大成现金增利货币市场基金
2026 年中期报告

2026 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：中国农业银行股份有限公司

送出日期：2026 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。本中期报告已经三分之二以上独立董事签字同意。

基金托管人中国农业银行股份有限公司根据本基金合同约定，于 2026 年 08 月 27 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。

本报告财务资料未经审计。

本报告期自 2026 年 01 月 01 日起至 06 月 30 日止。

1.2 目录

§1 重要提示及目录 2

1.1 重要提示 2
1.2 目录 3

§2 基金简介 5

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

§3 主要财务指标和基金净值表现 6

3.1 主要会计数据和财务指标 6
3.2 基金净值表现 7

§4 管理人报告 9

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遵规守信情况的说明 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
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 13

§5 托管人报告 13

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明 13
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明 13
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见 13

§6 半年度财务会计报告（未经审计） 13

6.1 资产负债表 13
6.2 利润表 15
6.3 净资产变动表 16
6.4 报表附注 18

§7 投资组合报告 38

7.1 期末基金资产组合情况 38
7.2 债券回购融资情况 38
7.3 基金投资组合平均剩余期限 38
7.4 报告期内投资组合平均剩余存续期超过 240 天情况说明 39
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合 39
7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名债券投资明细 40
7.7 “影子定价”与按实际利率计算账面价值确定的基金资产净值的偏离 40
7.8 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名资产支持证券投资明细 40

7.9 投资组合报告附注.....41
§8 基金份额持有人信息.....42
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....42
8.2 期末货币市场基金前十名份额持有人情况.....43
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....43
8.4 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.....43
§9 开放式基金份额变动.....43
§10 重大事件揭示.....44
10.1 基金份额持有人大会决议.....44
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.....44
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....44
10.4 基金投资策略的改变.....44
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....44
10.6 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况.....45
10.7 基金租用或者通过证券公司交易单元进行证券投资的相关情况.....45
10.8 偏离度绝对值超过 0.5%的情况.....47
10.9 其他重大事件.....47
§11 影响投资者决策的其他重要信息.....48
11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况.....48
11.2 影响投资者决策的其他重要信息.....48
§12 备查文件目录.....48
12.1 备查文件目录.....48
12.2 存放地点.....48
12.3 查阅方式.....49

§1 基金简介

1.1 基金基本情况

基金名称	大成现金增利货币市场基金	
基金简称	大成现金增利货币	
基金主代码	090022	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2012 年 11 月 20 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	
报告期末基金份额总额	50,263,820,321.06 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	大成现金增利货币 A	大成现金增利货币 B
下属分级基金的交易代码	090022	091022
报告期末下属分级基金的份额总额	50,260,573,998.25 份	3,246,322.81 份

1.2 基金产品说明

投资目标	在保持资产的低风险和高流动性的前提下，争取获得超过基金业绩比较基准的收益率。
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	银行活期存款利率
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。

1.3 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	中国农业银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	段皓静	任航
	联系电话	0755-83183388	010-66060069
	电子邮箱	office@dcfund.com.cn	tgxxpl@abchina.com
客户服务电话		4008885558	95599
传真		0755-83199588	010-68121816
注册地址		广东省深圳市南山区海德三道 1236 号大成基金总部大厦 5 层、27-33 层	北京市东城区建国门内大街 69 号

办公地址	广东省深圳市南山区海德三道 1236 号大成基金总部大厦 5 层、27-33 层	北京市西城区复兴门内大街 28 号凯晨世贸中心东座 F9
邮政编码	518054	100031
法定代表人	吴庆斌	谷澍

1.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《上海证券报》
登载基金中期报告的管理人互联网网址	www.dcfund.com.cn
基金中期报告置备地点	基金管理人及基金托管人住所

1.5 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	广东省深圳市南山区海德三道 1236 号大成基金总部大厦 5 层、27-33 层

§2 主要财务指标和基金净值表现

2.1 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	报告期(2026 年 1 月 1 日 - 2026 年 6 月 30 日)	
	大成现金增利货币 A	大成现金增利货币 B
本期已实现收益	248,710,936.66	23,436.62
本期利润	248,710,936.66	23,436.62
本期净值收益率	0.4847%	0.6044%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2026 年 6 月 30 日)	
期末基金资产净值	50,260,573,998.25	3,246,322.81
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(2026 年 6 月 30 日)	
累计净值收益率	41.9172%	46.6157%

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）扣除相关费用和信用减值损失后的余额，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

于本基金用实际利率法计算账面价值并用影子定价和偏离度加以控制的模式核算，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、本基金收益分配按日结转份额。

2.2 基金净值表现

2.2.1 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

大成现金增利货币 A

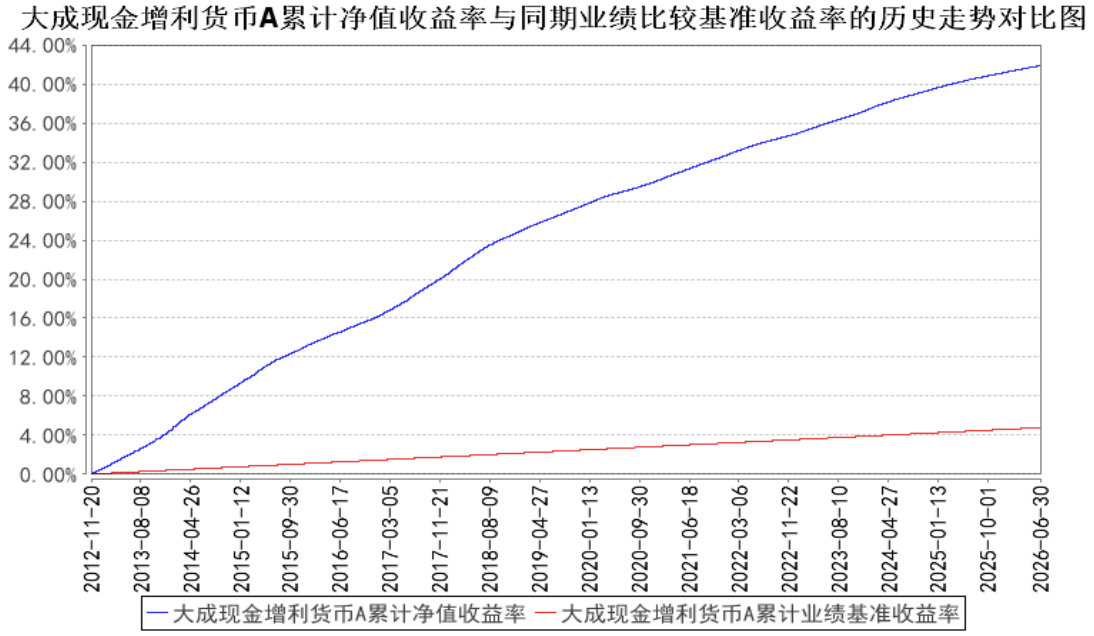
阶段	份额净值收益率①	份额净值收益率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①－③	②－④
过去三个月	0.2346%	0.0002%	0.0873%	0.0000%	0.1473%	0.0002%
过去六个月	0.4847%	0.0002%	0.1736%	0.0000%	0.3111%	0.0002%
过去一年	1.0091%	0.0002%	0.3500%	0.0000%	0.6591%	0.0002%
过去三年	4.2502%	0.0013%	1.0500%	0.0000%	3.2002%	0.0013%
过去五年	7.9870%	0.0012%	1.7500%	0.0000%	6.2370%	0.0012%
过去七年	12.3817%	0.0012%	2.4500%	0.0000%	9.9317%	0.0012%
过去十年	23.7451%	0.0028%	3.4995%	0.0000%	20.2456%	0.0028%
自基金合同生效起至今	41.9172%	0.0049%	4.7638%	0.0000%	37.1534%	0.0049%

