

大成理财 21 天债券型发起式证券投资基金  
2014 年半年度报告  
2014 年 6 月 30 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

送出日期：2014 年 8 月 28 日

## § 1 重要提示及目录

### 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。

基金托管人中国银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2014 年 8 月 26 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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2014 年 01 月 01 日起至 06 月 30 日止。

## 1.2 目录

<b>§ 1 重要提示及目录</b> .....	<b>2</b>
1.1 重要提示.....	2
1.2 目录.....	3
<b>§ 2 基金简介</b> .....	<b>5</b>
2.1 基金基本情况.....	5
2.2 基金产品说明.....	5
2.3 基金管理人和基金托管人.....	5
2.4 信息披露方式.....	6
2.5 其他相关资料.....	6
<b>§ 3 主要财务指标和基金净值表现</b> .....	<b>6</b>
3.1 主要会计数据和财务指标.....	6
3.2 基金净值表现.....	6
<b>§ 4 管理人报告</b> .....	<b>9</b>
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	9
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	10
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	11
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.....	11
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	12
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	12
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	13
<b>§ 5 托管人报告</b> .....	<b>13</b>
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	13
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明.....	13
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.....	14
<b>§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）</b> .....	<b>14</b>
6.1 资产负债表.....	14
6.2 利润表.....	15
6.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	16
6.4 报表附注.....	17
<b>§ 7 投资组合报告</b> .....	<b>31</b>
7.1 期末基金资产组合情况.....	31
7.2 债券回购融资情况.....	31
7.3 基金投资组合平均剩余期限.....	32
7.4 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	33
7.5 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.....	33
7.6 “影子定价”与“摊余成本法”确定的基金资产净值的偏离.....	34
7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细.....	34
7.8 投资组合报告附注.....	34
<b>§ 8 基金份额持有人信息</b> .....	<b>34</b>
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	34
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	35
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况.....	35
8.4 发起式基金发起资金持有份额情况.....	35

§ 9 开放式基金份额变动.....	36
§ 10 重大事件揭示.....	36
10.1 基金份额持有人大会决议.....	36
10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动.....	36
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	36
10.4 基金投资策略的改变.....	37
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	37
10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况.....	37
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	37
10.8 偏离度绝对值超过 0.5%的情况.....	40
10.9 其他重大事件.....	40
§ 11 影响投资者决策的其他重要信息.....	41
§ 12 备查文件目录.....	42
12.1 备查文件目录.....	42
12.2 存放地点.....	42
12.3 查阅方式.....	42

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	大成理财 21 天债券型发起式证券投资基金	
基金简称	大成理财 21 天债券发起式	
基金主代码	090023	
交易代码	090023	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2012 年 11 月 29 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	
报告期末基金份额总额	2,194,034,186.92 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称:	大成理财 21 天债券发起式 A	大成理财 21 天债券发起式 B
下属分级基金的交易代码:	090023	091023
报告期末下属分级基金的份额总额	41,879,838.05 份	2,152,154,348.87 份

### 2.2 基金产品说明

投资目标	以保持基金资产的安全性和适当流动性为首要目标，追求高于业绩比较基准的稳定收益。
投资策略	本基金通过平均剩余期限决策、类属配置、品种选择和其他衍生工具投资策略四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	七天通知存款税后利率
风险收益特征	本基金属于短期理财债券型证券投资基金，长期风险收益水平低于股票型基金、混合型基金，及普通债券型证券投资基金。

### 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	中国银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	王永民
	联系电话	010-66594896
	电子邮箱	fcid@bankofchina.com
客户服务电话	4008885558	95566
传真	0755-83199588	010-66594942
注册地址	深圳市福田区深南大道 7088 号招商银行大厦 32 层	北京市西城区复兴门内大街 1 号
办公地址	深圳市福田区深南大道 7088 号招商银行大厦 32 层	北京市西城区复兴门内大街 1 号
邮政编码	518040	100818
法定代表人	张树忠	田国立

## 2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《证券时报》、《上海证券报》、《中国证券报》
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内大街 1 号中国银行股份有限公司托管及投资者服务部

## 2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	大成基金管理有限公司	深圳市福田区深南大道 7088 号招商银行大厦 32 层

## § 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	大成理财 21 天债券发起式 A	大成理财 21 天债券发起式 B
3.1.1 期间数据和指标	报告期(2014 年 1 月 1 日 - 2014 年 6 月 30 日)	报告期(2014 年 1 月 1 日 - 2014 年 6 月 30 日)
本期已实现收益	1,450,001.45	36,489,936.13
本期利润	1,450,001.45	36,489,936.13
本期净值收益率	2.6607%	2.8088%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2014 年 6 月 30 日)	
期末基金资产净值	41,879,838.05	2,152,154,348.87
期末基金份额净值	1.0000	1.0000
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2014 年 6 月 30 日)	
累计净值收益率	6.9509%	7.4470%

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 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

大成理财 21 天债券发起式 A

阶段	份额净值	业绩比较	业绩比较基	①-③	②-④
----	------	------	-------	-----	-----

	收益率①	收益率标准差②	基准收益率③	准收益率标准差④		
过去一个月	0.3792%	0.0008%	0.1110%	0.0000%	0.2682%	0.0008%
过去三个月	1.2189%	0.0014%	0.3366%	0.0000%	0.8823%	0.0014%
过去六个月	2.6607%	0.0112%	0.6695%	0.0000%	1.9912%	0.0112%
过去一年	4.7700%	0.0082%	1.3500%	0.0000%	3.4200%	0.0082%
自基金合同生效起至今	6.9509%	0.0092%	2.1415%	0.0000%	4.8094%	0.0092%

