大成健康产业股票型证券投资基金

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。

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	71,143,716.40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	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,实施行业配置;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。 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。
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与投资者服务部

§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	-6,779,404.51
本期利润	-5,410,195.66
加权平均基金份额本期利润	-0.0964
本期基金份额净值增长率	-6.26%
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	-0.0112
期末基金资产净值	70,344,580.31
期末基金份额净值	0.989

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。

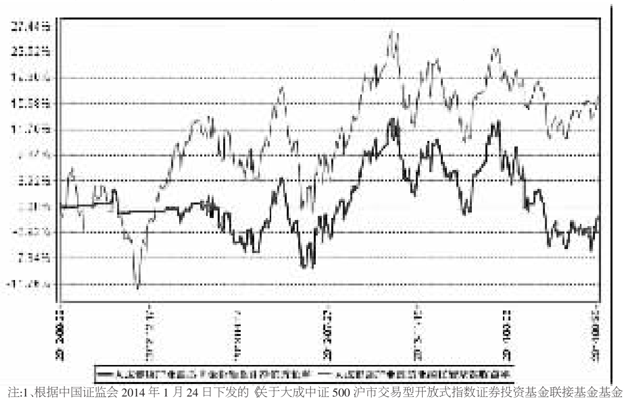
3.2 基金净值表现

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
过去一个月	2.49%	0.97%	2.42%	0.65%	0.07%	0.32%
过去三个月	-0.90%	0.98%	1.79%	0.77%	-2.69%	0.21%
过去六个月	-6.26%	1.23%	-0.05%	1.00%	-6.21%	0.23%
过去一年	8.68%	1.23%	17.80%	1.20%	-9.12%	0.03%
自基金合同生效起至今	-1.10%	1.06%	17.20%	1.29%	-18.30%	-0.23%

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,本基金仍处于建仓期。

3、本基金自2014年1月24日(基金合同生效日)至报告期末的基金份额净值增长率为-4.54%,同期业绩比较基准收益率为1.44%。

4、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。

§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		
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
曹雄飞先生	本基金基金经理	2014年2月17日	2014年6月25日	15年	北京大学中国经济研究中心国际金融硕士。曾任职于招商证券北京地区总部、鹏华基金管理公司、景顺长城基金管理公司、大成基金管理公司、建信基金管理有限责任公司等,曾担任行业研究员、宏观经济及投资策略研究员、市场销售和市场推广以及基金经理助理、基金经理等职。2006年1月至2007年6月曾任大成精选增值混合型证券投资基金基金经理;2007年10月至2008年11月曾任建信优选成长股票型证券投资基金基金经理。2008年12月加入大成基金管理有限公司曾担任研究部总监。2009年3月至2010年8月曾任大成精选增值混合型证券投资基金基金经理;2013年3月8日至2014年4月24日担任大成行业轮动股票型证券投资基金基金经理,2010年2月12日至2014年6月25日担任大成财富管理2020生命周期证券投资基金基金经理,2014年2月17日至2014年6月25日担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
苏秉毅先生	本基金基金经理	2014年1月24日	2014年2月17日	10年	经济学硕士。2004年9月至2008年5月就职于华夏基金管理有限公司基金运作部。2008年加入大成基金管理有限公司,历任产品设计师、高级产品设计师、基金经理助理、基金经理。2011年3月3日至2012年2月8日担任深证成长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基金经理助理。2012年8月28日至2014年1月23日担任大成中证500沪市交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理。2014年1月24日至2014年2月17日任大成健康产业股票型证券投资基金基金经理。2012年2月9日起担任深证成长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基金经理。2012年8月24日起任中证500沪市交易型开放式指数证券投资基金基金经理。2013年1月1日开始兼任大成沪深300指数证券投资基金基金经理。2013年2月7日起任大成中证100交易型开放式指数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助理。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》、《大成健康产业股票型证券投资基金基金合同》、《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。

