

大成现金增利货币市场基金  
2014 年年度报告摘要  
2014 年 12 月 31 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：2015 年 3 月 28 日

## § 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 2015 年 3 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。

本年度报告摘要摘自年度报告正文，投资者欲了解详细内容，应阅读年度报告正文。

本报告中财务资料已经审计。安永华明会计师事务所(特殊普通合伙)为本基金出具了无保留意见的审计报告，请投资者注意阅读。

本报告期自 2014 年 01 月 01 日起至 12 月 31 日止。

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

|                 |                    |                  |
|-----------------|--------------------|------------------|
| 基金简称            | 大成现金增利货币           |                  |
| 基金主代码           | 090022             |                  |
| 交易代码            | 090022             |                  |
| 基金运作方式          | 契约型开放式             |                  |
| 基金合同生效日         | 2012 年 11 月 20 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      | 4,989,619,172.03 份 |                  |
| 基金合同存续期         | 不定期                |                  |
| 下属分级基金的基金简称:    | 大成现金增利货币 A         | 大成现金增利货币 B       |
| 下属分级基金的交易代码:    | 090022             | 091022           |
| 报告期末下属分级基金的份额总额 | 4,244,259,865.30 份 | 745,359,306.73 份 |

### 2.2 基金产品说明

|        |   |
|--------|---|
| 投资目标   | 在保持资产的低风险和高流动性的前提下，争取获得超过基金业绩比较基准的收益率。  |
| 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 | 银行活期存款利率  |
| 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                   |
|         | 联系电话          | 0755-83183388        |
|         | 电子邮箱          | dupeng@dcfund.com.cn |
| 客户服务电话  | 4008885558    | 95599                |
| 传真      | 0755-83199588 | 010-68121816         |

### 2.4 信息披露方式

|                     |   |
|---------------------|---|
| 登载基金年度报告正文的管理人互联网网址 | <a href="http://www.dcfund.com.cn">http://www.dcfund.com.cn</a>                         |
| 基金年度报告备置地点          | 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 |

## § 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

## 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 | 2014 年           |                | 2013 年           |                  | 2012 年 11 月 20 日(基金合同生效日)-<br>2012 年 12 月 31 日 |                  |
|---------------|------------------|----------------|------------------|------------------|--|------------------|
|               | 大成现金增利货币 A       | 大成现金增利货币 B     | 大成现金增利货币 A       | 大成现金增利货币 B       | 大成现金增利货币 A                                     | 大成现金增利货币 B       |
| 本期已实现收益       | 128,608,158.61   | 66,466,570.87  | 16,187,504.07    | 26,119,895.71    | 7,941,067.17                                   | 10,277,276.52    |
| 本期利润          | 128,608,158.61   | 66,466,570.87  | 16,187,504.07    | 26,119,895.71    | 7,941,067.17                                   | 10,277,276.52    |
| 本期净值收益率       | 4.6485%          | 4.9000%        | 3.9420%          | 4.1920%          | 0.3868%  | 0.4140%          |
| 3.1.2 期末数据和指标 | 2014 年末          |                | 2013 年末          |                  | 2012 年末  |                  |
| 期末基金资产净值      | 4,244,259,865.30 | 745,359,306.73 | 2,025,675,070.92 | 4,475,995,430.10 | 2,044,607,033.05                               | 5,796,197,224.03 |
| 期末基金份额净值      | 1.0000           | 1.0000         | 1.0000           | 1.0000           | 1.0000   | 1.0000           |
| 3.1.3 累计期末指标  | 2014 年末          |                | 2013 年末          |                  | 2012 年末  |                  |
| 累计净值收益率       | 9.1944%          | 9.7499%        | 4.3440%          | 4.6233%          | 0.3868%  | 0.4140%          |

注：1、本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益，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。

