

大成月月盈短期理财债券型证券投资基金
2016 年年度报告摘要
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：中国银行股份有限公司

送出日期：2017 年 3 月 25 日

§ 1 重要提示及目录

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 | 大成月月盈短期理财债券 | | |
| 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 | 2014 年 9 月 12 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 | 1, 285, 808, 927. 78 份 | | |
| 基金合同存续期 | 不定期 | | |
| 下属分级基金的基金简称: | 大成月月盈短期理财债券 A | 大成月月盈短期理财债券 B | 大成月月盈短期理财债券 E |
| 下属分级基金的交易代码: | 090023 | 091023 | 001516 |
| 报告期末下属分级基金的份额总额 | 23, 866, 596. 66 份 | 1, 043, 626, 516. 80 份 | 218, 315, 814. 32 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 | 罗登攀 | 王永民 |
| | 联系电话 | 0755-83183388 | 010-66594896 |
| | 电子邮箱 | office@dcfund.com.cn | fcid@bankofchina.com |
| 客户服务电话 | | 4008885558 | 95566 |
| 传真 | | 0755-83199588 | 010-66594942 |

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 | 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 | 2016 年 | | | 2015 年 | | | 2014 年 9 月 12 日(基金合同生效日)-2014 年 12 月 31 日 | |
|---------------|---------------|------------------|----------------|---------------|---------------|---------------|-------------------------------------------|----------------|
| | 大成月月盈短期理财债券 A | 大成月月盈短期理财债券 B | 大成月月盈短期理财债券 E | 大成月月盈短期理财债券 A | 大成月月盈短期理财债券 B | 大成月月盈短期理财债券 E | 大成月月盈短期理财债券 A | 大成月月盈短期理财债券 B |
| 本期已实现收益 | 1,097,538.07 | 22,419,308.72 | 1,236,873.70 | 2,418,168.14 | 6,010,117.25 | 572,302.37 | 3,014,453.36 | 3,664,959.44 |
| 本期利润 | 1,097,538.07 | 22,419,308.72 | 1,236,873.70 | 2,418,168.14 | 6,010,117.25 | 572,302.37 | 3,014,453.36 | 3,664,959.44 |
| 本期净值收益率 | 2.8705% | 3.1723% | 2.8568% | 4.6191% | 4.9249% | 2.1451% | 1.4079% | 1.4797% |
| 3.1.2 期末数据和指标 | 2016 年末 | | | 2015 年末 | | | 2014 年末 | |
| 期末基金资产净值 | 23,866,596.66 | 1,043,626,516.80 | 218,315,814.32 | 65,117,111.37 | 46,981,111.52 | 83,241,484.69 | 186,268,398.06 | 276,012,879.55 |
| 末基金份额净值 | 1.0000 | 1.0000 | 1.0000 | 1.0000 | 1.0000 | 1.0000 | 1.0000 | 1.0000 |

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。

2. 本基金自 2014 年 9 月 12 日起由大成理财 21 天债券型发起式证券投资基金转为大成月月盈短期理财债券证券投资基金，所涉及的相关累计数据计算起始日从本次年报开始由原大成理财 21 天债券型发起式证券投资基金成立日变更为大成月月盈短期理财债券证券投资基金合同生效日。

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

大成月月盈短期理财债券 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 | 0.7045% | 0.0021% | 0.3393% | 0.0000% | 0.3652% | 0.0021% |
| 过去六个月 | 1.3999% | 0.0022% | 0.6787% | 0.0000% | 0.7212% | 0.0022% |
| 过去一年 | 2.8705% | 0.0036% | 1.3500% | 0.0000% | 1.5205% | 0.0036% |

| | | | | | | |
|----------------|---------|---------|---------|---------|---------|---------|
| 自基金合同 生效起至今 | 9.3263% | 0.0127% | 3.1105% | 0.0000% | 6.2158% | 0.0127% |
|----------------|---------|---------|---------|---------|---------|---------|

大成月月盈短期理财债券 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 | 0.7807% | 0.0021% | 0.3393% | 0.0000% | 0.4414% | 0.0021% |
| 过去六个月 | 1.5507% | 0.0022% | 0.6787% | 0.0000% | 0.8720% | 0.0022% |
| 过去一年 | 3.1723% | 0.0036% | 1.3500% | 0.0000% | 1.8223% | 0.0036% |
| 自基金合同 生效起至今 | 10.0578% | 0.0127% | 3.1105% | 0.0000% | 6.9473% | 0.0127% |

大成月月盈短期理财债券 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 | 0.6953% | 0.0021% | 0.3393% | 0.0000% | 0.3560% | 0.0021% |
| 过去六个月 | 1.3898% | 0.0022% | 0.6787% | 0.0000% | 0.7111% | 0.0022% |
| 过去一年 | 2.8568% | 0.0036% | 1.3500% | 0.0000% | 1.5068% | 0.0036% |
| 自基金合同 生效起至今 | 5.0607% | 0.0078% | 2.0749% | 0.0000% | 2.9858% | 0.0078% |

