

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。本基金年度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。

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2013年3月22日复核了本报告中的财务报表、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等內容，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。

本年度报告摘要节选自年度报告正文，投资者欲了解详细內容，应阅读年度报告正文。

本报告中财务资料已审计。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，敬请投资者注意阅读。

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	091008
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	58,034,933.93份
基金合同存续期	不定期

## 2.2 基金产品说明

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健增值，力争超越行业平均水平的收益率。

本基金将在严格控制组合风险的前提下，基于收益的预期和风险的评估，选择适合的交易策略层面上实施资产配置，个别选择和择时操作相结合，以期在承担有限风险的前提下获得较高投资收益。

业绩比较基准：中债综合指数

本基金是只能满足追求较高稳定回报的基金持有人的理财工具，风险承受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	0755-83183388	010-67595096
电子邮箱	dupeng@dfund.com.cn	Tianqing.lzh@cch.com
客户服务电话	4008855558	010-67595096
传真	0755-83199588	010-66275853

## 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>  
基金管理人住所地: 深圳市福田区深南大道7088号招行银行大厦32层  
基金管理人办公地址: 大成基金管理有限公司  
北京市西城区金融大街25号中国建设银行股份有限公司投资托管服务部

## § 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

## 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	2010年
本期已实现收益	-1,057,271.79	751,866.16	30,004,398.29
本期利润	-148,648.25	-10,614,560.38	19,575,576.75
加权平均基金份额本期利润	-0.0015	-0.0670	0.0342
本期基金份额净值增长率	0.36%	-7.35%	5.82%

3.1.2 期末数据和指标

2012年末 2011年末 2010年末

期末可供基金份额利润 -0.0390 -0.0424 0.0336

期末基金份额净值 55,770,229.07 113,547,286.45 292,770,329.66

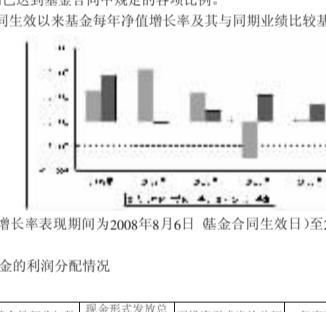
期末基金份额净值 -0.9610 0.9576 1.0336

注:1.本期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,本期利润为期末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,计费方法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与其同期业绩比较基准收益率的比较

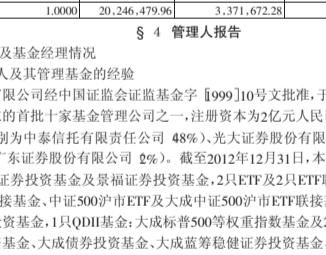
阶段	份额净值增长率	业绩比较基准收益率	业绩比较基准收益率差(%)	①-③	②-④
过去三个月	1.02%	0.13%	0.74%	0.03%	0.28% 0.10%
过去六个月	-1.52%	0.17%	0.58%	0.04%	-2.10% 0.13%
过去一年	0.36%	0.24%	3.60%	0.06%	-3.24% 0.18%
过去三年	-1.61%	0.29%	11.36%	0.07%	-12.97% 0.22%
自基金合同生效起至今	15.57%	0.29%	21.34%	0.09%	-5.77% 0.20%

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。在建仓期间及本报告期内本基金的各项投资比例已达到基金合同中规定的各项比例。

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



注:2008年净值增长率表现期间为2008年8月6日(基金合同生效日)至2008年12月31日,不按整个自然年度进行折算。

3.3 过去三年基金的利润分配情况

单位:人民币元

年度	每10份基金份额分红次数	现金形式分红金额	再投资形式发放总额	年度利润分配合计	备注
2012	2	—	—	—	
2011	2	—	—	—	
2010	1,0000	20,246,479.96	3,371,672.28	23,618,152.24	
合计	1,0000	20,246,479.96	3,371,672.28	23,618,152.24	

