

大成沪深300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:中国农业银行股份有限公司
送出日期:2014年08月28日

1.1 重要提示
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,也不保证基金份额持有人的本金不受损失,或保证投资收益水平。

2.1 基金基本情况
基金简称:大成沪深300指数
基金代码:019300
前端的交易代码:019300
后端的交易代码:019301

2.2 基金主要投资范围
本基金为指数基金,是风险中等、获得证券市场平均收益率的资产。

2.3 基金管理人及基金托管人
名称: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

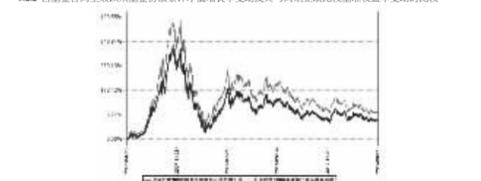
3 主要财务指标和基金净值表现
3.1 主要财务指标和财务指标

Table with 2 columns: 主要财务指标, 基金净值表现. Rows include 本期利润总额, 加权平均基金份额本期利润, etc.

3.2 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

Table with 5 columns: 阶段, 基金份额净值增长率①, 业绩比较基准收益率②, 业绩比较基准差收益率③, ①-③, ②-③. Rows include 过去一个月, 过去三个月, etc.

3.3 自基金合同生效以来基金净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率的比较



注:按《基金合同》规定,本基金的建仓期为6个月。截至本报告日,本基金的各投资组合比例已达到基金合同第二条之(六)投资组合中规定的各项比例。

4.1 基金管理人及基金托管人情况
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是中国证监会批准设立的基金管理公司,于1999年10月12日正式成立,是中国证监会批准设立的第十家基金管理公司。注册资本为2亿元人民币,注册地为山东济南。

4.1.2 基金基金经理(或基金经理助理)及基金经理助理简介

Table with 5 columns: 姓名, 职务, 任本基金的基金经理(或基金经理助理)的期限, 证券从业年限, 说明. Rows include 苏豪骏先生, 张神女士.

注:1. 任职日期:指担任本基金经理人职务的起始日期。
2. 证券从业年限:指从事证券行业工作的年限。

4.2 报告期内本基金运作遵规守信情况说明
报告期内,本基金管理人严格遵守《证券投资基金法》、《大成沪深300指数证券投资基金合同》、《大成沪深300指数证券投资基金托管协议》及其他相关法律法规、基金合同、基金托管协议、基金招募说明书及基金产品资料概要的约定,本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产,在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 公平交易制度的执行情况
公平交易制度的执行情况:报告期内,本基金管理人严格执行《证券投资基金法》、《证券投资基金运作管理办法》等相关规定,确保公平对待所有基金份额持有人,不存在任何不公平交易的情况。

4.4 报告期内基金投资策略和运作分析
报告期内,全球经济复苏乏力,主要经济体复苏进程缓慢,全球股市震荡上行,大宗商品价格高位运行,通胀压力依然较大。本基金管理人根据基金合同约定,严格控制投资风险,努力为基金份额持有人谋求最大利益。

