大成现金增利货币市场基金

【2016】第一季度报告

基金管理人:大成基金管理有限公司
基金托管人:中国农业银行股份有限公司
报告送出日期:2016年4月22日

§1 重要提示

基金管理人的董事会及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责任。

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2016年4月20日复核了本报告中的财务指标、净值表现和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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2016年1月1日起至3月31日止。

§2 基金产品概况

基金简称	大成现金增利货币
交易代码	090022
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2012年11月20日
报告期末基金份额总额	4,761,105,463.27份
投资目标	在保持资产的低风险和高流动性的前提下,争取获得超过基金业绩比较基准的收益率。
投资策略	本基金投资管理将充分运用收益率策略与估值策略相结合的方法,对各类可投资资产进行合理的配置和选择。投资策略首先审慎考虑各类资产的收益性、流动性及风险性特征,在风险与收益的配比中,力求将各类风险降到最低,并在控制投资组合良好流动性的基础上为投资者获取稳定的收益。
业绩比较基准	银行活期存款利率
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。
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
下属分级基金的基金简称	大成现金增利货币A / 大成现金增利货币B
下属分级基金的交易代码	090022 / 091022
报告期末下属分级基金的份额总额	4,623,180,223.36份 / 137,925,240.01份

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位:人民币元

主要财务指标	报告期(2016年1月1日 - 2016年3月31日)	
	大成现金增利货币A	大成现金增利货币B
1. 本期已实现收益	30,316,783.32	1,195,435.40
2. 本期利润	30,316,783.32	1,195,435.40
3. 期末基金资产净值	4,623,180,223.36	137,925,240.01

注: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 本报告期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

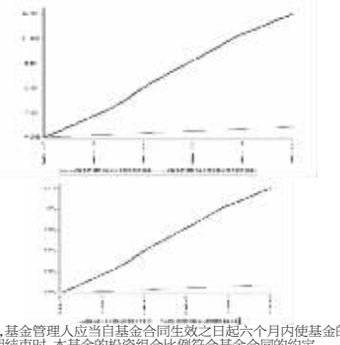
大成现金增利货币A

阶段	净值收益率①	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	0.6762%	0.0036%	0.0870%	0.0000%	0.5892%	0.0036%

大成现金增利货币B

阶段	净值收益率①	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	0.7363%	0.0036%	0.0870%	0.0000%	0.6493%	0.0036%

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:本基金合同规定,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约定。建仓期结束时,本基金的投资组合比例符合基金合同的约定。

§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
		任职日期	离任日期		
李达夫先生	本基金基金经理	2013年3月7日	-	9年	数量经济学硕士。2006年7月至2008年4月就职于东莞农商银行资金营运中心,历任交易员、研发员。2008年4月至2012年9月就职于国投瑞银基金管理有限公司固定收益部,2011年6月30日至2012年9月15日担任国投瑞银货币市场基金基金经理。2012年9月加入大成基金管理有限公司。2013年3月7日至2014年4月4日任大成货币市场证券投资基金基金经理。2013年3月7日起任大成现金增利货币市场基金基金经理。2013年7月17日起兼任大成景安短融债券型证券投资基金基金经理。2014年9月3日起任大成信用增利一年定期开放债券型证券投资基金基金经理。2015年8月4日起任大成恒丰宝货币市场基金基金经理。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》、《大成现金增利货币基金基金合同》和其他有关法律法规的规定,在基金管理运作中,大成现金增利货币基金的投资范围、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,努力为基金分额持有人谋求最大利益。

4.3 公平交易专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

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,公司制订了《大成基金管理有限公司公平交易制度》、《大成基金管理有限公司异常交易监控与报告制度》。公司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 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。2016年1季度公司旗下主动投资组合间股票交易存在9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,但不存在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%的交易情形;投资组合间债券交易存在2笔同日反向交易;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 报告期内基金投资策略和运作分析

2016年一季度,经济数据表现较为分化。工业生产继续回落,去产能调整结构持续进行,进出口大幅下滑,消费小幅回落但仍然保持稳定。1、2月新增信贷达到3.2万亿,2月份新增信贷比1月份回落,短期内政府托底经济效果明显,在一系列政策的促进下,投资增速有小幅回升但其持续性有待验证。

一季度资金环境整体保持宽松,月末以及季末受央行MPA政策影响,市场资金面初现较大波动。短端隔夜均值较上季度上行26bp至2.1%,7天均值略有下行至2.34%。1年期金融债收益率较与上季度基本持平,1年期AAA短融下行12bp,AA+下行约25bp,AA下行59bp。1个月、3个月shibor利率均值较上个季度小幅下行20bp和27bp。

