

# 大成丰财宝货币市场基金 2015 年年度报告

## 2015 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：中国银行股份有限公司

送出日期：2016 年 3 月 26 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。

基金托管人中国银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2016 年 3 月 24 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。

本报告财务资料已经审计。普华永道中天会计师事务所(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 2015 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            | 大成丰财宝货币          |                 |
| 基金主代码           | 000626           |                 |
| 交易代码            | 000626           |                 |
| 基金运作方式          | 契约型开放式           |                 |
| 基金合同生效日         | 2014 年 6 月 18 日  |                 |
| 基金管理人           | 大成基金管理有限公司       |                 |
| 基金托管人           | 中国银行股份有限公司       |                 |
| 报告期末基金份额总额      | 139,340,669.91 份 |                 |
| 基金合同存续期         | 不定期              |                 |
| 下属分级基金的基金简称:    | 大成丰财宝货币 A        | 大成丰财宝货币 B       |
| 下属分级基金的交易代码:    | 000626           | 000627          |
| 报告期末下属分级基金的份额总额 | 74,100,426.64 份  | 65,240,243.27 份 |

### 2.2 基金产品说明

|        |   |
|--------|---|
| 投资目标   | 在有效控制投资风险和保持高流动性的基础上，力争获得高于业绩比较基准的投资回报。   |
| 投资策略   | 本基金投资管理将充分运用收益率策略与估值相结合的方法，对各类可投资资产进行合理的配置和选择。策略首先审慎考虑各类收益性、流动性及风险特征，在风险与收益的配比中，力求将各类风险降到最低，并在控制组合良好流动性的基础上为投资者获得稳定的收益。 |
| 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           | 中国银行股份有限公司           |
| 信息披露负责人 | 姓名   | 杜鹏                   | 王永民                  |
|         | 联系电话 | 0755-83183388        | 010-66594896         |
|         | 电子邮箱 | dupeng@dcfund.com.cn | fcid@bankofchina.com |
| 客户服务电话  |      | 4008885558           | 95566                |
| 传真      |      | 0755-83199588        | 010-66594942         |

### 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<br>北京市西城区复兴门内大街 1 号 中国   |

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 | 2015 年        |               | 2014 年 6 月 18 日(基金合同生效日)-<br>2014 年 12 月 31 日 |               |
|---------------|---------------|---------------|---|---------------|
|               | 大成丰财宝货币<br>A  | 大成丰财宝货币<br>B  | 大成丰财宝货币<br>A                                  | 大成丰财宝货币<br>B  |
| 本期已实现收益       | 5,757,186.37  | 2,460,968.03  | 8,956,095.30                                  | 3,330,809.32  |
| 本期利润          | 5,757,186.37  | 2,460,968.03  | 8,956,095.30                                  | 3,330,809.32  |
| 本期净值收益率       | 3.7580%       | 4.0084%       | 2.1726%                                       | 2.3053%       |
| 3.1.2 期末数据和指标 | 2015 年末       |               | 2014 年末                                       |               |
| 期末基金资产净值      | 74,100,426.64 | 65,240,243.27 | 262,079,569.31                                | 23,638,506.77 |
| 期末基金份额净值      | 1.0000        | 1.0000        | 1.0000  | 1.0000        |
| 3.1.3 累计期末指标  | 2015 年末       |               | 2014 年末                                       |               |
| 累计净值收益率       | 6.0122%       | 6.4060%       | 2.1726%                                       | 2.3053%       |

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，由于货币市场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