4.5 报告期内基金业绩比较基准执行情况
报告期内,本基金管理人严格执行基金合同约定的业绩比较基准,确保基金投资运作的合规性和公平性。

4.6 管理人及托管人报告期内基金资产净值变动情况的说明
报告期内,本基金管理人及托管人严格按照基金合同约定,履行各自职责,确保基金资产的安全和完整。

4.7 管理人及托管人报告期内基金资产净值变动情况的说明
报告期内,本基金管理人及托管人严格按照基金合同约定,履行各自职责,确保基金资产的安全和完整。

4.8 基金管理人及托管人报告期内基金资产净值变动情况的说明
报告期内,本基金管理人及托管人严格按照基金合同约定,履行各自职责,确保基金资产的安全和完整。

4.9 基金管理人及托管人报告期内基金资产净值变动情况的说明
报告期内,本基金管理人及托管人严格按照基金合同约定,履行各自职责,确保基金资产的安全和完整。

4.10 基金管理人及托管人报告期内基金资产净值变动情况的说明
报告期内,本基金管理人及托管人严格按照基金合同约定,履行各自职责,确保基金资产的安全和完整。

4.11 基金管理人及托管人报告期内基金资产净值变动情况的说明
报告期内,本基金管理人及托管人严格按照基金合同约定,履行各自职责,确保基金资产的安全和完整。

4.12 基金管理人及托管人报告期内基金资产净值变动情况的说明
报告期内,本基金管理人及托管人严格按照基金合同约定,履行各自职责,确保基金资产的安全和完整。

4.13 基金管理人及托管人报告期内基金资产净值变动情况的说明
报告期内,本基金管理人及托管人严格按照基金合同约定,履行各自职责,确保基金资产的安全和完整。

4.14 基金管理人及托管人报告期内基金资产净值变动情况的说明
报告期内,本基金管理人及托管人严格按照基金合同约定,履行各自职责,确保基金资产的安全和完整。

4.15 基金管理人及托管人报告期内基金资产净值变动情况的说明
报告期内,本基金管理人及托管人严格按照基金合同约定,履行各自职责,确保基金资产的安全和完整。

4.16 基金管理人及托管人报告期内基金资产净值变动情况的说明
报告期内,本基金管理人及托管人严格按照基金合同约定,履行各自职责,确保基金资产的安全和完整。

4.17 基金管理人及托管人报告期内基金资产净值变动情况的说明
报告期内,本基金管理人及托管人严格按照基金合同约定,履行各自职责,确保基金资产的安全和完整。

基金费用开支及利润分配符合合同约定,不存在损害基金份额持有人利益的行为;在报告期内,严格遵守《证券投资基金法》等有关法律法规,在各重要方面的运作严格按照基金合同的约定进行。

5.3 托管人对上半年度基金净值增长情况的说明
本托管人认为,大成基金管理有限公司的信息披露事务符合《证券投资基金信息披露管理办法》及其他相关法律法规的规定,基金管理人编制和披露的基金半年度报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告等信息真实、准确、完整,没有出现虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏的情况。

6 半年度财务会计报告(未经审计)

6.1 资产负债表

Table with 3 columns: 资产, 本期末, 上年度末. Rows include 货币资金, 交易性金融资产, 应收利息, etc.

6.2 利润表

Table with 3 columns: 项目, 本期, 上年度可比期间. Rows include 一、收入, 利息收入, 投资收益, etc.

6.3 所有者权益(或股东权益)变动表

Table with 3 columns: 项目, 本期, 上年度可比期间. Rows include 一、所有者权益(或股东权益)合计, 未分配利润, 所有者权益合计, etc.

6.4 现金流量表

Table with 3 columns: 项目, 本期, 上年度可比期间. Rows include 一、经营活动产生的现金流量, 二、投资活动产生的现金流量, etc.

6.5 所有者权益(或股东权益)变动表

Table with 3 columns: 项目, 本期, 上年度可比期间. Rows include 一、所有者权益(或股东权益)合计, 未分配利润, 所有者权益合计, etc.

6.6 关联方关系及其交易的披露

6.6.1 本报告期及上年度可比期间的关联方交易
6.6.1.1 关联交易

Table with 4 columns: 关联方名称, 本期, 上年度可比期间. Rows include 光大证券, 招商证券, etc.

6.6.1.2 关联方交易
6.6.1.3 关联方交易佣金
6.6.1.4 关联方交易利息

6.6.2 本报告期及上年度可比期间的关联方交易
6.6.2.1 关联方交易

Table with 4 columns: 关联方名称, 本期, 上年度可比期间. Rows include 光大证券, 招商证券, etc.

6.6.2.2 关联方交易
6.6.2.3 关联方交易佣金
6.6.2.4 关联方交易利息

6.6.3 本报告期及上年度可比期间的关联方交易
6.6.3.1 关联方交易

Table with 4 columns: 关联方名称, 本期, 上年度可比期间. Rows include 光大证券, 招商证券, etc.

6.6.3.2 关联方交易
6.6.3.3 关联方交易佣金
6.6.3.4 关联方交易利息

6.6.4 本报告期及上年度可比期间的关联方交易
6.6.4.1 关联方交易

Table with 4 columns: 关联方名称, 本期, 上年度可比期间. Rows include 光大证券, 招商证券, etc.

6.6.4.2 关联方交易
6.6.4.3 关联方交易佣金
6.6.4.4 关联方交易利息

6.6.5 本报告期及上年度可比期间的关联方交易
6.6.5.1 关联方交易

Table with 4 columns: 关联方名称, 本期, 上年度可比期间. Rows include 光大证券, 招商证券, etc.