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

大成现金增利货币 A

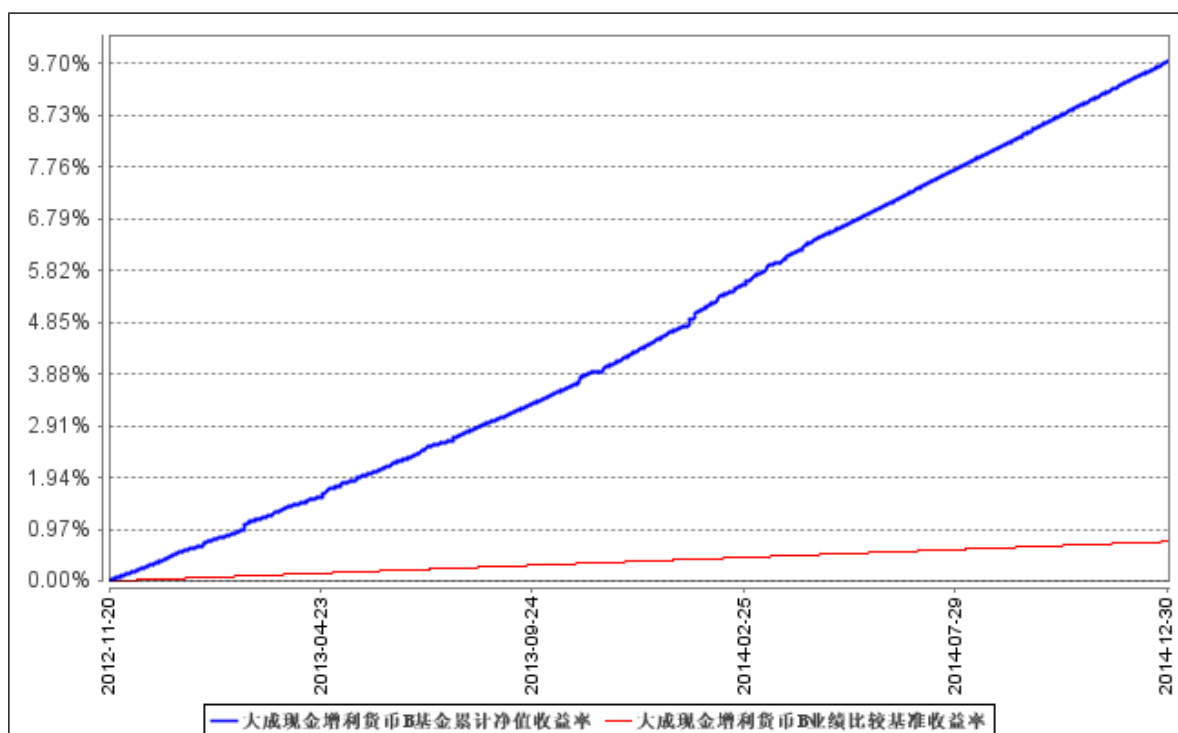
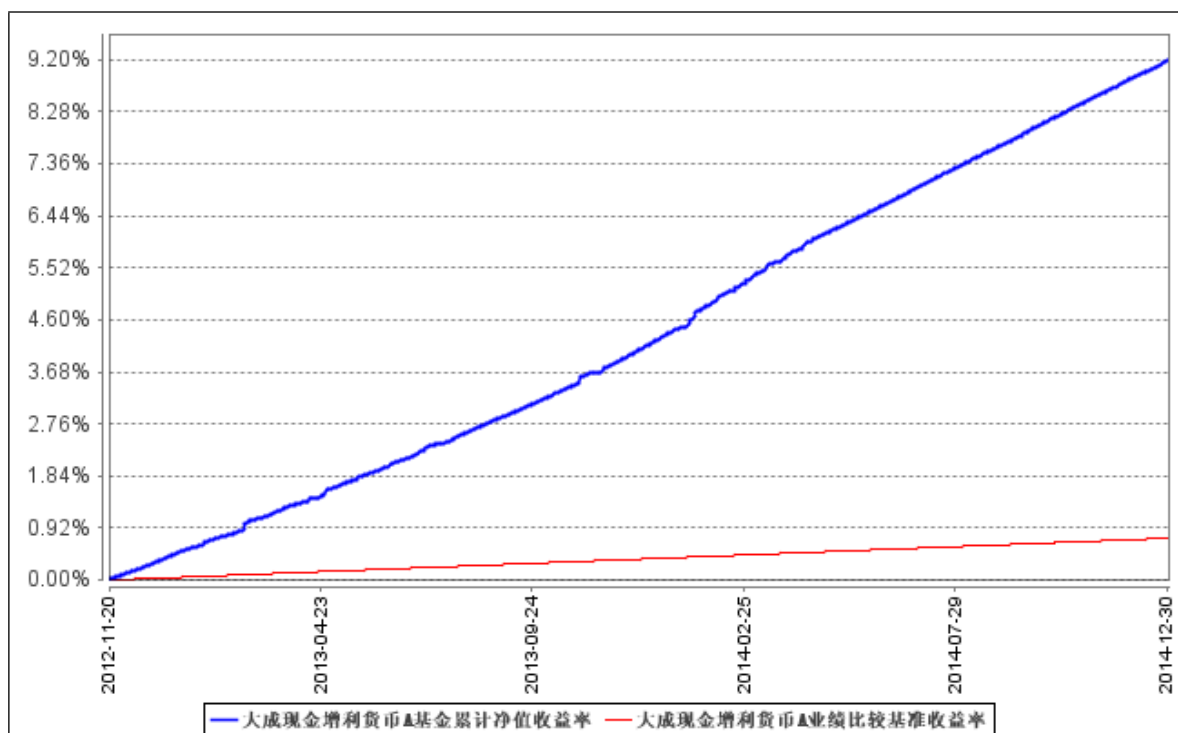
| 阶段         | 份额净值收益率① | 份额净值收益率标准差② | 业绩比较基准收益率③ | 业绩比较基准收益率标准差④ | ①-③     | ②-④     |
|------------|----------|-------------|------------|---------------|---------|---------|
| 过去三个月      | 1.0450%  | 0.0020%     | 0.0882%    | 0.0000%       | 0.9568% | 0.0020% |
| 过去六个月      | 2.1267%  | 0.0021%     | 0.1764%    | 0.0000%       | 1.9503% | 0.0021% |
| 过去一年       | 4.6485%  | 0.0078%     | 0.3500%    | 0.0000%       | 4.2985% | 0.0078% |
| 自基金合同生效起至今 | 9.1944%  | 0.0085%     | 0.7403%    | 0.0000%       | 8.4541% | 0.0085% |

大成现金增利货币 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 |
|----|----------|-------------|------------|---------------|-----|-----|
|----|----------|-------------|------------|---------------|-----|-----|

|            |         |         |         |         |         |         |
|------------|---------|---------|---------|---------|---------|---------|
| 过去三个月      | 1.1062% | 0.0020% | 0.0882% | 0.0000% | 1.0180% | 0.0020% |
| 过去六个月      | 2.2500% | 0.0021% | 0.1764% | 0.0000% | 2.0736% | 0.0021% |
| 过去一年       | 4.9000% | 0.0078% | 0.3500% | 0.0000% | 4.5500% | 0.0078% |
| 自基金合同生效起至今 | 9.7499% | 0.0085% | 0.7403% | 0.0000% | 9.0096% | 0.0085% |

