大成恒丰宝货币市场基金

2016 年度 报告摘要

2016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:恒丰银行股份有限公司
送出日期:2017年3月25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。

基金托管人恒丰银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2017年3月23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。

本报告财务资料已经审计。普华永道中天会计师事务所(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2016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	大成恒丰宝货币		
基金主代码	001697		
交易代码	001697		
基金运作方式	契约型开放式		
基金合同生效日	2015年8月4日		
基金管理人	大成基金管理有限公司		
基金托管人	恒丰银行股份有限公司		
报告期末基金份额总额	5,215,476,715.52份		
基金合同存续期	不定期		
下属分级基金的基金简称:	大成恒丰宝货币A	大成恒丰宝货币B	大成恒丰宝货币E
下属分级基金的交易代码:	001697	001698	001699
报告期末下属分级基金的份额总额	8,776,268.07份	5,113,728,578.01份	92,971,869.44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。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。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。在确保安全性和流动性的前提下,通过不同商业银行和不同存款期限的选择,挖掘出利率报价较高的多家银行进行银行协议存款和大额存单的投资,在获取较高投资收益的同时尽量分散投资风险,提高存款及存单资产的流动性。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	恒丰银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	罗登攀	吴琪君
	联系电话	0755-83183388	95395
	电子邮箱	office@dcfund.com.cn	wuqijun@hfbank.com.cn
客户服务电话		4008885558	95395
传真		0755-83199588	021-38966338

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
基金年度报告备置地点	基金管理人及基金托管人住所

§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	2016年			2015年8月4日(基金合同生效日)-2015年12月31日		
	大成恒丰宝货币A	大成恒丰宝货币B	大成恒丰宝货币E	大成恒丰宝货币A	大成恒丰宝货币B	大成恒丰宝货币E
本期已实现收益	174,212.29	7,688,260.47	2,028,399.64	145,090.02	3,846,654.65	56,700.68
本期利润	174,212.29	7,688,260.47	2,028,399.64	145,090.02	3,846,654.65	56,700.68
本期净值收益率	2.5306%	2.7767%	2.6326%	1.0024%	1.1055%	0.9494%
3.1.2 期末数据和指标	2016年末			2015年末		
期末基金资产净值	8,776,268.07	5,113,728,578.01	92,971,869.44	987,494.40	300,741,021.76	42,161,104.20
期末基金份额净值	1.000	1.000	1.000	1.000	1.000	1.000

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,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。

2.本基金申购赎回费为零。

3.本基金收益分配按日结转份额。

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

大成恒丰宝货币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	0.6932%	0.0028%	0.0880%	0.0000%	0.6052%	0.0028%
过去六个月	1.3199%	0.0054%	0.1760%	0.0000%	1.1439%	0.0054%
过去一年	2.5306%	0.0057%	0.3500%	0.0000%	2.1806%	0.0057%
自基金合同生效起至今	3.5584%	0.0050%	0.4938%	0.0000%	3.0646%	0.0050%

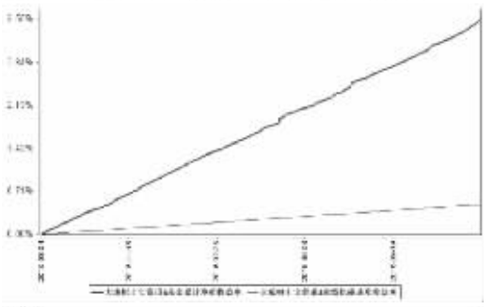
大成恒丰宝货币B

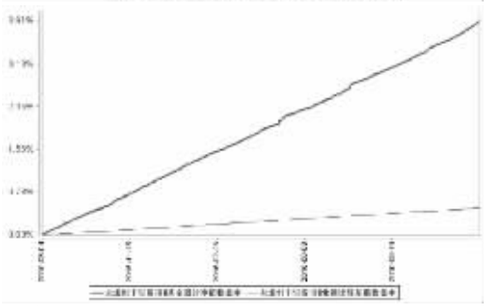
阶段	份额净值收益率①	份额净值收益率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	0.7541%	0.0027%	0.0880%	0.0000%	0.6661%	0.0027%
过去六个月	1.4426%	0.0054%	0.1760%	0.0000%	1.2666%	0.0054%
过去一年	2.7767%	0.0057%	0.3500%	0.0000%	2.4267%	0.0057%
自基金合同生效起至今	3.9129%	0.0049%	0.4938%	0.0000%	3.4191%	0.0049%

