大成现金宝场内实时申赎货币市场基金

【2014】半年度报告摘要

基金管理人:大成基金管理有限公司
基金托管人:中国农业银行股份有限公司
送出日期:2014年8月28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。本半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。

基金托管人中国农业银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2014年8月26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。

本半年度报告摘要摘自半年度报告正文,投资者欲了解详细内容,应阅读半年度报告正文。

本报告中财务资料未经审计 。

本报告期自2014年01月01日起至06月30日止。

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金简称	大成现金宝货币	
基金主代码	519898	
交易代码	519898	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2013年3月27日	
基金管理人	大成基金管理有限公司	
基金托管人	中国农业银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	358,567,403,637.00份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称:	现金宝A	现金宝B
下属分级基金的交易代码:	519898	519899
报告期末下属分级基金的份额总额	210,489,964,679.00份	148,077,438,958.00份

2.2 基金产品说明

投资目标	安全性和流动性优先,在此基础上追求适度收益。
投资策略	本基金通过结构化投资策略,分散化投资策略,利率趋势评估策略,滚动配置策略和相对价值评估策略多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	银行活期存款利率(税后)
风险收益特征	本基金为货币市场基金,为证券投资基金中的低风险品种。本基金长期的风险和预期收益低于股票型基金、混合型基金、债券型基金。

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	中国农业银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	杜鹏	李芳菲
	联系电话	0755-83183388	010-66060069
	电子邮箱	dupeng@dcfund.com.cn	lifangfei@abchina.com
客户服务电话		4008885558	95599
传真		0755-83199588	010-68121816

2.4 信息披露方式

登载基金半年度报告正文的管理人互联网网址	http://www.dcfund.com.cn
基金半年度报告备置地点	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28号凯晨世贸中心东座F9中国农业银行股份有限公司托管业务部

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

基金级别	现金宝A	现金宝B
3.1.1 期间数据和指标	报告期(2014年1月1日 - 2014年6月30日)	报告期(2014年1月1日 - 2014年6月30日)
本期已实现收益	27,272,719.08	26,052,534.11
本期利润	27,272,719.08	26,052,534.11
本期净值收益率	2.1825%	2.4813%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2014年6月30日)	
期末基金资产净值	2,104,899,646.79	1,480,774,389.58
期末基金份额净值	0.01	0.01

金额单位:人民币元

注:1、本基金根据每日基金收益公告,以每百万份基金份额收益为基准,为投资人每日计算收益并分配。

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

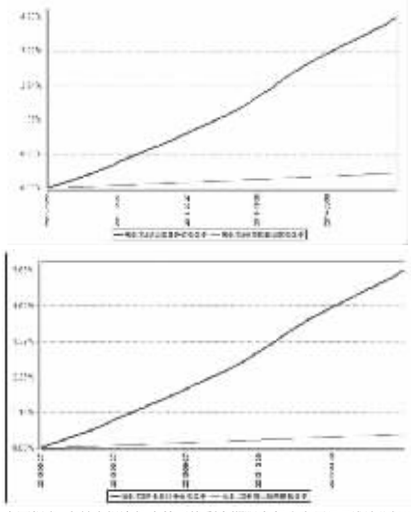
现金宝A

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
过去一个月	0.3534%	0.0066%	0.0288%	0.0000%	0.3246%	0.0066%
过去三个月	0.9872%	0.0039%	0.0873%	0.0000%	0.8999%	0.0039%
过去六个月	2.1825%	0.0040%	0.1736%	0.0000%	2.0089%	0.0040%
过去一年	4.0653%	0.0033%	0.3500%	0.0000%	3.7153%	0.0033%
自基金合同生效起至今	4.8762%	0.0033%	0.4421%	0.0000%	4.4341%	0.0033%

现金宝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
过去一个月	0.4017%	0.0066%	0.0288%	0.0000%	0.3729%	0.0066%
过去三个月	1.1353%	0.0039%	0.0873%	0.0000%	1.0480%	0.0039%
过去六个月	2.4813%	0.0040%	0.1736%	0.0000%	2.3077%	0.0040%
过去一年	4.6821%	0.0033%	0.3500%	0.0000%	4.3321%	0.0033%
自基金合同生效起至今	5.6585%	0.0033%	0.4421%	0.0000%	5.2164%	0.0033%

