

大成积极成长股票型证券投资基金

2014 半年度报告摘要

在投资本基金的过程中,本基金托管人中国农业银行股份有限公司严格遵守《证券投资基金法》相关法律法规的规定以及基金合同、托管协议的约定,对本基金基金管理人—大成基金管理有限公司 2014 年 1 月 1 日至 2014 年 6 月 30 日基金的投资运作,进行了认真、独立的会计核算和必要的投资监督,认真履行了托管人的各项义务,没有从事任何损害基金份额持有人利益的行为。

6.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规、净值计算、利润分配等情况的说明

本托管人对大成基金管理有限公司在本基金的投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支及利润分配等问题上,不存在损害基金份额持有人利益的行为;在报告期内,严格遵守了《证券投资基金法》等有关法律法规,在各重要方面的运作严格按照基金合同的的规定进行。

6.3 托管人对本半年度报告中财务信息内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人认为,大成基金管理有限公司的信息披露事务符合《证券投资基金信息披露管理办法》及其他相关法律法规的规定,基金管理人所编制和披露的本基金半年度报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告等信息真实、准确、完整,未发现有关损害基金份额持有人利益的行为。

6.1 资产负债表

会计主体:大成积极成长股票型证券投资基金

报告截止日:2014年6月30日

资产	期末 2014年6月30日	上年度末 2013年12月31日
货币资金	154,640,616.91	157,611,399.83
结算备付金	1,116,654.08	3,764,336.97
存出保证金	546,515.55	783,790.20
交易性金融资产	1,298,914,043.02	1,393,917,303.37
其中:股票投资	1,225,903,043.02	1,344,210,303.37
基金投资	—	—
债券投资	70,011,000.00	49,707,000.00
资产支持证券投资	—	—
贵金属投资	—	—
应收货币资金	59,000,279.00	99,600,449.40
应收证券清算款	1,492,165.32	12,717,713.46
应收利息	2,385,998.90	961,236.82
应收股利	—	—
应收申购款	4,346.33	164,460.32
递延所得税资产	—	—
其他资产	2,884,512.64	2,884,512.64
资产总计	1,517,985,131.75	1,672,405,226.01

负债和所有者权益	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	—	—
应付短期融资券	14,783,685.34	1,200,199.05
应付赎回款	737,715.08	1,203,199.05
应付管理人报酬	1,802,612.46	2,137,238.23
应付托管费	300,435.38	356,206.35
应付销售服务费	—	—
应付交易费用	695,005.14	1,877,453.02
应付股利	—	—
应付利息	—	—
应付利润	—	—
递延所得税负债	—	—
其他负债	3,384,876.06	3,386,667.85
负债合计	21,704,330.36	8,960,764.50
所有者权益:		
实收基金	1,778,492,754.34	1,905,859,148.12
未分配利润	-282,211,952.95	-242,414,686.61
所有者权益合计	1,496,280,801.39	1,663,444,461.51
负债和所有者权益总计	1,517,985,131.75	1,672,405,226.01

注:报告期末于2014年6月30日,基金份额净值0.841元,基金份额总额1,778,492,754.34份。

6.2 利润表

会计主体:大成积极成长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

资产	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	-43,214,294.14	64,404,533.11
1.利息收入	2,764,770.83	1,916,123.81
其中:存款利息收入	667,259.66	1,388,818.40
债券利息收入	1,547,696.01	12,557.80
资产支持证券利息收入	—	—
买入返售金融资产收入	749,824.16	614,947.61
其他利息收入	—	—
2.投资收益(损失以“-”填列)	-12,357,288.60	122,873,550.67
其中:股票投资收益	-21,416,392.97	111,322,672.29
基金投资收益	—	—
债券投资收益	21,900.00	—
资产支持证券投资收益	—	—
贵金属投资收益	—	—
衍生工具收益	—	—
公允价值变动收益	9,037,204.37	11,550,878.28
3.公允价值变动收益(损失以“-”号填列)	-33,625,635.14	-60,396,953.16
4.汇兑收益(损失以“-”号填列)	—	—
5.其他收入(损失以“-”号填列)	3,878.77	11,831.79
减:二、费用	17,220,364.40	23,174,747.78
1.管理人报酬	11,375,294.27	12,946,169.13
2.托管费	1,895,832.34	2,157,694.83
3.销售服务费	—	—
4.交易费用	3,730,981.26	7,858,604.19
5.其他费用	—	—
其中:卖出回购金融资产支出	—	—
6.其他费用	218,296.53	212,279.63
三、利润总额(亏损总额以“-”号填列)	-60,434,658.54	41,229,805.33
减:所得税费用	—	—
四、净利润(净亏损以“-”号填列)	-60,434,658.54	41,229,805.33