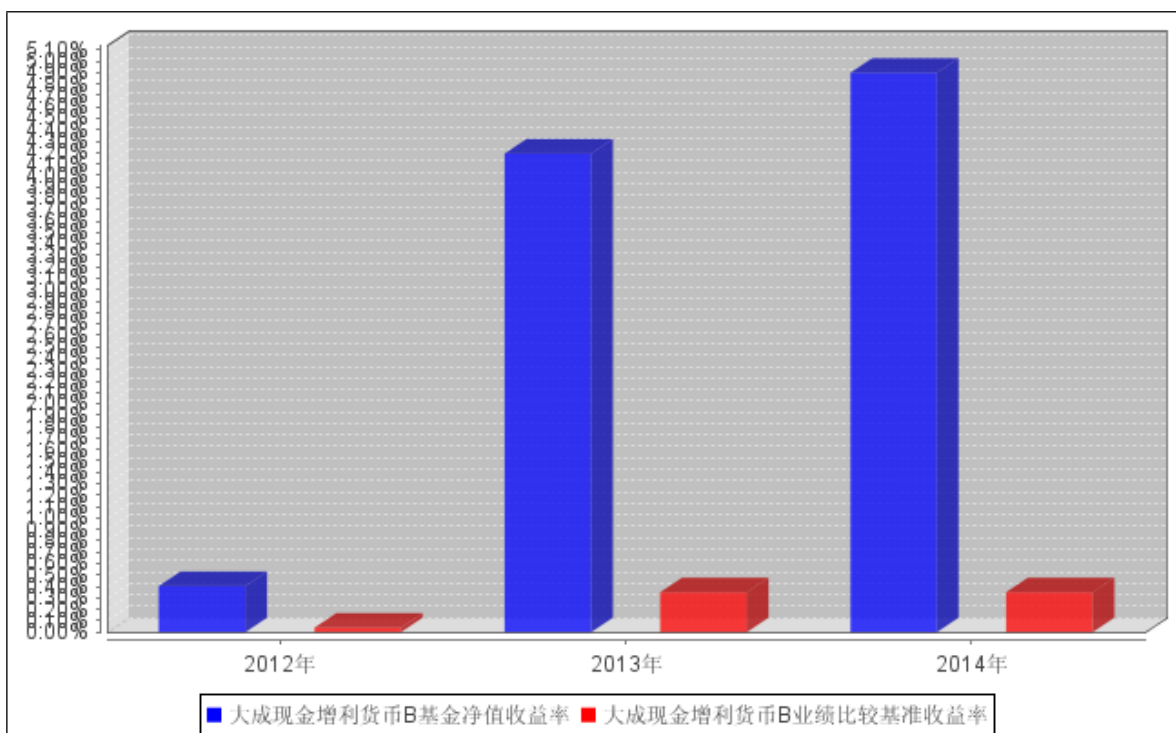
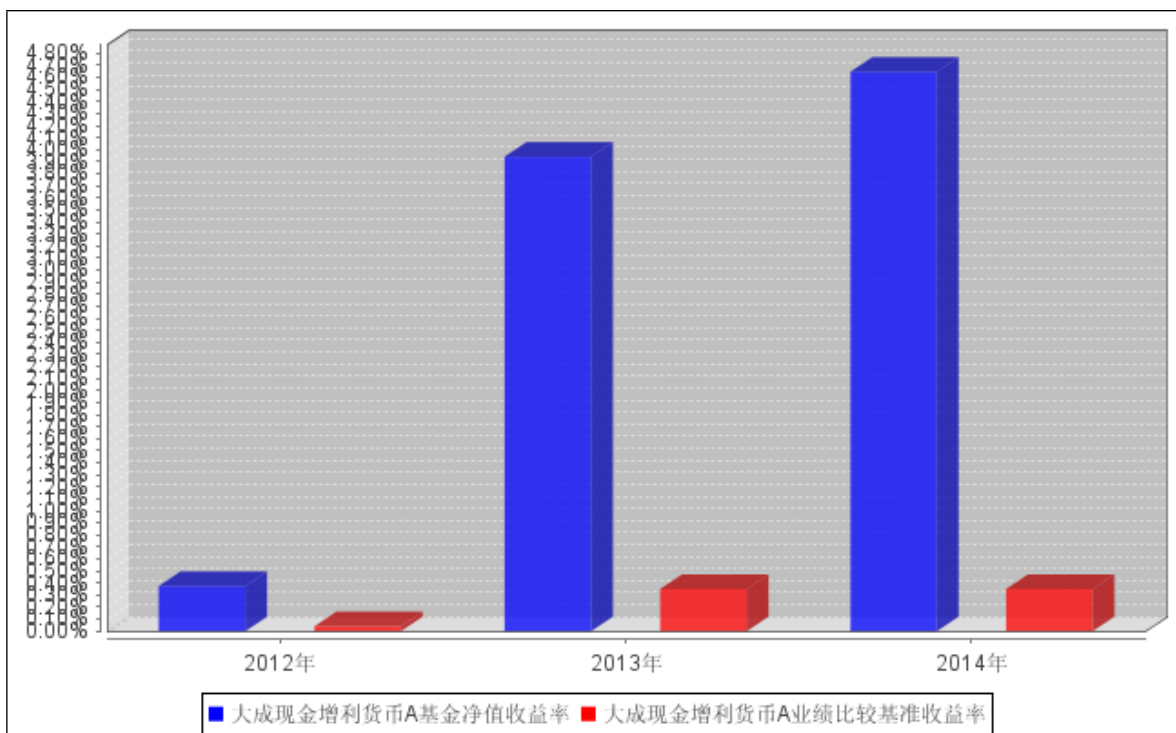
### 3.2.2 自基金合同生效以来基金累计净值收益率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较



注：按基金合同规定，本基金自基金合同生效起 6 个月内为建仓期。截至报告期末，本基金各项

投资比例已符合基金合同的规定。

### 3.2.3 自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较



注:2012年度计算期间为2012年11月20日(基金合同生效日)至2012年12月31日,不按整个自然年度进行折算。

### 3.3 过去三年基金的利润分配情况

单位：人民币元

| 大成现金增利货币 A |                  |                       |              |                |    |
|------------|------------------|-----------------------|--------------|----------------|----|
| 年度         | 已按再投资形式<br>转实收基金 | 直接通过应付<br>赎回款转出金<br>额 | 应付利润<br>本年变动 | 年度利润<br>分配合计   | 备注 |
| 2014       | 128,429,816.87   | -                     | 178,341.74   | 128,608,158.61 |    |
| 2013       | 16,149,752.98    | -                     | 37,751.09    | 16,187,504.07  |    |
| 2012       | 7,692,419.93     | -                     | 248,647.24   | 7,941,067.17   |    |
| 合计         | 152,271,989.78   | -                     | 464,740.07   | 152,736,729.85 |    |

单位：人民币元

| 大成现金增利货币 B |                  |                       |              |                |    |
|------------|------------------|-----------------------|--------------|----------------|----|
| 年度         | 已按再投资形式<br>转实收基金 | 直接通过应付<br>赎回款转出金<br>额 | 应付利润<br>本年变动 | 年度利润<br>分配合计   | 备注 |
| 2014       | 67,040,560.59    | -                     | -573,989.72  | 66,466,570.87  |    |
| 2013       | 26,203,780.99    | -                     | -83,885.28   | 26,119,895.71  |    |
| 2012       | 9,533,732.69     | -                     | 743,543.83   | 10,277,276.52  |    |
| 合计         | 102,778,074.27   | -                     | 85,668.83    | 102,863,743.10 |    |

## § 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12月31日，本基金管理人共管理4只ETF及1只ETF联接基金：大成中证100交易型开放式指数证券投资基金、深证成长40交易型开放式指数证券投资基金及大成深证成长40交易型开放式指数证券投资基金联接基金、中证500深市交易型开放式指数证券投资基金、中证500沪市交易型开放式指数证券投资基金，2只QDII基金：大成标普500等权重指数证券投资基金、大成纳斯达克100指数证券投资基金及40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、大成景恒保本混合型证券投资基金、大成内需增长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、大成消费主题股票型证券投资基金、大成新锐产业股票型证券投资基金、大成优选股票型证券投资基金 (LOF)、大成月添利理财债券型证券投资基金、大成现金增利货币市场证券投资基金、大成月月盈短期理财债券型证券投资基金、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、大成信用增利一年定期开放债券型证券投资基金、大成健康产业股票型证券投资基金、大成中小盘股票型证券投资基金 (LOF)、大成灵活配置混合型证券投资基金、大成丰财宝货币市场基金、大成景益平稳收益混合型证券投资基金、大成添利宝货币市场基金、大成景利混合型证券投资基金和大成产业升级股票型证券投资基金 (LOF)。

