

大成现金宝场内实时申赎货币市场基金  
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：中国农业银行股份有限公司

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。

基金托管人中国农业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

<b>§ 1 重要提示及目录</b> .....	<b>1</b>
1.1 重要提示.....	1
1.2 目录.....	2
<b>§ 2 基金简介</b> .....	<b>4</b>
2.1 基金基本情况.....	4
2.2 基金产品说明.....	4
2.3 基金管理人和基金托管人.....	4
2.4 信息披露方式.....	5
2.5 其他相关资料.....	5
<b>§ 3 主要财务指标和基金净值表现</b> .....	<b>5</b>
3.1 主要会计数据和财务指标.....	5
3.2 基金净值表现.....	5
<b>§ 4 管理人报告</b> .....	<b>7</b>
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	7
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	10
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	10
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.....	11
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	11
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	12
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	13
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.....	13
<b>§ 5 托管人报告</b> .....	<b>13</b>
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	13
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.....	13
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.....	13
<b>§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）</b> .....	<b>13</b>
6.1 资产负债表.....	13
6.2 利润表.....	15
6.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	16
6.4 报表附注.....	17
<b>§ 7 投资组合报告</b> .....	<b>31</b>
7.1 期末基金资产组合情况.....	31
7.2 债券回购融资情况.....	31
7.3 基金投资组合平均剩余期限.....	31
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.....	32
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	32
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.....	33
7.7 “影子定价”与“摊余成本法”确定的基金资产净值的偏离.....	33
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.....	33
7.9 投资组合报告附注.....	34
<b>§ 8 基金份额持有人信息</b> .....	<b>34</b>
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	34
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	35

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.....	35
<b>§ 9 开放式基金份额变动.....</b>	<b>35</b>
<b>§ 10 重大事件揭示.....</b>	<b>36</b>
10.1 基金份额持有人大会决议.....	36
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.....	36
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	36
10.4 基金投资策略的改变.....	36
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	36
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.....	36
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	36
10.8 偏离度绝对值超过 0.5%的情况.....	38
10.9 其他重大事件.....	38
<b>§ 11 影响投资者决策的其他重要信息.....</b>	<b>42</b>
<b>§ 12 备查文件目录.....</b>	<b>42</b>
12.1 备查文件目录.....	42
12.2 存放地点.....	42
12.3 查阅方式.....	42

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	大成现金宝场内实时申赎货币市场基金	
基金简称	大成现金宝货币	
基金主代码	519898	
交易代码	519898	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2013 年 3 月 27 日	
基金管理人	大成基金管理有限公司	
基金托管人	中国农业银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	221,517,628,727.00 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称:	现金宝 A	现金宝 B
下属分级基金的交易代码:	519898	519899
报告期末下属分级基金的份额总额	102,211,012,195.00 份	119,306,616,532.00 份

### 2.2 基金产品说明

投资目标	安全性和流动性优先，在此基础上追求适度收益。
投资策略	本基金通过结构化投资策略、分散化投资策略、利率趋势评估策略、滚动配置策略和相对价值评估策略多个层次进行投资管理，以实现超越投资基准的投资目标。
业绩比较基准	银行活期存款利率（税后）
风险收益特征	本基金为货币市场基金，为证券投资基金中的低风险品种。本基金长期的风险和预期收益低于股票型基金、混合型基金、债券型基金。

### 2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		大成基金管理有限公司	中国农业银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	杜鹏	林葛
	联系电话	0755-83183388	010-66060069
	电子邮箱	dupeng@dcfund.com.cn	tgxxpl@abchina.com
客户服务电话		4008885558	95599
传真		0755-83199588	010-68121816
注册地址		深圳市福田区深南大道 7088 号招商银行大厦 32 层	北京市东城区建国门内大街 69 号
办公地址		深圳市福田区深南大道 7088 号招商银行大厦 32 层	北京市西城区复兴门内大街 28 号凯晨世贸中心东座 F9
邮政编码		518040	100031
法定代表人		刘卓	周慕冰

## 2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《上海证券报》、《中国证券报》、《证券时报》
登载基金半年度报告正文的管理人互联网网址	http://www.dcfund.com.cn
基金半年度报告备置地点	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	中国证券登记结算有限责任公司	北京市西城区太平桥大街 17 号

## § 3 主要财务指标和基金净值表现

### 3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

基金级别	现金宝 A	现金宝 B
3.1.1 期间数据和指标	报告期( 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	13,576,276.82	16,628,149.94
本期利润	13,576,276.82	16,628,149.94
本期净值收益率	1.1367%	1.4343%
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	1,022,110,121.95	1,193,066,165.32
期末基金份额净值	0.01	0.01
3.1.3 累计期末指标	报告期末( 2016 年 6 月 30 日 )	
累计净值收益率	11.5311%	13.7113%

