

(%)

序号	债券品种	公允价值(元)	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	298,530,400.00	9.00
4	其中：政策性金融债	278,414,400.00	8.48
5	企业债券	2,214,418,588.32	67.44
6	企业短期融资券	431,015,000.00	13.13
7	中期票据	-	0.00
8	可转债	1,983,717,209.16	60.42

0.00
150.08

序号	债券名称	债券名称	数量(元)	公允价值(元)	公允价值占净值比例(%)
1	100015	石化转债	6,120,760	629,887,411.60	19.18
2	130002	中债02	4,653,600	509,960,978.80	15.53
3	130001	中债01	4,852,380	428,986,813.00	13.07
4	120060	中行南01	2,300,000	231,150,000.00	7.04
5	130003	惠工转债	1,902,780	201,276,068.40	6.13

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

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

5.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

5.8 投资组合报告附注

5.8.1 本基金投资的前十名证券的发行主体未被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。

5.8.2 本基金投资的前十名股票中,没有投资于超出基金合同规定的备选股票库之外的股票。

序号	名称	金额(元)
1	有价证券	338,340.38

8,340.28
2,409.91
—
9,300.29

5	应收申购款		12,119,309.20	
6	其他应付款		-	
7	待摊费用		-	
8	其他		-	
9	合计		125,270,059.30	

5.8.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

序号	债券代码	债券名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	110015	石化转债	629,887,411.60	19.18

2	113002	工行转债	509,969,978.80	15.53
3	113001	中行转债	428,986,813.00	13.07
4	113003	重工转债	201,276,068.40	6.13
5	110016	川投转债	49,363,988.80	1.50
6	110013	国投转债	24,398,000.00	0.74
7	110018	国电转债	22,528,000.00	0.69

8	125089	深航转债	9,210,121.66	0.28
9	110019	恒丰转债	1,035,364.40	0.03

§ 6 基金管理人运用固有资金投资本封闭式基金情况
本基金本报告期基金管理人未运用固有资金投资本封闭式基金。

§ 7 影响投资者决策的其他重要信息
本基金本报告期无影响投资者决策的其他重要信息。

§ 8 备查文件目录

8.1 备查文件目录

- 1、中国证监会批准设立大成基金分级债券型证券投资基金的文件；
- 2、大成基金分级债券型证券投资基金基金合同；
- 3、大成基金分级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设立、营业执照、公司章程。

4、大成基金资产管理有限公司批准文件(证监许可[2015]1234号)可在：
5、本报告期内在指定报刊上披露的各种公告原稿。
8.2 存放地点
本季度报告存放在本基金管理人和托管人的住所。
8.3 查阅方式
投资者可在营业时间内免费查阅，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
2013年1月19日

序号	债券代码	债券名称	数量(张)	公允价值(元)	占基金资产净值比例 (%)
----	------	------	-------	---------	------------------

			(元)		
1	110318	11进出18	1,000,000	100,210,000.00	11.29
2	120219	12固开19	1,000,000	100,040,000.00	11.27
3	120411	12农发11	1,000,000	97,980,000.00	11.04
4	126011	08石化债	891,580	85,591,680.00	9.65
5	120401	12农交01	700,000	68,929,000.00	7.77