一季度本基金在投资管理过程中继续贯彻稳健操作的原则,高度重视组合的流动性管理和安全性管理。在对基金份额持有人结构分析、未来投资期内持有人申购赎回带来的基金流动性变化预测以及货币市场利率判断的基础上,灵活管理组合现金流的到期分布。在实际操作中,一季度维持高比例短融投资比例,提高杠杆,增加了短期融资券配置力度以提高组合静态收益。

4.5 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0.6762%,B类净值收益率0.7363%,期间业绩比较基准收益率为0.0870%。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

无。

§5 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	固定收益投资	2,638,247,087.22	53.97
	其中:债券	2,638,247,087.22	53.97
	资产支持证券	-	0.00
2	买入返售金融资产	607,466,090.00	12.43
	其中:买断式回购的买入返售金融资产	-	0.00
3	银行存款和结算备付金合计	1,307,623,494.77	26.75
4	其他资产	334,647,675.24	6.85
5	合计	4,887,984,347.23	100.00

5.2 报告期债券回购融资情况

序号	项目	占基金资产净值的比例(%)	
1	报告期内债券回购融资余额	9.57	
	其中:买断式回购融资	0.00	
序号	项目	金额	占基金资产净值的比例(%)
2	报告期末债券回购融资余额	123,749,738.12	2.60
	其中:买断式回购融资	-	0.00

注:报告期内债券回购融资余额占基金资产净值的比例为报告期内每个交易日融资余额占资产净值比例的简单平均值。

债券正回购的资金余额超过基金资产净值的20%的说明

本报告期内本基金债券正回购的资金余额未超过基金资产净值的20%。

5.3 基金投资组合平均剩余期限

5.3.1 投资组合平均剩余期限基本情况

项目	天数
报告期末投资组合平均剩余期限	77
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	89
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	61

报告期内投资组合平均剩余期限超过180天情况说明

本基金合同约定:"本基金投资组合的平均剩余期限在每个交易日均不得超过90天",本报告期内,本基金未发生超标情况。

5.3.2 报告期末投资组合平均剩余期限分布比例

序号	平均剩余期限	各期限资产占基金资产净值的比例(%)	各期限负债占基金资产净值的比例(%)
1	30天以内	51.15	2.60
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	0.00	0.00
2	30天(含)-60天	6.73	0.00
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	0.00	0.00
3	60天(含)-90天	4.62	0.00
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	0.00	0.00
4	90天(含)-180天	20.49	0.00
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	0.00	0.00
5	180天(含)-397天(含)	12.64	0.00
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	0.00	0.00
	合计	95.64	2.60

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	摊余成本(元)	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	-	0.00
2	央行票据	-	0.00
3	金融债券	472,103,653.72	9.92
	其中:政策性金融债	472,103,653.72	9.92
4	企业债券	-	0.00
5	企业短期融资券	2,166,143,433.50	45.50
6	中期票据	-	0.00
7	同业存单	-	0.00
-	-	-	0.00
8	其他	-	0.00
9	合计	2,638,247,087.22	55.41
10	剩余存续期超过397天的浮动利率债券	-	0.00

5.5 报告期末按摊余成本占基金资产净值比例大小排序的前十名债券投资明细

序号	债券代码	债券名称	债券数量(张)	摊余成本(元)	占基金资产净值比例(%)
1	011517018	15华电SCP018	1,250,000	125,297,726.92	2.63
2	041564026	15国电集CP002	1,000,000	100,242,770.70	2.11
3	011599543	15陕延油SCP002	1,000,000	100,078,890.36	2.10
4	011513003	15招商局SCP003	1,000,000	100,058,594.56	2.10
5	011639202	16京汽股SCP001	1,000,000	100,021,891.36	2.10
6	011602001	16铁通SCP001	1,000,000	100,017,841.42	2.10
7	011599816	15首发SCP002	1,000,000	100,004,847.12	2.10
8	1302215	13国开15	1,000,000	99,992,761.89	2.10
9	011599500	15中油股SCP004	800,000	80,073,639.05	1.68
10	1402208	14国开08	500,000	51,365,596.56	1.08

5.6 "影子定价"与"摊余成本法"确定的基金资产净值的偏离

项目	偏离情况
报告期内偏离度的绝对值在0.25%(含)-0.5%间的次数	3
报告期内偏离度的最高值	0.2623%
报告期内偏离度的最低值	0.1459%
报告期内每个工作日偏离度的绝对值的简单平均值	0.1969%

