告期:2014 年 1 月 1 日至 2014 年 6 月 30 日

单位:人民币元

项目	附注号	本期 2014 年 1 月 1 日至 2014 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2013 年 3 月 27 日(基金 合同生效日)至 2013 年 6 月 30 日
一、收入		64,967,077.28	17,787,086.50
1. 利息收入		62,722,430.03	18,345,713.89
其中:存款利息收入	6.4.3.11	32,354,159.29	14,601,892.24
债券利息收入		20,203,375.98	2,783,117.72
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		10,164,894.76	960,703.93
其他利息收入		-	-
2. 投资收益(损失以“-”填列)		2,244,647.25	-558,627.39
其中:股票投资收益	6.4.3.12	-	-
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.3.13	2,244,647.25	-558,627.39
资产支持证券投资收益	6.4.3.13.1	-	-
贵金属投资收益	6.4.3.13.2	-	-
衍生工具收益	6.4.3.14	-	-
股利收益	6.4.3.15	-	-
3. 公允价值变动收益(损失以“-”号填列)	6.4.3.16	-	-
4. 汇兑收益(损失以“-”号填列)		-	-
5. 其他收入(损失以“-”号填列)	6.4.3.17	-	-
减:二、费用		11,641,824.09	3,471,280.48
1. 管理人报酬	6.4.6.2.1	3,229,681.98	1,133,650.48
2. 托管费	6.4.6.2.2	956,942.74	335,896.49
3. 销售服务费	6.4.6.2.3	1,686,460.99	449,951.71
4. 交易费用	6.4.3.18	-	-
5. 利息支出		3,228,389.85	841,629.57
其中:卖出回购金融资产支出		3,228,389.85	841,629.57
6. 其他费用	6.4.3.19	2,540,348.53	710,152.23
三、利润总额(亏损总额以“-”		53,325,253.19	14,315,806.02

号填列)			
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		53,325,253.19	14,315,806.02

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：大成现金宝场内实时申赎货币市场基金

本报告期：2014 年 1 月 1 日至 2014 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2014 年 1 月 1 日至 2014 年 6 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	2,634,355,187.70	-	2,634,355,187.70
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	53,325,253.19	53,325,253.19
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	951,318,848.67	-	951,318,848.67
其中：1. 基金申购款	34,317,228,884.13	-	34,317,228,884.13
2. 基金赎回款	-33,365,910,035.46	-	-33,365,910,035.46
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-53,325,253.19	-53,325,253.19
五、期末所有者权益（基金净值）	3,585,674,036.37	-	3,585,674,036.37
项目	上年度可比期间 2013 年 3 月 27 日（基金合同生效日）至 2013 年 6 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	1,219,724,388.00	-	1,219,724,388.00
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	14,315,806.02	14,315,806.02
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数	1,106,267,234.37	-	1,106,267,234.37

(净值减少以“-”号填列)			
其中：1. 基金申购款	12,018,885,317.68	-	12,018,885,317.68
2. 基金赎回款	-10,912,618,083.31	-	-10,912,618,083.31
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-14,315,806.02	-14,315,806.02
五、期末所有者权益（基金净值）	2,325,991,622.37	-	2,325,991,622.37

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：

张树忠 刘彩晖 范瑛
 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 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。

6.4.2 税项

6.4.2.1 营业税、企业所得税

根据财政部、国家税务总局财税字[2004]78号文《关于证券投资基金税收政策的通知》的规定，自2004年1月1日起，对证券投资基金（封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金）管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入，继续免征营业税和企业所得税；

根据财政部、国家税务总局财税[2008]1号文《关于企业所得税若干优惠政策的通知》的规定，对证券投资基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股权的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

6.4.2.2 个人所得税

根据财政部、国家税务总局财税字[2002]128号文《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》，对基金取得的股票的股息、红利及债券的利息等收入，由上市公司、债券发行企业等在向基金派发时代扣代缴20%的个人所得税。

根据财政部、国家税务总局财税[2008]132号《财政部国家税务总局关于储蓄存款利息所得有关个人所得税政策的通知》，自2008年10月9日起暂免征收储蓄存款利息所得个人所得税。

