

大成现金宝场内实时申赎货币市场基金

[2014] 第三季度报告

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

报告送出日期:2014年10月27日

§ 1重要提示

基金管理人的董事会及监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责任。

基金托管人中国银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2014年10月23日复核了本报告中的财务指标、净值表现、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。

本报告中财务数据未经审计。

本报告期自2014年7月1日起至9月30日止。

§ 2 基金产品概况

基金简称	大成现金宝货币
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
报告期末基金份额总额	331,689,423,550.09份
投资目标	本基金通过合理的投资策略，分散化投资策略，利率期货评估策略，滚动调整策略和对评价评估策略等多次进行投资管理，以实现资金的安全性和流动性，在此基础上追求适度收益。
风险收益特征	本基金为货币市场基金，其预期收益和风险水平低于股票型基金、混合型基金、债券型基金。
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
下属基金份额的基金简称	现金宝A 现金宝B
下属基金份额的交易代码	519898 519899
报告期末下属基金份额的份额总额	204,091,649,617.00份 127,597,493,118.00份

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

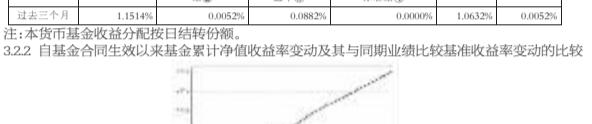
单位:人民币元

主要财务指标	报告期(2014年7月1日 - 2014年9月30日)	
	现金宝A	
1.本期已实现收益	18,217,215.94	16,268,601.56
2.本期利润	18,217,215.94	16,268,601.56
3.期末基金资产净值	2,040,091,649,617.00份	1,275,974,931.18份

注:本期实现收入包括基金本期利息收入、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，本期利润即为本期已实现收入扣除公允价值变动收益，由于货币市场基金采用摊余成本法核算，因此，公允价值变动收益为零，本期已实现收入和本期利润的金额相等。

3.2 基金净值表现

3.2.1 本基金报告期内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



注:按基金合同规定，本基金自基金合同生效之日起6个月内为建仓期。截至建仓期满本基金的各项投资比例已达到基金合同中规定的比例。

5.4 管理人报告

4.1 基金经理(或基金经理小组)简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限	证券从业年限	说明
屈伟南先生	本基金基金经理	2013年3月27日	-	12年 屈伟南先生具有丰富的金融行业经验，2001年7月至2004年1月就职于中国银行总行资金营运部，2004年1月至今就职于大成基金管理有限公司，期间历任大成基金管理有限公司资金营运部投资经理、高级理财师、高级研究员、基金经理助理、基金经理，现任大成基金管理有限公司基金经理。屈伟南先生具有基金从业资格，取得中国证券投资基金业协会颁发的基金从业资质证书，具有基金从业资格，国籍:中国

