送出日期;2012年3月28日 基金管理人的董事会、董事保证本报告所载资料不存在服假记载、误导性除述或重大遗漏,并对其内容的真实性、准确性 能能性系担个別及连带的法律责任。本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。 基金托管人中国或见谁衔报份有限公司根据本基金合同规定,于2012年3月33日复核了本报告中的财务指标。净值表 利润价贴信息、纷多会计报告、按照组合报告等项等。保证复核对客不存在能促放。误导性陈述或者重大遗漏。 基金管理人承据以读法信用,勤起尽册的原制管理和运用基金资产。但不保证基金一定查利。 基金管理人承据以读法信用,勤起尽册的原制管理和运用基金资产。但不保证基金一定查利。

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,应阅读年度报告正文。 本报告中财务资料已经审计。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

本报告期日 2011 年 1 月 1 日起: 2.1 基金基本情况	E 12 万 31 □ Ⅲ。 §2 基金简介	
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	3
报告期末基金份额总额	369,419,592.66 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称:	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	255,094,545.37 份	114,325,047.29 份
2.2 基金产品说明		
投资目标 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。

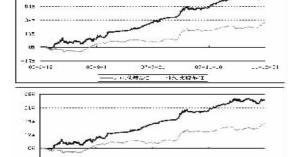
项目		基金管理人	基金托管人
名称		大成基金管理有限公司	中国农业银行股份有限公司
	姓名	杜鹏	李芳菲
信息披露负责人	联系电话	0755-83183388	010-66060069
	电子邮箱	dupeng@dcfund.com.cn	lifangfei@abchina.com
客户服务电话		4008885558	95599
传真		0755-83199588	010-63201816
2.4 信息披露方式			
登载基金年度报告正文的管理人互联网网		M http://	sww.defund.com.en

http://www.dcfund.com.cn

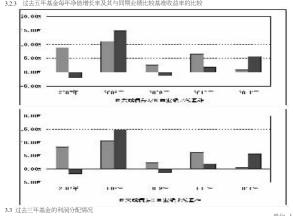
市福田区深南大道 7088 号招商银行大厦 32 层大成基金管理有限公司 北京市西城区复兴门内大街 28 号凯晨世贸中心东座 F9 中国农业银 基金年度报告备置地点 3.1 主要会计数据和财务指标

						金额毕位:人民市	
3.1.1 期间 数据和指 标	2011年		201	0年	2009年		
	大成债券 A/B	大成债券 C	大成债券 A/B	大成债券C	大成债券 A/B	大成债券 C	
本期已实 现收益	6,141,522.22	3,595,894.44	19,457,359.14	22,823,708.78	26,639,520.57	70,092,651.75	
本期利润	2,762,564.82	934,637.46	14,316,872.58	26,427,639.18	-2,212,844.38	-29,301,169.30	
加权平均 基金份额 本期利润	0.0100	0.0059	0.0642	0.0740	-0.0061	-0.0325	
本期基金 份额净值 增长率	0.94%	0.62%	6.56%	6.19%	2.72%	2.24%	
3.1.2 期末 数据和指 标	2011年末		2010	年末	2009年末		
期末可供 分配基金 份額利润	0.0173	-0.0011	0.0508	0.0227	0.0488	0.0259	
期 末 基 金 资产净值	259,516,214.96	114,195,738.94	268,170,073.60	248,646,770.36	197,698,339.52	271,404,395.53	
期 末 基 金 份額净值	1.0173	0.9989	1.0508	1.0227	1.0488	1.0259	