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、按基金合同规定,本基金投资组合的平均剩余期限在每个交易日不得超过120天;本基金与基金管理人管理的其他基金持有一家公司发行的证券总和,不超过该证券的10%;本基金投资于定期存款的比例不得超过基金资产净值的30%(有存款期限、但根据协议可提前支取且没有利息损失的银行存款,不受该比例限制);本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%;本基金不得投资于以定期存款利率为基准利率的浮动利率债券;本基金买断式回购融入基础债券的剩余期限不得超过397天;在全国银行间同业市场中的债券回购最长期限为1年,债券回购到期后不得展期;本基金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%;基金的投资组合中保留的现金或者到期日在一年以内的政府债券的比例合计不低于基金资产净值的5%;本基金投资于同一公司发行的短期企业债券及短期融资券的比例,合计不得超过基金资产净值的10%;本基金持有的全部资产支持证券,其市值不得超过基金资产净值的 20%;本基金持有的同一(指同一信用级别)资产支持证券的比例,不得超过该资产支持证券规模的10%;本基金投资于同一原始权益人的各类资产支持证券的比例,不得超过基金资产净值的10%;本基金管理人管理的全部基金投资于同一原始权益人的各类资产支持证券,不得超过其各类资产支持证券合计规模的 10%;本基金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%;

2、按基金合同规定,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有关约定。

§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2014年6月30日,本基金管理人共管理1只封闭式证券投资基金:景福证券投资基金,4只ETF及1只ETF联接基金:深证成长40交易型开放式指数证券投资基金、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、大成中证500沪市交易型开放式指数证券投资基金、大成中证100交易型开放式指数证券投资基金、大成中证500深市交易型开放式指数证券投资基金,1只QDII基金:大成标普500等权重指数证券投资基金及37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、大成积极成长股票型证券投资基金、大成创新成长混合型证券投资基金(LOF)、大成景阳领先股票型证券投资基金、大成强化收益债券型证券投资基金、大成策略回报股票型证券投资基金、大成行业轮动股票型证券投资基金、大成中证红利指数证券投资基金、大成核心双动力股票型证券投资基金、大成竞争优势股票型证券投资基金、大成内需增长股票型证券投资基金、大成消费主题股票型证券投资基金、大成可转债增强债券型证券投资基金、大成新锐产业股票型证券投资基金、大成景恒保本混合型证券投资基金、大成优选股票型证券投资基金(LOF)、大成现金增利货币市场基金、大成月添利理财债券型证券投资基金、大成理财21天债券型发起式基金、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、大成中小盘股票型证券投资基金(LOF)、大成健康产业股票型证券投资基金、大成信用增利一年定期开放债券型证券投资基金、大成灵活配置混合型证券投资基金、大成招财宝货币市场基金、大成景益平稳收益混合型证券投资基金。

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		
邵伟南先生	本基金基金经理	2013年3月27日	-	12年	工商管理硕士。曾任职于郑州纺织工学院,融通基金管理有限公司。2006年3月加入大成基金管理有限公司,历任基金会计、固定收益研究员、基金经理助理。2013年2月1日起任大成理财21天债券型发起式证券投资基金基金经理。2013年3月27日起任大成现金宝场内实时申赎货币市场基金基金经理。2013年11月19日起任大成景祥分级债券型证券投资基金基金经理。2014年6月18日起任大成招财宝货币市场基金基金经理。2014年7月28日起任大成添利宝货币市场基金基金经理。具有基金从业资格。国籍:中国
黄海峰先生	本基金基金经理助理	2013年10月14日	-	10年	南开大学经济学学士,2004年7月至2010年5月就职于深圳农村商业银行,任资金部投资经理;2010年5月至2012年10月就职于博时基金管理有限公司,任交易部交易员;2012年7月至2013年5月就职于银华基金管理有限公司,任固定收益部基金经理助理,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日起任大成货币市场证券投资基金基金经理助理。2014年6月23日起任大成招财宝货币市场基金及大成景益平稳收益混合型证券投资基金基金经理助理。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》、《大成现金宝场内实时申赎货币市场基金基金合同》和其他有关法律法规的规定,在基金管理运作中,大成现金宝场内实时申赎货币市场基金的投资范围、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分析及相应交易情形的分析结果表明: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。结合交易价差分布统计分析和潜在利益输送金额统计结果表明投资组合间不存在利益输送的可能性。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