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

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

### 3.2 基金净值表现

#### 3.2.1 基金份额净值收益率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

现金宝 A

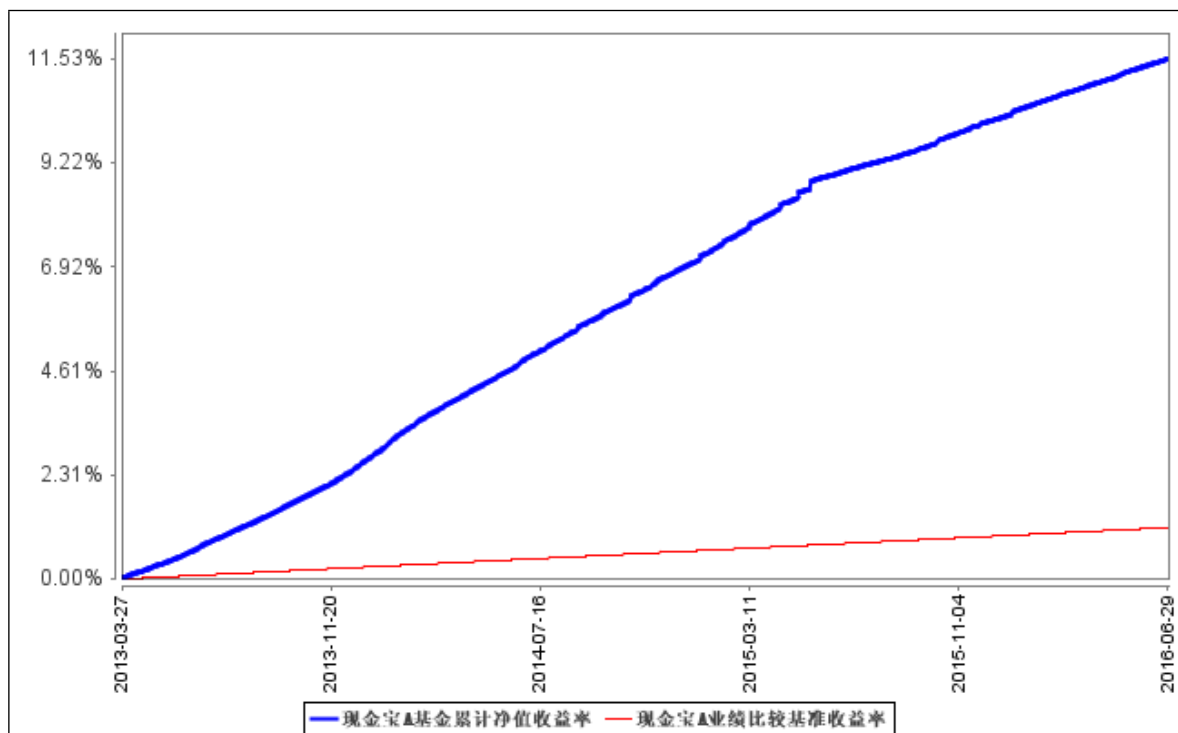
阶段	份额净值收益率①	份额净值收益率标	业绩比较基准收益	业绩比较基准收益率标	①—③	②—④

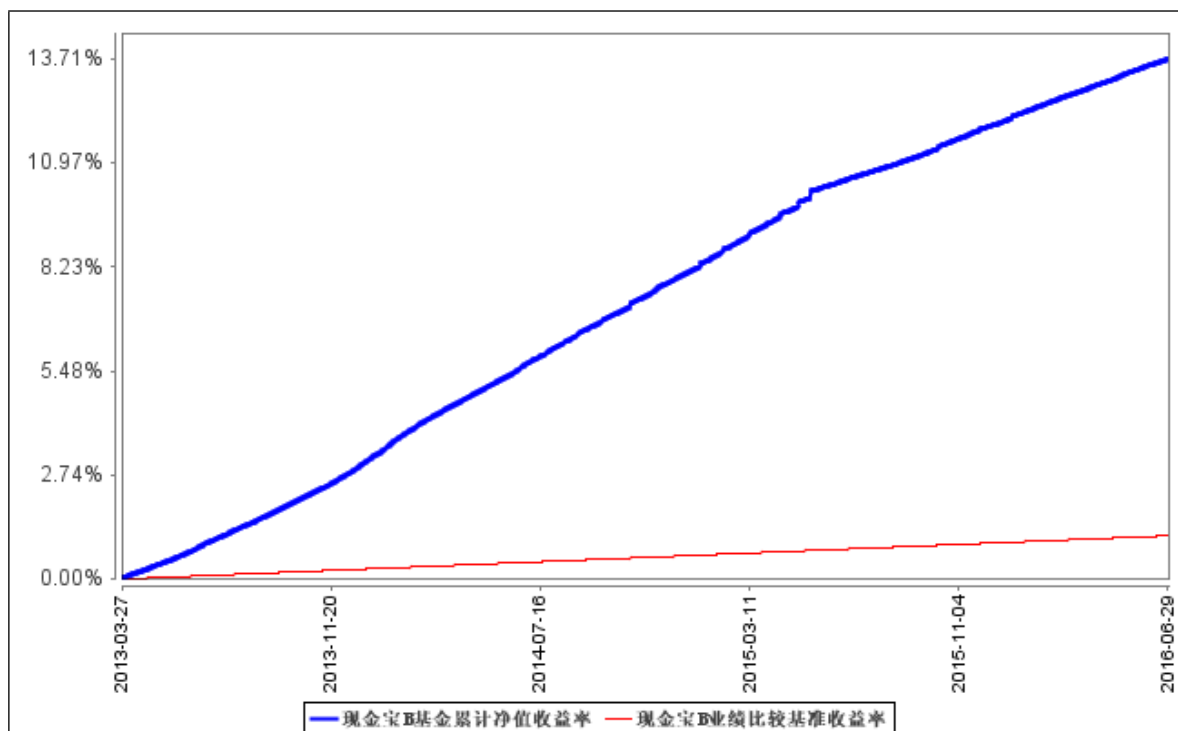
		准差②	率③	准差④		
过去一个月	0.1692%	0.0014%	0.0287%	0.0000%	0.1405%	0.0014%
过去三个月	0.5407%	0.0024%	0.0870%	0.0000%	0.4537%	0.0024%
过去六个月	1.1367%	0.0040%	0.1740%	0.0000%	0.9627%	0.0040%
过去一年	2.2740%	0.0039%	0.3505%	0.0000%	1.9235%	0.0039%
过去三年	10.6688%	0.0082%	1.0505%	0.0000%	9.6183%	0.0082%
自基金合同生效起至今	11.5311%	0.0079%	1.1425%	0.0000%	10.3886%	0.0079%

