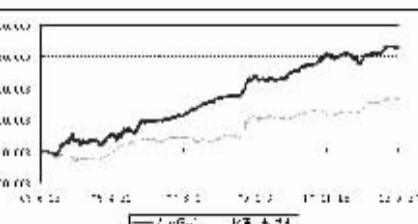


大成债券投资基金

2012 第三季度报告



注:1.本基金于2006年4月24日推出持续增值收费模式,将前端收费模式定义为A类收费模式,后端收费模式定义为B类收费模式...

4 管理人报告

Table with columns: 姓名, 职务, 任本基金基金经理期限, 证券从业年限, 说明

注:1.在任职日期,离任日期为本基金管理人作出决定之日...

5 投资组合报告

Table with columns: 序号, 项目, 金额(元), 占基金总资产的比例(%)

5.1 报告期末按行业分类的股票投资组合

Table with columns: 代码, 行业类别, 公允价值(元), 占基金资产净值比例(%)

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股票投资明细

Table with columns: 序号, 股票代码, 股票名称, 数量(股), 公允价值(元), 占基金资产净值比例(%)

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债券投资明细

Table with columns: 序号, 债券品种, 公允价值(元), 占基金资产净值比例(%)

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

Table with columns: 序号, 债券品种, 公允价值(元), 占基金资产净值比例(%)

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五名债券投资明细

Table with columns: 序号, 股票代码, 股票名称, 数量(股), 公允价值(元), 占基金资产净值比例(%)

5.6 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 columns: 序号, 股票代码, 股票名称, 数量(股), 公允价值(元), 占基金资产净值比例(%)

5.7 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

Table with columns: 序号, 股票代码, 股票名称, 公允价值(元), 占基金资产净值比例(%)

5.8 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中,没有投资于超出基金合同规定的备选股票库之外的股票。

5.8.3 其他资产构成

Table with columns: 序号, 名称, 金额(元)

5.8.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

Table with columns: 序号, 股票代码, 股票名称, 公允价值(元), 占基金资产净值比例(%)

5.8.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中,没有投资于超出基金合同规定的备选股票库之外的股票。

5.8.6 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中,没有投资于超出基金合同规定的备选股票库之外的股票。

5.8.7 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中,没有投资于超出基金合同规定的备选股票库之外的股票。

5.8.8 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中,没有投资于超出基金合同规定的备选股票库之外的股票。

5.8.9 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中,没有投资于超出基金合同规定的备选股票库之外的股票。

5.8.10 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中,没有投资于超出基金合同规定的备选股票库之外的股票。

5.8.11 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中,没有投资于超出基金合同规定的备选股票库之外的股票。

5.8.12 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中,没有投资于超出基金合同规定的备选股票库之外的股票。

5.8.13 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中,没有投资于超出基金合同规定的备选股票库之外的股票。

5.8.14 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中,没有投资于超出基金合同规定的备选股票库之外的股票。

5.8.15 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中,没有投资于超出基金合同规定的备选股票库之外的股票。

5.8.16 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中,没有投资于超出基金合同规定的备选股票库之外的股票。

5.8.17 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中,没有投资于超出基金合同规定的备选股票库之外的股票。

5.8.18 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中,没有投资于超出基金合同规定的备选股票库之外的股票。

5.8.19 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中,没有投资于超出基金合同规定的备选股票库之外的股票。

5.8.20 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中,没有投资于超出基金合同规定的备选股票库之外的股票。

5.8.21 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中,没有投资于超出基金合同规定的备选股票库之外的股票。

5.8.22 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中,没有投资于超出基金合同规定的备选股票库之外的股票。

5.8.23 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中,没有投资于超出基金合同规定的备选股票库之外的股票。

5.8.24 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中,没有投资于超出基金合同规定的备选股票库之外的股票。

5.8.25 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中,没有投资于超出基金合同规定的备选股票库之外的股票。

5.8.26 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中,没有投资于超出基金合同规定的备选股票库之外的股票。

5.8.27 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中,没有投资于超出基金合同规定的备选股票库之外的股票。

5.8.28 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中,没有投资于超出基金合同规定的备选股票库之外的股票。

5.8.29 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中,没有投资于超出基金合同规定的备选股票库之外的股票。

5.8.30 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中,没有投资于超出基金合同规定的备选股票库之外的股票。

5.8.31 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中,没有投资于超出基金合同规定的备选股票库之外的股票。

5.8.32 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中,没有投资于超出基金合同规定的备选股票库之外的股票。

5.8.33 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中,没有投资于超出基金合同规定的备选股票库之外的股票。

5.8.34 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中,没有投资于超出基金合同规定的备选股票库之外的股票。

