大成积极成长股票型证券投资基金

2014 第二季度 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:中国农业银行股份有限公司
报告送出日期:2014年7月18日

§1 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,并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带责任。

基金托管人中国农业银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2014年7月16日复核了本报告中的财务指标、净值表现和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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2014年4月1日起至6月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	大成积极成长股票
交易代码	519017
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2007年1月16日
报告期末基金份额总额	1,778,492,754.34份
投资目标	在优化组合投资基础上,主要投资于有良好成长潜力的上市公司,尽可能规避投资风险,谋求基金财产长期增值。
投资策略	本基金主要根据GDP增长率、工业增加值变化率、固定资产投资趋势、A股市场平均市盈率及其变化趋势、真实汇率、外贸顺差、消费者价格指数CPI增长率、M2、信贷增长率及增长结构等指标以及国家政策的变化,对宏观经济及证券市场的总体变动趋势进行定量、定性分析,作出资产配置决策。本基金还力争通过财务指标分析、成长型筛选、估值比较、实地调研等深入、科学的基本面分析,挖掘具有良好成长性的上市公司进行投资。
业绩比较基准	沪深300指数×80%+中证综合债券指数×20%
风险收益特征	本基金是股票型基金,风险高于货币市场基金、债券型基金和混合型基金。本基金主要投资于具有良好成长性的上市公司,属于中高风险的证券投资基金品种。
基金管理人	大成基金管理有限公司
基金托管人	中国农业银行股份有限公司

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位:人民币元

主要财务指标	报告期(2014年4月1日－2014年6月30日)
1.本期已实现收益	-7,957,304.10
2.本期利润	85,904,683.13
3.加权平均基金份额本期利润	0.0475
4.期末基金资产净值	1,496,280,801.39
5.期末基金份额净值	0.841

注:1.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。

2.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。

3.2 基金净值表现

3.2.1 本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

阶段	净值增长率①	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	5.92%	0.93%	1.29%	0.70%	4.63%	0.23%

3.2.2 自基金转型以来基金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.按基金合同规定,大成积极成长股票型证券投资基金自基金合同生效之日起3个月内为建仓期。截至建仓期结束时,本基金的各项投资比例已达到基金合同中规定的比例。

2.本基金业绩比较基准自2009年2月2日起变更为:沪深300指数×80%+中证综合债券指数×20%,本基金业绩比较基准收益率的历史走势图从2007年1月15日(基金合同生效暨基金转型日)至2009年2月1日为原业绩比较基准(新华富时600成长指数收益率×80%+新华雷曼中国全债指数收益率×20%)的走势图,2009年2月2日起为变更后的业绩比较基准的走势图。

§4 管理人报告

4.1 基金经理(或基金经理小组)简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
孙蓉琳女士	本基金基金经理	2012年12月18日	-	10年	经济学硕士。2004年7月至2007年7月就职于银华基金管理有限公司,历任宏观研究员、行业研究员。2007年7月加入大成基金管理有限公司,历任行业研究员、基金经理助理、研究部总监助理、研究部副总监。2012年7月28日至2014年1月29日任大成核心双动力股票型证券投资基金基金经理。2012年12月18日起任大成积极成长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》、《大成积极成长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,大成积极成长股票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 公平交易专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

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,公司制订了《大成基金管理有限公司公平交易制度》、《大成基金管理有限公司异常交易监控与报告制度》。公司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 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年二季度公司旗下主动投资组合间股票交易存在3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成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%的有1笔,原因为投资策略需要;投资组合间债券交易存在1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;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 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2014年2季度沪深300上涨0.88%,基本持平,创业板指数上涨5.79%,曾经跌至1210点后开始反弹,总体来看,大小盘分化依然存在,上半年市场波动较大,行业内的个股走势分化,行业属性在今年淡化的较为明显,主题性行情盛行,新能源汽车、互联网教育、军工、智慧城市、医疗服务等主题持续表现较为活跃。2季度基金在操作上逢低增持了汽车电子、互联网平台等板块,2季度净值增长5.92%,跑赢业绩基准。