## 大成丰财宝货币 A

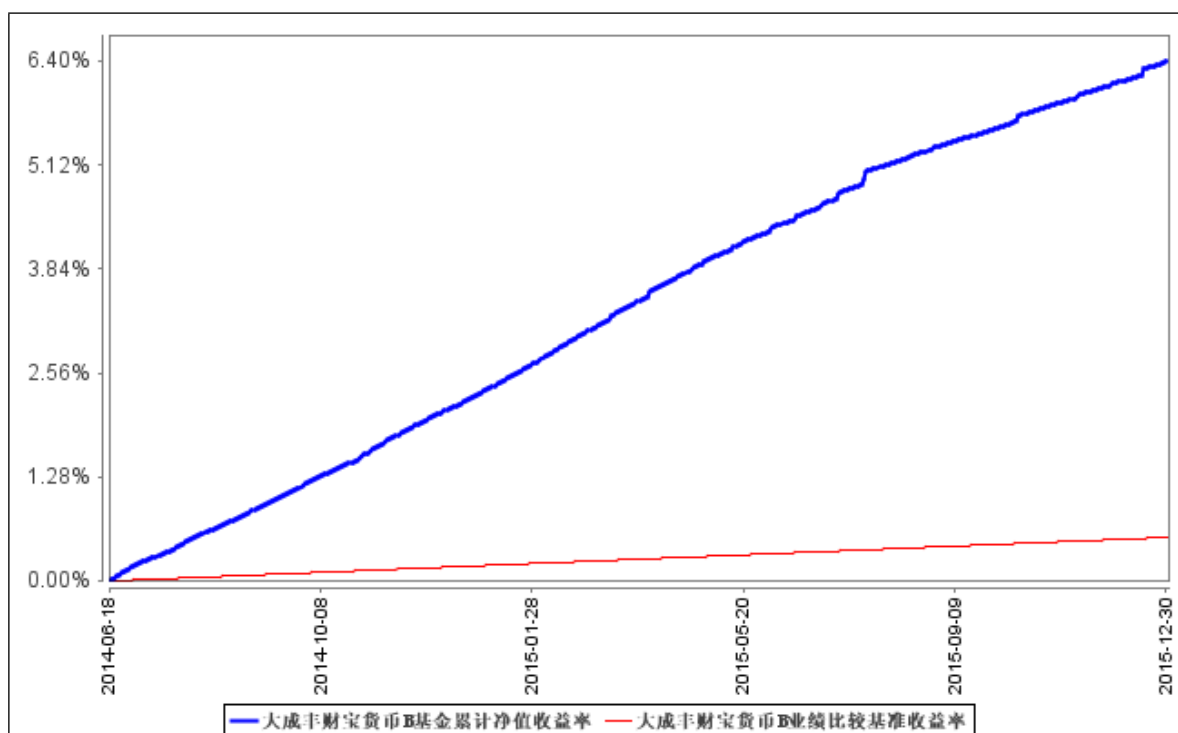
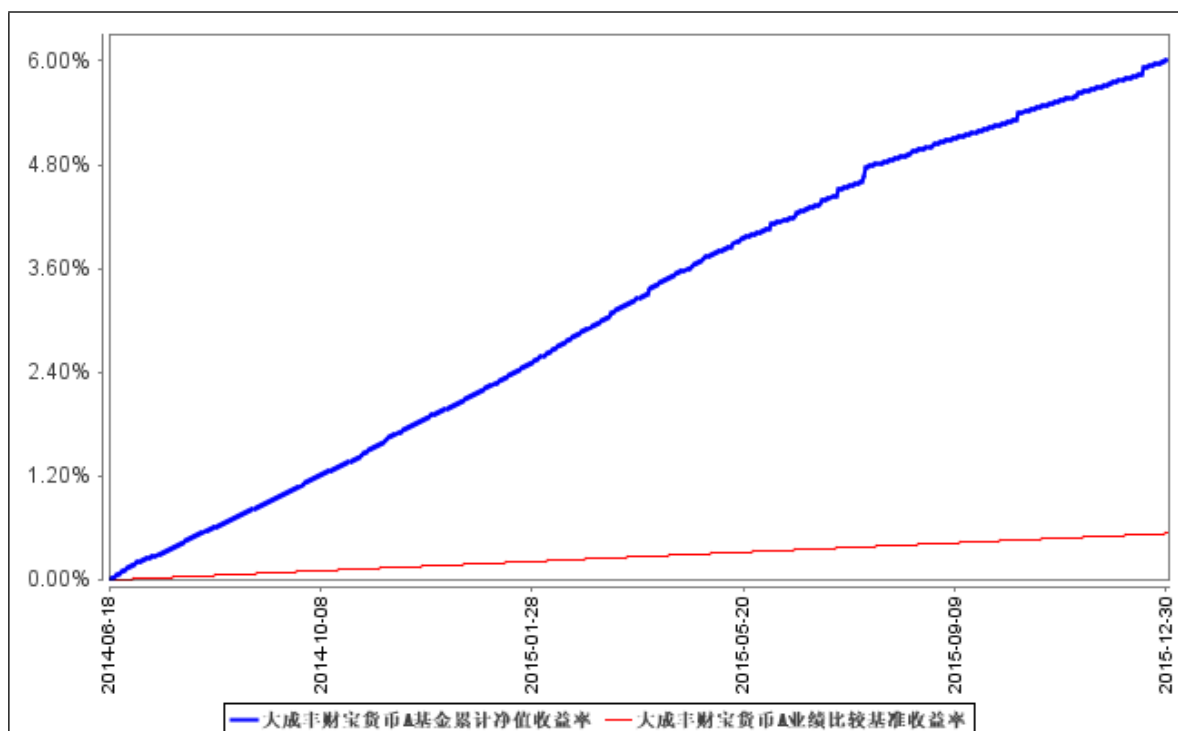
| 阶段             | 份额净值<br>收益率① | 份额净值<br>收益率标<br>准差② | 业绩比较<br>基准收益<br>率③ | 业绩比较基<br>准收益率标<br>准差④ | ①-③     | ②-④     |
|----------------|--------------|---------------------|--------------------|-----------------------|---------|---------|
| 过去三个月          | 0.7320%      | 0.0094%             | 0.0882%            | 0.0000%               | 0.6438% | 0.0094% |
| 过去六个月          | 1.6023%      | 0.0115%             | 0.1764%            | 0.0000%               | 1.4259% | 0.0115% |
| 过去一年           | 3.7580%      | 0.0096%             | 0.3500%            | 0.0000%               | 3.4080% | 0.0096% |
| 自基金合同<br>生效起至今 | 6.0122%      | 0.0079%             | 0.5389%            | 0.0000%               | 5.4733% | 0.0079% |

## 大成丰财宝货币 B

| 阶段 | 份额净值<br>收益率① | 份额净值<br>收益率标<br>准差② | 业绩比较<br>基准收益<br>率③ | 业绩比较基<br>准收益率标<br>准差④ | ①-③ | ②-④ |
|----|--------------|---------------------|--------------------|-----------------------|-----|-----|
|----|--------------|---------------------|--------------------|-----------------------|-----|-----|

|            |         |         |         |         |         |         |
|------------|---------|---------|---------|---------|---------|---------|
| 过去三个月      | 0.7932% | 0.0094% | 0.0882% | 0.0000% | 0.7050% | 0.0094% |
| 过去六个月      | 1.7255% | 0.0115% | 0.1764% | 0.0000% | 1.5491% | 0.0115% |
| 过去一年       | 4.0084% | 0.0096% | 0.3500% | 0.0000% | 3.6584% | 0.0096% |
| 自基金合同生效起至今 | 6.4060% | 0.0079% | 0.5389% | 0.0000% | 5.8671% | 0.0079% |

