

大成月添利理财债券型证券投资基金

[2013] 第三季度报告

基金管理人:大成基金管理有限公司

基金托管人:中国建设银行股份有限公司

报告送出日期:2013年10月23日

重要提示:基金管理人和基金托管人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、完整性、及时性承担个别及连带责任。

基金管理人的董事会及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、完整性、及时性承担个别及连带责任。

基金托管人和基金管理人根据本基金合同约定,于2013年10月18日复核了本报告中的财务指标、净值表现、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招募说明书。

报告期期末至报告期期末未发生基金。

报告期期限:2013年7月1日起至9月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称:大成月添利理财债券

交易代码:090021

基金运作方式:契约型开放式

基金合同生效日:2010年9月20日

报告期期末基金份额总额:840,196,566.28份

投资目标:本基金为债券基金,以本基金的安全性和适当流动性为首要目标,追求或侧重于债券基金的稳定性。

投资策略:本基金通过平均剩余期限管理、配置策略、品种选择和其衍生投资策略四个层次进行投资管理,以实现投资目标和投资策略。

业绩比较基准:七天通知存款利率(税后)。

风险收益特征:本基金为债券基金,为证券投资基金中的较低风险品种。本基金的预期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。

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

下属两级基金的基金简称:大成月添利债券A

下属两级基金的交易代码:090021 091021

报告期期限:下属两级基金的份额总额:299,164,770.74份 241,031,795.54份

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

报告期(2013年7月1日-2013年9月30日)

