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8月25日

大成货币市场证券投资基金

2012 半年度 报告摘要

2012年6月30日

§1 重要提示

1.1 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。

基金托管人中国光大银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2012年08月21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2012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	大成货币	
基金主代码	090005	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2005年6月3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	
报告期末基金份额总额	3,037,475,582.90份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称:	大成货币A	大成货币B
下属分级基金的交易代码:	090005	091005
报告期末下属分级基金的份额总额	698,844,038.78份	2,338,631,544.12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	本基金通过平均剩余期限决策、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。
业绩比较基准	税后活期存款利率。
风险收益特征	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
信息披露负责人	姓名	杜鹏	石立平
	联系电话	0755-83183388	010-63639161
	电子邮箱	dupeng@dcfund.com.cn	shiliping@cebbank.com
客户服务电话		4008885558	95595
传真		0755-83199588	010-63639132

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	http://www.dcfund.com.cn
基金半年度报告备置地点	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/北京市西城区太平桥大街25号中国光大中心B座801中国光大银行投资与托管业务部

§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	大成货币A	大成货币B
3.1.1 期间数据和指标	报告期(2012年1月1日-2012年6月30日)	报告期(2012年1月1日-2012年6月30日)
本期已实现收益	11,715,609.95	34,538,576.69
本期利润	11,715,609.95	34,538,576.69
本期净值收益率	2.0376%	2.1601%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2012年6月30日)	
期末基金资产净值	698,844,038.78	2,338,631,544.12
期末基金份额净值	1.0000	1.0000

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,每月集中支付收益。

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。

3.2 基金表现

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

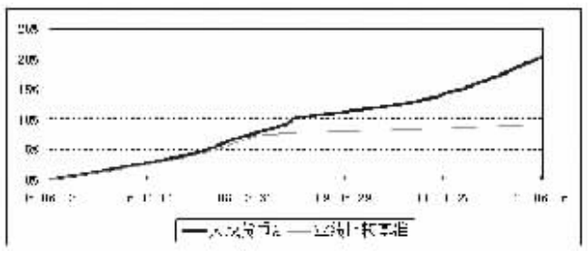
大成货币A

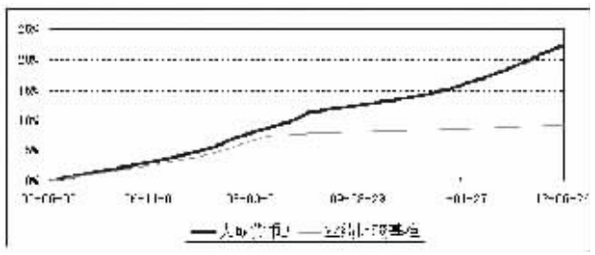
阶段	份额净值收益率①	份额净值收益率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	0.3104%	0.0039%	0.0347%	0.0001%	0.2757%	0.0038%
过去三个月	0.9267%	0.0025%	0.1180%	0.0001%	0.8087%	0.0024%
过去六个月	2.0376%	0.0036%	0.2423%	0.0001%	1.7953%	0.0035%
过去一年	3.9139%	0.0034%	0.4944%	0.0001%	3.4195%	0.0033%
过去三年	8.2423%	0.0049%	1.2535%	0.0002%	6.9888%	0.0047%
自基金合同生效起至今	20.2725%	0.0068%	9.1551%	0.0031%	11.1174%	0.0037%

大成货币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	0.3298%	0.0039%	0.0347%	0.0001%	0.2951%	0.0038%
过去三个月	0.9868%	0.0025%	0.1180%	0.0001%	0.8688%	0.0024%
过去六个月	2.1601%	0.0036%	0.2423%	0.0001%	1.9178%	0.0035%
过去一年	4.1641%	0.0034%	0.4944%	0.0001%	3.6697%	0.0033%
过去三年	9.0260%	0.0049%	1.2535%	0.0002%	7.7725%	0.0047%
自基金合同生效起至今	22.3391%	0.0068%	9.1551%	0.0031%	13.1840%	0.0037%