公司风险管理部定期对公司旗下所有投资组合间同向交易、反向交易等可能存在异常交易的行为进行分析。2014年上半年公司旗下主动投资组合间股票交易存在11笔同日反向交易,原因是投资组合投资策略需要。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3笔,原因为投资策略需要;投资组合间存在1笔债券同日反向交易,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;投资组合间虽然存在同向交易行为,但结合交易价差分布统计分析和潜在利益输送金额统计结果表明投资组合间不存在利益输送的可能性。

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

2014 年上半年,世界经济继续温和复苏。美国经济活动重新加速,第二季度GDP环比折年率增长4.0%,欧元区经济则继续微弱复苏。我国受房地产开发投资增速放缓,经济增速持续下滑。一、二季度GDP增速分别为7.4%和7.5%,低于2013年的7.7%。通胀方面,受食品价格影响,上半年CPI同比仅为2.3%。受国内外需求的影响,PPI上半年同比为-1.8%。因此,从整体宏观环境来看,对债券市场较为有利。在经济持续放缓、企业盈利下滑等背景下,央行态度较去年下半年明显好转。央行通过再贷款、定向降准等定向宽松的方式降低融资成本,同时在公开市场上持续保持净投放。上半年银行间7天回购利率均值由去年下半年的4.36%降至3.69%,3月SHIBOR回落至4.75%。各期限收益率亦出现大幅下行,其中1 年国开债下行120BP,AAA、AA+、AA短融均下行165BP以上。

由于组合规模波动较大,一季度组合投资为存款为主,同时剩余期限相对较短。二季度,组合作出了较大调整,一方面加大了组合的剩余期限,同时提高了债券的投资比例。在类属配置方面,加大了短融和利率债的配置比例。在短融投资方面,主要以AAA和AA+为主,兼顾了收益的提升和信用风险的防范,取得了较好的效果。

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2.1825%,B类净值收益率2.4813%,期间业绩比较基准收益率为0.1736%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望下半年,由于主要城市地产销量同比持续大幅下降,发电增速未有明显改善,经济增速难以乐观。目前经济增长虽在“微刺激”政策的带动下呈现出复苏迹象,但这一复苏势头对稳增长政策高度依赖,并面临着来自地产和基数效应的压力,因而并不稳固。去年3季度,GDP增速从去年2季度的7.5%回升至7.8%。这种基数的上升,会给今年3季度的经济和投资同比增速带来向下压力。在总需求回落的背景下,通胀总体不需担忧。在政府要求降低社会融资成本的指导理想下,预计下半年央行仍会保持政策的连续性和稳定性,坚持“总量稳定、结构优化”的取向,保持货币市场稳定。因此,目前短端信用和利率绝对收益率水平虽较年初大幅下行,但仍处历史高位,具一定的配置价值。但随着经济的进一步下行,对于低评级短融的投资上应谨慎对待。

基于上述分析,2014年下半年,组合仍将保持长久期的策略,在类属配置方面,我们将密切跟踪市场的变化,在充分做好流动性管理的前提下,继续保持短融的配置比例。同时密切关注同业存款政策的变化和新股发行节奏,力争在保持组合流动性的前提下,提升客户申赎体验,为投资者带来长期稳定的投资收益。

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、固定收益部、风险管理部、基金运营部、监察稽核部、委托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、固定收益部、风险管理部和委托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,截止报告期末未与外部估值定价服务机构签约。

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,以每百万份基金份额收益为基准,为投资人每日计算收益并分配。本报告期内本基金应分配利润53,325,253.19元,报告期内已分配利润53,325,253.19元。