6.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体:大成积极成长股票型证券投资基金

报告期间:2014年1月1日至2014年6月30日

项目	本期 2014年1月1日至2014年6月30日	上期 2013年1月1日至2013年6月30日
一、期初所有者权益(基金净值)	1,905,859,148.12	1,905,859,148.12
二、本期增减变动金额(本期净损益)	-282,211,952.95	-242,414,686.61
1.本期基金净值变动产生所有者权益变动(本期净损益)	-60,434,658.54	-60,434,658.54
2.本期基金净值变动产生所有者权益变动(本期净损益)	-127,366,395.78	-106,729,101.38
3.本期基金净值变动产生所有者权益变动(本期净损益)	6,416,739.15	-1,067,871.87
其中:1.基金申购款	6,416,739.15	-1,067,871.87
2.基金赎回款	-113,783,132.93	-21,705,244.07
三、本期基金净值变动产生所有者权益变动(本期净损益)	-133,783,132.93	-112,077,868.86
四、本期基金净值变动产生所有者权益变动(本期净损益)	1,778,492,754.34	-282,211,952.95
五、期末所有者权益(基金净值)	1,496,280,801.39	1,663,444,461.51

项目	本期 2014年1月1日至2014年6月30日	上期 2013年1月1日至2013年6月30日
一、期初所有者权益(基金净值)	2,194,468,343.74	-478,328,193.68
二、本期基金净值变动产生所有者权益变动(本期净损益)	-41,229,805.33	41,229,805.33
三、本期基金净值变动产生所有者权益变动(本期净损益)	-101,414,913.41	-82,867,173.26
其中:1.基金申购款	14,085,654.64	-2,735,511.51
2.基金赎回款	-115,490,568.05	-21,292,662.76
四、本期基金净值变动产生所有者权益变动(本期净损益)	-115,490,568.05	-82,867,173.26
五、期末所有者权益(基金净值)	2,093,063,430.33	-418,506,468.20

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告自1564号财务报表由下列负责人签署:

张树忠 刘彩霞 范祺

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 本报告期

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保持一致的说明

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

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2008]1号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]125号《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》及其他相关财税法规和实务操作,主要税项列示如下:

(1)以发行方式募集资金不属于营业税征收范围,不征收营业税。基金买卖股票、债券的差价收入不予征收营业税。

(2)对基金从事证券买卖取得的收入,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。

(3)对基金取得的债券利息收入,由发行债券的企业在向基金支付利息时代扣代缴20%的个人所得税。自2013年1月1日起,对基金从上市公司取得的股息红利所得,持股期限在1个月以上(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,暂按减按50%计入应纳税所得额;持股期限超过1年的,暂按减按25%计入应纳税所得额。对基金持有的上市公司限售股,解禁后取得的股息、红利收入,按照上述规定计算纳税,持股期间由证券登记结算机构对基金持有的限售股,视同新股发行计入应纳税所得额。

(4)基金卖出股票按0.1%的税率缴纳股票交易印花税,买入股票不征收股票交易印花税。

6.4.3 关联方关系

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、基金管理人
中国农业银行股份有限公司(“中国农业银行”)	基金托管人、基金管理人
中信证券股份有限公司	基金管理人
光大证券股份有限公司(“光大证券”)	基金管理人

