

大成现金增利货币市场基金更新招募说明书摘要

2017 年第 2 期

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

二零一八年一月

重要提示

大成现金增利货币市场基金（以下简称本基金）经中国证监会 2012 年 10 月 8 日证监许可

【2012】1306 号文核准募集，本基金的基金合同于 2012 年 11 月 20 日正式生效。

基金管理人保证招募说明书的内容真实、准确、完整。本招募说明书经中国证监会核准，但中国证监会对本基金募集的核准，并不表明其对本基金的价值和收益做出实质性判断或保证，也不表明投资于本基金没有风险。中国证监会不对基金的投资价值及市场前景等作出实质性判断或者保证。

基金管理人承诺依照恪尽职守、诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用基金资产，但不保证本基金一定盈利，也不保证最低收益。

基金的过往业绩并不预示其未来表现。基金管理人管理的其他基金的业绩并不构成本基金业绩表现的保证。

投资者购买货币市场基金并不等于将资金作为存款存放在银行或存款类金融机构。投资有风险，投资者申购基金时，请仔细阅读本基金的招募说明书及基金合同。

本招募说明书（更新）已经本基金托管人复核。本招募说明书（更新）所载内容截至日为 2017 年 11 月 20 日（其中人员变动信息以公告日为准），有关财务数据和基金净值表现截止日为 2017 年 9 月 30 日，所列财务数据未经审计。

一、基金管理人

（一）基金管理人概况

名称：大成基金管理有限公司

住所：深圳市福田区深南大道 7088 号招商银行大厦 32 层

办公地址：深圳市福田区深南大道 7088 号招商银行大厦 32 层

成立日期：1999 年 4 月 12 日

注册资本：贰亿元人民币

股权结构：公司股东为中泰信托有限责任公司（持股比例 50%）、中国银河投资管理有限公司（持股比例 25%）、光大证券股份有限公司（持股比例 25%）三家公司。

法定代表人：刘卓

电话：0755-83183388

传真：0755-83199588

联系人：肖剑

（二）主要人员情况

1. 公司高级管理人员

董事会：

刘卓先生，董事长，工学学士。曾任职于共青团哈尔滨市委、哈尔滨银行股份有限公司、中泰信托有限责任公司；2007 年 6 月，任哈尔滨银行股份有限公司执行董事；2008 年 8 月，任哈尔滨银行股份有限公司董事会秘书；2012 年 4 月，任哈尔滨银行股份有限公司副董事长；2012 年 11 月至今，任中泰信托有限责任公司监事会主席。2014 年 12 月 15 日起任大成基金管理有限公司董事长。

靳天鹏先生，副董事长，国际法学硕士。1991 年 7 月至 1993 年 2 月，任职于共青团河南省委；1993 年 3 月至 12 月，任职于深圳市国际经济与法律咨询公司；1994 年 1 月至 6 月，任职于深圳市蛇口律师事务所；1994 年 7 月至 1997 年 4 月，任职于蛇口招商港务股份有限公司；1997 年 5 月至 2015 年 1 月，先后任光大证券有限责任公司南方总部研究部研究员，南方总部机构管理部副总经理，光大证券股份有限公司债券业务部总经理助理，资产管理总部投资部副总经理（主持工作），法律合规部副总经理，零售交易业务总部副总经理；2014 年 10 月，任大成基金管理有限公司公司董事；2015 年 1 月起任大成基金管理有限公司副董事长。

罗登攀先生，董事、总经理，耶鲁大学经济学博士。具注册金融分析师(CFA)、金融风险管理师（FRM）资格。曾任毕马威（KPMG）法律诉讼部资深咨询师、金融部资深咨询师，以及 SLCG 证券诉讼和咨询公司合伙人；2009 年至 2012 年，任中国证券监督管理委员会规划委专家顾问委员，机构部创新处负责人，兼任国家千人计划专家；2013 年 2 月至 2014 年 10 月，任中信并购基金管理有限公司董事总经理，执委会委员。2014 年 11 月 26 日起任大成基金管理有限公司总经理。2015 年 3 月起兼任大成国际资产管理有限公司董事长。

周雄先生，董事，金融学博士，北京大学光华管理学院高级管理人员工商管理硕士（EMBA），上海市黄浦区政协委员。1987 年 8 月至 1993 年 4 月，任厦门大学财经系教师；1993 年 4 月至 1996 年 8 月，任华夏证券有限公司厦门分公司经理；1996 年 8 月至 1999 年 2 月，任人民日报社事业发展局企业管理处副处长；1999 年 2 月至今任职于中泰信托有限责任公司，历任副总裁、总裁，现任中泰信托有限责任公司董事、总裁。

孙学林先生，董事，硕士研究生。具注册会计师、注册资产评估师资格。现任中国银河投资管理有限公司党委委员、总裁助理，兼任投资二部总经理兼行政负责人、投资决策委员会副主任。2012 年 6 月起，兼任镇江银河创业投资有限公司总经理、投资决策委员会委员。

黄隽女士，独立董事，经济学博士。现任中国人民大学经济学院教授、博士生导师，中国人民大学艺术品金融研究所副所长。

叶林先生，独立董事，法学博士。现任中国人民大学法学院教授、民商法教研室主任，博士研究生导师、国家社会科学重点基地中国民商事法律科学研究中心兼职教授。

吉敏女士，独立董事，金融学博士，现任东北财经大学讲师，教研室主任，东北财经大学金融学国家级教学团队成员，东北财经大学开发金融研究中心助理研究员，主要从事金融业产业组织结构、银行业竞争方面的研究。参与两项国家自然科学基金、三项国家社科基金、三项教育部人文社会科学一般项目、多项省级创新团队项目，并负责撰写项目总结报告，在国内财经类期刊发表多篇学术论文。

金李先生，独立董事，博士。现任英国牛津大学商学院终身教职正教授（博士生导师）和北京大学光华管理学院讲席教授（博士生导师），金融系联合系主任，院长助理，北京大学国家金融研究中心主任。曾在美国哈佛大学商学院任教十多年，并兼任哈佛大学费正清东亚研究中心执行理事。

监事会：

陈希先生，监事长，中国人民大学经济学专业研究生，高级经济师。2006年被亚洲风险与危机管理协会授予企业风险管理师资格。2000年1月，先后任中国银河证券有限责任公司审计部、合规（法律）部总经理；2007年1月，任中国银河投资管理有限公司董事、常务副总裁、党委委员；2010年7月，兼任吉林省国家生物产业创业投资有限责任公司董事长兼总经理、吉林省国家汽车电子产业创业投资有限责任公司董事；2012年6月，兼任镇江银河创业投资有限公司董事长；2012年7月，任中国银河投资管理有限公司总裁；2015年1月起，任大成基金管理有限公司监事长。

蒋卫强先生，职工监事，经济学硕士。1997年7月至1998年10月任杭州益和电脑公司开发部软件工程师。1998年10月至1999年8月任杭州新利电子技术有限公司电子商务部高级程序员。1999年8月加入大成基金管理有限公司，历任信息技术部系统开发员、金融工程部高级工程师、监察稽核部总监助理、信息技术部副总监、风险管理部副总监、风险管理部总监，现任信息技术部总监。

吴萍女士，职工监事，文学学士，中国注册会计师协会非执业会员。曾任职于中国农业银行深圳分行、日本三和银行深圳分行、普华永道会计师事务所深圳分所。2010年6月加入大成基金管理有限公司，历任计划财务部高级会计师、总监助理，现任计划财务部副总监。2016年10月起兼任大成国际资产管理有限公司董事。

其他高级管理人员：

肖剑先生，副总经理，哈佛大学公共管理硕士。曾任深圳市南山区委（政府）办公室副主任，深圳市广聚能源股份有限公司副总经理兼广聚投资控股公司执行董事、总经理，深圳市人民政府国有资产监督管理委员会副处长、处长。2015年1月加入大成基金管理有限公司，任公司副总经理。

