大成月添利理财债券型证券投资基金

【2013】年度报告摘要

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:2014年3月29日

§1 重要提示

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2014年3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。

本报告中财务资料已经审计。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2013年1月1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	3,648,815,947.06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	2,531,034,772.54份	1,117,781,174.52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

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28号凯晨世贸中心东座F9中国农业银行托管业务部

§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	2013年		2012年9月20日(基金合同生效日)-2012年12月31日	
基金级别	大成月添利债券A	大成月添利债券B	大成月添利债券A	大成月添利债券B
本期已实现收益	36,091,232.22	16,363,768.58	28,084,101.80	16,696,347.89
本期利润	36,091,232.22	16,363,768.58	28,084,101.80	16,696,347.89
本期净值收益率	4.7613%	5.0643%	1.0351%	1.1175%
3.1.2 期末数据和指标	2013年末		2012年末	
期末基金资产净值	2,531,034,772.54	1,117,781,174.52	1,883,705,402.80	942,413,626.38
期末基金份额净值	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。
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

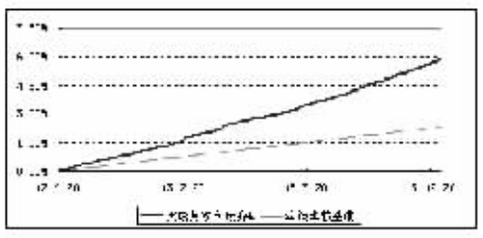
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	1.3110%	0.0070%	0.3403%	0.0000%	0.9707%	0.0070%
过去六个月	2.6373%	0.0094%	0.6805%	0.0000%	1.9568%	0.0094%
过去一年	4.7613%	0.0109%	1.3500%	0.0000%	3.4113%	0.0109%
自基金合同生效起至今	5.8454%	0.0097%	1.7310%	0.0000%	4.1144%	0.0097%

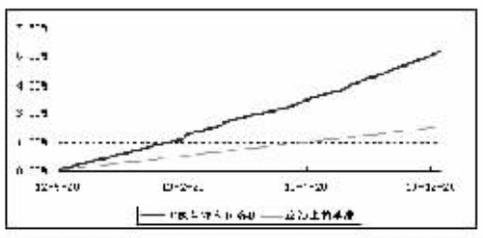
大成月添利债券B

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差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	1.3831%	0.0070%	0.3403%	0.0000%	1.0428%	0.0070%
过去六个月	2.7854%	0.0094%	0.6805%	0.0000%	2.1049%	0.0094%
过去一年	5.0643%	0.0109%	1.3500%	0.0000%	3.7143%	0.0109%
自基金合同生效起至今	6.2381%	0.0097%	1.7310%	0.0000%	4.5071%	0.0097%

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。

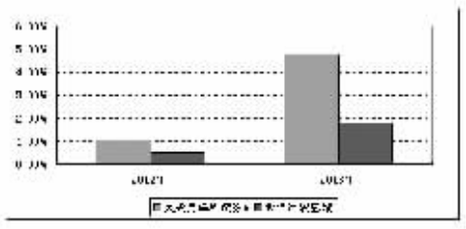
3.2.2 自基金合同生效以来基金累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

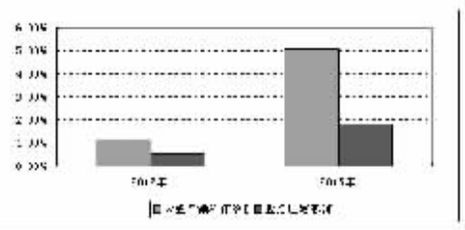




注:按基金合同规定,基金管理人应当自基金合同生效之日起六个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的有关约定。截至报告日本基金的各项投资比例已达到基金合同中规定的各项比例。

3.2.3 自基金合同生效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:2012年度计算期间为2012年9月20日(基金合同生效日)至2012年12月31日,不按整个自然年度进行折算。

3.3 过去三年基金的利润分配情况

单位:人民币元

大成月添利债券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
2013	18,899,525.52	13,199,005.58	3,992,701.12	36,091,232.22	
2012	9,789,726.53	15,177,395.56	3,116,979.71	28,084,101.80	
合计	28,689,252.05	28,376,401.14	7,109,680.83	64,175,334.02	
大成月添利债券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
2013	7,198,943.28	7,829,807.03	1,335,018.27	16,363,768.58	
2012	6,274,315.59	8,734,128.13	1,687,904.17	16,696,347.89	
合计	13,473,258.87	16,563,935.16	3,022,922.44	33,060,116.47	