#### 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      |        |  |
| 李达夫先生 | 本基金基金经理 | 2013年3月7日       | -         | 8年     | 数量经济学硕士。2006年7月至2008年4月就职于东莞农商银行资金营运中心，历任交易员、研究员。2008年4月至2012年9月就职于国投瑞银基金管理有限公司固定收益部，2011年6月30日至2012年9月15日担任国投瑞银货币市场基金基金经理。2012年9月加入大成基金管理有限公司。2013年3月7日至2014年4月4日任大成货币市场证券投资基金基金经理。2013年3月7日起任大成现金增利货币市场基金基金经理。2013年7月17日起兼任大成景安短融债券型证券投资基金基金经理。2014年9月3日起任大成信用增利一年定期开放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 |
| 王立女士  | 本基金基金经理 | 2012年11月20日     | 2014年4月4日 | 12年    | 经济学硕士。曾任职于申银万国证券股份有限公司、南京市商业银行资金营运中心。2005年4月加入大成基金管理有限公司，曾任大成货币市场基金基金经   |



|  |  |  |  |  |   |
|--|--|--|--|--|---|
|  |  |  |  |  | 理助理。2012 年 11 月 20 日至 2014 年 4 月 4 日任大成现金增利货币市场基金基金经理。2007 年 1 月 12 日至 2014 年 12 月 23 日担任大成货币市场证券投资基金基金经理。2009 年 5 月 23 日起兼任大成债券投资基金基金经理。2013 年 2 月 1 日起兼任大成月添利理财债券型证券投资基金基金经理。2013 年 7 月 23 日起任大成景旭纯债债券型证券投资基金基金经理。2014 年 9 月 3 日起任大成景兴信用债券型证券投资基金基金经理。2014 年 9 月 3 日起任大成景丰债券型证券投资基金（LOF）基金经理。具有基金从业资格。国籍：中国 |
|--|--|--|--|--|---|

注：1、任职日期、离任日期为本基金管理人作出决定之日。

2、证券从业年限的计算标准遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

#### 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

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》、《大成现金增利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，本基金的投资范围、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 公平交易制度和控制方法

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，基金管理人制订了《大成基金管理有限公司公平交易制度》及《大成基金管理有限公司异常交易监控与报告制度》。基金管理人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 公平交易制度的执行情况

报告期内，基金管理人严格执行了公平交易的原则和制度。

基金管理人运用统计分析方法和工具，对旗下所有投资组合间连续 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进行分析。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些组合间的成交价格差异较大，但结合交易价差专项统计分析，未发现违反公平交易原则的异常情况。

### 4.3.3 异常交易行为的专项说明

报告期内，基金管理人旗下所有投资组合未发现存在异常交易行为。主动投资组合间股票交易存在 23 笔同日反向交易，原因为投资策略需要。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 5 笔，原因为投资策略需要；主动投资组合间债券交易存在 2 笔同日反向交易，原因为投资策略需要。投资组合间相邻交易日反向交易的市场成交比例、成交均价等交易结果数据表明该类交易不对市场产生重大影响，无异常。

## 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，受房地产投资大幅下滑的拖累，经济增长持续低迷，GDP 增速逐季下滑，全年 GDP 同比增长 7.4%，为 2001 年以来的最低水平。通胀走势前高后低，CPI 全年同比上涨 1.99%，明显低于前两年的平均水平。受大宗商品大幅下跌影响，PPI 全年同比下跌 4.3%，为近 6 年来新低。“开正门”、堵偏门“的金融监管背景下，表外融资持续收缩，规范地方政府融资机制的 43 号文出台，房地产、平台两大融资主体信用扩张双双出现收缩，社会融资总量增速明显回落。决策层对经济增速下滑的容忍度提高，政策基调以“保持定力、定向调控”为主，前三个季度央行主要通过再贷款、定向降准、SLF 等定向宽松的方式降低社会融资成本，11 月份意外不对称降息，进一步加大宽松的力度。人民币汇率波动幅度扩大，尤其是在发达经济体基本面及货币政策出现分化、美元趋势性走强的背景下，国际资本流动对国内流动性及利率水平的影响进一步增强。

2014 年本基金在投资管理过程中继续贯彻稳健操作的原则，高度重视组合的流动性管理和安全性管理。具体来说，本基金对基金份额持有人结构分析、未来投资期内持有人申购赎回带来的基金流动性变化预测以及货币市场利率判断的基础上，辅以情景分析等技术和数量手段进行资产配置决策。针对货币市场资金面的波动情况，灵活调节各类资产投资比例以及投资期限，做好

流动性管理，同时进行主动和积极的收益管理。本基金着眼于货币基金流动性管理的本义，在投资管理过程中始终贯彻稳健操作的原则，合理安排投资组合和期限结构，在保证流动性的前提下通过积极主动管理提高组合投资收益。

#### 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 4.6485%，B 类净值收益率 4.9000%，期间业绩比较基准收益率为 0.3500%。

#### 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 2015 年，在经济增长低迷、通缩风险加剧、货币增速持续下行的宏观背景下，货币政策仍有继续放松的空间和必要性。预计央行将会继续通过降息、降准等方式降低社会融资成本，债券市场牛市基础仍然没有被动摇，慢牛行情有望延续。

本基金在 2015 年将密切关注金融市场的变化，在稳健操作的原则下，高度重视组合的流动性管理和安全性管理。基于市场基本面和资金面以及投资人结构变化的判断，本基金 2015 年将保持投资组合的高流动性，严格控制利率风险和流动性风险。在具体投资品种上，本基金投资将以存款和短期融资券为主，同时继续充分利用市场机会进行交易套利。我们将始终把确保基金资产的安全性和基金收益的稳定性放在首位，在严格控制流动性风险的基础上，坚持规范运作、审慎投资的原则为基金份额持有人争取长期稳定的投资回报。

#### 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。截止报告期末本基金管理人已与中央国债登记结算有限责任公司签署服务协议，由其按约定提供在银行间同业市场交易的债券品种的估值数据。

#### 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，为投资人每日计算收益并分配，按日结转份额，每月集中支付收益。本报告期内本基金应分配利润 195,074,729.48 元，报告期内已分配利润 195,074,729.48 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