## 现金宝 B

阶段	份额净值 收益率①	份额净值 收益率标 准差②	业绩比较 基准收益 率③	业绩比较基 准收益率标 准差④	①—③	②—④
过去一个月	0.2181%	0.0014%	0.0287%	0.0000%	0.1894%	0.0014%
过去三个月	0.6882%	0.0024%	0.0870%	0.0000%	0.6012%	0.0024%
过去六个月	1.4343%	0.0040%	0.1740%	0.0000%	1.2603%	0.0040%
过去一年	2.8818%	0.0039%	0.3505%	0.0000%	2.5313%	0.0039%
过去三年	12.6605%	0.0083%	1.0505%	0.0000%	11.6100%	0.0083%
自基金合同生效起至今	13.7113%	0.0080%	1.1425%	0.0000%	12.5688%	0.0080%

## 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，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。截至报告日，基金投资组合比例已达到本基金合同的相关规定要求。

## § 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



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

					<p>金管理有限公司，历任固定收益部助理研究员。</p> <p>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。</p> <p>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。</p>
黄海峰先生	本基金基金经理助理	2013 年 10 月 14 日	-	12 年	<p>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</p>

					<p>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</p>
--	--	--	--	--	---

注：1、任职日期、离任日期为本基金管理人作出决定之日。

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

#### 4.2 管理人对报告期内本基金运作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》、《大成现金宝场内实时申赎货币市场基金基金合同》和其他有关法律法规的规定，在基金管理运作中，大成现金宝场内实时申赎货币市场基金的投资范围、投资比例、投资组合、证券交易行为、信息披露等有关法律法规、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 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 年上半年经济依然比较疲弱。工业增加值和固定资产投资数据继续下滑。虽然一二线城市房价仍然上涨，但是房地产销售初显疲态，房地产投资也已经开始回落。央行继续执行稳健的货币政策，在一季度降低一次准备金后，二季度没有继续降低准备金，而是通过公开市场操作等方式保持货币市场稳定。

市场表现来看，债券市场波动较大。年初由于股市大跌，市场风险偏好骤降，以及资金面充裕，债券市场收益率迅速向下突破。4 月份在房价、大宗商品上涨，同时信用事件爆发的背景下，债券市场收益率迅速上行。而之后由于资金面依然非常宽松、经济数据继续下滑、通胀预期减弱、英国脱欧等因素，债券收益率又开始回调。货币市场走势相对平稳，只是在一季度末由于 MPA 因素扰动出现一定波动。

本组合在做好流动性管理基础上，灵活调整组合比例和结构，在利率较高时适度增加长久期债券和同业存单配置，提高组合静态收益，为持有人创造了一定的持有期回报。

##### 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 1.1367%，B 类净值收益率 1.4343%，期间业绩比较基准收益率为 0.1740%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望下半年，经济增长不容乐观。投资方面来看，房地产投资增长可能持续回落。随着销售和房价增速的见顶，未来房地产投资下滑速度将会加快。由于投资回报率下降，制造业投资短期无法恢复。而基建投资增速已经在高位徘徊，很难再大幅上行。进出口方面，由于人民币加权指数年初以来贬值较大，因此下半年出口对经济的贡献将会更大。消费方面，在居民收入减速、杠杆上升的情况下预计会继续疲软。货币政策方面，由于经济增速疲弱，因此央行将会保持资金面适度宽松。整体经济和政策环境对于债券和货币市场较为有利，但是也必须关注公开市场到期、缴税、银行分红等对资金面的扰动。同时三季度信用债到期量较大，特别是一些低等级信用债即将到期，需要密切关注。

下半年我们将进一步加大市场投研分析，增加组合操作灵活性，提高流动性资产配置。密切关注交易所回购利率变化，满足场内货币更高的流动性要求。同时优化组合配置，优选信用债和同业存单配置，在降低信用风险前提下增强组合收益。

#### 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本基金管理人指导基金估值业务的领导小组为公司估值委员会，公司估值委员会主要负责估值政策和估值程序的制定、修订以及执行情况的监督。估值委员会由股票投资部、研究部、固定收益部、风险管理部、基金运营部、监察稽核部、委托投资部指定人员组成。公司估值委员会的相关成员均具备相应的专业胜任能力和相关工作经历，估值委员会成员中包括两名投资组合经理。

股票投资部、研究部、固定收益部、风险管理部和委托投资部负责关注相关投资品种的动态，评判基金持有的投资品种是否处于不活跃的交易状态或者最近交易日后经济环境发生了重大变化或证券发行机构发生了影响证券价格的重大事件，从而确定估值日需要进行估值测算或者调整的投资品种；提出合理的数量分析模型对需要进行估值测算或者调整的投资品种进行公允价值定价与计量；定期对估值政策和程序进行评价，以保证其持续适用；基金运营部负责日常的基金资产的估值业务，执行基金估值政策，并负责与托管行沟通估值调整事项；监察稽核部负责审核估值政策和程序的一致性，监督估值委员会工作流程中的风险控制，并负责估值调整事项的信息披露工作。

本基金的日常估值程序由基金运营部基金估值核算员执行，并与托管银行的估值结果核对一致。基金估值政策的议定和修改采用集体讨论机制，基金经理及投资经理作为估值小组成员，对本基金持仓证券的交易情况、信息披露情况保持应有的职业敏感，向估值委员会提供估值参考信息，参与估值政策讨论。对需采用特别估值程序的证券，基金管理人及时启动特别估值程序，由估值委员会讨论议定特别估值方案并与托管行沟通后由基金运营部具体执行。

本基金管理人参与估值流程各方之间不存在任何重大利益冲突，截止报告期末未与外部估值定价服务机构签约。

#### 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金管理人严格按照本基金基金合同的规定进行收益分配。据本基金基金合同中收益分配有关原则的规定：本基金根据每日基金收益公告，以每百万份基金份额收益为基准，为投资人每日计算收益并分配。本报告期内本基金应分配利润 30,204,426.76 元，报告期内已分配利润 30,204,426.76 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

在托管本基金的过程中，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基金合同、托管协议的约定，对本基金基金管理人—大成基金管理有限公司 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日基金的投资运作，进行了认真、独立的会计核算和必要的投资监督，认真履行了托管人的义务，没有从事任何损害基金份额持有人利益的行为。

