

大成月添利理财债券型证券投资基金
2016 年年度报告
2016 年 12 月 31 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

送出日期：2017 年 3 月 25 日

§ 1 重要提示及目录

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 2017 年 3 月 23 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 2016 年 01 月 01 日起至 12 月 31 日止。

1.2 目录

§ 1 重要提示及目录	1
1.1 重要提示.....	1
1.2 目录.....	2
§ 2 基金简介	4
2.1 基金基本情况.....	4
2.2 基金产品说明.....	4
2.3 基金管理人和基金托管人.....	4
2.4 信息披露方式.....	4
2.5 其他相关资料.....	5
§ 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况	5
3.1 主要会计数据和财务指标.....	5
3.2 基金净值表现.....	6
3.3 过去三年基金的利润分配情况.....	10
§ 4 管理人报告	11
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	11
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	12
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	12
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.....	13
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	13
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况.....	14
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	14
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	15
4.9 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明.....	15
§ 5 托管人报告	16
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	16
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明.....	16
5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见.....	16
§ 6 审计报告	16
§ 7 年度财务报表	17
7.1 资产负债表.....	17
7.2 利润表.....	18
7.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	19
7.4 报表附注.....	20
§ 8 投资组合报告	41
8.1 期末基金资产组合情况.....	41
8.2 债券回购融资情况.....	41
8.3 基金投资组合平均剩余期限.....	41
8.4 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	42
8.5 期末按摊余成本占基金资产净值比例大小排序的前十名债券投资明细.....	43
8.6 “影子定价”与“摊余成本法”确定的基金资产净值的偏离.....	43
8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细.....	43
8.8 投资组合报告附注.....	43
§ 9 基金份额持有人信息	44

9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	44
9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	44
9.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况.....	44
§ 10 开放式基金份额变动.....	45
§ 11 重大事件揭示.....	45
11.1 基金份额持有人大会决议.....	45
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.....	45
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	46
11.4 基金投资策略的改变.....	46
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	46
11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况.....	46
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	46
11.8 偏离度绝对值超过 0.5%的情况.....	48
11.9 其他重大事件.....	48
§ 12 影响投资者决策的其他重要信息.....	52
§ 13 备查文件目录.....	52
13.1 备查文件目录.....	52
13.2 存放地点.....	53
13.3 查阅方式.....	53

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	大成月添利理财债券型证券投资基金		
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	543,347,437.25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	大成月添利债券 E
下属分级基金的交易代码:	090021	091021	001497
报告期末下属分级基金的份额总额	117,370,998.32份	407,392,707.39份	18,583,731.54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	罗登攀
	联系电话	0755-83183388
	电子邮箱	office@dcfund.com.cn
客户服务电话	4008885558	95599
传真	0755-83199588	010-68121816
注册地址	深圳市福田区深南大道 7088 号 招商银行大厦 32 层	北京市东城区建国门内大街 69 号
办公地址	深圳市福田区深南大道 7088 号 招商银行大厦 32 层	北京市西城区复兴门内大街 28 号 凯晨世贸中心东座 F9
邮政编码	518040	100031
法定代表人	刘卓	周慕冰

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《证券时报》、《上海证券报》、《中国证券报》
----------------	------------------------

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

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
会计师事务所	普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)	上海市黄浦区湖滨路 202 号企业天地 2 号楼普华永道中心 11 楼
注册登记机构	大成基金管理有限公司	深圳市福田区深南大道 7088 号招商银行大厦 32 层

§ 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	2016 年			2015 年			2014 年		
	大成月添利债券 A	大成月添利债券 B	大成月添利债券 E	大成月添利债券 A	大成月添利债券 B	大成月添利债券 E	大成月添利债券 A	大成月添利债券 B	大成月添利债券 E
本期已实现收益	5,219,638.92	12,498,295.55	2,745,166.64	18,370,275.00	36,716,946.18	1,679,420.13	43,596,768.70	40,358,273.44	-
本期利润	5,219,638.92	12,498,295.55	2,745,166.64	18,370,275.00	36,716,946.18	1,679,420.13	43,596,768.70	40,358,273.44	-
本期净值收益率	2.7451%	3.0416%	2.7407%	4.5218%	4.8247%	1.9172%	5.2352%	5.5406%	0.0000%
3.1.2 期末 数据 和指 标	2016 年末			2015 年末			2014 年末		
	期末基金资产净值	117,370,998.32	407,392,707.39	18,583,731.54	491,424,715.22	692,153,122.49	657,890,374.69	805,738,611.73	963,518,373.86
期末	1.0000	1.0000	1.0000	1.0000	1.0000	1.0000	1.0000	1.0000	-

基金份额净值									
3.1.3 累计期末指标	2016 年末			2015 年末			2014 年末		
累计净值收益率	19.6181%	21.1076%	4.7102%	16.4224%	17.5330%	1.9172%	11.3860%	12.1236%	0.0000%

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 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值收益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	份额净值收益率①	份额净值收益率标准差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	0.7126%	0.0022%	0.3393%	0.0000%	0.3733%	0.0022%
过去六个月	1.3863%	0.0033%	0.6787%	0.0000%	0.7076%	0.0033%
过去一年	2.7451%	0.0047%	1.3500%	0.0000%	1.3951%	0.0047%
过去三年	13.0127%	0.0123%	4.0500%	0.0000%	8.9627%	0.0123%
自基金合同生效起至今	19.6181%	0.0116%	5.7810%	0.0000%	13.8371%	0.0116%

大成月添利债券 B

阶段	份额净值收益率①	份额净值收益率标准差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	0.7860%	0.0023%	0.3393%	0.0000%	0.4467%	0.0023%
过去六个月	1.5341%	0.0033%	0.6787%	0.0000%	0.8554%	0.0033%
过去一年	3.0416%	0.0047%	1.3500%	0.0000%	1.6916%	0.0047%
过去三年	13.9971%	0.0123%	4.0500%	0.0000%	9.9471%	0.0123%
自基金合同生效起至今	21.1076%	0.0116%	5.7810%	0.0000%	15.3266%	0.0116%