§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

在托管大成现金宝场内实时申赎货币市场基金的过程中,本基金托管人—中国农业银行股份有限公司严格遵守《证券投资基金法》相关法律法规的规定以及《大成现金宝场内实时申赎货币市场基金基金合同》、《大成现金宝场内实时申赎货币市场基金托管协议》的约定,对大成现金宝场内实时申赎货币市场基金管理人—大成基金管理有限公司2014年1月1日至2014年6月30日基金的投资运作,进行了认真、独立的会计核算和必要的投资监督,认真履行了托管人的义务,没有从事任何损害基金份额持有人利益的行为。

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

本托管人认为,大成基金管理有限公司在大成现金宝场内实时申赎货币市场基金的投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支及利润分配等问题上,不存在损害基金份额持有人利益的行为;在报告期内,严格遵守了《证券投资基金法》等有关法律法规,在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人认为,大成基金管理有限公司的信息披露事务符合《证券投资基金信息披露管理办法》及其他相关法律法规的规定,基金管理人所编制和披露的大成现金宝场内实时申赎货币市场基金半年度报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告等信息真实、准确、完整,未发现有损害基金持有人利益的行为。

§6 半年度财务会计报告(未经审计)

6.1 资产负债表

会计主体:大成现金宝场内实时申赎货币市场基金

报告截止日:2014年6月30日

单位:人民币元

资 产	本期末 2014年6月30日	上年度末 2013年12月31日
资 产:		
银行存款	1,289,883,607.22	1,258,207,782.51
结算备付金	33,801,313.40	11,249,845.15
存出保证金	-	-
交易性金融资产	1,680,832,901.48	389,983,400.46
其中:股票投资	-	-
基金投资	-	-
债券投资	1,680,832,901.48	389,983,400.46
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	1,057,103,932.60	898,100,462.15
应收证券清算款	200,036,968.04	-
应收利息	23,176,643.80	11,884,305.63
应收股利	-	-
应收申购款	260,213,112.38	512,261,965.60
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	10,267.62
资产总计	4,545,048,478.92	3,081,698,029.12
负债和所有者权益	本期末 2014年6月30日	上年度末 2013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	559,799,400.10	146,804,486.60
应付证券清算款	-	270,000,000.00
应付赎回款	397,073,316.41	29,452,992.13
应付管理人报酬	707,460.41	261,338.15
应付托管费	209,617.90	77,433.53
应付销售服务费	353,075.78	142,065.41
应付交易费用	61,842.94	18,047.69
应交税费	-	-
应付利息	45,331.95	12,762.30
应付利润	432,594.14	318,787.99
递延所得税负债	-	-
其他负债	691,802.92	254,927.62
负债合计	959,374,442.55	447,342,841.42
所有者权益:		
实收基金	3,585,674,036.37	2,634,355,187.70
未分配利润	-	-
所有者权益合计	3,585,674,036.37	2,634,355,187.70
负债和所有者权益总计	4,545,048,478.92	3,081,698,029.12

注:报告截止日2014年6月30日,A级基金份额净值0.01元,基金份额总额210,489,964,679.00份;B级基金份额净值0.01元,基金份额总额148,077,438,958.00份。基金份额总额358,567,403,637.00份。

6.2 利润表

会计主体:大成现金宝场内实时申赎货币市场基金

本报告期:2014年1月1日至2014年6月30日

单位:人民币元

资 产	本期 2014年1月1日至2014年6月30日	上年度可比期间 2013年3月27日(基金合同生效日)至2013年6月30日
一、收入	64,967,077.28	17,787,086.50
1.利息收入	62,722,430.03	18,345,713.89
其中:存款利息收入	32,354,159.29	14,601,892.24
债券利息收入	20,203,375.98	2,783,117.72
资产支持证券利息收入	-	-
买入返售金融资产收入	10,164,894.76	960,703.93
其他利息收入	-	-
2.投资收益(损失以“-”填列)	2,244,647.25	-558,627.39
其中:股票投资收益	-	-
基金投资收益	-	-
债券投资收益	2,244,647.25	-558,627.39
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)	-	-
减:二、费用	11,641,824.09	3,471,280.48
1.管理人报酬	3,229,681.98	1,133,650.48
2.托管费	956,942.74	335,896.49
3.销售服务费	1,686,460.99	449,951.71
4.交易费用	-	-
5.利息支出	3,228,389.85	841,629.57
其中:卖出回购金融资产支出	3,228,389.85	841,629.57
6.其他费用	2,540,348.53	710,152.23
三、利润总额(亏损总额以“-”号填列)	53,325,253.19	14,315,806.02
减:所得税费用	-	-
四、净利润(净亏损以“-”号填列)	53,325,253.19	14,315,806.02

