

# 大成蓝筹稳健证券投资基金 2014 年半年度报告

2014 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：中国银行股份有限公司

送出日期：2014 年 8 月 28 日

## § 1 重要提示及目录

### 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的法律责任。本半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。

基金托管人中国银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2014 年 8 月 26 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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2014 年 01 月 01 日起至 06 月 30 日止。

## 1.2 目录

<b>§ 1 重要提示及目录</b> .....	<b>1</b>
1.1 重要提示.....	1
1.2 目录.....	2
<b>§ 2 基金简介</b> .....	<b>4</b>
2.1 基金基本情况.....	4
2.2 基金产品说明.....	4
2.3 基金管理人和基金托管人.....	4
2.4 信息披露方式.....	5
2.5 其他相关资料.....	5
<b>§ 3 主要财务指标和基金净值表现</b> .....	<b>5</b>
3.1 主要会计数据和财务指标.....	5
3.2 基金净值表现.....	6
<b>§ 4 管理人报告</b> .....	<b>7</b>
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	7
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	9
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	9
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.....	10
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	10
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	11
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	11
<b>§ 5 托管人报告</b> .....	<b>11</b>
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	11
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明.....	12
5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见.....	12
<b>§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）</b> .....	<b>12</b>
6.1 资产负债表.....	12
6.2 利润表.....	13
6.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	14
6.4 报表附注.....	15
<b>§ 7 投资组合报告</b> .....	<b>30</b>
7.1 期末基金资产组合情况.....	30
7.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	30
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细.....	31
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	32
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	34
7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细.....	34
7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细.....	34
7.8 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细.....	34
7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细.....	35
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....	35
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	35
7.12 投资组合报告附注.....	35
<b>§ 8 基金份额持有人信息</b> .....	<b>36</b>

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	36
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	36
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况.....	36
<b>§ 9 开放式基金份额变动.....</b>	<b>36</b>
<b>§ 10 重大事件揭示.....</b>	<b>37</b>
10.1 基金份额持有人大会决议.....	37
10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动.....	37
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	37
10.4 基金投资策略的改变.....	37
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	37
10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况.....	37
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	38
10.8 其他重大事件.....	40
<b>§ 11 影响投资者决策的其他重要信息.....</b>	<b>41</b>
<b>§ 12 备查文件目录.....</b>	<b>41</b>
12.1 备查文件目录.....	41
12.2 存放地点.....	41
12.3 查阅方式.....	41

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	大成蓝筹稳健证券投资基金
基金简称	大成蓝筹稳健混合
场内简称	-
基金主代码	090003
前端交易代码	090003
后端交易代码	091003
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2004 年 6 月 3 日
基金管理人	大成基金管理有限公司
基金托管人	中国银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	12,786,344,078.02 份
基金合同存续期	不定期

### 2.2 基金产品说明

投资目标	通过精选符合本基金投资理念、流动性良好的证券，在控制非系统风险的前提下获取投资收益，同时辅助运用一系列数量分析方法，有效控制系统性风险，实现基金资产的中长期稳定增值。
投资策略	本基金资产配置策略利用修正的恒定比例投资组合保险策略（CPPI）来动态调整基金中股票、债券和现金的配置比例；行业配置采取较为积极的策略，以投资基准的行业权重为基础，以行业研究及比较分析为核心，通过适时增大或降低相应行业的投资权重，使整体投资表现跟上或超越投资基准；个股选择策略则采用蓝筹成分股优选策略，运用“价值—势头”选股方法，优选出被市场低估并有良好市场表现，处于价值回归阶段的天相 280 指数成分股投资。
业绩比较基准	天相 280 指数×70%+中信标普国债指数×30%
风险收益特征	本基金属于较低风险证券投资基金，适于承受一定风险，追求当期收益和长期资本增值的基金投资人。

### 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	中国银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	杜鹏	王永民
	联系电话	0755-83183388	010-66594896
	电子邮箱	dupeng@dcfund.com.cn	fcid@bankofchina.com

客户服务电话	4008885558	95566
传真	0755-83199588	010-66594942
注册地址	深圳市福田区深南大道 7088 号招商银行大厦 32 层	北京市西城区复兴门内大街 1 号
办公地址	深圳市福田区深南大道 7088 号招商银行大厦 32 层	北京市西城区复兴门内大街 1 号
邮政编码	518040	100818
法定代表人	张树忠	田国立

## 2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《证券时报》、《上海证券报》、《中国证券报》
登载基金半年度报告正文的管理人互联网网址	<a href="http://www.dcfund.com.cn">http://www.dcfund.com.cn</a>
基金半年度报告备置地点	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 1 号 中国银行股份有限公司托管及投资者服务部

## 2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	大成基金管理有限公司	深圳市福田区深南大道 7088 号招商银行大厦 32 层

## § 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

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2014 年 1 月 1 日 - 2014 年 6 月 30 日)
本期已实现收益	-794,434,487.50
本期利润	-892,778,358.00
加权平均基金份额本期利润	-0.0677
本期加权平均净值利润率	-11.93%
本期基金份额净值增长率	-10.97%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2014 年 6 月 30 日)
期末可供分配利润	-6,821,946,636.41
期末可供分配基金份额利润	-0.5335
期末基金资产净值	6,971,303,308.57
期末基金份额净值	0.5452
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2014 年 6 月 30 日)

基金份额累计净值增长率	138.21%
-------------	---------

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、期末可供分配利润，采用期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数（为期末余额，不是当期发生数）。

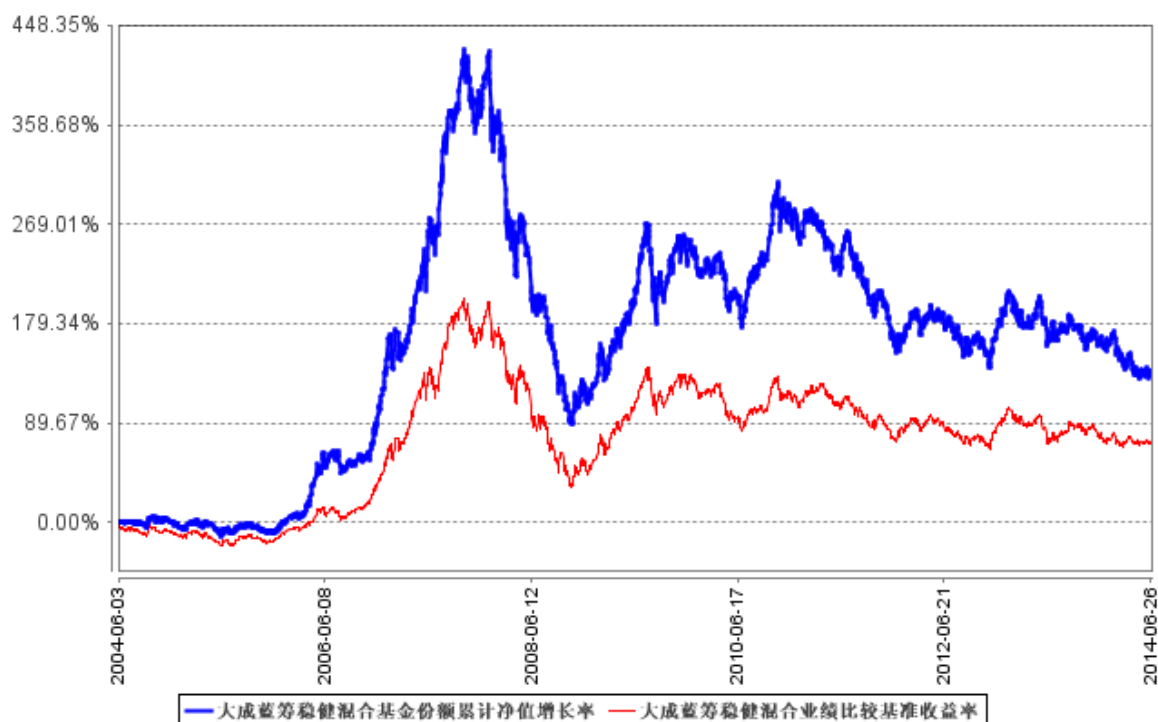
3、所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