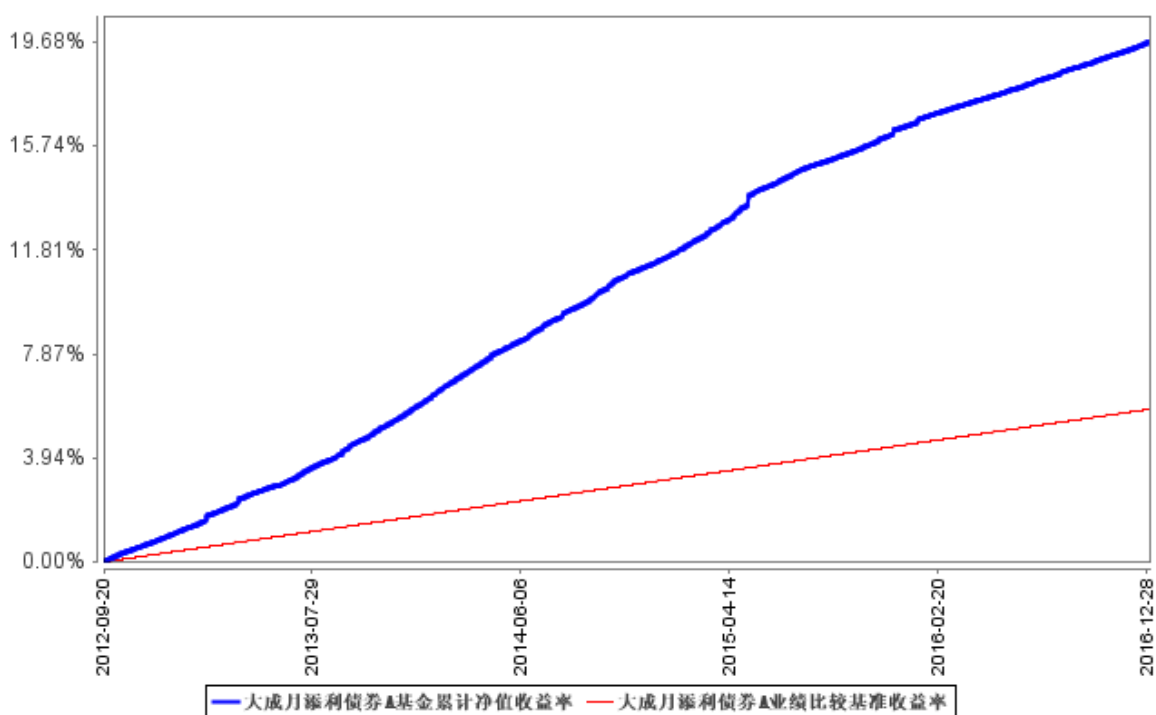
大成月添利债券 E

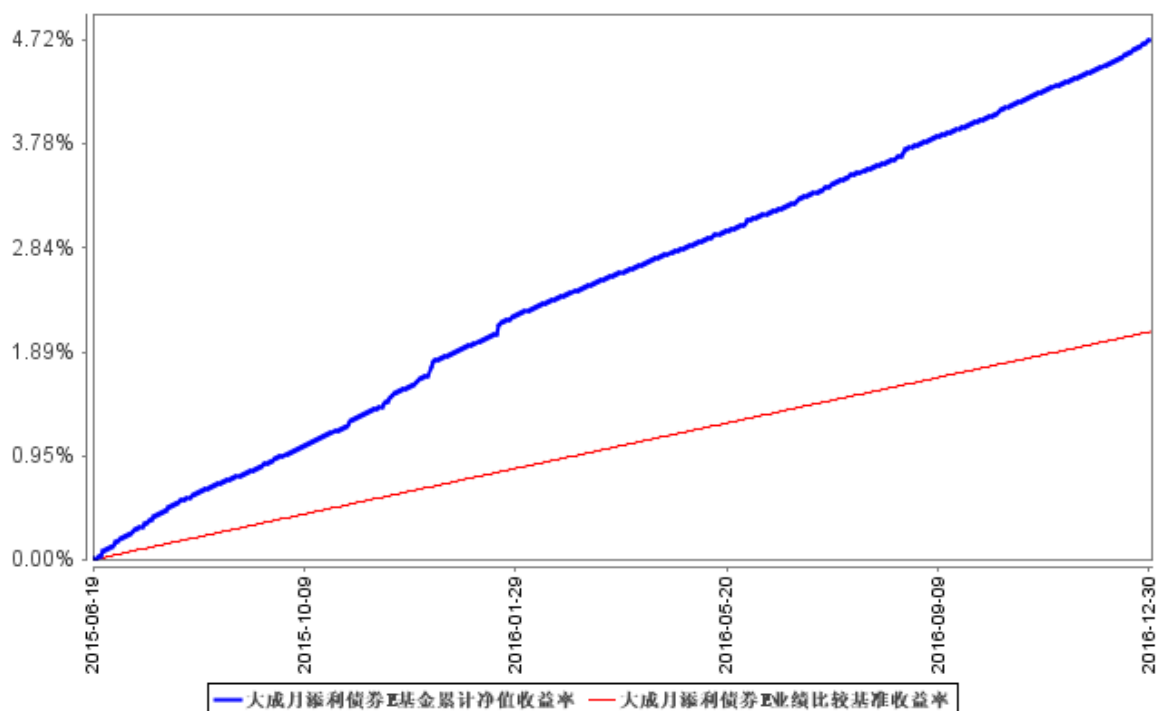
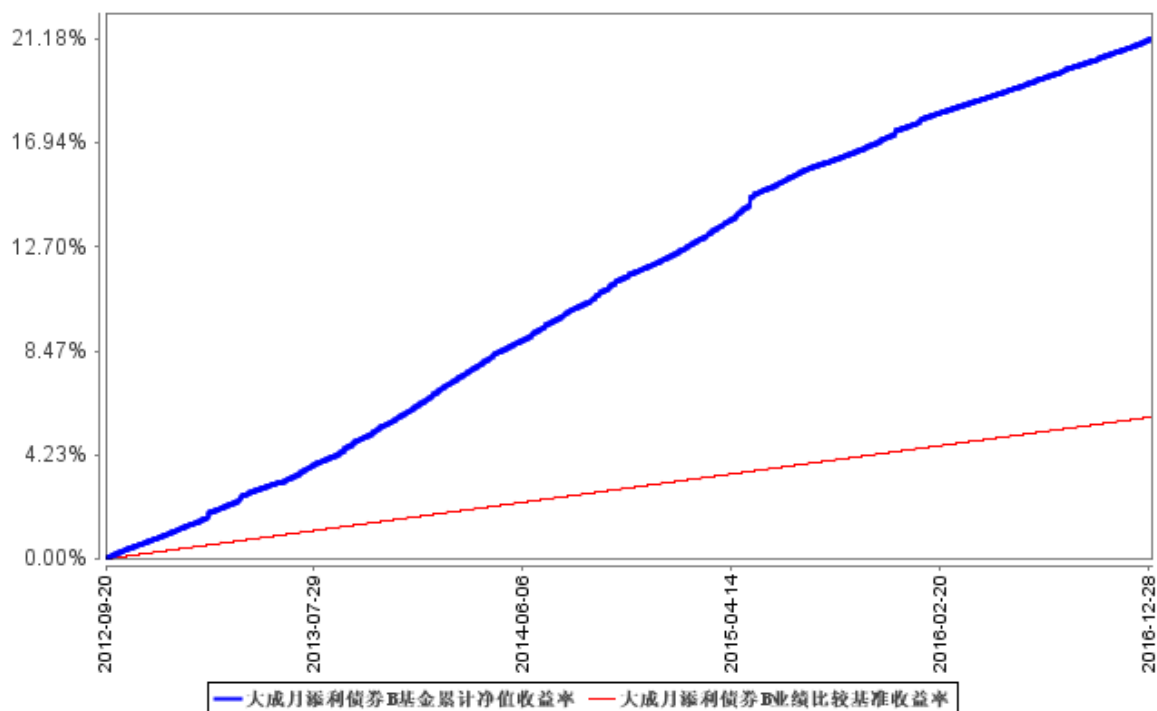
阶段	份额净值 收益率①	份额净值 收益率标 准差②	业绩比较 基准收益 率③	业绩比较基 准收益率标 准差④	①—③	②—④
过去三个月	0.7118%	0.0023%	0.3393%	0.0000%	0.3725%	0.0023%
过去六个月	1.3834%	0.0033%	0.6787%	0.0000%	0.7047%	0.0033%
过去一年	2.7407%	0.0047%	1.3500%	0.0000%	1.3907%	0.0047%
自基金合同 生效起至今	4.7102%	0.0060%	2.0749%	0.0000%	2.6353%	0.0060%

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。

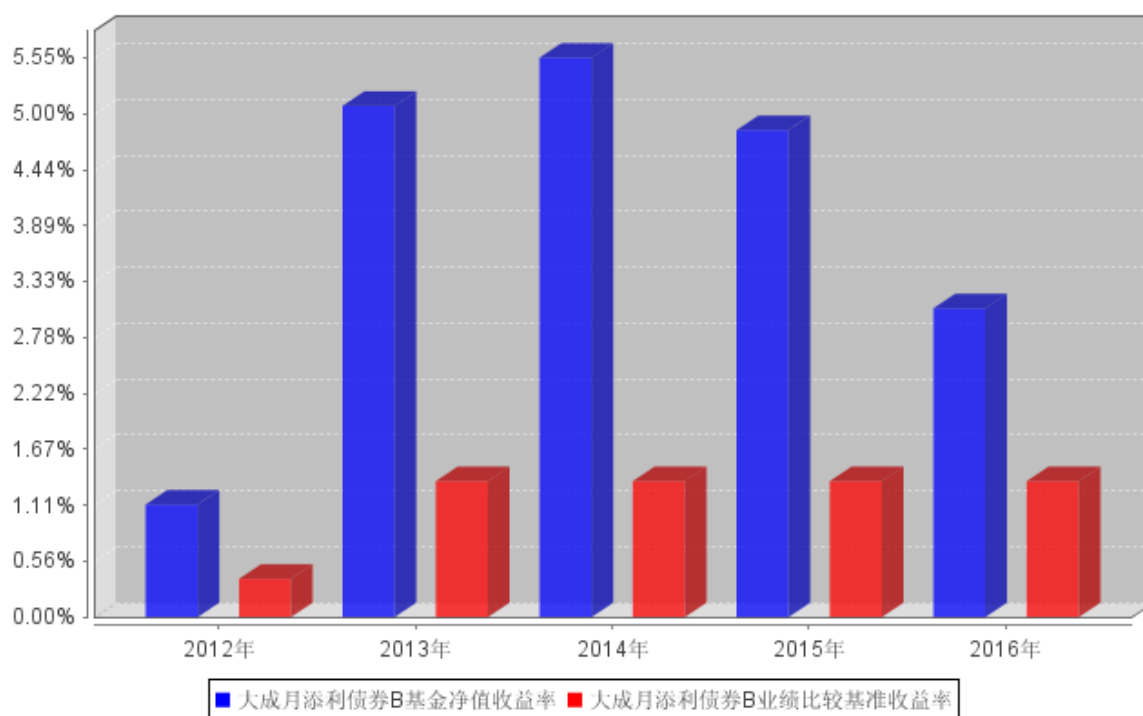
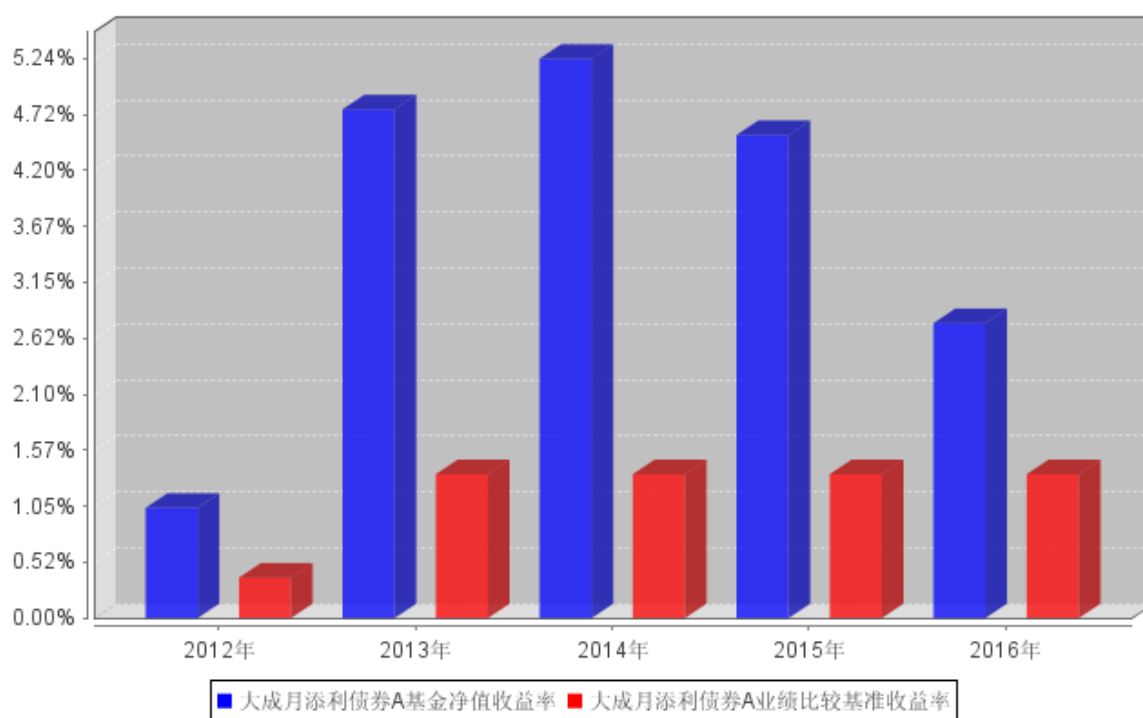
3.2.2 自基金合同生效以来基金累计净值收益率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

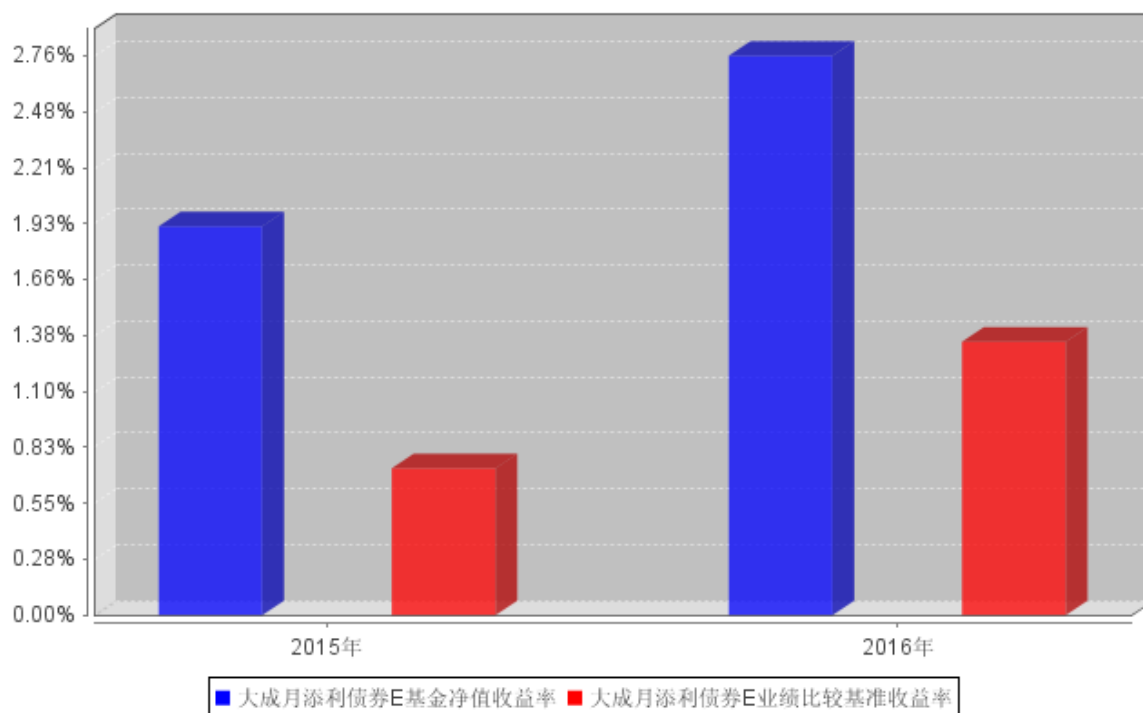




注：按基金合同规定，基金管理人应当自基金合同生效之日起六个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的有关约定。截至报告日本基金的各项投资比例已达到基金合同中规定的各项比例。