注:1、中国证监会于2006年11月6日作出对广东证券经纪业务许可并责令关闭的行政处罚。

2、下述关联方均在正常业务范围内进行一般商业条款订立。

6.4.4 本报告期上年度可比期间的关联交易

6.4.4.1 通过关联交易方式进行交易

6.4.4.1.1 股票交易

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
关联方名称	成交金额	占当期股票成交金额的比例
光大证券	74,015.12	3.27%
光大证券	287,978.52	6.28%

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的净额列示。

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
报告期内基金应支付的管理费	11,375,294.27	12,946,169.13
其中:支付销售机构的客户维护费	2,052,405.48	2,343,407.62

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%的年费率计算,逐日累计至每月月底,按月支付。其计算公式为:

日管理费=前一日基金资产净值 X 1.5% / 当年天数。

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
报告期内基金应支付的托管费	1,895,832.34	2,157,694.83

注:支付基金托管人中国农业银行的托管费按前一日基金资产净值0.25%的年费率计算,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 X 0.25% / 当年天数。

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

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

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

注:本报告期末及上年度末除基金管理人之外的其他关联方无投资本基金的情况。

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

注:本基金的银行存款由基金托管人中国农业银行保管,按银行同业利率或约定利率计息。

6.4.4.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

无。

6.4.4.7 其他关联交易事项的说明

无。

注:本基金的银行存款由基金托管人中国农业银行保管,按银行同业利率或约定利率计息。

6.4.4.6 本基金在承销期间参与关联方承销证券的情况

6.4.4.7 其他关联交易事项的说明

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

6.4.5.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

单位:人民币元

股票代码	股票简称	停牌日期	停牌原因	期末持仓数量(股)	期末持仓总市值	期末市值总额	备注
600637	百隆	2014/5/29	重大事项	32,015	18,132,098.22	19,458,000.79	-