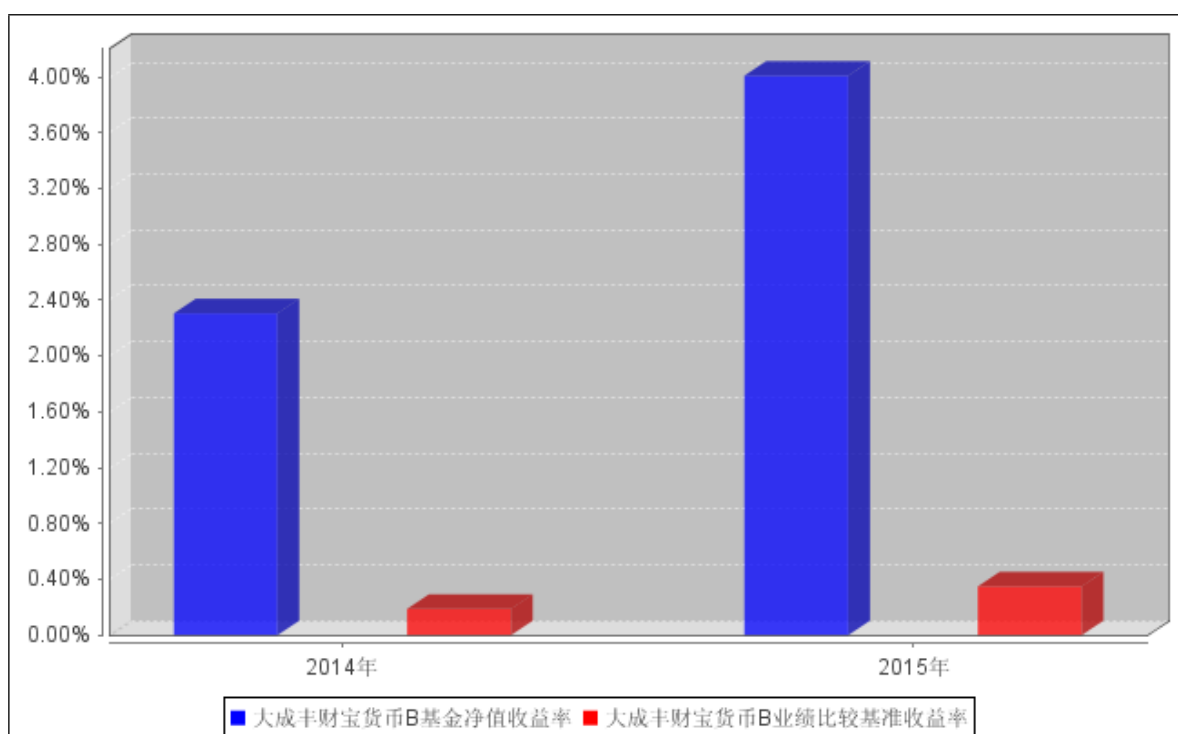
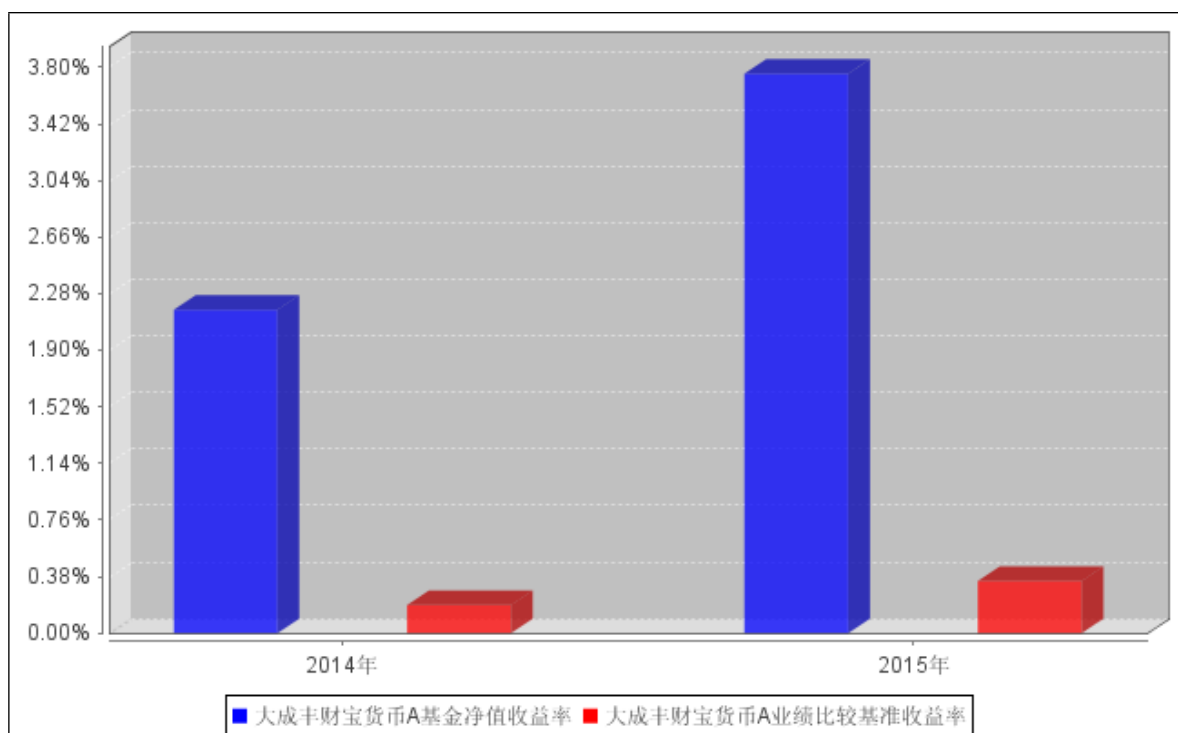
### 3.2.2 自基金合同生效以来基金累计净值收益率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较



