大成信用增利一年定期开放债券型证券投资基金

2014 第四季度 报告

2014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:中国农业银行股份有限公司
报告送出日期:2015年1月21日

§1 重要提示

基金管理人的董事会及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责任。

基金托管人中国农业银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2015年1月19日复核了本报告中的财务指标、净值表现和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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2014年10月1日起至12月31日止。

§2 基金产品概况

基金简称	大成信用增利一年债券	
交易代码	000426	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2014年1月28日	
报告期末基金份额总额	294,859,391.77份	
投资目标	在严格控制投资风险的基础上,力争获得高于业绩比较基准的投资业绩,使基金份额持有人资产获得长期稳定的增值。	
投资策略	本基金在封闭期与开放期采取不同的投资策略。 (一)封闭期投资策略 本基金通过综合分析国内外宏观经济形势、利率走势、资金供求关系、证券市场走势、流动性风险、信用风险和有关政策法规等因素,研判各类属固定收益类资产的预期收益和预期风险,确定各类金融资产的配置比例。本基金将灵活运用久期策略、收益率曲线策略、回购套利策略等多重投资策略,构建以信用债券为主的固定收益类资产组合。 (二)开放期投资策略 开放运作期内,本基金为保持较高的组合流动性,方便投资人安排投资,在遵守本基金有关投资限制与投资比例的前提下,将主要投资于高流动性的投资品种。	
业绩比较基准	同期中国人民银行公布的一年期定期存款基准利率(税后)+1.2%	
风险收益特征	本基金为债券型基金,属于证券投资基金中的较低风险品种,其预期风险与预期收益高于货币市场基金,低于混合型基金和股票型基金。	
基金管理人	大成基金管理有限公司	
基金托管人	中国农业银行股份有限公司	
下属两级基金的基金简称	大成信用增利一年债券A	大成信用增利一年债券C
下属两级基金的交易代码	000426	000427
报告期末下属两级基金的份额总额	227,174,756.69份	67,684,635.08份

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位:人民币元

主要财务指标	报告期(2014年10月1日-2014年12月31日)	
	大成信用增利一年债券A	大成信用增利一年债券C
1.本期已实现收益	10,800,263.03	3,132,202.69
2.本期利润	12,303,556.40	3,579,164.74
3.加权平均基金份额本期利润	0.0542	0.0529
4.期末基金资产净值	256,421,335.71	76,116,853.65
5.期末基金份额净值	1.129	1.125

注:1、所述基金业绩指标不包括持有人交易基金的各项费用,计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

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 基金净值表现

3.2.1 本报告期基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

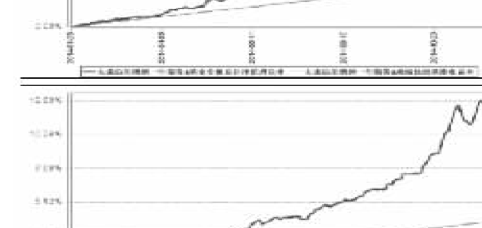
大成信用增利一年债券A

阶段	净值增长率①	净值增长率标准差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	5.02%	0.34%	1.03%	0.01%	3.99%	0.33%

大成信用增利一年债券C

阶段	净值增长率①	净值增长率标准差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	4.94%	0.35%	1.03%	0.01%	3.91%	0.34%

3.2.2 自基金合同生效以来基金累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较



注:1、本基金合同于2014年1月28日生效,截至报告期末,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约定。截至报告期末,本基金仍在建仓期。

§4 管理人报告

4.1 基金经理(或基金经理小组)简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
李达夫先生	本基金基金经理	2014年9月3日	-	8年	数量经济学硕士。2006年7月至2008年4月就职于东莞农商银行资金营运中心,历任交易员、研究员。2008年4月至2012年9月就职于国投瑞银基金管理有限公司固定收益部,2011年6月30日至2012年9月15日担任国投瑞银货币市场基金基金经理。2012年9月加入大成基金管理有限公司。2013年3月7日至2014年4月4日任大成货币市场证券投资基金。2013年3月7日起任大成现金增利货币市场基金基金经理。2013年7月17日起兼任大成景安短融债券型证券投资基金基金经理。2014年9月3日起任大成信用增利一年定期开放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。

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》、《大成信用增利一年定期开放债券型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,大成信用增利一年定期开放债券型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 公平交易专项说明

