

大成可转债增强债券型证券投资基金

2012 半年度 报告摘要

2012年6月30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
基金日期:2012年8月25日
§1 重要提示

1.1 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法律责任。

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2012年08月20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。

基金管理人承诺以恪尽职守、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。投资者有风险,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。

本半年度报告所载摘要自半年度报告正文,投资者欲了解详细内容,应阅读半年度报告正文。
本报告中期财务资料未经审计。

§2 基金简介
2.1 基金基本情况

Table with 2 columns: 基金基本情况, 基金运作情况. Includes details on fund type, start date, and management info.

Table with 2 columns: 基金管理人, 基金托管人. Lists大成基金管理有限公司 and 中国工商银行股份有限公司.

2.2 基金产品概况

本基金为投资于可转债等固定收益类资产,在债券基金中风险收益水平较高的品种,具有较好的长期增值潜力。

3.2 基金管理人、基金托管人

Table with 2 columns: 基金管理人, 基金托管人. Lists大成基金管理有限公司 and 中国工商银行股份有限公司.

2.4 信息披露方式

基金半年度报告正文的载地址: http://www.dcfund.com.cn

3.3 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

Table with 2 columns: 3.1.1 期间数据和指标, 报告期 2012年1月1日至2012年6月30日. Shows financial metrics like net assets and income.

3.2 基金业绩比较基准

3.3 基金合同生效以来基金净值增长率及与同期业绩比较基准收益率的比较

Table with 2 columns: 基金合同生效以来基金净值增长率及与同期业绩比较基准收益率的比较. Shows performance comparison over time.

3.4 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

4.2 基金管理人及其管理基金的经验

4.3 基金管理人及其管理基金的经验

4.4 基金管理人及其管理基金的经验

4.5 基金管理人及其管理基金的经验

4.6 基金管理人及其管理基金的经验

4.7 基金管理人及其管理基金的经验

4.8 基金管理人及其管理基金的经验

4.9 基金管理人及其管理基金的经验

4.10 基金管理人及其管理基金的经验

4.11 基金管理人及其管理基金的经验

4.12 基金管理人及其管理基金的经验

4.13 基金管理人及其管理基金的经验

4.14 基金管理人及其管理基金的经验

4.15 基金管理人及其管理基金的经验

4.16 基金管理人及其管理基金的经验

4.17 基金管理人及其管理基金的经验

4.18 基金管理人及其管理基金的经验

4.19 基金管理人及其管理基金的经验

4.20 基金管理人及其管理基金的经验

4.21 基金管理人及其管理基金的经验

4.22 基金管理人及其管理基金的经验

4.23 基金管理人及其管理基金的经验

4.24 基金管理人及其管理基金的经验

4.25 基金管理人及其管理基金的经验

4.26 基金管理人及其管理基金的经验

4.27 基金管理人及其管理基金的经验

4.28 基金管理人及其管理基金的经验

4.29 基金管理人及其管理基金的经验

4.30 基金管理人及其管理基金的经验

4.31 基金管理人及其管理基金的经验

4.32 基金管理人及其管理基金的经验

4.33 基金管理人及其管理基金的经验

4.34 基金管理人及其管理基金的经验

4.35 基金管理人及其管理基金的经验

4.36 基金管理人及其管理基金的经验

4.37 基金管理人及其管理基金的经验

4.38 基金管理人及其管理基金的经验

4.39 基金管理人及其管理基金的经验

4.40 基金管理人及其管理基金的经验

4.41 基金管理人及其管理基金的经验

4.42 基金管理人及其管理基金的经验

4.43 基金管理人及其管理基金的经验

4.44 基金管理人及其管理基金的经验

4.45 基金管理人及其管理基金的经验

4.46 基金管理人及其管理基金的经验

4.47 基金管理人及其管理基金的经验

4.48 基金管理人及其管理基金的经验

4.49 基金管理人及其管理基金的经验

4.50 基金管理人及其管理基金的经验

4.51 基金管理人及其管理基金的经验

4.52 基金管理人及其管理基金的经验

4.53 基金管理人及其管理基金的经验

4.54 基金管理人及其管理基金的经验

4.55 基金管理人及其管理基金的经验

尽管费用履行了基金托管人应尽的义务。

5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

2012年上半年,大成可转债增强债券型证券投资基金的管理人——大成基金管理有限公司在大成可转债增强债券型证券投资基金的投资运作、基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格计算、基金费用开支等方面,不存在任何损害基金份额持有人利益的行为,在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容的真实性、准确性和完整性发表意见

本托管人依法对大成基金管理有限公司编制和披露的大成可转债增强债券型证券投资基金2012年半年度报告中财务指标、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进行了核查,以上内容真实、准确和完整。

§6 半年度财务会计报告 (未经审计)

6.1 资产负债表

单位:人民币元

Table with 2 columns: 资产, 负债. Shows balance sheet items for 2012年6月30日 and 2012年12月31日.

