

大成慧成货币市场基金  
2017 年半年度报告摘要

2017 年 6 月 30 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 8 月 24 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。

基金托管人上海银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2017 年 8 月 22 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 2017 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	5,139,469,974.41 份		
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	17,887,810.68 份	5,120,976,494.24 份	605,669.49 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
信息披露负责人	姓名	罗登攀	闻怡
	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	021-68475888

#### 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	<a href="http://www.dcfund.com.cn">http://www.dcfund.com.cn</a>
基金半年度报告备置地点	基金管理人及基金托管人住所

### § 3 主要财务指标和基金净值表现

#### 3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

基金级别	大成慧成货币 A	大成慧成货币 B	大成慧成货币 E
3.1.1 期间数据和指标	报告期(2017年1月1日 - 2017年6月30日)	报告期(2017年1月1日 - 2017年6月30日)	报告期(2017年1月1日 - 2017年6月30日)
本期已实现收益	163,966.54	97,080,107.05	3,399.22
本期利润	163,966.54	97,080,107.05	3,399.22
本期净值收益率	1.9638%	2.0845%	1.9639%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2017年6月30日)		
期末基金资产净值	17,887,810.68	5,120,976,494.24	605,669.49
期末基金份额净值	1	1	1

注：1、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。

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

###### 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
过去一个月	0.3556%	0.0001%	0.0288%	0.0000%	0.3268%	0.0001%
过去三个月	1.0310%	0.0006%	0.0873%	0.0000%	0.9437%	0.0006%
过去六个月	1.9638%	0.0008%	0.1736%	0.0000%	1.7902%	0.0008%
过去一年	3.3238%	0.0020%	0.3495%	0.0000%	2.9743%	0.0020%
自基金合同生效起至今	4.2046%	0.0024%	0.4920%	0.0000%	3.7126%	0.0024%

###### 大成慧成货币 B

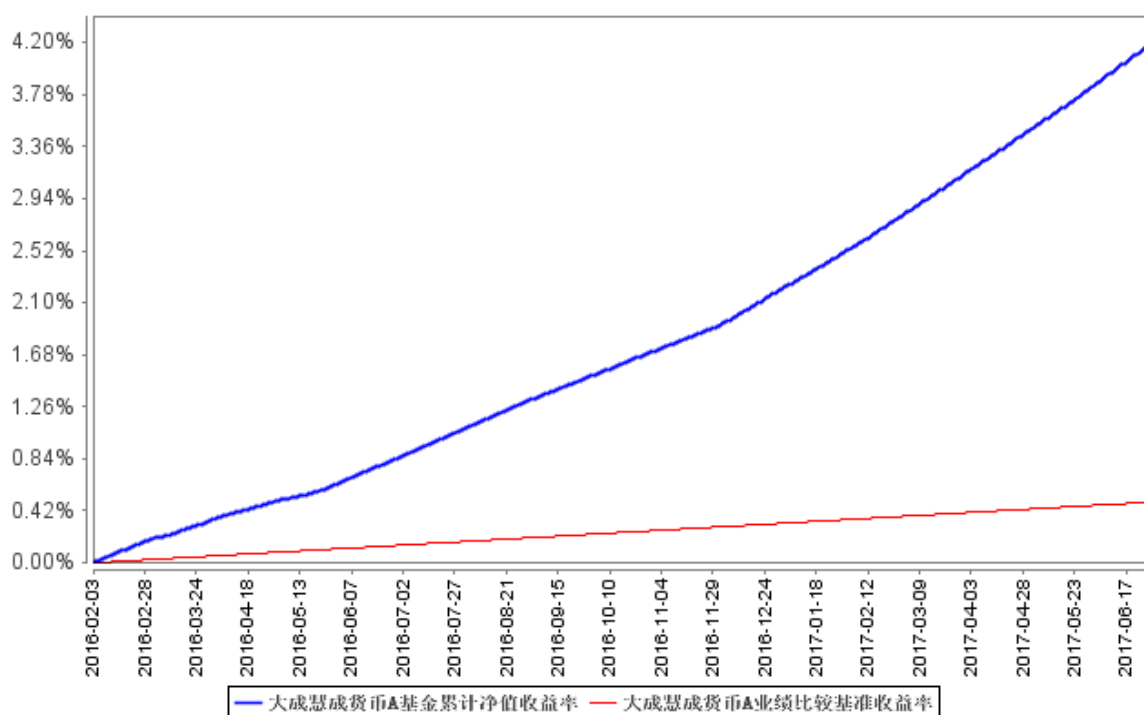
阶段	份额净值收益率①	份额净值收益率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	0.3749%	0.0001%	0.0288%	0.0000%	0.3461%	0.0001%
过去三个月	1.0910%	0.0006%	0.0873%	0.0000%	1.0037%	0.0006%