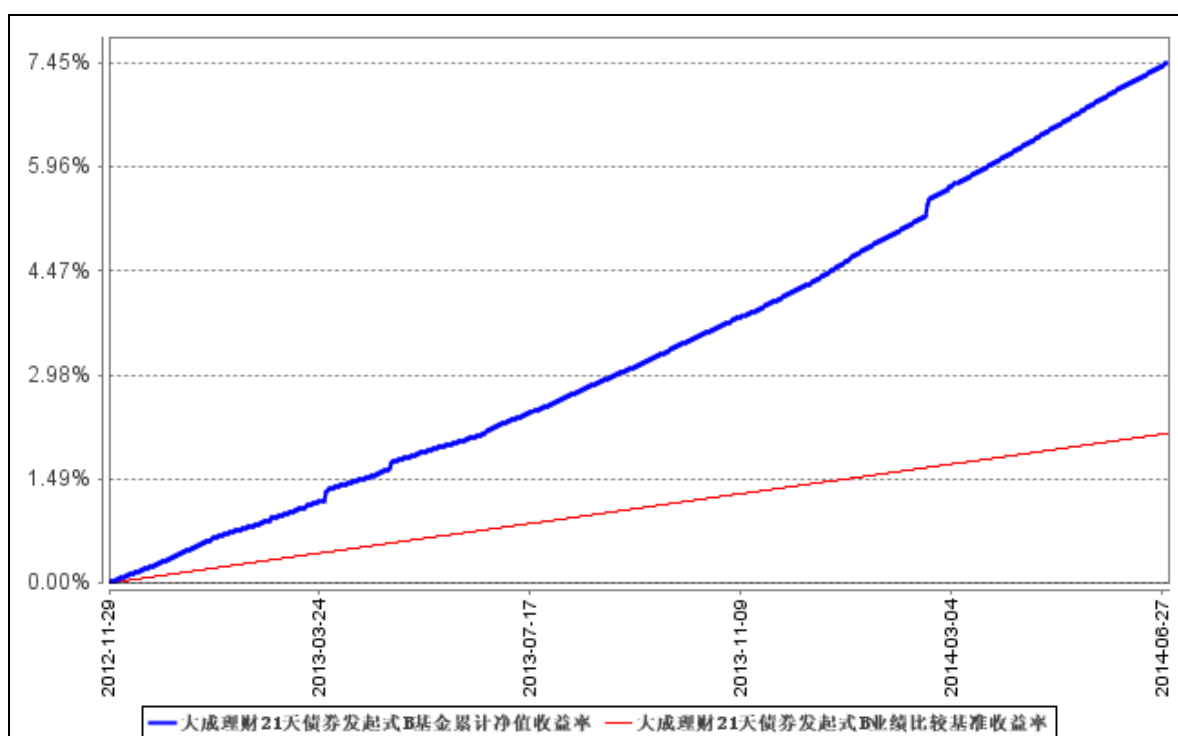
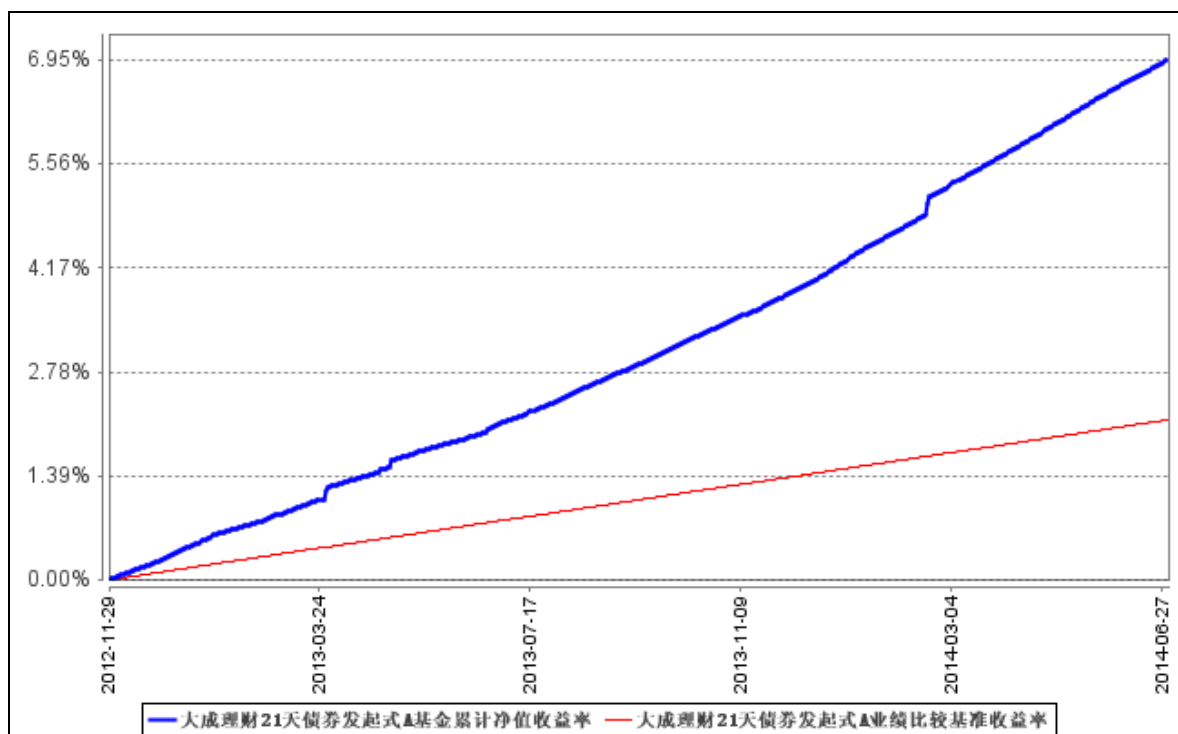
大成理财 21 天债券发起式 B

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	0.4038%	0.0008%	0.1110%	0.0000%	0.2928%	0.0008%
过去三个月	1.2927%	0.0014%	0.3366%	0.0000%	0.9561%	0.0014%
过去六个月	2.8088%	0.0112%	0.6695%	0.0000%	2.1393%	0.0112%
过去一年	5.0742%	0.0082%	1.3500%	0.0000%	3.7242%	0.0082%
自基金合同生效起至今	7.4470%	0.0092%	2.1415%	0.0000%	5.3055%	0.0092%

注：1、本基金根据每日基金收益情况，以基金净收益为基准，为投资者每日计算当日收益并分配，并在运作期期末集中支付。

2、本表净值收益率的计算所采取的运作周期，是按各统计时间段计算以基金合同生效日为起始日并持有至报告期末的基金份额所经历的运作周期。

## 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：按基金合同规定，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有关约定。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。



## § 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 2014 年 6 月 30 日，本基金管理人共管理 1 只封闭式证券投资基金：景福证券投资基金，4 只 ETF 及 1 只 ETF 联接基金：深证成长 40 交易型开放式指数证券投资基金、大成深证成长 40 交易型开放式指数证券投资基金联接基金、大成中证 500 沪市交易型开放式指数证券投资基金、大成中证 100 交易型开放式指数证券投资基金、大成中证 500 深市交易型开放式指数证券投资基金，1 只 QDII 基金：大成标普 500 等权重指数证券投资基金及 37 只开放式证券投资基金：大成景丰债券型证券投资基金（LOF）、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、大成竞争优势股票型证券投资基金、大成内需增长股票型证券投资基金、大成消费主题股票型证券投资基金、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、大成现金宝场内实时申赎货币市场基金、大成景安短融债券型证券投资基金、大成景兴信用债债券型证券投资基金、大成景旭纯债债券型证券投资基金、大成景祥分级债券型证券投资基金、大成中小盘股票型证券投资基金（LOF）、大成健康产业股票型证券投资基金、大成信用增利一年定期开放债券型证券投资基金、大成灵活配置混合型证券投资基金、大成招财宝货币市场基金、大成景益平稳收益混合型证券投资基金。

#### 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		

陶铄 先生	本基金基 金经理	2012 年 11 月 29 日	2014 年 4 月 4 日	7 年	中国科学院管理学硕士。曾任职于招商银行总行、普华永道会计师事务所、穆迪投资者服务有限公司、中国国际金融有限公司。曾担任中国国际金融有限公司固定收益部高级经理、副总经理。2010 年 9 月加入大成基金管理有限公司，历任研究员、基金经理助理。2012 年 2 月 9 日至 2013 年 10 月 15 日任大成景丰分级债券型证券投资基金基金经理。2012 年 9 月 20 日至 2014 年 4 月 4 日任大成月添利理财债券型证券投资基金基金经理。2012 年 11 月 29 日至 2014 年 4 月 4 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 5 月 24 日起任大成景安短融债券型证券投资基金基金经理。2013 年 6 月 4 日起任大成景兴信用债债券型证券投资基金基金经理。2013 年 10 月 16 日起任大成景丰债券型证券投资基金（LOF）基金经理。2014 年 1 月 28 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
屈伟南 先生	本基金基 金经理	2013 年 2 月 1 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 日起任大成理财 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。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合规守信情况的说明

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》、《大成理财 21 天债券型发起式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，大成理财 21

天债券型发起式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

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组合间的成交价格差异较大。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。

