

大成健康产业股票型证券投资基金  
2014 年年度报告摘要

2014 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：中国银行股份有限公司

送出日期：2015 年 3 月 28 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。

基金托管人中国银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2015 年 3 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。

根据中国证监会 2014 年 1 月 24 日下发的《关于大成中证 500 沪市交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金份额持有人大会决议备案的回函》（基金部函[2014]51 号），大成中证 500 沪市交易型开放式指数证券投资基金联接基金转型为大成健康产业股票型证券投资基金，修改基金合同中的基金名称、基金类别、基金的投资目标、投资范围、投资理念和投资策略、业绩比较基准、风险收益特征、基金投资组合比例限制、基金的费用等条款。

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。安永华明会计师事务所(特殊普通合伙)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 2014 年 01 月 01 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	大成健康产业股票
基金主代码	090020
交易代码	090020
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2012 年 8 月 28 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	36,061,686.85 份
基金合同存续期	不定期

### 2.2 基金产品说明

投资目标	本基金主要投资于与健康产业相关的优质上市公司，在控制风险的前提下，力争为投资者创造超越业绩比较基准的长期资本增值。
投资策略	<p>本基金采用自上而下和自下而上相结合的主动投资策略。以宏观经济和政策研究为基础，通过分析影响证券市场整体运行的内外部因素，实施大类资产配置；通过对健康产业各个子行业发展生命周期、行业景气度、行业竞争格局、技术水平及其发展趋势等多角度，综合评估各个行业的投资价值，实行业配置；对健康产业各公司在所属行业的竞争优势进行分析，结合股票基本面指标（包括成长性指标和估值指标），精选优质上市公司股票，构建投资组合。</p> <p>为有效控制投资风险，本基金将根据风险管理的原则适度进行股指期货投资。股指期货投资将根据风险管理的原则，以套期保值为目的，并按照中国金融期货交易所套期保值管理的有关规定执行，对冲系统性风险和某些特殊情况下的流动性风险等。</p>
业绩比较基准	申万医药生物行业指数×80%+中证综合债券指数×20%
风险收益特征	本基金为股票型基金，属于较高风险、较高预期收益的基金品种，其风险与预期收益高于混合基金、债券基金与货币市场基金。

注：根据中国证监会 2014 年 1 月 24 日下发的《关于大成中证 500 沪市交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金份额持有人大会决议备案的回函》（基金部函[2014]51 号），大成中证 500 沪市交易型开放式指数证券投资基金联接基金转型为大成健康产业股票型证券投资基金，修改基金合同中的基金名称、基金类别、基金的投资目标、投资范围、投资理念和投资策略、业绩比较基准、风险收益特征、基金投资组合比例限制、基金的费用等条款。修订后的《大成健康产业股票型证券投资基金基金合同》自 2014 年 1 月 24 日起正式生效。

### 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

## 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	<a href="http://www.dcfund.com.cn">http://www.dcfund.com.cn</a>
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 1 号中国银行股份有限公司托管业务部

## §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	2014 年	2013 年	2012 年 8 月 28 日(基金合同生效日)-2012 年 12 月 31 日
本期已实现收益	-2,196,186.92	3,613,627.62	1,288,773.59
本期利润	-3,524,264.17	4,869,984.64	1,288,773.59
加权平均基金份额本期利润	-0.0644	0.1245	0.0097
本期基金份额净值增长率	-7.01%	6.14%	-0.60%
3.1.2 期末数据和指标	2014 年末	2013 年末	2012 年末
期末可供分配基金份额利润	-0.0191	0.0545	-0.0058
期末基金资产净值	35,373,079.73	54,349,333.21	56,609,998.62
期末基金份额净值	0.981	1.055	0.994

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

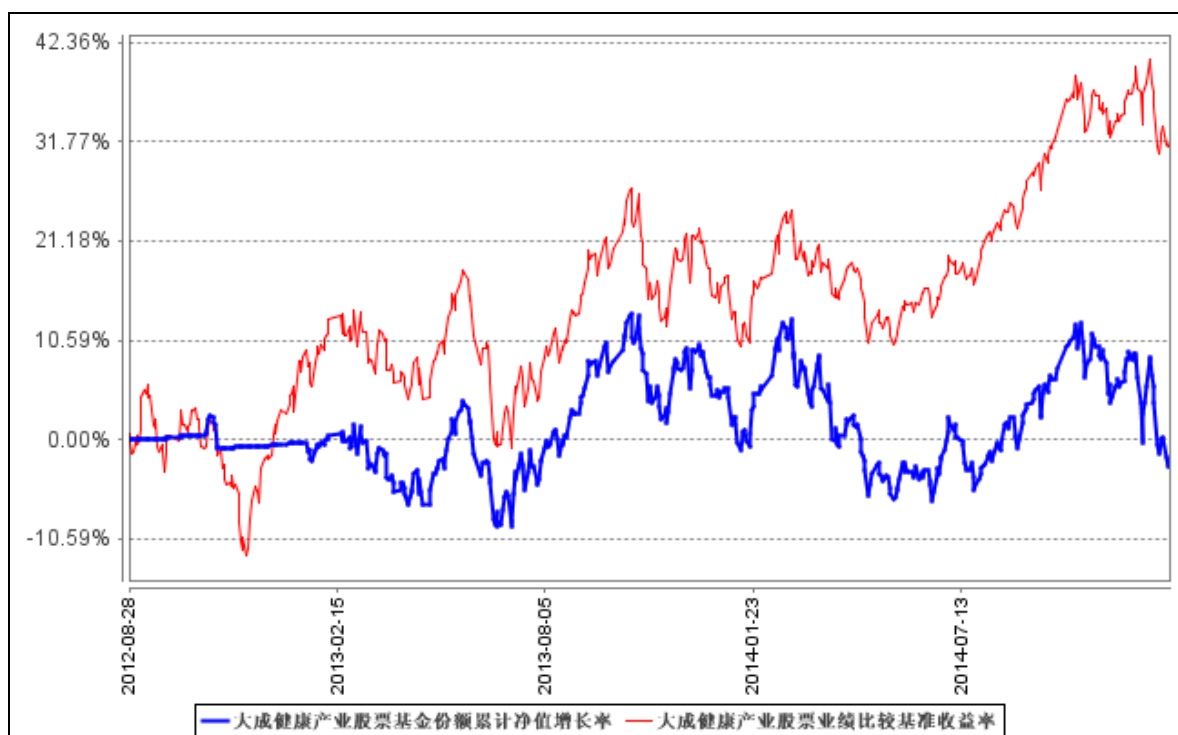
#### 3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

