

大成月添利理财债券型证券投资基金
2013 年半年度报告
2013 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：2013 年 8 月 29 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。

基金托管人中国农业银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2013 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 2013 年 1 月 1 日起至 6 月 30 日止。

1.2 目录

§ 1 重要提示及目录	1
1.1 重要提示.....	1
1.2 目录.....	2
§ 2 基金简介	4
2.1 基金基本情况.....	4
2.2 基金产品说明.....	4
2.3 基金管理人和基金托管人.....	4
2.4 信息披露方式.....	5
2.5 其他相关资料.....	5
§ 3 主要财务指标和基金净值表现	5
3.1 主要会计数据和财务指标.....	5
3.2 基金表现.....	5
§ 4 管理人报告	7
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	7
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	8
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	9
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.....	9
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	10
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	10
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	11
§ 5 托管人报告	11
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	11
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.....	11
5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见.....	12
§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）	12
6.1 资产负债表.....	12
6.2 利润表.....	13
6.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	14
6.4 报表附注.....	15
§ 7 投资组合报告	28
7.1 期末基金资产组合情况.....	28
7.2 债券回购融资情况.....	28
7.3 基金投资组合平均剩余期限.....	29
7.4 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	29
7.5 期末按摊余成本占基金资产净值比例大小排名的前十名债券投资明细.....	30
7.6 “影子定价”与“摊余成本法”确定的基金资产净值的偏离.....	30
7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的所有资产支持证券投资明细.....	30
7.8 投资组合报告附注.....	31
§ 8 基金份额持有人信息	31
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	31
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	32
§ 9 开放式基金份额变动	32
§ 10 重大事件揭示	32

10.1 基金份额持有人大会决议.....	32
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.....	33
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	33
10.4 基金投资策略的改变.....	33
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	33
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.....	33
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	33
10.8 偏离度绝对值超过 0.5%的情况.....	35
10.9 其他重大事件.....	35
§ 11 备查文件目录.....	36
11.1 备查文件目录.....	36
11.2 存放地点.....	36
11.3 查阅方式.....	36

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	大成月添利理财债券型证券投资基金	
基金简称	大成月添利理财债券	
基金主代码	090021	
交易代码	090021	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2012 年 9 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	492,930,470.65 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称:	大成月添利债券 A	大成月添利债券 B
下属分级基金的交易代码:	090021	091021
报告期末下属分级基金的份额总额	367,062,171.66 份	125,868,298.99 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	本基金为债券型基金，为证券投资基金中的较低风险品种。本基金的风险和预期收益低于股票型基金、混合型基金，高于货币市场基金。

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	中国农业银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	杜鹏	李芳菲
	联系电话	0755-83183388	010-66060069
	电子邮箱	dupeng@dcfund.com.cn	lifangfei@abchina.com
客户服务电话		4008885558	95599
传真		0755-83199588	010-63201816
注册地址		深圳市福田区深南大道 7088 号招商银行大厦 32 层	北京市东城区建国门内大街 69 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 28 号凯晨世贸中心东座 F9
邮政编码		518040	100031
法定代表人		张树忠	蒋超良

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 28 号凯晨世贸中心东座 F9 中国农业银行托管业务部

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	大成月添利债券 A	大成月添利债券 B
3.1.1 期间数据和指标	报告期(2013 年 1 月 1 日 - 2013 年 6 月 30 日)	报告期(2013 年 1 月 1 日 - 2013 年 6 月 30 日)
本期已实现收益	15,625,014.07	6,415,369.32
本期利润	15,625,014.07	6,415,369.32
本期净值收益率	2.0697%	2.2175%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2013 年 6 月 30 日)	
期末基金资产净值	367,062,171.66	125,868,298.99
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(2013 年 6 月 30 日)	
累计净值收益率	3.1260%	3.3595%

注：1、本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

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

3.2 基金表现

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

大成月添利债券 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
过去一个月	0.2749%	0.0068%	0.1110%	0.0000%	0.1639%	0.0068%