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0.841元,本报告期基金份额净值增长率为5.92%,同期业绩比较基准收益率为1.29%,高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

展望未来的宏观经济形势,我们判断认长期的角度来看,中国原有的经济增长模式已经告一段落,这对未来的经济结构以及各个行业的发展将带来颠覆性的影响,经济潜在增速正在步入下降通道,但从短期的经济形势来看,今年2季度以来房地产政策开始放松,政策托底的意图明显,未来甚至不排除大幅释放流动性的可能。所有的这些政策对长期的经济结转型不利,但是可以稳定当前下滑的经济。从这个角度来看,市场在目前阶段暂时没有明显的系统性风险,个股和板块行情有望能够持续。展望下半年,我们认为从投资上依然可以淡化仓位选择,在市场的波动中择机增加受益于经济转型的优质行业与个股,为持有人创造更大的回报。

§5 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	1,225,903,043.02	80.76
	其中:股票	1,225,903,043.02	80.76
2	固定收益投资	70,011,000.00	4.61
	其中:债券	70,011,000.00	4.61
	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	59,000,279.00	3.89
	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	155,757,270.99	10.26
7	其他资产	7,313,538.74	0.48
8	合计	1,517,985,131.75	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

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	24,767,476.68	1.66
B	采矿业	-	0.00
C	制造业	831,431,311.82	55.57
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	0.00
E	建筑业	31,031,101.92	2.07
F	批发和零售业	34,719,952.30	2.32
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	170,100,956.94	11.37
J	金融业	-	0.00
K	房地产业	-	0.00
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	58,957,752.80	3.94
O	居民服务、修理和其他服务业	-	0.00
P	教育	27,125,074.30	1.81
Q	卫生和社会工作	47,769,416.26	3.19
R	文化、体育和娱乐业	-	0.00
S	综合	-	0.00
	合计	1,225,903,043.02	81.93

5.3 报告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

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	000333	美的集团	4,180,825	80,773,539.00	5.40
2	002450	康得新	3,212,639	73,087,537.25	4.88
3	600887	伊利股份	1,979,555	65,562,861.60	4.38
4	000826	桑德环境	2,580,208	58,957,752.80	3.94
5	000538	云南白药	998,524	52,122,952.80	3.48
6	600699	均胜电子	1,993,296	50,091,528.48	3.35
7	300015	爱尔眼科	1,962,589	47,769,416.26	3.19
8	600872	中炬高新	4,470,382	47,698,975.94	3.19
9	600050	中国联通	13,097,300	42,304,279.00	2.83
10	002555	顺荣股份	824,786	38,830,924.88	2.60

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	公允价值(元)	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	70,011,000.00	4.68
	其中:政策性金融债	70,011,000.00	4.68
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	70,011,000.00	4.68

5.5 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债券投资明细

序号	债券代码	债券名称	数量(张)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	130236	13国开36	400,000	40,008,000.00	2.67
2	110257	11国开57	300,000	30,003,000.00	2.01

5.6 报告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。

5.7 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。

5.8 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权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.9.1 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。

5.9.2 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。

5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.10.1 本期国债期货投资政策

本基金本报告期末投资国债期货。

5.10.2 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。

5.10.3 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末投资国债期货。

5.11 投资组合报告附注

5.11.1 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。

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

5.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	546,515.55
2	应收证券清算款	1,492,165.32
3	应收股利	-
4	应收利息	2,385,998.90
5	应收申购款	4,346.33
6	其他应收款	2,884,512.64
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	7,313,538.74

5.11.4 报告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。

5.11.5 报告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的情况。

5.11.6 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。

§6 开放式基金份额变动

单位:份

报告期期初基金份额总额	1,836,369,042.59
报告期期间基金总申购份额	2,526,716.82
减:报告期期间基金总赎回份额	60,403,005.07
报告期期间基金拆分变动份额(份额减少以"-"填列)	-
报告期期末基金份额总额	1,778,492,754.34