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	-8.74%	1.53%	-0.74%	1.09%	-8.00%	0.44%

过去六个月	-0.81%	1.27%	12.69%	0.90%	-13.50%	0.37%
过去一年	-7.01%	1.25%	12.63%	0.95%	-19.64%	0.30%
自基金合同生效起至今	-1.90%	1.11%	32.07%	1.21%	-33.97%	-0.10%

注：根据《大成健康产业股票型证券投资基金基金合同》，业绩比较基准自2014年1月24日起，由“中证500沪市指数×95%+银行活期存款利率（税后）×5%”变更为“申万医药生物行业指数×80%+中证综合债券指数×20%”；基金业绩比较基准收益率在变更前后期间分别根据相应的指标计算。

### 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



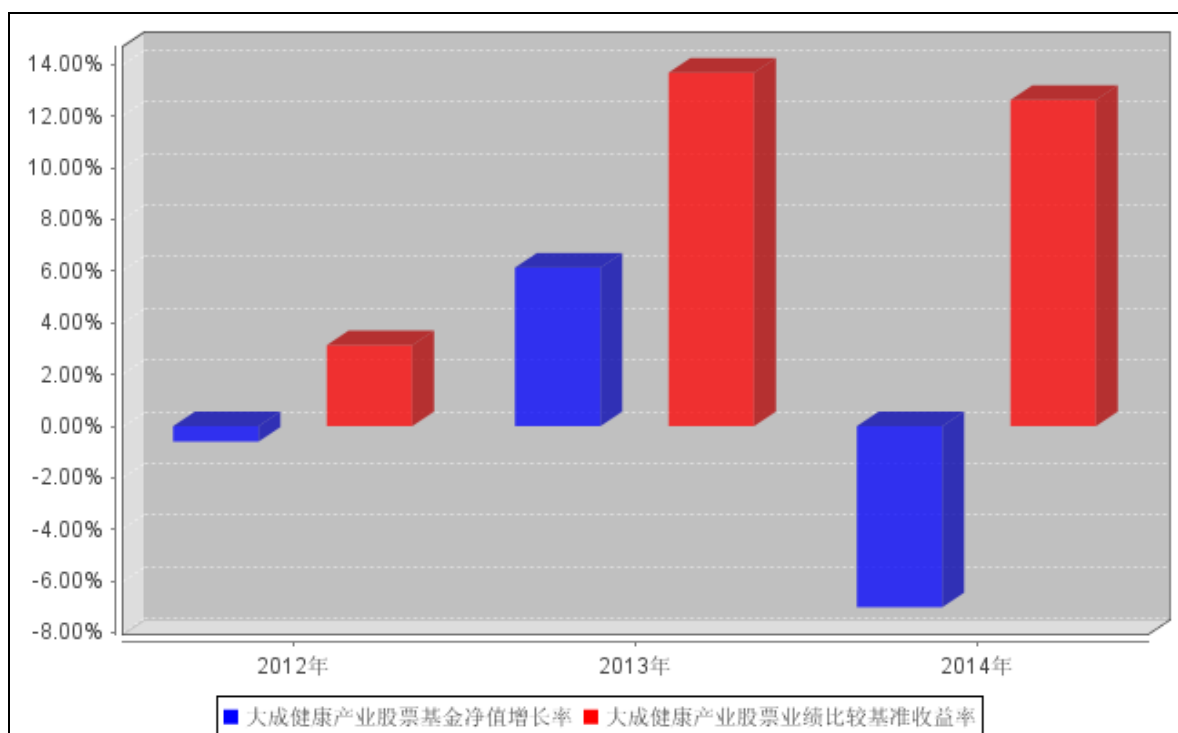
注：1、根据中国证监会 2014 年 1 月 24 日下发的《关于大成中证 500 沪市交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金份额持有人大会决议备案的回函》（基金部函[2014]51 号），大成中证 500 沪市交易型开放式指数证券投资基金联接基金转型为大成健康产业股票型证券投资基金，修改基金合同中的基金名称、基金类别、基金的投资目标、投资范围、投资理念和投资策略、业绩比较基准、风险收益特征、基金投资组合比例限制、基金的费用等条款。修订后的《大成健康产业股票型证券投资基金基金合同》自 2014 年 1 月 24 日起正式生效，截至报告期末本基金合同生效未满一年。

2、按照《大成健康产业股票型证券投资基金基金合同》规定，基金管理人应当自 2014 年 1 月 24 日（基金合同生效日）起六个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的约定。截至报告期

末，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、根据《大成健康产业股票型证券投资基金基金合同》，业绩比较基准自 2014 年 1 月 24 日起，由“中证 500 沪市指数×95%+银行活期存款利率（税后）×5%”变更为“申万医药生物行业指数×80%+中证综合债券指数×20%”；基金业绩比较基准收益率在变更前后期间分别根据相应的指标计算。

### 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：2012 年净值增长率表现期间为 2012 年 8 月 28 日(基金合同生效日)至 2012 年 12 月 31 日。

### 3.3 过去三年基金的利润分配情况

本基金自 2012 年 8 月 28 日(基金合同生效日)以来未有利润分配事项。

## § 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 2014 年 12 月 31 日，本基金管理人共管理 4 只 ETF 及 1 只 ETF 联接基金：大成中证 100 交易型开放式指数证券投

资基金、深证成长 40 交易型开放式指数证券投资基金及大成深证成长 40 交易型开放式指数证券投资基金联接基金、中证 500 深市交易型开放式指数证券投资基金、中证 500 沪市交易型开放式指数证券投资基金，2 只 QDII 基金：大成标普 500 等权重指数证券投资基金、大成纳斯达克 100 指数证券投资基金及 40 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、大成景恒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、大成可转债增强债券型证券投资基金、大成消费主题股票型证券投资基金、大成新锐产业股票型证券投资基金、大成优选股票型证券投资基金（LOF）、大成月添利理财债券型证券投资基金、大成现金增利货币市场证券投资基金、大成月月盈短期理财债券型证券投资基金、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、大成信用增利一年定期开放债券型证券投资基金、大成健康产业股票型证券投资基金、大成中小盘股票型证券投资基金（LOF）、大成灵活配置混合型证券投资基金、大成丰财宝货币市场基金、大成景益平稳收益混合型证券投资基金、大成添利宝货币市场基金、大成景利混合型证券投资基金和大成产业升级股票型证券投资基金（LOF）。

