

大成月月盈短期理财债券型证券投资基金
2016 年半年度报告
2016 年 6 月 30 日

基金管理人：大成基金管理有限公司

基金托管人：中国银行股份有限公司

送出日期：2016 年 8 月 25 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。

基金托管人中国银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2016 年 8 月 23 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 2016 年 01 月 01 日起至 06 月 30 日止。

1.2 目录

| | |
|--|-----------|
| § 1 重要提示及目录 | 2 |
| 1.1 重要提示..... | 2 |
| 1.2 目录..... | 3 |
| § 2 基金简介 | 5 |
| 2.1 基金基本情况..... | 5 |
| 2.2 基金产品说明..... | 5 |
| 2.3 基金管理人和基金托管人..... | 5 |
| 2.4 信息披露方式..... | 6 |
| 2.5 其他相关资料..... | 6 |
| § 3 主要财务指标和基金净值表现 | 6 |
| 3.1 主要会计数据和财务指标..... | 6 |
| 3.2 基金净值表现..... | 6 |
| § 4 管理人报告 | 9 |
| 4.1 基金管理人及基金经理情况..... | 9 |
| 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明..... | 11 |
| 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明..... | 11 |
| 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..... | 12 |
| 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望..... | 13 |
| 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明..... | 13 |
| 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明..... | 14 |
| 4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明..... | 14 |
| § 5 托管人报告 | 14 |
| 5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明..... | 14 |
| 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..... | 14 |
| 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..... | 14 |
| § 6 半年度财务会计报告（未经审计） | 15 |
| 6.1 资产负债表..... | 15 |
| 6.2 利润表..... | 16 |
| 6.3 所有者权益（基金净值）变动表..... | 17 |
| 6.4 报表附注..... | 18 |
| § 7 投资组合报告 | 34 |
| 7.1 期末基金资产组合情况..... | 34 |
| 7.2 债券回购融资情况..... | 34 |
| 7.3 基金投资组合平均剩余期限..... | 35 |
| 7.4 报告期内投资组合平均剩余存续期超过 240 天情况说明..... | 35 |
| 7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合..... | 35 |
| 7.6 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..... | 36 |
| 7.7 “影子定价”与“摊余成本法”确定的基金资产净值的偏离..... | 36 |
| 7.8 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..... | 37 |
| 7.9 投资组合报告附注..... | 37 |
| § 8 基金份额持有人信息 | 37 |
| 8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构..... | 37 |
| 8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况..... | 38 |

| | |
|--|-----------|
| 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..... | 38 |
| § 9 开放式基金份额变动..... | 39 |
| § 10 重大事件揭示..... | 39 |
| 10.1 基金份额持有人大会决议..... | 39 |
| 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..... | 39 |
| 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼..... | 39 |
| 10.4 基金投资策略的改变..... | 40 |
| 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况..... | 40 |
| 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..... | 40 |
| 10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况..... | 40 |
| 10.8 偏离度绝对值超过 0.5%的情况..... | 42 |
| 10.9 其他重大事件..... | 42 |
| § 11 影响投资者决策的其他重要信息..... | 45 |
| § 12 备查文件目录..... | 45 |
| 12.1 备查文件目录..... | 45 |
| 12.2 存放地点..... | 45 |
| 12.3 查阅方式..... | 46 |

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

| | | | |
|-----------------|--------------------|--------------------|-----------------|
| 基金名称 | 大成月月盈短期理财债券型证券投资基金 | | |
| 基金简称 | 大成月月盈短期理财债券 | | |
| 基金主代码 | 090023 | | |
| 交易代码 | 090023 | | |
| 基金运作方式 | 契约型开放式 | | |
| 基金合同生效日 | 2012 年 11 月 29 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 | 1,314,975,940.75 份 | | |
| 基金合同存续期 | 不定期 | | |
| 下属分级基金的基金简称: | 大成月月盈短期理财债券 A | 大成月月盈短期理财债券 B | 大成月月盈短期理财债券 E |
| 下属分级基金的交易代码: | 090023 | 091023 | 001516 |
| 报告期末下属分级基金的份额总额 | 34,776,155.26 份 | 1,257,630,397.66 份 | 22,569,387.83 份 |

2.2 基金产品说明

| | |
|--------|--|
| 投资目标 | 以保持基金资产的安全性和适当流动性为首要目标，追求高于业绩比较基准的稳定收益。 |
| 投资策略 | 本基金通过平均剩余期限决策、类属配置、品种选择和其他衍生工具投资策略四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 | 七天通知存款税后利率 |
| 风险收益特征 | 本基金属于短期理财债券型证券投资基金，长期风险收益水平低于股票型基金、混合型基金，及普通债券型证券投资基金。 |

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 |
| 注册地址 | | 深圳市福田区深南大道 7088 号招商银行大厦 32 层 | 北京市西城区复兴门内大街 1 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 1 号 |
| 邮政编码 | | 518040 | 100818 |
| 法定代表人 | | 刘卓 | 田国立 |

2.4 信息披露方式

| | |
|----------------------|--------------------------|
| 本基金选定的信息披露报纸名称 | 《证券时报》、《上海证券报》、《中国证券报》 |
| 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 | 基金管理人及基金托管人住所 |

2.5 其他相关资料

| 项目 | 名称 | 办公地址 |
|--------|------------|------------------------------|
| 注册登记机构 | 大成基金管理有限公司 | 深圳市福田区深南大道 7088 号招商银行大厦 32 层 |

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

| 基金级别 | 大成月月盈短期理财债券 A | 大成月月盈短期理财债券 B | 大成月月盈短期理财债券 E |
|---------------|-----------------------------|-----------------------------|-----------------------------|
| 3.1.1 期间数据和指标 | 报告期(2016年1月1日 - 2016年6月30日) | 报告期(2016年1月1日 - 2016年6月30日) | 报告期(2016年1月1日 - 2016年6月30日) |
| 本期已实现收益 | 711,858.84 | 4,660,957.22 | 672,713.14 |
| 本期利润 | 711,858.84 | 4,660,957.22 | 672,713.14 |
| 本期净值收益率 | 1.4656% | 1.6150% | 1.4500% |
| 3.1.2 期末数据和指标 | 报告期末(2016年6月30日) | | |
| 期末基金资产净值 | 34,776,155.26 | 1,257,630,397.66 | 22,569,387.83 |
| 期末基金份额净值 | 1.0000 | 1.0000 | 1.0000 |
| 3.1.3 累计期末指标 | 报告期末(2016年6月30日) | | |
| 累计净值收益率 | 17.5742% | 18.8051% | 3.6239% |

注：本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益，由于本基金采用摊余成本法核算，因此，公允价值变动收益为零，本期已实现收益和本期利润的金额相等。

3.2 基金净值表现

3.2.1 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

大成月月盈短期理财债券 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 | 0.2323% | 0.0021% | 0.1107% | 0.0000% | 0.1216% | 0.0021% |
| 过去三个月 | 0.6549% | 0.0018% | 0.3357% | 0.0000% | 0.3192% | 0.0018% |
| 过去六个月 | 1.4656% | 0.0047% | 0.6713% | 0.0000% | 0.7943% | 0.0047% |
| 过去一年 | 3.5280% | 0.0094% | 1.3519% | 0.0000% | 2.1761% | 0.0094% |
| 过去三年 | 15.1767% | 0.0330% | 4.0519% | 0.0000% | 11.1248% | 0.0330% |
| 自基金合同生效起至今 | 17.5742% | 0.0305% | 4.8434% | 0.0000% | 12.7308% | 0.0305% |

大成月月盈短期理财债券 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 | 0.2591% | 0.0021% | 0.1107% | 0.0000% | 0.1484% | 0.0021% |
| 过去三个月 | 0.7304% | 0.0018% | 0.3357% | 0.0000% | 0.3947% | 0.0018% |
| 过去六个月 | 1.6150% | 0.0047% | 0.6713% | 0.0000% | 0.9437% | 0.0047% |
| 过去一年 | 3.8315% | 0.0094% | 1.3519% | 0.0000% | 2.4796% | 0.0094% |
| 过去三年 | 16.1815% | 0.0330% | 4.0519% | 0.0000% | 12.1296% | 0.0330% |
| 自基金合同生效起至今 | 18.8051% | 0.0305% | 4.8434% | 0.0000% | 13.9617% | 0.0305% |