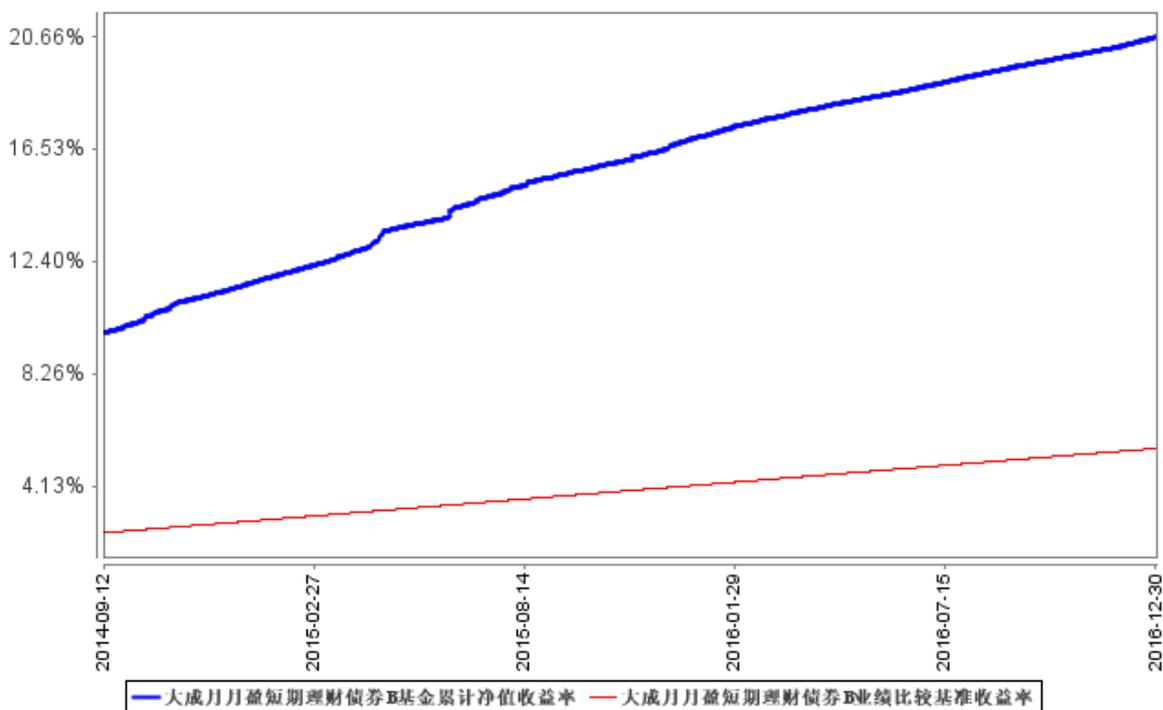
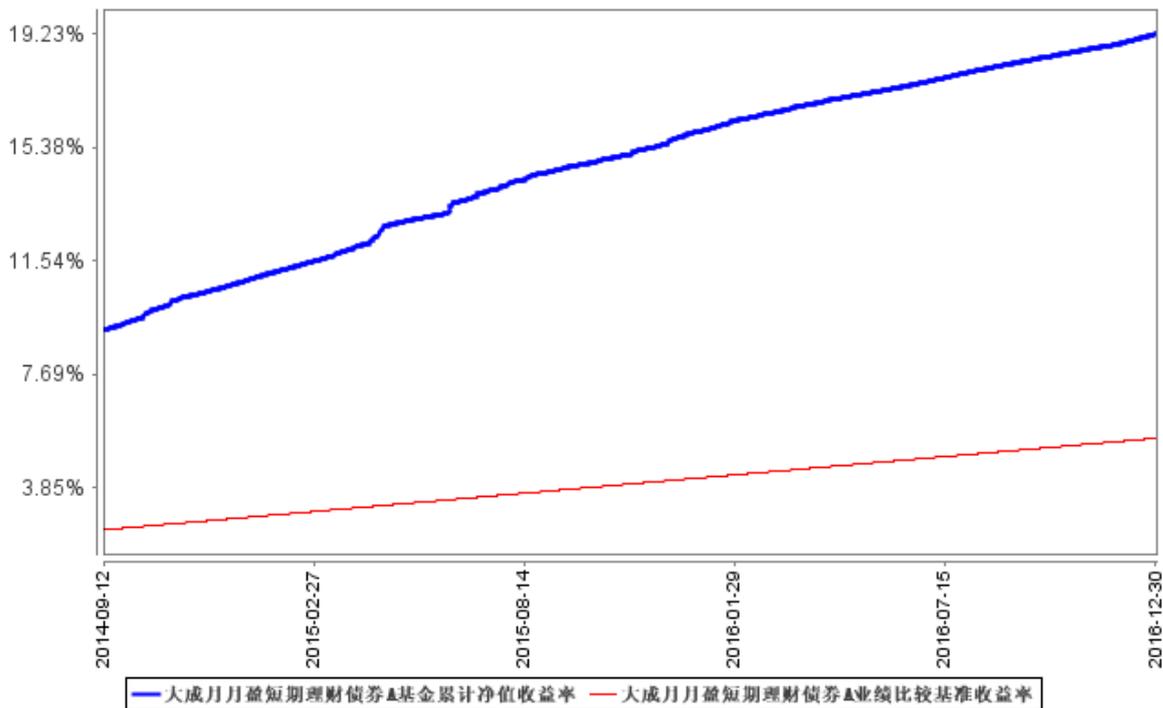
注：1、本基金根据每日基金收益情况，以基金净收益为基准，为投资者每日计算当日收益并分配，并在运作期期末集中支付。

