大成现金宝场内实时申赎货币市场基金

2014 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:2015年3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2015年3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。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,请投资者注意阅读。

本报告期自2014年01月01日起至12月31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	263,900,708,083.00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	190,622,662,689.00份	73,278,045,394.00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	林葛
	联系电话	0755-83183388	010-66060069
	电子邮箱	dupeng@dcfund.com.cn	tgxxpl@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	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、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 期间数据和指标	2014年		2013年3月27日(基金合同生效日)-2013年12月31日	
	现金宝A	现金宝B	现金宝A	现金宝B
本期已实现收益	62,970,564.61	55,384,063.06	16,891,337.67	17,945,110.92
本期利润	62,970,564.61	55,384,063.06	16,891,337.67	17,945,110.92
本期净值收益率	4.2037%	4.8243%	2.6362%	3.1003%
3.1.2 期末数据和指标	2014年末		2013年末	
期末基金资产净值	1,906,226,626.89	732,780,453.94	1,042,804,599.04	1,591,550,588.66
期末基金份额净值	0.01	0.01	0.01	0.01

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,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 基金份额净值收益率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

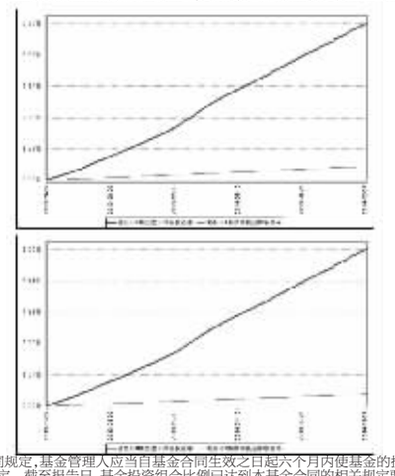
现金宝A

3.1.1 期间数据和指标	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
过去三个月	0.9692%	0.0087%	0.0882%	0.0000%	0.8810%	0.0087%
过去六个月	1.9781%	0.0071%	0.1764%	0.0000%	1.8017%	0.0071%
过去一年	4.2037%	0.0058%	0.3500%	0.0000%	3.8537%	0.0058%
自基金合同生效起至今	6.9507%	0.0047%	0.6185%	0.0000%	6.3322%	0.0047%

现金宝B

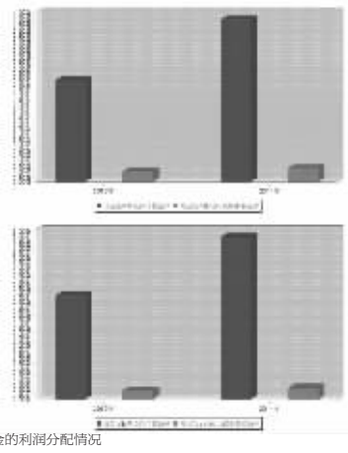
阶段	份额净值收益率①	份额净值收益率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	1.1219%	0.0087%	0.0882%	0.0000%	1.0337%	0.0087%
过去六个月	2.2863%	0.0072%	0.1764%	0.0000%	2.1099%	0.0072%
过去一年	4.8243%	0.0058%	0.3500%	0.0000%	4.4743%	0.0058%
自基金合同生效起至今	8.0741%	0.0047%	0.6185%	0.0000%	7.4556%	0.0047%

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: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。截至报告日,基金投资组合比例已达到本基金合同的相关规定要求。

3.2.3 自基金合同生效以来基金每年净值收益率及其与同期业绩比较基准收益率的比较



3.3 过去三年基金的利润分配情况

单位:人民币元

现金宝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
2014	62,946,474.63	-	24,089.98	62,970,564.61	
2013	16,774,194.85	-	117,142.82	16,891,337.67	
合计	79,720,669.48	-	141,232.80	79,861,902.28	

单位:人民币元

现金宝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	应付利润本年变动	年度利润分配合计	备注
2014	55,522,831.37	-	-138,768.31	55,384,063.06	
2013	17,743,465.75	-	201,645.17	17,945,110.92	
合计	73,266,297.12	-	62,876.86	73,329,173.98	

