

大成蓝筹稳健证券投资基金

2013] 第二季度报告

基金管理人:大成基金管理有限公司
基金托管人:中国光大银行股份有限公司
报告送出日期:2013年7月18日

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理本基金,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。

本报告期内财务报表未经审计。

本报告期末2013年4月1日起至6月30日止。

§ 1 重要提示

基金管理人对本基金定期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、准确性和完整性负个别及连带责任。

基金托管人中国银行股份有限公司根据基金合同规定,于2013年7月17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,保证复核后不存在虚假记载、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本基金,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。

本报告期内财务报表未经审计。

本报告期末2013年4月1日起至6月30日止。

§ 2 基金产品概况

基金简称 大成蓝筹稳健混合

交易代码 090003

前端交易代码 090003

后端交易代码 091003

基金运作方式 融资开放式

基金合同生效日 2004年6月3日

报告期末基金份额总额 14,538,161,071.50份

投资目标 通过综合运用基本面投资理念,流动性良好的证券,在控制系统风险的前提下获取收益,从而捕捉运用一系列数量分析方法,有效控制系统性风险,实现基金资产中长期稳定的增值。

投资策略 本基金管理资产的配置利用相对恒定的比例投资组合保险策略(CPPI)来动态调整基金的股票、债券和现金的配置比例,从而配置选取投资积极的策略,以投资基准的绝对收益为基础,以行业研究及比较分析为核算,通过适时的大降底仓应变的权重调整,使整体投资表现跟上市场变化的“仓位”进行“进退法”,优胜出战时低估并寻求良好市场表现,从而价值回撤阶段的相对280指数或个股投资。

业绩比较基准 天相480指数*70%+中证蓝筹国债指数*30%

风险收益特征 本基金属于较低风险类别的股票型基金,适于承受一定风险,追求当期收益和长期资本增值的基金投资人。

基金管理人 大成基金管理有限公司

基金托管人 中国光大银行股份有限公司

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

单位:人民币元

报告期(2013年4月1日 - 2013年6月30日)

1.本期已实现收益 -54,351,502.46

2.本期利润 -439,053,580.17

3.期末平均基金份额利润 -0.0298

4.期末基金资产净值 8,333,333,587.62

5.期末基金份额净值 0.6076

注:1.本期实现收益指基金本期期间利息收入、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,本期利润指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,计算费用后实际收益水平要低于所列数字。

3.2.1 本报告期基金资产净值增长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 收益率标准差④ ①-③ ②-④

过去三个月 -4.81% 1.3% 7.65% 1.04% 2.84% 0.27%

3.2.2 本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

图示:基金净值增长率与同期业绩比较基准收益率的比较

注:按基金合同规定,本基金自基金合同生效之日起6个月内为建仓期。依据本基金2005年8月31日 乾于调整大成蓝筹稳健证券投资基金资产配置比例公告,本基金股票投资比例为基金资产净值的30%-95%,投资股票的比例为基金资产净值的60%-65%,度或到报告日在内的政府债券不抵扣基金资产净值的5%,法律法规另有规定时从其规定。截至报告日本基金的资产配置比例符合基金合同中规定的各项比例。

§ 4 管理人报告

4.1 基金经理或基金经理助理简介

姓名 职务 任本基金的基金经理期间 证券从业年限 说明

施永辉 先生 基金经理,股票投资部副总监 2006年1月21日 16年 在职日期:2006年1月21日至至今担任大成蓝筹稳健证券投资基金基金经理。具有基金从业资格。国籍:中国

注:1.在任职期间,承于即刻向本公司报告。2.2.从业人员的培训情况请参见公司《从业人员管理办法》的相关规定。

4.2 管理人对报告期内基金运作指标的说明

报告期内,本基金代理人严格遵守《基金法》、《证券投资基金法》、《基金管理公司公平交易制度指导意见》的规定,在基金投资运作中,大成蓝筹稳健证券投资基金的投资决策、投资运作、绩效评估、合规监督和风险管理等各个环节均体现了公平交易的原则,未发现任何违反公平交易原则的情况。

