

大成月添利理财债券型证券投资基金

2013 第一季度报告

基金管理人:大成基金管理有限公司
基金托管人:中国农业银行股份有限公司
报告送出日期:2013年4月22日

重要提示
基金管理人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、准确性和完整性承担个别及连带责任。

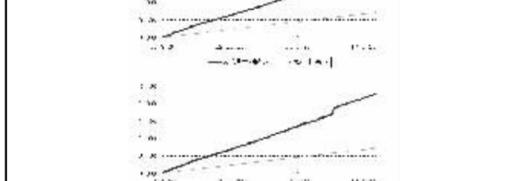
Table with 2 columns: Item and Value. Includes sections for 2.1 Main Financial Indicators and 2.2 Net Asset Value.

2.1 主要财务指标
单位:人民币元
报告期(2013年1月1日至2013年3月31日)

Table with 2 columns: Item and Value. Includes 1.本期已实现收益, 2.本期利润, 3.期末基金资产净值.

Table with 2 columns: Item and Value. Includes 1.本期基金份额净值增长率, 2.本期基金份额净值增长率标准差.

3.2 基金净值表现
3.2.1 本报告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



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,基金成立未逾1年;
2.按基金合同规定,本基金应当自基金合同生效之日起6个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的约定。

4.1 基金经理(或基金经理小组)简介
姓名 职务 任本基金的基金经理期限 证券从业年限 说明

Table with 5 columns: Name, Position, Tenure, Experience, Bio. Lists managers like 陶伟先生 and 王立女士.

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。

4.3 公平交易专项说明
4.3.1 公平交易制度的执行情况
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,公司制订了《大成基金管理有限公司公平交易管理制度》。

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。

4.4 报告期内基金投资策略和运作分析
2013年1季度,经济增长呈现弱复苏,通胀回升速度较快,由于2012年底银行超储率进一步回升至3.3%,使得银行间资金面较为宽松,且资金面稳定性增强。

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析
2013年1季度,经济增长呈现弱复苏,通胀回升速度较快,由于2012年底银行超储率进一步回升至3.3%,使得银行间资金面较为宽松,且资金面稳定性增强。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现
报告期内本基金A类净值增长率为1.0711%,B类净值增长率为1.1441%,期间业绩比较基准收益率为0.3329%。

4.5 管理人、对宏观经济、证券市场的展望
展望2季度,对宏观经济、流通中的现金对流动性的收缩大幅在万亿,假设外汇占款保持增加,公开市场操作保持中性,预计超储率将小幅下降,但绝对水平仍高于2012年2、3季度的水平。

流动负债保持相对宽松,7天回购利率继续保持在3%附近,资金面的不确定性主要来自于IPO重启及货币政策边际变化。

本基金在一季度将密切关注资金市场的变化,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。

5.1 报告期末基金资产组合情况
序号 项目 金额(元) 占基金总资产的比例(%)

Table with 3 columns: Item, Amount, Percentage. Shows asset allocation for大成月添利债券A/B.

5.2 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名债券投资明细

Table with 5 columns: Item, Amount, Percentage, etc. Lists top 10 bond holdings.

5.3 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券投资明细

Table with 5 columns: Item, Amount, Percentage, etc. Lists top 10 asset-backed securities.

5.4 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

Table with 5 columns: Item, Amount, Percentage, etc. Lists top 10 stock holdings.

5.5 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名权证投资明细

Table with 5 columns: Item, Amount, Percentage, etc. Lists top 10 warrants.

5.6 报告期末本基金投资组合公允价值超过3%的股票明细

Table with 5 columns: Item, Amount, Percentage, etc. Lists stocks over 3%.

5.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券投资明细

Table with 5 columns: Item, Amount, Percentage, etc. Lists top 10 asset-backed securities.

