

大成中证500深市交易型开放式指数证券投资基金

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
重要提示
基金管理人承诺: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法律责任...

Table with 2 columns: 基金基本情况 (Fund Basic Information) and 基金简介 (Fund Introduction). Includes details like fund name, codes, and objectives.

3 主要财务指标和基金净值表现

Table with 2 columns: 3.1 主要会计数据和财务指标 (Main Accounting Data and Financial Indicators) and 3.2 基金净值表现 (Fund Net Value Performance). Includes performance metrics and net value changes.

注:1.本基金采用公允价值计量金融资产公允价值,公允价值变动损益扣除相关费用后的余额,本期利润为本基金实现的净利润加上本期公允价值变动收益...

Table with 2 columns: 3.2.1 基金净值增长率及其与同期业绩比较基准收益的比较 (Fund Net Value Growth Rate and Comparison with Benchmark). Shows performance over various periods.

注:1.本基金合同于2013年9月12日生效,截至报告日本基金合同生效未满一年。
2.按基金合同规定,本基金自基金合同生效之日起6个月内为建仓期,截至报告期末,本基金的各项投资比例已达到基金合同规定的各项比例。



注:1.本基金合同于2013年9月12日生效,截至报告日本基金合同生效未满一年。
2.按基金合同规定,本基金自基金合同生效之日起6个月内为建仓期,截至报告期末,本基金的各项投资比例已达到基金合同规定的各项比例。

4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金基本情况
4.1.1 基金管理人及基金的基本情况
大成基金管理有限公司(以下简称“大成基金”)经中国证监会证监基金字[1999]010号批准,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...

4.1.2 基金管理人及基金的基本情况
大成基金秉承“稳健、诚信、专业、创新”的经营理念,坚持“客户至上”的服务宗旨,致力于为投资者提供长期、稳定的投资回报...

4.1.3 基金管理人及基金的基本情况
大成基金在报告期内,严格按照法律法规和基金合同的约定,勤勉尽责地开展各项业务,确保基金资产的安全和投资者的合法权益...

4.1.4 基金管理人及基金的基本情况
大成基金在报告期内,持续加强合规管理和风险控制,不断提升公司治理水平和风险管理能力,确保基金业务的稳健运行...

4.1.5 基金管理人及基金的基本情况
大成基金在报告期内,积极履行社会责任,支持国家经济建设,为实体经济的发展贡献了力量...

4.1.6 基金管理人及基金的基本情况
大成基金在报告期内,持续完善投资者服务体系,提升客户服务水平,增强投资者的投资信心和满意度...

4.1.7 基金管理人及基金的基本情况
大成基金在报告期内,持续加强品牌建设和市场推广,提升品牌知名度和影响力...

4.1.8 基金管理人及基金的基本情况
大成基金在报告期内,持续完善内部治理结构,提升管理效率和决策水平...

4.1.9 基金管理人及基金的基本情况
大成基金在报告期内,持续加强人才队伍建设,提升团队专业素质和业务能力...

4.1.10 基金管理人及基金的基本情况
大成基金在报告期内,持续完善信息披露制度,提升信息披露的及时性和透明度...

4.1.11 基金管理人及基金的基本情况
大成基金在报告期内,持续完善风险管理机制,提升风险防范和化解能力...

4.1.12 基金管理人及基金的基本情况
大成基金在报告期内,持续完善合规管理体系,提升合规意识和执行力...

4.1.13 基金管理人及基金的基本情况
大成基金在报告期内,持续完善投资者教育体系,提升投资者的风险意识和投资能力...

4.1.14 基金管理人及基金的基本情况
大成基金在报告期内,持续完善基金销售体系,提升基金销售效率和客户满意度...

4.1.15 基金管理人及基金的基本情况
大成基金在报告期内,持续完善基金估值体系,提升估值准确性和透明度...

4.1.16 基金管理人及基金的基本情况
大成基金在报告期内,持续完善基金清算体系,提升清算效率和准确性...

4.1.17 基金管理人及基金的基本情况
大成基金在报告期内,持续完善基金信息披露体系,提升信息披露的及时性和透明度...

4.1.18 基金管理人及基金的基本情况
大成基金在报告期内,持续完善基金风险管理机制,提升风险防范和化解能力...

4.1.19 基金管理人及基金的基本情况
大成基金在报告期内,持续完善基金合规管理体系,提升合规意识和执行力...

4.1.20 基金管理人及基金的基本情况
大成基金在报告期内,持续完善基金投资者教育体系,提升投资者的风险意识和投资能力...