6.4.3 重要财务报表项目的说明

6.4.3.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2014年6月30日
活期存款	14,883,607.22

定期存款	-
其中：存款期限 1-3 个月	-
其他存款	1,275,000,000.00
合计：	1,289,883,607.22

注：1、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。

2、本基金于本会计期间未投资于定期存款。

6.4.3.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末 2014 年 6 月 30 日			
		摊余成本	影子定价	偏离金额	偏离度
债券	交易所市场	-	-	-	0.0000%
	银行间市场	1,680,832,901.48	1,687,103,000.00	6,270,098.52	0.1749%
	合计	1,680,832,901.48	1,687,103,000.00	6,270,098.52	0.1749%

注：偏离金额=影子定价-摊余成本；偏离度=偏离金额/基金资产净值。

6.4.3.3 衍生金融资产/负债

本基金于本报告期末未持有衍生金融资产/负债。

6.4.3.4 买入返售金融资产

6.4.3.4.1 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 2014 年 6 月 30 日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
买入返售证券	168,700,000.00	-
买入返售证券_银行间	888,403,932.60	-
合计	1,057,103,932.60	-

6.4.3.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2014 年 6 月 30 日
应收活期存款利息	7,138.88
应收定期存款利息	-
应收其他存款利息	4,150,240.92
应收结算备付金利息	15,210.60

应收债券利息	17,950,914.33
应收买入返售证券利息	1,053,139.07
应收申购款利息	-
应收黄金合约拆借孳息	-
其他	-
合计	23,176,643.80

6.4.3.6 其他资产

本基金本报告期末未持有其他资产。

6.4.3.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2014年6月30日
交易所市场应付交易费用	-
银行间市场应付交易费用	61,842.94
合计	61,842.94

6.4.3.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2014年6月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	-
划款手续费	5,012.50
应付其他	32,644.45
应付增值服务费	476,690.63
预提费用	177,455.34
合计	691,802.92

6.4.3.9 实收基金

金额单位：人民币元

现金宝 A		
项目	本期 2014年1月1日至2014年6月30日	
	基金份额(份)	账面金额
上年度末	104,280,459,904.00	1,042,804,599.04
本期申购	2,389,324,062,767.00	23,893,240,627.67
本期赎回(以“-”号填列)	-2,283,114,557,992.00	-22,831,145,579.92
本期末	210,489,964,679.00	2,104,899,646.79

金额单位：人民币元

现金宝 B		
项目	本期 2014 年 1 月 1 日至 2014 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	159,155,058,866.00	1,591,550,588.66
本期申购	1,042,398,825,646.00	10,423,988,256.46
本期赎回(以“-”号填列)	-1,053,476,445,554.00	-10,534,764,455.54
本期末	148,077,438,958.00	1,480,774,389.58

注：本期申购包含红利再投资，分级调整的基金份额和金额；本期赎回包含分级调整的基金份额和金额。

6.4.3.10 未分配利润

单位：人民币元

现金宝 A			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-	-	-
本期利润	27,272,719.08	-	27,272,719.08
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	-27,272,719.08	-	-27,272,719.08
本期末	-	-	-

单位：人民币元

现金宝 B			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-	-	-
本期利润	26,052,534.11	-	26,052,534.11
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	-26,052,534.11	-	-26,052,534.11
本期末	-	-	-

注：本基金基金份额净值保持为 0.01 元，根据每日基金收益情况，以基金净收益为基准，为投资人每日计算当日收益并全部分配。

6.4.3.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2014 年 1 月 1 日至 2014 年 6 月 30 日
	活期存款利息收入

定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	-
结算备付金利息收入	291,988.23
其他	31,849,369.41
合计	32,354,159.29

注：其他存款利息收入为根据协议可提前支取且没有利息损失的协议存款产生的利息收入。

6.4.3.12 股票投资收益

本报告期内本基金无股票投资收益。

6.4.3.13 债券投资收益

单位：人民币元

项目	本期
	2014年1月1日至2014年6月30日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	2,058,963,839.14
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	2,031,765,914.39
减：应收利息总额	24,953,277.50
债券投资收益	2,244,647.25

