

2012年10月25日 星期四

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

基金管理人的董事会及监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。

基金托管人对本基金定期报告书根据基金合同规定，于2012年10月22日复核了本报告中的财务指标、净值表现和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。

本基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资人进行投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。

本报告期中财务资料未经审计。

§ 2 基金产品概况

基金简称	大成债券
交易代码	090002
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2003年6月12日
报告期末基金份额总额	326,248,974.14份
投资目标	在力保本金安全的前提下，保持资产流动性的基础上追求资产的长期稳定性。
投资策略	通过整体资产配置、类资产配置和个券选择三个层次上自上而下地进行投资管理，以实现投资所固有的、预期的、经过修正的均一化-方差模型在交易所国债、交易所企业债、银行间国债、银行间金融债之间进行最优化配置。
业绩比较基准	中债国债总指数
风险收益特征	无风险。
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
下属两级基金的基金简称	大成债券A/B
下属两级基金的交易代码	090002/091002
报告期末下属两级基金的份额总额	184,176,754.30份 142,072,219.84份

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

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
大成债券A/B	大成债券C	
1.本期已实现收益	974,794.32	1,085,830.33
2.本期利润	-572,786.63	-1,287,622.48
3.加权平均基金份额本期利润	-0.0028	-0.0049
4.期末基金资产净值	191,399,054.88	146,143,020.04
5.期末基金份额净值	1.0392	1.0287

注:1.所述基金业绩指标不包括持有人交易基金的各项费用，计算费用后实际收益水平要低于所列数字。

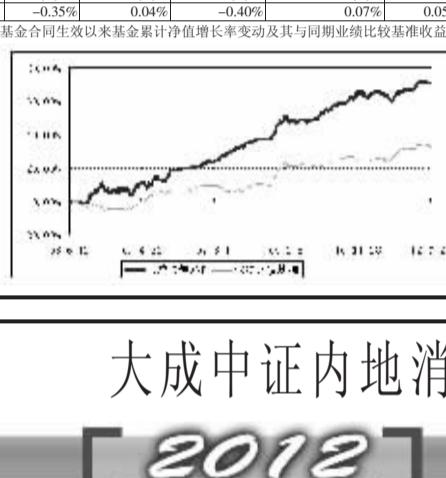
2.本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

3.基金净值表现

3.1 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

阶段	净值增长(%)	净值增长率差(%)	业绩比较基准收益率(%)	业绩比较基准收益率差(%)	(1)-(3)	(2)-(4)
过去三个月	-0.26%	0.04%	-0.40%	0.07%	0.14%	-0.03%