## § 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经验

大成基金管理有限公司是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,是中国证监会批准成立的首批十家基金管理公司之一,注册资本为人民币一亿元,人民币,注册地为深圳。目前公司由四家股东组成,分别为中泰信托有限责任公司(48%)、光大证券股份有限公司(25%)、中国银河投资管理有限公司(25%)、广东证券股份有限公司(7%)。截至2012年12月31日,基金管理人共管理2只封闭式证券投资基金、2只开放式证券投资基金、1只QDII基金、大成普利债券基金、大成增强收益债券基金、大成货币市场基金、大成蓝筹稳健债券型基金、大成精选增利货币型基金、大成货币市场基金、大成沪深300指数证券投资基金、大成财富管理2020生命周期证券投资基金、大成恐慌指数证券投资基金、大成景气行业证券投资基金、大成策略增长股票型证券投资基金、大成核心动力股票型证券投资基金、大成景气行业证券投资基金、大成新锐产业股票型证券投资基金、大成恒保稳健混合型证券投资基金、大成可转债增强债券型证券投资基金、大成景气行业证券投资基金、大成月添利货币市场基金、大成月添利货币型证券投资基金、大成月添利债券型证券投资基金、大成月添利债券型证券投资基金。

4.1.2 基金经理或基金经理助理简介

姓名 职务 任本基金的基金经理(助理)期限 说明

陈尚前先生 2008年8月6日 14年 南开大学经济学博士。曾任中国平安保险公司投资管理中心债券投资主任和公司研究发展中心策略部经理。2002年加盟大成基金管理有限公司,2003年6月至2009年5月担任大成债券基金基金经理,2008年8月6日开始担任大成稳健收益债券基金经理,2010年10月15日开始兼任大成景气分级债券基金经理,2011年4月20日起同时兼任大成保本型证券投资基金基金经理,基金管理人固定收益部总监,固定收益投资决策委员会主席,负责公司固定收益证券投资业务,并兼任大成国际资产管理有限公司董事,具有基金从业资格,国籍:中国。

注:1、任职日期、离任日期为基金管理人作出决定之日起。  
2、证券从业人员年限的计算标准遵从《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规性情况的说明

本报告期内,基金管理人严格遵守《证券法》、《证券投资基金法》、《大成强化收益债券型证券投资基金基金合同》及其他法律法规的规定,在基金管理运作中,大成强化收益债券型证券投资基金的投资范围、投资比例、投资组合、证券交易行为、信息披露等均符合有关法律法规、行业监管规则和基金合同的约定,不存在损害基金持有人利益的行为,完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

4.3 公平交易制度和公平交易原则的执行情况

本基金报告期内,基金管理人严格执行公平交易制度,在投资决策、交易执行、业绩评估等环节均按照《证券投资基金公平交易管理制度》的规定,未发生重大违法违规行为,没有因不公平交易而损害基金持有人利益的情况。

4.4 公平交易制度的执行情况

报告期内,基金管理人严格执行公平交易的原則和制度。

4.5 公平交易制度的执行情况

报告期内,基金管理人严格执行公平交易的原則和制度。

4.6 报告期内公平交易情况的专题说明

本基金报告期内,基金管理人严格执行公平交易的原則和制度。

4.7 报告期内公平交易情况的专题说明

本基金报告期内,基金管理人严格执行公平交易的原則和制度。

4.8 报告期内公平交易情况的专题说明

本基金报告期内,基金管理人严格执行公平交易的原則和制度。

4.9 报告期内公平交易情况的专题说明

本基金报告期内,基金管理人严格执行公平交易的原則和制度。

4.10 报告期内公平交易情况的专题说明

本基金报告期内,基金管理人严格执行公平交易的原則和制度。

4.11 报告期内公平交易情况的专题说明

本基金报告期内,基金管理人严格执行公平交易的原則和制度。

4.12 报告期内公平交易情况的专题说明

本基金报告期内,基金管理人严格执行公平交易的原則和制度。

4.13 报告期内公平交易情况的专题说明

本基金报告期内,基金管理人严格执行公平交易的原則和制度。

4.14 报告期内公平交易情况的专题说明

本基金报告期内,基金管理人严格执行公平交易的原則和制度。

4.15 报告期内公平交易情况的专题说明

本基金报告期内,基金管理人严格执行公平交易的原則和制度。

4.16 报告期内公平交易情况的专题说明

本基金报告期内,基金管理人严格执行公平交易的原則和制度。

4.17 报告期内公平交易情况的专题说明

本基金报告期内,基金管理人严格执行公平交易的原則和制度。

4.18 报告期内公平交易情况的专题说明

本基金报告期内,基金管理人严格执行公平交易的原則和制度。

4.19 报告期内公平交易情况的专题说明

本基金报告期内,基金管理人严格执行公平交易的原則和制度。

4.20 报告期内公平交易情况的专题说明

本基金报告期内,基金管理人严格执行公平交易的原則和制度。

4.21 报告期内公平交易情况的专题说明