

大成货币市场证券投资基金

2012第三季度报告

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
报告送出日期:2012年10月25日

\$1 重要提示

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、完整性承担个别及连带责任。

基金托管人中国光大银行股份有限公司根据基金合同规定，于2012年10月12日复核了本报告中的财务指标、净值表现和投资组合等内容，保证复核结果不存在虚假记载、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。

本报告期末基金份额总额为1,608,914,730.41份。

本报告期自2012年7月1日起至9月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	大成货币
交易代码	199005
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2005年7月1日
报告期末基金份额总额	1,259,847,716.09份

投资目标 本基金通过密切关注宏观经济形势，在稳健操作的原则下，高度重视组合的流动性管理和安全性管理，严格控制利率风险。在资产配置上，本基金将密切关注宏观经济形势而出现明显调整的品种，如国债、Shibor等，以便具备配置价值，适时增减持。在券种选择上，本基金将在信用基本面深入分析的基础上，以信用风险可控、流动机制较好的AAA+的短融为主。

§3 投资组合报告

本报告期自2012年7月1日起至9月30日止。

§4 财务指标

单位:人民币元

主要财务指标 报告期(2012年7月1日 - 2012年9月30日)

大成货币A 大成货币B

1.本期已实现收益 5,671,940.66 16,779,425.27

2.本期利润 5,671,940.66 16,779,425.27

3.期末基金资产净值 620,630,987.19 1,608,914,730.41

注:1.本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入、不含公允价值变动收益)扣除相关费用后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

2.所述基金业绩指标不包括持有人交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

3.2.1 本基金累计份额净值收益率及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

大成货币A

阶段 净值收益率(①) 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

过去三个月 0.8097% 0.0029% 0.0887% 0.0000% 0.7210% 0.0029%

注:本货币基金净值分配原则按份额转持。

3.2.2 本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

阶段 净值收益率(①) 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

过去三个月 0.8070% 0.0029% 0.0887% 0.0000% 0.7820% 0.0029%

注:本货币基金净值分配原则按份额转持。

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

大成货币A

阶段 净值收益率(①) 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

过去三个月 0.8097% 0.0029% 0.0887% 0.0000% 0.7210% 0.0029%

注:1.本基金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。

2.所述基金业绩指标不包括持有人交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

3.2.4 本基金报告期份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

大成货币A

阶段 净值增长率为(①) 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

过去三个月 -5.95% 1.11% -6.85% 1.19% 0.90% -0.08%

注:1.本基金合同生效以来基金累计净值增长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

阶段 净值增长率为(①) 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

过去三个月 -5.95% 1.11% -6.85% 1.19% 0.90% -0.08%

注:1.本基金合同生效以来基金累计净值增长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

阶段 净值增长率为(①) 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

过去三个月 -5.95% 1.11% -6.85% 1.19% 0.90% -0.08%

注:1.本基金合同生效以来基金累计净值增长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

阶段 净值增长率为(①) 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

过去三个月 -5.95% 1.11% -6.85% 1.19% 0.90% -0.08%

注:1.本基金合同生效以来基金累计净值增长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

阶段 净值增长率为(①) 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

过去三个月 -5.95% 1.11% -6.85% 1.19% 0.90% -0.08%

注:1.本基金合同生效以来基金累计净值增长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

阶段 净值增长率为(①) 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

过去三个月 -5.95% 1.11% -6.85% 1.19% 0.90% -0.08%

注:1.本基金合同生效以来基金累计净值增长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

阶段 净值增长率为(①) 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

过去三个月 -5.95% 1.11% -6.85% 1.19% 0.90% -0.08%

注:1.本基金合同生效以来基金累计净值增长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

阶段 净值增长率为(①) 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

过去三个月 -5.95% 1.11% -6.85% 1.19% 0.90% -0.08%

注:1.本基金合同生效以来基金累计净值增长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

阶段 净值增长率为(①) 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

过去三个月 -5.95% 1.11% -6.85% 1.19% 0.90% -0.08%

注:1.本基金合同生效以来基金累计净值增长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

阶段 净值增长率为(①) 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

过去三个月 -5.95% 1.11% -6.85% 1.19% 0.90% -0.08%

注:1.本基金合同生效以来基金累计净值增长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

阶段 净值增长率为(①) 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

过去三个月 -5.95% 1.11% -6.85% 1.19% 0.90% -0.08%

注:1.本基金合同生效以来基金累计净值增长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

阶段 净值增长率为(①) 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

过去三个月 -5.95% 1.11% -6.85% 1.19% 0.90% -0.08%

注:1.本基金合同生效以来基金累计净值增长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

阶段 净值增长率为(①) 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

过去三个月 -5.95% 1.11% -6.85% 1.19% 0.90% -0.08%

注:1.本基金合同生效以来基金累计净值增长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

阶段 净值增长率为(①) 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

过去三个月 -5.95% 1.11% -6.85% 1.19% 0.90% -0.08%

注:1.本基金合同生效以来基金累计净值增长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

阶段 净值增长率为(①) 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

过去三个月 -5.95% 1.11% -6.85% 1.19% 0.90% -0.08%

注:1.本基金合同生效以来基金累计净值增长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

阶段 净值增长率为(①) 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

过去三个月 -5.95% 1.11% -6.85% 1.19% 0.90% -0.08%

注:1.本基金合同生效以来基金累计净值增长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

阶段 净值增长率为(①) 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

过去三个月 -5.95% 1.11% -6.85% 1.19% 0.90% -0.08%

注:1.本基金合同生效以来基金累计净值增长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

阶段 净值增长率为(①) 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

过去三个月 -5.95% 1.11% -6.85% 1.19% 0.90% -0.08%

注:1.本基金合同生效以来基金累计净值增长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

阶段 净值增长率为(①) 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

过去三个月 -5.95% 1.11% -6.85% 1.19% 0.90% -0.08%

注:1.本基金合同生效以来基金累计净值增长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

阶段 净值增长率为(①) 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