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公司旗下所有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。2014年4季度公司旗下主动投资组合间股票交易存在8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,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%的交易情形;投资组合间债券交易不存在同日反向交易;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;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表明投资组合间不存在利益输送的可能性。

4.4 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2014年四季度,经济增长仍然较为低迷,工业增加值同比增速跌至8%以下。随着房地产限购限贷陆续放开,11月央行意外不对称降息,购房者预期在短时间发生了实质性的变化,房地产市场成交在四季度出现显著改善。国际油价暴跌41%,油价下跌压制通胀上行,CPI同比维持在2%以下。美、欧、日经济基本面及货币政策的分化使得美元继续升值,美元指数创近9年新高。美元走强使新兴市场货币普遍承压,尤其人民银行降息后,人民币贬值压力加大,资本流出压力加剧。大类资产轮动继续,低估值蓝筹接力债券牛市,沪深300四季度上涨44.17%,其中12月份上涨25.8%。股市赚钱效应出现使得居民资产配置开始从固定收益类向权益类资产倾斜,两融、伞形信托等交易型资金入场加大市场波动,打乱货币政策放松节奏,股债双牛逐渐演变为股强债弱。

具体来看,四季度中债综合财富指数累计上涨2.58%,其中10-11月上涨3.14%,12月下跌0.54%。类属资产方面,利率债走势出现较大波动,全季来看下行30-60bp,收益率曲线呈牛市平坦化。中债登企业债质押新规出台使得城投债调整提前到来,城投债收益率单季波动达到100bp。产业类中票收益率下行20-30bp,与城投债的利差重新拉大。

四季度,本基金对利率债进行了波段操作,信用组合根据个券风险收益变化进行了调仓,降低了城投债的持仓比例。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本报告期内,大成信用增利A份额净值增长率为5.02%,大成信用增利C参考份额净值增长率为4.94%,同期业绩比较基准增长率为1.03%,基金净值增长率高于同期业绩比较基准的表现。

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2015年一季度,近期稳增长的政策信号明确,发改委密集批复了一批基建项目,央行387号文在降低银行存贷比、增加银行可贷资金方面将发挥明显作用,一季度信贷放量应属大概率事件。货币政策全面放松的预期趋弱,利率债的下行空间受限。43号文后,城投债供给急剧下降,产业债融资需求仍无起色,供需关系良好使得信用利差走阔的风险不大。

基于以上判断,一季度本基金将以信用债作为主要配置,保持一定的杠杆,利率债以波段操作为主,择机增加转债配置,增强收益。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

报告期内,本基金未出现基金份额持有人数量不满二百人或者基金资产净值低于五千万元的情形。

§5 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	12,305,076.38	1.98
	其中:股票	12,305,076.38	1.98
2	固定收益投资	526,185,710.10	84.48
	其中:债券	526,185,710.10	84.48
	资产支持证券	-	0.00
3	贵金属投资	-	0.00
4	金融衍生品投资	-	0.00
5	买入返售金融资产	-	0.00
	其中:买断式回购的买入返售金融资产	-	0.00
6	银行存款和结算备付金合计	65,949,236.73	10.59
7	其他资产	18,403,676.89	2.95
8	合计	622,843,700.10	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

代码	行业类别	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	-	0.00
B	采矿业	-	0.00
C	制造业	6,819,461.70	2.05
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	0.00
E	建筑业	5,485,614.68	1.65
F	批发和零售业	-	0.00
G	交通运输、仓储和邮政业	-	0.00
H	住宿和餐饮业	-	0.00
I	信息传输、软件和信息技术服务业	-	0.00
J	金融业	-	0.00
K	房地产业	-	0.00
L	租赁和商务服务业	-	0.00
M	科学研究和技术服务业	-	0.00
N	水利、环境和公共设施管理业	-	0.00
O	居民服务、修理和其他服务业	-	0.00
P	教育	-	0.00
Q	卫生和社会工作	-	0.00
R	文化、体育和娱乐业	-	0.00
S	综合	-	0.00
	合计	12,305,076.38	3.70

5.3 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	600820	隧道股份	664,118	5,485,614.68	1.65
2	002185	华天科技	333,762	4,168,687.38	1.25
3	002318	久立特材	88,714	2,650,774.32	0.80

