大成货币市场证券投资基金

【2015】年度报告摘要

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:2016年3月26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、准确性和完整性承担个别及连带的法律责任。本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。

基金托管人中国光大银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2016年3月24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。

本报告财务资料已经审计。安永华明会计师事务所(特殊普通合伙)为本基金出具了无保留意见的审计报告,请投资者注意阅读。

本报告期自2015年01月01日起至12月31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		
交易代码	090005		
基金运作方式	契约型开放式		
基金合同生效日	2005年4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	62,739,921,552.89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	3,276,678,050.36份	59,463,243,502.53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决策、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	税后活期存款利率。
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债券基金、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
信息披露负责人	姓名	杜鹏	张建春
	联系电话	0755-83183388	010-63639180
	电子邮箱	dupeng@dcfund.com.cn	zhangjianchun@cebbank.com
客户服务电话		4008885558	95595
传真		0755-83190588	010-63639132

2.4 信息披露方式

登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	http://www.dcfund.com.cn
基金年度报告备置地点	深圳市福田区深南大道7088号招商银行大厦32层大成基金管理有限公司 北京市西城区复兴门外大街6号光大大厦 中国光大银行投资与托管业务部

§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位:人民币元

3.1.1 期间数据和指标	2015年		2014年		2013年	
	大成货币A	大成货币B	大成货币A	大成货币B	大成货币A	大成货币B
本期已实现收益	17,891,073.52	447,416,024.78	30,988,654.27	332,238,050.24	39,376,781.80	162,926,285.28
本期利润	17,891,073.52	447,416,024.78	30,988,654.27	332,238,050.24	39,376,781.80	162,926,285.28
本期净值收益率	3.2028%	3.4502%	4.4413%	4.6930%	3.6389%	3.8893%
3.1.2 期末数据和指标	2015年末		2014年末		2013年末	
期末基金资产净值	3,276,678,050.36	59,463,243,502.53	1,003,170,564.40	5,243,406,375.64	2,136,853,683.32	13,461,746,623.67
期末基金份额净值	1.0000	1.0000	1.0000	1.0000	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,每月集中支付收益。

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;

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

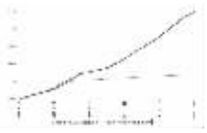
大成货币A

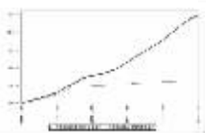
3.1.1 期间数据和指标	份额净值收益率①	份额净值收益率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	0.6704%	0.0026%	0.0882%	0.0000%	0.5822%	0.0026%
过去六个月	1.2945%	0.0021%	0.1764%	0.0000%	1.1181%	0.0021%
过去一年	3.2028%	0.0037%	0.3500%	0.0000%	2.8528%	0.0037%
过去三年	11.7086%	0.0051%	1.0500%	0.0000%	10.6586%	0.0051%
过去五年	19.9808%	0.0046%	1.9387%	0.0002%	18.0421%	0.0044%
自基金合同生效起至今	36.6307%	0.0063%	10.3817%	0.0028%	26.2490%	0.0035%

大成货币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
过去三个月	0.7301%	0.0026%	0.0882%	0.0000%	0.6419%	0.0026%
过去六个月	1.4159%	0.0021%	0.1764%	0.0000%	1.2395%	0.0021%
过去一年	3.4502%	0.0037%	0.3500%	0.0000%	3.1002%	0.0037%
过去三年	12.5174%	0.0051%	1.0500%	0.0000%	11.4674%	0.0051%
过去五年	21.4295%	0.0046%	1.9387%	0.0002%	19.4908%	0.0044%
自基金合同生效起至今	40.1518%	0.0063%	10.3817%	0.0028%	29.7701%	0.0035%

