大成保本混合型证券投资基金

2012 年度 报告摘要

2012年12月31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
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。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定, 于 2013 年 3 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。

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,请投资者注意阅读。

本报告期自 2012 年 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金简称	大成保本混合
基金主代码	090013
交易代码	090013
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2011年 4 月 20 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
报告期末基金份额总额	766,957,704.51 份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	依照保证合同,本基金通过运用组合保险策略,在为符合保本条件的投资金额提供保本保障的基础上,追求基金资产的长期增值。
投资策略	本基金投资采用 VPPI 可变组合保险策略 (Variable Proportion Portfolio Insurance)。VPPI 策略是国际投资管理领域中一种常见的投资组合保险机制,将基金资产分配在保本资产和风险资产上;并根据数量分析、市场波动等来调整、修正风险资产与保本资产在投资组合中的比重,在保证风险资产可能的损失额不超过扣除相关费用后的保本资产的潜在收益与基金前期收益的基础上,参与分享市场可能出现的风险收益,从而保证本金安全,并实现基金资产长期增值。保本资产主要包括货币市场工具和债券等低风险资产,其中债券包括国债、金融债、企业债、公司债、债券回购、央行票据、可转换债券、可分离债券、短期融资券、资产支持证券以及经法律法规或中国证监会允许投资的其他债券类金融工具;风险资产主要包括股票、权证等高风险资产。
业绩比较基准	3年期银行定期存款利率 (税后)。指按照基金合同生效日或新的保本周期开始日中国人民银行公布并执行的同期金融机构人民币存款基准利率 (按照四舍五入的方法保留到小数点后第 2 位,单位为百分数)计算的与当期保本周期同期限的税后收益率。
风险收益特征	本基金为保本混合型基金产品,属证券投资基金中的低风险收益品种。

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	中国工商银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	杜鹏	蒋松云
	联系电话	0755-83183388	010-66105799
	电子邮箱	dupeng@dcfund.com.cn	custody@icbc.com.cn
客户服务电话		4008885558	95588
传真		0755-83199588	010-66105798

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
基金年度报告备置地点	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 55 号中国工商银行托管业务部

§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	2012年	2011年 4 月 20 日 (基金合同生效日)-2011 年 12 月 31 日
本期已实现收益	22,762,580.90	20,367,960.90
本期利润	18,964,922.84	28,200,469.52
加权平均基金份额本期利润	0.0203	0.0206
本期基金份额净值增长率	1.96%	2.20%
3.1.2 期末数据和指标	2012年末	2011年末
期末可供分配基金份额利润	0.0382	0.0150
期末基金资产净值	798,859,138.14	1,204,700,984.55
期末基金份额净值	1.042	1.022

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。

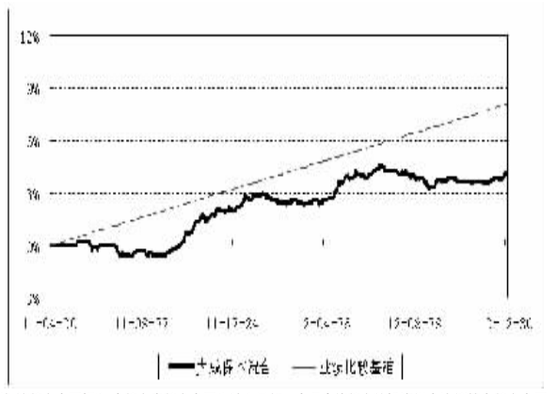
2、所述基金业绩指标不包括持有人交易基金的各项费用,计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

