大成标普500等权重指数证券投资基金

2014 半年度 报告摘要

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

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。

本半年度报告摘要摘自半年度报告正文,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。

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金简称	大成标普500等权重指数QDII
基金主代码	096001
交易代码	096001
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2011年3月23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	106,343,135.22份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	通过严格的投资纪律约束和数量化风险管理手段,实现基金投资组合对标的指数的有效跟踪,追求跟踪误差最小化。
投资策略	本基金将按照标的指数的成份股及其权重构建基金股票投资组合,并根据标的指数成份股及其权重的变动而进行相应调整。但在因特殊情况(如股票停牌、流动性不足)导致无法获得足够数量的股票时,基金管理人将搭配使用其他合理方法进行适当的替代。 本基金还可能将一定比例的基金资产投资于与标普500等权重指数相关的公募基金、上市交易型基金,以优化投资组合的建立,达到节约交易成本和有效追踪标的指数表现的目的。
业绩比较基准	标普500等权重指数(全收益指数)
风险收益特征	本基金为美国股票指数型证券投资基金,风险与预期收益高于混合型基金、债券基金以及货币市场基金,属于预期风险较高的产品。

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 境外投资顾问和境外资产托管人

项目		境外资产托管人
名称	英文	Bank of China (Hong Kong) Limited
	中文	中国银行(香港)有限公司
注册地址		香港花园道1号中银大厦
办公地址		香港花园道1号中银大厦
邮政编码		-

2.5 信息披露方式

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

§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	1,397,363.40
本期利润	10,402,535.31
加权平均基金份额本期利润	0.1062
本期基金份额净值增长率	7.99%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2014年6月30日)
期末可供分配基金份额利润	0.0572
期末基金资产净值	146,321,114.52
期末基金份额净值	1.376

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。

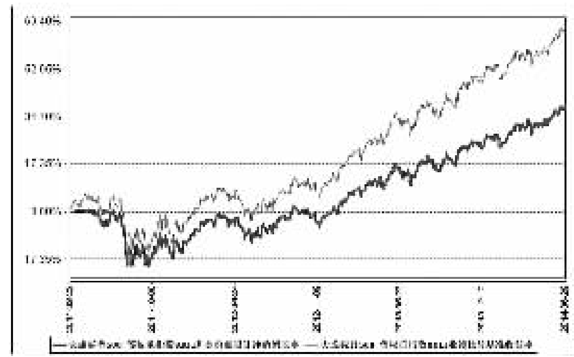
3.2 基金净值表现

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	2.30%	0.36%	2.89%	0.38%	-0.59%	-0.02%
过去三个月	4.64%	0.58%	5.53%	0.61%	-0.89%	-0.03%
过去六个月	7.99%	0.62%	8.66%	0.65%	-0.67%	-0.03%
过去一年	22.56%	0.63%	27.35%	0.66%	-4.79%	-0.03%
过去三年	40.08%	1.11%	60.86%	1.17%	-20.78%	-0.06%
自基金合同生效起至今	38.12%	1.07%	66.85%	1.14%	-28.73%	-0.07%

注:同期业绩比较基准以美元计价,不包含人民币汇率变动等因素产生的效应。

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、按基金合同规定,本基金自基金合同生效之日起6个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的约定。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各项比例。

2、同期业绩比较基准以美元计价,不包含人民币汇率变动等因素产生的效应。

§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		
冉凌浩先生	本基金基金经理	2011年8月26日	-	11年	金融学硕士。2003年4月至2004年6月就职于国信证券研究部,任研究员;2004年6月至2005年9月就职于华西证券研究部,任高级研究员;2005年9月加入大成基金管理有限公司,历任金融工程师、境外市场研究员及基金经理助理。2011年8月26日开始担任大成标普500等权重指数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 境外投资顾问为本基金提供投资建议的主要成员简介

本基金本报告期内无境外投资顾问。

4.3 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》、《大成标普500等权重指数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,大成标普500等权重指数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。

4.4 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.4.1 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些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。