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

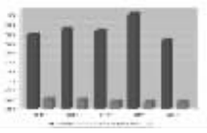


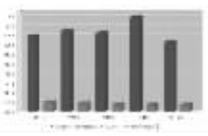


注:1、依据本基金合同规定,本基金投资于同一公司发行的短期企业债券的比例,不得超过基金资产净值的10%;存放在具有基金托管资格的同一商业银行的存款,不得超过基金资产净值的30%;存放在不具有基金托管资格的同一商业银行的存款,不得超过基金资产净值的5%;除发生巨额赎回的情形外,基金的投资组合中债券正回购的资金余额在每个交易日均不得超过基金资产净值的20%。因发生巨额赎回致使货币市场基金债券正回购的资金余额超过基金资产净值20%的,基金管理人应当在5个交易日内进行调整;基金持有的剩余期限不超过397天但剩余存续期超过397天的浮动利率债券的摊余成本总计不得超过当日基金资产净值的20%;投资组合的平均剩余期限在每个交易日不得超过180天。本基金在3个月的初始建仓期结束后,基金投资组合比例已达到本基金合同的相关规定要求。

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,并经中国证监会同意,自2008年6月1日起,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(基金合同生效日)至2008年5月31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 过去五年基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较





3.3 过去三年基金的利润分配情况

单位:人民币元

大成货币A

年度	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	年度利润分配合计	备注
2015	17,793,167.08	-	97,906.44	17,891,073.52	
2014	31,187,666.76	-	-199,012.49	30,988,654.27	
2013	39,672,379.55	-	-295,597.75	39,376,781.80	
合计	88,653,213.39	-	-396,703.80	88,256,509.59	

单位:人民币元

大成货币A

年度	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	年度利润分配合计	备注
2015	443,848,453.18	-	3,567,571.60	447,416,024.78	
2014	333,663,112.34	-	-1,425,062.10	332,238,050.24	
2013	163,202,402.55	-	-276,117.27	162,926,285.28	
合计	940,713,968.07	-	1,866,392.23	942,580,360.30	

§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。目前公司由四家股东组成,分别为中泰信托有限责任公司(48%)、光大证券股份有限公司(25%)、中国银河投资管理有限公司(25%)、广东证券股份有限公司(2%)。截至2015年12月31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55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、大成景源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和大成景辉灵活配置混合型证券投资基金。

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		
黄海峰先生	本基金基金经理	2014年12月24日	-	12年	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。2014年12月24日起,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

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遵规守信情况的说明

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》、《大成货币市场证券投资基金基金合同》和其他有关法律法规的规定,在基金管理运作中,大成货币市场证券投资基金的投资范围、投资比例、投资组合、证券交易行为、信息披露等符合有关法律法规、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 公平交易制度和控制方法

根据《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》的规定,基金管理人制订了《大成基金管理有限公司公平交易制度》及《大成基金管理有限公司异常交易监控与报告制度》。基金管理人旗下投资组合严格按照制度的规定,参与股票、债券的一级市场申购、二级市场交易等投资管理活动,内容包括授权、研究分析、投资决策、交易执行、业绩评估等与投资管理活动相关的各个环节。研究部负责提供投资研究支持,投资部门负责投资决策,交易管理部负责实施交易并实时监控,监察稽核部负责事前监督、事中检查和事后稽核,风险管理部负责对交易情况进行合理性分析,通过多部门的协作互控,保证了公平交易的可操作、可稽核和可持续。

4.3.2 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。基金管理人运用统计分析方法和工具,对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进行分析。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,但结合交易价差专项统计分析,未发现违反公平交易原则的异常情况。

4.3.3 异常交易行为的专项说明

报告期内,基金管理人旗下所有投资组合未发现存在异常交易行为。主动投资组合间股票交易存在130 笔同日反向交易,原因为投资策略需要。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,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%的仅有 1 笔,原因为投资策略需要;主动投资组合间债券交易存在 8 笔同日反向交易,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。

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

2015年中国债券市场延续了前一年的牛市行情。在调结构和去产能压力下,国内经济下行压力骤增,货币政策不断放水,降准降息连番上场,债券收益率持续下行。

操作上,上半年打新对组合规模冲击很大,本组合重点做好流动性管理,下半年根据对债券市场行情研判,积极配置短融和存单,抓住时点收益上行配置存款,为持有人获取了一定回报。

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3.2028%,B类净值收益率3.4502%, 期间业绩比较基准收益率为0.3500%。

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2016年,我们对债券市场相对乐观。从国内看,年初人民日报对权威人士的供给侧改革专访中明确提到,“在当前形势下, 国民经济不可能通过短期刺激实现V型反弹, 可能会经历一个L型增长阶段”,从这个角度看,在去产能、去库存、去杠杆和人口红利结束的大环境下,经济面临趋势性下行压力。从国外看,美日欧面临各自经济社会问题,油价低迷导致地缘政治紧张,全球经济走出泥潭尚需时日,外部环境异常复杂严峻。美国加息背景下人民币汇率贬值可能是一个风险因素,不过货币当局弹药充足,会对贬值进程和幅度做出合理选择,预计对国内流动性影响不大。