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：1、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。

2、本基金于 2015 年 6 月 16 日起增加 E 类份额。

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
2016	4,239,307.17	1,507,736.02	-527,404.27	5,219,638.92	
2015	11,779,392.84	7,257,765.70	-666,883.54	18,370,275.00	
2014	28,095,970.85	21,260,133.10	-5,759,335.25	43,596,768.70	
合计	44,114,670.86	30,025,634.82	-6,953,623.06	67,186,682.62	

单位：人民币元

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
2016	11,347,601.83	1,645,655.48	-494,961.76	12,498,295.55	
2015	31,098,301.02	6,713,083.97	-1,094,438.81	36,716,946.18	
2014	28,630,302.45	12,896,608.36	-1,168,637.37	40,358,273.44	
合计	71,076,205.30	21,255,347.81	-2,758,037.94	89,573,515.17	

单位：人民币元

大成月添利债券 E					
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
2016	621,978.96	2,743,051.00	-619,863.32	2,745,166.64	
2015	166,914.81	870,923.49	641,581.83	1,679,420.13	
2014	-	-	-	-	
合计	788,893.77	3,613,974.49	21,718.51	4,424,586.77	

§ 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。目前公司由三家股东组成，分别为中泰信托有限责任公司(50%)、光大证券股份有限公司(25%)、中国银河投资管理有限公司(25%)。主要业务是公募基金的募集、销售和管理，还具有全国社保基金投资管理、基本养老保险投资管理、受托管理保险资金、保险保障基金投资管理、特定客户资产管理和QDII业务资格。

经过十多年的稳健发展，公司形成了强大稳固的综合实力。公司旗下基金产品齐全、风格多样，构建了涵盖股票型基金、混合型基金、指数型基金、债券型基金和货币市场基金的完备产品线。截至2016年12月31日，本基金管理人共管理5只ETF及1只ETF联接基金，4只QDII基金及68只开放式证券投资基金。

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		
杨雅洁 女士	本基金 基金经 理	2015年3 月21日	-	8年	经济学硕士，2009年8月加入大成基金管理有限公司，曾任固定收益部宏观利率研究员。2013年1月14日至2014年1月10日任大成债券投资基金基金经理助理。2014年1月11日起任大成景旭纯债债券型证券投资基金基金经理。2015年3月21日起任大成月添利理财债券型证券投资基金基金经理。2015年5月22日起任大成景鹏灵活配置混合型证券投资基金基金经理。2016年9月29日起任大成慧成货币市场基金基金经理。2016年9月29日起任大成添益交易型货币市场基金基金经理。2017年1月6日起担任大成景尚灵活配置混合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。

3、陈会荣先生于 2017 年 3 月 22 日起担任本基金基金经理，详见 2017 年 3 月 23 日的变更基金经理公告。

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规情况的说明

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基金合同》和其他有关法律法规的规定，在基金管理运作中，本基金的投资范围、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，公司制订了《大成基金管理有限公司公平交易制度》、《大成基金管理有限公司异常交易监控与报告制度》。公司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 9 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，但不存在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% 的情形；主动投资组合间债券交易存在 2 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

2016 年经济继续底部徘徊，全年 GDP 增长 6.7%，较 2015 年下滑 0.2 个百分点。全年 CPI 同比增长 2%，较 2015 年上升 0.56%。受益于低库存和供给侧改革的推进，PPI 出现大幅反弹，全年下降幅度相较 2015 年趋缓，同比下降 1.3%，单月同比增速已于四季度转为正值，为 2012 年以来首次。全球范围内对超宽松货币政策和负利率的反思使得流动性迎来拐点。中国央行的货币政策取向也从三季度开始发生微妙转变，中央经济工作会议最终定调货币政策“稳健中性”，强调调节好货币闸门，标志着始于 2014 年的宽松货币政策正式转向。

2016 年银行间资金环境整体保持紧平衡，资金利率中枢明显上行。上半年 7 天回购均值为 2.46%，下半年 7 天利率均值升至 2.65%，且资金紧张的阶段明显增多。1 年期金融债从年中最低的 2.24% 上升至 3% 以上，各评级短融从最低点上行 130bp 以上，同业存单四季度大幅上行 200bp。

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 2.7451%，B 类净值收益率为 3.0416%，E 类净值收益率为 2.7618%，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

2017 年全球都面临新的政治周期，全球反思货币政策、重新重视财政政策，以及再通胀或成为新的主题。除宏观基本面方面的不利因素外，2017 年债券市场还面临监管全面加强的考验，央行人士明确要防止金融机构“带病扩张”，防止资金“脱实向虚”、“以钱炒钱”以及不合理的加杠杆行为。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。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。

4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

本报告期内，依据相关的法律法规、基金合同以及内部监察稽核制度，本基金管理人对本基金运作、内部管理、制度执行及遵规守法情况进行了监察稽核。内部监察稽核的重点是：国家法律法规及行业监管规则的执行情况；基金合同的遵守情况；内部规章制度的执行情况；资讯管制和保密工作落实情况；员工职业操守规范情况，目的是规范基金财产的运作，防范和控制投资风险，确保经营业务的稳健运行和受托资产的安全完整，维护本基金份额持有人的合法权益。

（一）根据最新的法律法规、规章、规范性文件，本基金管理人及时制定了相应的公司制度，并对现有制度进行不断修订和完善，确保本基金管理人内控制度的适时性、全面性和合法合规性。同时，为保障制度的适时性，避免部分内控制度、业务规则与业务发展不相适应，报告期内本基金管理人组织各部门对内部管理制度作了进一步梳理和完善。

（二）全面加强风险监控，不断提高基金业务风险管理水平。为督促各部门完善并落实各项内控措施，公司严格执行风险控制管理员制度，健全内控工作协调机制及监督机制，并进一步加强投资风险量化评价能力及事前风险防范能力，有效防范相关业务风险。同时，公司严格执行投资报备制度，建立了基金从业人员证券投资管理监控信息系统，将投资报备工作纳入常态。

（三）日常监察和专项监察相结合，确保监察稽核的有效性和深入性。本年度，公司继续对本基金销售、宣传等方面的材料、协议及其他法律资料等进行了严格审查，对本基金各项投资比例、投资权限、基金交易、股票投资限制、股票库维护等方面进行实时监控，同时，还专门针对基金投资交易（包括公平交易、转债投资、投资权限、投资比例、流动性风险、基金重仓股等）、基金运营（基金头寸、基金结算、登记清算等）、网上交易、基金销售等进行专项监察。通过日常监察，保证了公司监察的全面性、实时性，通过专项监察，及时发现并纠正了业务中的潜在风险，加强了业务部门和人员的风险意识，从而较好地预防了风险的发生。

（四）加强了对投资管理人员通讯工具在交易时间的集中管理，定期或不定期对投资管理人员的网络即时通讯记录、电话录音等进行抽查，有效的防范了各种形式的利益输送行为。

（五）以多种方式加强合规教育与培训，提高全公司的合规守法意识。及时向全公司传达与基金相关的法律法规，并要求公司各部门贯彻到日常工作中。公司监察稽核部通过解答各业务部门提出的法律问题，提供法律依据，对于较为重大疑难法律事项及时咨询公司外部律师或监管部门，避免了业务发展中的盲目性，及时防范风险，维护了基金份额持有人的利益。

4.7 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

收益总部、风险管理部、基金运营部、监察稽核部、社保基金及机构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组合经理。

股票投资部、研究部、固定收益总部、风险管理部和社保基金及机构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。截止报告期末本基金管理人已与中央国债登记结算有限责任公司/中证指数有限公司签署服务协议，由其按约定提供在银行间同业市场交易的债券品种/在交易所市场上市交易或挂牌转让的固定收益品种（估值处理标准另有规定的除外）的估值数据。

4.8 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 20,463,101.11 元，报告期内已分配利润 20,463,101.11 元。

4.9 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

无。

§ 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

在托管本基金的过程中，本基金托管人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基金合同、托管协议的约定，对本基金基金管理人-大成基金管理有限公司 2016 年 1 月 1 日至 2016 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本基金的投资运作、基金资产净值的计算、基金份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本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

审计报告标题	审计报告
审计报告收件人	大成月添利理财债券型证券投资基金全体基金份额持有人
引言段	我们审计了后附的大成月添利理财债券型证券投资基金（以下简称“大成月添利理财基金”）的财务报表，包括 2016 年 12 月 31 日的资产负债表、2016 年度 的利润表和所有者权益（基金净值）变动表以及财务报表附注。
管理层对财务报表的责任段	编制和公允列报财务报表是大成月添利理财基金的基金管理人 大成基金管理有限公司 管理层的责任。这种责任包括： (1) 按照企业会计准则和中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）、中国证券投资基金业协会（以下简称“中国基金业协会”）发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制财务报表，并使其实现公允反映； (2) 设计、执行和维护必要的内部控制，以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。
注册会计师的责任段	我们的责任是在执行审计工作的基础上对财务报表发表审计意见。我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。中国注册会计师审计准则要求我们遵守中国注册会计师职业道德守则，计划和执行审计工作以对财务报表是否不存在重大错报获取合理保证。

	<p>审计工作涉及实施审计程序，以获取有关财务报表金额和披露的审计证据。选择的审计程序取决于注册会计师的判断，包括对由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险的评估。在进行风险评估时，注册会计师考虑与财务报表编制和公允列报相关的内部控制，以设计恰当的审计程序，但目的并非对内部控制的有效性发表意见。审计工作还包括评价管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计的合理性，以及评价财务报表的总体列报。</p> <p>我们相信，我们获取的审计证据是充分、适当的，为发表审计意见提供了基础。</p>
审计意见段	<p>我们认为，上述大成月添利理财基金的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则和在财务报表附注中所列示的中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制，公允反映了大成月添利理财基金 2016 年 12 月 31 日的财务状况以及 2016 年度的经营成果和基金净值变动情况。</p>
注册会计师的姓名	薛竞 俞伟敏
会计师事务所的名称	普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)
会计师事务所的地址	中国上海
审计报告日期	2017 年 3 月 24 日