5.8.35 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中,没有投资于超出基金合同规定的备选股票库之外的股票。

5.8.36 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中,没有投资于超出基金合同规定的备选股票库之外的股票。

5.8.37 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中,没有投资于超出基金合同规定的备选股票库之外的股票。

5.8.38 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中,没有投资于超出基金合同规定的备选股票库之外的股票。

5.8.39 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中,没有投资于超出基金合同规定的备选股票库之外的股票。

5.8.40 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中,没有投资于超出基金合同规定的备选股票库之外的股票。

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:2012年10月25日

1 重要提示

基金管理人、基金托管人及基金销售机构不存在虚假记载、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。

2 基金产品概况

Table with columns: 基金简称, 交易代码, 基金运作方式, 报告期末基金份额总额, 投资目标, 投资策略, 业绩比较基准, 风险收益特征, 基金管理人, 基金托管人, 下属两级基金的基金简称, 下属两级基金的交易代码, 报告期末下属两级基金的基金份额总额

3 主要财务指标和基金净值表现

Table with columns: 主要财务指标, 报告期(2012年7月1日-2012年9月30日), 单位:人民币元

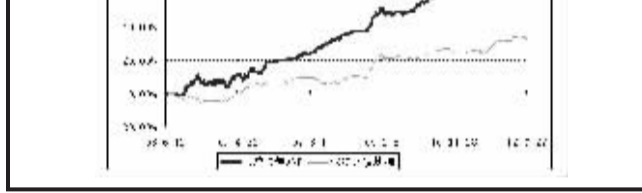
3.1 主要财务指标

Table with columns: 阶段, 净值增长率①, 净值增长率②, 业绩比较基准收益差③, ①-③, ②-④

3.2 基金净值表现

Table with columns: 阶段, 净值增长率①, 净值增长率②, 业绩比较基准收益差③, ①-③, ②-④

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



大成中证内地消费主题指数证券投资基金

2012 第三季度报告

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:2012年10月25日

1 重要提示

基金管理人、基金托管人及基金销售机构不存在虚假记载、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。

2 基金产品概况

Table with columns: 基金简称, 交易代码, 基金运作方式, 报告期末基金份额总额, 投资目标, 投资策略, 业绩比较基准, 风险收益特征, 基金管理人, 基金托管人, 下属两级基金的基金简称, 下属两级基金的交易代码, 报告期末下属两级基金的基金份额总额

3 主要财务指标和基金净值表现

Table with columns: 主要财务指标, 报告期(2012年7月1日-2012年9月30日), 单位:人民币元

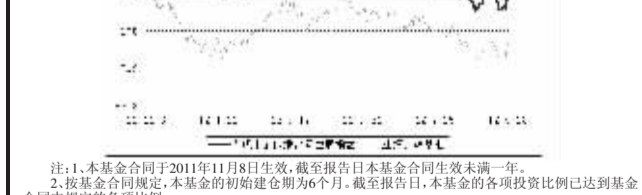
3.1 主要财务指标

Table with columns: 阶段, 净值增长率①, 净值增长率②, 业绩比较基准收益差③, ①-③, ②-④

3.2 基金净值表现

Table with columns: 阶段, 净值增长率①, 净值增长率②, 业绩比较基准收益差③, ①-③, ②-④

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



三季度以来,国际方面,欧债危机有所缓和,美国则在走出次贷危机的阴影。随着美国QE3的推出,欧洲也推出了有条件的债务调整计划,全球宏观经济前景预期大增。

5 投资组合报告

Table with columns: 序号, 项目, 金额(元), 占基金总资产的比例(%)

5.1 报告期末基金资产组合情况

Table with columns: 代码, 行业类别, 公允价值(元), 占基金资产净值比例(%)

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股票投资明细

Table with columns: 序号, 股票代码, 股票名称, 数量(股), 公允价值(元), 占基金资产净值比例(%)

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五名债券投资明细

Table with columns: 序号, 债券品种, 公允价值(元), 占基金资产净值比例(%)

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

Table with columns: 序号, 债券品种, 公允价值(元), 占基金资产净值比例(%)

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五名债券投资明细

Table with columns: 序号, 股票代码, 股票名称, 数量(股), 公允价值(元), 占基金资产净值比例(%)

5.6 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 columns: 序号, 股票代码, 股票名称, 数量(股), 公允价值(元), 占基金资产净值比例(%)

5.7 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

Table with columns: 序号, 股票代码, 股票名称, 公允价值(元), 占基金资产净值比例(%)

5.8 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中,没有投资于超出基金合同规定的备选股票库之外的股票。

5.8.3 其他资产构成

Table with columns: 序号, 名称, 金额(元)