本基金代理人严格遵守《基金法》、《证券投资基金法》、《基金管理公司公平交易制度指导意见》的规定,在基金投资运作中,大成蓝筹稳健证券投资基金的投资决策、投资运作、绩效评估、合规监督和风险管理等各个环节均体现了公平交易的原则,未发现任何违反公平交易原则的情况。

4.3 公平交易制度的执行情况

根据《证券投资基金法》公平交易制度指导意见的规定,公司制定了《大成基金管理有限公司公平交易制度》,明确了公平交易的原则、方法、操作要求、异常行为的监控与处理、责任追究等。

本基金代理人严格遵守《基金法》、《证券投资基金法》、《基金管理公司公平交易制度指导意见》的规定,在基金投资运作中,大成蓝筹稳健证券投资基金的投资决策、投资运作、绩效评估、合规监督和风险管理等各个环节均体现了公平交易的原则,未发现任何违反公平交易原则的情况。

4.4 报告期内基金的投顾策略及运用分析

2013年2季度公司旗下所有投资组合间投资交易在3日内完成,不存在不公平交易和利益输送的情况。

2013年3季度经济复苏进入实质性阶段,货币市场利率下行,回购利率和利率期货利率一并走低,资金面宽松,投资组合虽然在货币市场利率下行的同时也存在不公平交易和利益输送的情况。

4.5 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投资交易在3日内完成,不存在不公平交易和利益输送的情况。

4.6 公平交易制度的执行情况

根据《证券投资基金法》公平交易制度指导意见的规定,公司制定了《大成基金管理有限公司公平交易制度》,明确了公平交易的原则、方法、操作要求、异常行为的监控与处理、责任追究等。

本基金代理人严格遵守《基金法》、《证券投资基金法》、《基金管理公司公平交易制度指导意见》的规定,在基金投资运作中,大成蓝筹稳健证券投资基金的投资决策、投资运作、绩效评估、合规监督和风险管理等各个环节均体现了公平交易的原则,未发现任何违反公平交易原则的情况。

4.7 公平交易制度的执行情况

根据《证券投资基金法》公平交易制度指导意见的规定,公司制定了《大成基金管理有限公司公平交易制度》,明确了公平交易的原则、方法、操作要求、异常行为的监控与处理、责任追究等。

本基金代理人严格遵守《基金法》、《证券投资基金法》、《基金管理公司公平交易制度指导意见》的规定,在基金投资运作中,大成蓝筹稳健证券投资基金的投资决策、投资运作、绩效评估、合规监督和风险管理等各个环节均体现了公平交易的原则,未发现任何违反公平交易原则的情况。

4.8 公平交易制度的执行情况

根据《证券投资基金法》公平交易制度指导意见的规定,公司制定了《大成基金管理有限公司公平交易制度》,明确了公平交易的原则、方法、操作要求、异常行为的监控与处理、责任追究等。

本基金代理人严格遵守《基金法》、《证券投资基金法》、《基金管理公司公平交易制度指导意见》的规定,在基金投资运作中,大成蓝筹稳健证券投资基金的投资决策、投资运作、绩效评估、合规监督和风险管理等各个环节均体现了公平交易的原则,未发现任何违反公平交易原则的情况。

4.9 公平交易制度的执行情况

根据《证券投资基金法》公平交易制度指导意见的规定,公司制定了《大成基金管理有限公司公平交易制度》,明确了公平交易的原则、方法、操作要求、异常行为的监控与处理、责任追究等。

本基金代理人严格遵守《基金法》、《证券投资基金法》、《基金管理公司公平交易制度指导意见》的规定,在基金投资运作中,大成蓝筹稳健证券投资基金的投资决策、投资运作、绩效评估、合规监督和风险管理等各个环节均体现了公平交易的原则,未发现任何违反公平交易原则的情况。

4.10 公平交易制度的执行情况

根据《证券投资基金法》公平交易制度指导意见的规定,公司制定了《大成基金管理有限公司公平交易制度》,明确了公平交易的原则、方法、操作要求、异常行为的监控与处理、责任追究等。