5.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

5.8 投资组合报告附注

5.8.1 本基金估值采用摊余成本法估值,即估值对象以买入成本列示,按票面利率或协议利率并考虑其买入时的溢价与折价,在其剩余存续期内按照实际利率法每日计提损益。本基金通过每日计算基金收益并分配的方式,使基金份额净值保持在人民币1.00 元。

5.8.2 本报告期内不存在基金持有剩余期限小于397天但剩余存续期超过397天的浮动利率债券的摊余成本超过当日基金资产净值的20%的情况。

5.8.3 本基金投资的前十名证券的发行主体未出现本期被监管部门立案调查,或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

5.8.4 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	-
2	应收证券清算款	-
3	应收利息	46,043,088.71
4	应收申购款	288,604,586.53
5	其他应收款	-
6	待摊费用	-
7	其他	-
8	合计	334,647,675.24

5.8.5 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入原因,分项之和与合计可能有尾差。

§6 开放式基金份额变动

单位:份

项目	大成现金增利货币A	大成现金增利货币B
报告期期初基金份额总额	4,872,223,871.13	222,610,566.10
报告期期间基金总申购份额	7,448,130,680.92	234,040,732.82
报告期期间基金总赎回份额	7,697,174,328.69	318,726,058.91
报告期期末基金份额总额	4,623,180,223.36	137,925,240.01

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

本报告期基金管理人未运用固有资金投资本基金。

§8 影响投资者决策的其他重要信息

本基金本报告期无影响投资者决策的其他重要信息。

§9 备查文件目录

9.1 备查文件目录

1、中国证监会批准设立大成现金增利货币市场基金的文件;

2、《大成现金增利货币市场基金基金合同》;

3、《大成现金增利货币市场基金托管协议》;

4、大成基金管理有限公司批准文件、营业执照、公司章程;

5、本报告期内在指定报刊上披露的各种公告原稿。

9.2 存放地点

本报告存放在本基金管理人和托管人的办公住所。

9.3 查阅方式

投资者可在营业时间免费查阅,或登录本基金管理人网站http://www.dcfund.com.cn进行查阅。

大成基金管理有限公司
2016年4月22日

大成现金宝场内实时申赎货币市场基金

【2016】第一季度报告

基金管理人:大成基金管理有限公司
基金托管人:中国农业银行股份有限公司
报告送出日期:2016年4月22日

§1 重要提示

基金管理人的董事会及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责任。

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2016年4月20日复核了本报告中的财务指标、净值表现和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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2016年1月1日起至3月31日止。

§2 基金产品概况

基金简称	大成现金宝货币	
交易代码	519988	
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	183,825,927,804.00份	
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。	
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	
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	97,257,088,041.00份	86,568,839,763.00份

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位:人民币元

主要财务指标	报告期(2016年1月1日 - 2016年3月31日)	
	现金宝A	现金宝B
1. 本期已实现收益	6,749,956.14	7,848,384.16
2. 本期利润	6,749,956.14	7,848,384.16
3. 期末基金资产净值	972,570,880.41	865,688,397.63

注: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 本报告期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

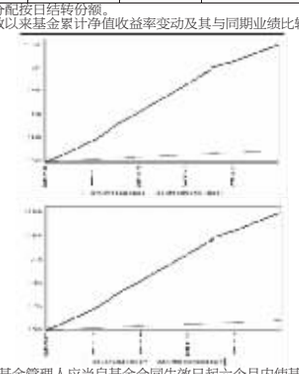
阶段	净值收益率①	净值收益率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	0.5928%	0.0051%	0.0870%	0.0000%	0.5058%	0.0051%

现金宝B

阶段	净值收益率①	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	0.7410%	0.0051%	0.0870%	0.0000%	0.6540%	0.0051%

注:本货币基金收益分配按日结转份额。

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:本基金合同规定,基金管理人应当自基金合同生效日起六个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的约定。建仓期结束时,本基金的投资组合比例符合基金合同的约定。

§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
		任职日期	离任日期		
张文平先生	本基金基金经理	2015年7月1日	-	5年	南京大学管理学硕士,2009年10月至2011年5月就职于毕马威企业咨询有限公司南京分公司审计部;2011年起加入大成基金管理有限公司,历任固定收益策略研究员。2013年11月25日至2015年3月5日担任大成景祥分级债券型证券投资基金基金经理助理。2015年3月7日起担任大成景祥分级债券型证券投资基金基金经理。2015年6月23日起任大成景裕灵活配置混合型证券投资基金基金经理。2015年7月1日起任大成现金宝场内实时申赎货币市场基金基金经理及大成月月盈短期理财债券型证券投资基金基金经理。2015年11月24日起任大成景沛灵活配置混合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购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购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,努力为基金分额持有人谋求最大利益。