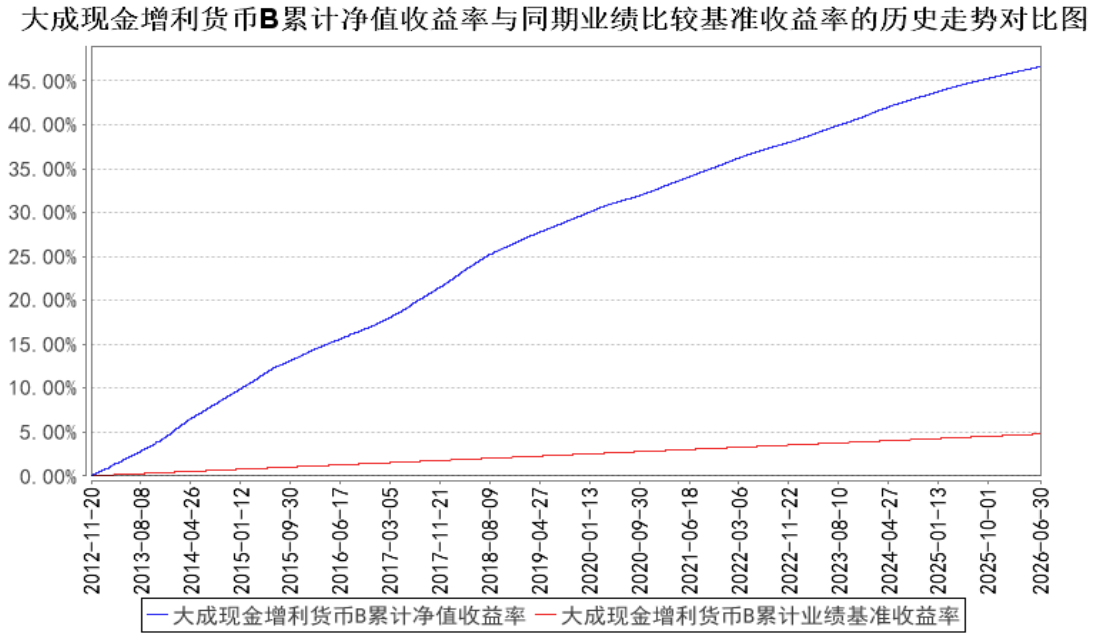
大成现金增利货币 B

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	0.2946%	0.0002%	0.0873%	0.0000%	0.2073	0.0002

					%	%
过去六个月	0.6044%	0.0002%	0.1736%	0.0000%	0.4308%	0.0002%
过去一年	1.2507%	0.0002%	0.3500%	0.0000%	0.9007%	0.0002%
过去三年	4.9974%	0.0013%	1.0500%	0.0000%	3.9474%	0.0013%
过去五年	9.2840%	0.0012%	1.7500%	0.0000%	7.5340%	0.0012%
过去七年	14.2785%	0.0012%	2.4500%	0.0000%	11.8285%	0.0012%
过去十年	26.7382%	0.0028%	3.4995%	0.0000%	23.2387%	0.0028%
自基金合同生效起至今	46.6157%	0.0049%	4.7638%	0.0000%	41.8519%	0.0049%

2.2.2 自基金合同生效以来基金份额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。建仓期结束时，本基金的投资组合比例符合基金合同的约定。

§3 管理人报告

3.1 基金管理人及基金经理情况

3.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

大成基金管理有限公司成立于 1999 年 4 月 12 日，注册资本人民币 2 亿元，是中国首批获准成立的“老十家”基金管理公司之一。公司总部位于深圳，同时设置了北方、华东和南方营销总部，在北京、上海等地开设有 5 家分公司。2009 年，公司在香港设立大成国际资产管理有限公司；2013 年，设立大成创新资本管理有限公司。

公司业务资质齐全，全面覆盖公募基金、机构投资、海外投资、财富管理、养老金管理等业务，还受全国社会保障基金理事会委托管理部分社保基金和基本养老保险基金。旗下大成国际资产管理公司具备 QFII、RQFII 等资格，是首批首家完成备案的能够提供港股通投资顾问服务的香港机构。

历经二十余年的磨砺和沉淀，大成基金形成了以长期投资能力为核心的竞争优势，打造了一支具有良好职业素养和丰富经验的资产管理队伍。公司目前已形成权益投资、固收投资、指数与期货投资、跨境投资、混合资产投资、大类资产配置六大投资团队，全面覆盖各类投资领域，综合实力不断提升，各项业务迅猛发展，管理资产种类位居同业前列。

3.1.2 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	证券从	说明

		（助理）期限		业年限	
		任职日期	离任日期		
曾婷婷	本基金基金经理	2022 年 7 月 1 日	-	16 年	北京大学工商管理硕士。2008 年 10 月至 2010 年 11 月任安永会计师事务所审计部高级审计。2010 年 11 月至 2013 年 3 月任第一创业证券研究所合规经理。2013 年 3 月至 2015 年 8 月任华润元大基金固定收益部固收信用研究员。2015 年 10 月至 2022 年 3 月任前海联合基金固定收益部基金经理。2022 年 3 月加入大成基金管理有限公司，现任固定收益总部现金资产投资部基金经理。2022 年 7 月 1 日至 2024 年 5 月 30 日任大成月添利一个月滚动持有中短债债券型证券投资基金基金经理。2022 年 7 月 1 日起任大成现金增利货币市场基金、大成恒丰宝货币市场基金基金经理。2022 年 10 月 11 日至 2024 年 5 月 30 日任大成惠昭一年定期开放债券型发起式证券投资基金基金经理。2023 年 6 月 5 日至 2025 年 11 月 14 日任大成惠嘉一年定期开放债券型证券投资基金基金经理。2023 年 6 月 5 日起任大成通嘉三年定期开放债券型证券投资基金基金经理。2023 年 10 月 27 日起任大成景安短融债券型证券投资基金基金经理。2024 年 9 月 19 日起任大成现金宝场内实时申赎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中国证监会《证券基金经营机构董事、监事、高级管理人员及从业人员监督管理办法》的相关规定。

3.1.3 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理同时管理的产品情况

无。

3.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

报告期内，本基金管理人严格遵守《中华人民共和国证券法》、《中华人民共和国证券投资基金法》等有关法律法规及基金合同、基金招募说明书等有关基金法律文件的规定，以取信于市场、取信于社会投资公众为宗旨，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在规范基金运作和严格控制投资风险的前提下，为基金份额持有人谋求最大利益，无损害基金份额持有人利益的行为。

3.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

3.3.1 公平交易制度的执行情况

报告期内，公司严格执行了公平交易的原则和制度。公司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、5 日内及 10 日内股票及债券交易同向交易价差进行分析，针对同一基金经理管理的多个投资组合及公私募兼任基金经理管理的多个投资组合的投资交易行为加强了公平交易监测与分析，包括对不同时间窗下（同日、3 日、5 日、10 日）反向交易和同向交易价差监控的分析。分析结果表明：债券交易同向交易频率较低；部分股票同向交易溢价率较大主要来源于投资策略差异、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，同时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。

3.3.2 异常交易行为的专项说明

报告期内，公司旗下所有投资组合未发现存在异常交易行为。公司旗下投资组合间存在证券同日反向交易，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证券当日成交量 5%的情形。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。

3.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

3.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

上半年经济基本面呈现 “外需托底、内需偏弱” 的运行格局。制造业 PMI 在荣枯线附近窄幅震荡，景气度边际走弱；固定资产投资同比增速转负，社会消费持续走弱。价格端走势分化明显，呈现 “PPI 走强、CPI 平稳” 的态势。

货币政策坚持 “适度宽松、精准有效” 基调，持续引导隔夜市场利率围绕政策利率平稳运行。

在基本面与资金面共同支撑下，债券市场整体震荡下行。受活期存款自律管理影响，叠加银行存贷差持续走阔、结汇资金持续流入，银行间资金利率中枢快速下行，短端收益率持续走低，短端品种期限利差收窄至历史低位，1 年期国股行同业存单利率下探至 1.43% 附近。此后央行持续回笼中长期流动性，6 月中旬资金利率中枢回升至政策利率上方，存单利率同步反弹至 1.50% 左右。