6.6.5.2 关联方交易
6.6.5.3 关联方交易佣金
6.6.5.4 关联方交易利息

6.6.6 本报告期及上年度可比期间的关联方交易
6.6.6.1 关联方交易

Table with 4 columns: 关联方名称, 本期, 上年度可比期间. Rows include 光大证券, 招商证券, etc.

6.6.6.2 关联方交易
6.6.6.3 关联方交易佣金
6.6.6.4 关联方交易利息

6.6.7 本报告期及上年度可比期间的关联方交易
6.6.7.1 关联方交易

Table with 4 columns: 关联方名称, 本期, 上年度可比期间. Rows include 光大证券, 招商证券, etc.

6.6.7.2 关联方交易
6.6.7.3 关联方交易佣金
6.6.7.4 关联方交易利息

6.6.8 本报告期及上年度可比期间的关联方交易
6.6.8.1 关联方交易

Table with 4 columns: 关联方名称, 本期, 上年度可比期间. Rows include 光大证券, 招商证券, etc.

6.6.8.2 关联方交易
6.6.8.3 关联方交易佣金
6.6.8.4 关联方交易利息

6.6.9 本报告期及上年度可比期间的关联方交易
6.6.9.1 关联方交易

Table with 4 columns: 关联方名称, 本期, 上年度可比期间. Rows include 光大证券, 招商证券, etc.

6.6.9.2 关联方交易
6.6.9.3 关联方交易佣金
6.6.9.4 关联方交易利息

6.6.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易
6.6.10.1 关联方交易

Table with 4 columns: 关联方名称, 本期, 上年度可比期间. Rows include 光大证券, 招商证券, etc.

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 关联交易

Table with 4 columns: 关联方名称, 本期, 上年度可比期间. Rows include 光大证券, 招商证券, etc.

6.4.4.2 关联方交易
6.4.4.3 关联方交易佣金
6.4.4.4 关联方交易利息

6.4.5 本报告期及上年度可比期间的关联方交易
6.4.5.1 关联方交易

Table with 4 columns: 关联方名称, 本期, 上年度可比期间. Rows include 光大证券, 招商证券, etc.

6.4.5.2 关联方交易
6.4.5.3 关联方交易佣金
6.4.5.4 关联方交易利息

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 关联方交易

Table with 4 columns: 关联方名称, 本期, 上年度可比期间. Rows include 光大证券, 招商证券, etc.

6.4.6.2 关联方交易
6.4.6.3 关联方交易佣金
6.4.6.4 关联方交易利息

6.4.7 本报告期及上年度可比期间的关联方交易
6.4.7.1 关联方交易

Table with 4 columns: 关联方名称, 本期, 上年度可比期间. Rows include 光大证券, 招商证券, etc.

6.4.7.2 关联方交易
6.4.7.3 关联方交易佣金
6.4.7.4 关联方交易利息

6.4.8 本报告期及上年度可比期间的关联方交易
6.4.8.1 关联方交易

Table with 4 columns: 关联方名称, 本期, 上年度可比期间. Rows include 光大证券, 招商证券, etc.

6.4.8.2 关联方交易
6.4.8.3 关联方交易佣金
6.4.8.4 关联方交易利息

6.4.9 本报告期及上年度可比期间的关联方交易
6.4.9.1 关联方交易

Table with 4 columns: 关联方名称, 本期, 上年度可比期间. Rows include 光大证券, 招商证券, etc.

6.4.9.2 关联方交易
6.4.9.3 关联方交易佣金
6.4.9.4 关联方交易利息

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易
6.4.10.1 关联方交易

Table with 4 columns: 关联方名称, 本期, 上年度可比期间. Rows include 光大证券, 招商证券, etc.

6.4.10.2 关联方交易
6.4.10.3 关联方交易佣金
6.4.10.4 关联方交易利息

6.4.11 本报告期及上年度可比期间的关联方交易
6.4.11.1 关联方交易

Table with 4 columns: 关联方名称, 本期, 上年度可比期间. Rows include 光大证券, 招商证券, etc.

6.4.11.2 关联方交易
6.4.11.3 关联方交易佣金
6.4.11.4 关联方交易利息

6.4.12 本报告期及上年度可比期间的关联方交易
6.4.12.1 关联方交易

Table with 4 columns: 关联方名称, 本期, 上年度可比期间. Rows include 光大证券, 招商证券, etc.