6.2 利润表

Table with 2 columns: 营业收入, 费用. Shows profit and loss items for 2012年6月30日 and 2012年1月1日至2012年6月30日.

6.3 所有者权益变动表

Table with 2 columns: 所有者权益. Shows equity changes for 2012年6月30日 and 2012年1月1日至2012年6月30日.

注:报告截止日2012年6月30日,基金份额净值1.019元,基金份额总额251,785,796.08份。

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

大成基金管理有限公司(以下简称“本公司”)经中国证监会证监基金字[2001]10号文批准,于1999年4月12日正式成立。

6.4.2 主要会计政策和会计估计

6.4.2.1 会计政策

6.4.2.2 会计估计

6.4.2.3 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.2.4 会计政策变更的说明

6.4.2.5 会计估计变更的说明

6.4.2.6 差错更正的说明

6.4.2.7 税项

6.4.2.8 关联方关系及其关联方交易的披露

6.4.2.9 公允价值

6.4.2.10 金融资产和金融负债的公允价值

6.4.2.11 金融工具

6.4.2.12 金融资产和金融负债的抵销

6.4.2.13 金融资产和金融负债的公允价值

6.4.2.14 金融资产和金融负债的公允价值

6.4.2.15 金融资产和金融负债的公允价值

6.4.2.16 金融资产和金融负债的公允价值

6.4.2.17 金融资产和金融负债的公允价值

6.4.2.18 金融资产和金融负债的公允价值

6.4.2.19 金融资产和金融负债的公允价值

6.4.2.20 金融资产和金融负债的公允价值

6.4.2.21 金融资产和金融负债的公允价值

6.4.2.22 金融资产和金融负债的公允价值

6.4.2.23 金融资产和金融负债的公允价值

6.4.2.24 金融资产和金融负债的公允价值

6.4.2.25 金融资产和金融负债的公允价值

6.4.2.26 金融资产和金融负债的公允价值

6.4.2.27 金融资产和金融负债的公允价值

6.4.2.28 金融资产和金融负债的公允价值

6.4.2.29 金融资产和金融负债的公允价值

6.4.2.30 金融资产和金融负债的公允价值

6.4.2.31 金融资产和金融负债的公允价值

6.4.2.32 金融资产和金融负债的公允价值

6.4.2.33 金融资产和金融负债的公允价值

6.4.2.34 金融资产和金融负债的公允价值

6.4.2.35 金融资产和金融负债的公允价值

6.4.2.36 金融资产和金融负债的公允价值

6.4.2.37 金融资产和金融负债的公允价值

6.4.2.38 金融资产和金融负债的公允价值

6.4.2.39 金融资产和金融负债的公允价值

6.4.2.40 金融资产和金融负债的公允价值

6.4.2.41 金融资产和金融负债的公允价值

6.4.2.42 金融资产和金融负债的公允价值

6.4.2.43 金融资产和金融负债的公允价值

6.4.2.44 金融资产和金融负债的公允价值

6.4.2.45 金融资产和金融负债的公允价值

6.4.2.46 金融资产和金融负债的公允价值

6.4.2.47 金融资产和金融负债的公允价值

6.4.2.48 金融资产和金融负债的公允价值

6.4.2.49 金融资产和金融负债的公允价值

6.4.2.50 金融资产和金融负债的公允价值

6.4.2.51 金融资产和金融负债的公允价值

6.4.2.52 金融资产和金融负债的公允价值

6.4.2.53 金融资产和金融负债的公允价值

6.4.2.54 金融资产和金融负债的公允价值

6.4.2.55 金融资产和金融负债的公允价值

6.4.2.56 金融资产和金融负债的公允价值

6.4.2.57 金融资产和金融负债的公允价值

6.4.2.58 金融资产和金融负债的公允价值

6.4.2.59 金融资产和金融负债的公允价值

6.4.2.60 金融资产和金融负债的公允价值

6.4.2.61 金融资产和金融负债的公允价值

6.4.2.62 金融资产和金融负债的公允价值

6.4.2.63 金融资产和金融负债的公允价值

6.4.2.64 金融资产和金融负债的公允价值

6.4.2.65 金融资产和金融负债的公允价值

6.4.2.66 金融资产和金融负债的公允价值

6.4.2.67 金融资产和金融负债的公允价值

本基金持有的资产和承担的负债基本为金融资产和金融负债。

6.4.4.7 关联交易

6.4.4.8 关联方关系及其关联方交易的披露

6.4.4.9 关联方关系及其关联方交易的披露

6.4.4.10 关联方关系及其关联方交易的披露

6.4.4.11 关联方关系及其关联方交易的披露

6.4.4.12 关联方关系及其关联方交易的披露

6.4.4.13 关联方关系及其关联方交易的披露