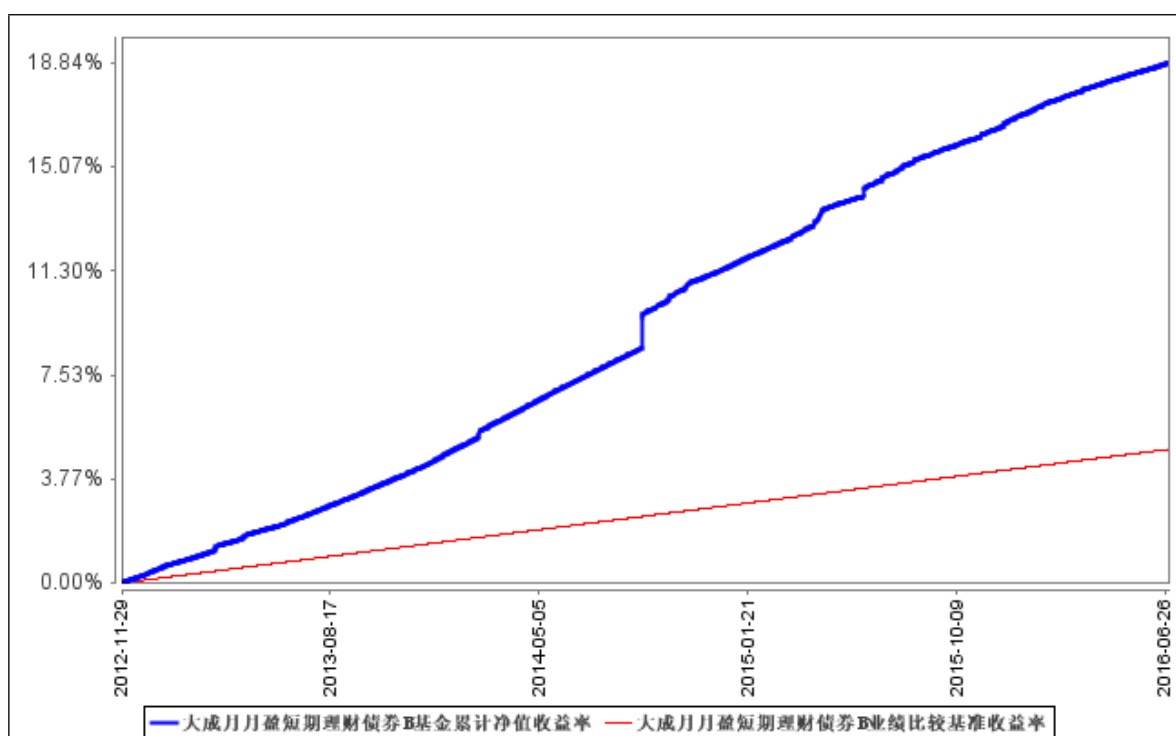
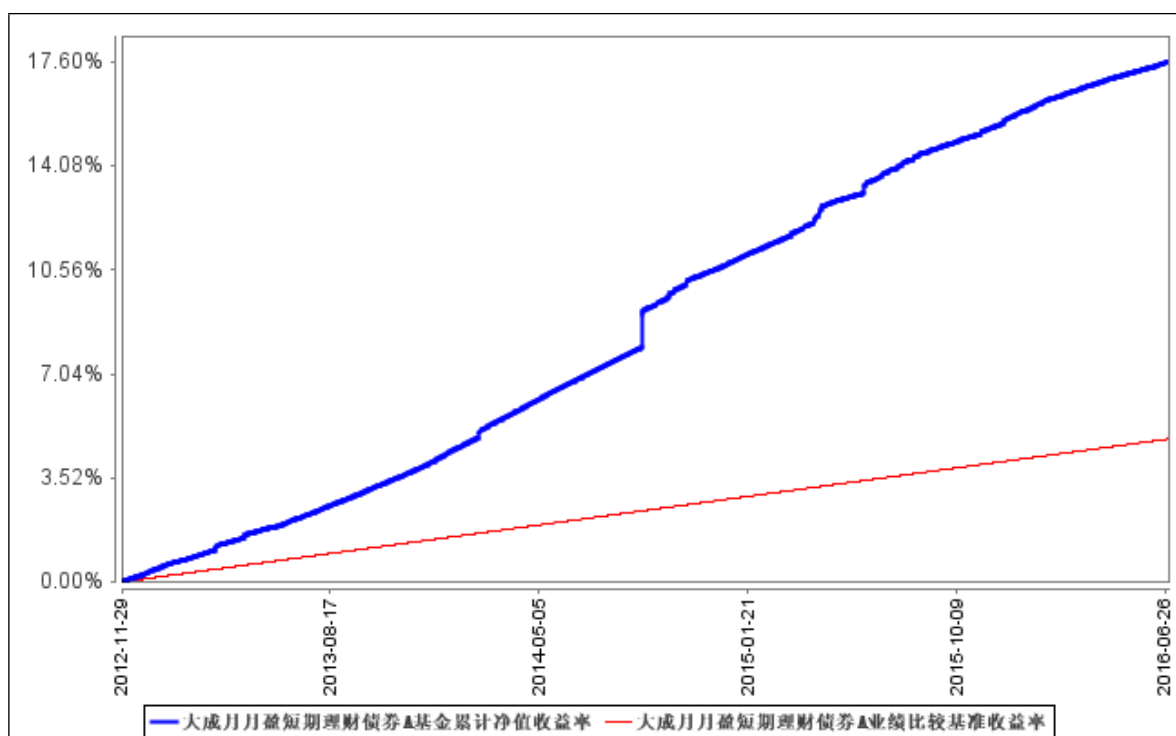
大成月月盈短期理财债券 E

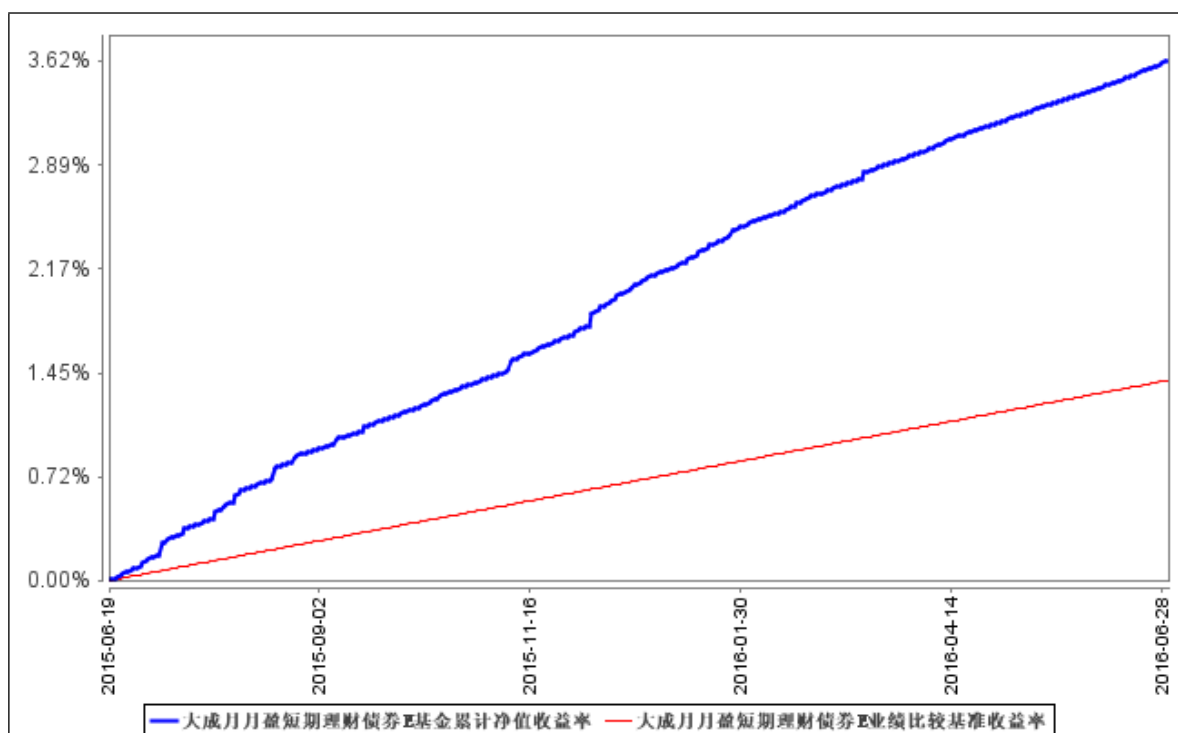
| 阶段 | 份额净值 收益率① | 份额净值 收益率标 准差② | 业绩比较 基准收益 率③ | 业绩比较基 准收益率标 准差④ | ①—③ | ②—④ |
|------------|--------------|---------------------|--------------------|-----------------------|---------|---------|
| 过去一个月 | 0.2209% | 0.0021% | 0.1107% | 0.0000% | 0.1102% | 0.0021% |
| 过去三个月 | 0.6412% | 0.0018% | 0.3357% | 0.0000% | 0.3055% | 0.0018% |
| 过去六个月 | 1.4500% | 0.0047% | 0.6713% | 0.0000% | 0.7787% | 0.0047% |
| 自基金合同生效起至今 | 3.6239% | 0.0093% | 1.3962% | 0.0000% | 2.2277% | 0.0093% |