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	25,174,406.50	7.57
2	央行票据	-	0.00
3	金融债券	55,081,916.40	16.56
	其中:政策性金融债	55,081,916.40	16.56
4	企业债券	226,301,749.00	68.05
5	企业短期融资券	130,582,000.00	39.27
6	中期票据	51,298,000.00	15.43
7	可转债	37,747,638.20	11.35
8	其他	-	0.00
9	合计	526,185,710.10	158.23

5.5 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

序号	债券代码	债券名称	数量(张)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	010107	21国债(7)	210,030	21,748,606.50	6.54
2	140225	14国开25	200,000	20,194,000.00	6.07
3	126018	08江铜债	170,610	16,085,110.80	4.84
4	122165	12国电03	150,000	14,955,000.00	4.50
5	122579	09远洋债	130,000	13,026,000.00	3.92

5.6 报告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

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

5.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

5.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

5.9 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.9.1 本期国债期货投资政策

本基金本报告期末未投资国债期货。

5.9.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未投资国债期货。

5.9.3 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末未投资国债期货。

5.10 投资组合报告附注

5.10.1 报告期内基金投资的前十名证券的发行主体本无被监管部门立案调查的,或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

5.10.2 基金投资的前十名股票中,没有投资于超出基金合同规定备选股票库之外的股票。

5.10.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	24,648.95
2	应收证券清算款	2,805,233.68
3	应收股利	-
4	应收利息	15,573,794.26
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	18,403,676.89

5.10.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

序号	债券代码	债券名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	113005	平安转债	8,479,740.00	2.55
2	113006	深燃转债	7,084,726.20	2.13
3	110017	中海转债	3,472,080.00	1.04
4	110022	同仁转债	2,421,140.00	0.73
5	113001	中行转债	2,348,850.00	0.71
6	110011	歌华转债	2,255,390.00	0.68
7	110023	民生转债	2,074,050.00	0.62
8	110018	国电转债	1,855,350.00	0.56
9	113002	工行转债	1,491,900.00	0.45
10	110020	南山转债	698,050.00	0.21
11	110015	石化转债	674,600.00	0.20
12	125089	深机转债	253,234.00	0.08

5.10.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

5.10.6 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。

§6 开放式基金份额变动

单位:份

项目	大成信用增利一年债券A	大成信用增利一年债券C
报告期期初基金份额总额	227,174,756.69	67,684,635.08
报告期期间基金总申购份额	-	-
减:报告期期间基金总赎回份额	-	-
报告期期末基金份额总额	227,174,756.69	67,684,635.08

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

基金管理人未持有本基金份额。

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

本报告期基金管理人未运用固有资金投资本基金。

§8 影响投资者决策的其他重要信息

本基金本报告期无影响投资者决策的其他重要信息。

§9 备查文件目录

9.1 备查文件目录

1、中国证监会批准设立大成信用增利一年定期开放债券型证券投资基金的文件;

2、《大成信用增利一年定期开放债券型证券投资基金基金合同》;

3、《大成信用增利一年定期开放债券型证券投资基金托管协议》;

4、大成基金管理有限公司批准文件、营业执照、公司章程;

5、本报告期内在指定报刊上披露的各种公告原稿。

9.2 存放地点

本报告存放在本基金管理人和托管人的办公住所。

9.3 查阅方式

投资者可在营业时间免费查阅,或登录本基金管理人网站 http://www.dcfund.com.cn 进行查阅。

大成基金管理有限公司
2015年1月21日

大成景益平稳收益混合型证券投资基金

2014 第四季度 报告

2014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:中国农业银行股份有限公司
报告送出日期:2015年1月21日

§1 重要提示

基金管理人的董事会及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责任。

基金托管人中国农业银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2015年1月16日复核了本报告中的财务指标、净值表现和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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2014年10月1日起至12月31日止。

§2 基金产品概况

基金简称	大成景益平稳收益混合
交易代码	000695
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2014年6月26日
报告期末基金份额总额	1,097,696,187.40份
投资目标	在严格控制风险和保持资产流动性的基础上,通过灵活的资产配置,力求实现基金资产的持续稳健增值。
投资策略	本基金将有采用"自上而下"的资产配置策略,在综合判断宏观经济基本面、证券市场走势等宏观因素的基础上,通过动态调整资产配置比例以控制基金资产整体风险。在个券投资方面采用"自下而上"精选策略,通过严谨个股选择、信用分析以及对券种收益水平、流动性的客观判断,综合运用多种投资策略,精选个券构建投资组合。
业绩比较基准	3年期银行定期存款利率(税后)+2%
风险收益特征	本基金为混合型基金,基金的风险与预期收益高于债券型基金和货币市场基金低于股票型基金,属于证券投资基金中的中高风险投资品种。
基金管理人	大成基金管理有限公司
基金托管人	中国农业银行股份有限公司