温智敏先生，副总经理，哈佛大学法学博士。曾任职美国 HuntonWilliams 国际律师事务所纽约州执业律师。中银国际投行业务副总裁，香港三山投资公司董事总经理，标准银行亚洲有限公司董事总经理兼中国投行业务主管。2015年4月加入大成基金管理有限公司，任首席战略官，2015年8月起任公司副总经理。2016年10月起兼任大成国际资产管理有限公司董事。

周立新先生，副总经理，大学本科学历。曾任新疆精河县县委办公室机要员、新疆精河县团委副书记、新疆精河县人民政府体改委副主任、新疆精河县八家户农场党委书记、新疆博尔塔拉蒙古自治州团委副书记及少工委主任、江苏省铁路发展股份有限公司办公室主任、江苏省铁路发展股份有限公司控股企业及江苏省铁路实业集团有限公司控股企业负责人、中国华闻投资控股有限公司燃气战略管理部项目经理。

2005年1月加入大成基金管理有限公司，历任客户服务中心总监助理、市场部副总经理、上海分公司副总经理、客户服务部总监兼上海分公司总经理、公司助理总经理，2015年8月起任公司副总经理。

谭晓冈先生，副总经理，哈佛大学公共行政管理硕士。曾任财政部世界银行司科长，世界银行中国执基办技术顾问，财政部办公厅处长，全国社保基金理事会办公厅处长、海外投资部副主任。2016年7月加入大成基金管理有限公司，2017年2月起任公司副总经理。

姚余栋先生，副总经理，英国剑桥大学经济学博士。曾任职于原国家经贸委企业司、美国花旗银行伦敦分行。曾任世界银行咨询顾问，国际货币基金组织国际资本市场部和非洲部经济学家，原黑龙江省招商局副局长，黑龙江省商务厅副厅长，中国人民银行货币政策二司副巡视员，中国人民银行货币政策司副司长，中国人民银行金融研究所所长。2016年9月加入大成基金管理有限公司，任首席经济学家，2017年2月起任公司副总经理。

陈翔凯先生，副总经理，香港中文大学工商管理硕士。曾任职于广发证券海南分公司，平安保险集团公司。曾任华安财产保险有限公司高级投资经理，国投瑞银基金管理有限公司固定收益部总监，招商证券资产管理有限公司副总经理。2016年11月加入大成基金管理有限公司，2017年2月起任公司副总经理。

赵冰女士，督察长，清华大学工商管理硕士。曾任职于中国证券业协会资格管理部、专业联络部、基金公司会员部，曾任中国证券业协会分析师委员会委员、基金销售专业委员会委员。曾参与基金业协会筹备组的筹备工作。曾先后任中国证券投资基金业协会投教与媒体公关部负责人、理财及服务机构部负责人。

2017年7月加入大成基金管理有限公司，2017年8月起任公司督察长。

2、基金经理

(1) 现任基金经理

张文平先生，南京大学管理学硕士，注册会计师，6年证券从业经历。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年起加入大成基金管理有限公司，历任固定收益部助理研究员，现任固定收益总部研究部副总监。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日至2016年11月18日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日至2017年3月18日任大成现金宝场内实时申赎货币市场基金基金经理。2015年7月1日起任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。2016年9月6日起任大成景安短融债券型证券投资基金和大成现金增利货币市场基金基金经理。2016年9月20日起任大成景辉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。

(2) 历任基金经理

历任基金经理姓名 管理本基金时间

王立 2012年11月20日至2014年4月4日

李达夫 2013年3月7日至2016年9月23日

3、公司固定收益投资决策委员会

公司固定收益投资决策委员会由4名成员组成，设固定收益投资决策委员会主席1名，其他委员3名。名单如下：

陈翔凯，公司副总经理，固定收益投资决策委员会主席；王立，基金经理，固定收益总部总监，固定收益投资决策委员会委员；谢民，交易管理部副总监，固定收益投资决策委员会委员；张文平，基金经理，固定收益投资决策委员会委员。

上述人员之间不存在亲属关系。

二、基金托管人

(一) 基金托管人情况

1、基本情况

名称：中国农业银行股份有限公司（简称中国农业银行）

住所：北京市东城区建国门内大街69号

办公地址：北京市西城区复兴门内大街28号凯晨世贸中心东座

法定代表人：周慕冰

成立日期：2009年1月15日

批准设立机关和批准设立文号：中国银监会银监复[2009]13号

基金托管业务批准文号：中国证监会证监基字[1998]23号

注册资本：32,479,411.7万元人民币

存续期间：持续经营

联系电话：010-66060069

传真：010-68121816

联系人：林葛

中国农业银行股份有限公司是中国金融体系的重要组成部分,总行设在北京。经国务院批准,中国农业银行整体改制为中国农业银行股份有限公司并于2009年1月15日依法成立。中国农业银行股份有限公司承继原中国农业银行全部资产、负债、业务、机构网点和员工。中国农业银行网点遍布中国城乡,成为国内网点最多、业务辐射范围最广,服务领域最广,服务对象最多,业务功能齐全的大型国有商业银行之一。在海外,中国农业银行同样通过自己的努力赢得了良好的信誉,每年位居《财富》世界500强企业之列。作为一家城乡并举、联通国际、功能齐备的大型国有商业银行,中国农业银行一贯秉承以客户为中心的经营理念,坚持审慎稳健经营、可持续发展,立足县域和城市两大市场,实施差异化竞争策略,着力打造伴你成长服务品牌,依托覆盖全国的分支机构、庞大的电子化网络和多元化的金融产品,致力为广大客户提供优质的金融服务,与广大客户共创价值、共同成长。

中国农业银行是中国第一批开展托管业务的国内商业银行,经验丰富,服务优质,业绩突出,2004年被英国《全球托管人》评为中国最佳托管银行。2007年中国农业银行通过了美国SAS70内部控制审计,并获得无保留意见的SAS70审计报告。自2010年起中国农业银行连续通过托管业务国际内控标准

(ISAE3402)认证,表明了独立公正第三方对中国农业银行托管服务运作流程的风险管理、内部控制的健全有效性的全面认可。中国农业银行着力加强能力建设,品牌声誉进一步提升,在2010年首届金牌理财TOP10颁奖盛典中成绩突出,获最佳托管银行奖。2010年再次荣获《首席财务官》杂志颁发的最佳资产托管奖。2012年荣获第十届中国财经风云榜最佳资产托管银行称号;2013年至2016年连续荣获上海清算所授予的托管银行优秀奖和中央国债登记结算有限责任公司授予的优秀托管机构奖称号;2015年、2016年荣获中国银行业协会授予的养老金业务最佳发展奖称号。

中国农业银行证券投资基金托管部于1998年5月经中国证监会和中国人民银行批准成立,2014年更名为托管业务部/养老金管理中心,内设综合管理部、业务管理部、客户一部、客户二部、客户三部、客户四部、风险合规部、产品研发与信息技术部、营运一部、营运二部、市场营销部、内控监管部、账户管理部,拥有先进的安全防范设施和基金托管业务系统。

2、主要人员情况

中国农业银行托管业务部现有员工近140名,其中具有高级职称的专家30余名,服务团队成员专业水平高、业务素质好、服务能力强,高级管理层均有20年以上金融从业经验和高级技术职称,精通国内外证券市场的运作。

3、基金托管业务经营情况

截止到2017年9月30日,中国农业银行托管的封闭式证券投资基金和开放式证券投资基金共415只。

(二) 基金托管人的内部风险控制制度说明

1、内部控制目标

严格遵守国家有关托管业务的法律法规、行业监管规章和行内有关管理规定,守法经营、规范运作、严格监察,确保业务的稳健运行,保证基金财产的安全完整,确保有关信息的真实、准确、完整、及时,保护基金份额持有人的合法权益。

2、内部控制组织结构

风险管理委员会总体负责中国农业银行的风险管理与内部控制工作,对托管业务风险管理和内部控制工作进行监督和评价。托管业务部专门设置了风险管理处,配备了专职内控监督人员负责托管业务的内控监督工作,独立行使监督稽核职权。