#### 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		
杨挺先生	本基金基金经理	2014 年 6 月 26 日	-	6 年	工学硕士。曾任广发证券股份有限公司发展研究中心研究员；2012 年 8 月起任职于大成基金管理有限公司研究部，历任研究部研究员。2014 年 3 月 18 日起任大成健康产业股票型证券投资基金基金经理助理。2014 年 6 月 26 日起任大成健康产业股票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合规守信情况的说明

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》、《大成健康产业股票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，本基金的投资范围、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，基金管理人制订了《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》。基金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。

基金管理人运用统计分析方法和工具，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进行分析。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，但结合交易价差专项统计分析，未发现违反公平交易原则的异常情况。

### 4.3.3 异常交易行为的专项说明

报告期内，基金管理人旗下所有投资组合未发现存在异常交易行为。主动投资组合间股票交易存在 23 笔同日反向交易，原因为投资策略需要。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 5 笔，原因为投资策略需要；主动投资组合间债券交易存在 2



笔同日反向交易，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。

#### 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

14 年中国经济面临较大下行压力，工业增长的动能不足，投资疲弱。回顾全年的经济局势，经济数据在基建投资扩张的拉动下 5-6 月曾出现短暂的回暖，但整体 14 年呈滑落态势。工业增加值、PMI 等硬数据依旧面临较大的下行压力，而制造业投资、基建投资、地产投资三大支柱性投资在 14 年下半年集体下滑，拖累固定资产投资疲弱。在政策面上，随着宏观数据的回落，为政策放松打开了空间——14 年基建投资加速，地产限购逐步放开，此外央行通过降息、定向降准、再贷款、SLO、SLF、MLF 等多种手段促进资金利率的下降，需求端刺激政策密集推出。

从股市表现来看，上半年的上证综指可谓波澜不惊，除了 2 月两会召开前的“春季躁动”与 4 月“沪港通”带来的主题行情之外，在 2000 点上下 100 点的空间内窄幅波动，亮点乏陈。而下半年的市场活跃度明显上升，7 月下旬市场在万亿 PSL 带来的流动性宽松预期、“沪港通”开启在即以及海外资金的流入带来的 A 股“估值接轨”预期等因素的共同作用下，迎来一波脉冲式上涨行情。而经历短暂的调整休息后，11 月末大盘在降息消息的提振下，再度强势上攻，最终站上 3200 点的五年新高，为 14 年强势收官。整个 14 年上证综指上涨 52.87%，仅次于阿根廷股指，是全球排名第二的指数。行业表现上，14 年涨幅最高的行业是多元金融（160%）、保险（84%）、地产（74%）、公用事业（72%）和银行（72%），而涨幅最小的行业是医疗保健和日常消费和能源。

本基金在四季度基本保持了较高仓位运行，继续延续了三季度较为激进的配置思路，并开始逐步布局快年度行情。但是在 11 月中下旬开始对医药行业和创业板的下跌风险估计不足，在配置上没有回避开部分估值较高的创业板公司，导致净值在最后一个个月发生了较大回撤，是本季度较为明显的失误。不过组合已经在年底完成了调整，目前组合基本兼顾了估值的安全性和标的的成长性。

##### 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 0.981 元，本报告期基金份额净值增长率为-7.01%，同期业绩比较基准收益率为 12.63%，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

预计 2015 年经济运行仍处于下行趋势中——人口要素意味着潜在经济增速已经显著下行，而政府转型意味着总需求存在萎缩的趋势，因此经济转型意味着增速的下行。展望 2015 年，经济运

行仍将维持减速趋势，预计 GDP 同比增速将回落 0.3 个百分点至 7.1%左右，CPI 单月同比增速在 1-2%的区间中运行，未来仍存在一定的降息空间。

15 年 1-2 月步入经济数据真空期，政策进一步宽松的趋势没有结束。目前来看，四季度以来的宏观数据虽然低于预期，但是仍然处于窄幅波动的区间之内，且随着近期地产销售的企稳回升，短期仍看不到宏观经济大幅恶化的可能；而从政策面来看，在较低的房价水平和通胀水平下，货币政策仍有进一步宽松的空间，且目前来自地产和“一带一路”的希望又不至于让投资者担心政策放松是无效的。

展望 15 年的股市表现，我们预计在上半年有三大条件可以继续支撑股市上涨：1、平稳的宏观经济环境（可以容忍短期小幅回落但不能发生系统性风险）；2、宽松的政策环境和流动性环境；3、经济转型和各项改革的顺利推进。对于 15 年下半年的判断目前还比较模糊，以上三点条件可能会发生变化。

医药板块依然是我们长期看好的板块，但是板块也在经历转型，行业内部分化将会加剧，配置上注意估值风险和标的的流通性，并注意医药电商和医药信息化的投资机会。

#### 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。截止报告期末本基金管理人已与中央国债登记结算有限责任公司签署服务协议，由其按约定提供在银行间同业市场交易的债券品种的估值数据。

#### 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。本报告期末本基金无可供分配收益。

#### 4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

本基金在本报告期内，曾于 2014 年 10 月 17 日至 2014 年 12 月 31 日出现了连续 20 个工作日资产净值低于五千万元的情形。

### § 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”）在对大成健康产业股票型证券投资基金（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遵规守信、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、基金份额申购赎回价格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、财务会计报告（注：财务会计报告中的“金融工具风险及管理”部分未在托管人复核范围内）、投资组合报告等数据真实、准确和完整。

### § 6 审计报告

本基金 2014 年年度财务会计报告已经安永华明会计师事务所(特殊普通合伙)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：大成健康产业股票型证券投资基金

报告截止日：2014 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资 产	本期末 2014 年 12 月 31 日	上年度末 2013 年 12 月 31 日
<b>资 产：</b>		
银行存款	5,861,249.64	14,075,300.25
结算备付金	135,748.05	-
存出保证金	31,174.87	11,514.96
交易性金融资产	29,417,825.78	49,913,189.15
其中：股票投资	29,417,825.78	3,077.14
基金投资	-	49,910,112.01
债券投资	-	-
资产支持证券投资	-	-
贵金属投资	-	-
衍生金融资产	-	-
买入返售金融资产	-	-
应收证券清算款	1,014,621.71	88,234.00
应收利息	1,067.89	4,482.07
应收股利	-	-
应收申购款	75,684.44	105,541.38
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	1,488.88
资产总计	36,537,372.38	64,199,750.69
<b>负债和所有者权益</b>	<b>本期末 2014 年 12 月 31 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	-	-
卖出回购金融资产款	-	-
应付证券清算款	536,415.09	9,536,219.35
应付赎回款	96,507.69	137,085.68
应付管理人报酬	49,185.43	3,791.22