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位:人民币元

主要财务指标	报告期(2014年10月1日-2014年12月31日)
1.本期已实现收益	118,700,715.02
2.本期利润	321,123,753.12
3.加权平均基金份额本期利润	0.3824
4.期末基金资产净值	1,575,410,782.62
5.期末基金份额净值	1.435

注:1、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。

2、所述基金业绩指标不包括持有人交易基金的各项费用,计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

3.2 基金净值表现

3.2.1 本报告期基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	净值增长率①	净值增长率标准差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	32.87%	1.70%	1.55%	0.02%	31.32%	1.68%

3.2.2 自基金合同生效以来基金累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

注:1、本基金合同于2014年6月26日生效,截至报告日本基金合同生效未满一年。

2、按基金合同规定,本基金自基金合同生效之日起6个月内为建仓期。截至报告期末,本基金的各项投资比例已达到基金合同中规定的各项比例。

管理人报告

§4 管理人报告

4.1 基金经理(或基金经理小组)简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
王磊先生	本基金基金经理	2014年6月26日	-	10年	经济学硕士。2003年5月至2012年10月曾任证券时报社公司新闻部记者、世纪证券投资银行部业务董事、国信证券经济研究所分析师及资产管理总部专户投资经理、中银基金管理有限公司专户理财部投资经理及总监(主持工作)。2012年11月加入大成基金管理有限公司。2013年6月7日起担任大成强化收益债券型证券投资基金基金经理。2013年7月17日起任大成景恒保本混合型证券投资基金基金经理。2013年11月9日起任大成可转债增强债券型证券投资基金基金经理。2014年6月26日起任大成景益平稳收益混合型证券投资基金基金经理。2014年9月3日起兼任大成景丰债券型证券投资基金(LOF)基金经理。2014年12月9日起任大成景利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

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》、《大成景益平稳收益混合型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,大成景益平稳收益混合型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 公平交易专项说明

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公司旗下所有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。2014年4季度公司旗下主动投资组合间股票交易存在8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,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%的交易情形;投资组合间债券交易不存在同日反向交易;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;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表明投资组合间不存在利益输送的可能性。

4.4 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2014年4季度,央行通过公开市场操作和降息释放宽松信号,债券市场各品种整体上涨,中长久期债券尤为明显,但短券在年末受新股发行和资金面影响,收益率大幅上行,导致年末收益率曲线出现异常的倒挂行情。整体看,中债综合财富总指数大幅上涨2.58%。

由于受到央行降息,以及国家实施一带一路等国家战略的影响,大量的场外资金进入股票市场,使本季度股票市场呈现了快速上涨的行情,其中大盘股表现尤为突出,具体来看,沪深300指数上涨44.17%,受市场风格转换的影响,创业板指数则下跌4.49%。转债市场也出现大幅上涨,中证转债指数上涨幅度达43.15%。

组合操作上,债券方面,本组合增加和保持可转债仓位,精选大盘和高弹性转债获得了一定收益,另外通过增配中高评级信用债获取票息收益,同时交易利率债获得波段操作收益;在股票方面,进一步提升了股票的仓位,通过精选大盘蓝筹和主题机会个股,增强组合收益。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末,本基金份额净值为1.435元,本报告期份额净值增长率为32.87%,同期业绩比较基准增长率为1.55%,高于业绩比较基准的表现。

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2015年1季度,我们看好经济调结构和稳增长下的债券投资机会,继续全面深入研究宏观经济和货币政策走势,抓住市场机会,提前布局,顺势而为,抓住大类资产轮动投资机会,提高组合收益。股票方面,驱动权益市场上涨的因素仍然存在,我们仍然看好股票市场。我们将根据市场情况,寻找估值合理,符合政策方向的行业和个股进行投资。

我们非常感谢基金份额持有人的信任和支持,我们将按照本基金合同和风险收益特征的要求,严格控制投资风险,积极进行资产配置,适时调整组合结构,研究新的投资品种和挖掘投资机会,力争获得与基金风险特征一致的稳定收益回报给投资者。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