注：本基金合同规定，基金管理人应当自基金合同生效之日起六个月内使基金的投资组合比例符

合基金合同的约定。建仓期结束时，本基金的投资组合比例符合基金合同的约定。

### 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：2014年净值增长率表现期间为2014年6月18日(基金合同生效日)至2014年12月31日。

### 3.3 过去三年基金的利润分配情况

单位：人民币元

大成丰财宝货币 A

| 年度    | 已按再投资形式<br>转实收基金 | 直接通过应付<br>赎回款转出金额 | 应付利润<br>本年变动 | 年度利润<br>分配合计  | 备注 |
|-------|------------------|-------------------|--------------|---------------|----|
| 2015年 | 5,781,044.80     | -                 | -23,858.43   | 5,757,186.37  |    |
| 2014年 | 8,925,707.60     | -                 | 30,387.70    | 8,956,095.30  |    |
| 合计    | 14,706,752.40    | -                 | 6,529.27     | 14,713,281.67 |    |

单位：人民币元

| 大成丰财宝货币 B |                  |                   |              |              |    |
|-----------|------------------|-------------------|--------------|--------------|----|
| 年度        | 已按再投资形式<br>转实收基金 | 直接通过应付<br>赎回款转出金额 | 应付利润<br>本年变动 | 年度利润<br>分配合计 | 备注 |
| 2015年     | 2,457,684.26     | -                 | 3,283.77     | 2,460,968.03 |    |
| 2014年     | 3,327,908.77     | -                 | 2,900.55     | 3,330,809.32 |    |
| 合计        | 5,785,593.03     | -                 | 6,184.32     | 5,791,777.35 |    |

## § 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2015年12月31日，本基金管理人共管理5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、大成深证成份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55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、大成积极成长混合型证券投资基金、大成创新成长混合型证券投资基金(LOF)、大成景阳领先混合型证券投资基金、大成强化收益定期开放债券型证券投资基金、大成策略回报混合型证券投资基金、大成行业轮动混合型证券投资基金、大成中证红利指数证券投资基金、大成核心双动力混合型证券投资基金、大成竞争优势混合型证券投资基金、大成景恒保本混合型证券投资基金、大成内需增长混合型证券投资基金、大成可转债增强债券型证券投资基金、大成消费主题混合型证券投资

基金、大成新锐产业混合型证券投资基金、大成优选混合型证券投资基金（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、大成健康产业混合型证券投资基金、大成中小盘混合型证券投资基金（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、大成产业升级股票型证券投资基金（LOF）、大成高新技术产业股票型证券投资基金、大成景秀灵活配置混合型证券投资基金、大成互联网思维混合型证券投资基金、大成景明灵活配置混合型证券投资基金、大成景穗灵活配置混合型证券投资基金、大成景鹏灵活配置混合型证券投资基金、大成景源灵活配置混合型证券投资基金、大成睿景灵活配置混合型证券投资基金、大成景裕灵活配置混合型证券投资基金、大成中证互联网金融指数分级证券投资基金、大成正向回报灵活配置混合型证券投资基金、大成恒丰宝货币市场基金、大成绝对收益策略混合型发起式证券投资基金、大成景沛灵活配置混合型证券投资基金和大成景辉灵活配置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 |        |  |
| 黄海峰先生 | 本基金基金经理 | 2014年12月24日     | -    | 12年    | 南开大学经济学学士，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日至2014年12月23日任大成货币市场证券投资基金基金经理助理。2014年6月23日至2014年12月23日任大成丰财宝货币市场基金基金经理助理。2014年6月26日起任大成景益平稳收益混合型证券投资基金基金经理助理。2014年12月24日起，任大成货币市场证券投资基金基金经理及大成丰财宝货币市场基金基金经理。2015年3月21日起，任大成添利宝货币市场基金及大成景兴信用债债券型证券投资基金基金经理。 |



|       |         |                 |                 |      |  |
|-------|---------|-----------------|-----------------|------|--|
|       |         |                 |                 |      | 2015 年 3 月 27 日起，任大成景秀灵活配置混合型证券投资基金基金经理。2015 年 4 月 29 日起，任大成景明灵活配置混合型证券投资基金基金经理。2015 年 5 月 4 日起，任大成景穗灵活配置混合型证券投资基金基金经理。2015 年 5 月 15 日起，任大成景源灵活配置混合型证券投资基金基金经理。具有基金从业资格。国籍：中国  |
| 屈伟南先生 | 本基金基金经理 | 2014 年 6 月 18 日 | 2015 年 6 月 30 日 | 13 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 日至 2014 年 9 月 11 日任大成理财 21 天债券型发起式证券投资基金基金经理。2013 年 3 月 27 日至 2015 年 6 月 30 日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 日至 2015 年 5 月 25 日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 日至 2015 年 6 月 30 日任大成丰财宝货币市场基金基金经理。2014 年 7 月 28 日至 2015 年 6 月 30 日任大成添利宝货币市场基金基金经理。2014 年 9 月 12 日至 2015 年 6 月 30 日任大成月月盈短期理财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 |

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》、《大成丰财宝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，大成丰财宝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 130 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 1 笔，原因为投资策略需要；主动投资组合间债券交易存在 8 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

2015 年中国债券市场延续了前一年的牛市行情。在调结构和去产能压力下，国内经济下行压力骤增，货币政策不断放水，降准降息连番上场，债券收益率持续下行。从指数看，全年中债综合财富总指数上涨 8.15%。

操作上，去年打新对组合规模影响不太大，我们抓住打新期间收益上行机会积极配置存款和

回购，下半年根据对债券市场行情研判，积极配置短融和存单，抓住时点收益上行配置存款，为持有人获取了一定回报。

#### 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 3.7580%，B 类净值收益率 4.0084%，期间业绩比较基准收益率为 0.3500%。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。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望 2016 年，我们对债券市场相对乐观。从国内看，年初人民日报对权威人士的供给侧改革专访中明确提到，“在当前形势下，国民经济不可能通过短期刺激实现 V 型反弹，可能会经历一个 L 型增长阶段”，从这个角度看，在去产能、去库存、去杠杆和人口红利结束的大环境下，经济面临趋势性下行压力。从国外看，美日欧面临各自经济社会问题，油价低迷导致地缘政治紧张，全球经济走出泥潭尚需时日，外部环境异常复杂严峻。美国加息背景下人民币汇率贬值可能是一个风险因素，不过货币当局弹药充足，会对贬值进程和幅度做出合理选择，预计对国内流动性影响不大。