应付托管费	8,197.55	758.24
应付销售服务费	-	-
应付交易费用	143,659.44	42,085.76
应交税费	-	-
应付利息	-	-
应付利润	-	-
递延所得税负债	-	-
其他负债	330,327.45	130,477.23
负债合计	1,164,292.65	9,850,417.48
<b>所有者权益：</b>		
实收基金	36,061,686.85	51,540,055.08
未分配利润	-688,607.12	2,809,278.13
所有者权益合计	35,373,079.73	54,349,333.21
负债和所有者权益总计	36,537,372.38	64,199,750.69

注：1、根据中国证监会 2014 年 1 月 24 日下发的《关于大成中证 500 沪市交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金份额持有人大会决议备案的回函》（基金部函[2014]51 号），大成中证 500 沪市交易型开放式指数证券投资基金联接基金转型为大成健康产业股票型证券投资基金，修改基金合同中的基金名称、基金类别、基金的投资目标、投资范围、投资理念和投资策略、业绩比较基准、风险收益特征、基金投资组合比例限制、基金的费用等条款。修订后的《大成健康产业股票型证券投资基金基金合同》自 2014 年 1 月 24 日起正式生效，截至报告期末本基金合同生效未满一年。

2、报告截止日 2014 年 12 月 31 日，基金份额净值为人民币 0.981 元，基金份额总额 36,061,686.85 份。

## 7.2 利润表

会计主体：大成健康产业股票型证券投资基金

本报告期：2014 年 1 月 1 日至 2014 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2014 年 1 月 1 日至 2014 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2013 年 1 月 1 日至 2013 年 12 月 31 日
<b>一、收入</b>	-826,699.75	5,410,090.04
1. 利息收入	64,082.05	103,341.58
其中：存款利息收入	64,082.05	103,341.58
债券利息收入	-	-
资产支持证券利息收入	-	-
买入返售金融资产收入	-	-
其他利息收入	-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）	293,498.66	3,688,911.88
其中：股票投资收益	-1,862,361.56	-581,610.54

基金投资收益	1,857,349.56	4,269,950.69
债券投资收益	-	-
资产支持证券投资收益	-	-
贵金属投资收益	-	-
衍生工具收益	-	-
股利收益	298,510.66	571.73
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	-1,328,077.25	1,256,357.02
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）	-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	143,796.79	361,479.56
<b>减：二、费用</b>	<b>2,697,564.42</b>	<b>540,105.40</b>
1. 管理人报酬	782,076.80	54,462.61
2. 托管费	130,384.11	10,892.61
3. 销售服务费	-	-
4. 交易费用	1,395,076.57	319,266.62
5. 利息支出	-	-
其中：卖出回购金融资产支出	-	-
6. 其他费用	390,026.94	155,483.56
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>	<b>-3,524,264.17</b>	<b>4,869,984.64</b>
减：所得税费用	-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>	<b>-3,524,264.17</b>	<b>4,869,984.64</b>

### 7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：大成健康产业股票型证券投资基金

本报告期：2014 年 1 月 1 日至 2014 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2014 年 1 月 1 日至 2014 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）	51,540,055.08	2,809,278.13	54,349,333.21
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-3,524,264.17	-3,524,264.17
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）	-15,478,368.23	26,378.92	-15,451,989.31
其中：1. 基金申购款	96,689,473.12	6,099,549.62	102,789,022.74
2. 基金赎回款	-112,167,841.35	-6,073,170.70	-118,241,012.05
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）	36,061,686.85	-688,607.12	35,373,079.73
项目	上年度可比期间 2013年1月1日至2013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）	56,942,995.26	-332,996.64	56,609,998.62
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	4,869,984.64	4,869,984.64
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）	-5,402,940.18	-1,727,709.87	-7,130,650.05
其中：1. 基金申购款	278,705,774.71	5,144,644.34	283,850,419.05
2. 基金赎回款	-284,108,714.89	-6,872,354.21	-290,981,069.10
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）	51,540,055.08	2,809,278.13	54,349,333.21

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：

罗登攀

肖剑

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

## 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、税项与最近一期年度报告相一致的说明

财政部于 2014 年颁布《企业会计准则第 39 号——公允价值计量》、《企业会计准则第 40 号——合营安排》、《企业会计准则第 41 号——在其他主体中权益的披露》和修订后的《企业会计准则第 2 号——长期股权投资》、《企业会计准则第 9 号——职工薪酬》、《企业会计准则第 30 号——财务报表列报》、《企业会计准则第 33 号——合并财务报表》以及《企业会计准则第

37 号——金融工具列报》，要求除《企业会计准则第 37 号——金融工具列报》自 2014 年度财务报表起施行外，其他准则自 2014 年 7 月 1 日起施行。上述准则对本基金本报告期无重大影响。

除上述会计政策变更事项，本报告期所采用的其他会计政策、会计估计、税项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
中国银行股份有限公司（“中国银行”）	基金托管人、基金销售机构
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、基金销售机构
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”）	基金管理人的合营企业

注：1、根据中国证监会 2014 年 1 月 24 日下发的《关于大成中证 500 沪市交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金份额持有人大会决议备案的回函》（基金部函[2014]51 号），大成中证 500 沪市交易型开放式指数证券投资基金联接基金转型为大成健康产业股票型证券投资基金，转型后与中证 500 沪市交易型开放式指数证券投资基金不再存在关联方关系。

2、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。

3、以下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

###### 7.4.3.1.1 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 12 月 31 日		上年度可比期间 2013 年 1 月 1 日至 2013 年 12 月 31 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	44,752,389.42	4.87%	-	0.00%

###### 7.4.3.1.2 权证交易

本基金本期及上年度可比期间均未发生通过关联方交易单元进行的权证交易。

###### 7.4.3.1.3 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12月31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	39,660.31	4.83%	-	0.00%
关联方名称	上年度可比期间 2013年1月1日至2013年12月31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
-	-	0.00	-	0.00

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。

(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。

#### 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 2014年1月1日至2014年12 月31日	上年度可比期间 2013年1月1日至2013年12月31 日
	当期发生的基金应支付的管理费	782,076.80
其中：支付销售机构的客户维护费	294,772.69	52,229.16

注：基金管理费每日计提，按月支付。本基金的管理费按前一日基金资产净值的 1.50%年费率计提。管理费的计算方法如下：

$$H = E \times 1.50\% / \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

##### 7.4.3.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2014年1月1日至2014年12 月31日	上年度可比期间 2013年1月1日至2013年12月31 日
	当期发生的基金应支付的托管费	130,384.11