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

本报告期基金管理人未持有本基金份额。

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

本报告期基金管理人未运用固有资金投资本基金。

§8 影响投资者决策的其他重要信息

本基金本报告期无影响投资者决策的其他重要信息。

§9 备查文件目录

9.1 备查文件目录

1、中国证监会《关于核准景业证券投资基金基金份额持有人大会决议的批复》;

2、《大成积极成长股票型证券投资基金基金合同》;

3、《大成积极成长股票型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。

9.2 存放地点

本季度报告存放在本基金管理人和托管人的办公住所。

9.3 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。

大成基金管理有限公司
2014年7月18日

大成价值增长证券投资基金

2014 第二季度 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:中国农业银行股份有限公司
报告送出日期:2014年7月18日

§1 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,并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带责任。

基金托管人中国农业银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2014年7月16日复核了本报告中的财务指标、净值表现和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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2014年4月1日起至6月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	大成价值增长混合
交易代码	090001
前端交易代码	090001
后端交易代码	091001
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2002年11月11日
报告期末基金份额总额	9,445,412,727.42份
投资目标	以价值增长类股票为主构造投资组合,在有效分散投资风险的基础上,通过资产配置和投资组合的动态调整,达到超过市场的风险收益比之目标,实现基金资产的长期稳定增值。
投资策略	本基金在三个层次上均采取积极的投资策略:资产配置和行业配置遵循自上而下的积极策略,个股选择遵循自下而上的积极策略。本基金的股票投资重点关注低PB值、具有可持续增长潜力、盈利水平超过行业平均水平、具有核心竞争力的优势企业。
业绩比较基准	沪深300指数×80%+中信标普国债指数×20%
风险收益特征	无
基金管理人	大成基金管理有限公司
基金托管人	中国农业银行股份有限公司

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位:人民币元

主要财务指标	报告期(2014年4月1日－2014年6月30日)
1.本期已实现收益	110,333,962.53
2.本期利润	210,185,607.76
3.加权平均基金份额本期利润	0.0219
4.期末基金资产净值	6,399,796,072.85
5.期末基金份额净值	0.6776

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。

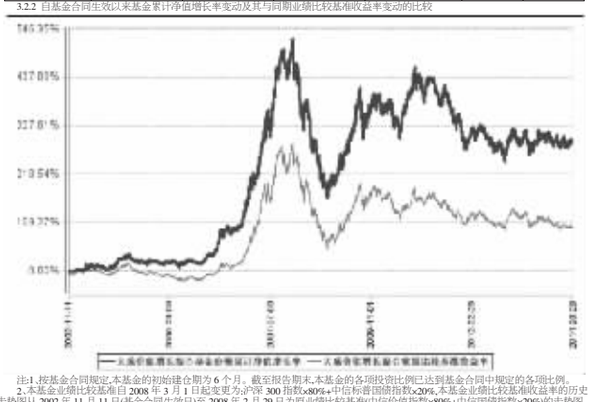
2.所述基金业绩指标不包括持有人交易基金的各项费用,计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

3.2 基金净值表现

3.2.1 本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

阶段	净值增长率①	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	3.34%	0.74%	0.98%	0.70%	2.36%	0.04%

3.2.2 自基金合同生效以来基金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.按基金合同规定,本基金的初始建仓期为6个月。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。

2.本基金业绩比较基准自2008年3月1日起变更为:沪深300指数×80%+中信标普国债指数×20%,本基金业绩比较基准收益率的历史走势图从2002年11月11日(基金合同生效日)至2008年2月29日为原业绩比较基准(中信价值指数×80%+中信国债指数×20%)的走势图,2008年3月1日起为变更后的业绩比较基准的走势图。