6.4.3.13.1 资产支持证券投资收益

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

6.4.3.13.2 贵金属投资收益

本报告期内本基金无贵金属投资收益。

6.4.3.14 衍生工具收益

本报告期内本基金无衍生工具收益。

6.4.3.15 股利收益

本报告期内本基金无股利收益。

6.4.3.16 公允价值变动收益

本报告期内本基金无公允价值变动收益。

6.4.3.17 其他收入

本报告期内本基金无其他收入。

6.4.3.18 交易费用

本报告期内本基金无交易费用。

6.4.3.19 其他费用

单位：人民币元

项目	本期
----	----

	2014 年 1 月 1 日至 2014 年 6 月 30 日
审计费用	19,835.79
信息披露费	148,765.71
其他	300.00
上清所债券托管帐户维护费	8,926.92
银行汇划手续费	68,613.57
增值服务费 519898	2,284,979.62
中债登债券托管帐户维护费	8,926.92
合计	2,540,348.53

6.4.3.20 分部报告

截至本期末，本基金仅在中国大陆境内从事证券投资单一业务，因此，无需作披露的分部报告。

6.4.4 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.4.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的重大或有事项。

6.4.4.2 资产负债表日后事项

截至本会计报表批准报出日，本基金无需作披露的资产负债表日后事项。

6.4.5 关联方关系

6.4.5.1 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。

6.4.5.2 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
中国农业银行股份有限公司(“中国农业银行”)	基金托管人
中泰信托有限责任公司	基金管理人的股东
光大证券股份有限公司(“光大证券”)	基金管理人的股东、基金代销机构
中国银河投资管理有限公司	基金管理人的股东
广东证券股份有限公司(“广东证券”)	基金管理人的股东
大成国际资产管理有限公司(“大成国际”)	基金管理人的子公司
大成创新资本管理有限公司(“大成创新资本”)	基金管理人的全资子公司

注：1、中国证监会于 2005 年 11 月 6 日作出对广东证券取消业务许可并责令关闭的行政处罚。

2、以下关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.6 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.6.1 通过关联方交易单元进行的交易

本基金本期内未发生通过关联方交易单元进行的交易。

6.4.6.2 关联方报酬

6.4.6.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2014 年 1 月 1 日至 2014 年 6 月 30 日	2013 年 3 月 27 日(基金合同生效日)至 2013 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	3,229,681.98	1,133,650.48
其中：支付销售机构的客户维护费	1,131,064.57	350,912.80

注：在通常情况下，基金管理费按前一日基金资产净值的 0.27% 年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times \text{年管理费率} \div \text{当年天数}$$
，本基金年管理费率为 0.27%

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日基金资产净值

基金管理费每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付。由基金管理人向基金托管人发送基金管理费划付指令，经基金托管人复核后于次月首日起 3 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。

6.4.6.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2014 年 1 月 1 日至 2014 年 6 月 30 日	2013 年 3 月 27 日(基金合同生效日)至 2013 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	956,942.74	335,896.49

注：在通常情况下，基金托管费按前一日基金资产净值的 0.08% 年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times \text{年托管费率} \div \text{当年天数}$$
，本基金年托管费率为 0.08%

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日基金资产净值

基金托管费每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付。由基金管理人向基金托管人发送基金托管费划付指令，经基金托管人复核后于次月首日起 3 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金托管人。

6.4.6.2.3 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		
	2014 年 1 月 1 日至 2014 年 6 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	现金宝 A	现金宝 B	合计
光大证券	61,422.58	766.43	62,189.01
合计	61,422.58	766.43	62,189.01
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间		
	2013 年 3 月 27 日(基金合同生效日)至 2013 年 6 月 30 日		

	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	现金宝 A	现金宝 B	合计
光大证券	19,392.98	192.80	19,585.78
合计	19,392.98	192.80	19,585.78