#### 5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

本托管人认为，大成基金管理有限公司在本基金的投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支及利润分配等问题上，不存在损害基金份额持有人利益的行为；在报告期内，严格遵守了《证券投资基金法》等有关法律法规，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

#### 5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

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

## § 6 半年度财务会计报告（未经审计）

## 6.1 资产负债表

会计主体：大成现金宝场内实时申赎货币市场基金

报告截止日：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
<b>资产：</b>			
银行存款	6.4.3.1	1,280,685,832.19	1,205,419,074.40
结算备付金		40,772,053.56	51,228,997.85
存出保证金		3,882,575.42	7,664,369.63
交易性金融资产	6.4.3.2	658,486,390.20	777,182,817.67
其中：股票投资		-	-
基金投资		-	-
债券投资		658,486,390.20	777,182,817.67
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	230,698,560.97	300,000,000.00
应收证券清算款		-	-
应收利息	6.4.3.5	5,546,001.89	9,307,866.37
应收股利		-	-
应收申购款		175,071,879.97	637,004,453.71
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.3.6	-	-
资产总计		2,395,143,294.20	2,987,807,579.63
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2016 年 6 月 30 日</b>	<b>上年度末 2015 年 12 月 31 日</b>
<b>负债：</b>			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.3.3	-	-
卖出回购金融资产款		119,699,740.15	100,099,749.95
应付证券清算款		-	300,000,000.00
应付赎回款		58,568,745.44	37,004,604.96
应付管理人报酬		550,053.18	412,694.32
应付托管费		162,978.75	122,279.81
应付销售服务费		267,152.91	204,461.32
应付交易费用	6.4.3.7	19,671.11	18,959.21
应交税费		-	-
应付利息		6,886.85	6,636.77
应付利润		137,770.10	169,404.82

递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.3.8	554,008.44	457,482.18
负债合计		179,967,006.93	438,496,273.34
<b>所有者权益：</b>			
实收基金	6.4.3.9	2,215,176,287.27	2,549,311,306.29
未分配利润	6.4.3.10	-	-
所有者权益合计		2,215,176,287.27	2,549,311,306.29
负债和所有者权益总计		2,395,143,294.20	2,987,807,579.63

注：报告截止日 2016 年 6 月 30 日，A 级基金份额净值 0.01 元，基金份额总额 102,211,012,195.00 份；B 级基金份额净值 0.01 元，基金份额总额 119,306,616,532.00 份。基金份额总额 221,517,628,727.00 份。

## 6.2 利润表

会计主体：大成现金宝场内实时申赎货币市场基金

本报告期：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
<b>一、收入</b>		38,897,098.20	50,257,162.76
1. 利息收入		37,529,307.78	43,746,131.03
其中：存款利息收入	6.4.3.11	21,318,137.46	23,614,085.76
债券利息收入		10,598,878.64	18,934,262.90
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		5,612,291.68	1,197,782.37
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		1,367,790.42	6,511,031.73
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	1,367,790.42	6,511,031.73
资产支持证券投资收益		-	-
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	-	-
<b>减：二、费用</b>		8,692,671.44	11,287,253.56



1. 管理人报酬	6.4.6.1.1	3,218,123.81	2,972,374.22
2. 托管费	6.4.6.1.2	953,518.17	880,703.60
3. 销售服务费	6.4.6.1.3	1,568,500.22	2,032,387.39
4. 交易费用	6.4.3.19	-	-
5. 利息支出		597,613.99	2,361,154.32
其中：卖出回购金融资产支出		597,613.99	2,361,154.32
6. 其他费用	6.4.3.20	2,354,915.25	3,040,634.03
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		<b>30,204,426.76</b>	<b>38,969,909.20</b>
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		<b>30,204,426.76</b>	<b>38,969,909.20</b>

### 6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：大成现金宝场内实时申赎货币市场基金

本报告期：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）	2,549,311,306.29	-	2,549,311,306.29
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	30,204,426.76	30,204,426.76
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）	-334,135,019.02	-	-334,135,019.02
其中：1. 基金申购款	24,607,311,227.53	-	24,607,311,227.53
2. 基金赎回款	-24,941,446,246.55	-	-24,941,446,246.55
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）	-	-30,204,426.76	-30,204,426.76
五、期末所有者权益（基金净值）	2,215,176,287.27	-	2,215,176,287.27
项目	上年度可比期间 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日		

	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益 (基金净值)	2,639,007,080.83	-	2,639,007,080.83
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	38,969,909.20	38,969,909.20
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)	-791,528,293.18	-	-791,528,293.18
其中：1. 基金申购款	45,554,698,508.17	-	45,554,698,508.17
2. 基金赎回款	-46,346,226,801.35	-	-46,346,226,801.35
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)	-	-38,969,909.20	-38,969,909.20
五、期末所有者权益 (基金净值)	1,847,478,787.65	-	1,847,478,787.65

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署：

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

## 6.4 报表附注

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

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

### 6.4.2 税项

#### 1、营业税、增值税、企业所得税

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。

自 2016 年 5 月 1 日起，在全国范围内全面推开营业税改征增值税试点，金融业纳入试点范围，由缴纳营业税改为缴纳增值税。对证券投资基金（封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金）管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税；国债、地方政府债利息收入免征增值税；存款利息收入不征收增值税；质押式买入返售金融商品及持有政策性金融债券的利息收入免征增值税。

证券投资基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股权的股息、红

利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

## 2、个人所得税

个人所得税税率为 20%；

基金取得的债券利息收入，由债券发行企业在向基金派发债券利息收入时代扣代缴个人所得税；

暂免征收储蓄存款利息所得个人所得税。

### 6.4.3 重要财务报表项目的说明

#### 6.4.3.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2016 年 6 月 30 日
活期存款	2,685,832.19
定期存款	-
其中：存款期限 1-3 个月	-
其他存款	1,278,000,000.00
合计：	1,280,685,832.19

