

大成慧成货币市场基金  
2016 年年度报告摘要  
2016 年 12 月 31 日

基金管理人：大成基金管理有限公司

基金托管人：上海银行股份有限公司

送出日期：2017 年 3 月 25 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。

基金托管人上海银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2017 年 3 月 23 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。普华永道中天会计师事务所（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 2016 年 2 月 3 日（基金合同生效日）起至 12 月 31 日止。

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金简称	大成慧成货币		
基金主代码	002200		
交易代码	002200		
基金运作方式	契约型开放式		
基金合同生效日	2016 年 2 月 3 日		
基金管理人	大成基金管理有限公司		
基金托管人	上海银行股份有限公司		
报告期末基金份额总额	1, 009, 622, 064. 79 份		
基金合同存续期	不定期		
下属分级基金的基金简称:	大成慧成货币 A	大成慧成货币 B	大成慧成货币 E
下属分级基金的交易代码:	002200	002201	002202
报告期末下属分级基金的份额总额	5, 669, 000. 29 份	1, 003, 930, 121. 39 份	22, 943. 11 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	1、利率趋势评估策略通过对宏观经济、宏观政策、市场资金面供求等因素的综合分析,对资金利率变动趋势进行评估,最大限度地优化存款期限、回购和债券品种组合。 2、类属配置策略本基金管理人在评估各品种在流动性、收益率稳定性基础上,结合预先制定的组合平均期限范围确定类属资产配置。 3、组合平均剩余期限配置策略基金根据对未来短期利率走势的研判,结合基金资产流动性的要求动态调整组合久期。当预期短期利率上升时,降低组合久期,以规避资本损失或获得较高的再投资收益;在预期短期利率下降时,提高组合久期,以获得资本利得或锁定较高的利率水平。 4、银行协议存款和大额存单投资策略银行协议存款和大额存单是本基金的主要投资对象。 5、流动性管理策略在日常的投资管理过程中,本基金将会紧密关注申购与赎回资金变化情况、季节性资金流动等影响货币市场基金流动性管理的因素,建立组合流动性监控管理指标,实现对基金资产流动性的实时管理。
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	上海银行股份有限公司
信息披露负责	姓名	罗登攀	闻怡

人	联系电话	0755-83183388	021-68475888
	电子邮箱	office@dcfund.com.cn	wenyi@bankofshanghai.com
客户服务电话		4008885558	95594
传真		0755-83199588	021-68476936

## 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	基金管理人及基金托管人住所

## § 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	2016年2月3日(基金合同生效日)-2016年12月31日		
	大成慧成货币 A	大成慧成货币 B	大成慧成货币 E
本期已实现收益	748,043.77	76,161,562.84	615.04
本期利润	748,043.77	76,161,562.84	615.04
本期净值收益率	2.1977%	2.4229%	0.8417%
3.1.2 期末数据和指标	2016年末		
期末基金资产净值	5,669,000.29	1,003,930,121.39	22,943.11
期末基金份额净值	1.0000	1.0000	1.0000

注：1、本基金合同生效日为 2016 年 2 月 3 日，本报告期自 2016 年 2 月 3 日起至 2016 年 12 月 31 日止。

2、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。

3、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

大成慧成货币 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
过去三个月	0.6861%	0.0015%	0.0880%	0.0000%	0.5981%	0.0015%
过去六个月	1.3339%	0.0011%	0.1760%	0.0000%	1.1579%	0.0011%
自基金合同	2.1977%	0.0015%	0.3184%	0.0000%	1.8793%	0.0015%