报告期内，本基金持仓以同业存单、协议存款、逆回购和利率债为主，资产的安全性和流动性较高。本基金流动性未出现异常，满足了投资者正常的申购、赎回要求。

3.4.2 报告期内基金的业绩表现

本报告期大成现金增利货币 A 的基金份额净值收益率为 0.4847%，同期业绩比较基准收益率

为 0.1736%，本报告期大成现金增利货币 B 的基金份额净值收益率为 0.6044%，同期业绩比较基准收益率为 0.1736%。

3.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望三季度，海外地缘冲突、关税政策带来的不确定性仍存。若国内财政支出提速，叠加各类广义财政工具落地见效，内需有望获得提振。货币政策预计维持适度宽松基调，央行持续加大结构性支持力度。整体来看，流动性保持宽松，资金利率或将维持窄幅波动，关键时点或存在阶段性扰动，债券短端、中短端品种仍具备较高配置价值；长端债券需要持续跟踪 PPI 上行的可持续性、政府债券供给节奏、机构配置力度等核心变量，择机布局。

3.6 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。估值委员会由公司分管领导、各投研部门、交易管理部、风险管理部、监察稽核部、基金运营部指定人员组成。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。

各投研部门、风险管理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；交易管理部负责关注相关投资品种的流动性状况，协助反馈其市场交易信息；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，并负责与托管人沟通估值调整事项；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人员执行，并与托管人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，投资组合经理作为估值小组成员，对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人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及中证指数有限公司签署服务协议，由中央国债登记结算有限责任公司按约定提供银行间交易的债券品种的估值数据，由中证指数有限公司按约定提供交易所交易的债券品种的估值数据和流通受限股票的折扣率数据。

3.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金管理人严格按照本基金基金合同的规定进行收益分配。据本基金基金合同中收益分配有关原则的规定：本基金根据每日基金收益公告，以每万份基金份额收益为基准，为投资人每日计算基金收益并分配。本报告期内本基金应分配利润 248,734,373.28 元，报告期内已分配利润 248,734,373.28 元。

3.8 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。

§4 托管人报告

4.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内，中国农业银行股份有限公司（以下简称“本基金托管人”）在本基金的托管过程中，严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》及其他相关法律、法规的规定和基金合同、托管协议的约定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

4.2 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，本基金托管人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》及其他相关法律、法规的规定和基金合同、托管协议的约定，对本基金的投资运作情况进行了必要的监督，对本基金的基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格计算、基金费用开支、利润分配等方面进行了复核，未发现基金管理人有损害基金份额持有人利益的行为。

4.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本基金托管人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》及其他相关法律、法规的规定和基金合同、托管协议的约定，以自身能够获取的数据和信息为限，对本基金中期报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容进行核查，以上内容真实、准确、完整。

§5 半年度财务会计报告（未经审计）

5.1 资产负债表

会计主体：大成现金增利货币市场基金

报告截止日：2026 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2026 年 6 月 30 日	上年度末 2025 年 12 月 31 日
资 产：			
货币资金	6.4.7.1	38,646,383,342.85	25,736,014,747.51
结算备付金		500,062.57	21,363,026.39
存出保证金		163,637.90	161,096.81
交易性金融资产	6.4.7.2	12,411,920,553.70	22,463,606,453.30
其中：股票投资		-	-
基金投资		-	-
债券投资		12,411,920,553.70	22,463,606,453.30
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
其他投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	3,732,959,101.46	6,744,134,620.47
应收清算款		-	262,474,319.31
应收股利		-	-
应收申购款		2,646.70	3,728,884.03
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.8	-	-
资产总计		54,791,929,345.18	55,231,483,147.82
负债和净资产	**附注号**	**本期末 2026 年 6 月 30 日**	**上年度末 2025 年 12 月 31 日**
负 债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		4,500,192,631.51	2,858,484,381.32
应付清算款		-	-
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		13,722,922.91	14,704,212.79
应付托管费		2,079,230.76	2,227,911.04
应付销售服务费		10,395,513.64	11,138,490.04
应付投资顾问费		-	-
应交税费		3,895.25	37,796.44
应付利润		1,254,014.36	1,489,946.27
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.9	460,815.69	395,182.88
负债合计		4,528,109,024.12	2,888,477,920.78
净资产：			
实收基金	6.4.7.10	50,263,820,321.06	52,343,005,227.04
未分配利润	6.4.7.12	-	-
净资产合计		50,263,820,321.06	52,343,005,227.04

负债和净资产总计		54,791,929,345.18	55,231,483,147.82

注：报告截止日 2026 年 6 月 30 日,基金份额总额 50,263,820,321.06 份。其中大成现金增利货币 A 类基金份额总额为 50,260,573,998.25 份，基金份额净值 1.0000 元；大成现金增利货币 B 类基金份额总额为 3,246,322.81 份，基金份额净值 1.0000 元。

5.2 利润表

会计主体：大成现金增利货币市场基金

本报告期：2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
一、营业总收入		430,164,934.07	519,021,367.63
1.利息收入		301,115,412.60	263,506,643.81
其中：存款利息收入	6.4.7.13	257,602,018.27	147,663,892.48
债券利息收入		-	-
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		43,513,394.33	115,842,751.33
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		129,049,521.47	255,514,723.82
其中：股票投资收益	6.4.7.14	-	-
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.15	129,049,521.47	255,514,723.82
资产支持证券投资收益	6.4.7.16	-	-
贵金属投资收益	6.4.7.17	-	-
衍生工具收益	6.4.7.18	-	-
股利收益	6.4.7.19	-	-
以摊余成本计量的金融资产终止确认产生的收益		-	-
其他投资收益		-	-
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.20	-	-
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-

5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.21	-	-
减：二、营业总支出		181,430,560.79	177,226,831.06
1．管理人报酬	6.4.10.2.1	84,157,929.61	87,078,989.14
2．托管费	6.4.10.2.2	12,751,201.40	13,193,786.27
3．销售服务费	6.4.10.2.3	63,751,389.64	65,876,206.57
4．投资顾问费		-	-
5．利息支出		20,533,417.94	10,747,518.91
其中：卖出回购金融资产支出		20,533,417.94	10,747,518.91
6．信用减值损失	6.4.7.22	-	-
7．税金及附加		21,029.37	-
8．其他费用	6.4.7.23	215,592.83	330,330.17
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		248,734,373.28	341,794,536.57
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		248,734,373.28	341,794,536.57
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		248,734,373.28	341,794,536.57

5.3 净资产变动表

会计主体：大成现金增利货币市场基金

本报告期：2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	52,343,005,227.04	-	-	52,343,005,227.04
二、本期期初净资产	52,343,005,227.04	-	-	52,343,005,227.04
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-2,079,184,905.98	-	-	-2,079,184,905.98
（一）、综合收益总额	-	-	248,734,373.28	248,734,373.28
（二）、本期基金份额交易产生的净资产变	-2,079,184,905.98	-	-	-2,079,184,905.98

动数（净资产减少以“-”号填列）				
其中：1.基金申购款	230,040,326,379.66	-	-	230,040,326,379.66
2.基金赎回款	-232,119,511,285.64	-	-	-232,119,511,285.64
（三）、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动（净资产减少以“-”号填列）	-	-	-248,734,373.28	-248,734,373.28
四、本期期末净资产	50,263,820,321.06	-	-	50,263,820,321.06

项目	上年度可比期间 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	51,794,484,204.82	-	-	51,794,484,204.82
二、本期期初净资产	51,794,484,204.82	-	-	51,794,484,204.82
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	3,781,045,709.24	-	-	3,781,045,709.24
（一）、综合收益总额	-	-	341,794,536.57	341,794,536.57
（二）、本期基金份额交易产生的净资产变动数（净资产减少以“-”号填列）	3,781,045,709.24	-	-	3,781,045,709.24
其中：1.基金申购款	235,787,665,758.51	-	-	235,787,665,758.51

2. 基金赎回款	-232,006,620,049.27	-	-	-232,006,620,049.27
（三）、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动（净资产减少以“-”号填列）	-	-	-341,794,536.57	-341,794,536.57
四、本期期末净资产	55,575,529,914.06	-	-	55,575,529,914.06