4.3.2 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。

4.4 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

从海外经济情况来看,美国一季度经济有所放缓,但二季度逐渐恢复,其中居民消费保持温和回升、企业资本支出改善。但自3月份以来通胀持续上升,需要重视如果通胀加速上升后美联储可能会采取超预期的紧缩措施。欧元区在二季度延续复苏势头,结构上和一季度情况类似,以德国为首各国普遍出现回暖迹象。5月份欧洲经济景气指数升至11年7月以来的新高。从目前情况看,欧元区服务业回暖、就业改善,各国复苏逐渐均衡,有助于欧元区通胀回升。在经济扩张的背景下,道琼斯工业指数、纳斯达克指数、法国CAC40指数和德国DAX指数均创新高。

国内经济情况受中央的一系列结构性刺激政策影响开始显现,中国经济一季度下滑的态势在二季度出现改观,经济逐渐出现企稳回升的迹象。中央的财政政策力度加大,居民消费相对平稳,为了抵抗房地产行业可能存在的加速下滑风险把经济拖入泥潭,因此货币政策也逐渐加大了刺激的力度:从微刺激过渡至全面放松。但这一轮政府对经济的刺激较为温和,主要的目的在于确保经济平稳,为改革争取更多的时间,而非刺激经济大幅回升。

在宏观经济的背景下,上半年市场整体先跌后企稳,上证综指下跌3.20%、沪深300下跌7.08%、中小板下跌3.72%。由于传统蓝筹股行情低迷,市场对于新兴经济和题材股表现出较高热情,上半年创业板表现明显好于其他指数,创业板上半年上涨7.69%。

本基金1月24日转型以来截止6月30日仍然处于建仓期。

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0.989元,本报告期基金份额净值增长率为-6.26%,同期业绩比较基准收益率为-0.05%,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

尽管全球经济环境有所回暖,但是经济整体局面仍然不明朗,在国内外经济政治局势的综合考虑下,我们认为经济转型是2014年经济形势的主题,新兴产业投资依然是我们需要关注的方向。

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,一方面医疗服务和医疗仪器则面临更好的成长环境,其中创新力强、在新兴领域预先投入的公司有望在复杂的竞争环境中获得优势;另一方面部分蓝筹股经过半年的调整已经具备长期投资价值。我们会根据中报情况筛选前景广阔,业绩优异的公司重点配置。

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,截止报告期末未与外部估值定价服务机构签约。

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。

§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:大成健康产业股票型证券投资基金

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	7,073,519.15	14,075,300.25
结算备付金	583,198.81	-
存出保证金	53,336.23	11,514.96
交易性金融资产	61,524,756.71	49,913,189.15
其中:股票投资	61,524,756.71	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	1,748,140.86	88,234.00
应收利息	1,674.68	4,482.07
应收股利	-	-
应收申购款	56,288.27	105,541.38
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	1,488.88
资产总计	71,040,914.71	64,199,750.69
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	-	9,536,219.35
应付赎回款	184,172.85	137,085.68
应付管理人报酬	85,241.45	3,791.22
应付托管费	14,206.93	758.24
应付销售服务费	-	-
应付交易费用	272,300.55	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	140,412.62	130,477.23
负债合计	696,334.40	9,850,417.48
所有者权益:		
实收基金	71,143,716.40	51,540,055.08
未分配利润	-799,136.09	2,809,278.13
所有者权益合计	70,344,580.31	54,349,333.21
负债和所有者权益总计	71,040,914.71	64,199,750.69

注:报告截止日2014年6月30日,基金份额净值0.989元,基金份额总额71,143,716.40份。

6.2 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	-3,974,272.79	-2,186,692.42
1.利息收入	41,316.69	82,479.95
其中:存款利息收入	41,316.69	82,479.95
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)	-5,462,556.01	424,102.42
其中:股票投资收益	-7,561,324.68	-789,395.39
基金投资收益	1,857,349.56	1,213,318.56
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	241,419.11	179.25
3.公允价值变动收益(损失以“-”号填列)	1,369,208.85	-2,882,219.02
4.汇兑收益(损失以“-”号填列)	-	-
5.其他收入(损失以“-”号填列)	77,757.68	188,944.23
减:二、费用	1,435,922.87	277,392.14
1.管理人报酬	365,855.25	38,172.65
2.托管费	61,013.92	7,634.63
3.销售服务费	-	-
4.交易费用	826,603.23	153,645.07
5.利息支出	-	-
其中:卖出回购金融资产支出	-	-
6.其他费用	182,450.47	77,939.79
三、利润总额(亏损总额以“-”号填列)	-5,410,195.66	-2,464,084.56
减:所得税费用	-	-
四、净利润(净亏损以“-”号填列)	-5,410,195.66	-2,464,084.56