注：1、本基金根据每日基金收益情况，以基金净收益为基准，为投资者每日计算当日收益并分配，并在运作期期末集中支付。

2、本表净值收益率的计算所采取的运作周期，是按各统计时间段计算以基金合同生效日为起始日并持有至报告期末的基金份额所经历的运作周期。

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，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。截至报告期末，本基金的各项投资比例已达到基金合同中规定的各项比例。

2. 本基金自 2015 年 6 月 16 日起增设 E 类基金份额（E 类份额基金代码：001516）。

§ 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。目前公司由三家股东组成，分别为中泰信托有限责任公司(50%)、光大证券股份有限公司(25%)、中国银河投资管理有限公司(25%)。截至2016年6月30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61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、大成睿景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、大成景辉灵活配置混合型证券投资基金、大成中证 360 互联网+大数据 100 指数型证券投资基金、大成慧成货币市场基金、大成趋势回报灵活配置混合型证券投资基金、大成国家安全主题灵活配置混合型证券投资基金、大成景荣保本混合型证券投资基金和大成景华一年定期开放债券型证券投资基金等。

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 | | |
| 张文平先生 | 本基金基金经理 | 2015 年 7 月 1 日 | - | 5 年 | 南京大学管理学硕士, 2009 年 10 月至 2011 年 5 月就职于 |

| | | | | | |
|--|---|--|--|--|---|
| | 理 | | | | 毕马威企业咨询有限公司南京分公司审计部；2011 年起加入大成基金管理有限公司，历任固定收益部助理研究员。2013 年 11 月 25 日至 2015 年 3 月 5 日担任大成景祥分级债券型证券投资基金基金经理助理。2015 年 3 月 7 日起担任大成景祥分级债券型证券投资基金基金经理。2015 年 6 月 23 日起任大成景裕灵活配置混合型证券投资基金基金经理。2015 年 7 月 1 日起任大成现金宝场内实时申赎货币市场基金基金经理及大成月月盈短期理财债券型证券投资基金基金经理。2015 年 11 月 24 日起任大成景沛灵活配置混合型证券投资基金基金经理。2016 年 8 月 6 日起任大成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。 |
|--|---|--|--|--|---|

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》、《关于大成月月盈短期理财债券型证券投资基金基金合同》和其他有关法律法规的规定，在基金管理运作中，关于大成月月盈短期理财债券型证券投资基金的投资范围、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些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。2016 年上半年公司旗下主动投资组合间股票交易存在 9 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，但不存在参与交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量超过该股当日成交量 5% 的情形；投资组合间存在 2 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

2016 年上半年经济增长依然疲弱，一季度和二季度 GDP 同比增速仅 6.7%，明显低于 2015 年的增长水平。工业生产和固定资产投资持续低迷。通胀方面，2016 年上半年 CPI 同比上涨 2.1%，总体可控。一二线房地产市场经历了上半年的狂飙之后，房地产销售初显疲态，带动房地产投资开始回落。政策方面，央行主要通过公开市场操作调控货币市场，维持货币市场稳定，此外，央行对商业银行实施了 MPA 考核，对一季度末资金面造成了明显干扰。隔夜回购利率均值在 2% 附近，7 天回购利率均值约为 2.45%，其中一季度末和二季度末资金相对较为紧张。

尽管货币政策总体宽松，但是 MPA 考核和信用违约的干扰使得上半年债券市场波动较大。1 年期金融债收益率先上行约 40-50bp，后下行 50-60bp，高等级短期融资券先下行约 25bp，后受一季度末资金面紧张影响，上行约 40bp，随着资金面逐步宽松，短融又逐步下行约 30bp。受新的货币基金监管政策和投资者对信用风险担忧的影响，低等级短期融资券表现弱于高等级品种。此外，产能过剩行业的短期融资券看法出现分化。除一季度末和二季度末，同业存款报价多数为减点。

上半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，本基金在和持有人积极沟通的基础上，灵活管理组合现金流的到期分布情况，并提高了短融的仓位。并把握半年末等关键时点进行了银行存款和逆回购投资。此外，本基金在一级市场进行了积极的投标，获取了良好的投资收益。

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 1.4656%，B 类净值收益率 1.6150%，E 类净值收益率 1.4500%，期间业绩比较基准收益率为 0.6713%。

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 年下半年，尽管当前债券收益率较低，但在经济疲弱、风险偏好较低以及宽松货币政策的背景下，债券市场总体面临的风险较小。本基金将继续维持稳健操作的风格，基于市场状况以及投资人结构变化的判断，合理安排逆回购、存款、短融及金融债的投资比例，以期持有人获得稳定安全的回报。

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情况，以基金净收益为基准，为投资者每日计算当日收益并分配，并在运作期期末集中支付。本报告期内本基金应分配利润 6,045,529.20 元，报告期内已分配利润 6,045,529.20 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”）在大成月月盈短期理财债券型证券投资基金（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 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：大成月月盈短期理财债券型证券投资基金

报告截止日：2016 年 6 月 30 日

单位：人民币元

| 资产 | 附注号 | 本期末 2016 年 6 月 30 日 | 上年度末 2015 年 12 月 31 日 |
|-----------------|------------|--------------------------------|----------------------------------|
| 资产： | | | |
| 银行存款 | 6.4.3.1 | 668,181,186.61 | 84,156,211.74 |
| 结算备付金 | | - | - |
| 存出保证金 | | - | - |
| 交易性金融资产 | 6.4.3.2 | 654,728,034.26 | 44,957,741.09 |
| 其中：股票投资 | | - | - |
| 基金投资 | | - | - |
| 债券投资 | | 654,728,034.26 | 44,957,741.09 |
| 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 | 475,226,505.00 | 69,800,584.70 |
| 应收证券清算款 | | - | - |
| 应收利息 | 6.4.3.5 | 4,518,680.61 | 1,029,355.45 |
| 应收股利 | | - | - |
| 应收申购款 | | 10.00 | - |
| 递延所得税资产 | | - | - |
| 其他资产 | 6.4.3.6 | - | - |
| 资产总计 | | 1,802,654,416.48 | 199,943,892.98 |
| 负债和所有者权益 | 附注号 | 本期末 2016 年 6 月 30 日 | 上年度末 2015 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 | | 484,368,648.09 | 3,999,878.00 |
| 应付证券清算款 | | - | - |
| 应付赎回款 | | - | - |
| 应付管理人报酬 | | 281,408.18 | 40,360.35 |
| 应付托管费 | | 83,380.22 | 11,958.60 |
| 应付销售服务费 | | 25,044.46 | 32,583.68 |
| 应付交易费用 | 6.4.3.7 | 29,620.57 | 28,948.96 |
| 应交税费 | | - | - |
| 应付利息 | | 77,587.01 | 304.47 |
| 应付利润 | | 2,609,677.98 | 331,151.34 |

| | | | |
|---------------|----------|------------------|----------------|
| 递延所得税负债 | | - | - |
| 其他负债 | 6.4.3.8 | 203,109.22 | 159,000.00 |
| 负债合计 | | 487,678,475.73 | 4,604,185.40 |
| 所有者权益： | | | |
| 实收基金 | 6.4.3.9 | 1,314,975,940.75 | 195,339,707.58 |
| 未分配利润 | 6.4.3.10 | - | - |
| 所有者权益合计 | | 1,314,975,940.75 | 195,339,707.58 |
| 负债和所有者权益总计 | | 1,802,654,416.48 | 199,943,892.98 |

注：报告截止日 2016 年 6 月 30 日，基金份额净值 1.0000 元，基金份额总额 1,314,975,940.75 份，其中 A 类基金份额总额为 34,776,155.26 份，B 类基金份额的份额总额为 1,257,630,397.66 份，E 类基金份额的份额总额为 22,569,387.83。