阶段	份额净值 增长率①	份额净值增长率 标准差②	业绩比较基准 收益率③	业绩比较基准收 益率标准差④	1)-(3)	2-4
过去三个月	3.36%	0.16%	4.04%	0.13%	-0.68%	0.03%
过去六个月	0.47%	0.15%	4.65%	0.13%	-4.18%	0.02%
过去一年	0.94%	0.14%	5.72%	0.11%	-4.78%	0.03%
过去三年	10.48%	0.15%	6.41%	0.10%	4.07%	0.05%
过去五年	33.54%	0.16%	20.05%	0.13%	13.49%	0.03%
自基金合同生 效起至今	65.55%	0.20%	31.03%	0.19%	34.52%	0.01%
过去三个月	3.29%	0.16%	4.04%	0.13%	-0.75%	0.03%
过去六个月	0.31%	0.15%	4.65%	0.13%	-4.34%	0.02%
过去一年	0.62%	0.14%	5.72%	0.11%	-5.10%	0.03%
过去三年	9.23%	0.15%	6.41%	0.10%	2.82%	0.05%
过去五年	30.64%	0.16%	20.05%	0.13%	10.59%	0.03%
自基金合同生 效起至今	61.30%	0.20%	31.03%	0.19%	30.27%	0.01%
	过去三个月 过去六个月 过去一年 过去三年 过去三年 自基金合同生 过去三个月 过去六个月 过去六个月 过去三年 过去三年 目基金元十月 过去六个月 过去二年 目基金元十月	財政 増长率の   対土   対土   対土   対土   対土   対土   対土   対	#技・単立 标准業② 过去三个月 33.66% 过去六个月 0.47% 0.15% 过去六个月 0.47% 0.15% 过去六年 10.48% 0.15% 过去五年 10.48% 0.15% 过去五年 33.54% 0.16% 包基金合同生 65.55% 0.20% 过去三个月 32.9% 0.16% 过去六个月 0.31% 0.15% 过去一年 0.62% 0.14% 过去二年 92.3% 0.15% 过去五年 33.64% 0.15% 过去五年 10.62% 0.16% 日基金合同生 61.30% 0.16% 日基金合同生 61.40% 0.20% 0.16%	物味   物味を②   収益率③   収益率③   収益率③   収益率③   14.04%   14.0	野(家   樹冬率①   标准差②   収益率③   益率标准差④   过去三个月   3.36%   0.16%   4.04%   0.13%   过去六个月   0.47%   0.15%   4.65%   0.13%   过去一年   0.94%   0.14%   5.72%   0.11%   过去三年   10.48%   0.15%   6.41%   0.10%   0.15%   6.41%   0.10%   0.15%   0.16%   20.05%   0.13%   0.15%   0.16%   20.05%   0.13%   0.15%   0.16%   0.16%   0.15%   4.65%   0.13%   0.15%   4.65%   0.13%   0.15%   4.65%   0.13%   0.15%   0.15%   4.65%   0.13%   0.15%   0.15%   0.16%   0.15%   0.1	野球   搬送率①   标准差②   収益率③   益率标准差④   13-6   13-6   1-6   13-6   1-6   13-6   1-6   13-6   1-6   13-6   1-6   13-6   1-6   13-6   1-6   13-6   1-6   13-6   1-6   13-6   1-6   13-6   1-6   13



· 中以数1000年(1月) 生:1.4年經歷,2007 经收费模式、者对应的基金份額商格、失成债券 AB\*,1将持续性収效模式及及少0.50%以2007 债券 C\*。 2校基金合同规定、本基金自基金合同生效配6个月内为建仓期,截至报告日本基金的各项投资比例已达到基金合同第 十二条之 份、股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单值的 20%。 3.2.3 过去五年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



每 10 份基金份 额分红数	现金形式发放总额	再投资形式发放总额	年度利润分配合计	备注
0.4300	7,180,724.32	4,195,539.53	11,376,263.85	-
0.6500	8,537,661.32	5,643,971.32	14,181,632.64	-
0.4000	9,165,457.68	5,694,305.68	14,859,763.36	-
1.4800	24,883,843.32	15,533,816.53	40,417,659.85	-
每 10 份基金份 额分红数	现金形式发放总额	再投资形式发放总额	年度利润分配合计	备注
0.3000	4,395,618.19	1,345,363.88	5,740,982.07	-
0.6500	18,776,656.10	4,354,816.36	23,131,472.46	-
0.4000	41,609,086.42	6,618,778.07	48,227,864.49	
1.3500	64,781,360.71	12,318,958.31	77,100,319.02	
	0.4300 0.6500 0.4000 1.4800 每 10 份基金份 额分红数 0.3000 0.6500 0.4000	### (751.0) (4330 7.180.724.32 0.6500 8.537.661.32 0.4000 9.165,457.68 1.4800 24.883,843.32 日 10 分基金份 現金形式发放急額 0.3000 4.395.618.19 0.6500 18.776.656.10 0.4000 41.699,086.42 1.1500 64.781.360.71	##7721.0X 4.195.539.53	(報77年) 校 7、180、724.32 4.195.539.53 11.376.263.85 0.6500 8.537.661.32 5.643.971.32 14.181.632.64 0.4000 9.165.457.68 5.694.305.68 14.859.763.36 1.4800 24.883.843.32 15.533.816.53 40.417.659.85 年 10 份基金分 報金を定めた総額 再投資形式发放总額 年度利润分配合计 0.3000 4.395.618.19 1.345.363.88 5.740.982.07 0.6500 18.776.656.10 4.354.816.36 23.131.472.46 0.4000 41.609.0864.2 6.618.778.07 48.227.864.49 1.3550 64.781.360.71 12.318.958.31 77.100.31902