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：

谭晓冈	范瑛	梁靖
基金管理人负责人	主管会计工作负责人	会计机构负责人

5.4 报表附注

5.4.1 基金基本情况

大成现金增利货币市场基金（以下简称“本基金”）经中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）证监许可[2012]1306 文《关于核准大成现金增利货币市场基金募集的批复》核准，由大成基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《大成现金增利货币市场基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式，存续期限不定，募集期结束经安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）安永华明（2012）验字第 60469430_H05 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《大成现金增利货币市场基金基金合同》于 2012 年 11 月 20 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 4,866,253,649.51 份基金份额，本基金的基金管理人为大成基金管理有限公司，基金托管人为中国农业银行股份有限公司。

本基金分设两类基金份额：A 类基金份额和 B 类基金份额。两类基金份额针对不同类别的基金份额持有人，分设不同的基金代码，收取不同销售服务费并单独公布基金日收益和基金 7 日年化收益率。投资者可自行选择认/申购的基金份额类别，不同基金份额登记之间不得互相转换。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》、基金合同及招募说明书的有关规定，本基金的投资范围为法律法规及监管机构允许投资的金融工具，包括现金、期限在 1 年以内（含 1 年）的银行存款、债券回购、中央银行票据、同业存单、剩余期限在 397 天以内（含 397 天）的债券、非金

融企业债务融资工具、资产支持证券以及中国证监会、中国人民银行认可的其它具有良好流动性的货币市场工具。法律法规或监管机构允许货币市场基金投资其他货币市场工具的，在不改变基金投资目标、投资策略，不改变基金风险收益特征的条件下，本基金可参与其他货币市场工具的投资，不需召开持有人大会。具体比例限制按照相关法律法规和监管规定执行。

本基金的业绩比较基准为银行活期存款利率。

5.4.2 会计报表的编制基础

本财务报表系按照财政部颁布的《企业会计准则——基本准则》以及其后颁布及修订的具体会计准则、解释以及《资产管理产品相关会计处理规定》和其他相关规定（统称“企业会计准则”）编制，同时，在信息披露和估值方面，也参考了中国证监会颁布的《中国证券监督管理委员会关于证券投资基金估值业务的指导意见》、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》、《公开募集证券投资基金信息披露内容与格式准则第 2 号——定期报告的内容与格式》、《证券投资基金信息披露编报规则第 3 号<会计报表附注的编制及披露>》、《证券投资基金信息披露编报规则第 5 号<货币市场基金信息披露特别规定>》，中国证券投资基金业协会发布的《公开募集证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号——年度报告和中期报告》以及中国证监会和中国证券投资基金业协会颁布的其他相关规定。

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

5.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金 2026 年 6 月 30 日的财务状况以及 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日期间的经营成果和净资产变动情况等有关信息。

5.4.4 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。

5.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

5.4.5.1 会计政策变更的说明

无。

5.4.5.2 会计估计变更的说明

无。

5.4.5.3 差错更正的说明

无。

5.4.6 税项

（1）增值税及附加

根据中华人民共和国主席令第四十一号《中华人民共和国增值税法》、中华人民共和国国务院令第 826 号《中华人民共和国增值税法实施条例》及财政部、税务总局公告 2026 年第 10 号《关于增值税法施行后增值税优惠政策衔接事项的公告》的规定，资管产品运营过程中发生的应税交易，资管产品管理人为纳税人；自 2026 年 1 月 1 日至 2027 年 12 月 31 日，资管产品管理人运营契约制资管产品过程中发生的增值税应税行为，可以选择适用简易计税方法，按照 3%的规定征收率计算缴纳增值税，公募证券投资基金（封闭式证券投资基金、开放式证券投资基金）管理人运用基金买卖股票、债券取得的收入及金融同业往来利息收入免征增值税，金融同业往来利息收入包括金融机构与人民银行所发生的资金往来业务、银行联行往来业务、金融机构间的资金往来业务，以及金融机构开展同业存款、同业借款、同业代付、买断式买入返售金融商品、质押式买入返售金融商品、同业存单，取得的利息收入；取得存款利息收入不属于应税交易，不征收增值税。

根据财政部、税务总局公告 2025 年第 4 号《关于国债等债券利息收入增值税政策的公告》的规定，自 2025 年 8 月 8 日起，对在该日期之后（含当日）新发行的国债、地方政府债券、金融债券的利息收入，恢复征收增值税。对在该日期之前已发行的国债、地方政府债券、金融债券（包含在 2025 年 8 月 8 日之后续发行的部分）的利息收入，继续免征增值税直至债券到期。

增值税附加税包括城市维护建设税、教育费附加和地方教育附加，以实际缴纳的增值税税额为计税依据，分别按 7%、3%和 2%的比例缴纳城市维护建设税、教育费附加和地方教育附加。

（2）企业所得税

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》的规定，自 2004 年 1 月 1 日起，对证券投资基金（封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金）管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入，继续免征企业所得税。

根据财政部、国家税务总局财税[2008]1 号《财政部　国家税务总局关于企业所得税若干优惠政策的通知》的规定，对证券投资基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股权的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

（3）个人所得税

根据财政部、国家税务总局财税[2008]132 号《关于储蓄存款利息所得有关个人所得税政策的通知》的规定，自 2008 年 10 月 9 日起，对储蓄存款利息所得暂免征收个人所得税。

根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2012]85 号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》的规定，自 2013 年 1 月 1 日起，证券投资基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，持股期限在 1 个月以内（含 1 个月）的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在 1 个月以上至 1 年（含 1 年）的，暂减按 50%计入应纳税所得额；

持股期限超过 1 年的，暂减按 25%计入应纳税所得额。上述所得统一适用 20%的税率计征个人所得税。

根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2015]101 号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》的规定，自 2015 年 9 月 8 日起，证券投资基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，持股期限超过 1 年的，股息红利所得暂免征收个人所得税。

5.4.7 重要财务报表项目的说明

5.4.7.1 货币资金

单位：人民币元

项目	本期末 2026 年 6 月 30 日
活期存款	12,760,880,204.95
等于：本金	12,755,672,746.94
加：应计利息	5,207,458.01
减：坏账准备	-
定期存款	500,040,000.00
等于：本金	500,000,000.00
加：应计利息	40,000.00
减：坏账准备	-
其中：存款期限 1 个月以内	-
存款期限 1-3 个月	500,040,000.00
存款期限 3 个月以上	-
其他存款	25,385,463,137.90
等于：本金	25,305,000,000.00
加：应计利息	80,463,137.90
减：坏账准备	-
合计	38,646,383,342.85

注：其他存款为根据协议可提前支取的协议存款。

5.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末 2026 年 6 月 30 日			
		按实际利率计算的账面价值	影子定价	偏离金额	偏离度（%）
债券	交易所市场	120,224,140.28	120,206,140.28	-18,000.00	-0.0000
	银行间市场	12,291,696,413.42	12,293,775,000.00	2,078,586.58	0.0041
	合计	12,411,920,553.70	12,413,981,140.28	2,060,586.58	0.0041
资产支持证券		-	-	-	-

合计	12,411,920,553.70	12,413,981,140.28	2,060,586.58	0.0041

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。

5.4.7.3 衍生金融资产/负债

5.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

无。

5.4.7.3.2 期末基金持有的期货合约情况

无。

5.4.7.3.3 期末基金持有的黄金衍生品情况

无。

5.4.7.4 买入返售金融资产

5.4.7.4.1 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 2026 年 6 月 30 日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	-	-
银行间市场	3,732,959,101.46	-
合计	3,732,959,101.46	-

5.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

无。

5.4.7.4.3 按预期信用损失一般模型计提减值准备的说明

无。

5.4.7.5 债权投资

5.4.7.5.1 债权投资情况

无。

5.4.7.5.2 债权投资减值准备计提情况

无。

5.4.7.6 其他债权投资

5.4.7.6.1 其他债权投资情况

无。

5.4.7.6.2 其他债权投资减值准备计提情况

无。

5.4.7.7 其他权益工具投资

5.4.7.7.1 其他权益工具投资情况

无。

5.4.7.7.2 报告期末其他权益工具投资情况

无。

5.4.7.8 其他资产

无。

5.4.7.9 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2026 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	-
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	362,255.54
其中：交易所市场	-
银行间市场	362,255.54
应付利息	-
预提费用	98,560.15
合计	460,815.69