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、依据本基金合同规定,本基金投资于同一公司发行的短期企业债券的比例,不得超过基金资产净值的10%;存放在具有基金托管资格的同一商业银行的存款,不得超过基金资产净值的30%;存放在不具有基金托管资格的同一商业银行的存款,不得超过基金资产净值的5%;除发生巨额赎回的情形外,基金的投资组合中债券正回购的资金余额在每个交易日均不得超过基金资产净值的20%。因发生巨额赎回致使货币市场基金债券正回购的资金余额超过基金资产净值20%的,基金管理人应当在5个交易日内进行调整;基金持有的剩余期限不超过397天但剩余存续期超过397天的浮动利率债券的摊余成本总计不得超过当日基金资产净值的20%;投资组合的平均剩余期限在每个交易日不得超过180天。本基金在3个月的初始建仓期结束后,基金投资组合比例已达到本基金合同的相关规定要求。

2、为使本基金业绩与其业绩比较基准具有更强的可比性,经大成基金管理有限公司申请,并经中国证监会同意,自2008年6月1日起,本基金业绩比较基准由"税后一年期银行定期存款利率"变更为"税后活期存款利率"。本基金业绩比较基准收益率的历史走势图从2005年6月3日(基金合同生效日)至2008年5月31日为原业绩比较基准("税后一年期银行定期存款利率")的走势图,2008年6月1日起为变更后的业绩比较基准的走势图。

§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2012年6月30日,本基金管理人共管理3只封闭式证券投资基金:景宏证券投资基金、景福证券投资基金、大成优选股票型证券投资基金,1只ETF及1只ETF联接基金:深证成长40ETF及大成深证成长40ETF联接基金,1只创新型基金:大成景丰分级债券型证券投资基金,1只QDII基金:大成标普500等权重指数基金及21只开放式证券投资基金: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、大成中证内地消费主题指数证券投资基金、大成可转债增强债券型证券投资基金、大成新锐产业股票型证券投资基金、大成景恒保本混合型证券投资基金。

4.1.2 基金经理简介

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	2007年1月12日	-	10年	经济学硕士。曾任职于中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日起担任大成货币市场证券投资基金基金经理。2009年5月23日起兼任大成债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。

3、本基金经理于2012年5月2日起休产假。在产假期间,由本公司基金经理陶铄先生代为管理本基金。上述事项已按有关法规进行披露并向中国证监会深圳证监局备案。

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》、《大成货币市场证券投资基金基金合同》和其他有关法律法规的规定,在基金管理运作中,大成货币市场证券投资基金的投资范围、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。2012年上半年,公司旗下主动投资组合间股票交易存在两笔同日反向交易,与市场成交情况比较,两笔交易成交均价与市场均价不存在明显差异,且同日反向交易成交较少的单边交易量占该股当日市场成交量比例均低于1%。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,其中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%的情况有3次,原因是指数型投资组合投资策略需要;投资组合间存在债券同日反向交易,但投资组合间的交易价格比较一致,与市场成交均价较为接近,且各投资组合成交量占市场成交量比例不足5%,基于此公司认为,投资组合间债券的同日反向交易不存在异常交易行为;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;而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,投资组合间不存在利益输送的可能性。

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

2012年上半年,随着通胀的下行,及经济增长下行压力的增大,货币政策逐步走向宽松,银行超储率自一季末提升到2%以上。此外,随着欧债危机的逐步加深,美元相对于欧元走强,使得人民币相对于美元也出现贬值预期,这导致了实际结汇数量的减少。今年以来外汇占款比去年同期减少80%,下调存款准备金率必要性明显增加,央行分别在一、二季度两次下调存款准备金,并在二季度下调基准利率一次。伴随着资金面的宽松,主要货币市场利率均出现明显下行。7天回购利率逐月下降,从年初的月均4.92%最低降至5月的2.95%。3个月Shibor利率年初月平均5.48%,6月份降至4.1%,降幅达到140bp。随着资金面的宽松,货币市场收益率也出现明显下降,1年期央票利率下行约80个基点,各评级短融收益率下行幅度达到150-250个基点。受益于较高的票息以及利差的下降,浮息债持有回报好于固息债。

本基金在上半年的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。在实际操作上,本基金根据资金面逐步改善、市场收益率下降以及基金规模变动因素的实际情况,上半年适当提高了组合剩余期限和久期,获取了部分资本利得和较高的利息收入。在具体投资品种上,上半年本基金仍然看重银行存款和短期融资券的投资价值, 增加投资并获利了结了部分一年期以内的央票和国债,增持了部分短期融资券,保持了适当的信用债投资比例,同时增持了浮动利率债券品种,以获取较高利息收入并受益于市场的上涨。由于套利空间逐步缩小,我们减少了逆回购操作。