§ 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：2016 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2016 年 12 月 31 日	上年度末 2015 年 12 月 31 日
资产：			
银行存款	7.4.7.1	270,589,238.99	856,880,427.87
结算备付金		-	-
存出保证金		-	-
交易性金融资产	7.4.7.2	109,704,906.32	887,647,889.54
其中：股票投资		-	-
基金投资		-	-
债券投资		109,704,906.32	887,647,889.54
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	7.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	167,300,690.96	504,102,076.15
应收证券清算款		-	-
应收利息	7.4.7.5	1,608,964.33	7,832,115.75
应收股利		-	-

应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.6	-	-
资产总计		549,203,800.60	2,256,462,509.31
负债和所有者权益	附注号	本期末 2016年12月31日	上年度末 2015年12月31日
负 债:			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	7.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		4,999,872.50	411,999,394.00
应付证券清算款		-	-
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		122,310.73	337,610.00
应付托管费		36,240.23	100,032.63
应付销售服务费		39,335.47	214,685.80
应付交易费用	7.4.7.7	11,003.18	39,828.73
应交税费		-	-
应付利息		940.46	23,855.62
应付利润		442,660.78	2,084,890.13
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.8	204,000.00	194,000.00
负债合计		5,856,363.35	414,994,296.91
所有者权益:			
实收基金	7.4.7.9	543,347,437.25	1,841,468,212.40
未分配利润	7.4.7.10	-	-
所有者权益合计		543,347,437.25	1,841,468,212.40
负债和所有者权益总计		549,203,800.60	2,256,462,509.31

注：报告截止日 2016 年 12 月 31 日，基金份额净值 1.000 元，基金份额总额 543,347,437.25 份，其中 A 类基金份额的份额总额为 117,370,998.32 份，B 类基金份额的份额总额为 407,392,707.39 份，E 类基金份额的份额总额为 18,583,731.54 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：2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2016年1月1日至 2016年12月31日	上年度可比期间 2015年1月1日至 2015年12月31日
一、收入		26,164,880.44	69,891,409.35
1. 利息收入		23,991,566.99	59,955,929.23

其中：存款利息收入	7.4.7.11	7,264,497.96	19,117,698.89
债券利息收入		9,224,331.43	30,043,539.36
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		7,502,737.60	10,794,690.98
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		2,173,313.45	9,935,480.12
其中：股票投资收益	7.4.7.12	-	-
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.13	2,173,313.45	9,935,480.12
资产支持证券投资收益		-	-
贵金属投资收益	7.4.7.14	-	-
衍生工具收益	7.4.7.15	-	-
股利收益	7.4.7.16	-	-
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.17	-	-
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.18	-	-
减：二、费用		5,701,779.33	13,124,768.04
1. 管理人报酬	7.4.10.2.1	1,879,529.82	3,478,159.62
2. 托管费	7.4.10.2.2	556,897.90	1,030,565.86
3. 销售服务费	7.4.10.2.3	895,989.19	1,445,874.01
4. 交易费用	7.4.7.19	-	-
5. 利息支出		1,883,572.10	6,674,681.67
其中：卖出回购金融资产支出		1,883,572.10	6,674,681.67
6. 其他费用	7.4.7.20	485,790.32	495,486.88
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		20,463,101.11	56,766,641.31
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		20,463,101.11	56,766,641.31

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：2016年1月1日至2016年12月31日

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016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	1,841,468,212.40	-	1,841,468,212.40

(基金净值)			
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	20,463,101.11	20,463,101.11
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)	-1,298,120,775.15	-	-1,298,120,775.15
其中:1.基金申购款	1,006,827,074.88	-	1,006,827,074.88
2.基金赎回款	-2,304,947,850.03	-	-2,304,947,850.03
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)	-	-20,463,101.11	-20,463,101.11
五、期末所有者权益(基金净值)	543,347,437.25	-	543,347,437.25
项目	上年度可比期间 2015年1月1日至2015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)	1,769,256,985.59	-	1,769,256,985.59
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	56,766,641.31	56,766,641.31
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)	72,211,226.81	-	72,211,226.81
其中:1.基金申购款	4,166,350,618.46	-	4,166,350,618.46
2.基金赎回款	-4,094,139,391.65	-	-4,094,139,391.65
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)	-	-56,766,641.31	-56,766,641.31
五、期末所有者权益(基金净值)	1,841,468,212.40	-	1,841,468,212.40

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:

罗登攀
基金管理人负责人

周立新
主管会计工作负责人

周立新
会计机构负责人

7.4 报表附注

7.4.1 基金基本情况

大成月添利理财债券型证券投资基金(以下简称“本基金”)经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2012]第 1155 号《关于核准大成月添利理财债券型证券投资基金募集的批复》核准,由大成基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《大成月添利理财债券型证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式,存续期限不定,首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币 5,117,943,444.16 元,业经普华永道中天会计师事务所有限公司普华永道中天验字(2012)第 369 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《大成月添利理财债券型证券投资基金基金合同》于 2012 年 9 月 20 日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为 5,118,524,089.71 份基金份额,其中认购资金利息折合 580,645.55 份基金份额。本基金的基金管理人为大成基金管理有限公司,基金托管人为中国农业银行股份有限公司。

本基金根据投资者认(申)购本基金的金额,对投资者持有的基金份额按照不同的费率计提销售服务费用,因此形成 A 级、B 级和 E 级三级基金份额,三级基金份额分别设置基金代码,并单独公布每万份基金净收益和 7 日年化收益率。本基金每份基金份额自基金合同生效日或申购确认日起每个月为一个运作期,运作期到期日前不得赎回。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《大成月添利理财债券型证券投资基金基金合同》的有关规定,本基金的投资范围为法律法规及监管机构允许投资的金融工具,包括现金,通知存款,短期融资券,一年以内(含一年)的银行定期存款、大额存单,期限在一年以内(含一年)的债券回购,期限在一年以内(含一年)的中央银行票据,剩余期限(或回售期限)在 397 天以内(含 397 天)的债券、资产支持证券、中期票据,中国证监会认可的其他具有良好流动性的固定收益类金融工具。本基金投资业绩比较基准为:七天通知存款税后利率。

本财务报表由本基金的基金管理人大成基金管理有限公司于 2017 年 3 月 24 日批准报出。

7.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于 2006 年 2 月 15 日及以后期间颁布的《企业会计准则—基本准则》、各项具体会计准则及相关规定(以下合称“企业会计准则”)、中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和半年度报告>》、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《大成月添利理财债券型证券投资基金基金合同》和在财务报表附注 7.4.4 所列示的中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2016 年度 财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金 2016 年 12 月 31 日 的财务状况以及 2016 年度的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

7.4.4 重要会计政策和会计估计

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一致。

7.4.4.1 会计年度

本基金会计年度为公历 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

7.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

(1) 金融资产的分类

金融资产于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、应收款项、可供出售金融资产及持有至到期投资。金融资产的分类取决于本基金对金融资产的持有意图和持有能力。本基金现无金融资产分类为可供出售金融资产及持有至到期投资。

本基金目前以交易目的持有的债券投资和资产支持证券投资分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。以公允价值计量且其公允价值变动计入损益的金融资产在资产负债表 中以交易性金融资产列示。

本基金持有的其他金融资产分类为应收款项，包括银行存款、买入返售金融资产和其他各类 应收款项等。应收款项是指在活跃市场中没有报价、回收金额固定或可确定的非衍生金融资产。

(2) 金融负债的分类

金融负债于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债及其他金 融负债。本基金目前暂无金融负债分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。本 基金持有的其他金融负债包括卖出回购金融资产款和其他各类应付款项等。

7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

金融资产或金融负债于本基金成为金融工具合同的一方时，于交易日按公允价值在资产负债 表内确认。对于取得债券投资支付的价款中包含的债券起息日或上次除息日至购买日止的利息， 单独确认为应收项目。应收款项和其他金融负债的相关交易费用计入初始确认金额。

债券投资按票面利率或商定利率每日计提应收利息，按实际利率法在其剩余期限内摊销其买

入时的溢价或折价；同时于每一计价日计算影子价格，以避免债券投资的账面价值与公允价值的差异导致基金资产净值发生重大偏离。对于应收款项和其他金融负债采用实际利率法，以摊余成本进行后续计量。

金融资产满足下列条件之一的，予以终止确认：(1) 收取该金融资产现金流量的合同权利终止；(2) 该金融资产已转移，且本基金将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方；或者(3) 该金融资产已转移，虽然本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬，但是放弃了对该金融资产控制。

金融资产终止确认时，其账面价值与收到的对价的差额，计入当期损益。

当金融负债的现时义务全部或部分已经解除时，终止确认该金融负债或义务已解除的部分。终止确认部分的账面价值与支付的对价之间的差额，计入当期损益。

7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

为了避免债券投资的账面价值与公允价值的差异导致基金资产净值发生重大偏离，从而对基金持有人的利益产生稀释或不公平的结果，基金管理人于每一计价日采用债券投资的公允价值计算影子价格。当影子价格确定的基金资产净值与摊余成本法计算的基金资产净值的偏离度绝对值达到或超过 0.25%时，基金管理人应根据相关法律法规采取相应措施，使基金资产净值更能公允地反映基金投资组合价值。

计算影子价格时按如下原则确定债券投资的公允价值：

(1) 存在活跃市场的金融工具按其估值日的市场交易价格确定公允价值；估值日无交易，但最近交易日后经济环境未发生重大变化且证券发行机构未发生影响证券价格的重大事件的，按最近交易日的市场交易价格确定公允价值。

(2) 存在活跃市场的金融工具，如估值日无交易且最近交易日后经济环境发生了重大变化，参考类似投资品种的现行市价及重大变化等因素，调整最近交易市价以确定公允价值。

(3) 当金融工具不存在活跃市场，采用市场参与者普遍认同且被以往市场实际交易价格验证具有可靠性的估值技术确定公允价值。估值技术包括参考熟悉情况并自愿交易的各方最近进行的市场交易中使用的价格、参照实质上相同的其他金融工具的当前公允价值、现金流量折现法和期权定价模型等。采用估值技术时，尽可能最大程度使用市场参数，减少使用与本基金特定相关的参数。

7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

本基金持有的资产和承担的负债基本为金融资产和金融负债。当本基金 1) 具有抵销已确认

金额的法定权利且该种法定权利现在是可执行的；且 2) 交易双方准备按净额结算时，金融资产与金融负债按抵销后的净额在资产负债表中列示。

7.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行基金份额所募集的总金额。每份基金份额面值为 1.00 元。由于申购和赎回引起的实收基金变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日认列。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少，以及因类别调整而引起的 A、B、E 类基金份额之间的转换所产生的实收基金变动。