§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12月31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,4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、中证100ETF、中证500深市ETF,1只QDII基金:大成标普500等权重指数基金及31只开放式证券投资基金:大成景丰债券型证券投资基金(LOF)、大成价值增长证券投资基金、大成债券投资基金、大成蓝筹稳健证券投资基金、大成精选增值混合型证券投资基金、大成货币市场证券投资基金、大成沪深300指数证券投资基金、大成财富管理2020生命周期证券投资基金、大成积极成长股票型证券投资基金、大成创新成长混合型证券投资基金(LOF)、大成景阳领先股票型证券投资基金、大成强化收益债券型证券投资基金、大成策略回报股票型证券投资基金、大成行业轮动股票型证券投资基金、大成中证红利指数证券投资基金、大成核心双动力股票型证券投资基金、大成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、大成景旭纯债债券型证券投资基金及大成景祥分级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		
陶铄先生	本基金基金经理	2012年9月20日	-	6年	中国科学院管理学硕士。曾任职于招商银行总行、普华永道会计师事务所、穆迪投资者服务有限公司、中国国际金融有限公司。曾担任中国国际金融有限公司固定收益部高级经理、副总经理。2010年9月加入大成基金管理有限公司,历任研究员、基金经理助理。2012年2月9日至2013年10月15日任大成景丰分级债券型证券投资基金基金经理。2012年9月20日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。2013年10月16日起任大成景丰债券型证券投资基金(LOF)基金经理。2014年1月28日起任大成信用增利一年定期开放债券型证券投资基金基金经理。具有基金从业资格。国籍:中国
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遵规守信情况的说明

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,基金管理人制订了《大成基金管理有限公司公平交易制度》及《大成基金管理有限公司异常交易监控与报告制度》。基金管理人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间连续4个季度的日内、3日内及5日内股票及债券交易同向交易价差进行分析。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11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,参与交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量超过该股当日成交量5%的仅有2笔,原因为投资策略需要;主动投资组合间债券交易存在1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

2013年宏观经济平稳运行,一季度GDP同比增长7.7%,二季度进一步回落至7.4%,三季度在补库存需求的带动下,GDP反弹至7.8%,四季度景气程度有所回落,全年GDP同比增长 7.7%。CPI呈现前低后高的走势,其中上半年同比增长2.4%,下半年增长2.8%。相比基本面的平稳,流动性的变化是左右资本市场走势更重要的力量。上半年外汇占款大幅增长,银行间流动性极为宽松,债券市场各类品种出现普涨。“620”钱荒成为流动性的大拐点,在盘活存量的大背景下,央行对金融行业高杠杆、非标资产快速扩张的态度更趋严厉,市场对央行态度的转变预期不足。央行的一系列操作,包括“锁长放短”,持续上调逆回购利率等对市场信心形成持续打击,叠加回购利率逐季攀高,债券收益率大幅上行。

具体来看,2013年全年7天回购利率均值达到4.12%,为2000年以来最高水平。其中上半年为3.87%,下半年达到4.36%。1个月Shibor利率上半年均值为4.24%,下半年达到5.36%。各类货币市场工具收益率均出现大幅上行,1年期金融债全年上行200个基点,其中上半年上行63个基点,下半年上行138个基点。各评级短融上行幅度达到180-220个基点,创历史新高。四季度,随着同业存单的推出,3个月Shibor报价开始向市场真实成交利率靠拢,从横盘5个月之久的4.7%跳升至5.5%以上,Shibor浮息债迎来重估。

2013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,本基金看重银行存款、逆回购和短期融资券的投资价值,根据对资金面的判断,全年保持高存款、低久期,并把握资金紧张的关键时点,进行了部分较高收益的银行存款和逆回购投资。

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4.7613%,B类净值收益率5.0643%,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

