

基金管理人:大成基金管理有限公司
基金托管人:中国建设银行股份有限公司
送出日期:2013年8月29日

§ 1 重要提示

基金管理人的董事会、董事声明本基金的披露资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对内容的真实性、准确性、完整性、及时性承担责任；基金托管人声明本基金的披露资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对内容的真实性、准确性、完整性承担责任。

本报告年度报告经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人根据本基金合同的规定，于2013年8月27日复核了本报告书的财务指标、净值表现、财务状况、持有人数、资产情况、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。

基金管理人以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金财产，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。

本半年度报告摘要概要半年度报告全文，投资者欲了解详细内容，应阅读半年度报告全文。

本报告期自2013年1月1日起至6月30日止。

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

| | |
|------------|----------------|
| 基金简称 | 大成强化收益债券 |
| 基金主代码 | 090008 |
| 前端交易代码 | 090008 |
| 后端交易代码 | 091108 |
| 基金运作方式 | 契约型开放式 |
| 基金合同生效日 | 2008年8月6日 |
| 基金管理人 | 大成基金管理有限公司 |
| 基金托管人 | 中国建设银行股份有限公司 |
| 报告期末基金份额总额 | 57,075,440.66份 |
| 基金合同存续期 | 不定期 |

2.2 基金产品说明

| | |
|--------|--|
| 投资目标 | 在保持资产流动性基础上通过积极主动的投资管理，追求基金资产的长期稳定增值，力争获取超过业绩比较基准的收益业绩。 |
| 投资策略 | 本基金将在严格控制组合风险的前提下，基于收益的需求，在资产配置、个券选择和交易策略层面实施积极管理策略，以期在承担有限风险的前提下获得较高回报收益。 |
| 业绩比较基准 | 中债综合指数 |
| 风险收益特征 | 本基金定位为满足追求较高稳定回报的基金持有人的投资需求，风险收益水平高于货币市场基金，低于混合基金和股票基金。 |

2.3 基金管理人员和基金托管人

| 项目 | 基金管理人 | 基金托管人 |
|---------|---|---|
| 名称 | 大成基金管理有限公司 | 中国建设银行股份有限公司 |
| 姓名 | 杜鹏 | 田青 |
| 信息披露负责人 | 联系电话:0755-83133388 电子邮箱:dupeng@dcfund.com.cn | 010-67595096 tianqing.lzh@cib.com.cn |
| 客户服务电话 | 4008855858 传真:0755-83199588 | 010-66275853 |

2.4 信息披露方式

| | |
|----------------------|------------------------------------|
| 登载基金半年度报告正文的管理人互联网网址 | http://www.dcfund.com.cn |
| 基金管理人 | 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 |
| 基金半年度报告备置地点 | 北京市西城区金融街1号院1号楼中国建设银行股份有限公司托管部 |

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

金额单位:人民币元

3.1 期间数据和指标

报告期(2013年1月1日 - 2013年6月30日)

本期已实现收益 793,740.88

本期利润 440,140.06

加权平均基金份额本期利润 0.0068

本期基金份额净值增长率 0.88%

报告期(2013年1月1日 - 2013年6月30日)

期末可供基金份额利润 -0.0305

期末基金份额净值 55,334,703.82

期末基金份额净值 0.9695

注: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.所列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.基金净值表现

3.2.1 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 份额净值增长率 (%) 增长率差 (%) 基准收益率 (%) 基准收益率 (%) ①-③ ②-④

过去一个月 -3.15% 0.44% -0.31% 0.18% -2.84% 0.26%

过去三个月 -2.53% 0.35% 0.93% 0.11% -3.46% 0.24%

过去六个月 0.88% 0.36% 2.34% 0.08% -1.46% 0.28%

过去一年 -0.65% 0.28% 2.94% 0.06% -3.59% 0.22%

过去三年 1.84% 0.31% 10.82% 0.07% -8.98% 0.24%

自基金合同生效起至今 16.59% 0.30% 24.18% 0.09% -7.59% 0.21%

3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动与其同期业绩比较基准收益率变动的比较

注:按基金合同规定,本基金自基金合同生效起6个月内为建仓期。在建仓期结束时及本报告期末本基金的各项投资比例已达本基金合同中规定的比例。

§ 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情况

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,是全国首批成立的基金管理公司之一,注册资本为人民币1亿元,人民币资本。公司由深圳大成投资有限公司(占股48%)、光大证券股份有限公司(占股25%)、中国银河证券投资基金(占股2%)、中泰信托有限责任公司(占股4%)、光大证券股份有限公司(占股4%)组成,并分别在深圳、上海、北京、成都、南京设有分公司。公司设有董事会、监事会、经营决策层、督察长、总经理、副总经理、基金经理等组织机构,并设有研究部、投资部、交易部、风险管理部、监察稽核部、客户服务部、信息技术部、人力资源部、综合管理部等部门。