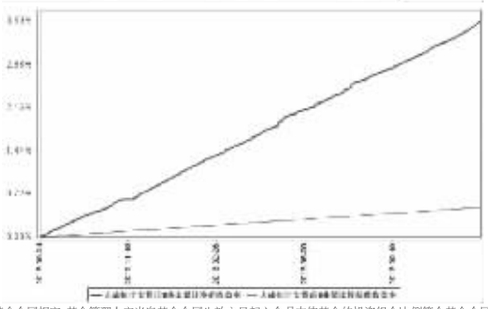
大成恒丰宝货币E

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
过去三个月	0.6934%	0.0027%	0.0880%	0.0000%	0.6054%	0.0027%
过去六个月	1.3202%	0.0054%	0.1760%	0.0000%	1.1442%	0.0054%
过去一年	2.6326%	0.0057%	0.3500%	0.0000%	2.2826%	0.0057%
自基金合同生效起至今	3.6070%	0.0050%	0.4938%	0.0000%	3.1132%	0.0050%

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

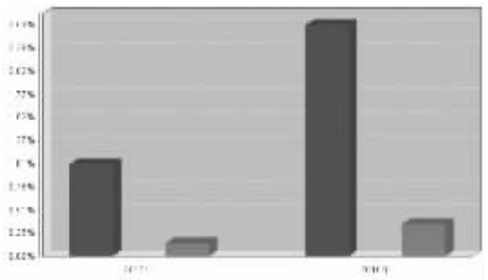


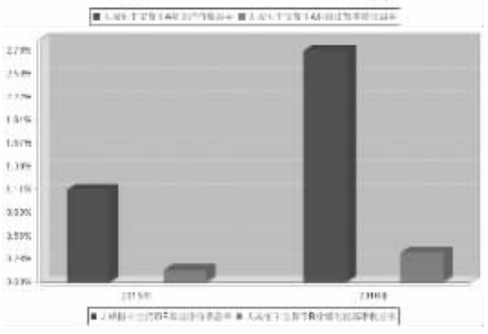




注:本基金合同规定,基金管理人应当自基金合同生效之日起六个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的约定。截至报告期末,本基金的投资组合比例符合基金合同的约定。

3.2.3 自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较





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》、《大成恒丰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,大成恒丰宝货币市场基金的投资范围、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,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 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,债券交易同向交易赎率较低;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。

4.3.3 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9 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 2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

2016年前三季度,央行执行稳健的货币政策,资金面总体宽松,到四季度,一系列去杠杆政策使资产荒的局面转为了资金荒,隔夜回购利率均值约为2.29%,较三季度上升19BP,14天回购加权利率均值约为3.28%,较三季度上升55BP。美联储加息和通胀预期造成全球多数主要市场债券收益率大幅上行,我国1年期金融债收益率上行约90bp,1年AAA短期融资券上行约107bp,1年AA+短融品种上行约124bp。

本基金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,取得了良好的组合收益。

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2.5306%,B类净值收益率为2.7767%,E类净值收益率为2.6326%, 期间业绩比较基准收益率为0.3500%。

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,货币政策将进一步从降低融资成本切换到抑制资产泡沫,资金面仍将中性偏紧,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,努力为持有人带来持续稳定的回报。

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情况,以每万份基金净收益为基准,为投资人每日计算当日收益并分配,每日支付。本报告期内本基金应分配利润9,890,872.40元,报告期内已分配利润9,890,872.40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