6.3 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)	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)	-	-5,410,195.66	-5,410,195.66
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)	19,603,661.32	1,801,781.44	21,405,442.76
其中:1.基金申购款	79,146,894.95	4,952,810.22	84,099,705.17
2.基金赎回款	-59,543,233.63	-3,151,028.78	-62,694,262.41
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)	71,143,716.40	-799,136.09	70,344,580.31
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)	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)	-	-2,464,084.56	-2,464,084.56
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)	-4,022,155.60	-1,959,341.59	-5,981,497.19
其中:1.基金申购款	147,405,531.41	-2,232,324.03	145,173,207.38
2.基金赎回款	-151,427,687.01	272,982.44	-151,154,704.57
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)	52,920,839.66	-4,756,422.79	48,164,416.87

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、会计估计与最近一期年度报告一致的说明

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告一致。

6.4.2 税项

6.4.2.1 印花税

经国务院批准,财政部、国家税务总局研究决定,自2008年4月24日起,调整证券(股票)交易印花税税率,由原先的3‰调整为1‰;

经国务院批准,财政部、国家税务总局研究决定,自2008年9月19日起,调整由出让方按证券(股票)交易印花税税率缴纳印花税,受让方不再征收,税率不变;

根据财政部、国家税务总局财税字[2005]103号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》的规定,股权分置改革过程中因非流通股股东向流通股股东支付对价而发生的股权转让,暂免征收印花税。

6.4.2.2 营业税、企业所得税

根据财政部、国家税务总局财税字[2004]78号文《关于证券投资基金税收政策的通知》的规定,自2004年1月1日起,对证券投资基金(封闭式证券投资基金,开放式证券投资基金)管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入,继续免征营业税和企业所得税;

根据财政部、国家税务总局财税字[2005]103号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》的规定,股权分置改革中非流通股股东通过对价方式向流通股股东支付的股份、现金等收入,暂免征收流通股股东应缴纳的企业所得税;

根据财政部、国家税务总局财税[2008]1号文《关于企业所得税若干优惠政策的通知》的规定,对证券投资基金从证券市场中取得的收入,包括买卖股票、债券的差价收入,股权的股息、红利收入,债券的利息收入及其他收入,暂不征收企业所得税。

6.4.2.3 个人所得税

根据财政部、国家税务总局财税字[2002]128号文《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》的规定,对基金取得的股票的股息、红利收入、债券的利息收入及储蓄利息收入,由上市公司、债券发行企业及金融机构在向基金派发股息、红利收入、债券的利息收入及储蓄利息收入时代扣代缴20%的个人所得税;

根据财政部、国家税务总局财税[2008]132号《财政部国家税务总局关于储蓄存款利息所得有关个人所得税政策的通知》,自2008年10月9日起暂免征收储蓄存款利息所得个人所得税;

根据财政部、国家税务总局财税字[2005]107号文《关于股息红利有关个人所得税政策的补充通知》的规定,自2005年6月13日起,对证券投资基金从上市公司分配取得的股息红利所得,按照财税[2005]102号文规定,扣缴义务人在代扣代缴个人所得税时,减按50%计算应纳税所得额;

根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2012]85号文《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》的规定,自2013年1月1日起,个人从公开发行和转让市场取得的上市公司股票,持股期限在1个月以内(含1个月)的,其股息红利所得全额计入应纳税所得额;持股期限在1个月以上至1年(含1年)的,暂减按50%计入应纳税所得额;持股期限超过1年的,暂减按25%计入应纳税所得额。上述所得统一适用20%的税率计征个人所得税;

根据财政部、国家税务总局财税字[2005]103号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》的规定,股权分置改革中非流通股股东通过对价方式向流通股股东支付的股份、现金等收入,暂免征收流通股股东应缴纳的个人所得税。