4.1.2 基金经理的管理权限

基金经理杜鹏先生,男,1970年1月出生,大学本科,硕士学位,经济师,2000年7月加入大成基金管理有限公司,历任大成基金研究员、基金经理助理、基金经理,2008年8月起任大成基金量化投资部总监,2010年10月起任大成基金量化投资部总监,2011年4月起任大成基金量化投资部总监,2012年1月起任大成基金量化投资部总监,2013年6月起任大成基金量化投资部总监,2013年7月起任大成基金量化投资部总监,2013年8月起任大成基金量化投资部总监,2013年9月起任大成基金量化投资部总监,2013年10月起任大成基金量化投资部总监,2013年11月起任大成基金量化投资部总监,2013年12月起任大成基金量化投资部总监,2014年1月起任大成基金量化投资部总监,2014年2月起任大成基金量化投资部总监,2014年3月起任大成基金量化投资部总监,2014年4月起任大成基金量化投资部总监,2014年5月起任大成基金量化投资部总监,2014年6月起任大成基金量化投资部总监,2014年7月起任大成基金量化投资部总监,2014年8月起任大成基金量化投资部总监,2014年9月起任大成基金量化投资部总监,2014年10月起任大成基金量化投资部总监,2014年11月起任大成基金量化投资部总监,2014年12月起任大成基金量化投资部总监,2015年1月起任大成基金量化投资部总监,2015年2月起任大成基金量化投资部总监,2015年3月起任大成基金量化投资部总监,2015年4月起任大成基金量化投资部总监,2015年5月起任大成基金量化投资部总监,2015年6月起任大成基金量化投资部总监,2015年7月起任大成基金量化投资部总监,2015年8月起任大成基金量化投资部总监,2015年9月起任大成基金量化投资部总监,2015年10月起任大成基金量化投资部总监,2015年11月起任大成基金量化投资部总监,2015年12月起任大成基金量化投资部总监,2016年1月起任大成基金量化投资部总监,2016年2月起任大成基金量化投资部总监,2016年3月起任大成基金量化投资部总监,2016年4月起任大成基金量化投资部总监,2016年5月起任大成基金量化投资部总监,2016年6月起任大成基金量化投资部总监,2016年7月起任大成基金量化投资部总监,2016年8月起任大成基金量化投资部总监,2016年9月起任大成基金量化投资部总监,2016年10月起任大成基金量化投资部总监,2016年11月起任大成基金量化投资部总监,2016年12月起任大成基金量化投资部总监,2017年1月起任大成基金量化投资部总监,2017年2月起任大成基金量化投资部总监,2017年3月起任大成基金量化投资部总监,2017年4月起任大成基金量化投资部总监,2017年5月起任大成基金量化投资部总监,2017年6月起任大成基金量化投资部总监,2017年7月起任大成基金量化投资部总监,2017年8月起任大成基金量化投资部总监,2017年9月起任大成基金量化投资部总监,2017年10月起任大成基金量化投资部总监,2017年11月起任大成基金量化投资部总监,2017年12月起任大成基金量化投资部总监,2018年1月起任大成基金量化投资部总监,2018年2月起任大成基金量化投资部总监,2018年3月起任大成基金量化投资部总监,2018年4月起任大成基金量化投资部总监,2018年5月起任大成基金量化投资部总监,2018年6月起任大成基金量化投资部总监,2018年7月起任大成基金量化投资部总监,2018年8月起任大成基金量化投资部总监,2018年9月起任大成基金量化投资部总监,2018年10月起任大成基金量化投资部总监,2018年11月起任大成基金量化投资部总监,2018年12月起任大成基金量化投资部总监,2019年1月起任大成基金量化投资部总监,2019年2月起任大成基金量化投资部总监,2019年3月起任大成基金量化投资部总监,2019年4月起任大成基金量化投资部总监,2019年5月起任大成基金量化投资部总监,2019年6月起任大成基金量化投资部总监,2019年7月起任大成基金量化投资部总监,2019年8月起任大成基金量化投资部总监,2019年9月起任大成基金量化投资部总监,2019年10月起任大成基金量化投资部总监,2019年11月起任大成基金量化投资部总监,2019年12月起任大成基金量化投资部总监,2020年1月起任大成基金量化投资部总监,2020年2月起任大成基金量化投资部总监,2020年3月起任大成基金量化投资部总监,2020年4月起任大成基金量化投资部总监,2020年5月起任大成基金量化投资部总监,2020年6月起任大成基金量化投资部总监,2020年7月起任大成基金量化投资部总监,2020年8月起任大成基金量化投资部总监,2020年9月起任大成基金量化投资部总监,2020年10月起任大成基金量化投资部总监,2020年11月起任大成基金量化投资部总监,2020年12月起任大成基金量化投资部总监,