2016年,本组合将保持机动和灵活的操作,做好流动性管理同时,积极调整组合仓位结构,积极参与债券波段操作,提高组合收益。

我们非常感谢基金份额持有人的信任和支持,我们将按照本基金合同和风险收益特征的要求,严格控制投资风险,积极进行资产配置,适时调整组合结构,研究新的投资品种和挖掘投资机会,力争获得与基金风险特征一致的稳定收益回报给投资者。

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、固定收益总部、风险管理部、基金运营部、监察稽核部、专户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、固定收益总部、风险管理部和专户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。截止报告期末本基金管理人已与中央国债登记结算有限责任公司/中证指数有限公司签署服务协议, 由其按约定提供在银行间同业市场交易的债券品种/在交易所市场上市交易或挂牌转让的固定收益品种 (估值处理标准另有规定的除外)的估值数据。

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,以每万份基金份额收益为基准,为投资人每日计算收益并分配,按日结转份额,每月集中支付收益。本报告期内本基金应分配利润465,307,098.30元,报告期内已分配利润465,307,098.30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

2015年度,中国光大银行股份有限公司在大成货币市场证券投资基金托管过程中,严格遵守了《证券投资基金法》、《证券投资基金运作管理办法》、《证券投资基金信息披露管理办法》及其他法律法规、相关实施准则、基金合同、托管协议等的规定,依法安全保管了基金的全部资产,对大成货币市场证券投资基金的投资运作进行了全面的会计核算和应有的监督,对发现的问题及时提出了意见和建议。同时,按规定如实、独立地向监管机构提交了本基金运作情况报告,没有发生任何损害基金份额持有人利益的行为,诚实信用、勤勉尽责地履行了作为基金托管人所应尽的义务。

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

2015年度,中国光大银行股份有限公司依据《证券投资基金法》、《证券投资基金运作管理办法》、《证券投资基金信息披露管理办法》及其他法律法规、相关实施准则、基金合同、托管协议等的规定,对基金管理人——大成基金管理有限公司的投资运作、信息披露等行为进行了复核、监督,未发现基金管理人在投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支等方面存在损害基金份额持有人利益的行为。该基金在运作中遵守了有关法律法规的要求,各重要方面的运作也能够严格按照基金合同的规定进行。该基金在运作中遵守了《证券投资基金法》等有关法律法规的要求;各重要方面由投资管理人依据基金合同及实际运作情况进行处理。

5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

中国光大银行股份有限公司依法对基金管理人——大成基金管理有限公司编制的 “大成货币市场证券投资基金2015年年度报告”进行了复核,报告中相关财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容真实、准确、完整。

§6 审计报告

本基金2015年年度财务报表已经安永华明会计师事务所(特殊普通合伙)审计,注册会计师签字出具了标准无保留意见的审计报告。投资者欲了解本基金审计报告详细内容,应阅读年度报告正文。

§7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体:大成货币市场证券投资基金
报告截止日:2015年12月31日

单位:人民币元

资 产	本期末 2015年12月31日	上年度末 2014年12月31日
资 产:		
银行存款	28,501,851,605.85	1,155,455,314.56
结算备付金	-	3,825,000.00
存出保证金	-	-
交易性金融资产	9,947,489,311.36	3,277,457,684.65
其中:股票投资	-	-
基金投资	-	-
债券投资	9,947,489,311.36	3,277,457,684.65
资产支持证券投资	-	-
贵金属投资	-	-
衍生金融资产	-	-
买入返售金融资产	22,116,632,637.90	1,864,122,716.17
应收证券清算款	-	-
应收利息	167,822,878.45	63,968,351.40
应收股利	-	-
应收申购款	2,021,399,557.75	407,263,256.14
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	-
资产总计	62,755,195,991.31	6,772,092,322.92
负债和所有者权益	本期末 2015年12月31日	上年度末 2014年12月31日
负 债:		
短期借款	-	-
交易性金融负债	-	-
衍生金融负债	-	-
卖出回购金融资产款	-	520,598,579.10
应付证券清算款	-	-
应付赎回款	-	-
应付管理人报酬	6,634,063.52	1,671,133.36
应付托管费	2,010,322.28	506,404.06
应付销售服务费	355,830.59	212,456.51
应付交易费用	157,029.80	116,010.29
应交税费	1,033,100.00	1,033,100.00
应付利息	-	71,485.37
应付利润	4,400,092.23	734,614.19
递延所得税负债	-	-
其他负债	684,000.00	571,600.00
负债合计	15,274,438.42	525,515,382.88
所有者权益:		
实收基金	62,739,921,552.89	6,246,576,940.04
未分配利润	-	-
所有者权益合计	62,739,921,552.89	6,246,576,940.04
负债和所有者权益总计	62,755,195,991.31	6,772,092,322.92