##### 4.3.2 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 年上半年公司旗下主动投资组合间股票交易存在 11 笔同日反向交易，原因是投资组合投资策略需要。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，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% 的仅有 3 笔，原因为投资策略需要；投资组合间存在 1 笔债券同日反向交易，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；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 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

2014 年上半年，世界经济继续温和复苏。美国经济活动重新加速，第二季度 GDP 环比折年率增长 4.0%，欧元区经济则继续微弱复苏。我国受房地产开发投资增速放缓，经济增速持续下滑。一、二季度 GDP 增速分别为 7.4% 和 7.5%，低于 2013 年的 7.7%。通胀方面，受食品价格影响，上半年 CPI 同比仅为 2.3%。受国内外需求的影响，PPI 上半年同比为 -1.8%。因此，从整体宏观环境

来看，对债券市场较为有利。在经济持续放缓、企业盈利下滑等背景下，央行态度较去年下半年明显好转。央行通过再贷款、定向降准等定向宽松的方式降低融资成本，同时在公开市场上持续保持净投放。上半年银行间 7 天回购利率均值由去年下半年的 4.36% 降至 3.69%，3 月 SHIBOR 回落至 4.75%。各期限收益率亦出现大幅下行，其中 1 年国开债下行 120BP，AAA、AA+、AA 短融均下行 165BP 以上。

在组合投资方面，一季度，由于组合规模大幅增长，因此适时调整了久期策略，加大了组合的剩余期限。在类属配置方面，以同业存款的为主，适度增加短融的配置额度。二季度由于组合规模相对稳定，因此在类属配置方面，主要延续了前期的配置思路，以同业存款和逆回购为主，保持组合净收益，同时适度增加短融的配置力度。在短融投资方面，新增短融以 AA+ 和 AA 为主。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

报告期内本基金 A 级净值收益率为 2.6607%，B 级净值收益率 2.8088%，期间业绩比较基准收益率为 0.6695%。

#### 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，由于主要城市地产销量同比持续大幅下降，发电增速未有明显改善，经济增速难以乐观。目前经济增长虽在“微刺激”政策的带动下呈现出复苏迹象，但这一复苏势头对稳增长政策高度依赖，并面临着来自地产和基数效应的压力，因而并不稳固。去年 3 季度，GDP 增速从去年 2 季度的 7.5% 回升至 7.8%。这种基数的上升，会给今年 3 季度的经济和投资同比增速带来向下压力。在总需求回落的背景下，通胀总体不需担忧。在政府要求降低社会融资成本的指导理想下，预计下半年央行仍会保持政策的连续性和稳定性，坚持“总量稳定、结构优化”的取向，保持货币市场稳定。因此，目前短端信用和利率绝对收益率水平虽较年初大幅下行，但仍处历史高位，具有一定的配置价值。但随着经济的进一步下行，对于低评级短融的投资上应谨慎对待。

基于上述分析，2014 年下半年，组合将适度提高组合剩余期限。在类属配置方面，我们将密切跟踪市场的变化，在充分做好流动性管理的前提下，适度加大短融的配置比例。同时密切关注同业存款政策的变化，力争在保持组合流动性的前提下，为投资者带来长期稳定的投资收益。

#### 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情况，以基金净收益为基准，为投资者每日计算当日收益并分配，并在运作期期末集中支付。本报告期内本基金应分配利润 37,939,937.58 元，报告期内已分配利润 37,939,937.58 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

本报告期内，中国银行股份有限公司（以下称“本托管人”）在对大成理财 21 天债券型发起式证券投资基金（以下称“本基金”）的托管过程中，严格遵守《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有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了应尽的义务。

#### 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

本报告期内，本托管人根据《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，对本基金管理人的投资运作进行了必要的监督，对基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算以及基金费用开支等方面进行了认真地复核，未发现本基金管理人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

本报告中的财务指标、净值收益表现、收益分配情况、财务会计报告（注：财务会计报告中的“金融工具风险及管理”部分未在托管人复核范围内）、投资组合报告等数据真实、准确和完整。

## § 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：大成理财 21 天债券型发起式证券投资基金

报告截止日：2014 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2014 年 6 月 30 日	上年度末 2013 年 12 月 31 日
<b>资产：</b>			
银行存款	6.4.3.1	1,217,009,904.24	25,264,087.15
结算备付金		-	-
存出保证金		-	-
交易性金融资产	6.4.3.2	490,161,204.60	89,683,388.49
其中：股票投资		-	-
基金投资		-	-
债券投资		490,161,204.60	89,683,388.49
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	6.4.3.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.3.4	700,001,200.00	34,920,172.38
应收证券清算款		-	-
应收利息	6.4.3.5	31,229,509.73	1,864,658.91
应收股利		-	-
应收申购款		-	137,000.00
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.3.6	-	-
资产总计		2,438,401,818.57	151,869,306.93
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2014 年 6 月 30 日</b>	<b>上年度末 2013 年 12 月 31 日</b>
<b>负债：</b>			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.3.3	-	-

卖出回购金融资产款		239,799,010.10	36,529,781.73
应付证券清算款		-	-
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		490,865.80	29,559.00
应付托管费		145,441.70	8,758.21
应付销售服务费		29,382.22	10,489.54
应付交易费用	6.4.3.7	27,983.81	16,675.18
应交税费		-	-
应付利息		69,616.40	3,241.71
应付利润		3,622,916.88	270,090.89
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.3.8	182,414.74	159,000.00
负债合计		244,367,631.65	37,027,596.26
<b>所有者权益：</b>			
实收基金	6.4.3.9	2,194,034,186.92	114,841,710.67
未分配利润	6.4.3.10	-	-
所有者权益合计		2,194,034,186.92	114,841,710.67
负债和所有者权益总计		2,438,401,818.57	151,869,306.93

注：报告截止日 2014 年 6 月 30 日，基金份额净值 1.0000 元，基金份额总额 2,194,034,186.92 份，其中 A 类基金份额总额为 41,879,838.05 份，B 类基金份额的份额总额为 2,152,154,348.87 份。

## 6.2 利润表

会计主体：大成理财 21 天债券型发起式证券投资基金

本报告期：2014 年 1 月 1 日至 2014 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期	上年度可比期间
		2014 年 1 月 1 日至 2014 年 6 月 30 日	2013 年 1 月 1 日至 2013 年 6 月 30 日
<b>一、收入</b>		42,178,741.25	8,785,577.78
1. 利息收入		41,652,649.15	7,612,663.10
其中：存款利息收入	6.4.3.11	32,280,615.16	3,946,402.87
债券利息收入		6,785,720.69	3,040,207.16
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		2,586,313.30	626,053.07
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		526,092.10	1,172,914.68
其中：股票投资收益	6.4.3.12	-	-
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.3.13	526,092.10	1,172,914.68
资产支持证券投资收益	6.4.3.13.1	-	-
贵金属投资收益	6.4.3.14	-	-

衍生工具收益	6.4.3.15	-	-
股利收益	6.4.3.16	-	-
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.3.17	-	-
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.3.18	-	-
<b>减：二、费用</b>		4,238,803.67	1,951,519.23
1. 管理人报酬	6.4.6.2.1	1,974,461.14	510,756.93
2. 托管费	6.4.6.2.2	585,025.47	151,335.39
3. 销售服务费	6.4.6.2.3	155,458.24	328,620.06
4. 交易费用	6.4.3.19	-	-
5. 利息支出		1,305,882.63	734,690.13
其中：卖出回购金融资产支出		1,305,882.63	734,690.13
6. 其他费用	6.4.3.20	217,976.19	226,116.72
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		37,939,937.58	6,834,058.55
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		37,939,937.58	6,834,058.55

