

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:2016年3月26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应当遵守法律法规、诚实信用、勤勉尽责地运作基金，其对基金的过往业绩、准确性和完整性承担个别及连带的法律责任。本基金报告书经公告之日“以上”指包含董事字样，同上，由基金管理人负责。

基金托管人和中国银行股份有限公司根据本基金合同约定，于2016年3月24日复核了本报告书的编制、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等事项，保证本报告所载内容不存在虚假记载、误导陈述或重大遗漏。

基金经理承诺：本人以诚信守法的原则谨慎履行基金合同规定的职责，但本人对本基金的过往业绩、准确性和完整性不作任何保证，也不代表将来的业绩表现。

基金合同由基金管理人和基金托管人共同签署，自基金合同成立之日起生效，基金合同的成立日为基金合同生效日。

基金的过往业绩并不代表其未来表现，投资者应认真阅读基金合同、招募说明书、基金产品资料概要、定期报告和最新的基金公告等文件。

本报告书摘要由基金管理人制作并经基金托管人复核无误后由基金管理人公告。

本报告书摘要由基金管理人于2016年3月21日登载于本公司网站。

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称 大成月盈短期理财债券

基金简称 大成月盈

基金代码 000023

交易代码 000023

基金运作方式 灵活配置型

基金合同生效日 2012年11月26日

基金管理人 大成基金管理有限公司

基金托管人 中信银行股份有限公司

报告期末基金份额总额 196,339,707,586份

基金合同的存续期 不定期

下属分级基金的基金简称： 大成月盈短期理财债券

大成月盈分级基金的基金代码： 000023

报告期末分级基金的份额总额 46,117,111.52份 46,381,111.52份 46,241,484.69份

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首要目标，追求高于业绩比较基准的稳定收益。

投资策略 本基金通过平滑的期限配置策略，实现风险与收益的平衡。

业绩比较基准 七天通知存款利率+0.1%

风险特征 本基金属于货币市场基金中的短期债券基金，长期风险收益水平低于股票型基金、混合型基金，投资风险相对较低。

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 中信银行股份有限公司

姓名 杜鹏 王永民

联系电话 0756-8313388 010-66594856

电子邮箱 dupeng@efund.citic.com fwmh@bankofchina.com

客户服务电话 4008885656 95562

传真 0756-83199688 010-66594942

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.ytfund.com>

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内大街1号中国银行股份有限公司总行营业部

§ 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

金额单位:人民币元

		2015年		2014年		2013年	
3.1.1 利润数据和指标							

大成月盈短期理财债券 A 大成月盈短期理财债券 B 大成月盈短期理财债券 A 大成月盈短期理财债券 B 大成月盈短期理财债券 A 大成月盈短期理财债券 B

本期收入 2,416,000 6,010 572,302.37 5,171,077.43 62,910 4,999 6,596 134,03

本期利润 2,418,000 6,010 572,302.37 5,171,077.43 62,910 4,999 6,596 134,03

本期的利润 4,619,111 4,524,96 45,924,69 2,346,111 2,346,111 2,346,111 2,346,111 2,346,111

本期的利润 4,619,111 4,524,96 45,924,69 2,346,111 2,346,111 2,346,111 2,346,111 2,346,111

3.1.2 利润指标

2015年末 2014年末 2013年末

期末净值 66,117,46,961 83,341,198,268 276,012,20,044 86,797

净资产 111,57 111,562 398,06 87,956 154,85 566,82

份额净值 1,0000 1,0000 1,0000 1,0000 1,0000 1,0000

注:本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、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,因此,公允价值变动收益为零,本期已实现收益加上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,本期已实现收益和期末的基金相等。

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值及其与同期业债比较基准收益率的比较

大成月盈短期理财债券 A

3.3.1 利率数据和指标

份额净收入 基准收益率 收益率标准差 基准收益率标准差 基准收益率标准差

过去三个月 0.0107% 0.0107% 0.0000% 0.0000% 0.0107%

过去六个月 0.0123% 0.0123% 0.0006% 0.0006% 0.0123%

过去一年 0.0126% 0.0126% 0.0006% 0.0006% 0.0126%

过去三年 0.0322% 0.0322% 0.0006% 0.0006% 0.0322%

自基金合同生效以来 15.897% 0.0327% 4.721% 0.0000% 11.723%

最近一月 16.099% 0.0327% 4.721% 0.0000% 12.767%

注:本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、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,因此,公允价值变动收益为零,本期已实现收益加上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,本期已实现收益和期末的基金相等。

3.2.2 基金净值表现

3.2.2.1 基金份额净值及其与同期业债比较基准收益率的比较

大成月盈短期理财债券 B

3.3 利率数据和指标

份额净收入 基准收益率 收益率标准差 基准收益率标准差 基准收益率标准差

过去三个月 0.0107% 0.0107% 0.0000% 0.0000% 0.0107%

过去六个月 0.0123% 0.0123% 0.0006% 0.0006% 0.0123%

过去一年 0.0126% 0.0126% 0.0006% 0.0006% 0.0126%

过去三年 0.0322% 0.0322% 0.0006% 0.0006% 0.0322%

自基金合同生效以来 15.897% 0.0327% 4.721% 0.0000% 11.723%

最近一月 16.099% 0.0327% 4.721% 0.0000% 12.767%

注:本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、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,因此,公允价值变动收益为零,本期已实现收益加上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,本期已实现收益和期末的基金相等。

2.本表净值收益率的计算所采取的周期,是以基金合同生效日为起始日并持有至报告期末的基金份额所经历的周期。

3.2.2.2 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债比较基准收益率变动的比较

大成月盈短期理财债券 B

3.3 过去三年基金的利润分配情况

大成月盈短期理财债券 A

大成月盈短期理财债券 B

大成月盈短期理财债券 A

大成月盈短期理财债券 B