2016 年，本组合将保持机动和灵活的操作，重点提高组合静态收益，积极调整组合仓位结构，参与债券波段操作，提高组合收益。

我们非常感谢基金份额持有人的信任和支持，我们将按照本基金合同和风险收益特征的要求，严格控制投资风险，积极进行资产配置，适时调整组合结构，研究新的投资品种和挖掘投资机会，力争获得与基金风险特征一致的稳定收益回报给投资者。

#### 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、固定收益总部、风险管理部、基金运营部、监察稽核部、专户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、固定收益总部、风险管理部和专户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/中证指数有限公司签署服务协议，由其按约定提供在银行间同业市场交易的债券品种/在交易所市场上市交易或挂牌转让的固定收益品种（估值处理标准另有规定的除外）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，每日支付。本报告期内本基金应分配利润 8,218,154.40 元，报告期内已分配利润 8,218,154.40 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

本报告期内，中国银行股份有限公司（以下称“本托管人”）在对大成丰财宝货币市场基金（以下称“本基金”）的托管过程中，严格遵守《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有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了应尽的义务。

#### 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

本报告期内，本托管人根据《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，对本基金管理人的投资运作进行了必要的监督，对基金资产净值的计算、基金净值收益率的计算以及基金费用开支等方面进行了认真地复核，未发现本基金管理人存在损害基金份额持有人利益的行为。

### 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

本报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告（注：财务会计报告中的“金融工具风险及管理”部分未在托管人复核范围内）、投资组合报告等数据真实、准确和完整。

## § 6 审计报告

本基金 2015 年年度财务会计报告已经普华永道中天会计师事务所(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：大成丰财宝货币市场基金

报告截止日：2015 年 12 月 31 日

单位：人民币元

| 资 产         | 本期末<br>2015 年 12 月 31 日 | 上年度末<br>2014 年 12 月 31 日 |
|-------------|-------------------------|--------------------------|
| <b>资 产：</b> |                         |                          |
| 银行存款        | 50,153,290.34           | 190,338,085.26           |
| 结算备付金       | -                       | 208,000.00               |
| 存出保证金       | -                       | -                        |
| 交易性金融资产     | 49,979,905.59           | 90,228,340.63            |
| 其中：股票投资     | -                       | -                        |
| 基金投资        | -                       | -                        |
| 债券投资        | 49,979,905.59           | 90,228,340.63            |
| 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    | 54,600,521.90           | 52,204,838.31            |
| 应收证券清算款     | -                       | -                        |
| 应收利息        | 909,923.93              | 2,939,324.45             |
| 应收股利        | -                       | -                        |
| 应收申购款       | -                       | -                        |
| 递延所得税资产     | -                       | -                        |

|                 |                         |                         |
|-----------------|-------------------------|-------------------------|
| 其他资产            | -                       | -                       |
| 资产总计            | 155,643,641.76          | 335,918,588.65          |
| <b>负债和所有者权益</b> | <b>本期末</b>              | <b>上年度末</b>             |
|                 | <b>2015 年 12 月 31 日</b> | <b>2014 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       | 16,037,791.98           | 49,699,485.45           |
| 应付证券清算款         | -                       | -                       |
| 应付赎回款           | -                       | -                       |
| 应付管理人报酬         | 38,343.18               | 121,622.03              |
| 应付托管费           | 11,619.13               | 36,855.17               |
| 应付销售服务费         | 15,836.58               | 82,036.16               |
| 应付交易费用          | 16,688.26               | 36,933.30               |
| 应交税费            | -                       | -                       |
| 应付利息            | 979.13                  | 9,292.21                |
| 应付利润            | 12,713.59               | 33,288.25               |
| 递延所得税负债         | -                       | -                       |
| 其他负债            | 169,000.00              | 181,000.00              |
| 负债合计            | 16,302,971.85           | 50,200,512.57           |
| <b>所有者权益:</b>   |                         |                         |
| 实收基金            | 139,340,669.91          | 285,718,076.08          |
| 未分配利润           | -                       | -                       |
| 所有者权益合计         | 139,340,669.91          | 285,718,076.08          |
| 负债和所有者权益总计      | 155,643,641.76          | 335,918,588.65          |

注：报告截止日 2015 年 12 月 31 日，大成丰财宝货币基金的净值为 1.0000 元，基金份额总额 139,340,669.91 份。其中 A 类基金份额总额为 74,100,426.64 份，B 类基金份额的份额总额为 65,240,243.27 份。

## 7.2 利润表

会计主体：大成丰财宝货币市场基金

本报告期：2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日

单位：人民币元

| 项 目       | 本期<br>2015 年 1 月 1 日至 2015 年<br>12 月 31 日 | 上年度可比期间<br>2014 年 6 月 18 日(基金合<br>同生效日)至 2014 年<br>12 月 31 日 |
|-----------|---|--|
| 一、收入      | 10,534,973.66                             | 15,121,796.18  |
| 1. 利息收入   | 9,219,293.79                              | 14,364,492.75  |
| 其中：存款利息收入 | 3,740,899.87                              | 4,993,178.73   |

|                            |                     |                      |
|----------------------------|---------------------|----------------------|
| 债券利息收入                     | 2,913,778.41        | 3,163,647.04         |
| 资产支持证券利息收入                 | -                   | -                    |
| 买入返售金融资产收入                 | 2,564,615.51        | 6,207,666.98         |
| 其他利息收入                     | -                   | -                    |
| 2. 投资收益（损失以“-”填列）          | 1,315,679.87        | 757,303.43           |
| 其中：股票投资收益                  | -                   | -                    |
| 基金投资收益                     | -                   | -                    |
| 债券投资收益                     | 1,315,679.87        | 757,303.43           |
| 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）         | -                   | -                    |
| <b>减：二、费用</b>              | <b>2,316,819.26</b> | <b>2,834,891.56</b>  |
| 1. 管理人报酬                   | 712,592.15          | 1,012,903.12         |
| 2. 托管费                     | 215,936.84          | 306,940.30           |
| 3. 销售服务费                   | 385,130.74          | 573,673.96           |
| 4. 交易费用                    | -                   | 318.50               |
| 5. 利息支出                    | 554,129.16          | 711,244.98           |
| 其中：卖出回购金融资产支出              | 554,129.16          | 711,244.98           |
| 6. 其他费用                    | 449,030.37          | 229,810.70           |
| <b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b> | <b>8,218,154.40</b> | <b>12,286,904.62</b> |
| 减：所得税费用                    | -                   | -                    |
| <b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>   | <b>8,218,154.40</b> | <b>12,286,904.62</b> |