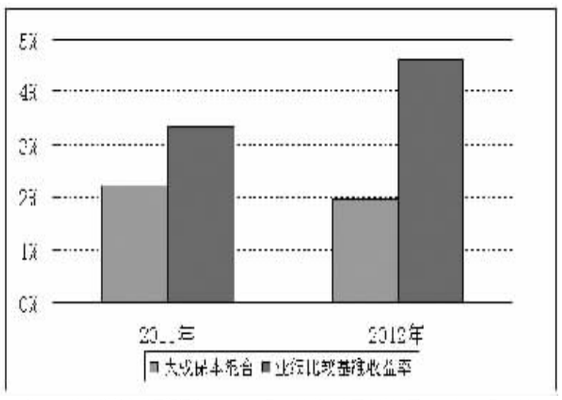
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	0.39%	0.06%	1.12%	0.00%	-0.73%	0.06%
过去六个月	0.10%	0.07%	2.27%	0.00%	-2.17%	0.07%
过去一年	1.96%	0.08%	4.61%	0.00%	-2.65%	0.08%
自基金合同生效起至今	4.20%	0.08%	8.08%	0.00%	-3.88%	0.08%

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之日起 6 个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的约定,建仓期结束时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:2011 净值增长率表现期间为 2011 年 4 月 20 日(基金合同生效日)至 2011 年 12 月 31 日

3.3 过去三年基金的利润分配情况

本基金自 2011 年 4 月 20 日(基金合同生效日)以来未有收益分配事项。

§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经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 2 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(2%)。截至 2012 年 12 月 31 日,本基金管理人共管理 2 只封闭式证券投资基金:景宏证券投资基金及景福证券投资基金,2 只 ETF 及 2 只 ETF 联接基金:深证成长 40ETF、大成深证成长 40ETF 联接基金、中证 500 沪市 ETF 及大成中证 500 沪市 ETF 联接基金,1 只创新型基金:大成景丰分级债券型证券投资基金,1 只 QDII 基金:大成标普 500 等权重指数基金及 25 只开放式证券投资基金:大成价值增长证券投资基金、大成债券投资基金、大成蓝筹稳健证券投资基金、大成精选增值混合型证券投资基金、大成货币市场证券投资基金、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、大成积极成长股票型证券投资基金、大成创新成长混合型证券投资基金(LOF)、大成景阳领先股票型证券投资基金、大成强化收益债券型证券投资基金、大成策略回报股票型证券投资基金、大成行业轮动股票型证券投资基金、大成中证红利指数证券投资基金、大成核心双动力股票型证券投资基金、大成保本混合型证券投资基金、大成内需增长股票型证券投资基金、大成中证内地消费主题指数证券投资基金、大成可转债增强债券型证券投资基金、大成新锐产业股票型证券投资基金、大成景恒保本混合型证券投资基金、大成优选股票型证券投资基金(LOF)、大成现金增利货币市场基金、大成月添利理财债券型证券投资基金、大成理财 21 天债券型发起式基金。

4.1.2 基金经理(或基金经理小组)及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理 (助理)期限 任职日期	离任日期	证券从业年限	说明
陈尚前先生	本基金基金经理、固定收益部总监	2011 年 4 月 20 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室主任和招商证券股份有限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 月曾任大成债券基金基金经理。2008 年 8 月 6 日开始担任大成强化收益债券基金基金经理,2010 年 10 月 15 日开始兼任大成景丰分级债券型证券投资基金基金经理,2011 年 4 月 20 日起同时兼任大成保本混合型证券投资基金基金经理,现同时担任公司固定收益部总监,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
朱文辉先生	本基金基金经理	2011年 6 月 4 日	-	12年	工商管理硕士。2000 年 9 月至 2002 年 1 月就职于平安保险集团总公司投资管理中心任债券研究员;2002 年 1 月至 2003 年 1 月就职于东方保险股份有限公司投资管理中心任债券投资经理。2003 年 1 月至 2005 年 12 月就职于生命人寿保险股份有限公司资产管理部任助理总经理;2006 年 1 月至 2010 年 12 月就职于汇丰晋信基金管理有限公司基金投资部任固定收益投资副总监,2008 年 12 月 3 日至 2010 年 12 月 4 日兼任汇丰晋信平稳增利债券型证券投资基金基金经理。2011 年加入大成基金管理有限公司,2011 年 6 月 4 日开始担任大成保本混合型证券投资基金基金经理。2011 年 11 月 30 日起担任大成可转债增强债券基金基金经理。2012 年 6 月 15 日起担任大成景恒保本混合型证券投资基金基金经理。具有基金从业资格。国籍:中国。

