

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:2015年8月27日

§ 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、完整性承担责任个别及连带的法律责任。本半年度报告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的规定,于2015年8月25日核对了本报告中的财务指标、净值表现、投资组合情况、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。

本半年度报告摘要源自半年度报告正文,投资者欲了解详细内容,应阅读半年度报告正文。

本报告中财务数据未经审计。

本报告期自2015年01月01日起至2015年06月30日止。

§ 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

基金代码 000023

交易代码 000023

基金运作方式 委托管理开放式

基金合同生效日 2012年11月05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 150,003,626,059份

基金份额总额变动 不定期

基金份额净值 1.0000000000000000

本报告期基金份额总额变动幅度 -0.997,348.05份

报告期基金份额净值 0.99123,890.65份

基金份额总额变动比例 -0.4000000000000000

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经营目标,追求高于行业平均水平的稳定收益。

投资策略 本基金通过定期调整资产配置比例,并根据宏观经济、行业政策、市场环境、资金供求、利率水平、信用利差、流动性、资金成本、风险收益预期等指标,在严格控制风险的前提下,通过资产配置,在追求资产安全的前提下,力争获得超越基准的稳定收益。

业绩基准 4.4%±0.5%

风险收益特征 本基金为货币市场基金,属于低风险、低收益的基金品种。

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 王永国

联系电话 0755-83163308 010-66594896

电子邮箱 dupeng@fund.citic.com leis@bankofchina.com

客户服务电话 4008885655 95566

传真 0755-83199588 010-66594942

2.4 信息披露方式

登载基金半年报报告的管理人互联网网址 http://www.fund.citic.com

深圳市福田区深南大道7089号招商银行大厦32层

基金管理人半年报报告备置地点 深圳市福田区深南大道7089号招商银行大厦14层中国银行股份有限公司托管部业务部

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

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C

报告期 2015年1月1日 - 2015年6月30日 报告期 2015年1月1日 - 2015年6月30日 报告期 2015年1月1日 - 2015年6月30日

本期已实现收益 4,407,300.01 4,101,860.60 3.64

本期利润 4,407,300.01 4,101,860.60 3.64

本报告期收益 25460.00 2.6006% 0.1150%

报告期 2015年6月30日

期末基金资产净值 32,967,348.15 97,031,890.65 14,400.0000

本报告期基金份额总额 32,967,348.15份

报告期基金份额净值 0.990023 0.99123,890.65份 0.001516

报告期基金份额总额变动 -32,967,348.15份

报告期基金份额净值变动 -0.4000000000000000

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C

报告期 2015年1月1日 - 2015年6月30日 报告期 2015年1月1日 - 2015年6月30日 报告期 2015年1月1日 - 2015年6月30日

本期已实现收益 509,167.15 509,167.15 3.64

本期利润 509,167.15 509,167.15 3.64

本报告期收益 25460.00 2.6006% 0.1150%

报告期 2015年6月30日

累计份额净值 135,091.91 14,400.0000 0.1150%

注:本报告期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,本期利息收入为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

基金级别 分份额净值收益率 分份额净值收益率 分份额净值收益率 分份额净值收益率 分份额净值收益率

过去一个月 0.0322% 0.0306% 0.1110% 0.0000% 0.0412% 0.0306%

过去三个月 1.5649% 0.0306% 0.3366% 0.0000% 1.1688% 0.0296%

过去六个月 2.5460% 0.0314% 0.6969% 0.0000% 1.3765% 0.0194%

过去一年 6.2223% 0.0306% 1.3600% 0.0000% 4.8823% 0.0506%

自基金合同生效至今 135,091.91 0.034% 3.4015% 0.0000% 10,107.60% 0.0354%

大成月月盈短期理财债券B

基金级别 分份额净值收益率 分份额净值收益率 分份额净值收益率 分份额净值收益率 分份额净值收益率

过去一个月 0.0322% 0.0306% 0.1110% 0.0000% 0.0412% 0.0306%

过去三个月 1.5649% 0.0306% 0.3366% 0.0000% 1.1688% 0.0296%

过去六个月 2.5460% 0.0314% 0.6969% 0.0000% 1.3765% 0.0194%

过去一年 6.2223% 0.0306% 1.3600% 0.0000% 4.8823% 0.0506%

自基金合同生效至今 135,091.91 0.034% 3.4015% 0.0000% 10,107.60% 0.0354%

大成月月盈短期理财债券C

基金级别 分份额净值收益率 分份额净值收益率 分份额净值收益率 分份额净值收益率 分份额净值收益率

过去一个月 0.0340% 0.0306% 0.1110% 0.0000% 0.0412% 0.0306%

过去三个月 1.5612% 0.0306% 0.3366% 0.0000% 1.1688% 0.0296%

过去六个月 2.6090% 0.0313% 0.6969% 0.0000% 2.0271% 0.0193%

过去一年 6.5420% 0.0306% 1.3600% 0.0000% 5.1920% 0.0506%

自基金合同生效至今 14.4646% 0.0306% 3.4015% 0.0000% 10.9056% 0.0354%

注:本报告期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,本期利息收入为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。

3.2.2 基金净值表现

3.2.2.1 本基金报告期内净值表现情况

大成月月盈短期理财债券型证券投资基金

报告期 2015年1月1日至2015年6月30日

单位:人民币元

资产 本期末 2015年6月30日 上年度末 2014年12月31日

资产: 899,970,98 75,025,269,190

银行存款和结算备付金 1,000 1,000

应收证券清算款 10,968,126,033 260,331,429,311

应收利息 10,968,126,033 260,331,429,311

应收股利 10,968,126,033 260,331,429,311

应收申购款 10,968,126,033 260,331,429,311

应收赎回款 10,968,126,033 260,331,429,311

应收定期存款 10,968,126,033 260,331,429,311

应收保证金 10,968,126,033 260,331,429,311

应收票据 10,968,126,033 260,331,429,311

应收股利 10,968,126,033 260,331,429,311

应收利息 10,968,126,033 260,331,429,311

应收申购款 10,968,126,033 260,331,429,311

应收赎回款 10,968,126,033 260,331,429,311

应收定期存款 10,968,126,033 260,331,429,311

应收保证金 10,968,126,033 260,331,429,311

应收票据 10,968,126,033 260,331,429,311

应收股利 10,968,126,033 260,331,429,311

应收利息 10,968,126,033 260,331,429,311

应收申购款 10,968,126,033 260,331,429,311

应收赎回款 10,968,126,033 260,331,429,311

应收定期存款 10,968,126,033 260,331,429,311

应收保证金 10,968,126,033 260,331,429,311

应收票据 10,968,126,033 260,331,429,311

应收股利 10,968,126,033 260,331,429,311

应收利息 10,968,126,033 260,331,429,311

应收申购款 10,968,126,033 260,331,429,311

应收赎回款 10,968,126,033 260,331,429,311

应收定期存款 10,968,126,033 260,331,429,311

应收保证金 10,968,126,033 260,331,429,311

应收票据 10,968,126,033