本基金代理人严格遵守《基金法》、《证券投资基金法》、《基金管理公司公平交易制度指导意见》的规定,在基金投资运作中,大成蓝筹稳健证券投资基金的投资决策、投资运作、绩效评估、合规监督和风险管理等各个环节均体现了公平交易的原则,未发现任何违反公平交易原则的情况。

4.11 公平交易制度的执行情况

根据《证券投资基金法》公平交易制度指导意见的规定,公司制定了《大成基金管理有限公司公平交易制度》,明确了公平交易的原则、方法、操作要求、异常行为的监控与处理、责任追究等。

本基金代理人严格遵守《基金法》、《证券投资基金法》、《基金管理公司公平交易制度指导意见》的规定,在基金投资运作中,大成蓝筹稳健证券投资基金的投资决策、投资运作、绩效评估、合规监督和风险管理等各个环节均体现了公平交易的原则,未发现任何违反公平交易原则的情况。

4.12 公平交易制度的执行情况

根据《证券投资基金法》公平交易制度指导意见的规定,公司制定了《大成基金管理有限公司公平交易制度》,明确了公平交易的原则、方法、操作要求、异常行为的监控与处理、责任追究等。

本基金代理人严格遵守《基金法》、《证券投资基金法》、《基金管理公司公平交易制度指导意见》的规定,在基金投资运作中,大成蓝筹稳健证券投资基金的投资决策、投资运作、绩效评估、合规监督和风险管理等各个环节均体现了公平交易的原则,未发现任何违反公平交易原则的情况。

4.13 公平交易制度的执行情况

根据《证券投资基金法》公平交易制度指导意见的规定,公司制定了《大成基金管理有限公司公平交易制度》,明确了公平交易的原则、方法、操作要求、异常行为的监控与处理、责任追究等。

本基金代理人严格遵守《基金法》、《证券投资基金法》、《基金管理公司公平交易制度指导意见》的规定,在基金投资运作中,大成蓝筹稳健证券投资基金的投资决策、投资运作、绩效评估、合规监督和风险管理等各个环节均体现了公平交易的原则,未发现任何违反公平交易原则的情况。

4.14 公平交易制度的执行情况

根据《证券投资基金法》公平交易制度指导意见的规定,公司制定了《大成基金管理有限公司公平交易制度》,明确了公平交易的原则、方法、操作要求、异常行为的监控与处理、责任追究等。

本基金代理人严格遵守《基金法》、《证券投资基金法》、《基金管理公司公平交易制度指导意见》的规定,在基金投资运作中,大成蓝筹稳健证券投资基金的投资决策、投资运作、绩效评估、合规监督和风险管理等各个环节均体现了公平交易的原则,未发现任何违反公平交易原则的情况。

4.15 公平交易制度的执行情况

根据《证券投资基金法》公平交易制度指导意见的规定,公司制定了《大成基金管理有限公司公平交易制度》,明确了公平交易的原则、方法、操作要求、异常行为的监控与处理、责任追究等。

本基金代理人严格遵守《基金法》、《证券投资基金法》、《基金管理公司公平交易制度指导意见》的规定,在基金投资运作中,大成蓝筹稳健证券投资基金的投资决策、投资运作、绩效评估、合规监督和风险管理等各个环节均体现了公平交易的原则,未发现任何违反公平交易原则的情况。

4.16 公平交易制度的执行情况

根据《证券投资基金法》公平交易制度指导意见的规定,公司制定了《大成基金管理有限公司公平交易制度》,明确了公平交易的原则、方法、操作要求、异常行为的监控与处理、责任追究等。

本基金代理人严格遵守《基金法》、《证券投资基金法》、《基金管理公司公平交易制度指导意见》的规定,在基金投资运作中,大成蓝筹稳健证券投资基金的投资决策、投资运作、绩效评估、合规监督和风险管理等各个环节均体现了公平交易的原则,未发现任何违反公平交易原则的情况。

4.17 公平交易制度的执行情况

根据《证券投资基金法》公平交易制度指导意见的规定,公司制定了《大成基金管理有限公司公平交易制度》,明确了公平交易的原则、方法、操作要求、异常行为的监控与处理、责任追究等。