6.4.4.14 关联方关系及其关联方交易的披露

6.4.4.15 关联方关系及其关联方交易的披露

6.4.4.16 关联方关系及其关联方交易的披露

6.4.4.17 关联方关系及其关联方交易的披露

6.4.4.18 关联方关系及其关联方交易的披露

6.4.4.19 关联方关系及其关联方交易的披露

6.4.4.20 关联方关系及其关联方交易的披露

6.4.4.21 关联方关系及其关联方交易的披露

6.4.4.22 关联方关系及其关联方交易的披露

6.4.4.23 关联方关系及其关联方交易的披露

6.4.4.24 关联方关系及其关联方交易的披露

6.4.4.25 关联方关系及其关联方交易的披露

6.4.4.26 关联方关系及其关联方交易的披露

6.4.4.27 关联方关系及其关联方交易的披露

6.4.4.28 关联方关系及其关联方交易的披露

6.4.4.29 关联方关系及其关联方交易的披露

6.4.4.30 关联方关系及其关联方交易的披露

6.4.4.31 关联方关系及其关联方交易的披露

6.4.4.32 关联方关系及其关联方交易的披露

6.4.4.33 关联方关系及其关联方交易的披露

6.4.4.34 关联方关系及其关联方交易的披露

6.4.4.35 关联方关系及其关联方交易的披露

6.4.4.36 关联方关系及其关联方交易的披露

6.4.4.37 关联方关系及其关联方交易的披露

6.4.4.38 关联方关系及其关联方交易的披露

6.4.4.39 关联方关系及其关联方交易的披露

6.4.4.40 关联方关系及其关联方交易的披露

6.4.4.41 关联方关系及其关联方交易的披露

6.4.4.42 关联方关系及其关联方交易的披露

6.4.4.43 关联方关系及其关联方交易的披露

6.4.4.44 关联方关系及其关联方交易的披露

6.4.4.45 关联方关系及其关联方交易的披露

6.4.4.46 关联方关系及其关联方交易的披露

6.4.4.47 关联方关系及其关联方交易的披露

6.4.4.48 关联方关系及其关联方交易的披露

6.4.4.49 关联方关系及其关联方交易的披露

6.4.4.50 关联方关系及其关联方交易的披露

6.4.4.51 关联方关系及其关联方交易的披露

6.4.4.52 关联方关系及其关联方交易的披露

6.4.4.53 关联方关系及其关联方交易的披露

6.4.4.54 关联方关系及其关联方交易的披露

6.4.4.55 关联方关系及其关联方交易的披露

6.4.4.56 关联方关系及其关联方交易的披露

6.4.4.57 关联方关系及其关联方交易的披露

6.4.4.58 关联方关系及其关联方交易的披露

6.4.4.59 关联方关系及其关联方交易的披露

6.4.4.60 关联方关系及其关联方交易的披露

6.4.4.61 关联方关系及其关联方交易的披露

6.4.4.62 关联方关系及其关联方交易的披露

6.4.4.63 关联方关系及其关联方交易的披露

6.4.4.64 关联方关系及其关联方交易的披露

6.4.4.65 关联方关系及其关联方交易的披露

6.4.4.66 关联方关系及其关联方交易的披露

6.4.4.67 关联方关系及其关联方交易的披露

6.4.4.68 关联方关系及其关联方交易的披露

6.4.4.69 关联方关系及其关联方交易的披露

6.4.4.70 关联方关系及其关联方交易的披露

6.4.4.71 关联方关系及其关联方交易的披露

6.4.4.72 关联方关系及其关联方交易的披露

6.4.4.73 关联方关系及其关联方交易的披露

6.4.4.74 关联方关系及其关联方交易的披露

6.4.4.75 关联方关系及其关联方交易的披露

6.4.4.76 关联方关系及其关联方交易的披露

6.4.4.77 关联方关系及其关联方交易的披露

6.4.4.78 关联方关系及其关联方交易的披露

6.4.4.79 关联方关系及其关联方交易的披露

6.4.4.80 关联方关系及其关联方交易的披露

6.4.4.81 关联方关系及其关联方交易的披露

6.4.4.82 关联方关系及其关联方交易的披露

6.4.4.83 关联方关系及其关联方交易的披露

6.4.4.84 关联方关系及其关联方交易的披露

6.4.4.85 关联方关系及其关联方交易的披露

6.4.4.86 关联方关系及其关联方交易的披露

6.4.4.87 关联方关系及其关联方交易的披露

6.4.4.88 关联方关系及其关联方交易的披露

6.4.4.89 关联方关系及其关联方交易的披露

6.4.4.90 关联方关系及其关联方交易的披露

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名股票投资明细

Table with 5 columns: 序号, 股票代码, 股票名称, 数量(股), 公允价值. Lists top 10 stock holdings.

注:投资者欲了解本报告期末基金投资的所有股票明细,应阅读载于大成基金管理有限公司网站(http://www.dcfund.com.cn)的半年度报告正文。