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:2013年3月26日

大成货币市场证券投资基金

2012年度报告摘要

2012年12月31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。

基金托管人中国光大银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2013年03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。

本报告中财务资料已经审计。安永华明会计师事务所(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2012年01月01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	23,659,528,685.68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	5,122,121,194.11份	18,537,407,491.57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 北京市西城区复兴门外大街6号光大大厦 中国光大银行投资与托管业务部

§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	2012年		2011年		2010年	
	大成货币A	大成货币B	大成货币A	大成货币B	大成货币A	大成货币B
本期已实现收益	28,439,582.86	82,030,725.78	26,959,582.86	36,083,136.05	7,364,720.37	33,095,455.54
本期利润	28,439,582.86	82,030,725.78	26,959,582.86	36,083,136.05	7,364,720.37	33,095,455.54
本期净值收益率	3.7661%	4.0149%	3.5069%	3.7550%	1.8066%	2.0525%
3.1.2 期末数据和指标	2012年末		2011年末		2010年末	
期末基金资产净值	5,122,121,194.11	18,537,407,491.57	1,653,457,848.31	7,291,924,293.30	435,465,622.13	1,217,356,144.60
期末基金份额净值	1.0000	1.0000	1.0000	1.0000	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。

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

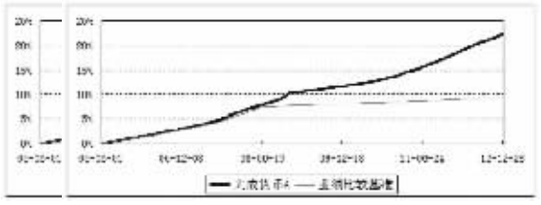
大成货币A

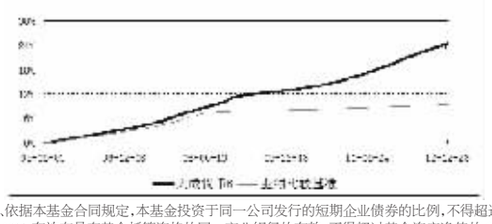
阶段	份额净值收益率①	份额净值收益率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	0.8771%	0.0016%	0.0880%	0.0000%	0.7891%	0.0016%
过去六个月	1.6940%	0.0024%	0.1766%	0.0000%	1.5174%	0.0024%
过去一年	3.7661%	0.0032%	0.4190%	0.0002%	3.3471%	0.0030%
过去三年	9.3455%	0.0045%	1.2487%	0.0002%	8.0968%	0.0043%
过去五年	14.9205%	0.0072%	3.6213%	0.0027%	11.2992%	0.0045%
自基金合同生效起至今	22.3099%	0.0066%	9.3317%	0.0031%	12.9782%	0.0035%

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
过去三个月	0.9367%	0.0016%	0.0880%	0.0000%	0.8487%	0.0016%
过去六个月	1.8155%	0.0024%	0.1766%	0.0000%	1.6389%	0.0024%
过去一年	4.0149%	0.0032%	0.4190%	0.0002%	3.5959%	0.0030%
过去三年	10.1357%	0.0045%	1.2487%	0.0002%	8.8870%	0.0043%
过去五年	16.3070%	0.0072%	3.6213%	0.0027%	12.6857%	0.0045%
自基金合同生效起至今	24.5602%	0.0066%	9.3317%	0.0031%	15.2285%	0.0035%

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

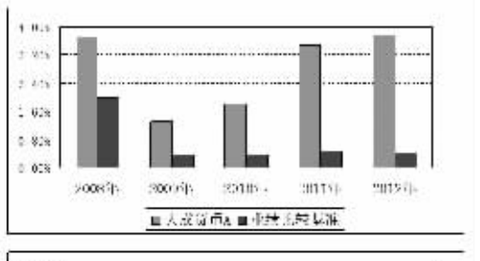


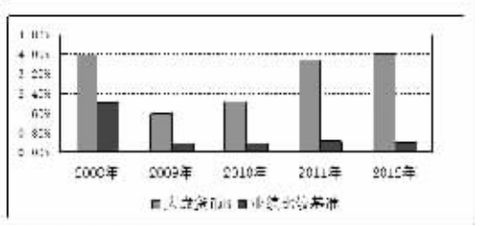


注:1、依据本基金合同规定,本基金投资于同一公司发行的短期企业债券的比例,不得超过基金资产净值的10%;存放在具有基金托管资格的同一商业银行的存款,不得超过基金资产净值的30%;存放在不具有基金托管资格的同一商业银行的存款,不得超过基金资产净值的5%;除发生巨额赎回的情形外,基金的投资组合中债券正回购的资金余额在每个交易日均不得超过基金资产净值的20%。因发生巨额赎回致使货币市场基金债券正回购的资金余额超过基金资产净值20%的,基金管理人应当在5个交易日内进行调整;基金持有的剩余期限不超过397天但剩余存续期超过397天的浮动利率债券的摊余成本总计不得超过当日基金资产净值的20%;投资组合的平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。