6.4.12.2 关联方交易
6.4.12.3 关联方交易佣金
6.4.12.4 关联方交易利息

6.4.13 本报告期及上年度可比期间的关联方交易
6.4.13.1 关联方交易

Table with 4 columns: 关联方名称, 本期, 上年度可比期间. Rows include 光大证券, 招商证券, etc.

6.4.13.2 关联方交易
6.4.13.3 关联方交易佣金
6.4.13.4 关联方交易利息

6.4.14 本报告期及上年度可比期间的关联方交易
6.4.14.1 关联方交易

Table with 4 columns: 关联方名称, 本期, 上年度可比期间. Rows include 光大证券, 招商证券, etc.

6.4.14.2 关联方交易
6.4.14.3 关联方交易佣金
6.4.14.4 关联方交易利息

6.4.15 本报告期及上年度可比期间的关联方交易
6.4.15.1 关联方交易

Table with 4 columns: 关联方名称, 本期, 上年度可比期间. Rows include 光大证券, 招商证券, etc.

6.4.15.2 关联方交易
6.4.15.3 关联方交易佣金
6.4.15.4 关联方交易利息

6.4.16 本报告期及上年度可比期间的关联方交易
6.4.16.1 关联方交易

Table with 4 columns: 关联方名称, 本期, 上年度可比期间. Rows include 光大证券, 招商证券, etc.

6.4.16.2 关联方交易
6.4.16.3 关联方交易佣金
6.4.16.4 关联方交易利息

6.4.17 本报告期及上年度可比期间的关联方交易
6.4.17.1 关联方交易

Table with 4 columns: 关联方名称, 本期, 上年度可比期间. Rows include 光大证券, 招商证券, etc.

6.4.17.2 关联方交易
6.4.17.3 关联方交易佣金
6.4.17.4 关联方交易利息

6.4.18 本报告期及上年度可比期间的关联方交易
6.4.18.1 关联方交易

Table with 4 columns: 关联方名称, 本期, 上年度可比期间. Rows include 光大证券, 招商证券, etc.

Table with 5 columns: 序号, 股票代码, 股票名称, 本期累计卖出金额, 占期末基金资产净值比例(%)

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

Table with 2 columns: 买入股票成本, 卖出股票收入. Rows include 买入股票成本, 卖出股票收入.

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

Table with 3 columns: 序号, 债券品种, 公允价值, 占基金资产净值比例(%)

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

Table with 4 columns: 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(%)

7.7 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

Table with 4 columns: 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(%)

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

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

7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

7.11 报告期末本基金投资的国债期货投资情况说明

7.12 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

7.13 报告期末本基金投资的国债期货投资损益

7.14 报告期末本基金投资的国债期货投资损益

7.15 报告期末本基金投资的国债期货投资损益

7.16 报告期末本基金投资的国债期货投资损益

7.17 报告期末本基金投资的国债期货投资损益

7.18 报告期末本基金投资的国债期货投资损益

7.19 报告期末本基金投资的国债期货投资损益

7.20 报告期末本基金投资的国债期货投资损益

7.21 报告期末本基金投资的国债期货投资损益

7.22 报告期末本基金投资的国债期货投资损益

7.23 报告期末本基金投资的国债期货投资损益

7.24 报告期末本基金投资的国债期货投资损益

7.25 报告期末本基金投资的国债期货投资损益

7.26 报告期末本基金投资的国债期货投资损益

7.27 报告期末本基金投资的国债期货投资损益

7.28 报告期末本基金投资的国债期货投资损益

7.29 报告期末本基金投资的国债期货投资损益

7.30 报告期末本基金投资的国债期货投资损益

7.31 报告期末本基金投资的国债期货投资损益

7.32 报告期末本基金投资的国债期货投资损益

7.33 报告期末本基金投资的国债期货投资损益

7.34 报告期末本基金投资的国债期货投资损益

7.35 报告期末本基金投资的国债期货投资损益

7.36 报告期末本基金投资的国债期货投资损益

7.37 报告期末本基金投资的国债期货投资损益

7.38 报告期末本基金投资的国债期货投资损益

7.39 报告期末本基金投资的国债期货投资损益

7.40 报告期末本基金投资的国债期货投资损益