### 6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：大成理财 21 天债券型发起式证券投资基金

本报告期：2014 年 1 月 1 日至 2014 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2014 年 1 月 1 日至 2014 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）	114,841,710.67	-	114,841,710.67
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	37,939,937.58	37,939,937.58
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）	2,079,192,476.25	-	2,079,192,476.25
其中：1. 基金申购款	4,197,317,891.68	-	4,197,317,891.68
2. 基金赎回款	-2,118,125,415.43	-	-2,118,125,415.43



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）	-	-37,939,937.58	-37,939,937.58
五、期末所有者权益（基金净值）	2,194,034,186.92	-	2,194,034,186.92
项目	上年度可比期间 2013 年 1 月 1 日至 2013 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）	1,334,791,660.06	-	1,334,791,660.06
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	6,834,058.55	6,834,058.55
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）	-1,190,937,790.62	-	-1,190,937,790.62
其中：1. 基金申购款	684,055,627.56	-	684,055,627.56
2. 基金赎回款	-1,874,993,418.18	-	-1,874,993,418.18
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）	-	-6,834,058.55	-6,834,058.55
五、期末所有者权益（基金净值）	143,853,869.44	-	143,853,869.44

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：

<u>张树忠</u>	<u>刘彩晖</u>	<u>范瑛</u>
基金管理人负责人	主管会计工作负责人	会计机构负责人

#### 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。

##### 6.4.2 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128 号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2004]78 号《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》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1) 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。

(2) 基金买卖债券的差价收入暂免征营业税和企业所得税。

(3) 对基金取得的企业债券利息收入，由发行债券的企业在向基金派发利息时代扣代缴 20% 的个人所得税，暂不征收企业所得税。

#### 6.4.3 重要财务报表项目的说明

##### 6.4.3.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2014 年 6 月 30 日
活期存款	2,009,904.24
定期存款	-
其中：存款期限 1-3 个月	-
其他存款	1,215,000,000.00
合计：	1,217,009,904.24

注：1. 其他存款为根据协议可提前支取且没有利息损失的协议存款。

2. 本基金于本报告期末未投资于定期存款。

##### 6.4.3.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2014 年 6 月 30 日				
	摊余成本	影子定价	偏离金额	偏离度	
债券	交易所市场	-	-	-	0.0000%
	银行间市场	490,161,204.60	492,276,000.00	2,114,795.40	0.0964%
	合计	490,161,204.60	492,276,000.00	2,114,795.40	0.0964%

注：1. 偏离金额 = 影子定价 - 摊余成本；

2. 偏离度 = 偏离金额 / 摊余成本法确定的基金资产净值。

##### 6.4.3.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末未持有衍生金融资产/负债。

## 6.4.3.4 买入返售金融资产

## 6.4.3.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

单位：人民币元

项目	本期末 2014年6月30日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
买入返售证券_银行间	700,001,200.00	-
合计	700,001,200.00	-

## 6.4.3.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金于本期末无买断式逆回购交易中取得的债券。

## 6.4.3.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2014年6月30日
应收活期存款利息	180.94
应收定期存款利息	-
应收其他存款利息	22,677,666.14
应收结算备付金利息	-
应收债券利息	7,151,303.75
应收买入返售证券利息	1,400,358.90
应收申购款利息	-
应收黄金合约拆借孳息	-
其他	-
合计	31,229,509.73

## 6.4.3.6 其他资产

本基金本报告期末未持有其他资产。

## 6.4.3.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2014年6月30日
交易所市场应付交易费用	-
银行间市场应付交易费用	27,983.81
合计	27,983.81

## 6.4.3.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2014年6月30日
----	-------------------

应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	-
预提费用	182,414.74
合计	182,414.74

#### 6.4.3.9 实收基金

金额单位：人民币元

大成理财 21 天债券发起式 A		
项目	本期 2014 年 1 月 1 日至 2014 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	29,044,154.85	29,044,154.85
本期申购	243,535,569.62	243,535,569.62
本期赎回（以“-”号填列）	-230,699,886.42	-230,699,886.42
本期末	41,879,838.05	41,879,838.05

金额单位：人民币元

大成理财 21 天债券发起式 B		
项目	本期 2014 年 1 月 1 日至 2014 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	85,797,555.82	85,797,555.82
本期申购	3,953,782,322.06	3,953,782,322.06
本期赎回（以“-”号填列）	-1,887,425,529.01	-1,887,425,529.01
本期末	2,152,154,348.87	2,152,154,348.87

注：申购份额含红利再投和因份额升降级导致的强制调增份额，赎回份额含因份额升降级导致的强制调减份额。

#### 6.4.3.10 未分配利润

单位：人民币元

大成理财 21 天债券发起式 A			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-	-	-
本期利润	1,450,001.45	-	1,450,001.45
本期基金份额交易产生的变动数	-	-	-
其中：基金申购款	-	-	-
基金赎回款	-	-	-
本期已分配利润	-1,450,001.45	-	-1,450,001.45
本期末	-	-	-

单位：人民币元

大成理财 21 天债券发起式 B			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-	-	-
本期利润	36,489,936.13	-	36,489,936.13
本期基金份额交易产生的变动数	-	-	-
其中：基金申购款	-	-	-
基金赎回款	-	-	-
本期已分配利润	-36,489,936.13	-	-36,489,936.13
本期末	-	-	-

#### 6.4.3.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2014年1月1日至2014年6月30日
活期存款利息收入	4,747.94
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	32,275,769.54
结算备付金利息收入	97.68
其他	-
合计	32,280,615.16

#### 6.4.3.12 股票投资收益

本报告期内本基金无股票投资收益。

#### 6.4.3.13 债券投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2014年1月1日至2014年6月30日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	352,154,984.59
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	348,194,045.24
减：应收利息总额	3,434,847.25
债券投资收益	526,092.10

#### 6.4.3.14 贵金属投资收益

本报告期内本基金无贵金属投资收益。

#### 6.4.3.15 衍生工具收益

本报告期内本基金无衍生工具收益。

#### 6.4.3.16 股利收益

本报告期内本基金无股利收益。

**6.4.3.17 公允价值变动收益**

本报告期内本基金无公允价值变动收益。

**6.4.3.18 其他收入**

本报告期内本基金无其他收入。

**6.4.3.19 交易费用**

本报告期内本基金无交易费用。

**6.4.3.20 其他费用**

单位：人民币元

项目	本期 2014 年 1 月 1 日至 2014 年 6 月 30 日
信息披露费	148,765.71
银行汇划费用	26,311.45
审计费用	24,795.19
上清所债券托管帐户维护费	8,926.92
中债登债券托管帐户维护费	8,926.92
其他	250.00
合计	217,976.19

**6.4.4 或有事项、资产负债表日后事项的说明****6.4.4.1 或有事项**

截至资产负债表日，本基金并无须作披露的或有事项。

**6.4.4.2 资产负债表日后事项**

截至本会计报表批准报出日，本基金并无须作披露的资产负债表日后事项。

**6.4.5 关联方关系****6.4.5.1 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。

**6.4.5.2 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（“大成基金”）	基金管理人、注册登记机构、基金销售机构
中国银行股份有限公司（“中国银行”）	基金托管人、基金代销机构
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、基金代销机构