3.2 本报告期基金份额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



注:1.经基金管理人决定由大成基金管理人作出决定之日。

2.本基金从2012年10月21日起恢复执行基金经理限制。

3.上述各项数据已按有关规定进行调整。

4.本基金从2012年10月21日起恢复执行基金经理限制。

5.本基金从2012年10月21日起恢复执行基金经理限制。

6.本基金从2012年10月21日起恢复执行基金经理限制。

7.本基金从2012年10月21日起恢复执行基金经理限制。

8.本基金从2012年10月21日起恢复执行基金经理限制。

9.本基金从2012年10月21日起恢复执行基金经理限制。

10.本基金从2012年10月21日起恢复执行基金经理限制。

11.本基金从2012年10月21日起恢复执行基金经理限制。

12.本基金从2012年10月21日起恢复执行基金经理限制。

13.本基金从2012年10月21日起恢复执行基金经理限制。

14.本基金从2012年10月21日起恢复执行基金经理限制。

15.本基金从2012年10月21日起恢复执行基金经理限制。

16.本基金从2012年10月21日起恢复执行基金经理限制。

17.本基金从2012年10月21日起恢复执行基金经理限制。

18.本基金从2012年10月21日起恢复执行基金经理限制。

19.本基金从2012年10月21日起恢复执行基金经理限制。

20.本基金从2012年10月21日起恢复执行基金经理限制。

21.本基金从2012年10月21日起恢复执行基金经理限制。

22.本基金从2012年10月21日起恢复执行基金经理限制。

23.本基金从2012年10月21日起恢复执行基金经理限制。

24.本基金从2012年10月21日起恢复执行基金经理限制。

25.本基金从2012年10月21日起恢复执行基金经理限制。

26.本基金从2012年10月21日起恢复执行基金经理限制。

27.本基金从2012年10月21日起恢复执行基金经理限制。

28.本基金从2012年10月21日起恢复执行基金经理限制。

29.本基金从2012年10月21日起恢复执行基金经理限制。

30.本基金从2012年10月21日起恢复执行基金经理限制。

31.本基金从2012年10月21日起恢复执行基金经理限制。

32.本基金从2012年10月21日起恢复执行基金经理限制。

33.本基金从2012年10月21日起恢复执行基金经理限制。

34.本基金从2012年10月21日起恢复执行基金经理限制。

35.本基金从2012年10月21日起恢复执行基金经理限制。

36.本基金从2012年10月21日起恢复执行基金经理限制。

37.本基金从2012年10月21日起恢复执行基金经理限制。

38.本基金从2012年10月21日起恢复执行基金经理限制。

39.本基金从2012年10月21日起恢复执行基金经理限制。

40.本基金从2012年10月21日起恢复执行基金经理限制。

41.本基金从2012年10月21日起恢复执行基金经理限制。

42.本基金从2012年10月21日起恢复执行基金经理限制。

43.本基金从2012年10月21日起恢复执行基金经理限制。

44.本基金从2012年10月21日起恢复执行基金经理限制。

45.本基金从2012年10月21日起恢复执行基金经理限制。

46.本基金从2012年10月21日起恢复执行基金经理限制。

47.本基金从2012年10月21日起恢复执行基金经理限制。

48.本基金从2012年10月21日起恢复执行基金经理限制。

49.本基金从2012年10月21日起恢复执行基金经理限制。

50.本基金从2012年10月21日起恢复执行基金经理限制。

51.本基金从2012年10月21日起恢复执行基金经理限制。

52.本基金从2012年10月21日起恢复执行基金经理限制。

53.本基金从2012年10月21日起恢复执行基金经理限制。

54.本基金从2012年10月21日起恢复执行基金经理限制。

55.本基金从2012年10月21日起恢复执行基金经理限制。

56.本基金从2012年10月21日起恢复执行基金经理限制。

57.本基金从2012年10月21日起恢复执行基金经理限制。

58.本基金从2012年10月21日起恢复执行基金经理限制。

59.本基金从2012年10月21日起恢复执行基金经理限制。

60.本基金从2012年10月21日起恢复执行基金经理限制。

61.本基金从2012年10月21日起恢复执行基金经理限制。

62.本基金从2012年10月21日起恢复执行基金经理限制。

63.本基金从2012年10月21日起恢复执行基金经理限制。

64.本基金从2012年10月21日起恢复执行基金经理限制。

65.本基金从2012年10月21日起恢复执行基金经理限制。

66.本基金从2012年10月21日起恢复执行基金经理限制。

67.本基金从2012年10月21日起恢复执行基金经理限制。

68.本基金从2012年10月21日起恢复执行基金经理限制。

69.本基金从2012年10月21日起恢复执行基金经理限制。

70.本基金从2012年10月21日起恢复执行基金经理限制。

71.本基金从2012年10月21日起恢复执行基金经理限制。

72.本基金从2012年10月21日起恢复执行基金经理限制。

73.本基金从2012年10月21日起恢复执行基金经理限制。

74.本基金从2012年10月21日起恢复执行基金经理限制。

75.本基金从2012年10月21日起恢复执行基金经理限制。

76.本基金从2012年10月21日起恢复执行基金经理限制。

77.本基金从2012年10月21日起恢复执行基金经理限制。

78.本基金从2012年10月21日起恢复执行基金经理限制。

79.本基金从2012年10月21日起恢复执行基金经理限制。

80.本基金从2012年10月21日起恢复执行基金经理限制。

81.本基金从2012年10月21日起恢复执行基金经理限制。

82.本基金从2012年10月21日起恢复执行基金经理限制。

83.本基金从2012年10月21日起恢复执行基金经理限制。

84.本基金从2012年10月21日起恢复执行基金经理限制。

85.本基金从2012年10月21日起恢复执行基金经理限制。

86.本基金从2012年10月21日起恢复执行基金经理限制。

87.本基金从2012年10月21日起恢复执行基金经理限制。

88.本基金从2012年10月21日起恢复执行基金经理限制。

89.本基金从2012年10月21日起恢复执行基金经理限制。

90.本基金从2012年10月21日起恢复执行基金经理限制。

91.本基金从2012年10月21日起恢复执行基金经理限制。

92.本基金从2012年10月21日起恢复执行基金经理限制。

93.本基金从2012年10月21日起恢复执行基金经理限制。

94.本基金从2012年10月21日起恢复执行基金经理限制。

95.本基金从2012年10月21日起恢复执行基金经理限制。

96.本基金从2012年10月21日起恢复执行基金经理限制。