注：1、其他存款为根据协议可提前支取且没有利息损失的协议存款。

2、本基金于本会计期间未投资于定期存款。

#### 6.4.3.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 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	658,486,390.20	658,716,000.00	229,609.80	0.0104%
	合计	658,486,390.20	658,716,000.00	229,609.80	0.0104%

注：偏离金额=影子定价-摊余成本；偏离度=偏离金额/基金资产净值。

#### 6.4.3.3 衍生金融资产/负债

本基金于本报告期末未持有衍生金融资产/负债。

## 6.4.3.4 买入返售金融资产

## 6.4.3.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

单位：人民币元

项目	本期末 2016年6月30日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所买入返售证券	176,718,240.00	-
银行间买入返售证券	53,980,320.97	-
合计	230,698,560.97	-

## 6.4.3.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告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	15,494.96
应收定期存款利息	-
应收其他存款利息	1,136,144.54
应收结算备付金利息	18,347.40
应收债券利息	3,485,052.36
应收买入返售证券利息	889,215.43
应收申购款利息	-
应收黄金合约拆借孳息	-
其他	1,747.20
合计	5,546,001.89

## 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	19,671.11
合计	19,671.11

## 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	-
划款手续费	1,231.15
应付增值服务费	359,888.33
预提费用	192,888.96
合计	554,008.44

#### 6.4.3.9 实收基金

金额单位：人民币元

现金宝 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	127,926,054,788.00	1,279,260,547.88
本期申购	1,508,377,976,757.00	15,083,779,767.57
本期赎回（以“-”号填列）	-1,534,093,019,350.00	-15,340,930,193.50
本期末	102,211,012,195.00	1,022,110,121.95

金额单位：人民币元

现金宝 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	127,005,075,841.00	1,270,050,758.41
本期申购	952,353,145,996.00	9,523,531,459.96
本期赎回（以“-”号填列）	-960,051,605,305.00	-9,600,516,053.05
本期末	119,306,616,532.00	1,193,066,165.32

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

#### 6.4.3.10 未分配利润

单位：人民币元

现金宝 A			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-	-	-
本期利润	13,576,276.82	-	13,576,276.82
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	-13,576,276.82	-	-13,576,276.82

本期末	-	-	-
-----	---	---	---

单位：人民币元

现金宝 B			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-	-	-
本期利润	16,628,149.94	-	16,628,149.94
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	-16,628,149.94	-	-16,628,149.94
本期末	-	-	-

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

#### 6.4.3.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	240,953.28
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	20,743,587.56
结算备付金利息收入	281,099.54
其他	52,497.08
合计	21,318,137.46

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

#### 6.4.3.12 股票投资收益

本报告期内本基金无股票投资收益。

#### 6.4.3.13 债券投资收益

单位：人民币元

项目	本期 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	986,488,169.28
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	970,735,440.54
减：应收利息总额	14,384,938.32
买卖债券差价收入	1,367,790.42

**6.4.3.14 贵金属投资收益**

本报告期内本基金无贵金属收益。

**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	34,809.32
信息披露费	149,178.12
其他	600.00
银行费用	38,848.44
增值服务费	2,113,577.85
债券账户维护费	17,901.52
合计	2,354,915.25

**6.4.3.21 分部报告**

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

**6.4.4 或有事项、资产负债表日后事项的说明****6.4.4.1 或有事项**

截至资产负债表日，本基金无需要说明的重大或有事项。

#### 6.4.4.2 资产负债表日后事项

截至本会计报表批准报出日，本基金无需作披露的资产负债表日后事项。

#### 6.4.5 关联方关系

##### 6.4.5.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

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
中国农业银行股份有限公司(“中国农业银行”)	基金托管人
中泰信托有限责任公司	基金管理人的股东
光大证券股份有限公司(“光大证券”)	基金管理人的股东、基金销售机构
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：以下关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

#### 6.4.6 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

本基金本期及上年度可比期间均未发生通过关联方交易单元进行的交易。

##### 6.4.6.1 关联方报酬

###### 6.4.6.1.1 基金管理费

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管理费	3,218,123.81	2,972,374.22
其中：支付销售机构的客户维护费	1,156,046.60	1,063,456.26

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



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

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日基金资产净值

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

#### 6.4.6.1.2 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	953,518.17	880,703.60

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

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

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日基金资产净值

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

#### 6.4.6.1.3 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		
	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		
	现金宝 A	现金宝 B	合计
光大证券	28,960.71	129.06	29,089.77
合计	28,960.71	129.06	29,089.77
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		
	现金宝 A	现金宝 B	合计
光大证券	54,514.16	163.27	54,677.43
合计	54,514.16	163.27	54,677.43

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

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

各类基金份额的销售服务费计提的计算公式如下：

$$H = E \times R \div \text{当年天数}$$

H 为每日该类基金份额应计提的基金销售服务费

E 为前一日该类基金份额的基金资产净值

R 为该类基金份额的年销售服务费率

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

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

#### 6.4.6.2 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

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
中国农业银行	-	51,666,541.26	-	-	884,400,000.00	190,058.66
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
中国农业银行	-	-	-	-	-	-

#### 6.4.6.3 各关联方投资本基金的情况

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

报告期内基金管理人未运用固有资金投资本基金。

## 6.4.6.3.2 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

报告期末除基金管理人之外的其他关联方未持有本基金。

## 6.4.6.4 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 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
中国农业银行	2,685,832.19	240,953.28	9,695,336.85	3,105,361.61

注：本基金的银行存款由基金托管人中国农业银行保管，并按银行间同业利率计息。

## 6.4.6.5 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本报告期内本基金未在承销期内参与关联方承销证券。

## 6.4.6.6 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。

## 6.4.7 利润分配情况

## 6.4.7.1 利润分配情况——货币市场基金

金额单位：人民币元

## 现金宝A

已按再投资形式转实收基金	直接通过应付赎回款转出金额	应付利润本年变动	本期利润分配合计	备注
13,597,865.49	-	-21,588.67	13,576,276.82	-