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
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”)	基金管理人的合资子公司

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. 下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

#### 6.4.6 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

##### 6.4.6.1 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。

##### 6.4.6.2 关联方报酬

###### 6.4.6.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2014 年 1 月 1 日至 2014 年 6 月 30 日	2013 年 1 月 1 日至 2013 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	1,974,461.14	510,756.93
其中：支付销售机构的客户维护费	66,743.14	209,427.37

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 0.27% 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 X 0.27% / 当年天数。

###### 6.4.6.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2014 年 1 月 1 日至 2014 年 6 月 30 日	2013 年 1 月 1 日至 2013 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	585,025.47	151,335.39

注：支付基金托管人中国银行的托管费按前一日基金资产净值 0.08% 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 X 0.08% / 当年天数。

###### 6.4.6.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的	本期
----------	----

各关联方名称	2014 年 1 月 1 日至 2014 年 6 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	大成理财 21 天债券发起式 A	大成理财 21 天债券发起式 B	合计
大成基金	6,396.56	66,900.24	73,296.80
中国银行	75,719.62	3,275.61	78,995.23
合计	82,116.18	70,175.85	152,292.03
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2013 年 1 月 1 日至 2013 年 6 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	大成理财 21 天债券发起式 A	大成理财 21 天债券发起式 B	合计
大成基金	2,953.10	13.71	2,966.81
中国银行	317,757.81	7,895.44	325,653.25
合计	320,710.91	7,909.15	328,620.06

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 类基金份额和 B 类基金份额约定的销售服务费年费率分别为 0.30% 和 0.01%。销售服务费的计算公式为：

$$\text{日销售服务费} = \text{前一日基金资产净值} \times \text{约定年费率} / \text{当年天数}。$$

#### 6.4.6.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

单位：人民币元

本期 2014 年 1 月 1 日至 2014 年 6 月 30 日						
银行间市场交易的各关联方名称	债券交易金额		基金逆回购		基金正回购	
	基金买入	基金卖出	交易金额	利息收入	交易金额	利息支出
中国银行	-	10,355,487.81	-	-	305,050,000.00	20,546.29
上年度可比期间 2013 年 1 月 1 日至 2013 年 6 月 30 日						
银行间市场交易的各关联方名称	债券交易金额		基金逆回购		基金正回购	
	基金买入	基金卖出	交易金额	利息收入	交易金额	利息支出
中国银行	-	-	-	-	59,000,000.00	7,905.17

#### 6.4.6.4 各关联方投资本基金的情况

##### 6.4.6.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

份额单位：份

项目	本期
----	----



	2014 年 1 月 1 日至 2014 年 6 月 30 日	
	大成理财 21 天债券发起式 A	大成理财 21 天债券发起式 B
基金合同生效日（2012 年 11 月 29 日）持有的基金份额	-	-
期初持有的基金份额	-	10,423,393.38
期间申购/买入总份额	-	91,108,754.59
期间因拆分变动份额	-	-
减：期间赎回/卖出总份额	-	-
期末持有的基金份额	-	101,532,147.97
期末持有的基金份额占基金总份额比例	0.00%	4.63%

项目	上年度可比期间	
	2013 年 1 月 1 日至 2013 年 6 月 30 日	
	大成理财 21 天债券发起式 A	大成理财 21 天债券发起式 B
基金合同生效日（2012 年 11 月 29 日）持有的基金份额	-	-
期初持有的基金份额	-	10,021,809.07
期间申购/买入总份额	-	200,375.34
期间因拆分变动份额	-	-
减：期间赎回/卖出总份额	-	-
期末持有的基金份额	-	10,222,184.41
期末持有的基金份额占基金总份额比例	0.00%	11.87%

注：1、期间申购份额包含期间收益再投资份额，基金管理人大成基金管理有限公司于本报告期间申购本基金 90,000,000.00 份，申购本基金的费率与本基金法律文件规定一致。

2、基金管理人大成基金管理有限公司发起认购本基金的交易委托中国银行办理，认购本基金的费率与本基金法律文件规定一致。

#### 6.4.6.4.2 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

##### 大成理财 21 天债券发起式 B

份额单位：份

关联方名称	本期末 2014 年 6 月 30 日		上年度末 2013 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
大成创新资本	10,089,298.18	0.46%	-	0.00%

注：基金管理人子公司-大成创新资本于本报告期间申购本基金 10,000,000.00 份，申购本基金的

费率与本基金法律文件规定一致；大成创新资本自有资金持有份额变化由收益分配引起。

#### 6.4.6.5 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 2014年1月1日至2014年6月30日		上年度可比期间 2013年1月1日至2013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
中国银行	2,009,904.24	4,747.94	3,120,683.31	15,469.71

注：本基金的银行活期存款由基金托管人中国银行保管，按银行同业利率计息。

#### 6.4.6.6 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。

#### 6.4.6.7 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。

#### 6.4.7 利润分配情况

##### 6.4.7.1 利润分配情况——货币市场基金

金额单位：人民币元

##### 大成理财21天债券发起式A

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	本期利润分配 合计	备注
973,401.75	477,885.16	-1,285.46	1,450,001.45	

##### 大成理财21天债券发起式B

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	本期利润分配 合计	备注
27,454,551.97	5,681,272.71	3,354,111.45	36,489,936.13	

#### 6.4.8 期末（2014年6月30日）本基金持有的流通受限证券

##### 6.4.8.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

本基金本期末无因认购新发/增发证券而流通受限的证券。

##### 6.4.8.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金本期末无暂时停牌等流通受限的股票。

##### 6.4.8.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

##### 6.4.8.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末2014年06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 239,799,010.10 元，是以如下债券作为抵押：

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
140207	14 国开 07	2014-07-04	100.36	1,200,000	120,432,000.00
130212	13 国开 12	2014-07-04	99.70	200,000	19,940,000.00
090306	09 进出 06	2014-07-04	100.18	100,000	10,018,000.00
041455023	14 北方水泥 CP002	2014-07-01	100.24	200,000	20,048,000.00
041459042	14 包钢集 CP002	2014-07-01	99.86	200,000	19,972,000.00
041359068	13 桑德 CP001	2014-07-01	100.99	200,000	20,198,000.00
041464036	14 张资产 CP001	2014-07-01	100.26	200,000	20,052,000.00
011420005	14 中铝 SCP005	2014-07-01	100.31	100,000	10,031,000.00
041472001	14 宁技发 CP001	2014-07-01	100.89	20,000	2,017,800.00
041461004	14 浙手工 CP001	2014-07-01	101.14	20,000	2,022,800.00
合计				2,440,000	244,731,600.00

#### 6.4.8.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2014 年 6 月 30 日止，本基金无从事证券交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款的余额。

#### 6.4.9 金融工具风险及管理

##### 6.4.9.1 风险管理政策和组织架构

本基金投资于各类固定收益类金融工具，属于低风险合理稳定收益品种。本基金的基金管理人从事风险管理的主要目标是争取将以上风险控制在限定的范围之内，使本基金在风险和收益之间取得最佳的平衡以实现“低风险、高流动性和持续稳定收益”的风险收益目标。