注：1、本基金 A 类基金份额的销售服务费年费率为 0.25%，对于由 B 类降级为 A 类的基金份额持有人，基金年销售服务费率应自其达到 A 类条件的开放日当日起适用 A 类基金份额持有人的费率。本基金 B 类基金份额的销售服务费年费率为 0.01%，对于由 A 类升级为 B 类的基金份额持有人，基金年销售服务费率应自其达到 B 类条件的开放日当日起适用 B 类基金份额持有人的费率。

各类基金份额的销售服务费计提的计算公式如下：

$$H = E \times R \div \text{当年天数}$$

H 为每日该类基金份额应计提的基金销售服务费

E 为前一日该类基金份额的基金资产净值

R 为该类基金份额的年销售服务费率

基金销售服务费每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金管理人向基金托管人发送销售服务费划款指令，基金托管人复核后于次月首日起 3 个工作日内从基金财产中一次性划付给基金管理人，由基金管理人代收，基金管理人收到后支付给销售机构。

销售服务费主要用于支付销售机构佣金、以及基金管理人的基金营销广告费、促销活动费、持有人服务费等。

2、根据基金合同，对于本基金 A 类基金份额，每日应收取的增值服务费以 0.35% 的年费率，按其持有的前一日基金资产净值进行计算。本基金本报告期发生的应支付本基金管理人股东“光大证券”的 A 类基金份额增值服务费为 85,991.70 元。

6.4.6.3 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

本期 2014 年 1 月 1 日至 2014 年 6 月 30 日						
银行间市场交易的 各关联方名称	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
中国农业银行	-	-	-	-	207,020,000.00	17,011.45
上年度可比期间 2013 年 3 月 27 日(基金合同生效日)至 2013 年 6 月 30 日						
银行间市场交易的 各关联方名称	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
中国农业银行	-	-	-	-	-	-

6.4.6.4 各关联方投资本基金的情况

6.4.6.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

报告期内基金管理人未运用固有资金投资本基金。

6.4.6.4.2 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

报告期末除基金管理人之外的其他关联方未持有本基金。

6.4.6.5 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 2014年1月1日至2014年6月30日		上年度可比期间 2013年3月27日(基金合同生效日)至 2013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
中国农业银行	14,883,607.22	212,801.65	114,939,416.93	484,910.52

注：本基金的银行存款由基金托管人中国农业银行保管，并按银行间同业利率计息。

6.4.6.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本报告期内本基金未在承销期内参与关联方承销证券。

6.4.6.7 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。

6.4.7 利润分配情况**6.4.7.1 利润分配情况——货币市场基金**

金额单位：人民币元

现金宝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
27,150,994.37	-	121,724.71	27,272,719.08	-

现金宝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
26,060,452.67	-	-7,918.56	26,052,534.11	-

6.4.8 期末（2014年6月30日）本基金持有的流通受限证券**6.4.8.1 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。

6.4.8.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金本报告期末未持有暂时停牌等流通受限的股票。

6.4.8.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券**6.4.8.3.1 银行间市场债券正回购**

截止本报告期末2014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 559,799,400.10 元，是以如下债券作为质押：

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
130212	13 国开 12	2014 年 7 月 1 日	98.38	200,000	19,676,230.44
140212	14 国开 12	2014 年 7 月 1 日	99.97	400,000	39,986,078.45
100236	10 国开 36	2014 年 7 月 1 日	100.00	500,000	50,002,311.28
140207	14 国开 07	2014 年 7 月 1 日	100.14	1,500,000	150,210,237.35
140204	14 国开 04	2014 年 7 月 1 日	100.08	2,000,000	200,168,481.64
011490002	14 苏交通 SCP002	2014 年 7 月 1 日	100.04	1,000,000	100,040,500.51
合计				5,600,000	560,083,839.67

6.4.8.3.2 交易所市场债券正回购

截至本期末 2014 年 6 月 30 日止，本基金未持有从事交易所市场债券正回购交易中作为抵押的债券。

6.4.9 金融工具风险及管理

6.4.9.1 风险管理政策和组织架构

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（董事会合规审计和风险控制委员会、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审计和风险控制委员会，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。