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2.0376%,B类净值收益率2.1601%, 期间业绩比较基准收益率为0.2423%。本基金着眼于货币基金流动性管理的本义,在投资管理过程中始终贯彻稳健操作的原则,合理安排投资组合和期限结构,在保证流动性的前提下通过积极主动管理提高组合投资收益。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望下半年,虽然上半年末的资金面紧张超出预期,但我们预计货币政策宽松的主基调不变,下半年存款准备金率有望下调2-3次, 主要的货币市场利率在经历季末流动性的阶段性紧张后仍将继续下行,7天回购利率均值有望回落至2.5%-3%,3个月Shibor利率也会随着资金面的宽松进一步回落。短融在经过上季末调整后具备一定的配置价值,此外Shibor浮息债票面利率仍高于固息债,点差风险不大,也值得关注。而银行在信贷有效需求不足的背景下,对存款的需求也将明显下降,银行存款的投资吸引力将明显下降。

本基金在下半年将密切关注金融市场的变化,在稳健操作的原则下,高度重视组合的流动性管理和安全性管理。基于市场基本面和资金面的判断,本基金下半年将继续保持投资组合的高流动性,严格控制信用风险、利率风险和流动性风险。在具体投资品种上,本基金投资仍将以央票、金融债、短期融资券和浮动利率债券为主,在配置为主的基础上尽量利用资金面波动对收益率造成的影响获得交易性集会。同时继续充分利用市场机会进行利差套利,为投资人获取更多的无风险收益。

非常感谢基金份额持有人对本基金的长期信任和支持,作为现金管理工具,我们将始终把确保基金资产的安全性和基金收益的稳定性放在首位,在严格控制流动性风险的基础上,坚持规范运作、审慎投资的原则为基金份额持有人争取长期稳定的投资回报。

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,截止报告期末未与外部估值定价服务机构签约。

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,按日结转份额,每月集中支付收益。本报告期内本基金应分配利润46,254,186.64元,报告期内已分配利润46,254,186.64元。

§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

2012年上半年,中国光大银行在大成货币市场基金托管过程中,严格遵守了《证券投资基金法》、《证券投资基金运作管理办法》、《证券投资基金信息披露管理办法》及其他法律法规、相关实施准则、基金合同、托管协议等的规定,依法安全保管了基金的全部资产,对大成货币市场基金的投资运作进行了全面的会计核算和应有的监督,及时提出了意见和建议。同时,按规定如实、独立地向监管机构提交了本基金运作情况报告,没有发生任何损害基金份额持有人利益的行为,诚实信用、勤勉尽责地履行了作为基金托管人所应尽的义务。

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

2012年上半年,中国光大银行依据《证券投资基金法》、《证券投资基金运作管理办法》及其他法律法规、相关实施准则、基金合同、托管协议等的规定,对基金管理人——大成基金管理有限公司的投资运作、信息披露等行为进行了复核、监督,未发现基金管理人在投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支等方面存在损害基金份额持有人利益的行为。

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

本托管人依法对基金管理人——大成基金管理有限公司编制的"大成货币市场证券投资基金2012年半年度报告"进行了复核,认为报告中相关财务指标、净值表现、财务会计报告、投资组合报告等内容是真实、准确和完整的。

§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:大成货币市场证券投资基金

报告截止日:2012年6月30日

单位:人民币元

资 产	本期末 2012年6月30日	上年度末 2011年12月31日
资 产:		
银行存款	1,847,798,780.24	6,803,924,593.63
结算备付金	-	-
存出保证金	-	-
交易性金融资产	590,300,693.34	629,990,542.75
其中:股票投资	-	-
基金投资	-	-
债券投资	590,300,693.34	629,990,542.75
资产支持证券投资	-	-
衍生金融资产	-	-
买入返售金融资产	685,200,237.80	1,205,733,848.60
应收证券清算款	-	-
应收利息	14,970,450.52	12,531,984.56
应收股利	-	-
应收申购款	297,077,391.71	298,220,879.38
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	-
资产总计	3,435,347,553.61	8,950,401,848.92
负债和所有者权益	本期末 2012年6月30日	上年度末 2011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	144,999,727.50	-
应付证券清算款	249,973,691.90	-
应付赎回款	-	-
应付管理人报酬	630,407.57	561,185.50
应付托管费	191,032.65	170,056.22
应付销售服务费	109,845.52	126,285.71
应付交易费用	20,790.93	13,557.83
应交税费	1,033,100.00	1,033,100.00
应付利息	28,602.74	-
应付利润	633,087.40	2,680,422.05
递延所得税负债	-	-
其他负债	251,684.50	435,100.00
负债合计	397,871,970.71	5,019,707.31
所有者权益:		
实收基金	3,037,475,582.90	8,945,382,141.61
未分配利润	-	-
所有者权益合计	3,037,475,582.90	8,945,382,141.61
负债和所有者权益总计	3,435,347,553.61	8,950,401,848.92