### 7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：大成丰财宝货币市场基金

本报告期：2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日

单位：人民币元

| 项目              | 本期<br>2015 年 1 月 1 日至 2015 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） | 285,718,076.08                         | -            | 285,718,076.08 |
| 二、本期经营活动产生的基金净  | -                                      | 8,218,154.40 | 8,218,154.40   |

|  |  |                |                   |
|--|--|----------------|-------------------|
| 值变动数（本期利润）                             |  |                |                   |
| 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）      | -146,377,406.17                            | -              | -146,377,406.17   |
| 其中：1.基金申购款                             | 978,884,621.41                             | -              | 978,884,621.41    |
| 2.基金赎回款                                | -1,125,262,027.58                          | -              | -1,125,262,027.58 |
| 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） | -  | -8,218,154.40  | -8,218,154.40     |
| 五、期末所有者权益（基金净值）                        | 139,340,669.91                             | -              | 139,340,669.91    |
| 项目                                     | 上年度可比期间<br>2014年6月18日（基金合同生效日）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（基金净值）                        | 1,011,657,015.05                           | -              | 1,011,657,015.05  |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）               | -  | 12,286,904.62  | 12,286,904.62     |
| 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）      | -725,938,938.97                            | -              | -725,938,938.97   |
| 其中：1.基金申购款                             | 2,329,671,052.20                           | -              | 2,329,671,052.20  |
| 2.基金赎回款                                | -3,055,609,991.17                          | -              | -3,055,609,991.17 |
| 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） | -  | -12,286,904.62 | -12,286,904.62    |
| 五、期末所有者权益（基金净值）                        | 285,718,076.08                             | -              | 285,718,076.08    |

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      | 周立新       | 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

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。

##### 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 |



|                        |                 |
|------------------------|-----------------|
| 中国银行股份有限公司(“中国银行”)     | 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、下述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

本基金本报告期及上年度可比期间均无通过关联方交易单元进行的交易。

##### 7.4.3.1 关联方报酬

###### 7.4.3.1.1 基金管理费

单位：人民币元

| 项目              | 本期<br>2015 年 1 月 1 日至 2015 年<br>12 月 31 日 | 上年度可比期间<br>2014 年 6 月 18 日(基金合同生效<br>日)至 2014 年 12 月 31 日 |
|-----------------|---|---|
| 当期发生的基金应支付的管理费  | 712,592.15                                | 1,012,903.12  |
| 其中：支付销售机构的客户维护费 | 341,622.39                                | 774,774.94  |

注：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 0.33%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：

$$\text{日管理人报酬} = \text{前一日基金资产净值} \times 0.33\% / \text{当年天数}。$$

###### 7.4.3.1.2 基金托管费

单位：人民币元

| 项目             | 本期<br>2015 年 1 月 1 日至 2015 年<br>12 月 31 日 | 上年度可比期间<br>2014 年 6 月 18 日(基金合同生效<br>日)至 2014 年 12 月 31 日 |
|----------------|---|---|
| 当期发生的基金应支付的托管费 | 215,936.84                                | 306,940.30  |

注：支付基金托管人 中国银行 的托管费按前一日基金资产净值 0.10%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：

$$\text{日托管费} = \text{前一日基金资产净值} \times 0.10\% / \text{当年天数}。$$

## 7.4.3.1.3 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<br>2015年1月1日至2015年12月31日                |           |            |
|----------------|--|-----------|------------|
|                | 当期发生的基金应支付的销售服务费                           |           |            |
|                | 大成丰财宝货币<br>A                               | 大成丰财宝货币 B | 合计         |
| 大成基金           | 7,256.32                                   | 4,689.53  | 11,945.85  |
| 中国银行           | 332,283.60                                 | 1,639.81  | 333,923.41 |
| 光大证券           | 2,120.86                                   | -         | 2,120.86   |
| 合计             | 341,660.78                                 | 6,329.34  | 347,990.12 |
| 获得销售服务费的各关联方名称 | 上年度可比期间<br>2014年6月18日(基金合同生效日)至2014年12月31日 |           |            |
|                | 当期发生的基金应支付的销售服务费                           |           |            |
|                | 大成丰财宝货币<br>A                               | 大成丰财宝货币 B | 合计         |
| 大成基金           | 1,659.08                                   | 696.14    | 2,355.22   |
| 中国银行           | 548,096.42                                 | 7,426.49  | 555,522.91 |
| 光大证券           | 4,154.50                                   | -         | 4,154.50   |
| 合计             | 553,910.00                                 | 8,122.63  | 562,032.63 |

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

对应级别日销售服务费 = 前一日对应级别基金资产净值 × 约定年费率 / 当年天数。

## 7.4.3.2 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<br>交易的<br>各关联方名<br>称 | 本期<br>2015年1月1日至2015年12月31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<br>额 | 利息收<br>入 | 交易金额           | 利息支出      |
| 中国银行                       | 10,004,021.23                              | -    | -        | -        | 9,800,000.00   | 903.53    |
| 银行间市场<br>交易的<br>各关联方名<br>称 | 上年度可比期间<br>2014年6月18日(基金合同生效日)至2014年12月31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<br>额 | 利息收<br>入 | 交易金额           | 利息支出      |
| 中国银行                       | -  | -    | -        | -        | 571,010,000.00 | 65,016.42 |