### 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
过去一个月	0.96%	1.02%	0.47%	0.57%	0.49%	0.45%
过去三个月	0.17%	0.98%	1.17%	0.62%	-1.00%	0.36%
过去六个月	-10.97%	1.10%	-3.79%	0.73%	-7.18%	0.37%
过去一年	-10.27%	1.14%	-0.36%	0.83%	-9.91%	0.31%
过去三年	-31.88%	1.25%	-17.35%	0.92%	-14.53%	0.33%
自基金合同生效起至今	138.21%	1.51%	73.28%	1.25%	64.93%	0.26%

### 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起 6 个月内为建仓期。依据本基金 2005 年 8 月 31 日《关于调整大成蓝筹稳健证券投资基金资产配置比例的公告》，本基金投资股票比例为基金资产净值的 30%~95%，投资债券比例为基金资产净值的 0%~65%，现金或到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%，法律法规另有规定时从其规定。截至报告日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。

## § 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 2014 年 6 月 30 日，本基金管理人共管理 1 只封闭式证券投资基金：景福证券投资基金，4 只 ETF 及 1 只 ETF 联接基金：深证成长 40 交易型开放式指数证券投资基金、大成深证成长 40 交易型开放式指数证券



投资基金联接基金、大成中证 500 沪市交易型开放式指数证券投资基金、大成中证 100 交易型开放式指数证券投资基金、大成中证 500 深市交易型开放式指数证券投资基金，1 只 QDII 基金：大成标普 500 等权重指数证券投资基金及 37 只开放式证券投资基金：大成景丰债券型证券投资基金（LOF）、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、大成竞争优势股票型证券投资基金、大成内需增长股票型证券投资基金、大成消费主题股票型证券投资基金、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、大成现金宝场内实时申赎货币市场基金、大成景安短融债券型证券投资基金、大成景兴信用债债券型证券投资基金、大成景旭纯债债券型证券投资基金、大成景祥分级债券型证券投资基金、大成中小盘股票型证券投资基金（LOF）、大成健康产业股票型证券投资基金、大成信用增利一年定期开放债券型证券投资基金、大成灵活配置混合型证券投资基金、大成招财宝货币市场基金、大成景益平稳收益混合型证券投资基金。

#### 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		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
支兆华先生	本基金基金经理	2013 年 11 月 25 日	-	13 年	经济学硕士。2001 年至 2005 年, 在华夏基金管理有限公司从事产品开发工作。2006 年加入大成基金管理有限公司, 历任规划发展部总监助理、副总监、总经理办公室主任兼公司战略发展委员会秘书、数量投资部总监及研究部总监。2013 年 11 月 25 日起任大成蓝筹稳健证券投资基金基金经理。具有基金从业资格。国籍：中国
李冒余先生	本基金基金经理助理	2013 年 9 月 9 日	-	8 年	金融学硕士, 2007 年 7 月至 2012 年 4 月任长江证券研究部研究员; 2012 年 4 月加入大成基金管理有限公司从事研究工作, 现任研究部宏观策略小组研究主管。2013 年 9 月 9 日起担任大成蓝筹稳

					健证券投资基金基金经理助理。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。

3、李冒余先生已于 2014 年 8 月 6 日离任本基金基金经理助理。

#### 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》、《大成蓝筹稳健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，大成蓝筹稳健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组合间的成交价格差异较大。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。

##### 4.3.2 异常交易行为的专项说明

公司风险管理部定期对公司旗下所有投资组合间同向交易、反向交易等可能存在异常交易的行为进行分析。2014 年上半年公司旗下主动投资组合间股票交易存在 11 笔同日反向交易，原因是投资组合投资策略需要。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% 的仅有 3 笔，原因为投资策略需要；投资组合间存在 1 笔债券同日反向交易，原因为投资策略需要。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；投资组合间虽然存在同向交易行为，但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。

#### 4.4 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

2014 年上半年 A 股市场指数呈现窄幅震荡趋势，市场风格变化较为剧烈。年初以来 A 股市场延续了 2013 年新兴行业和中小盘股占优的风格特点，但是伴随着一季度末宏观经济持续走低，支柱型产业房地产销量进入下滑通道，经济前景逐步悲观，市场风格也出现剧烈变化，二季度政府调控政策趋于宽松，利率也相应走低，整体风险偏好趋于下行，导致银行地产为主的中大盘蓝筹板块逐步走强。此外，市场因素层面，沪港通推出预期，国企改革和房地产调控政策转向，都进一步加强了这一风格变化趋势。

本基金在报告期内积极对于持仓结构和品种进行调整，紧跟宏观经济和政策调控节奏，相比于 2013 年更为注重风格板块持仓的均衡性，整体继续沿着“创新+改革”的投资主线，一方面，在符合经济转型和模式改革方向的 TMT、节能环保和高端智能装备等行业中自下而上精选个股，另一方面，继续维持可选消费品、大众食品和医药行业等稳定行业的配置比例，并增配了受益于政府政策调控放松的相关板块。

##### 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 0.5452 元，本报告期基金份额净值增长率为 -10.97%，同期业绩比较基准收益率为 -3.79%，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 2014 年下半年的 A 股市场，从宏观基本面角度，经济仍存在下行压力，但是二季度宽松政策仍将带动三季度经济出现环比好转，提供较好的投资时机。考虑到通胀仍将处于较低水平，货币政策依然存在放松空间，同时，房地产政策变化和国企改革的推进，也将改善上市公司盈利前景，因此，我们对整体 A 股指数依然维持“中性震荡”的判断，但是市场结构性机会将多于上半年。

针对以上判断，本组合首先将延续 2014 年上半年均衡配置的组合搭建思路，在继续保持可选消费品、大众食品和医药行业等稳定行业较高配置比例的基础上，结合宏观经济的波动节奏，通过对于风险偏好的准确把握，在市场窄幅波动中积极加强新兴行业的阶段性配置以获取超额收益。同时，继续保持对于新能源汽车、移动互联网、国防军工民参军和国企改革等主题领域的关注，通过自下而上精选以上配置重点的优质标的，在有效控制风险的前提下，构建同时具备相对和绝对收益的组合。

