

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
送达日期:2013年3月26日

基金管理人的董事会、监事会对本报告的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。

基金托管人中国农业银行股份有限公司根据本基金合同的规定，于2013年3月22日核对了本报告中的财务报表、净值表现、附注、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等內容，保证复核报告不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

基金的过往业绩不足以预测其未来表现。投资者欲了解详细内容，应阅读年度报告正文。

本年度报告摘要摘自年度报告正文，投资者欲了解详细内容，应阅读年度报告全文。

本报告期自2012年01月01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 大成债券

基金主代码 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

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

报告期末基金份额总额 256,780,481.79份

基金合同存续期间 不定期

下属分级基金的基本简称： 大成债券A/B 大成债券C

下属分级基金的交易代码： 090002/091002 092002

报告期末下属分级基金的份额总额 178,915,463.50份 77,865,018.29份

2.2 基金产品说明

在力保本金安全和保持资产流动性的基础上追求资产的长期稳定增值。

通过整体资产配置、类属资产配置和个券选择三个层次自上而下地进行投资

管理，以实现投资目标。类属资产部分按照相对均一化、横跨行业在交易所市

场、交易所国债、银行间国债、银行间金融债之间实行最优配置。

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 中国农业银行股份有限公司

姓名 邓鹏 李芳菲

信息披露负责人 联系电话 0755-83183388 010-66006069

电子邮箱 dupeng@efund.com.cn lifangfei@abcchina.com

客户服务电话 4008855558 95599

传真 0755-83199588 010-63201816

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.efund.com.cn>

深圳证券交易所深证1008号招商银行大厦32层大成基金管理有限公司

基金年度报告备置地点 北京市西城区复兴门内大街28号凯晨世贸中心东座9层中国农业银行股份有限公司托管业务部

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(①)

2012年 2011年 2010年

大成债券A/B 大成债券C 大成债券A/B 大成债券C

5,118,263.08 3,259,236.92 6,141,522.22 3,905,894.44 19,457,359.14 22,823,708.78

本期已实现收益 10,042,870.12 4,651,937.36 2,762,564.82 934,637,487.26 24,372,639.19

加权平均基金 0.0478 0.0288 0.0100 0.0059 0.0642 0.0740

本期利润 4.85% 4.47% 0.94% 0.62% 6.19%

净利润 4.85% 4.47% 0.94% 0.62% 6.19%

净利增长 1.0552 1.0436 1.0173 0.9989 1.0508 1.0227

注:1.本期已实现收益指本期利息收入、投资收益、其他收入(不含汇率升值变动收益)扣除相关费用后的余额，本期利润为已实现收益加上本期公允价值变动收益。
注:2.上述基金业绩指标不包括持有人认购基金的各项费用，计入费用后实际收益水平将低于所列数字。

5.1.1 本期已实现收益指本期利息收入、投资收益、其他收入(不含汇率升值变动收益)扣除相关费用后的余额，本期利润为已实现收益加上本期公允价值变动收益。

5.1.2 本期基金业绩指标不包括持有人认购基金的各项费用，计入费用后实际收益水平将低于所列数字。

5.2.1 基金净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

大成债券A/B

阶段 份额净值增长率(①) 份额净值增长率(②) 业绩比较基准收益率差额(③) 业绩比较基准收益率差额(④) ①-③ ②-④

过去三个月 1.54% 0.06% 0.56% 0.03% 0.98% 0.03%

过去六个月 1.28% 0.06% 0.16% 0.05% 1.12% 0.01%

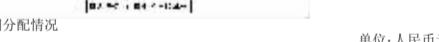
过去一年 4.85% 0.07% 2.51% 0.07% 2.34% 0.00%