6.4.9.2 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，导致基金资产损失和收益变化的风险。本基金均投资于具有良好信用等级的债券，包括国债、央行票据、政策性金融债等，且通过分散化投资以分散信用风险。

本基金在交易所进行的交易均与中国证券登记结算有限责任公司完成证券交收和款项清算，因此违约风险发生的可能性很小；基金在进行银行间同业市场交易前均对交易对手进行信用评估，以控制相应的信用风险。

于 2014 年 6 月 30 日，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 32.64%。

6.4.9.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2014 年 6 月 30 日	上年度末 2013 年 12 月 31 日
A-1	850,331,278.68	250,273,737.23
A-1 以下	-	29,995,733.45
未评级	830,501,622.80	109,713,929.78
合计	1,680,832,901.48	389,983,400.46

6.4.9.2.2 按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2014 年 6 月 30 日	本期末 2013 年 12 月 31 日
AAA	-	-
AAA 以下	-	-
未评级	-	-
合计	-	-

注：上述债券信用未评级包括央行票据、国债及政策性金融债。

6.4.9.3 流动性风险

流动性风险是指基金所持金融工具变现的难易程度。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。

本基金所持大部分证券为剩余期限较短、信誉良好的国债、央行票据、政策性金融债及企业短期融资券等，除在证券交易所的债券回购交易，其余均在银行间同业市场交易，能及时变现。此外，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，卖出回购的资金余额在每个交易日一般均不超过基金资产净值的 20%。一般地，本基金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不计息，可赎回基金份额净值(所有者权益)无固定到期日且不计息，因此账面余额即为未折现的合约到期现金流量。

本基金管理人每日预测本基金的流动性需求，并同时通过独立的风险管理部门设定流动性比例要求，对流动性指标进行持续的监测和分析。

6.4.9.4 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。

6.4.9.4.1 利率风险

利率风险是指基金的财务状况和现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。本基金主要投资于银行间市场交易的固定收益品种，以摊余成本计价，并通过“影子定价”机制使按摊余成本确认的基金资产净值能近似反映基金资产的公允价值，因此本基金的运作仍然存在相应的利率风险。本基金管理人每日对本基金面临的利率敏感度缺口进行监控。

下表统计了本基金的利率风险敞口。表中所示为本基金资产及负债的公允价值，并按照合约

规定的重新定价日或到期日孰早者进行了分类。

6.4.9.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2014年6月 30日	1个月以内	1-3个月	3个月-1年	1-5 年	5年 以上	不计息	合计
资产							
银行存款	1,109,883,607.22	120,000,000.00	60,000,000.00	-	-	-	1,289,883,607.22
结算备付 金	33,801,313.40	-	-	-	-	-	33,801,313.40
交易性金 融资产	-	-189,951,111.53	1,490,881,789.95	-	-	-	1,680,832,901.48
买入返售 金融资产	1,057,103,932.60	-	-	-	-	-	1,057,103,932.60
应收证券 清算款	-	-	-	-	-	-200,036,968.04	200,036,968.04
应收利息	-	-	-	-	-	23,176,643.80	23,176,643.80
应收申购 款	-	-	-	-	-	-260,213,112.38	260,213,112.38
其他资产	-	-	-	-	-	-	-
资产总计	2,200,788,853.22	309,951,111.53	1,550,881,789.95	-	-	-483,426,724.22	4,545,048,478.92
负债							
卖出回购 金融资产 款	559,799,400.10	-	-	-	-	-	559,799,400.10
应付赎回 款	-	-	-	-	-	-397,073,316.41	397,073,316.41
应付管理 人报酬	-	-	-	-	-	707,460.41	707,460.41
应付托管 费	-	-	-	-	-	209,617.90	209,617.90
应付销售 服务费	-	-	-	-	-	353,075.78	353,075.78
应付交易 费用	-	-	-	-	-	61,842.94	61,842.94
应付利息	-	-	-	-	-	45,331.95	45,331.95
应付利润	-	-	-	-	-	432,594.14	432,594.14
其他负债	-	-	-	-	-	691,802.92	691,802.92
负债总计	559,799,400.10	-	-	-	-	-399,575,042.45	959,374,442.55
利率敏感 度缺口	1,640,989,453.12	309,951,111.53	1,550,881,789.95	-	-	-83,851,681.77	3,585,674,036.37
上年度末 2013年12	1个月以内	1-3个月	3个月-1年	1-5 年	5年 以上	不计息	合计

