

# 信息披露 Disclosure

## 大成蓝筹稳健证券投资基金

### 【2015】半年度报告摘要

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2015年1月1日至2015年6月30日		上年度可比期间 2014年1月1日至2014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	1,189,445,119.68	8.31%	1,928,411,768.46	12.78%

6.4.3.1.2 权证交易  
本基金本报告期及上年度可比期间未通过关联方交易单元进行权证交易。

6.4.3.1.3 应支付关联方的佣金  
金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2015年1月1日至2015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	1,063,404.41	82.2%	675,688.39	87.7%
	上年度可比期间			

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券费和经手费后的净额列示。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。

6.4.3.2 关联方管理费  
6.4.3.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	2015年1月1日至2015年6月30日	2014年1月1日至2014年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	63,362,917.96	55,729,506.63
其中：支付给销售机构的各项费用	12,963,581.68	11,004,949.18

注：支付基金管理人大成基金的基金管理人报酬按前一日基金资产净值1.5%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：  
日管理人报酬=前一日基金资产净值×1.5%/当年天数。

6.4.3.2.2 基金托管费  
单位：人民币元

项目	2015年1月1日至2015年6月30日	2014年1月1日至2014年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	10,565,490.33	9,289,260.98

注：支付基金托管人中国银行的托管费按前一日基金资产净值0.25%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：  
日托管费=前一日基金资产净值×0.25%/当年天数。

6.4.3.6 与关联方进行银行间同业市场债券交易（回购）交易  
6.4.3.4 各关联方投资本基金的情况

6.4.3.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况  
本报告期及上年度可比期间基金管理人未运用固有资金投资本基金。

6.4.3.4.2 报告期末除基金管理人以外的其他关联方投资本基金的情况  
本报告期及上年度可比期间除基金管理人以外的其他关联方无投资本基金的情况。

6.4.3.5 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 2015年1月1日至2015年6月30日		上年度可比期间 2014年1月1日至2014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	346,296,681.63	811,173.44	152,107,804.82	1,818,191.66