5.8 投资组合报告附注
5.8.1 本基金报告期内未持有资产支持证券。

5.8.2 本基金报告期内未持有权证。

5.8.3 本基金报告期内未持有股票。

5.8.4 本基金报告期内未持有权证。

5.8.5 本基金报告期内未持有股票。

5.8.6 本基金报告期内未持有股票。

5.8.7 本基金报告期内未持有股票。

5.8.8 本基金报告期内未持有股票。

5.8.9 本基金报告期内未持有股票。

5.8.10 本基金报告期内未持有股票。

5.8.11 本基金报告期内未持有股票。

5.8.12 本基金报告期内未持有股票。

5.8.13 本基金报告期内未持有股票。

5.8.14 本基金报告期内未持有股票。

5.8.15 本基金报告期内未持有股票。

5.8.16 本基金报告期内未持有股票。

5.8.17 本基金报告期内未持有股票。

5.8.18 本基金报告期内未持有股票。

5.8.19 本基金报告期内未持有股票。

5.8.20 本基金报告期内未持有股票。

5.8.21 本基金报告期内未持有股票。

5.8.22 本基金报告期内未持有股票。

5.8.23 本基金报告期内未持有股票。

5.8.24 本基金报告期内未持有股票。

5.8.25 本基金报告期内未持有股票。

5.8.26 本基金报告期内未持有股票。

5.8.27 本基金报告期内未持有股票。

5.8.28 本基金报告期内未持有股票。

5.8.29 本基金报告期内未持有股票。

5.8.30 本基金报告期内未持有股票。

5.8.31 本基金报告期内未持有股票。

5.8.32 本基金报告期内未持有股票。

5.8.33 本基金报告期内未持有股票。

5.8.34 本基金报告期内未持有股票。

5.8.35 本基金报告期内未持有股票。

5.8.36 本基金报告期内未持有股票。

5.8.37 本基金报告期内未持有股票。

5.8.38 本基金报告期内未持有股票。

5.8.39 本基金报告期内未持有股票。

5.8.40 本基金报告期内未持有股票。

5.8.41 本基金报告期内未持有股票。

大成债券投资基金

2013 第一季度报告

基金管理人:大成基金管理有限公司
基金托管人:中国农业银行股份有限公司
报告送出日期:2013年4月22日

重要提示
基金管理人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、准确性和完整性承担个别及连带责任。

Table with 2 columns: Item and Value. Includes 2.1 Main Financial Indicators and 2.2 Net Asset Value.

2.1 主要财务指标
单位:人民币元
报告期(2013年1月1日至2013年3月31日)

Table with 2 columns: Item and Value. Includes 1.本期已实现收益, 2.本期利润, 3.期末基金资产净值.

Table with 2 columns: Item and Value. Includes 1.本期基金份额净值增长率, 2.本期基金份额净值增长率标准差.

3.2 基金净值表现
3.2.1 本报告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



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,基金成立未逾1年;
2.按基金合同规定,本基金应当自基金合同生效之日起6个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的约定。

4.1 基金经理(或基金经理小组)简介
姓名 职务 任本基金的基金经理期限 证券从业年限 说明

Table with 5 columns: Name, Position, Tenure, Experience, Bio. Lists managers like 陶伟先生 and 王立女士.

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。

4.3 公平交易专项说明
4.3.1 公平交易制度的执行情况
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,公司制订了《大成基金管理有限公司公平交易管理制度》。

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。

4.4 报告期内基金投资策略和运作分析
2013年1季度,经济增长呈现弱复苏,通胀回升速度较快,由于2012年底银行超储率进一步回升至3.3%,使得银行间资金面较为宽松,且资金面稳定性增强。

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析
2013年1季度,经济增长呈现弱复苏,通胀回升速度较快,由于2012年底银行超储率进一步回升至3.3%,使得银行间资金面较为宽松,且资金面稳定性增强。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现
报告期内本基金A类净值增长率为1.0711%,B类净值增长率为1.1441%,期间业绩比较基准收益率为0.3329%。

4.5 管理人、对宏观经济、证券市场的展望
展望2季度,对宏观经济、流通中的现金对流动性的收缩大幅在万亿,假设外汇占款保持增加,公开市场操作保持中性,预计超储率将小幅下降,但绝对水平仍高于2012年2、3季度的水平。

流动负债保持相对宽松,7天回购利率继续保持在3%附近,资金面的不确定性主要来自于IPO重启及货币政策边际变化。

本基金在一季度将密切关注资金市场的变化,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。

5.1 报告期末基金资产组合情况
序号 项目 金额(元) 占基金总资产的比例(%)

Table with 3 columns: Item, Amount, Percentage. Shows asset allocation for大成债券A/B.

