

基金管理人:大成基金管理有限公司
基金托管人:中国工商银行股份有限公司
送出日期:2013年3月26日

§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。本基金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。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2013年3月25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。

本年度报告摘要来自年度报告正文，投资者欲了解详细内容，应阅读年度报告正文。

本报告所载财务资料已经审计。普华永道中天会计师事务所有限公司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2012年1月1日起至2012年12月31日止。

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金简称	大成保本混合
基金主代码	090013
交易代码	090013
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2011年4月20日
基金管理人	大成基金管理有限公司
基金托管人	中国工商银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	766,957,704.51份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	依照保证合同，本基金通过运用组合保险策略，在为符合保本条件的投资金额提供安全保障的基础上，追求基金资产的长期增值。
投资策略	本基金投资采用VPI可变组合保险策略(Variable Proposition Portfolio Insurance)。VPI策略是国际风险管理领域中一种常见的投资组合保险机制，将股票、债券、货币和现金资产的收益波动和损失波动等来调整，修正风险资产与保本资产的投资组合中占比重，在保证风险资产可能的损失不超过超过其相关费用后的保本资产的收益率与基金前期收益的基础上，参与分享市场可能出现的收益风险，从而保证本金安全，并实现基金资产的长期增值。
业绩比较基准	3年定期存款利率(税后)+0.5%。按照中国人民银行公布的同期金融机构人民币存款基准利率(按照四舍五入的原则保留到小数点后第2位，单位为百分比)计算的与当期保本周期期限相同的税后收益率。
风险收益特征	本基金为保本混合型基金产品，属证券投资基金中的低风险收益品种。

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	中国工商银行股份有限公司
姓名	杜鹏	蒋松云
信息披露负责人	联系电话 0755-83183388	010-66105799
	电子邮件 dlpeng@fund.com.cn	custody@icbc.com.cn
客户服务电话	4008885558	95588
传真	0755-83199588	010-66105798

2.4 信息披露方式

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号招行大厦32层大成基金管理有限公司客户服务部

风险收益特征: 本基金为保本混合型基金产品，属证券投资基金中的低风险收益品种。

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		2012年	2011年4月20日(基金额同生日期)	-2011年12月31日
本期已实现收益		22,762,580.90	20,367,960.90	
本期利润		18,964,922.84	28,200,449.52	
加权平均基金份额本期利润		0.0203	0.0206	
基金总资产份额净值增长率		1.96%	2.20%	
3.1.2 期末数据和指标	2012年末	2011年末		
期末可供分配基金份额利润		0.0382	0.0150	
期末基金资产净值		798,859,138.14	1,204,700,984.55	
基金份额净值		1.042	1.022	

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。

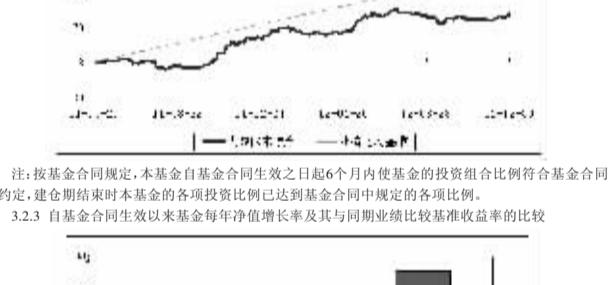
2. 所述基金业绩指标不包括持有人交易基金的各项费用, 计入费用后实际收益水平将低于所列数据。

3.2 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-长(①)	份额净值增 率-短(②)	业绩比较基准 收益率(③)	业绩比较基准收益 率-长(④)	①-③	②-④
过去三个月	0.39%	0.06%	1.12%	0.00%	-0.73%	0.06%
过去六个月	0.10%	0.07%	2.27%	0.00%	-2.17%	0.07%
过去一年	1.96%	0.08%	4.61%	0.00%	-2.65%	0.08%
自基金合同生 效起至今	4.20%	0.08%	8.08%	0.00%	-3.88%	0.08%

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及其与同期业绩比较基准收益率的比较



注:按合同规定,本基金自基金合同生效之日起6个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的约定,建仓期结束时本基金的各项投资比例已达到基金合同中规定的各项比值。

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

3.2.4 过去三年的利润分配情况

3.2.5 基金管理人及其管理基金的经验

4.1 基金管理人及其管理基金的经验

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

4.1.2 基金管理人及其管理基金的经验

4.1.3 基金管理人及其管理基金的经验

4.1.4 基金管理人及其管理基金的经验

4.1.5 基金管理人及其管理基金的经验

4.1.6 基金管理人及其管理基金的经验

4.1.7 基金管理人及其管理基金的经验

4.1.8 基金管理人及其管理基金的经验

4.1.9 基金管理人及其管理基金的经验

4.1.10 基金管理人及其管理基金的经验

4.1.11 基金管理人及其管理基金的经验

4.1.12 基金管理人及其管理基金的经验

4.1.13 基金管理人及其管理基金的经验

4.1.14 基金管理人及其管理基金的经验

4.1.15 基金管理人及其管理基金的经验

4.1.16 基金管理人及其管理基金的经验

4.1.17 基金管理人及其管理基金的经验

4.1.18 基金管理人及其管理基金的经验

4.1.19 基金管理人及其管理基金的经验

4.1.20 基金管理人及其管理基金的经验

4.1.21 基金管理人及其管理基金的经验

4.1.22 基金管理人及其管理基金的经验

4.1.23 基金管理人及其管理基金的经验

4.1.24 基金管理人及其管理基金的经验

4.1.25 基金管理人及其管理基金的经验

4.1.26 基金管理人及其管理基金的经验

4.1.27 基金管理人及其管理基金的经验

4.1.28 基金管理人及其管理基金的经验

4.1.29 基金管理人及其管理基金的经验

4.1.30 基金管理人及其管理基金的经验

4.1.31 基金管理人及其管理基金的经验

4.1.32 基金管理人及其管理基金的经验

4.1.33 基金管理人及其管理基金的经验

4.1.34 基金管理人及其管理基金的经验

4.1.35 基金管理人及其管理基金的经验

4.1.36 基金管理人及其管理基金的经验

4.1.37 基金管理人及其管理基金的经验

4.1.38 基金管理人及其管理基金的经验

4.1.39 基金管理人及其管理基金的经验

4.1.40 基金管理人及其管理基金的经验

4.1.41 基金管理人及其管理基金的经验

4.1.42 基金管理人及其管理基金的经验

4.1.43 基金管理人及其管理基金的经验

4.1.44 基金管理人及其管理基金的经验

4.1.45 基金管理人及其管理基金的经验

4.1.46 基金管理人及其管理基金的经验

4.1.47 基金管理人及其管理基金的经验

4.1.48 基金管理人及其管理基金的经验

4.1.49 基金管理人及其管理基金的经验

4.1.50 基金管理人及其管理基金的经验

4.1.51 基金管理人及其管理基金的经验

4.1.52 基金管理人及其管理基金的经验

4.1.53 基金管理人及其管理基金的经验

4.1.54 基金管理人及其管理基金的经验

4.1.55 基金管理人及其管理基金的经验

4.1.56 基金管理人及其管理基金的经验

4.1.57 基金管理人及其管理基金的经验

4.1.58 基金管理人及其管理基金的经验

4.1.59 基金管理人及其管理基金的经验

4.1.60 基金管理人及其管理基金的经验