6.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体:大成现金宝场内实时申赎货币市场基金

本报告期:2014年1月1日 至 2014年6月30日

单位:人民币元

项目	本期 2014年1月1日至2014年6月30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)	2,634,355,187.70	-	2,634,355,187.70
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	53,325,253.19	53,325,253.19
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)	951,318,848.67	-	951,318,848.67
其中:1.基金申购款	34,317,228,884.13	-	34,317,228,884.13
2.基金赎回款	-33,365,910,035.46	-	-33,365,910,035.46
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)	-	-53,325,253.19	-53,325,253.19
五、期末所有者权益(基金净值)	3,585,674,036.37	-	3,585,674,036.37
项目	上年度可比期间 2013年3月27日(基金合同生效日)至2013年6月30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)	1,219,724,388.00	-	1,219,724,388.00
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	14,315,806.02	14,315,806.02
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)	1,106,267,234.37	-	1,106,267,234.37
其中:1.基金申购款	12,018,885,317.68	-	12,018,885,317.68
2.基金赎回款	-10,912,618,083.31	-	-10,912,618,083.31
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)	-	-14,315,806.02	-14,315,806.02
五、期末所有者权益(基金净值)	2,325,991,622.37	-	2,325,991,622.37

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署:

_____张树忠_____ _____刘彩晖_____ _____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

6.4 报表附注

6.4.1 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。

6.4.2 税项

6.4.2.1 营业税、企业所得税

根据财政部、国家税务总局财税字[2004]78号文《关于证券投资基金税收政策的通知》的规定,自2004年1月1日起,对证券投资基金(封闭式证券投资基金,开放式证券投资基金)管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入,继续免征营业税和企业所得税;

根据财政部、国家税务总局财税[2008]1号文《关于企业所得税若干优惠政策的通知》的规定,对证券投资基金从证券市场中取得的收入,包括买卖股票、债券的差价收入,股权的股息、红利收入,债券的利息收入及其他收入,暂不征收企业所得税。

6.4.2.2 个人所得税

根据财政部、国家税务总局财税字 [2002]128号文《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》,对基金取得的股票的股息、红利及债券的利息等收入,由上市公司、债券发行企业等在向基金派发时代扣代缴20%的个人所得税。

根据财政部、国家税务总局财税[2008]132号《财政部国家税务总局关于储蓄存款利息所得有关个人所得税政策的通知》,自2008年10月9日起暂免征收储蓄存款利息所得个人所得税。

6.4.3 关联方关系

6.4.3.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

6.4.3.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	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
中国农业银行股份有限公司(“中国农业银行”)	基金托管人
中泰信托有限责任公司	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、基金代销机构
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”)	基金管理人的合资子公司

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。

6.4.4 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.4.1 通过关联方交易单元进行的交易

本基金本期内未发生通过关联方交易单元进行的交易。

6.4.4.2 关联方报酬

6.4.4.2.1 基金管理费

单位:人民币元

项目	本期 2014年1月1日至2014年6月30日	上年度可比期间 2013年3月27日(基金合同生效日)至2013年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	3,229,681.98	1,133,650.48
其中:支付销售机构的客户维护费	1,131,064.57	350,912.80

注:在通常情况下,基金管理费按前一日基金资产净值的0.27%年费率计提。计算方法如下:

H = E × 年管理费率 ÷ 当年天数,本基金年管理费率为0.27%

H为每日应计提的基金管理费

E为前一日基金资产净值

基金管理费每日计提,逐日累计至每月月末,按月支付。由基金管理人向基金托管人发送基金管理费划付指令,经基金托管人复核后于次月首日起3个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。

