

基金管理人:大成基金管理有限公司  
基金托管人:中国光大银行股份有限公司  
送出日期:2012年8月25日

## § 1 重要提示

基金管理人的董事、监事、高级管理人员和基金托管人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确认，并由董事长签发。

基金托管人中国光大银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2012年8月21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。

本半年度报告摘要摘录了半年度报告正文,投资者欲了解详细内容,请阅读半年度报告正文。

本报告所载资料未经审计。

本报告期自2012年1月01日起至2012年6月30日止。

## § 2 基金简介

## 2.1 基金基本情况

基金简称	大成货币
基金主代码	090005
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2005年6月3日
基金管理人	大成基金管理有限公司
基金托管人	中国光大银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	3,037,475,582.90份
基金合同存续期	不定期
下属分级基金的基金简称;	大成货币A 大成货币B
下属分级基金的交易代码:	090005 091005
报告期末下属分级基金的份额总额	698,844,038.78份 2,338,631,544.12份

## 2.2 基金产品说明

投资目标 在保持本金安全和资产流动性基础上追求较高的当期收益。

投资策略 本基金通过平均剩余期限策略、类属配置和品种选择三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 稳定期存款利率。

风险收益特征 本基金为货币市场基金,属于证券投资基金中的低风险品种;预期收益和风险都低于货币基金、混合基金、股票基金。

## 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	中国光大银行股份有限公司
姓名	杜鹃	石立平
信息披露负责人	0755-83183388	010-63639161
电子邮箱	dupeng@cdfund.com.cn	shiliping@cebbank.com
客户服务电话	4008885558	95595
传真	0755-83199588	010-63639132

## 2.4 信息披露方式

登载基金半年度报告的管理人互联网网址: <http://www.cdfund.com.cn>

深圳证监局日常监管大额T+0资金划拨银行大额22号文及深证基办25号文《中国光大中心B座801号中国光大银行投资与托管业务部》

## § 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	大成货币A	大成货币B
报告期(2012年1月1日-2012年6月30日)	报告期(2012年1月1日至2012年6月30日)	报告期(2012年1月1日至2012年6月30日)
本期已实现收益	11,715,609.95	34,538,576.69
本期利润	11,715,609.95	34,538,576.69
本期净值收益率	2.0376%	2.1601%

3.1.2 期末数据和指标 报告期末(2012年6月30日)

期末基金资产净值 698,844,038.78 2,338,631,544.12

期末基金资产净值 1,0000 1,0000

注:1. 本基金根据每日基金收益公告,以每万份基金份额收益为基准,为投资人每日计算收益并分配,每月定期支付收益。

2.本期已实现收益指基金利息收入、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。

3.2 基金表现

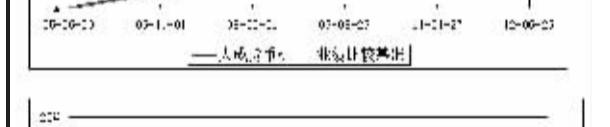
3.2.1 基金份额净值收益率与其同期业绩比较基准收益率的比较

大成货币A

阶段	份额净值收益率①	份额净值收益率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	0.3104%	0.0039%	0.0347%	0.0001%	0.2757%	0.0038%
过去三个月	0.9267%	0.0025%	0.1180%	0.0001%	0.8087%	0.0024%
过去六个月	2.0376%	0.0036%	0.2423%	0.0001%	1.7953%	0.0035%
过去一年	3.9139%	0.0034%	0.4944%	0.0001%	3.4195%	0.0033%
过去三年	8.2423%	0.0049%	1.2535%	0.0002%	6.9888%	0.0047%
自基金合同生效起至今	20.2725%	0.0068%	9.1551%	0.0031%	13.1840%	0.0037%