3、内部控制制度及措施

具备系统、完善的制度控制体系,建立了管理制度、控制制度、岗位职责、业务操作流程,可以保证托管业务的规范操作和顺利进行;业务人员具备从业资格;业务管理实行严格的复核、审核、检查制度,授权工作实行集中控制,业务印章按规程保管、存放、使用,账户资料严格保管,制约机制严格有效;业务操作区专门设置,封闭管理,实施音像监控;业务信息由专职信息披露人负责,防止泄密;业务实现自动化操

作，防止人为事故的发生，技术系统完整、独立。

（三）基金托管人对基金管理人运作基金进行监督的方法和程序

基金托管人通过参数设置将《基金法》、《运作办法》、基金合同、托管协议规定的投资比例和禁止投资品种输入监控系统，每日登录监控系统监督基金管理人的投资运作，并通过基金资金账户、基金管理人的投资指令等监督基金管理人的其他行为。

当基金出现异常交易行为时，基金托管人应当针对不同情况进行以下方式的处理：

- 1、电话提示。对媒体和舆论反映集中的问题，电话提示基金管理人；
- 2、书面警示。对本基金投资比例接近超标、资金头寸不足等问题，以书面方式对基金管理人进行提示；
- 3、书面报告。对投资比例超标、清算资金透支以及其他涉嫌违规交易等行为，书面提示有关基金管理人并报中国证监会。

三、相关服务机构

（一）直销机构

名称：大成基金管理有限公司

住所：深圳市福田区深南大道 7088 号招商银行大厦 32 层

办公地址：深圳市福田区深南大道 7088 号招商银行大厦 32 层

法定代表人：刘卓

电话：0755-83183388

传真：0755-83199588

联系人：乐园

公司网址：www.dcfund.com.cn

大成基金客户服务热线：400-888-5558（免长途固话费）

大成基金深圳投资理财中心：

地址：深圳市福田区深南大道 7088 号招商银行大厦 32 层

联系人：肖成卫、关志玲、白小雪

电话：0755-22223523/22223177/22223555

传真：0755-83195235/83195242/83195232

（二）代销机构

1、中国农业银行股份有限公司

注册地址：北京市东城区建国门内大街 69 号

办公地址：北京市西城区复兴门内大街 28 号凯晨世贸中心东座

法定代表人：周慕冰

联系人：林葛

联系电话：010-66060069

传真：010-68121816

客服电话：95599

网址：www.abchina.com

2、中国银行股份有限公司

注册地址：北京西城区复兴门内大街 1 号

法定代表人：田国立

客服电话：95566

联系人：王娟

电话：010-66594909

传真：010-66594942

网址：www.boc.cn

3、交通银行股份有限公司

办公地址：上海市浦东新区银城中路 188 号

法定代表人：牛锡明

客服电话：95559

联系人：曹榕

电话：021-58781234

传真：021-58408483

网址：www.bankcomm.com

4、上海农村商业银行股份有限公司

注册地址：上海市浦东新区浦东大道 981 号

法定代表人：胡平西

客服电话：021-962999、400-696-2999

电话：021-38576666

传真：021-50105124

联系人：施传荣

网址：www.shrcb.com

5、青岛银行股份有限公司

办公地址：青岛市市南区香港中路 68 号华普大厦

法定代表人：张广鸿

联系人：滕克、李佳程

联系电话：0532-68629926

客服电话：96588（青岛）、400-66-96588（全国）

网址：www.qdccb.com

6、杭州银行股份有限公司

办公地址：杭州庆春路 46 号

法定代表人：吴太普

联系人：严峻

联系电话：0571-85108309

客服电话：95398

网址：www.hzbank.com.cn

7、温州银行股份有限公司

注册地址：温州市车站大道华海广场 1 号楼

办公地址：温州市车站大道 196 号

法定代表人：邢增福

联系人：林波

电话：0577-88990082

传真：0577-88995217

客户服务热线：96699、浙江省外 0577-96699

网址：www.wzbank.cn

8、张家港农村商业银行股份有限公司

注册地址：张家港市杨舍镇人民中路 66 号

法定代表人：王自忠

客服电话：0512-96065

联系人：施圆圆

电话：0512-56968212

传真：0512-58236370

网址：www.zrcbank.com

9、洛阳银行股份有限公司

注册地址：洛阳市洛龙区开元大道 256 号

办公地址：洛阳市洛龙区开元大道 256 号

客服电话：0379-96699

法定代表人：王建甫

联系人：胡艳丽

电话：0379-65921977

传真：0379-65921851

网址：www.bankofluoyang.com.cn

10、大连银行股份有限公司

注册地址：大连市中山区中山路 88 号天安国际大厦 49 楼

法定代表人：陈占维

客服电话：4006640099

联系人：：李格格

电话：：0411-82356627

传真：0411-82311420

网址：www.bankofdl.com

11、哈尔滨银行股份有限公司

住所：哈尔滨市道里区尚志大街 160 号

办公地址：哈尔滨市道里区尚志大街 160 号

法定代表人：郭志文

联系人：遇玺

联系电话：0451-86779018

传真：0451-86779007

客服电话：95537

公司网址：www.hrbb.com.cn

12、吉林银行股份有限公司

注册地址：吉林省长春市东南湖大路 1817 号

法定代表人：张宝祥

联系人：孙琦

联系电话：043184999627

客服电话：400-88-96666(全国)、96666(吉林省)

网址：www.jlbank.com.cn

13、徽商期货有限责任公司

注册地址：合肥市芜湖路 258 号

法人代表：吴国华

联系人：蔡芳

传真：0551-62862801

客服电话：4008878707

网址：<http://www.hsqh.net>

14、东海期货有限责任公司

注册地址：江苏省常州市延陵西路 23、25、27、29 号
办公地址：上海市浦东新区东方路 1928 号东海证券大厦 8 楼
法定代表人：陈太康
联系人：李天雨
联系电话：021-68757102
客服电话：95531、4008888588
网址：www.qh168.com.cn

15、国泰君安证券股份有限公司

注册地址：中国（上海）自由贸易试验区商城路 618 号
办公地址：上海市浦东新区银城中路 168 号上海银行大厦 29 楼
法定代表人：杨德红
客服电话：95521
联系人：芮敏祺、朱雅崑
联系电话：021-38676666
传真：021-38670161
网址：www.gtja.com

16、中信建投证券股份有限公司

注册地址：北京市朝阳区安立路 66 号 4 号楼
法定代表人：王常青
客服电话：4008888108
联系人：权唐
电话：010-85130577
传真：010-65182261
网址：www.csc108.com

17、国信证券股份有限公司

注册地址：深圳市罗湖区红岭中路 1012 号国信证券大厦十六层至二十六层
法定代表人：何如
客服电话：95536
联系人：周杨
电话：0755-82130833
传真：0755-82133952
网址：www.guosen.com.cn

18、招商证券股份有限公司

注册地址：深圳市福田区益田路江苏大厦 A 座 38-45 层
法定代表人：宫少林
客服电话：95565
联系人：黄婵君
电话：0755-82960167
传真：0755-82943636
网址：www.newone.com.cn

19、广发证券股份有限公司

注册地址：广州天河区天河北路 183-187 号大都会广场 43 楼（4301-4316 房）
办公地址：广东省广州天河北路大都会广场 5、18、19、36、38、39、41、42、43、44 楼
法定代表人：孙树明