5.2 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名债券投资明细

Table with 5 columns: Item, Amount, Percentage, etc. Lists top 10 bond holdings.

5.3 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券投资明细

Table with 5 columns: Item, Amount, Percentage, etc. Lists top 10 asset-backed securities.

5.4 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

Table with 5 columns: Item, Amount, Percentage, etc. Lists top 10 stock holdings.

5.5 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名权证投资明细

Table with 5 columns: Item, Amount, Percentage, etc. Lists top 10 warrants.

5.6 报告期末本基金投资组合公允价值超过3%的股票明细

Table with 5 columns: Item, Amount, Percentage, etc. Lists stocks over 3%.

5.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券投资明细

Table with 5 columns: Item, Amount, Percentage, etc. Lists top 10 asset-backed securities.

5.8 投资组合报告附注
5.8.1 本基金报告期内未持有资产支持证券。

5.8.2 本基金报告期内未持有权证。

5.8.3 本基金报告期内未持有股票。

5.8.4 本基金报告期内未持有权证。

5.8.5 本基金报告期内未持有股票。

5.8.6 本基金报告期内未持有股票。

5.8.7 本基金报告期内未持有股票。

5.8.8 本基金报告期内未持有股票。

5.8.9 本基金报告期内未持有股票。

5.8.10 本基金报告期内未持有股票。

5.8.11 本基金报告期内未持有股票。

5.8.12 本基金报告期内未持有股票。

5.8.13 本基金报告期内未持有股票。

5.8.14 本基金报告期内未持有股票。

5.8.15 本基金报告期内未持有股票。

5.8.16 本基金报告期内未持有股票。

5.8.17 本基金报告期内未持有股票。

5.8.18 本基金报告期内未持有股票。

5.8.19 本基金报告期内未持有股票。

5.8.20 本基金报告期内未持有股票。

大成中证红利指数证券投资基金

2013 第一季度报告

基金管理人:大成基金管理有限公司
基金托管人:中国农业银行股份有限公司
报告送出日期:2013年4月22日

重要提示
基金管理人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、准确性和完整性承担个别及连带责任。

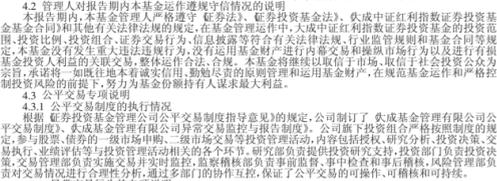
Table with 2 columns: Item and Value. Includes 2.1 Main Financial Indicators and 2.2 Net Asset Value.

2.1 主要财务指标
单位:人民币元
报告期(2013年1月1日至2013年3月31日)

Table with 2 columns: Item and Value. Includes 1.本期已实现收益, 2.本期利润, 3.期末基金资产净值.

Table with 2 columns: Item and Value. Includes 1.本期基金份额净值增长率, 2.本期基金份额净值增长率标准差.

3.2 基金净值表现
3.2.1 本报告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



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,基金成立未逾1年;
2.按基金合同规定,本基金应当自基金合同生效之日起6个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的约定。

4.1 基金经理(或基金经理小组)简介
姓名 职务 任本基金的基金经理期限 证券从业年限 说明

Table with 5 columns: Name, Position, Tenure, Experience, Bio. Lists managers like 陶伟先生 and 王立女士.

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。

4.3 公平交易专项说明
4.3.1 公平交易制度的执行情况
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,公司制订了《大成基金管理有限公司公平交易管理制度》。

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。

4.4 报告期内基金投资策略和运作分析
2013年1季度,经济增长呈现弱复苏,通胀回升速度较快,由于2012年底银行超储率进一步回升至3.3%,使得银行间资金面较为宽松,且资金面稳定性增强。

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析
2013年1季度,经济增长呈现弱复苏,通胀回升速度较快,由于2012年底银行超储率进一步回升至3.3%,使得银行间资金面较为宽松,且资金面稳定性增强。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现
报告期内本基金A类净值增长率为1.0711%,B类净值增长率为1.1441%,期间业绩比较基准收益率为0.3329%。

