

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3月6日

§ 1 重要提示

基金管理人的董事、监事、高级管理人员和其他从业人员在编制虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏，并对内容的真实性、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，并由董事长签章。

基金托管人中国农业银行股份有限公司根据基金合同约定，于2013年3月22日收到本报告的财务报表、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，保证复核报告不存在虚假记载、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，投资人在作出投资决策前应仔细阅读该基金的招募说明书及定期报告。

本年度报告摘要摘要报告年度投资人欲详细了解内容，阅读年度报告正文。

本报告中财务数据已经审计。普华永道中天会计师事务所有限公司为本基金出具了无保留意见的审计报告，敬请投资人注意阅读。

本报告期自2012年9月20日至2012年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型证券投资基金 |
| 基金代码 | 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 2,826,119,298.18份

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 1,883,705,402.80份 942,413,626.38份

2.2 基金品种说明

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绝对收益。

本基金在报告期内多次调整资产配置，以实现超越基准的投资目标。

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率低于股票型基金、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

基金管理人 基金托管人

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 范芳

联系电话

0755-83183388 010-66060699

电子邮件

dlapeng@fund.com.cn lifangfei@abcchina.com

客户服务电话

40068885558 95599

传真

0755-83199588 010-63201816

2.4 信息披露方式

登载基金年度报告的管理人互联网网址

http://www.defund.com.cn

深圳福田区农行大厦7088号招行银行大厦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9层中国农业银行总行营业部

§ 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

2012年9月20日(基金合同生效日)-2012年12月31日

大成月添利债券

大成月添利债券B

本期已实现收益 28,04,101.80 16,696,347.89

本期利润 28,04,101.80 16,696,347.89

本期利润折算率 1.0351% 1.1175%

3.1.2 期末数据和指标

2012年末

期末基金资产净值 1,883,705,402.80 942,413,626.38

基金份额净值 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)和相关费用后的余额,本期利润为本期实现收入加上本期公允价值变动收益。

2.本基金的利润指标不包括持有本基金的客户在本期的利息收入。

3.本基金自2012年9月20日起生效,报告期为2012年9月20日至2012年12月31日。

3.2 基金表现

3.2.1 基金份额净值收益率与其同期业绩比较基准收益率的比较

大成月添利债券

份额净值 份额净值收益率(%)

收益率(1) 业绩比较基准收益率(2)

收益差(3) 收益差/业绩比较基准(%)

过去三个月 0.9069% 0.0010% 0.3403% 0.0000% 0.5666% 0.0010%

自基金合同生效日起至今 1.0351% 0.0011% 0.3810% 0.0000% 0.6541% 0.0011%

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)和相关费用后的余额,本期利润为本期实现收入加上本期公允价值变动收益。

