

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

8.3.1 投资组合平均剩余期限基本情况

	天数
告期末投资组合平均剩余期限	91
告期内投资组合平均剩余期限最高值	96
告期内投资组合平均剩余期限最低值	19
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，本基金未发生超情况。	
8.3.2 期末投资组合平均剩余期限分布比例	
小于1年	无固定资产占基金总资产
	无固定负债占基金总资产

序号	平均剩余期限	值的比例(%)	净值的比例(%)
1	30天以内	61.43	11.11
	其中,剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-

30天(含)~60天	14.16	-	-
其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-	-
60天(含)~90天	0.36	-	-
其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-	-
90天(含)~180天	7.08	-	-
其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-	-
180天(含)~397天(含)	27.60	-	-
其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-	-
合计	110.63	-	11.11

8.4 期末按债券品种分类的债券投资组合金额单位:人民币元

序号	债券品种	摊余成本	占基金资产净值比例(%)
	国家债券	-	-
	央行票据	-	-

金融债券	209,578,852.25	7.42			
其中：政策性金融债	209,578,852.25	7.42			
企业债券	730,917,266.02	25.86			
企业短期融资券	730,917,266.02	25.86			
中期票据					
其他					
合计	940,496,118.27	33.28			
剩余合同期限超过307天的浮动利率债券					
8.5 期末按摊余成本法计量的金融资产净负债比例大于10%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	120228	12国开28	1,200,000	119,733,464.92	4.24

041258060	12號房CP002B	800, 000	80, 272, 962.96	2.84
041258060	12福福CP003	500, 000	49, 998, 738.68	1.77
041252048	12聯合水苑CP003	400, 000	40, 025, 712.33	1.42
041251011	12二海CP002	300, 000	30, 121, 017.53	1.07
041259008	12金茂CP001	300, 000	30, 081, 398.04	1.06
041256037	12TCL集CP001	300, 000	30, 052, 224.31	1.06
041252051	12正泰CP001	300, 000	30, 050, 616.65	1.06
041254055	12水电七局CP001	300, 000	30, 028, 111.61	1.06

041258063	12 宏安CP001	300,000	30,025,410.86	1.06
8.6	影子定价与 摊余成本法 确定的基金资产净值的偏离			
	报告期内偏离度的绝对值在 0.25(含)~0.5% 间的次数			偏离情况
	报告期内偏离度的最高值		0.0449%	
	报告期内偏离度的最低值		0.0005%	
	报告期内每个交易日偏离度的绝对值的简单平均值		0.0152%	
8.7	期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名前的所有资产支持证券投资明细			
	本报告期末持有资产支持证券			

8.8 投资组合报告附注

8.8.1 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买入时的溢价与折价,在其剩余存续期内按实际利率法每日计提损益。本基金通过每日计算基金资产净值的方式,在估值日对基金持有的金融资产按公允价值进行估值,持有人民币1.00元。

8.8.2 基金估值不存在估值持续期则小于397天但剩余存续期超过397天的浮动利率计息资产的摊本超过当日基金资产净值的20%的情况。

8.8.3 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受到公开谴责、处罚的情况。

8.8.4 期末其他各项资产构成

单位:人民币元

名称	金额
存出保证金	-
应收证劵清算款	-
应收利息	20,074,440.20
应收申购款	-
其他应收款	-
待摊费用	-
其他	-

合计	20,074,440.20									
8.8.5 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。										
8.9 基金业绩持有人信息										
9.1 期末基金业绩持有人户数及持有金额										
份单位:份										
类别别	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 持有份额	个人投资者 持有份额	总份额					
			持有份额	持有份额	总份额					

或月添利 券A	或月添利 券B	或月添利 券C	或月添利 券D	或月添利 券E	或月添利 券F	或月添利 券G	或月添利 券H	或月添利 券I	或月添利 券J	或月添利 券K	或月添利 券L	或月添利 券M	或月添利 券N	或月添利 券O	或月添利 券P	或月添利 券Q	或月添利 券R	或月添利 券S	或月添利 券T	或月添利 券U	或月添利 券V	或月添利 券W	或月添利 券X	或月添利 券Y	或月添利 券Z
10.892	172.943,94	21,079.261,75	1.12%	1,862,626,141.05	98.88%																				
78	12,082,225.98	435,676,168.14	46.23%	506,737,458.24	53.77%																				
10.970	257,622.52	456,755,429.89	16.16%	2,369,363,599.29	83.84%																				

注：1、下属分级基金份额比例的母基金用各自基金份额的份额、合计比例的母基金用各自分级基金份额的合计。

2、持有人人数为有效人数，即存量份额大于零的账户。

3、主要持有人是指持有份额达到或超过基金总份额1%的持有人。

目	份额级别	持有份额总数(份)	占基金总份额比例
金管理公司所有从业人员持有本基金基金份额	大成月添利债券A	5,052.16	0.000268%
	大成月添利债		0.00%