4.5 管理人、对宏观经济、证券市场的展望
展望2季度,对宏观经济、流通中的现金对流动性的收缩大幅在万亿,假设外汇占款保持增加,公开市场操作保持中性,预计超储率将小幅下降,但绝对水平仍高于2012年2、3季度的水平。

流动负债保持相对宽松,7天回购利率继续保持在3%附近,资金面的不确定性主要来自于IPO重启及货币政策边际变化。

本基金在一季度将密切关注资金市场的变化,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。

5.1 报告期末基金资产组合情况
序号 项目 金额(元) 占基金总资产的比例(%)

Table with 3 columns: Item, Amount, Percentage. Shows asset allocation for大成中证红利.

5.2 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名债券投资明细

Table with 5 columns: Item, Amount, Percentage, etc. Lists top 10 bond holdings.

5.3 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券投资明细

Table with 5 columns: Item, Amount, Percentage, etc. Lists top 10 asset-backed securities.

5.4 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

Table with 5 columns: Item, Amount, Percentage, etc. Lists top 10 stock holdings.

5.5 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名权证投资明细

Table with 5 columns: Item, Amount, Percentage, etc. Lists top 10 warrants.

5.6 报告期末本基金投资组合公允价值超过3%的股票明细

Table with 5 columns: Item, Amount, Percentage, etc. Lists stocks over 3%.

5.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券投资明细

Table with 5 columns: Item, Amount, Percentage, etc. Lists top 10 asset-backed securities.

5.8 投资组合报告附注
5.8.1 本基金报告期内未持有资产支持证券。

5.8.2 本基金报告期内未持有权证。

5.8.3 本基金报告期内未持有股票。

5.8.4 本基金报告期内未持有权证。

5.8.5 本基金报告期内未持有股票。

5.8.6 本基金报告期内未持有股票。

5.8.7 本基金报告期内未持有股票。

5.8.8 本基金报告期内未持有股票。

5.8.9 本基金报告期内未持有股票。

5.8.10 本基金报告期内未持有股票。

5.8.11 本基金报告期内未持有股票。

5.8.12 本基金报告期内未持有股票。

5.8.13 本基金报告期内未持有股票。

5.8.14 本基金报告期内未持有股票。

5.8.15 本基金报告期内未持有股票。

5.8.16 本基金报告期内未持有股票。

5.8.17 本基金报告期内未持有股票。

5.8.18 本基金报告期内未持有股票。

5.8.19 本基金报告期内未持有股票。

5.8.20 本基金报告期内未持有股票。

5.8.21 本基金报告期内未持有股票。

5.8.22 本基金报告期内未持有股票。

5.8.23 本基金报告期内未持有股票。

5.8.24 本基金报告期内未持有股票。

5.8.25 本基金报告期内未持有股票。

5.8.26 本基金报告期内未持有股票。

5.8.27 本基金报告期内未持有股票。

5.8.28 本基金报告期内未持有股票。

5.8.29 本基金报告期内未持有股票。

5.8.30 本基金报告期内未持有股票。

5.8.31 本基金报告期内未持有股票。

5.8.32 本基金报告期内未持有股票。

5.8.33 本基金报告期内未持有股票。

5.8.34 本基金报告期内未持有股票。

5.8.35 本基金报告期内未持有股票。

5.8.36 本基金报告期内未持有股票。

5.8.37 本基金报告期内未持有股票。

5.8.38 本基金报告期内未持有股票。

5.8.39 本基金报告期内未持有股票。

5.8.40 本基金报告期内未持有股票。

5.8.41 本基金报告期内未持有股票。

5.8.42 本基金报告期内未持有股票。

5.8.43 本基金报告期内未持有股票。

5.8.44 本基金报告期内未持有股票。

5.8.45 本基金报告期内未持有股票。

5.8.46 本基金报告期内未持有股票。

5.8.47 本基金报告期内未持有股票。

5.8.48 本基金报告期内未持有股票。

5.8.49 本基金报告期内未持有股票。

5.8.50 本基金报告期内未持有股票。

5.8.51 本基金报告期内未持有股票。

5.8.52 本基金报告期内未持有股票。

5.8.53 本基金报告期内未持有股票。

</