注:报告截止日2015年12月31日,A级基金份额参考净值人民币1.000元,基金份额总额3,276,678,050.36份;B级基金份额参考净值人民币1.000元, 基金份额总额59,463,243,502.53份。基金份额总额62,739,921,552.89份。

7.2 利润表

会计主体:大成货币市场证券投资基金
本报告期:2015年1月1日至2015年12月31日

单位:人民币元

资 产	本期 2015年1月1日至2015年12月31日	上年度可比期间 2014年1月1日至2014年12月31日
一、收入	537,871,026.35	415,991,206.40
1.利息收入	520,501,635.33	373,443,771.85
其中:存款利息收入	225,609,112.25	126,636,648.91
债券利息收入	190,003,634.57	181,290,067.95
资产支持证券利息收入	-	-
买入返售金融资产收入	104,888,888.51	65,517,054.99
其他利息收入	-	-
2.投资收益(损失以“-”填列)	17,334,755.64	42,479,934.55
其中:股票投资收益	-	-
基金投资收益	-	-
债券投资收益	17,334,755.64	42,479,934.55
资产支持证券投资收益	-	-
贵金属投资收益	-	-
衍生工具收益	-	-
股利收益	-	-
3.公允价值变动收益(损失以“-”号填列)	-	-
4.汇兑收益(损失以“-”号填列)	-	-
5.其他收入(损失以“-”号填列)	34,635.38	67,500.00
减:二、费用	72,963,928.05	52,764,501.89
1. 管理人报酬	50,554,823.16	27,426,290.64
2. 托管费	15,319,643.25	8,310,997.15
3. 销售服务费	2,819,816.27	2,580,262.05
4. 交易费用	-	-
5. 利息支出	2,991,670.88	13,624,008.77
其中:卖出回购金融资产支出	2,991,670.88	13,624,008.77
6. 其他费用	877,974.49	822,943.28
三、利润总额(亏损总额以“-”号填列)	465,307,098.30	363,226,704.51
减:所得税费用	-	-
四、净利润(净亏损以“-”号填列)	465,307,098.30	363,226,704.51

7.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体:大成货币市场证券投资基金
本报告期:2015年1月1日至2015年12月31日

单位:人民币元

项目	本期 2015年1月1日至2015年12月31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)	6,246,576,940.04	-	6,246,576,940.04
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	465,307,098.30	465,307,098.30
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)	56,493,344,612.85	-	56,493,344,612.85
其中:1.基金申购款	160,844,264,251.81	-	160,844,264,251.81
2.基金赎回款	-104,350,919,638.96	-	-104,350,919,638.96
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)	-	-465,307,098.30	-465,307,098.30
五、期末所有者权益(基金净值)	62,739,921,552.89	-	62,739,921,552.89

项目	上年度可比期间 2014年1月1日至2014年12月31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)	15,598,600,306.99	-	15,598,600,306.99
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	363,226,704.51	363,226,704.51
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)	-9,352,023,366.95	-	-9,352,023,366.95
其中:1.基金申购款	75,971,585,866.17	-	75,971,585,866.17
2.基金赎回款	-85,323,609,233.12	-	-85,323,609,233.12
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)	-	-363,226,704.51	-363,226,704.51
五、期末所有者权益(基金净值)	6,246,576,940.04	-	6,246,576,940.04

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.4 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