注：本基金的银行存款由基金托管人中国银行保管，按银行同业利率计息。

4.9.6 本基金在定期报告中基金与关联方中国银行签订的协议

注：本基金的银行存款由基金托管人中国银行保管，按银行同业利率计息。

6.4.3.6 与关联方进行银行间同业市场债券交易（回购）交易  
6.4.3.7 其他关联方交易事项的说明

6.4.3.7.1 报告期末基金管理人运用固有资金投资本基金的情况  
本报告期及上年度可比期间基金管理人未运用固有资金投资本基金。

6.4.3.7.2 报告期末除基金管理人以外的其他关联方投资本基金的情况  
本报告期及上年度可比期间除基金管理人以外的其他关联方无投资本基金的情况。

6.4.3.7.3 报告期末基金管理人运用固有资金投资本基金的情况  
本报告期及上年度可比期间基金管理人未运用固有资金投资本基金。

6.4.3.7.4 报告期末基金管理人运用固有资金投资本基金的情况  
本报告期及上年度可比期间基金管理人未运用固有资金投资本基金。

6.4.3.7.5 报告期末基金管理人运用固有资金投资本基金的情况  
本报告期及上年度可比期间基金管理人未运用固有资金投资本基金。

6.4.3.7.6 报告期末基金管理人运用固有资金投资本基金的情况  
本报告期及上年度可比期间基金管理人未运用固有资金投资本基金。

6.4.3.7.7 报告期末基金管理人运用固有资金投资本基金的情况  
本报告期及上年度可比期间基金管理人未运用固有资金投资本基金。

6.4.3.7.8 报告期末基金管理人运用固有资金投资本基金的情况  
本报告期及上年度可比期间基金管理人未运用固有资金投资本基金。

6.4.3.7.9 报告期末基金管理人运用固有资金投资本基金的情况  
本报告期及上年度可比期间基金管理人未运用固有资金投资本基金。

6.4.3.7.10 报告期末基金管理人运用固有资金投资本基金的情况  
本报告期及上年度可比期间基金管理人未运用固有资金投资本基金。

6.4.3.7.11 报告期末基金管理人运用固有资金投资本基金的情况  
本报告期及上年度可比期间基金管理人未运用固有资金投资本基金。

6.4.3.7.12 报告期末基金管理人运用固有资金投资本基金的情况  
本报告期及上年度可比期间基金管理人未运用固有资金投资本基金。

6.4.3.7.13 报告期末基金管理人运用固有资金投资本基金的情况  
本报告期及上年度可比期间基金管理人未运用固有资金投资本基金。

6.4.3.7.14 报告期末基金管理人运用固有资金投资本基金的情况  
本报告期及上年度可比期间基金管理人未运用固有资金投资本基金。

6.4.3.7.15 报告期末基金管理人运用固有资金投资本基金的情况  
本报告期及上年度可比期间基金管理人未运用固有资金投资本基金。

6.4.3.7.16 报告期末基金管理人运用固有资金投资本基金的情况  
本报告期及上年度可比期间基金管理人未运用固有资金投资本基金。

6.4.3.7.17 报告期末基金管理人运用固有资金投资本基金的情况  
本报告期及上年度可比期间基金管理人未运用固有资金投资本基金。

6.4.3.7.18 报告期末基金管理人运用固有资金投资本基金的情况  
本报告期及上年度可比期间基金管理人未运用固有资金投资本基金。

6.4.3.7.19 报告期末基金管理人运用固有资金投资本基金的情况  
本报告期及上年度可比期间基金管理人未运用固有资金投资本基金。

6.4.3.7.20 报告期末基金管理人运用固有资金投资本基金的情况  
本报告期及上年度可比期间基金管理人未运用固有资金投资本基金。

6.4.3.7.21 报告期末基金管理人运用固有资金投资本基金的情况  
本报告期及上年度可比期间基金管理人未运用固有资金投资本基金。

6.4.3.7.22 报告期末基金管理人运用固有资金投资本基金的情况  
本报告期及上年度可比期间基金管理人未运用固有资金投资本基金。

6.4.3.7.23 报告期末基金管理人运用固有资金投资本基金的情况  
本报告期及上年度可比期间基金管理人未运用固有资金投资本基金。

6.4.3.7.24 报告期末基金管理人运用固有资金投资本基金的情况  
本报告期及上年度可比期间基金管理人未运用固有资金投资本基金。

6.4.3.7.25 报告期末基金管理人运用固有资金投资本基金的情况  
本报告期及上年度可比期间基金管理人未运用固有资金投资本基金。

6.4.3.7.26 报告期末基金管理人运用固有资金投资本基金的情况  
本报告期及上年度可比期间基金管理人未运用固有资金投资本基金。

6.4.3.7.27 报告期末基金管理人运用固有资金投资本基金的情况  
本报告期及上年度可比期间基金管理人未运用固有资金投资本基金。

6.4.3.7.28 报告期末基金管理人运用固有资金投资本基金的情况  
本报告期及上年度可比期间基金管理人未运用固有资金投资本基金。

6.4.3.7.29 报告期末基金管理人运用固有资金投资本基金的情况  
本报告期及上年度可比期间基金管理人未运用固有资金投资本基金。

6.4.3.7.30 报告期末基金管理人运用固有资金投资本基金的情况  
本报告期及上年度可比期间基金管理人未运用固有资金投资本基金。

6.4.3.7.31 报告期末基金管理人运用固有资金投资本基金的情况  
本报告期及上年度可比期间基金管理人未运用固有资金投资本基金。

6.4.3.7.32 报告期末基金管理人运用固有资金投资本基金的情况  
本报告期及上年度可比期间基金管理人未运用固有资金投资本基金。

6.4.3.7.33 报告期末基金管理人运用固有资金投资本基金的情况  
本报告期及上年度可比期间基金管理人未运用固有资金投资本基金。

6.4.3.7.34 报告期末基金管理人运用固有资金投资本基金的情况  
本报告期及上年度可比期间基金管理人未运用固有资金投资本基金。