§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12月31日,本基金管理人共管理4只ETF及1只ETF联接基金:大成中证100交易型开放式指数证券投资基金、深证成长40交易型开放式指数证券投资基金及大成深证成长40交易型开放式指数证券投资基金联接基金、中证500深市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,2只QDII基金:大成标普500等权重指数证券投资基金、大成纳斯达克100指数证券投资基金及40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、大成景恒保本混合型证券投资基金、大成内需增长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、大成消费主题股票型证券投资基金、大成新锐产业股票型证券投资基金、大成优选股票型证券投资基金(LOF)、大成月添利理财债券型证券投资基金、大成现金增利货币市场证券投资基金、大成月月盈短期理财债券型证券投资基金、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、大成健康产业股票型证券投资基金、大成中小盘股票型证券投资基金(LOF)、大成灵活配置混合型证券投资基金、大成丰财宝货币市场基金、大成景益平稳收益混合型证券投资基金、大成添利宝货币市场基金、大成景利混合型证券投资基金和大成产业升级股票型证券投资基金(LOF)。

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		
屈伟南先生	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日至2014年9月11日任大成理财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日起任大成丰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。2014年9月12日起任大成月月盈短期理财债券型证券投资基金基金经理。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10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29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日起任大成丰财宝货币市场基金(原大成招财宝货币市场基金)基金经理助理。2014年6月26日起任大成景益平稳收益混合型证券投资基金基金经理助理。2014年12月24日起,任大成货币市场证券投资基金基金经理及大成丰财宝货币市场基金基金经理。2015年3月21日起担任大成添利宝货币市场基金及大成景兴信用债债券型证券投资基金基金经理。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《证券从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,本基金的投资范围、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 公平交易制度和控制方法

根据《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》的规定,基金管理人制订了《大成基金管理有限公司公平交易制度》及《大成基金管理有限公司异常交易监控与报告制度》。基金管理人旗下投资组合严格按照制度的规定,参与股票、债券的一级市场申购、二级市场交易等投资管理活动,内容包括授权、研究分析、投资决策、交易执行、业绩评估等与投资管理活动相关的各个环节。研究部负责提供投资研究支持,投资部门负责投资决策,交易管理部负责实施交易并实时监控,监察稽核部负责事前监督、事中检查和事后稽核,风险管理部负责对交易情况进行合理性分析,通过多部门的协作互控,保证了公平交易的可操作、可稽核和可持续。

4.3.2 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。

基金管理人运用统计分析方法和工具,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进行分析。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,但结合交易价差专项统计分析,未发现违反公平交易原则的异常情况。

4.3.3 异常交易行为的专项说明

报告期内,基金管理人旗下所有投资组合未发现存在异常交易行为。主动投资组合间股票交易存在23笔同日反向交易,原因为投资策略需要。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5笔,原因为投资策略需要;主动投资组合间债券交易存在2笔同日反向交易,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。

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,全球主要经济体经济表现和宏观政策分化明显,国际金融市场和大宗商品价格波动较大,新兴市场经济体增长普遍放缓。2014年,我国经济受房地产投资增速下滑等因素影响,固定资产投资增速放缓,GDP增速逐季下滑,比上年增长7.4%。分季度看,四个季度同比分别增长7.4%、7.5%、7.3%和7.3%,环比亦呈现逐季下滑态势。受全球需求下滑影响,PPI全年同比下跌4.3%。通胀呈前高后低走势,CPI全年同比仅上涨1.99%。2014年发达经济体货币政策出现较大分化,美元走强,对国内流动性和货币政策产生较大影响。在外汇占款投放基础货币出现阶段性放缓的情况下,央行增强了主动提供基础货币的能力,综合运用公开市场操作、短期流动性调节工具、常备借贷便利等多种货币政策工具,保持流动性合理充裕。同时主要通过再贷款、定向降准、SLF等定向宽松的方式降低社会融资成本。

市场表现方面,2014年全年中债综合指数上涨10.34%,为2002年以来的第二大牛市。类属资产中,金融债指数上涨11.86%,10年期金融债全年回报接近20%。中债短融指数上涨5.99%。

本年度,组合规模较上年度有所稳步增长,因此在组合操作上加大了短融的配置力度,一季度短融仓位较低,自二季度起,短融仓位保持在30%以上。存款则以1月以内为主,以应对组合流动性。

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4.2037%,B类净值收益率4.8243%,期间业绩比较基准收益率为0.3500%。

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2015年,受主要经济体经济运行和宏观政策分化影响,全球金融市场的波动性可能进一步加大。国内来看,在经济增长低迷、通缩风险加剧的宏观背景下,货币政策仍将继续宽松,预计央行将会继续通过降息、降准等方式降低社会融资成本,对债券市场较为有利。