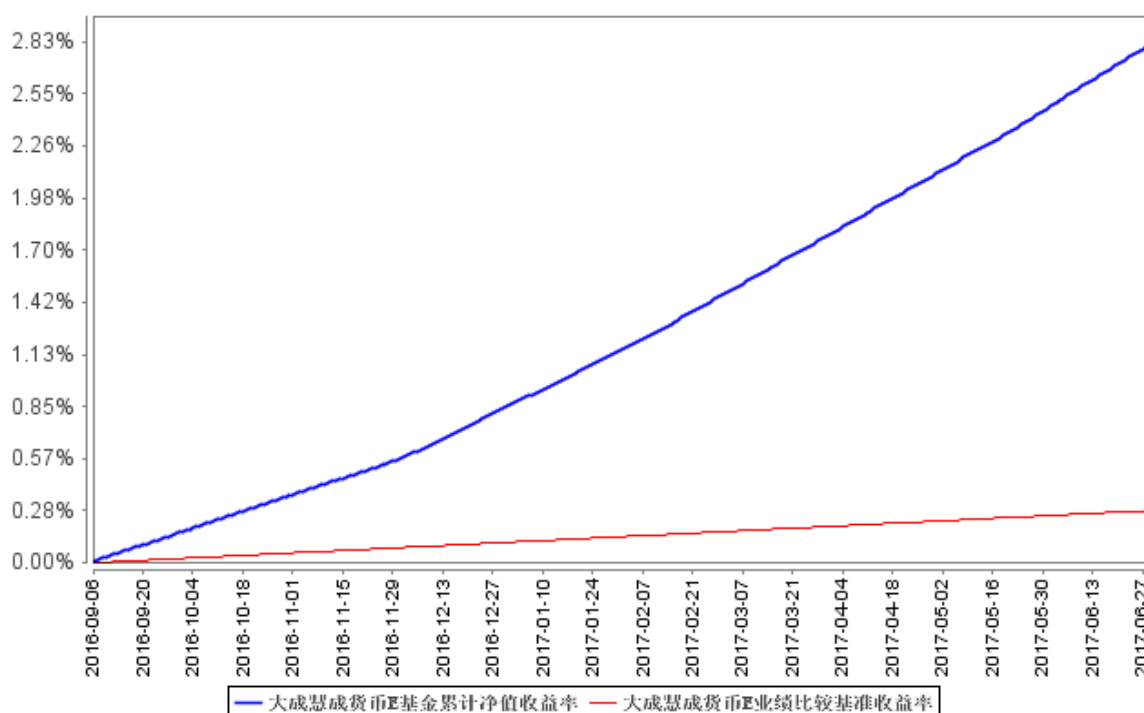
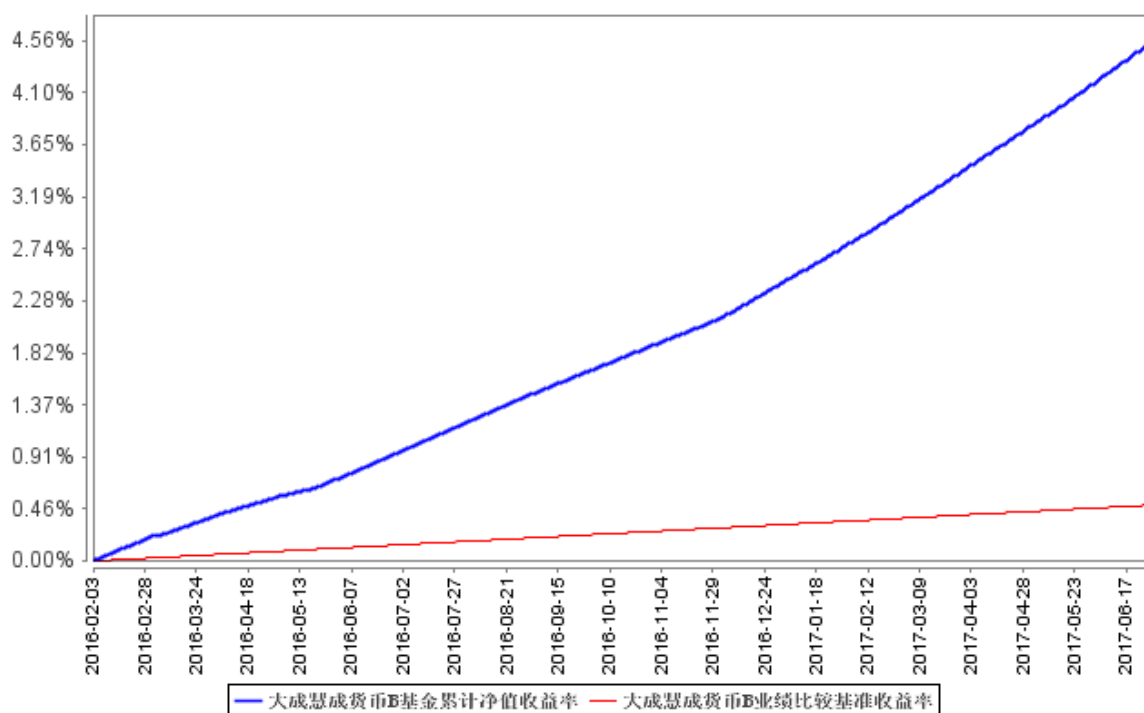
过去六个月	2.0845%	0.0008%	0.1736%	0.0000%	1.9109%	0.0008%
过去一年	3.5715%	0.0020%	0.3495%	0.0000%	3.2220%	0.0020%
自基金合同生效起至今	4.5579%	0.0024%	0.4920%	0.0000%	4.0659%	0.0024%