注:1、任职日期、离任日期为本基金管理人作出决定之日。

2、证券从业年限的计算标准遵从行业协会《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遵规守信情况的说明

本报告期内,本基金管理人严格遵守《证券法》、《证券投资基金法》、《大成保本混合型证券投资基金基金合同》和其他有关法律法规的规定,在基金管理运作中,大成保本混合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、信息披露等符合有关法律法规、行业监管规则和基金合同等规定,本基金没有发生重大违法违规行为,没有运用基金财产进行内幕交易和操纵市场行为以及进行有损基金投资人利益的关联交易,整体运作合法、合规。本基金将继续以取信于市场、取信于社会投资公众为宗旨,承诺将一如既往地本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金财产,在规范基金运作和严格控制投资风险的前提下,努力为基金份额持有人谋求最大利益。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度和控制方法

根据《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》的规定,资产管理人制订了《大成基金管理有限公司公平交易制度》及《大成基金管理有限公司异常交易监控与报告制度》。资产管理人旗下投资组合严格按照制度的规定,参与股票、债券的一级市场申购、二级市场交易等投资管理活动,内容包括授权、研究分析、投资决策、交易执行、业绩评估等与投资管理活动相关的各个环节。研究部负责提供投资研究支持,投资部门负责投资决策,交易管理部负责实施交易并实时监控,监察稽核部负责事前监督、事中检查和事后稽核,风险管理部负责对交易情况进行合理性分析,通过多部门的协作互控,保证了公平交易的可操作、可稽核和可持续。

4.3.2 公平交易制度的执行情况

报告期内,基金管理人严格执行了公平交易的原则和制度。

基金管理人对旗下所有投资组合间连续 4 个季度的日内、3 日内及 5 日内股票及债券交易同向交易价差分析及相应交易情形的分析结果表明:债券交易同向交易频率较低;股票同向交易溢价率较大主要来源于市场因素(如个股当日价格振幅较高)及组合经理交易时机选择,即投资组合成交时间不一致以及成交价格的日内较大变动导致个别些组合间的成交价格差异较大,但参与交易所公开竞价同日同向交易成交较少的单边交易量均不超过该股当日成交量 10%。结合交易价差分布统计分析和潜在利益输送金额统计结果表明投资组合间不存在利益输送的可能性。

4.3.3 异常交易行为的专项说明

2012 年基金管理人旗下主动投资组合间股票交易存在 6 笔同日反向交易,原因是投资组合投资策略需要,且参与交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量均不超过该股当日成交量 5%。主动型投资组合与指数型投资组合之间或指数型投资组合之间存在股票同日反向交易,参与交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量超过该股当日成交量 5%的情况有 9 次,原因是指数型投资组合投资策略需要。投资组合间债券交易存在 4 笔同日反向交易,原因是投资组合投资策略需要,且参与交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量均不超过该股当日成交量 5%。投资组合间相邻交易日反向交易的市场成交比例、成交均价等交易结果数据表明该类交易不对市场产生重大影响,无异常。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2012 年,欧债危机继续发酵,美国经济低速增长。中国经济上半年总需求依旧疲弱,通货膨胀出现回落。下半年,由于外需改善和政府基建投资加快,影子银行快速扩张,社会融资总量对经济的支持力度加大,国内经济环比改善,温和复苏。工业品价格指数跌幅收敛,CPI 小幅反弹,全年 CPI 同比上涨 2.7%。年底央行加大短期资金投放,流动性出现明显宽松,尤其是十八大召开后,经济复苏预期有所升温,市场风险偏好明显上升。

2012 年,股票指数全年震荡下行后在年底出现快速反弹,上证综指小幅收阳。全年来看,利率债呈熊市走势,国债收益率上行 15-20 个基点,金融债收益率上行 30-50 个基点。可转债在前三季度表现不佳,股市在年底的快速反弹拉动转债指数全年实现正回报。