注:报告截止日2012年6月30日,基金份额净值1.0000元,基金份额总额3,037,475,582.90份。其中,大成货币A的份额为698,844,038.78份,大成货币B的份额为2,338,631,544.12份。

6.2 利润表

会计主体:大成货币市场证券投资基金

本报告期:2012年1月1日至2012年6月30日

单位:人民币元

项 目	本期 2012年1月1日至2012年6月30日	上年度可比期间 2011年1月1日至2011年6月30日
一、收入	52,621,277.81	46,199,904.22
1.利息收入	49,907,333.92	45,147,505.22
其中:存款利息收入	32,682,566.82	19,687,345.85
债券利息收入	11,627,573.97	14,716,629.68
资产支持证券利息收入	-	-
买入返售金融资产收入	5,597,193.13	10,743,529.69
其他利息收入	-	-
2.投资收益(损失以"-"填列)	2,713,943.89	1,052,399.00
其中:股票投资收益	-	-
基金投资收益	-	-
债券投资收益	2,713,943.89	1,052,399.00
资产支持证券投资收益	-	-
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	6,367,091.17	8,132,589.81
1.管理人报酬	3,635,687.82	4,007,954.95
2.托管费	1,101,723.64	1,214,531.74
3.销售服务费	798,654.08	1,469,342.20
4.交易费用	-	-
5.利息支出	571,707.03	1,177,346.82
其中:卖出回购金融资产支出	571,707.03	1,177,346.82
6.其他费用	259,318.60	263,414.10
三、利润总额(亏损总额以"-"号填列)	46,254,186.64	38,067,314.41
减:所得税费用	-	-
四、净利润(净亏损以"-"号填列)	46,254,186.64	38,067,314.41

6.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体:大成货币市场证券投资基金

本报告期:2012年1月1日 至 2012年6月30日

单位:人民币元

项目	本期 2012年1月1日至2012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)	8,945,382,141.61	-	8,945,382,141.61
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	46,254,186.64	46,254,186.64
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)	-5,907,906,558.71	-	-5,907,906,558.71
其中:1.基金申购款	8,228,506,174.16	-	8,228,506,174.16
2.基金赎回款	-14,136,412,732.87	-	-14,136,412,732.87
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)	-	-46,254,186.64	-46,254,186.64
五、期末所有者权益(基金净值)	3,037,475,582.90	-	3,037,475,582.90
项目	上年度可比期间 2011年1月1日至2011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)	1,652,821,766.73	-	1,652,821,766.73
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	38,067,314.41	38,067,314.41
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)	-411,732,480.82	-	-411,732,480.82
其中:1.基金申购款	14,227,925,772.48	-	14,227,925,772.48
2.基金赎回款	-14,639,658,253.30	-	-14,639,658,253.30
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)	-	-38,067,314.41	-38,067,314.41
五、期末所有者权益(基金净值)	1,241,089,285.91	-	1,241,089,285.91

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:

基金管理公司负责人-王颖 主管会计工作负责人-刘彩晖 会计机构负责人-范瑛

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、税项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、税项与最近一期年度报告相一致。

6.4.2 关联方关系

6.4.2.1 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。

6.4.2.2 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	基金管理人、注册登记机构、基金销售机构
中国光大银行股份有限公司("中国光大银行")	基金托管人、基金代销机构
中泰信托有限责任公司("中泰信托")	基金管理人股东
光大证券股份有限公司("光大证券")	基金管理人股东、基金代销机构
中国银河投资管理有限公司	基金管理人股东
广东证券股份有限公司	基金管理人股东

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。

6.4.3 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.3.1 通过关联方交易单元进行的交易

无.

