

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:2011年3月31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、完整性承担个别及连带的法律责任。本基金报告已经三分之二以上独立董事签字同意，由董事长签发。

基金托管人中国光大银行(以下简称“光大银行”)有限公司根据基金合同规定，于2011年3月25日复函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，报告不存在虚假记载、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摘要。

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。

本报告中财务资料已经审计。安永华明会计师事务所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2010年1月1日起至2010年12月31止。

## § 2 基本简介

## 2.1 基金基本情况

大成货币

基金代码 090005

基金运作方式 约定型开放式

基金成立日 2005年6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 1,652,821,766.73份

下属分级基金简称 不定期

大成货币A

大成货币B

下属分级的交易代码 090005 091005

报告期末下属分级基金的份额总额 435,465,622.13份 1,217,356,144.60份

## 2.2 基金产品说明

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、属类配置和品种选择三个层次进行投资管理，以实现超额回报率为前提，努力为基金份额持有人谋求最大利益。

业绩比较基准 指标法评价货币市场基金，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，略高于货币市场基金。

风险收益特征 本基金的预期风险和预期收益均低于货币市场基金。

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

姓名 郑毅 石平宜

信息披露负责人 邓丽 0755-83183388

联系电话 010-68560675

电子邮件 dcljgq@ecbchina.com shlpjjg@ccb.com

客户服务电话 4008885555

传真 0755-83199588

010-68560661

## 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 中国深圳市福南大道7088号招行银行大厦32层大成基金管理有限公司

北京光大银行总行及各分支行营业部

## § 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 2010年 2009年 2008年

大成货币A 大成货币B 大成货币B 大成货币B 大成货币B

本期已实现收益 7,364,720.37 33,095,455.54 14,596,948.64 39,993,559.03 29,865,300.07 57,265,514.46

本期利润 7,364,720.37 33,095,455.54 14,596,948.64 39,993,559.03 29,865,300.07 57,265,514.46

期末净值 1.8066% 2.0525% 1.3162% 1.5995% 3.7332% 3.9814%

3.1.2 期末数据 和指标 2010年末 2009年末 2008年末

期末净资产 435,465,622.13 1,217,356,144.60 2,397,964,970.73 13,858,734,290,250,470,463.75 8,049,790,688.66

期末基金份额 1,0000 1,0000 1,0000 1,0000 1,0000 1,0000

注: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,每月集中计付收益。

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

阶段 份额净值增长率① (%) 份额净值增长率标准差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

过去一个月 0.5900% 0.0070% 0.0090% 0.0000% 0.0090% 0.0070%

过去二个月 1.0946% 0.0055% 0.1815% 0.0000% 0.0131% 0.0055%

过去一年 1.8066% 0.0043% 0.3600% 0.0000% 1.4466% 0.0043%

过去五年 6.9972% 0.0086% 2.7336% 0.0039% 4.2636% 0.0053%

过去十年 12.5931% 0.0074% 3.9895% 0.0034% 5.9128% 0.0040%

自基金合同生效起至今 13.8771% 0.0072% 8.4440% 0.0032% 5.4331% 0.0040%

3.2.2 大成货币A

阶段 份额净值增长率① (%) 份额净值增长率标准差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

过去一个月 0.5900% 0.0070% 0.0090% 0.0000% 0.0090% 0.0070%

过去二个月 1.0946% 0.0055% 0.1815% 0.0000% 0.0131% 0.0055%

过去一年 1.8066% 0.0043% 0.3600% 0.0000% 1.4466% 0.0043%

过去五年 6.9972% 0.0086% 2.7336% 0.0039% 4.2636% 0.0053%

过去十年 12.5931% 0.0074% 3.9895% 0.0034% 5.9128% 0.0040%

自基金合同生效起至今 13.8771% 0.0072% 8.4440% 0.0032% 5.4331% 0.0040%

3.2.3 大成货币A

阶段 份额净值增长率① (%) 份额净值增长率标准差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 0.6515% 0.0070% 0.0090% 0.0000% 0.5606% 0.0070%