考虑到本基金的产品特征,我们基于“严格风险控制,追求稳健收益”的投资原则进行管理:大类资产配置上,超配固定收益类资产,以金融债券和较高等级信用债为主,同时降低组合久期;虽然在四季度对债性转债进行了较大比例的增持,但由于权益类资产的明显低配,未能分享年底股票市场的强劲反弹。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截止本报告期末,本基金份额资产净值为 1.042 元,本报告期基金份额净值增长率为 1.96%同期业绩比较基准收益率为 4.61%,低于业绩比较基准的表现。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望 2013 年,海外需求的拉动和去年下半年刺激政策的效果逐渐减弱,存货调整对产能过剩的消化有限,中国经济弱复苏的可持续性仍存不确定性,通货膨胀可能温和上升。房地产和影子银行的风险值得关注。在此背景下,预计高等级债券的收益稳定,中低等级信用债券违约风险加大。持续下跌后的股票市场存在结构性投资机会,进一步扩容的转债市场也将提供更多的投资选择。

本基金将继续通过固定收益证券投资积累安全垫,严格控制信用风险。在控制整体组合下行风险的前提下,积极灵活加大股票市场的投资比例,以提高组合的投资收益。

我们非常感谢基金份额持有人的信任和支持,我们将继续按照本基金合同和风险收益特征的要求,严格控制投资风险,积极进行资产配置,适时调整组合结构,研究新的投资品种和挖掘投资机会,力争获得与基金风险特征一致的稳定收益,以回报给投资者。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本基金管理人指导基金估值业务的领导小组为公司估值委员会,公司估值委员会主要负责估值政策和估值程序的制定、修订以及执行情况的监督。估值委员会由股票投资部、研究部、固定收益部、风险管理部、基金运营部、监察稽核部、委托投资部指定人员组成。公司估值委员会的相关成员均具备相应的专业胜任能力和相关工作经历,估值委员会成员中包括两名投资组合经理。

股票投资部、研究部、固定收益部、风险管理部和委托投资部负责关注相关投资品种的动态,评判基金持有的投资品种是否处于不活跃的交易状态或者最近交易日后经济环境发生了重大变化或证券发行机构发生了影响证券价格的重大事件,从而确定估值日需要进行估值测算或者调整的投资品种;提出合理的数量分析模型对需要进行估值测算或者调整的投资品种进行公允价值定价与计量;定期对估值政策和程序进行评价,以保证其持续适用;基金运营部负责日常的基金资产的估值业务,执行基金估值政策,并负责与托管行沟通估值调整事项; 监察稽核部负责审核估值政策和程序的一致性, 监督估值委员会工作流程中的风险控制,并负责估值调整事项的信息披露工作。

本基金的日常估值程序由基金运营部基金估值核算员执行,并与托管银行的估值结果核对一致。基金估值政策的议定和修改采用集体讨论机制,基金经理及投资经理作为估值小组成员,对本基金持仓证券的交易情况、信息披露情况保持应有的职业敏感,向估值委员会提供估值参考信息,参与估值政策讨论。对需采用特别估值程序的证券,基金管理人及时启动特别估值程序,由估值委员会讨论议定特别估值方案并与托管行沟通后由基金运营部具体执行。

本基金管理人参与估值流程各方之间不存在任何重大利益冲突,截止报告期末未与外部估值定价服务机构签约。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金管理人严格按照本基金基金合同的规定进行收益分配。本报告期内本基金无收益分配事项。

§5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

2012 年,本基金托管人在对大成保本混合型证券投资基金的托管过程中,严格遵守《证券投资基金法》及其他法律法规和基金合同的有关规定,不存在任何损害基金份额持有人利益的行为,完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

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,大成保本混合型证券投资基金的管理人——大成基金管理有限公司在大成保本混合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、基金费用开支等问题上,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 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