## 现金宝B

已按再投资形式转实收基金	直接通过应付赎回款转出金额	应付利润本年变动	本期利润分配合计	备注
16,638,195.99	-	-10,046.05	16,628,149.94	-

## 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

于本报告期末，本基金未持有因认购新发或增发证券而流通受限的证券。

## 6.4.8.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金本报告期末未持有暂时停牌等流通受限的股票。

### 6.4.8.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

#### 6.4.8.3.1 银行间市场债券正回购

截止本报告期末 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 119,699,740.15 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
011699947	16 长江电力 SCP002	2016 年 7 月 1 日	99.85	600,000	59,911,874.77
071603003	16 中信 CP003	2016 年 7 月 1 日	99.99	400,000	39,996,563.53
071603005	16 中信 CP005	2016 年 7 月 1 日	99.99	600,000	59,992,558.48
合计				1,600,000	159,900,996.78

#### 6.4.8.3.2 交易所市场债券正回购

截至本期末 2016 年 6 月 30 日止，本基金未持有从事交易所市场债券正回购交易中作为抵押的债券。

### 6.4.9 金融工具风险及管理

#### 6.4.9.1 风险管理政策和组织架构

本基金在日常经营活动中涉及的财务风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金管理人制定了政策和程序来识别及分析这些风险，并设定适当的风险限额及内部控制流程，通过可靠的管理及信息系统持续监控上述各类风险。

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

#### 6.4.9.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息，导致基金资产损失和收益变化的风险。本基金均投资于具有良好信用等级的债券，包括国债、央行票据、政策性金融债等，且通过分散化投资以分散信用风险。

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

于 2016 年 6 月 30 日，本基金持有的除国债、央行票据和政策性金融债以外的债券占基金资产净值的比例为 24.31%。

##### 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	99,989,122.01	199,987,006.48
A-1 以下	-	-
未评级	558,497,268.19	517,193,485.30
合计	658,486,390.20	717,180,491.78

注：(1) 债券评级取自第三方评级机构的债项评级。

(2) 未评级债券为债券期限在一年以内的政策性金融债、大额存单及超短融券。

##### 6.4.9.2.2 按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2016 年 6 月 30 日	上年度末 2015 年 12 月 31 日
AAA	-	-
AAA 以下	-	-
未评级	-	60,002,325.89
合计	-	60,002,325.89

注：(1) 债券评级取自第三方评级机构的债项评级。

(2) 未评级债券为债券期限大于一年的政策性金融债。

#### 6.4.9.3 流动性风险

流动性风险是指基金所持金融工具变现的难易程度。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难。

本基金所持大部分证券为剩余期限较短、信誉良好的国债、央行票据、政策性金融债及企业

短期融资券等，除在证券交易所的债券回购交易，其余均在银行间同业市场交易，能及时变现。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，卖出回购的资金余额在每个交易日一般均不超过基金资产净值的 20%。一般地，本基金所持有的金融负债的合同约定剩余到期日均为一年以内且不计息，可赎回基金份额净值(所有者权益)无固定到期日且不计息，因此账面余额即为未折现的合约到期现金流量。

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

#### 6.4.9.4 市场风险

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

##### 6.4.9.4.1 利率风险

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

下表统计了本基金的利率风险敞口。表中所示为本基金资产及负债的公允价值，并按照合同约定的重新定价日或到期日孰早者进行了分类。

##### 6.4.9.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2016年6月30日	1个月以内	1-3个月	3个月-1年	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产							
银行存款	2,685,832.19	1,098,000,000.00	180,000,000.00	-	-	-	1,280,685,832.19
结算备付金	40,772,053.56	-	-	-	-	-	40,772,053.56
存出保证金	3,882,575.42	-	-	-	-	-	3,882,575.42
交易性金融资产	100,008,683.54	428,582,928.57	129,894,778.09	-	-	-	658,486,390.20
买入返售金融资产	115,218,240.00	115,480,320.97	-	-	-	-	230,698,560.97
应收利息	-	-	-	-	-	5,546,001.89	5,546,001.89
应收申购款	-	-	-	-	-	175,071,879.97	175,071,879.97
资产总计	262,567,384.71	1,642,063,249.54	309,894,778.09	-	-	180,617,881.86	2,395,143,294.20
负债							
卖出回购金融资产款	119,699,740.15	-	-	-	-	-	119,699,740.15
应付赎回款	-	-	-	-	-	58,568,745.44	58,568,745.44