证券B		0.0001%
合计	5,052.16	0.000179%

注1、下部分级基金份额比例的分母采用各自各级的份额,合计数比例的分母采用各分级基金份额的合计;

注2、本公司基金管理人、基金投资和研究所部门负责人持有该只基金份额总量的数量区间:0;

注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。

§ 10 开放式基金份额变动

大成月添利债券A	大成月添利债券B	单位:份
----------	----------	------

截至合同生效日(2012年9月20日)基金份额总额	3,635,402,926.26	1,483,121,163.45
报告期末初基金份额总额		
报告期末基金总申购份额	3,500,643,352.31	1,998,976,113.33
本报告期基金总赎回份额	5,252,340,875.77	2,598,683,650.40
报告期末基金拆分变动份额		
报告期末末基金份额总额	1,883,705,402.80	942,413,626.38

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额，不单独列示。

根据《大成创新券和利率债型证券投资基金招募说明书》规定,本基金分为两级基金份额,A级基金份额为100份, A级基金份额持有人持有单个基金份额保留份额在500万份以上的持有人, B级基金份额持有人持有单个基金份额保留份额在500万份以下的持有人。若A级基金份额持有人有个人在本基金账户保留基金份额超过500万份时,本基金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级基金份额持有人有个人在本基金账户保留的基金份额低于500万份时,本基金的销售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。

§ 1 重大事件揭示

报告期内基金持有人大会决议

报告期内基金持有人大会决议。

11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动无。

11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。

本报告期间没有涉及与本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

11.4 基金投资策略的改变

本基金投资策略在本报告期间内没有重大改变。

11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金的审计师为本报告期间的会计师事务所为普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙），会计师事务所名称、会计师事务所名称、本年度支付的审计费用无。

11.6 管理人、托管人及基金销售机构受处罚或调查情况

本报告期间，基金管理人、基金托管人、基金销售机构均无受处罚或调查情况。

本报告期末,本基金管理人、托管人及高级管理人员均未受到监管部门稽查或处罚。

11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

11.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

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 交易总额的比例	佣金 占当期佣金 总额的比例	
中信证券	1	— 0.00	— 0.00	—

金额单位:人民币元

城投债	2	—	0.00	—	0.00	—
北证券	1	—	0.00	—	0.00	—
正证券	1	—	0.00	—	0.00	—
华证券	1	—	0.00	—	0.00	—
大证券	2	—	0.00	—	0.00	—
发证券	1	—	0.00	—	0.00	—
金证券	2	—	0.00	—	0.00	—
高证券	1	—	0.00	—	0.00	—

李君安	2	-	0.00	-	0.00	-
信证券	1	-	0.00	-	0.00	-
通证券	1	-	0.00	-	0.00	-
洛证券	1	-	0.00	-	0.00	-
鼎证券	1	-	0.00	-	0.00	-
创证券	1	-	0.00	-	0.00	-
泰证券	1	-	0.00	-	0.00	-
圭证券	1	-	0.00	-	0.00	-
			0.00		0.00	

京证券	1	—	—	0.00	—
安信	1	—	0.00	0.00	—
鲁证	1	—	0.00	0.00	—
银证	1	—	0.00	0.00	—
海证	1	—	0.00	0.00	—
银万国	1	—	0.00	0.00	—
纪证券	1	—	0.00	0.00	—
风证	1	—	0.00	0.00	—
源证	1	—	0.00	0.00	—

中证券	2	-	0.00	-	0.00	-
中证券	3	-	0.00	-	0.00	-
大证券	1	-	0.00	-	0.00	-
商证券	3	-	0.00	-	0.00	-
商证券	1	-	0.00	-	0.00	-
金公司	2	-	0.00	-	0.00	-
信建投	3	-	0.00	-	0.00	-
信证券	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。	2	0.00	0.00	0.00
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，内部控制制度健全，能满足各投资组合交易的保密性要求；				
（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，满足各投资组合交易需求。				
注：除上述投资组合外，除前所述外的其他基金投资组合				

(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。

利用证券交易单元的程序的：首先根据租用证券公司交易单元的选择标准形成 券商服务评价然后根据其评分高低进行选择基金交易单元。

本报告期间增加基金交易单元：安信证券、长城证券、东北证券、方正证券、高华证券、光大证券、广发证券、国泰君安、国盛证券、国泰君安、国信证券、海通证券、华泰证券、开源证券、申银万国、上海证券、民生证券、银河证券、英大证券、招商证券、浙商证券、中金公司、中信建投、中信证券、中银国际。

11.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况如下

大成基金管理有限公司
2013年3月26日

大成基金管理有限公司
2013年3月26日