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保本混合型证券投资基金 2012 年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 审计报告

本基金 2012 年年度财务会计报告已经普华永道中天会计师事务所有限公司审计, 注册会计师签字出具了标准无保留意见的审计报告。投资者欲了解本基金审计报告详细内容,应阅读年度报告正文。

§7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体:大成保本混合型证券投资基金

报告截止日: 2012 年 12 月 31 日

单位:人民币元

资 产	本期末 2012年 12 月 31 日	上年度末 2011年 12 月 31 日
资 产:		
银行存款	72,632,292.12	68,818,813.23
结算备付金	295,454.55	889,089.47
存出保证金	83,333.33	62,448.88
交易性金融资产	733,923,273.10	1,115,110,256.40
其中:股票投资	16,791,420.00	10,676,458.40
基金投资	-	-
债券投资	717,131,853.10	1,104,433,798.00
资产支持证券投资	-	-
衍生金融资产	-	-
买入返售金融资产	23,000,000.00	-
应收证券清算款	-	2,983,168.10
应收利息	9,245,298.41	19,767,129.83
应收股利	-	-
应收申购款	90,540.95	23,028.66
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	-
资产总计	839,270,192.46	1,207,653,934.57
负债和所有者权益	本期末 2012年 12 月 31 日	上年度末 2011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	-	-
应付证券清算款	38,446,069.84	-
应付赎回款	701,699.40	1,259,648.80
应付管理人报酬	822,209.29	1,244,232.18
应付托管费	137,034.86	207,372.03
应付销售服务费	-	-
应付交易费用	31,457.37	52,416.74
应交税费	64,016.00	-
应付利息	-	-
应付利润	-	-
递延所得税负债	-	-
其他负债	208,567.56	189,280.27
负债合计	40,411,054.32	2,952,950.02
所有者权益:		
实收基金	766,957,704.51	1,178,359,027.14
未分配利润	31,901,433.63	26,341,957.41
所有者权益合计	798,859,138.14	1,204,700,984.55
负债和所有者权益总计	839,270,192.46	1,207,653,934.57

注:报告截止日 2012 年 12 月 31 日,基金份额净值 1.042 元,基金份额总额 766,957,704.51 份。

7.2 利润表

会计主体:大成保本混合型证券投资基金

本报告期: 2012 年 1 月 1 日至 2012 年 12 月 31 日

单位:人民币元

项 目	本期 2012年 1 月 1 日 至 2012 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2011年 4 月 20 日 (基金合同生效日) 至 2011 年 12 月 31 日
一、收入	33,232,572.39	42,026,981.45
1.利息收入	31,456,422.00	34,146,277.40
其中:存款利息收入	600,441.20	653,386.49
债券利息收入	30,101,787.35	30,122,397.21
资产支持证券利息收入	-	-
买入返售金融资产收入	754,193.45	3,370,493.70
其他利息收入	-	-
2.投资收益 (损失以“-”填列)	3,672,087.17	-2,462,292.50
其中:股票投资收益	-3,235,996.69	-2,568,546.82
基金投资收益	-	-
债券投资收益	6,754,213.56	61,354.32
资产支持证券投资收益	-	-
衍生工具收益	-	-
股利收益	153,870.30	44,900.00
3.公允价值变动收益 (损失以“-”号填列)	-3,797,658.06	7,832,508.62
4.汇兑收益 (损失以“-”号填列)	-	-
5.其他收入 (损失以“-”号填列)	1,901,721.28	2,510,487.93
减:二、费用	14,267,649.55	13,826,511.93
1.管理人报酬	11,667,116.85	11,536,854.10
2.托管费	1,944,519.39	1,922,809.04
3.销售服务费	-	-
4.交易费用	212,425.35	174,526.65
5.利息支出	-	-
其中:卖出回购金融资产支出	-	-
6.其他费用	443,587.96	192,322.14
三、利润总额 (亏损总额以“-”号填列)	18,964,922.84	28,200,469.52
减:所得税费用	-	-
四、净利润 (净亏损以“-”号填列)	18,964,922.84	28,200,469.52