注：基金托管费每日计提，按月支付。本基金的托管费按前一日基金资产净值的 0.25%年费率计

提。托管费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.25\% / \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

#### 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

本基金本报告期末与关联方进行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

##### 7.4.3.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

份额单位：份

项目	本期 2014年1月1日 至2014年12月31日	上年度可比期间 2013年1月1日 至2013年12月31日
基金合同生效日（2012年8月28日）持有的基金份额	-	-
期初持有的基金份额	5,024,120.60	-
期间申购/买入总份额	-	5,024,120.60
期间因拆分变动份额	-	-
减：期间赎回/卖出总份额	-	-
期末持有的基金份额	5,024,120.60	5,024,120.60
期末持有的基金份额 占基金总份额比例	13.93%	9.75%

注：基金管理人申购本基金的费率与本基金法律文件规定一致。

##### 7.4.3.4.2 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

本基金除基金管理人之外的其他关联方于本报告期末及上年度末均未持有本基金份额。

#### 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 2014年1月1日至2014年12月31日		上年度可比期间 2013年1月1日至2013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
中国银行	5,861,249.64	57,378.79	14,075,300.25	67,354.06

注：本基金的银行存款由基金托管人中国银行保管，并按银行间同业利率计息。

#### 7.4.3.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金于本报告期及上年度可比期间均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

本基金本报告期无其他关联交易事项。

#### 7.4.4 期末（2014 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

本基金本期末未持有因认购新发/增发证券而于年末流通受限证券。

##### 7.4.4.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末 估值单价	复牌日期	复牌 开盘单价	数量（股）	期末 成本总额	期末估值总 额	备 注
002437	誉衡药业	2014-11-21	重大事项	23.75	2015-01-26	26.13	37,000	827,109.35	878,750.00	-
300168	万达信息	2014-12-31	重大事项	46.20	2015-01-08	44.50	11,934	584,743.00	551,350.80	-

##### 7.4.4.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

###### 7.4.4.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末，本基金未持有从事银行间市场债券正回购交易中作为抵押的债券。

###### 7.4.4.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末，本基金未持有从事交易所市场债券正回购交易中作为抵押的债券。

## §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	29,417,825.78	80.51
	其中：股票	29,417,825.78	80.51
2	固定收益投资	-	0.00
	其中：债券	-	0.00
	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	-	0.00
	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	5,996,997.69	16.41
7	其他各项资产	1,122,548.91	3.07
8	合计	36,537,372.38	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	采矿业	-	0.00
C	制造业	20,117,340.23	56.87
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	0.00
E	建筑业	-	0.00
F	批发和零售业	4,479,490.00	12.66
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	2,502,250.80	7.07
J	金融业	1,130,810.00	3.20
K	房地产业	354,200.00	1.00
L	租赁和商务服务业	-	0.00
M	科学研究和技术服务业	5,995.00	0.02
N	水利、环境和公共设施管理业	-	0.00
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	827,739.75	2.34
R	文化、体育和娱乐业	-	0.00
S	综合	-	0.00
	合计	29,417,825.78	83.16

## 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	300255	常山药业	45,000	1,590,750.00	4.50
2	000623	吉林敖东	40,000	1,392,400.00	3.94
3	300273	和佳股份	60,037	1,389,856.55	3.93
4	002462	嘉事堂	50,000	1,335,000.00	3.77
5	000423	东阿阿胶	35,000	1,304,800.00	3.69

6	000661	长春高新	15,000	1,300,500.00	3.68
7	600511	国药股份	41,000	1,270,590.00	3.59
8	600196	复星医药	60,000	1,266,000.00	3.58
9	600998	九州通	70,000	1,264,900.00	3.58
10	000503	海虹控股	40,000	1,251,200.00	3.54

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	300273	和佳股份	10,025,226.96	18.45
2	002022	科华生物	9,287,821.92	17.09
3	002390	信邦制药	8,208,295.12	15.10
4	600518	康美药业	7,830,765.63	14.41
5	600252	中恒集团	7,677,279.06	14.13
6	600276	恒瑞医药	7,485,670.73	13.77
7	000538	云南白药	6,768,350.79	12.45
8	600699	均胜电子	6,532,969.64	12.02
9	002437	誉衡药业	6,272,012.08	11.54
10	002626	金达威	6,227,743.83	11.46
11	600079	人福医药	6,194,433.86	11.40
12	300015	爱尔眼科	5,855,406.50	10.77
13	300146	汤臣倍健	5,616,324.69	10.33
14	600511	国药股份	5,512,935.99	10.14
15	300255	常山药业	5,284,907.73	9.72
16	002219	恒康医疗	5,190,035.63	9.55
17	300323	华灿光电	5,181,196.02	9.53
18	600998	九州通	5,178,155.16	9.53
19	002550	千红制药	5,138,463.63	9.45
20	000705	浙江震元	5,136,509.25	9.45
21	300168	万达信息	5,044,231.60	9.28
22	600330	天通股份	4,816,184.74	8.86
23	002030	达安基因	4,733,599.38	8.71

24	002475	立讯精密	4,714,298.14	8.67
25	002433	太安堂	4,550,612.92	8.37
26	002008	大族激光	4,421,252.70	8.13
27	300011	鼎汉技术	4,342,315.33	7.99
28	600261	阳光照明	4,292,331.71	7.90
29	300233	金城医药	4,285,224.70	7.88
30	600332	白云山	4,200,172.43	7.73
31	000623	吉林敖东	4,160,127.18	7.65
32	300253	卫宁软件	4,156,954.39	7.65
33	002555	顺荣股份	3,955,725.72	7.28
34	300147	香雪制药	3,901,352.92	7.18
35	600521	华海药业	3,821,326.87	7.03
36	000739	普洛药业	3,778,016.10	6.95
37	002454	松芝股份	3,741,580.14	6.88
38	600196	复星医药	3,709,190.35	6.82
39	600645	中源协和	3,698,957.03	6.81
40	600587	新华医疗	3,630,708.72	6.68
41	002595	豪迈科技	3,627,290.51	6.67
42	002407	多氟多	3,589,064.76	6.60
43	600479	千金药业	3,543,329.60	6.52
44	600759	洲际油气	3,519,529.01	6.48
45	002019	亿帆鑫富	3,506,890.40	6.45
46	300246	宝莱特	3,298,249.57	6.07
47	601633	长城汽车	3,273,474.98	6.02
48	002131	利欧股份	3,257,897.77	5.99
49	600351	亚宝药业	3,237,801.99	5.96
50	002678	珠江钢琴	3,221,319.85	5.93
51	000963	华东医药	3,196,874.73	5.88
52	002547	春兴精工	3,102,420.12	5.71
53	600572	康恩贝	2,988,456.70	5.50
54	002577	雷柏科技	2,974,417.34	5.47
55	300206	理邦仪器	2,951,489.48	5.43
56	300026	红日药业	2,948,336.44	5.42
57	000503	海虹控股	2,946,780.27	5.42
58	600720	祁连山	2,908,860.50	5.35
59	600217	秦岭水泥	2,884,570.48	5.31