5.4.7.10 实收基金

金额单位：人民币元

大成现金增利货币 A

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	52,337,777,741.53	52,337,777,741.53
本期申购	230,040,302,862.24	230,040,302,862.24
本期赎回（以“-”号填列）	-232,117,506,605.52	-232,117,506,605.52
基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算调整	-	-
本期申购	-	-
本期赎回（以“-”号填列）	-	-
本期末	50,260,573,998.25	50,260,573,998.25

大成现金增利货币 B

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日

	基金份额（份）	账面金额
上年度末	5,227,485.51	5,227,485.51
本期申购	23,517.42	23,517.42
本期赎回（以“-”号填列）	-2,004,680.12	-2,004,680.12
基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算调整	-	-
本期申购	-	-
本期赎回（以“-”号填列）	-	-
本期末	3,246,322.81	3,246,322.81

注：申购含红利再投份额(如有)、转换入份额(如有)；赎回含转换出份额(如有)。

5.4.7.11 其他综合收益

无。

5.4.7.12 未分配利润

单位：人民币元

大成现金增利货币 A

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-	-	-
本期期初	-	-	-
本期利润	248,710,936.66	-	248,710,936.66
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	-248,710,936.66	-	-248,710,936.66
本期末	-	-	-

大成现金增利货币 B

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-	-	-
本期期初	-	-	-
本期利润	23,436.62	-	23,436.62
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	-23,436.62	-	-23,436.62
本期末	-	-	-

5.4.7.13 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	63,730,897.25

定期存款利息收入	7,779,859.14
其他存款利息收入	186,056,248.71
结算备付金利息收入	34,726.87
其他	286.30
合计	257,602,018.27

5.4.7.14 股票投资收益

无。

5.4.7.15 债券投资收益

5.4.7.15.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2026年1月1日至2026年6月30日
债券投资收益——利息收入	124,563,376.21
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	4,486,145.26
债券投资收益——赎回差价收入	-
债券投资收益——申购差价收入	-
合计	129,049,521.47

5.4.7.15.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2026年1月1日至2026年6月30日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	26,460,104,467.37
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	26,436,763,928.85
减：应计利息总额	18,854,423.26
减：交易费用	-30.00
买卖债券差价收入	4,486,145.26

5.4.7.15.3 债券投资收益——赎回差价收入

无。

5.4.7.15.4 债券投资收益——申购差价收入

无。

5.4.7.16 资产支持证券投资收益

5.4.7.16.1 资产支持证券投资收益项目构成

无。

5.4.7.16.2 资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入

无。

5.4.7.16.3 资产支持证券投资收益——赎回差价收入

无。

5.4.7.16.4 资产支持证券投资收益——申购差价收入

无。

5.4.7.17 贵金属投资收益

5.4.7.17.1 贵金属投资收益项目构成

无。

5.4.7.17.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

无。

5.4.7.17.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

无。

5.4.7.17.4 贵金属投资收益——申购差价收入

无。

5.4.7.18 衍生工具收益

5.4.7.18.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

无。

5.4.7.18.2 衍生工具收益——其他投资收益

无。

5.4.7.19 股利收益

无。

5.4.7.20 公允价值变动收益

无。

5.4.7.21 其他收入

无。

5.4.7.22 信用减值损失

无。

5.4.7.23 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
审计费用	29,752.78
信息披露费	59,507.37

证券出借违约金	-
银行划款手续费	97,732.68
账户维护费	18,600.00
其他	10,000.00
合计	215,592.83

5.4.7.24 分部报告

无。

5.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

5.4.8.1 或有事项

无。

5.4.8.2 资产负债表日后事项

无。

5.4.9 关联方、关联关系

5.4.9.1 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

本基金本报告期存在控制关系或者其他重大利害关系的关联方未发生变化。

5.4.9.2 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
中国农业银行股份有限公司(“中国农业银行”)	基金托管人、基金销售机构
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

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

5.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

5.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

5.4.10.1.1 股票交易

无。

5.4.10.1.2 债券交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2025年1月1日至2025年6月30日	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例（%）	成交金额	占当期债券成交总额的比例（%）

光大证券	1,081,395,931.40	54.84	391,808,296.38	22.86

5.4.10.1.3 债券回购交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2025年1月1日至2025年6月30日	
	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例（%）	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例（%）
光大证券	18,811,200,000.00	91.10	83,046,636,000.00	97.04

5.4.10.1.4 权证交易

无。

5.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

无。

5.4.10.2 关联方报酬

5.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	84,157,929.61	87,078,989.14
其中：应支付销售机构的客户维护费	41,916,966.26	43,354,336.80
应支付基金管理人的净管理费	42,240,963.35	43,724,652.34

注：本基金管理费年费率为 0.33%，每日计提，按月支付。其计算公式为：

日管理费＝前一日基金资产净值×管理费年费率/当年天数。

5.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	12,751,201.40	13,193,786.27

注：本基金托管费年费率为 0.05%，每日计提，按月支付。其计算公式为：

日托管费＝前一日基金资产净值×托管费年费率/当年天数。

5.4.10.2.3 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 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	大成现金增利货币 A	大成现金增利货币 B	合计
大成基金	185,333.49	3.88	185,337.37
光大证券	1.81	-	1.81
中国农业银行	252,281.71	-	252,281.71
合计	437,617.01	3.88	437,620.89
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	大成现金增利货币 A	大成现金增利货币 B	合计
大成基金	201,871.76	4.05	201,875.81
光大证券	0.45	-	0.45
中国农业银行	35,455.32	33.02	35,488.34
合计	237,327.53	37.07	237,364.60

注：A 类基金份额、B 类基金份额的销售服务费年费率分别为 0.25%、0.01%。

销售服务费的计算方法如下：

H＝E×该类基金份额销售服务费年费率÷当年天数

H 为该类基金份额每日应计提的销售服务费

E 为该类基金份额前一日基金资产净值

5.4.10.3 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 2026 年 1 月 1 日至 2026 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
中国农业银行	-	197,327,644.38	-	-	-	-
上年度可比期间 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日						
银行间市场交易的	债券交易金额		基金逆回购		基金正回购	

各关联方名称	基金买入	基金卖出	交易金额	利息收入	交易金额	利息支出
-	-	-	-	-	-	-

5.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

5.4.10.4.1 与关联方通过约定申报方式进行的适用固定期限费率的证券出借业务的情况

无。

5.4.10.4.2 与关联方通过约定申报方式进行的适用市场化期限费率的证券出借业务的情况

无。

5.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

5.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

无。

5.4.10.5.2 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

无。

5.4.10.6 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 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2025年1月1日至2025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
中国农业银行	19,791,114,287.70	111,438,765.85	12,478,793,597.14	49,337,597.25

注：本基金由基金托管人保管的银行存款，按银行约定利率计息。

5.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

无。

5.4.10.8 其他关联交易事项的说明

无。

5.4.11 利润分配情况

单位：人民币元

大成现金增利货币 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
248,946,787.77	-	-235,851.11	248,710,936.66	-
大成现金增利货币 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
23,517.42	-	-80.80	23,436.62	-

