

大成强化收益债券型证券投资基金 2010年半年度报告摘要

2010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：中国建设银行股份有限公司

报告日期：2010年8月24日

1.1 重要提示

基金管理人的董事、监事及高级管理人员声明：本报告不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对内容的真实性、准确性、完整性和及时性承担个别及连带法律责任。本半年度报告经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2010年6月20日复核了本报告中的财务数据，基金经理的过往业绩并不代表其未来表现。本报告未经审计。

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。

本半年度报告摘要摘录了半年度报告正文，投资者欲了解详细内容，应阅读半年度报告正文。

本报告期自2010年1月1日起至2010年6月30日止。

1.2 基金简介

1.1 基金基本情况	大成强化收益债券型证券投资基金
基金代码	099008
前端交易代码	099008
后端交易代码	099108
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2008年8月6日
基金管理人	大成基金管理有限公司
基金托管人	中国建设银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	636,854,842.12份
基金合同存续期	不定期

1.3 基金产品说明

投资目标 在保持资产流动性基础上通过积极主动的投资管理，追求基金经理的长期稳健回报，力争超越业绩比较基准的投资业绩。

投资策略 在资产配置、个券选择和交易策略上实施积极的资产配置策略，以期在承担有限风险的前提下获得较高投资收益。

业绩比较基准 中债综合指数

风险收益特征 本基金定位为满足追求较高稳定回报的基金持有人的投资需求，风险收益水平高于货币市场基金，低于混合基金和股票基金。

1.4 基金管理人和基金托管人

基金管理人 大成基金管理有限公司 中国建设银行股份有限公司

名称 大成基金管理有限公司 中国建设银行股份有限公司

信息披露负责人 姓名 杜鹏 尹东

信息披露负责人 联系电话 0755-83183388 010-67595003

电子邮箱 dupsen@fund.com.cn vinolong@cboc.com

客户服务电话 4008855558 010-67595096

传真 0755-83199588 010-66725856

1.5 信息披露方式

基金半年度报告正文的管理人互联网网址 http://www.dcfund.com.cn

深圳福田区深南大道 7088 号招行大厦 32 层大成基金管理有限公司

基金半年度报告备置地点 北京市西城区丽泽大街 1 号院 1 号楼中国建设银行股份有限公司投资理财服务部

1.6 主要财务指标和基金净值表现及利润分配情况

金额单位：人民币元

1.1 利润数据和指标 报告期(2010年1月1日至2010年6月30日) 2,967,454.05

本期已实现收益 -20,612,392.06

加权平均基金份额本期利润 -0.0269

本期基金份额净值增长率 -2.54%

1.2 利润数据和指标 报告期末(2010年6月30日) 0.0449

期末可供分配基金份额利润 0.450,870.80

期末基金份额净值 1.0449

注：1.本报告期内实现收益指基金本期已收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益、利息收入、手续费收入）减去费用后的余额，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.本期已实现收益不包括持有人买卖基金的损益，计入费用后实际收益水平将低于所列数字。

1.3 基金净值表现

1.3.1 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

金额单位：人民币元

报告期(2010年1月1日至2010年6月30日)

本期末 2010年6月30日 2009年12月31日 上年度末 2009年12月31日

资产 9,575,492.67 6,255,478.26

负债准备金 3,986,700.28 3,076,573.26

存出保证金 185,260.89 250,000.00

应付交易费用 646,887,891.71 897,070,651.82

其中：股票投资 105,061,985.81 149,395,467.82

债券投资 541,825,853.90 747,675,184.00

货币市场基金 - -

应付债券 6,455,898.65 13,799,089.83

应收股利 - -

应收申购款 2,088.29 182,000.75

递延所得税资产 - -

其他资产 - -

资产总计 667,183,350.49 931,474,976.66

负债和所有者权益 667,183,350.49 931,474,976.66

负债 2010年6月30日 2009年12月31日 上年度末 2009年12月31日

负债：应付托管费 - -

应付管理费 - -

应付交易费用 135,440.85 102,115.99

应付税费 520,113.60 108,600.00

应付利息 - -

应付利润 - -

应付利润 - -

应付股利 443,492.66 340,681.62

负债合计 1,732,479.69 1,323,657.05

所有者权益：实收基金 636,854,842.12 867,595,492.95

未分配利润 28,596,028.68 62,555,826.66

所有者权益合计 667,183,350.49 931,474,976.66

注：报告截止日 2010 年 6 月 30 日，基金份额净值 0.0449 元，基金份额总额 636,854,842.12 分。

1.4 利润表

会计主体：大成强化收益债券型证券投资基金

本报告期：2010年1月1日至2010年6月30日

单位：人民币元

项目 2010年1月1日至2010年6月30日 上年度可比期间 2009年1月1日至2009年6月30日

实收基金 15,344,963.72 63,588,802.23

1. 利润收入 9,883,831.56 16,009,637.09

其中：存放中央银行款项 262,033.16 238,253.91

存放同业款项 9,602,137.46 15,771,383.18

拆入资金 - -

支付债券投资收益 443,297,732.8 50,660,126.10

支付交易费用 454,589.55 1,030,575.08

5. 利息支出 976,607.20 68,831.16

6. 其他费用 218,176.01 207,887.02

三、利润总额 -20,612,392.06 57,218,159.86

四、净利润 -20,612,392.06 57,218,159.86

6.3 有助于理解和分析基金净值变动的因素

会计主体：大成强化收益债券型证券投资基金

本报告期：2010年1月1日至2010年6月30日

单位：人民币元

项目 2010年1月1日至2010年6月30日 上年度可比期间 2009年1月1日至2009年6月30日

实收基金 867,595,492.95 62,555,826.66

其中：基金份额持有人 930,151,319.61

其中：基金合同生效日以前业已形成的资本公积 6,255,478.26

减：应付债券 -23,740,650.83 -13,347,405.92 -244,088,056.75

其中：应付短期借款 -1,713,769.78 83,587,351.79

其中：应付债券利息 6,446,850.52 31,569,234.89

其中：应付债券溢价 8,297,297.38 50,660,126.10

其中：应付债券折价 -250,000.00 250,000.00

减：应付股利 137,116.98 1,357,990.80

减：应付利润 -23,579,846.11 -36,502,382.57

减：应付股利 64,820.61 264,195.92

减：其他费用 5,267,428.34 6,140,642.37

减：应付手续费 2,814,043.23 3,759,271.54

减：应付工资福利费 804,013.25 1,074,077.57

减：预提费用 - -

减：应付股利 - -