2.本基金的利润指标不包括持有本基金的客户在本期的利息收入。

3.本基金合同生效以来基金净值收益率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

3.3 过去一年基金的利润分配情况

注:本基金合同生效日为2012年9月20日,2012年度主要财务指标的计算期间为2012年9月20日至2012年12月31日,不包含个别年度进行折算。

3.4 基金合同约定的基金利润分配情况

3.5 过去一年基金的利润分配情况

注:本基金合同生效日为2012年9月20日,2012年度主要财务指标的计算期间为2012年9月20日至2012年12月31日,不包含个别年度进行折算。

3.6 基金合同约定的基金利润分配情况

注:本基金合同生效日为2012年9月20日,2012年度主要财务指标的计算期间为2012年9月20日至2012年12月31日,不包含个别年度进行折算。

3.7 过去一年基金的利润分配情况

注:本基金合同生效日为2012年9月20日,2012年度主要财务指标的计算期间为2012年9月20日至2012年12月31日,不包含个别年度进行折算。

3.8 基金合同约定的基金利润分配情况

注:本基金合同生效日为2012年9月20日,2012年度主要财务指标的计算期间为2012年9月20日至2012年12月31日,不包含个别年度进行折算。

3.9 基金合同约定的基金利润分配情况

注:本基金合同生效日为2012年9月20日,2012年度主要财务指标的计算期间为2012年9月20日至2012年12月31日,不包含个别年度进行折算。

3.10 基金合同约定的基金利润分配情况

注:本基金合同生效日为2012年9月20日,2012年度主要财务指标的计算期间为2012年9月20日至2012年12月31日,不包含个别年度进行折算。

3.11 基金合同约定的基金利润分配情况

注:本基金合同生效日为2012年9月20日,2012年度主要财务指标的计算期间为2012年9月20日至2012年12月31日,不包含个别年度进行折算。

3.12 基金合同约定的基金利润分配情况

注:本基金合同生效日为2012年9月20日,2012年度主要财务指标的计算期间为2012年9月20日至2012年12月31日,不包含个别年度进行折算。

3.13 基金合同约定的基金利润分配情况

注:本基金合同生效日为2012年9月20日,2012年度主要财务指标的计算期间为2012年9月20日至2012年12月31日,不包含个别年度进行折算。

3.14 基金合同约定的基金利润分配情况

注:本基金合同生效日为2012年9月20日,2012年度主要财务指标的计算期间为2012年9月20日至2012年12月31日,不包含个别年度进行折算。

3.15 基金合同约定的基金利润分配情况

注:本基金合同生效日为2012年9月20日,2012年度主要财务指标的计算期间为2012年9月20日至2012年12月31日,不包含个别年度进行折算。

3.16 基金合同约定的基金利润分配情况

注:本基金合同生效日为2012年9月20日,2012年度主要财务指标的计算期间为2012年9月20日至2012年12月31日,不包含个别年度进行折算。

3.17 基金合同约定的基金利润分配情况

注:本基金合同生效日为2012年9月20日,2012年度主要财务指标的计算期间为2012年9月20日至2012年12月31日,不包含个别年度进行折算。

3.18 基金合同约定的基金利润分配情况

注:本基金合同生效日为2012年9月20日,2012年度主要财务指标的计算期间为2012年9月20日至2012年12月31日,不包含个别年度进行折算。

3.19 基金合同约定的基金利润分配情况

注:本基金合同生效日为2012年9月20日,2012年度主要财务指标的计算期间为2012年9月20日至2012年12月31日,不包含个别年度进行折算。

3.20 基金合同约定的基金利润分配情况

注:本基金合同生效日为2012年9月20日,2012年度主要财务指标的计算期间为2012年9月20日至2012年12月31日,不包含个别年度进行折算。

3.21 基金合同约定的基金利润分配情况

注:本基金合同生效日为2012年9月20日,2012年度主要财务指标的计算期间为2012年9月20日至2012年12月31日,不包含个别年度进行折算。

3.22 基金合同约定的基金利润分配情况

注:本基金合同生效日为2012年9月20日,2012年度主要财务指标的计算期间为2012年9月20日至2012年12月31日,不包含个别年度进行折算。

3.23 基金合同约定的基金利润分配情况

注:本基金合同生效日为2012年9月20日,2012年度主要财务指标的计算期间为2012年9月20日至2012年12月31日,不包含个别年度进行折算。

3.24 基金合同约定的基金利润分配情况

注:本基金合同生效日为2012年9月20日,2012年度主要财务指标的计算期间为2012年9月20日至2012年12月31日,不包含个别年度进行折算。

3.25 基金合同约定的基金利润分配情况

注:本基金合同生效日为2012年9月20日,2012年度主要财务指标的计算期间为2012年9月20日至2012年12月31日,不包含个别年度进行折算。

3.26 基金合同约定的基金利润分配情况

注:本基金合同生效日为2012年9月20日,2012年度主要财务指标的计算期间为2012年9月20日至2012年12月31日,不包含个别年度进行折算。

3.27 基金合同约定的基金利润分配情况

注:本基金合同生效日为2012年9月20日,2012年度主要财务指标的计算期间为2012年9月20日至2012年12月31日,不包含个别年度进行折算。

3.28 基金合同约定的基金利润分配情况

注:本基金合同生效日为2012年9月20日,2012年度主要财务指标的计算期间为2012年9月20日至2012年12月31日,不包含个别年度进行折算。

3.29 基金合同约定的基金利润分配情况

注:本基金合同生效日为2012年9月20日,2012年度主要财务指标的计算期间为2012年9月20日至2012年12月31日,不包含个别年度进行折算。

3.30 基金合同约定的基金利润分配情况

注:本基金合同生效日为2012年9月20日,2012年度主要财务指标的计算期间为2012年9月20日至2012年12月31日,不包含个别年度进行折算。