

大成月月盈短期理财债券型证券投资基金

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:中国银行股份有限公司
送出日期:2016年3月26日

1.1 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法律责任。在签署本报告之前,基金管理人已经按照勤勉尽责原则,对本基金的投资、业绩、财务状况和其他事项进行了认真、全面、审慎和独立的核查,确信本报告内容不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏。基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理本基金资产,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,投资者有风险,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。
 本年度报告摘要摘自年度报告正文,投资者欲了解详细内容,应阅读年度报告正文。
 本报告财务资料已经审计。普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)为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

基金简称	大成月月盈短期理财债券
基金主代码	000023
交易代码	000023
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2012年11月20日
基金合同生效日	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	116,339,707.58份
基金合同存续期	不定期
下属分级基金的基金简称:	大成月月盈短期理财债券A大成月月盈短期理财债券B
下属分级基金的基金代码:	000023 091023
报告期末A级基金份额总额	65,117,113.7份
报告期末B级基金份额总额	46,361,111.52份
2.2 基金产品说明	
投资目标	以保障基金资产的安全性和流动性为首要目标,追求高于业绩比较基准的稳定收益。
投资策略	本基金通过平均期限配置策略,类属配置,品种选择等资产配置手段进行资产配置,以实现超越业绩比较基准的投资目标。
业绩比较基准	七天通知存款税后利率
风险收益特征	本基金属于短期理财债券型证券投资基金,长期风险收益水平低于股票型基金、混合型基金,及普通债券型基金。
2.3 基金管理人	
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
名称	姓名
信息披露负责人	杜鹏
客户服务电话	4008888568
传真	0755-43199688
2.4 信息披露方式	
信息披露网站	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22层大成基金管理有限公司 北京市西城区复兴门内大街2号A座10层中国银行股份有限公司托管部

3.1 主要会计数据和财务指标		§ 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								
3.1.1 期间数据和指标	2015年				2014年				2013年	
	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A	大成月月盈短期理财债券B	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A	大成月月盈短期理财债券B	大成月月盈短期理财债券A	大成月月盈短期理财债券B
本期已实现收益	2,418,168.14	6,010,117.26	572,302.37	5,171,077.43	62,519,742.02	4,989,889.39	6,370,134.03			
本期利润	2,418,168.14	6,010,117.26	572,302.37	5,171,077.43	62,519,742.02	4,989,889.39	6,370,134.03			
本期净收益	461,914.39	4,939,494.81	2,145.11	6,357.74	6,650.00	3,860.77	4,165.11			
3.1.2 期末数据和指标	2015年末				2014年末				2013年末	
	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A	大成月月盈短期理财债券B	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A	大成月月盈短期理财债券B	大成月月盈短期理财债券A	大成月月盈短期理财债券B
期末基金资产净值	65,117,113.71	46,901,113.62	83,241,484.69	186,389,113.71	276,012,154.48	85,797,113.71	29,944,154.85	85,797,113.71		
期末基金份额	10,000,000	10,000,000	10,000,000	10,000,000	10,000,000	10,000,000	10,000,000	10,000,000		

注：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。本期费用为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 基金份额净值增长率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					
3.1.1 期间数据	份额净值增长率	业绩比较基准收益率	份额净值增长率-业绩比较基准收益率	①-③	②-④
过去三个月	0.0810%	0.0107%	0.0430%	0.0000%	0.6407%
过去六个月	2.0409%	0.0123%	0.0806%	0.0000%	1.3694%
过去一年	4.6191%	0.0628%	1.3600%	0.0000%	3.2691%
过去三年	15.5349%	0.0323%	4.0600%	0.0000%	11.4849%
自基金合同生效起至今	16.8597%	0.0227%	4.1721%	0.0000%	11.7263%