在托管大成现金增利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《大成现金增利货币市场基金基金合同》、

《大成现金增利货币市场基金托管协议》的约定，对大成现金增利货币市场基金管理人一大成基金管理有限公司 2014 年 1 月 1 日至 2014 年 12 月 31 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增利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增利货币市场基金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 审计报告

本基金 2014 年年度财务会计报告已经安永华明会计师事务所(特殊普通合伙)审计，注册会计师签字出具了标准无保留意见的审计报告。投资者欲了解本基金审计报告详细内容，应阅读年度报告正文。

## § 7 年度财务报表

### 7.1 资产负债表

会计主体：大成现金增利货币市场基金

报告截止日：2014 年 12 月 31 日

单位：人民币元

| 资产         | 本期末<br>2014 年 12 月 31 日 | 上年度末<br>2013 年 12 月 31 日 |
|------------|-------------------------|--------------------------|
| <b>资产：</b> |                         |                          |
| 银行存款       | 1,987,525,249.39        | 2,473,668,668.35         |
| 结算备付金      | 2,250,000.00            | -                        |
| 存出保证金      | -                       | -                        |
| 交易性金融资产    | 2,544,529,693.03        | 798,995,542.15           |
| 其中：股票投资    | -                       | -                        |
| 基金投资       | -                       | -                        |
| 债券投资       | 2,544,529,693.03        | 798,995,542.15           |
| 资产支持证券投资   | -                       | -                        |
| 贵金属投资      | -                       | -                        |
| 衍生金融资产     | -                       | -                        |
| 买入返售金融资产   | 497,701,746.55          | 2,488,641,655.97         |
| 应收证券清算款    | -                       | -                        |
| 应收利息       | 63,846,254.18           | 22,955,553.71            |
| 应收股利       | -                       | -                        |
| 应收申购款      | 686,540,368.64          | 759,578,265.13           |
| 递延所得税资产    | -                       | -                        |

|                 |                    |                    |
|-----------------|--------------------|--------------------|
| 其他资产            | -                  | -                  |
| 资产总计            | 5,782,393,311.79   | 6,543,839,685.31   |
| <b>负债和所有者权益</b> | <b>本期末</b>         | <b>上年度末</b>        |
|                 | <b>2014年12月31日</b> | <b>2013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          | -                  | -                  |
| 卖出回购金融资产款       | 788,598,017.10     | -                  |
| 应付证券清算款         | -                  | 39,971,490.73      |
| 应付赎回款           | -                  | -                  |
| 应付管理人报酬         | 1,577,160.13       | 604,479.93         |
| 应付托管费           | 477,927.32         | 183,175.72         |
| 应付销售服务费         | 950,380.12         | 243,130.97         |
| 应付交易费用          | 113,049.34         | 21,850.06          |
| 应交税费            | -                  | -                  |
| 应付利息            | 105,996.85         | -                  |
| 应付利润            | 550,408.90         | 946,056.88         |
| 递延所得税负债         | -                  | -                  |
| 其他负债            | 401,200.00         | 199,000.00         |
| 负债合计            | 792,774,139.76     | 42,169,184.29      |
| <b>所有者权益:</b>   |                    |                    |
| 实收基金            | 4,989,619,172.03   | 6,501,670,501.02   |
| 未分配利润           | -                  | -                  |
| 所有者权益合计         | 4,989,619,172.03   | 6,501,670,501.02   |
| 负债和所有者权益总计      | 5,782,393,311.79   | 6,543,839,685.31   |

注：报告截止日 2014 年 12 月 31 日，A 类基金份额净值 1.0000 元，基金份额总额

4,244,259,865.30 份；B 类基金份额净值 1.0000 元，基金份额总额 745,359,306.73 份。基金份额总额 4,989,619,172.03 份。

## 7.2 利润表

会计主体：大成现金增利货币市场基金

本报告期：2014 年 1 月 1 日至 2014 年 12 月 31 日

单位：人民币元

| 项目          | 本期<br>2014年1月1日至<br>2014年12月31日 | 上年度可比期间<br>2013年1月1日至<br>2013年12月31日 |
|-------------|---------------------------------|--------------------------------------|
| <b>一、收入</b> | 235,290,435.42                  | 50,220,449.91                        |
| 1. 利息收入     | 226,553,007.90                  | 48,945,167.67                        |
| 其中：存款利息收入   | 95,112,485.07                   | 29,915,251.61                        |
| 债券利息收入      | 95,550,343.40                   | 14,145,298.70                        |

|                            |                       |                      |
|----------------------------|-----------------------|----------------------|
| 资产支持证券利息收入                 | -                     | -                    |
| 买入返售金融资产收入                 | 35,890,179.43         | 4,884,617.36         |
| 其他利息收入                     | -                     | -                    |
| 2. 投资收益（损失以“-”填列）          | 8,737,427.52          | 1,267,782.24         |
| 其中：股票投资收益                  | -                     | -                    |
| 基金投资收益                     | -                     | -                    |
| 债券投资收益                     | 8,737,427.52          | 1,267,782.24         |
| 资产支持证券投资收益                 | -                     | -                    |
| 贵金属投资收益                    | -                     | -                    |
| 衍生工具收益                     | -                     | -                    |
| 股利收益                       | -                     | -                    |
| 3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）     | -                     | -                    |
| 4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）         | -                     | -                    |
| 5. 其他收入（损失以“-”号填列）         | -                     | 7,500.00             |
| <b>减：二、费用</b>              | <b>40,215,705.94</b>  | <b>7,913,050.13</b>  |
| 1. 管理人报酬                   | 14,872,395.14         | 3,483,258.35         |
| 2. 托管费                     | 4,506,786.47          | 1,055,532.91         |
| 3. 销售服务费                   | 7,717,680.92          | 1,078,545.96         |
| 4. 交易费用                    | 625.00                | -                    |
| 5. 利息支出                    | 12,475,178.30         | 1,775,135.87         |
| 其中：卖出回购金融资产支出              | 12,475,178.30         | 1,775,135.87         |
| 6. 其他费用                    | 643,040.11            | 520,577.04           |
| <b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b> | <b>195,074,729.48</b> | <b>42,307,399.78</b> |
| 减：所得税费用                    | -                     | -                    |
| <b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>   | <b>195,074,729.48</b> | <b>42,307,399.78</b> |