6.2 利润表

会计主体：大成月月盈短期理财债券型证券投资基金

本报告期：2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日

单位：人民币元

| 项目 | 附注号 | 本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日 | 上年度可比期间 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日 |
|------------------------|------------|--|---|
| 一、收入 | | 7,567,952.86 | 6,910,020.40 |
| 1. 利息收入 | | 6,763,402.60 | 5,877,831.42 |
| 其中：存款利息收入 | 6.4.3.11 | 1,810,539.56 | 563,927.44 |
| 债券利息收入 | | 1,930,069.28 | 3,416,297.62 |
| 资产支持证券利息收入 | | - | - |
| 买入返售金融资产收入 | | 3,022,793.76 | 1,897,606.36 |
| 其他利息收入 | | - | - |
| 2. 投资收益（损失以“-”填列） | | 804,550.26 | 1,032,188.98 |
| 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 | 804,550.26 | 1,032,188.98 |
| 资产支持证券投资收益 | 6.4.3.13.1 | - | - |
| 贵金属投资收益 | 6.4.3.14 | - | - |
| 衍生工具收益 | 6.4.3.15 | - | - |
| 股利收益 | 6.4.3.16 | - | - |
| 3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列） | 6.4.3.17 | - | - |
| 4. 汇兑收益（损失以“-”号填列） | | - | - |
| 5. 其他收入（损失以“-”号填列） | 6.4.3.18 | - | - |
| 减：二、费用 | | 1,522,423.66 | 1,400,853.25 |

| | | | |
|----------------------------|-----------|---------------------|---------------------|
| 1. 管理人报酬 | 6.4.6.2.1 | 547,328.77 | 325,299.62 |
| 2. 托管费 | 6.4.6.2.2 | 162,171.40 | 96,385.10 |
| 3. 销售服务费 | 6.4.6.2.3 | 155,771.80 | 100,424.65 |
| 4. 交易费用 | 6.4.3.19 | - | - |
| 5. 利息支出 | | 464,984.71 | 673,843.45 |
| 其中：卖出回购金融资产支出 | | 464,984.71 | 673,843.45 |
| 6. 其他费用 | 6.4.3.20 | 192,166.98 | 204,900.43 |
| 三、利润总额（亏损总额以“-”号填列） | | 6,045,529.20 | 5,509,167.15 |
| 减：所得税费用 | | - | - |
| 四、净利润（净亏损以“-”号填列） | | 6,045,529.20 | 5,509,167.15 |

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：大成月月盈短期理财债券型证券投资基金

本报告期：2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 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） | 195,339,707.58 | - | 195,339,707.58 |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润） | - | 6,045,529.20 | 6,045,529.20 |
| 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） | 1,119,636,233.17 | - | 1,119,636,233.17 |
| 其中：1. 基金申购款 | 1,690,199,210.61 | - | 1,690,199,210.61 |
| 2. 基金赎回款 | -570,562,977.44 | - | -570,562,977.44 |
| 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） | - | -6,045,529.20 | -6,045,529.20 |
| 五、期末所有者权益（基金净值） | 1,314,975,940.75 | - | 1,314,975,940.75 |
| 项目 | 上年度可比期间 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日 | | |

项列示如下：

(1) 于 2016 年 5 月 1 日前，以发行基金方式募集资金不属于营业税征收范围，不征收营业税。对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入免征营业税。自 2016 年 5 月 1 日起，金融业由缴纳营业税改为缴纳增值税。对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税，对金融同业往来利息收入亦免征增值税。

(2) 对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。

(3) 对基金取得的企业债券利息收入，应由发行债券的企业在向基金支付利息时代扣代缴 20% 的个人所得税。对基金从上市公司取得的股息红利所得，持股期限在 1 个月以内(含 1 个月)的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在 1 个月以上至 1 年(含 1 年)的，暂减按 50% 计入应纳税所得额；持股期限超过 1 年的，于 2015 年 9 月 8 日前暂减按 25% 计入应纳税所得额，自 2015 年 9 月 8 日起，暂免征收个人所得税。对基金持有的上市公司限售股，解禁后取得的股息、红利收入，按照上述规定计算纳税，持股时间自解禁日起计算；解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按 50% 计入应纳税所得额。上述所得统一适用 20% 的税率计征个人所得税。

(4) 基金卖出股票按 0.1% 的税率缴纳股票交易印花税，买入股票不征收股票交易印花税。

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 2016 年 6 月 30 日 |
|----------------|------------------------|
| 活期存款 | 2,181,186.61 |
| 定期存款 | - |
| 其中：存款期限 1-3 个月 | - |
| 存款期限 3 个月以上 | - |
| 其他存款 | 666,000,000.00 |
| 合计： | 668,181,186.61 |

注：其他存款为根据协议可提前支取且没有利息损失的协议存款。

6.4.3.2 交易性金融资产

单位：人民币元

| 项目 | 本期末 2016 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 | 654,728,034.26 | 655,026,500.00 | 298,465.74 | 0.0227% |
| | 合计 | 654,728,034.26 | 655,026,500.00 | 298,465.74 | 0.0227% |

注：1. 偏离金额=影子定价-摊余成本；

2. 偏离度=偏离金额/摊余成本法确定的基金资产净值。

6.4.3.3 衍生金融资产/负债

本基金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 2016年6月30日 | |
|------------|-------------------|-----------|
| | 账面余额 | 其中：买断式逆回购 |
| 买入返售证券_交易所 | 85,225,000.00 | - |
| 买入返售证券_银行间 | 390,001,505.00 | - |
| 合计 | 475,226,505.00 | - |

6.4.3.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金于本期末无买断式逆回购交易中取得的债券。

6.4.3.5 应收利息

单位：人民币元

| 项目 | 本期末 2016年6月30日 |
|------------|-------------------|
| 应收活期存款利息 | 2,450.55 |
| 应收定期存款利息 | - |
| 应收其他存款利息 | 1,174,369.85 |
| 应收结算备付金利息 | - |
| 应收债券利息 | 2,464,880.20 |
| 应收买入返售证券利息 | 876,980.01 |
| 应收申购款利息 | - |
| 应收黄金合约拆借孳息 | - |
| 其他 | - |
| 合计 | 4,518,680.61 |

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 2016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 | 29,620.57 |
| 合计 | 29,620.57 |

6.4.3.8 其他负债

单位：人民币元

| 项目 | 本期末 2016年6月30日 |
|-------------|-------------------|
| 应付券商交易单元保证金 | - |
| 应付赎回费 | - |
| 预提费用 | 203,109.22 |
| 合计 | 203,109.22 |

6.4.3.9 实收基金

金额单位：人民币元

| 大成月月盈短期理财债券 A | | |
|---------------|----------------------------|-----------------|
| 项目 | 本期 2016年1月1日至2016年6月30日 | |
| | 基金份额（份） | 账面金额 |
| 上年度末 | 65,117,111.37 | 65,117,111.37 |
| 本期申购 | 116,971,705.66 | 116,971,705.66 |
| 本期赎回（以“-”号填列） | -147,312,661.77 | -147,312,661.77 |
| 本期末 | 34,776,155.26 | 34,776,155.26 |

金额单位：人民币元

| 大成月月盈短期理财债券 B | | |
|---------------|----------------------------|------------------|
| 项目 | 本期 2016年1月1日至2016年6月30日 | |
| | 基金份额（份） | 账面金额 |
| 上年度末 | 46,981,111.52 | 46,981,111.52 |
| 本期申购 | 1,446,775,915.04 | 1,446,775,915.04 |

| | | |
|---------------|------------------|------------------|
| 本期赎回(以“-”号填列) | -236,126,628.90 | -236,126,628.90 |
| 本期末 | 1,257,630,397.66 | 1,257,630,397.66 |

金额单位：人民币元

| 大成月月盈短期理财债券 E | | |
|---------------|---------------------------------------|-----------------|
| 项目 | 本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日 | |
| | 基金份额（份） | 账面金额 |
| 上年度末 | 83,241,484.69 | 83,241,484.69 |
| 本期申购 | 126,451,589.91 | 126,451,589.91 |
| 本期赎回(以“-”号填列) | -187,123,686.77 | -187,123,686.77 |
| 本期末 | 22,569,387.83 | 22,569,387.83 |

注：申购份额含红利再投和因份额升降级导致的强制调增份额，赎回份额含因份额升降级导致的强制调减份额。

6.4.3.10 未分配利润

单位：人民币元

| 大成月月盈短期理财债券 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 | 711,858.84 | - | 711,858.84 |
| 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 | -711,858.84 | - | -711,858.84 |
| 本期末 | - | - | - |