大成月月盈短期理财债券A						
阶段	份额净收益增长率①	份额净收益增长率②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率④	①-③	②-④
过去三个月	1.0606%	0.0107%	0.0430%	0.0000%	0.7166%	0.0107%
过去六个月	2.2044%	0.0123%	0.0806%	0.0000%	1.5238%	0.0123%
过去一年	4.5248%	0.0628%	1.3600%	0.0000%	3.1648%	0.0628%
过去三年	16.5477%	0.0323%	4.0600%	0.0000%	12.4877%	0.0323%
自基金合同生效起至今	16.5897%	0.0227%	4.1721%	0.0000%	12.7676%	0.0227%
大成月月盈短期理财债券B						
阶段	份额净收益增长率①	份额净收益增长率②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率④	①-③	②-④
过去三个月	0.9894%	0.0107%	0.0430%	0.0000%	0.6291%	0.0107%
过去六个月	2.0276%	0.0123%	0.0806%	0.0000%	1.3470%	0.0123%
自基金合同生效起至今	21.4618%	0.0118%	0.7368%	0.0000%	14.7658%	0.0118%

效起至今	2017-01-01	2017-01-01	2017-01-01	2017-01-01	2017-01-01	2017-01-01
注：1、本基金根据每日基金收益情况，以基金净收益为基准，为投资者每日计算当日收益并分配，并在运作期末集中支付。						
2、本表净值收益率的计算所采取的运作周期，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运作周期。						

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

The chart displays the performance of the fund's cumulative net value yield rate (solid line) against the benchmark yield rate (dashed line) from the inception of the fund contract. The Y-axis represents the yield rate, ranging from 0.00% to 1.00%. The X-axis represents time. The fund's yield rate is consistently higher than the benchmark yield rate, indicating superior performance.

阶段	份额净收益增长率①	份额净收益增长率②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率④	①-③	②-④
过去三个月	0.0694%	0.0107%	0.0430%	0.0000%	0.6254%	0.0107%
过去六个月	0.2027%	0.0123%	0.0806%	0.0000%	1.2470%	0.0123%
过去一年	2.1451%	0.0119%	0.0724%	0.0000%	1.4262%	0.0119%

The chart displays two performance trajectories. The solid line starts at approximately 0.05% and rises to about 1.5% over the period shown. The dashed line starts at the same point but rises much more slowly, reaching approximately 0.5% by the end of the period. The gap between the two lines widens as time progresses, indicating superior performance for the solid line's strategy.

Time Period	Solid Line (Approx. %)	Dashed Line (Approx. %)
Start	0.05	0.05
Mid-Point	0.8	0.2
End	1.5	0.5

大成月月盈短期理财债券A	大成月月盈短期理财债券B					
阶段	份额净收益增长率①	份额净收益增长率②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率④	①-③	②-④
过去三个月	0.0694%	0.0107%	0.0430%	0.0000%	0.6254%	0.0107%
过去六个月	0.2027%	0.0123%	0.0806%	0.0000%	1.2470%	0.0123%
过去一年	2.1451%	0.0119%	0.0724%	0.0000%	1.4262%	0.0119%

阶段	份额净收益增长率①	份额净收益增长率②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率④	①-③	②-④
过去三个月	0.0694%	0.0107%	0.0430%	0.0000%	0.6254%	0.0107%
过去六个月	0.2027%	0.0123%	0.0806%	0.0000%	1.2470%	0.0123%
过去一年	2.1451%	0.0119%	0.0724%	0.0000%	1.4262%	0.0119%

注：1. 根据基金合同约定，基金管理人应当自基金合同生效之日起六个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的相关规定。截至报告期末，本基金的各项投资比例已达到基金合同中规定的各项比例。

2. 本基金自2015年6月16日起增设E类基金份额（E类份额基金代码：001516）。

3.2.3 自基金合同生效以来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

阶段	大成月月盈短期理财债券A	大成月月盈短期理财债券B
过去三个月	0.0694%	0.0107%
过去六个月	0.2027%	0.0123%
过去一年	2.1451%	0.0119%

阶段	大成月月盈短期理财债券A 份额净收益增长率①	大成月月盈短期理财债券B 份额净收益增长率②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率④	①-③	②-④
过去三个月	0.0694%	0.0107%	0.0430%	0.0000%	0.6254%	0.0107%
过去六个月	0.2027%	0.0123%	0.0806%	0.0000%	1.2470%	0.0123%
过去一年	2.1451%	0.0119%	0.0724%	0.0000%	1.4262%	0.0119%

大成月月盈短期理财债券A		大成月月盈短期理财债券B	
阶段	份额净收益增长率①	份额净收益增长率②	业绩比较基准收益率③
过去三个月	0.0694%	0.0107%	0.0430%
过去六个月	0.2027%	0.0123%	0.0806%
过去一年	2.1451%	0.0119%	0.0724%