报告期内,本基金未出现基金份额持有人数量不满二百人或者基金资产净值低于五千万元的情形。

§5 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	404,526,430.85	19.13
	其中:股票	404,526,430.85	19.13
2	固定收益投资	1,508,213,544.27	71.34
	其中:债券	1,508,213,544.27	71.34
	资产支持证券	-	0.00
3	贵金属投资	-	0.00
4	金融衍生品投资	-	0.00
5	买入返售金融资产	-	0.00
	其中:买断式回购的买入返售金融资产	-	0.00
6	银行存款和结算备付金合计	170,225,873.56	8.05
7	其他资产	31,239,560.77	1.48
8	合计	2,114,205,409.45	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

代码	行业类别	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	-	0.00
B	采矿业	3,548,000.00	0.23
C	制造业	59,706,812.72	3.79
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	0.00
E	建筑业	14,867,000.00	0.94
F	批发和零售业	-	0.00
G	交通运输、仓储和邮政业	16,000,000.00	1.02
H	住宿和餐饮业	-	0.00
I	信息传输、软件和信息技术服务业	28,118,400.00	1.78
J	金融业	207,481,265.20	13.17
K	房地产业	69,260,952.93	4.40
L	租赁和商务服务业	-	0.00
M	科学研究和技术服务业	-	0.00
N	水利、环境和公共设施管理业	-	0.00
O	居民服务、修理和其他服务业	-	0.00
P	教育	-	0.00
Q	卫生和社会工作	-	0.00
R	文化、体育和娱乐业	-	0.00
S	综合	5,544,000.00	0.35
	合计	404,526,430.85	25.68

5.3 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	600036	招商银行	4,999,889	82,948,158.51	5.27
2	600185	格力地产	1,800,001	39,600,022.00	2.51
3	601688	华泰证券	1,399,949	34,256,752.03	2.17
4	002544	杰赛科技	1,010,000	28,118,400.00	1.78
5	000728	国元证券	740,098	23,068,854.66	1.46
6	601336	新华保险	450,000	22,302,000.00	1.42
7	002465	海格通信	1,000,000	19,320,000.00	1.23
8	600266	北京城建	800,099	18,930,342.34	1.20
9	601166	兴业银行	1,000,000	16,500,000.00	1.05
10	600428	中远航运	2,000,000	16,000,000.00	1.02

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	723,814.50	0.05
2	央行票据	-	0.00
3	金融债券	157,544,700.00	10.00
	其中:政策性金融债	157,544,700.00	10.00
4	企业债券	315,063,380.50	20.00
5	企业短期融资券	30,189,000.00	1.92
6	中期票据	95,845,500.00	6.08
7	可转债	908,847,149.27	57.69
8	其他	-	0.00
9	合计	1,508,213,544.27	95.73

5.5 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

序号	债券代码	债券名称	数量(张)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	110027	东方转债	1,000,000	171,210,000.00	10.87
2	113001	中行转债	1,000,000	156,590,000.00	9.94
3	113005	平安转债	700,000	126,294,000.00	8.02
4	110023	民生转债	736,190	101,792,991.30	6.46
5	140208	14国开08	700,000	71,953,000.00	4.57

5.6 报告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

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

5.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

5.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未投资股指期货。

5.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期末未投资股指期货。

5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.10.1 本期国债期货投资政策

本基金本报告期末未投资国债期货。

5.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未投资国债期货。

5.10.3 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末未投资国债期货。

5.11 投资组合报告附注

5.11.1 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。

5.11.2 本基金投资的前十名股票中,没有投资于超出基金合同规定的备选股票库之外的股票。

5.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	283,497.84
2	应收证券清算款	10,902,754.69
3	应收股利	-
4	应收利息	19,095,153.14
5	应收申购款	958,155.10
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	31,239,560.77

5.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

序号	债券代码	债券名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	113001	中行转债	156,590,000.00	9.94
2	113005	平安转债	126,294,000.00	8.02
3	110023	民生转债	101,792,991.30	6.46
4	110020	南山转债	61,428,400.00	3.90
5	110018	国电转债	32,984,000.00	2.09
6	113002	工行转债	29,838,000.00	1.89
7	128005	齐翔转债	19,208,802.16	1.22
8	127002	徐工转债	4,131,849.05	0.26

5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)	流通受限情况说明
1	600428	中远航运	16,000,000.00	1.02	重大事项