单位：人民币元

| 大成月月盈短期理财债券 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 | 4,660,957.22 | - | 4,660,957.22 |
| 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 | -4,660,957.22 | - | -4,660,957.22 |
| 本期末 | - | - | - |

单位：人民币元

| 大成月月盈短期理财债券 E | | | |
|----------------|-------------|-------|-------------|
| 项目 | 已实现部分 | 未实现部分 | 未分配利润合计 |
| 上年度末 | - | - | - |
| 本期利润 | 672,713.14 | - | 672,713.14 |
| 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 | -672,713.14 | - | -672,713.14 |
| 本期末 | - | - | - |

6.4.3.11 存款利息收入

单位：人民币元

| 项目 | 本期 |
|-----------|----------------------|
| | 2016年1月1日至2016年6月30日 |
| 活期存款利息收入 | 18,617.93 |
| 定期存款利息收入 | 17,471.99 |
| 其他存款利息收入 | 1,774,449.64 |
| 结算备付金利息收入 | - |
| 其他 | - |
| 合计 | 1,810,539.56 |

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 |
|-------------------------|----------------------|
| | 2016年1月1日至2016年6月30日 |
| 卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额 | 635,697,086.11 |
| 减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额 | 632,855,814.96 |
| 减：应收利息总额 | 2,036,720.89 |
| 买卖债券差价收入 | 804,550.26 |

6.4.3.13.1 资产支持证券投资收益

本报告期内本基金无资产支持证券投资收益。

6.4.3.14 贵金属投资收益

本报告期内本基金无贵金属投资收益。

6.4.3.15 衍生工具收益

本报告期内本基金无衍生工具收益。

6.4.3.16 股利收益

本报告期内本基金无股利收益。

6.4.3.17 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。

6.4.3.18 其他收入

本报告期内本基金无其他收入。

6.4.3.19 交易费用

本报告期内本基金无交易费用。

6.4.3.20 其他费用

单位：人民币元

| 项目 | 本期 |
|--------------|----------------------|
| | 2016年1月1日至2016年6月30日 |
| 审计费用 | 24,863.02 |
| 信息披露费 | 119,344.68 |
| 其他 | 605.00 |
| 上清所债券托管帐户维护费 | 8,950.76 |
| 银行汇划费用 | 29,452.76 |
| 中债登债券托管帐户维护费 | 8,950.76 |
| 合计 | 192,166.98 |

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，本基金并无须作披露的或有事项。

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，本基金并无须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

根据本基金管理人大成基金管理有限公司(以下简称“大成基金”)董事会及股东会的有关决议,大成基金原股东广东证券股份有限公司将所持大成基金 2%股权以拍卖竞买的方式转让给大成基金股东中泰信托有限责任公司。上述股权变更及修改《大成基金管理有限公司公司章程》的工商变更手续已于 2016 年 4 月 25 日在深圳市市场监督管理局办理完毕。

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、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(2016 年 4 月 25 日前) |
| 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:下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.6 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

本报告期内及上年度可比期间本基金无通过关联方交易单元进行的交易。

6.4.6.1 通过关联方交易单元进行的交易

无。

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 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日 | 上年度可比期间 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日 |
|-----------------|--|---|
| 当期发生的基金应支付的管理费 | 547,328.77 | 325,299.62 |
| 其中:支付销售机构的客户维护费 | 35,247.08 | - |

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 0.27%的年费率计提,逐日累计至每月月底,按月支付。其计算公式为:

日管理人报酬=前一日基金资产净值 X 0.27% / 当年天数。

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 |
|----------------|---------------------------------|---------------------------------|
| | 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日 | 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日 |
| 当期发生的基金应支付的托管费 | 162,171.40 | 96,385.10 |

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 0.08% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日托管费=前一日基金资产净值 X 0.08% / 当年天数。

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 | | | |
|----------------|---------------------------------|---------------|---------------|------------|
| | 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日 | | | |
| | 当期发生的基金应支付的销售服务费 | | | |
| | 大成月月盈短期理财债券 A | 大成月月盈短期理财债券 B | 大成月月盈短期理财债券 E | 合计 |
| 大成基金 | 5,775.05 | 14,657.83 | 67,400.97 | 87,833.85 |
| 中国银行 | 49,822.13 | 914.60 | - | 50,736.73 |
| 合计 | 55,597.18 | 15,572.43 | 67,400.97 | 138,570.58 |
| 获得销售服务费的各关联方名称 | 上年度可比期间 | | | |
| | 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日 | | | |
| | 当期发生的基金应支付的销售服务费 | | | |
| | 大成月月盈短期理财债券 A | 大成月月盈短期理财债券 B | 大成月月盈短期理财债券 E | 合计 |
| 大成基金 | 3,388.21 | 7,687.07 | 0.17 | 11,075.45 |
| 中国银行 | 76,478.76 | 1,219.98 | - | 77,698.74 |
| 合计 | 79,866.97 | 8,907.05 | 0.17 | 88,774.19 |

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 类、B 类、E 类基金份额约定的销售服务费年费率分别为 0.30%、0.01%、0.30%。销售服务费的计算公式为：

日销售服务费=前一日基金资产净值 X 约定年费率 / 当年天数。

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 |
|---------------------------------|
| 2016 年 1 月 1 日至 2016 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 |
| - | - | - | - | - | - | - |
| 上年度可比期间 2015 年 1 月 1 日至 2015 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 |
| 中国银行 | - | 20,589,737.26 | - | - | - | - |

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

份额单位：份

| 项目 | 本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日 | | |
|----------------------------------|---------------------------------------|---------------|---------------|
| | 大成月月盈短期理财债券 A | 大成月月盈短期理财债券 B | 大成月月盈短期理财债券 E |
| 基金合同生效日（2012 年 11 月 29 日）持有的基金份额 | - | - | - |
| 期初持有的基金份额 | - | 11,691,583.98 | - |
| 期间申购/买入总份额 | - | 187,971.87 | - |
| 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 | - | 11,879,555.85 | - |
| 期末持有的基金份额占基金总份额比例 | 0.0000% | 0.9000% | 0.0000% |

| 项目 | 上年度可比期间 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日 | | |
|----------------------------------|--|----------------|---------------|
| | 大成月月盈短期理财债券 A | 大成月月盈短期理财债券 B | 大成月月盈短期理财债券 E |
| 基金合同生效日（2012 年 11 月 29 日）持有的基金份额 | - | - | - |
| 期初持有的基金份额 | - | 105,334,706.57 | - |
| 期间申购/买入总份额 | - | 1,664,365.53 | - |
| 期间因拆分变动份额 | - | - | - |
| 减：期间赎回/卖出总份额 | - | 95,554,703.95 | - |

| | | | |
|-----------------------|---------|---------------|---------|
| 期末持有的基金份额 | - | 11,444,368.15 | - |
| 期末持有的基金份额 占基金总份额比例 | 0.0000% | 8.8000% | 0.0000% |

注：本报告期申购 0 份，红利再投资 187,971.87 份。

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

本报告期末及上年度可比期间除基金管理人之外的其他关联方无投资本基金的情况。

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 2016年1月1日至2016年6月30日 | | 上年度可比期间 2015年1月1日至2015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 |
| 中国银行 | 2,181,186.61 | 18,617.93 | 899,970.98 | 8,605.57 |

注：本基金的银行活期存款由基金托管人中国银行保管，按银行同业利率计息。

6.4.6.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本报告期内及上年度可比期间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

本基金本报告期及上年度可比期间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

大成月月盈短期理财债券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 |
|--------------|-------------------|--------------|--------------|----|
| 628,513.71 | 154,750.58 | -71,405.45 | 711,858.84 | - |

大成月月盈短期理财债券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 |
|--------------|-------------------|--------------|--------------|----|
| 1,649,238.51 | 547,996.55 | 2,463,722.16 | 4,660,957.22 | - |

大成月月盈短期理财债券E

| 已按再投资形式转实收基金 | 直接通过应付 赎回款转出金额 | 应付利润 本年变动 | 本期利润分配 合计 | 备注 |
|--------------|-------------------|--------------|--------------|----|
| 265,507.29 | 520,995.92 | -113,790.07 | 672,713.14 | - |

