

2013年8月29日 星期四

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:2013年8月29日§ 1 重要提示
基金管理人的董事、监事、经理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。本半年度报告经三分之二以上独立董事审查，通过并由董事长签发。

基金管理人和基金托管公司根据本基金合同规定，于2013年8月28日复核了本报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务报表、投资组合报告等内容，确认复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏。

基金销售代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。

基金过往业绩不代表未来表现。投资有风险，投资者在作出投资决策前应仔细阅读基金的招募说明书和其他相关文件。

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金简称 大成蓝筹稳健混合

基金主代码 090003

前一交易日代码 090003

后一交易日代码 091003

基金运作方式 购买开放式

基金合同生效日 2004年6月3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 14,538,161,071.50份

基金合同存续期 不定期

2.2 基金产品说明

通过精选符合本基金投资理念、流动性良好的证券，在控制非系统风险的前提下获取投资收益，同时辅助运用一些数量分析方法，有效控制系统性风险，实现基金资产的长期稳定增值。

本基金的投资配置策略为修正的恒定比例投资组合保险策略(CPPI)来动态调整基金中股票、债券和现金的配置比例，行业配置采取较为积极的策略，以投资基准的行业权重为基础，以此行业研究及比较分析为核心，通过择时或降低相对行业的投资权重，使整体投资表现超越或超越基准；个股选择策略则采取蓝筹股分散投资策略，运用价值-趋势“选股”方法，挑选出被市场低估且具有良好市场表现，处于价值回归阶段的100只指数成分股进行投资。

§ 3 半年度财务会计报告(未经审计)

6.1 资产负债表

会社注释:大成蓝筹稳健证券投资基金

报告期截至: 2013年6月30日

单位:人民币元

资产 本期末 上年度末

2013年6月30日 2012年12月31日

资产:

银行存款 312,174,447.25 652,637,952.81

结算备付金 7,961,608.75 8,979,998.58

交易保证金 4,395,968.38 3,670,116.00

交易性金融资产 8,526,630,910.44 9,808,591,154.90

其中:股票投资 7,602,582,605.44 9,259,211,154.90

基金投资

债券投资 924,048,305.00 549,380,000.00

资产支持证券投资

衍生金融资产

买入返售金融资产

应收证券清算款

应收利息 10,757,109.46 7,517,083.17

应收股利 16,597,190.56

应收申购款 365,933.39 94,587.96

递延所得税资产 -

预提费用 -

其他资产 -

资产总计 8,878,883,168.23 10,481,308,894.42

负债和所有者权益

本期末 2013年6月30日 上年度末 2012年12月31日

负债:

短期借款

应付票据

应付账款

应付职工薪酬 11,559,026.88 11,931,279.21

应交税费 1,926,504.46 1,988,546.57

应付销售服务费

应付交易费用 4,387,049.29 14,851,638.60

应付交税费 -

应付利息 -

应付股利 -

应付利润 2,067,908.74 2,295,442.42

应付管理人报酬

应付托管费 11,559,026.88 11,931,279.21

应付佣金 1,926,504.46 1,988,546.57

应付销售服务费

应付交易费用

应付交税费 -

应付利息 -

应付股利 -

应付利润 14,851,638.60 14,851,638.60

负债合计 24,857,184.60 286,919,027.95

所有者权益:

实收基金 2,067,908.74 2,295,442.42

未分配利润 11,559,026.88 11,931,279.21

所有者权益总计 14,538,161,071.50 15,790,605.57

负债和所有者权益总计 14,538,161,071.50 15,790,605.57

注:1.本期实现收益指收益基金本期利息收入、投资收益、其他收入、不含公允价值变动收益扣除期间费用后的余额，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.所列基金业绩指标不包括待持有人认购或赎回基金时产生的费用，计算后实际收益水平要低于所列数据。

3.基金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 增长率比较基 准差 (%) ①-③ (%) ②-④ (%)

过去一个月 -11.25% 1.68% -11.12% 1.35% -0.13% 0.33%

过去二个月 -4.81% 1.31% -7.65% 1.04% 2.84% 0.27%

过去六个月 -5.75% 1.45% -8.21% 1.08% 2.46% 0.37%

过去一年 -5.05% 1.34% -5.80% 0.98% 0.75% 0.36%

过去三年 -7.12% 1.32% -5.78% 0.97% -1.34% 0.35%

自基金合同生效以来 165.47% 1.54% 73.91% 1.29% 91.56% 0.25%

3.2.2 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的比较

注:按基金合同规定，本基金基金合同生效之日起进入建仓期。依据本基金2005年6月31日，对于股票型基金，本报告期内本基金的平均仓位为65%，即本基金在建仓期内股票投资仓位占基金资产净值的30%-65%，当基金达到建仓期时，即以该时点的基金资产净值占基金总资产净值的5%的法律比例为准定期时从其规定。截至报告日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。