姓名 职务 任本基金的基金经理期限 证券从业年 限	债增强债券型证 4.1.2 基金		理小组 )及基金组			
在职日期 离任日期 整任日期 整 经济学额上。曾任职于申银万国证券股份有限之司、南京市商业银行资金营业各价有限之司、南京市商业银行资金营业各价。曾任大成货币市场业金基金管理有限公司。曾任大成货币市场起告金基金经理。10年 110年 理助理:2007年1月12日起任大成货币市场证券投资基金基金经理。具有基金从业资格。国籍中电	h4-77	町水	任本基金的	基金经理期限		HARE
王立女士 本基金基金 2009年5月23 - 10年 10年 10年 2009年5月23 - 10年 10年 11年 11年 11年 11年 11年 11年 11年 11年	XEAD	B/(95	任职日期	离任日期	限	10097
		经理	B	- 施山小空之口	10年	份有限公司、南京市商业银行资金营运中心。2005年4月加入大成基金管理中心。2007年1月12日起担任大成货币市场基金基金经理助理。2007年1月12日起担任大成货币市场证券投资基金基金经理。2009年5月23日起兼任大成债券投资基金基金经理。具有基金从业资格。国籍:中

## 大成债券投资基金

## 2011 年度 报告摘要

## 2011年 12 月 31 日

格的资产选择原则进行投资运作。同时尽量降低基金组合的净值波动率,获得稳定增长的收益。
在资产配置层面上。债券类资产的投资方面,我们基于对安观经济环境和债券收益率曲线变动的预期,继续对组合进行
主动管理。在保证底水胜的同时,对债券组合结构进行了调整。在上半年货金间特效紧张的环境下,我们制持债券投资组合中
性量能的外则。以保障组合统动性。而三季使处打开始增加设合为人则。下半年较在特别农场人期,在具头有人 为机 间特于了部分中长,场中被告局中,以我取料律品种以企业曲线下降的效益。同时加大对信用产品的深入明充,其大对已持仓品
中生市强势分析,经过效分下公司基本而被分产系统的强力。

2011 年中的市场经历,是一支收入,是一致现代的人工程,是一个一个人工程,是一个人工程,是一个企业的工程,是一个人工程,是一个人工程,是一个人工程,是一个人工程,是一个人工程,是一个人工程,是一个人工程,是一个人工程,是一个人工程,是一个人工程,是一个人工程,是一个人工程,是一个人工程,是一个人工程,是一个一个人工程,是一个一个人工程,是一个一个人工程,是一个人工程,是一个一个人工程,是一个人工程,是一个人工程,是一个人工程,是一个人工程,是一个人工程,是一个人工程,是一个人工程,是一个人工程,是一个人工程,是一个人工程,是一个人工程,是一个人工程,是一个人工程,是一个人工程,是一个人工程,是一个人工程,是一个人工程,是一个人工程,是一个一个工程,是一个一个工程,是一个一个工程,是一个一个工程,是一个一个工程,是一个一个工程,是一个人工程,是一个一个工程,是一个工程,是一个工程,是一个工程,是一个工程,是一个工程,是一个工程,是一个工程,是一个工程,是一个工程,是一个工程,

7.1 资产负债表 会计主体:大成债券投资基金

资产	本期末 2011年 12 月 31 日	上年度末 2010年 12 月 31 日
资产:		
银行存款	2,573,084.40	9,059,615.40
结算备付金	5,358,531.77	1,723,700.24
存出保证金	168,407.73	183,867.14
交易性金融资产	415,736,895,60	488,920,525.23
其中:股票投资	_	25,109,033.3
基金投资	_	
债券投资	415,736,895.60	463,811,491.9
资产支持证券投资	_	
衍生金融资产	_	
买人返售金融资产	_	
应收证券清算款	_	
应收利息	6,074,357,13	2,721,135.3
应收股利	_	-
应收申购款	78,559.67	21,820,961.7
递延所得税资产	_	
其他资产	_	
资产总计	429,989,836.30	524,429,805.0
负债和所有者权益	本期末 2011年 12 月 31 日	上年度末 2010年 12 月 31 日
负 债:		
短期借款	-	
交易性金融负债	-	
衍生金融负债	-	
卖出回购金融资产款	52,000,000.00	
立付证券清算款	16,422.19	
立付赎回款	181,517.46	501,797.9
立付管理人报酬	227,261.76	300,800.3
立付托管费	64,931.92	85,942.9
立付销售服务费	31,152.45	59,653.6
应付交易费用	7,325.12	46,997.3
立交税费	3,203,149.68	6,074,330.5
立付利息	5,799.34	
立付利润	_	
递延所得税负债	_	
其他负债	540,322.48	543,438.4
负债合计	56,277,882.40	7,612,961.1
所有者权益:		
实收基金	369,419,592.66	498,350,983.9
未分配利润	4,292,361.24	18,465,860.0
所有者权益合计	373,711,953.90	516,816,843.9
负债和所有者权益总计	429,989,836.30	524,429,805.0