## 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
过去一个月	0.3554%	0.0002%	0.0288%	0.0000%	0.3266%	0.0002%
过去三个月	1.0313%	0.0006%	0.0873%	0.0000%	0.9440%	0.0006%
过去六个月	1.9639%	0.0008%	0.1736%	0.0000%	1.7903%	0.0008%
自基金合同生效起至今	2.8296%	0.0020%	0.2854%	0.0000%	2.5442%	0.0020%

## 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，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

## § 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 2017 年 6 月 30 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 74 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		
杨雅洁女士	本基金基金经理	2016 年 9 月 29 日	2017 年 3 月 27 日	8 年	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 日至 2017 年 3 月 27 日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 日至 2017 年 3 月 27 日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 日至 2017 年 3 月 27 日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 日至 2017 年 3 月 27 日任大成慧成货币市场基金基金经理。2016 年 9 月 29 日至 2017 年 3 月 27 日任大成添益交易型货



					币市场基金基金经理。2017 年 1 月 6 日至 2017 年 3 月 27 日担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
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
陈会荣先生	本基金基金经理	2017 年 3 月 22 日	-	10 年	中央财经大学经济学学士。2007 年 10 月加入大成基金管理有限公司，历任基金运营部基金助理会计师、基金运营部登记清算主管、固定收益总部助理研究员、固定收益总部基金经理助理、固定收益总部基金经理。自 2016 年 8 月 6 日起任大成景穗灵活配置混合型证券投资基金基金经理，自 2016 年 8 月 6 日起任大成丰财宝货

					币市场基金基金经理，自 2016 年 9 月 6 日起任大成恒丰宝货币市场基金基金经理。自 2016 年 11 月 2 日起任大成惠利纯债债券型证券投资基金、大成惠益纯债债券型证券投资基金基金经理，自 2017 年 3 月 1 日起任大成惠祥定期开放纯债债券型证券投资基金基金经理。自 2017 年 3 月 22 日起担任大成月添利理财债券型证券投资基金、大成慧成货币市场基金和大成景旭纯债债券型证券投资基金基金经理。具备基金从业资格。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合规守信情况的说明

报告期内，本基金管理人严格遵守《证券法》、《证券投资基金法》等有关法律法规及基金合同、基金招募说明书等有关基金法律文件的规定，以取信于市场、取信于社会投资公众为宗旨，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在规范基金运作和严格控制投资风险的前提下，为基金份额持有人谋求最大利益，无损害基金份额持有人利益的行为。

#### 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。

##### 4.3.2 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 4 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 6 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

