

大成债券投资基金 2007年第二季度报告

一、重要提示
基金管理人的董事会及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，并对其中内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带责任。
于2007年7月16日复核了本报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、风险揭示等内容，确认不存在虚假记载、误导性陈述和重大遗漏。
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。

报告期为2007年4月1日起至2007年6月30日止。本报告中的财务资料未经审计。

1. 基金简介：	大成债券 A/B, 大成债券 C
2. 基金运作方式：	契约型开放式
3. 基金合同生效日：	2003年4月12日
4. 报告期末基金份额总额：	大成债券 A: 1,717,768,456.30 分份 大成债券 C: 1,717,768,456.30 分份
5. 投资目标：	在力保本金安全的前提下资产流动性基础上追求资产长期稳健增值。 通过资产配置、类属资产配置和个券选择三个层次面上而实现预期目标。类属资产部分按照绝对价值—方差模型在交易市场、交易所企业债、银行间国债、银行间金融债之间实行优化配置。

6. 投资策略：	按组合合规规定：本基金自基金经理之日起6个月内为建仓期，截至报告日本基金的各项投资比例均达到基金合同第十二条之六：股权投资中规定的各项比例；本基金投资于债券类投资工具的比例不超过基金总资产的30%；比例低于规定的30%时，将投资于股票的比例调高至基金净资产的20%。
----------	---

7. 业绩比较基准：

8. 风险收益特征：

9. 基金管理人：

10. 基金托管人：

11. 主要财务指标和基金净值表现

2007年2季度	
大成债券 A/B	大成债券 C
基金本期净收益	51,367,814.01 元
基金份额本期净收益	3,154,621.90 元
期末基金单位净值	0.9263 元
期末基金份额净值	0.9291 元
基金份额本期净值	1,444,013,790.61 元
期末基金份额净值	143,460,337.64 元
基金份额本期净值	1,0488 元
基金份额本期净值	1,0417 元

(三) 本期报告期基金份额净值增长率与同期业绩比较基准收益率的变动比较

大成债券 A/B 累计份额净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势图(2003年6月12日至2007年6月30日)



(五) 本期报告期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

大成债券 A/B 累计份额净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势图(2003年6月12日至2007年6月30日)

(六) 本期报告期基金各项财务指标

1. 基金简介：

2. 基金运作方式：

3. 基金合同生效日：

4. 报告期末基金份额总额：

5. 投资目标：

6. 投资策略：

7. 业绩比较基准：

8. 风险收益特征：

9. 基金管理人：

10. 基金托管人：

11. 主要财务指标

12. 基金份额总额

13. 基金合同生效日

14. 基金管理人名称

15. 基金托管人名称

16. 基金份额净值

17. 基金份额净值增长率

18. 基金份额净值增长率标准差

19. 基金份额净值增长率

20. 基金份额净值增长率

21. 基金份额净值增长率

22. 基金份额净值增长率

23. 基金份额净值增长率

24. 基金份额净值增长率

25. 基金份额净值增长率

26. 基金份额净值增长率

27. 基金份额净值增长率

28. 基金份额净值增长率

29. 基金份额净值增长率

30. 基金份额净值增长率

31. 基金份额净值增长率

32. 基金份额净值增长率

33. 基金份额净值增长率

34. 基金份额净值增长率

35. 基金份额净值增长率

36. 基金份额净值增长率

37. 基金份额净值增长率

38. 基金份额净值增长率

39. 基金份额净值增长率

40. 基金份额净值增长率

41. 基金份额净值增长率

42. 基金份额净值增长率

43. 基金份额净值增长率

44. 基金份额净值增长率

45. 基金份额净值增长率

46. 基金份额净值增长率

47. 基金份额净值增长率

48. 基金份额净值增长率

49. 基金份额净值增长率

50. 基金份额净值增长率

51. 基金份额净值增长率

52. 基金份额净值增长率

53. 基金份额净值增长率

54. 基金份额净值增长率

55. 基金份额净值增长率

56. 基金份额净值增长率

57. 基金份额净值增长率

58. 基金份额净值增长率

59. 基金份额净值增长率

60. 基金份额净值增长率

61. 基金份额净值增长率

62. 基金份额净值增长率

63. 基金份额净值增长率

64. 基金份额净值增长率

65. 基金份额净值增长率

66. 基金份额净值增长率

67. 基金份额净值增长率

68. 基金份额净值增长率

69. 基金份额净值增长率

70. 基金份额净值增长率

71. 基金份额净值增长率

72. 基金份额净值增长率

73. 基金份额净值增长率

74. 基金份额净值增长率

75. 基金份额净值增长率

76. 基金份额净值增长率

77. 基金份额净值增长率

78. 基金份额净值增长率

79. 基金份额净值增长率

80. 基金份额净值增长率

81. 基金份额净值增长率

82. 基金份额净值增长率

83. 基金份额净值增长率

84. 基金份额净值增长率

85. 基金份额净值增长率

86. 基金份额净值增长率

87. 基金份额净值增长率

88. 基金份额净值增长率

89. 基金份额净值增长率

90. 基金份额净值增长率

91. 基金份额净值增长率

92. 基金份额净值增长率

93. 基金份额净值增长率

94. 基金份额净值增长率

95. 基金份额净值增长率

96. 基金份额净值增长率

97. 基金份额净值增长率

98. 基金份额净值增长率

99. 基金份额净值增长率

100. 基金份额净值增长率

101. 基金份额净值增长率

102. 基金份额净值增长率

103. 基金份额净值增长率

104. 基金份额净值增长率

105. 基金份额净值增长率

106. 基金份额净值增长率

107. 基金份额净值增长率

108. 基金份额净值增长率

109. 基金份额净值增长率

110. 基金份额净值增长率

111. 基金份额净值增长率

112. 基金份额净值增长率

113. 基金份额净值增长率

114. 基金份额净值增长率

115. 基金份额净值增长率

116. 基金份额净值增长率

117. 基金份额净值增长率

118. 基金份额净值增长率

119. 基金份额净值增长率

120. 基金份额净值增长率

121. 基金份额净值增长率

122. 基金份额净值增长率

123. 基金份额净值增长率