6.4.3.7.35 报告期末基金管理人运用固有资金投资本基金的情况  
本报告期及上年度可比期间基金管理人未运用固有资金投资本基金。

6.4.3.7.36 报告期末基金管理人运用固有资金投资本基金的情况  
本报告期及上年度可比期间基金管理人未运用固有资金投资本基金。

6.4.3.7.37 报告期末基金管理人运用固有资金投资本基金的情况  
本报告期及上年度可比期间基金管理人未运用固有资金投资本基金。

6.4.3.7.38 报告期末基金管理人运用固有资金投资本基金的情况  
本报告期及上年度可比期间基金管理人未运用固有资金投资本基金。

6.4.3.7.39 报告期末基金管理人运用固有资金投资本基金的情况  
本报告期及上年度可比期间基金管理人未运用固有资金投资本基金。

6.4.3.7.40 报告期末基金管理人运用固有资金投资本基金的情况  
本报告期及上年度可比期间基金管理人未运用固有资金投资本基金。

6.4.3.7.41 报告期末基金管理人运用固有资金投资本基金的情况  
本报告期及上年度可比期间基金管理人未运用固有资金投资本基金。

6.4.3.7.42 报告期末基金管理人运用固有资金投资本基金的情况  
本报告期及上年度可比期间基金管理人未运用固有资金投资本基金。

6.4.3.7.43 报告期末基金管理人运用固有资金投资本基金的情况  
本报告期及上年度可比期间基金管理人未运用固有资金投资本基金。

6.4.3.7.44 报告期末基金管理人运用固有资金投资本基金的情况  
本报告期及上年度可比期间基金管理人未运用固有资金投资本基金。

6.4.3.7.45 报告期末基金管理人运用固有资金投资本基金的情况  
本报告期及上年度可比期间基金管理人未运用固有资金投资本基金。

6.4.3.7.46 报告期末基金管理人运用固有资金投资本基金的情况  
本报告期及上年度可比期间基金管理人未运用固有资金投资本基金。

6.4.3.7.47 报告期末基金管理人运用固有资金投资本基金的情况  
本报告期及上年度可比期间基金管理人未运用固有资金投资本基金。

6.4.3.7.48 报告期末基金管理人运用固有资金投资本基金的情况  
本报告期及上年度可比期间基金管理人未运用固有资金投资本基金。

6.4.3.7.49 报告期末基金管理人运用固有资金投资本基金的情况  
本报告期及上年度可比期间基金管理人未运用固有资金投资本基金。

6.4.3.7.50 报告期末基金管理人运用固有资金投资本基金的情况  
本报告期及上年度可比期间基金管理人未运用固有资金投资本基金。

6.4.3.7.51 报告期末基金管理人运用固有资金投资本基金的情况  
本报告期及上年度可比期间基金管理人未运用固有资金投资本基金。

6.4.3.7.52 报告期末基金管理人运用固有资金投资本基金的情况  
本报告期及上年度可比期间基金管理人未运用固有资金投资本基金。

6.4.3.7.53 报告期末基金管理人运用固有资金投资本基金的情况  
本报告期及上年度可比期间基金管理人未运用固有资金投资本基金。

6.4.3.7.54 报告期末基金管理人运用固有资金投资本基金的情况  
本报告期及上年度可比期间基金管理人未运用固有资金投资本基金。

6.4.3.7.55 报告期末基金管理人运用固有资金投资本基金的情况  
本报告期及上年度可比期间基金管理人未运用固有资金投资本基金。

6.4.3.7.56 报告期末基金管理人运用固有资金投资本基金的情况  
本报告期及上年度可比期间基金管理人未运用固有资金投资本基金。

6.4.3.7.57 报告期末基金管理人运用固有资金投资本基金的情况  
本报告期及上年度可比期间基金管理人未运用固有资金投资本基金。

6.4.3.7.58 报告期末基金管理人运用固有资金投资本基金的情况  
本报告期及上年度可比期间基金管理人未运用固有资金投资本基金。

6.4.3.7.59 报告期末基金管理人运用固有资金投资本基金的情况  
本报告期及上年度可比期间基金管理人未运用固有资金投资本基金。

6.4.3.7.60 报告期末基金管理人运用固有资金投资本基金的情况  
本报告期及上年度可比期间基金管理人未运用固有资金投资本基金。

6.4.3.7.61 报告期末基金管理人运用固有资金投资本基金的情况  
本报告期及上年度可比期间基金管理人未运用固有资金投资本基金。

注：本期累计卖出金额指卖出成交金额（成交单乘以成交数量），不考虑相关交易费用。

1.2.3 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	卖出股票收入（成交）总额
4,002,480,346.68	10,318,919,110.24

注：上述金额均指成交金额（成交单乘以成交数量），不考虑相关交易费用。

1.3 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	-	0.00
2	央行票据	-	0.00
3	金融债券	-	0.00
4	其中：政策性金融债	-	0.00
5	企业债券	-	0.00
6	企业短期融资券	-	0.00
7	中期票据	32,651,157.00	0.00
8	其他	-	0.00
9	合计	32,651,157.00	0.01

1.4 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

金额单位：人民币元

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（%）
1	1110131	中信转债	224,700	32,651,157.00	0.01

1.5 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有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。