2017 年一季度，货币政策延续 2016 年年末的稳健中性，受银行 MPA 考核及外部因素影响，数度出现资金面较为紧张的情况，二季度前期货币政策紧缩预期浓重，金融监管压力不断加大，后期在央行中期借贷便利等措施干预下，资金面趋于平稳。纵观上半年，隔夜回购利率均值约为 2.77%，较年初上升 48BP，14 天回购加权利率均值约为 3.98%，较年初上升 70BP。债市继续调整，在 6 月跌幅收窄，1 年期金融债收益率上行约 69bp，1 年 AAA 短期融资券上行约 44bp，1 年 AA+ 短融品种上行约 36bp。

本基金将继续以流动性为第一前提，在关键时点适度加长配置期限并适时调整组合结构，努力提高组合静态收益。

##### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本报告期大成慧成货币 A 的基金份额净值收益率为 1.9638%，本报告期大成慧成货币 B 的基金份额净值收益率为 2.0845%，本报告期大成慧成货币 E 的基金份额净值收益率为 1.9639%，同期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

2017 年下半年，随着金融去杠杆阶段性效果显现，货币政策将维持稳健，资金面将回归中性，本基金将延续稳健的操作风格，合理安排组合久期及资产结构，为持有人带来和基金风格相适应的回报。

#### 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验，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。本报告期内本基金应分配利润 97,247,472.81 元，报告期内已分配利润 97,247,472.81 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

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 97,247,472.81 元。

### 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 半年度财务会计报告（未经审计）

## 6.1 资产负债表

会计主体：大成慧成货币市场基金

报告截止日：2017 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资 产	本期末 2017 年 6 月 30 日	上年度末 2016 年 12 月 31 日
<b>资 产：</b>		
银行存款	4,031,533,076.21	528,988,458.67
结算备付金	-	-
存出保证金	-	-
交易性金融资产	1,253,540,461.68	139,963,641.82
其中：股票投资	-	-
基金投资	-	-
债券投资	1,253,540,461.68	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	259,000,708.50	335,300,000.00
应收证券清算款	-	-
应收利息	30,246,741.68	5,943,335.30
应收股利	-	-
应收申购款	23,276.00	-
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	-
资产总计	5,574,344,264.07	1,010,195,435.79
<b>负债和所有者权益</b>	<b>本期末</b> <b>2017 年 6 月 30 日</b>	<b>上年度末</b> <b>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	432,749,463.62	-
应付证券清算款	-	-
应付赎回款	-	-
应付管理人报酬	842,587.67	183,567.60
应付托管费	294,905.70	64,248.63
应付销售服务费	45,076.10	10,365.84
应付交易费用	49,760.36	37,939.86

应交税费	-	-
应付利息	53,064.76	-
应付利润	641,994.16	208,249.07
递延所得税负债	-	-
其他负债	197,437.29	69,000.00
负债合计	434,874,289.66	573,371.00
<b>所有者权益：</b>		
实收基金	5,139,469,974.41	1,009,622,064.79
未分配利润	-	-
所有者权益合计	5,139,469,974.41	1,009,622,064.79
负债和所有者权益总计	5,574,344,264.07	1,010,195,435.79

注：报告截止日 2017 年 6 月 30 日，A 级基金份额净值人民币 1.00 元，基金份额总额 17,887,810.68 份；B 级基金份额净值人民币 1.00 元，基金份额总额 5,120,976,494.24 份；E 级基金份额净值人民币 1.00 元，E 级基金份额总额 605,669.49 份。基金份额总额 5,139,469,974.41 份。

## 6.2 利润表

会计主体：大成慧成货币市场基金

本报告期：2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2016 年 2 月 3 日(基金合 同生效日)至 2016 年 6 月 30 日
<b>一、收入</b>	107,009,823.03	19,491,914.09
1.利息收入	107,030,458.38	19,468,015.17
其中：存款利息收入	75,717,120.61	14,390,477.38
债券利息收入	23,797,949.56	4,458,187.34
资产支持证券利息收入	-	-
买入返售金融资产收入	7,515,388.21	619,350.45
其他利息收入	-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）	-20,635.35	20,298.92
其中：股票投资收益	-	-
基金投资收益	-	-
债券投资收益	-20,635.35	20,298.92
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>	<b>9,762,350.22</b>	<b>3,145,543.56</b>
1. 管理人报酬	4,553,033.57	1,154,603.50
2. 托管费	1,593,561.69	404,111.18
3. 销售服务费	237,580.60	130,391.38
4. 交易费用	-	-
5. 利息支出	3,149,082.24	1,375,475.15
其中：卖出回购金融资产支出	3,149,082.24	1,375,475.15
6. 其他费用	229,092.12	80,962.35
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>	<b>97,247,472.81</b>	<b>16,346,370.53</b>
减：所得税费用	-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>	<b>97,247,472.81</b>	<b>16,346,370.53</b>