7.2 利润表 会计主体:大成债券投资基金 本报告期:2011 年 1 月 1 日至 2011 年 12 月 31 日

		单位:人民市
项目	本期 2011年1月1日至2011年12月31 日	上年度可比期间 2010年 1 月 1 日至 2010 年 12 月 31 日
一、收入	9,975,375.25	49,445,967.36
1.利息收入	13,555,257.78	12,234,454.5
其中:存款利息收入	131,551.53	534,254.50
债券利息收入	13,423,706.25	11,306,255.30
资产支持证券利息收入	_	393,944.6
买人返售金融资产收人	_	
其他利息收入	_	
2.投资收益 假失以""填列)	2,277,208.11	38,516,813.22
其中:股票投资收益	4,195,984.53	32,352,173.36
基金投资收益	_	
债券投资收益	-1,918,776.42	6,105,457.30
资产支持证券投资收益	_	
衍生工具收益	_	
股利收益	_	59,182.50
3.公允价值变动收益(损失以""号填列)	-6,040,214.38	-1,536,556.10
4.汇兑收益 假失以 ""号填列)	_	
5.其他收入 假失以 ""号填列)	183,123.74	231,255.7
减:二、费用	6,278,172.97	8,701,455.6
1.管理人报酬	3,068,950.69	4,224,583.50
2.托管费	876,843.06	1,207,023.8
3.销售服务费	477,030.66	1,107,987.5
4.交易费用	63,877.10	192,689.24
5.利息支出	1,384,465.51	1,320,364.20
其中:卖出回购金融资产支出	1,384,465.51	1,320,364.20
6.其他费用	407,005.95	648,807.2
三、利润总额 (亏损总额以""号填列)	3,697,202.28	40,744,511.70
咸:所得税费用	_	
四、净利润(净亏损以""号填列)	3,697,202.28	40,744,511.76

会计主体:大成债券投资基金 本报告期:2011年1月1日至2011年12月31日 单位:人民币

项目	2011	本期 年1月1日至2011年12月31	В			
グロ	实收基金	未分配利润	所有者权益合计			
一、期初所有者权益 (基金净值)	498,350,983.94	18,465,860.02	516,816,843.96			
二、本期经营活动产生的基金净 直变动数 (本期利润)	-	3,697,202.28	3,697,202.28			
三、本期基金份额交易产生的基 金净值变动数 (净值减少以"" 号填列)	-128,931,391.28	-753,455.14	-129,684,846.42			
其中:1.基金申购款	405,760,682.36	4,040,493.32	409,801,175.68			
2.基金赎回款	-534,692,073.64	-4,793,948.46	-539,486,022.10			
四、本期向基金份额持有人分配 利润产生的基金净值变动(净值 或少以""号填列)	-	-17,117,245.92	-17,117,245.92			
五、期末所有者权益 堪金净值)	369,419,592.66	4,292,361.24	373,711,953.90			
项目	上年度可比期间 2010年 1 月 1 日至 2010 年 12 月 31 日					
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计			
一、期初所有者权益 (基金净值)	453,055,304.25	16,047,430.80	469,102,735.05			
二、本期经营活动产生的基金净 直变动数 (本期利润)	-	40,744,511.76	40,744,511.76			
三、本期基金份额交易产生的基 金净值变动数 (净值减少以"" 号填列)	45,295,679.69	-1,012,977.44	44,282,702.25			
其中:1.基金申购款	1,103,910,507.32	37,284,374.76	1,141,194,882.08			
2.基金赎回款	-1,058,614,827.63	-38,297,352.20	-1,096,912,179.83			
四、本期向基金份额持有人分配 利润产生的基金净值变动(净值 减少以""号填列)	-	-37,313,105.10	-37,313,105.10			
丘、期末所有者权益 (基金净值)	498,350,983.94	18,465,860.02	516,816,843.96			