5.4.12 期末（2026 年 6 月 30 日）本基金持有的流通受限证券

5.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

无。

5.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

无。

5.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

5.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末 2026 年 6 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 4,500,192,631.51 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
112505307	25 建设银行 CD307	2026 年 7 月 1 日	99.85	1,000,000	99,849,539.15
112505415	25 建设银行 CD415	2026 年 7 月 1 日	99.74	1,000,000	99,741,414.65
112514200	25 江苏银行 CD200	2026 年 7 月 1 日	99.65	2,000,000	199,299,116.93
112515304	25 民生银行 CD304	2026 年 7 月 1 日	99.36	1,000,000	99,361,709.94
112520293	25 广发银行 CD293	2026 年 7 月 1 日	99.44	1,000,000	99,443,543.82
112584506	25 杭州银行 CD199	2026 年 7 月 1 日	99.44	2,000,000	198,879,142.45
112584524	25 杭州银行 CD200	2026 年 7 月 1 日	99.85	2,000,000	199,698,473.11
112602096	26 工商银行 CD096	2026 年 7 月 1 日	99.37	3,000,000	298,111,182.16
112602111	26 工商银行 CD111	2026 年 7 月 1 日	99.32	1,671,000	165,960,162.26
112602114	26 工商银行 CD114	2026 年 7 月 1 日	99.31	3,000,000	297,941,915.48
112604006	26 中国银行 CD006	2026 年 7 月 1 日	99.25	1,000,000	99,245,138.13
112604017	26 中国银行 CD017	2026 年 7 月 1 日	98.97	3,000,000	296,907,752.54
112605161	26 建设银行 CD161	2026 年 7 月 1 日	99.31	2,000,000	198,627,342.71
112612007	26 北京银行 CD007	2026 年 7 月 1 日	99.51	1,000,000	99,505,700.98

112612042	26 北京银行 CD042	2026 年 7 月 1 日	98.88	5,000,000	494,421,513.82
112612076	26 北京银行 CD076	2026 年 7 月 1 日	99.34	2,000,000	198,683,005.08
112616072	26 上海银行 CD072	2026 年 7 月 1 日	98.94	1,000,000	98,943,053.12
112616073	26 上海银行 CD073	2026 年 7 月 1 日	98.57	2,000,000	197,148,913.97
112620049	26 广发银行 CD049	2026 年 7 月 1 日	98.89	237,000	23,437,291.13
112690729	26 南京银行 CD015	2026 年 7 月 1 日	99.92	2,277,000	227,506,481.19
112694748	26 厦门国际银行 CD021	2026 年 7 月 1 日	98.81	312,000	30,828,143.10
112695486	26 徽商银行 CD095	2026 年 7 月 1 日	99.48	2,000,000	198,952,333.69
112696501	26 徽商银行 CD111	2026 年 7 月 1 日	99.41	1,169,000	116,212,785.08
112697072	26 杭州银行 CD121	2026 年 7 月 1 日	99.33	3,000,000	297,985,506.08
112697426	26 厦门国际银行 CD042	2026 年 7 月 1 日	99.31	1,000,000	99,305,356.21
112697583	26 厦门国际银行 CD043	2026 年 7 月 1 日	99.29	4,000,000	397,159,532.75
合计				48,666,000	4,833,156,049.53

5.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

无。

5.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

无。

5.4.13 金融工具风险及管理

5.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金在日常经营活动由金融工具产生的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金管理人制定了政策和程序来识别及分析这些风险，并设定适当的风险限额及内部控制流程，通过可靠的管理及信息系统持续监控上述各类风险。

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（合规与风险管理委员会、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与风险管理委员会，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具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。

5.4.13.2 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人中国农业银行股份有限公司或其他商业银行开立的存款账户，因而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。信用等级评估以内部信用评级为主，外部信用评级为辅。内部债券信用评级主要考察发行人的经营风险、财务风险和流动性风险，以及信用产品的条款和担保人的情况等。此外，本基金的基金管理人根据信用产品的内部评级，通过单只信用产品投资占基金资产净值的比例及占发行量的比例进行控制，通过分散化投资以分散信用风险。

本期末，本基金持有的除国债、央行票据和政策性金融债以外的债券占基金资产净值的比例为 24.69%(上年度末：42.92%)。

5.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金在履行与金融负债有关的义务时遇到资金短缺的风险。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。

5.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《货币市场基金监督管理办法》及《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》等有关法规的要求对本基金组合资产的流动性风险进行管理。本基金的基金管理人采用监控流动性受限资产比例、份额持有人集中度、调整平均剩余期限和平均剩余存续期、压力测试等方式防范流动性风险，并于开放日对本基金的申购赎回情况进行监控，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配，确保本基金资产的变现能力与投资者赎回需求的匹配与平衡。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。于本期末，本基金持有的流动性受限资产的估值占基金资产净值的比例未超过 10%，本基金投资组合中现金、国债、中央银行票据、政策性金融债券以及 5 个交易日内到期的其他金融工具占基金资产净值的比例合计不低于 30%，且本基金前 10 名份额持有人的持有份额合计占基金总份额的比例、投资组合的平均剩余期限及平均剩余存续期皆符合有关法规的要求。

本基金所持大部分证券为剩余期限较短、具有良好流动性的债券和货币市场工具，除在证券交易所的债券买卖、债券回购及返售交易，其余均在银行间同业市场交易，因此，除在“期末本基金持有的流通受限证券”中列示的部分基金资产流通暂时受限制外（如有），均能够及时变现。本基金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，其上限一般不超过基金持有的债券资产的公允价值。除附注“期末债券正回购交易中作为抵押的债券”中列示的卖出回购金融资产款余额（如有）将在 1 个月内到期且计息外，本基金于资产负债表日所持有的金融负债的合约约定剩余到期日均为一年以内且一般不计息，可赎回基金份额净值无固定到期日且不计息，因此账面余额一般即为未折现的合约到期现金流量。本报告期内，本基金未发生重大流动性风险事件。

5.4.13.4 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。

5.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指金融工具的公允价值或未来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。

5.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2026 年 6 月 30 日	6 个月以内	6 个月-1 年	1-5 年	不计息	合计
资产					
货币资金	35,235,061,369.58	3,411,321,973.27	-	-	38,646,383,342.85
结算备付金	500,062.57	-	-	-	500,062.57
存出保证金	163,637.90	-	-	-	163,637.90
交易性金融资产	9,275,131,660.72	3,136,788,892.98	-	-	12,411,920,553.70
买入返售金融资产	3,732,959,101.46	-	-	-	3,732,959,101.46
应收申购款	-	-	-	2,646.70	2,646.70
资产总计	48,243,815,832.23	6,548,110,866.25	-	2,646.70	54,791,929,345.18
负债					
应付管理人报酬	-	-	-	13,722,922.91	13,722,922.91
应付托管费	-	-	-	2,079,230.76	2,079,230.76
卖出回购金融资产款	4,500,192,631.51	-	-	-	4,500,192,631.51
应付销售服务费	-	-	-	10,395,513.64	10,395,513.64
应付利润	-	-	-	1,254,014.36	1,254,014.36
应交税费	-	-	-	3,895.25	3,895.25
其他负债	-	-	-	460,815.69	460,815.69
负债总计	4,500,192,631.51	-	-	27,916,392.61	4,528,109,024.12
利率敏感度缺口	43,743,623,200.72	6,548,110,866.25	-	-27,913,745.91	50,263,820,321.06
上年度末 2025 年 12 月 31 日	6 个月以内	6 个月 -1 年	1-5 年	不计息	合计
资产					
货币资金	25,030,249,182.13	705,765,565.38	-	-	25,736,014,747.51
结算备付金	21,363,026.39	-	-	-	21,363,026.39
存出保证金	161,096.81	-	-	-	161,096.81
交易性金融资产	19,590,085,788.65	2,873,520,664.65	-	-	22,463,606,453.30
买入返售金融资产	6,744,134,620.47	-	-	-	6,744,134,620.47
应收申购款	-	-	-	3,728,884.03	3,728,884.03

应收清算款	-	-	-	262,474,319.31	262,474,319.31
资产总计	51,385,993,714.45	3,579,286,230.03	-	266,203,203.34	55,231,483,147.82
负债					
应付管理人报酬	-	-	-	14,704,212.79	14,704,212.79
应付托管费	-	-	-	2,227,911.04	2,227,911.04
卖出回购金融资产款	2,858,484,381.32	-	-	-	2,858,484,381.32
应付销售服务费	-	-	-	11,138,490.04	11,138,490.04
应付利润	-	-	-	1,489,946.27	1,489,946.27
应交税费	-	-	-	37,796.44	37,796.44
其他负债	-	-	-	395,182.88	395,182.88
负债总计	2,858,484,381.32	-	-	29,993,539.46	2,888,477,920.78
利率敏感度缺口	48,527,509,333.13	3,579,286,230.03	-	236,209,663.88	52,343,005,227.04