应付管理人报酬	-	-	-	-	-	550,053.18	550,053.18
应付托管费	-	-	-	-	-	162,978.75	162,978.75
应付销售服务费	-	-	-	-	-	267,152.91	267,152.91
应付交易费用	-	-	-	-	-	19,671.11	19,671.11
应付利息	-	-	-	-	-	6,886.85	6,886.85
应付利润	-	-	-	-	-	137,770.10	137,770.10
其他负债	-	-	-	-	-	554,008.44	554,008.44
负债总计	119,699,740.15	-	-	-	-	60,267,266.78	179,967,006.93
利率敏感度缺口	142,867,644.56	1,642,063,249.54	309,894,778.09	-	-	120,350,615.08	2,215,176,287.27
上年度末 2015 年 12 月 31 日	1 个月以内	1-3 个月	3 个月-1 年	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产							
银行存款	160,419,074.40	1,045,000,000.00	-	-	-	-	1,205,419,074.40
结算备付金	51,228,997.85	-	-	-	-	-	51,228,997.85
存出保证金	7,664,369.63	-	-	-	-	-	7,664,369.63
交易性金融资产	40,005,538.64	328,349,816.56	408,827,462.47	-	-	-	777,182,817.67
买入返售金融资产	300,000,000.00	-	-	-	-	-	300,000,000.00
应收利息	-	-	-	-	-	9,307,866.37	9,307,866.37
应收申购款	-	-	-	-	-	637,004,453.71	637,004,453.71
资产总计	559,317,980.52	1,373,349,816.56	408,827,462.47	-	-	646,312,320.08	2,987,807,579.63
负债							
卖出回购金融资产款	100,099,749.95	-	-	-	-	-	100,099,749.95
应付证券清算款	-	-	-	-	-	300,000,000.00	300,000,000.00
应付赎回款	-	-	-	-	-	37,004,604.96	37,004,604.96
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	412,694.32	412,694.32
应付托管费	-	-	-	-	-	122,279.81	122,279.81
应付销售服务费	-	-	-	-	-	204,461.32	204,461.32
应付交易费用	-	-	-	-	-	18,959.21	18,959.21
应付利息	-	-	-	-	-	6,636.77	6,636.77
应付利润	-	-	-	-	-	169,404.82	169,404.82
其他负债	-	-	-	-	-	457,482.18	457,482.18
负债总计	100,099,749.95	-	-	-	-	338,396,523.39	438,496,273.34
利率敏感度缺口	459,218,230.57	1,373,349,816.56	408,827,462.47	-	-	307,915,796.69	2,549,311,306.29

## 6.4.9.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	下表为利率风险的敏感性分析，反映了在其他变量不变的假设下，利率发生合理、可能的变动时，为交易而持有的债券公允价值的变动将对基金净值产生的影响。正数表示可能增加基金资产净值，负数表示可能减少基金资产净值。		
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）
	利率上升 25 个基点	-354,146.00	-596,917.94

	利率下降 25 个基点	354,865.00	598,049.74
--	-------------	------------	------------

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

#### 6.4.9.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基金持有的金融工具以人民币计价，因此无重大外汇风险。

#### 6.4.9.4.3 其他价格风险

市场价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于银行间同业市场交易的固定收益品种，且以摊余成本进行后续计量，因此无重大市场价格风险。

#### 6.4.10 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的其他重要事项。

## § 7 投资组合报告

### 7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	固定收益投资	658,486,390.20	27.49
	其中：债券	658,486,390.20	27.49
	资产支持证券	-	0.00
2	买入返售金融资产	230,698,560.97	9.63
	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	1,321,457,885.75	55.17
4	其他各项资产	184,500,457.28	7.70
5	合计	2,395,143,294.20	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	2.69
	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	119,699,740.15	5.40
	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

本基金本报告期内未发生债券正回购的资金余额超过基金资产净值的 20% 的情况。

## 7.3 基金投资组合平均剩余期限

### 7.3.1 投资组合平均剩余期限基本情况

项目	天数
报告期末投资组合平均剩余期限	82
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	83
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	25

### 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 120 天”，本报告期内，本基金未发生超标情况。

### 7.3.2 期末投资组合平均剩余期限分布比例

序号	平均剩余期限	各期限资产占基金资产净值的比例（%）	各期限负债占基金资产净值的比例（%）
1	30 天以内	11.85	5.40
	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	19.61	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	54.52	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	10.38	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）	3.61	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	99.97	5.40

## 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

本基金本报告期内未发生投资组合平均剩余存续期超过 240 天的情况。

## 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	120,002,783.77	5.42
	其中：政策性金融债	120,002,783.77	5.42
4	企业债券	-	0.00
5	企业短期融资券	209,889,799.87	9.48
6	中期票据	-	0.00
7	同业存单	328,593,806.56	14.83
8	其他	-	0.00
9	合计	658,486,390.20	29.73
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	111611180	16 平安 CD180	1,000,000	99,614,222.17	4.50
2	111610256	16 兴业 CD256	1,000,000	99,586,728.14	4.50
3	111611174	16 平安 CD174	800,000	79,704,213.17	3.60
4	071603005	16 中信 CP005	600,000	59,992,558.48	2.71
5	011699947	16 长江电力 SCP002	600,000	59,911,874.77	2.70
6	150416	15 农发 16	500,000	50,008,256.24	2.26
7	150215	15 国开 15	500,000	50,000,427.30	2.26
8	011699154	16 中节能 SCP001	500,000	49,988,803.09	2.26
9	111619044	16 恒丰银行 CD044	500,000	49,688,643.08	2.24
10	071603003	16 中信 CP003	400,000	39,996,563.53	1.81

## 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	0.1257%
报告期内偏离度的最低值	0.0051%
报告期内每个交易日偏离度的绝对值的简单平均值	0.0570%

**报告期内负偏离度的绝对值达到 0.25%情况说明**

本基金报告期内未发生负偏离度的绝对值达到 0.25%的情况。

**报告期内正偏离度的绝对值达到 0.5%情况说明**

本基金报告期内未发生正偏离度的绝对值达到 0.5%的情况。

**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 0.01 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	3,882,575.42
2	应收证券清算款	-
3	应收利息	5,546,001.89
4	应收申购款	175,071,879.97
5	其他应收款	-
6	待摊费用	-
7	其他	-
8	合计	184,500,457.28

**7.9.4 投资组合报告附注的其他文字描述部分**

由于四舍五入原因,分项之和与合计可能有尾差。

**§8 基金份额持有人信息****8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构**

份额单位:份

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

	(户)		持有份额	占总 份额 比例	持有份额	占总 份额 比例
现金宝 A	33,752	3,028,294.98	6,615,085,554.00	6.47%	95,595,926,641.00	93.53%
现金宝 B	85	1,403,607,253.32	102,874,682,179.00	86.23%	16,431,934,353.00	13.77%
合计	33,837	6,546,609.59	109,489,767,733.00	49.43%	112,027,860,994.00	50.57%

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

2、持有人户数为有效户数，即存量份额大于零的账户。

### 8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数（份）	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员 持有本基金	现金宝 A	-	0.0000%
	现金宝 B	-	0.0000%
	合计	-	0.0000%