生效起至今						
-------	--	--	--	--	--	--

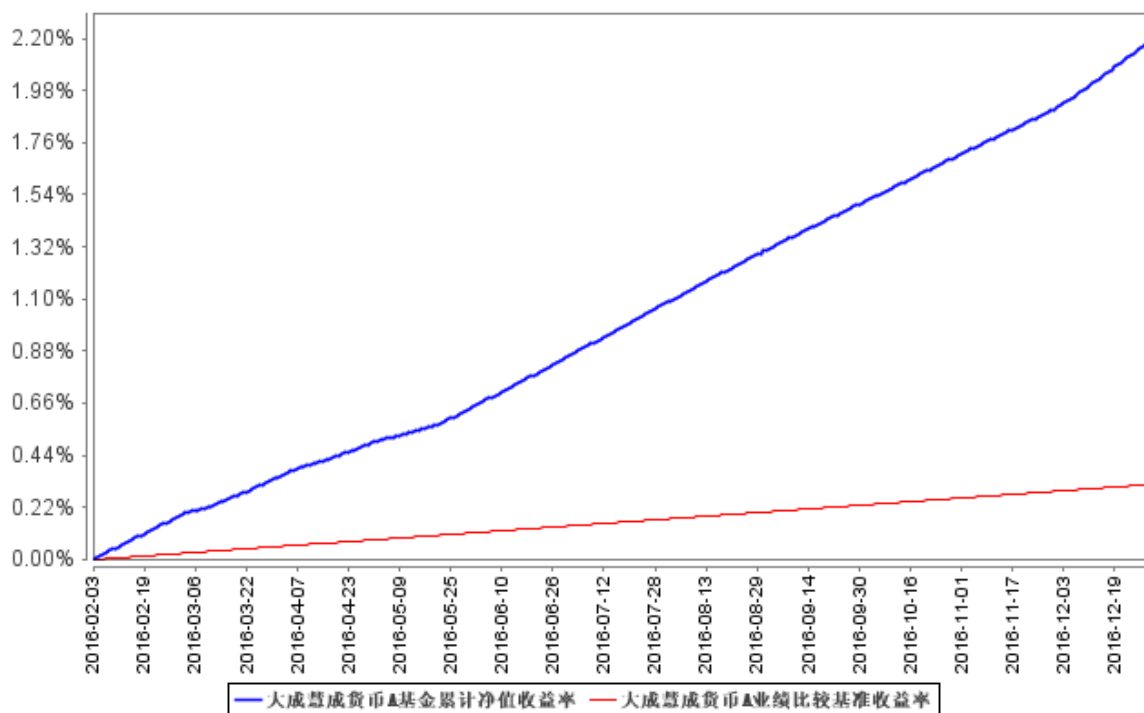
大成慧成货币 B

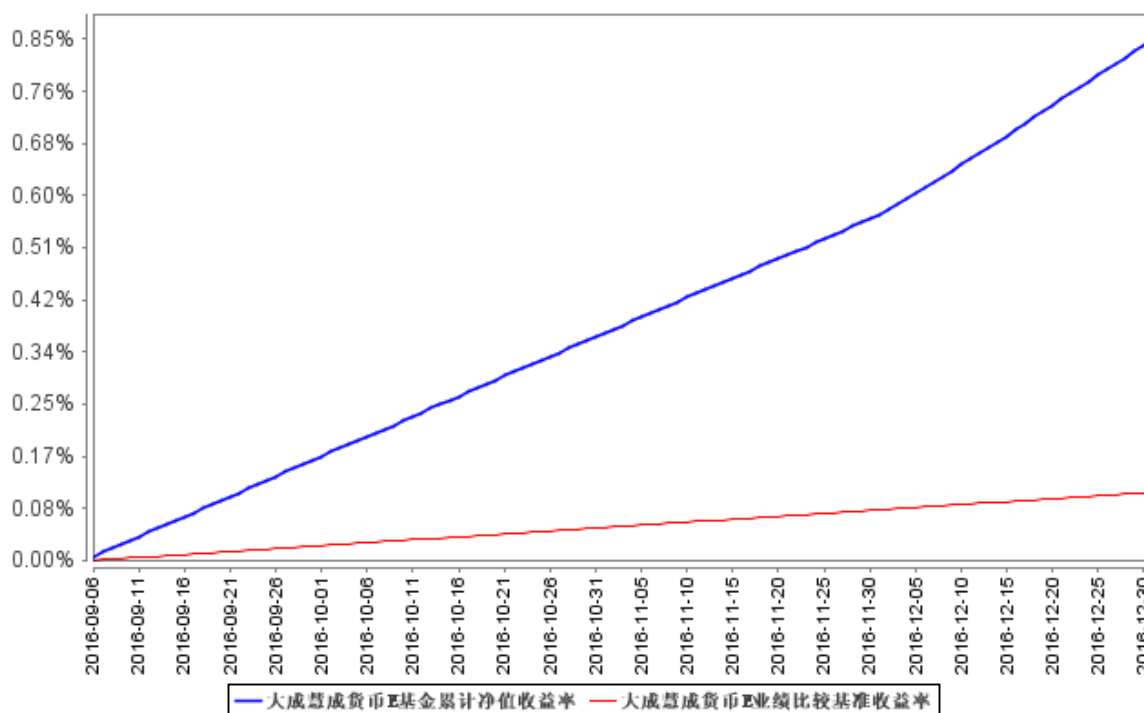
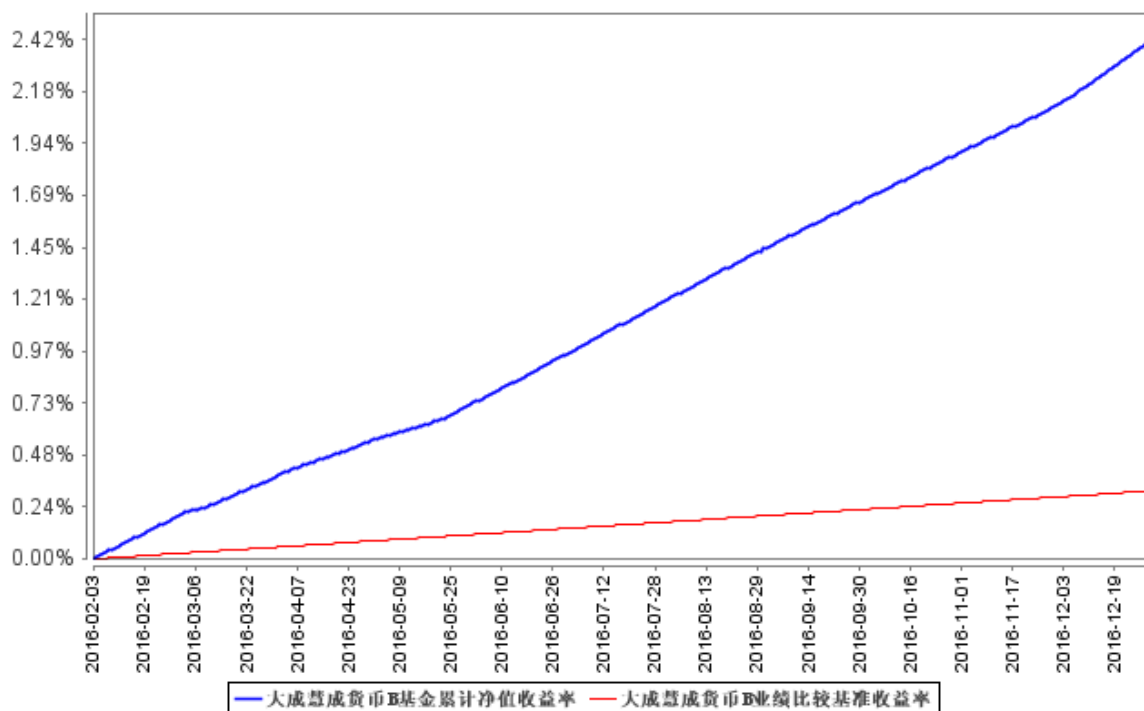
阶段	份额净值 收益率①	份额净值 收益率标 准差②	业绩比较 基准收益 率③	业绩比较基 准收益率标 准差④	①—③	②—④
过去三个月	0.7468%	0.0015%	0.0880%	0.0000%	0.6588%	0.0015%
过去六个月	1.4566%	0.0011%	0.1760%	0.0000%	1.2806%	0.0011%
自基金合同 生效起至今	2.4229%	0.0015%	0.3184%	0.0000%	2.1045%	0.0015%

大成慧成货币 E

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	0.6834%	0.0015%	0.0880%	0.0000%	0.5954%	0.0015%
自基金合同 生效起至今	0.8490%	0.0013%	0.1119%	0.0000%	0.7371%	0.0013%