60	300298	三诺生物	2,877,911.52	5.30
61	002382	蓝帆医疗	2,867,882.50	5.28
62	300150	世纪瑞尔	2,815,105.50	5.18
63	000597	东北制药	2,681,575.40	4.93
64	002653	海思科	2,572,234.27	4.73
65	002332	仙琚制药	2,557,811.78	4.71
66	002223	鱼跃医疗	2,510,993.94	4.62
67	000895	双汇发展	2,509,525.95	4.62
68	002551	尚荣医疗	2,440,255.92	4.49
69	600329	中新药业	2,428,156.38	4.47
70	600055	华润万东	2,413,787.07	4.44
71	300098	高新兴	2,391,569.00	4.40
72	002007	华兰生物	2,304,281.83	4.24
73	002709	天赐材料	2,298,739.40	4.23
74	601222	林洋电子	2,282,304.09	4.20
75	000028	国药一致	2,278,509.44	4.19
76	000661	长春高新	2,271,805.00	4.18
77	002584	西陇化工	2,245,028.09	4.13
78	600594	益佰制药	2,216,185.42	4.08
79	002271	东方雨虹	2,174,620.21	4.00
80	300009	安科生物	2,106,994.93	3.88
81	002594	比亚迪	2,080,098.56	3.83
82	002020	京新药业	2,063,289.59	3.80
83	600535	天士力	2,012,583.83	3.70
84	600584	长电科技	2,008,129.98	3.69
85	600422	昆明制药	1,992,470.98	3.67
86	002341	新纶科技	1,983,042.60	3.65
87	000997	新大陆	1,980,740.40	3.64
88	000919	金陵药业	1,925,598.50	3.54
89	600557	康缘药业	1,924,374.91	3.54
90	300194	福安药业	1,903,396.06	3.50
91	600085	同仁堂	1,872,355.00	3.45
92	000788	北大医药	1,869,181.64	3.44
93	000566	海南海药	1,843,315.00	3.39
94	600884	杉杉股份	1,840,355.00	3.39
95	300199	翰宇药业	1,823,445.10	3.36

96	002249	大洋电机	1,802,774.20	3.32
97	000681	视觉中国	1,802,007.21	3.32
98	002711	欧浦钢网	1,799,486.00	3.31
99	000915	山大华特	1,797,442.00	3.31
100	601607	上海医药	1,791,479.44	3.30
101	600562	国睿科技	1,751,630.00	3.22
102	300059	东方财富	1,745,382.81	3.21
103	300016	北陆药业	1,743,376.00	3.21
104	600081	东风科技	1,722,437.58	3.17
105	002279	久其软件	1,690,810.08	3.11
106	600158	中体产业	1,650,930.43	3.04
107	600519	贵州茅台	1,649,878.38	3.04
108	600867	通化东宝	1,636,472.40	3.01
109	600420	现代制药	1,579,664.00	2.91
110	600109	国金证券	1,570,447.51	2.89
111	002004	华邦颖泰	1,550,129.00	2.85
112	000988	华工科技	1,546,055.50	2.84
113	300314	戴维医疗	1,544,564.16	2.84
114	300326	凯利泰	1,538,136.20	2.83
115	601998	中信银行	1,535,700.00	2.83
116	300178	腾邦国际	1,535,285.12	2.82
117	300003	乐普医疗	1,534,468.21	2.82
118	600129	太极集团	1,532,229.00	2.82
119	600222	太龙药业	1,505,204.00	2.77
120	000401	冀东水泥	1,504,470.00	2.77
121	002603	以岭药业	1,450,847.04	2.67
122	300049	福瑞股份	1,394,188.00	2.57
123	300358	楚天科技	1,389,445.00	2.56
124	000513	丽珠集团	1,388,831.11	2.56
125	002727	一心堂	1,386,779.50	2.55
126	300096	易联众	1,381,865.30	2.54
127	000516	开元投资	1,371,211.00	2.52
128	300289	利德曼	1,352,799.58	2.49
129	002001	新和成	1,350,834.50	2.49
130	002398	建研集团	1,333,481.56	2.45
131	600718	东软集团	1,323,900.00	2.44



132	600893	航空动力	1,300,000.00	2.39
133	002510	天汽模	1,292,478.50	2.38
134	000423	东阿阿胶	1,288,750.00	2.37
135	002286	保龄宝	1,277,606.92	2.35
136	300347	泰格医药	1,254,771.86	2.31
137	000411	英特集团	1,231,484.98	2.27
138	002317	众生药业	1,230,459.00	2.26
139	600436	片仔癀	1,223,197.14	2.25
140	002321	华英农业	1,214,057.00	2.23
141	002410	广联达	1,207,200.00	2.22
142	002462	嘉事堂	1,186,600.00	2.18
143	600372	中航电子	1,148,050.00	2.11
144	600885	宏发股份	1,104,624.25	2.03
145	300068	南都电源	1,094,440.00	2.01

注：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	002022	科华生物	9,534,779.71	17.54
2	300273	和佳股份	8,255,982.36	15.19
3	002390	信邦制药	7,685,407.76	14.14
4	000538	云南白药	6,963,678.68	12.81
5	600276	恒瑞医药	6,746,884.32	12.41
6	600518	康美药业	6,727,658.90	12.38
7	002626	金达威	6,505,240.59	11.97
8	002030	达安基因	6,411,469.10	11.80
9	600252	中恒集团	6,361,602.20	11.71
10	300168	万达信息	6,082,705.82	11.19
11	600079	人福医药	6,052,623.94	11.14
12	600699	均胜电子	5,943,380.32	10.94
13	002437	誉衡药业	5,906,895.11	10.87
14	002550	千红制药	5,304,536.01	9.76
15	002219	恒康医疗	5,285,219.83	9.72
16	300011	鼎汉技术	5,037,780.87	9.27
17	002475	立讯精密	4,887,037.38	8.99