4.4.2 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。

4.5 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.5.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2014年上半年,全球宏观经济基本保持相对稳定的增长状况,股票市场也呈现小幅上涨的情形。

从欧洲方面来看,虽然经济增长依然比较疲软,但是已经不再继续衰退,同时金融系统保持相对稳定。

2014年1季度,美国本土遭遇近二十年来最严寒天气,期间社会经济活动减弱,1季度的宏观经济数据也相对疲弱,GDP环比增长率甚至出现了负增长。因此,1季度的美国主要股票指数出现了区间小幅震动的情况。

但是,恶劣的天气状况不改美国宏观经济全面向好的趋势。在严冬过后,美国社会经济活动逐步恢复到正常状况,至2季度期间,美国宏观经济更是出现了爆发式的增长,各项宏观经济指标屡创金融危机之后的最佳水平,2季度的GDP年化环比增速甚至达到了年化4%的水平。这都表明了美国宏观经济继续维持了全面向好的趋势。

2014年上半年,美国联邦储备委员会更换了主席,新任主席也被市场公认为鸽派,对宽松货币政策持支持立场。由于经济的持续好转,美联储正在逐步退出量化宽松政策,但此行为仅造成美国股票市场在极短期内的波动,并不会改变美国宏观经济持续向好的趋势。

在本报告期内,本基金的目标指数上涨8.66%,美元兑人民币中间价上涨0.92%,经汇率调整后的目标指数上涨9.65%。在本报告期内,本基金净值上涨7.99%,低于经汇率调整后的目标指数1.66%。在本报告期内,本基金的经汇率调整后的年化跟踪误差为0.83%,日均偏差绝对值为0.042%,均显著优于本基金合同中的目标值。

4.5.2 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1.376元,本报告期基金份额净值增长率为7.99%,同期业绩比较基准收益率为8.66%,低于业绩比较基准的表现。

4.6 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,美国经济活动预计依然保持强劲增长。经济增长的来源依然在于个人消费的持续增加及企业投资意愿的增强,住宅市场也有望保持持续回暖,进一步推对经济增长。

虽然会逐步退出量化宽松政策,但美联储将继续维持宽松的货币政策助力经济复苏,因此美联储逐步消减量化宽松政策规模的行为不会改变美国宏观经济及股票市场的长期趋势。

过往30年以来,标普500指数的年化复合增长率在11%左右,而当前标普500指数的动态市盈率处于16至17倍之间,基本位于历史平均水平区间内。因此,未来由强劲的宏观经济增长带来的指数成分股公司盈利的持续增加有望推动标普500指数持续上涨。

本基金为被动型指数基金,其投资目标就是要复制指数的收益率。本基金将坚持被动型的指数化投资理念,持续实施高效的组合管理策略、交易策略及风险控制方法,以期更好的跟踪指数,力争将跟踪误差控制在较低的水平。

4.7 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。

4.8 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。本报告期内大成标普500等权重指数证券投资基金已分配利润437,546.23元(每十份基金份额分红0.048元),符合基金合同规定的分红比例。

§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")在对大成标普500等权重指数证券投资基金(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 半年度财务会计报告(未经审计)

6.1 资产负债表

会计主体:大成标普500等权重指数证券投资基金

报告截止日:2014年6月30日

单位:人民币元

资产	本期末 2014年6月30日	上年度末 2013年12月31日
资产:		
银行存款	11,391,838.17	9,287,850.70
结算备付金	-	-
存出保证金	-	-
交易性金融资产	138,390,457.51	105,853,653.46
其中:股票投资	138,390,457.51	105,853,653.46
基金投资	-	-
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	266,979.10	-
应收利息	1,067.59	307.74
应收股利	141,170.52	128,843.41
应收申购款	566,013.25	683,023.65
递延所得税资产	-	-
其他资产	103,595.22	-
资产总计	150,861,121.36	115,953,678.96
负债和所有者权益	本期末 2014年6月30日	上年度末 2013年12月31日
负债:		
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	65,766.91	2,134,315.56
应付赎回款	4,144,348.74	1,088,259.01
应付管理人报酬	118,338.57	93,310.77
应付托管费	29,584.65	23,327.68
应付销售服务费	-	-
应付交易费用	-	-
应交税费	-	-
应付利息	-	-
应付利润	-	-
递延所得税负债	-	-
其他负债	181,967.97	142,535.34
负债合计	4,540,006.84	3,481,748.36
所有者权益:		
实收基金	106,343,135.22	87,946,838.33
未分配利润	39,977,979.30	24,525,092.27
所有者权益合计	146,321,114.52	112,471,930.60
负债和所有者权益总计	150,861,121.36	115,953,678.96