#### 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

本报告期内，中国银行股份有限公司（以下称“本托管人”）在对大成蓝筹稳健证券投资基金（以下称“本基金”）的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了应尽的义务。

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

本报告期内，本托管人根据《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，对本基金管理人的投资运作进行了必要的监督，对基金资产净值的计算以及基金费用开支等方面进行了认真地复核，未发现本基金管理人存在损害基金份额持有人利益的行为。

## 5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报表（注：财务会计报表中的“金融工具风险及管理”部分未在托管人复核范围内）、投资组合报告中的数据真实、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

会计主体：大成蓝筹稳健证券投资基金

报告截止日：2014年6月30日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2014年6月30日	上年度末 2013年12月31日
<b>资产：</b>			
银行存款	6.4.3.1	382,107,804.82	347,556,939.69
结算备付金		16,412,038.30	8,315,787.17
存出保证金		1,013,169.89	1,393,812.30
交易性金融资产	6.4.3.2	6,415,070,931.44	7,880,191,173.18
其中：股票投资		5,970,503,931.44	7,462,623,173.18
基金投资		-	-
债券投资		444,567,000.00	417,568,000.00
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	6.4.3.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.3.4	100,000,270.00	98,000,169.00
应收证券清算款		69,579,980.03	7,521,347.03
应收利息	6.4.3.5	7,052,573.66	5,770,542.68
应收股利		-	-
应收申购款		16,507.32	91,260.89
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.3.6	-	-
资产总计		6,991,253,275.46	8,348,841,031.94
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2014年6月30日</b>	<b>上年度末 2013年12月31日</b>
<b>负债：</b>			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-

衍生金融负债	6.4.3.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		-	-
应付赎回款		3,085,216.95	4,707,466.09
应付管理人报酬		8,527,901.81	10,638,845.91
应付托管费		1,421,316.98	1,773,140.99
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.3.7	6,416,718.80	8,766,310.77
应交税费		-	-
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.3.8	498,812.35	548,981.45
负债合计		19,949,966.89	26,434,745.21
<b>所有者权益：</b>			
实收基金	6.4.3.9	12,786,344,078.02	13,589,528,486.45
未分配利润	6.4.3.10	-5,815,040,769.45	-5,267,122,199.72
所有者权益合计		6,971,303,308.57	8,322,406,286.73
负债和所有者权益总计		6,991,253,275.46	8,348,841,031.94

注：报告截止日 2014 年 6 月 30 日，基金份额净值 0.5452 元，基金份额总额 12,786,344,078.02 份。

## 6.2 利润表

会计主体：大成蓝筹稳健证券投资基金

本报告期：2014 年 1 月 1 日至 2014 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2014 年 1 月 1 日至 2014 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2013 年 1 月 1 日至 2013 年 6 月 30 日
<b>一、收入</b>		-804,319,882.49	-404,766,915.40
1. 利息收入		11,182,301.18	8,938,439.17
其中：存款利息收入	6.4.3.11	2,104,037.73	1,663,513.77
债券利息收入		8,645,282.42	7,054,120.74
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		432,981.03	220,804.66
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		-717,457,677.45	93,722,849.34
其中：股票投资收益	6.4.3.12	-770,561,788.36	15,613,085.11
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.3.13	1,380,596.38	-366,500.00
资产支持证券投资收益	6.4.3.13	-	-
贵金属投资收益	6.4.3.14	-	-

衍生工具收益	6.4.3.15	-	-
股利收益	6.4.3.16	51,723,514.53	78,476,264.23
3. 公允价值变动收益(损失以“-”号填列)	6.4.3.17	-98,343,870.50	-507,965,154.89
4. 汇兑收益(损失以“-”号填列)		-	-
5. 其他收入(损失以“-”号填列)	6.4.3.18	299,364.28	536,950.98
<b>减：二、费用</b>		88,458,475.51	113,059,201.94
1. 管理人报酬	6.4.6.2.1	55,729,505.63	74,223,526.40
2. 托管费	6.4.6.2.2	9,288,250.98	12,370,587.80
3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用	6.4.3.19	23,166,691.82	26,185,221.47
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 其他费用	6.4.3.20	274,027.08	279,866.27
<b>三、利润总额(亏损总额以“-”号填列)</b>		-892,778,358.00	-517,826,117.34
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润(净亏损以“-”号填列)</b>		-892,778,358.00	-517,826,117.34

### 6.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体：大成蓝筹稳健证券投资基金

本报告期：2014年1月1日至2014年6月30日

单位：人民币元

项目	本期 2014年1月1日至2014年6月30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)	13,589,528,486.45	-5,267,122,199.72	8,322,406,286.73
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	-892,778,358.00	-892,778,358.00
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)	-803,184,408.43	344,859,788.27	-458,324,620.16
其中：1. 基金申购款	25,981,806.44	-11,172,818.58	14,808,987.86
2. 基金赎回款	-829,166,214.87	356,032,606.85	-473,133,608.02
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）	12,786,344,078.02	-5,815,040,769.45	6,971,303,308.57
项目	上年度可比期间 2013年1月1日至2013年6月30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）	15,761,290,722.68	-5,599,742,363.97	10,161,548,358.71
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-517,826,117.34	-517,826,117.34
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）	-1,223,129,651.18	412,740,997.43	-810,388,653.75
其中：1. 基金申购款	48,075,735.77	-16,438,144.02	31,637,591.75
2. 基金赎回款	-1,271,205,386.95	429,179,141.45	-842,026,245.50
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）	14,538,161,071.50	-5,704,827,483.88	8,833,333,587.62

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署：

张树忠

刘彩晖

范瑛

基金管理人负责人

主管会计工作负责人

会计机构负责人

#### 6.4 报表附注

##### 6.4.1 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。

##### 6.4.2 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2004]78号《关于证券投资基金税收政策的通知》、财税[2005]102号《关于股息红利个人所得税有关政策的通知》、财税[2005]107号《关于股息红利有关个人所得税政策的补充通



知》、财税[2008]1号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》及其他相关税务法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1) 以发行基金方式募集资金不属于营业税征收范围，不征收营业税。

(2) 基金买卖股票、债券的差价收入暂免征营业税和企业所得税。

(3) 对基金取得的企业债券利息收入，由发行债券的企业在向基金派发利息时代扣代缴 20% 的个人所得税，暂不征收企业所得税。2013 年 1 月 1 日以前，对基金取得的股票的股息、红利收入，由上市公司在向基金派发股息、红利时暂减按 50% 计入个人应纳税所得额，依照现行税法规定即 20% 代扣代缴个人所得税，暂不征收企业所得税。自 2013 年 1 月 1 日起，对基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，持股期限在 1 个月以内(含 1 个月)的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在 1 个月以上至 1 年(含 1 年)的，暂减按 50% 计入应纳税所得额；持股期限超过 1 年的，暂减按 25% 计入应纳税所得额。

(4) 基金卖出股票按 0.1% 的税率缴纳股票交易印花税，买入股票不征收股票交易印花税。

#### 6.4.3 重要财务报表项目的说明

##### 6.4.3.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2014 年 6 月 30 日
活期存款	152,107,804.82
定期存款	-
其中：存款期限 1-3 个月	-
其他存款	230,000,000.00
合计：	382,107,804.82