### 7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：大成现金增利货币市场基金

本报告期：2014 年 1 月 1 日至 2014 年 12 月 31 日

单位：人民币元

| 项目                               | 本期<br>2014 年 1 月 1 日至 2014 年 12 月 31 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<br>(基金净值)              | 6,501,670,501.02                       | -              | 6,501,670,501.02  |
| 二、本期经营活动产生的<br>基金净值变动数（本<br>期利润） | -                                      | 195,074,729.48 | 195,074,729.48    |
| 三、本期基金份额交易<br>产生的基金净值变动数         | -1,512,051,328.99                      | -              | -1,512,051,328.99 |

|  |                                  |                 |                    |
|--|----------------------------------|-----------------|--------------------|
| (净值减少以“-”号填列)                          |                                  |                 |                    |
| 其中: 1. 基金申购款                           | 42,918,920,698.72                | -               | 42,918,920,698.72  |
| 2. 基金赎回款                               | -44,430,972,027.71               | -               | -44,430,972,027.71 |
| 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) | -                                | -195,074,729.48 | -195,074,729.48    |
| 五、期末所有者权益(基金净值)                        | 4,989,619,172.03                 | -               | 4,989,619,172.03   |
| 项目                                     | 上年度可比期间<br>2013年1月1日至2013年12月31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)                        | 7,840,804,257.08                 | -               | 7,840,804,257.08   |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)               | -                                | 42,307,399.78   | 42,307,399.78      |
| 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)      | -1,339,133,756.06                | -               | -1,339,133,756.06  |
| 其中: 1. 基金申购款                           | 13,540,447,593.85                | -               | 13,540,447,593.85  |
| 2. 基金赎回款                               | -14,879,581,349.91               | -               | -14,879,581,349.91 |
| 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) | -                                | -42,307,399.78  | -42,307,399.78     |
| 五、期末所有者权益(基金净值)                        | 6,501,670,501.02                 | -               | 6,501,670,501.02   |

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.4 财务报表由下列负责人签署:

罗登攀 肖剑 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

## 7.4 报表附注

### 7.4.1 本报告期所采用的会计政策、会计估计、税项与最近一期年度报告相一致的说明

财政部于 2014 年颁布《企业会计准则第 39 号——公允价值计量》、《企业会计准则第 40 号——合营安排》、《企业会计准则第 41 号——在其他主体中权益的披露》和修订后的《企



业会计准则第 2 号——长期股权投资》、《企业会计准则第 9 号——职工薪酬》、《企业会计准则第 30 号——财务报表列报》、《企业会计准则第 33 号——合并财务报表》以及《企业会计准则第 37 号——金融工具列报》，要求除《企业会计准则第 37 号——金融工具列报》自 2014 年度财务报表起施行外，其他准则自 2014 年 7 月 1 日起施行。上述准则对本基金本报告期无重大影响。

除上述会计政策变更事项，本报告期所采用的其他会计政策、会计估计、税项与最近一期年度报告相一致。

#### 7.4.2 关联方关系

| 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 |
| 中国农业银行股份有限公司（“中国农业银行”） | 基金托管人、基金销售机构        |
| 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、基金销售机构     |
| 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”） | 基金管理人的合营企业          |

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。

#### 7.4.3 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

##### 7.4.3.1 通过关联方交易单元进行的交易

本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行交易。

##### 7.4.3.2 关联方报酬

###### 7.4.3.2.1 基金管理费

单位：人民币元

| 项目              | 本期<br>2014 年 1 月 1 日至 2014 年<br>12 月 31 日 | 上年度可比期间<br>2013 年 1 月 1 日至 2013 年 12 月<br>31 日 |
|-----------------|---|--|
| 当期发生的基金应支付的管理费  | 14,872,395.14                             | 3,483,258.35                                   |
| 其中：支付销售机构的客户维护费 | 1,321,093.83                              | 829,080.27                                     |

注：基金管理费每日计提，按月支付。基金管理费按前一日的基金资产净值的 0.33% 的年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 0.33\% / \text{当年天数}$$

H 为每日应支付的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

#### 7.4.3.2.2 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 12 月 31 日 | 2013 年 1 月 1 日至 2013 年 12 月 31 日 |
| 当期发生的基金应支付的托管费 | 4,506,786.47                     | 1,055,532.91                     |

注：基金托管费每日计提，按月支付。基金托管费按基金财产净值的 0.10% 年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 0.10\% / \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金财产净值

#### 7.4.3.2.3 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 12 月 31 日 |            |              |
|                | 当期发生的基金应支付的销售服务费                 |            |              |
|                | 大成现金增利货币 A                       | 大成现金增利货币 B | 合计           |
| 大成基金           | 5,776,204.52                     | 115,926.65 | 5,892,131.17 |
| 中国农业银行         | 970,920.95                       | 15,937.25  | 986,858.20   |
| 光大证券           | 5,937.42                         | 149.47     | 6,086.89     |
| 合计             | 6,753,062.89                     | 132,013.37 | 6,885,076.26 |
| 获得销售服务费的各关联方名称 | 上年度可比期间                          |            |              |
|                | 2013 年 1 月 1 日至 2013 年 12 月 31 日 |            |              |
|                | 当期发生的基金应支付的销售服务费                 |            |              |
|                | 大成现金增利货币 A                       | 大成现金增利货币 B | 合计           |
| 大成基金           | 32,125.45                        | 40,201.60  | 72,327.05    |
| 中国农业银行         | 806,463.49                       | 18,422.94  | 824,886.43   |
| 光大证券           | 860.77                           | 75.58      | 936.35       |
| 合计             | 839,449.71                       | 58,700.12  | 898,149.83   |

注：基金销售服务费每日计算，按月支付。本基金 A 级基金份额的基金销售服务费按前一日基金资产净值的 0.25% 的年费率计提；B 级基金份额的基金销售服务费按前一日基金资产净值的 0.01% 的年费率计提。计算方法如下：

$$H=E \times R / \text{当年天数}$$

H 为每日应支付的基金销售服务费

E 为前一日的该类基金份额的基金资产净值

R 为该类基金份额的销售服务年费率

#### 7.4.3.3 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<br>2014 年 1 月 1 日至 2014 年 12 月 31 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       |
| 光大证券  | -             | 20,880,542.47 | -     | -    | -                | -          |
| 中国农业银行                                      | 51,878,165.07 | 49,974,527.40 | -     | -    | 4,349,930,000.00 | 876,426.71 |
| 上年度可比期间<br>2013 年 1 月 1 日至 2013 年 12 月 31 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                                      | 71,689,665.47 | -             | -     | -    | 965,720,000.00   | 98,395.09  |