5.11.6 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。

§6 开放式基金份额变动

单位:份

报告期期初基金份额总额	603,191,972.73
报告期期间基金总申购份额	539,192,553.50
减:报告期期间基金总赎回份额	44,688,338.83
报告期期间基金拆分变动份额(份额减少以"-"填列)	-
报告期期末基金份额总额	1,097,696,187.40

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

报告期期初管理人持有的本基金份额	9,999,000.00
报告期期间买入/申购总份额	-
报告期期间卖出/赎回总份额	-
报告期期末管理人持有的本基金份额	9,999,000.00
报告期期末持有的本基金份额占基金总份额比例(%)	0.91

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

本基金管理人本报告期末运用固有资金投资本基金。

§8 影响投资者决策的其他重要信息

本基金本报告期无影响投资者决策的其他重要信息。

§9 备查文件目录

9.1 备查文件目录

1、中国证监会批准设立大成景益平稳收益混合型证券投资基金的文件;

2、《大成景益平稳收益混合型证券投资基金基金合同》;

3、《大成景益平稳收益混合型证券投资基金托管协议》;

4、大成基金管理有限公司批准文件、营业执照、公司章程;

5、本报告期内在指定报刊上披露的各种公告原稿。

9.2 存放地点

本季度报告存放在本基金管理人和托管人的办公住所。

9.3 查阅方式

投资者可在营业时间免费查阅,或登录本基金管理人网站 http://www.dcfund.com.cn 进行查阅。

大成基金管理有限公司
2015年1月21日

大成丰财宝货币市场基金(原大成招财宝货币市场基金)

2014 第四季度 报告

2014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:中国银行股份有限公司
报告送出日期:2015年1月21日

§1 重要提示

基金管理人的董事会及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责任。

基金托管人中国银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2015年1月19日复核了本报告中的财务指标、净值表现和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。

大成丰财宝货币市场基金是由大成招财宝货币市场基金更名而来,大成招财宝货币市场基金(A类份额基金代码:000626,B类份额基金代码:000627)的基金合同已于2014年6月18日生效,于2014年7月15日开放申购、赎回。经本基金管理人与本基金托管人中国银行股份有限公司协商一致,并向中国证监会备案,自2014年11月28日起本基金名称变更为"大成丰财宝货币市场基金";基金简称变更为"大成丰财宝货币";两类基金份额名称分别变更为"大成丰财宝货币A"(基金代码不变,仍为000626)、"大成丰财宝货币B"(基金代码不变,仍为000627)。

按照基金合同约定,本次变更对基金份额持有人利益无实质性不利影响且不涉及基金合同当事人权利义务关系发生重大变化的情形,不需要召开基金份额持有人大会。本基金更名后,《大成招财宝货币市场基金基金合同》、《大成招财宝货币市场基金托管协议》等法律文件项下的全部权利、义务由大成丰财宝货币市场基金承担和继承。

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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2014年10月1日起至12月31日止。

§2 基金产品概况

基金简称	大成丰财宝货币	
交易代码	000626	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2014年6月18日	
报告期末基金份额总额	285,718,076.08份	
投资目标	在有效控制投资组合风险,保持高流动性的基础上,力争获得高于业绩比较基准的投资回报。	
投资策略	本基金投资管理将充分运用收益率策略与估值策略相结合的方法,对各类可投资资产进行合理的配置和选择。投资策略首先审慎考虑各类资产的收益性、流动性及风险性特征,在风险与收益的配比中,力求将各类风险降到最低,并在控制投资组合良好流动性的基础上为投资者获取稳定的收益。	
业绩比较基准	活期存款利率(税后)	
风险收益特征	本基金为货币市场基金,基金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。	
基金管理人	大成基金管理有限公司	
基金托管人	中国银行股份有限公司	
下属两级基金的基金简称	大成丰财宝货币A	大成丰财宝货币B
下属两级基金的交易代码	000626	000627
报告期末下属两级基金的份额总额	262,079,569.31份	23,638,506.77份

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位:人民币元

主要财务指标	报告期(2014年10月1日-2014年12月31日)	
	大成丰财宝货币A	大成丰财宝货币B
1. 本期已实现收益	3,565,517.45	547,679.70
2.本期利润	3,565,517.45	547,679.70
3.期末基金资产净值	262,079,569.31	23,638,506.77

注: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,由于本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 本报告期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