月 31 日							
资产							
银行存款	1,205,207,782.51	53,000,000.00	-	-	-	-	1,258,207,782.51
结算备付金	11,249,845.15	-	-	-	-	-	11,249,845.15
交易性金融资产	200,335,879.26	59,992,734.67	129,654,786.53	-	-	-	389,983,400.46
买入返售金融资产	898,100,462.15	-	-	-	-	-	898,100,462.15
应收利息	-	-	-	-	-	11,884,305.63	11,884,305.63
应收申购款	-	-	-	-	-	512,261,965.60	512,261,965.60
其他资产	-	-	-	-	-	10,267.62	10,267.62
资产总计	2,314,893,969.07	112,992,734.67	129,654,786.53	-	-	524,156,538.85	3,081,698,029.12
负债							
卖出回购金融资产款	146,804,486.60	-	-	-	-	-	146,804,486.60
应付证券清算款	-	-	-	-	-	270,000,000.00	270,000,000.00
应付赎回款	-	-	-	-	-	29,452,992.13	29,452,992.13
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	261,338.15	261,338.15
应付托管费	-	-	-	-	-	77,433.53	77,433.53
应付销售服务费	-	-	-	-	-	142,065.41	142,065.41
应付交易费用	-	-	-	-	-	18,047.69	18,047.69
应付利息	-	-	-	-	-	12,762.30	12,762.30
应付利润	-	-	-	-	-	318,787.99	318,787.99
其他负债	-	-	-	-	-	254,927.62	254,927.62
负债总计	146,804,486.60	-	-	-	-	300,538,354.82	447,342,841.42
利率敏感度缺口	2,168,089,482.47	112,992,734.67	129,654,786.53	-	-	-223,618,184.03	2,634,355,187.70

6.4.9.4.1.2 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	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的 影响金额（单位：人民币元）
		本期末（2014年6月30日） 上年度末（2013年12月31日）

			日)
	利率上升 25 个基点	-2,722,440.48	-246,148.60
	利率下降 25 个基点	2,732,271.06	246,945.35

注：该表为利率风险的敏感性分析，反映了在其他变量不变的假设下，利率发生合理、可能的变动时，为交易而持有的债券公允价值的变动将对基金资产净值产生的影响。正数表示可能增加基金资产净值，负数表示可能减少基金资产净值。

6.4.9.4.2 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。本基金持有的金融工具以人民币计价，因此无重大外汇风险。

6.4.9.4.3 其他价格风险

市场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。本基金主要投资于银行间同业市场交易的固定收益品种，且以摊余成本进行后续计量，因此无重大市场价格风险。

6.4.10 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	1,680,832,901.48	36.98
	其中：债券	1,680,832,901.48	36.98
	资产支持证券	-	0.00
2	买入返售金融资产	1,057,103,932.60	23.26
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	0.00
3	银行存款和结算备付金合计	1,323,684,920.62	29.12
4	其他各项资产	483,426,724.22	10.64
5	合计	4,545,048,478.92	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	9.10	
	其中：买断式回购融资	0.00	
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	559,799,400.10	15.61
	其中：买断式回购融资	-	0.00

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

本报告期内未出现债券正回购资金余额超过基金资产净值 20% 的情况。

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	108
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	17

报告期内投资组合平均剩余期限超过 180 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	66.96	15.61
	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	2.22	0.00
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	0.55	0.00
3	60 天(含)—90 天	6.42	0.00
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	2.24	0.00
4	90 天(含)—180 天	2.51	0.00
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	0.00	0.00
5	180 天(含)—397 天(含)	40.74	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	118.85	15.61