本基金代理人严格遵守《基金法》、《证券投资基金法》、《基金管理公司公平交易制度指导意见》的规定,在基金投资运作中,大成蓝筹稳健证券投资基金的投资决策、投资运作、绩效评估、合规监督和风险管理等各个环节均体现了公平交易的原则,未发现任何违反公平交易原则的情况。

4.18 公平交易制度的执行情况

根据《证券投资基金法》公平交易制度指导意见的规定,公司制定了《大成基金管理有限公司公平交易制度》,明确了公平交易的原则、方法、操作要求、异常行为的监控与处理、责任追究等。

本基金代理人严格遵守《基金法》、《证券投资基金法》、《基金管理公司公平交易制度指导意见》的规定,在基金投资运作中,大成蓝筹稳健证券投资基金的投资决策、投资运作、绩效评估、合规监督和风险管理等各个环节均体现了公平交易的原则,未发现任何违反公平交易原则的情况。

4.19 公平交易制度的执行情况

根据《证券投资基金法》公平交易制度指导意见的规定,公司制定了《大成基金管理有限公司公平交易制度》,明确了公平交易的原则、方法、操作要求、异常行为的监控与处理、责任追究等。

本基金代理人严格遵守《基金法》、《证券投资基金法》、《基金管理公司公平交易制度指导意见》的规定,在基金投资运作中,大成蓝筹稳健证券投资基金的投资决策、投资运作、绩效评估、合规监督和风险管理等各个环节均体现了公平交易的原则,未发现任何违反公平交易原则的情况。

4.20 公平交易制度的执行情况

根据《证券投资基金法》公平交易制度指导意见的规定,公司制定了《大成基金管理有限公司公平交易制度》,明确了公平交易的原则、方法、操作要求、异常行为的监控与处理、责任追究等。

本基金代理人严格遵守《基金法》、《证券投资基金法》、《基金管理公司公平交易制度指导意见》的规定,在基金投资运作中,大成蓝筹稳健证券投资基金的投资决策、投资运作、绩效评估、合规监督和风险管理等各个环节均体现了公平交易的原则,未发现任何违反公平交易原则的情况。

4.21 公平交易制度的执行情况

根据《证券投资基金法》公平交易制度指导意见的规定,公司制定了《大成基金管理有限公司公平交易制度》,明确了公平交易的原则、方法、操作要求、异常行为的监控与处理、责任追究等。

本基金代理人严格遵守《基金法》、《证券投资基金法》、《基金管理公司公平交易制度指导意见》的规定,在基金投资运作中,大成蓝筹稳健证券投资基金的投资决策、投资运作、绩效评估、合规监督和风险管理等各个环节均体现了公平交易的原则,未发现任何违反公平交易原则的情况。

4.22 公平交易制度的执行情况

根据《证券投资基金法》公平交易制度指导意见的规定,公司制定了《大成基金管理有限公司公平交易制度》,明确了公平交易的原则、方法、操作要求、异常行为的监控与处理、责任追究等。

本基金代理人严格遵守《基金法》、《证券投资基金法》、《基金管理公司公平交易制度指导意见》的规定,在基金投资运作中,大成蓝筹稳健证券投资基金的投资决策、投资运作、绩效评估、合规监督和风险管理等各个环节均体现了公平交易的原则,未发现任何违反公平交易原则的情况。

4.23 公平交易制度的执行情况

根据《证券投资基金法》公平交易制度指导意见的规定,公司制定了《大成基金管理有限公司公平交易制度》,明确了公平交易的原则、方法、操作要求、异常行为的监控与处理、责任追究等。

本基金代理人严格遵守《基金法》、《证券投资基金法》、《基金管理公司公平交易制度指导意见》的规定,在基金投资运作中,大成蓝筹稳健证券投资基金的投资决策、投资运作、绩效评估、合规监督和风险管理等各个环节均体现了公平交易的原则,未发现任何违反公平交易原则的情况。

4.24 公平交易制度的执行情况

根据《证券投资基金法》公平交易制度指导意见的规定,公司制定了《大成基金管理有限公司公平交易制度》,明确了公平交易的原则、方法