客服电话：95575

联系人：黄岚

电话：020-87555888

传真：020-87555305

网址：www.gf.com.cn

20、中信证券股份有限公司

注册地址：广东省深圳市福田区中心三路8号卓越时代广场（二期）北座

法定代表人：张佑君

客服电话：010-84588888

联系人：顾凌

电话：010-60838696

传真：010-84865560

网址：www.cs.ecitic.com

21、中国银河证券股份有限公司

注册地址：北京市西城区金融大街35号国际企业大厦C座

法定代表人：宋卫刚

客服电话：4008-888-888

联系人：宋明

联系电话：010-66568450

传真：010-66568990

网址：www.chinastock.com.cn

22、海通证券股份有限公司

注册地址：上海市广东路689号

法定代表人：瞿秋平（代为履行法定代表人职责）

客服电话：95553、400-888-8001

联系人：李笑鸣

电话：021-23219000

传真：021-63602722

网址：www.htsec.com

23、申万宏源证券有限公司

通讯地址：上海市徐汇区长乐路989号40层

法定代表人：李梅

客服电话：95523 或 4008895523

联系人：曹晔

电话：021-54033888

传真：021-54038844

网址：www.sywg.com

24、兴业证券股份有限公司

注册地址：福州市湖东路268号

法定代表人：兰荣

客服电话：95562

联系人：夏中苏

电话：0591-38281963

传真：0591-38507538

网址: www.xyqz.com.cn

25、安信证券股份有限公司

注册地址: 深圳市福田区金田路 4018 号安联大厦 35 层、28 层 A02 单元

法定代表人: 王连志

客服电话: 4008001001

联系人: 陈剑虹

电话: 0755-82825551

传真: 0755-82558355

网址: www.essence.com.cn

26、西南证券股份有限公司

注册地址: 重庆市渝中区临江支路 2 号合景国际大厦 A 幢

法定代表人: 余维佳

客服电话: 4008096096

联系人: 张煜

联系电话: 023-63786633

网址: www.swsc.com.cn

27、万联证券有限责任公司

注册地址: 北京市海淀区北三环西路 99 号院 1 号楼 15 层 1501

法定代表人: 张建军

联系人: 王鑫

联系电话: 020-38286651

客服电话: 400-8888-133

网址: www.wlzq.com.cn

28、民生证券股份有限公司

注册地址: 北京市东城区建国门内大街 28 号民生金融中心 A 座

法定代表人: 余政

客服电话: 4006198888

联系人: 赵明

联系电话: 010-85127622

联系传真: 010-85127917

公司网址: www.msyzq.com

29、渤海证券股份有限公司

注册地址: 天津市经济技术开发区第二大街 42 号写字楼 101 室

法定代表人: 王春峰

联系人: 蔡霆

电话: 022-28451991

传真: 022-28451892

客服电话: 4006515988

网址: www.ewww.com.cn

30、华泰证券股份有限公司

注册地址: 南京市江东中路 228 号

办公地址: 南京市建邺区江东中路 228 号华泰证券广场

法定代表人: 周易

客服电话: 4008-888-168、95597

联系人：庞晓芸

电话：0755-82492193

传真：0755-82492962

网址：www.htsc.com.cn

31、中信证券（山东）有限责任公司

注册地址：青岛市崂山区苗岭路 29 号澳柯玛大厦 15 层（1507-1510 室）

办公地址：青岛市东海西路 28 号

法定代表人：杨宝林

客服电话：95548

联系人：吴忠超

电话：0532-85022326

传真：0532-85022605

网址：www.zxwt.com.cn

32、信达证券股份有限公司

注册地址：北京市西城区闹市口大街 9 号院 1 号楼

法定代表人：张志刚

客服电话：4008008899

联系人：唐静

联系电话：010-63081000

传真：010-63080978

公司网址：www.cindasc.com

33、东方证券股份有限公司

注册地址：上海市中山南路 318 号新源广场 2 号楼 22-29 楼

法定代表人：潘鑫军

客服电话：95503

联系人：胡月茹

电话：021-63325888

传真：021-63326173

网址：www.dfzq.com.cn

34、方正证券股份有限公司

注册地址：湖南省长沙市芙蓉中路二段华侨国际大厦 22-24 层

法定代表人：雷杰

客服电话：95571

联系人：徐锦福

电话：010-57398062

传真：010-57398058

网址：www.foundersc.com

35、长城证券股份有限公司

注册地址：深圳市福田区深南大道 6008 号特区报业大厦 14、16、17 层

法定代表人：杨光裕

客户服务热线：0755-33680000、400-6666-888

联系人：高峰

电话：0755-83516094

传真：0755-83516199

网址: www.cgws.com

36、光大证券股份有限公司

办公地址: 上海市静安区新闻路 1508 号

法定代表人: 薛峰

客服电话: 400-888-8788、95525

联系人: 刘晨

电话: 021-22169999

传真: 021-22169134

网址: www.ebscn.com

37、广州证券股份有限公司

注册地址: 广州市先烈中路 69 号东山广场主楼十七楼

法定代表人: 邱三发

客服电话: 95396

联系人: 林洁茹

联系电话: 020-87322668

传真: 020-87325036

网址: www.gzs.com.cn

38、东北证券股份有限公司

注册地址: 长春市生态大街 6666 号

办公地址: 长春市生态大街 6666 号

法定代表人: 李福春

客服电话: 95360

联系人: 安岩岩

电话: 0431-85096517

传真: 0431-85096795

网址: www.nesc.cn

39、南京证券股份有限公司

办公地址: 南京市玄武区大钟亭 8 号

法定代表人: 步国旬

客服电话: 95386

联系人: 石健

电话: 025-83367888

传真: 025-83364032

网址: www.njq.com.cn

40、上海证券有限责任公司

注册地址: 上海市黄浦区四川中路 213 号久事商务大厦 7 楼

法定代表人: 李俊杰

客服电话: 021-962518、4008918918

联系人: 许曼华

电话: 021-53519888

传真: 021-63608830

网址: www.962518.com

41、浙商证券股份有限公司

办公地址: 浙江省杭州市杭大路 1 号黄龙世纪广场 A 座 6-7 楼

法定代表人：吴承根

联系人：张智

电话：021-64716089

客服电话：95345

网址：www.stocke.com.cn

42、平安证券股份有限公司

办公地址：深圳市福田区金田路大中华国际交易广场 8 楼

法定代表人：曹实凡

客服电话：95511 转 8

传真：0755-82400862

网址：www.pingan.com

43、华安证券有限责任公司

注册地址：安徽省合肥市长江中路 357 号

法定代表人：李工

客服电话：0551-96518、400-80-96518

联系人：甘霖

电话：0551-5161821

传真：0551-5161672

网址：www.hazq.com

44、东莞证券有限责任公司

注册地址：东莞市莞城区可园南路 1 号金源中心 30 楼

法定代表人：张运勇

客服电话：0769-961130

联系人：梁健伟

电话：0769-22119341

传真：0769-22116999

网址：www.dgzq.com.cn

45、国都证券股份有限公司

注册地址：北京市东城区东直门南大街 3 号国华投资大厦 9 层 10 层

法定代表人：常喆

客服电话：400-818-8118

联系人：黄静

电话：010-84183333

传真：010-84183311-3389

网址：www.guodu.com

46、中泰证券股份有限公司

办公地址：山东省济南市经十路 20518 号

法定代表人：李玮

客服电话：95538

联系人：吴阳

电话：0531-81283938

传真：0531-81283900

网址：www.qlzq.com.cn

47、第一创业证券股份有限公司

办公地址：深圳市罗湖区笋岗路 12 号中民时代广场 B 座 25F

法人代表：刘学民

电话：95358

网址：www.firstcapital.com.cn

48、金元证券股份有限公司

注册地址：海南省海口市南宝路 36 号证券大厦 4 层（邮政编码：570206）