基于上述分析,2015年度,将适当提高组合剩余期限。在类属配置方面,在充分做好流动性管理的前提下,适当保持短融的配置比例。力争在保持组合流动性的前提下,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,对本基金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。截止报告期末本基金管理人已与中央国债登记结算有限责任公司签署服务协议,由其按约定提供在银行间同业市场交易的债券品种的估值数据。

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118,354,627.67元,报告期内已分配利润118,354,627.67元。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

无。

§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

在托管本基金的过程中,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基金合同、托管协议的约定,对本基金基金管理人—大成基金管理有限公司 2014年1月1日至2014年12月31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本基金的投资运作、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本基金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 审计报告

本基金2014年年度财务会计报告已经安永华明会计师事务所(特殊普通合伙)审计,注册会计师签字出具了标准无保留意见的审计报告。投资者欲了解本基金审计报告详细内容,应阅读年度报告正文。

§7 年度财务报表

7.1 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12月31日

单位:人民币元

资 产	本期末 2014年12月31日	上年度末 2013年12月31日
资 产:		
银行存款	554,337,830.29	1,258,207,782.51
结算备付金	99,840,931.50	11,249,845.15
存出保证金	12,559,390.52	-
交易性金融资产	1,561,199,141.36	389,983,400.46
其中:股票投资	-	-
基金投资	-	-
债券投资	1,561,199,141.36	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	550,000,000.00	898,100,462.15
应收证券清算款	-	-
应收利息	32,401,042.09	11,884,305.63
应收股利	-	-
应收申购款	642,779,758.63	512,261,965.60
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	10,267.62
资产总计	3,453,118,094.39	3,081,698,029.12
负债和所有者权益	本期末 2014年12月31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	188,999,516.50	146,804,486.60
应付证券清算款	550,000,000.00	270,000,000.00
应付赎回款	72,779,818.32	29,452,992.13
应付管理人报酬	623,048.62	261,338.15
应付托管费	184,607.02	77,433.53
应付销售服务费	364,253.19	142,065.41
应付交易费用	39,975.17	18,047.69
应交税费	-	-
应付利息	25,890.41	12,762.30
应付利润	204,109.66	318,787.99
递延所得税负债	-	-
其他负债	889,794.67	254,927.62
负债合计	814,111,013.56	447,342,841.42
所有者权益:		
实收基金	2,639,007,080.83	2,634,355,187.70
未分配利润	-	-
所有者权益合计	2,639,007,080.83	2,634,355,187.70
负债和所有者权益总计	3,453,118,094.39	3,081,698,029.12

注:(1)报告截止日2014年12月31日,A级基金份额净值人民币0.0100元,基金份额总额190,622,662,689.00份;B级基金份额净值人民币0.0100元,基金份额总额73,278,045,394.00份。基金份额总额263,900,708,083.00份。

(2)本基金合同生效日为2013年3月27日,本财务报表比较期间的实际编制期间为2013年3月27日至2013年12月31日。

7.2 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12月31日

单位:人民币元

项 目	本期 2014年1月1日至2014年12月31日	上年度可比期间 2013年3月27日(基金合同生效日)至2013年12月31日
一、收入	149,098,834.47	42,682,022.86
1.利息收入	140,833,960.44	43,388,109.87
其中:存款利息收入	68,186,532.49	30,055,787.99
债券利息收入	57,952,339.56	10,543,135.93
资产支持证券利息收入	-	-
买入返售金融资产收入	14,695,088.39	2,789,185.95
其他利息收入	-	-
2.投资收益(损失以"-"填列)	8,264,874.03	-706,087.01
其中:股票投资收益	-	-
基金投资收益	-	-
债券投资收益	8,264,874.03	-706,087.01
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	30,744,206.80	7,845,574.27
1.管理人报酬	7,719,984.98	2,573,983.33
2.托管费	2,287,402.94	762,661.85
3.销售服务费	4,231,225.00	1,258,339.72
4.交易费用	170.95	-
5.利息支出	10,220,641.12	1,269,365.71
其中:卖出回购金融资产支出	10,220,641.12	1,269,365.71
6.其他费用	6,284,781.81	1,981,223.66
三、利润总额(亏损总额以"-"号填列)	118,354,627.67	34,836,448.59
减:所得税费用	-	-
四、净利润(净亏损以"-"号填列)	118,354,627.67	34,836,448.59