《规则作》的《报表的组成部分。 本报告 7.1 至 7.4 财务报表的组成部分。 本报告 7.1 至 7.4 财务报表的组成部分。 本报告 7.1 至 7.4 财务报表由于列负责人签署。 基金管理公司负责人王勤。 土管会计工作负责人:刘彩军 会计机构负责人,范璞 7.4 取款的。 7.4 取款的。 7.4 取款的。 第一次, 不知之, 2.4 工程管则所采用的会计政策。会计估计与最近一期年度报告相一致的说明 本报告则所采用的会计政策。会计估计与最近一期年度报告相一致。

与本基金的关系
基金管理人、注册登记机构、基金销售机构
基金托管人、基金代销机构
基金管理人的股东
基金管理人的股东、基金代销机构
基金管理人的股东
基金管理人的股东

注:1. 中国证监会于2005年11月6日作出对广东证券取消业务许可并责令关闭的行政处罚。 2. 下途关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。 7.4.3 本报告期及上年度可比期间的关联方交易 7.4.3.1 超过关联方交易单元进行的交易 7.4.3.1 股票交易

7.4.3.1.1 反示义勿			4	验额单位:人民币元
	本期 2011年1月1日至2011年	12月31日	上年度可比期间 2010年1月1日至 2010年	
关联方名称	成交金额	占当期股票 成交总额的比 例	成交金额	占当期股票 成交总额的比 例
光大证券	75,780.00	0.30%	-	0.00%

	关联方名称	2			
	大块万石桥	当期 佣金	占当期佣金总 量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣 金总额的比例
Г	光大证券	62.26	0.31%	62.26	22.37%
	关联方名称	2		可比期间 2010年 12 月 31 日	
	大吹刀石帆	当期 佣金	占当期佣金总 量的比例	期末应付佣金余額	占期末应付佣 金总额的比例
Г	_	_	0.00%	_	0.00%

注: 1. 上述佣金按市场佣金率计算,以扣除由中国证券登记结算有限责任公司收取的证管费和终手费的净额列示。 2. 该类佣金协议的服务范围还包括佣金收取方为本基金提供的证券投资研究成果和市场信息服务等。 7-4.3.2 关联方报酬 7-4.3.2 1 基金管理费

7.4.3.2.1 巫並日注页		单位:人民币元
项目	本期 2011年1月1日至2011年12月31日	上年度可比期间 2010年 1 月 1 日至 2010 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的管理 费	3,068,950.69	4,224,583.50
其中:支付销售机构的客户维护 费	263,264.42	390,832.93
注:支付基金管理人大成基金 寸。其计算公式为: 日管理人报酬=前一日基金资产 7.4.3.2.2 基金托管费		%的年费率计提,逐日累计至每月月底,按月5 单位,人民币元

		单位:人民币元
项目	本期 2011年1月1日至2011年12月31日	上年度可比期间 2010年1月1日至2010年12月31日
当期发生的基金应支付的托管 费	876,843.06	1,207,023.84
注:支付基金托管人中国农业付。其计算公式为:		2%的年费率计提,逐日累计至每月月底,按月支

本期 2011年1月1日至2011年12月31日 279,514.78 279,514.78 上年度可比期间 2010年 1 月 1 日至 2010年 12 月 31 大成债券 A/B 107,324.06 107,324.06

819,657.54

注:支付基金销售机构的销售服务费按前一日持续性销售服务费收费模式下的 C 类基金份额对应的 的年费率计提,逐日累计至每月月底,按月支付给大成基金,再由大成基金计算并支付给各基金销售机构

						单位:人民
	20	オ 11年1月1日至	×期 2011年12月	31 ⊟		
银行间市场交易的	债券交易	金額	基金进	逆回购	基金	:正回购
各关联方名称	基金买人	基金卖出	交易金额	利息收入	交易金额	利息支出
光大证券	40,874,175.74	_	-	-	-	
	20	上年度 110年1月1日至	可比期间 2010年12月	31 ⊟		
银行间市场交易的	债券交易	金額	基金进	逆回购	基金	正回购
各关联方名称	基金买人	基金卖出	交易金额	利息收入	交易金额	利息支出
中国农业银行	29,719,127.26	_	-	-	-	

						单位:人民司	
关联方 名称	2011年1	本期 2011年1月1日至2011年12月31日			上年度可比期间 2010年 1 月 1 日至 2010年 12 月 31 日		
中国农业银行 注:本基金的银行	期末余	期末余額 当期利息收入		息收入	期末余额	当期利息收入	
中国农业银行	2	2,573,084.40		81,972.04	9,059,615.40	499,560.05	
7.4.3.6 平基金	2在承销期内参与	<b>、</b>	37FH)1  OL			金额单位:人民币	
7.4.3.6 本基金	2仕承销期内参与;		本	期 2011年12月3	ıl Fl	金额单位:人民币	
		2011年	本 1月1日至	2011年12月3		金額单位:人民币	
7.4.3.6 本基金 关联方名称	证券代码		本 1月1日至				
		2011年 证券名称	本 1月1日至	2011年12月3	基金在3数量 单位:股)	季销期内买人 总金额	