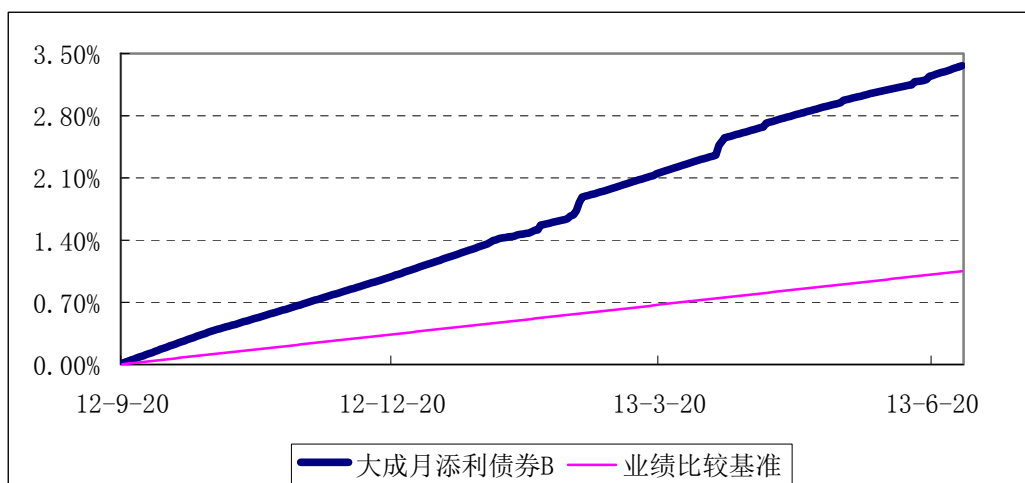
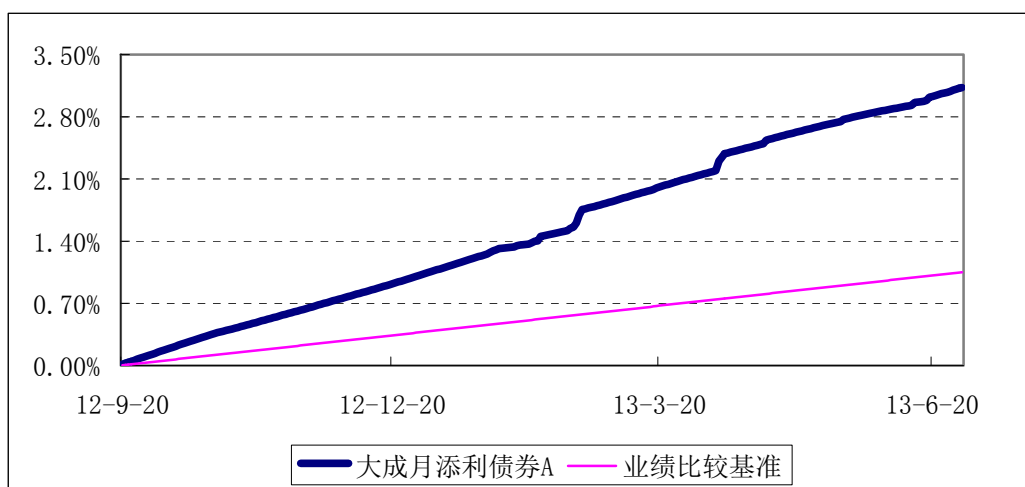
过去三个月	0.9884%	0.0123%	0.3366%	0.0000%	0.6518%	0.0123%
过去六个月	2.0697%	0.0120%	0.6695%	0.0000%	1.4002%	0.0120%
自基金合同生效起至今	3.1260%	0.0096%	1.0504%	0.0000%	2.0756%	0.0096%

大成月添利债券 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
过去一个月	0.2992%	0.0068%	0.1110%	0.0000%	0.1882%	0.0068%
过去三个月	1.0617%	0.0123%	0.3366%	0.0000%	0.7251%	0.0123%
过去六个月	2.2175%	0.0120%	0.6695%	0.0000%	1.5480%	0.0120%
自基金合同生效起至今	3.3595%	0.0096%	1.0504%	0.0000%	2.3091%	0.0096%

注：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，并在运作期末集中支付。

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



注：1、本基金的《基金合同》生效日为 2012 年 9 月 20 日，截至本报告期末，基金成立未满 1 年；
2、按基金合同规定，基金管理人应当自基金合同生效之日起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。截至报告日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 2013 年 6 月 30 日，本基金管理人共管理 2 只封闭式证券投资基金：景宏证券投资基金及景福证券投资基金，3 只 ETF 及 2 只 ETF 联接基金：深证成长 40ETF、大成深证成长 40ETF 联接基金、中证 500 沪市 ETF 及大成中证 500 沪市 ETF 联接基金、大成中证 100ETF，1 只创新型基金：大成景丰分级债券型证券投资基金，1 只 QDII 基金：大成标普 500 等权重指数基金及 28 只开放式证券投资基金：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、大成保本混合型证券投资基金、大成内需增长股票型证券投资基金、大成中证内地消费主题指数证券投资基金、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。

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	本基金基	2012 年 9	-	6 年	中国科学院管理学硕士。曾任职于招