### 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

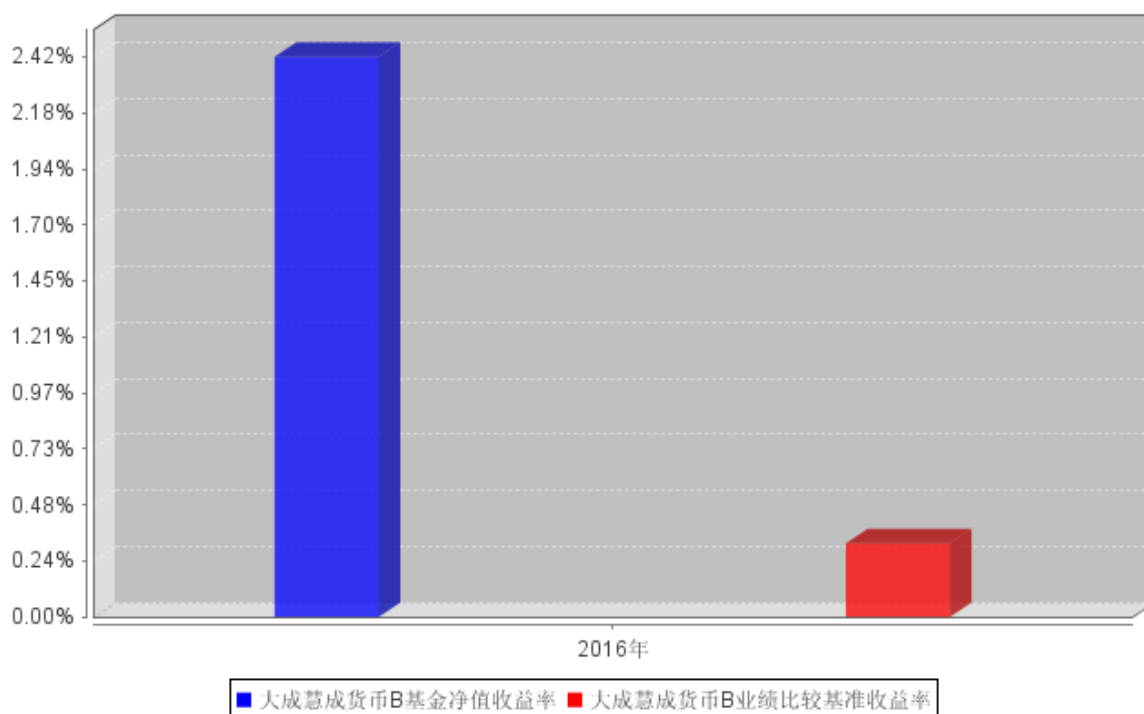
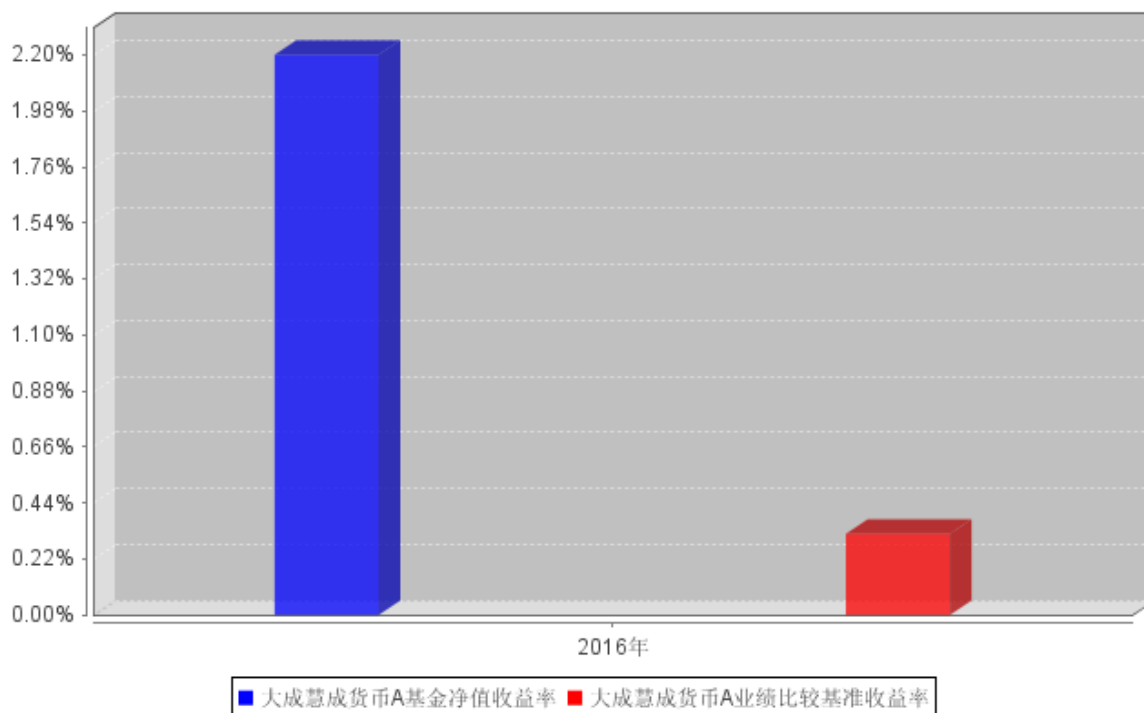


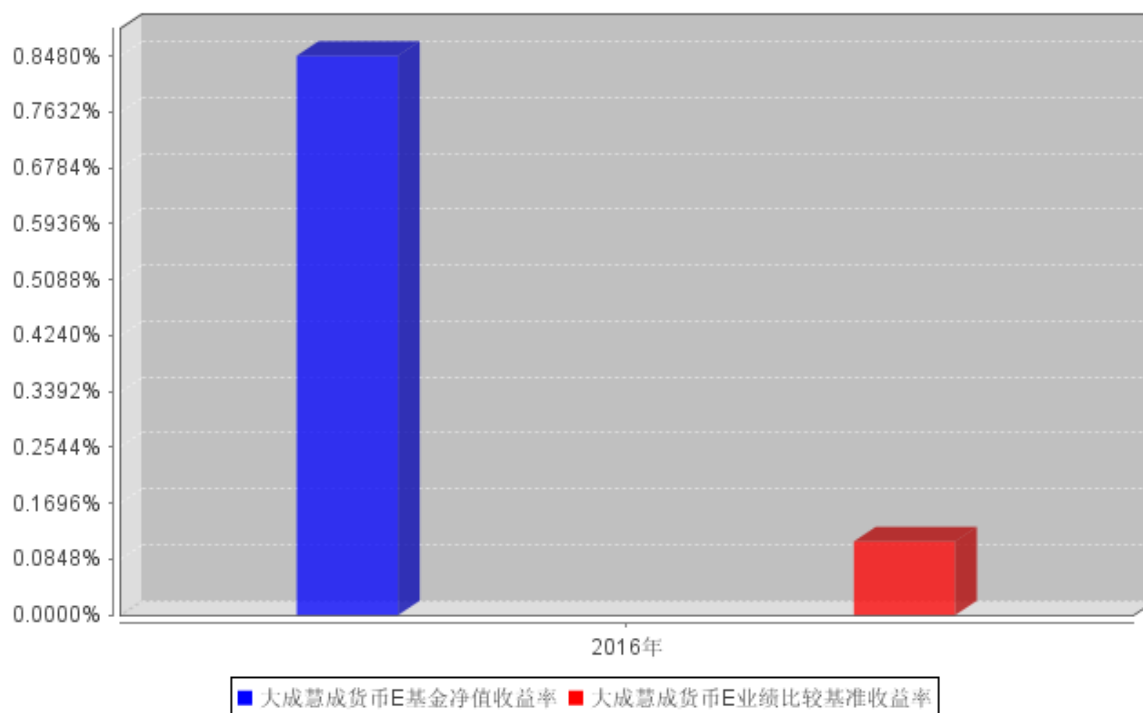


注：1、本基金的基金合同生效日为 2016 年 2 月 3 日，截至本报告期末，本基金合同生效未满一年。

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 6 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增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较





