

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  
基金合同生效日期:2011年8月27日

重要提示

基金管理人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法律责任。 本年度报告所载数据截止日为2011年6月30日,并经注册会计师审计。 基金托管人中国农业银行股份有限公司(以下简称“中国农业银行”)根据基金合同规定,于2011年8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,也不保证基金份额持有人的本金不受损失,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更新。 基金的投资运作并不代表其未来表现,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更新。

本半年度报告摘自自半年度报告正文,投资者欲了解详细内容,应阅读半年度报告正文。

本报告刊登于中国证监会指定网站,投资者欲了解详细内容,应阅读半年度报告正文。

本报告自2011年7月1日起至2011年6月30日止。

基金简介

2.1 基金基本情况	大成债券
基金简称	大成债券
基金代码	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	445,643,996.36份
基金合同期限	不定期
跟踪投资标的基金名称	大成债券 A
跟踪投资标的基金代码	090002/0102
报告期末所属层级基金的份额总额	285,301,260.25份
2.2 基金业绩说明	160,342,736.11份

投资目标 在确保本金安全和保持资产流动性的基础上追求资产价值的长期稳定增值。

投资策略 通过资产配置、属属资产配置和属属资产配置三个层次自上而下地进行资产配置,以实现投资收益目标。属属资产配置和属属资产配置均分为属属资产配置和属属资产配置,属属资产配置分为属属资产配置和属属资产配置。

业绩比较基准	中国国债指数
2.3 基金管理人和其他基金托管人	

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
注册	李芳菲	
信息披露负责人	联系电话 0755-83183888	010-66060069
电子邮箱	dapeng@dfund.com.cn	dfund@ahcb.com.cn
客户服务电话	4008885588	95599
网址	0755-83198588	100-63201816

基金半年度报告正文的全文互联网网址: <http://www.dcfund.com>

基金半年度报告各签署地点: 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 北京市西城区复兴门内大街28号凯悦酒店中心东塔19层 中国农业银行股份有限公司总行营业部

主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标	金额单位:人民币元	
基金业绩指标	报告期(2011年1月1日至2011年6月30日)	
3.1.1 期间数据指标	大成债券 A B	大成债券 C
本期已实现收益	7,284,372.79	4,385,591.89
本期利润	1,769,387.28	861,286.241
加权平均基金份额本期利润	0.0062	0.0046
本基金基金份额净值增长率	0.46%	0.31%

3.1.2 期末基金份额指标	报告期末(2011年6月30日)	
期末可供分配基金份额利润	0.0125	-0.0042
期末基金份额净值	288.809,539.25	159.665,195.16
期末基金份额净值	1.0125	0.9958

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.所述基金份额指标不包括持有人交易基金的各项费用,计入费用后来收益水平会低于所列数据。

基金业绩比较基准

3.2 基金业绩比较基准	业绩比较基准
3.2.1 基金业绩比较基准及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较	

份额类别	阶段	份额净值增长率	业绩比较基准收益率差	业绩比较基准收益率标准差	①-③	②-④
------	----	---------	------------	--------------	-----	-----

大成债券 A B	过去一个月	-0.76%	0.10%	-0.42%	0.10%	-0.34%
	过去三个月	0.14%	0.09%	0.36%	0.07%	-0.22%
	过去六个月	0.46%	0.13%	1.03%	0.08%	-0.57%
	过去一年	4.12%	0.18%	-0.44%	0.10%	4.57%
	过去三年	19.83%	0.16%	14.74%	0.15%	5.69%
	自基金合同生效起至今	64.76%	0.20%	25.21%	0.19%	39.55%

大成债券 C	过去一个月	-0.79%	0.10%	-0.42%	0.10%	-0.37%
	过去三个月	0.05%	0.09%	0.36%	0.07%	-0.31%
	过去六个月	0.31%	0.13%	1.03%	0.08%	-0.72%
	过去一年	3.78%	0.18%	-0.44%	0.10%	4.22%
	过去三年	18.41%	0.16%	14.74%	0.15%	3.67%
	自基金合同生效起至今	60.81%	0.20%	25.21%	0.19%	35.60%

注:1.本基金业绩比较基准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.所述基金份额指标不包括持有人交易基金的各项费用,计入费用后来收益水平会低于所列数据。

基金业绩比较基准

3.2.1 基金业绩比较基准及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较	
-----------------------------------	--

份额类别	阶段	份额净值增长率	业绩比较基准收益率差	业绩比较基准收益率标准差	①-③	②-④
------	----	---------	------------	--------------	-----	-----

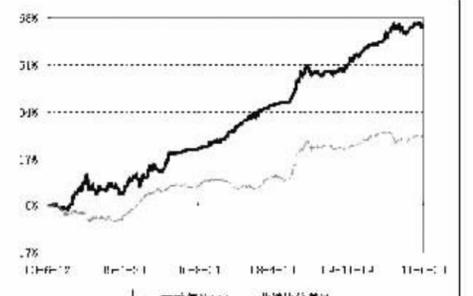
大成债券 A B	过去一个月	-0.76%	0.10%	-0.42%	0.10%	-0.34%
	过去三个月	0.14%	0.09%	0.36%	0.07%	-0.22%
	过去六个月	0.46%	0.13%	1.03%	0.08%	-0.57%
	过去一年	4.12%	0.18%	-0.44%	0.10%	4.57%
	过去三年	19.83%	0.16%	14.74%	0.15%	5.69%
	自基金合同生效起至今	64.76%	0.20%	25.21%	0.19%	39.55%