4.1.21 基金管理人及基金的基本情况
大成基金在报告期内,持续完善基金销售体系,提升基金销售效率和客户满意度...

4.1.22 基金管理人及基金的基本情况
大成基金在报告期内,持续完善基金估值体系,提升估值准确性和透明度...

4.1.23 基金管理人及基金的基本情况
大成基金在报告期内,持续完善基金清算体系,提升清算效率和准确性...

4.1.24 基金管理人及基金的基本情况
大成基金在报告期内,持续完善基金信息披露体系,提升信息披露的及时性和透明度...

4.1.25 基金管理人及基金的基本情况
大成基金在报告期内,持续完善基金风险管理机制,提升风险防范和化解能力...

Table with 2 columns: 资产 (Assets) and 负债和所有者权益 (Liabilities and Equity). Shows the fund's financial position as of June 30, 2014.

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及相关协议执行。
6.4.4.5 其他关联交易事项的说明
6.4.5 期末持有的有价证券明细表

Table with 10 columns: 股票代码 (Stock Code), 股票名称 (Stock Name), 停牌日期 (Suspension Date), 停牌原因 (Suspension Reason), 期末估值单价 (End Valuation Price), 复牌日期 (Resumption Date), 数量(股) (Quantity), 期末成本总额 (End Cost Total), 期末市值总额 (End Market Value Total), 备注 (Remarks).

注:本基金截至2014年6月30日止持有以上上列公司的重大事项可能产生重大影响而暂时停牌的股票,该类股票将在所公布的本报告期末,本基金无异常赎回的交易所作为抵押的债券。
7.1 期末基金资产组合情况

Table with 3 columns: 序号 (Serial Number), 项目 (Item), 金额 (Amount), 占基金资产净值比例 (Percentage of Net Asset Value). Shows the fund's asset allocation.

注:本基金的投资组合符合《证券投资基金运作管理办法》第二十一条关于股票资产占基金资产净值的比例限制。
7.2 期末按行业分类的股票投资组合

Table with 4 columns: 代码 (Code), 行业类别 (Industry Category), 公允价值(元) (Fair Value), 占基金资产净值比例(%) (Percentage of Net Asset Value). Shows the fund's industry exposure.

7.2.1 期末按行业分类的股票投资组合
7.2.2 期末按行业分类的股票投资组合

Table with 4 columns: 代码 (Code), 行业类别 (Industry Category), 公允价值(元) (Fair Value), 占基金资产净值比例(%) (Percentage of Net Asset Value). Shows the fund's industry exposure.

注:本基金的投资组合符合《证券投资基金运作管理办法》第二十一条关于股票资产占基金资产净值的比例限制。
7.3 期末按行业分类的股票投资组合

Table with 4 columns: 代码 (Code), 行业类别 (Industry Category), 公允价值(元) (Fair Value), 占基金资产净值比例(%) (Percentage of Net Asset Value). Shows the fund's industry exposure.

注:本基金的投资组合符合《证券投资基金运作管理办法》第二十一条关于股票资产占基金资产净值的比例限制。
7.4 期末按行业分类的股票投资组合

Table with 4 columns: 代码 (Code), 行业类别 (Industry Category), 公允价值(元) (Fair Value), 占基金资产净值比例(%) (Percentage of Net Asset Value). Shows the fund's industry exposure.

注:本基金的投资组合符合《证券投资基金运作管理办法》第二十一条关于股票资产占基金资产净值的比例限制。
7.5 期末按行业分类的股票投资组合

Table with 4 columns: 代码 (Code), 行业类别 (Industry Category), 公允价值(元) (Fair Value), 占基金资产净值比例(%) (Percentage of Net Asset Value). Shows the fund's industry exposure.

注:本基金的投资组合符合《证券投资基金运作管理办法》第二十一条关于股票资产占基金资产净值的比例限制。
7.6 期末按行业分类的股票投资组合

Table with 4 columns: 代码 (Code), 行业类别 (Industry Category), 公允价值(元) (Fair Value), 占基金资产净值比例(%) (Percentage of Net Asset Value). Shows the fund's industry exposure.

注:本基金的投资组合符合《证券投资基金运作管理办法》第二十一条关于股票资产占基金资产净值的比例限制。
7.7 期末按行业分类的股票投资组合

Table with 4 columns: 代码 (Code), 行业类别 (Industry Category), 公允价值(元) (Fair Value), 占基金资产净值比例(%) (Percentage of Net Asset Value). Shows the fund's industry exposure.