##### 6.4.3.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2014 年 6 月 30 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	6,059,771,085.80	5,970,503,931.44	-89,267,154.36
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	-	-
	银行间市场	444,095,080.00	444,567,000.00

	合计	444,095,080.00	444,567,000.00	471,920.00
资产支持证券		-	-	-
基金		-	-	-
其他		-	-	-
	合计	6,503,866,165.80	6,415,070,931.44	-88,795,234.36

#### 6.4.3.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末未持有衍生金融工具。

#### 6.4.3.4 买入返售金融资产

##### 6.4.3.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

单位：人民币元

项目	本期末 2014年6月30日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
买入返售证券_银行间	100,000,270.00	-
合计	100,000,270.00	-

##### 6.4.3.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末无买断式逆回购交易中取得的债券。

#### 6.4.3.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2014年6月30日
应收活期存款利息	45,865.79
应收定期存款利息	-
应收其他存款利息	184,966.69
应收结算备付金利息	6,646.86
应收债券利息	6,614,681.96
应收买入返售证券利息	200,002.05
应收申购款利息	-
应收黄金合约拆借孳息	-
其他	410.31
合计	7,052,573.66

#### 6.4.3.6 其他资产

本基金本报告期末未持有其他资产。

## 6.4.3.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2014年6月30日
交易所市场应付交易费用	6,412,661.35
银行间市场应付交易费用	4,057.45
合计	6,416,718.80

## 6.4.3.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2014年6月30日
应付券商交易单元保证金	250,000.00
应付赎回费	5,827.09
预提费用	242,985.26
合计	498,812.35

## 6.4.3.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2014年1月1日至2014年6月30日	
	基金份额(份)	账面金额
上年度末	13,589,528,486.45	13,589,528,486.45
本期申购	25,981,806.44	25,981,806.44
本期赎回(以“-”号填列)	-829,166,214.87	-829,166,214.87
本期末	12,786,344,078.02	12,786,344,078.02

注：申购含转换入份额；赎回含转换出份额。

## 6.4.3.10 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-6,426,813,602.55	1,159,691,402.83	-5,267,122,199.72
本期利润	-794,434,487.50	-98,343,870.50	-892,778,358.00
本期基金份额交易产生的变动数	399,301,453.64	-54,441,665.37	344,859,788.27
其中：基金申购款	-12,837,399.90	1,664,581.32	-11,172,818.58
基金赎回款	412,138,853.54	-56,106,246.69	356,032,606.85
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-6,821,946,636.41	1,006,905,866.96	-5,815,040,769.45

## 6.4.3.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2014年1月1日至2014年6月30日
活期存款利息收入	1,818,191.66
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	184,966.69
结算备付金利息收入	90,801.85
其他	10,077.53
合计	2,104,037.73

## 6.4.3.12 股票投资收益

## 6.4.3.12.1 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2014年1月1日至2014年6月30日
卖出股票成交总额	7,861,369,916.25
减：卖出股票成本总额	8,631,931,704.61
买卖股票差价收入	-770,561,788.36

## 6.4.3.13 债券投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2014年1月1日至2014年6月30日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	409,476,787.81
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	399,773,810.00
减：应收利息总额	8,322,381.43
债券投资收益	1,380,596.38

## 6.4.3.13.1 资产支持证券投资收益

本报告期内本基金无资产支持证券投资收益。

## 6.4.3.14 贵金属投资收益

本报告期内本基金无贵金属投资收益。

**6.4.3.15 衍生工具收益**

本报告期内本基金无衍生工具收益。

**6.4.3.16 股利收益**

单位：人民币元

项目	本期 2014年1月1日至2014年6月30日
股票投资产生的股利收益	51,723,514.53
基金投资产生的股利收益	-
合计	51,723,514.53

**6.4.3.17 公允价值变动收益**

单位：人民币元

项目名称	本期 2014年1月1日至2014年6月30日
1. 交易性金融资产	-98,343,870.50
——股票投资	-100,117,420.50
——债券投资	1,773,550.00
——资产支持证券投资	-
——贵金属投资	-
——其他	-
2. 衍生工具	-
——权证投资	-
3. 其他	-
合计	-98,343,870.50

**6.4.3.18 其他收入**

单位：人民币元

项目	本期 2014年1月1日至2014年6月30日
基金赎回费收入	287,900.16
转换费收入	11,464.12
合计	299,364.28

注：1、本基金的赎回费率按持有期间递减，赎回费总额的 25% 归入基金资产。

2、本基金的转换费由申购补差费和转出基金的赎回费两部分构成，其中转出基金的赎回费的 25% 归入转出基金的基金资产。

**6.4.3.19 交易费用**

单位：人民币元

项目	本期 2014年1月1日至2014年6月30日
交易所市场交易费用	23,162,491.82
银行间市场交易费用	4,200.00
合计	23,166,691.82

**6.4.3.20 其他费用**

单位：人民币元

项目	本期 2014年1月1日至2014年6月30日
审计费用	94,219.55
信息披露费	148,765.71
其他	400.00
银行划款手续费	21,641.82
中债登债券托管帐户维护费	9,000.00
合计	274,027.08

**6.4.4 或有事项、资产负债表日后事项的说明****6.4.4.1 或有事项**

本基金无需要说明的重大或有事项。

**6.4.4.2 资产负债表日后事项**

本基金无需要作披露的资产负债表日后事项。

**6.4.5 关联方关系****6.4.5.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况**

本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

**6.4.5.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方**

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
中国银行股份有限公司(“中国银行”)	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
大成国际资产管理有限公司（“大成国际”）	基金管理人的子公司
大成创新资本管理有限公司（“大成创新资本”）	基金管理人的合资子公司

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。

#### 6.4.6 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

##### 6.4.6.1 通过关联方交易单元进行的交易

##### 6.4.6.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2014年1月1日至2014年6月30日		上年度可比期间 2013年1月1日至2013年6月30日	
	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	1,928,411,768.46	12.78%	4,171,882,463.83	24.77%

##### 6.4.6.1.2 权证交易

本基金本报告期及上年度可比期间未通过关联方交易单元进行权证交易。

##### 6.4.6.1.3 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2014年1月1日至2014年6月30日			
	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
光大证券	1,711,090.49	12.62%	979,398.40	15.27%
关联方名称	上年度可比期间 2013年1月1日至2013年6月30日			
	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
光大证券	3,758,596.27	24.72%	513,057.55	11.70%

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经手费后的净额列示。权证交易不计佣金。

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。

## 6.4.6.2 关联方报酬

## 6.4.6.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2014年1月1日至2014年6月30日	2013年1月1日至2013年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	55,729,505.63	74,223,526.40
其中：支付销售机构的客户维护费	11,004,949.18	14,383,268.83

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 1.5%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×1.5%/当年天数。

## 6.4.6.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2014年1月1日至2014年6月30日	2013年1月1日至2013年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	9,288,250.98	12,370,587.80

注：支付基金托管人中国银行的托管费按前一日基金资产净值 0.25%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×0.25%/当年天数。