大成债券 C	过去一个月	-0.79%	0.10%	-0.42%	0.10%	-0.37%
	过去三个月	0.05%	0.09%	0.36%	0.07%	-0.31%
	过去六个月	0.31%	0.13%	1.03%	0.08%	-0.72%
	过去一年	3.78%	0.18%	-0.44%	0.10%	4.22%
	过去三年	18.41%	0.16%	14.74%	0.15%	3.67%
	自基金合同生效起至今	60.81%	0.20%	25.21%	0.19%	35.60%

注:1.本基金业绩比较基准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.所述基金份额指标不包括持有人交易基金的各项费用,计入费用后来收益水平会低于所列数据。

3.2.2 自基金合同生效以来基金业绩比较基准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:1.本基金于2006年4月24日推出持续收取费率,将前期收取费率定义为A类收取费率,后期收取费率定义为B类收取费率,二者对应的基金份额简称“大成债券 A B”;将前期收取费率定义为C类收取费率,对应的基金份额简称“大成债券 C”。

2.按基金合同约定,本基金自基金合同生效起6个月内建仓期,截至报告日本基金的各项投资比例已达到基金合同第十二条的(一)项投资组合中规定的各项比例;本基金投资于债券类投资工具的比例不低于基金资产总值的80%,投资于国债的比例不低于基金资产净值的30%。

基金管理人

4.1 基金管理人及基金基本情况	
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(以下简称“大成基金”)经中国证监会基金字[1999]30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12家基金管理公司之一,注册资本为2亿元人民币,注册地在中国深圳。目前大成基金托管人中国农业银行股份有限公司(以下简称“中国农业银行”)根据基金合同规定,于2011年8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,也不保证基金份额持有人的本金不受损失,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更新。 基金的投资运作并不代表其未来表现,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更新。

本半年度报告摘自自半年度报告正文,投资者欲了解详细内容,应阅读半年度报告正文。

本报告刊登于中国证监会指定网站,投资者欲了解详细内容,应阅读半年度报告正文。

本报告自2011年7月1日起至2011年6月30日止。

基金简介

2.1 基金基本情况	大成债券
基金简称	大成债券
基金代码	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	445,643,996.36份
基金合同期限	不定期
跟踪投资标的基金名称	大成债券 A
跟踪投资标的基金代码	090002/0102
报告期末所属层级基金的份额总额	285,301,260.25份
2.2 基金业绩说明	160,342,736.11份

投资目标 在确保本金安全和保持资产流动性的基础上追求资产价值的长期稳定增值。

投资策略 通过资产配置、属属资产配置和属属资产配置三个层次自上而下地进行资产配置,以实现投资收益目标。属属资产配置和属属资产配置均分为属属资产配置和属属资产配置。

业绩比较基准	中国国债指数
2.3 基金管理人和其他基金托管人	

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
注册	李芳菲	
信息披露负责人	联系电话 0755-83183888	010-66060069
电子邮箱	dapeng@dfund.com.cn	dfund@ahcb.com.cn
客户服务电话	4008885588	95599
网址	0755-83198588	100-63201816

基金半年度报告正文的全文互联网网址: <http://www.dcfund.com>

基金半年度报告各签署地点: 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 北京市西城区复兴门内大街28号凯悦酒店中心东塔19层 中国农业银行股份有限公司总行营业部

主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标	金额单位:人民币元	
基金业绩指标	报告期(2011年1月1日至2011年6月30日)	
3.1.1 期间数据指标	大成债券 A B	大成债券 C
本期已实现收益	7,284,372.79	4,385,591.89
本期利润	1,769,387.28	861,286.241
加权平均基金份额本期利润	0.0062	0.0046
本基金基金份额净值增长率	0.46%	0.31%

3.1.2 期末基金份额指标	报告期末(2011年6月30日)	
期末可供分配基金份额利润	0.0125	-0.0042
期末基金份额净值	288.809,539.25	159.665,195.16
期末基金份额净值	1.0125	0.9958

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.所述基金份额指标不包括持有人交易基金的各项费用,计入费用后来收益水平会低于所列数据。

基金业绩比较基准

3.2 基金业绩比较基准	业绩比较基准
3.2.1 基金业绩比较基准及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较	

份额类别	阶段	份额净值增长率	业绩比较基准收益率差	业绩比较基准收益率标准差	①-③	②-④
------	----	---------	------------	--------------	-----	-----