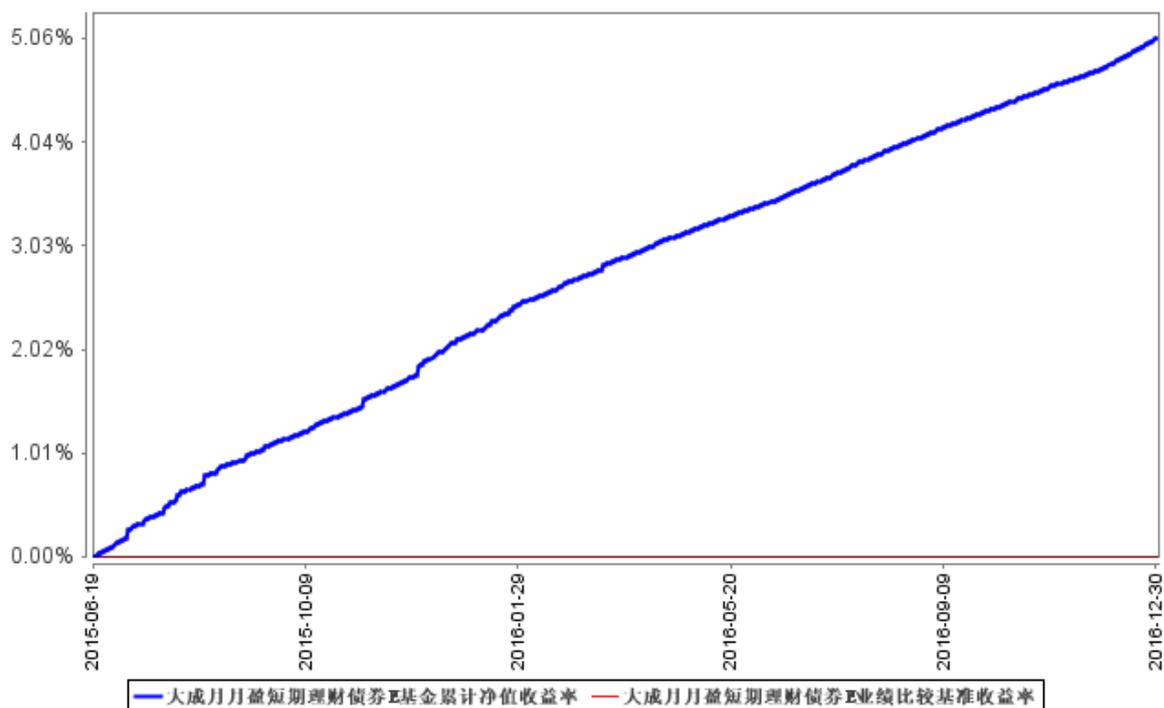
2、本表净值收益率的计算所采取的运作周期，是以基金合同生效日为起始日并持有至报告期末的基金份额所经历的运作周期。

3、本基金自 2015 年 6 月 19 日起，新增 E 类份额。

4、本基金自 2014 年 9 月 12 日起由大成理财 21 天债券型发起式证券投资基金转为大成月月盈短期理财债券证券投资基金，所涉及的相关数据计算起始日从本次年报开始由原大成理财 21 天债券型发起式证券投资基金成立日变更为大成月月盈短期理财债券证券投资基金合同生效日。