## 6.4.6.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

单位：人民币元

上年度可比期间 2013年1月1日至2013年6月30日						
银行间市场交易的各关联方名称	债券交易金额		基金逆回购		基金正回购	
	基金买入	基金卖出	交易金额	利息收入	交易金额	利息支出
中国银行	-	-	140,000,000.00	155,342.47	-	-

注：本基金本报告期末与关联方进行银行间同业市场债券（含回购）交易。

## 6.4.6.4 各关联方投资本基金的情况

## 6.4.6.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

本报告期内及上年度可比期间基金管理人未运用固有资金投资本基金。



## 6.4.6.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

本报告期内及上年度可比期间除基金管理人之外的其他各关联方无投资本基金的情况。

## 6.4.6.5 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		上年度可比期间	
	2014年1月1日至2014年6月30日		2013年1月1日至2013年6月30日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国银行	152,107,804.82	1,818,191.66	312,174,447.25	1,505,052.28

注：本基金的银行存款由基金托管人中国银行保管，按银行同业利率计息。

## 6.4.6.6 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。

## 6.4.6.7 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。

## 6.4.7 利润分配情况

## 6.4.7.1 利润分配情况——非货币市场基金

本报告期内本基金无利润分配。

## 6.4.8 期末（2014年6月30日）本基金持有的流通受限证券

## 6.4.8.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

6.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量 (单位：股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
600460	士兰微	2013年9月5日	2014年9月2日	非公开发行流通受限	4.80	5.50	13,000,000	48,000,000.00	71,500,000.00	-

注：基金可使用以基金名义开设的股票账户，选择网上或者网下一种方式进行新股申购。其中基金作为一般法人或战略投资者认购的新股，根据基金与上市公司所签订申购协议的规定，在新股上市后的约定期限内不能自由转让；基金作为个人投资者参与网上认购获配的新股，从新股获配日至新股上市日之间不能自由转让。此外，基金还可作为特定投资者，认购由中国证监会《上市

公司证券发行管理办法》规范的非公开发行股票，所认购的股票自发行结束之日起 12 个月内不得转让。

#### 6.4.8.2 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。

#### 6.4.8.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

##### 6.4.8.3.1 银行间市场债券正回购

于本报告期末，本基金无银行间市场债券正回购交易中作为抵押的债券。

##### 6.4.8.3.2 交易所市场债券正回购

于本报告期末，本基金无交易所市场债券正回购交易中作为抵押的债券。

#### 6.4.9 金融工具风险及管理

##### 6.4.9.1 风险管理政策和组织架构

本基金是一只进行主动投资的混合型证券投资基金，属于高风险品种。本基金投资的金融工具主要包括股票投资、债券投资及权证投资。本基金在日常经营活动中面临的与这些金融工具相关的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金的基金管理人从事风险管理的主要目标是争取将以上风险控制在限定的范围之内，使本基金在风险和收益之间取得最佳的平衡以实现“风险和收益高于保本基金而低于平衡型基金，谋求稳定和可持续的绝对收益”的风险收益目标。

本基金的基金管理人奉行全面风险管理体系的建设，建立了以由高层监控(董事会合规审计和风险控制委员会、公司投资风险控制委员会)、专业监控(监察稽核部、风险管理部)、部门互控、岗位自控构成的风险管理架构体系。本基金的基金管理人在董事会下设立合规审计和风险控制委员会，对公司整体运营风险进行监督，监督风险控制措施的执行；在管理层层面设立投资风险控制委员会，通过定期会议讨论涉及投资风险的重大议题，形成正式决议提交投委会；在业务操作层面，监察稽核部履行合规控制职责，通过定期、不定期检查内控制度的执行情况、对重大风险点以专项稽核的方式确保公司内控制度、流程得到贯彻执行。风险管理部履行风险量化评估分析职责。

本基金的基金管理人对于金融工具的风险管理方法主要是通过定性分析和定量分析的方法去估测各种风险产生的可能损失。从定性分析的角度出发，判断风险损失的严重程度和出现同类风险损失的频度。而从定量分析的角度出发，根据本基金的投资目标，结合基金资产所运用金融工

其特征通过特定的风险量化指标、模型，日常的量化报告，确定风险损失的限度和相应置信程度，及时可靠地对各种风险进行监督、检查和评估，并通过相应决策，将风险控制在可承受的范围内。

#### 6.4.9.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息等情况，导致基金资产损失和收益变化的风险。

本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的银行存款存放在本基金的托管行中国银行，与该银行存款相关的信用风险不重大。本基金在交易所进行的交易均以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，违约风险可能性很小；在银行间同业市场进行交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式进行限制以控制相应的信用风险。

本基金的基金管理人建立了信用风险管理流程，通过对投资品种信用等级评估来控制证券发行人的信用风险，且通过分散化投资以分散信用风险。于 2014 年 6 月 30 日，本基金未持有信用类债券(2013 年 12 月 31 日：未持有信用类债券)。

#### 6.4.9.3 流动性风险

流动性风险是指基金所持金融工具变现的难易程度。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难或因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理的价格变现。

针对兑付赎回资金的流动性风险，本基金的基金管理人每日对本基金的申购赎回情况进行严密监控并预测流动性需求，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配。本基金的基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。

针对投资品种变现的流动性风险，本基金的基金管理人通过独立的风险管理部门设定流动性比例要求，对流动性指标进行持续的监测和分析，包括组合持仓集中度指标、组合在短时间内变现能力的综合指标、组合中变现能力较差的投资品种比例以及流通受限制的投资品种比例等。本基金投资于一家公司发行的股票市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金的基金管理人管理的其他基金共同持有一家发行的证券不得超过该证券的 10%。本基金所持大部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易，因此除附注 6.4.8 中列示的部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况外，其余金融资产均能以合理价格适时变现。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债

券投资的公允价值。

本基金所持有的全部金融负债的合同约定到期日均为一个月以内且不计息，可赎回基金份额净值(所有者权益)无固定到期日且不计息，因此账面余额即为未折现的合约到期现金流量。

#### 6.4.9.4 市场风险

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动而发生波动的风险，包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

##### 6.4.9.4.1 利率风险

利率风险是指金融工具的公允价值或现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。利率敏感性金融工具均面临由于市场利率上升而导致公允价值下降的风险，其中浮动利率类金融工具还面临每个付息期间结束根据市场利率重新定价时对于未来现金流影响的风险。

本基金的基金管理人定期对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控，并通过调整投资组合的久期等方法对上述利率风险进行管理。

本基金持有的大部分金融资产和金融负债不计息，因此本基金的收入及经营活动的现金流量在很大程度上独立于市场利率变化。本基金持有的利率敏感性资产主要为银行存款、结算备付金及债券投资等。

##### 6.4.9.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2014年6月30日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	382,107,804.82	-	-	-	382,107,804.82
结算备付金	16,412,038.30	-	-	-	16,412,038.30
存出保证金	1,013,169.89	-	-	-	1,013,169.89
交易性金融资产	444,567,000.00	-	-	5,970,503,931.44	6,415,070,931.44
买入返售金融资产	100,000,270.00	-	-	-	100,000,270.00
应收证券清算款	-	-	-	69,579,980.03	69,579,980.03
应收利息	-	-	-	7,052,573.66	7,052,573.66
应收申购款	1,499.40	-	-	15,007.92	16,507.32
资产总计	944,101,782.41	-	-	6,047,151,493.05	6,991,253,275.46
负债					
应付赎回款	-	-	-	3,085,216.95	3,085,216.95
应付管理人报酬	-	-	-	8,527,901.81	8,527,901.81
应付托管费	-	-	-	1,421,316.98	1,421,316.98