#### 7.4.3.4 各关联方投资本基金的情况

##### 7.4.3.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

份额单位：份

| 项目                               | 本期<br>2014 年 1 月 1 日至 2014 年 12 月 31 日 |              |
|----------------------------------|--|--------------|
|                                  | 大成现金增利货币 A                             | 大成现金增利货币 B   |
| 基金合同生效日（2012 年 11 月 20 日）持有的基金份额 | -                                      | -            |
| 期初持有的基金份额                        | -                                      | -            |
| 期间申购/买入总份额                       | -                                      | 5,016,910.34 |
| 期间因拆分变动份额                        | -                                      | -            |
| 减：期间赎回/卖出总份额                     | -                                      | 5,016,910.34 |
| 期末持有的基金份额                        | -                                      | -            |
| 期末持有的基金份额占基金总份额比例                | 0.00%                                  | 0.00%        |

| 项目                               | 上年度可比期间<br>2013 年 1 月 1 日至 2013 年 12 月 31 日 |            |
|----------------------------------|---|------------|
|                                  | 大成现金增利货币 A                                  | 大成现金增利货币 B |
| 基金合同生效日（2012 年 11 月 20 日）持有的基金份额 | -   | -          |
| 期初持有的基金份额                        | -   | -          |
| 期间申购/买入总份额                       | -   | -          |
| 期间因拆分变动份额                        | -   | -          |
| 减：期间赎回/卖出总份额                     | -   | -          |
| 期末持有的基金份额                        | -   | -          |
| 期末持有的基金份额<br>占基金总份额比例            | 0.00%                                       | 0.00%      |

注：本报告期本基金管理人申购本基金 5,000,000.00 份，红利再投资 16,910.34 份，本基金管理人申购与赎回本基金的费率与本基金法律文件规定一致。

#### 7.4.3.4.2 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

本基金除基金管理人之外的其他关联方于本报告期末及上年度末未持有本基金份额。

#### 7.4.3.5 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<br>2014 年 1 月 1 日至 2014 年 12 月 31 日 |            | 上年度可比期间<br>2013 年 1 月 1 日至 2013 年 12 月 31 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 | 5,525,249.39                           | 496,637.35 | 47,668,668.35                               | 349,906.98 |

注：本基金的银行存款由基金托管人中国农业银行保管，按约定利率计息。

#### 7.4.3.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金于本报告期末在承销期内参与关联方承销证券。

#### 7.4.3.7 其他关联交易事项的说明

本基金本期及上年度可比期间无其他关联交易事项。

#### 7.4.4 期末（2014 年 12 月 31 日）本基金持有的流通受限证券

##### 7.4.4.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

本基金本报告期末未持有因认购新发/增发证券而于年末流通受限证券。

**7.4.4.2 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。

**7.4.4.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券****7.4.4.3.1 银行间市场债券正回购**

截至本报告期末，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 788,598,017.10 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         |
|-----------|---------------|------------|--------|-----------|----------------|
| 100209    | 10 国开 09      | 2015-01-05 | 100.15 | 1,800,000 | 180,270,100.46 |
| 100236    | 10 国开 36      | 2015-01-05 | 100.18 | 1,000,000 | 100,176,033.03 |
| 011473007 | 14 鲁高速 SCP007 | 2015-01-05 | 99.91  | 1,000,000 | 99,909,111.38  |
| 041458049 | 14 中铝业 CP003  | 2015-01-05 | 100.00 | 800,000   | 79,996,425.90  |
| 041451017 | 14 太不锈 CP002  | 2015-01-05 | 100.28 | 500,000   | 50,138,715.75  |
| 011420004 | 14 中铝 SCP004  | 2015-01-05 | 100.21 | 500,000   | 50,102,799.71  |
| 011481005 | 14 淮南矿 SCP005 | 2015-01-05 | 100.01 | 500,000   | 50,005,287.89  |
| 011487001 | 14 中电建 SCP001 | 2015-01-05 | 100.00 | 500,000   | 50,000,352.27  |
| 041464036 | 14 张资产 CP001  | 2015-01-05 | 100.00 | 400,000   | 40,001,660.79  |
| 011473005 | 14 鲁高速 SCP005 | 2015-01-05 | 100.00 | 300,000   | 30,000,329.07  |
| 011499056 | 14 豫能源 SCP002 | 2015-01-05 | 99.98  | 300,000   | 29,992,682.29  |
| 1130211   | 13 国开 11      | 2015-01-05 | 100.17 | 200,000   | 20,033,160.90  |
| 011490005 | 14 苏交通 SCP005 | 2015-01-05 | 99.99  | 200,000   | 19,997,596.31  |
| 合计        |               |            |        | 8,000,000 | 800,624,255.75 |

**7.4.4.3.2 交易所市场债券正回购**

截至本报告期末，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。

**§ 8 投资组合报告****8.1 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            | 2,544,529,693.03 | 44.00        |
|    | 其中：债券             | 2,544,529,693.03 | 44.00        |
|    | 资产支持证券            | -                | 0.00         |
| 2  | 买入返售金融资产          | 497,701,746.55   | 8.61         |
|    | 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 | 1,989,775,249.39 | 34.41  |
| 4 | 其他各项资产       | 750,386,622.82   | 12.98  |
| 5 | 合计           | 5,782,393,311.79 | 100.00 |

## 8.2 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 |                | 9.13           |
|    | 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 | 788,598,017.10 | 15.80          |
|    | 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

本报告期内本基金无债券正回购的资金余额超过基金资产净值的 20%的情况。

## 8.3 基金投资组合平均剩余期限

### 8.3.1 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    | 73 |
| 报告期内投资组合平均剩余期限最高值 | 90 |
| 报告期内投资组合平均剩余期限最低值 | 13 |

### 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 90 天”,本报告期内,本基金未发生超标情况。

### 8.3.2 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                 | 55.69               | 15.80               |
|    | 其中:剩余存续期超过 397 天的浮动利率债 | 2.80                | 0.00                |
| 2  | 30 天(含)—60 天           | 5.61                | 0.00                |
|    | 其中:剩余存续期超过 397 天的浮动利率债 | 0.00                | 0.00                |
| 3  | 60 天(含)—90 天           | 5.62                | 0.00                |
|    | 其中:剩余存续期超过 397 天的浮     | 0.00                | 0.00                |

|    |                        |        |       |
|----|------------------------|--------|-------|
|    | 浮动利率债                  |        |       |
| 4  | 90 天(含)—180 天          | 21.71  | 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)      | 12.22  | 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 |                        | 100.85 | 15.80 |