注:报告截止日2014年6月30日,基金份额净值1.376元,基金份额总额106,343,135.22份。

6.2 利润表

公告主体:大成标普500等权重指数证券投资基金

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	上年度可比期间 2013年1月1日至 2013年6月30日
一、收入	11,482,617.60	11,171,559.38
1.利息收入	21,335.08	12,691.80
其中:存款利息收入	21,335.08	12,691.80
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)	2,484,882.93	4,067,807.18
其中:股票投资收益	1,449,276.27	3,220,570.67
基金投资收益	-	-
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	1,035,606.66	847,236.51
3.公允价值变动收益(损失以"-"号填列)	9,005,171.91	7,364,015.57
4.汇兑收益(损失以"-"号填列)	-94,663.93	-319,281.46
5.其他收入(损失以"-"号填列)	65,891.61	46,326.29
减:二、费用	1,080,082.29	848,707.83
1.管理人报酬	633,228.08	459,566.38
2.托管费	158,307.00	114,891.57
3.销售服务费	-	-
4.交易费用	10,770.27	15,213.35
5.利息支出	-	-
其中:卖出回购金融资产支出	-	-
6.其他费用	277,776.94	259,036.53
三、利润总额(亏损总额以"-"号填列)	10,402,535.31	10,322,851.55
减:所得税费用	-	-
四、净利润(净亏损以"-"号填列)	10,402,535.31	10,322,851.55

6.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体:大成标普500等权重指数证券投资基金

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)	87,946,838.33	24,525,092.27	112,471,930.60
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期净利润)	-	10,402,535.31	10,402,535.31
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)	18,396,296.89	5,487,897.95	23,884,194.84
其中:1.基金申购款	62,127,005.09	18,803,035.47	80,930,040.56
2.基金赎回款	-43,730,708.20	-13,315,137.52	-57,045,845.72
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)	-	-437,546.23	-437,546.23
五、期末所有者权益(基金净值)	106,343,135.22	39,977,979.30	146,321,114.52
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)	97,408,937.82	524,935.25	97,933,873.07
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期净利润)	-	10,322,851.55	10,322,851.55
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)	-21,504,348.63	-1,220,133.28	-22,724,481.91
其中:1.基金申购款	41,872,652.39	4,673,891.89	46,546,544.28
2.基金赎回款	-63,377,001.02	-5,894,025.17	-69,271,026.19
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)	75,904,589.19	9,627,653.52	85,532,242.71

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、税项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、会计估计税项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[2008]1号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》及其他相关境内外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)目前基金取得的源自境外的差价收入,其涉及的境外所得税税收政策,按照相关国家或地区税收法律和法规执行,在境内不予征收营业税且暂不征收企业所得税。

(3)目前基金取得的源自境外的股利收益,其涉及的境外所得税税收政策,按照相关国家或地区税收法律和法规执行,在境内暂不征收个人所得税和企业所得税。

6.4.3 关联方关系

6.4.3.1 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。

6.4.3.2 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
中国银行(香港)股份有限公司("中银香港")	境外资产托管人
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、以下关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.4 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.4.1 通过关联方交易单元进行的交易

本报告期及上年度可比期间内本基金无通过关联方交易单元进行的交易。

6.4.4.2 关联方报酬

6.4.4.2.1 基金管理费

单位:人民币元

项目	本期 2014年1月1日至 2014年6月30日	上年度可比期间 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	633,228.08	459,566.38
其中:支付销售机构的客户维护费	231,904.35	176,032.47