注:1.任日期、离任日期为本基金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

4.3 管理人对报告期内本基金利润分配情况的说明

4.4 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

4.6 管理人对报告期内基金估值政策和会计政策的说明

4.7 管理人对报告期内基金投资组合跟踪情况的说明

4.8 管理人对报告期内基金投资组合的偏离度的说明

4.9 报告期内基金的资产配置情况

4.10 公司风险控制部门定期分析公司旗下所有投资组合之间同向交易可能存在的异常交易行为

4.11 公司风险管理部定期分析公司旗下所有投资组合之间反向交易可能存在的异常交易行为

4.12 公司风险管理部定期分析公司旗下所有投资组合之间是否存在利益输送情形

4.13 公司风险管理部定期分析公司旗下所有投资组合之间是否存在不公平交易行为

4.14 公司风险管理部定期分析公司旗下所有投资组合之间是否存在内幕交易行为

4.15 公司风险管理部定期分析公司旗下所有投资组合之间是否存在不公平交易行为

4.16 公司风险管理部定期分析公司旗下所有投资组合之间是否存在利益输送情形

4.17 公司风险管理部定期分析公司旗下所有投资组合之间是否存在不公平交易行为

4.18 公司风险管理部定期分析公司旗下所有投资组合之间是否存在内幕交易行为

4.19 公司风险管理部定期分析公司旗下所有投资组合之间是否存在不公平交易行为

4.20 公司风险管理部定期分析公司旗下所有投资组合之间是否存在利益输送情形

4.21 公司风险管理部定期分析公司旗下所有投资组合之间是否存在不公平交易行为

4.22 公司风险管理部定期分析公司旗下所有投资组合之间是否存在内幕交易行为

4.23 公司风险管理部定期分析公司旗下所有投资组合之间是否存在不公平交易行为

4.24 公司风险管理部定期分析公司旗下所有投资组合之间是否存在利益输送情形

4.25 公司风险管理部定期分析公司旗下所有投资组合之间是否存在不公平交易行为

4.26 公司风险管理部定期分析公司旗下所有投资组合之间是否存在内幕交易行为

4.27 公司风险管理部定期分析公司旗下所有投资组合之间是否存在不公平交易行为

4.28 公司风险管理部定期分析公司旗下所有投资组合之间是否存在利益输送情形

4.29 公司风险管理部定期分析公司旗下所有投资组合之间是否存在不公平交易行为

4.30 公司风险管理部定期分析公司旗下所有投资组合之间是否存在内幕交易行为

4.31 公司风险管理部定期分析公司旗下所有投资组合之间是否存在不公平交易行为

4.32 公司风险管理部定期分析公司旗下所有投资组合之间是否存在利益输送情形

4.33 公司风险管理部定期分析公司旗下所有投资组合之间是否存在不公平交易行为

4.34 公司风险管理部定期分析公司旗下所有投资组合之间是否存在内幕交易行为

4.35 公司风险管理部定期分析公司旗下所有投资组合之间是否存在不公平交易行为

4.36 公司风险管理部定期分析公司旗下所有投资组合之间是否存在利益输送情形

4.37 公司风险管理部定期分析公司旗下所有投资组合之间是否存在不公平交易行为

4.38 公司风险管理部定期分析公司旗下所有投资组合之间是否存在内幕交易行为

4.39 公司风险管理部定期分析公司旗下所有投资组合之间是否存在不公平交易行为

4.40 公司风险管理部定期分析公司旗下所有投资组合之间是否存在利益输送情形

4.41 公司风险管理部定期分析公司旗下所有投资组合之间是否存在不公平交易行为

4.42 公司风险管理部定期分析公司旗下所有投资组合之间是否存在内幕交易行为

4.43 公司风险管理部定期分析公司旗下所有投资组合之间是否存在不公平交易行为

4.44 公司风险管理部定期分析公司旗下所有投资组合之间是否存在利益输送情形

4.45 公司风险管理部定期分析公司旗下所有投资组合之间是否存在不公平交易行为

4.46 公司风险管理部定期分析公司旗下所有投资组合之间是否存在内幕交易行为

4.47 公司风险管理部定期分析公司旗下所有投资组合之间是否存在不公平交易行为

4.48 公司风险管理部定期分析公司旗下所有投资组合之间是否存在利益输送情形

4.49 公司风险管理部定期分析公司旗下所有投资组合之间是否存在不公平交易行为

4.50 公司风险管理部定期分析公司旗下所有投资组合之间是否存在内幕交易行为

4.51 公司风险管理部定期分析公司旗下所有投资组合之间是否存在不公平交易行为

4.52 公司风险管理部定期分析公司旗下所有投资组合之间是否存在利益输送情形