办公地址：深圳市深南大道 4001 号时代金融中心 17 楼（邮政编码：518034）

法定代表人：陆涛

客服电话：4008-888-228

联系人：马贤清

电话：0755-83025022

传真：0755-83025625

网址：www.jyzq.cn

49、华林证券股份有限公司

注册地址：西藏自治区拉萨市柳梧新区察古大道 1-1 君泰国际 B 栋一层 3 号

办公地址：深圳市福田区民田路 178 号华融大厦 5、6 楼

法定代表人：林立

客服电话：400-188-3888

联系人：李琳

电话：0755-82707857

传真：0755-23613751

网址：www.chinalions.com

50、中国国际金融有限公司

注册地址：北京市建国门外大街 1 号国贸大厦 2 座 27 层及 28 层

办公地址：北京市建国门外大街甲 6 号 SK 大厦

法定代表人：丁学东

联系人：杨涵宇

电话：010-65051166

网址：www.ciccs.com.cn

51、财通证券有限责任公司

注册地址：杭州市杭大路 15 号嘉华国际商务中心

法定代表人：沈继宁

客户联系电话：0571-96336（上海地区：962336）

联系人：乔骏

电话：0571-87925129

传真：0571-87925100

网址：www.ctsec.com

52、上海华信证券有限责任公司

注册地址：上海浦东新区世纪大道 100 号环球金融中心 9 楼

法定代表人：郭林

客服电话：4008205999

联系人：李颖

电话：021-38784814

传真：021-68774818

网址: www.shhxzq.com

53、华鑫证券有限责任公司

注册地址: 深圳市福田区金田路 4018 号安联大厦 28 层 A01、B01 (b) 单元

办公地址: 上海市肇嘉浜路 750 号

法定代表人: 俞洋

联系人: 陈敏

网站: www.cfsc.com.cn

客服电话: 021-32109999、029-68918888、4001099918

54、瑞银证券有限责任公司

注册地址: 北京市西城区金融大街 7 号英蓝国际金融中心 12 层、15 层

法定代表人: 程宜荪

电话: 010-58328373

传真: 010-58328748

联系人: 冯爽

客服电话: 400-887-8827

网址: www.ubssecurities.com

55、中国中投证券有限责任公司

注册地址: 深圳市福田区益田路与福中路交界处荣超商务中心 A 栋第 18 层-21 层及第 04 层
01.02.03.05.11.12.13.15.16.18.19.20.21.22.23 单元

办公地址: 深圳市福田区益田路 6003 号荣超商务中心 A 栋第 04、18 层至 21 层

法定代表人: 高涛

联系人: 刘毅

客户电话: 4006008008

电话: 0755-82023442

传真: 0755-82026539

网址: www.china-invs.cn

56、中山证券有限责任公司

注册地址: 深圳市福田区益田路 6009 号新世界中心 29 层

法定代表人: 黄扬录

联系人: 罗艺琳

联系电话: 0755-82570586

客服电话: 400-1022-011

网址: www.zszq.com.cn

57、联讯证券股份有限公司

注册地址: 广东省惠州市惠城区江北东江三路惠州广播电视新闻中心三、四楼

法人代表: 徐刚

联系人: 郭晴

联系电话: 0752-2119391

客服电话: 95564

网址: www.lxzq.com.cn

58、江海证券有限公司

办公地址: 哈尔滨市香坊区赣水路 56 号

法人代表: 孙名扬

电话: 0451-85863726

客服热线：4006662288

联系人：周俊

网址：www.jhzq.com.cn

59、国金证券股份有限公司

注册地址：成都市东城根上街 95 号

客服电话：4006600109

联系人：刘婧漪

电话：028-86690057

传真：028-86690126

客服电话：95310

网址：www.gjq.com.cn

60、中国民族证券有限责任公司

注册地址：北京市朝阳区北四环中路 27 号院 5 号楼 40 层-43 层

法人代表：赵大建

联系人：李微

客服电话：400-889-5618

网址：www.e5618.com

61、华宝证券有限责任公司

注册地址：上海市浦东新区环球金融中心 57 楼

法定代表人：陈林

客服电话：400-820-9898

联系人：刘闻川

电话：021-68778075

传真：021-68868117

网址：www.cnhbstock.com

62、爱建证券有限责任公司

注册地址：中国（上海）自由贸易试验区世纪大道 1600 号 1 幢 32 楼

法定代表人：钱华

客服电话：4001-962-502

联系人：陈敏

电话：021-32229888

传真：021-62878783

网址：www.ajzq.com

63、华融证券股份有限公司

注册地址：北京市西城区金融大街 8 号

法定代表人：祝献忠

联系人：李慧灵

联系电话：010-58315221

传真：010-58568062

客服电话：010-58568118、400-898-9999

网址：www.hrsec.com.cn

64、天风证券股份有限公司

注册地址：湖北省武汉市东湖新技术开发区关东园路 2 号高科大厦四楼

法定代表人：余磊

联系人：翟璟

联系电话：（027）87618882、（028）86711410

传真：（027）87618863

网址：www.tfzq.com

65、万和证券有限责任公司

注册地址：海口市南沙路 49 号通信广场二楼

法定代表人：朱治理

联系人：王少峰

电话：0755-25479116

网站：www.wanhesec.com.cn

公司传真：0755-25171353

客服电话：0755-25170332

66、宏信证券有限责任公司

办公地址：四川省成都市人民南路二段 18 号川信大厦 10 楼

法人代表：吴玉明

客服电话：4008366366

联系人：刘文涛

电话：02886199765

传真：02886199533

网址：<http://www.hx818.com>

67、天相投资顾问有限公司

注册地址：北京市西城区金融街 19 号富凯大厦 B 座 701

法定代表人：林义相

客服电话：010-66045678

联系人：尹伶

传真：010-66045527

网址：www.txsec.com

68、深圳市新兰德证券投资咨询有限公司

注册地址：深圳市福田区华强北路赛格科技园 4 栋 10 层 1006 号

法定代表人：杨懿

办公地址：深圳市福田区华强北路赛格科技园 4 栋 10 层 1006 号

联系人：张燕

联系电话：010-58325388*1588

网站：www.new-rand.cn

客服电话：400-166-1188

69、和讯信息科技有限公司

注册地址：北京市朝阳区朝外大街 22 号泛利大厦 10 层

法定代表人：王莉

联系人：刘洋

联系电话：021-20835785

传真：021-20835879

客服电话：400-920-0022

网址：<http://licaike.hexun.com>

70、诺亚正行（上海）基金销售投资顾问有限公司

注册地址：上海市虹口区飞虹路 360 弄 9 号 3724 室
法定代表人：汪静波
办公地址：上海市杨浦区昆明路 508 号北美广场 B 座 12 楼
联系人：徐诚
联系电话：021-38509639
网站：www.noah-fund.com
客服电话：400-821-5399

71、深圳众禄金融控股股份有限公司

办公地址：深圳市罗湖区梨园路 8 号 HALO 广场 4 楼
法定代表人：薛峰
联系人：童彩平
电话：0755-33227950
传真：0755-82080798
网址：www.zlfund.cn
客服电话：4006-788-887

72、上海天天基金销售有限公司

注册地址：上海市徐汇区龙田路 195 号 3C 座 9 楼
法人代表：其实
联系人：潘世友
电话：021-54509998
传真：021-64383798
客服电话：400-1818-188
网址：www.1234567.com.cn

73、上海好买基金销售有限公司

注册地址：上海市虹口区场中路 685 弄 37 号 4 号楼 449 室
办公地址：上海市浦东新区浦东南路 1118 号鄂尔多斯国际大厦 903~906
法定代表人：杨文斌
客服电话：400-700-9665
联系人：张茹
联系电话：021-58870011
传真：021-68596916
网址：www.ehowbuy.com

74、蚂蚁(杭州)基金销售有限公司(原杭州数米基金销售有限公司)

注册地址：杭州市余杭区仓前街文一西路 1218 号 1 栋 202 室
法人代表：陈柏青
联系人：徐映绯
电话：021-60897840
传真：0571-26698533
客服电话：4000-766-123
网址：www.fund123.cn