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

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

5.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资明细
本基金本报告期末未持有权证。

5.8 投资组合报告附注

5.8.1 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。

5.8.2 本基金投资的前十名股票中,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

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	-
2	应收利息	-
3	应收股利	-
4	其他资产	-
5	其他资产	-
6	其他资产	-
7	其他资产	-
8	其他资产	-
9	其他资产	-
10	其他资产	-
11	其他资产	-
12	其他资产	-
13	其他资产	-
14	其他资产	-
15	其他资产	-
16	其他资产	-
17	其他资产	-
18	其他资产	-
19	其他资产	-
20	其他资产	-
21	其他资产	-
22	其他资产	-
23	其他资产	-
24	其他资产	-
25	其他资产	-
26	其他资产	-
27	其他资产	-
28	其他资产	-
29	其他资产	-
30	其他资产	-
31	其他资产	-
32	其他资产	-
33	其他资产	-
34	其他资产	-
35	其他资产	-
36	其他资产	-
37	其他资产	-
38	其他资产	-
39	其他资产	-
40	其他资产	-
41	其他资产	-
42	其他资产	-
43	其他资产	-
44	其他资产	-
45	其他资产	-
46	其他资产	-
47	其他资产	-
48	其他资产	-
49	其他资产	-
50	其他资产	-
51	其他资产	-
52	其他资产	-
53	其他资产	-
54	其他资产	-
55	其他资产	-
56	其他资产	-
57	其他资产	-
58	其他资产	-
59	其他资产	-
60	其他资产	-
61	其他资产	-
62	其他资产	-
63	其他资产	-
64	其他资产	-
65	其他资产	-
66	其他资产	-
67	其他资产	-
68	其他资产	-
69	其他资产	-
70	其他资产	-
71	其他资产	-
72	其他资产	-
73	其他资产	-
74	其他资产	-
75	其他资产	-
76	其他资产	-
77	其他资产	-
78	其他资产	-
79	其他资产	-
80	其他资产	-
81	其他资产	-
82	其他资产	-
83	其他资产	-
84	其他资产	-
85	其他资产	-
86	其他资产	-
87	其他资产	-
88	其他资产	-
89	其他资产	-
90	其他资产	-
91	其他资产	-
92	其他资产	-
93	其他资产	-
94	其他资产	-
95	其他资产	-
96	其他资产	-
97	其他资产	-
98	其他资产	-
99	其他资产	-
100	其他资产	-

2	应收账款(合并报表)		-
3	应收股利		-
4	应收利息	13,886,898.50	-
5	应收申购款		-
6	其他应收款		-
7	坏账准备		-

7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	13,886,898.50

5.8.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

序号	债券代码	债券名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例
----	------	------	---------	-----------

序号	债券代码	债券名称	公允价值(元)	(%)
1	113002	工行转债	32,874,000.00	3.70

5.8.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末未持有股票。

5.8.6 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。

本报告期初基金份额总额	946,271,667.07
本报告期基金总申购份额	612,186.17
减:本报告期基金总赎回份额	57,034,287.40
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期末基金份额总额	889,849,565.84

§ 7 影响投资者决策的其他重要信息

本基金本报告期无影响投资者决策的其他重要信息。

§ 8 备查文件目录

8.1 备查文件目录

1. 中国证监会批准设立大成恒保本混合型证券投资基金的文件。

- 2、伙成景恒保本混合型证券投资基金基金合同》;
- 3、伙成景恒保本混合型证券投资基金基金托管协议》;

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。

8.2 存放地点
本季度报告存放在本基金管理人和托管人的住所。

8.3 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
2013年1月19日

序号	债券品种	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	-	0.00

2	央行票据	549,380,000.00	5.41
3	金融债券	--	0.00
	其中：政策性金融债	--	0.00
4	企业债券	--	0.00
5	企业短期融资券	--	0.00
6	中期票据	--	0.00

7	可转债	-	0.00
8	其他	-	0.00
9	合计	549,380,000.00	5.41

5.5 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名债券投资明细

序号	债券代码	债券名称	数量(张)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
----	------	------	-------	---------	--------------

1	1001060	10央行票据60	2,000,000	199,740,000.00	1.97
2	1001074	10央行票据74	1,500,000	149,760,000.00	1.47
3	1001037	10央行票据37	1,000,000	99,950,000.00	0.98
4	1001042	10央行票据42	1,000,000	99,930,000.00	0.98

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

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

5.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资明细本基金本报告期末未持有权证。

5.8 投资组合报告附注

5.8.1 报告期内本基金投资的前十名证券的发行主体无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。

5.8.2 本基金投资的前十名股票未超出基金合同规定的各该股票库。

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	3,670,116.00
2	应收证券清算款	--
3	应收股利	--
4	应收利息	7,517,083.17

5	应收申购款	94,587.96
6	其他应收款	--
7	待摊费用	--
8	其他	--
9	合计	11,281,787.13

5.8.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

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不存在流通受限情况。

§ 6 开放式基金份额变动		单位:份
本报告期期初基金份额总额		15,955,531,110.56
本报告期基金总申购份额		20,056,918.67
减:本报告期基金总赎回份额		214,297,306.55
本报告期基金份额净变动额		

本报告期基金资产变动份额	-
本报告期末基金份额总额	15,761,290,722.68

§ 7 影响投资者决策的其他重要信息

本基金本报告期无影响投资者决策的其他重要信息。

§ 8 备查文件目录

8.1 备查文件目录

- 1、中国证监会批准设立大成蓝筹稳健证券投资基金的文件；
- 2、大成蓝筹稳健证券投资基金基金合同；
- 3、大成蓝筹稳健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。

8.2 存放地点
本季度报告存放在本基金管理人和托管人的住所。

8.3 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
2013年1月19日