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,大成健康产业股票型证券投资基金与中证500沪市交易型开放式指数证券投资基金不存在关联方关系。

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

6.4.4.1.1 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6月30日		上年度可比期间 2013年1月1日至2013年6月30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	42,480,875.61	7.69%	-	0.00%

6.4.4.1.2 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。

6.4.4.1.3 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6月30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	37,592.18	7.61%	37,592.18	13.81%
关联方名称	上年度可比期间 2013年1月1日至2013年6月30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	-	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的净额列示。权证交易不计佣金。

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。

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	365,855.25	38,172.65
其中:支付销售机构的客户维护费	144,351.64	31,078.97

注:本基金的管理费按前一日基金资产净值的1.5%年费率计提。管理费的计算方法如下:

H=E×1.5%÷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

基金管理费每日计提,按月支付。经基金管理人与基金托管人核对一致后,由基金托管人于次月首日起3个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。若遇法定节假日、休息日,支付日相应顺延。

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	61,013.92	7,634.63

注: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×0.25%÷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

基金托管费每日计提,按月支付。经基金管理人与基金托管人核对一致后,由基金托管人于次月首日起3个工作日内从基金财产中一次性支付给基金托管人。若遇法定节假日、休息日,支付日相应顺延。

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

本基金本报告期及上年度可比期间未与关联方进行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

份额单位:份

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
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	7.06%	9.49%

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。

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

本基金除基金管理人之外的其他关联方于本报告期末未持有本基金份额。

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
中国银行股份有限公司	7,073,519.15	37,228.42	3,687,274.41	47,406.98

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。

6.4.4.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金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。

6.4.4.7 其他关联交易事项的说明

本基金本期及上年度可比期间无其他关联交易事项。

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

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。

6.4.5.2 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
300323	华灿光电	2014/4/28	重大事项	18.68	2014/7/28	11.21	109,944	2,244,489.82	2,053,753.92	-

6.4.5.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

本基金本期末未持有债券正回购交易中作为抵押的债券。

§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	61,524,756.71	86.60
	其中:股票	61,524,756.71	86.60
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	7,656,717.96	10.78
7	其他各项资产	1,859,440.04	2.62
8	合计	71,040,914.71	100.00

7.2 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(元)	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	51,282,741.41	72.90
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	3,623,200.00	5.15
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	1,729,914.00	2.46
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	1,340,000.00	1.90
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	2,520,201.30	3.58
R	文化、体育和娱乐业	-	0.00
S	综合	1,028,700.00	1.46
	合计	61,524,756.71	87.46

7.3 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	002219	恒康医疗	140,000	3,077,200.00	4.37
2	000963	华东医药	55,000	2,970,000.00	4.22
3	002433	太安堂	275,104	2,833,571.20	4.03
4	300147	香雪制药	104,917	2,832,759.00	4.03
5	002390	信邦制药	130,000	2,765,100.00	3.93
6	002030	达安基因	139,870	2,720,471.50	3.87
7	600079	人福医药	90,000	2,686,500.00	3.82
8	000739	普洛药业	416,000	2,649,920.00	3.77
9	300015	爱尔眼科	99,945	2,432,661.30	3.46
10	002020	京新药业	120,000	2,160,000.00	3.07