3.2.2 自基金转型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

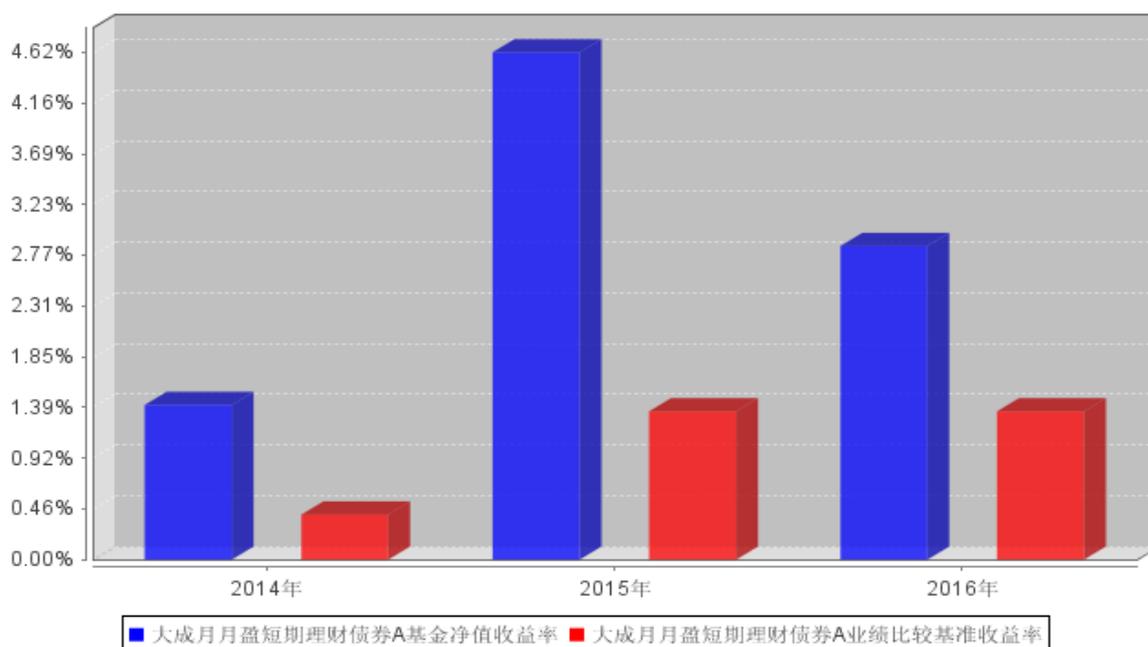


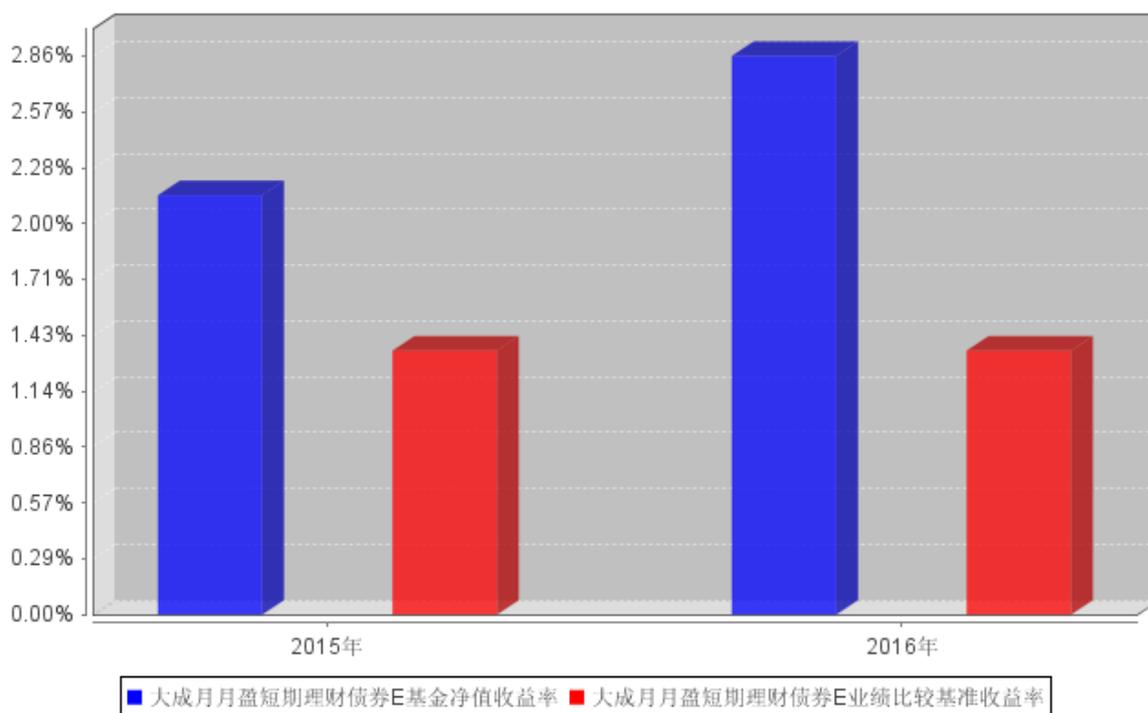
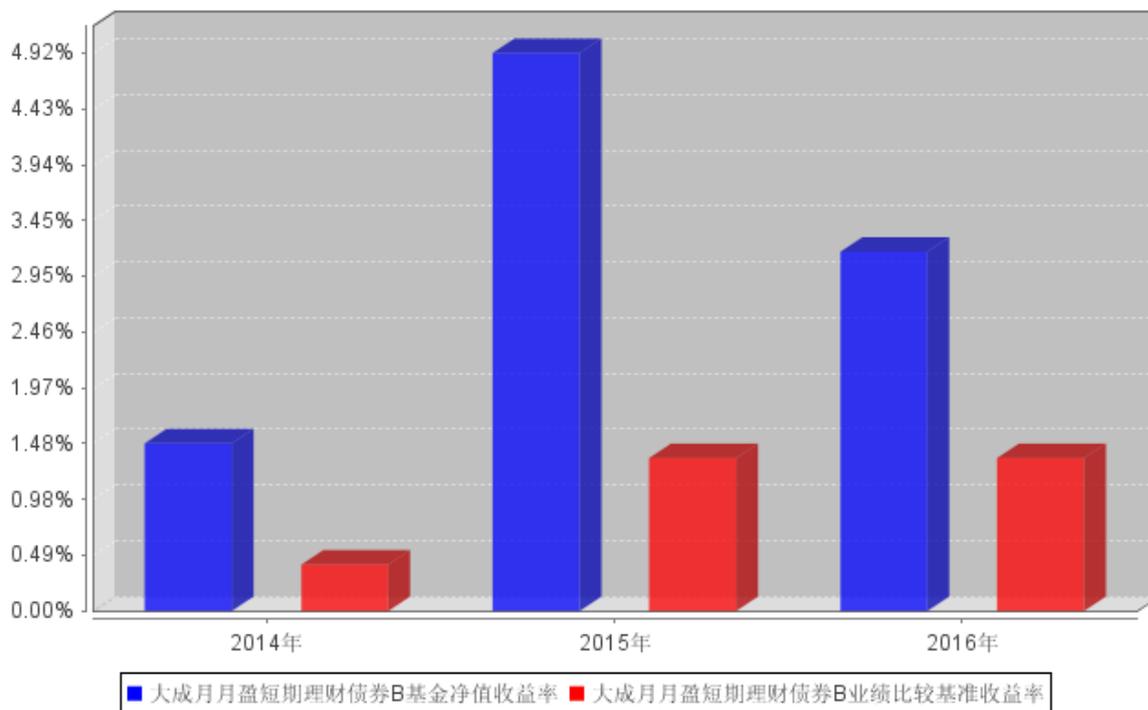


注：1. 按基金合同规定，基金管理人应当自基金合同生效之日起六个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的有关约定。截至报告期末，本基金的各项投资比例已达到基金合同中规定的各项比例。

2. 本基金自 2014 年 9 月 12 日起由大成理财 21 天债券型发起式证券投资基金转为大成月月盈短期理财债券证券投资基金。

3.2.3 自基金转型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：本基金自 2014 年 9 月 12 日起由大成理财 21 天债券型发起式证券投资基金转为大成月月盈短期理财债券证券投资基金。

3.3 过去三年基金的利润分配情况

| 大成月月盈短期理财债券 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 |
| 2016 | 973,146.74 | 197,176.11 | -72,784.78 | 1,097,538.07 | - |
| 2015 | 1,771,015.85 | 847,538.37 | -200,386.08 | 2,418,168.14 | - |
| 2014 | 1,354,103.54 | 1,771,798.42 | -111,448.60 | 3,014,453.36 | - |
| 合计 | 4,098,266.13 | 2,816,512.90 | -384,619.46 | 6,530,159.57 | - |
| 大成月月盈短期理财债券 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 |
| 2016 | 18,793,012.99 | 3,441,146.51 | 185,149.22 | 22,419,308.72 | - |
| 2015 | 4,843,720.39 | 1,607,150.42 | -440,753.56 | 6,010,117.25 | - |
| 2014 | 3,971,337.00 | 755,734.24 | -1,062,111.80 | 3,664,959.44 | - |
| 合计 | 27,608,070.38 | 5,804,031.17 | -1,317,716.14 | 32,094,385.41 | - |
| 大成月月盈短期理财债券 E | | | | | |
| 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 |
| 2016 | 426,202.96 | 636,081.86 | 174,588.88 | 1,236,873.70 | - |
| 2015 | 59,097.09 | 375,104.61 | 138,100.67 | 572,302.37 | - |
| 合计 | 485,300.05 | 1,011,186.47 | 312,689.55 | 1,809,176.07 | - |

