

基金管理人：大成基金管理有限公司

基金托管人：中国光大银行股份有限公司

送出日期：2012年3月28日

\$1 重要提示

基金管理人的董事、监事及本基金代销机构在对本报告所载资料进行复核时，对其内容的真实性、准确性、完整性和独立性承担法律责任。本报告经三分之二以上独立董事签字并自董事会上报后，由董事长签发。

基金托管人中国光大银行股份有限公司以下简称“光大银行”对基金合同的复核意见，于2012年3月23日复核了本报告中基金资产净值的计算、净值表现、申购赎回价格、投资组合报告等内容，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财产，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。

本公司提醒投资者注意以下风险公告，投资有风险，投资者在作出投资决策前应仔细阅读年度报告全文。

本公司中财数据信息部预计，安永华明会计师事务所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2011年1月1日起至2012年1月31日止。

\$2 基金简介

基金简称	大成货币A
基金代码	000005
基金运作方式	契约型开放式
起始基金合同生效日	2005年6月1日
基金管理人	大成基金管理有限公司
基金托管人	中国光大银行股份有限公司
报告期天数	365天
基金合同存续期间	不适用
下属分级基金的基金简称	大成货币A
下属分级基金的交易代码	000005
报告期末下属分级基金的份额总额	1,653,457,848.31份
大成货币B	大成货币B
000005	001005
7,291,924,293.30份	

2.2 基金产品说明

本基金在保持本金安全和流动性基础上追求较高的当期收益。

本基金通过平均剩余期限策略、类属配置和品种选择三个层次进行投资管理，以实现超越投资基准的投资目标。

该产品的投资对象为：

投资比例特征

本基金为货币市场基金，属于证券投资基金中的低风险品种；预期收益和风险都低于债券基金、混合基金、股票基金。

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 中国光大银行股份有限公司

姓名 杜鹤 石立平

信息披露负责人

联系电话 0755-83183388

电子邮箱 dsheng@cdcfund.com.cn

客户服务电话 4008885555

传真 0755-8319588

2.4 信息披露方式

基金年度报告正文的管理人互联网网址 http://www.cdcfund.com

深圳证券交易所深证大通07088号银行大厦12层大成基金管理有限公司

基金年度报告备置地点 北京市西城区复兴门内大街9号光大大厦

中国光大银行报告厅接待业务室

\$3 主要财务指标、基金表现及表现情况分析

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 相关期间和指标

2011年 2010年

2009年

本期已实现收益 26,959,582.86 36,083,136.05 7,364,720.37

33,095,455.54 14,596,948.64 39,993,559.03

本期利润 26,959,582.86 36,083,136.05 7,364,720.37

33,095,455.54 14,596,948.64 39,993,559.03

本年初利润 率 3.5069% 3.7550% 1.8066% 2.0526% 1.3162% 1.5599%

3.1.2 相关数据

2011年末 2010年末

2009年末

期初基金资产净值 1,653,457,848.31 7,291,924,293.30

3.2.1 相关指标

期初基金资产净值与其同期业绩比较基准收益率的比较

大成货币A

阶段 份额净值收益 收益率(%) 基准收益率(%) 基准收益率(%)

单利(年化) ① ② ③ ④

过去三个月 0.0526% 0.0030% 0.1260% 0.0000% 0.8266% 0.0000%

过去六个月 1.8389% 0.0016% 0.2521% 0.0000% 1.5867% 0.0001%

过去一年 3.5069% 0.0040% 0.4607% 0.0019% 3.0372% 0.0009%

过去三年 6.7639% 0.0047% 1.1897% 0.0026% 5.5741% 0.0004%

过去五年 14.2930% 0.0075% 5.9847% 0.0036% 8.3066% 0.0004%

自基金合同生效以来基金累计净值收益变化与其同期业绩比较基准收益率变化的比较

3.2.2 基金合同生效以来基金累计净值收益变化及其与同期业绩比较基准收益率变化的比较

大成货币B

阶段 份额净值收益 收益率(%) 基准收益率(%) 基准收益率(%)

单利(年化) ① ② ③ ④

过去三个月 0.0526% 0.0030% 0.1260% 0.0000% 0.8266% 0.0000%

过去六个月 1.8389% 0.0016% 0.2521% 0.0000% 1.5867% 0.0001%

过去一年 3.5069% 0.0040% 0.4607% 0.0019% 3.0372% 0.0009%

过去三年 6.7639% 0.0047% 1.1897% 0.0026% 5.5741% 0.0004%

过去五年 14.2930% 0.0075% 5.9847% 0.0036% 8.3066% 0.0004%

自基金合同生效以来基金累计净值收益变化与其同期业绩比较基准收益率变化的比较

3.3 过去三年基金的利润分配情况

单位：人民币元

3.4 基金管理人及基金经理

基金管理人及基金经理的经

验及从业资格

4.1 基金管理人及基金经理的经

验及从业资格

4.2 基金经理

姓名 职务 任职日期 离任日期

王立女士 本基金基金经理 2007年1月12日 10年

4.3 管理人报告

4.3.1 重要提示

基金管理人的董事、监事及本基金代销机构在对本报告所载资料进行复核时，对其内容的真实性、准确性、完整性和独立性承担法律责任。本报告经三分之二以上独立董事签字并自董事会上报后，由董事长签发。

基金托管人中国光大银行股份有限公司以下简称“光大银行”对基金合同的复核意见，于2012年3月23日复核了本报告中基金资产净值的计算、净值表现、申购赎回价格、投资组合报告等内容，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财产，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。

本公司提醒投资者注意以下风险公告，投资有风险，投资者在作出投资决策前应仔细阅读年度报告全文。

本公司中财数据信息部预计，安永华明会计师事务所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2011年1月1日起至2012年1月31日止。

4.3.2 年度报告摘要

大成货币市场证券投资基金管理

2011 年度 报告摘要

2011年12月31日

注:1、任职日期,离任日期为基金管理人作出决定之日起。

2、管理人对报告期内本基金运作合规性情况的说明

本基金报告期内,基金管理人严格按照《证券法》、《证券投资基金法》、《货币市场基金管理暂行规定》、《基金合同》、《基金托管协议》以及有关法律法规的规定,履行了基金管理人职责,没有损害基金份额持有人的利益。

本基金报告期内,基金管理人没有发生重大违法违规行为,没有损害基金份额持有人利益的情况。

本基金报告期内,基金管理人没有进行关联交易,没有损害基金份额持有人利益的情况。

本基金报告期内,基金管理人没有从事内幕交易、操纵证券交易价格等禁止行为,没有损害基金份额持有人利益的情况。

本基金报告期内,基金管理人没有从事不公平交易和利益输送等异常交易行为,没有损害基金份额持有人利益的情况。

本基金报告期内,基金管理人没有从事利用未公开信息交易行为,没有损害基金份额持有人利益的情况。

本基金报告期内,基金管理人没有从事不公平交易和利益输送等异常交易行为,没有损害基金份额持有人利益的情况。