18	600330	天通股份	4,732,375.88	8.71
19	300015	爱尔眼科	4,720,802.02	8.69
20	300323	华灿光电	4,705,379.79	8.66
21	300146	汤臣倍健	4,595,402.14	8.46
22	000705	浙江震元	4,513,651.57	8.30
23	002008	大族激光	4,423,901.18	8.14
24	300233	金城医药	4,394,433.39	8.09
25	600511	国药股份	4,345,039.51	7.99
26	600332	白云山	4,328,100.82	7.96
27	000739	普洛药业	4,293,608.40	7.90
28	002407	多氟多	4,185,174.73	7.70
29	600261	阳光照明	3,955,335.37	7.28
30	600998	九州通	3,758,266.37	6.92
31	002454	松芝股份	3,749,742.81	6.90
32	002595	豪迈科技	3,684,639.13	6.78
33	002019	亿帆鑫富	3,674,080.44	6.76
34	300255	常山药业	3,632,138.12	6.68
35	600645	中源协和	3,626,868.23	6.67
36	000963	华东医药	3,595,617.14	6.62
37	600759	洲际油气	3,564,519.72	6.56
38	300246	宝莱特	3,544,694.69	6.52
39	002433	太安堂	3,532,956.33	6.50
40	600587	新华医疗	3,521,822.77	6.48
41	600479	千金药业	3,496,102.87	6.43
42	600351	亚宝药业	3,444,060.32	6.34
43	002555	顺荣股份	3,394,897.74	6.25
44	002547	春兴精工	3,357,444.02	6.18
45	002131	利欧股份	3,210,667.85	5.91
46	600572	康恩贝	3,143,336.00	5.78
47	601633	长城汽车	3,135,742.82	5.77
48	002678	珠江钢琴	3,027,426.07	5.57
49	300253	卫宁软件	3,017,858.48	5.55
50	600217	秦岭水泥	2,912,751.72	5.36
51	002577	雷柏科技	2,888,289.93	5.31
52	002332	仙琚制药	2,881,341.67	5.30
53	300147	香雪制药	2,877,490.99	5.29
54	300150	世纪瑞尔	2,877,018.39	5.29
55	600720	祁连山	2,875,135.77	5.29

56	000623	吉林敖东	2,786,217.45	5.13
57	600521	华海药业	2,781,726.28	5.12
58	300026	红日药业	2,724,652.77	5.01
59	300098	高新兴	2,694,630.29	4.96
60	002653	海思科	2,649,536.76	4.88
61	002382	蓝帆医疗	2,627,803.00	4.84
62	000597	东北制药	2,627,150.00	4.83
63	002223	鱼跃医疗	2,521,632.85	4.64
64	000895	双汇发展	2,497,544.40	4.60
65	600055	华润万东	2,404,929.88	4.42
66	600329	中新药业	2,385,655.57	4.39
67	300206	理邦仪器	2,360,315.00	4.34
68	002551	尚荣医疗	2,341,424.68	4.31
69	601222	林洋电子	2,286,438.30	4.21
70	002271	东方雨虹	2,250,484.36	4.14
71	002709	天赐材料	2,223,740.80	4.09
72	300298	三诺生物	2,212,000.23	4.07
73	000788	北大医药	2,161,313.00	3.98
74	600196	复星医药	2,146,057.17	3.95
75	600594	益佰制药	2,125,334.77	3.91
76	000028	国药一致	2,099,403.99	3.86
77	000919	金陵药业	2,029,596.18	3.73
78	002020	京新药业	2,019,579.83	3.72
79	600422	昆明制药	2,015,225.00	3.71
80	300009	安科生物	2,000,630.00	3.68
81	000997	新大陆	1,955,340.11	3.60
82	600584	长电科技	1,944,345.54	3.58
83	002594	比亚迪	1,941,251.20	3.57
84	002279	久其软件	1,939,491.38	3.57
85	300199	翰宇药业	1,936,074.00	3.56
86	600557	康缘药业	1,910,853.54	3.52
87	002341	新纶科技	1,873,755.00	3.45
88	002249	大洋电机	1,871,418.50	3.44
89	600535	天士力	1,853,181.92	3.41
90	300194	福安药业	1,818,575.50	3.35
91	000566	海南海药	1,816,584.99	3.34
92	300016	北陆药业	1,794,404.08	3.30
93	600884	杉杉股份	1,775,970.96	3.27

94	002711	欧浦钢网	1,766,509.00	3.25
95	000503	海虹控股	1,743,210.00	3.21
96	600519	贵州茅台	1,742,199.89	3.21
97	600081	东风科技	1,719,612.21	3.16
98	600562	国睿科技	1,699,827.50	3.13
99	601607	上海医药	1,680,609.35	3.09
100	600867	通化东宝	1,679,164.49	3.09
101	600129	太极集团	1,642,580.81	3.02
102	002584	西陇化工	1,623,078.80	2.99
103	002007	华兰生物	1,603,596.57	2.95
104	300059	东方财富	1,597,810.02	2.94
105	300003	乐普医疗	1,594,098.43	2.93
106	600109	国金证券	1,532,920.03	2.82
107	601998	中信银行	1,525,106.82	2.81
108	000401	冀东水泥	1,518,134.00	2.79
109	000681	视觉中国	1,507,465.28	2.77
110	600420	现代制药	1,499,003.00	2.76
111	002004	华邦颖泰	1,488,066.35	2.74
112	300178	腾邦国际	1,455,867.00	2.68
113	600222	太龙药业	1,446,189.35	2.66
114	000988	华工科技	1,443,080.90	2.66
115	300049	福瑞股份	1,356,077.53	2.50
116	002398	建研集团	1,355,104.50	2.49
117	300314	戴维医疗	1,353,992.97	2.49
118	300326	凯利泰	1,350,487.12	2.48
119	000513	丽珠集团	1,336,691.27	2.46
120	002727	一心堂	1,329,650.01	2.45
121	300289	利德曼	1,325,195.32	2.44
122	300358	楚天科技	1,320,503.60	2.43
123	002286	保龄宝	1,276,113.74	2.35
124	002001	新和成	1,268,400.00	2.33
125	002321	华英农业	1,262,164.70	2.32
126	002510	天汽模	1,261,093.32	2.32
127	600718	东软集团	1,252,457.01	2.30
128	600893	航空动力	1,246,646.24	2.29
129	002317	众生药业	1,245,198.80	2.29
130	600085	同仁堂	1,212,732.92	2.23
131	300096	易联众	1,202,993.18	2.21