应付交易费用	-	-	-	6,416,718.80	6,416,718.80
其他负债	-	-	-	498,812.35	498,812.35
负债总计	-	-	-	19,949,966.89	19,949,966.89
利率敏感度缺口	944,101,782.41	-	-	6,027,201,526.16	6,971,303,308.57
上年度末 2013 年 12 月 31 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	347,556,939.69	-	-	-	347,556,939.69
结算备付金	8,315,787.17	-	-	-	8,315,787.17
存出保证金	1,393,812.30	-	-	-	1,393,812.30
交易性金融资产	417,568,000.00	-	-	7,462,623,173.18	7,880,191,173.18
买入返售金融资产	98,000,169.00	-	-	-	98,000,169.00
应收证券清算款	-	-	-	7,521,347.03	7,521,347.03
应收利息	-	-	-	5,770,542.68	5,770,542.68
应收申购款	4,595.82	-	-	86,665.07	91,260.89
资产总计	872,839,303.98	-	-	7,476,001,727.96	8,348,841,031.94
负债					
应付赎回款	-	-	-	4,707,466.09	4,707,466.09
应付管理人报酬	-	-	-	10,638,845.91	10,638,845.91
应付托管费	-	-	-	1,773,140.99	1,773,140.99
应付交易费用	-	-	-	8,766,310.77	8,766,310.77
其他负债	-	-	-	548,981.45	548,981.45
负债总计	-	-	-	26,434,745.21	26,434,745.21
利率敏感度缺口	872,839,303.98	-	-	7,449,566,982.75	8,322,406,286.73

注：表中所示为本基金资产及负债的公允价值，并按照合约规定的利率重新定价日或到期日孰早予以分类。

#### 6.4.9.4.1.2 利率风险的敏感性分析

于 2014 年 6 月 30 日，本基金持有的交易性债券投资公允价值占基金资产净值的比例为 6.38% (2013 年 12 月 31 日：5.02%)，因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响 (2013 年 12 月 31 日：同)。

#### 6.4.9.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无重大外汇风险。

#### 6.4.9.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场交易的股票和债券，所面临的其他价格风险来源于单个证券发行主体自身经营情况或特殊事项的

影响，也可能来源于证券市场整体波动的影响。

本基金的基金管理人在构建和管理投资组合的过程中，采用“自上而下”的策略，通过对宏观经济情况及政策的分析，结合证券市场运行情况，做出资产配置及组合构建的决定；通过对单个证券的定性分析及定量分析，选择符合基金合同约定范围的投资品种进行投资。本基金的基金管理人定期结合宏观及微观环境的变化，对投资策略、资产配置、投资组合进行修正，来主动应对可能发生的市场价格风险。

本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险。本基金投资组合中股票投资比例为基金资产净值的 30%-95%，债券投资比例为基金资产净值的 0%-65%，现金或到期日在一年以内的政府债券投资比例不低于基金资产净值的 5%。此外，本基金的基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控，定期运用多种定量方法对基金进行风险度量，包括 VaR(Value at Risk) 指标等来测试本基金面临的潜在价格风险，及时可靠地对风险进行跟踪和控制。

#### 6.4.9.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2014 年 6 月 30 日		上年度末 2013 年 12 月 31 日	
	公允价值	占基金 资产净 值比例 (%)	公允价值	占基金资 产净值比 例 (%)
交易性金融资产-股票投资	5,970,503,931.44	85.64	7,462,623,173.18	89.67
衍生金融资产-权证投资	-	0.00	-	0.00
其他	-	0.00	-	0.00
合计	5,970,503,931.44	85.64	7,462,623,173.18	89.67

#### 6.4.9.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除业绩比较基准以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2014 年 6 月 30 日）	上年度末（2013 年 12 月 31 日）
	1. 业绩比较基准上升 5%		462,480,000.00
2. 业绩比较基准下降 5%		-462,480,000.00	-578,870,000.00

## 6.4.10 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

本基金无需要说明的其他事项。

## § 7 投资组合报告

## 7.1 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	5,970,503,931.44	85.40
	其中：股票	5,970,503,931.44	85.40
2	固定收益投资	444,567,000.00	6.36
	其中：债券	444,567,000.00	6.36
	资产支持证券	-	0.00
3	贵金属投资	-	0.00
4	金融衍生品投资	-	0.00
5	买入返售金融资产	100,000,270.00	1.43
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	0.00
6	银行存款和结算备付金合计	398,519,843.12	5.70
7	其他各项资产	77,662,230.90	1.11
8	合计	6,991,253,275.46	100.00

## 7.2 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（元）	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	311,551,165.90	4.47
B	采矿业	-	0.00
C	制造业	3,340,244,482.01	47.91
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	0.00
E	建筑业	154,318,751.62	2.21
F	批发和零售业	-	0.00
G	交通运输、仓储和邮政业	-	0.00
H	住宿和餐饮业	-	0.00
I	信息传输、软件和信息技术服务业	952,006,416.93	13.66
J	金融业	926,973,177.47	13.30
K	房地产业	95,814,625.76	1.37

L	租赁和商务服务业	-	0.00
M	科学研究和技术服务业	-	0.00
N	水利、环境和公共设施管理业	189,595,311.75	2.72
O	居民服务、修理和其他服务业	-	0.00
P	教育	-	0.00
Q	卫生和社会工作	-	0.00
R	文化、体育和娱乐业	-	0.00
S	综合	-	0.00
	合计	5,970,503,931.44	85.64

## 7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

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	000400	许继电气	16,590,948	332,648,507.40	4.77
2	601166	兴业银行	28,305,546	283,904,626.38	4.07
3	300124	汇川技术	8,998,428	280,750,953.60	4.03
4	000625	长安汽车	21,304,179	262,254,443.49	3.76
5	600519	贵州茅台	1,757,875	249,583,092.50	3.58
6	600109	国金证券	12,273,597	243,876,372.39	3.50
7	300104	乐视网	5,340,096	234,430,214.40	3.36
8	600597	光明乳业	14,376,523	230,599,428.92	3.31
9	601998	中信银行	52,399,478	223,745,771.06	3.21
10	002041	登海种业	7,408,060	206,240,390.40	2.96
11	600309	万华化学	12,990,415	196,934,691.40	2.82
12	300070	碧水源	6,481,891	189,595,311.75	2.72
13	601318	中国平安	4,459,746	175,446,407.64	2.52
14	002353	杰瑞股份	4,280,759	172,300,549.75	2.47
15	600804	鹏博士	11,829,685	170,820,651.40	2.45
16	600703	三安光电	7,050,183	165,185,787.69	2.37
17	600588	用友软件	11,728,423	165,018,911.61	2.37
18	002410	广联达	5,936,068	156,949,637.92	2.25
19	300024	机器人	5,288,874	155,492,895.60	2.23
20	600372	中航电子	6,807,969	154,336,657.23	2.21
21	601117	中国化学	29,619,722	154,318,751.62	2.21
22	000997	新大陆	8,588,816	149,101,845.76	2.14