7.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体:大成保本混合型证券投资基金

本报告期:2012 年 1 月 1 日至 2012 年 12 月 31 日

单位:人民币元

项目	本期 2012年 1 月 1 日至 2012 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)	1,178,359,027.14	26,341,957.41	1,204,700,984.55
二、本期经营活动产生的基金净值变动数 (本期利润)	-	18,964,922.84	18,964,922.84
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)	-411,401,322.63	-13,405,446.62	-424,806,769.25
其中:1.基金申购款	9,478,704.16	326,211.67	9,804,915.83
2.基金赎回款	-420,880,026.79	-13,731,658.29	-434,611,685.08
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)	-	-	-
五、期末所有者权益 (基金净值)	766,957,704.51	31,901,433.63	798,859,138.14
项目	上年度可比期间 2011年 4 月 20 日 (基金合同生效日)至 2011 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)	1,672,116,147.63	-	1,672,116,147.63
二、本期经营活动产生的基金净值变动数 (本期利润)	-	28,200,469.52	28,200,469.52
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)	-493,757,120.49	-1,858,512.11	-495,615,632.60
其中:1.基金申购款	6,461,525.96	18,574.00	6,480,099.96
2.基金赎回款	-500,218,646.45	-1,877,086.11	-502,095,732.56
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)	-	-	-
五、期末所有者权益 (基金净值)	1,178,359,027.14	26,341,957.41	1,204,700,984.55

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.4 财务报表由下列负责人签署:

_____王颖_____ _____刘彩晖_____ ____范瑛____

基金管理公司负责人 主管会计工作负责人 会计机构负责人

7.4 报表附注

7.4.1 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

7.4.2 关联方关系

关联方名称	与本基金的关系
大成基金管理有限公司 (“大成基金”)	基金管理人、注册登记机构、基金销售机构
中国工商银行股份有限公司 (“中国工商银行”)	基金托管人、基金代销机构
中泰信托有限责任公司	基金管理人的股东
光大证券股份有限公司 (“光大证券”)	基金管理人的股东、基金代销机构
中国银河投资管理有限公司	基金管理人的股东
广东证券股份有限公司 (“广东证券”)	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、下述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 通过关联方交易单元进行的交易

无。

7.4.3.2 关联方报酬

7.4.3.2.1 基金管理费

单位:人民币元

项目	本期 2012年 1 月 1 日 至 2012 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2011年 4 月 20 日 (基金合同生效日)至 2011 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的管理费	11,667,116.85	11,536,854.10
其中:支付销售机构的客户维护费	4,740,486.37	4,353,989.91

注:支付基金管理人大成基金的管理人报酬按前一日基金资产净值 1.2%的年费率计提,逐日累计至每月月底,按月支付。其计算公式为:

日管理人报酬=前一日基金资产净值 X 1.2% / 当年天数。

7.4.3.2.2 基金托管费

单位:人民币元

项目	本期 2012年 1 月 1 日 至 2012 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2011年 4 月 20 日 (基金合同生效日)至 2011 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的托管费	1,944,519.39	1,922,809.04

注:支付基金托管人中国工商银行的托管费按前一日基金资产净值 0.2%的年费率计提,逐日累计至每月月底,按月支付。其计算公式为:

日托管费=前一日基金资产净值 X 0.2% / 当年天数。

7.4.3.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本报告期内及上年度可比期间本基金未发生与关联方进行的银行间同业市场的债券(含回购)交易。

7.4.3.4 各关联方投资本基金的情况

本报告期内及上年度可比期间本基金未发生各关联方投资本基金的情况。

7.4.3.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位:人民币元

关联方名称	本期 2012年 1 月 1 日 至 2012 年 12 月 31 日		上年度可比期间 2011年 4 月 20 日 (基金合同生效日) 至 2011 年 12 月 31 日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国工商银行	72,632,292.12	571,351.43	68,818,813.23	603,591.18