展望2014年,房地产市场供需两旺的格局难以在2014年继续延续,房地产投资增速有望下降。政府性债务比例纳入地方官员考核等措施使得平台融资增速受到抑制,基建投资增速也可能有所下滑, 2014年经济增速可能弱于2013年。2014年CPI翘尾与2013年接近, 预计全年CPI同比增速在2.5%-2.7%之间。宏观基本面对债券市场不会造成大的冲击。2014年公开市场的到期量创历史新低,央行公开市场操作力度对银行间流动性的影响较大。今年以来央行政策态度有所转变,降低银行间回购利率波动幅度的意图明显,我们认为银行间的流动性环境有望好于2013年四季度,回购利率波动中枢有望低于2013年下半年的水平。资金利率的下降以及市场预期的好转有望带动各类品种出现估值修复。

本基金在2014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,本基金将降低近回购投资比例,以存款、金融债、短期融资券和浮动利率债券为主要投资品种。本基金认为当前中高等级短期债券品种具备较好配置价值。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品种经理。

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52,455,000.80元,报告期内已分配利润52,455,000.80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,本基金托管人一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一大成基金管理有限公司2013年1月1日至2013年12月31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、基金分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,未发现有损害基金持有人利益的行为。

§6 审计报告

本基金2013年年度财务报表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:大成月添利理财债券型证券投资基金
报告截止日:2013年12月31日

单位:人民币元

资 产	本期末 2013年12月31日	上年度末 2012年12月31日
资 产:		
银行存款	1,807,071,885.86	1,432,266,952.32
结算备付金	-	-
存出保证金	-	-
交易性金融资产	888,927,985.55	940,496,118.27
其中:股票投资	-	-
基金投资	-	-
债券投资	888,927,985.55	940,496,118.27
资产支持证券投资	-	-
衍生金融资产	-	-
买入返售金融资产	1,251,044,276.57	753,677,090.52
应收证券清算款	-	-
应收利息	29,770,051.73	20,074,440.20
应收股利	-	-
应收申购款	18,982,280.72	-
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	-
资产总计	3,995,796,480.43	3,146,514,601.31
负债和所有者权益	本期末 2013年12月31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	-	-
卖出回购金融资产款	335,114,432.44	313,839,443.08
应付证券清算款	-	-
应付赎回款	-	-
应付管理人报酬	703,387.25	765,846.63
应付托管费	208,411.05	226,917.53
应付销售服务费	563,798.03	574,599.49
应付交易费用	34,467.25	37,552.63
应交税费	-	-
应付利息	29,362.80	33,328.89
应付利润	10,132,603.27	4,804,883.88
递延所得税负债	-	-
其他负债	194,071.28	113,000.00
负债合计	346,980,533.37	320,395,572.13
所有者权益:		
实收基金	3,648,815,947.06	2,826,119,029.18
未分配利润	-	-
所有者权益合计	3,648,815,947.06	2,826,119,029.18
负债和所有者权益总计	3,995,796,480.43	3,146,514,601.31

注:报告截止日2013年12月31日,基金份额净值1.000元,基金份额总额 3,648,815,947.06份,其中A类基金份额的份额总额为2,531,034,772.54份,B类基金份额的份额总额为 1,117,781,174.52份。

7.2 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12月31日

单位:人民币元

项 目	本期 2013年1月1日至2013年12月31日	上年度可比期间 2012年9月20日(基金合同生效日)至2012年12月31日
一、收入	65,158,277.74	52,698,775.13
1.利息收入	61,209,494.01	52,698,775.13
其中:存款利息收入	29,842,512.09	44,995,134.36
债券利息收入	24,294,219.98	5,713,537.45
资产支持证券利息收入	-	-
买入返售金融资产收入	7,072,761.94	1,990,103.32
其他利息收入	-	-
2.投资收益(损失以“-”填列)	3,941,283.73	-
其中:股票投资收益	-	-
基金投资收益	-	-
债券投资收益	3,941,283.73	-
资产支持证券投资收益	-	-
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)	7,500.00	-
减:二、费用	12,703,276.94	7,918,325.44
1.管理人报酬	2,949,562.29	3,142,291.13
2.托管费	873,944.45	931,049.25
3.销售服务费	2,325,027.40	2,284,095.03
4.交易费用	-	-
5.利息支出	6,039,545.20	1,357,534.86
其中:卖出回购金融资产支出	6,039,545.20	1,357,534.86
6.其他费用	515,197.60	203,355.17
三、利润总额(亏损总额以“-”号填列)	52,455,000.80	44,780,449.69
减:所得税费用	-	-
四、净利润(净亏损以“-”号填列)	52,455,000.80	44,780,449.69