大成月添利债券A 大成月添利债券B

1.本期已实现收益 4,155,348.93 2,263,490.29

2.本期利润 4,155,348.93 2,263,490.29

3.期初基金份额净值 299,164,770.74 241,031,795.54

注:本期已实现收益指基金本期利润减去累计已实现的前期收益,因此,本期利润已实现收益和本期利润相等。

3.2 基金净值表现

3.2.1 本期基金份额净值增长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

净值收益率 1.3094% 0.0114%

① ② ③ ④

过去三个月 0.0114% 0.0403% 0.0000% 0.0961% 0.0114%

大成月添利债券B

净值收益率 1.3835% 0.0114%

① ② ③ ④

过去三个月 0.0114% 0.0403% 0.0000% 0.1043% 0.0114%

注:本基金根据货币基金收益情况,以基金净值收益为基准,为投资者每日计算当日收益并分配,并在运作期未集中支付。

3.2.2 基金合同生效以来基金累计净值收益率变动与其同期业绩比较基准收益率变动的比较

大成月添利债券A

净值收益率 1.3094% 0.0114%

① ② ③ ④

过去三个月 0.0114% 0.0403% 0.0000% 0.0961% 0.0114%

大成月添利债券B

净值收益率 1.3835% 0.0114%

① ② ③ ④

过去三个月 0.0114% 0.0403% 0.0000% 0.1043% 0.0114%

注:本基金根据货币基金收益情况,以基金净值收益为基准,为投资者每日计算当日收益并分配,并在运作期未集中支付。

3.2.3 基金合同生效以来基金累计净值收益率变动与其同期业绩比较基准收益率变动的比较

大成月添利债券A

净值收益率 1.3094% 0.0114%

① ② ③ ④

过去三个月 0.0114% 0.0403% 0.0000% 0.0961% 0.0114%

大成月添利债券B

净值收益率 1.3835% 0.0114%

① ② ③ ④

过去三个月 0.0114% 0.0403% 0.0000% 0.1043% 0.0114%

注:本基金根据货币基金收益情况,以基金净值收益为基准,为投资者每日计算当日收益并分配,并在运作期未集中支付。

3.2.4 基金合同生效以来基金累计净值收益率变动与其同期业绩比较基准收益率变动的比较

大成月添利债券A

净值收益率 1.3094% 0.0114%

① ② ③ ④

过去三个月 0.0114% 0.0403% 0.0000% 0.0961% 0.0114%

大成月添利债券B

净值收益率 1.3835% 0.0114%

① ② ③ ④

过去三个月 0.0114% 0.0403% 0.0000% 0.1043% 0.0114%

注:本基金根据货币基金收益情况,以基金净值收益为基准,为投资者每日计算当日收益并分配,并在运作期未集中支付。

3.2.5 基金合同生效以来基金累计净值收益率变动与其同期业绩比较基准收益率变动的比较

大成月添利债券A

净值收益率 1.3094% 0.0114%

① ② ③ ④

过去三个月 0.0114% 0.0403% 0.0000% 0.0961% 0.0114%

大成月添利债券B

净值收益率 1.3835% 0.0114%

① ② ③ ④

过去三个月 0.0114% 0.0403% 0.0000% 0.1043% 0.0114%

注:本基金根据货币基金收益情况,以基金净值收益为基准,为投资者每日计算当日收益并分配,并在运作期未集中支付。

3.2.6 基金合同生效以来基金累计净值收益率变动与其同期业绩比较基准收益率变动的比较

大成月添利债券A

净值收益率 1.3094% 0.0114%

① ② ③ ④

过去三个月 0.0114% 0.0403% 0.0000% 0.0961% 0.0114%

大成月添利债券B

净值收益率 1.3835% 0.0114%

① ② ③ ④

过去三个月 0.0114% 0.0403% 0.0000% 0.1043% 0.0114%

注:本基金根据货币基金收益情况,以基金净值收益为基准,为投资者每日计算当日收益并分配,并在运作期未集中支付。

3.2.7 基金合同生效以来基金累计净值收益率变动与其同期业绩比较基准收益率变动的比较

大成月添利债券A

净值收益率 1.3094% 0.0114%

① ② ③ ④

过去三个月 0.0114% 0.0403% 0.0000% 0.0961% 0.0114%

大成月添利债券B

净值收益率 1.3835% 0.0114%

① ② ③ ④

过去三个月 0.0114% 0.0403% 0.0000% 0.1043% 0.0114%

注:本基金根据货币基金收益情况,以基金净值收益为基准,为投资者每日计算当日收益并分配,并在运作期未集中支付。

3.2.8 基金合同生效以来基金累计净值收益率变动与其同期业绩比较基准收益率变动的比较

大成月添利债券A

净值收益率 1.3094% 0.0114%

① ② ③ ④

过去三个月 0.0114% 0.0403% 0.0000% 0.0961% 0.0114%

大成月添利债券B

净值收益率 1.3835% 0.0114%

① ② ③ ④

过去三个月 0.0114% 0.0403% 0.0000% 0.1043% 0.0114%

注:本基金根据货币基金收益情况,以基金净值收益为基准,为投资者每日计算当日收益并分配,并在运作期未集中支付。

3.2.9 基金合同生效以来基金累计净值收益率变动与其同期业绩比较基准收益率变动的比较

大成月添利债券A

净值收益率 1.3094% 0.0114%

① ② ③ ④

过去三个月 0.0114% 0.0403% 0.0000% 0.0961% 0.0114%

大成月添利债券B

净值收益率 1.3835% 0.0114%

① ② ③ ④

过去三个月 0.0114% 0.0403% 0.0000% 0.1043% 0.0114%

注:本基金根据货币基金收益情况,以基金净值收益为基准,为投资者每日计算当日收益并分配,并在运作期未集中支付。

3.2.10 基金合同生效以来基金累计净值收益率变动与其同期业绩比较基准收益率变动的比较

大成月添利债券A

净值收益率 1.3094% 0.0114%

① ② ③ ④

过去三个月 0.0114% 0.0403% 0.0000% 0.0961% 0.0114%

大成月添利债券B

净值收益率 1.3835% 0.0114%

① ② ③ ④

过去三个月 0.0114% 0.0403% 0.0000% 0.1043% 0.0114%

注:本基金根据货币基金收益情况,以基金净值收益为基准,为投资者每日计算当日收益并分配,并在运作期未集中支付。

3.2.11 基金合同生效以来基金累计净值收益率变动与其同期业绩比较基准收益率变动的比较

大成月添利债券A

净值收益率 1.3094% 0.0114%

① ② ③ ④

过去三个月 0.0114% 0.0403% 0.0000% 0.0961% 0.0114%

大成月添利债券B

净值收益率 1.3835% 0.0114%

① ② ③ ④

过去三个月 0.0114% 0.0403% 0.0000% 0.1043% 0.0114%

注:本基金根据货币基金收益情况,以基金净值收益为基准,为投资者每日计算当日收益并分配,并在运作期未集中支付。

3.2.12 基金合同生效以来基金累计净值增长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

净值增长率① 1.87% 10.4%

② ③ ④

过去三个月 1.87% 11.32% 6.515.94%

大成月添利债券B

净值增长率① 193.565.865.50

② ③ ④

过去三个月 1.819%

注:本期已实现收益指本期利润减去累计已实现的前期收益,本期利润已实现收益和本期利润相等。

3.2.13 基金合同生效以来基金累计净值增长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

净值增长率