

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:2013年3月26日

§1 重要提示

基金管理人的董事会、监事会对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约定，于2013年3月22日核对了本报告中的财务数据、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等內容，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摘要。

本年度报告摘要节选自年度报告正文，投资者欲了解详细内容，应阅读年度报告全文。

本报告中财务数据已经审计，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，报告投资者注意阅读。

本报告期自2012年01月01日起至2012年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

基金运作方式 约定型开放式

基金合同生效日 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 23,659,528,685.68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: 5,122,121,194.11份 18,537,407,491.57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，以实现超越基准的投资目标。

业绩比较基准 持续活期存款利率。

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；预期收益和风险均低于货币基金、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

姓名/名称 杜鹏 王颖

联系电话 0755-83183388 010-63639161

电子邮箱 dupeng@dfcfund.com.cn shlping@cecbank.com

客户服务电话 4008885555 95595

传真 0755-83199588 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.dfcfund.com.cn

深圳市民福区深南大道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大街6号光大大厦

中国光大银行投资与托管业务部

3.1 主要数据和财务指标

金额单位:人民币元

3.1.1 期间数据

2012年 2011年 上年度 2010年

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 28,439,582.86 82,030,725.78 26,959,582.86 36,083,136.05

本期利润 28,439,582.86 82,030,725.78 26,959,582.86 36,083,136.05

期末净值 3.7661% 4.0149% 3.5069% 1.8066%

2.0525%

3.1.2 期末未摊销费用

2012年末 2011年末 上年度末 2010年末

期末总资产 5,122,121,194.11 18,537,407,491.57 1,653,475,791.27 2,791,924.30

净资产 848.31 293.30 622.13 144.60

期末负债 1.0000 1.0000 1.0000 1.0000

份额净值 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。

本基金在2013年将密切关注金融市场变化，在稳健操作的原则下，高度重视组合的流动性管理。

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

阶段 份额净值收益率① 份额净值收益基準率差② 业绩比较基准收益率③ 业绩比较基准收益基準率差④ ①~③ ②~④

过去三个月 0.8771% 0.0016% 0.0880% 0.0000% 0.7891% 0.0016%

过去六个月 1.6940% 0.0246% 0.166% 0.0000% 1.5174% 0.0246%

过去一年 3.7661% 0.0324% 0.410% 0.0002% 3.34% 0.0309%

过去三年 9.345% 0.0458% 1.248% 0.002% 8.0968% 0.0434%

过去五年 14.920% 0.0726% 3.621% 0.0027% 11.299% 0.0484%

自基金合同生效起至今 22.309% 0.0666% 9.331% 0.0031% 15.228% 0.035%

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。

本基金在2013年将密切关注金融市场变化，在稳健操作的原则下，高度重视组合的流动性管理。

3.2.2 基金净值表现

3.2.1.1 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 份额净值收益率① 份额净值收益基準率差② 业绩比较基准收益率③ 业绩比较基准收益基準率差④ ①~③ ②~④

过去三个月 0.9367% 0.0016% 0.0880% 0.0000% 0.8487% 0.0016%

过去六个月 1.815% 0.024% 0.1766% 0.0000% 1.6389% 0.024%

过去一年 4.014% 0.032% 0.419% 0.0002% 3.505% 0.030%

过去三年 10.135% 0.045% 1.248% 0.002% 8.887% 0.0403%

过去五年 16.307% 0.072% 3.621% 0.0027% 12.685% 0.0405%

自基金合同生效起至今 24.5602% 0.0666% 9.331% 0.0031% 15.228% 0.035%

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。

本基金在2013年将密切关注金融市场变化，在稳健操作的原则下，高度重视组合的流动性管理。

3.2.2.1 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 份额净值收益率① 份额净值收益基準率差② 业绩比较基准收益率③ 业绩比较基准收益基準率差④ ①~③ ②~④

过去三个月 0.9367% 0.0016% 0.0880% 0.0000% 0.8487% 0.0016%

过去六个月 1.815% 0.024% 0.1766% 0.0000% 1.6389% 0.024%

过去一年 4.014% 0.032% 0.419% 0.0002% 3.505% 0.030%

过去三年 10.135% 0.045% 1.248% 0.002% 8.887% 0.0403%

过去五年 16.307% 0.072% 3.621% 0.0027% 12.685% 0.0405%

自基金合同生效起至今 24.5602% 0.0666% 9.331% 0.0031% 15.228% 0.035%

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。

本基金在2013年将密切关注金融市场变化，在稳健操作的原则下，高度重视组合的流动性管理。

3.2.2.2 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 份额净值收益率① 份额净值收益基準率差② 业绩比较基准收益率③ 业绩比较基准收益基準率差④ ①~③ ②~④

过去三个月 0.9367% 0.0016% 0.0880% 0.0000% 0.8487% 0.0016%

过去六个月 1.815% 0.024% 0.1766% 0.0000% 1.6389% 0.024%

过去一年 4.014% 0.032% 0.419% 0.0002% 3.505% 0.030%

过去三年 10.135% 0.045% 1.248% 0.002% 8.887% 0.0403%

过去五年 16.307% 0.072% 3.621% 0.0027% 12.685% 0.0405%

自基金合同生效起至今 24.5602% 0.0666% 9.331% 0.0031% 15.228% 0.035%

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。

本基金在2013年将密切关注金融市场变化，在稳健操作的原则下，高度重视组合的流动性管理。

3.2.3 销售服务费

金额单位:人民币元

3.2.3.1 销售服务费

项目 本期 2012年1月1日至2012年12月31日 上年度可比期间 2011年1月1日至2011年12月31日

实收基金 8,945,382,141.61 1,652,821,766.73

未分配利润 - 63,042,718.91

所有者权益合计 8,945,382,141.61 1,652,821,766.73

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. 以下为本公司在正常业务范围内按一般商业条款订立的日常关联交易。

3. 本公司在正常业务范围内按一般商业条款订立的日常关联交易。

4. 其他关联交易。

5. 本公司在正常业务范围内按一般商业条款订立的日常关联交易。

6. 本公司在正常业务范围内按一般商业条款订立的日常关联交易。

7. 本公司在正常业务范围内按一般商业条款订立的日常关联交易。

8. 本公司在正常业务范围内按一般商业条款订立的日常关联交易。

9. 本公司在正常业务范围内按一般商业条款订立的日常关联交易。

10. 本公司在正常业务范围内按一般商业条款订立的日常关联交易。

11. 本公司在正常业务范围内按一般商业条款订立的日常关联交易。

12. 本公司在正常业务范围内按一般商业条款订立的日常关联交易。

13. 本公司在正常业务范围内按一般商业条款订立的日常关联交易。

14. 本公司在正常业务范围内按一般商业条款订立的日常关联交易。

15. 本公司在正常业务范围内按一般商业条款订立的日常关联交易。

16. 本公司在正常业务范围内按一般商业条款订立的日常关联交易。

17. 本公司在正常业务范围内按一般商业条款订立的日常关联交易。

18. 本公司在正常业务范围内按一般商业条款订立的日常关联交易。