23	002202	金风科技	14,819,046	140,632,746.54	2.02
24	600893	航空动力	4,780,000	123,180,600.00	1.77
25	002030	达安基因	6,146,576	119,550,903.20	1.71
26	600872	中炬高新	10,148,896	108,288,720.32	1.55
27	600196	复星医药	5,229,932	105,592,327.08	1.51
28	002714	牧原股份	2,390,710	105,310,775.50	1.51
29	600271	航天信息	4,717,101	98,445,897.87	1.41
30	002415	海康威视	5,729,495	97,057,645.30	1.39
31	600759	正和股份	9,375,208	95,814,625.76	1.37
32	600276	恒瑞医药	2,710,611	89,883,860.76	1.29
33	600535	天士力	2,049,869	79,473,421.13	1.14
34	300212	易华录	2,416,512	75,685,155.84	1.09
35	600460	士兰微	13,000,000	71,500,000.00	1.03
36	601633	长城汽车	1,034,880	26,182,464.00	0.38
37	002341	新纶科技	999,977	19,639,548.28	0.28
38	603699	纽威股份	999,926	19,468,559.22	0.28
39	600252	中恒集团	1,156,052	13,560,489.96	0.19
40	002547	春兴精工	999,925	11,969,102.25	0.17
41	300307	慈星股份	1,018,754	10,798,792.40	0.15
42	600741	华域汽车	499,909	4,889,110.02	0.07
43	603006	黎明股份	3,027	43,286.10	0.00

#### 7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

##### 7.4.1 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	601166	兴业银行	279,972,454.22	3.36
2	600109	国金证券	267,593,244.13	3.22
3	600597	光明乳业	256,271,203.48	3.08
4	601998	中信银行	245,159,595.45	2.95
5	300104	乐视网	231,875,454.31	2.79
6	300124	汇川技术	220,702,058.40	2.65
7	000400	许继电气	217,821,543.10	2.62
8	600999	招商证券	195,490,223.33	2.35
9	600588	用友软件	188,871,757.11	2.27

10	600519	贵州茅台	187,210,728.22	2.25
11	002353	杰瑞股份	184,942,432.92	2.22
12	601117	中国化学	173,712,290.34	2.09
13	002410	广联达	165,495,616.82	1.99
14	000625	长安汽车	159,661,220.96	1.92
15	600372	中航电子	156,522,850.10	1.88
16	000997	新大陆	150,851,581.88	1.81
17	002202	金风科技	140,301,245.88	1.69
18	600893	航空动力	138,896,451.27	1.67
19	600759	正和股份	137,776,228.33	1.66
20	002041	登海种业	135,362,978.98	1.63

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

#### 7.4.2 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	000001	平安银行	249,067,430.61	2.99
2	000651	格力电器	241,661,601.93	2.90
3	600887	伊利股份	222,497,353.01	2.67
4	600999	招商证券	181,749,379.85	2.18
5	600016	民生银行	173,009,212.76	2.08
6	600340	华夏幸福	145,184,180.28	1.74
7	600383	金地集团	142,486,168.79	1.71
8	000895	双汇发展	139,753,486.88	1.68
9	601299	中国北车	136,659,787.86	1.64
10	601318	中国平安	135,630,131.76	1.63
11	002008	大族激光	130,471,711.73	1.57
12	000826	桑德环境	130,446,371.37	1.57
13	002081	金螳螂	126,482,192.15	1.52
14	600406	国电南瑞	120,776,615.16	1.45
15	000581	威孚高科	120,180,261.25	1.44
16	002475	立讯精密	118,564,410.07	1.42
17	600252	中恒集团	106,915,113.19	1.28
18	300146	汤臣倍健	103,412,754.44	1.24
19	600036	招商银行	101,456,549.76	1.22

20	000538	云南白药	100,273,314.05	1.20
----	--------	------	----------------	------

注：本期累计卖出金额指卖出成交金额（成交单价乘以成交数量），不考虑相关交易费用。

#### 7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	7,239,929,883.37
卖出股票收入（成交）总额	7,861,369,916.25

注：上述金额均指成交金额（成交单价乘以成交数量），不考虑相关交易费用。

#### 7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	-	0.00
2	央行票据	-	0.00
3	金融债券	444,567,000.00	6.38
	其中：政策性金融债	444,567,000.00	6.38
4	企业债券	-	0.00
5	企业短期融资券	-	0.00
6	中期票据	-	0.00
7	可转债	-	0.00
8	其他	-	0.00
9	合计	444,567,000.00	6.38

#### 7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	140316	14 进出 16	2,800,000	274,176,000.00	3.93
2	140204	14 国开 04	600,000	60,270,000.00	0.86
3	140212	14 国开 12	500,000	50,085,000.00	0.72
4	130243	13 国开 43	200,000	20,022,000.00	0.29
5	130232	13 国开 32	200,000	20,010,000.00	0.29

#### 7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

#### 7.8 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末投资贵金属。

**7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细**

本基金本报告期末未持有权证。

**7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明****7.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细**

本基金本报告期末投资股指期货。

**7.10.2 本基金投资股指期货的投资政策**

本基金本报告期末投资股指期货。

**7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明****7.11.1 本期国债期货投资政策**

本基金本报告期末投资国债期货。

**7.11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细**

本基金本报告期末投资国债期货。

**7.11.3 本期国债期货投资评价**

本基金本报告期末投资国债期货。

**7.12 投资组合报告附注**

**7.12.1 报告期内基金投资的前十名证券的发行主体无被监管部门立案调查的，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。**

**7.12.2 本基金投资的前十名股票未超出基金合同规定的备选股票库。**

**7.12.3 期末其他各项资产构成**

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	1,013,169.89
2	应收证券清算款	69,579,980.03
3	应收股利	-
4	应收利息	7,052,573.66
5	应收申购款	16,507.32
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	77,662,230.90

**7.12.4 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债。

**7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明**

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

**7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分**

由于四舍五入原因，分项之和与合计可能有尾差。

**§ 8 基金份额持有人信息****8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构**

份额单位：份

持有人户数 (户)	户均持有的 基金份额	持有人结构			
		机构投资者		个人投资者	
		持有份额	占总份 额比例	持有份额	占总份 额比例
694,896	18,400.37	43,575,491.62	0.34%	12,742,768,586.40	99.66%

注：持有人户数为有效户数，即存量份额大于零的账户。

**8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况**

项目	持有份额总数（份）	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	-	0.00

**8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况**

项目	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	0
本基金基金经理持有本开放式基金	0

**§ 9 开放式基金份额变动**

单位：份

基金合同生效日（2004年6月3日）基金份额总额	2,234,307,480.29
--------------------------	------------------

本报告期期初基金份额总额	13,589,528,486.45
本报告期基金总申购份额	25,981,806.44
减:本报告期基金总赎回份额	829,166,214.87
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	12,786,344,078.02

