

信息披露 Disclosure

大成精选增值混合型证券投资基金

2014 半年度报告摘要

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

关联方名称	当期	本期		上期可比期间
		当期佣金金额占当期佣金总量的比例	期末未付佣金余额占期末未付佣金总量的比例	上期可比期间佣金金额占上期可比期间佣金总量的比例
无元证券	441,999.98	18.19%	173,820.11	16.94%
光大证券	91,305.92	2.84%	28,021.94	1.54%

注：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交易费和经手费后的净额。权证交易不计佣金。

2. 关联券商提供的服务范围和佣金收取方式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

项目	本期	上期可比期间
	2014年1月1日至2014年6月30日	2013年1月1日至2013年6月30日
当期发生的基金应支付的基金管理费	13,273,370.59	15,647,033.87
其中：支付销售机构的客户维护费	1,501,995.85	1,776,002.22

注：支付基金托管人大成基金的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：

日管理费=前一日基金资产净值×1.5%÷当年天数。

6.4.4.2.2 基金托管费

项目	本期	上期可比期间
	2014年1月1日至2014年6月30日	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	2,212,228.49	2,607,838.95

注：支付基金托管人中国农业银行行的托管费按照一日基金资产净值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。

6.4.4.3 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 各关联方持有本基金的情况

6.4.4.4.1 报告期末基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

本基金的管理人于本期末未运用固有资金投资本基金。

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期末未投资本基金。

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

关联方名称	本期	上期可比期间
	2014年1月1日至2014年6月30日	2013年1月1日至2013年6月30日
中国工商银行	127,747,447.07	450,118.73
当期发生的基金应支付的利息	2,212,228.49	2,607,838.95

注：本基金的资金由基金托管人中国农业银行保管，按银行同业利率计息。

6.4.4.6 本基金在承销期间参与关联方承销的情况

本基金本报告期及上年度可比期间均未在承销期间参与关联方承销情况。

6.4.4.7 其他关联方事项的说明

本基金本报告及上年度可比期间无其他关联方事项。

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

6.4.5.2 期末未认购/认购失败而于期末持有的流通受限证券

股票代码	股票名称	停牌日期	期末停牌前收盘价	停牌日期	复牌开盘价	数量(股)	期末公允价值	期末市值总额	备注
30028	苏文科	2014/6/25	8.75	2014/7/4	9.18	5,064,284	34,135,269.36	44,312,485.00	-
8	合计						1,701,203,931.92	1,005,297.42	

注：本基金的资金由基金托管人中国农业银行保管，按银行同业利率计息。

6.4.5.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

本基金本报告期末未持有债券正回购交易中作为抵押的债券。

7.1 期末基金资产组合情况

序号	项目	金额	占基金总资产比例(%)
1	权益投资	1,419,039,096.72	83.41
1.1	其中：股票	1,419,039,096.72	83.41
2	固定收益投资	80,145,000.00	4.71
2.1	其中：债券	80,145,000.00	4.71
3	基金投资	-	0.00
4	金融衍生品投资	-	0.00
5	买入返售金融资产	49,500,144.75	2.91
6	其他资产	129,501,163.13	7.35
7	负债及所有者权益合计	2,013,527,131.21	100.00

7.2 期末按行业分类的股票投资组合

代码	行业名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	20,281,664.00	1.21
B	采矿业	-	0.00
C	制造业	870,700,716.76	51.88
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	0.00
E	建筑业	-	0.00
F	交通运输、仓储业	-	0.00
G	信息传输、软件和信息技术服务业	189,182,286.31	11.27
H	金融业	110,533,745.39	6.57
J	房地产业	128,670,909.36	7.67
L	医药和医疗器械业	-	0.00
M	科学、技术和设备制造业	44,312,485.00	2.64
N	水利、环境和公共设施管理业	41,172,666.00	2.45
O	其他行业	-	0.00
P	其他行业	-	0.00
Q	其他行业	-	0.00
R	其他行业	-	0.00
S	合计	1,419,039,096.72	84.55

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

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	000625	长安汽车	6,099,701	75,087,319.31	4.47
2	601318	中国平安	1,449,880	57,038,279.27	3.40
3	300124	汇川技术	1,577,061	54,306,303.20	3.25
4	003475	佳士科技	1,577,860	51,722,260.80	3.08
5	002410	广联达	1,886,284	49,589,912.96	2.97
6	600560	金亚科技	1,896,655	47,743,640.35	2.94
7	002008	大族激光	2,699,828	46,815,017.52	2.79
8	003415	海康威视	2,681,416	45,423,187.04	2.71
9	600309	万邦达	2,959,886	44,871,867.76	2.67
10	300284	苏文科	5,064,284	44,312,485.00	2.64

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(www.dcfund.com.cn)的半年度报告全文。