### 7.4.3.3 各关联方投资本基金的情况

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

无。

#### 7.4.3.3.2 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

无。

#### 7.4.3.4 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>2015年1月1日至2015年12月31日 |          | 上年度可比期间<br>2014年6月18日(基金合同生效日)至<br>2014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    |
| 中国银行  | 153,290.34                  | 7,257.67 | 338,085.26                                     | 91,300.75 |

注：本基金的银行存款由基金托管人中国银行保管，按约定利率计息。

#### 7.4.3.5 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本报告期及上年度可比期间内本基金未在承销期内参与关联方承销证券。

#### 7.4.3.6 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。

### 7.4.4 期末（2015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

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。

#### 7.4.4.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

于本报告期末，本基金未持有暂时停牌等流通受限股票。

#### 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 2015 年 12 月 31 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 16,037,791.98 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       |
|-----------|---------------|-------------------|--------|--------|--------------|
| 011526003 | 15 中金集 SCP003 | 2016 年 1 月<br>4 日 | 99.96  | 62,000 | 6,197,691.86 |

|           |             |                   |       |         |               |
|-----------|-------------|-------------------|-------|---------|---------------|
| 041551063 | 15 联通 CP001 | 2016 年 1 月<br>4 日 | 99.94 | 100,000 | 9,994,382.90  |
| 合计        |             |                   |       | 162,000 | 16,192,074.76 |

#### 7.4.4.3.2 交易所市场债券正回购

于本报告期末，本基金无从事交易所市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

### § 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            | 49,979,905.59  | 32.11         |
|    | 其中：债券             | 49,979,905.59  | 32.11         |
|    | 资产支持证券            | -              | 0.00          |
| 2  | 买入返售金融资产          | 54,600,521.90  | 35.08         |
|    | 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      | 50,153,290.34  | 32.22         |
| 4  | 其他各项资产            | 909,923.93     | 0.58          |
| 5  | 合计                | 155,643,641.76 | 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 |                | 10.41          |
|    | 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 | 16,037,791.98  | 11.51          |
|    | 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

本基金合同约定：“除发生巨额赎回的情况外，本基金债券正回购的资产余额在每个交易日均不得超过基金资产净值的 20%；因发生巨额赎回致使本基金债券正回购的资金余额超过基金资产净值 20% 的，基金管理人应当在 5 个交易日内进行调整”。

### 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    | 85  |
| 报告期内投资组合平均剩余期限最高值 | 112 |
| 报告期内投资组合平均剩余期限最低值 | 22  |

#### 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。

#### 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比例 (%) | 各期限负债占基金资产净值比例 (%) |
|----|------------------------|--------------------|--------------------|
| 1  | 30 天以内                 | 60.82              | 11.51              |
|    | 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           | 7.17               | 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           | 7.18               | 0.00               |
|    | 其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债 | 0.00               | 0.00               |
| 4  | 90 天(含)—180 天          | 7.18               | 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)      | 28.70              | 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                     | 111.05             | 11.51              |

### 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      | -             | 0.00          |
| 2  | 央行票据      | -             | 0.00          |
| 3  | 金融债券      | 9,994,932.57  | 7.17          |
|    | 其中：政策性金融债 | 9,994,932.57  | 7.17          |
| 4  | 企业债券      | -             | 0.00          |
| 5  | 企业短期融资券   | 39,984,973.02 | 28.70         |

|    |                      |               |       |
|----|----------------------|---------------|-------|
| 6  | 中期票据                 | -             | 0.00  |
| 7  | 同业存单                 | -             | 0.00  |
| 8  | 其他                   | -             | 0.00  |
| 9  | 合计                   | 49,979,905.59 | 35.87 |
| 10 | 剩余存续期超过 397 天的浮动利率债券 | -             | 0.00  |

#### 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  | 041556027 | 15 长沙先导 CP001 | 100,000 | 9,997,330.61 | 7.17          |
| 2  | 041559058 | 15 天富 CP001   | 100,000 | 9,996,982.32 | 7.17          |
| 3  | 011526003 | 15 中金集 SCP003 | 100,000 | 9,996,277.19 | 7.17          |
| 4  | 150403    | 15 农发 03      | 100,000 | 9,994,932.57 | 7.17          |
| 5  | 041551063 | 15 联通 CP001   | 100,000 | 9,994,382.90 | 7.17          |

#### 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 | 35       |
| 报告期内偏离度的最高值                   | 0.3510%  |
| 报告期内偏离度的最低值                   | -0.0421% |
| 报告期内每个交易日偏离度的绝对值的简单平均值        | 0.1445%  |

#### 8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券投资明细

本基金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    | 909,923.93 |
| 4 | 应收申购款   | -          |
| 5 | 其他应收款   | -          |
| 6 | 待摊费用    | -          |
| 7 | 其他      | -          |
| 8 | 合计      | 909,923.93 |

#### 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 |
| 大成丰财宝货币 A | 7,449    | 9,947.70      | 3,041,075.33  | 4.10%  | 71,059,351.31 | 95.90% |
| 大成丰财宝货币 B | 2        | 32,620,121.64 | 60,227,066.46 | 92.32% | 5,013,176.81  | 7.68%  |
| 合计        | 7,451    | 18,700.94     | 63,268,141.79 | 45.41% | 76,072,528.12 | 54.59% |

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。

#### 9.1 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 | 大成丰财宝货币 A | 118,280.80 | 0.1596%  |
|                  | 大成丰财宝货币 B | -          | 0.0000%  |
|                  | 合计        | 118,280.80 | 0.0849%  |