### 6.3 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：2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2017 年 1 月 1 日至 2017 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）	1,009,622,064.79	-	1,009,622,064.79
二、本期经营活动产生	-	97,247,472.81	97,247,472.81



的基金净值变动数（本期利润）			
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）	4,129,847,909.62	-	4,129,847,909.62
其中：1. 基金申购款	5,532,754,536.93	-	5,532,754,536.93
2. 基金赎回款	-1,402,906,627.31	-	-1,402,906,627.31
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）	-	-97,247,472.81	-97,247,472.81
五、期末所有者权益（基金净值）	5,139,469,974.41	-	5,139,469,974.41
项目	上年度可比期间 2016年2月3日(基金合同生效日)至2016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）	-	-	-
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	16,346,370.53	16,346,370.53
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）	5,041,058,933.06	-	5,041,058,933.06
其中：1. 基金申购款	5,542,891,475.14	-	5,542,891,475.14
2. 基金赎回款	-501,832,542.08	-	-501,832,542.08
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）	-	-16,346,370.53	-16,346,370.53
五、期末所有者权益（基金净值）	5,041,058,933.06	-	5,041,058,933.06

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：

罗登攀	周立新	崔伟
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

根据财政部、国家税务总局财税[1998]55 号《关于证券投资基金税收问题的通知》[适用于封闭式基金]/财税[2002]128 号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》[适用于开放式基金]、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[2012]85 号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2015]101 号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、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补充政策的通知》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股票、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股票、债券的转让收入免征增值税，对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。

(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。对基金从上市公司取得的股息红利所得，持股期限在 1 个月以内(含 1 个月)的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在 1 个月以上至 1 年(含 1 年)的，暂减按 50% 计入应纳税所得额；持股期限超过 1 年的，于 2015 年 9 月 8 日前暂减按 25% 计入应纳税所得额，自 2015 年 9 月 8 日起，暂免征收个人所得税。对基金持有的上市公司限售股，解禁后取得的股息、红利收入，按照上述规定计算纳税，持股时间自解禁日起计算；解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按 50% 计入应纳税所得额。上述所得统一适用 20% 的税率计征个人所得税。

(4) 基金卖出股票按 0.1% 的税率缴纳股票交易印花税，买入股票不征收股票交易印花税。

### 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、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
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：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

本报告期及上年度可比期间内本基金无通过关联方交易单元进行的交易。

#### 6.4.4.2 关联方报酬本基金本报告期内无通过关联方交易单元进行的交易。

##### 6.4.4.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2017年1月1日至2017年6月30日	2016年2月3日(基金合同生效日)至2016年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	4,553,033.57	1,154,603.50
其中：支付销售机构的客户维护费	1,794.90	23,207.94

注：本基金的管理费按前一日基金资产净值的0.20%年费率计提。管理费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.20\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计算，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款指令，基金托管人复核后于次月前3个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。

若遇法定节假日、公休假等,支付日期顺延。

#### 6.4.4.2.2 基金托管费

单位:人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2017年1月1日至2017年6月30日	2016年2月3日(基金合同生效日)至2016年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	1,593,561.69	404,111.18

注:本基金的托管费按前一日基金资产净值的0.07%的年费率计提。托管费的计算方法如下:

$$H = E \times 0.07\% \div \text{当年天数}$$

H为每日应计提的基金托管费

E为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计算,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款指令,基金托管人复核后于次月前3个工作日内从基金财产中一次性支取。若遇法定节假日、公休日等,支付日期顺延。

#### 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			
	2017年1月1日至2017年6月30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	2,612.62	227,238.05	-	229,850.67
上海银行	6,744.42	-	202.65	6,947.07
合计	9,357.04	227,238.05	202.65	236,797.74
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间			
	2016年2月3日(基金合同生效日)至2016年6月30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	1.69	53,774.52	-	53,776.21
上海银行	75,680.54	922.91	-	76,603.45
光大证券	-	-	-	-
合计	75,682.23	54,697.43	-	130,379.66