7.3 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12月31日

单位:人民币元

项目	本期 2013年1月1日至2013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)	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)	-	52,455,000.80	52,455,000.80
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)	822,696,917.88	-	822,696,917.88
其中:1.基金申购款	7,108,722,993.61	-	7,108,722,993.61
2.基金赎回款	-6,286,026,075.73	-	-6,286,026,075.73
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)	-	-52,455,000.80	-52,455,000.80
五、期末所有者权益(基金净值)	3,648,815,947.06	-	3,648,815,947.06
项目	上年度可比期间 2012年9月20日(基金合同生效日)至2012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)	5,118,524,089.71	-	5,118,524,089.71
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	44,780,449.69	44,780,449.69
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)	-2,292,405,060.53	-	-2,292,405,060.53
其中:1.基金申购款	5,499,619,465.64	-	5,499,619,465.64
2.基金赎回款	-7,792,024,526.17	-	-7,792,024,526.17
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)	-	-44,780,449.69	-44,780,449.69
五、期末所有者权益(基金净值)	2,826,119,029.18	-	2,826,119,029.18

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.4 财务报表由下列负责人签署:

张树忠_____ 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

7.4 报表附注

7.4.1 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

7.4.2 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
大成国际资产管理有限公司(“大成国际”)	基金管理人的子公司
大成创新资本管理有限公司(“大成创新资本”)	基金管理人的合资子公司

注:1、本基金基金管理人于2013年10月29日成立了合资子公司大成创新资本管理有限公司,其中大成基金管理有限公司持有52%的股权。

2. 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。

3. 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 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.3.1 通过关联方交易单元进行的交易

本报告期内及上年度可比期间本基金无通过关联方交易单元进行的交易。

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 2013年1月1日至2013年12月31日	上年度可比期间 2012年9月20日(基金合同生效日)至2012年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	2,949,562.29	3,142,291.13
其中:支付销售机构的客户维护费	1,034,698.56	1,115,750.08

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。

7.4.3.2.2 基金托管费

单位:人民币元

项目	本期 2013年1月1日至2013年12月31日	上年度可比期间 2012年9月20日(基金合同生效日)至2012年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	873,944.45	931,049.25

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。

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 2013年1月1日至2013年12月31日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	大成月添利债券A	大成月添利债券B	合计
大成基金	45,105.01	12,011.49	57,116.50
中国农业银行	2,150,360.34	19,936.21	2,170,296.55
合计	2,195,465.35	31,947.70	2,227,413.05
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2012年9月20日(基金合同生效日)至2012年12月31日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	大成月添利债券A	大成月添利债券B	合计
大成基金	8,887.77	8,266.61	17,154.38
中国农业银行	2,172,318.04	27,814.65	2,200,132.69
合计	2,181,205.81	36,081.26	2,217,287.07

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 X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 2013年1月1日至2013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
中国农业银行	-	20,987,383.56	-	-	220,770,000.00	35,571.99
上年度可比期间 2012年9月20日(基金合同生效日)至2012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
中国农业银行	130,610,898.36	-	-	-	-	-

7.4.3.4 各关联方投资本基金的情况

本报告期内及上年度可比期间本基金未发生各关联方投资本基金的情况。

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 2013年1月1日至2013年12月31日		上年度可比期间 2012年9月20日(基金合同生效日)至2012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
中国农业银行	2,071,885.86	74,127.23	2,266,952.32	60,686.64

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。7.4.3.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

金额单位:人民币元

本期 2013年1月1日至2013年12月31日					
关联方名称	证券代码	证券名称	发行方式	基金在承销期内买入	
				数量(单位:张)	总金额
光大证券	041361049	13中炬高新CP001	新债认购	100,000	10,000,000.00
上年度可比期间 2012年9月20日(基金合同生效日)至2012年12月31日					
关联方名称	证券代码	证券名称	发行方式	基金在承销期内买入	
				数量(单位:张)	总金额
-	-	-	-	-	-

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(2013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

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。

7.4.4.2 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。

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2013年12月31日止, 本基金从事银行间市场债券正回购交易