过去三年 12.78% 0.14% 10.46% 0.09% 2.32% 0.05%

过去五年 28.71% 0.14% 25.33% 0.13% 3.38% 0.01%

自基金合同生效起至今 73.67% 0.19% 34.32% 0.18% 39.35% 0.01%

5.2.2 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



5.2.3 过去五年基金净值增长率与其同期业绩比较基准收益率的比较

大成债券A/B

阶段 份额净值增长率(①) 份额净值增长率(②) 业绩比较基准收益率差额(③) 业绩比较基准收益率差额(④) ①-③ ②-④

过去三个月 1.54% 0.06% 0.56% 0.03% 0.98% 0.03%

过去六个月 1.28% 0.06% 0.16% 0.05% 1.12% 0.01%

过去一年 4.85% 0.07% 2.51% 0.07% 2.34% 0.00%

过去三年 12.78% 0.14% 10.46% 0.09% 2.32% 0.05%

过去五年 28.71% 0.14% 25.33% 0.13% 3.38% 0.01%

自基金合同生效起至今 73.67% 0.19% 34.32% 0.18% 39.35% 0.01%

5.2.4 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



5.2.5 过去五年基金净值增长率与其同期业绩比较基准收益率的比较

大成债券A/B

阶段 份额净值增长率(①) 份额净值增长率(②) 业绩比较基准收益率差额(③) 业绩比较基准收益率差额(④) ①-③ ②-④

过去三个月 1.54% 0.06% 0.56% 0.03% 0.98% 0.03%

过去六个月 1.28% 0.06% 0.16% 0.05% 1.12% 0.01%

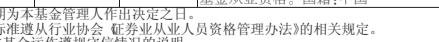
过去一年 4.85% 0.07% 2.51% 0.07% 2.34% 0.00%

过去三年 12.78% 0.14% 10.46% 0.09% 2.32% 0.05%

过去五年 28.71% 0.14% 25.33% 0.13% 3.38% 0.01%

自基金合同生效起至今 73.67% 0.19% 34.32% 0.18% 39.35% 0.01%

5.2.6 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



5.2.7 基金合同生效以来基金净值增长率与其同期业绩比较基准收益率的比较

大成债券A/B

阶段 份额净值增长率(①) 份额净值增长率(②) 业绩比较基准收益率差额(③) 业绩比较基准收益率差额(④) ①-③ ②-④

过去三个月 1.54% 0.06% 0.56% 0.03% 0.98% 0.03%

过去六个月 1.28% 0.06% 0.16% 0.05% 1.12% 0.01%

过去一年 4.85% 0.07% 2.51% 0.07% 2.34% 0.00%

过去三年 12.78% 0.14% 10.46% 0.09% 2.32% 0.05%

过去五年 28.71% 0.14% 25.33% 0.13% 3.38% 0.01%

自基金合同生效起至今 73.67% 0.19% 34.32% 0.18% 39.35% 0.01%

5.2.8 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

5.2.9 过去五年基金净值增长率与其同期业绩比较基准收益率的比较

大成债券A/B

阶段 份额净值增长率(①) 份额净值增长率(②) 业绩比较基准收益率差额(③) 业绩比较基准收益率差额(④) ①-③ ②-④

过去三个月 1.54% 0.06% 0.56% 0.03% 0.98% 0.03%

过去六个月 1.28% 0.06% 0.16% 0.05% 1.12% 0.01%

过去一年 4.85% 0.07% 2.51% 0.07% 2.34% 0.00%

过去三年 12.78% 0.14% 10.46% 0.09% 2.32% 0.05%

过去五年 28.71% 0.14% 25.33% 0.13% 3.38% 0.01%

自基金合同生效起至今 73.67% 0.19% 34.32% 0.18% 39.35% 0.01%

5.2.10 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

5.2.11 基金合同生效以来基金净值增长率与其同期业绩比较基准收益率的比较

大成债券A/B

阶段 份额净值增长率(①) 份额净值增长率(②) 业绩比较基准收益率差额(③) 业绩比较基准收益率差额(④) ①-③ ②-④

过去三个月 1.54% 0.06% 0.56% 0.03% 0.98% 0.03%

过去六个月 1.28% 0.06% 0.16% 0.05% 1.12% 0.01%

过去一年 4.85% 0.07% 2.51% 0.07% 2.34% 0.00%

过去三年 12.78% 0.14% 10.46% 0.09% 2.32% 0.05%

过去五年 28.71% 0.14% 25.33% 0.13% 3.38% 0.01%

自基金合同生效起至今 73.67% 0.19% 34.32% 0.18% 39.35% 0.01%

5.2.12 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

<img alt="Line chart showing the cumulative net value growth rate of the fund from January 2003 to December 2012, comparing it with the performance of the同期基准收益率 (Benchmark Performance). The fund's growth rate is consistently higher than the benchmark throughout the period." data-bbox="7