75、上海长量基金销售投资顾问有限公司

注册地址：上海市浦东新区高翔路 526 号 2 幢 220 室
办公地址：上海市浦东新区浦东大道 555 号裕景国际 B 座 16 层
法定代表人：张跃伟

客服电话：400-820-2899

网址：www.erichfund.com

76、浙江同花顺基金销售有限公司

注册地址：杭州市西湖区文二西路1号元茂大厦903室

办公地址：浙江省杭州市西湖区翠柏路7号电子商务产业园2号楼

法人代表：凌顺平

联系人：林海明

电话：0571-88911818-8580

传真：0571-88911818-8002

客服电话：4008-773-772

网站地址：www.5ifund.com

77、上海利得基金销售有限公司

注册地址：上海市宝山区蕴川路5475号1033室

办公地址：上海市浦东新区峨山路91弄61号1幢14层

法定代表人：李兴春

传真：021-50583633

电话：021-50583533

客服电话：400-921-7755

网址：www.leadfund.com.cn

78、北京恒天明泽基金销售有限公司

注册地址：北京市经济技术开发区宏达北路10号5层5122室

办公地址：北京市朝阳区东三环北路甲19号SOHO嘉盛中心30层3001室

法定代表人：周斌

客服电话：4008980618

网址：www.chtfund.com

79、北京汇成基金销售有限公司

注册地址：北京市海淀区中关村大街11号11层1108

法定代表人：王伟刚

联系人：丁向坤

电话：010-56282140

传真：010-62680827

客服电话：400-619-9059

网址：www.fundzone.cn

80、北京晟视天下投资管理有限公司

注册地址：北京市怀柔区九渡河镇黄坎村735号03室

法定代表人：蒋煜

联系人：孙悦

电话：010-58170823

传真：010-58170800

客服电话：400-818-8866

网址：<http://fund.shengshiview.com>

81、北京钱景基金销售有限公司

注册地址：北京市海淀区丹棱街6号1幢9层1008-1012

办公地址：北京市海淀区丹棱街6号中关村金融大厦（丹棱soho）1008

法定代表人：赵荣春

联系人：魏争

网站：www.qianjing.com

客服电话：400-893-6885

82、北京唐鼎耀华投资咨询有限公司

注册地址：北京市延庆县延庆经济开发区百泉街10号2栋236室

法定代表人：张冠宇

客服电话：400-819-9868

联系人：刘美薇

电话：010-85870662

传真：4008875666-129666

网址：www.tdyhfund.com

83、北京植信基金销售有限公司

注册地址：北京市密云县兴盛南路8号院2号楼106室-67

办公地址：北京市朝阳区四惠盛世龙源国食苑10号

法定代表人：杨纪峰

联系人：吴鹏

电话：18701358525

传真：010-67767615

客服电话：400-680-2123

网址：www.zhixin-inv.com

84、泰诚财富基金销售（大连）有限公司

注册地址：辽宁省大连市沙河口区星海中路3号

法定代表人：林卓

联系人：张晓辉

电话：0411-88891212

传真：0411-84396536

客服电话：400-6411-999

网址：www.taichengcaifu.com

85、上海基煜基金销售有限公司

注册地址：上海市崇明县长兴镇路潘园公路1800号2号楼6153室（上海泰和经济展发区）

办公地址：上海市杨浦区昆明路518号a1002室

法定代表人：王翔

联系人：安彬

客服电话：（021）65370077

网址：www.jiyufund.com.cn

86、上海凯石财富基金销售有限公司

注册地址：上海市黄浦区西藏南路765号602-115室

法定代表人：陈继武

客服电话：4000178000

联系人：葛佳蕊

电话：021-63333319

传真：021-63332523

网址：www.vstonewealth.com

87、北京虹点基金销售有限公司

注册地址：北京市朝阳区工人体育场北路甲 2 号裙房 2 层 222 单元

办公地址：北京市朝阳区工人体育场北路甲 2 号裙房 2 层 222 单元

法定代表人：胡伟

传真：010-65951887

电话：010-65951887

客服电话：400-618-0707

网址：www.hongdianfund.com

88、武汉市伯嘉基金销售有限公司

注册地址：湖北省武汉市江汉区武汉中央商务区泛海国际 SOHO 城（一期）第 7 栋 23 层 1 号、4 号

法定代表人：陶捷

联系人：杨帆

电话：027-87006003、87006009

网站：www.buyfunds.cn

公司传真：027-87006010

客服电话：400-027-9899

89、上海陆金所资产管理有限公司

注册地址：上海市浦东新区陆家嘴环路 1333 号 14 楼 09 单元

法定代表人：郭坚

办公地址：上海市浦东新区陆家嘴环路 1333 号 14 楼

联系人：宁博宇

客服电话：4008219031

网站：www.lufunds.com

90、珠海盈米财富管理有限公司

注册地址：珠海市横琴新区宝华路 6 号 105 室-3491

法定代表人：肖雯

办公地址：广州市海珠区琶洲大道东 1 号保利国际广场南塔 12 楼 B1201-1203

联系人：黄敏嫦

网站：www.yingmi.cn

客服电话：020-89629066

91、奕丰金融服务（深圳）有限公司

注册地址：深圳市前海深港合作区前湾一路 1 号 A 栋 201 室（入住深圳市前海商务秘书有限公司）

办公地址：深圳市南山区海德三路海岸大厦东座 1115 室，1116 室及 1307 室

法定代表人：TANYIKKUAN

联系人：叶健

电话：0755-89460507

传真：0755-21674453

客服电话：400-684-0500

网址：www.ifastps.com.cn

92、北京肯特瑞财富投资管理有限公司

注册地址：北京市海淀区中关村东路 66 号 1 号楼 22 层 2603-06

办公地址：北京市大兴区亦庄经济技术开发区科创十一街 18 号院京东集团总部

法定代表人：江卉

电话：个人业务：95118、4000988511

企业业务：4000888816

传真：010-8919566

网址：fund.jd.com

93、深圳市金斧子基金销售有限公司

注册地址：深圳市南山区粤海街道科苑路 16 号东方科技大厦 18 楼

办公地址：深圳市南山区粤海街道科苑路科兴科学园 B3 单元 7 楼

法定代表人：赖任军

联系人：张焯

电话：0755-66892301

传真：0755-26920530

客服电话：400-950-0888

网址：www.jfzinv.com

94、北京蛋卷基金销售有限公司（原北京惠次方资产管理有限公司）

注册地址：北京市朝阳区阜通东大街 1 号院 6 号楼 2 单元 21 层 222507

法定代表人：钟斐斐

客服电话：4000618518

联系人：袁永娇

电话：010-61840688

传真：010-61840699

网址：<https://danjuanapp.com>

95、和谐保险销售有限公司

注册地址：北京市朝阳区东三环中路 55 号楼 20 层 2302

办公地址：北京市朝阳区东三环中路 55 号楼 20 层 2302

法定代表人：蒋洪

客服电话：95569

网址：<http://www.hx-sales.com>

（二）注册登记机构

名称：大成基金管理有限公司

住所：深圳市福田区深南大道 7088 号招商银行大厦 32 层

办公地址：深圳市福田区深南大道 7088 号招商银行大厦 33 层

法定代表人：刘卓

电话：0755-83183388

传真：0755-83195239

联系人：黄慕平

（三）律师事务所和经办律师

名称：北京市金杜律师事务所

注册地址：北京市朝阳区东三环中路 7 号财富中心写字楼 A 座 40 层

办公地址：北京市朝阳区东三环中路 7 号财富中心写字楼 A 座 40 层

负责人：王玲

电话：0755-22163333

传真：0755-22163390

经办律师：靳庆军、冯艾

联系人：冯艾

（四）会计师事务所和经办注册会计师

名称：安永华明会计师事务所

住所：北京市东城区东长安街1号东方广场安永大楼17层01-12室

办公地址：北京市东城区东长安街1号东方广场安永大楼17层01-12室

执行事务合伙人：吴港平

电话：（010）58153000、（0755）25028288

传真：（010）85188298、（0755）25026188

签章注册会计师：昌华、高鹤

联系人：昌华

四、基金的名称

大成现金增利货币市场证券投资基金

五、基金的类型

基金类型：契约型

六、基金的运作方式

基金运作方式：开放式

七、基金的投资目标

在保持资产的低风险和高流动性的前提下，争取获得超过基金业绩比较基准的收益率。

八、基金的投资范围

本基金的投资范围包括：

1、现金；

2、期限在1年以内（含1年）的银行存款、债券回购、中央银行票据、同业存单；

3、剩余期限在397天以内（含397天）的债券、非金融企业债务融资工具、资产支持证券；

4、中国证监会、人民银行认可的其它具有良好流动性货币市场工具。

法律规或监管机构允许货币市场基金投资其他货币市场工具的，在不改变基金投资目标、投资策略，不改变基金风险收益特征的前提下，本基金可参与其他货币市场工具的投资，不需召开持有人大会。具体比例限制按照相关法律法规和监管规定执行。