先生	金经理	月 20 日			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 日起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 日起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 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。具有基金从业资格。国籍：中国
王立女士	本基金基金经理	2013 年 2 月 1 日	-	11 年	经济学硕士。曾任职于申银万国证券股份有限公司、南京市商业银行资金营运中心。2005 年 4 月加入大成基金管理有限公司，曾任大成货币市场基金基金经理助理。2007 年 1 月 12 日起担任大成货币市场证券投资基金基金经理。2009 年 5 月 23 日起兼任大成债券投资基金基金经理。2012 年 11 月 20 日起任大成现金增利货币市场基金基金经理。2013 年 2 月 1 日起兼任大成月添利理财债券型证券投资基金基金经理。2013 年 7 月 23 日起任大成景旭纯债债券型证券投资基金基金经理。具有基金从业资格。国籍：中国

注：1、任职日期、离任日期为本基金管理人作出决定之日；

2、证券从业年限的计算标准遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.2 管理人对报告期内本基金运作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》、《大成月添利理财债券型证券投资基金合同》和其他有关法律法规的规定，在基金管理运作中，大成月添利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些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。2013 年上半年公司旗下主动投资组合间股票交易存在 7 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，但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均不超过该股当日成交量 5%；投资组合间不存在债券同日反向交易。投资组合间相邻交易日反向交易的市场成交比例、成交均价等交易结果数据表明该类交易不对市场产生重大影响，无异常；投资组合间虽然存在同向交易行为，但结合交易价差分布统计分析和潜在利益输送金额统计结果表明投资组合间不存在利益输送的可能性。

4.4 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

2013 年上半年，经济增长持续低于预期，上半年 GDP 同比仅增长 7.6%。通胀水平温和可控，上半年 CPI 同比增长 2.4%，宏观环境呈现低增长、低通胀的态势。但货币市场出现较大波动。一季度外汇占款大幅增长带来流动性超预期宽松，各类货币市场利率出现不同程度的下行。二季度政策转向防风险，多部委联合发文抑制热钱流入和金融套利，叠加季节性因素，使得 6 月份资金面出现异常紧张。1 个月 shibor 利率最高超过 9%，市场陷入恐慌，货币市场利率收益率上行的幅度和速度创历史之最。上半年来看，7 天回购利率均值为 3.87%，其中 1 至 5 月均值基本在 3.5% 以下，但 6 月份均值达到 6.9%。1 年期金融债上行 70 个基点，各评级短融上行 60 个基点。

上半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。在实际操作中，上半年本基金看重银行存款和短期融资券的投资价值，同时根据对资金面的判断，保持了较低的组合剩余期限，在半年末较大赎回压力的影响下，仍较好的控制了估值偏离风险，并把握关键时点，进行了部分较高收益的存款投资。短期融资券仍是第二季度的重点投资债券品种之一，尤其是在 6 月底，收益率达 5.5% 以上的中高等级短期融资券已具备较好的配置价值。

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 2.0697%，B 类净值收益率 2.2175%，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，政治局会议传递出更多稳增长的信息，但具体出什么样的政策，以及政策推出的时点和力度尚待观察。通胀同比预计将温和走高，但幅度可控。货币政策可能继续维持中性态度，在外汇占款减少的情况下，预计央行在三季度主要通过公开市场正逆回购来调节银行间流动性。到了四季度，随着 M2 逐步回落至央行目标值附近，加上美联储有可能退出 QE，而同时公开市场到期量较少，央行有可能加大逆回购操作的力度，甚至不排除降准的可能。

本基金在下半年将密切关注金融市场的变化，在稳健操作的原则下，高度重视组合的流动性管理和安全性管理。基于市场基本面和资金面以及投资人结构变化的判断，本基金将继续保持投资组合的流动性，严格控制利率风险和流动性风险。在具体投资品种上，本基金投资仍将以存款、央票、金融债、短期融资券和浮动利率债券为主。本基金认为目前金融债和短融绝对收益率已超过历史 3/4 分位数，随着资金面的逐步好转，均具备较强配置价值。在个券选择上，本基金将在信用基本面深入分析的基础上，以信用风险可控、流动性较好的中高等级的短融为主。并根据货币市场利率变化，把握关键时点，适时加大存款类投资。

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 22,040,383.39 元，报告期内已分配利润 22,040,383.39 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

在托管大成月添利理财债券型证券投资基金的过程中，本基金托管人—中国农业银行股份有限公司严格遵守《证券投资基金法》相关法律法规的规定以及《大成月添利理财债券型证券投资基金基金合同》、《大成月添利理财债券型证券投资基金托管协议》的约定，对大成月添利理财债券型证券投资基金管理人—大成基金管理有限公司 2013 年 1 月 1 日至 2013 年 6 月 30 日基金的投资运作，进行了认真、独立的会计核算和必要的投资监督，认真履行了托管人的义务，没有从事任何损害基金份额持有人利益的行为。

5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

本托管人认为，大成基金管理有限公司在大成月添利理财债券型证券投资基金的投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支及利润分配等问题上，不存