本报告期内,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、基金合同和托管协议的规定,诚信、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

本报告期内,本托管人根据国家有关法律法规、基金合同和托管协议的规定,对基金管理人在本基金的投资运作、基金资产净值的计算、基金收益的计算、基金费用开支、利润分配情况等方面进行了必要的监督、复核和审查,未发现其存在任何损害本基金份额持有人利益的行为。

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

本托管人认真复核了本年度报告中的财务指标、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,认为其真实、准确和完整,不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

§6 审计报告

本基金2016年年度财务报表已经普华永道中天会计师事务所(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:大成恒丰宝货币市场基金

报告截止日:2016年12月31日

单位:人民币元

资 产	本期末 2016年12月31日	上年度末 2015年12月31日
资 产:		
银行存款	2,642,752,106.06	193,814,154.36
结算备付金	-	-
存出保证金	-	-
交易性金融资产	319,688,135.40	169,942,798.10
其中:股票投资	-	-
基金投资	-	-
债券投资	319,688,135.40	169,942,798.10
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	2,246,134,237.49	20,000,150.00
应收证券清算款	-	-
应收利息	6,810,260.82	1,882,905.62
应收股利	-	-
应收申购款	1,872,608.93	3,010,881.15
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	-
资产总计	5,217,257,348.70	388,650,889.23

负债和所有者权益	本期末 2016年12月31日	上年度末 2015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	-	44,549,777.72
应付证券清算款	-	-
应付赎回款	-	-
应付管理人报酬	183,112.74	80,426.03
应付托管费	51,271.53	22,519.29
应付销售服务费	28,559.50	4,190.32
应付交易费用	25,503.43	16,011.64
应交税费	-	-
应付利息	-	2,630.93
应付利润	1,343,185.98	26,712.94
递延所得税负债	-	-
其他负债	149,000.00	59,000.00
负债合计	1,780,633.18	44,761,268.87
所有者权益:		
实收基金	5,215,476,715.52	343,889,620.36
未分配利润	-	-
所有者权益合计	5,215,476,715.52	343,889,620.36
负债和所有者权益总计	5,217,257,348.70	388,650,889.23

注:报告截止日2016年12月31日,基金份额净值1.000元,基金份额总额5,215,476,715.52份,其中A类基金份额总额为8,776,268.07份,B类基金份额总额为5,113,728,578.01份,E类基金份额总额为92,971,869.44份。

7.2 利润表

会计主体:大成恒丰宝货币市场基金

本报告期:2016年1月1日至2016年12月31日

单位:人民币元

项 目	本期 2016年1月1日至2016年12月31日	上年度可比期间 2015年8月4日(基金合同生效日)至2015年12月31日
一、收入	11,818,692.48	4,850,507.57
1.利息收入	11,300,310.21	4,769,788.30
其中:存款利息收入	4,239,483.85	3,316,842.25
债券利息收入	3,488,241.00	1,250,081.76
资产支持证券利息收入	-	-
买入返售金融资产收入	3,572,585.36	202,864.29
其他利息收入	-	-
2.投资收益(损失以“-”填列)	517,504.27	80,719.27
其中:股票投资收益	-	-
基金投资收益	-	-
债券投资收益	517,504.27	80,719.27
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)	878.00	-
减:二、费用	1,927,820.08	802,062.22
1. 管理人报酬	774,695.20	382,294.42
2. 托管费	216,914.49	107,042.40
3. 销售服务费	172,279.39	32,804.71
4. 交易费用	162.50	15.00
5. 利息支出	386,368.50	189,405.69
其中:卖出回购金融资产支出	386,368.50	189,405.69
6. 其他费用	377,400.00	90,500.00
三、利润总额(亏损总额以“-”号填列)	9,890,872.40	4,048,445.35
减:所得税费用	-	-
四、净利润(净亏损以“-”号填列)	9,890,872.40	4,048,445.35