7.4.4.8 收入/(损失)的确认和计量

债券投资在持有期间按实际利率计算确定的金额扣除在适用情况下由债券发行企业代扣代缴的个人所得税后的净额确认为利息收入。

债券投资处置时其处置价格扣除相关交易费用后的净额与账面价值之间的差额确认为投资收益。

应收款项在持有期间确认的利息收入按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

7.4.4.9 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬、托管费和销售服务费在费用涵盖期间按基金合同约定的费率和计算方法逐日确认。

其他金融负债在持有期间确认的利息支出按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的也可按直线法计算。

7.4.4.10 基金的收益分配政策

本基金每一级基金份额享有同等分配权。申购的基金份额享有确认当日的分红权益，而赎回的基金份额不享有确认当日的分红权益。本基金以份额面值 1.00 元固定份额净值交易方式，每日计算当日收益并全部分配结转至应付收益科目，每个运作期末以红利再投资方式集中支付累计收益。

7.4.4.11 分部报告

本基金以内部组织结构、管理要求、内部报告制度为依据确定经营分部，以经营分部为基础确定报告分部并披露分部信息。

经营分部是指本基金内同时满足下列条件的组成部分：(1) 该组成部分能够在日常活动中产

生收入、发生费用；(2) 本基金的基金管理人能够定期评价该组成部分的经营成果，以决定向其配置资源、评价其业绩；(3) 本基金能够取得该组成部分的财务状况、经营成果和现金流量等有关会计信息。如果两个或多个经营分部具有相似的经济特征，并且满足一定条件的，则合并为一个经营分部。

本基金目前以一个单一的经营分部运作，不需要披露分部信息。

7.4.4.12 其他重要的会计政策和会计估计

根据本基金的估值原则和中国证监会允许的基金行业估值实务操作，本基金计算影子价格过程中确定债券投资的公允价值时采用的估值方法及其关键假设如下：

在银行间同业市场交易的债券品种，根据中国证监会证监会计字[2007]21号《关于证券投资基金执行〈企业会计准则〉估值业务及份额净值计价有关事项的通知》采用估值技术确定公允价值。本基金持有的银行间同业市场债券按现金流量折现法估值，具体估值模型、参数及结果由中央国债登记结算有限责任公司独立提供。

7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

7.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期未发生会计政策变更。

7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

7.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

7.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2004]78号《财政部、国家税务总局关于证券投资基金税收政策的通知》、财税[2008]1号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2016]36号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1) 于 2016 年 5 月 1 日前，以发行基金方式募集资金不属于营业税征收范围，不征收营业税。对证券投资基金管理人运用基金买卖债券的差价收入免征营业税。自 2016 年 5 月 1 日起，金融业由缴纳营业税改为缴纳增值税。对证券投资基金管理人运用基金买卖债券的转让收入免征增值

税，对国债、地方政府债以及金融同业往来利息收入亦免征增值税。

(2)对基金从证券市场中取得的收入，包括买卖债券的差价收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

(3)对基金取得的企业债券利息收入，应由发行债券的企业在向基金支付利息时代扣代缴 20% 的个人所得税。

7.4.7 重要财务报表项目的说明

7.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2016 年 12 月 31 日	上年度末 2015 年 12 月 31 日
活期存款	4,589,238.99	1,880,427.87
定期存款	-	150,000,000.00
其中：存款期限 1-3 个月	-	-
其中：存款期限 3 个月至 1 年	-	150,000,000.00
其他存款	266,000,000.00	705,000,000.00
合计：	270,589,238.99	856,880,427.87

注：1、定期存款的存款期限为定期存款的票面存期。

2、其他存款为根据协议可提前支取且没有利息损失的协议存款。

7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末 2016 年 12 月 31 日			
		摊余成本	影子定价	偏离金额	偏离度
债券	交易所市场	-	-	-	0.0000%
	银行间市场	109,704,906.32	109,359,000.00	-345,906.32	-0.0637%
	合计	109,704,906.32	109,359,000.00	-345,906.32	-0.0637%
项目		上年度末 2015 年 12 月 31 日			
		摊余成本	影子定价	偏离金额	偏离度
债券	交易所市场	-	-	-	0.0000%

银行间市场	887,647,889.54	889,356,000.00	1,708,110.46	0.0928%
合计	887,647,889.54	889,356,000.00	1,708,110.46	0.0928%

注：1. 偏离金额=影子定价-摊余成本；

2. 偏离度=偏离金额/摊余成本法确定的基金资产净值。

7.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末及上年度末未持有衍生金融工具。

7.4.7.4 买入返售金融资产

7.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

单位：人民币元

项目	本期末 2016年12月31日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
买入返售证券_银行间	167,300,690.96	-
合计	167,300,690.96	-
项目	上年度末 2015年12月31日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
买入返售证券_银行间	504,102,076.15	-
合计	504,102,076.15	-

7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末及上年度末未持有买断式逆回购交易中取得的债券。

7.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2016年12月31日	上年度末 2015年12月31日
应收活期存款利息	1,592.38	2,247.83
应收定期存款利息	-	486,527.60
应收其他存款利息	476,033.39	2,305,999.83
应收结算备付金利息	-	-
应收债券利息	763,278.07	4,167,382.96
应收买入返售证券利息	368,060.49	869,957.53
应收申购款利息	-	-
应收黄金合约拆借孳息	-	-
其他	-	-
合计	1,608,964.33	7,832,115.75

7.4.7.6 其他资产

本基金本报告期末及上年度末未持有其他资产。

7.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2016 年 12 月 31 日	上年度末 2015 年 12 月 31 日
交易所市场应付交易费用	-	-
银行间市场应付交易费用	11,003.18	39,828.73
合计	11,003.18	39,828.73

7.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2016 年 12 月 31 日	上年度末 2015 年 12 月 31 日
应付券商交易单元保证金	-	-
应付赎回费	-	-
预提费用	204,000.00	194,000.00
应付其他	-	-
合计	204,000.00	194,000.00

7.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

大成月添利债券 A		
项目	本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	491,424,715.22	491,424,715.22
本期申购	247,078,175.17	247,078,175.17
本期赎回（以“-”号填列）	-621,131,892.07	-621,131,892.07
本期末	117,370,998.32	117,370,998.32

金额单位：人民币元

大成月添利债券 B		
项目	本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	692,153,122.49	692,153,122.49
本期申购	311,375,489.92	311,375,489.92
本期赎回（以“-”号填列）	-596,135,905.02	-596,135,905.02
本期末	407,392,707.39	407,392,707.39

金额单位：人民币元

大成月添利债券 E		
项目	本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	657,890,374.69	657,890,374.69
本期申购	448,373,409.79	448,373,409.79
本期赎回(以“-”号填列)	-1,087,680,052.94	-1,087,680,052.94
本期末	18,583,731.54	18,583,731.54

注：申购含红利再投、转换入、级别调整入份额；赎回含转换出、级别调整出。

7.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

大成月添利债券 A			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-	-	-
本期利润	5,219,638.92	-	5,219,638.92
本期基金份额交易产生的变动数	-	-	-
其中：基金申购款	-	-	-
基金赎回款	-	-	-
本期已分配利润	-5,219,638.92	-	-5,219,638.92
本期末	-	-	-

单位：人民币元

大成月添利债券 B			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-	-	-
本期利润	12,498,295.55	-	12,498,295.55
本期基金份额交易产生的变动数	-	-	-
其中：基金申购款	-	-	-
基金赎回款	-	-	-
本期已分配利润	-12,498,295.55	-	-12,498,295.55
本期末	-	-	-

单位：人民币元

大成月添利债券 E			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-	-	-
本期利润	2,745,166.64	-	2,745,166.64
本期基金份额交易产生的变动数	-	-	-
其中：基金申购款	-	-	-
基金赎回款	-	-	-

本期已分配利润	-2,745,166.64	-	-2,745,166.64
本期末	-	-	-

7.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2016年1月1日至2016年12月31日	2015年1月1日至2015年12月31日
活期存款利息收入	72,882.03	50,015.59
定期存款利息收入	1,300,694.66	566,277.60
其他存款利息收入	-	-
结算备付金利息收入	1,353.04	392.39
其他	5,889,568.23	18,501,013.31
合计	7,264,497.96	19,117,698.89

7.4.7.12 股票投资收益

7.4.7.12.1 股票投资收益——买卖股票差价收入

本报告期内及上年度可比期间本基金无股票投资收益。

7.4.7.13 债券投资收益

7.4.7.13.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2016年1月1日至2016年12月31日	2015年1月1日至2015年12月31日
债券投资收益——买卖债券（、债转股及债券到期兑付）差价收入	2,173,313.45	9,935,480.12
债券投资收益——赎回差价收入	-	-
债券投资收益——申购差价收入	-	-
合计	2,173,313.45	9,935,480.12

7.4.7.13.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2016年1月1日至2016年12月31日	2015年1月1日至2015年12月31日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	1,751,177,876.99	2,983,405,004.91
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	1,738,893,910.49	2,920,749,321.35
减：应收利息总额	10,110,653.05	52,720,203.44
买卖债券差价收入	2,173,313.45	9,935,480.12

7.4.7.13.3 资产支持证券投资收益

本报告期内及上年度可比期间本基金无资产支持证券投资收益。

7.4.7.14 贵金属投资收益**7.4.7.14.1 贵金属投资收益项目构成**

本报告期内及上年度可比期间本基金无贵金属投资。

7.4.7.14.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

本报告期内及上年度可比期间本基金无贵金属投资。

7.4.7.14.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

本报告期内及上年度可比期间本基金无贵金属投资。

7.4.7.14.4 贵金属投资收益——申购差价收入

本报告期内及上年度可比期间本基金无贵金属投资。

7.4.7.15 衍生工具收益

本报告期内及上年度可比期间本基金无衍生工具收益。

7.4.7.16 股利收益

本报告期内及上年度可比期间本基金无股利收益。

7.4.7.17 公允价值变动收益

本报告期内及上年度可比期间本基金无公允价值变动收益。

7.4.7.18 其他收入

本报告期内及上年度可比期间本基金无其他收入。

7.4.7.19 交易费用

本报告期内及上年度可比期间本基金无交易费用。

7.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016 年12月31日	上年度可比期间 2015年1月1日至2015 年12月31日
审计费用	95,000.00	85,000.00
信息披露费	300,000.00	300,000.00
其他	1,400.00	1,006.18

银行划款手续费	53,390.32	73,480.70
债券托管帐户维护费	36,000.00	36,000.00
合计	485,790.32	495,486.88