注:本基金A级基金份额的基金销售服务费按前一日基金资产净值的0.25%的年费率计提,B级基金份额的基金销售服务费按前一日基金资产净值的0.01%的年费率计提,E级基金份额的基金销售

服务费按前一日基金资产净值的 0.25% 的年费率计提。销售服务费计提的计算公式具体如下：

$$H = E \times \text{年销售服务费率} \div \text{当年天数}$$

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

基金销售服务费每日计提，按月支付。由基金管理人向基金托管人发送基金销售服务费划付指令，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注册登记机构，由注册登记机构代付给销售机构。

#### 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

本基金本报告期末与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。

#### 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

份额单位：份

项目	本期 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日		
	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）持有的基金份额	-	-	-
期初持有的基金份额	-	-	-
期间申购/买入总份额	-	-	-
期间因拆分变动份额	-	-	-
减：期间赎回/卖出总份额	-	-	-
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%	0.0000%	0.0000%

项目	上年度可比期间 2016 年 2 月 3 日(基金合同生效日)至 2016 年 6 月 30 日		
	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）持有的基金份额	-	-	-
期初持有的基金份额	-	-	-
期间申购/买入总份额	-	10,031,399.27	-
期间因拆分变动份额	-	-	-
减：期间赎回/卖出总份额	-	-	-
期末持有的基金份额	-	10,031,399.27	-
期末持有的基金份额 占基金总份额比例	0.0000%	0.2000%	0.0000%

**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**

本基金本报告期末除基金管理人之外的其他关联方未投资本基金。

**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**

关联方名称	本期 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日		上期可比期间 2016 年 2 月 3 日(基金合同生效日)至 2016 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
上海银行	1,533,076.21	27,567.50	5,384,813.89	49,527.96

注：本基金的银行存款由基金托管人上海银行保管，按银行同业利率计息。

**6.4.4.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况**

本基金本报告期末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（2017 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**

本基金于本报告期末未持有因认购新发/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**

本基金于本报告期末未持有暂时停牌的股票。

**6.4.5.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券****6.4.5.3.1 银行间市场债券正回购**

截至本报告期末 2017 年 6 月 30 日止，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 432,749,463.62 元，是以如下债券作为抵押：

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
111798127	17 江西银行 CD052	-	99.36	1,750,000	173,880,000.00
140220	14 国开 20	-	100.12	100,000	10,012,000.00
150417	15 农发 17	-	100.03	500,000	50,015,000.00
160419	16 农发 19	-	99.94	2,000,000	199,880,000.00
合计				4,350,000	433,787,000.00

#### 6.4.5.3.2 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。

## § 7 投资组合报告

## 7.1 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	1,253,540,461.68	22.49
	其中：债券	1,253,540,461.68	22.49
	资产支持证券	-	0.00
2	买入返售金融资产	259,000,708.50	4.65
	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	4,031,533,076.21	72.32
4	其他各项资产	30,270,017.68	0.54
5	合计	5,574,344,264.07	100.00

## 7.2 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		4.14
	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	432,749,463.62	8.42
	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

注：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。

## 7.3 基金投资组合平均剩余期限

## 7.3.1 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	43
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	80
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	5

## 报告期内投资组合平均剩余期限超过 120 天情况说明



本报告期内无投资组合平均剩余期限超过 120 天的情况。

### 7.3.2 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	13.82	8.42
	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	94.05	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	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
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)	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
合计		107.87	8.42

### 7.4 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。

### 7.5 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	259,903,789.16	5.06
	其中：政策性金融债	259,903,789.16	5.06
4	企业债券	-	0.00
5	企业短期融资券	-	0.00
6	中期票据	-	0.00
7	同业存单	993,636,672.52	19.33
8	其他	-	0.00
9	合计	1,253,540,461.68	24.39
10	剩余存续期超过 397 天的浮动利率债券	-	0.00

## 7.6 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	160419	16 农发 19	2,000,000	199,877,650.07	3.89
2	111798110	17 中原银行 CD084	2,000,000	198,733,506.14	3.87
3	111798085	17 四川天府银行 CD085	2,000,000	198,728,363.12	3.87
3	111798127	17 江西银行 CD052	2,000,000	198,728,363.12	3.87
5	111798120	17 桂林银行 CD074	2,000,000	198,723,220.07	3.87
5	111798141	17 昆仑银行 CD012	2,000,000	198,723,220.07	3.87
7	150417	15 农发 17	500,000	50,013,851.28	0.97
8	140220	14 国开 20	100,000	10,012,287.81	0.19