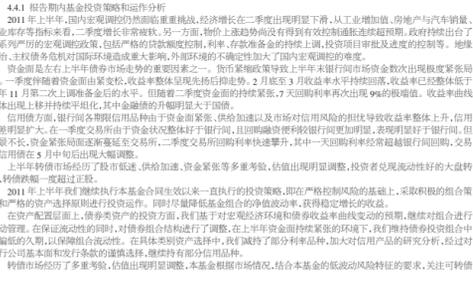
大成债券 A B	过去一个月	-0.76%	0.10%	-0.42%	0.10%	-0.34%
	过去三个月	0.14%	0.09%	0.36%	0.07%	-0.22%
	过去六个月	0.46%	0.13%	1.03%	0.08%	-0.57%
	过去一年	4.12%	0.18%	-0.44%	0.10%	4.57%
	过去三年	19.83%	0.16%	14.74%	0.15%	5.69%
	自基金合同生效起至今	64.76%	0.20%	25.21%	0.19%	39.55%

大成债券 C	过去一个月	-0.79%	0.10%	-0.42%	0.10%	-0.37%
	过去三个月	0.05%	0.09%	0.36%	0.07%	-0.31%
	过去六个月	0.31%	0.13%	1.03%	0.08%	-0.72%
	过去一年	3.78%	0.18%	-0.44%	0.10%	4.22%
	过去三年	18.41%	0.16%	14.74%	0.15%	3.67%
	自基金合同生效起至今	60.81%	0.20%	25.21%	0.19%	35.60%

注:1.本基金业绩比较基准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.所述基金份额指标不包括持有人交易基金的各项费用,计入费用后来收益水平会低于所列数据。

3.2.2 自基金合同生效以来基金业绩比较基准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:1.本基金于2006年4月24日推出持续收取费率,将前期收取费率定义为A类收取费率,后期收取费率定义为B类收取费率,二者对应的基金份额简称“大成债券 A B”;将前期收取费率定义为C类收取费率,对应的基金份额简称“大成债券 C”。

2.按基金合同约定,本基金自基金合同生效起6个月内建仓期,截至报告日本基金的各项投资比例已达到基金合同第十二条的(一)项投资组合中规定的各项比例;本基金投资于债券类投资工具的比例不低于基金资产总值的80%,投资于国债的比例不低于基金资产净值的30%。

基金管理人

4.1 基金管理人及基金基本情况	
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(以下简称“大成基金”)经中国证监会基金字[1999]30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12家基金管理公司之一,注册资本为2亿元人民币,注册地在中国深圳。目前大成基金托管人中国农业银行股份有限公司(以下简称“中国农业银行”)根据基金合同规定,于2011年8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,也不保证基金份额持有人的本金不受损失,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更新。 基金的投资运作并不代表其未来表现,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更新。

本半年度报告摘自自半年度报告正文,投资者欲了解详细内容,应阅读半年度报告正文。

本报告刊登于中国证监会指定网站,投资者欲了解详细内容,应阅读半年度报告正文。

本报告自2011年7月1日起至2011年6月30日止。

基金简介

2.1 基金基本情况	大成债券
基金简称	大成债券
基金代码	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	445,643,996.36份
基金合同期限	不定期
跟踪投资标的基金名称	大成债券 A
跟踪投资标的基金代码	090002/0102
报告期末所属层级基金的份额总额	285,301,260.25份
2.2 基金业绩说明	160,342,736.11份

投资目标 在确保本金安全和保持资产流动性的基础上追求资产价值的长期稳定增值。

投资策略 通过资产配置、属属资产配置和属属资产配置三个层次自上而下地进行资产配置,以实现投资收益目标。属属资产配置和属属资产配置均分为属属资产配置和属属资产配置。

业绩比较基准	中国国债指数
2.3 基金管理人和其他基金托管人	

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
注册	李芳菲	
信息披露负责人	联系电话 0755-83183888	010-66060069
电子邮箱	dapeng@dfund.com.cn	dfund@ahcb.com.cn
客户服务电话	4008885588	95599
网址	0755-83198588	100-63201816

基金半年度报告正文的全文互联网网址: <http://www.dcfund.com>

基金半年度报告各签署地点: 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 北京市西城区复兴门内大街28号凯悦酒店中心东塔19层 中国农业银行股份有限公司总行营业部

主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标	金额单位:人民币元	
基金业绩指标	报告期(2011年1月1日至2011年6月30日)	
3.1.1 期间数据指标	大成债券 A B	大成债券 C
本期已实现收益	7,284,372.79	4,385,591.89
本期利润	1,769,387.28	861,286.241
加权平均基金份额本期利润	0.0062	0.0046
本基金基金份额净值增长率	0.46%	0.31%

3.1.2 期末基金份额指标	报告期末(2011年6月30日)	
期末可供分配基金份额利润	0.0125	-0.0042
期末基金份额净值	288.809,539.25	159.665,195.16
期末基金份额净值	1.0125	0.9958

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.所述基金份额指标不包括持有人交易基金的各项费用,计入费用后来收益水平会低于所列数据。

基金业绩比较基准

3.2 基金业绩比较基准	业绩比较基准
3.2.1 基金业绩比较基准及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较	

份额类别	阶段	份额净值增长率	业绩比较基准收益率差</
------	----	---------	--------------