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。

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 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	002022	科华生物	7,509,409.54	13.82
2	002390	信邦制药	6,816,043.52	12.54
3	000538	云南白药	6,768,350.79	12.45
4	300273	和佳股份	6,734,550.00	12.39
5	600699	均胜电子	6,362,671.64	11.71
6	002626	金达威	6,227,743.83	11.46
7	600079	人福医药	6,194,433.86	11.40
8	300146	汤臣倍健	5,616,324.69	10.33
9	600276	恒瑞医药	5,374,219.82	9.89
10	002219	恒康医疗	5,190,035.63	9.55
11	300323	华灿光电	5,181,196.02	9.53
12	300015	爱尔眼科	4,995,975.50	9.19
13	600330	天通股份	4,816,184.74	8.86
14	002475	立讯精密	4,714,298.14	8.67
15	600518	康美药业	4,652,265.63	8.56
16	002008	大族激光	4,421,252.70	8.13
17	600252	中恒集团	4,009,674.55	7.38
18	600261	阳光照明	4,006,851.71	7.37
19	002555	顺荣股份	3,955,725.72	7.28
20	000739	普洛药业	3,778,016.10	6.95
21	002454	松芝股份	3,741,580.14	6.88
22	002595	豪迈科技	3,627,290.51	6.67
23	002030	达安基因	3,625,879.38	6.67
24	300011	鼎汉技术	3,616,426.23	6.65
25	300246	宝莱特	3,298,249.57	6.07
26	601633	长城汽车	3,273,474.98	6.02
27	002131	利欧股份	3,257,897.77	5.99
28	002678	珠江钢琴	3,221,319.85	5.93
29	600759	正和股份	3,212,177.01	5.91
30	600511	国药股份	3,164,514.02	5.82
31	002577	雷柏科技	2,974,417.34	5.47
32	600332	白云山	2,963,260.43	5.45
33	300206	理邦仪器	2,951,489.48	5.43
34	300026	红日药业	2,948,336.44	5.42
35	300147	香雪制药	2,929,352.60	5.39
36	002433	太安堂	2,882,062.24	5.30
37	300298	三诺生物	2,877,911.52	5.30
38	002437	誉衡药业	2,858,076.02	5.26
39	300150	世纪瑞尔	2,815,105.50	5.18
40	600720	祁连山	2,683,364.50	4.94
41	000597	东北制药	2,681,575.40	4.93
42	000963	华东医药	2,587,551.00	4.76
43	002223	鱼跃医疗	2,510,993.94	4.62
44	000895	双汇发展	2,509,525.95	4.62
45	000705	浙江震元	2,499,109.40	4.60
46	002551	尚荣医疗	2,440,255.92	4.49
47	002550	千红制药	2,424,528.63	4.46
48	600196	复星医药	2,420,684.75	4.45
49	300253	卫宁软件	2,366,842.00	4.35
50	002709	天赐材料	2,298,739.40	4.23
51	601222	林洋电子	2,282,304.09	4.20
52	000028	国药一致	2,278,509.44	4.19
53	002271	东方雨虹	2,174,620.21	4.00
54	002594	比亚迪	2,080,098.56	3.83
55	002020	京新药业	2,063,289.59	3.80
56	600535	天士力	2,012,583.83	3.70
57	000997	新大陆	1,980,740.40	3.64
58	000919	金陵药业	1,925,598.50	3.54
59	600587	新华医疗	1,817,906.72	3.34
60	002249	大洋电机	1,802,774.20	3.32
61	000681	远东股份	1,802,007.21	3.32
62	002711	欧浦钢网	1,799,486.00	3.31
63	601607	上海医药	1,791,479.44	3.30
64	600594	益佰制药	1,766,599.42	3.25
65	300059	东方财富	1,745,382.81	3.21
66	002279	久其软件	1,690,810.08	3.11
67	002547	春兴精工	1,684,432.62	3.10
68	600422	昆明制药	1,675,106.98	3.08
69	600584	长电科技	1,673,795.98	3.08
70	600519	贵州茅台	1,649,878.38	3.04
71	600867	通化东宝	1,636,472.40	3.01
72	300233	金城医药	1,628,430.00	3.00
73	600884	杉杉股份	1,618,683.00	2.98
74	002004	华邦颖泰	1,550,129.00	2.85
75	000988	华工科技	1,546,055.50	2.84
76	300326	凯利泰	1,538,136.20	2.83
77	601998	中信银行	1,535,700.00	2.83
78	300178	腾邦国际	1,535,285.12	2.82
79	300003	乐普医疗	1,534,468.21	2.82
80	000401	冀东水泥	1,504,470.00	2.77
81	002603	以岭药业	1,450,847.04	2.67
82	300255	常山药业	1,383,337.90	2.55
83	000516	开元投资	1,371,211.00	2.52
84	300289	利德曼	1,352,799.58	2.49
85	002398	建研集团	1,333,481.56	2.45
86	600718	东软集团	1,323,900.00	2.44
87	300098	高新兴	1,315,353.00	2.42
88	002653	海思科	1,295,211.27	2.38
89	002286	保龄宝	1,277,606.92	2.35
90	300347	泰格医药	1,254,771.86	2.31
91	600351	亚宝药业	1,232,243.00	2.27
92	300194	福安药业	1,205,115.33	2.22
93	600329	中新药业	1,203,981.40	2.22
94	002382	蓝帆股份	1,200,702.50	2.21
95	000788	北大医药	1,151,373.00	2.12
96	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。