在损害基金份额持有人利益的行为；在报告期内，严格遵守了《证券投资基金法》等有关法律法规，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

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

本托管人认为，大成基金管理有限公司的信息披露事务符合《证券投资基金信息披露管理办法》及其他相关法律法规的规定，基金管理人所编制和披露的大成月添利理财债券型证券投资基金半年度报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告等信息真实、准确、完整，未发现有关损害基金持有人利益的行为。

§ 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：大成月添利理财债券型证券投资基金

报告截止日：2013 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2013 年 6 月 30 日	上年度末 2012 年 12 月 31 日
资产：			
银行存款	6.4.3.1	119,678,470.52	1,432,266,952.32
结算备付金		254,090.91	-
存出保证金		-	-
交易性金融资产	6.4.3.2	530,601,784.61	940,496,118.27
其中：股票投资		-	-
基金投资		-	-
债券投资		530,601,784.61	940,496,118.27
资产支持证券投资		-	-
衍生金融资产	6.4.3.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.3.4	-	753,677,090.52
应收证券清算款		-	-
应收利息	6.4.3.5	13,306,833.36	20,074,440.20
应收股利		-	-
应收申购款		205,500.00	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.3.6	-	-
资产总计		664,046,679.40	3,146,514,601.31
负债和所有者权益	附注号	本期末 2013 年 6 月 30 日	上年度末 2012 年 12 月 31 日
负债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.3.3	-	-
卖出回购金融资产款		169,489,310.76	313,839,443.08

应付证券清算款		-	-
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		159,376.67	765,846.63
应付托管费		47,222.73	226,917.53
应付销售服务费		125,566.59	574,599.49
应付交易费用	6.4.3.7	30,727.64	37,552.63
应交税费		-	-
应付利息		308,473.31	33,328.89
应付利润		729,338.57	4,804,883.88
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.3.8	226,192.48	113,000.00
负债合计		171,116,208.75	320,395,572.13
所有者权益：			
实收基金	6.4.3.9	492,930,470.65	2,826,119,029.18
未分配利润	6.4.3.10	-	-
所有者权益合计		492,930,470.65	2,826,119,029.18
负债和所有者权益总计		664,046,679.40	3,146,514,601.31

注：报告截止日 2013 年 6 月 30 日，基金份额净值 1.000 元，基金份额总额 492,930,470.65 份，其中 A 类基金份额的份额总额为 367,062,171.66 份，B 类基金份额的份额总额为 125,868,298.99 份。

6.2 利润表

会计主体：大成月添利理财债券型证券投资基金

本报告期：2013 年 1 月 1 日至 2013 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
		2013 年 1 月 1 日至 2013 年 6 月 30 日	2012 年 1 月 1 日至 2012 年 6 月 30 日
一、收入		28,851,304.16	-
1. 利息收入		25,565,011.29	-
其中：存款利息收入	6.4.3.11	10,700,126.75	-
债券利息收入		12,779,717.08	-
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		2,085,167.46	-
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		3,286,292.87	-
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	3,286,292.87	-
资产支持证券投资收益		-	-
衍生工具收益	6.4.3.14	-	-
股利收益	6.4.3.15	-	-

3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.3.16	-	-
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.3.17	-	-
减：二、费用		6,810,920.77	-
1. 管理人报酬	6.4.6.2.1	1,460,261.77	-
2. 托管费	6.4.6.2.2	432,670.15	-
3. 销售服务费		1,175,883.27	-
4. 交易费用	6.4.3.18	-	-
5. 利息支出		3,451,299.84	-
其中：卖出回购金融资产支出		3,451,299.84	-
6. 其他费用	6.4.3.19	290,805.74	-
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		22,040,383.39	-
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		22,040,383.39	-

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：大成月添利理财债券型证券投资基金

本报告期：2013 年 1 月 1 日至 2013 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 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）	2,826,119,029.18	-	2,826,119,029.18
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	22,040,383.39	22,040,383.39
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）	-2,333,188,558.53	-	-2,333,188,558.53
其中：1. 基金申购款	1,842,495,060.56	-	1,842,495,060.56
2. 基金赎回款	-4,175,683,619.09	-	-4,175,683,619.09
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基	-	-22,040,383.39	-22,040,383.39

金净值变动（净值减少以“-”号填列）			
五、期末所有者权益（基金净值）	492,930,470.65	-	492,930,470.65
项目	上年度可比期间 2012年1月1日至2012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）	-	-	-
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-	-
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）	-	-	-
其中：1. 基金申购款	-	-	-
2. 基金赎回款	-	-	-
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）	-	-	-
五、期末所有者权益（基金净值）	-	-	-

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：

王颢

刘彩晖

范瑛

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[2005]102号《关于股息红利个人所得税有关政策的通知》、财税[2005]107号《关于股息红利有关个人所得税政策的补充通