2010年1月1日至2010年12月31日 证券名称 发行方式

本基金本报告期及1年 12月31日 叶基金持有的选通受限证券 7.4.41 期末 10日 年 12月31日 叶基金持有的流通受限证券 7.4.41 期末 10日 東京 10日 東京

			金额单位:人臣
序号	项目	金額	占基金总资产的比例 %
1	权益投资	-	0
	其中:股票	-	0
2	固定收益投资	415,736,895.60	96
	其中:债券	415,736,895.60	96
	资产支持证券	-	0
3	金融衍生品投资	-	0
4	买人返售金融资产	-	0
	其中:买断式回购的买人返售金融资产	-	0
5	银行存款和结算备付金合计	7,931,616.17	1
6	其他各项资产	6,321,324.53	1.
7	合计	429,989,836.30	100

8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细 本基金本报告期末未持有股票。

8.4 报告期内股票投资组合的重大变动 8.4.1 累计买人金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

序号	股票代码	股票名称	本期累计买人金额	占期初基金资产净值比例 %)
1	601558	华锐风电	270,000.00	0.05
2	601216	内蒙君正	150,000.00	0.03
3	601336	新华保险	69,750.00	0.01
4	300223	北京君正	65,700.00	0.01
5	002557	治治食品	40,000.00	0.01
6	300180	华峰超纤	29,595.00	0.01
7	300225	金力泰	28,000.00	0.01
8	601519	大智慧	23,200.00	0.00
9	300191	潜能恒信	20,730.00	0.00
10	300183	东软载波	20,725.00	0.00
11	002541	鸿路钢构	20,500.00	0.00
12	300195	长荣股份	20,000.00	0.00
13	601677	明泰铝业	20,000.00	0.00
14	002540	亚太科技	20,000.00	0.00
15	002559	亚威股份	20,000.00	0.00
16	002566	益盛药业	19,950.00	0.00
17	002612	朗姿股份	17,500.00	0.00
18	002539	新都化工	16,940.00	0.00
19	300161	华中数控	13,000.00	0.00
20	002554	惠博普	13,000.00	0.00

				3匹18(十-17:)(た(11))
序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例 %)
1	002493	荣盛石化	10,214,240.78	1.98
2	300134	大富科技	6,128,757.14	1.19
3	002492	恒基达鑫	3,647,554.83	0.71
4	002495	佳隆股份	2,238,181.30	0.43
5	300137	先河环保	981,428.60	0.19
6	300113	顺网科技	857,129.82	0.17
7	601558	华锐风电	250,323.00	0.05
8	601216	内蒙君正	162,000.00	0.03
9	601336	新华保险	78,630.00	0.02
10	300223	北京君正	59,850.00	0.01
11	601118	海南橡胶	55,600.00	0.01
12	300159	新研股份	52,340.00	0.01
13	002557	治治食品	38,170.00	0.01
14	300157	恒泰艾普	34,930.00	0.01
15	300156	天立环保	32,050.00	0.01
16	300180	华峰超纤	30,810.00	0.01
17	300225	金力泰	26,900.00	0.01
18	601519	大智慧	25,654.80	0.00
10	002612	àn Malla	22, 075,00	0.00

8.4.3 买人股票的成本总额及卖出股票的收入总额 25,306,480.81

注:上述金额均指成交金额 戗交单价乘以成交数量),不考虑相关交易费用 8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合 金额单位:人民币:

かち	顶夯面件	公元17011111111111111111111111111111111111	白基金質严伊恒比例 (%)
1	国家债券	20,916,000.00	5.6
2	央行票据	9,664,000.00	2.5
3	金融债券	154,237,000.00	41.2
	其中:政策性金融债	126,604,000.00	33.8
4	企业债券	230,919,895.60	61.7
5	企业短期融资券	-	0.0
6	中期票据	-	0.0
7	可转债	-	0.0
8	其他	-	0.0
9	合计	415,736,895.60	111.2:
8.6 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	
			A 455 M A 1 12 T

08国开 18 08江铜债 080218 49,455,000.00 400,000 41,208,000.00 5 052001 300,000 27,633,000.00

本基金本报告期末未持有资产支持证务。 8.8 期末按公允价值占基金资产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。 8.9 投资相会组生组24