本基金的基金管理人奉行全面风险管理体系的建设，建立了以由高层监控（董事会合规审计和风险控制委员会、公司投资风险控制委员会）、专业监控（监察稽核部、风险管理部）、部门互控、岗位自控构成的风险管理架构体系。本基金的基金管理人在董事会下设立合规审计和风险控制委员会，对公司整体运营风险进行监督，监督风险控制措施的执行；在管理层层面设立投资风险控制委员会，通过定期会议讨论涉及投资风险的重大议题，形成正式决议提交投委会；在业务操作层面，监察稽核部履行合规控制职责，通过定期、不定期检查内控制度的执行情况、对重大风险点以专项稽核的方式确保公司内控制度、流程得到贯彻执行。风险管理部履行风险量化评估分析职责。

本基金的基金管理人对于金融工具的风险管理方法主要是通过定性分析和定量分析的方法去估测各种风险产生的可能损失。从定性分析的角度出发，判断风险损失的严重程度和出现同类风险损失的频度。而从定量分析的角度出发，根据本基金的投资目标，结合基金资产所运用金融工

其特征通过特定的风险量化指标、模型，日常的量化报告，确定风险损失的限度和相应置信程度，及时可靠地对各种风险进行监督、检查和评估，并通过相应决策，将风险控制在可承受的范围内。

#### 6.4.9.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息等情况，导致基金资产损失和收益变化的风险。

本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的银行存款存放在本基金的托管行中国银行，与该银行存款相关的信用风险不重大。其他协议存款存放在民生银行、上海银行及中信银行，与银行存款相关的信用风险不重大。本基金在交易所进行的交易均以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，违约风险可能性很小；在银行间同业市场进行交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式进行限制以控制相应的信用风险。

本基金的基金管理人建立了信用风险管理流程，通过对投资品种信用等级评估来控制证券发行人的信用风险，且通过分散化投资以分散信用风险。

本基金债券投资的信用评级情况按《中国人民银行信用评级管理指导意见》设定的标准统计及汇总。

##### 6.4.9.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2014年6月30日	上年度末 2013年12月31日
A-1	300,321,271.92	79,708,471.65
A-1 以下	-	-
未评级	189,839,932.68	-
合计	490,161,204.60	79,708,471.65

注：上述债券信用未评级包含政策性金融债及超短融债。

##### 6.4.9.2.2 按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2014年6月30日	上年度末 2013年12月31日
AAA	-	-
AAA 以下	-	-
未评级	-	9,974,916.84
合计	-	9,974,916.84

注：上述债券信用未评级包含政策性金融债。

### 6.4.9.3 流动性风险

流动性风险是指基金所持金融工具变现的难易程度。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难或因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理的价格变现。

针对兑付赎回资金的流动性风险，本基金的基金管理人每日对本基金的申购赎回情况进行严密监控并预测流动性需求，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配。本基金的基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。

针对投资品种变现的流动性风险，本基金的基金管理人主要通过限制、跟踪和控制基金投资交易的不活跃品种(企业债或短期融资券)来实现。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 141 天，且能够通过出售所持有的银行间同业市场交易债券应对流动性需求。此外本基金还可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，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 40%。

于 2014 年 6 月 30 日，除卖出回购金融资产款余额中有 239,799,010.10 元将在一个月以内到期且计息(该利息金额不重大)外，本基金所承担的全部金融负债的合同约定到期日均为一个月以内且不计息，可赎回基金份额净值(所有者权益)无固定到期日且不计息，因此账面余额即约为未折现的合约到期现金流量。

### 6.4.9.4 市场风险

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动而发生波动的风险，包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

#### 6.4.9.4.1 利率风险

利率风险是指金融工具的公允价值或现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。利率敏感性金融工具均面临由于市场利率上升而导致公允价值下降的风险，其中浮动利率类金融工具还面临每个付息期间结束根据市场利率重新定价时对于未来现金流影响的风险。

本基金主要投资于银行间同业市场交易的固定收益品种，因此存在相应的利率风险。本基金的基金管理人每日通过“影子定价”对本基金面临的市场风险进行监控，定期对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控，并通过调整投资组合的久期等方法对上述利率风险进行管理。

##### 6.4.9.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末	6 个月以内	6 个月-1 年	1-5 年	5 年以	不计息	合计

2014 年 6 月 30 日				上		
资产						
银行存款	1,217,009,904.24	-	-	-	-	1,217,009,904.24
交易性金融资产	160,030,601.06	330,130,603.54	-	-	-	490,161,204.60
买入返售金融资产	700,001,200.00	-	-	-	-	700,001,200.00
应收利息	-	-	-	-	31,229,509.73	31,229,509.73
其他资产	-	-	-	-	-	-
资产总计	2,077,041,705.30	330,130,603.54	-	-	31,229,509.73	2,438,401,818.57
负债						
卖出回购金融资产款	239,799,010.10	-	-	-	-	239,799,010.10
应付管理人报酬	-	-	-	-	490,865.80	490,865.80
应付托管费	-	-	-	-	145,441.70	145,441.70
应付销售服务费	-	-	-	-	29,382.22	29,382.22
应付交易费用	-	-	-	-	27,983.81	27,983.81
应付利息	-	-	-	-	69,616.40	69,616.40
应付利润	-	-	-	-	3,622,916.88	3,622,916.88
其他负债	-	-	-	-	182,414.74	182,414.74
负债总计	239,799,010.10	-	-	-	4,568,621.55	244,367,631.65
利率敏感度缺口	1,837,242,695.20	330,130,603.54	-	-	26,660,888.18	2,194,034,186.92
上年度末 2013 年 12 月 31 日	6 个月以内	6 个月-1 年	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产						
银行存款	25,264,087.15	-	-	-	-	25,264,087.15
交易性金融资产	89,683,388.49	-	-	-	-	89,683,388.49
买入返售金融资产	34,920,172.38	-	-	-	-	34,920,172.38
应收利息	-	-	-	-	1,864,658.91	1,864,658.91
应收申购款	-	-	-	-	137,000.00	137,000.00
其他资产	-	-	-	-	-	-
资产总计	149,867,648.02	-	-	-	2,001,658.91	151,869,306.93
负债						
卖出回购金融资产款	36,529,781.73	-	-	-	-	36,529,781.73
应付管理人报酬	-	-	-	-	29,559.00	29,559.00
应付托管费	-	-	-	-	8,758.21	8,758.21
应付销售服务费	-	-	-	-	10,489.54	10,489.54
应付交易费用	-	-	-	-	16,675.18	16,675.18
应付利息	-	-	-	-	3,241.71	3,241.71
应付利润	-	-	-	-	270,090.89	270,090.89
其他负债	-	-	-	-	159,000.00	159,000.00
负债总计	36,529,781.73	-	-	-	497,814.53	37,027,596.26
利率敏感度缺口	113,337,866.29	-	-	-	1,503,844.38	114,841,710.67

注：表中所示为本基金资产及负债的账面价值，并按照合约规定的利率重新定价日或到期日孰早者予以分类。

## 6.4.9.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假	除市场利率以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2014 年 6 月 30 日）	上年度末（2013 年 12 月 31 日）
	市场利率下降 25 个基点	732,894.51	60,000.00
	市场利率上升 25 个基点	-730,286.60	-60,000.00

## 6.4.9.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无重大外汇风险。

## 6.4.9.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于银行间同业市场交易的固定收益品种，因此无重大其他价格风险。

## 6.4.10 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

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	490,161,204.60	20.10
	其中：债券	490,161,204.60	20.10
	资产支持证券	-	0.00
2	买入返售金融资产	700,001,200.00	28.71
	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	1,217,009,904.24	49.91
4	其他各项资产	31,229,509.73	1.28
5	合计	2,438,401,818.57	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	10.05