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1.0%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 X 1.0% / 当年天数。

6.4.4.2.2 基金托管费

单位:人民币元

项目	本期 2014年1月1日至 2014年6月30日	上年度可比期间 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	158,307.00	114,891.57

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 X 0.25% / 当年天数。

6.4.4.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本报告期及上年度可比期间内本基金未发生与关联方进行的银行间同业市场的债券(含回购)交易。

6.4.4.4 各关联方投资本基金的情况

6.4.4.4.1 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。

6.4.4.4.2 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

本报告期末及上年度末除基金管理人之外的其他关联方无投资本基金的情况。

6.4.4.5 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6月30日		上年度可比期间 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
中银香港	5,006,840.87	-	10,824,593.66	-
中国银行	6,384,997.30	21,254.10	4,582,425.31	12,691.80

注:本基金的银行存款由基金托管人中国银行和境外资产托管人中银香港保管,按银行同业利率计息。

6.4.4.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本报告期及上年度可比期间内本基金未在承销期内参与关联方承销证券。

6.4.4.7 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期无须作说明的其他关联交易事项。

6.4.5 期末(2014年6月30日)本基金持有的流通受限证券

6.4.5.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

于本报告期末,本基金未持有因认购新发或增发证券而流通受限的证券。

6.4.5.2 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。

§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	138,390,457.51	91.73
	其中:普通股票	138,390,457.51	91.73
	存托凭证	-	0.00
	优先股	-	0.00
	房地产信托凭证	-	0.00
2	基金投资	-	0.00
3	固定收益投资	-	0.00
	其中:债券	-	0.00
	资产支持证券	-	0.00
4	金融衍生品投资	-	0.00
	其中:远期	-	0.00
	期货	-	0.00
	期权	-	0.00
	权证	-	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	货币市场工具	-	0.00
7	银行存款和结算备付金合计	11,391,838.17	7.55
8	其他各项资产	1,078,825.68	0.72
9	合计	150,861,121.36	100.00

7.2 期末在各个国家(地区)证券市场的权益投资分布

金额单位:人民币元

国家(地区)	公允价值	占基金资产净值比列(%)
美国	138,390,457.51	94.58
合计	138,390,457.51	94.58

7.3 期末按行业分类的权益投资组合

7.3.1 期末指数投资按行业分类的权益投资组合

金额单位:人民币元

行业类别	公允价值(人民币元)	占基金资产净值比例(%)
消费者非必需品	22,836,216.67	15.61
金融	22,790,816.00	15.58
工业	17,900,067.34	12.23
信息技术	17,771,922.77	12.15
医疗保健	14,976,009.59	10.24
能源	12,944,780.68	8.85
消费者常用品	11,039,839.02	7.54
公用事业	8,467,049.40	5.79
基础材料	8,177,763.97	5.59
电信服务	1,485,992.07	1.02
合计	138,390,457.51	94.58

注:以上分类采用全球行业分类标准(GICS)。

7.3.2 期末积极投资按行业分类的权益投资组合

本基金本报告期末未持有积极投资的股票及存托凭证。

7.4 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名权益投资明细

金额单位:人民币元

序号	公司名称(英文)	公司名称(中文)	证券代码	所在证券市场	所属国家(地区)	数量(股)	公允价值	占基金资产净值比列(%)
1	The Williams Companies Inc	威廉姆斯公司	WMB UN	纽约交易所	US	1,039	372,122.51	0.25
2	Vertex Pharmaceuticals Inc	维特制药股份有限公司	VRTX UQ	纳斯达克交易所	US	608	354,188.64	0.24
3	Iron Mountain Inc	美国铁山公司	IRM UN	纽约交易所	US	1,570	342,443.31	0.23
4	Integrys Energy Group Inc	英迪斯能源集团公司	TEG UN	纽约交易所	US	765	334,801.23	0.23
5	Covidien Plc	Covidien公共股份公司	COV UN	纽约交易所	US	603	334,580.28	0.23
6	Carmax Inc	CarMax股份有限公司	KMX UN	纽约交易所	US	1,012	323,847.21	0.22
7	Entergy Corp	Entergy公司	ETR UN	纽约交易所	US	631	318,707.60	0.22
8	QEP Resources	QEP资源公司	QEP UN	纽约交易所	US	1,500	318,407.40	0.22
9	Best Buy Co Inc	百思买	BBY UN	纽约交易所	US	1,663	317,297.62	0.22
10	Baker Hughes Inc	贝克休斯	BHI UN	纽约交易所	US	690	316,072.41	0.22