7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

7.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金并无须作披露的或有事项。

7.4.8.2 资产负债表日后事项

财政部、国家税务总局于 2016 年 12 月 21 日颁布《关于明确金融 房地产开发 教育辅助服务等增值税政策的通知》(财税[2016]140 号)，要求资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人，自 2016 年 5 月 1 日起执行。

根据财政部、国家税务总局于 2017 年 1 月 6 日颁布的《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》(财税[2017]2 号)，2017 年 7 月 1 日(含)以后，资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人，按照现行规定缴纳增值税。对资管产品在 2017 年 7 月 1 日前运营过程中发生的增值税应税行为，未缴纳增值税的，不再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从资管产品管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。资管产品运营过程中发生增值税应税行为的具体征收管理办法，由国家税务总局另行制定。上述税收政策对本基金截至本财务报表批准报出日止的财务状况和经营成果无影响。

7.4.9 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、基金销售机构
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、基金销售机构
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(2016 年 4 月 25 日前)
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”)	基金管理人的合营企业

注：1. 根据本基金管理人大成基金管理有限公司(以下简称“大成基金”)董事会及股东会的有关决议，大成基金原股东广东证券股份有限公司将所持大成基金 2%股权以拍卖竞买的方式转让给大成基金股东中泰信托有限责任公司。上述股权变更及修改《大成基金管理有限公司公司章程》的工商变更手续已于 2016 年 4 月 25 日在深圳市市场监督管理局办理完毕。

2. 下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.10.1 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。

7.4.10.2 关联方报酬

7.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至 2016年12月31日	上年度可比期间 2015年1月1日至2015 年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	1,879,529.82	3,478,159.62
其中：支付销售机构的客户维护费	287,335.60	549,584.62

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。

7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年12 月31日	上年度可比期间 2015年1月1日至2015 年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	556,897.90	1,030,565.86

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。

7.4.10.2.3 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 2016年1月1日至2016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	大成月添利债券 E	合计
大成基金	289,641.88	31,890.83	37,986.67	359,519.38
中国农业银行	-	278,646.47	2,640.71	281,287.18
合计	289,641.88	310,537.30	40,627.38	640,806.56
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2015年1月1日至2015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	大成月添利债券 E	合计
大成基金	134,568.91	77,354.62	138,174.73	350,098.26
中国农业银行	696,211.75	5,496.57	-	701,708.32
合计	830,780.66	82,851.19	138,174.73	1,051,806.58

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、B类基金份额和E类基金份额约定的销售服务费年费率分别为0.30%、0.01%和0.03%。销售服务费的计算公式为：

对应级别日销售服务费 = 前一日对应级别基金资产净值 × 约定年费率 / 当年天数。

7.4.10.3 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 2016年1月1日至2016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	-	-	-	-	80,000,000.00	4,667.40
上年度可比期间 2015年1月1日至2015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	10,143,667.32	30,182,535.25	-	-	140,000,000.00	10,193.29

7.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

7.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

无。

7.4.10.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

无。

7.4.10.5 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 2016年1月1日至2016年12月31日		上年度可比期间 2015年1月1日至2015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	4,589,238.99	72,882.03	1,880,427.87	50,015.59

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。

7.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本报告期内及上年度可比期间本基金未在承销期内参与关联方承销证券。

7.4.10.7 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。

7.4.11 利润分配情况

7.4.11.1 利润分配情况——货币市场基金

金额单位：人民币元

大成月添利债券A

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	本期利润分配合 计	备注
4,239,307.17	1,507,736.02	-527,404.27	5,219,638.92	-

大成月添利债券B

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	本期利润分配合 计	备注
11,347,601.83	1,645,655.48	-494,961.76	12,498,295.55	-

大成月添利债券E

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	本期利润分配合 计	备注
621,978.96	2,743,051.00	-619,863.32	2,745,166.64	-

7.4.12 期末（2016年12月31日）本基金持有的流通受限证券

7.4.12.1 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。

7.4.12.2 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。

7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末2016年12月31日止，本基金从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额4,999,872.50元，是以如下债券作为抵押：

金额单位：人民币元

债券代码	债券名称	回购到期日	期末估值单价	数量（张）	期末估值总额
160201	16国开 01	2017年1月3日	99.99	50,000	4,999,747.07
合计				50,000	4,999,747.07

7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

于本报告期末，本基金无从事交易所市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

7.4.13 金融工具风险及管理

7.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金为债券型基金，属于较低风险品种。本基金投资的金融工具主要为存款和债券投资等。本基金在日常经营活动中面临的与这些金融工具相关的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金的基金管理人从事风险管理的主要目标是争取将以上风险控制在限定的范围之内，使本基金在风险和收益之间取得最佳的平衡以实现“风险收益水平高于货币市场基金而低于混合基金和股票基金，追求高于业绩比较基准的稳定收益”的投资目标。

本基金的基金管理人奉行全面风险管理体系的建设，建立了以由高层监控(合规与风险管理委员会、公司投资风险控制委员会)、专业监控(监察稽核部、风险管理部)、部门互控、岗位自控构成的风险管理架构体系。本基金的基金管理人在董事会下设立合规与风险管理委员会，对公司整体运营风险进行监督，监督风险控制措施的执行；在管理层层面设立投资风险控制委员会，通过定期会议讨论涉及投资风险的重大议题，形成正式决议提交投委会；在业务操作层面，监察稽核部履行合规控制职责，通过定期、不定期检查内控制度的执行情况、对重大风险点以专项稽核的方式确保公司内控制度、流程得到贯彻执行。风险管理部履行风险量化评估分析职责。

本基金的基金管理人对于金融工具的风险管理方法主要是通过定性分析和定量分析的方法去估测各种风险产生的可能损失。从定性分析的角度出发，判断风险损失的严重程度和出现同类风险损失的频度。而从定量分析的角度出发，根据本基金的投资目标，结合基金资产所运用金融工具特征通过特定的风险量化指标、模型，日常的量化报告，确定风险损失的限度和相应置信程度，及时可靠地对各种风险进行监督、检查和评估，并通过相应决策，将风险控制在可承受的范围内。

7.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息等情况，导致基金资产损失和收益变化的风险。

本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的银行存款存放在本基金的托管行中国农业银行，定期存款存放在包商银行股份有限公司，其他协议存款存放在浦发银行股份有限公司、上海银行股份有限公司、交通银行股份有限公司、平安银行股份有限公司、中信银行股份有限公司、民生银行股份有限公司、北京银行股份有限公司、兴业银行股份有限公司、广发银行股份有限公司、光大银行股份有限公司、华夏银行股份有限公司和江苏银

行股份有限公司，与银行存款相关的信用风险不重大。本基金在交易所进行的交易均以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，违约风险可能性很小；在银行间同业市场进行交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式进行限制以控制相应的信用风险。

本基金的基金管理人建立了信用风险管理流程，通过对投资品种信用等级评估来控制证券发行人的信用风险，且通过分散化投资以分散信用风险。

本基金债券投资的信用评级情况按《中国人民银行信用评级管理指导意见》设定的标准统计及汇总。

7.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2016年12月31日	上年度末 2015年12月31日
A-1	29,984,871.12	160,002,810.43
A-1 以下	-	-
未评级	79,720,035.20	707,614,287.81
合计	109,704,906.32	867,617,098.24

注：上述未评级债券为短期融资券、同业存单或政策性金融债券。

7.4.13.2.2 按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2016年12月31日	上年度末 2015年12月31日
AAA	-	-
AAA 以下	-	-
未评级	-	20,030,791.30
合计	-	20,030,791.30

注：上述未评级债券为政策性金融债券。

7.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金所持金融工具变现的难易程度。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难或因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理的价格变现。

针对兑付赎回资金的流动性风险，本基金的基金管理人每日对本基金的申购赎回情况进行严密监控并预测流动性需求，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配。本基金的基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。

针对投资品种变现的流动性风险，本基金的基金管理人主要通过限制、跟踪和控制基金投资交易的不活跃品种(企业债或短期融资券)来实现。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，且能够通过出售所持有的银行间同业市场交易债券应对流动性需求。此外本基金还可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，除发生巨额赎回情形外，债券正回购的资金余额在每个交易日均不得超过基金资产净值的 40%。

于 2016 年 12 月 31 日，除卖出回购金融资产款余额 4,999,872.50 元将在一个月内到期且计息(该利息金额不重大)外，本基金所承担的其他金融负债的合同约定到期日均为一个月以内且不计息，因此账面余额约为未折现的合约到期现金流量。

7.4.13.4 市场风险

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动而发生波动的风险，包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

7.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指金融工具的公允价值或现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。利率敏感性金融工具均面临由于市场利率上升而导致公允价值下降的风险，其中浮动利率类金融工具还面临每个付息期间结束根据市场利率重新定价时对于未来现金流影响的风险。

本基金主要投资于银行间同业市场交易的固定收益品种，因此存在相应的利率风险。本基金的基金管理人每日通过“影子定价”对本基金面临的市场风险进行监控，定期对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控，并通过调整投资组合的久期等方法对上述利率风险进行管理。

7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2016 年 12 月 31 日	6 个月以内	6 个月-1 年	1-5 年	5 年 以上	不计息	合计
资产						
银行存款	270,589,238.99	-	-	-	-	270,589,238.99
交易性金融 资产	79,720,035.20	29,984,871.12	-	-	-	109,704,906.32
买入返售金 融资产	167,300,690.96	-	-	-	-	167,300,690.96
应收利息	-	-	-	-	1,608,964.33	1,608,964.33
其他资产	-	-	-	-	-	-
资产总计	517,609,965.15	29,984,871.12	-	-	1,608,964.33	549,203,800.60
负债						

卖出回购金 融资产款	4,999,872.50	-	-	-	-	4,999,872.50
应付管理人 报酬	-	-	-	-	122,310.73	122,310.73
应付托管费	-	-	-	-	36,240.23	36,240.23
应付销售服 务费	-	-	-	-	39,335.47	39,335.47
应付交易费 用	-	-	-	-	11,003.18	11,003.18
应付利息	-	-	-	-	940.46	940.46
应付利润	-	-	-	-	442,660.78	442,660.78
其他负债	-	-	-	-	204,000.00	204,000.00
负债总计	4,999,872.50	-	-	-	856,490.85	5,856,363.35
利率敏感度 缺口	512,610,092.65	29,984,871.12	-	-	752,473.48	543,347,437.25
上年度末 2015年12 月31日	6个月以内	6个月-1年	1-5年	5年 以上	不计息	合计
资产						
银行存款	856,880,427.87	-	-	-	-	856,880,427.87
交易性金融 资产	577,761,697.69	309,886,191.85	-	-	-	887,647,889.54
买入返售金 融资产	504,102,076.15	-	-	-	-	504,102,076.15
应收利息	-	-	-	-	7,832,115.75	7,832,115.75
资产总计	1,938,744,201.71	309,886,191.85	-	-	7,832,115.75	2,256,462,509.31
负债						
卖出回购金 融资产款	411,999,394.00	-	-	-	-	411,999,394.00
应付管理人 报酬	-	-	-	-	337,610.00	337,610.00
应付托管费	-	-	-	-	100,032.63	100,032.63
应付销售服 务费	-	-	-	-	214,685.80	214,685.80
应付交易费 用	-	-	-	-	39,828.73	39,828.73
应付利润	-	-	-	-	2,084,890.13	2,084,890.13
应付利息	-	-	-	-	23,855.62	23,855.62
其他负债	-	-	-	-	194,000.00	194,000.00
负债总计	411,999,394.00	-	-	-	2,994,902.91	414,994,296.91
利率敏感度 缺口	1,526,744,807.71	309,886,191.85	-	-	4,837,212.84	1,841,468,212.40