### 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	现金宝 A	0
	现金宝 B	0
	合计	0
本基金基金经理持有本开 放式基金	现金宝 A	0
	现金宝 B	0
	合计	0

## §9 开放式基金份额变动

单位：份

	现金宝 A	现金宝 B
基金合同生效日（2013 年 3 月 27 日）基金 份额总额	53,299,270,100.00	68,673,168,700.00
本报告期期初基金份额总额	127,926,054,788.00	127,005,075,841.00
本报告期基金总申购份额	1,508,377,976,757.00	952,353,145,996.00
减：本报告期基金总赎回份额	1,534,093,019,350.00	960,051,605,305.00
本报告期基金拆分变动份额（份额减少以“-” 填列）	-	-
本报告期期末基金份额总额	102,211,012,195.00	119,306,616,532.00

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

依据《大成现金宝场内实时申赎货币市场基金招募说明书》规定，本基金分设两级基金份额，A 级基金份额和 B 级基金份额。A 级基金份额针对在单个基金账户保留份额在 30000 万以下的持有人，B 级基金份额针对在单个基金账户保留份额在 30000 万以上(含 30000 万)的持有人。若 A 级基金份额持有人在单个基金账户保留的基金份额超过 30000 万份时，本基金的注册登记机构自动将其在该基金账户持有的 A 级基金份额升级为 B 级基金份额；若 B 级基金份额持有人在单个基金账户保留的基金份额低于 30000 万份时，本基金的注册登记机构自动将其在该基金账户持有的 B 级基金份额转为 A 级基金份额。上述申购赎回份额中包含了 A 级与 B 级之间调增和调减份额。

## § 10 重大事件揭示

### 10.1 基金份额持有人大会决议

报告期内无基金份额持有人大会决议。

### 10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

#### 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

无。

### 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

报告期内无涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

### 10.4 基金投资策略的改变

本基金投资策略在本报告期内无重大改变。

### 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

基金聘任的为本基金审计的会计师事务所为安永华明会计师事务所(特殊普通合伙)。该事务所自基金合同生效日起为本基金提供审计服务至今。

### 10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期，本基金管理人、托管人及高级管理人员未受到监管部门稽查或处罚。

## 10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

## 10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
爱建证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
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%	-
川财证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
第一创业	1	-	0.00%	-	0.00%	-
东北证券	2	-	0.00%	-	0.00%	-
东方证券	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%	-
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%	-
华创证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
华西证券	2	-	0.00%	-	0.00%	-
联讯证券	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%	-
瑞银证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
山西证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
上海证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
申万宏源	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%	-
万和证券	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%	-
中泰证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
中信建投	2	-	0.00%	-	0.00%	-
中信证券	2	-	0.00%	-	0.00%	-
中银国际	2	-	0.00%	-	0.00%	-

注：根据中国证监会颁布的《关于完善证券投资基金交易席位制度有关问题的通知》（证监基金字[2007]48号）的有关规定，本公司制定了租用证券公司交易单元的选择标准和程序。

租用证券公司交易单元的选择标准主要包括：

- （一）财务状况良好，最近一年无重大违规行为；
- （二）经营行为规范，内控制度健全，能满足各投资组合运作的保密性要求；
- （三）研究实力较强，能提供包括研究报告、路演服务、协助进行上市公司调研等研究服务；
- （四）具备各投资组合运作所需的高效、安全的通讯条件，有足够的交易和清算能力，满足各投资组合证券交易需要；
- （五）能提供投资组合运作、管理所需的其他券商服务；
- （六）相关基金合同、资产管理合同以及法律法规规定的其他条件。

租用证券公司交易单元的程序：首先根据租用证券公司交易单元的选择标准形成《券商服务评价表》，然后根据评分高低进行选择基金交易单元。

本报告期内本基金退租交易单元：爱建证券，东方证券，万和证券；新增交易单元：无。

#### 10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例

中金公司	-	0.00%	627,000,000.00	100.00%	-	0.00%
------	---	-------	----------------	---------	---	-------

### 10.8 偏离度绝对值超过 0.5%的情况

本基金本报告期内无偏离度绝对值超过0.5%的情况。

### 10.9 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	大成现金宝场内实时申赎货币市场基金 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
2	大成现金宝场内实时申赎货币市场基金 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
3	大成现金宝场内实时申赎货币市场基金 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
4	大成现金宝场内实时申赎货币市场基金 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
5	大成现金宝场内实时申赎货币市场基金更新招募说明书 (2016 年 1 期)	中国证监会指定报刊及本公司网站	2016 年 5 月 12 日
6	大成现金宝场内实时申赎货币市场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 5 月 12 日
7	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
8	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
9	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
10	大成基金管理有限公司关于养	中国证监会指定报刊及本	2016 年 1 月 18



	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	公司网站	日
11	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
12	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
13	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
14	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
15	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
16	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
17	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
18	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	中国证监会指定报刊及本公司网站	2016 年 3 月 26 日

	业务的公告		
19	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
20	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
21	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
22	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
23	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
24	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
25	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
26	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
27	大成基金管理有限公司关于增	中国证监会指定报刊及本	2016 年 5 月 17

	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	公司网站	日
28	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
29	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、中国证监会批准设立大成现金宝场内实时申赎货币市场基金的文件；
- 2、《大成现金宝场内实时申赎货币市场基金基金合同》；
- 3、《大成现金宝场内实时申赎货币市场基金托管协议》；
- 4、大成基金管理有限公司批准文件、营业执照、公司章程；
- 5、本报告期内在指定报刊上披露的各种公告原稿。

#### 12.2 存放地点

备查文件存放在本基金管理人和托管人的办公住所。

### 12.3 查阅方式

投资者可在营业时间免费查阅，或登录本基金管理人网站 <http://www.dcfund.com.cn> 进行查阅。

大成基金管理有限公司  
2016 年 8 月 25 日