1.6 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支货币资金投资明细  
本基金本报告期末未持有货币资金。

1.7 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。

1.8 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明  
1.8.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细  
本基金本报告期末未投资股指期货。

1.8.2 本基金投资股指期货的投资政策  
本基金本报告期末未投资股指期货。

1.9 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明  
1.9.1 本报告期国债期货交易情况  
本基金本报告期末未投资国债期货。

1.9.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细  
本基金本报告期末未投资国债期货。

1.9.3 本报告期国债期货交易情况  
本基金本报告期末未投资国债期货。

1.10 投资组合报告附注  
1.10.1 报告期内基金投资的前十名证券的发行主体未被监管部门立案调查的，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情况。  
1.10.2 本基金投资的前十名证券未超出基金合同规定的备选股票库。  
1.10.3 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	4,800,469.52
2	应收证券清算款	96,256,843.88
3	应收股利	-
4	应收利息	78,651.49
5	应收申购款	3,641,290.11
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	合计	103,777,211.10

1.10.4 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。

1.10.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明  
单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限情况下的公允价值	占基金资产净值比例（%）	流通受限情况说明
1	002292	奥飞动漫	714,462,751.88	1.38%	重大事项的停牌
2	002702	康欣食品	282,662,996.38	0.52%	重大事项的停牌
3	300212	易华录	242,831,545.04	0.45%	重大事项的停牌

1.10.6 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。

2. 基金资产净值及基金份额持有人信息

2.1 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	机构投资者持有基金份额	个人投资者持有基金份额
持有户数	持有份额	持有份额	持有份额
222,611	16,430.02	29,549,090.17	5,771,996,811.46

注：持有人户数为有效户数，即账户份额大于零的账户。

2.2 期末基金管理人从业人数持有本基金的情况  
单位：份

项目	持有基金份额总额（份）	占基金净值比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	0	0
持有本基金情况的从业人数	0	0

2.3 期末基金管理人从业人数持有本基金情况的区间情况  
单位：份

项目	持有基金份额总额（份）	占基金净值比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	0	0
持有本基金情况的从业人数	0	0

3. 基金资产净值及基金份额持有人信息

3.1 基金资产净值及基金份额持有人信息  
单位：人民币元

项目	持有基金份额总额（份）	占基金净值比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	0	0
持有本基金情况的从业人数	0	0

3.2 基金资产净值及基金份额持有人信息  
单位：人民币元

项目	持有基金份额总额（份）	占基金净值比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	0	0
持有本基金情况的从业人数	0	0

3.3 基金资产净值及基金份额持有人信息  
单位：人民币元

项目	持有基金份额总额（份）	占基金净值比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	0	0
持有本基金情况的从业人数	0	0

3.4 基金资产净值及基金份额持有人信息  
单位：人民币元

项目	持有基金份额总额（份）	占基金净值比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	0	0
持有本基金情况的从业人数	0	0

3.5 基金资产净值及基金份额持有人信息  
单位：人民币元

项目	持有基金份额总额（份）	占基金净值比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	0	0
持有本基金情况的从业人数	0	0

3.6 基金资产净值及基金份额持有人信息  
单位：人民币元

项目	持有基金份额总额（份）	占基金净值比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	0	0
持有本基金情况的从业人数	0	0

3.7 基金资产净值及基金份额持有人信息  
单位：人民币元

项目	持有基金份额总额（份）	占基金净值比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	0	0
持有本基金情况的从业人数	0	0

3.8 基金资产净值及基金份额持有人信息  
单位：人民币元

项目	持有基金份额总额（份）	占基金净值比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	0	0
持有本基金情况的从业人数	0	0

3.9 基金资产净值及基金份额持有人信息  
单位：人民币元

项目	持有基金份额总额（份）	占基金净值比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	0	0
持有本基金情况的从业人数	0	0

3.10 基金资产净值及基金份额持有人信息  
单位：人民币元

项目	持有基金份额总额（份）	占基金净值比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	0	0
持有本基金情况的从业人数	0	0

3.11 基金资产净值及基金份额持有人信息  
单位：人民币元

项目	持有基金份额总额（份）	占基金净值比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	0	0
持有本基金情况的从业人数	0	0

3.12 基金资产净值及基金份额持有人信息  
单位：人民币元

项目	持有基金份额总额（份）	占基金净值比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	0	0
持有本基金情况的从业人数	0	0

3.13 基金资产净值及基金份额持有人信息  
单位：人民币元

（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，内部控制制度健全，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，满足各校