4.53 公司风险管理部定期分析公司旗下所有投资组合之间是否存在不公平交易行为

4.54 公司风险管理部定期分析公司旗下所有投资组合之间是否存在内幕交易行为

4.55 公司风险管理部定期分析公司旗下所有投资组合之间是否存在不公平交易行为

4.56 公司风险管理部定期分析公司旗下所有投资组合之间是否存在利益输送情形

4.57 公司风险管理部定期分析公司旗下所有投资组合之间是否存在不公平交易行为

4.58 公司风险管理部定期分析公司旗下所有投资组合之间是否存在内幕交易行为

4.59 公司风险管理部定期分析公司旗下所有投资组合之间是否存在不公平交易行为

4.60 公司风险管理部定期分析公司旗下所有投资组合之间是否存在利益输送情形

4.61 公司风险管理部定期分析公司旗下所有投资组合之间是否存在不公平交易行为

4.62 公司风险管理部定期分析公司旗下所有投资组合之间是否存在内幕交易行为

4.63 公司风险管理部定期分析公司旗下所有投资组合之间是否存在不公平交易行为

4.64 公司风险管理部定期分析公司旗下所有投资组合之间是否存在利益输送情形

4.65 公司风险管理部定期分析公司旗下所有投资组合之间是否存在不公平交易行为

4.66 公司风险管理部定期分析公司旗下所有投资组合之间是否存在内幕交易行为

4.67 公司风险管理部定期分析公司旗下所有投资组合之间是否存在不公平交易行为

4.68 公司风险管理部定期分析公司旗下所有投资组合之间是否存在利益输送情形

4.69 公司风险管理部定期分析公司旗下所有投资组合之间是否存在不公平交易行为

4.70 公司风险管理部定期分析公司旗下所有投资组合之间是否存在内幕交易行为

4.71 公司风险管理部定期分析公司旗下所有投资组合之间是否存在不公平交易行为

4.72 公司风险管理部定期分析公司旗下所有投资组合之间是否存在利益输送情形

4.73 公司风险管理部定期分析公司旗下所有投资组合之间是否存在不公平交易行为

4.74 公司风险管理部定期分析公司旗下所有投资组合之间是否存在内幕交易行为

4.75 公司风险管理部定期分析公司旗下所有投资组合之间是否存在不公平交易行为

4.76 公司风险管理部定期分析公司旗下所有投资组合之间是否存在利益输送情形

4.77 公司风险管理部定期分析公司旗下所有投资组合之间是否存在不公平交易行为

4.78 公司风险管理部定期分析公司旗下所有投资组合之间是否存在内幕交易行为

4.79 公司风险管理部定期分析公司旗下所有投资组合之间是否存在不公平交易行为

4.80 公司风险管理部定期分析公司旗下所有投资组合之间是否存在利益输送情形

4.81 公司风险管理部定期分析公司旗下所有投资组合之间是否存在不公平交易行为

4.82 公司风险管理部定期分析公司旗下所有投资组合之间是否存在内幕交易行为

4.83 公司风险管理部定期分析公司旗下所有投资组合之间是否存在不公平交易行为

4.84 公司风险管理部定期分析公司旗下所有投资组合之间是否存在利益输送情形

4.85 公司风险管理部定期分析公司旗下所有投资组合之间是否存在不公平交易行为

4.86 公司风险管理部定期分析公司旗下所有投资组合之间是否存在内幕交易行为

4.87 公司风险管理部定期分析公司旗下所有投资组合之间是否存在不公平交易行为

4.88 公司风险管理部定期分析公司旗下所有投资组合之间是否存在利益输送情形

4.89 公司风险管理部定期分析公司旗下所有投资组合之间是否存在不公平交易行为

4.90 公司风险管理部定期分析公司旗下所有投资组合之间是否存在内幕交易行为

4.91 公司风险管理部定期分析公司旗下所有投资组合之间是否存在不公平交易行为

4.92 公司风险管理部定期分析公司旗下所有投资组合之间是否存在利益输送情形

4.93 公司风险管理部定期分析公司旗下所有投资组合之间是否存在不公平交易行为

4.94 公司风险管理部定期分析公司旗下所有投资组合之间是否存在内幕交易行为

4.95 公司风险管理部定期分析公司旗下所有投资组合之间是否存在不公平交易行为

4.96 公司风险管理部定期分析公司旗下所有投资组合之间是否存在利益输送情形

4.97 公司风险管理部定期分析公司旗下所有投资组合之间是否存在不公平交易行为

4.98 公司风险管理部定期分析公司旗下所有投资组合之间是否存在内幕交易行为

4.99 公司风险管理部定期分析公司旗下所有投资组合之间是否存在不公平交易行为

4.100 公司风险管理部定期分析公司旗下所有投资组合之间是否存在利益输送情形

4.101 公司风险管理部定期分析公司旗下所有投资组合之间是否存在不公平交易行为

4.102 公司风险管理部定期分析公司旗下所有投资组合之间是否存在内幕交易行为