7.4 报表附注

7.4.1 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。

7.4.2 关联方关系

项目	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、注册登记机构、基金销售机构
中国光大银行股份有限公司(“光大银行”)	基金托管人、基金销售机构
中泰信托有限责任公司(“中泰信托”)	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
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:1. 中国证监会于2005年11月6日作出对广东证券取消业务许可并责令关闭的行政处罚。

2、以下关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

7.4.3 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

本基金本报告期及上年度可比期间未发生通过关联方交易单元进行的交易。

7.4.3.1 关联方报酬

7.4.3.1.1 基金管理费

单位:人民币元

项目	本期 2015年1月1日至2015年12月31日	上年度可比期间 2014年1月1日至2014年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	50,554,823.16	27,426,290.64
其中:支付销售机构的客户维护费	874,029.93	1,798,499.59

注:(1) 基金管理费每日计提,按月支付。基金管理费按前一日的基金资产净值的0.33%的年费率计提。计算方法如下:

H=E×0.33%/当年天数

H为每日应支付的基金管理费

E为前一日的基金资产净值

(2) 于2015年12月31日,应付基金管理费的金额为人民币6,634,063.52元,(2014年12月31日:人民币1,671,133.36元)。

7.4.3.1.2 基金托管费

单位:人民币元

项目	本期 2015年1月1日至2015年12月31日	上年度可比期间 2014年1月1日至2014年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	15,319,643.25	8,310,997.15

注:(1) 基金托管费每日计提,按月支付。基金托管费按前一日的基金资产净值的0.10%的年费率计提。计算方法如下:

H=E×0.10%/当年天数

H为每日应支付的基金托管费

E为前一日的基金资产净值

(2) 于2015年12月31日应付基金托管费的金额为人民币2,010,322.28元,(2014年12月31日:人民币506,404.06元)。

7.4.3.1.3 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 2015年1月1日至2015年12月31日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	大成货币A	大成货币B	合计
大成基金	327,653.53	1,417,557.27	1,745,210.80
光大银行	35,558.77	228.53	35,787.30
光大证券	1,614.85	-	1,614.85
合计	364,827.15	1,417,785.80	1,782,612.95
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2014年1月1日至2014年12月31日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	大成货币A	大成货币B	合计
大成基金	209,003.51	654,701.95	863,705.46
光大银行	48,381.04	78.47	48,459.51
光大证券	5,152.97	105.62	5,258.59
合计	262,537.52	654,886.04	917,423.56

注:1)基金销售服务费可用于本基金的市场推广、销售、服务等各项费用,由基金管理人支配使用。基金销售服务费每日计算, 按月支付。本基金A级基金份额的基金销售服务费按前一日基金资产净值的0.25%的年费率计提;B级基金份额的基金销售服务费按前一日基金资产净值的0.01%的年费率计提。计算方法如下:

H=E×R/当年天数

H为每日应支付的基金销售服务费

E为前一日的基金资产净值

R为该级基金份额的销售服务年费率

2)本期末本基金应付大成基金基金销售服务费为人民币205,787.20元;应付光大银行基金销售服务费为人民币2,072.89元;应付光大证券基金销售服务费为人民币110.76元。于2014年末应付大成基金基金销售服务费为人民币58,088.13元;应付光大银行销售服务费为人民币4,096.31元;应付光大证券基金销售服务费为人民币103.19元。

1.1.1.1 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金本报告期及上年度可比期间未与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。

1.1.1.2 各关联方投资本基金的情况

1.1.1.2.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

份额单位:份

项目	本期 2015年1月1日至2015年12月31日	
	大成货币A	大成货币B
期初持有的基金份额	-	-
期间申购/买入总份额	-	-
期间因拆分变动份额	-	-
减:期间赎回/卖出总份额	-	-
期末持有的基金份额	-	-
期末持有的基金份额占基金总份额比例	0.0000%	0.0000%

项目	上年度可比期间 2014年1月1日至2014年12月31日	
	大成货币A	大成货币B
期初持有的基金份额	-	-
期间申购/买入总份额	17,780.00	20,000,000.00
期间因拆分变动份额	-	-
减:期间赎回/卖出总份额	17,780.00	20,000,000.00
期末持有的基金份额	-	-
期末持有的基金份额占基金总份额比例	0.0000%	0.0000%

1.1.1.2.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金