注：表中所示为本基金资产及负债的账面价值，并按照合同约定的利率重新定价日或到期日孰早

予以分类。

7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	除市场利率以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2016年12月31日）	上年度末（2015年12月31日）
	1. 市场利率下降 25 个基点	80,000.00	910,000.00
2. 市场利率上升 25 个基点	-70,000.00	-910,000.00	

7.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无重大外汇风险。

7.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于银行间同业市场交易的固定收益品种，因此无重大市场价格风险。

7.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

(1) 公允价值

(a) 金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属的层次，由对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次决定：

第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

(b) 持续的以公允价值计量的金融工具

(i) 各层次金融工具公允价值

于 2016 年 12 月 31 日，本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产中属于第二层次的余额为 109,704,906.32 元，无属于第一或第三层次的余额(2015 年 12 月 31 日，第二层次的余额为 887,647,889.54 元，无属于第一或第三层次的余额)。

(ii) 公允价值所属层次间的重大变动

本基金本期及上年度可比期间持有的以公允价值计量的金融工具的公允价值所属层次未发生重大变动。

(iii) 第三层次公允价值余额和本期变动金额

无。

(c) 非持续的以公允价值计量的金融工具

于 2016 年 12 月 31 日，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产(2015 年 12 月 31 日：未持有)。

(d) 不以公允价值计量的金融工具

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括应收款项和其他金融负债，其账面价值与公允价值相差很小。

(2) 除公允价值外，截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

§ 8 投资组合报告

8.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	固定收益投资	109,704,906.32	19.98
	其中：债券	109,704,906.32	19.98
	资产支持证券	-	0.00
2	买入返售金融资产	167,300,690.96	30.46
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	0.00
3	银行存款和结算备付金合计	270,589,238.99	49.27
4	其他各项资产	1,608,964.33	0.29
5	合计	549,203,800.60	100.00

8.2 债券回购融资情况

金额单位：人民币元

序号	项目	占基金资产净值的比例 (%)	
1	报告期内债券回购融资余额	10.74	
	其中：买断式回购融资	0.00	
序号	项目	金额	占基金资产净值的比例 (%)
2	报告期末债券回购融资余额	4,999,872.50	0.92
	其中：买断式回购融资	-	0.00

注：报告期内债券回购融资余额占基金资产净值的比例为报告期内每个交易日融资余额占资产净值比例的简单平均值。

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值的 40%”。本报告期内，本基金未发生超标情况。

8.3 基金投资组合平均剩余期限

8.3.1 投资组合平均剩余期限基本情况

项目	天数
报告期末投资组合平均剩余期限	60
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	122
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	36

报告期内投资组合平均剩余期限超过 120 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，本基金未发生超标情况。

8.3.2 期末投资组合平均剩余期限分布比例

序号	平均剩余期限	各期限资产占基金资产净值的比例 (%)	各期限负债占基金资产净值的比例 (%)
1	30 天以内	17.07	0.92
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	0.00	0.00
2	30 天(含)—60 天	47.33	0.00
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	0.00	0.00
3	60 天(含)—90 天	30.87	0.00
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	0.00	0.00
4	90 天(含)—120 天	0.00	0.00
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	0.00	0.00
5	120 天(含)—397 天(含)	5.52	0.00
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	0.00	0.00
	合计	100.78	0.92

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 (%)
1	国家债券	-	0.00
2	央行票据	-	0.00

3	金融债券	29,999,299.40	5.52
	其中：政策性金融债	29,999,299.40	5.52
4	企业债券	-	0.00
5	企业短期融资券	29,984,871.12	5.52
6	中期票据	-	0.00
7	同业存单	49,720,735.80	9.15
8	其他	-	0.00
9	合计	109,704,906.32	20.19
10	剩余存续期超过 397 天的浮动利率债券	-	0.00

8.5 期末按摊余成本占基金资产净值比例大小排序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	111619147	16 恒丰银行 CD147	500,000	49,720,735.80	9.15
2	041656027	16 大宁资产 CP001	300,000	29,984,871.12	5.52
3	160401	16 农发 01	200,000	19,999,805.26	3.68
4	160201	16 国开 01	100,000	9,999,494.14	1.84

8.6 “影子定价”与“摊余成本法”确定的基金资产净值的偏离

项目	偏离情况
报告期内偏离度的绝对值在 0.25(含)-0.5%间的次数	-
报告期内偏离度的最高值	0.1689%
报告期内偏离度的最低值	-0.1123%
报告期内每个交易日偏离度的绝对值的简单平均值	0.0475%

报告期内负偏离度的绝对值达到 0.25%情况说明

报告期内负偏离度的绝对值均未达到 0.25%。

报告期内正偏离度的绝对值达到 0.5%情况说明

报告期内正偏离度的绝对值均未达到 0.5%。

8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

本报告期末未持有资产支持证券。

8.8 投资组合报告附注

8.8.1 本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其买入时的溢价与折价,在其剩余存续期内按照实际利率法每日计提损益。本基金通过每日计算基金收益并分配的方式,使基金份额净值保持在人民币 1.00 元。

8.8.2 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年内受到公开谴责、处罚的情形。

8.8.3 期末其他各项资产构成

单位:人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	-
2	应收证券清算款	-
3	应收利息	1,608,964.33
4	应收申购款	-
5	其他应收款	-
6	待摊费用	-
7	其他	-
8	合计	1,608,964.33

8.8.4 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。

§9 基金份额持有人信息

9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位:份

份额级别	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		个人投资者	
			持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例
大成月添利债券 A	6,621	17,727.08	955,082.92	0.81%	116,415,915.40	99.19%
大成月添利债券 B	8	50,924,088.42	374,892,707.39	92.02%	32,500,000.00	7.98%
大成月添利债券 E	881	21,093.91	-	0.00%	18,583,731.54	100.00%
合计	7,510	72,349.86	375,847,790.31	69.17%	167,499,646.94	30.83%

注:1、下属分级基金份额比例的分母采用各自级别的份额,合计数比例的分母采用各分级基金份额的合计数。

2、持有人户数为有效户数,即存量份额大于零的账户。

9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数（份）	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	大成月添利债券 A	112,448.68	0.0958%
	大成月添利债券 B	-	0.0000%
	大成月添利债券 E	2,071.04	0.0111%
	合计	114,519.72	0.0211%

注：下属分级基金份额比例的分母采用各自级别的份额，合计数比例的分母采用各分级基金份额的合计数。

9.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

项目	份额级别	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和相关部门负责人持有本开放式基金	大成月添利债券 A	0
	大成月添利债券 B	0
	大成月添利债券 E	0
	合计	0
本基金基金经理持有本开放式基金	大成月添利债券 A	0
	大成月添利债券 B	0
	大成月添利债券 E	0
	合计	0

§ 10 开放式基金份额变动

单位：份

	大成月添利债券 A	大成月添利债券 B	大成月添利债券 E
基金合同生效日（2012年9月20日）基金份额总额	3,635,402,926.26	1,483,121,163.45	-
本报告期期初基金份额总额	491,424,715.22	692,153,122.49	657,890,374.69
本报告期基金总申购份额	247,078,175.17	311,375,489.92	448,373,409.79
减：本报告期基金总赎回份额	621,131,892.07	596,135,905.02	1,087,680,052.94
本报告期基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-	-	-
本报告期期末基金份额总额	117,370,998.32	407,392,707.39	18,583,731.54

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份额，不单独列示。

依据《大成月添利理财债券型证券投资基金招募说明书》规定，本基金分设两级基金份额，A 级基金份额和 B 级基金份额。A 级基金份额针对在单个基金账户保留份额在 500 万以下的持有人，B 级基金份额针对在单个基金账户保留份额在 500 万以上（含 500 万）的持有人。若 A 级基金份额持有人在单个基金账户保留的基金份额超过 500 万份时，本基金的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 级基金份额持有人在单个基金账户保留的基金份额低于 500 万份时，本基金的注册登记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。

§ 11 重大事件揭示

11.1 基金份额持有人大会决议

报告期内无基金份额持有人大会决议。

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

一、基金管理人的重大人事变动

基金管理人于 2016 年 6 月 25 日发布了《大成基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告》，经大成基金管理有限公司第六届董事会第十七次会议审议通过，钟鸣远先生不再担任公司副总经理。

二、基金托管人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

本报告期内没有涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的重大诉讼事项。

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

本基金聘任的为本基金审计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)，本年度支付的审计费用为 8.5 万元。该事务所自基金合同生效日起为本基金提供审计服务至今。

11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

1、报告期内基金管理人收到中国证券监督管理委员会深圳监管局（以下简称“深圳证监局”）《关于对大成基金管理有限公司采取责令整改并暂停办理相关业务措施的决定》，责令公司进行整改，并暂停受理公募基金产品注册申请 6 个月，暂停受理新设子公司业务申请 1 年，对相关责任人采取行政监管措施。公司高度重视，制定并落实相关整改措施，并及时向深圳证监局提交整

改报告。目前公司已完成相关整改工作。

2、报告期内基金托管人的托管业务部门及其相关高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

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

金额单位：人民币元

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	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
爱建证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
安信证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
长城证券	2	-	0.00%	-	0.00%	-
川财证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
第一创业	1	-	0.00%	-	0.00%	-
东北证券	2	-	0.00%	-	0.00%	-
东财证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
东方证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
东吴证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
东兴证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
方正证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
高华证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
光大证券	2	-	0.00%	-	0.00%	-
广发证券	2	-	0.00%	-	0.00%	-
国金证券	2	-	0.00%	-	0.00%	-
国盛证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
国泰君安	2	-	0.00%	-	0.00%	-
国信证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
海通证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
红塔证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
宏源证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
华创证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
华泰证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
华西证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
联讯证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
民生证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-