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)的半年度报告正文。

7.5 报告期内权益投资组合的重大变动

7.5.1 累计买入金额超出期初基金资产净值2%或前20名的权益投资明细

金额单位:人民币元

序号	公司名称(英文)	证券代码	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	Essex Property Trust Inc	ESS UN	295,649.64	0.26
2	Tractor Supply Co	TSCO UQ	286,578.00	0.25
3	Cimarex Energy Co	XEC UN	275,806.16	0.25
4	Avago Technologies Ltd	AVGO UQ	270,936.02	0.24
5	Keurig Green Mountain Inc	GMCR UQ	254,988.11	0.23
6	Under Armour Inc A	UA UN	248,578.91	0.22
7	Navient Corp	NAVI UQ	234,549.79	0.21
8	The ADT Corp.	ADT UN	140,991.48	0.13
9	Best Buy Co Inc	BBY UN	138,006.10	0.12
10	Coach Inc	COH UN	135,043.61	0.12
11	Whole Foods Market Inc	WFM UQ	132,314.63	0.12
12	PETSMART Inc	PETM UQ	124,998.78	0.11
13	National Oilwell Varco Inc	NOV UN	123,767.73	0.11
14	Transocean Ltd	RIG UN	116,987.69	0.10
15	Staples Inc	SPLS UQ	115,822.67	0.10
16	Carmax Inc	KMX UN	113,736.99	0.10
17	Bed Bath & Beyond Inc	BBBY UQ	113,087.94	0.10
18	Diamond Offshore Drilling	DO UN	111,850.58	0.10
19	Noble Corp plc	NE UN	107,914.95	0.10
20	E*TRADE Financial Corp	ETFC UQ	103,803.77	0.09

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。

7.5.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值2%或前20名的权益投资明细

金额单位:人民币元

序号	公司名称(英文)	证券代码	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	Intl Game Technology	IGT UN	282,957.90	0.25
2	Cliffs Natural Resources Inc	CLF UN	265,396.72	0.24
3	Life Technologies Corp	LIFE UQ	207,965.95	0.18
4	WPX Energy Inc.	WPX UN	207,456.91	0.18
5	Newfield Exploration Co	NFX UN	161,522.71	0.14
6	Forest Laboratories	FRX UN	145,919.86	0.13
7	Nabors Industries Ltd	NBR UN	141,989.55	0.13
8	Allergan Inc	AGN UN	136,268.57	0.12
9	Electronic Arts Inc	EA UQ	115,879.71	0.10
10	Pepco Holdings Inc	POM UN	99,613.88	0.09
11	Alcoa Inc	AA UN	98,177.15	0.09
12	Anadarko Petroleum Corp	APC UN	95,604.18	0.09
13	SLM Corp	SLM UQ	87,022.54	0.08
14	Alexion Pharmaceuticals Inc	ALXN UQ	82,027.48	0.07
15	EOG Resources	EOG UN	81,923.92	0.07
16	SanDisk Corp	SNDK UQ	79,928.75	0.07
17	LSI Corporation	LSI UQ	78,061.07	0.07
18	ConocoPhillips	COP UN	73,621.86	0.07
19	Molson Coors Brewing Co B	TAP UN	70,382.42	0.06
20	Apache Corp	APA UN	69,575.97	0.06