知》、财税[2008]1号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[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》及其他相关税务法规和实务操作，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) 基金买卖股票、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。2013 年 1 月 1 日以前，对基金取得的股票的股息、红利收入，由上市公司在向基金派发股息、红利时暂减按 50% 计入个人应纳税所得额，依照现行税法规定即 20% 代扣代缴个人所得税，暂不征收企业所得税。自 2013 年 1 月 1 日起，对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。
- (4) 基金卖出股票按 0.1% 的税率缴纳股票交易印花税，买入股票不征收股票交易印花税。

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 2013 年 6 月 30 日
活期存款	1,678,470.52
定期存款	-
其中：存款期限 1-3 个月	-
其他存款	118,000,000.00
合计	119,678,470.52

6.4.3.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2013 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	-	-	-
	银行间市场	530,601,784.61	530,987,000.00	385,215.39 0.0781%

合计	530,601,784.61	530,987,000.00	385,215.39	0.0781%
----	----------------	----------------	------------	---------

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工具。

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

本基金本报告期末未持有买入返售金融资产。

6.4.3.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末未持有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 2013年6月30日
应收活期存款利息	880.95
应收定期存款利息	-
应收其他存款利息	368,658.38
应收结算备付金利息	114.30
应收债券利息	12,937,179.73
应收买入返售证券利息	-
应收申购款利息	-
其他	-
合计	13,306,833.36

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 2013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	30,727.64
合计	30,727.64

6.4.3.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2013年6月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	-
应付其他	2,000.00
预提费用	224,192.48
合计	226,192.48

6.4.3.9 实收基金

金额单位：人民币元

大成月添利债券 A		
项目	本期 2013年1月1日至2013年6月30日	
	基金份额(份)	账面金额
上年度末	1,883,705,402.80	1,883,705,402.80
本期申购	1,190,813,558.78	1,190,813,558.78
本期赎回(以“-”号填列)	-2,707,456,789.92	-2,707,456,789.92
本期末	367,062,171.66	367,062,171.66

金额单位：人民币元

大成月添利债券 B		
项目	本期 2013年1月1日至2013年6月30日	
	基金份额(份)	账面金额
上年度末	942,413,626.38	942,413,626.38
本期申购	651,681,501.78	651,681,501.78
本期赎回(以“-”号填列)	-1,468,226,829.17	-1,468,226,829.17
本期末	125,868,298.99	125,868,298.99

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

大成月添利债券 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	15,625,014.07	-	15,625,014.07
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	-15,625,014.07	-	-15,625,014.07
本期末	-	-	-

单位：人民币元

大成月添利债券 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	6,415,369.32	-	6,415,369.32
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	-6,415,369.32	-	-6,415,369.32
本期末	-	-	-

6.4.3.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2013年1月1日至2013年6月30日
活期存款利息收入	43,056.86
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	10,655,473.93
结算备付金利息收入	1,595.96
其他	-
合计	10,700,126.75

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 2013年1月1日至2013年6月30日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	1,057,251,048.16
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	1,030,646,821.03
减：应收利息总额	23,317,934.26
债券投资收益	3,286,292.87

6.4.3.14 衍生工具收益

本报告期内本基金无衍生工具收益。

6.4.3.15 股利收益

本报告期内本基金无股利收益。

6.4.3.16 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。

6.4.3.17 其他收入

本报告期内本基金无其他收入。

6.4.3.18 交易费用

本报告期内本基金无交易费用。

6.4.3.19 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2013年1月1日至2013年6月30日
审计费用	66,448.72
信息披露费	148,767.52
上清所债券帐户维护费	13,488.12
银行汇划费用	47,413.26
银行间债券帐户维护费	13,488.12
其他	1,200.00
合计	290,805.74

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**

无。

6.4.4.2 资产负债表日后事项

无。

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
中国农业银行股份有限公司（“中国农业银行”）	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
--------------------	----------

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

本报告期内本基金无通过关联方交易单元进行的交易。

6.4.6.1 通过关联方交易单元进行的交易

无。

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
	2013 年 1 月 1 日至 2013 年 6 月 30 日	2012 年 1 月 1 日至 2012 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	1,460,261.77	-
其中：支付销售机构的客户维护费	518,322.23	-

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
	2013 年 1 月 1 日至 2013 年 6 月 30 日	2012 年 1 月 1 日至 2012 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	432,670.15	-

注：支付基金托管人中国农业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

获得销售服务费的各关联方名称	本期			上年度可比期间		
	2013 年 1 月 1 日至 2013 年 6 月 30 日			2012 年 1 月 1 日至 2012 年 6 月 30 日		
	A 类	B 类	合计	A 类	B 类	合计