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。

5.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	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（2026 年 6 月 30 日）	上年度末 （2025 年 12 月 31 日 ）
	市场利率上升 25 个基点	-13,374,675.58	-17,201,160.12
	市场利率下降 25 个基点	13,411,857.05	17,238,266.24

5.4.13.4.2 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。本基金持有的金融工具均以人民币计价，因此无重大外汇风险。

5.4.13.4.3 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，且以摊余成本进行后续计量，因此无重大市场价格风险。

5.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

无。

5.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

无。

5.4.14 公允价值

5.4.14.1 金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属的层次，由对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次决定：

第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

5.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

5.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2026 年 6 月 30 日	上年度末 2025 年 12 月 31 日
第一层次	-	-
第二层次	12,411,920,553.70	22,463,606,453.30
第三层次	-	-
合计	12,411,920,553.70	22,463,606,453.30

5.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

本基金以导致各层次之间转换的事项发生日为确认各层次之间转换的时点。

本基金本期及上年度可比期间持有的以公允价值计量的金融工具的公允价值所属层次未发生重大变动。

5.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

于本期末，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融工具(上年度末：同)。

5.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括货币资金、应收款项和其他金融负债等，其账面价值与公允价值相差很小。

5.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

§6 投资组合报告

6.1 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	12,411,920,553.70	22.65
	其中：债券	12,411,920,553.70	22.65
	资产支持证券	-	-
2	买入返售金融资产	3,732,959,101.46	6.81
	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	38,646,883,405.42	70.53
4	其他各项资产	166,284.60	0.00
5	合计	54,791,929,345.18	100.00

6.2 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	5.60	
	其中：买断式回购融资	-	
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	4,500,192,631.51	8.95
	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

无。

6.3 基金投资组合平均剩余期限

6.3.1 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	89
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	89
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	60

报告期内投资组合平均剩余期限超过 120 天情况说明

无。

6.3.2 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	45.73	8.95
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
2	30 天（含）—60 天	8.95	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
3	60 天（含）—90 天	12.11	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
4	90 天（含）—120 天	3.65	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
5	120 天（含）—397 天（含）	38.39	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
合计		108.84	8.95

6.4 报告期内投资组合平均剩余存续期超过 240 天情况说明

无。

6.5 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	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	120,224,140.28	0.24
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	同业存单	12,291,696,413.42	24.45
8	其他	-	-
9	合计	12,411,920,553.70	24.69
10	剩余存续期超过397天的浮动利率债券	-	-

6.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名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）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	112612042	26 北京银行 CD042	5,000,000	494,421,513.82	0.98
2	112621088	26 渤海银行 CD088	4,900,000	488,307,061.16	0.97
3	112690584	26 广州银行 CD006	4,000,000	399,674,327.70	0.80
4	112695365	26 广州农村商业银行 CD049	4,000,000	397,927,567.79	0.79
5	112697583	26 厦门国际银行 CD043	4,000,000	397,159,532.75	0.79
6	112690729	26 南京银行 CD015	3,000,000	299,745,034.51	0.60
7	112697213	26 广州银行 CD096	3,000,000	299,062,687.73	0.59
8	112693368	26 广州农村商业银行 CD031	3,000,000	298,963,597.12	0.59
9	112602096	26 工商银行 CD096	3,000,000	298,111,182.16	0.59
10	112697072	26 杭州银行 CD121	3,000,000	297,985,506.08	0.59

6.7 “影子定价”与按实际利率计算账面价值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	0
报告期内偏离度的最高值	0.0148%
报告期内偏离度的最低值	0.0011%
报告期内每个交易日偏离度的绝对值的简单平均值	0.0079%

报告期内负偏离度的绝对值达到 0.25%情况说明

无。

报告期内正偏离度的绝对值达到 0.5%情况说明

无。

6.8 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名资产支持证券投资明细

无。

6.9 投资组合报告附注

6.9.1 基金计价方法说明

本基金按照实际利率法计算金融资产的账面价值，并使用影子定价和偏离度加以控制。

6.9.2 基金投资的前十名证券的发行主体本期是否出现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

1、本基金投资的前十名证券 26 北京银行 CD042 的发行主体北京银行股份有限公司于 2025 年 9 月 30 日因贷款风险分类不准确、金融投资业务减值准备计提不充足、违规办理票据业务、贷款数据不准确、消费者权益保护工作不规范、法人商用房按揭贷款贷前调查不到位、违规为土地储备项目融资等受到国家金融监督管理总局北京监管局处罚；于 2025 年 11 月 26 日因违反账户管理规定、违反收单业务管理规定、违反代收业务管理规定、违反反假货币业务管理规定、占压财政存款或者资金、违反信用信息采集、提供、查询及相关管理规定、未按规定履行客户身份识别义务、未按规定报送大额交易报告或者可疑交易报告、与身份不明的客户进行交易等受到中国人民银行处罚（银罚决字〔2025〕84 号）；于 2026 年 6 月 18 日因外币现金管理存在缺陷等受到国家金融监督管理总局北京监管局处罚。本基金认为，对北京银行股份有限公司的处罚不会对其投资价值构成实质性负面影响。

2、本基金投资的前十名证券 26 广州银行 CD096、26 广州银行 CD006 的发行主体广州银行股份有限公司于 2026 年 1 月 14 日因内控失效，员工违规使用客户信息等受到国家金融监督管理总局广东监管局处罚；于 2026 年 4 月 30 日因信息科技管理不到位等受到国家金融监督管理总局广东监管局处罚。本基金认为，对广州银行股份有限公司的处罚不会对其投资价值构成实质性负面影响。

3、本基金投资的前十名证券 26 南京银行 CD015 的发行主体南京银行股份有限公司于 2025 年 7 月 18 日因监管统计指标计量不准确等受到国家金融监督管理总局江苏监管局处罚（苏金罚决字〔2025〕32 号）。本基金认为，对南京银行股份有限公司的处罚不会对其投资价值构成实质性负面影响。

4、本基金投资的前十名证券 26 厦门国际银行 CD043 的发行主体厦门国际银行股份有限公司于 2026 年 5 月 13 日因未按照规定报告可疑交易等受到中国人民银行厦门市分行处罚（厦门银罚决字〔2026〕1 号）。本基金认为，对厦门国际银行股份有限公司的处罚不会对其投资价值构成实质性负面影响。

5、本基金投资的前十名证券 26 工商银行 CD096 的发行主体中国工商银行股份有限公司于 2025 年 12 月 10 日因违反金融统计相关规定、违反账户管理规定、违反清算管理规定、违反特约商户实名制管理规定、违反反假货币业务管理规定、违反信用信息采集、提供、查询及相关管理

规定、未按规定履行客户身份识别义务、未按规定保存客户身份资料和交易记录、未按规定报送大额交易报告或者可疑交易报告、与身份不明的客户进行交易等受到中国人民银行处罚（银罚决字〔2025〕110 号）；于 2026 年 6 月 5 日因重要信息系统投产变更风险管控不到位、未按规定报告重要信息系统突发事件等受到国家金融监督管理总局处罚。本基金认为，对中国工商银行股份有限公司的处罚不会对其投资价值构成实质性负面影响。

6.9.3 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	163,637.90
2	应收清算款	-
3	应收利息	-
4	应收申购款	2,646.70
5	其他应收款	-
6	待摊费用	-
7	其他	-
8	合计	166,284.60

6.9.4 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。

§7 基金份额持有人信息

7.1 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（%）
大成现金增利货币 A	5,684,591	8,841.55	3,755,197.16	0.01	50,256,818,801.09	99.99
大成现金增利货币 B	26	124,858.57	1,629.67	0.05	3,244,693.14	99.95
合计	5,684,617	8,842.08	3,756,826.83	0.01	50,260,063,494.23	99.99