注:本基金截至2014年6月30日止持有以上因公布的重大事项可能产生重大影响而被暂时停牌的股票,该类股票将在所公布事项的重大影响消除后,经交易所批准复牌。

6.4.5.3 期末债券正回购交易中作为负债的债券

6.4.5.3.1 银行间市场债券正回购

6.4.5.3.2 交易所市场债券正回购

6.4.5.3.2 交易所市场债券正回购

6.4.5.3.3 交易所市场债券正回购

6.4.5.3.3 交易所市场债券正回购

6.4.5.3.3 交易所市场债券正回购

6.4.5.3.3 交易所市场债券正回购

6.4.5.3.3 交易所市场债券正回购

6.4.5.3.3 交易所市场债券正回购

6.4.5.3.3 交易所市场债券正回购

6.4.5.3.3 交易所市场债券正回购

6.4.5.3.3 交易所市场债券正回购

6.4.5.3.3 交易所市场债券正回购

6.4.5.3.3 交易所市场债券正回购

6.4.5.3.3 交易所市场债券正回购

6.4.5.3.3 交易所市场债券正回购

6.4.5.3.3 交易所市场债券正回购

6.4.5.3.3 交易所市场债券正回购

6.4.5.3.3 交易所市场债券正回购

6.4.5.3.3 交易所市场债券正回购

6.4.5.3.3 交易所市场债券正回购

6.4.5.3.3 交易所市场债券正回购

6.4.5.3.3 交易所市场债券正回购

6.4.5.3.3 交易所市场债券正回购

6.4.5.3.3 交易所市场债券正回购

6.4.5.3.3 交易所市场债券正回购

6.4.5.3.3 交易所市场债券正回购

6.4.5.3.3 交易所市场债券正回购

6.4.5.3.3 交易所市场债券正回购

6.4.5.3.3 交易所市场债券正回购

6.4.5.3.3 交易所市场债券正回购

6.4.5.3.3 交易所市场债券正回购

6.4.5.3.3 交易所市场债券正回购

6.4.5.3.3 交易所市场债券正回购

6.4.5.3.3 交易所市场债券正回购

6.4.5.3.3 交易所市场债券正回购

6.4.5.3.3 交易所市场债券正回购

6.4.5.3.3 交易所市场债券正回购

6.4.5.3.3 交易所市场债券正回购

6.4.5.3.3 交易所市场债券正回购

6.4.5.3.3 交易所市场债券正回购

6.4.5.3.3 交易所市场债券正回购

6.4.5.3.3 交易所市场债券正回购

6.4.5.3.3 交易所市场债券正回购

6.4.5.3.3 交易所市场债券正回购

6.4.5.3.3 交易所市场债券正回购

6.4.5.3.3 交易所市场债券正回购

6.4.5.3.3 交易所市场债券正回购

6.4.5.3.3 交易所市场债券正回购

6.4.5.3.3 交易所市场债券正回购

6.4.5.3.3 交易所市场债券正回购

6.4.5.3.3 交易所市场债券正回购

6.4.5.3.3 交易所市场债券正回购

6.4.5.3.3 交易所市场债券正回购

6.4.5.3.3 交易所市场债券正回购

6.4.5.3.3 交易所市场债券正回购

6.4.5.3.3 交易所市场债券正回购

6.4.5.3.3 交易所市场债券正回购

6.4.5.3.3 交易所市场债券正回购

6.4.5.3.3 交易所市场债券正回购

6.4.5.3.3 交易所市场债券正回购

6.4.5.3.3 交易所市场债券正回购

6.4.5.3.3 交易所市场债券正回购

6.4.5.3.3 交易所市场债券正回购

6.4.5.3.3 交易所市场债券正回购

6.4.5.3.3 交易所市场债券正回购

6.4.5.3.3 交易所市场债券正回购

6.4.5.3.3 交易所市场债券正回购

6.4.5.3.3 交易所市场债券正回购

6.4.5.3.3 交易所市场债券正回购

6.4.5.3.3 交易所市场债券正回购

6.4.5.3.3 交易所市场债券正回购

6.4.5.3.3 交易所市场债券正回购

6.4.5.3.3 交易所市场债券正回购

6.4.5.3.3 交易所市场债券正回购

6.4.5.3.3 交易所市场债券正回购

6.4.5.3.3 交易所市场债券正回购

6.4.5.3.3 交易所市场债券正回购

序号	债券代码	债券名称	数量(元)	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	130256	13国债06	400,000	40,008,000.00	2.67
2	110257	11国债07	300,000	30,003,000.00	2.01

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

本基金本报告期末未投资股指期货。

7.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期末未投资股指期货。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货投资情况

7.11.1 本期国债期货投资政策

本基金本报告期末未投资国债期货。

7.11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未投资国债期货。

7.11.3 本期国债期货投资政策

本基金本报告期末未投资国债期货。

7.12 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。

7.12.1 本期国债期货投资政策

本基金本报告期末未投资国债期货。

7.12.2 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。

7.12.3 本期国债期货投资政策

本基金本报告期末未投资国债期货。

7.12.4 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。

7.12.5 本期国债期货投资政策

本基金本报告期末未投资国债期货。

7.12.6 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。

7.12.7 本期国债期货投资政策

本基金本报告期末未投资国债期货。

7.12.8 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。

7.12.9 本期国债期货投资政策

本基金本报告期末未投资国债期货。

7.12.10 本期国债期货投资政策

本基金本报告期末未投资国债期货。

7.12.11 本期国债期货投资政策

本基金本报告期末未投资国债期货。

7.12.12 本期国债期货投资政策

本基金本报告期末未投资国债期货。

7.12.13 本期国债期货投资政策

本基金本报告期末未投资国债期货。

7.12.14 本期国债期货投资政策

本基金本报告期末未投资国债期货。

7.12.15 本期国债期货投资政策

本基金本报告期末未投资国债期货。

7.12.16 本期国债期货投资政策

本基金本报告期末未投资国债期货。

7.12.17 本期国债期货投资政策

本基金本报告期末未投资国债期货。

7.12.18 本期国债期货投资政策

本基金本报告期末未投资国债期货。

7.12.19 本期国债期货投资政策

本基金本报告期末未投资国债期货。

7.12.20 本期国债期货投资政策

本基金本报告期末未投资国债期货。

7.12.21 本期国债期货投资政策

本基金本报告期末未投资国债期货。