3.2.3 过去五年基金每年净值收益率及其与同期业绩比较基准收益率的比较





3.3 过去三年基金的利润分配情况

单位:人民币元

大成货币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
2012	28,310,137.19	-	129,445.67	28,439,582.86	
2011	26,518,792.74	-	440,790.12	26,959,582.86	
2010	7,397,553.39	-	-32,833.02	7,364,720.37	
合计	62,226,483.32	-	537,402.77	62,763,886.09	

大成货币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
2012	81,910,189.70	-	120,536.08	82,030,725.78	
2011	33,994,882.45	-	2,088,253.60	36,083,136.05	
2010	33,480,937.30	-	-385,481.76	33,095,455.54	
合计	149,386,009.45	-	1,823,307.92	151,209,317.37	

§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12月31日,本基金管理人共管理2只封闭式证券投资基金:景宏证券投资基金及景福证券投资基金,2只ETF及2只ETF联接基金:深证成长40ETF、大成深证成长40ETF联接基金、中证500沪市ETF及大成中证500沪市ETF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25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、大成优选股票型证券投资基金(LOF)、大成现金增利货币市场基金、大成月添利理财债券型证券投资基金、大成理财21天债券型发起式基金。

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	2007年1月12日	-	11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。2012年11月20日起任大成现金增利货币市场基金基金经理。2013年2月1日起兼任大成月添利理财债券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。

3、本基金于2013年3月7日起增聘李达夫先生为本基金基金经理,该事项已按规定在中国证券业协会办理变更手续,报中国证券监督管理委员会深圳监管局备案,并按规定进行公开披露。

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,资产管理人制订了《大成基金管理有限公司公平交易制度》及《大成基金管理有限公司异常交易监控与报告制度》。资产管理人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 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分析及相应交易情形的分析结果表明: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,但参与交易所公开竞价同日同向交易成交较少的单边交易量均不超过该股当日成交量10%。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。

4.3.3 异常交易行为的专项说明

2012年基金管理人旗下主动投资组合间股票交易存在6笔同日反向交易,原因是投资组合投资策略需要,且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均不超过该股当日成交量5%。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,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9次,原因是指数型投资组合投资策略需要。投资组合间债券交易存在4笔同日反向交易,原因是投资组合投资策略需要,且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均不超过该股当日成交量5%。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

2012年随着通货膨胀的逐级回落,货币政策逐步走向宽松,央行在上半年两次降低存款准备金率,两次降低基准利率,资金利率有明显下降,银行7天回购利率均值由年初的4%以上回落至3%附近,3个月Shibor利率下行150个基点,高评级短融收益率下行150-200个基点,中低评级短融下行250-300个基点。下半年,央行对流动性的调控方式发生转变,以逆回购为主的价格型政策手段取代了过往以准备金政策为主的数量型手段,7天回购利率维持在3%-3.5%的区间,其它主要货币市场利率也筑底回升,3个月shibor利率回升20个基点,各评级短融回升70-100个基点。

2012年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。具体来说,本基金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,辅以情景分析等技术和数量手段进行资产配置决策。针对货币市场资金面的波动情况,灵活调节各类资产投资比例以及投资期限,做好流动性管理,同时进行主动和积极的收益管理。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。

4.4.2 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3.7661%,B类净值收益率4.0149%,期间业绩比较基准收益率为0.4190%。

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2013年,经济弱复苏可期,货币政策重在保持货币环境的稳定,大幅放松的可能性不大。从影响超储率的几个主要因素看,2013年全年央票到期量为10340亿,略高于2012年。财政赤字规模相比2012年有望小幅扩大,财政存款的总投放量也相应高于2012年。资金面的不确定性主要来自于外汇占款的变化,2012年外汇占款仅增加不到5000亿,较2011年减少80%。预计2013年外汇占款将出现恢复性增长,但国际资本流动的变化将对外汇占款的分布产生较大影响。预计回购利率全年均值可能略低于2012年,央行创新工具的使用将有助于缓平资金面的波动。央票全部到期将使短期利率品种的供给极度稀缺,作为替代品种的短期金融债收益率预计有较大下行空间。信用债风险溢价的回落将使短融等品种难以在2013年再获得超额收益,但国开行发行机制的创新可能提高浮息债的流动性并带来交易型机会。