九、基金的投资策略

本基金投资管理将充分运用收益率策略与估值策略相结合的方法，对各类可投资资产进行合理的配置和选择。投资策略首先审慎考虑各类资产的收益性、流动性及风险性特征，在风险与收益的配比中，力求将各类风险降到最低，并在控制投资组合良好流动性的基础上为投资者获取稳定的收益。

1. 整体资产配置策略

整体资产配置策略主要包括两个方面：一是根据宏观经济形势、央行货币政策、短期资金市场状况等因素对短期利率走势进行综合判断；二是根据前述判断形成的利率预期动态调整基金投资组合的平均剩余期限。

（1）利率分析策略

对利率走势的科学预期是进行基金目标久期设定的基本前提，也是债券部分进行正确投资的首要条件。通过对通货膨胀率、GDP增长率、货币供应量、国际利率水平、汇率、政策取向等跟踪分析，形成对基本面的宏观研判。同时，结合微观层面研究，主要考察指标包括：央行公开市场操作、主流机构投资者的短期投资倾向、债券供给、货币市场与资本市场资金互动等，合理预期货币市场利率曲线动态变化。

（2）久期管理策略

久期是衡量债券利率风险的主要指标，反映了债券价格对于收益率变动的敏感程度。当预期市场利率上升时，基金管理人将通过增加持有剩余期限较短债券并减持剩余期限较长债券等方式降低组合久期，以降低组合跌价风险；在预期市场收益率下降时，通过增持剩余期限较长债券等方式提高组合久期，以分享债券价格上升的收益。

2. 类属配置策略

类属配置是指基金组合在国债、央行票据、债券回购、金融债、短期融资券及现金等投资品种之间的配置比例。类属配置策略主要实现两个目标：一是通过类属配置满足基金流动性需求，二是通过类属配置获得投资收益。从流动性角度来说，基金管理人需对市场资金供求、申赎金额的变化进行动态分析，以确定本基金的流动性目标，并在此基础上相应调整组合资产在高流动性资产和相对流动性较低资产之间的配比，以满足投资者的流动性需求。从收益性角度来说，基金管理人将通过分析各类属品种的相对收益、利差变化、流动性风险、信用风险等因素来确定各类属品种的配置比例，寻找具有投资价值的投资品种，增持相对低估、价格将上升的、能给组合带来相对较高回报的类属品种，减持相对高估、价格将下降的、给组合带来相对较低回报的类属品种，以期取得较高的总回报。

3.个券选择策略

在个券选择层面，将首先考虑安全性因素，优先选择央票、短期国债等高信用等级的债券品种以规避违约风险。除考虑安全性因素外，在具体的券种选择上，基金管理人将在正确拟合收益率曲线的基础上，找出收益率明显偏高的券种，并客观分析收益率出现偏离的原因。若出现因市场原因所导致的收益率高于公允水平，则该券种价格出现低估，本基金将对此类低估值品种进行重点关注。此外，鉴于收益率曲线可以判断出定价偏高或偏低的期限段，从而指导相对价值投资，这也可以帮助基金管理人选择投资于定价低估的短期债券品种。

4.回购策略

(1) 息差放大策略：该策略是指利用回购利率低于债券收益率的机会通过循环回购以放大债券投资收益的投资策略。该策略的基本模式是利用买入债券进行正回购，再利用回购融入资金购买收益率较高债券品种，如此循环至回购期结束卖出债券偿还所融入资金。在进行回购放大操作时，基金管理人将严格遵守相关法律法规关于债券正回购的有关规定。

(2) 逆回购策略：基金管理人将密切关注由于新股申购等原因导致短期资金需求激增的机会，通过逆回购的方式融出资金以分享短期资金利率陡升的投资机会。

5.流动性管理策略

由于货币市场基金要保持高流动性的特性，本基金会紧密关注申购/赎回现金流情况、季节性资金流动、日历效应等，建立组合流动性预警指标，实现对基金资产的结构化管理，并结合持续性投资的方法，将回购/债券到期日进行均衡等量配置，以确保基金资产的整体变现能力。

随着国内货币市场的进一步发展，以及今后相关法律法规允许本基金可投资的金融工具出现时，本基金将予以深入分析并加以审慎评估，在符合本基金投资目标的前提下适时调整本基金投资对象。

十、基金的业绩比较基准

本基金的业绩比较基准为：银行活期存款利率

本基金为货币市场基金，具有低风险、高流动性的特征。根据基金的投资标的、投资目标及流动性特征，本基金选取同期银行活期存款利率作为本基金的业绩比较基准。

如果法律法规或未来市场发生变化导致此业绩比较基准不再适用，或有其他代表性更强、更科学客观的或者更能为市场普遍接受的业绩比较基准适用于本基金时，本基金管理人可依据维护基金份额持有人合法权益的原则，根据实际情况对业绩比较基准进行相应调整并及时公告，并在更新的招募说明书中列示。

十一、基金的风险收益特征

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。

十二、基金的投资组合报告

基金管理人的董事会及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责任。

基金托管人中国农业银行根据基金合同规定，于2017年11月30日复核了本报告中的财务指标、净值表现和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。

本投资组合报告所载数据取自本基金2017年第3季度报告，截至2017年9月30日。（财务数据未经审

计)

1. 基金资产组合情况

序号 项目 金额(元) 占基金总资产的比例(%)

1 固定收益投资 2,146,305,472.03 95.31

其中: 债券 2,146,305,472.03 95.31

资产支持证券 -

0.00

2 买入返售金融资产 36,814,375.22

1.63

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 51,788,317.89 2.30

4 其他资产 17,058,547.79 0.76

5 合计 2,251,966,712.93 100.00

2. 报告期债券回购融资情况

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 10.33

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 99,999,650.00 4.65

其中: 买断式回购融资 - 0.00

注: 报告期内债券回购融资余额占基金资产净值的比例为报告期内每个交易日融资余额占资产净值比例的简单平均值。

债券正回购的资金余额超过基金资产净值的 20%的说明

本报告期内本基金债券正回购的资金余额未超过基金资产净值的 20%。

3. 期末基金组合剩余期限

(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 72

报告期内投资组合平均剩余期限最高值 73

报告期内投资组合平均剩余期限最低值 30

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 90 天, 本报告期内, 本基金未发生超标情况。

(2) 报告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 21.84 4.65

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 19.06 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 50.50 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 3.72 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) 8.83 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 103.96 4.65

4. 报告期内投资组合平均剩余存续期超过 240 天情况说明

本报告期内本基金无平均剩余存续期超过 240 天的情况。

5. 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号 债券品种 摊余成本(元) 占基金资产净值比例(%)

1 国家债券 19,944,774.83 0.93

2 央行票据 -0.00

3 金融债券 90,096,148.29 4.19

其中：政策性金融债 90,096,148.29 4.19

4 企业债券 -0.00

5 企业短期融资券 1,044,849,342.16 48.60

6 中期票据 -0.00

7 同业存单 991,415,206.75 46.11

8 其他 -0.00

9 合计 2,146,305,472.03 99.83

10 剩余存续期超过 397 天的浮动利率债券 -0.00

6. 报告期末按摊余成本占基金资产净值比例大小排名的前十名债券投资明细

序号 债券代码 债券名称 债券数量(张) 摊余成本(元) 占基金资产净值比例(%)