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。

7.2 期末货币市场基金前十名份额持有人情况

序号	持有人类别	持有份额（份）	占总份额比例（%）
1	个人	21,992,245.96	0.04
2	个人	21,050,226.43	0.04
3	个人	17,034,016.85	0.03
4	个人	16,385,301.70	0.03
5	个人	13,434,589.12	0.03
6	个人	12,929,205.70	0.03
7	个人	12,427,391.47	0.02
8	个人	11,261,026.06	0.02
9	个人	10,310,091.43	0.02
10	个人	9,898,809.35	0.02

7.3 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	大成现金增利货币 A	1,238,336.21	0.0025
	大成现金增利货币 B	-	-
	合计	1,238,336.21	0.0025

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）。

7.4 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	大成现金增利货币 A	0~10
	大成现金增利货币 B	0
	合计	0~10
本基金基金经理持有本开放式基金	大成现金增利货币 A	0
	大成现金增利货币 B	0
	合计	0

§8 开放式基金份额变动

单位：份

项目	大成现金增利货币 A	大成现金增利货币 B
基金合同生效日（2012 年 11 月 20 日）基金份额总额	2,538,753,613.56	2,327,500,035.95
本报告期期初基金份额总额	52,337,777,741.53	5,227,485.51
本报告期基金总申购份额	230,040,302,862.24	23,517.42
减：本报告期基金总赎回份额	232,117,506,605.52	2,004,680.12
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	50,260,573,998.25	3,246,322.81

§9 重大事件揭示

9.1 基金份额持有人大会决议

无。

9.2 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

经大成基金管理有限公司 2026 年第一次临时股东会及公司九届四次监事会审议通过，同意选举郭向东先生为公司第九届监事会股东代表监事，监事会主席，任期自 2026 年 4 月 30 日之日起计算，与公司第九届监事会剩余任期一致。自郭向东先生的监事任职生效之日起，陈勇先生将不再担任公司监事、监事会主席职务。

二、基金托管人的基金托管部门的重大人事变动

无。

9.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内无涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

9.4 基金投资策略的改变

本基金投资策略在本报告期内没有重大改变。

9.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金自基金合同生效日起聘请安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）为本基金提供审计服务至今。

9.6 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况

9.6.1 管理人受调查或处罚等情况

本报告期内，基金管理人无受调查或处罚等情况。

9.6.2 管理人相关从业人员受调查或处罚等情况

本报告期内，基金管理人相关从业人员无受调查或处罚等情况。

9.6.3 托管人受调查或处罚等情况

无。

9.6.4 托管人相关从业人员受调查或处罚等情况

无。

9.7 基金租用或者通过证券公司交易单元进行证券投资的相关情况

9.7.1 基金租用或者通过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(%)	
爱建证券	1	-	-	-	-	-
财通证券	1	-	-	-	-	-
长江证券	1	-	-	-	-	新增 1 个
第一创业	1	-	-	-	-	-
东北证券	1	-	-	-	-	-
东财证券	1	-	-	-	-	-
东方证券	1	-	-	-	-	-
东吴证券	1	-	-	-	-	-
东兴证券	1	-	-	-	-	-
方正证券	1	-	-	-	-	-
高盛中国证券	1	-	-	-	-	-
光大证券	2	-	-	-	-	-
广发证券	2	-	-	-	-	-
国金证券	2	-	-	-	-	-
国盛证券	1	-	-	-	-	-
国泰海通	3	-	-	-	-	-
国投证券	1	-	-	-	-	-
国信证券	1	-	-	-	-	-
红塔证券	1	-	-	-	-	-
华创证券	1	-	-	-	-	-
华泰证券	1	-	-	-	-	-

民生证券	1	-	-	-	-	-
南京证券	1	-	-	-	-	-
平安证券	1	-	-	-	-	-
瑞银证券	2	-	-	-	-	-
山西证券	1	-	-	-	-	-
上海证券	1	-	-	-	-	-
申万宏源	1	-	-	-	-	-
天风证券	1	-	-	-	-	-
万和证券	0	-	-	-	-	退租 1 个
西部证券	1	-	-	-	-	-
信达证券	0	-	-	-	-	退租 1 个
兴业证券	2	-	-	-	-	-
野村东方国际证券	1	-	-	-	-	-
粤开证券	1	-	-	-	-	-
招商证券	2	-	-	-	-	-
浙商证券	1	-	-	-	-	-
中国银河证券	3	-	-	-	-	-
中金公司	2	-	-	-	-	-
中泰证券	2	-	-	-	-	-
中信建投证券	2	-	-	-	-	-
中信证券	3	-	-	-	-	-
中银国际证券	1	-	-	-	-	-

注：本基金采用托管人结算模式，本基金管理人负责选择证券经纪商，租用其交易单元作为本基金的交易单元。证券经纪商的选择标准和流程如下:

（一）筛选标准

大成基金管理有限公司（以下简称“公司”）严格按照《公开募集证券投资基金证券交易费用管理规定》要求制定了证券公司筛选标准，建立了证券公司尽职调查、证券公司负面筛查、备选池筛选机制，选择财务状况良好，经营行为规范，合规风控能力和交易、研究等服务能力较强的证券公司参与证券交易。

（二）筛选流程

1、经公司尽调符合条件的证券公司进入备选池，由股票投委会以公平、公正、公开为原则，结合定性及定量办法科学评估证券公司研究服务能力，形成证券公司白名单，并定期及不定期进行动态调整。

2、公司按照白名单与证券公司进行协议签署。

9.7.2 基金租用或者通过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(%)
东方证券	-	-	1,837,359,000.00	8.90	-	-
光大证券	1,081,395,931.40	54.84	18,811,200,000.00	91.10	-	-
国泰海通	70,058,160.00	3.55	-	-	-	-
招商证券	820,360,200.00	41.60	-	-	-	-

9.8 偏离度绝对值超过 0.5%的情况

无。

9.9 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	大成现金增利货币市场基金(B 类份额)基金产品资料概要更新	中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站	2026 年 06 月 30 日
2	大成现金增利货币市场基金(A 类份额)基金产品资料概要更新	中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站	2026 年 06 月 30 日
3	大成基金管理有限公司关于旗下货币基金在部分销售机构暂停申购、转换转入及定期定额投资业务的公告	中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站	2026 年 05 月 22 日
4	2025 年度公募基金管理人以股东身份（通过公募基金持股）参与股东大会投票信息披露	中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站	2026 年 04 月 30 日
5	大成基金管理有限公司旗下 212 只公募基金 2026 年第 1 季度报告提示性公告	规定报刊	2026 年 04 月 22 日
6	大成现金增利货币市场基金 2026 年第 1 季度报告	中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站	2026 年 04 月 22 日
7	大成现金增利货币市场基金 2025 年	中国证监会基金电子披	2026 年 03 月 31 日

	年度报告	露网站、规定报刊及本公司网站	
8	大成基金管理有限公司旗下 205 只公募基金 2025 年年度报告提示性公告	规定报刊	2026 年 03 月 31 日
9	大成基金管理有限公司旗下公募基金通过证券公司证券交易及佣金支付情况（2025 年度）	中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站	2026 年 03 月 31 日
10	大成基金管理有限公司提醒投资者谨防金融诈骗的公告	中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站	2026 年 02 月 14 日
11	大成基金管理有限公司提醒投资者谨防金融诈骗的公告	中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站	2026 年 01 月 30 日
12	大成现金增利货币市场基金 2025 年第 4 季度报告	中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站	2026 年 01 月 22 日
13	大成基金管理有限公司旗下 205 只公募基金 2025 年第 4 季度报告提示性公告	规定报刊	2026 年 01 月 22 日

§10 影响投资者决策的其他重要信息

10.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

无。

10.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§11 备查文件目录

11.1 备查文件目录

1、中国证监会批准设立大成现金增利货币市场基金的文件；

2、《大成现金增利货币市场基金基金合同》；

3、《大成现金增利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、本报告期内在规定报刊上披露的各种公告原稿。

11.2 存放地点

备查文件存放在本基金管理人和托管人的住所。

11.3 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

2026 年 8 月 28 日