本基金在2013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以及投资人结构变化的判断,本基金2013年将继续保持投资组合的高流动性,严格控制利率风险和流动性风险。在具体投资品种上,本基金投资将以金融债、短期融资券和浮动利率债券为主,同时继续充分利用市场机会进行利差套利。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110,470,308.64元,报告期内已分配利润110,470,308.64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年度,中国光大银行股份有限公司在大成货币市场证券投资基金托管过程中,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,对大成货币市场证券投资基金的投资运作进行了全面的会计核算和应有的监督,对发现的问题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年度,中国光大银行股份有限公司依据《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,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。该基金在运作中遵守了有关法律法规的要求,各重要方面的运作也能够严格按照基金合同的规定进行。该基金在运作中遵守了《证券投资基金法》等有关法律法规的要求;各重要方面由投资管理人依据基金合同及实际运作情况进行处理。

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

中国光大银行股份有限公司依法对基金管理人——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年年度报告”进行了复核,报告中相关财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容真实、准确、完整。

§6 审计报告

本基金2012年年度财务会计报告已经安永华明会计师事务所(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:大成货币市场证券投资基金

报告截止日:2012年12月31日

单位:人民币元

资 产	本期末 2012年12月31日	上年度末 2011年12月31日
资 产:		
银行存款	15,973,744,338.96	6,803,924,593.63
结算备付金	-	-
存出保证金	-	-
交易性金融资产	1,920,016,337.67	629,990,542.75
其中:股票投资	-	-
基金投资	-	-
债券投资	1,920,016,337.67	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	6,224,480,968.98	1,205,733,848.60
应收证券清算款	-	-
应收利息	51,688,727.55	12,531,984.56
应收股利	-	-
应收申购款	1,168,133.44	298,220,879.38
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	-
资产总计	24,171,098,506.60	8,950,401,848.92
负债和所有者权益	本期末 2012年12月31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	303,799,648.10	-
应付证券清算款	200,000,000.00	-
应付赎回款	-	-
应付管理人报酬	2,220,022.10	561,185.50
应付托管费	672,733.98	170,056.22
应付销售服务费	502,095.43	126,285.71
应付交易费用	74,489.62	13,557.83
应交税费	1,033,100.00	1,033,100.00
应付利息	32,127.89	-
应付利润	2,930,403.80	2,680,422.05
递延所得税负债	-	-
其他负债	305,200.00	435,100.00
负债合计	511,569,820.92	5,019,707.31
所有者权益:		
实收基金	23,659,528,685.68	8,945,382,141.61
未分配利润	-	-
所有者权益合计	23,659,528,685.68	8,945,382,141.61
负债和所有者权益总计	24,171,098,506.60	8,950,401,848.92

注:报告截止日2012年12月31日,A级基金份额净值1.0000元,基金份额总额5,122,121,194.11份;B级基金份额净值1.0000元,基金份额总额18,537,407,491.57份。基金份额总额23,659,528,685.68份。

7.2 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12月31日

单位:人民币元

项 目	本期 2012年1月1日至2012年12月31日	上年度可比期间 2011年1月1日至2011年12月31日
一、收入	130,264,198.36	75,507,813.95
1.利息收入	126,254,490.92	73,721,661.58
其中:存款利息收入	81,176,749.71	32,369,244.43
债券利息收入	29,868,475.48	27,422,983.30
资产支持证券利息收入	-	-
买入返售金融资产收入	15,209,265.73	13,929,433.85
其他利息收入	-	-
2.投资收益(损失以“-”填列)	4,009,707.44	1,736,152.37
其中:股票投资收益	-	-
基金投资收益	-	-
债券投资收益	4,009,707.44	1,736,152.37
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)	-	50,000.00
减:二、费用	19,793,889.72	12,465,095.04
1.管理人报酬	9,262,016.43	6,051,008.49
2.托管费	2,806,671.66	1,833,638.93
3.销售服务费	2,107,765.05	2,189,944.54
4.交易费用	-	-
5.利息支出	5,037,299.05	1,908,167.85
其中:卖出回购金融资产支出	5,037,299.05	1,908,167.85
6.其他费用	580,137.53	482,335.23
三、利润总额(亏损总额以“-”号填列)	110,470,308.64	63,042,718.91
减:所得税费用	-	-
四、净利润(净亏损以“-”号填列)	110,470,308.64	63,042,718.91