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）。

#### 9.2 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 | 大成丰财宝货币 A | 0 |
|                                | 大成丰财宝货币 B | 0 |
|                                | 合计        | 0 |
| 本基金基金经理持有本开放式基金                | 大成丰财宝货币 A | 0 |
|                                | 大成丰财宝货币 B | 0 |
|                                | 合计        | 0 |

## § 10 开放式基金份额变动

单位：份

|                                | 大成丰财宝货币<br>A     | 大成丰财宝货币 B      |
|--------------------------------|------------------|----------------|
| 基金合同生效日（2014 年 6 月 18 日）基金份额总额 | 791,790,120.45   | 219,866,894.60 |
| 本报告期期初基金份额总额                   | 262,079,569.31   | 23,638,506.77  |
| 本报告期基金总申购份额                    | 817,818,459.69   | 161,066,161.72 |
| 减：本报告期基金总赎回份额                  | 1,005,797,602.36 | 119,464,425.22 |
| 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                   | 74,100,426.64    | 65,240,243.27  |

## § 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 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。

3、基金管理人于 2015 年 5 月 5 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六次会议审议通过，刘明先生不再担任公司副总经理。



4、基金管理人于 2015 年 5 月 16 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七次会议审议通过，肖冰先生不再担任公司副总经理。

5、基金管理人于 2015 年 10 月 15 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十一次会议审议通过，杨春明先生不再担任公司副总经理职务。

6、基金管理人分别于 2015 年 10 月 16 日、10 月 30 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十次会议审议通过，周立新先生、温志敏先生担任公司副总经理职务。

## 二、基金托管人在本报告期内重大人事变动情况：

2015 年 4 月，李爱华先生不再担任中国银行股份有限公司托管业务部总经理职务。上述人事变动已按相关规定备案、公告。

### 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普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)，本年度应支付的审计费用为 60,000.00 元。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 | 股票交易 | 应支付该券商的佣金 | 备注 |
|------|------|------|-----------|----|
|------|------|------|-----------|----|

|      | 数量 | 成交金额 | 占当期股票<br>成交总额的比<br>例 | 佣金 | 占当期佣金<br>总量的比例 |   |
|------|----|------|----------------------|----|----------------|---|
| 安信证券 | 2  | -    | 0.00%                | -  | 0.00%          | - |
| 渤海证券 | 2  | -    | 0.00%                | -  | 0.00%          | - |
| 财富证券 | 1  | -    | 0.00%                | -  | 0.00%          | - |
| 长城证券 | 1  | -    | 0.00%                | -  | 0.00%          | - |
| 长江证券 | 1  | -    | 0.00%                | -  | 0.00%          | - |
| 东方证券 | 1  | -    | 0.00%                | -  | 0.00%          | - |
| 东海证券 | 1  | -    | 0.00%                | -  | 0.00%          | - |
| 东莞证券 | 1  | -    | 0.00%                | -  | 0.00%          | - |
| 东吴证券 | 1  | -    | 0.00%                | -  | 0.00%          | - |
| 光大证券 | 2  | -    | 0.00%                | -  | 0.00%          | - |
| 广发证券 | 1  | -    | 0.00%                | -  | 0.00%          | - |
| 广州证券 | 1  | -    | 0.00%                | -  | 0.00%          | - |
| 国都证券 | 1  | -    | 0.00%                | -  | 0.00%          | - |
| 国海证券 | 1  | -    | 0.00%                | -  | 0.00%          | - |
| 国泰君安 | 1  | -    | 0.00%                | -  | 0.00%          | - |
| 国信证券 | 1  | -    | 0.00%                | -  | 0.00%          | - |
| 海通证券 | 2  | -    | 0.00%                | -  | 0.00%          | - |
| 华宝证券 | 1  | -    | 0.00%                | -  | 0.00%          | - |
| 华福证券 | 1  | -    | 0.00%                | -  | 0.00%          | - |
| 华林证券 | 1  | -    | 0.00%                | -  | 0.00%          | - |
| 华泰证券 | 2  | -    | 0.00%                | -  | 0.00%          | - |
| 华鑫证券 | 1  | -    | 0.00%                | -  | 0.00%          | - |
| 江海证券 | 1  | -    | 0.00%                | -  | 0.00%          | - |
| 民生证券 | 1  | -    | 0.00%                | -  | 0.00%          | - |
| 民族证券 | 1  | -    | 0.00%                | -  | 0.00%          | - |
| 中泰证券 | 2  | -    | 0.00%                | -  | 0.00%          | - |
| 申银万国 | 1  | -    | 0.00%                | -  | 0.00%          | - |
| 天源证券 | 1  | -    | 0.00%                | -  | 0.00%          | - |
| 万和证券 | 1  | -    | 0.00%                | -  | 0.00%          | - |
| 万联证券 | 1  | -    | 0.00%                | -  | 0.00%          | - |
| 西南证券 | 1  | -    | 0.00%                | -  | 0.00%          | - |
| 湘财证券 | 1  | -    | 0.00%                | -  | 0.00%          | - |
| 银河证券 | 1  | -    | 0.00%                | -  | 0.00%          | - |

|      |   |   |       |   |       |   |
|------|---|---|-------|---|-------|---|
| 英大证券 | 1 | - | 0.00% | - | 0.00% | - |
| 招商证券 | 2 | - | 0.00% | - | 0.00% | - |
| 中航证券 | 1 | - | 0.00% | - | 0.00% | - |
| 中金公司 | 2 | - | 0.00% | - | 0.00% | - |
| 中投证券 | 3 | - | 0.00% | - | 0.00% | - |
| 中信证券 | 2 | - | 0.00% | - | 0.00% | - |
| 中银国际 | 1 | - | 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：

本报告期内本基金新增交易单元：长城证券。

本报告期内本基金退租交易单元：万和证券。

#### 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

无。

#### 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

无。

大成基金管理有限公司  
2016 年 3 月 26 日