132	000516	开元投资	1,195,160.00	2.20
133	000411	英特集团	1,188,197.00	2.19
134	002603	以岭药业	1,188,185.41	2.19
135	300347	泰格医药	1,182,600.00	2.18
136	600158	中体产业	1,176,596.00	2.16
137	600436	片仔癀	1,151,645.35	2.12
138	600372	中航电子	1,146,500.00	2.11
139	002410	广联达	1,134,072.20	2.09

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。

#### 8.4.3 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	450,188,029.51
卖出股票收入（成交）总额	468,177,502.92

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。

#### 8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

#### 8.6 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

本基金本报告期末未持有债券。

#### 8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名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。

#### 8.8 报告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

本基金本报告期末未持有贵金属投资。

#### 8.9 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。

#### 8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

##### 8.10.1 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。

##### 8.10.2 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。

**8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明****8.11.1 本期国债期货投资政策**

本基金本报告期末未投资国债期货。

**8.11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细**

本基金本报告期末未投资国债期货。

**8.11.3 本期国债期货投资评价**

本基金本报告期末未投资国债期货。

**8.12 投资组合报告附注**

8.12.1 本基金投资的前十名证券的发行主体未出现本期被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

8.12.2 本基金投资的前十名股票中，没有投资于超出基金合同规定的备选股票库之外的股票。

**8.12.3 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	31,174.87
2	应收证券清算款	1,014,621.71
3	应收股利	-
4	应收利息	1,067.89
5	应收申购款	75,684.44
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	1,122,548.91

**8.12.4 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换债券。

**8.12.5 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。

**8.12.6 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。

## § 9 基金份额持有人信息

### 9.1 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
980	36,797.64	10,564,759.84	29.30%	25,496,927.01	70.70%

注：持有人户数为有效户数，即存量份额大于零的账户。

### 9.2 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	28,082.71	0.0779%

### 9.3 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

## § 10 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2012年8月28日）基金份额总额	322,007,363.05
本报告期期初基金份额总额	51,540,055.08
本报告期基金总申购份额	96,689,473.12
减：本报告期基金总赎回份额	112,167,841.35
本报告期基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-
本报告期期末基金份额总额	36,061,686.85

## § 11 重大事件揭示

### 11.1 基金份额持有人大会决议

本基金份额持有人大会以通讯方式召开，大会表决投票时间为2013年12月26日至2014年1月13日17:00，会议审议通过了《关于大成中证500沪市交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金转型相关事项的议案》，中国证券监督管理委员会基金监管部于2014年1月24日下发

了《关于大成中证 500 沪市交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金份额持有人大会决议备案的回函》(基金部函[2014]51 号),大成中证 500 沪市交易型开放式指数证券投资基金联接基金持有人大会决议报中国证监会备案手续完成,持有人大会决议于 2014 年 1 月 24 日生效。

### 11.2 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

#### 一、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。

#### 二、基金管理人在本报告期内重大人事变动情况

1、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。

2、基金管理人于 2014 年 11 月 28 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三十九次会议审议通过,由罗登攀先生任公司总经理。

3、基金管理人于 2014 年 12 月 20 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三十九次会议审议通过,由刘卓先生任公司董事长及法定代表人,张树忠先生不再担任公司董事长。

### 11.3 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。

### 11.4 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。

### 11.5 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安永华明会计师事务所(特殊普通合伙),本报告期应支付的审计费用为 3 万元整。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。



## 11.6 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。

## 11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

## 11.7.1 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	
招商证券	2	226,447,090.71	24.66%	202,116.35	24.62%	-
中投证券	3	147,568,523.01	16.07%	134,348.16	16.37%	-
中银国际	1	73,824,200.77	8.04%	65,329.03	7.96%	-
华宝证券	1	72,411,558.81	7.89%	64,077.45	7.81%	-
东吴证券	1	65,518,942.43	7.14%	57,978.72	7.06%	-
光大证券	2	44,752,389.42	4.87%	39,660.31	4.83%	-
湘财证券	1	39,556,028.52	4.31%	36,012.38	4.39%	-
申银万国	1	36,154,201.43	3.94%	31,992.21	3.90%	-
中金公司	2	35,862,686.12	3.91%	31,735.21	3.87%	-
财富证券	1	31,935,695.41	3.48%	28,260.61	3.44%	-
国海证券	1	27,180,231.91	2.96%	24,052.18	2.93%	-
民生证券	1	23,480,968.21	2.56%	20,778.79	2.53%	-
海通证券	2	18,278,230.07	1.99%	16,640.33	2.03%	-
江海证券	1	14,162,482.42	1.54%	12,893.49	1.57%	-
万和证券	1	12,138,206.97	1.32%	11,050.78	1.35%	-
银河证券	1	11,610,008.51	1.26%	10,569.91	1.29%	-
华林证券	1	10,343,359.89	1.13%	9,152.92	1.12%	-
东兴证券	1	10,063,338.14	1.10%	8,905.06	1.08%	-
渤海证券	2	6,651,567.53	0.72%	5,947.58	0.72%	-
华鑫证券	1	6,304,647.65	0.69%	5,739.75	0.70%	-
东方证券	1	3,993,656.00	0.43%	3,635.73	0.44%	-
中航证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
长城证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
天源证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
东海证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
国泰君安	1	-	0.00%	-	0.00%	-

国都证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
中信证券	2	-	0.00%	-	0.00%	-
华泰证券	2	-	0.00%	-	0.00%	-
国信证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
东莞证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
西南证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
安信证券	2	-	0.00%	-	0.00%	-
万联证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
齐鲁证券	2	-	0.00%	-	0.00%	-
英大证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
华福证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
民族证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
广州证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
长江证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
广发证券	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、报告期内租用交易单元变更情况，新增交易单元：招商证券、安信证券、渤海证券、东方证券、东海证券、东兴证券、光大证券、广发证券、广州证券、海通证券、华福证券、华鑫证券、江海证券、齐鲁证券、万和证券、西南证券、湘财证券、银河证券、长城证券、中金公司、中投证券、中信证券。退出交易单元：无。

11.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

无。

§ 12 影响投资者决策的其他重要信息

1、基金管理人于 2015 年 1 月 13 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六届董事会第一次会议审议通过，刘彩晖女士不再担任公司副总经理。

2、基金管理人于 2015 年 1 月 22 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六届董事会第一次会议审议通过，由肖剑先生、钟鸣远先生任公司副总经理。

3、本报告期内，本基金托管人中国银行的专门基金托管部门的名称由“托管及投资者服务部”更名为“托管业务部”。

大成基金管理有限公司  
2015 年 3 月 28 日