5.8.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

Table with columns: 序号, 股票代码, 股票名称, 公允价值(元), 占基金资产净值比例(%)

5.8.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中,没有投资于超出基金合同规定的备选股票库之外的股票。

5.8.6 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中,没有投资于超出基金合同规定的备选股票库之外的股票。

5.8.7 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中,没有投资于超出基金合同规定的备选股票库之外的股票。

5.8.8 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中,没有投资于超出基金合同规定的备选股票库之外的股票。

5.8.9 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中,没有投资于超出基金合同规定的备选股票库之外的股票。

5.8.10 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中,没有投资于超出基金合同规定的备选股票库之外的股票。

5.8.11 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中,没有投资于超出基金合同规定的备选股票库之外的股票。

5.8.12 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中,没有投资于超出基金合同规定的备选股票库之外的股票。

5.8.13 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中,没有投资于超出基金合同规定的备选股票库之外的股票。

5.8.14 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中,没有投资于超出基金合同规定的备选股票库之外的股票。

5.8.15 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中,没有投资于超出基金合同规定的备选股票库之外的股票。

5.8.16 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中,没有投资于超出基金合同规定的备选股票库之外的股票。

5.8.17 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中,没有投资于超出基金合同规定的备选股票库之外的股票。

5.8.18 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中,没有投资于超出基金合同规定的备选股票库之外的股票。

5.8.19 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中,没有投资于超出基金合同规定的备选股票库之外的股票。

大成中证红利指数证券投资基金

2012 第三季度报告

受到明限制,企业杠杆化过程减缓,在此背景下,股票、转债和债券市场在三季度均出现明显调整。2012年三季度,本基金在严格控制风险的基础上,采取积极的组合策略和严格的资产选择原则进行投资运作。

4.5 管理人对于宏观经济、证券市场及行业走势的展望
随着2012年四季度,美国财政悬崖对需求的挤压和欧债危机恶化导致外需疲弱,在固定资产配置难以增加的情况下,预计经济将维持低速,物价水平上升速度有限,通胀压力短期有所缓解。

基于对流动性变化和负债收缩的宏观背景,部分企业盈利和现金流状况明显恶化,从大类资产配置角度出发,预计下一阶段债券资产仍优于股票资产,固收类资产和高等信用债具有投资价值,并拉长久期以获取组合投资收益,同时深入研究,把握转债市场的结构性投资机会并做好创新转债估值下的个股精选工作。

我们非常感谢基金份额持有人的信任和支持,我们将按照本基金合同和风险控制特征的要求,严格控制风险,积极进行资产配置,调整调整投资组合,研究新的投资品种和挖掘投资机会,力争获得与基金风险特征一致的稳定投资回报给投资者。

4.2 报告期末基金的投资组合

5.1 报告期末基金资产组合情况

Table with columns: 序号, 项目, 金额(元), 占基金总资产的比例(%)

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

Table with columns: 代码, 行业类别, 公允价值(元), 占基金资产净值比例(%)

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股票投资明细

Table with columns: 序号, 股票代码, 股票名称, 数量(股), 公允价值(元), 占基金资产净值比例(%)

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五名债券投资明细

Table with columns: 序号, 债券品种, 公允价值(元), 占基金资产净值比例(%)

5.5 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

Table with columns: 序号, 债券品种, 公允价值(元), 占基金资产净值比例(%)

5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

Table with columns: 序号, 股票代码, 股票名称, 数量(股), 公允价值(元), 占基金资产净值比例(%)

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权证投资明细

Table with columns: 序号, 股票代码, 股票名称, 数量(股), 公允价值(元), 占基金资产净值比例(%)

5.8 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

Table with columns: 序号, 股票代码, 股票名称, 公允价值(元), 占基金资产净值比例(%)

5.9 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中,没有投资于超出基金合同规定的备选股票库之外的股票。

5.9.3 其他资产构成

Table with columns: 序号, 名称, 金额(元)

5.9.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

Table with columns: 序号, 股票代码, 股票名称, 公允价值(元), 占基金资产净值比例(%)

5.9.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中,没有投资于超出基金合同规定的备选股票库之外的股票。

5.9.6 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中,没有投资于超出基金合同规定的备选股票库之外的股票。

5.9.7 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中,没有投资于超出基金合同规定的备选股票库之外的股票。

5.9.8 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中,没有投资于超出基金合同规定的备选股票库之外的股票。

5.9.9 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中,没有投资于超出基金合同规定的备选股票库之外的股票。

5.9.10 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中,没有投资于超出基金合同规定的备选股票库之外的股票。

5.9.11 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中,没有投资于超出基金合同规定的备选股票库之外的股票。

5.9.12 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明