6.4.8 期末（2016 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

本基金本期末无因认购新发/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

本基金本期末无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

截至本报告期末 2016 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 484,368,648.09 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 |
|-----------|----------------|----------|--------|-----------|----------------|
| 011699669 | 16 京汽集 SCP001 | 2016-7-1 | 99.94 | 200,000 | 19,988,943.12 |
| 011699932 | 16 中核工 SCP001 | 2016-7-1 | 99.84 | 900,000 | 89,851,578.52 |
| 011699939 | 16 南京交建 SCP001 | 2016-7-1 | 99.87 | 100,000 | 9,987,034.40 |
| 041654022 | 16 淄博城资 CP001 | 2016-7-1 | 99.80 | 200,000 | 19,960,238.68 |
| 041659003 | 16 义乌国资 CP001 | 2016-7-1 | 100.04 | 100,000 | 10,003,851.49 |
| 111611182 | 16 平安 CD182 | 2016-7-1 | 99.61 | 230,000 | 22,909,420.11 |
| 011699392 | 16 南汇 SCP002 | 2016-7-1 | 100.00 | 100,000 | 9,999,730.85 |
| 140407 | 14 农发 07 | 2016-7-1 | 101.65 | 50,000 | 5,082,525.25 |
| 150215 | 15 国开 15 | 2016-7-1 | 100.01 | 705,000 | 70,504,175.21 |
| 111609138 | 16 浦发 CD138 | 2016-7-1 | 99.95 | 1,000,000 | 99,945,317.12 |
| 011699952 | 16 大渡河 SCP003 | 2016-7-1 | 99.95 | 300,000 | 29,984,772.97 |
| 111608150 | 16 中信 CD150 | 2016-7-1 | 99.60 | 500,000 | 49,802,437.71 |
| 111612054 | 16 北京银行 CD054 | 2016-7-1 | 99.92 | 500,000 | 49,957,967.91 |
| 合计 | - | - | - | 4,885,000 | 487,977,993.34 |

6.4.8.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2016 年 6 月 30 日止，本基金无从事证券交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款的余额。

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

本基金属于短期理财债券型证券投资基金，长期风险收益水平低于股票型基金、混合型基金，及普通债券型证券投资基金的。本基金在日常经营活动中面临的与这些金融工具相关的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金的基金管理人以保持基金资产的安全性和适当流动性为首要目标，追求高于业绩比较基准的稳定收益。

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。

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

6.4.9.2 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、拒绝支付到期本息等情况，导致基金资产损失和收益变化的风险。

本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的银行存款存放在本基金的托管行中国银行，与该银行存款相关的信用风险不重大。其他协议存款存放在民生银行、上海银行及中信银行，与银行存款相关的信用风险不重大。本基金在交易所进行的交易均以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，违约风险可能性很小；

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

本基金的基金管理人建立了信用风险管理流程，通过对投资品种信用等级评估来控制证券发行人的信用风险，且通过分散化投资以分散信用风险。

本基金债券投资的信用评级情况按《中国人民银行信用评级管理指导意见》设定的标准统计及汇总。

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 2016年6月30日 | 上年度末 2015年12月31日 |
|--------|-------------------|---------------------|
| A-1 | 29,964,090.17 | 15,007,973.30 |
| A-1 以下 | - | - |
| 未评级 | 624,763,944.09 | 29,949,767.79 |
| 合计 | 654,728,034.26 | 44,957,741.09 |

6.4.9.2.2 按长期信用评级列示的债券投资

无。

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或因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理的价格变现。

针对兑付赎回资金的流动性风险，本基金的基金管理人每日对本基金的申购赎回情况进行严密监控并预测流动性需求，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配。本基金的基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。

针对投资品种变现的流动性风险，本基金的基金管理人主要通过限制、跟踪和控制基金投资交易的不活跃品种(企业债或短期融资券)来实现。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 150 天，且能够通过出售所持有的银行间同业市场交易债券应对流动性需求。此外本基金还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，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 40%。

于 2016 年 6 月 30 日，除卖出回购金融资产款余额中有 484,368,648.09 元将在一个月以内到期且计息(该利息金额不重大)外，本基金所承担的全部金融负债的合同约定到期日均为一个月

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，因此账面余额即约为未折现的合约到期现金流量。

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

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

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

6.4.9.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

| 本期末 2016年6月30日 | 6个月以内 | 6个月-1年 | 1-5年 | 5年 以上 | 不计息 | 合计 |
|-------------------|------------------|----------------|------|----------|---------------|------------------|
| 资产 | | | | | | |
| 银行存款 | 668,181,186.61 | - | - | - | - | 668,181,186.61 |
| 交易性金融资产 | 449,895,021.02 | 204,833,013.24 | - | - | - | 654,728,034.26 |
| 买入返售金融资产 | 390,000,000.00 | - | - | - | - | 390,000,000.00 |
| 应收利息 | - | - | - | - | 4,518,680.61 | 4,518,680.61 |
| 应收申购款 | - | - | - | - | 10.00 | 10.00 |
| 其他资产 | - | - | - | - | 85,226,505.00 | 85,226,505.00 |
| 资产总计 | 1,508,076,207.63 | 204,833,013.24 | - | - | 89,745,195.61 | 1,802,654,416.48 |
| 负债 | | | | | | |
| 卖出回购金融资产款 | 484,368,648.09 | - | - | - | - | 484,368,648.09 |
| 应付管理人报酬 | - | - | - | - | 281,408.18 | 281,408.18 |
| 应付托管费 | - | - | - | - | 83,380.22 | 83,380.22 |
| 应付销售服务费 | - | - | - | - | 25,044.46 | 25,044.46 |
| 应付交易费用 | - | - | - | - | 29,620.57 | 29,620.57 |
| 应付利息 | - | - | - | - | 77,587.01 | 77,587.01 |
| 应付利润 | - | - | - | - | 2,609,677.98 | 2,609,677.98 |
| 其他负债 | - | - | - | - | 203,109.22 | 203,109.22 |
| 负债总计 | 484,368,648.09 | - | - | - | 3,309,827.64 | 487,678,475.73 |
| 利率敏感度缺口 | 1,023,707,559.54 | 204,833,013.24 | - | - | 86,435,367.97 | 1,314,975,940.75 |
| 上年度末 | 6个月以内 | 6个月-1年 | 1-5年 | 5年 | 不计息 | 合计 |

| 2015 年 12 月 31 日 | | | | 以上 | | |
|------------------|----------------|--------------|---|----|--------------|----------------|
| 资产 | | | | | | |
| 银行存款 | 84,156,211.74 | - | - | - | - | 84,156,211.74 |
| 交易性金融资产 | 39,948,763.87 | 5,008,977.22 | - | - | - | 44,957,741.09 |
| 买入返售金融资产 | 69,800,584.70 | - | - | - | - | 69,800,584.70 |
| 应收利息 | - | - | - | - | 1,029,355.45 | 1,029,355.45 |
| 其他资产 | - | - | - | - | - | - |
| 资产总计 | 193,905,560.31 | 5,008,977.22 | - | - | 1,029,355.45 | 199,943,892.98 |
| 负债 | | | | | | |
| 卖出回购金融资产款 | 3,999,878.00 | - | - | - | - | 3,999,878.00 |
| 应付管理人报酬 | - | - | - | - | 40,360.35 | 40,360.35 |
| 应付托管费 | - | - | - | - | 11,958.60 | 11,958.60 |
| 应付销售服务费 | - | - | - | - | 32,583.68 | 32,583.68 |
| 应付交易费用 | - | - | - | - | 28,948.96 | 28,948.96 |
| 应付利息 | - | - | - | - | 304.47 | 304.47 |
| 应付利润 | - | - | - | - | 331,151.34 | 331,151.34 |
| 其他负债 | - | - | - | - | 159,000.00 | 159,000.00 |
| 负债总计 | 3,999,878.00 | - | - | - | 604,307.40 | 4,604,185.40 |
| 利率敏感度缺口 | 189,905,682.31 | 5,008,977.22 | - | - | 425,048.05 | 195,339,707.58 |

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

6.4.9.4.1.2 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（2016年6月30日） | 上年度末（2015年12月31日） |
| | 市场利率下降 25 个基点 | 410,000.00 | 30,000.00 |
| 市场利率上升 25 个基点 | -410,000.00 | -30,000.00 | |

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。本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无重大外汇风险。

6.4.9.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以

外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于银行间同业市场交易的固定收益品种，因此无重大其他价格风险。