7.4 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	摊余成本	占基金资产净值比例 (%)
1	国家债券	-	0.00
2	央行票据	-	0.00
3	金融债券	510,330,298.96	14.23
	其中：政策性金融债	510,330,298.96	14.23
4	企业债券	-	0.00
5	企业短期融资券	1,170,502,602.52	32.64
6	中期票据	-	0.00
7	其他	-	0.00
8	合计	1,680,832,901.48	46.88
9	剩余存续期超过 397 天的浮动利率债券	99,972,462.29	2.79

7.5 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

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	债券数量(张)	摊余成本	占基金资产净值比例 (%)
1	140204	14 国开 04	2,000,000	200,168,481.64	5.58
2	140207	14 国开 07	1,500,000	150,210,237.35	4.19
3	011490002	14 苏交通 SCP002	1,000,000	100,040,500.51	2.79
4	041464038	14 津地铁 CP001	1,000,000	100,033,895.13	2.79
5	011420005	14 中铝 SCP005	800,000	80,119,801.90	2.23
6	041456027	14 开滦 CP001	800,000	80,013,829.57	2.23
7	140212	14 国开 12	600,000	59,979,117.68	1.67
8	041452020	14 南方水 泥 CP002	500,000	50,097,025.22	1.40
9	041464036	14 张资产 CP001	500,000	50,004,380.99	1.39
10	100236	10 国开 36	500,000	50,002,311.28	1.39

7.6 “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	-
报告期内偏离度的最高值	0.2421%
报告期内偏离度的最低值	0.0254%

报告期内每个交易日偏离度的绝对值的简单平均值	0.1381%
------------------------	---------

7.7 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明细

本报告期末未持有资产支持证券。

7.8 投资组合报告附注

7.8.1 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 0.01 元。

7.8.2 本报告期内不存在基金持有剩余期限小于 397 天但剩余存续期超过 397 天的浮动利率债券的摊余成本超过当日基金资产净值的 20%的情况。

7.8.3 本基金投资的前十名证券的发行主体未出现本期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。

7.8.4 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	应收证券清算款	200,036,968.04
3	应收利息	23,176,643.80
4	应收申购款	260,213,112.38
5	其他应收款	-
6	待摊费用	-
7	其他	-
8	合计	483,426,724.22

7.8.5 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)	户均持有的基金份额	持有人结构			
			机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例
现金宝 A	32,436	6,489,393.41	4,422,434,204.00	2.10%	206,067,530,475.00	97.90%

现金宝 B	107	1,383,901,298.67	56,511,046,096.00	38.16%	91,566,392,862.00	61.84%
合计	32,543	11,018,265.18	60,933,480,300.00	16.99%	297,633,923,337.00	83.01%

注：1、下属分级基金份额比例的分母采用各自级别的份额，合计数比例的分母采用各分级基金份额的合计数。

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	现金宝 A	-	0.00
	现金宝 B	-	0.00
	合计	-	0.00

8.3 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

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	现金宝 A	-
	现金宝 B	-
	合计	-
本基金基金经理持有本开放式基金	现金宝 A	-
	现金宝 B	-
	合计	-

§9 开放式基金份额变动

单位：份

	现金宝 A	现金宝 B
基金合同生效日（2013 年 3 月 27 日）基金份额总额	53,299,270,100.00	68,673,168,700.00
本报告期期初基金份额总额	104,280,459,904.00	159,155,058,866.00
本报告期基金总申购份额	2,389,324,062,767.00	1,042,398,825,646.00
减：本报告期基金总赎回份额	2,283,114,557,992.00	1,053,476,445,554.00
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	210,489,964,679.00	148,077,438,958.00

注：基金合同生效日为 2013 年 3 月 27 日，红利再投资作为本期申购资金的来源，统一计入本期总申购份额，不单独列示。

依据《大成现金宝场内实时申赎货币市场基金招募说明书》规定，本基金分设两级基金份额，

A 级基金份额和 B 级基金份额。A 级基金份额针对在单个基金账户保留份额在 30000 万以下的持有人，B 级基金份额针对在单个基金账户保留份额在 30000 万以上(含 30000 万)的持有人。若 A 级基金份额持有人在单个基金账户保留的基金份额超过 30000 万份时，本基金的注册登记机构自动将其在该基金账户持有的 A 级基金份额升级为 B 级基金份额；若 B 级基金份额持有人在单个基金账户保留的基金份额低于 30000 万份时，本基金的注册登记机构自动将其在该基金账户持有的 B 级基金份额转为 A 级基金份额。上述申购赎回份额中包含了 A 级与 B 级之间调增和调减份额。