§ 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。目前公司由三家股东组成，分别为中泰信托有限责任公司(50%)、光大证券股份有限公司(25%)、中国银河投资管理有限公司(25%)。主要业务是公募基金的募集、销售和管理，还具有全国社保基金投资管理、基本养老保险投资管理、受托管理保险资金、保险保障基金投资管理、特定客户资产管理和QDII业务资格。

经过十多年的稳健发展，公司形成了强大稳固的综合实力。公司旗下基金产品齐全、风格多样，构建了涵盖股票型基金、混合型基金、指数型基金、债券型基金和货币市场基金的完备产品线。截至2016年12月31日，本基金管理人共管理5只ETF及1只ETF联接基金，4只QDII基金及68只开放式证券投资基金。

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 | | |
| 张文平先生 | 本基金基金经理 | 2015年7月1日 | - | 6年 | <p>南京大学管理学硕士，注册会计师，2009年10月至2011年5月就职于毕马威企业咨询有限公司南京分公司审计部；2011年起加入大成基金管理有限公司，历任固定收益部助理研究员。2013年11月25日至2015年3月5日担任大成景祥分级债券型证券投资基金基金经理助理。2015年3月7日至2016年11月18日担任大成景祥分级债券型证券投资基金基金经理。2015年6月23日起任大成景裕灵活配置混合型证券投资基金基金经理。2015年7月1日至2017年3月18日任大成现金宝场内实时申赎货币市场基金基金经理。2015年7月1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。2015年11月24日起任大成景沛灵活配置混合型证券投资基金基金经理。2016年8月6日起任大</p> |

| | | | | | |
|--|--|--|--|--|--------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
| | | | | | 成添利宝货币市场基金基金经理。2016年9月6日起任大成景安短融债券型证券投资基金和大成现金增利货币市场基金基金经理。2016年9月20日起任大成景辉灵活配置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》、《大成月月盈短期理财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，大成月月盈短期理财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 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 年经济增长乏力，继续低位徘徊，全年 GDP 同比增长 6.7%，较 2015 年下滑 0.2%。全年 CPI 同比增长 2%，较 2015 年上升 0.56%。供给侧改革的大力推进带动 PPI 大幅反弹，全年下降幅度相较 2015 年趋缓，同比下降 1.3%，单月同比增速已于四季度转为正值，为 2012 年以来首次。流动性方面，随着全球诸多国家逐渐认为给实体经济注入过多的流动性无益于经济基本面，中央央行的监管思路也发生明显变化，中央经济工作会议最终定调货币政策“稳健中性”，先前的货币宽松正式转向。

2016 年银行间资金环境整体保持紧平衡状态，资金利率中枢明显上行且波动很大，资金紧张的阶段性和不可预测性明显增强。1 年期金融债从年中最低的 2.24% 上升至 3% 以上，各评级短融从最低点上行逾 130bp，同业存单四季度大幅上行约 200bp。

2016 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，本基金在和持有人积极沟通的基础上，灵活管理组合现金流的到期分布情况，并灵活调整短融和存单等资产的仓位。并把握半年末、季度末等关键时点进行了银行存款和逆回购投资。此外，本基金在一级市场进行了积极的投标，获取了良好的投资收益。

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 2.8705%，B 类净值收益率为 3.1723%，E 类净值收益率为 2.8568%，期间业绩比较基准收益率为 1.3500%。

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 年全球都面临新的政治周期，货币政策和财政政策可能会发生较为明显的变化。除宏观基本面方面的不利因素外，在看到加杠杆行为得到明显遏制之前，央行去杠杆的政策思路 and 措施将很难停止，市场出清预计将持续较长时间。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。在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，灵活管理组合现金流的到期分布，力争为持有人带来安全稳健较高的收益。

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 24,753,720.49 元，报告期内已分配利润 24,753,720.49 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，中国银行股份有限公司（以下称“本托管人”）在对大成月月盈短期理财债券型证券投资基金（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 托管人对本年度报告中财务信息等内容真实、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 审计报告

本基金 2016 年度财务会计报告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: 大成月月盈短期理财债券型证券投资基金

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 | 645,341,651.55 | 84,156,211.74 |
| 结算备付金 | - | - |
| 存出保证金 | - | - |
| 交易性金融资产 | 339,817,847.75 | 44,957,741.09 |
| 其中: 股票投资 | - | - |
| 基金投资 | - | - |
| 债券投资 | 339,817,847.75 | 44,957,741.09 |
| 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 | 367,475,436.34 | 69,800,584.70 |
| 应收证券清算款 | - | - |
| 应收利息 | 5,500,418.48 | 1,029,355.45 |
| 应收股利 | - | - |
| 应收申购款 | - | - |
| 递延所得税资产 | - | - |
| 其他资产 | - | - |
| 资产总计 | 1,358,135,354.12 | 199,943,892.98 |
| 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 | 71,059,693.41 | 3,999,878.00 |
| 应付证券清算款 | - | - |

| | | |
|---------------|------------------|----------------|
| 应付赎回款 | - | - |
| 应付管理人报酬 | 305,310.21 | 40,360.35 |
| 应付托管费 | 90,462.33 | 11,958.60 |
| 应付销售服务费 | 43,528.71 | 32,583.68 |
| 应付交易费用 | 47,713.88 | 28,948.96 |
| 应交税费 | - | - |
| 应付利息 | 12,613.14 | 304.47 |
| 应付利润 | 618,104.66 | 331,151.34 |
| 递延所得税负债 | - | - |
| 其他负债 | 149,000.00 | 159,000.00 |
| 负债合计 | 72,326,426.34 | 4,604,185.40 |
| 所有者权益： | | |
| 实收基金 | 1,285,808,927.78 | 195,339,707.58 |
| 未分配利润 | - | - |
| 所有者权益合计 | 1,285,808,927.78 | 195,339,707.58 |
| 负债和所有者权益总计 | 1,358,135,354.12 | 199,943,892.98 |