8.9 投资组合报告附注 8.9.1 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

8.9.2 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。 8.9.3 期末其他各项资产构成 单位:人民币元 168,407.73 6,074,357.1 6,321,324.53

8.9.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细 本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券 8.9.5 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。

8.9.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分 由于四舍五人原因,分项之和与合计可能有尾差

§9 基金份额持有人信息 9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

	1-00/00/01/01/01/01/01/01/01/01/01/01/01/0	., 200014117 0111	•			份额单位:
			持有人结构			
份额级		户均持有的基金	机构投资	机构投资者		ž
别		份额	持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额 比例
A/B 类	25,874	9,859.11	41,302,084.79	16.19%	213,792,460.58	83.819
C类	6,779	16,864.59	29,304,893.03	25.63%	85,020,154.26	74.379
合计	32,653	11,313.50	70,606,977.82	19.11%	298,812,614.84	80.899
注:1、	· 沭和松/个人投资	者持有份额占总的	分额比例的计算中,对分约	及份额,比例的分	母采用各自级别的份:	縮. 对合计?

注:1、上述机序/个人投资者持有份额点忌份额比例的订单中,对 比例的分母采用下属分级基金份额的合计数 仰期末基金份额总额) 2.持有人户数为有效户数 即存量份额大于零的账户。 9.2.期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金的情况

	[/J d)(8)(X/7) <sup>1</sup> ]	14.4 N 46024X (N )	口盔弦点闪柳几日列	
the A determine the Control of the C	大成债券 A/B	225.27	0.00009%	
基金管理公司所有从业人员持有本 开放式基金	大成债券C	9,934.43	0.00869%	
71 222 4000 400	合计	10,159.70	0.00275%	
注:上述占基金总份额比例的计算	章中,对分级份额,比例的	的分母采用各自级别的份额,对合计数	,比例的分母采用下属分	$\frac{1}{2}$
级基金份额的合计数 (即期末基金份額	<b>額总额</b> )。			

项目	大成债券 A/B	大成债券C
基金合同生效日 2003 年 6 月 12 日 )基金份额总额	2,152,776,735.13	-
本报告期期初基金份额总额	255,216,903.16	243,134,080.78
本报告期基金总申购份额	224,640,824.43	181,119,857.93
减:本报告期基金总赎回份额	224,763,182.22	309,928,891.42
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	255,094,545.37	114,325,047.29
211 ==	上本外担二	

\$11 重大事件揭示
11.1 基金价额持有人大会决议
报告期内无基金份额持有人大会决议。
11.2 基金管理人、基金栏管人的专门基金栏管部门的重大人事变动
2011年,19.1日,中国证金参核准中国火业银行股份有限公司张健基金行业高级管理人员任职资格 征监许可 [2011]
6 号)、张健任中国火业银行股份有限公司任管业务部总经理。
11.3 涉及基金管理人、基金性产、基金性管业务的诉讼
本报告期内没有涉及本准金管理人、基金财产、基金社管业务的诉讼

本报告期內沒有涉及本盘室管理人。基金研产、基金社管业务的功识公事项。
11.4 基金投资策略的改变
基金投资策略在本报告期內沒有重大改变。
15. 为基金进行审计的会计师事务所有配
本基金部任的为本基金审计的会计师事务所为普华永道中天会计师事务所有限公司,本年度应支付的审计费用为 6.万 该事务所目基金合同生效日起为本基金提供审计服务至今。
11.6 管理人,任管人及其高效管理人员会管查成此可等情况。
本据告期,本基金管理人,托管人及高效管理人员未受到监管部门稽查或处罚。
17. 生命组即非然公司求息增于的女生地密入

	-2- H 24 - 24	股票	交易	应支付该券商的佣金		
券商名称	交易单元数 -	成交金额	占当期股票 成交总额的比例	佣金	占当期佣金 总量的比例	备注
银河证券	3	24,605,493.01	97.23%	19,992.10	99.14%	-
申银万国	2	493,577.80	1.95%	-	0.00%	-
中信证券	2	93,270.00	0.37%	79.27	0.39%	-
光大证券	2	75,780.00	0.30%	62.26	0.31%	-
西部证券	1	38,360.00	0.15%	31.17	0.15%	-
招商证券	3	-	0.00%	-	0.00%	-
国泰君安	2	-	0.00%	-	0.00%	-
国信证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
海通证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
红塔证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
宏源证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
华创证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
华泰联合	1	-	0.00%	-	0.00%	-
民生证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
南京证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
平安证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
齐鲁证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
瑞银证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
上海证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
广发证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
国金证券	2	-	0.00%	-	0.00%	-
国盛证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
安信证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
北京高华	1	-	0.00%	-	0.00%	-
长城证券	2	-	0.00%	-	0.00%	-
东北证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
方正证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
浙商证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
中金公司	2	-	0.00%	-	0.00%	-
中信建投	2	_	0.00%	-	0.00%	-
兴业证券	2	_	0.00%	-	0.00%	-
世纪证券	1	_	0.00%	-	0.00%	-
天风证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
中银国际	2	_	0.00%	_	0.00%	-
英大证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
合计	49	25,306,480.81	100.00%	20,164.80	100,00%	_