7.4.2 累计卖出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	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	000538	云南白药	6,963,678.68	12.81
2	002626	金达威	6,505,240.59	11.97
3	600699	均胜电子	5,943,380.32	10.94
4	002022	科华生物	5,887,070.00	10.83
5	002475	立讯精密	4,887,037.38	8.99
6	600330	天通股份	4,732,375.88	8.71
7	300146	汤臣倍健	4,595,402.14	8.46
8	300273	和佳股份	4,560,667.29	8.39
9	002008	大族激光	4,423,901.18	8.14
10	600518	康美药业	4,399,182.91	8.09
11	002390	信邦制药	3,983,410.76	7.33
12	600261	阳光照明	3,955,335.37	7.28
13	600252	中恒集团	3,772,794.48	6.94
14	002454	松芝股份	3,749,742.81	6.90
15	002595	豪迈科技	3,684,639.13	6.78
16	600276	恒瑞医药	3,680,542.23	6.77
17	600079	人福医药	3,631,410.54	6.68
18	600759	正和股份	3,564,519.72	6.56
19	600511	国药股份	3,532,156.25	6.50
20	002131	利欧股份	3,210,667.85	5.91
21	601633	长城汽车	3,135,742.82	5.77
22	002678	珠江钢琴	3,027,426.07	5.57
23	600332	白云山	2,942,189.82	5.41
24	300323	华灿光电	2,927,836.47	5.39
25	002577	雷柏科技	2,888,289.93	5.31
26	300150	世纪瑞尔	2,877,018.39	5.29
27	600720	祁连山	2,875,135.77	5.29
28	300026	红日药业	2,724,652.77	5.01
29	000597	东北制药	2,627,150.00	4.83
30	002223	鱼跃医疗	2,521,632.85	4.64
31	000895	双汇发展	2,497,544.40	4.60
32	300206	理邦仪器	2,360,315.00	4.34
33	002551	尚荣医疗	2,341,424.68	4.31
34	601222	林洋电子	2,286,438.30	4.21
35	300246	宝莱特	2,262,227.30	4.16
36	002271	东方雨虹	2,250,484.36	4.14
37	002709	天赐材料	2,223,740.80	4.09
38	300298	三诺生物	2,212,000.23	4.07
39	600196	复星医药	2,146,057.17	3.95
40	002219	恒康医疗	2,133,475.46	3.93
41	600594	益佰制药	2,125,334.77	3.91
42	300011	鼎汉技术	2,105,120.87	3.87
43	000028	国药一致	2,099,403.99	3.86
44	300015	爱尔眼科	2,087,470.14	3.84
45	300253	卫宁软件	2,068,272.48	3.81
46	600422	昆明制药	2,015,225.00	3.71
47	000997	新大陆	1,955,340.11	3.60
48	600584	长电科技	1,944,345.54	3.58
49	002594	比亚迪	1,941,251.20	3.57
50	002279	久其软件	1,939,491.38	3.57
51	002249	大洋电机	1,871,418.50	3.44
52	600535	天士力	1,853,181.92	3.41
53	000705	浙江震元	1,797,234.78	3.31
54	600884	杉杉股份	1,775,970.96	3.27
55	002711	欧浦钢网	1,766,509.00	3.25
56	600519	贵州茅台	1,742,199.89	3.21
57	601607	上海医药	1,680,609.35	3.09
58	002437	誉衡药业	1,668,048.54	3.07
59	002030	达安基因	1,655,963.00	3.05
60	002555	顺荣股份	1,636,155.25	3.01
61	300003	乐普医疗	1,594,098.43	2.93
62	600351	亚宝药业	1,586,313.88	2.92
63	300098	高新兴	1,540,785.29	2.83
64	601998	中信银行	1,525,106.82	2.81
65	000401	冀东水泥	1,518,134.00	2.79
66	000681	远东股份	1,507,465.28	2.77
67	002004	华邦颖泰	1,488,066.35	2.74
68	300178	腾邦国际	1,455,867.00	2.68
69	000988	华工科技	1,443,080.90	2.66
70	300255	常山药业	1,411,488.34	2.60
71	002398	建研集团	1,355,104.50	2.49
72	300326	凯利泰	1,350,487.12	2.48
73	300289	利德曼	1,325,195.32	2.44
74	002286	保龄宝	1,276,113.74	2.35
75	600718	东软集团	1,252,457.01	2.30
76	300194	福安药业	1,211,220.86	2.23
77	000516	开元投资	1,195,160.00	2.20
78	002603	以岭药业	1,188,185.41	2.19
79	000739	普洛药业	1,096,744.00	2.02