7.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体:大成恒丰宝货币市场基金

本报告期:2016年1月1日至2016年12月31日

单位:人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016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)	343,889,620.36	-	343,889,620.36
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	9,890,872.40	9,890,872.40
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)	4,871,587,095.16	-	4,871,587,095.16
其中:1.基金申购款	6,474,568,651.35	-	6,474,568,651.35
2.基金赎回款	-1,602,981,556.19	-	-1,602,981,556.19
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)	-	-9,890,872.40	-9,890,872.40
五、期末所有者权益(基金净值)	5,215,476,715.52	-	5,215,476,715.52

项目	上年度可比期间 2015年8月4日(基金合同生效日)至2015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)	334,457,921.93	-	334,457,921.93
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	4,048,445.35	4,048,445.35
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)	9,431,698.43	-	9,431,698.43
其中:1.基金申购款	1,208,377,782.52	-	1,208,377,782.52
2.基金赎回款	-1,198,946,084.09	-	-1,198,946,084.09
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)	-	-4,048,445.35	-4,048,445.35
五、期末所有者权益(基金净值)	343,889,620.36	-	343,889,620.36

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:

罗登攀 周立新 周立新

基金管理人负责人 主管会计工作负责人 会计机构负责人

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一致。

7.4.2 税项

根据财政部、国家税务总局财税[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[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政策的补充通知》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债券的转让收入免征增值税,对国债、地方政府债以及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,包括买卖债券的差价收入,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。

7.4.3 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(“大成基金”)	基金管理人、注册登记机构、基金销售机构
恒丰银行股份有限公司(“恒丰银行”)	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、基金销售机构
中国银河投资管理有限公司	基金管理人的股东
广东证券股份有限公司(“广东证券”)	基金管理人的股东(2016年4月25日前)
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:1. 根据本基金管理人大成基金管理有限公司(以下简称“大成基金”)董事会及股东会的有关决议,大成基金原股东广东证券股份有限公司将所持大成基金2%股权以拍卖竞买的方式转让给大成基金股东中泰信托有限责任公司。上述股权变更及修改《大成基金管理有限公司公司章程》的工商变更手续已于2016年4月25日在深圳市市场监督管理局办理完毕。

2. 下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

7.4.4 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.4.1 通过关联方交易单元进行的交易

本报告期内及上年度可比期间本基金无通过关联方交易单元进行的交易。

7.4.4.2 关联方报酬

7.4.4.2.1 基金管理费

单位:人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年12月31日	上年度可比期间 2015年8月4日(基金合同生效日)至2015年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	774,695.20	382,294.42
其中:支付销售机构的客户维护费	166,308.50	10,177.45

注:支付基金管理人大成基金 的管理人报酬按前一日基金资产净值0.25%的年费率计提,逐日累计至每月月底,按月支付。其计算公式为:

日管理人报酬=前一日基金资产净值 × 0.25% / 当年天数。

7.4.4.2.2 基金托管费

单位:人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年12月31日	上年度可比期间 2015年8月4日(基金合同生效日)至2015年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	216,914.49	107,042.40

注:支付基金托管人恒丰银行的托管费按前一日基金资产净值0.07%的年费率计提,逐日累计至每月月底,按月支付。其计算公式为:

日托管费=前一日基金资产净值 × 0.07% / 当年天数。

7.4.4.2.3 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 2016年1月1日至2016年12月31日			
	当期发生的基金应支付的销售服务费			
	大成恒丰宝货币A	大成恒丰宝货币B	大成恒丰宝货币E	合计
大成基金	1,183.82	10,715.15	-	11,898.97
恒丰银行	467.90	-	130,845.19	131,313.09
光大证券	616.52	-	-	616.52
合计	2,268.24	10,715.15	130,845.19	143,828.58

获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2015年8月4日(基金合同生效日)至2015年12月31日			
	当期发生的基金应支付的销售服务费			
	大成恒丰宝货币A	大成恒丰宝货币B	大成恒丰宝货币E	合计
大成基金	14.46	14,672.37	-	14,686.83
恒丰银行	303.51	-	1,135.63	1,439.14
合计	317.97	14,672.37	1,135.63	16,125.97