大成丰财宝货币A

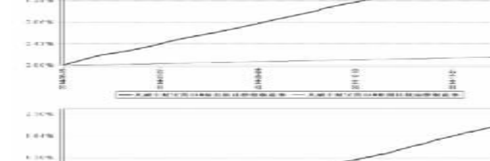
阶段	净值收益率①	净值收益率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	1.0273%	0.0029%	0.0882%	0.0000%	0.9391%	0.0029%

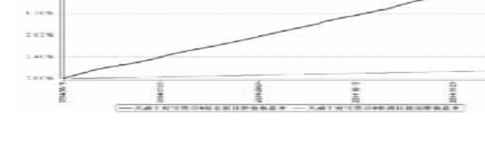
大成丰财宝货币B

阶段	净值收益率①	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	1.0884%	0.0029%	0.0882%	0.0000%	1.0002%	0.0029%

注:本货币基金收益分配按日结转份额。

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、本基金合同于2014年6月18日生效,截至报告期末,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约定。截至建仓期结束时,本基金的各项投资比例已达到基金合同中规定的比例。

§4 管理人报告

4.1 基金经理(或基金经理小组)简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
屈伟南先生	本基金基金经理	2014年6月18日	-	12年	工商管理硕士。曾任职于郑州纺织工学院、融通基金管理有限公司。2006年3月加入大成基金管理有限公司,历任基金会计、固定收益研究员、基金经理助理。2013年2月1日至2014年9月11日任大成理财21天债券型发起式证券投资基金基金经理。2013年3月27日起任大成现金宝场内实时申赎货币市场基金基金经理。2013年11月19日起任大成景祥分级债券型证券投资基金基金经理。2014年6月18日起任大成丰财宝货币市场基金(原大成招财宝货币市场基金)基金经理。2014年7月28日起任大成添利宝货币市场基金基金经理。2014年9月12日起任大成月月盈短期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
黄海峰先生	本基金基金经理助理	2014年6月23日	-	10年	南开大学经济学学士,2004年7月至2010年5月就职于深圳农村商业银行,任资金部投资经理;2010年5月至2012年10月就职于博时基金管理有限公司,任交易部交易员;2012年10月至2013年5月就职于银华基金管理有限公司,任固定收益部基金经理助理;2013年7月加入大成基金管理有限公司固定收益部。2013年10月14日起任大成现金宝场内实时申赎货币市场基金基金经理助理。2013年10月28日起大成景恒保本混合型证券投资基金基金经理助理。2014年3月18日起任大成强化收益债券型证券投资基金基金经理助理。2014年3月18日起任大成货币市场证券投资基金基金经理助理。2014年6月23日起任大成丰财宝货币市场基金(原大成招财宝货币市场基金)及大成景益平稳收益混合型证券投资基金基金经理助理。2014年12月24日起,任大成货币市场证券投资基金基金经理及大成丰财宝货币市场基金(原大成招财宝货币市场基金)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。

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》、《大成招财宝货币市场基金基金合同》、《大成丰财宝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,本基金的投资范围、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 公平交易专项说明

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公司旗下所有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。2014年4季度公司旗下主动投资组合间股票交易存在8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,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%的交易情形;投资组合间债券交易不存在同日反向交易;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;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表明投资组合间不存在利益输送的可能性。

4.4 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2014年4季度,央行通过公开市场操作和降息释放宽松信号,债券市场各品种整体上涨,中长久期债券尤为明显,但短券在年末受新股发行和资金面影响,收益率大幅上行,导致年末收益率曲线出现异常的倒挂行情。整体看,中债综合财富总指数大幅上涨2.58%。

操作上,本组合根据市场资金面和利差变化,灵活调整利率债和信用债仓位,根据年末资金面紧张预期,提前做好流动性安排,在规模大幅波动情况下,保证组合安全性,同时维持组合一定静态收益。

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1.0273%,B类净值收益率1.0884%,期间业绩比较基准收益率为0.0882%。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2015年1季度,我们看好经济调结构和稳增长下的债券投资机会,后期将继续全面深入研究宏观经济、货币政策和资金面状况,结合组合规模和客户结构,提前布局,顺势而为。

基于一季度流动性宽松预期,本组合将提升债券比例,优化信用债品种结构,适度增加组合久期,力争在确保安全性和流动性前提下,提高组合收益。

我们非常感谢基金份额持有人的信任和支持,我们将按照本基金合同和风险收益特征的要求,严格控制投资风险,积极进行资产配置,适时调整组合结构,研究新的投资品种和挖掘投资机会,力争获得与基金风险特征一致的稳定收益回报给投资者。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