注：合同生效当年按实际存续期计算，不按整个自然年度进行折算。

### 3.3 过去三年基金的利润分配情况

大成慧成货币 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
2016年	746,948.41	-	1,095.36	748,043.77	
合计	746,948.41	-	1,095.36	748,043.77	

大成慧成货币 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
2016年	75,954,413.55	-	207,149.29	76,161,562.84	
合计	75,954,413.55	-	207,149.29	76,161,562.84	

大成慧成货币 E					
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
2016年	610.62	-	4.42	615.04	
合计	610.62	-	4.42	615.04	



## § 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。目前公司由三家股东组成，分别为中泰信托有限责任公司(50%)、光大证券股份有限公司(25%)、中国银河投资管理有限公司(25%)。主要业务是公募基金的募集、销售和管理，还具有全国社保基金投资管理、基本养老保险投资管理、受托管理保险资金、保险保障基金投资管理、特定客户资产管理和QDII业务资格。

经过十多年的稳健发展，公司形成了强大稳固的综合实力。公司旗下基金产品齐全、风格多样，构建了涵盖股票型基金、混合型基金、指数型基金、债券型基金和货币市场基金的完备产品线。截至2016年12月31日，本基金管理人共管理5只ETF及1只ETF联接基金，4只QDII基金及68只开放式证券投资基金。

#### 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		
王立女士	本基金基金经理，固定收益总部总监	2016年2月3日	-	15年	经济学硕士。曾任职于申银万国证券股份有限公司、南京市商业银行资金营运中心。2005年4月加入大成基金管理有限公司，曾任大成货币市场基金基金经理助理。2007年1月12日至2014年12月23日担任大成货币市场证券投资基金基金经理。2009年5月23日起任大成债券投资基金基金经理。2012年11月20日至2014年4月4日任大成现金增利货币市场基金基金经理。2013年2月1日至2015年5月25日任大成月添利理财债券型证券投资基金基

					<p>金经理。2013 年 7 月 23 日至 2015 年 5 月 25 日任大成景旭纯债债券型证券投资基金基金经理。2014 年 9 月 3 日起任大成景兴信用债券型证券投资基金基金经理。2014 年 9 月 3 日至 2016 年 11 月 23 日任大成景丰债券型证券投资基金 (LOF) 基金经理。2016 年 2 月 3 日起任大成慧成货币市场基金基金经理。现任固定收益总部总监。具有基金从业资格。国籍：中国</p>
杨雅洁女士	本基金基金经理	2016 年 9 月 29 日	-	8 年	<p>经济学硕士，2009 年 8 月加入大成基金管理有限公司，曾任固定收益部宏观利率研究员。2013 年 1 月 14 日至 2014 年 1 月 10 日任大成债券投资基金基金经理助理。2014 年 1 月 11 日起任大成景旭纯债债券型证券投资基金基金经理。2015 年 3 月 21 日起任大成月添利理财债券型证券投资基金基金经理。2015 年 5 月 22 日起任大成景鹏灵活配置混合型证券投资基金基金经理。2016 年 9 月 29 日起任大成慧成货币市场基金基金经理。2016 年 9 月 29 日起任大成添益交易型货币市场基金基金经理。2017 年 1 月 6 日起任大成景尚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</p>

- 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。
- 3、陈会荣先生于 2017 年 3 月 22 日起担任本基金基金经理，详见 2017 年 3 月 23 日的变更基金经理公告。

#### 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

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》、《大成慧成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，大成慧成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，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 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% 的情形；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

2016 年经济继续底部徘徊，全年 GDP 增长 6.7%，较 2015 年下滑 0.2 个百分点。全年 CPI 同比增长 2%，较 2015 年上升 0.56%。受益于低库存和供给侧改革的推进，PPI 出现大幅反弹，全年同比增长-1.3%，单月同比增速已于四季度转为正值，为 2012 年以来首次。全球范围内对超宽松货币政策和负利率的反思使得流动性迎来拐点。中国央行的货币政策取向也从三季度开始发生微妙转变，中央经济工作会议最终定调货币政策“稳健中性”，强调调节好货币闸门，标志着始于 2014 年的宽松货币政策正式转向。

2016 年银行间资金环境整体保持紧平衡，资金利率中枢明显上行。上半年 7 天回购均值为 2.46%，下半年 7 天利率均值升至 2.65%，且资金紧张的阶段明显增多。1 年期金融债从年中最低的 2.24% 上升至 3% 以上，各评级短融从最低点上行 130bp 以上，同业存单四季度大幅上行 200bp。

### 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 2.1977%，B 类净值收益率为 2.4229%，E 类净值收益率为 0.8490%，期间业绩比较基准收益率为 0.3184%。

## 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

2017 年全球都面临新的政治周期，全球反思货币政策、重新重视财政政策，以及再通胀或成为新的主题。除宏观基本面方面的不利因素外，2017 年债券市场还面临监管全面加强的考验，央行人士明确要防止金融机构“带病扩张”，防止资金“脱实向虚”、“以钱炒钱”以及不合理的加杠杆行为。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。

#### 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、固定收益总部、风险管理部、基金运营部、监察稽核部、社保基金及机构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、固定收益总部、风险管理部和社保基金及机构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/中证指数有限公司签署服务协议，由其按约定提供在银行间同业市场交易的债券品种/在交易所市场上市交易或挂牌转让的固定收益品种（估值处理标准另有规定的除外）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情况，以每万份基金净收益为基准，为投资人每日计算当日收益并分配，每日支付。本报告期内本基金应分配利润 76,910,221.65 元，报告期内已分配利润 76,910,221.65 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

本报告期内，本基金曾出现了连续 20 个工作日资产净值低于五千万元的情形。

### § 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

本报告期，本托管人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律法规、《大成慧成货币市场基金基金合同》和《大成慧成货币市场基金托管协议》的有关约定，诚实、尽责地履行了基金托管人义务，不存在损害本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

本报告期，本托管人根据国家有关法律法规、基金合同、托管协议的规定，对本基金的投资运作、基金资产净值计算、基金费用开支等方面进行了必要的监督、复核和审查，未发现基金管理人有关损害基金份额持有人利益的行为。

本报告期内本基金已分配利润 76,910,221.65 元。

#### 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，认为复核内容真实、准确、完整，不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