§ 4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

基金管理人:大成基金管理有限公司之一，注册资本为人民币1亿元人民币，注册地为深圳。

公司由四家股东组成，分别为中信信托有限责任公司48%，光大证券股份有限公司25%，中国银河基金管理有限公司5%，东证资产管理有限公司5%。截至2013年6月30日，本基金持有人共1,000户，其中机构持有人数占95%以上。

4.1.1 基金管理人及基金经理情况

大成基金管理有限公司系中国证监会批准成立的首批基金管理公司之一，注册资本为人民币1亿元人民币，注册地为深圳。

公司由四家股东组成，分别为中信信托有限责任公司48%，光大证券股份有限公司25%，中国银河基金管理有限公司5%，东证资产管理有限公司5%。

4.1.2 基金管理人对报告期内基金运作的总体评价

报告期内，本基金运作正常，没有出现违法违规行为。

4.1.3 基金管理人对宏观经济、证券市场及基金走势的展望

本基金将密切关注宏观经济形势，把握经济运行脉搏，结合宏观经济政策，适时调整投资策略。

4.1.4 基金管理人对基金产品的未来业绩做出的预测

4.1.5 基金管理人对报告期内基金估值政策和核算方法的说明

4.1.6 基金管理人对报告期内基金利润分配政策的说明

4.1.7 基金管理人对基金持续经营能力的说明

4.1.8 基金管理人对报告期内基金的风险揭示

4.1.9 基金管理人对基金投资组合的说明

4.1.10 基金管理人对基金投资组合的流动性风险评价

4.1.11 基金管理人对基金投资组合的信用风险评价

4.1.12 基金管理人对基金投资组合的流动性风险评价

4.1.13 基金管理人对基金投资组合的流动性风险评价

4.1.14 基金管理人对基金投资组合的流动性风险评价

4.1.15 基金管理人对基金投资组合的流动性风险评价

4.1.16 基金管理人对基金投资组合的流动性风险评价

4.1.17 基金管理人对基金投资组合的流动性风险评价

4.1.18 基金管理人对基金投资组合的流动性风险评价

4.1.19 基金管理人对基金投资组合的流动性风险评价

4.1.20 基金管理人对基金投资组合的流动性风险评价

4.1.21 基金管理人对基金投资组合的流动性风险评价

4.1.22 基金管理人对基金投资组合的流动性风险评价

4.1.23 基金管理人对基金投资组合的流动性风险评价

4.1.24 基金管理人对基金投资组合的流动性风险评价

4.1.25 基金管理人对基金投资组合的流动性风险评价

4.1.26 基金管理人对基金投资组合的流动性风险评价

4.1.27 基金管理人对基金投资组合的流动性风险评价

4.1.28 基金管理人对基金投资组合的流动性风险评价

4.1.29 基金管理人对基金投资组合的流动性风险评价

4.1.30 基金管理人对基金投资组合的流动性风险评价

4.1.31 基金管理人对基金投资组合的流动性风险评价

4.1.32 基金管理人对基金投资组合的流动性风险评价

4.1.33 基金管理人对基金投资组合的流动性风险评价

4.1.34 基金管理人对基金投资组合的流动性风险评价

4.1.35 基金管理人对基金投资组合的流动性风险评价

4.1.36 基金管理人对基金投资组合的流动性风险评价

4.1.37 基金管理人对基金投资组合的流动性风险评价

4.1.38 基金管理人对基金投资组合的流动性风险评价

4.1.39 基金管理人对基金投资组合的流动性风险评价

4.1.40 基金管理人对基金投资组合的流动性风险评价

4.1.41 基金管理人对基金投资组合的流动性风险评价

4.1.42 基金管理人对基金投资组合的流动性风险评价

4.1.43 基金管理人对基金投资组合的流动性风险评价

4.1.44 基金管理人对基金投资组合的流动性风险评价

4.1.45 基金管理人对基金投资组合的流动性风险评价

4.1.46 基金管理人对基金投资组合的流动性风险评价

4.1.47 基金管理人对基金投资组合的流动性风险评价

4.1.48 基金管理人对基金投资组合的流动性风险评价

4.1.49 基金管理人对基金投资组合的流动性风险评价

4.1.50 基金管理人对基金投资组合的流动性风险评价

4.1.51 基金管理人对基金投资组合的流动性风险评价

4.1.52 基金管理人对基金投资组合的流动性风险评价

4.1.53 基金管理人对基金投资组合的流动性风险评价

4.1.54 基金管理人对基金投资组合的流动性风险评价

4.1.55 基金管理人对基金投资组合的流动性风险评价

4.1.56 基金管理人对基金投资组合的流动性风险评价

4.1.57 基金管理人对基金投资组合的流动性风险评价

4.1.58 基金管理人对基金投资组合的流动性风险评价

4.1.59 基金管理人对基金投资组合的流动性风险评价

4.1.60 基金管理人对基金投资组合的流动性风险评价