大成基金	20,033.41	3,463.82	23,497.23	-	-	-
中国农业银行	1,133,747.65	9,844.62	1,143,592.27	-	-	-
合计	1,153,781.06	13,308.44	1,167,089.50	-	-	-

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：

日销售服务费 = 前一日基金资产净值 × 约定年费率 / 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 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
中国农业银行	-	20,987,383.56	-	-	42,570,000.00	3,775.57
上年度可比期间 2012 年 1 月 1 日至 2012 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	-	-	-	-	-	-

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

本报告期内本基金未发生基金管理人运用固有资金投资本基金的情况。

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

本报告期内本基金未发生除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况。

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 2013 年 1 月 1 日至 2013 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2012 年 1 月 1 日至 2012 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	1,678,470.52	43,056.86	-	-

注：本基金的银行存款由基金托管人中国农业银行保管，按约定利率计息。

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

大成月添利债券 A

单位：人民币元

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
9,603,418.34	8,535,204.89	-2,513,609.16	15,625,014.07	-

大成月添利债券 B

单位：人民币元

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
2,820,447.88	5,156,857.59	-1,561,936.15	6,415,369.32	-

6.4.8 期末（2013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

于本报告期末，本基金未持有因认购新发或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

于本报告期末，本基金未持有暂时停牌等流通受限股票。

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，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 169,489,310.76 元，是以如下债券作为质押：

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
041354011	13 亿利 CP001	2013-07-01	100.00	50,000	5,000,133.55
120228	12 国开 28	2013-07-03	99.99	300,000	29,997,155.96
041258055	12 万里扬 CP001	2013-07-04	100.06	150,000	15,008,254.34
041253066	12 杭锅炉 CP001	2013-07-04	100.46	200,000	20,092,177.38
041258050	12 福耀 CP003	2013-07-04	100.00	200,000	19,999,852.24
041352022	13 正泰 CP001	2013-07-04	99.64	200,000	19,927,643.19
041358024	13 旭阳化工 CP001	2013-07-04	99.84	200,000	19,967,853.72
041258060	12 魏桥 CP002B	2013-07-04	100.11	400,000	40,045,048.43
合计				1,700,000	170,038,118.81

6.4.8.3.2 交易所市场债券正回购

于本报告期末，本基金无从事交易所市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

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

本基金为债券型基金，属于较低风险品种。本基金投资的金融工具主要为存款和债券投资等。本基金在日常经营活动中面临的与这些金融工具相关的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。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“风险收益水平高于货币市场基金而低于混合基金和股票基金，追求高于业绩比较基准的稳定收益”的投资目标。

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。

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农业银行，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上海银行股份有限公司、中国建设银行股份有限公司、中国民生银行股份有限公司、兴业银行股份有限公司以及中国光大银行股份有限公司，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。

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 2013年6月30日	上年度末 2012年12月31日
A-1	460,602,361.90	730,917,266.02
A-1 以下	-	-
未评级	69,999,422.71	169,720,572.23
合计	530,601,784.61	900,637,838.25

注：上述债券信用未评级包括一年内到期的政策性金融债券。

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 2013年6月30日	上年度末 2012年12月31日
AAA	-	-
AAA 以下	-	-
未评级	-	39,858,280.02
合计	-	39,858,280.02

注：上述债券信用未评级包括政策性金融债券。

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通过独立的风险管理部门设定流动性比例要求，对流动性指标进行持续的监测和分析，包括组合持仓集中度指标、组合在短时间内变

现能力的综合指标、组合中变现能力较差的投资品种比例以及流通受限制的投资品种比例等。本基金投资于同一公司发行的短期企业债券及短期融资券的比例合计不得超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金的基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司发行的证券不得超过该证券的 10%。本基金所持大部分证券在银行间同业市场交易，其余亦可在证券交易所交易，均能以合理价格适时变现。此外，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投资的公允价值。

于 2013 年 6 月 30 日，除卖出回购金融资产款余额 169,489,310.76 元将在一个月内到期且计息（该利息金额不重大）外，本基金所承担的其他金融负债的合同约定到期日均为一个月以内且不计息，因此账面余额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 2013 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					
银行存款	119,678,470.52	-	-	-	119,678,470.52
结算备付金	254,090.91	-	-	-	254,090.91
交易性金融资产	430,829,979.24	99,771,805.37	-	-	530,601,784.61
应收利息	-	-	-	13,306,833.36	13,306,833.36
应收申购款	-	-	-	205,500.00	205,500.00
资产总计	550,762,540.67	99,771,805.37	-	13,512,333.36	664,046,679.40
负债					
卖出回购金融资	169,489,310.76	-	-	-	169,489,310.76