### § 6 审计报告

本基金 2016 年年度财务会计报告已经普华永道中天会计师事务所（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：大成慧成货币市场基金

报告截止日：2016 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资 产	本期末 2016 年 12 月 31 日

<b>资产：</b>	
银行存款	528,988,458.67
结算备付金	-
存出保证金	-
交易性金融资产	139,963,641.82
其中：股票投资	-
基金投资	-
债券投资	139,963,641.82
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	335,300,000.00
应收证券清算款	-
应收利息	5,943,335.30
应收股利	-
应收申购款	-
递延所得税资产	-
其他资产	-
资产总计	1,010,195,435.79
<b>负债和所有者权益</b>	<b>本期末 2016年12月31日</b>
<b>负债：</b>	
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	-
应付证券清算款	-
应付赎回款	-
应付管理人报酬	183,567.60
应付托管费	64,248.63
应付销售服务费	10,365.84
应付交易费用	37,939.86

应交税费	-
应付利息	-
应付利润	208,249.07
递延所得税负债	-
其他负债	69,000.00
负债合计	573,371.00
<b>所有者权益：</b>	
实收基金	1,009,622,064.79
未分配利润	-
所有者权益合计	1,009,622,064.79
负债和所有者权益总计	1,010,195,435.79

注：1. 报告截止日 2016 年 12 月 31 日，基金份额净值 1.0000 元，基金份额总额 1,009,622,064.79 份，其中 A 类基金份额的份额总额为 5,669,000.29 份，B 类基金份额的份额总额为 1,003,930,121.39 份，E 类基金份额的份额总额为 22,943.11 份。

2. 本财务报表的实际编制期间为 2016 年 2 月 3 日(基金合同生效日)至 2016 年 12 月 31 日止期间。

## 7.2 利润表

会计主体：大成慧成货币市场基金

本报告期：2016 年 2 月 3 日(基金合同生效日)至 2016 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项 目	本期 2016 年 2 月 3 日(基金合同生效日)至 2016 年 12 月 31 日
<b>一、收入</b>	92,681,614.30
1.利息收入	92,166,682.48
其中：存款利息收入	61,274,365.58
债券利息收入	23,802,491.61
资产支持证券利息收入	-
买入返售金融资产收入	7,089,825.29
其他利息收入	-
2.投资收益（损失以“-”填列）	511,331.82
其中：股票投资收益	-
基金投资收益	-
债券投资收益	511,331.82
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）	3,600.00
<b>减：二、费用</b>	15,771,392.65
1. 管理人报酬	5,572,125.53
2. 托管费	1,950,243.90
3. 销售服务费	359,948.97
4. 交易费用	200.48
5. 利息支出	7,686,683.23
其中：卖出回购金融资产支出	7,686,683.23
6. 其他费用	202,190.54
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>	76,910,221.65
减：所得税费用	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>	76,910,221.65

### 7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：大成慧成货币市场基金

本报告期：2016年2月3日（基金合同生效日）至2016年12月31日

单位：人民币元

项目	本期 2016年2月3日（基金合同生效日）至2016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）	511,690,704.48	-	511,690,704.48
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	76,910,221.65	76,910,221.65
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）	497,931,360.31	-	497,931,360.31
其中：1. 基金申购款	6,393,407,938.28	-	6,393,407,938.28
2. 基金赎回款	-5,895,476,577.97	-	-5,895,476,577.97
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）	-	-76,910,221.65	-76,910,221.65
五、期末所有者权益（基金净值）	1,009,622,064.79	-	1,009,622,064.79

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：

<u>刘卓</u>	<u>周立新</u>	<u>周立新</u>
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 基金基本情况

大成慧成货币市场基金（以下简称“本基金”）经中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）证监许可[2015]第 2363 号《关于准予大成慧成货币市场基金注册的批复》核准，由大成基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《大成慧成货币市场基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式，存续期限不定，首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币 511,593,196.35 元，业经普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）普华永道中天验字(2016)第 110 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《大成慧成货币市场基金基金合同》于 2016 年 2 月 3 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 511,690,704.48 份基金份额，其中认购资金利息折合 97,508.13 份基金份额。本基金的基金管理人为大成基金管理有限公司，基金托管人为上海银行股份有限公司。

本基金根据销售方式或单个账户持有的基金份额数量等的不同，分为 A 类基金份额、B 类基金份额和 E 类基金份额。各类别分设不同的基金代码，按各自的费率收取销售服务费并分别公布每万份基金净收益和七日年化收益率。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《大成慧成货币市场基金基金合同》的有关规定，本基金主要投资于：现金；期限在 1 年以内（含 1 年）的银行存款、债券回购、中央银行票据、同业存单；剩余期限在 397 天以内（含 397 天）的债券、非金融企业债务融资工具、资产支持证券；中国证监会、人民银行认可的其它具有良好流动性货币市场工具。本基金投资业绩比较基准为：银行活期存款利率（税后）。

本财务报表由本基金的基金管理人大成基金管理有限公司于 2017 年 3 月 24 日批准报出。

### 7.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于 2006 年 2 月 15 日及以后期间颁布的《企业会计准则—基本准则》、各项具体会计准则及相关规定（以下合称“企业会计准则”）、中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号〈年度报告和半年度报告〉》、中国证券投资基金业协会（以下简称“中国基金业协会”）颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《大成慧成货币市场基金基金合同》和在财务报表附注 7.4.4 所列示的中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

### 7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2016 年 2 月 3 日(基金合同生效日)至 2016 年 12 月 31 日止期间财务报表符合企业会计准则的要求,真实、完整地反映了本基金 2016 年 12 月 31 日的财务状况以及 2016 年 2 月 3 日(基金合同生效日)至 2016 年 12 月 31 日止期间的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

### 7.4.4 重要会计政策和会计估计

#### 7.4.4.1 会计年度

本基金会计年度为公历 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。本期财务报表的实际编制期间为 2016 年 2 月 3 日(基金合同生效日)至 2016 年 12 月 31 日止期间。

#### 7.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

#### 7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

##### (1) 金融资产的分类

金融资产于初始确认时分类为:以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、应收款项、可供出售金融资产及持有至到期投资。金融资产的分类取决于本基金对金融资产的持有意图和持有能力。本基金现无金融资产分类为可供出售金融资产及持有至到期投资。

本基金目前以交易目的持有的债券投资分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。以公允价值计量且其公允价值变动计入损益的金融资产在资产负债表中以交易性金融资产列示。

本基金持有的其他金融资产分类为应收款项,包括银行存款、买入返售金融资产和其他各类应收款项等。应收款项是指在活跃市场中没有报价、回收金额固定或可确定的非衍生金融资产。