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

大成货币A

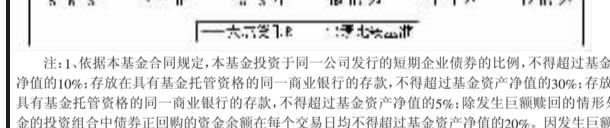


注:1. 本基金合同规定,本基金投资于同一公司发行的短期企业债券的比例,不得超过基金资产净值的10%;存放具有基金托管资格的同一商业银行的存款,不得超过基金资产净值的30%;存放不存在大额定期存款的基金的余额超过基金资产净值的5%;除发生巨额赎回的情形外,基金投资于货币市场基金的余额不得超过基金资产净值的20%;基金管理人应当在5个交易日内进行投资操作,确保基金的剩余期限不超过30天,但因基金合同约定除外。因发生巨额赎回而暂停赎回的基金,基金管理人应当在5个交易日内进行投资操作,确保基金的剩余期限不超过180天。本基金在3个月的初始期限结束后,基金投资组合比例达到本基金合同的有关规定。

2.为使本基金业绩与其业绩比较基准具有更强的可比性,经大成基金管理有限公司申请,并经中国证监会证监许可[2008]61号文同意,本基金业绩比较基准由“税后一年期银行定期存款利率”变更为“税后活期存款利率”。本基金业绩比较基准收益率的历史走势图从2005年6月3日至2008年6月3日为原业绩比较基准,税后一年期银行定期存款利率的走势图,2008年6月1日起为变更后的业绩比较基准的走势图。

3.2.3 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

大成货币B

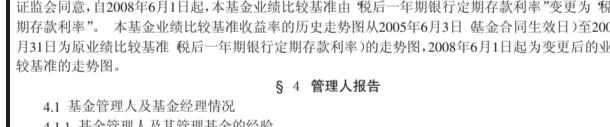


注:1. 本基金合同规定,本基金投资于同一公司发行的短期企业债券的比例,不得超过基金资产净值的10%;存放具有基金托管资格的同一商业银行的存款,不得超过基金资产净值的30%;存放不存在大额定期存款的基金的余额超过基金资产净值的5%;除发生巨额赎回的情形外,基金投资于货币市场基金的余额不得超过基金资产净值的20%;基金管理人应当在5个交易日内进行投资操作,确保基金的剩余期限不超过30天,但因基金合同约定除外。因发生巨额赎回而暂停赎回的基金,基金管理人应当在5个交易日内进行投资操作,确保基金的剩余期限不超过180天。本基金在3个月的初始期限结束后,基金投资组合比例达到本基金合同的有关规定。

2.为使本基金业绩与其业绩比较基准具有更强的可比性,经大成基金管理有限公司申请,并经中国证监会证监许可[2008]61号文同意,本基金业绩比较基准由“税后一年期银行定期存款利率”变更为“税后活期存款利率”。本基金业绩比较基准收益率的历史走势图从2005年6月3日至2008年6月3日为原业绩比较基准,税后一年期银行定期存款利率的走势图,2008年6月1日起为变更后的业绩比较基准的走势图。

3.2.4 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

大成货币B

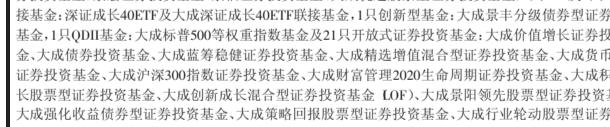


注:1. 本基金合同规定,本基金投资于同一公司发行的短期企业债券的比例,不得超过基金资产净值的10%;存放具有基金托管资格的同一商业银行的存款,不得超过基金资产净值的30%;存放不存在大额定期存款的基金的余额超过基金资产净值的5%;除发生巨额赎回的情形外,基金投资于货币市场基金的余额不得超过基金资产净值的20%;基金管理人应当在5个交易日内进行投资操作,确保基金的剩余期限不超过30天,但因基金合同约定除外。因发生巨额赎回而暂停赎回的基金,基金管理人应当在5个交易日内进行投资操作,确保基金的剩余期限不超过180天。本基金在3个月的初始期限结束后,基金投资组合比例达到本基金合同的有关规定。

2.为使本基金业绩与其业绩比较基准具有更强的可比性,经大成基金管理有限公司申请,并经中国证监会证监许可[2008]61号文同意,本基金业绩比较基准由“税后一年期银行定期存款利率”变更为“税后活期存款利率”。本基金业绩比较基准收益率的历史走势图从2005年6月3日至2008年6月3日为原业绩比较基准,税后一年期银行定期存款利率的走势图,2008年6月1日起为变更后的业绩比较基准的走势图。