7.3 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12月31日

单位:人民币元

项目	本期 2012年1月1日至2012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)	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)	-	110,470,308.64	110,470,308.64
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)	14,714,146,544.07	-	14,714,146,544.07
其中:1.基金申购款	40,973,375,277.91	-	40,973,375,277.91
2.基金赎回款	-26,259,228,733.84	-	-26,259,228,733.84
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)	-	-110,470,308.64	-110,470,308.64
五、期末所有者权益(基金净值)	23,659,528,685.68	-	23,659,528,685.68
项目	上年度可比期间 2011年1月1日至2011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)	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)	-	63,042,718.91	63,042,718.91
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)	7,292,560,374.88	-	7,292,560,374.88
其中:1.基金申购款	25,093,172,351.60	-	25,093,172,351.60
2.基金赎回款	-17,800,611,976.72	-	-17,800,611,976.72
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)	-	-63,042,718.91	-63,042,718.91
五、期末所有者权益(基金净值)	8,945,382,141.61	-	8,945,382,141.61

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:

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

7.4 报表附注

7.4.1 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。

7.4.2 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	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。

7.4.3 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.3.1 通过关联方交易单元进行的交易

本基金本期内及上年度可比期间未发生通过关联方交易单元进行的交易。

7.4.3.2 关联方报酬

7.4.3.2.1 基金管理费

单位:人民币元

项目	本期 2012年1月1日至2012年12月31日	上年度可比期间 2011年1月1日至2011年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	9,262,016.43	6,051,008.49
其中:支付销售机构的客户维护费	1,294,906.96	1,263,149.41

注:1、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。

2、基金管理费于2012年末尚未支付的金额为2,220,022.10元,于2011年末尚未支付的金额为561,185.50元。

7.4.3.2.2 基金托管费

单位:人民币元

项目	本期 2012年1月1日至2012年12月31日	上年度可比期间 2011年1月1日至2011年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	2,806,671.66	1,833,638.93

注:1、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。

2、基金托管费于2012年末尚未支付的金额为672,733.98元,于2011年末尚未支付的金额为170,056.22元。

7.4.3.2.3 销售服务费

金额单位:人民币元

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12月31日		
	当期应支付的销售服务费		
	A级	B级	合计
大成基金管理有限公司	208,356.78	146,242.37	354,599.15
中国光大银行	73,987.07	802.73	74,789.80
光大证券	2,368.57	29.91	2,398.48
合计	284,712.42	147,075.01	431,787.43
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12月31日		
	当期应支付的销售服务费		
	A级	B级	合计
大成基金管理有限公司	230,381.48	33,000.05	263,381.53
中国光大银行	71,311.24	192.22	71503.46
光大证券	7,939.66	-	7,939.66
合计	309,632.38	33,192.27	342,824.65

注:1、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。

2、基金销售服务费于2012年末尚未支付大成基金管理有限公司A级基金份额为25,659.46元,B级基金份额为35,383.59元;尚未支付中国光大银行A级基金份额为5,711.38元,B级基金份额为202.20元;尚未支付光大证券A级基金份额为2,137.01元,B级基金份额为0.00元。于2011年末尚未支付大成基金管理有限公司A级基金份额为13,723.89元,B级基金份额为8,858.86元;尚未支付中国光大银行A级基金份额为12,007.20元,B级基金份额为137.46元;尚未支付光大证券A级基金份额为2,369.23元,B级基金份额为0.00元。

7.4.3.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金本期及上年度可比期间均未与关联方进行银行间同业市场债券(含回购)交易。

7.4.3.4 各关联方投资本基金的情况

7.4.3.4.1 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。

7.4.3.4.2 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

单位:份

关联方名称	本期末 2012年1月31日		上年度末 2011年1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

单位:份

关联方名称	本期末 2012年1月31日		上年度末 2011年1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	545,146,014.85	2.30%	50,006,348.71	0.56%

7.4.3.5 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12月31日		上年度可比期间 2011年1月1日至2011年12月31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	2,283,744,338.96	18,327,252.35	1,803,924,593.63	29,151,221.93

注:本基金