注：1. 报告截止日 2016 年 12 月 31 日，基金份额净值 1.0000 元，基金份额总额 1,285,808,927.78 份，其中 A 类基金份额总额为 23,866,596.66 份，B 类基金份额的份额总额为 1,043,626,516.80 份，E 类基金份额总额为 218,315,814.32 份。

7.2 利润表

会计主体：大成月月盈短期理财债券型证券投资基金

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 | 上年度可比期间 |
|------------------|----------------------------------|----------------------------------|
| | 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日 | 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日 |
| 一、收入 | 31,120,850.04 | 11,334,593.86 |
| 1.利息收入 | 28,270,863.31 | 9,039,318.75 |
| 其中：存款利息收入 | 8,019,775.98 | 1,507,394.42 |
| 债券利息收入 | 10,526,464.53 | 4,877,043.07 |
| 资产支持证券利息收入 | - | - |
| 买入返售金融资产收入 | 9,724,622.80 | 2,654,881.26 |
| 其他利息收入 | - | - |
| 2.投资收益（损失以“-”填列） | 2,849,986.73 | 2,295,275.11 |
| 其中：股票投资收益 | - | - |
| 基金投资收益 | - | - |
| 债券投资收益 | 2,849,986.73 | 2,295,275.11 |
| 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） | - | - |
| 减：二、费用 | 6,367,129.55 | 2,334,006.10 |
| 1. 管理人报酬 | 2,219,970.28 | 557,906.18 |
| 2. 托管费 | 657,768.93 | 165,305.55 |
| 3. 销售服务费 | 309,818.86 | 226,589.76 |
| 4. 交易费用 | - | - |
| 5. 利息支出 | 2,787,006.14 | 965,544.87 |
| 其中：卖出回购金融资产支出 | 2,787,006.14 | 965,544.87 |
| 6. 其他费用 | 392,565.34 | 418,659.74 |
| 三、利润总额（亏损总额以“-”号填列） | 24,753,720.49 | 9,000,587.76 |
| 减：所得税费用 | - | - |
| 四、净利润（净亏损以“-”号填列） | 24,753,720.49 | 9,000,587.76 |

7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：大成月月盈短期理财债券型证券投资基金

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） | 195,339,707.58 | - | 195,339,707.58 |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润） | - | 24,753,720.49 | 24,753,720.49 |
| 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） | 1,090,469,220.20 | - | 1,090,469,220.20 |

7.4.1.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

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 |
| 中国银行股份有限公司(“中国银行”) | 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。

7.4.3.1 通过关联方交易单元进行的交易

本基金本报告期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 | 上年度可比期间 |
|-----------------|-----------------------|-----------------------|
| | 2016年1月1日至2016年12月31日 | 2015年1月1日至2015年12月31日 |
| 当期发生的基金应支付的管理费 | 2,219,970.28 | 557,906.18 |
| 其中：支付销售机构的客户维护费 | 51,787.74 | 86,300.53 |

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 × 0.27% / 当年天数。

7.4.3.2.2 基金托管费

单位：人民币元

| 项目 | 本期 | 上年度可比期间 |
|----------------|-----------------------|-----------------------|
| | 2016年1月1日至2016年12月31日 | 2015年1月1日至2015年12月31日 |
| 当期发生的基金应支付的托管费 | 657,768.93 | 165,305.55 |

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 × 0.08% / 当年天数。

7.4.3.2.3 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 | | | |
| | 大成月月盈短期理财债券 A | 大成月月盈短期理财债券 B | 大成月月盈短期理财债券 E | 合计 |
| 大成基金 | 120,330.11 | 11,267.95 | 73,178.19 | 204,776.25 |
| 中国银行 | - | 79,598.55 | 1,168.92 | 80,767.47 |
| 合计 | 120,330.11 | 90,866.50 | 74,347.11 | 285,543.72 |
| 获得销售服务费的各关联方名称 | 上年度可比期间 | | | |
| | 2015年1月1日至2015年12月31日 | | | |

| | 当期发生的基金应支付的销售服务费 | | | |
|------|------------------|---------------|---------------|------------|
| | 大成月月盈短期理财债券 A | 大成月月盈短期理财债券 B | 大成月月盈短期理财债券 E | 合计 |
| 大成基金 | 8,219.91 | 11,224.70 | 42,169.79 | 61,614.40 |
| 中国银行 | 126,470.78 | 2,325.20 | - | 128,795.98 |
| 合计 | 134,690.69 | 13,549.90 | 42,169.79 | 190,410.38 |

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 级基金份额、B 级基金份额和 E 级基金份额约定的销售服务费年费率分别为 0.30%、0.01%和 0.30%。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。

7.4.3.3 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 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 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 | - | - | - | - | - | - |
| 上年度可比期间 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 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 | - | 20,589,737.26 | - | - | - | - |

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

份额单位：人民币元

| 项目(B类份额) | 本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日 | 上年度可比期间 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日 |
|----------------|-------------------------------------------|------------------------------------------------|
| | 报告期初持有的基金份额 | 11,691,583.98 |
| 报告期间申购/买入总份额 | 249,749.95 | 1,911,581.36 |
| 报告期间因拆分变动份额 | - | - |
| 减：报告期间赎回/卖出总份额 | 11,941,333.93 | 95,554,703.95 |
| 报告期末持有的基金份额 | - | 11,691,583.98 |
| 报告期末持有的基金份额 | 0.00% | 5.99% |

| | | |
|----------|--|--|
| 占基金总份额比例 | | |
|----------|--|--|

注：1、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份额均由收益分配引起，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赎回本基金委托中国银行办理，赎回本基金的费率与本基金法律文件规定一致(2015 年：基金管理人大成基金管理有限公司赎回本基金通过直销中心办理，赎回本基金的费率与本基金法律文件规定一致)。