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。

7.5.3 权益投资的买入成本总额及卖出收入总额

单位:人民币元

买入成本(成交)总额	28,986,970.46
卖出收入(成交)总额	6,904,614.59

注:本项中"买入股票的成本(成交)总额"及"卖出股票的收入(成交)总额"均按买卖成交金额(成交单价乘以成交数量)填列,不考虑相关交易费用。

7.6 期末按债券信用等级分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

7.7 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。

7.8 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名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。

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金融衍生品投资明细

本基金本报告期末未持有金额衍生品。

7.10 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名基金投资明细

本基金本报告期末未持有基金。

7.11 投资组合报告附注

7.11.1 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。

7.11.2 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股票。

7.11.3 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	-
2	应收证券清算款	266,979.10
3	应收股利	141,170.52
4	应收利息	1,067.59
5	应收申购款	566,013.25
6	其他应收款	-
7	待摊费用	103,595.22
8	其他	-
9	合计	1,078,825.68

7.11.4 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。

7.11.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

7.11.5.1 期末指数投资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无流通受限情况。

7.11.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末未持有积极投资的股票及存托凭证。

7.11.6 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。

§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
6143	17,311.27	6,749,566.66	6.35%	99,593,568.56	93.65%

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	213,552.45	0.20%

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情况

项目	份额级别	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	大成标普500	0
	合计	0
本基金基金经理持有本开放式基金	大成标普500	0
	合计	0

§9 开放式基金份额变动

单位:份

基金合同生效日(2011年3月23日)基金份额总额	822,754,222.26
本报告期期初基金份额总额	87,946,838.33
本报告期基金总申购份额	62,127,005.09
减:本报告期基金总赎回份额	43,730,708.20
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	106,343,135.22

§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(特殊普通合伙)。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

本报告期内,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	
摩根士丹利	1	35,421,861.37	100.00%	10,770.27	100.00%	-

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,本公司制定了租用境内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、公司作为管理人负责选择代理各投资组合证券买卖的境外券商,具体选择标准如下:

(一)具备该机构所在国家或地区政府、监管机构核发的营业执照、业务许可证明文件;

(二)资历雄厚,信誉良好;

(三)财务状况良好,经营行为规范;

(四)内部管理规范、严格,具备健全的内控制度(包括但不限于公平交易制度及保密制度),能满足各投资组合运作高度保密的要求;

(五)证券研究或市场研究实力较强,有固定的研究机构和专门研究人员,能及时、定期、全面地为各投资组合提供宏观经济、行业情况、个股分析、市场研究等各方面研究报告及周到的信息服务,并能根据各投资组合投资的特定要求,提供专题研究报告;

(六)具备各投资组合运作所需的交易执行能力。能够准确、及时、高质量完成各投资组合下达的交易指令。

(七)具备各投资组合运作所需的后台清算执行能力。能及时、高效处理交易清算、证券交收等后台清算业务。

(八)能提供各投资组合运作、管理所需的其他服务。

(九)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。

交易管理部在每半年15个交易日内,汇总上半年境外券商综合服务评价结果,作为当次境外券商交易量分配依据。并依此制作交易量分配计划,报部门及公司分管领导批准;

交易量分配计划获批后,作为选择交易券商的依据,供交易员在交易时进行券商选择。

券商服务出现重大失误或其他异常情况时,及时报公司监察稽核部及相关领导。可暂停与该券商的合作,并对其失误所造成的损失进行追偿。

3、境内交易单元包括:长江证券、中信证券、海通证券、光大证券、江海证券、安信证券、东方证券、中金公司、广州证券、中投证券、湘财证券、银河证券、招商证券、申银万国、中银国际、东莞证券、渤海证券、国都证券、国泰君安、华宝证券、国信证券、中航证券、财富证券、华泰证券、天源证券、广发证券、西南证券、华福证券、齐鲁证券、民生证券、万联证券、东海证券、万和证券、华鑫证券、东吴证券、国海证券、华林证券、英大证券、民族证券。上述交易单元无交易。

4、本报告期内本基金无退租或新增的境内交易单元,无新增或退租境外交易单元。

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

无。

大成基金管理有限公司
2014年8月28日