注:支付基金销售机构的销售服务费按前一日基金资产净值的约定年费率计提,逐日累计至每月月底,按月支付给大成基金,再由大成基金计算并支付给各基金销售机构。A类基金份额、B类基金份额和E类基金份额约定的销售服务费年费率分别为0.25%、0.01%和0.25%。销售服务费的计算公式为:对应级别日销售服务费=前一日对应级别基金资产净值 ×约定年费率 ÷当年天数。

7.4.4.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本报告期内及上年度可比期间本基金未发生与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。

7.4.4.4 各关联方投资本基金的情况

7.4.4.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

本报告期内及上年度可比期间基金管理人均未运用固有资金投资本基金。

7.4.4.4.2 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

本报告期末及上年度末除基金管理人以外的其他关联方均未投资本基金。

7.4.4.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位:人民币元

关联方名称	本期 2016年1月1日至2016年12月31日		上年度可比期间 2015年8月4日(基金合同生效日)至2015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
恒丰银行	12,752,106.06	33,083.32	3,814,154.36	27,776.48

注:本基金的银行存款由基金托管人恒丰银行保管,按约定利率计息。

7.4.4.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本报告期内及上年度可比期间本基金未在承销期内参与关联方承销证券。

7.4.4.7 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期及上年度可比期间无须作说明的其他关联交易事项。

7.4.5 期末(2016年12月31日)本基金持有的流通受限证券

7.4.5.1 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。

7.4.5.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金本报告期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

7.4.5.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.5.3.1 银行间市场债券正回购

于本报告期末,本基金无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。

7.4.5.3.2 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。

§8 投资组合报告

8.1 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	319,688,135.40	6.13
	其中:债券	319,688,135.40	6.13
	资产支持证券	-	0.00
2	买入返售金融资产	2,246,134,237.49	43.05
	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	2,642,752,106.06	50.65
4	其他各项资产	8,682,869.75	0.17
5	合计	5,217,257,348.70	100.00

8.2 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	5.99
	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	-	0.00
	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。

8.3 基金投资组合平均剩余期限

8.3.1 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	45
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	110
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	22

报告期内投资组合平均剩余期限超过120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。

8.3.2 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	69.77	0.00
	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	0.58	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	14.00	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	2.30	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)	13.23	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	95.63	0.00

8.4 报告期内投资组合平均剩余存续期超过240天情况说明

本报告期内,本基金未发生超标情况。

8.5 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	269,687,940.55	5.17
	其中:政策性金融债	269,687,940.55	5.17
4	企业债券	-	0.00
5	企业短期融资券	50,000,194.85	0.96
6	中期票据	-	0.00
7	同业存单	-	0.00
8	其他	-	0.00
9	合计	319,688,135.40	6.13
10	剩余存续期超过397天的浮动利率债券	-	0.00

8.6 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	160201	16国开01	1,600,000	159,952,996.38	3.07
2	160414	16农发14	1,100,000	109,734,944.17	2.10
3	011699819	16华电SCP008	100,000	10,009,155.02	0.19
4	011698578	16苏交通SCP015	100,000	9,998,072.63	0.19
5	011698568	16同方SCP005	100,000	9,997,895.27	0.19
6	011698487	16厦门航空SCP010	50,000	4,999,110.15	0.10
7	011698624	16川能投SCP001	50,000	4,998,928.69	0.10
8	011611009	16大唐集SCP009	50,000	4,998,808.33	0.10
9	011698684	16中航租赁SCP006	50,000	4,998,224.76	0.10

8.7 “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	0.2180%
报告期内偏离度的最低值	-0.1816%
报告期内每个交易日偏离度的绝对值的简单平均值	0.0880%

报告期内负偏离度的绝对值达到0.25%情况说明

报告期内负偏离度的绝对值均未达到0.25%。

报告期内正偏离度的绝对值达到0.5%情况说明

报告期内正偏离