注:本基金的投资组合符合《证券投资基金运作管理办法》第二十一条关于股票资产占基金资产净值的比例限制。
7.8 期末按行业分类的股票投资组合

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
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
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 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名股指期货合约投资明细

Table with 3 columns: 序号 (Serial Number), 名称 (Name), 金额 (Amount). Shows the fund's top holdings.

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细
7.12.5 期末持有的处于转股期的可转换债券
7.12.6 期末持有的处于转股期的可转换债券
7.12.7 期末持有的处于转股期的可转换债券

7.12.8 期末持有的处于转股期的可转换债券
7.12.9 期末持有的处于转股期的可转换债券
7.12.10 期末持有的处于转股期的可转换债券

7.12.11 期末持有的处于转股期的可转换债券
7.12.12 期末持有的处于转股期的可转换债券

7.12.13 期末持有的处于转股期的可转换债券
7.12.14 期末持有的处于转股期的可转换债券

7.12.15 期末持有的处于转股期的可转换债券
7.12.16 期末持有的处于转股期的可转换债券

7.12.17 期末持有的处于转股期的可转换债券
7.12.18 期末持有的处于转股期的可转换债券

7.12.19 期末持有的处于转股期的可转换债券
7.12.20 期末持有的处于转股期的可转换债券

7.12.21 期末持有的处于转股期的可转换债券
7.12.22 期末持有的处于转股期的可转换债券

7.12.23 期末持有的处于转股期的可转换债券
7.12.24 期末持有的处于转股期的可转换债券

7.12.25 期末持有的处于转股期的可转换债券
7.12.26 期末持有的处于转股期的可转换债券

7.12.27 期末持有的处于转股期的可转换债券
7.12.28 期末持有的处于转股期的可转换债券

7.12.29 期末持有的处于转股期的可转换债券
7.12.30 期末持有的处于转股期的可转换债券

7.12.31 期末持有的处于转股期的可转换债券
7.12.32 期末持有的处于转股期的可转换债券

7.12.33 期末持有的处于转股期的可转换债券
7.12.34 期末持有的处于转股期的可转换债券

7.12.35 期末持有的处于转股期的可转换债券
7.12.36 期末持有的处于转股期的可转换债券

7.12.37 期末持有的处于转股期的可转换债券
7.12.38 期末持有的处于转股期的可转换债券

7.12.39 期末持有的处于转股期的可转换债券
7.12.40 期末持有的处于转股期的可转换债券

7.12.41 期末持有的处于转股期的可转换债券
7.12.42 期末持有的处于转股期的可转换债券

7.12.43 期末持有的处于转股期的可转换债券
7.12.44 期末持有的处于转股期的可转换债券

7.12.45 期末持有的处于转股期的可转换债券
7.12.46 期末持有的处于转股期的可转换债券

7.12.47 期末持有的处于转股期的可转换债券
7.12.48 期末持有的处于转股期的可转换债券

7.12.49 期末持有的处于转股期的可转换债券
7.12.50 期末持有的处于转股期的可转换债券

7.12.51 期末持有的处于转股期的可转换债券
7.12.52 期末持有的处于转股期的可转换债券

7.12.53 期末持有的处于转股期的可转换债券
7.12.54 期末持有的处于转股期的可转换债券

7.12.55 期末持有的处于转股期的可转换债券
7.12.56 期末持有的处于转股期的可转换债券

7.12.57 期末持有的处于转股期的可转换债券
7.12.58 期末持有的处于转股期的可转换债券

7.12.59 期末持有的处于转股期的可转换债券
7.12.60 期末持有的处于转股期的可转换债券

7.12.61 期末持有的处于转股期的可转换债券
7.12.62 期末持有的处于转股期的可转换债券

7.12.63 期末持有的处于转股期的可转换债券
7.12.64 期末持有的处于转股期的可转换债券

7.12.65 期末持有的处于转股期的可转换债券
7.12.66 期末持有的处于转股期的可转换债券

7.12.67 期末持有的处于转股期的可转换债券
7.12.68 期末持有的处于转股期的可转换债券

7.12.69 期末持有的处于转股期的可转换债券
7.12.70 期末持有的处于转股期的可转换债券

7.12.71 期末持有的处于转股期的可转换债券
7.12.72 期末持有的处于转股期的可转换债券

7.12.73 期末持有的处于转股期的可转换债券
7.12.74 期末持有的处于转股期的可转换债券

7.12.75 期末持有的处于转股期的可转换债券
7.12.76 期末持有的处于转股期的可转换债券

7.12.77 期末持有的处于转股期的可转换债券
7.12.78 期末持有的处于转股期的可转换债券