## § 10 重大事件揭示

### 10.1 基金份额持有人大会决议

报告期内无基金份额持有人大会决议。

### 10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

基金托管人在本报告期内重大人事变动情况：

2014年2月14日中国银行股份有限公司公告，自2014年2月13日起，陈四清先生担任本行行长。

报告期内基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

基金管理人在本报告期内重大人事变动情况：

基金管理人于2014年1月25日发布了《大成基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告》，经大成基金管理有限公司第五届董事会第二十八次会议审议通过，王颢先生不再担任大成基金管理有限公司总经理，由董事长张树忠先生代任公司总经理。

### 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内没有涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

### 10.4 基金投资策略的改变

本基金投资策略在本报告期内没有重大改变。

### 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金聘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，该事务所自基金合同生效日起为本基金提供审计服务至今。

### 10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期，本基金管理人、托管人及高级管理人员未受到监管部门稽查或处罚。

## 10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

## 10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		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	
东海证券	1	2,654,955,531.98	17.59%	2,417,072.19	17.83%	-
光大证券	2	1,928,411,768.46	12.78%	1,711,090.49	12.62%	-
广发证券	1	1,263,646,409.24	8.37%	1,150,424.44	8.48%	-
安信证券	2	1,209,147,244.05	8.01%	1,073,425.97	7.92%	-
中信证券	2	1,068,476,232.05	7.08%	972,739.72	7.17%	-
中投证券	2	945,644,329.33	6.27%	860,913.21	6.35%	-
申银万国	1	886,939,960.99	5.88%	784,862.21	5.79%	-
渤海证券	2	582,571,412.86	3.86%	515,521.47	3.80%	-
国泰君安	1	522,965,220.13	3.47%	462,780.09	3.41%	-
国信证券	1	484,434,769.41	3.21%	428,684.15	3.16%	-
银河证券	1	398,936,476.92	2.64%	363,192.17	2.68%	-
民生证券	1	388,097,541.64	2.57%	343,430.81	2.53%	-
英大证券	1	383,949,614.61	2.54%	339,761.47	2.51%	-
长江证券	1	383,259,693.71	2.54%	348,917.24	2.57%	-
招商证券	2	364,929,971.35	2.42%	332,229.96	2.45%	-
东方证券	1	340,065,960.22	2.25%	309,595.44	2.28%	-
民族证券	1	302,997,081.76	2.01%	268,125.68	1.98%	-
国海证券	1	232,815,263.74	1.54%	206,018.69	1.52%	-
国都证券	1	183,500,602.62	1.22%	162,380.97	1.20%	-
中金公司	2	176,857,477.25	1.17%	156,502.09	1.15%	-
华鑫证券	1	167,276,439.73	1.11%	152,287.44	1.12%	-
海通证券	2	112,865,594.61	0.75%	102,753.53	0.76%	-
华泰证券	2	108,643,344.35	0.72%	96,139.18	0.71%	-
万联证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
齐鲁证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
华福证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
华宝证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
西南证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
华林证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-

东莞证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
东吴证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
中航证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
万和证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
江海证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
湘财证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
天源证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
中银国际	1	-	0.00%	-	0.00%	-
财富证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
广州证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-

注：1、根据中国证监会颁布的《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，本公司制定了租用证券公司交易单元的选择标准和程序。

租用证券公司交易单元的选择标准主要包括：

- （一）财务状况良好，最近一年无重大违规行为；
- （二）经营行为规范，内控制度健全，能满足各投资组合运作的保密性要求；
- （三）研究实力较强，能提供包括研究报告、路演服务、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、安全的通讯条件，有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、管理所需的其他券商服务；
- （六）相关基金合同、资产管理合同以及法律法规规定的其他条件。

租用证券公司交易单元的程序：首先根据租用证券公司交易单元的选择标准形成《券商服务评价表》，然后根据评分高低进行选择基金交易单元。

2、本报告期内本基金租用证券公司交易单元的变更情况如下：

本报告期内增加交易单元：无；

本报告期内退租交易单元：无。

#### 10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

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
广发证券	11,466,470.20	100.00%	-	0.00%	-	0.00%



## 10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	大成基金管理有限公司关于增加和讯信息科技有限公司为开放式基金代销机构并开通相关业务的公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2014/1/4
2	大成蓝筹稳健证券投资基金更新的招募说明书摘要（2013 年第 2 期）	中国证监会指定报刊及本公司网站	2014/1/18
3	大成蓝筹稳健证券投资基金更新的招募说明书（2013 年第 2 期）	中国证监会指定报刊及本公司网站	2014/1/18
4	大成蓝筹稳健证券投资基金 2013 年第 4 季度报告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2014/1/22
5	大成基金管理有限公司关于旗下基金持有的“汤臣倍健”股票估值调整的公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2014/1/25
6	大成基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2014/1/25
7	大成基金管理有限公司关于旗下基金持有的“和佳股份”股票估值调整的公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2014/3/18
8	关于大成基金管理有限公司北京理财中心办公地址变更的公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2014/3/19
9	大成蓝筹稳健证券投资基金 2013 年年度报告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2014/3/29
10	大成蓝筹稳健证券投资基金 2013 年年度报告摘要	中国证监会指定报刊及本公司网站	2014/3/29
11	大成基金管理有限公司关于旗下基金持有的“新华医疗”股票估值调整的公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2014/4/1
12	大成基金管理有限公司关于调整网上直销系统中定期定额投资起点金额的公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2014/4/8
13	大成基金管理有限公司董事、监事、高级管理人员以及其他从业人员在子公司兼任职务及领薪情况的公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2014/4/11
14	关于增加中国民族证券有限责任公司为开放式基金代销机构并开通相关业务的公告	中国证监会指定报刊及本公	2014/4/17

		司网站	
15	大成蓝筹稳健证券投资基金 2014 年第 1 季度报告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2014/4/21
16	大成基金管理有限公司关于旗下基金持有的“宇通客车”股票估值调整的公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2014/4/22
17	关于增加杭州数米基金销售有限公司为代销机构及相关申购费率优惠的公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2014/6/5
18	大成基金管理有限公司关于调整旗下开放式基金基金转换业务规则的公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2014/6/30

### § 11 影响投资者决策的其他重要信息

无。

### § 12 备查文件目录

#### 12.1 备查文件目录

- 1、中国证监会批准设立《大成蓝筹稳健证券投资基金》的文件；
- 2、《大成蓝筹稳健证券投资基金基金合同》；
- 3、《大成蓝筹稳健证券投资基金托管协议》；
- 4、大成基金管理有限公司批准文件、营业执照、公司章程；
- 5、本报告期内在指定报刊上披露的各种公告原稿。

#### 12.2 存放地点

本期报告存放在本基金管理人和托管人的住所。

#### 12.3 查阅方式

投资者可在营业时间免费查阅，或登录本基金管理人网站 <http://www.dcfund.com.cn> 进行查阅。

投资者对本报告书如有疑问，可咨询本基金管理人大成基金管理有限公司。

客户服务中心电话：400-888-5558（免长途通话费用）

国际互联网址：<http://www.dcfund.com.cn>

大成基金管理有限公司

2014 年 8 月 28 日