##### (2) 金融负债的分类

金融负债于初始确认时分类为:以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债及其他金融负债。本基金目前暂无金融负债分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。本基金持有的其他金融负债包括卖出回购金融资产款和其他各类应付款项等。

#### 7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

金融资产或金融负债于本基金成为金融工具合同的一方时,按公允价值在资产负债表内确认。对于取得债券投资支付的价款中包含的债券起息日或上次除息日至购买日止的利息,单独确认为应收项目。应收款项和其他金融负债的相关交易费用计入初始确认金额。

债券投资按票面利率或商定利率每日计提应收利息,按实际利率法在其剩余期限内摊销其买

入时的溢价或折价；同时于每一计价日计算影子价格，以避免债券投资的账面价值与公允价值的差异导致基金资产净值发生重大偏离。对于应收款项和其他金融负债采用实际利率法，以摊余成本进行后续计量。

金融资产满足下列条件之一的，予以终止确认：(1) 收取该金融资产现金流量的合同权利终止；(2) 该金融资产已转移，且本基金将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方；或者(3) 该金融资产已转移，虽然本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬，但是放弃了对该金融资产控制。

金融资产终止确认时，其账面价值与收到的对价的差额，计入当期损益。

当金融负债的现时义务全部或部分已经解除时，终止确认该金融负债或义务已解除的部分。终止确认部分的账面价值与支付的对价之间的差额，计入当期损益。

#### 7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

为了避免债券投资的账面价值与公允价值的差异导致基金资产净值发生重大偏离，从而对基金持有人的利益产生稀释或不公平的结果，基金管理人于每一计价日采用债券投资的公允价值计算影子价格。当影子价格确定的基金资产净值与摊余成本法计算的基金资产净值的偏离度绝对值达到或超过 0.25%时，基金管理人应根据相关法律法规采取相应措施，使基金资产净值更能公允地反映基金投资组合价值。

计算影子价格时按如下原则确定债券投资的公允价值：

(1) 存在活跃市场的金融工具按其估值日的市场交易价格确定公允价值；估值日无交易，但最近交易日后经济环境未发生重大变化且证券发行机构未发生影响证券价格的重大事件的，按最近交易日的市场交易价格确定公允价值。

(2) 存在活跃市场的金融工具，如估值日无交易且最近交易日后经济环境发生了重大变化，参考类似投资品种的现行市价及重大变化等因素，调整最近交易市价以确定公允价值。

(3) 当金融工具不存在活跃市场，采用市场参与者普遍认同且被以往市场实际交易价格验证具有可靠性的估值技术确定公允价值。估值技术包括参考熟悉情况并自愿交易的各方最近进行的市场交易中使用的价格、参照实质上相同的其他金融工具的当前公允价值、现金流量折现法和期权定价模型等。采用估值技术时，尽可能最大程度使用市场参数，减少使用与本基金特定相关的参数。

#### 7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

本基金持有的资产和承担的负债基本为金融资产和金融负债。当本基金 1) 具有抵销已确认

金额的法定权利且该种法定权利现在是可执行的；且 2) 交易双方准备按净额结算时，金融资产与金融负债按抵销后的净额在资产负债表中列示。

#### 7.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行基金份额所募集的总金额。每份基金份额面值为 1.00 元。由于申购和赎回引起的实收基金变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日认列。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少，以及因类别调整而引起的 A、B、E 类基金份额之间的转换所产生的实收基金变动。

#### 7.4.4.8 收入/(损失)的确认和计量

债券投资在持有期间按实际利率计算确定的金额扣除在适用情况下由债券发行企业代扣代缴的个人所得税后的净额确认为利息收入。

债券投资处置时其处置价格扣除相关交易费用后的净额与账面价值之间的差额确认为投资收益。

应收款项在持有期间确认的利息收入按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

#### 7.4.4.9 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬、托管费和销售服务费在费用涵盖期间按基金合同约定的费率和计算方法逐日确认。

其他金融负债在持有期间确认的利息支出按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

#### 7.4.4.10 基金的收益分配政策

本基金每一级基金份额享有同等分配权。申购的基金份额享有确认当日的分红权益，而赎回的基金份额不享有确认当日的分红权益。本基金以份额面值 1.00 元固定份额净值交易方式，每日计算当日收益并全部分配结转至应付收益科目，于下一工作日以红利再投资方式支付累计收益。

#### 7.4.4.11 分部报告

本基金以内部组织结构、管理要求、内部报告制度为依据确定经营分部，以经营分部为基础确定报告分部并披露分部信息。

经营分部是指本基金内同时满足下列条件的组成部分：(1) 该组成部分能够在日常活动中产生收入、发生费用；(2) 本基金的基金管理人能够定期评价该组成部分的经营成果，以决定向其

配置资源、评价其业绩；(3) 本基金能够取得该组成部分的财务状况、经营成果和现金流量等有关会计信息。如果两个或多个经营分部具有相似的经济特征，并且满足一定条件的，则合并为一个经营分部。

本基金目前以一个单一的经营分部运作，不需要披露分部信息。

#### 7.4.4.12 其他重要的会计政策和会计估计

根据本基金的估值原则和中国证监会允许的基金行业估值实务操作，本基金计算影子价格过程中确定债券投资的公允价值时采用的估值方法及其关键假设如下：

在银行间同业市场交易的债券品种，根据中国证监会证监会计字[2007]21号《关于证券投资基金执行〈企业会计准则〉估值业务及份额净值计价有关事项的通知》采用估值技术确定公允价值。本基金持有的银行间同业市场债券按现金流量折现法估值，具体估值模型、参数及结果由中央国债登记结算有限责任公司独立提供。

#### 7.4.5 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2004]78号《财政部、国家税务总局关于证券投资基金税收政策的通知》、财税[2008]1号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2016]36号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1) 于 2016 年 5 月 1 日前，以发行基金方式募集资金不属于营业税征收范围，不征收营业税。对证券投资基金管理人运用基金买卖债券的差价收入免征营业税。自 2016 年 5 月 1 日起，金融业由缴纳营业税改为缴纳增值税。对证券投资基金管理人运用基金买卖债券的转让收入免征增值税，对国债、地方政府债以及金融同业往来利息收入亦免征增值税。

(2) 对基金从证券市场中取得的收入，包括买卖债券的差价收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

(3) 对基金取得的企业债券利息收入，应由发行债券的企业在向基金支付利息时代扣代缴 20% 的个人所得税。

#### 7.4.6 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、注册登记机构、基金销售机构
上海银行股份有限公司（“上海银行”）	基金托管人、基金销售机构
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
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(2016年4月25日前)
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. 根据本基金管理人大成基金管理有限公司董事会及股东会的有关决议，大成基金原股东广东证券股份有限公司将所持大成基金 2%股权以拍卖竞买的方式转让给大成基金股东中泰信托有限责任公司。上述股权变更及修改《大成基金管理有限公司公司章程》的工商变更手续已于 2016 年 4 月 25 日在深圳市市场监督管理局办理完毕。