6.4.10 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

无。

§ 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 | 654,728,034.26 | 36.32 |
| | 其中：债券 | 654,728,034.26 | 36.32 |
| | 资产支持证券 | - | 0.00 |
| 2 | 买入返售金融资产 | 475,226,505.00 | 26.36 |
| | 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 | 668,181,186.61 | 37.07 |
| 4 | 其他各项资产 | 4,518,690.61 | 0.25 |
| 5 | 合计 | 1,802,654,416.48 | 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 | | 9.08 |
| | 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 | 484,368,648.09 | 36.83 |
| | 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：“本基金进入全国银行间同业市场进行债券回购的资金余额不得超过基金资产净值的 40%”，本报告期内，本基金未发生超标情况。

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 | 42 |
| 报告期内投资组合平均剩余期限最高值 | 114 |
| 报告期内投资组合平均剩余期限最低值 | 32 |

报告期内投资组合平均剩余期限超过 120 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 150 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 | 88.94 | 36.83 |
| | 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 | 19.81 | 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 | 3.65 | 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)—120 天 | 2.28 | 0.00 |
| | 其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债 | 0.00 | 0.00 |
| 5 | 120 天(含)—397 天(含) | 15.58 | 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 | 130.26 | 36.83 |

7.4 报告期内投资组合平均剩余存续期超过 240 天情况说明

本报告期内，本基金未发生超标情况。

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

| 序号 | 债券品种 | 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 | 75,586,700.46 | 5.75 |
| | 其中：政策性金融债 | 75,586,700.46 | 5.75 |
| 4 | 企业债券 | - | 0.00 |
| 5 | 企业短期融资券 | 209,750,218.84 | 15.95 |
| 6 | 中期票据 | - | 0.00 |
| 7 | 同业存单 | 369,391,114.96 | 28.09 |
| 8 | 其他 | - | 0.00 |
| 9 | 合计 | 654,728,034.26 | 49.79 |
| 10 | 剩余存续期超过 397 天的浮动利率债券 | - | 0.00 |

7.6 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 | 111610171 | 16 兴业 CD171 | 1,000,000 | 99,961,070.14 | 7.60 |
| 2 | 111609138 | 16 浦发 CD138 | 1,000,000 | 99,945,317.12 | 7.60 |
| 3 | 011699932 | 16 中核工 SCP001 | 900,000 | 89,851,578.52 | 6.83 |
| 4 | 150215 | 15 国开 15 | 705,000 | 70,504,175.21 | 5.36 |
| 5 | 111611182 | 16 平安 CD182 | 700,000 | 69,724,322.08 | 5.30 |
| 6 | 111612054 | 16 北京银行 CD054 | 500,000 | 49,957,967.91 | 3.80 |
| 7 | 111608150 | 16 中信 CD150 | 500,000 | 49,802,437.71 | 3.79 |
| 8 | 011699952 | 16 大渡河 SCP003 | 300,000 | 29,984,772.97 | 2.28 |
| 9 | 011699939 | 16 南京交建 SCP001 | 300,000 | 29,961,103.21 | 2.28 |
| 10 | 011699669 | 16 京汽集 SCP001 | 200,000 | 19,988,943.12 | 1.52 |

7.7 “影子定价”与“摊余成本法”确定的基金资产净值的偏离

| 项目 | 偏离情况 |
|-------------------------------|------|
| 报告期内偏离度的绝对值在 0.25(含)-0.5%间的次数 | - |

| | |
|------------------------|----------|
| 报告期内偏离度的最高值 | 0.0672% |
| 报告期内偏离度的最低值 | -0.0348% |
| 报告期内每个交易日偏离度的绝对值的简单平均值 | 0.0246% |

报告期内负偏离度的绝对值达到 0.25%情况说明

本报告期内，本基金未发生超标情况。

报告期内正偏离度的绝对值达到 0.5%情况说明

本报告期内，本基金未发生超标情况。

7.8 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。

7.9 投资组合报告附注

7.9.1 本基金估值采用摊余成本法估值，即估值对象以买入成本列示，按票面利率或协议利率并考虑其买入时的溢价与折价，在其剩余存续期内按照实际利率法每日计提损益。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 1.0000 元。

7.9.2 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。

7.9.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

| 序号 | 名称 | 金额 |
|----|---------|--------------|
| 1 | 存出保证金 | - |
| 2 | 应收证券清算款 | - |
| 3 | 应收利息 | 4,518,680.61 |
| 4 | 应收申购款 | 10.00 |
| 5 | 其他应收款 | - |
| 6 | 待摊费用 | - |
| 7 | 其他 | - |
| 8 | 合计 | 4,518,690.61 |

7.9.4 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入原因，分项之和与合计可能有尾差。

§ 8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

| 份额级别 | 持有人户数 (户) | 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 |
| 大成月月盈短期理财债券 A | 812 | 42,827.78 | 4,042,612.40 | 11.62% | 30,733,542.86 | 88.38% |
| 大成月月盈短期理财债券 B | 8 | 157,203,799.71 | 1,251,414,211.14 | 99.51% | 6,216,186.52 | 0.49% |
| 大成月月盈短期理财债券 E | 2,925 | 7,716.03 | - | 0.00% | 22,569,387.83 | 100.00% |
| 合计 | 3,745 | 351,128.42 | 1,255,456,823.54 | 95.47% | 59,519,117.21 | 4.53% |

注：1、上述机构/个人投资者持有份额占总份额比例的计算中，对分级份额，比例的分母采用各自级别的份额，对合计数，比例的分母采用下属分级基金份额的合计数（即期末基金份额总额）。

2、持有人户数为有效户数，即存量份额大于零的账户。

8.2 期末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 | 大成月月盈短期理财债券 A | 10.31 | 0.0000% |
| | 大成月月盈短期理财债券 B | - | 0.0000% |
| | 大成月月盈短期理财债券 E | 8,475.00 | 0.0376% |
| | 合计 | 8,485.31 | 0.0006% |

注：上述占基金总份额比例的计算中，对分级份额，比例的分母采用各自级别的份额，对合计数，比例的分母采用下属分级基金份额的合计数（即期末基金份额总额）。

8.3 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、基金投资和相关部门负责人持有本开放式基金 | 大成月月盈短期理财债券 A | 0 |
| | 大成月月盈短期理财债券 B | 0 |
| | 大成月月盈短期理财债券 E | 0 |
| | 合计 | 0 |
| 本基金基金经理持有本开放式基金 | 大成月月盈短期理财债券 A | 0 |

| | | |
|--|---------------|---|
| | 大成月月盈短期理财债券 B | 0 |
| | 大成月月盈短期理财债券 E | 0 |
| | 合计 | 0 |

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

| | 大成月月盈短期理财债券 A | 大成月月盈短期理财债券 B | 大成月月盈短期理财债券 E |
|---------------------------------|----------------------|----------------------|-------------------|
| 基金合同生效日（2012 年 11 月 29 日）基金份额总额 | 2, 216, 351, 283. 87 | 1, 404, 512, 744. 10 | - |
| 本报告期期初基金份额总额 | 65, 117, 111. 37 | 46, 981, 111. 52 | 83, 241, 484. 69 |
| 本报告期基金总申购份额 | 116, 971, 705. 66 | 1, 446, 775, 915. 04 | 126, 451, 589. 91 |
| 减：本报告期基金总赎回份额 | 147, 312, 661. 77 | 236, 126, 628. 90 | 187, 123, 686. 77 |
| 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 | 34, 776, 155. 26 | 1, 257, 630, 397. 66 | 22, 569, 387. 83 |

§ 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

一、基金管理人的重大人事变动

1、基金管理人于 2016 年 6 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六届董事会第十七次会议审议通过，钟鸣远先生不再担任公司副总经理。

二、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，基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内，无涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。

10.4 基金投资策略的改变

基金投资策略在本报告期内没有重大改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金聘任的为本基金审计的会计师事务所为普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)，该事务所自基金合同生效日起为本基金提供审计服务至今。

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，本基金托管人的托管业务部门及其相关高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

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 | 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% | - |
| 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% | - |
| 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% | - |
| 恒泰证券 | 1 | - | 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% | - |
| 平安证券 | 1 | - | 0.00% | - | 0.00% | - |
| 申银万国 | 1 | - | 0.00% | - | 0.00% | - |
| 天源证券 | 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% | - |
| 中泰证券 | 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：1、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。