7.3 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12月31日

单位:人民币元

项目	本期 2014年1月1日至2014年12月31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)	-	118,354,627.67	118,354,627.67
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)	4,651,893.13	-	4,651,893.13
其中:1.基金申购款	103,097,188,915.88	-	103,097,188,915.88
2.基金赎回款	-103,092,537,022.75	-	-103,092,537,022.75
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)	-	-118,354,627.67	-118,354,627.67
五、期末所有者权益(基金净值)	2,639,007,080.83	-	2,639,007,080.83
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12月31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)	-	34,836,448.59	34,836,448.59
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)	1,414,630,799.70	-	1,414,630,799.70
其中:1.基金申购款	33,055,980,881.22	-	33,055,980,881.22
2.基金赎回款	-31,641,350,081.52	-	-31,641,350,081.52
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)	-	-34,836,448.59	-34,836,448.59
五、期末所有者权益(基金净值)	2,634,355,187.70	-	2,634,355,187.70

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告7.1至7.4财务报表由下列负责人签署:

罗登攀 肖剑 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

7.4 报表附注

7.4.1 本报告期所采用的会计政策、会计估计、税项与最近一期年度报告相一致的说明

财政部于2014年颁布《企业会计准则第39号——公允价值计量》、《企业会计准则第40号——合营安排》、《企业会计准则第41号——在其他主体中权益的披露》和修订后的《企业会计准则第2号——长期股权投资》、《企业会计准则第9号——职工薪酬》、《企业会计准则第30号——财务报表列报》、《企业会计准则第33号——合并财务报表》以及《企业会计准则第37号——金融工具列报》,要求除《企业会计准则第37号——金融工具列报》自2014年度财务报表起施行外,其他准则自2014年7月1日起施行。上述准则对本基金本报告期无重大影响。

除上述会计政策变更事项,本报告期所采用的其他会计政策、会计估计、税项与最近一期年度报告相一致。

7.4.2 关联方关系

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,基金销售机构
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")	基金管理人的合营企业

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。

7.4.3 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.3.1 通过关联方交易单元进行的交易

本基金本期及上年度可比期间均未发生通过关联方交易单元进行的交易。

7.4.3.2 关联方报酬

7.4.3.2.1 基金管理费

单位:人民币元

项目	本期 2014年1月1日至2014年12月31日	上年度可比期间 2013年3月27日(基金合同生效日)至2013年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	7,719,984.98	2,573,983.33
其中:支付销售机构的客户维护费	2,694,704.71	884,430.37

注:基金管理费每日计提,按月支付。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

7.4.3.2.2 基金托管费

单位:人民币元

项目	本期 2014年1月1日至2014年12月31日	上年度可比期间 2013年3月27日(基金合同生效日)至2013年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	2,287,402.94	762,661.85

注:基金托管费每日计提,按月支付。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

7.4.3.2.3 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12月31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	151,417.83	1,677.55	153,095.38
合计	151,417.83	1,677.55	153,095.38
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12月31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	70,849.82	877.88	71,727.70
合计	70,849.82	877.88	71,727.70

注:(1)基金销售服务费每日计算,按月支付。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

(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人民币211,985.20元。

7.4.3.3 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

本期 2014年1月1日至2014年12月31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	-	-	-	-	857,020,000.00	73,827.90
上年度可比期间 2013年3月27日(基金合同生效日)至2013年12月31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	-	-	-	-	-	-

7.4.3.4 各关联方投资本基金的情况7.4.3.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

本基金的管理人于本报告期及上年度可比期间未运用固有资金投资本基金。

7.4.3.4.2 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

本基金除基金管理人之外的其他关联方于本报告期及上年度可比期间未持有本基金份额。

7.4.3.5 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12月31日		上年度可比期间 2013年3月27日(基金合同生效日)至2013年12月31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	4,337,830.29	708,106.93	29,207,782.51	625,834.73

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及相关协议利率计息。

7.4.3.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金于本报告期及上年度可比期间未在承销期内参与关联方承销证券。

7.4.3.7 其他关联交易事项的说明

本基金本期及上年度可比期间无其他关联交易事项。

7.4.4 期末(2014年12月31日)本基金持有的流通受限证券

7.4.4.4 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

本基金于本报告期末未持有因认购新发/增发证券而于年末流通受限证券。

7.4.4.5 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。

7.4.4.6 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.4.6.1 银行间市场债券正回购

截止本报告期末,本基金从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额188,999,516.50元,是以如下债券作为质押:

金额单位:人民币元

债券代码	债券名称	回购到期日	期末估值单价	数量(张)	期末估值总额
041464036	14张资产CP001	2015年1月6日	100.00	500,000	50,001,981.94
041455033	14汉城投CP002	2015年1月6日	100.62	700,000	70,431,809.09
011420005	14中铝SCP005	2015年1月6日	100.02	800,