2. 下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

#### 7.4.7 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

##### 7.4.7.1 通过关联方交易单元进行的交易

###### 7.4.7.1.1 股票交易

本基金本报告期内无通过关联方交易单元进行的股票交易。

###### 7.4.7.1.2 债券回购交易

关联方名称	本期 2016年1月1日至2016年12月31日	
	成交金额	占当期债券回购 成交总额的比例
光大证券	570,100,000.00	100.00%

###### 7.4.7.1.3 权证交易

本基金本报告期内无通过关联方交易单元进行的权证交易。

##### 7.4.7.2 关联方报酬

###### 7.4.7.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2016年2月3日(基金合同生效日)至2016年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	5,572,125.53
其中：支付销售机构的客户维护费	25,331.80

注：支付基金管理人大成基金 的管理人报酬按前一日基金资产净值 0.20%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日管理人报酬=前一日基金资产净值 × 0.20% / 当年天数。

#### 7.4.7.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期
	2016 年 2 月 3 日(基金合同生效日)至 2016 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的托管费	1,950,243.90

注：支付基金托管人上海银行的托管费按前一日基金资产净值 0.07%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日托管费=前一日基金资产净值 × 0.07% / 当年天数。

#### 7.4.7.2.3 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			
	2016 年 2 月 3 日(基金合同生效日)至 2016 年 12 月 31 日			
	当期发生的基金应支付的销售服务费			
	大成慧成货币 A	大成慧成货币 B	大成慧成货币 E	合计
大成基金	103.35	274,289.77	-	274,393.12
上海银行	84,435.06	942.59	59.91	85,437.56
合计	84,538.41	275,232.36	59.91	359,830.68

注：支付基金销售机构的销售服务费按前一日基金资产净值的约定年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付给大成基金，再由大成基金计算并支付给各基金销售机构。A 类基金份额、B 类基金份额和 E 类基金份额约定的销售服务费年费率分别为 0.25%、0.01%和 0.25%。销售服务费的计算公式为：

对应级别日销售服务费=前一日对应级别基金资产净值×约定年费率÷当年天数。

#### 7.4.7.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本报告期内本基金未发生与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。

#### 7.4.7.4 各关联方投资本基金的情况

##### 7.4.7.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

份额单位：份

项目	本期
	2016 年 2 月 3 日(基金合同生效日)至 2016 年 12 月 31 日



	大成慧成货币 B
基金合同生效日持有的基金份额	-
期间申购/买入总份额	10,159,260.64
期间因拆分变动份额	-
减：期间赎回/卖出总份额	10,159,260.64
期末持有的基金份额	-
期末持有的基金份额占基金总份额比例	0.0000%

注：基金管理人大成基金管理有限公司申购本基金通过直销中心办理，申购本基金的费率与本基金法律文件规定一致。

#### 7.4.7.4.2 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

注：本报告期末及上年度末除基金管理人以外的其他关联方均未投资本基金。

#### 7.4.7.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

关联方名称	本期 2016年2月3日(基金合同生效日)至2016年12月31日	
	期末余额	当期利息收入
上海银行-活期存款	2,988,458.67	83,992.31
上海银行-其他存款	-	1,528,283.33

注：本基金的银行存款由基金托管人上海银行保管，按约定利率计息。

#### 7.4.7.6 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。

#### 7.4.7.7 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。

#### 7.4.8 期末（2016年12月31日）本基金持有的流通受限证券

##### 7.4.8.1 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。

##### 7.4.8.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

于本报告期末，本基金未持有暂时停牌等流通受限股票。

##### 7.4.8.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

###### 7.4.8.3.1 银行间市场债券正回购

于本报告期末，本基金无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。

## 7.4.8.3.2 交易所市场债券正回购

于本报告期末，本基金无从事交易所市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

## § 8 投资组合报告

## 8.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	固定收益投资	139,963,641.82	13.86
	其中：债券	139,963,641.82	13.86
	资产支持证券	-	0.00
2	买入返售金融资产	335,300,000.00	33.19
	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	528,988,458.67	52.36
4	其他各项资产	5,943,335.30	0.59
5	合计	1,010,195,435.79	100.00

## 8.2 债券回购融资情况

金额单位：人民币元

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		7.61
	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	-	0.00
	其中：买断式回购融资	-	0.00

## 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。

## 8.3 基金投资组合平均剩余期限

## 8.3.1 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	48
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	84

报告期内投资组合平均剩余期限最低值	1
-------------------	---

### 报告期内投资组合平均剩余期限超过 120 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 120 天”，本报告期内，本基金未发生超标情况。

### 8.3.2 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	12.19	0.00
	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	9.90	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	35.26	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)—120 天	0.00	0.00
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	0.00	0.00
5	120 天(含)—397 天(含)	8.90	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	66.26	0.00

### 8.4 报告期内投资组合平均剩余存续期超过 240 天情况说明

报告期内投资组合平均剩余存续期均未超过 240 天。

### 8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	摊余成本	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	50,057,618.28	4.96
	其中：政策性金融债	50,057,618.28	4.96
4	企业债券	-	0.00
5	企业短期融资券	89,906,023.54	8.90

6	中期票据	-	0.00
7	同业存单	-	0.00
8	其他	-	0.00
9	合计	139,963,641.82	13.86
10	剩余存续期超过 397 天的浮动利率债券	-	0.00

### 8.6 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

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	债券数量(张)	摊余成本	占基金资产净值比例 (%)
1	140201	14 国开 01	500,000	50,057,618.28	4.96
2	011698623	16 沪电力 SCP008	500,000	49,932,607.19	4.95
3	011698598	16 厦翔业 SCP012	400,000	39,973,416.35	3.96

### 8.7 “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	0.0254%
报告期内偏离度的最低值	-0.0772%
报告期内每个交易日偏离度的绝对值的简单平均值	0.0129%

#### 报告期内负偏离度的绝对值达到 0.25%情况说明

本基金报告期内未出现负偏离度绝对值达到 0.25%的情况。

#### 报告期内正偏离度的绝对值达到 0.5%情况说明

本基金报告期内未出现正偏离度绝对值达到 0.5%的情况。

### 8.8 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

本报告期末未持有资产支持证券。

## 8.9 投资组合报告附注

**8.9.1** 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。

**8.9.2** 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。

### 8.9.3 期末其他各项资产构成

单位:人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	-
2	应收证券清算款	-
3	应收利息	5,943,335.30
4	应收申购款	-
5	其他应收款	-
6	待摊费用	-
7	其他	-
8	合计	5,943,335.30