2、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：

本报告期内增加交易单元：恒泰证券、方正证券、平安证券；

本报告期内退租交易单元：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

无。

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 | 关于大成月月盈短期理财债券型证券投资基金恢复大额申购（含定期定额申购）业务公告 | 中国证监会指定报刊及本公司网站 | 2016 年 1 月 19 日 |
| 2 | 大成月月盈短期理财债券型证券投资基金 2015 年第 4 季度报告 | 中国证监会指定报刊及本公司网站 | 2016 年 1 月 20 日 |
| 3 | 关于大成月月盈短期理财债券型证券投资基金“春节”假期前暂停申购业务公告 | 中国证监会指定报刊及本公司网站 | 2016 年 2 月 2 日 |
| 4 | 大成月月盈短期理财债券型证券投资基金 2015 年年度报告 | 中国证监会指定报刊及本公司网站 | 2016 年 3 月 26 日 |
| 5 | 大成月月盈短期理财债券型证券投资基金 2015 年年度报告摘要 | 中国证监会指定报刊及本公司网站 | 2016 年 3 月 26 日 |
| 6 | 关于大成月月盈短期理财债券型证券投资基金“清明节”假期前暂停申购业务公告 | 中国证监会指定报刊及本公司网站 | 2016 年 3 月 29 日 |
| 7 | 大成月月盈短期理财债券型证券投资基金 2016 年第 1 季度报告 | 中国证监会指定报刊及本公司网站 | 2016 年 4 月 22 日 |
| 8 | 大成月月盈短期理财债券型证券投资基金 | 中国证监会指定报 | 2016 年 4 |

| | | | |
|----|---|---------------------|--------------------|
| | 更新招募说明书（2016 年 1 期） | 刊及本公司网站 | 月 22 日 |
| 9 | 大成月月盈短期理财债券型证券投资基金 更新招募说明书（2016 年 1 期）-摘要 | 中国证监会指定报 刊及本公司网站 | 2016 年 4 月 22 日 |
| 10 | 关于大成月月盈短期理财债券型证券投资 基金“劳动节”假期前暂停申购业务公告 | 中国证监会指定报 刊及本公司网站 | 2016 年 4 月 26 日 |
| 11 | 关于大成月月盈短期理财债券型证券投资 基金“端午节”假期前暂停申购业务公告 | 中国证监会指定报 刊及本公司网站 | 2016 年 6 月 3 日 |
| 12 | 关于大成月月盈短期理财债券型证券投资 基金暂停大额申购（含定期定额申购）业 务公告 | 中国证监会指定报 刊及本公司网站 | 2016 年 6 月 17 日 |
| 13 | 大成基金管理有限公司关于因指数熔断调 整公司旗下部分公募基金开放时间的公告 | 中国证监会指定报 刊及本公司网站 | 2016 年 1 月 5 日 |
| 14 | 关于旗下场内基金在指数熔断期间暂停申 购赎回业务的提示性公告 | 中国证监会指定报 刊及本公司网站 | 2016 年 1 月 6 日 |
| 15 | 大成基金管理有限公司关于因指数熔断调 整公司旗下部分公募基金开放时间的公告 | 中国证监会指定报 刊及本公司网站 | 2016 年 1 月 8 日 |
| 16 | 大成基金管理有限公司关于养老金账户通 过直销中心申购旗下部分基金费率优惠的 公告 | 中国证监会指定报 刊及本公司网站 | 2016 年 1 月 18 日 |
| 17 | 大成基金管理有限公司关于降低旗下部分 开放式基金申购、赎回、转换转出及最低 持有份额数额限制的公告 | 中国证监会指定报 刊及本公司网站 | 2016 年 1 月 30 日 |
| 18 | 大成基金管理有限公司关于增加上海凯石 财富基金销售有限公司代销公告 | 中国证监会指定报 刊及本公司网站 | 2016 年 2 月 18 日 |
| 19 | 大成基金关于旗下部分基金增加深圳前海 微众银行股份有限公司为代销机构的公告 | 中国证监会指定报 刊及本公司网站 | 2016 年 2 月 27 日 |
| 20 | 大成基金管理有限公司关于增加北京葱次 方资产管理有限公司为开放式基金代销机 构及相关费率优惠的公告 | 中国证监会指定报 刊及本公司网站 | 2016 年 3 月 1 日 |

| | | | |
|----|--|-----------------|-----------------|
| 21 | 大成基金管理有限公司关于增加徽商期货有限责任公司为开放式基金代销机构并开通相关业务的公告 | 中国证监会指定报刊及本公司网站 | 2016 年 3 月 12 日 |
| 22 | 关于增加深圳市金斧子投资咨询有限公司为开放式基金代销机构及相关费率优惠的公告 | 中国证监会指定报刊及本公司网站 | 2016 年 3 月 17 日 |
| 23 | 大成基金管理有限公司关于旗下基金实行网上直销申购费率优惠的公告 | 中国证监会指定报刊及本公司网站 | 2016 年 3 月 18 日 |
| 24 | 大成基金管理有限公司关于增加万和证券有限责任公司为开放式基金代销机构并开通相关业务的公告 | 中国证监会指定报刊及本公司网站 | 2016 年 3 月 26 日 |
| 25 | 关于大成基金管理有限公司上海理财中心业务变更的公告 | 中国证监会指定报刊及本公司网站 | 2016 年 3 月 29 日 |
| 26 | 大成基金管理有限公司关于支付宝基金支付业务下线的公告 | 中国证监会指定报刊及本公司网站 | 2016 年 4 月 18 日 |
| 27 | 大成基金管理来有限公司关于股权变更及修改《公司章程》的公告 | 中国证监会指定报刊及本公司网站 | 2016 年 4 月 27 日 |
| 28 | 大成基金管理有限公司关于增加奕丰金融服务（深圳）有限公司为开放式基金代销机构并开通相关业务的公告 | 中国证监会指定报刊及本公司网站 | 2016 年 4 月 30 日 |
| 29 | 大成基金管理有限公司关于旗下部分基金增加北京钱景财富投资管理有限公司为代销机构的公告 | 中国证监会指定报刊及本公司网站 | 2016 年 5 月 5 日 |
| 30 | 大成基金管理有限公司关于增加深圳市金斧子投资咨询有限公司为开放式基金代销机构并开通相关业务的公告 | 中国证监会指定报刊及本公司网站 | 2016 年 5 月 5 日 |
| 31 | 大成基金管理有限公司关于增加珠海盈米财富管理有限公司为开放式基金代销机构并开通相关业务的公告 | 中国证监会指定报刊及本公司网站 | 2016 年 5 月 7 日 |

| | | | |
|----|--|-----------------|-----------------|
| 32 | 大成基金管理有限公司关于旗下部分基金增加上海好买基金销售有限公司为代销机构的公告 | 中国证监会指定报刊及本公司网站 | 2016 年 5 月 10 日 |
| 33 | 大成基金管理有限公司关于增加武汉市伯嘉基金销售有限公司为开放式基金代销机构并开通相关业务的公告 | 中国证监会指定报刊及本公司网站 | 2016 年 5 月 17 日 |
| 34 | 大成基金管理有限公司关于增加泰诚财富基金销售（大连）有限公司为开放式基金代销机构并开通相关业务的公告 | 中国证监会指定报刊及本公司网站 | 2016 年 6 月 22 日 |
| 35 | 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 | 2016 年 6 月 25 日 |

§ 11 影响投资者决策的其他重要信息

根据 2016 年 4 月 27 日《大成基金管理有限公司关于股权变更及修改《公司章程》的公告》，根据大成基金管理有限公司（以下简称“本公司”）第六届董事会第十四次会议和 2016 年第一次临时股东大会的有关决议，本公司原股东广东证券股份有限公司通过其破产管理人将所持本公司 2% 股权（对应出资额 400 万元）以拍卖竞买的方式转让给本公司股东中泰信托有限责任公司，广东证券股份有限公司退出本公司投资，中泰信托有限责任公司所持本公司股权增至 50%（对应出资额 1 亿元），同时，就本公司股权变更的相关内容修改《大成基金管理有限公司公司章程》。本公司股权变更及修改《大成基金管理有限公司公司章程》的工商变更手续已于 2016 年 4 月 25 日在深圳市市场监督管理局办理完毕。

§ 12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

- 1、《关于大成月月盈短期理财债券型证券投资基金份额持有人大会决议生效的公告》；
- 2、《大成月月盈短期理财债券型证券投资基金基金合同》；
- 3、《大成月月盈短期理财债券型证券投资基金托管协议》；
- 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

备查文件存放在本基金管理人和托管人住所。

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。

投资者对本报告书如有疑问，可咨询本基金管理人大成基金管理有限公司。

客户服务中心电话：400-888-5558（免长途通话费用）

国际互联网网址：<http://www.dcfund.com.cn>

大成基金管理有限公司
2016年8月25日