6.4.4.2.2 基金托管费

单位:人民币元

项目	本期 2014年1月1日至2014年6月30日	上年度可比期间 2013年3月27日(基金合同生效日)至2013年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	956,942.74	335,896.49

注:在通常情况下,基金托管费按前一日基金资产净值的0.08%年费率计提。计算方法如下:

H = E × 年托管费率 ÷ 当年天数,本基金年托管费率为0.08%

H为每日应计提的基金托管费

E为前一日基金资产净值

基金托管费每日计提,逐日累计至每月月末,按月支付。由基金管理人向基金托管人发送基金托管费划付指令,经基金托管人复核后于次月首日起3个工作日内从基金财产中一次性支付给基金托管人。

6.4.4.2.3 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 2014年1月1日至2014年6月30日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	现金宝A	现金宝B	合计
光大证券	61,422.58	766.43	62,189.01
合计	61,422.58	766.43	62,189.01
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2013年3月27日(基金合同生效日)至2013年6月30日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	现金宝A	现金宝B	合计
光大证券	19,392.98	192.80	19,585.78
合计	19,392.98	192.80	19,585.78

注:1、本基金A类基金份额的销售服务费年费率为0.25%,对于由B类降级为A类的基金份额持有人,基金年销售服务费率应自其达到A类条件的开放日当日起适用A类基金份额持有人的费率。

本基金B类基金份额的销售服务费年费率为0.01%,对于由A类升级为B类的基金份额持有人,基金年销售服务费率应自其达到B类条件的开放日当日起适用B类基金份额持有人的费率。

各类基金份额的销售服务费计提的计算公式如下:

H = E × R ÷ 当年天数

H 为每日该类基金份额应计提的基金销售服务费

E 为前一日该类基金份额的基金资产净值

R 为该类基金份额的年销售服务费率

基金销售服务费每日计提,逐日累计至每月月末,按月支付,由基金管理人向基金托管人发送销售服务费划款指令,基金托管人复核后于次月首日起3个工作日内从基金财产中一次性划付给基金管理人,由基金管理人代收,基金管理人收到后支付给销售机构。

销售服务费主要用于支付销售机构佣金、以及基金管理人的基金营销广告费、促销活动费、持有人服务费等。

2、根据基金合同,对于本基金A类基金份额,每日应收取的增值服务费以0.35%的年费率,按其持有的前一日基金资产净值进行计算。本基金本报告期发生的应支付本基金管理人股东“光大证券”的A类基金份额增值服务费为85,991.70元。

6.4.4.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

单位:人民币元

银行间市场交易的各关联方名称	本期 2014年1月1日至2014年6月30日					
	债券交易金额		基金逆回购		基金正回购	
	基金买入	基金卖出	交易金额	利息收入	交易金额	利息支出
中国农业银行	-	-	-	-	207,020,000.00	17,011.45
	上年度可比期间 2013年3月27日(基金合同生效日)至2013年6月30日					
银行间市场交易的各关联方名称	债券交易金额		基金逆回购		基金正回购	
	基金买入	基金卖出	交易金额	利息收入	交易金额	利息支出
中国农业银行	-	-	-	-	-	-

6.4.4.4 各关联方投资本基金的情况

6.4.4.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

报告期内基金管理人未运用固有资金投资本基金。

6.4.4.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

报告期末除基金管理人之外的其他关联方未持有本基金。

6.4.4.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位:人民币元

关联方名称	本期 2014年1月1日至2014年6月30日		上年度可比期间 2013年3月27日(基金合同生效日)至2013年6月30日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国农业银行	14,883,607.22	212,801.65	114,939,416.93	484,910.52

注:本基金的银行存款由基金托管人中国农业银行保管,并按银行间同业利率计息。

6.4.4.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本报告期内本基金未在承销期内参与关联方承销证券。

6.4.4.7 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期无须作说明的其他关联交易事项。

6.4.5 期末(2014年6月30日)本基金持有的流通受限证券

6.4.5.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

于本报告期末,本基金未持有因认购新发或增发证券而流通受限的证券。

6.4.5.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金本报告期末未持有暂时停牌等流通受限的股票。

6.4.5.3 期末债券正回购交易中作为