	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	239,799,010.10	10.93
	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

本基金合同约定：“本基金进入全国银行间同业市场进行债券回购的资金余额不得超过基金资产净值的 40%”，本报告期内，本基金未发生超标情况。

## 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	87
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	137
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	54

### 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 141 天”，本报告期内，本基金未发生超标情况。

### 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	32.68	10.93
	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	1.36	0.00
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	0.90	0.00
3	60 天(含)—90 天	56.52	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)—180 天	4.11	0.00
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	0.00	0.00



5	180 天(含)—397 天(含)	15.05	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		109.71	10.93

## 7.4 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	149,838,999.47	6.83
	其中：政策性金融债	149,838,999.47	6.83
4	企业债券	-	0.00
5	企业短期融资券	340,322,205.13	15.51
6	中期票据	-	0.00
7	其他	-	0.00
8	合计	490,161,204.60	22.34
9	剩余存续期超过 397 天的浮动利率债券	19,793,562.95	0.90

## 7.5 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	140207	14 国开 07	1,200,000	120,052,121.43	5.47
2	041366015	13 包钢 CP001	600,000	60,124,785.11	2.74
3	041455015	14 瘦西湖 CP001	300,000	30,000,752.71	1.37
4	011485001	14 北控集 SCP001	300,000	30,000,595.37	1.37
5	041360058	13 广安爱众 CP001	200,000	20,067,646.05	0.91
6	041359068	13 桑德 CP001	200,000	20,050,696.49	0.91
7	041459042	14 包钢集 CP002	200,000	20,002,387.36	0.91
8	041464036	14 张资产 CP001	200,000	20,001,835.56	0.91
9	041472010	14 宁国投 CP001	200,000	20,001,485.56	0.91
10	041455023	14 北方水泥 CP002	200,000	20,000,597.50	0.91

## 7.6 “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	19
报告期内偏离度的最高值	0.4865%
报告期内偏离度的最低值	0.0211%
报告期内每个交易日偏离度的绝对值的简单平均值	0.1244%

## 7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

本报告期末未持有资产支持证券。

## 7.8 投资组合报告附注

7.8.1 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 1.0000 元。

7.8.2 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。

7.8.3 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。

## 7.8.4 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	-
2	应收证券清算款	-
3	应收利息	31,229,509.73
4	应收申购款	-
5	其他应收款	-
6	待摊费用	-
7	其他	-
8	合计	31,229,509.73

## 7.8.5 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。

## §8 基金份额持有人信息

## 8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额级别	持有人户	户均持有的基金份额	持有人结构	
			机构投资者	个人投资者

	数 (户)		持有份额	占总份 额比例	持有份额	占总份 额比例
大成理财 21 天债券 发起式 A	573	73,088.72	2,890,561.88	6.90%	38,989,276.17	93.10%
大成理财 21 天债券 发起式 B	5	430,430,869.77	2,152,154,348.87	100.00%	-	0.00%
合计	578	3,795,906.90	2,155,044,910.75	98.22%	38,989,276.17	1.78%

注：1、上述机构/个人投资者持有份额占总份额比例的计算中，对分级份额，比例的分母采用各自级别的份额，对合计数，比例的分母采用下属分级基金份额的合计数（即期末基金份额总额）。

2、持有人户数为有效户数，即存量份额大于零的账户。

## 8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数（份）	占基金总份额比例
基金管理人所有 从业人员持有本 基金	大成理财 21 天债券发起式 A	50,135.40	0.1197%
	大成理财 21 天债券发起式 B	-	0.0000%
	合计	50,135.40	0.0023%

注：上述占基金总份额比例的计算中，对分级份额，比例的分母采用各自级别的份额，对合计数，比例的分母采用下属分级基金份额的合计数（即期末基金份额总额）。

## 8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

项目	份额级别	持有基金份额总量的 数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和研 究部门负责人持有本开放式基金	大成理财 21 天债券发起式 A	0
	大成理财 21 天债券发起式 B	0
	合计	0
本基金基金经理持有本开放式基金	大成理财 21 天债券发起式 A	0
	大成理财 21 天债券发起式 B	0
	合计	0

## 8.4 发起式基金发起资金持有份额情况

项目	持有份额总数	持有份额 占基金总 份额比例 (%)	发起份额总数	发起份额 占基金总 份额比例 (%)	发起份额 承诺持有 期限
基金管理人固有资金	10,728,464.23	0.49	10,000,000.00	0.46	3 年
基金管理人高级管理人员	-	0.00	-	0.00	-
基金经理等人员	-	0.00	-	0.00	-

基金管理人股东	-	0.00	-	0.00	-
其他	-	0.00	-	0.00	-
合计	10,728,464.23	0.49	10,000,000.00	0.46	-

注：本报告期间基金管理人固有资金持有份额变化均由收益分配引起。比例的分母采用各分级基金份额的合计数。

## § 9 开放式基金份额变动

单位：份

	大成理财 21 天债券发起式 A	大成理财 21 天债券发起式 B
基金合同生效日（2012 年 11 月 29 日）基金份额总额	2,216,351,283.87	1,404,512,744.10
本报告期期初基金份额总额	29,044,154.85	85,797,555.82
本报告期基金总申购份额	243,535,569.62	3,953,782,322.06
减：本报告期基金总赎回份额	230,699,886.42	1,887,425,529.01
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期末基金份额总额	41,879,838.05	2,152,154,348.87

## § 10 重大事件揭示

### 10.1 基金份额持有人大会决议

报告期内无基金份额持有人大会决议。

### 10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本报告期内，基金管理人于 2014 年 1 月 25 日发布了《大成基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告》，经大成基金管理有限公司第五届董事会第二十八次会议审议通过，王颢先生不再担任大成基金管理有限公司总经理，由董事长张树忠先生代任公司总经理。

2014 年 2 月 14 日中国银行股份有限公司公告，自 2014 年 2 月 13 日起，陈四清先生担任本行行长。

报告期内基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

### 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内没有涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

#### 10.4 基金投资策略的改变

基金投资策略在本报告期内没有重大改变。

#### 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金聘任的为本基金审计的会计师事务所为普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙), 该事务所自基金合同生效日起为本基金提供审计服务至今。

#### 10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期, 本基金管理人、托管人及高级管理人员未受到监管部门稽查或处罚。

#### 10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

##### 10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位: 人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
安信证券	2	-	0.00%	-	0.00%	-
渤海证券	2	-	0.00%	-	0.00%	-
财富证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
长江证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
东方证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
东海证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
东莞证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
东吴证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
光大证券	2	-	0.00%	-	0.00%	-
广发证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
广州证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
国都证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
国海证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
国泰君安	1	-	0.00%	-	0.00%	-
国信证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
海通证券	2	-	0.00%	-	0.00%	-
华宝证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
华福证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
华林证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-

华泰证券	2	-	0.00%	-	0.00%	-
华鑫证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
江海证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
民生证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
民族证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
齐鲁证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
申银万国	1	-	0.00%	-	0.00%	-
天源证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
万和证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
万联证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
西南证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
湘财证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
银河证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
英大证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
招商证券	2	-	0.00%	-	0.00%	-
中航证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
中金公司	2	-	0.00%	-	0.00%	-
中投证券	3	-	0.00%	-	0.00%	-
中信证券	2	-	0.00%	-	0.00%	-
中银国际	1	-	0.00%	-	0.00%	-