§4 管理人报告

4.1 基金经理(或基金经理小组)简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
汤义峰先生	本基金基金经理、数量投资部总监	2013年3月8日	-	8年	中国科学院管理学博士。曾就职于博时基金管理有限公司,历任金融工程师、股票投资部数量化研究员、数量化研究员兼任博时特许价值股票型证券投资基金及特洛菲证券投资基金的基金经理助理。2010年3月12日至2012年6月11日曾任博时裕富沪深300指数证券投资基金基金经理及博时特许价值股票型证券投资基金基金经理。2012年11月26日起任大成优选股票型证券投资基金(LOF)基金经理,2013年3月8日起担任大成价值增长证券投资基金基金经理,现同时担任大成基金管理有限公司数量投资部总监。具有基金从业资格。国籍:中国
石国武先生	本基金基金经理	2013年4月18日	-	11年	工学硕士。2002年12月至2012年11月就职于博时基金管理有限公司,历任系统分析员、股票投资部投资经理助理、特定资产部投资经理。2012年11月加入大成基金管理有限公司。2013年4月18日起担任大成价值增长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》、《大成价值增长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,大成价值增长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 公平交易专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

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,公司制订了《大成基金管理有限公司公平交易制度》、《大成基金管理有限公司异常交易监控与报告制度》。公司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 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年二季度公司旗下主动投资组合间股票交易存在3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成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%的有1笔,原因为投资策略需要;投资组合间债券交易存在1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;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 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2014年二季度,沪深300上涨0.88%,创业板指数上涨5.79%,股票市场整体波动不大,小市值股票表现相对活跃。宏观经济和政策来看,在一季度经济快速下滑的背景下,政府微刺激的力度和频率明显加大,货币政策在实际操作上开始放松,基建投资加速,经济指标从底部逐步缓慢企稳。由于房地产销售疲软,市场对经济的担忧情绪依然强烈。资本市场的IPO发行新规出台,新股和次新股继续强烈吸引市场的热情。

本季度基金组合资产配置比例变化不大,组合换手率提高,行业偏离度提升,继续组合平衡配置基础上的个股优选策略。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末,本基金份额净值为0.6776元,本报告期份额净值增长率为3.34%,同期业绩比较基准增长率为0.98%,高于同期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年三季度,随着政府保增长措施的陆续增强,预计实体经济融资成本高企的状态将有所改善,经济表现将有所回升。宏观经济的弱势企稳将为中央政府推进改革创造一个良好的外部环境,改革措施的推进有利于缓解市场对中国经济长期竞争力的担忧情绪,我们对未来市场表现相对乐观,其中,我们将七为关注企业投资回报率的表现和其背后企业竞争力要素的变迁。

组合投资上,大成价值增长资产配置变化不大,适度提高行业配置的偏离度,提高组合换手率、丰富投资策略的多样性,持续根据公司业绩表现优化个股,力争获取超越基准的回报。

§5 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额(元)	占基金资产的比例(%)
1	权益投资	4,924,509,654.85	76.72
	其中:股票	4,924,509,654.85	76.72
2	固定收益投资	1,291,321,848.00	20.12
	其中:债券	1,291,321,848.00	20.12
	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	60,000,290.00	0.93
	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	113,012,839.66	1.76
7	其他资产	29,570,680.71	0.46
8	合计	6,418,415,313.22	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

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	18,003,678.00	0.28
B	采矿业	48,476,685.71	0.76
C	制造业	2,422,788,471.11	37.86
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	83,410,529.41	1.30
E	建筑业	271,491,602.70	4.24
F	批发和零售业	301,195,284.24	4.71
G	交通运输、仓储和邮政业	112,810,073.22	1.76
H	住宿和餐饮业	-	0.00
I	信息传输、软件和信息技术服务业	173,019,080.00	2.70
J	金融业	1,002,123,103.09	15.66
K	房地产业	305,220,234.20	4.77
L	租赁和商务服务业	9,025,628.52	0.14
M	科学研究和技术服务业	64,034,126.73	1.00
N	水利、环境和公共设施管理业	63,652,109.51	0.99
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	21,099,591.46	0.33
R	文化、体育和娱乐业	590,330.00	0.01
S	综合	27,569,126.95	0.43
	合计	4,924,509,654.85	76.95