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

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	002008	大族激光	63,485,476.62	3.15
2	601166	兴业银行	59,377,591.35	2.95
3	002410	广联达	58,217,943.67	2.89
4	300070	银禧科技	53,272,109.87	2.64
5	600597	光明乳业	50,441,358.33	2.51
6	602230	华讯方舟	49,250,714.74	2.44
7	002655	东华软件	48,173,457.62	2.39
8	300357	新研股份	47,749,530.62	2.38
9	600486	国电南瑞	46,314,264.69	2.30
10	000409	明电股份	45,194,230.28	2.24
11	002533	亚细亚	40,261,251.19	2.00
12	600588	用友软件	38,513,238.93	1.91
13	600703	三安光电	38,220,803.86	1.90
14	601515	东风汽车	37,645,470.18	1.87
15	600488	长海股份	34,227,714.99	1.70
16	002146	荣泰发展	32,472,392.59	1.61
17	002174	华讯方舟	30,576,910.46	1.52
18	600330	旭光股份	27,600,786.65	1.38
19	600223	华讯方舟	26,414,680.28	1.31
20	300124	汇川技术	25,614,788.38	1.27

注：本期累计买入金额按买入成交金额(成交单价乘以成交数量)计算，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

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	000651	格力电器	85,734,092.61	4.25
2	200024	中兴通讯	68,715,056.90	3.41
3	601166	兴业银行	68,881,831.98	3.41
4	600368	金亚科技	55,856,311.38	2.77
5	600637	南京证券	50,510,725.44	2.50
6	600826	鲁商发展	42,518,510.48	2.14
7	600609	特变电工	41,578,094.23	2.06
8	300133	荣泰发展	40,475,515.41	2.01
9	002570	贝达药业	39,591,134.20	1.96
10	000413	东南汽车	38,056,461.39	1.89
11	000851	海康威视	36,761,285.08	1.82
12	601014	上汽集团	35,698,075.29	1.77
13	300315	奥普光电	35,033,451.38	1.74
14	602230	华讯方舟	34,918,266.37	1.73
15	300037	新研股份	33,518,263.89	1.66
16	602230	华讯方舟	33,518,266.38	1.66
17	002294	紫光股份	33,456,482.62	1.66
18	000671	阳光城	33,337,432.64	1.65
19	600252	中恒集团	32,036,966.29	1.59
20	600729	华讯方舟	31,083,954.16	1.54

注：本期累计卖出金额按卖出成交金额(成交单价乘以成交数量)计算，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成本总额

买入股票成本(成交总额)	卖出股票成本(成交总额)
1,257,364,912.06	1,466,287,178.10

注：上述金额均按成交金额(成交单价乘以成交数量)计算，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

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	国债投资	-	0.00
2	央行票据	-	0.00
3	金融债券	80,145,000.00	4.78
4	其中：政策性金融债	80,145,000.00	4.78
5	企业债券	-	0.00
6	企业短期融资券	-	0.00
7	可转债	-	0.00
8	其他	-	0.00
9	合计	80,145,000.00	4.78

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

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	国债投资	-	0.00
2	央行票据	-	0.00
3	金融债券	80,145,000.00	4.78
4	其中：政策性金融债	80,145,000.00	4.78
5	企业债券	-	0.00
6	企业短期融资券	-	0.00
7	可转债	-	0.00
8	其他	-	0.00
9	合计	80,145,000.00	4.78

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

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	国债投资	-	0.00
2	央行票据	-	0.00
3	金融债券	80,145,000.00	4.78
4	其中：政策性金融债	80,145,000.00	4.78
5	企业债券	-	0.00
6	企业短期融资券	-	0.00
7	可转债	-	0.00
8	其他	-	0.00
9	合计	80,145,000.00	4.78

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

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	国债投资	-	0.00
2	央行票据	-	0.00
3	金融债券	80,145,000.00	4.78
4	其中：政策性金融债	80,145,000.00	4.78
5	企业债券	-	0.00
6	企业短期融资券	-	0.00
7	可转债	-	0.00
8	其他	-	0.00
9	合计	80,145,000.00	4.78

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

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	国债投资	-	0.00
2	央行票据	-	0.00
3	金融债券	80,145,000.00	4.78
4	其中：政策性金融债	80,145,000.00	4.78
5	企业债券	-	0.00
6	企业短期融资券	-	0.00
7	可转债	-	0.00
8	其他	-	0.00
9	合计	80,145,000.00	4.78

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

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	国债投资	-	0.00
2	央行票据	-	0.00
3	金融债券	80,145,000.00	4.78
4	其中：政策性金融债	80,145,000.00	4.78
5	企业债券	-	0.00
6	企业短期融资券	-	0.00
7	可转债	-	0.00
8	其他	-	0.00
9	合计	80,145,000.00	4.78

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

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	国债投资	-	0.00
2	央行票据	-	0.00
3	金融债券	80,145,000.00	4.78
4	其中：政策性金融债	80,145,000.00	4.78
5	企业债券	-	0.00
6	企业短期融资券	-	0.00
7	可转债	-	0.00
8	其他	-	0.00
9	合计	80,145,000.00	4.78

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

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	国债投资	-	0.00
2	央行票据	-	0.00
3	金融债券	80,145,000.00	4.78
4	其中：政策性金融债	80,145,000.00	4.78
5	企业债券	-	0.00
6	企业短期融资券	-	0.00
7	可转债	-	0.00
8	其他	-	0.00
9	合计	80,145,000.00	4.78

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