3.2.5 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

大成货币B



注:1. 本基金合同规定,本基金投资于同一公司发行的短期企业债券的比例,不得超过基金资产净值的10%;存放具有基金托管资格的同一商业银行的存款,不得超过基金资产净值的30%;存放不存在大额定期存款的基金的余额超过基金资产净值的5%;除发生巨额赎回的情形外,基金投资于货币市场基金的余额不得超过基金资产净值的20%;基金管理人应当在5个交易日内进行投资操作,确保基金的剩余期限不超过30天,但因基金合同约定除外。因发生巨额赎回而暂停赎回的基金,基金管理人应当在5个交易日内进行投资操作,确保基金的剩余期限不超过180天。本基金在3个月的初始期限结束后,基金投资组合比例达到本基金合同的有关规定。

2.为使本基金业绩与其业绩比较基准具有更强的可比性,经大成基金管理有限公司申请,并经中国证监会证监许可[2008]61号文同意,本基金业绩比较基准由“税后一年期银行定期存款利率”变更为“税后活期存款利率”。本基金业绩比较基准收益率的历史走势图从2005年6月3日至2008年6月3日为原业绩比较基准,税后一年期银行定期存款利率的走势图,2008年6月1日起为变更后的业绩比较基准的走势图。

3.2.6 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

大成货币B

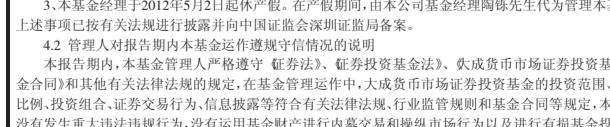


注:1. 本基金合同规定,本基金投资于同一公司发行的短期企业债券的比例,不得超过基金资产净值的10%;存放具有基金托管资格的同一商业银行的存款,不得超过基金资产净值的30%;存放不存在大额定期存款的基金的余额超过基金资产净值的5%;除发生巨额赎回的情形外,基金投资于货币市场基金的余额不得超过基金资产净值的20%;基金管理人应当在5个交易日内进行投资操作,确保基金的剩余期限不超过30天,但因基金合同约定除外。因发生巨额赎回而暂停赎回的基金,基金管理人应当在5个交易日内进行投资操作,确保基金的剩余期限不超过180天。本基金在3个月的初始期限结束后,基金投资组合比例达到本基金合同的有关规定。

2.为使本基金业绩与其业绩比较基准具有更强的可比性,经大成基金管理有限公司申请,并经中国证监会证监许可[2008]61号文同意,本基金业绩比较基准由“税后一年期银行定期存款利率”变更为“税后活期存款利率”。本基金业绩比较基准收益率的历史走势图从2005年6月3日至2008年6月3日为原业绩比较基准,税后一年期银行定期存款利率的走势图,2008年6月1日起为变更后的业绩比较基准的走势图。

3.2.7 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

大成货币B



注:1. 本基金合同规定,本基金投资于同一公司发行的短期企业债券的比例,不得超过基金资产净值的10%;存放具有基金托管资格的同一商业银行的存款,不得超过基金资产净值的30%;存放不存在大额定期存款的基金的余额超过基金资产净值的5%;除发生巨额赎回的情形外,基金投资于货币市场基金的余额不得超过基金资产净值的20%;基金管理人应当在5个交易日内进行投资操作,确保基金的剩余期限不超过30天,但因基金合同约定除外。因发生巨额赎回而暂停赎回的基金,基金管理人应当在5个交易日内进行投资操作,确保基金的剩余期限不超过180天。本基金在3个月的初始期限结束后,基金投资组合比例达到本基金合同的有关规定。

2.为使本基金业绩与其业绩比较基准具有更强的可比性,经大成基金管理有限公司申请,并经中国证监会证监许可[2008]61号文同意,本基金业绩比较基准由“税后一年期银行定期存款利率”变更为“税后活期存款利率”。本基金业绩比较基准收益率的历史走势图从2005年6月3日至2008年6月3日为原业绩比较基准,税后一年期银行定期存款利率的走势图,2008年6月1日起为变更后的业绩比较基准的走势图。

3.2.8 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