4.3 公平交易专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

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,公司制订了《大成基金管理有限公司公平交易制度》、《大成基金管理有限公司异常交易监控与报告制度》。公司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 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。2016年1季度公司旗下主动投资组合间股票交易存在9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,但不存在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%的交易情形;投资组合间债券交易存在2笔同日反向交易;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 报告期内基金投资策略和运作分析

2016年一季度经济逐渐呈现走稳态势。房地产销售的持续回升开始带动投资企稳,一线房价大幅上涨。基建方面也表现突出,微观层面重卡、挖掘机销售等也强力反弹。在企业补库存的带动下,大宗商品价格大幅上涨。同时,猪肉价格和蔬菜价格也大幅上涨。货币政策方面,在经济复苏和通胀上行的背景下,央行货币政策宽松力度明显减弱,同时出台宏观审慎监管制度,以期控制金融体系系统性风险。市场表现来看,市场走势较为纠结。货币市场利率大部分时间比较宽松,但季度末资金非常紧张。利率债收益率先下后上,全季来看变化不大。在银行理财的配置压力下,信用债收益率大幅下行,信用利差达到历史低位。本组合在做好流动性管理基础上,灵活调整组合比例和结构,在利率较高时适度增加长久期债券和同业存单配置,提高组合静态收益,为持有人创造了一定的持有期回报。

4.5 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0.5928%,B类净值收益率0.7410%,期间业绩比较基准收益率为0.0870%。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

无。

§5 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	固定收益投资	518,844,937.31	24.98
	其中:债券	518,844,937.31	24.98
	资产支持证券	-	0.00
2	买入返售金融资产	475,669,905.00	22.90
	其中:买断式回购的买入返售金融资产	-	0.00
3	银行存款和结算备付金合计	924,674,270.66	44.52
4	其他资产	157,727,724.77	7.59
5	合计	2,076,916,837.74	100.00

5.2 报告期债券回购融资情况

序号	项目	占基金资产净值的比例(%)	
1	报告期内债券回购融资余额	3.02	
	其中:买断式回购融资	0.00	
序号	项目	金额	占基金资产净值的比例(%)
2	报告期末债券回购融资余额	145,349,581.97	7.91
	其中:买断式回购融资	-	0.00

注:报告期内债券回购融资余额占基金资产净值的比例为报告期内每个交易日融资余额占资产净值比例的简单平均值。

债券正回购的资金余额超过基金资产净值的20%的说明

本报告期内无债券正回购的资金余额超过基金资产净值的20%的情况。

5.3 基金投资组合平均剩余期限

5.3.1 投资组合平均剩余期限基本情况

项目	天数
报告期末投资组合平均剩余期限	73
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	73
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	25

报告期内投资组合平均剩余期限超过180天情况说明

注:本基金合同约定:"本基金投资组合的平均剩余期限在每个交易日均不得超过120天",本报告期内,本基金未发生超标情况。

5.3.2 报告期末投资组合平均剩余期限分布比例

序号	平均剩余期限	各期限资产占基金资产净值的比例(%)	各期限负债占基金资产净值的比例(%)
1	30天以内	21.37	7.91
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	0.00	0.00
2	30天(含)-60天	15.51	0.00
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	0.00	0.00
3	60天(含)-90天	53.83	0.00
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	0.00	0.00
4	90天(含)-180天	8.13	0.00
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	0.00	0.00
5	180天(含)-397天(含)	5.98	0.00
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	0.00	0.00
	合计	104.82	7.91

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	摊余成本(元)	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	-	0.00
2	央行票据	-	0.00
3	金融债券	160,039,320.65	8.71
	其中:政策性金融债	160,039,320.65	8.71
4	企业债券	-	0.00
5	企业短期融资券	209,968,102.77	11.42
6	中期票据	-	0.00
7	同业存单	148,837,513.89	8.10
8	其他	-	0.00
9	合计	518,844,937.31	28.22
10	剩余存续期超过397天的浮动利率债券	-	0.00