南京证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
平安证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
齐鲁证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
瑞银证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
山西证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
上海证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
申银万国	1	-	0.00%	-	0.00%	-
世纪证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
天风证券	2	-	0.00%	-	0.00%	-
万和证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
西部证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
湘财证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
兴业证券	2	-	0.00%	-	0.00%	-
银河证券	4	-	0.00%	-	0.00%	-
英大证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
招商证券	2	-	0.00%	-	0.00%	-
浙商证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
中金公司	3	-	0.00%	-	0.00%	-
中信建投	2	-	0.00%	-	0.00%	-
中信证券	2	-	0.00%	-	0.00%	-
中银国际	2	-	0.00%	-	0.00%	-
中原证券	1	-	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。

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，内控制度健全，能满足各投资组合运作的保密性要求；
- （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，满足各投资组合证券交易需要；
- （五）能提供投资组合运作、管理所需的其他券商服务；
- （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。

租用证券公司交易单元的程序：首先根据租用证券公司交易单元的选择标准形成《券商服务评价表》，然后根据评分高低进行选择基金交易单元。

本报告期内增加基金交易单元：爱建证券、东方证券、中原证券、中金公司、广发证券、东吴证券、万和证券，退租交易单元：无。

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

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例
中金公司	-	0.00%	7,200,000.00	100.00%	-	0.00%

11.8 偏离度绝对值超过 0.5%的情况

本基金本报告期内无偏离度绝对值超过 0.5%的情况。

11.9 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	关于大成月添利理财债券型证券投资基金“元旦”假期前暂停申购业务公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2016年12月27日
2	大成月添利理财债券型证券投资基金更新招募说明书（2016年第2期）	中国证监会指定报刊及本公司网站	2016年11月4日
3	大成月添利理财债券型证券投资基金更新招募说明书（2016年第2期）-摘要	中国证监会指定报刊及本公司网站	2016年11月4日
4	大成月添利理财债券型证券投资基金 2016 年第 3 季度报告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2016年10月24日
5	大成月添利理财债券型证券投资基金 2016 年第 3 季度报告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2016年10月24日
6	关于大成月添利理财债券型证券投资基金“国庆节”假期前暂停申购业务公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2016年9月22日
7	关于大成月添利理财债券型证券投资基金“中秋节”假期前暂停申购业务公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2016年9月9日
8	大成月添利理财债券型证券投资基金 2016 年半年度报告摘要	中国证监会指定报刊及本公司网站	2016年8月25日
9	大成月添利理财债券型证券投资基金 2016 年半年	中国证监会指定报刊	2016年8月

	度报告	刊及本公司网站	25 日
10	大成月添利理财债券型证券投资基金 2016 年第 2 季度报告	中国证监会指定报 刊及本公司网站	2016 年 7 月 20 日
11	大成基金管理有限公司关于旗下部分基金增加上海陆金所资产管理有限公司为代销机构的公告	中国证监会指定报 刊及本公司网站	2016 年 7 月 2 日
12	关于大成月添利理财债券型证券投资基金“端午节”假期前暂停申购业务公告	中国证监会指定报 刊及本公司网站	2016 年 6 月 3 日
13	关于大成月添利理财债券型证券投资基金恢复大额申购（含定期定额申购）业务公告	中国证监会指定报 刊及本公司网站	2016 年 5 月 26 日
14	大成月添利理财债券型证券投资基金更新招募说明书（2016 年第 1 期）-摘要	中国证监会指定报 刊及本公司网站	2016 年 5 月 5 日
15	大成月添利理财债券型证券投资基金更新招募说明书（2016 年第 1 期）	中国证监会指定报 刊及本公司网站	2016 年 5 月 5 日
16	关于大成月添利理财债券型证券投资基金“劳动节”假期前暂停申购业务公告	中国证监会指定报 刊及本公司网站	2016 年 4 月 26 日
17	大成月添利理财债券型证券投资基金 2016 年第 1 季度报告	中国证监会指定报 刊及本公司网站	2016 年 4 月 22 日
18	关于大成月添利理财债券型证券投资基金“清明节”假期前暂停申购业务公告	中国证监会指定报 刊及本公司网站	2016 年 3 月 29 日
19	大成月添利理财债券型证券投资基金 2015 年年度报告摘要	中国证监会指定报 刊及本公司网站	2016 年 3 月 26 日
20	大成月添利理财债券型证券投资基金 2015 年年度报告	中国证监会指定报 刊及本公司网站	2016 年 3 月 26 日
21	关于大成月添利理财债券型证券投资基金“春节”假期前暂停申购业务公告	中国证监会指定报 刊及本公司网站	2016 年 2 月 2 日
22	大成基金管理有限公司关于降低旗下部分开放式基金申购、赎回、转换转出及最低持有份额数额限制的公告	中国证监会指定报 刊及本公司网站	2016 年 1 月 30 日
23	大成月添利理财债券型证券投资基金 2015 年第 4	中国证监会指定报	2016 年 1 月

	季度报告	刊及本公司网站	20 日
24	关于再次提请投资者及时更新已过期身份证件或者身份证明文件的公告	中国证监会指定报 刊及本公司网站	2016 年 12 月 22 日
25	大成基金管理有限公司关于撤销上海理财中心的公告	中国证监会指定报 刊及本公司网站	2016 年 9 月 21 日
26	大成基金管理有限公司澄清公告	中国证监会指定报 刊及本公司网站	2016 年 9 月 20 日
27	大成基金管理有限公司关于撤销福州分公司的公告	中国证监会指定报 刊及本公司网站	2016 年 8 月 6 日
28	大成基金管理有限公司关于网上直销端通联-民生银行支付渠道维护暂停服务的通知	中国证监会指定报 刊及本公司网站	2016 年 8 月 5 日
29	关于调整直销网上交易系统通联支付交通银行渠道认申购费率优惠的公告	中国证监会指定报 刊及本公司网站	2016 年 7 月 19 日
30	大成基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告	中国证监会指定报 刊及本公司网站	2016 年 6 月 25 日
31	大成基金管理有限公司关于网上直销端通联支付渠道维护暂停服务的通知大成基金管理有限公司关于网上直销端通联支付渠道维护暂停服务的通知	中国证监会指定报 刊及本公司网站	2016 年 5 月 18 日
32	大成基金管理有限公司关于网上直销端通联支付渠道维护暂停服务的通知	中国证监会指定报 刊及本公司网站	2016 年 4 月 29 日
33	大成基金管理有限公司关于股权变更及修改《公司章程》的公告	中国证监会指定报 刊及本公司网站	2016 年 4 月 27 日
34	大成基金管理有限公司关于支付宝基金支付业务下线的公告	中国证监会指定报 刊及本公司网站	2016 年 4 月 18 日
35	关于网上直销端建设银行进行系统维护暂停服务的通知	中国证监会指定报 刊及本公司网站	2016 年 4 月 15 日
36	大成基金管理有限公司关于网上直销端通联支付渠道维护暂停服务的通知	中国证监会指定报 刊及本公司网站	2016 年 4 月 14 日
37	关于大成基金管理有限公司上海理财中心业务变更	中国证监会指定报	2016 年 3 月

	的公告	刊及本公司网站	29 日
38	大成基金管理有限公司关于网上直销端中国银行渠道维护暂停服务的通知	中国证监会指定报 刊及本公司网站	2016 年 3 月 25 日
39	大成基金管理有限公司关于网上直销端民生银行渠道维护暂停服务的通知	中国证监会指定报 刊及本公司网站	2016 年 3 月 25 日
40	大成基金管理有限公司关于网上直销端暂停申购交易业务的通知	中国证监会指定报 刊及本公司网站	2016 年 2 月 3 日
41	大成基金管理有限公司关于网上直销端银联支付渠道维护暂停服务的通知	中国证监会指定报 刊及本公司网站	2016 年 1 月 26 日
42	大成基金管理有限公司关于网上交易 PC 端银联支付渠道升级暂停部分服务的通知	中国证监会指定报 刊及本公司网站	2016 年 1 月 22 日
43	大成基金管理有限公司关于网上交易通联系统升级暂停服务的通知	中国证监会指定报 刊及本公司网站	2016 年 1 月 19 日
44	大成基金管理有限公司关于网上交易 PC 端银联支付渠道升级暂停服务的通知	中国证监会指定报 刊及本公司网站	2016 年 1 月 15 日
45	大成基金管理有限公司关于网上交易通联系统升级暂停服务的通知	中国证监会指定报 刊及本公司网站	2016 年 1 月 14 日
46	大成基金管理有限公司关于因指数熔断调整公司旗下部分公募基金开放时间的公告	中国证监会指定报 刊及本公司网站	2016 年 1 月 8 日
47	关于旗下场内基金在指数熔断期间暂停申购赎回业务的提示性公告	中国证监会指定报 刊及本公司网站	2016 年 1 月 6 日
48	大成基金管理有限公司关于因指数熔断调整公司旗下部分公募基金开放时间的公告	中国证监会指定报 刊及本公司网站	2016 年 1 月 5 日

§ 12 影响投资者决策的其他重要信息

1、根据 2016 年 4 月 27 日《大成基金管理有限公司关于股权变更及修改〈公司章程〉的公告》，根据大成基金管理有限公司（以下简称“本公司”）第六届董事会第十四次会议和 2016 年第一次临时股东会的有关决议，本公司原股东广东证券股份有限公司通过其破产管理人将所持本公司 2% 股权（对应出资额 400 万元）以拍卖竞买的方式转让给本公司股东中泰信托有限责任公司，广东证券股份有限公司退出本公司投资，中泰信托有限责任公司所持本公司股权增至

50%（对应出资额 1 亿元），同时，就本公司股权变更的相关内容修改《大成基金管理有限公司公司章程》。本公司股权变更及修改《大成基金管理有限公司公司章程》的工商变更手续已于 2016 年 4 月 25 日在深圳市市场监督管理局办理完毕。

2、基金管理人于 2017 年 2 月 18 日发布了《大成基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告》，经大成基金管理有限公司第六届董事会第二十四次会议（以下简称“董事会”）审议通过，杜鹏女士不再担任公司督察长。董事会同时决议，同意在公司新督察长任职前，由公司总经理罗登攀先生代为履行督察长职务，代为履职时间不超过 90 日。

3、基金管理人于 2017 年 2 月 18 日发布了《大成基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告》，经大成基金管理有限公司第六届董事会第二十四次会议审议通过，陈翔凯先生、谭晓冈先生和姚余栋先生担任公司副总经理。

§ 13 备查文件目录

13.1 备查文件目录

- 1、中国证监会批准设立大成月添利理财债券型证券投资基金的文件；
- 2、《大成月添利理财债券型证券投资基金基金合同》；
- 3、《大成月添利理财债券型证券投资基金托管协议》；
- 4、大成基金管理有限公司批准文件、营业执照、公司章程；
- 5、本报告期内在指定报刊上披露的各种公告原稿。

13.2 存放地点

备查文件存放在本基金管理人和托管人的办公住所。

13.3 查阅方式

投资者可在营业时间免费查阅，或登录本基金管理人网站 <http://www.dcfund.com.cn> 进行查阅。

大成基金管理有限公司
2017 年 3 月 25 日