注:本基金的银行存款由基金托管人 中国工商银行保管,按银行同业利率计息。

7.4.3.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本报告期内及上年度可比期间本基金未在承销期内参与关联方承销证券。

7.4.3.7 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期及上年度可比期间无须作说明的其他关联交易事项。

7.4.4 期末(2012 年 12 月 31 日)本基金持有的流通受限证券

7.4.4.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

本基金本期未持有因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券。

7.4.4.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

于本报告期末,本基金未持有暂时停牌等流通受限股票。

7.4.4.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

于本报告期末,本基金无从事债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

§8 投资组合报告

8.1 期末基金资产组合情况

金额单位:人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	16,791,420.00	2.00
	其中:股票	16,791,420.00	2.00
2	固定收益投资	717,131,853.10	85.45
	其中:债券	717,131,853.10	85.45
	资产支持证券	-	0.00
3	金融衍生品投资	-	0.00
4	买入返售金融资产	23,000,000.00	2.74
	其中:买断式回购的买入返售金融资产	-	0.00
5	银行存款和结算备付金合计	72,927,746.67	8.69
6	其他各项资产	9,419,172.69	1.12
7	合计	839,270,192.46	100.00

8.2 期末按行业分类的股票投资组合

金额单位:人民币元

代码	行业类别	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	-	0.00
B	采掘业	-	0.00
C	制造业	4,681,620.00	0.59
C0	食品、饮料	2,299,220.00	0.29
C1	纺织、服装、皮毛	-	0.00
C2	木材、家具	-	0.00
C3	造纸、印刷	-	0.00
C4	石油、化学、塑胶、塑料	-	0.00
C5	电子	-	0.00
C6	金属、非金属	-	0.00
C7	机械、设备、仪表	-	0.00
C8	医药、生物制品	2,382,400.00	0.30
C99	其他制造业	-	0.00
D	电力、煤气及水的生产和供应业	-	0.00
E	建筑业	-	0.00
F	交通运输、仓储业	-	0.00
G	信息技术业	-	0.00
H	批发和零售贸易	-	0.00
I	金融、保险业	6,809,800.00	0.85
J	房地产业	5,300,000.00	0.66
K	社会服务业	-	0.00
L	传播与文化产业	-	0.00
M	综合类	-	0.00
	合计	16,791,420.00	2.10

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

金额单位:人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量 (股)	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
1	601318	中国平安	120,000	5,434,800.00	0.68
2	600383	金地集团	600,000	4,212,000.00	0.53
3	600267	海正药业	160,000	2,382,400.00	0.30
4	600519	贵州茅台	11,000	2,299,220.00	0.29
5	600036	招商银行	100,000	1,375,000.00	0.17
6	600048	保利地产	80,000	1,088,000.00	0.14

注:投资者欲了解本报告期末基金投资的所有股票明细,应阅读登载于大成基金管理有限公司网站(http://www.dcfund.com.cn)的年度报告正文。8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

8.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位:人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	600036	招商银行	12,949,978.41	1.07
2	601318	中国平安	12,901,664.83	1.07
3	601006	大秦铁路	10,701,200.00	0.89
4	601628	中国人寿	7,688,560.94	0.64
5	000423	东阿阿胶	6,565,046.09	0.54
6	601601	中国太保	5,409,200.00	0.45
7	600383	金地集团	3,789,290.00	0.31
8	600267	海正药业	2,790,599.00	0.23
9	000568	泸州老窖	2,005,979.15	0.17
10	600048	保利地产	1,039,900.00	0.09
11	300307	慈星股份	17,500.00	0.00
12	300301	长方照明	10,000.00	0.00

注:本项中“本期累计买入金额”指买入成交金额(成交单价乘以成交数量),不考虑相关交易费用。

8.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位:人民币元

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	600036	招商银行	13,953,548.95	1.16
2	601006	大秦铁路	10,543,176.57	0.88
3	601318	中国平安	7,953,359.40	0.66