5.5 报告期末按摊余成本占基金资产净值比例大小排序的前十名债券投资明细

序号	债券代码	债券名称	债券数量(张)	摊余成本(元)	占基金资产净值比例(%)
1	150222	15国开22	600,000	59,977,391.13	3.26
2	150416	15农发16	500,000	50,055,047.13	2.72
3	150215	15国开15	500,000	50,006,882.39	2.72
4	011699154	16中节能SCP001	500,000	49,979,517.82	2.72
5	111511258	15平安CD258	500,000	49,917,163.95	2.72
6	111591909	15宁波银行CD109	500,000	49,574,967.83	2.70
7	111619044	16恒丰银行CD044	500,000	49,345,382.11	2.68
8	041558035	15通泰CP001	400,000	39,998,567.30	2.18
9	041564032	15泰交通CP001	400,000	39,987,855.06	2.18
10	011599693	15陕有色SCP003	400,000	39,994,238.32	2.18

5.6 "影子定价"与"摊余成本法"确定的基金资产净值的偏离

项目	偏离情况
报告期内偏离度的绝对值在0.25%(含)-0.5%间的次数	-
报告期内偏离度的最高值	0.1257%
报告期内偏离度的最低值	0.0662%
报告期内每个工作日偏离度的绝对值的简单平均值	0.0829%

5.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

5.8 投资组合报告附注

5.8.1 本基金估值采用摊余成本法估值,即估值对象以买入成本列示,按票面利率或协议利率并考虑其买入时的溢价与折价,在其剩余存续期内按照实际利率法每日计提损益。本基金通过每日计算基金收益并分配的方式,使基金份额净值保持在人民币1.00元。

5.8.2 本报告期内不存在基金持有剩余期限小于397天但剩余存续期超过397天的浮动利率债券的摊余成本超过当日基金资产净值的20%的情况。

5.8.3 本基金投资的前十名证券的发行主体未出现本期被监管部门立案调查,或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

5.8.4 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	7,623,889.37
2	应收证券清算款	-
3	应收利息	8,556,890.66
4	应收申购款	141,546,944.74
5	其他应收款	-
6	待摊费用	-
7	其他	-
8	合计	157,727,724.77

5.8.5 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入原因,分项之和与合计可能有尾差。

§6 开放式基金份额变动

单位:份

项目	现金宝A	现金宝B
报告期期初基金份额总额	127,926,054,788.00	127,005,075,841.00
报告期期间基金总申购份额	663,806,338,788.00	335,296,285,340.00
报告期期间基金总赎回份额	694,475,305,535.00	375,732,521,418.00
报告期期末基金份额总额	97,257,088,041.00	86,568,839,763.00

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

本报告期基金管理人未运用固有资金投资本基金。

§8 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§9 备查文件目录

9.1 备查文件目录

1、中国证监会批准设立大成现金宝场内实时申赎货币市场基金的文件;

2、《大成现金宝场内实时申赎货币市场基金基金合同》;

3、《大成现金宝场内实时申赎货币市场基金托管协议》;

4、大成基金管理有限公司批准文件、营业执照、公司章程;

5、本报告期内在指定报刊上披露的各种公告原稿。

9.2 存放地点

备查文件存放在本基金管理人和托管人的办公住所。

9.3 查阅方式

投资者可在营业时间免费查阅,或登录本基金管理人网站http://www.dcfund.com.cn进行查阅。

大成基金管理有限公司
2016年4月22日

大成添利宝货币市场基金

【2016】第一季度报告

基金管理人:大成基金管理有限公司
基金托管人:兴业银行股份有限公司
报告送出日期:2016年4月22日

§1 重要提示

基金管理人的董事会及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责任。

基金托管人兴业银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2016年4月20日复核了本报告中的财务指标、净值表现和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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2016年1月1日起至3月31日止。

§2 基金产品概况

基金简称	大成添利宝货币		
交易代码	000724		
基金运作方式	契约型开放式		
基金合同生效日	2014年7月28日		
报告期末基金份额总额	766,700,902.56份		
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	本基金运用利率趋势评估策略、类属配置策略、平均剩余期限配置策略、银行协议存款和大额存单投资策略、流动性管理策略进行投资管理,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。		
基金管理人	大成基金管理有限公司		
基金托管人	兴业银行股份有限公司		
下属分级基金的基金简称	大成添利宝A	大成添利宝B	大成添利宝E
下属分级基金的交易代码	000724	000725	000726
报告期末下属分级基金的份额总额	16,266,233.56份	44,052,129.42份	706,382,539.58份

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位:人民币元

主要财务指标	报告期(2016年1月1日 - 2016年3月31日)		
	大成添利宝A	大成添利宝B	大成添利宝E
1. 本期已实现收益	131,772.66	336,390.36	4,089,179.84
2. 本期利润	131,772.66	336,390.36	4,089,179.84
3. 期末基金资产净值	16,266,233.56	44,052,129.42	706,382,539.58

注: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,由于本基金采用摊余成本法核算,因此,