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

单位:人民币元

买入股票成本(成交)总额	284,844,010.29
卖出股票收入(成交)总额	267,724,875.75

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。

7.5 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。

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

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。

7.8 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。

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

本基金本报告期末未持有权证。

7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

7.10.1 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。

7.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期未投资股指期货。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.11.1 本期国债期货投资政策

本基金本报告期末投资国债期货。

7.11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末投资国债期货。

7.11.3 本期国债期货投资评价

本基金本报告期未投资国债期货。

7.12 投资组合报告附注

7.12.1 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。

7.12.2 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。

7.12.3 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	53,336.23
2	应收证券清算款	1,748,140.86
3	应收股利	-
4	应收利息	1,674.68
5	应收申购款	56,288.27
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	1,859,440.04

7.12.4 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。

7.12.5 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。

7.12.6 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。

§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
1,099	64,734.96	5,987,745.22	8.42%	65,155,971.18	91.58%

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	2,423.70	0.0034%

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

§9 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	79,146,894.95
减:本报告期基金总赎回份额	59,543,233.63
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	71,143,716.40

§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。

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。

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

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,修改基金合同中的投资策略条款。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。

本基金由“以大成中证500沪市交易型开放式指数证券投资基金作为主要投资标的,方便特定的客户群通过本基金投资大成中证500沪市交易型开放式指数证券投资基金”的投资策略改变为“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,实施行业配置;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。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”的投资策略。

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安永华明会计师事务所(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,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	
招商证券	2	155,626,863.96	28.17%	137,714.10	27.87%	-
中投证券	3	147,568,523.01	26.71%	134,348.16	27.19%	-
中银国际	1	73,824,200.77	13.36%	65,329.03	13.22%	-
光大证券	2	42,480,875.61	7.69%	37,592.18	7.61%	-
湘财证券	1	39,556,028.52	7.16%	36,012.38	7.29%	-
华宝证券	1	39,146,428.58	7.08%	34,640.79	7.01%	-
申银万国	1	36,154,201.43	6.54%	31,992.21	6.48%	-
银河证券	1	11,610,008.51	2.10%	10,569.91	2.14%	-
财富证券	1	4,152,976.13	0.75%	3,675.15	0.74%	-
渤海证券	2	2,428,831.02	0.44%	2,211.04	0.45%	-
安信证券	2	-	0.00%	-	0.00%	-
英大证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
中信证券	2	-	0.00%	-	0.00%	-
中航证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
中金公司	2	-	0.00%	-	0.00%	-
长江证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
东方证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
东海证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
东莞证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
东吴证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
天源证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
万和证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
万联证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
西南证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
华福证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
华林证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
华泰证券	2	-	0.00%	-	0.00%	-
华鑫证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
江海证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
民生证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
民族证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
齐鲁证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
广发证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
广州证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
国都证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
国海证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
国泰君安	1	-	0.00%	-	0.00%	-
国信证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
海通证券	2	-	0.00%	-	0.00%	-

注: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。

本报告期内本基金新增席位:东海证券、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、中信证券、湘财证券、渤海证券、广发证券、西南证券、华福证券、齐鲁证券、华鑫证券、银河证券、招商证券、万和证券。

本报告期内本基金退租席位:无。

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