在:1.1-本核官例27-◆您並不抵性X 20 平 4.1 河田 2 7 下国证分、运国证分、运程证力、运动证为、不可以不正元、不可以证为、不对证券、养鱼油类、精健证券、无证券、性税证券、无证券、地方高格、长城证券、东区域、证券、中租国际、申银万国、英大证券、银河证券、国金证券、中信建投、国参君安、中金公司、招商证券、光大证券、兴业证券等交易单元。

2. 租用券商专用交易单元的选择标准和程序。
在报中国证益会颁布的 关于完善证券投资基金交易席位制度有关问题的通知》证监基金字 2007 [48 号]的有关规定,本公司制定了租用业务公司交易单元的选择标准。和经验。

金额单位:人民币元

金额单位, 人民币元

租用证券公司交易柜元的选择标准主要包括:
(一期考状风良保。最近一年无重大连账行动;
(二)经营行为规范,内控制度整全。能制度各投资组合运作的保密性要求。
(三)研究实力较强、能继供包括研究报告。路·演服多,协助进行上市公司调研等研究服务;
(四)具备各投资组合运作所需的高效。安全创建机条件,看足够的交易和清算能力,满足各投资组合证券交易需要;
(五)能提供投资组合运作。管理所需的其他参加服务;
(6)用程法金合同。资产增整合同以及注中法规规定的其他条件。
租用证券公司交身单元的程序;首先根据租用证券公司交易单元的选择标准形成,每海服务评价表》,然后根据评分高低进行选择基金公房单元。

117.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

1	往來女目		/# # E396-2- B		金额甲位:人民用元	
券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券 成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购 成交总额的比例	成交金额	占当期权证 成交总额的 比例
银河证券	11,790,012.15	1.57%	-	0.00%	-	0.00%
申银万国	402,358,465.03	53.46%	4,470,300,000.00	59.35%	-	0.00%
中信证券	87,600,075.82	11.64%	1,617,600,000.00	21.48%	-	0.00%
光大证券	182,975,139.78	24.31%	1,434,200,000.00	19.04%	-	0.00%
西部证券	-	0.00%	-	0.00%	-	0.00%
招商证券	67,906,970.70	9.02%	10,000,000.00	0.13%	-	0.00%
国泰君安	-	0.00%	-	0.00%	-	0.00%
国信证券	-	0.00%	-	0.00%	-	0.00%
海通证券	-	0.00%	-	0.00%	-	0.00%
红塔证券	-	0.00%	-	0.00%	-	0.00%
宏源证券	-	0.00%	-	0.00%	-	0.00%
华创证券	-	0.00%	-	0.00%	-	0.00%
华泰联合	-	0.00%	-	0.00%	-	0.00%
民生证券	-	0.00%	-	0.00%	-	0.00%
南京证券	-	0.00%	-	0.00%	-	0.00%
平安证券	-	0.00%	-	0.00%	-	0.00%
齐鲁证券	-	0.00%	-	0.00%	-	0.00%
瑞银证券	-	0.00%	-	0.00%	-	0.00%
上海证券	-	0.00%	-	0.00%	-	0.00%
广发证券	_	0.00%	-	0.00%	-	0.00%
国金证券	-	0.00%	-	0.00%	-	0.00%
国盛证券	-	0.00%	-	0.00%	-	0.00%
安信证券	-	0.00%	-	0.00%	-	0.00%
北京高华	-	0.00%	-	0.00%	-	0.00%
长城证券	-	0.00%	-	0.00%	-	0.00%
东北证券	-	0.00%	-	0.00%	-	0.00%
方正证券	-	0.00%	-	0.00%	-	0.00%
浙商证券	-	0.00%	-	0.00%	-	0.00%
中金公司	-	0.00%	-	0.00%	-	0.00%
中信建投	-	0.00%	-	0.00%	-	0.00%
兴业证券	-	0.00%	-	0.00%	-	0.00%
世纪证券	-	0.00%	-	0.00%	-	0.00%
APTIC MALIE					<b>—</b>	

大成基金管理有限公司 2012年3月28日