阶段	份额净收益增长率①	份额净收益增长率②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率④	①-③	②-④
过去三个月	0.0694%	0.0107%	0.0430%	0.0000%	0.6254%	0.0107%
过去六个月	0.2027%	0.0123%	0.0806%	0.0000%	1.2470%	0.0123%
过去一年	2.1451%	0.0119%	0.0724%	0.0000%	1.4262%	0.0119%

注:1. 本基金合同生效日为2012年11月29日,2012年度主要财务指标的计算期间为2012年11月29日至2012年12月31日,不按整个自然年度进行折算。

2. 本基金自2015年6月16日起增设E类基金份额（E类份额基金代码：001516）。

3.3 过去三年基金的利润分配情况

大成月月盈短期理财债券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	1,711,015.85	847,538.37	-200,386.08	2,418,168.14	-
2014	2,637,843.53	2,289,737.60	243,496.30	5,171,077.43	-
2013	3,319,579.04	2,473,978.44	-793,667.63	4,999,889.85	-
合计	7,728,438.42	5,611,254.41	-750,567.41	12,589,135.42	-
大成月月盈短期理财债券B					

年度	已按两投资形式 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	4,843,720.39	1,607,750.42	-440,750.56	6,010,117.25	-
2014	50,141,179.90	12,057,969.90	320,603.12	62,519,742.92	-
2013	3,943,686.32	3,545,723.30	-519,275.59	6,970,134.03	-

合计	58,925,586.61	17,210,833.62	-639,426.03	75,499,994.20	-
大成月月盈短期理财债券B					
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	应付利息 本年变动	年度利润 分配合计	备注
2015	59,097.09	375,104.61	138,100.67	572,302.37	-

合计	1,097.09	375,104.61	138,100.67	572,302.37	-
----	----------	------------	------------	------------	---

§ 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

成立并自拟十家基金管理公司，注册资本42亿元人民币，注册地为深圳。目前公司由国内股东组成，分别为华泰信托有限公司(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，基金管理人管理5只ETF及1只ETF联接基金：大成中证500交易型开放式指数证券投资基金、中证500交易型开放式指数证券投资基金联接基金和大成中证成长40交易型开放式指数证券投资基金联接基金。大成中证500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、大成中证成长交易型开放式指数证券投资基金、2只QDII基金、大成标准普尔500指数证券投资基金、大成纳斯达克100指数证券投资基金和5只开放式证券投资基金。

金;大成晨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、大成财富领航2020生命周期证券投资基金、大成成长双轮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)、大成前沿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）、大成月添利货币市场基金、大成现金增利货币市场基金、大成月盈短期理财债券型证券投资基金、大成现金添利货币市场基金、大成安享短期理财债券型证券投资基金、大成现金宝货币市场基金、大成安弘稳健债券型证券投资基金、大成兴信信用增强债券型证券投资基金、大成景纯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

大成中证500指数证券投资基金(LOF)、大成灵活配置混合型证券投资基金、大成财富货币市场基金、大成景利稳收益混合型证券投资基金、大成利兴利宝货币市场基金、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、大成成长驱动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、大成明远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500指数基金分级证券投资基金

恒丰宝货币市场基金、大成增利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聚灵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

大成月月盈短期理财债券A	大成月月盈短期理财债券B					
阶段	份额净收益增长率①	份额净收益增长率②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率④	①-③	②-④
过去三个月	0.0694%	0.0107%	0.0430%	0.0000%	0.6254%	0.0107%
过去六个月	0.2027%	0.0123%	0.0806%	0.0000%	1.2470%	0.0123%
过去一年	2.1451%	0.0119%	0.0724%	0.0000%	1.4262%	0.0119%

大成月月盈短期理财债券A	大成月月盈短期理财债券B					
阶段	份额净收益增长率①	份额净收益增长率②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率④	①-③	②-④
过去三个月	0.0694%	0.0107%	0.0430%	0.0000%	0.6254%	0.0107%
过去六个月	0.2027%	0.0123%	0.0806%	0.0000%	1.2470%	0.0123%
过去一年	2.1451%	0.0119%	0.0724%	0.0000%	1.4262%	0.0119%

大成月月盈短期理财债券A	大成月月盈短期理财债券B
阶段	份额净收益