#### 8.4 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                 | 49,727,307.81    | 1.00          |
| 2  | 央行票据                 | -                | 0.00          |
| 3  | 金融债券                 | 500,335,901.42   | 10.03         |
|    | 其中：政策性金融债            | 500,335,901.42   | 10.03         |
| 4  | 企业债券                 | -                | 0.00          |
| 5  | 企业短期融资券              | 1,994,466,483.80 | 39.97         |
| 6  | 中期票据                 | -                | 0.00          |
| 7  | 其他                   | -                | 0.00          |
| 8  | 合计                   | 2,544,529,693.03 | 51.00         |
| 9  | 剩余存续期超过 397 天的浮动利率债券 | 139,708,169.07   | 2.80          |

#### 8.5 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  | 100209    | 10 国开 09      | 1,900,000 | 190,285,106.04 | 3.81          |
| 2  | 100236    | 10 国开 36      | 1,000,000 | 100,176,033.03 | 2.01          |
| 3  | 011473007 | 14 鲁高速 SCP007 | 1,000,000 | 99,909,111.38  | 2.00          |
| 4  | 130215    | 13 国开 15      | 1,000,000 | 99,536,654.81  | 1.99          |
| 5  | 041458049 | 14 中铝业 CP003  | 800,000   | 79,996,425.90  | 1.60          |
| 6  | 041461048 | 14 津城建 CP002  | 600,000   | 59,999,915.34  | 1.20          |
| 7  | 041451017 | 14 太不锈 CP002  | 500,000   | 50,138,715.75  | 1.00          |
| 8  | 100230    | 10 国开 30      | 500,000   | 50,133,432.38  | 1.00          |
| 9  | 011420004 | 14 中铝 SCP004  | 500,000   | 50,102,799.71  | 1.00          |

|    |           |                  |         |               |      |
|----|-----------|------------------|---------|---------------|------|
| 10 | 011481005 | 14 淮南矿<br>SCP005 | 500,000 | 50,005,287.89 | 1.00 |
|----|-----------|------------------|---------|---------------|------|

#### 8.6 “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 | 33      |
| 报告期内偏离度的最高值                   | 0.3322% |
| 报告期内偏离度的最低值                   | 0.0149% |
| 报告期内每个交易日偏离度的绝对值的简单平均值        | 0.1525% |

#### 8.7 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。

#### 8.8 投资组合报告附注

8.8.1 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 1.00 元。

8.8.2 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。

8.8.3 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。

#### 8.8.4 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 | -              |
| 3  | 应收利息    | 63,846,254.18  |
| 4  | 应收申购款   | 686,540,368.64 |
| 5  | 其他应收款   | -              |
| 6  | 待摊费用    | -              |
| 7  | 其他      | -              |
| 8  | 合计      | 750,386,622.82 |

#### 8.8.5 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。



## § 9 基金份额持有人信息

## 9.1 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 |
| 大成现金增利货币 A | 305,264  | 13,903.57     | 15,598,068.01  | 0.37%  | 4,228,661,797.29 | 99.63% |
| 大成现金增利货币 B | 28       | 26,619,975.24 | 663,000,614.45 | 88.95% | 82,358,692.28    | 11.05% |
| 合计         | 305,292  | 16,343.76     | 678,598,682.46 | 13.60% | 4,311,020,489.57 | 86.40% |

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。

## 9.2 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 | 大成现金增利货币 A | 502,681.42 | 0.01%    |
|                  | 大成现金增利货币 B | -          | 0.00%    |
|                  | 合计         | 502,681.42 | 0.01%    |

注：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。

## 9.3 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、基金投资和研发部门负责人持有本开放式基金 | 大成现金增利货币 A | 0~10              |
|                                | 大成现金增利货币 B | 0                 |
|                                | 合计         | 0~10              |
| 本基金基金经理持有本开放式基金                | 大成现金增利货币 A | 0                 |
|                                | 大成现金增利货币 B | 0                 |
|                                | 合计         | 0                 |

## § 10 开放式基金份额变动

单位：份

|                       | 大成现金增利货币 A       | 大成现金增利货币 B       |
|-----------------------|------------------|------------------|
| 基金合同生效日(2012年11月20日)基 | 2,538,753,613.56 | 2,327,500,035.95 |

|                          |                   |                   |
|--------------------------|-------------------|-------------------|
| 金份额总额                    |                   |                   |
| 本报告期期初基金份额总额             | 2,025,675,070.92  | 4,475,995,430.10  |
| 本报告期基金总申购份额              | 35,670,311,269.95 | 7,248,609,428.77  |
| 减:本报告期基金总赎回份额            | 33,451,726,475.57 | 10,979,245,552.14 |
| 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             | 4,244,259,865.30  | 745,359,306.73    |

## § 11 重大事件揭示

### 11.1 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。

### 11.2 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、基金管理人在本报告期内重大人事变动情况

1、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。

2、基金管理人于 2014 年 11 月 28 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三十九次会议审议通过，由罗登攀先生任公司总经理。

3、基金管理人于 2014 年 12 月 20 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三十九次会议审议通过，由刘卓先生任公司董事长及法定代表人，张树忠先生不再担任公司董事长。

#### 二、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

因中国农业银行股份有限公司（以下简称“本行”）工作需要，任命余晓晨先生主持本行托管业务部/养老金管理中心工作。余晓晨先生的基金行业高级管理人员任职资格已在中国基金业协会备案。

### 11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内没有涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

### 11.4 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。

## 11.5 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安永华明会计师事务所(特殊普通合伙)，本年度应支付的审计费用为 9 万元整。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。

## 11.6 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。

## 11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

## 11.7.1 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%      | -  |
| 北京高华 | 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%      | -  |
| 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% | - |
| 湘财证券 | 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 | 2 | - | 0.00% | - | 0.00% | - |
| 中信证券 | 3 | - | 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。

本报告期内本基金租用证券公司交易单元的变更情况如下：

本报告期内退出交易单元：招商证券，本报告期内新增交易单元：湘财证券。

#### 11.7.2 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%        | 3,676,800,000.00 | 100.00%        | -    | 0.00%        |

#### 11.8 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。

#### § 12 影响投资者决策的其他重要信息

1、基金管理人于 2015 年 1 月 13 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六届董事会第一次会议审议通过，刘彩晖女士不再担任公司副总经理。

2、基金管理人于 2015 年 1 月 22 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六届董事会第一次会议审议通过，由肖剑先生、钟鸣远先生任公司副总经理。

大成基金管理有限公司  
2015 年 3 月 28 日