5.3 报告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

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	601318	中国平安	8,000,000	314,720,000.00	4.92
2	600000	浦发银行	33,000,000	298,650,000.00	4.67
3	000002	万 科A	30,000,000	248,100,000.00	3.88
4	601166	兴业银行	24,000,000	240,720,000.00	3.76
5	000333	美的集团	10,999,950	212,519,034.00	3.32
6	601668	中国建筑	56,535,291	159,429,520.62	2.49
7	600016	民生银行	20,400,000	126,684,000.00	1.98
8	600511	国药股份	5,276,599	119,778,797.30	1.87
9	600859	王府井	7,225,218	114,158,444.40	1.78
10	002051	中工国际	6,299,474	102,051,478.80	1.59

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	132,406,848.00	2.07
2	央行票据	100,140,000.00	1.56
3	金融债券	1,058,775,000.00	16.54
	其中:政策性金融债	1,058,775,000.00	16.54
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	1,291,321,848.00	20.18

5.5 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债券投资明细

序号	债券代码	债券名称	数量(张)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	140436	14农发36	1,500,000	150,240,000.00	2.35
2	120215	12国开15	1,500,000	149,520,000.00	2.34
3	010107	21国债(7)	1,313,560	132,406,848.00	2.07
4	120219	12国开19	1,100,000	109,692,000.00	1.71
5	1101078	11央行票据78	1,000,000	100,140,000.00	1.56

5.6 报告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。

5.7 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。

5.8 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权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.9.1 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。

5.9.2 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。

5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.10.1 本期国债期货投资政策

本基金本报告期末投资国债期货。

5.10.2 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。

5.10.3 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末投资国债期货。

5.11 投资组合报告附注

5.11.1 本基金投资的前十名证券的发行主体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、处罚的情行。

根据中国平安股票发行主体中国平安保险(集团)股份有限公司于2013年5月21日和2013年10月14日发布的公告,该上市公司的控股子公司平安证券有限责任公司(以下简称"平安证券")收到中国证券监督管理委员会(以下简称"中国证监会")《行政处罚和市场禁入事先告知书》。中国证监会决定对平安证券给予警告并没收其在万福生科(湖南)农业开发股份有限公司(以下简称"万福生科")发行上市项目中的业务收入人民币2,555万元,并处以人民币5,110万元的罚款,暂停其保荐机构资格3个月。

在上述公告公布后,本基金管理人对该上市公司进行了进一步了解和分析,认为上述处罚不会对中国平安的投资价值构成实质性负面影响,因此本基金管理人对其投资判断未发生改变。

5.11.2 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。

5.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	1,229,165.84
2	应收证券清算款	7,981,055.94
3	应收股利	-
4	应收利息	20,337,047.11
5	应收申购款	23,411.82
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	29,570,680.71

5.11.4 报告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。

5.11.5 报告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。

5.11.6 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。

§6 开放式基金份额变动

单位:份

报告期期初基金份额总额	9,838,680,642.50
报告期期间基金总申购份额	11,840,978.11
减:报告期期间基金总赎回份额	405,108,893.19
报告期期间基金拆分变动份额(份额减少以"-"填列)	-
报告期期末基金份额总额	9,445,412,727.42

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

基金管理人未持有本基金份额。

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

本报告期基金管理人未运用固有资金投资本基金。

§8 影响投资者决策的其他重要信息

本基金本报告期无影响投资者决策的其他重要信息。

§9 备查文件目录

9.1 备查文件目录

1、中国证监会批准设立大成价值增长证券投资基金的文件;

2、《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的文件》;

3、《大成价值增长证券投资基金基金合同》;

4、《大成价值增长证券投资基金托管协议》;

5、大成基金管理有限公司批准文件、营业执照、公司章程;

6、本报告期内在指定报刊上披露的各种公告原稿。

9.2 存放地点

本报告存放在本基金管理人和托管人的办公住所。

9.3 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。

大成基金管理有限公司
2014年7月18日

大成健康产业股票型证券投资基金

2014 第二季度 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
报告送出日期:2014年7月18日

§1 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,并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带责任。

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7月16日复核了本报告中的财务指标、净值表现和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