1 111715342 17 民生银行 CD342 4,000,000 396,106,212.54 18.42

2 111710471 17 兴业银行 CD471 3,000,000 297,387,593.25 13.83

3 011759073 17 华能 SCP006 2,000,000 199,981,705.82 9.30

4 011758088 17 长电 SCP003 1,700,000 170,007,556.97 7.91

5 011764057 17 国电 SCP003 1,500,000 149,924,270.38 6.97

6 011764087 17 中文天地 SCP001 1,000,000 99,965,699.10 4.65

7 111780884 17 盛京银行 CD151 1,000,000 99,886,996.64 4.65

8 111710491 17 兴业银行 CD491 1,000,000 99,034,167.64 4.61

9 111785607 17 武汉农商行 CD021 1,000,000 99,000,236.68 4.60

10 011769037 17 华电 SCP014 800,000 80,009,645.01 3.72

7. 影子定价与摊余成本法确定的基金资产净值偏离

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 0

报告期内偏离度的最高值 0.0982%

报告期内偏离度的最低值 0.0173%

报告期内每个工作日偏离度的绝对值的简单平均值 0.0564%

(1) 报告期内负偏离度的绝对值达到 0.25%情况说明

本报告期本基金无负偏离度的绝对值达到 0.25%的情况。

(2) 报告期内正偏离度的绝对值达到 0.5%情况说明

本报告期本基金无正偏离度的绝对值达到 0.5%的情况。

8. 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名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。

9. 投资组合报告附注

(1) 基金计价方法说明

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。

(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。

(3) 其他资产构成

序号 名称 金额(元)

| | | |
|---|---------|---------------|
| 1 | 存出保证金 | - |
| 2 | 应收证券清算款 | - |
| 3 | 应收利息 | 8,872,054.19 |
| 4 | 应收申购款 | 8,096,215.60 |
| 5 | 其他应收款 | 90,278.00 |
| 6 | 待摊费用 | - |
| 7 | 其他 | - |
| 8 | 合计 | 17,058,547.79 |

(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。

十三、基金业绩

基金管理人依照恪尽职守、诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用基金财产,但不保证基金一定盈利,也不保证最低收益。基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险,投资者在做出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书及其更新。

(一) 基金合同生效日为 2012 年 11 月 20 日,基金合同生效以来完整会计年度的投资业绩及与同期基准的比较如下表所示:

A 类

阶段 基金净值收益率

基金净值收益率标准差

比较基准收益率

业绩比较基准收益率标准差

— —

2012.11.20—2012.12.31 0.3868% 0.0008% 0.0403% 0.0000% 0.3465% 0.0008%

2013.01.01—2013.12.31 3.9420% 0.0095% 0.3500% 0.0000% 3.5920% 0.0095%

2014.01.01—2014.12.31 4.6485% 0.0078% 0.3500% 0.0000% 4.2985% 0.0078%

2015.01.01—2015.12.31 3.7042% 0.0058% 0.3500% 0.0000% 3.3542% 0.0058%

2016.01.01—2016.12.31 2.5957% 0.0035% 0.3500% 0.0000% 2.2457% 0.0035%

2017.01.01—2017.09.30 2.7443% 0.0029% 0.2618% 0.0000% 2.4825% 0.0029%

2012.11.20—2017.09.30 19.3669% 0.0067% 1.7021% 0.0000% 17.6648% 0.0067%

B类

阶段 基金净值收益率

基金净值收益率标准差

比较基准收益率

业绩比较基准收益率标准差

--

2012.11.20—2012.12.31 0.4140% 0.0007% 0.0403% 0.0000% 0.3737% 0.0007%

2013.01.01—2013.12.31 4.1920% 0.0095% 0.3500% 0.0000% 3.8420% 0.0095%

2014.01.01—2014.12.31 4.9000% 0.0078% 0.3500% 0.0000% 4.5500% 0.0078%

2015.01.01—2015.12.31 3.9535% 0.0058% 0.3500% 0.0000% 3.6035% 0.0058%

2016.01.01—2016.12.31 2.8427% 0.0035% 0.3500% 0.0000% 2.4927% 0.0035%

2017.01.01—2017.09.30 2.9291% 0.0029% 0.2618% 0.0000% 2.6673% 0.0029%

2012.11.20—2017.09.30 20.7689% 0.0067% 1.7021% 0.0000% 19.0668% 0.0067%

(二) 自基金合同生效以来基金份额净值的变动情况，并与同期业绩比较基准的变动的比较（2012年11月20日至2017年9月30日）

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。

十四、费用概览

(一)基金费用的种类

- 1、基金管理人的管理费；
- 2、基金托管人的托管费；
- 3、基金的销售服务费
- 4、《基金合同》生效后与基金相关的信息披露费用；
- 5、《基金合同》生效后与基金相关的会计师费、律师费和诉讼费；
- 6、基金份额持有人大会费用；
- 7、基金的证券交易费用；
- 8、基金的银行汇划费用；
- 9、按照国家有关规定和《基金合同》约定，可以在基金财产中列支的其他费用。

上述费用从基金财产中支付。

(二) 上述基金费用由基金管理人在法律法规规定的范围内按照公允的市场价格确定，法律法规和基金合同另有规定时从其规定。

(三) 基金费用计提方法、计提标准和支付方式

1、基金管理人的管理费

在通常情况下，基金管理费按前一日基金资产净值的年费率计提。计算方法如下：

$H = E \times \text{年管理费率} \times \text{当年天数}$ ，本基金年管理费率为 0.33%

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，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，若遇法定节假日、休息日，支付日期顺延。

2、基金托管人的托管费

在通常情况下，基金托管费按前一日基金资产净值的年费率计提。计算方法如下：

$H = E \times \text{年托管费率} \times \text{当年天数}$ ，本基金年托管费率为 0.1%

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，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，若遇法定节假日、休息日，支付日期顺延。

3、基金销售服务费

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，基金年销售服务费应自其达到 A 类条件的开放日后的下一个工作日起适用 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，基金年销售服务费应自其达到 B 类条件的开放日后的下一个工作日起适用 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：

$H = ER \times \text{当年天数}$

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基金销售机构。

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。

4、上述(一)中 4 到 9 项费用由基金托管人根据其他有关法律法规及相应协议的规定，按费用支出金额支付，列入或摊入当期基金费用。

(四) 不列入基金费用的项目

基金管理人和基金托管人因未履行或未完全履行义务导致的费用支出或基金财产的损失，以及处理与基金运作无关的事项发生的费用等不列入基金费用。基金合同生效前的相关费用，包括但不限于验资费、会计师和律师费、信息披露费等费用不列入基金费用。

(五)基金管理人和基金托管人可根据基金发展情况调整基金管理费率、基金托管费率和基金销售服务费率。降低基金管理费率、基金托管费率和销售服务费率，无须召开基金份额持有人大会。基金管理人必须依照有关规定最迟于新的费率实施日前在指定媒体和基金管理人网站上刊登公告。

(六) 基金税收

基金和基金份额持有人根据国家法律法规的规定，履行纳税义务。十五、对招募说明书更新部分的说明本更新招募说明书依据《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《证券投资基金销售管理办法》、《证券投资基金信息披露管理办法》及其他有关法律法规的要求，并根据本基金管理人对本基金实施的投资经营活动，对 2017 年 7 月 5 日公布的《大成现金增利货币市场证券投资基金更新招募说明书（2017 年第 1 期）》进行了内容补充和更新，本更新的招募说明书主要更新的内容如下：

1. 根据最新资料，更新了三、基金管理人部分。
2. 根据最新资料，更新了四、基金托管人部分。
3. 根据最新资料，更新了五、相关服务机构部分。
4. 根据最新数据，更新了八、基金的投资部分。
5. 根据最新数据，更新了九、基金业绩部分。
6. 根据最新公告，更新了二十一、其他应披露的事项。

7. 根据最新情况，更新了二十二、招募说明书更新部分的说明。

大成基金管理有限公司

二〇一八年一月四日