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

本基金除基金管理人之外的其他关联方于本报告期和上年度可比期间均未运用自有资金投资本基金。

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 | | 上年度可比期间 | |
|-------|----------------------------------|-----------|----------------------------------|-----------|
| | 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日 | | 2015 年 1 月 1 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 |
| 中国银行 | 2,341,651.55 | 65,260.41 | 1,156,211.74 | 15,828.78 |

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。

7.4.3.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本报告期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。

7.4.3.7 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。

7.4.4 期末（2016 年 12 月 31 日）本基金持有的流通受限证券

7.4.4.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

本基金本期末无因认购新发/增发证券而流通受限的证券。

7.4.4.2 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。

7.4.4.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.4.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末 2016 年 12 月 31 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 71,059,693.41 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 |
|-----------|----------------|----------|--------|---------|---------------|
| 011698993 | 16 龙源电力 SCP016 | 2017-1-3 | 99.93 | 248,000 | 24,782,640.00 |
| 111610389 | 16 兴业 CD389 | 2017-1-3 | 99.91 | 500,000 | 49,955,000.00 |
| 合计 | - | - | - | 748,000 | 74,737,640.00 |

7.4.4.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2016 年 12 月 31 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（2015 年 12 月 31 日：同）。

§ 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 | 339,817,847.75 | 25.02 |
| | 其中：债券 | 339,817,847.75 | 25.02 |
| | 资产支持证券 | - | 0.00 |
| 2 | 买入返售金融资产 | 367,475,436.34 | 27.06 |
| | 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 | 645,341,651.55 | 47.52 |
| 4 | 其他各项资产 | 5,500,418.48 | 0.40 |
| 5 | 合计 | 1,358,135,354.12 | 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 | 12.02 | |
| | 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 | 71,059,693.41 | 5.53 |
| | 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。

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 | 57 |
| 报告期内投资组合平均剩余期限最高值 | 132 |
| 报告期内投资组合平均剩余期限最低值 | 32 |

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 150 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 | 18.84 | 5.53 |
| | 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 | 15.37 | 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 | 60.11 | 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 | 0.00 | 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) | 7.00 | 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 | 101.32 | 5.53 |

8.4 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 | 69,999,219.25 | 5.44 |
| | 其中：政策性金融债 | 69,999,219.25 | 5.44 |
| 4 | 企业债券 | - | 0.00 |
| 5 | 企业短期融资券 | 219,865,120.76 | 17.10 |
| 6 | 中期票据 | - | 0.00 |
| 7 | 同业存单 | 49,953,507.74 | 3.88 |
| 8 | 其他 | - | 0.00 |
| 9 | 合计 | 339,817,847.75 | 26.43 |
| 10 | 剩余存续期超过 397 天的浮动利率债券 | - | 0.00 |

8.5 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 | 011698998 | 16 苏交通 SCP019 | 1,000,000 | 99,929,049.19 | 7.77 |
| 2 | 160204 | 16 国开 04 | 600,000 | 60,002,063.20 | 4.67 |
| 3 | 111610389 | 16 兴业 CD389 | 500,000 | 49,953,507.74 | 3.88 |
| 4 | 011698364 | 16 鲁信 SCP003 | 300,000 | 29,991,082.91 | 2.33 |
| 5 | 011698993 | 16 龙源电力 SCP016 | 300,000 | 29,979,727.65 | 2.33 |
| 6 | 011698885 | 16 联通 SCP006 | 300,000 | 29,977,872.30 | 2.33 |
| 7 | 011698684 | 16 中航租赁 SCP006 | 200,000 | 19,993,219.87 | 1.55 |
| 8 | 160201 | 16 国开 01 | 100,000 | 9,997,156.05 | 0.78 |
| 9 | 041655028 | 16 康美 CP001 | 100,000 | 9,994,168.84 | 0.78 |

8.6 “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 | - |
| 报告期内偏离度的最高值 | 0.0685% |
| 报告期内偏离度的最低值 | -0.1153% |
| 报告期内每个交易日偏离度的绝对值的简单平均值 | 0.0279% |

报告期内负偏离度的绝对值达到 0.25%情况说明

本报告期内本基金均未发生负偏离度的绝对值达到 0.25%的情况。

报告期内正偏离度的绝对值达到 0.5%情况说明

本报告期内本基金均未发生正偏离度的绝对值达到 0.5%的情况。

8.7 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

本报告期末未持有资产支持证券。

8.8 投资组合报告附注

8.8.1 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。

8.8.2 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。

8.8.3 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 | 5,500,418.48 |
| 4 | 应收申购款 | - |
| 5 | 其他应收款 | - |
| 6 | 待摊费用 | - |
| 7 | 其他 | - |
| 8 | 合计 | 5,500,418.48 |

8.8.4 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。

§9 基金份额持有人信息

9.1 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 | 持有人户数(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 | |
| | | | 持有份额 | 占总份额比例 | 持有份额 | 占总份额比例 |
| 大成月月盈短期理财债券 A | 709 | 33,662.34 | 34,926.07 | 0.15% | 23,831,670.59 | 99.85% |
| 大成月月盈短期理财债券 B | 3 | 347,875,505.60 | 1,043,626,516.80 | 100.00% | - | 0.00% |
| 大成月月盈短 | 10,100 | 21,615.43 | - | 0.00% | 218,315,814.32 | 100.00% |

| | | | | | | |
|---------|--------|------------|------------------|--------|----------------|--------|
| 期理财债券 E | | | | | | |
| 合计 | 10,812 | 118,924.24 | 1,043,661,442.87 | 81.17% | 242,147,484.91 | 18.83% |