## 7.7 “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	0.0115%
报告期内偏离度的最低值	-0.0381%
报告期内每个交易日偏离度的绝对值的简单平均值	0.0104%

## 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。

## 7.8 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

本报告期末未持有资产支持证券。

## 7.9 投资组合报告附注

7.9.1 7.9.1 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。

7.9.2 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。

### 7.9.3 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	30,246,741.68
4	应收申购款	23,276.00
5	其他应收款	-
6	待摊费用	-
7	其他	-
8	合计	30,270,017.68

### 7.9.4 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。

## § 8 基金份额持有人信息

## 8.1 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	669	26,738.13	4,246,798.29	23.74%	13,641,012.39	76.26%
大成慧成货 币 B	19	269,525,078.64	5,120,935,666.20	100.00%	40,828.04	0.00%
大成慧成货 币 E	24	25,236.23	-	0.00%	605,669.49	100.00%
合计	712	7,218,356.71	5,125,182,464.49	99.72%	14,287,509.92	0.28%

注：1、下属分级基金份额比例的分母采用各自级别的份额，合计数比例的分母采用各分级基金份额的合计数。

2、持有人户数为有效户数，即存量份额大于零的账户。

## 8.2 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	1,286,369.20	7.1913%
	大成慧成货 币 B	-	0.0000%
	大成慧成货 币 E	140,149.71	23.1396%
	合计	1,426,518.91	0.0278%

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）。

## 8.3 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 投资和部门负责人持 有本开放式基金	大成慧成货币 A	50~100
	大成慧成货币 B	0
	大成慧成货币 E	0
	合计	50~100
本基金基金经理持有本开	大成慧成货币 A	0

开放式基金	大成慧成货币 B	0
	大成慧成货币 E	0
	合计	0

## § 9 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	5,669,000.29	1,003,930,121.39	22,943.11
本报告期基金总申购份额	18,787,859.63	5,512,368,329.70	1,598,347.60
减：本报告期基金总赎回份额	6,569,049.24	1,395,321,956.85	1,015,621.22
本报告期基金拆分变动份额 （份额减少以“-”填列）	-	-	-
本报告期末基金份额总额	17,887,810.68	5,120,976,494.24	605,669.49

注：红利再投资和基金转换转入作为本期申购资金的来源，统一计入本期总申购份额，基金转换转出作为本期赎回资金的支付，统一计入本期总赎回份额，不单独列示。

## § 10 重大事件揭示

### 10.1 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。

### 10.2 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

1、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。基金管理人于 2017 年 5 月 17 日发布了《大成基金管理有限公司关于总经理继续代为履行督察长职务的公告》，经公司第六届董事会第二十六次会议审议通过，决定继续由总经理罗登攀先生代为履行督察长职务。代为履职的时间自董事会决议通过之日起不超过 90 日。

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。

### 10.3 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、基金托管业务的诉讼事项。

### 10.4 基金投资策略的改变

基金投资策略在本报告期内没有重大改变。

### 10.5 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）。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。

### 10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期，本基金管理人、托管人涉及托管业务的部门及高级管理人员未受到监管部门稽查或处罚。

## 10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

### 10.7.1 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。

本报告期内本基金新增席位：无。本报告期内本基金退租席位：无。

### 10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

无。

## 10.8 偏离度绝对值超过 0.5%的情况

本基金报告期内未出现偏离度绝对值超过0.5%的情况。



## § 11 影响投资者决策的其他重要信息

## 11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过 20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比
机构	1	20170101-20170630	1,003,681,462.84	5,095,075,582.87	1,018,774,929.87	5,079,982,115.84	98.84%
个人	-	-	-	-	-	-	-
产品特有风险							
当基金份额持有人占比过于集中时，可能会因某单一基金份额持有人大额赎回而引发基金净值剧烈波动的风险，甚至有可能引起基金的流动性风险，基金管理人可能无法及时变现基金资产以应对基金份额持有人的赎回申请，基金份额持有人可能无法及时赎回持有的全部基金份额。							

## 11.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。
----

大成基金管理有限公司

2017 年 8 月 24 日