产款					
应付管理人报酬				159,376.67	159,376.67
应付托管费				47,222.73	47,222.73
应付销售服务费				125,566.59	125,566.59
应付交易费用				30,727.64	30,727.64
应付利息				308,473.31	308,473.31
应付利润				729,338.57	729,338.57
其他负债				226,192.48	226,192.48
负债总计	169,489,310.76			1,626,897.99	171,116,208.75
利率敏感度缺口	381,273,229.91	99,771,805.37		11,885,435.37	492,930,470.65
上年度末 2012 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					
银行存款	1,432,266,952.32				1,432,266,952.32
交易性金融资产	160,365,573.16	780,130,545.11			940,496,118.27
买入返售金融资产	753,677,090.52				753,677,090.52
应收利息				20,074,440.20	20,074,440.20
资产总计	2,346,309,616.00	780,130,545.11		20,074,440.20	3,146,514,601.31
负债					
卖出回购金融资产款	313,839,443.08				313,839,443.08
应付管理人报酬				765,846.63	765,846.63
应付托管费				226,917.53	226,917.53
应付销售服务费				574,599.49	574,599.49
应付交易费用				37,552.63	37,552.63
应付利息				33,328.89	33,328.89
应付利润				4,804,883.88	4,804,883.88
其他负债				113,000.00	113,000.00
负债总计	313,839,443.08			6,556,129.05	320,395,572.13
利率敏感度缺口	2,032,470,172.92	780,130,545.11		13,518,311.15	2,826,119,029.18

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

6.4.9.4.1.2 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：人民币万元）	
		本期末（2013 年 6 月 30 日）	上年度末（2012 年 12 月 31 日）
	1. 市场利率下降 25 个基点	增加约 56.42	增加约 148

	2. 市场利率上升 25 个基点	下降约 56.27	下降约 148
--	------------------	-----------	---------

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，因此无重大市场价格风险。

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	530,601,784.61	79.90
	其中：债券	530,601,784.61	79.90
	资产支持证券	-	0.00
2	买入返售金融资产	-	0.00
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	0.00
3	银行存款和结算备付金合计	119,932,561.43	18.06
4	其他各项资产	13,512,333.36	2.03
5	合计	664,046,679.40	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	21.41	
	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	169,489,310.76	34.38
	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	110
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	145
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	74

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 150 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	28.39	34.38
	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	4.06	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	44.72	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	34.57	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)	20.24	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	131.97	34.38

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	50,001,879.32	10.14
	其中：政策性金融债	50,001,879.32	10.14
4	企业债券	-	0.00
5	企业短期融资券	480,599,905.29	97.50
6	中期票据	-	0.00
7	其他	-	0.00
8	合计	530,601,784.61	107.64
9	剩余存续期超过 397 天的浮动利率债券	-	0.00

7.5 期末按摊余成本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)	摊余成本	占基金资产净值比例 (%)
1	041258053	12 荣盛 CP002	400,000	40,200,508.07	8.16
2	041258060	12 魏桥 CP002B	400,000	40,045,048.43	8.12
3	041258050	12 福耀 CP003	400,000	39,999,704.48	8.11
4	041252041	12 公控 CP001	300,000	30,172,248.48	6.12
5	041254052	12 南玻 CP001	300,000	30,146,519.15	6.12
6	041259067	12 苏汇鸿 CP001	300,000	30,067,892.27	6.10
7	041256030	12 开滦 CP001	300,000	30,004,767.65	6.09
8	120228	12 国开 28	300,000	29,997,155.96	6.09
9	041352005	13 西王 CP001	300,000	29,994,506.94	6.08
10	041251041	12 沙钢 CP002	300,000	29,979,043.93	6.08

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	88
报告期内偏离度的最高值	0.4740%
报告期内偏离度的最低值	-0.2188%
报告期内每个交易日偏离度的绝对值的简单平均值	0.3006%

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名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 1.00 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	13,306,833.36
4	应收申购款	205,500.00
5	其他应收款	-
6	待摊费用	-
7	其他	-
8	合计	13,512,333.36

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
大成月添利 A	4,195	87,499.92	1,196,731.17	0.33%	365,865,440.49	99.67%
大成月添利 B	10	12,586,829.90	71,184,114.49	56.55%	54,684,184.50	43.45%
合计	4,205	117,224.84	72,380,845.66	14.68%	420,549,624.99	85.32%

注:1、下属分级基金份额比例的分母采用各自级别的份额,合计数比例的分母采用各分级基金份额的合计数。

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	大成月添利 A	130,668.64	0.04%
	大成月添利 B	-	-
	合计	130,668.64	0.03%

注：1、下属分级基金份额比例的分母采用各自级别的份额，合计数比例的分母采用各分级基金份额的合计数。

2、本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有该只基金份额总量的数量区间:0;