报告期内,本基金未出现基金份额持有人数量不满二百人或者基金资产净值低于五千万元的情形。

§5 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	固定收益投资	90,228,340.63	26.86
	其中:债券	90,228,340.63	26.86
	资产支持证券	-	-
2	买入返售金融资产	52,204,838.31	15.54
	其中:买断式回购的买入返售金融资产	-	-
3	银行存款和结算备付金合计	190,546,085.26	56.72
4	其他资产	2,939,324.45	0.88
5	合计	335,918,588.65	100.00

5.2 报告期债券回购融资情况

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	13.73	
	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	49,699,485.45	17.39
	其中:买断式回购融资	-	-

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

序号	发生日期	融资余额占基金资产净值比例(%)	原因	调整期
1	2014年11月28日	21.09	巨额赎回	1天

注:本基金合同约定:"除发生巨额赎回的情况外,本基金债券正回购的资产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本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"。

5.3 基金投资组合平均剩余期限

5.3.1 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	72
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	119
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	41

报告期内投资组合平均剩余期限超过180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。

5.3.2 报告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	58.71	17.39
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
2	30天(含)-60天	12.27	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
3	60天(含)-90天	24.51	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
4	90天(含)-180天	-	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
5	180天(含)-397天(含)	21.05	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
	合计	116.54	17.39

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	摊余成本(元)	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	20,016,054.56	7.01
	其中:政策性金融债	20,016,054.56	7.01
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	70,212,286.07	24.57
6	中期票据	-	-
7	其他	-	-
8	合计	90,228,340.63	31.58
9	剩余存续期超过397天的浮动利率债券	-	-

5.5 报告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

序号	债券代码	债券名称	债券数量(张)	摊余成本(元)	占基金资产净值比例(%)
1	041471005	14万联能源CP001	200,000	20,017,737.42	7.01
2	041458076	14龙盛CP001	100,000	10,069,900.57	3.52
3	041466002	14冀水泥CP001	100,000	10,067,227.86	3.52
4	041461053	14沪临港CP002	100,000	10,026,033.08	3.51
5	041452055	14萧山水务CP001	100,000	10,024,480.04	3.51
6	140218	14国开18	100,000	10,012,192.91	3.50
7	041466004	14海大CP001	100,000	10,006,907.10	3.50
8	140204	14国开04	100,000	10,003,861.65	3.50

5.6 "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	3
报告期内偏离度的最高值	0.2741%
报告期内偏离度的最低值	-0.1578%
报告期内每个工作日偏离度的绝对值的简单平均值	0.1268%

5.7 报告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

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

5.8 投资组合报告附注

5.8.1 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。

5.8.2 本报告期内不存在基金持有剩余期限小于397天但剩余存续期超过397天的浮动利率债券的摊余成本超过当日基金资产净值的20%的情况。

5.8.3 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。

5.8.4 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	-
2	应收证券清算款	-
3	应收利息	2,939,324.45
4	应收申购款	-
5	其他应收款	-
6	待摊费用	-
7	其他	-
8	合计	2,939,324.45

5.8.5 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。

§6 开放式基金份额变动

单位:份

项目	大成丰财宝货币A	大成丰财宝货币B
报告期期初基金份额总额	228,257,065.98	54,740,452.38
报告期期间基金总申购份额	971,780,739.48	85,542,659.17
减:报告期期间基金总赎回份额	937,958,236.15	116,644,604.78
报告期期末基金份额总额	262,079,569.31	23,638,506.77

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

本报告期基金管理人未运用固有资金投资本基金。

§8 影响投资者决策的其他重要信息

本基金本报告期无影响投资者决策的其他重要信息。

§9 备查文件目录

9.1 备查文件目录

1、中国证监会批准设立大成招财宝货币市场基金的文件;

2、《大成招财宝货币市场基金基金合同》;

3、《大成招财宝货币市场基金托管协议》;

4、大成基金管理有限公司批准文件、营业执照、公司章程;

5、本报告期内在指定报刊上披露的各种公告原稿。

9.2 存放地点

本季度报告存放在本基金管理人和托管人的办公住所。

9.3 查阅方式

投资者可在营业时间免费查阅,或登录本基金管理人网站 http://www.dcfund.com.cn 进行查阅。

大成基金管理有限公司
2015年1月21日