2021年1月起任大成基金量化投资部总监,2021年2月起任大成基金量化投资部总监,2021年3月起任大成基金量化投资部总监,2021年4月起任大成基金量化投资部总监,2021年5月起任大成基金量化投资部总监,2021年6月起任大成基金量化投资部总监,2021年7月起任大成基金量化投资部总监,2021年8月起任大成基金量化投资部总监,2021年9月起任大成基金量化投资部总监,2021年10月起任大成基金量化投资部总监,2021年11月起任大成基金量化投资部总监,2021年12月起任大成基金量化投资部总监,2022年1月起任大成基金量化投资部总监,2022年2月起任大成基金量化投资部总监,2022年3月起任大成基金量化投资部总监,2022年4月起任大成基金量化投资部总监,2022年5月起任大成基金量化投资部总监,2022年6月起任大成基金量化投资部总监,2022年7月起任大成基金量化投资部总监,2022年8月起任大成基金量化投资部总监,2022年9月起任大成基金量化投资部总监,2022年10月起任大成基金量化投资部总监,2022年11月起任大成基金量化投资部总监,2022年12月起任大成基金量化投资部总监,2023年1月起任大成基金量化投资部总监,2023年2月起任大成基金量化投资部总监,2023年3月起任大成基金量化投资部总监,2023年4月起任大成基金量化投资部总监,2023年5月起任大成基金量化投资部总监,2023年6月起任大成基金量化投资部总监,2023年7月起任大成基金量化投资部总监,2023年8月起任大成基金量化投资部总监,2023年9月起任大成基金量化投资部总监,2023年10月起任大成基金量化投资部总监,2023年11月起任大成基金量化投资部总监,2023年12月起任大成基金量化投资部总监,2024年1月起任大成基金量化投资部总监,2024年2月起任大成基金量化投资部总监,2024年3月起任大成基金量化投资部总监,2024年4月起任大成基金量化投资部总监,2024年5月起任大成基金量化投资部总监,2024年6月起任大成基金量化投资部总监,2024年7月起任大成基金量化投资部总监,2024年8月起任大成基金量化投资部总监,2024年9月起任大成基金量化投资部总监,2024年10月起任大成基金量化投资部总监,2024年11月起任大成基金量化投资部总监,2024年12月起任大成基金量化投资部总监,2025年1月起任大成基金量化投资部总监,2025年2月起任大成基金量化投资部总监,2025年3月起任大成基金量化投资部总监,2025年4月起任大成基金量化投资部总监,2025年5月起任大成基金量化投资部总监,2025年6月起任大成基金量化投资部总监,2025年7月起任大成基金量化投资部总监,2025年8月起任大成基金量化投资部总监,2025年9月起任大成基金量化投资部总监,2025年10月起任大成基金量化投资部总监,2025年11月起任大成基金量化投资部总监,2025年12月起任大成基金量化投资部总监,2026年1月起任大成基金量化投资部总监,2026年2月起任大成基金量化投资部总监,2026年3月起任大成基金量化投资部总监,2026年4月起任大成基金量化投资部总监,2026年5月起任大成基金量化投资部总监,2026年6月起任大成基金量化投资部总监,2026年7月起任大成基金量化投资部总监,2026年8月起任大成基金量化投资部总监,2026年9月起任大成基金量化投资部总监,2026年10月起任大成基金量化投资部总监,2026年11月起任大成基金量化投资部总监,2026年12月起任大成基金量化投资部总监,2027年1月起任大成基金量化投资部总监,2027年2月起任大成基金量化投资部总监,2027年3月起任大成基金量化投资部总监,2027年4月起任大成基金量化投资部总监,2027年5月起任大成基金量化投资部总监,2027年6月起任大成基金量化投资部总监,2027年7月起任大成基金量化投资部总监,2027年8月起任大成基金量化投资部总监,2027年9月起任大成基金量化投资部总监,2027年10月起任大成基金量化投资部总监,2027年11月起任大成基金量化投资部总监,2027年12月起任大成基金量化投资部总监,2028年1月起任大成基金量化投资部总监,2028年2月起任大成基金量化投资部总监,2028年3月起任大成基金量化投资部总监,2028年4月起任大成基金量化投资部总监,2028年5月起任大成基金量化投资部总监,2028年6月起任大成基金量化投资部总监,2028年7月起任大成基金量化投资部总监,2028年8月起任大成基金量化投资部总监,2028年9月起任大成基金量化投资部总监,2028年10月起任大成基金量化投资部总监,2028年11月起任大成基金量化投资部总监,2028年12月起任大成基金量化投资部总监,2029年1月起任大成基金量化投资部总监,2029年2月起任大成基金量化投资部总监,2029年3月起任大成基金量化投资部总监,2029年4月起任大