6.4.3.2 关联方报酬

6.4.3.2.1 基金管理费

单位:人民币元

项目	本期 2012年1月1日至2012年6月30日	上年度可比期间 2011年1月1日至2011年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	3,635,687.82	4,007,954.95
其中:支付销售机构的客户维护费	457,692.30	897,761.72

注:基金管理费按前一日的基金资产净值的0.33%的年费率计提。计算方法 如下:

H=E×0.33%/当年天数

H为每日应支付的基金管理费

E为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计提,按月支付。由基金管理人向基金托管人发送基金管理费划付指令,基金托管人复核后于次月首日起5个工作日内从基金资产中一次性支付给基金管理人。

6.4.3.2.2 基金托管费

单位:人民币元

项目	本期 2012年1月1日至2012年6月30日	上年度可比期间 2011年1月1日至2011年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	1,101,723.64	1,214,531.74

注:基金托管费按前一日的基金资产净值的0.10%的年费率计提。计算方法如下:

H=E×0.10%/当年天数

H为每日应支付的基金托管费

E为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计提,按月支付。由基金管理人向基金托管人发送基金托管费划付指令,基金托管人复核后于次月首日起5个工作日内从基金资产中一次性支付给基金托管人。

6.4.3.2.3 销售服务费

获得销售服务费的各关联方名称	本期 2012年1月1日至2012年6月30日 当期发生的基金应支付的销售服务费		
	大成货币A	大成货币B	合计
大成基金管理有限公司	89,362.66	59,315.98	148,678.64
中国光大银行	38,242.90	545.28	38,788.18
光大证券	1,212.60	29.91	1,242.51
合计	128,818.16	59,891.17	188,709.33
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2011年1月1日至2011年6月30日 当期发生的基金应支付的销售服务费		
	大成货币A	大成货币B	合计
大成基金管理有限公司	126,587.25	17,266.09	143,853.34
中国光大银行	43,500.65	54.76	43,555.41
光大证券	5,835.86	-	5,835.86
合计	175,923.76	17,320.85	193,244.61

注:基金销售服务费可用于本基金的市场推广、销售、服务等各项费用,由基金管理人支配使用。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。计算方法如下:

H=E×R/当年天数

H为每日应支付的基金销售服务费

E为前一日的基金资产净值

R为该级基金份额的销售服务年费率

基金销售服务费每日计算,逐日累计至每个月月末,按月支付,基金管理人应于次月前两个工作日内将上月基金销售服务费的计算结果书面通知基金托管人并做出划付指令;基金托管人应在收到计算结果后当日完成复核,并于当日从基金资产中一次性支付给管理人。

6.4.3.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

无.

6.4.3.4 各关联方投资本基金的情况

6.4.3.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

本基金的基金管理人于本报告期内及上年度可比期间内均未投资于本基金.

6.4.3.4.2 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

大成货币A

份额单位:份

关联方名称	本期末 2012年6月30日		上年度末 2011年12月31日	
	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例
-	-	-	-	-

大成货币B

份额单位:份

关联方名称	本期末 2012年6月30日		上年度末 2011年12月31日	
	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例
光大证券	-	-	50,006,348.71	0.56%

注:其他关联方投资本基金的费率标准严格按照法律法规及交易所相关规定计算并支付。

6.4.3.5 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 2012年1月1日至2012年6月30日		上年度可比期间 2011年1月1日至2011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
中国光大银行	697,798,780.24	12,061,881.15	150,617,909.37	19,485,414.25

注:本基金的银行存款由基金托管人中国光大银行保管,并分别按银行间同业利率及协议利率计息。

6.4.3.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本报告期及上年度可比期内本基金未参与关联方承销的证券。

6.4.3.7 其他关联交易事项的说明

无。

6.4.4 期末(2012年6月30日)本基金持有的流通受限证券

6.4.4.1 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。

6.4.4.2 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。

6.4.4.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.4.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末2012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144,999,727.50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
090205	09国开05	2012-7-2	101.24	500,000	50,621,386.90
1101094	11央行票据94	2012-7-2	98.52	1,000,000	98,521,935.91
合计				1,500,000	149,143,322.81

6.4.4.3.2 交易所市场债券正回购

无。

§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	590,300,693.34	17.18
	其中:债券	590,300,693.34	17.18
	资产支持证券	-	0.00
2	买入返售金融资产	685,200,237.80	19.95
	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	1,847,798,780.24	53.79
4	其他各项资产	312,047,842.23	9.08
5	合计	3,435,347,553.61	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	2.58	
	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	144,999,727.50	4.77
	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。

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	74
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	117
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	17

报告期内投资组合平均剩余期限超过180天情况说明

本报告期内无投资组合平均剩余期限超过180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	53.11	13.00
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	0.99	0.00
2	30天(含)—60天