§ 10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

报告期内无基金份额持有人大会决议。

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

本报告期内，基金管理人于 2014 年 1 月 25 日发布了《大成基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告》，经大成基金管理有限公司第五届董事会第二十八次会议审议通过，王颢先生不再担任大成基金管理有限公司总经理，由董事长张树忠先生代任公司总经理。

本报告期内，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

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无重大改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

基金聘任的为本基金审计的会计师事务所为安永华明会计师事务所(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

本报告期，本基金管理人、托管人及高级管理人员未受到监管部门稽查或处罚。

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	
安信证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
长城证券	2	-	0.00%	-	0.00%	-
东北证券	2	-	0.00%	-	0.00%	-
东兴证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
方正证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-

高华证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
光大证券	2	-	0.00%	-	0.00%	-
广发证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
国金证券	2	-	0.00%	-	0.00%	-
国盛证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
国泰君安	2	-	0.00%	-	0.00%	-
国信证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
海通证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
红塔证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
宏源证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
华创证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
华泰证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
民生证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
南京证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
平安证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
齐鲁证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
瑞银证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
上海证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
申银万国	1	-	0.00%	-	0.00%	-
世纪证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
天风证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
西部证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
兴业证券	2	-	0.00%	-	0.00%	-
银河证券	4	-	0.00%	-	0.00%	-
英大证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
招商证券	2	-	0.00%	-	0.00%	-
浙商证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
中金公司	2	-	0.00%	-	0.00%	-
中信建投	3	-	0.00%	-	0.00%	-
中信证券	2	-	0.00%	-	0.00%	-
中银国际	2	-	0.00%	-	0.00%	-

注：根据中国证监会颁布的《关于完善证券投资基金交易席位制度有关问题的通知》（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的选择标准和程序。

租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) 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：招商证券；新增交易单元：无。

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
招商证券	-	0.00%	953,700,000.00	100.00%	-	0.00%

10.8 偏离度绝对值超过 0.5% 的情况

本基金本报告期内无偏离度绝对值超过 0.5% 的情况。

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	大成现金宝场内实时申赎货币市场基金 2013 年第 4 季度报告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2014/1/22
2	大成基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2014/1/25
3	关于大成基金管理有限公司北京理财中心办公地址变更的公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2014/3/19
4	大成现金宝场内实时申赎货币市场基金 2013 年年度报告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2014/3/29
5	大成现金宝场内实时申赎货币市场基金 2013 年年度报告摘要	中国证监会指定报刊及本公司网站	2014/3/29
6	大成基金管理有限公司关于调整网上直销系统中定期定额投资起点金额的公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2014/4/8
7	大成基金管理有限公司董事、监事、高级管理人员以及其他从业人员在子公司兼任职务及领薪情况的公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2014/4/11
8	大成现金宝场内实时申赎货币市场基金 2014 年第 1 季度报告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2014/4/21
9	大成现金宝场内实时申赎货币市场基金更新招募说明书（2014 年第 1 期）	中国证监会指定报刊及本公司网站	2014/5/9
10	大成现金宝场内实时申赎货币市场基金更新招募说明书摘要（2014 年第 1 期）	中国证监会指定报刊及本公司网站	2014/5/9
11	大成基金管理有限公司关于调整旗下开放式基	中国证监会指定报	2014/6/30

金基金转换业务规则的公告

刊及本公司网站

§ 11 影响投资者决策的其他重要信息

本基金本报告期无影响投资者决策的其他重要信息。

§ 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现金宝场内实时申赎货币市场基金的文件；
- 2、《大成现金宝场内实时申赎货币市场基金基金合同》；
- 3、《大成现金宝场内实时申赎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。

12.2 存放地点

本报告存放在本基金管理人和托管人的办公住所。

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
2014 年 8 月 28 日