过去六个月 1.2167% 0.0055% 0.1815% 0.0000% 1.0352% 0.0055%

过去一年 2.0525% 0.0043% 0.3600% 0.0000% 1.6925% 0.0043%

过去五年 7.7709% 0.0086% 2.7336% 0.0039% 5.0373% 0.0053%

过去十年 13.9559% 0.0074% 3.9895% 0.0034% 5.6574% 0.0040%

自基金合同生效起至今 15.4183% 0.0072% 8.4440% 0.0032% 6.9734% 0.0040%

3.2.4 大成货币A

阶段 份额净值增长率① (%) 份额净值增长率标准差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

过去一个月 0.6515% 0.0070% 0.0090% 0.0000% 0.5606% 0.0070%

过去二个月 1.2167% 0.0055% 0.1815% 0.0000% 1.0352% 0.0055%

过去一年 2.0525% 0.0043% 0.3600% 0.0000% 1.6925% 0.0043%

过去五年 7.7709% 0.0086% 2.7336% 0.0039% 5.0373% 0.0053%

过去十年 13.9559% 0.0074% 3.9895% 0.0034% 5.6574% 0.0040%

自基金合同生效起至今 15.4183% 0.0072% 8.4440% 0.0032% 6.9734% 0.0040%

3.2.5 大成货币A

阶段 份额净值增长率① (%) 份额净值增长率标准差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

过去一个月 0.6515% 0.0070% 0.0090% 0.0000% 0.5606% 0.0070%

过去二个月 1.2167% 0.0055% 0.1815% 0.0000% 1.0352% 0.0055%

过去一年 2.0525% 0.0043% 0.3600% 0.0000% 1.6925% 0.0043%

过去五年 7.7709% 0.0086% 2.7336% 0.0039% 5.0373% 0.0053%

过去十年 13.9559% 0.0074% 3.9895% 0.0034% 5.6574% 0.0040%

自基金合同生效起至今 15.4183% 0.0072% 8.4440% 0.0032% 6.9734% 0.0040%

3.2.6 大成货币A

阶段 份额净值增长率① (%) 份额净值增长率标准差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

过去一个月 0.6515% 0.0070% 0.0090% 0.0000% 0.5606% 0.0070%

过去二个月 1.2167% 0.0055% 0.1815% 0.0000% 1.0352% 0.0055%

过去一年 2.0525% 0.0043% 0.3600% 0.0000% 1.6925% 0.0043%

过去五年 7.7709% 0.0086% 2.7336% 0.0039% 5.0373% 0.0053%

过去十年 13.9559% 0.0074% 3.9895% 0.0034% 5.6574% 0.0040%

自基金合同生效起至今 15.4183% 0.0072% 8.4440% 0.0032% 6.9734% 0.0040%

3.2.7 大成货币A

阶段 份额净值增长率① (%) 份额净值增长率标准差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

过去一个月 0.6515% 0.0070% 0.0090% 0.0000% 0.5606% 0.0070%

过去二个月 1.2167% 0.0055% 0.1815% 0.0000% 1.0352% 0.0055%

过去一年 2.0525% 0.0043% 0.3600% 0.0000% 1.6925% 0.0043%

过去五年 7.7709% 0.0086% 2.7336% 0.0039% 5.0373% 0.0053%

过去十年 13.9559% 0.0074% 3.9895% 0.0034% 5.6574% 0.0040%

自基金合同生效起至今 15.4183% 0.0072% 8.4440% 0.0032% 6.9734% 0.0040%

3.2.8 大成货币A

阶段 份额净值增长率① (%) 份额净值增长率标准差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

过去一个月 0.6515% 0.0070% 0.0090% 0.0000% 0.5606% 0.0070%

过去二个月 1.2167% 0.0055% 0.1815% 0.0000% 1.0352% 0.0055%

过去一年 2.0525% 0.0043% 0.3600% 0.0000% 1.6925% 0.0043%

过去五年 7.7709% 0.0086% 2.7336% 0.0039% 5.0373% 0.0053%

过去十年 13.9559% 0.0074% 3.9895% 0.0034% 5.6574% 0.0040%

自基金合同生效起至今 15.4183% 0.0072% 8.4440% 0.0032% 6.9734% 0.0040%

3.2.9 大成货币A

阶段 份额净值增长率① (%) 份额净值增长率标准差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

过去一个月 0.6515% 0.0070% 0.0090% 0.0000% 0.5606% 0.0070%

过去二个月 1.2167% 0.0055% 0.1815% 0.0000% 1.0352% 0.0055%