## § 9 基金份额持有人信息

### 9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位:份

份额级别	持有人户数(户)	户均持有的基金份额	持有人结构			
			机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例
大成慧成货币 A	662	8,563.44	106,071.97	1.87%	5,562,928.32	98.13%
大成慧成货币 B	17	59,054,713.02	1,003,930,118.95	100.00%	2.44	0.00%
大成慧成货币	8	2,867.89	-	0.00%	22,943.11	100.00%

E						
合计	687	1,469,609.99	1,004,036,190.92	99.45%	5,585,873.87	0.55%

注：1、上述机构/个人投资者持有份额占总份额比例的计算中，对分级份额，比例的分母采用各自级别的份额，对合计数，比例的分母采用下属分级基金份额的合计数（即期末基金份额总额）。

2、持有人户数为有效户数，即存量份额大于零的账户。

## 9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数（份）	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	大成慧成货币 A	2.15	0.0000%
	大成慧成货币 B	-	0.0000%
	大成慧成货币 E	6,689.12	29.1552%
	合计	6,691.27	0.0007%

注：上述占基金总份额比例的计算中，对分级份额，比例的分母采用各自级别的份额，对合计数，比例的分母采用下属分级基金份额的合计数（即期末基金份额总额）。

## 9.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

项目	份额级别	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	大成慧成货币 A	0
	大成慧成货币 B	0
	大成慧成货币 E	0
	合计	0
本基金基金经理持有本开放式基金	大成慧成货币 A	0
	大成慧成货币 B	0
	大成慧成货币 E	0
	合计	0

## § 10 开放式基金份额变动

单位：份

	大成慧成货币 A	大成慧成货币 B	大成慧成货币 E
基金合同生效日（2016 年 2 月 3 日）基金份额总额	229,647,234.48	282,043,470.00	-

本报告期期初基金份额总额	-	-	-
基金合同生效日起至报告期末基金总申购份额	2,170,815.77	6,390,954,425.45	282,697.06
减:基金合同生效日起至报告期末基金总赎回份额	226,149,049.96	5,669,067,774.06	259,753.95
基金合同生效日起至报告期末基金拆分变动份额(份额减少以“-”填列)	-	-	-
本报告期期末基金份额总额	5,669,000.29	1,003,930,121.39	22,943.11

## § 11 重大事件揭示

### 11.1 基金份额持有人大会决议

报告期内无基金份额持有人大会决议。

### 11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

#### 一、基金管理人的重大人事变动

基金管理人于 2016 年 6 月 25 日发布了《大成基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告》，经大成基金管理有限公司第六届董事会第十七次会议审议通过，钟鸣远先生不再担任公司副总经理。

#### 二、基金托管人基金托管部门的重大人事变动：

2016 年 10 月，许卿斌先生担任上海银行股份有限公司资产托管部总经理职务。上述人事变动已按相关规定备案、公告。

### 11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内没有涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的重大诉讼事项。

### 11.4 基金投资策略的改变

本基金投资策略在本报告期内没有重大改变。

### 11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金聘任的为本基金审计的会计师事务所为普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)，本年度应支付的审计费用为 6 万元整。该事务所自基金合同生效日起为本基金提供审计服务至今。

**11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况**

1、报告期内基金管理人收到中国证券监督管理委员会深圳监管局(以下简称“深圳证监局”)《关于对大成基金管理有限公司采取责令整改并暂停办理相关业务措施的决定》，责令公司进行整改，并暂停受理公募基金产品注册申请 6 个月，暂停受理新设子公司业务申请 1 年，对相关责任人采取行政监管措施。公司高度重视，制定并落实相关整改措施，并及时向深圳证监局提交整改报告。目前公司已完成相关整改工作。

2、报告期内基金托管人的托管业务部门及其相关高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

**11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况****11.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况**

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
光大证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
申万宏源	1	-	0.00%	-	0.00%	-

注：根据中国证监会颁布的《关于完善证券投资基金交易席位制度有关问题的通知》（证监基金字[2007]48号）的有关规定，本公司制定了租用证券公司交易单元的选择标准和程序。

租用证券公司交易单元的选择标准主要包括：

- （一）财务状况良好，最近一年无重大违规行为；
- （二）经营行为规范，内控制度健全，能满足各投资组合运作的保密性要求；
- （三）研究实力较强，能提供包括研究报告、路演服务、协助进行上市公司调研等研究服务；
- （四）具备各投资组合运作所需的高效、安全的通讯条件，有足够的交易和清算能力，满足各投资组合证券交易需要；
- （五）能提供投资组合运作、管理所需的其他券商服务；
- （六）相关基金合同、资产管理合同以及法律法规规定的其他条件。

租用证券公司交易单元的程序：首先根据租用证券公司交易单元的选择标准形成《券商服务评价表》，然后根据评分高低进行选择基金交易单元。

本基金本报告期末所有席位均为本报告期内新增。本报告期内本基金退租席位：无。

**11.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况**

无。



### 11.8 偏离度绝对值超过 0.5%的情况

本基金本报告期内无偏离度绝对值超过 0.5%的情况。

### § 12 影响投资者决策的其他重要信息

1、根据 2016 年 4 月 27 日《大成基金管理有限公司关于股权变更及修改〈公司章程〉的公告》，根据大成基金管理有限公司（以下简称“本公司”）第六届董事会第十四次会议和 2016 年第一次临时股东大会的有关决议，本公司原股东广东证券股份有限公司通过其破产管理人将所持本公司 2%股权（对应出资额 400 万元）以拍卖竞买的方式转让给本公司股东中泰信托有限责任公司，广东证券股份有限公司退出本公司投资，中泰信托有限责任公司所持本公司股权增至 50%（对应出资额 1 亿元），同时，就本公司股权变更的相关内容修改《大成基金管理有限公司公司章程》。本公司股权变更及修改《大成基金管理有限公司公司章程》的工商变更手续已于 2016 年 4 月 25 日在深圳市市场监督管理局办理完毕。

2、基金管理人于 2017 年 2 月 18 日发布了《大成基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告》，经大成基金管理有限公司第六届董事会第二十四次会议（以下简称“董事会”）审议通过，杜鹏女士不再担任公司督察长。董事会同时决议，同意在公司新督察长任职前，由公司总经理罗登攀先生代为履行督察长职务，代为履职时间不超过 90 日。

3、基金管理人于 2017 年 2 月 18 日发布了《大成基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告》，经大成基金管理有限公司第六届董事会第二十四次会议审议通过，陈翔凯先生、谭晓冈先生和姚余栋先生担任公司副总经理。

大成基金管理有限公司  
2017 年 3 月 25 日