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。

9.2 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 | 大成月月盈短期理财债券 A | 20.22 | 0.0001% |
| | 大成月月盈短期理财债券 B | - | 0.0000% |
| | 大成月月盈短期理财债券 E | 9,589.15 | 0.0044% |
| | 合计 | 9,609.37 | 0.0007% |

注：1、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）；

9.3 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的情况

| 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、基金投资和部门负责人持有本开放式基金 | 大成月月盈短期理财债券 A | 0 |
| | 大成月月盈短期理财债券 B | 0 |
| | 大成月月盈短期理财债券 E | 0 |
| | 合计 | 0 |
| 本基金基金经理持有本开放式基金 | 大成月月盈短期理财债券 A | 0 |
| | 大成月月盈短期理财债券 B | 0 |
| | 大成月月盈短期理财债券 E | 0 |
| | 合计 | 0 |

§ 10 开放式基金份额变动

单位：份

| | 大成月月盈短期理财债券 A | 大成月月盈短期理财债券 B | 大成月月盈短期理财债券 E |
|--------------------------------|----------------|------------------|----------------|
| 基金合同生效日（2014 年 9 月 12 日）基金份额总额 | 35,756,883.12 | 145,202,557.59 | - |
| 本报告期初基金份额总额 | 65,117,111.37 | 46,981,111.52 | 83,241,484.69 |
| 本报告期基金总申购份额 | 124,525,587.03 | 2,474,485,574.52 | 372,877,687.46 |
| 减：本报告期基金总赎回份额 | 165,776,101.74 | 1,477,840,169.24 | 237,803,357.83 |

| | | | |
|------------------------------|---------------|------------------|----------------|
| 本报告期基金拆分变动份额 (份额减少以“-”填列) | - | - | - |
| 本报告期末基金份额总额 | 23,866,596.66 | 1,043,626,516.80 | 218,315,814.32 |

§ 11 重大事件揭示

11.1 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。

11.2 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

一、基金管理人的重大人事变动

基金管理人于 2016 年 6 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六届董事会第十七次会议审议通过，钟鸣远先生不再担任公司副总经理。

二、基金托管人基金托管部门的重大人事变动

2016 年 12 月，郭德秋先生担任中国银行股份有限公司托管业务部总经理职务。上述人事变动已按相关规定备案、公告。

11.3 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。

11.4 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。

11.5 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有限公司，本年度应支付的审计费用为 6 万元整。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。

11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

1、报告期内基金管理人收到中国证券监督管理委员会深圳监管局（以下简称“深圳证监局”）《关于对大成基金管理有限公司采取责令整改并暂停办理相关业务措施的决定》，责令公司进行整改，并暂停受理公募基金产品注册申请 6 个月，暂停受理新设子公司业务申请 1 年，对相关责任人采取行政监管措施。公司高度重视，制定并落实相关整改措施，并及时向深圳证监局提交整改

报告。目前公司已完成相关整改工作。

2、报告期内基金托管人的托管业务部门及其相关高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

11.7.1 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% | - |
| 长城证券 | 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% | - |
| 东兴证券 | 1 | - | 0.00% | - | 0.00% | - |
| 方正证券 | 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% | - |
| 恒泰证券 | 1 | - | 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% | - |
| 平安证券 | 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% | - |
| 中泰证券 | 1 | - | 0.00% | - | 0.00% | - |
| 中投证券 | 3 | - | 0.00% | - | 0.00% | - |
| 中信建投证 券 | 1 | - | 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：恒泰证券、方正证券、中信建投证券、平安证券；退租交易单元：中

泰证券。

11.7.2 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% |
| 长城证券 | - | 0.00% | - | 0.00% | - | 0.00% |
| 长江证券 | - | 0.00% | - | 0.00% | - | 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% |
| 东兴证券 | - | 0.00% | - | 0.00% | - | 0.00% |
| 方正证券 | - | 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% |
| 恒泰证券 | - | 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% |

| | | | | | | |
|--------|---|-------|---|-------|---|-------|
| 平安证券 | - | 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% |
| 中泰证券 | - | 0.00% | - | 0.00% | - | 0.00% |
| 中投证券 | - | 0.00% | - | 0.00% | - | 0.00% |
| 中信建投证券 | - | 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% |

11.8 偏离度绝对值超过 0.5%的情况

注：本基金本报告期内无偏离度绝对值超过 0.5%的情况。

§ 12 影响投资者决策的其他重要信息

1、根据 2016 年 4 月 27 日《大成基金管理有限公司关于股权变更及修改〈公司章程〉的公告》，根据大成基金管理有限公司（以下简称“本公司”）第六届董事会第十四次会议和 2016 年第一次临时股东会的有关决议，本公司原股东广东证券股份有限公司通过其破产管理人将所持本公司 2%股权（对应出资额 400 万元）以拍卖竞买的方式转让给本公司股东中泰信托有限责任公司，广东证券股份有限公司退出本公司投资，中泰信托有限责任公司所持本公司股权增至 50%（对应出资额 1 亿元），同时，就本公司股权变更的相关内容修改《大成基金管理有限公司公司章程》。本公司股权变更及修改《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、基金管理人于 2017 年 2 月 18 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六届董事会第二十四次会议（以下简称“董事会”）审议通过，杜鹏女士不再担任公司督察长。董事会同时决议，同意在公司新督察长任职前，由公司总经理罗登攀先生代为履行督察长职务，代为履职时间不超过 90 日。

3、基金管理人于 2017 年 2 月 18 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六届董事会第二十四次会议审议通过，陈翔凯先生、谭晓冈先生和姚余栋先生担任公司副总经理。

大成基金管理有限公司
2017 年 3 月 25 日