注：根据中国证监会颁布的《关于完善证券投资基金交易席位制度有关问题的通知》（证监基金字[2007]48号）的有关规定，本公司制定了租用证券公司交易单元的选择标准和程序。

租用证券公司交易单元的选择标准主要包括：

- （一）财务状况良好，最近一年无重大违规行为；
- （二）经营行为规范，内控制度健全，能满足各投资组合运作的保密性要求；
- （三）研究实力较强，能提供包括研究报告、路演服务、协助进行上市公司调研等研究服务；
- （四）具备各投资组合运作所需的高效、安全的通讯条件，有足够的交易和清算能力，满足各投资组合证券交易需要；
- （五）能提供投资组合运作、管理所需的其他券商服务；
- （六）相关基金合同、资产管理合同以及法律法规规定的其他条件。

租用证券公司交易单元的程序：首先根据租用证券公司交易单元的选择标准形成《券商服务评价表》，然后根据评分高低进行选择基金交易单元。

本报告期内本基金租用证券公司交易单元的变更情况如下：

本报告期内增加交易单元：无。本报告期内退租交易单元：无。

## 10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例
安信证券	-	0.00%	-	0.00%	-	0.00%
渤海证券	-	0.00%	-	0.00%	-	0.00%
财富证券	-	0.00%	-	0.00%	-	0.00%
长江证券	-	0.00%	10,000,000.00	100.00%	-	0.00%
东方证券	-	0.00%	-	0.00%	-	0.00%
东海证券	-	0.00%	-	0.00%	-	0.00%
东莞证券	-	0.00%	-	0.00%	-	0.00%
东吴证券	-	0.00%	-	0.00%	-	0.00%
光大证券	-	0.00%	-	0.00%	-	0.00%
广发证券	-	0.00%	-	0.00%	-	0.00%
广州证券	-	0.00%	-	0.00%	-	0.00%
国都证券	-	0.00%	-	0.00%	-	0.00%
国海证券	-	0.00%	-	0.00%	-	0.00%
国泰君安	-	0.00%	-	0.00%	-	0.00%
国信证券	-	0.00%	-	0.00%	-	0.00%
海通证券	-	0.00%	-	0.00%	-	0.00%
华宝证券	-	0.00%	-	0.00%	-	0.00%
华福证券	-	0.00%	-	0.00%	-	0.00%
华林证券	-	0.00%	-	0.00%	-	0.00%
华泰证券	-	0.00%	-	0.00%	-	0.00%
华鑫证券	-	0.00%	-	0.00%	-	0.00%
江海证券	-	0.00%	-	0.00%	-	0.00%
民生证券	-	0.00%	-	0.00%	-	0.00%
民族证券	-	0.00%	-	0.00%	-	0.00%
齐鲁证券	-	0.00%	-	0.00%	-	0.00%
申银万国	-	0.00%	-	0.00%	-	0.00%
天源证券	-	0.00%	-	0.00%	-	0.00%
万和证券	-	0.00%	-	0.00%	-	0.00%
万联证券	-	0.00%	-	0.00%	-	0.00%
西南证券	-	0.00%	-	0.00%	-	0.00%
湘财证券	-	0.00%	-	0.00%	-	0.00%

银河证券	-	0.00%	-	0.00%	-	0.00%
英大证券	-	0.00%	-	0.00%	-	0.00%
招商证券	-	0.00%	-	0.00%	-	0.00%
中航证券	-	0.00%	-	0.00%	-	0.00%
中金公司	-	0.00%	-	0.00%	-	0.00%
中投证券	-	0.00%	-	0.00%	-	0.00%
中信证券	-	0.00%	-	0.00%	-	0.00%
中银国际	-	0.00%	-	0.00%	-	0.00%

### 10.8 偏离度绝对值超过 0.5%的情况

本基金本报告期内无偏离度绝对值超过0.5%的情况。

### 10.9 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	大成基金管理有限公司关于增加和讯信息科技有限公司为开放式基金代销机构并开通相关业务的公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2014/1/4
2	大成理财 21 天债券型发起式证券投资基金更新招募说明书摘要（2013 年第 2 期）	中国证监会指定报刊及本公司网站	2014/1/14
3	大成理财 21 天债券型发起式证券投资基金更新招募说明书（2013 年第 2 期）	中国证监会指定报刊及本公司网站	2014/1/14
4	大成理财 21 天债券型发起式证券投资基金 2013 年第 4 季度报告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2014/1/22
5	大成基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2014/1/25
6	关于大成理财 21 天债券型发起式证券投资基金“春节”假期前暂停申购业务公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2014/1/27
7	关于大成理财 21 天债券型发起式证券投资基金暂停大额申购业务公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2014/3/7
8	关于大成基金管理有限公司北京理财中心办公地址变更的公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2014/3/19
9	大成理财 21 天债券型发起式证券投资基金 2013 年年度报告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2014/3/29
10	大成理财 21 天债券型发起式证券投资基金 2013 年年	中国证监会指	2014/3/29



	度报告摘要	定报刊及本公司网站	
11	关于大成理财 21 天债券型发起式证券投资基金“清明”假期前暂停申购业务公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2014/4/2
12	大成基金管理有限公司关于调整网上直销系统中定期定额投资起点金额的公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2014/4/8
13	大成理财 21 天债券型发起式基金变更基金经理公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2014/4/8
14	大成基金管理有限公司董事、监事、高级管理人员以及其他从业人员在子公司兼任职务及领薪情况的公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2014/4/11
15	关于大成理财 21 天债券型发起式证券投资基金恢复大额申购业务的公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2014/4/12
16	关于大成理财 21 天债券型发起式证券投资基金暂停大额申购业务公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2014/4/19
17	大成理财 21 天债券型发起式证券投资基金 2014 年第 1 季度报告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2014/4/21
18	关于大成理财 21 天债券型发起式证券投资基金“劳动节”假期前暂停申购业务公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2014/4/25
19	关于增加杭州数米基金销售有限公司为代销机构及相关申购费率优惠的公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2014/6/5
20	大成基金管理有限公司关于调整旗下开放式基金基金转换业务规则的公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2014/6/30

### § 11 影响投资者决策的其他重要信息

本基金管理人于 2014 年 8 月 7 日在《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》及本公司网站（www.dcfund.com.cn）发布了“大成基金管理有限公司关于召开大成理财 21 天债券型发起式证券投资基金基金份额持有人大会（通讯方式）的公告”，经与本基金的基金托管人中国银行股份有限公司协商一致，决定以通讯方式召开本基金的基金份额持有人大会，审议本基金转型成为“大成月月盈短期理财债券型证券投资基金”等相关事宜，会议投票表决起止时间从 2014

年 8 月 14 日至 2014 年 9 月 10 日 17:00 止。截至报告送出日，会议投票表决仍在进行中，详情将见相关公告及附件。

## § 12 备查文件目录

### 12.1 备查文件目录

- 1、中国证监会批准设立大成理财 21 天债券型发起式证券投资基金的文件；
- 2、《大成理财 21 天债券型发起式证券投资基金基金合同》；
- 3、《大成理财 21 天债券型发起式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。

### 12.2 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。

### 12.3 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。

投资者对本报告书如有疑问，可咨询本基金管理人大成基金管理有限公司。

客户服务中心电话：400-888-5558（免长途通话费用）

国际互联网网址：<http://www.dcfund.com.cn>

大成基金管理有限公司  
2014 年 8 月 28 日