3、该只基金的基金经理持有该只基金份额总量的数量区间:0。

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

	大成月添利债券 A	大成月添利债券 B
基金合同生效日（2012 年 9 月 20 日）基金份额总额	3,635,402,926.26	1,483,121,163.45
本报告期期初基金份额总额	1,883,705,402.80	942,413,626.38
本报告期基金总申购份额	1,190,813,558.78	651,681,501.78
减：本报告期基金总赎回份额	2,707,456,789.92	1,468,226,829.17
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期末基金份额总额	367,062,171.66	125,868,298.99

注：基金合同生效日为 2012 年 9 月 20 日，红利再投资作为本期申购资金的来源，统一计入本期总申购份额，不单独列示。

依据《大成月添利理财债券型证券投资基金招募说明书》规定，本基金分设两级基金份额，A 级基金份额和 B 级基金份额。A 级基金份额针对在单个基金账户保留份额在 500 万以下的持有人，B 级基金份额针对在单个基金账户保留份额在 500 万以上(含 500 万)的持有人。若 A 级基金份额持有人在单个基金账户保留的基金份额超过 500 万份时，本基金的注册登记机构自动将其在该基金账户持有的 A 级基金份额升级为 B 级基金份额；若 B 级基金份额持有人在单个基金账户保留的基金份额低于 500 万份时，本基金的注册登记机构自动将其在该基金账户持有的 B 级基金份额转为 A 级基金份额。上述申购赎回份额中包含了 A 级与 B 级之间调增和调减份额。

§ 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

本报告期本基金的基金管理人、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

本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。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	1	-	0.00%	-	0.00%	-
长城证券	2	-	0.00%	-	0.00%	-
东北证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
方正证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
高华证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
光大证券	2	-	0.00%	-	0.00%	-
广发证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
国金证券	2	-	0.00%	-	0.00%	-
国盛证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
国泰君安	2	-	0.00%	-	0.00%	-
国信证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
海通证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-

红塔证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
宏源证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
华创证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
华泰证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
民生证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
南京证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
平安证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
齐鲁证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
瑞银证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
上海证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
申银万国	1	-	0.00%	-	0.00%	-
世纪证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
天风证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
西部证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
兴业证券	2	-	0.00%	-	0.00%	-
银河证券	4	-	0.00%	-	0.00%	-
英大证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
招商证券	3	-	0.00%	-	0.00%	-
浙商证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
中金公司	2	-	0.00%	-	0.00%	-
中信建投	3	-	0.00%	-	0.00%	-
中信证券	2	-	0.00%	-	0.00%	-
中银国际	2	-	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。

本报告期内增加基金交易单元：银河证券，无退租交易单元。

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
招商证券	-	0.00%	216,800,000.00	100.00%	-	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	大成月添利理财债券型证券投资基金 2012 年第 4 季度报告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2013-1-19
2	大成月添利理财债券型证券投资基金增聘基金经理公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2013-2-4
3	关于大成月添利理财债券型证券投资基金“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	2013-2-5
4	关于全面启用综合对帐服务方式的公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2013-3-19
5	大成月添利理财债券型证券投资基金 2012 年年度报告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2013-3-26
6	大成月添利理财债券型证券投资基金 2012 年年度报告摘要	中国证监会指定报刊及本公司网站	2013-3-26
7	关于大成月添利理财债券型证券投资基金“清明节”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	2013-3-29
8	关于大成月添利理财债券型证券投资基金在招商银行股份有限公司代销系统开通申购业务的公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2013-4-16
9	大成月添利理财债券型证券投资基金 2013 年第 1 季度报告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2013-4-22
10	关于大成月添利理财债券型证券投资基金“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	2013-4-23
11	大成基金管理有限公司关于港澳台居民投资旗下基金开立证券投资基金账户的公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2013-4-25
12	大成月添利理财债券型证券投资基金更新招募说明书摘要（2013 年第 1 期）	中国证监会指定报刊及本公司网站	2013-5-4
13	大成月添利理财债券型证券投资基金更新招募说明书（2013 年第 1 期）	中国证监会指定报刊及本公司网站	2013-5-4
14	大成基金管理有限公司开通支付宝网上直	中国证监会指定报	2013-5-21

	销交易的公告	刊及本公司网站	
15	关于大成月添利理财债券型证券投资基金“端午节”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	2013-6-4

§ 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月添利理财债券型证券投资基金的文件；
- 2、《大成月添利理财债券型证券投资基金基金合同》；
- 3、《大成月添利理财债券型证券投资基金托管协议》；
- 4、大成基金管理有限公司批准文件、营业执照、公司章程；
- 5、本报告期内在指定报刊上披露的各种公告原稿。

11.2 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。

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
2013 年 8 月 29 日