大成景安短融债券型证券投资基金

【2014】半年度报告摘要

基金管理人:大成基金管理有限公司
基金托管人:中国农业银行股份有限公司
送出日期:2014年8月28日

§1 重要提示

基金管理人的董事会、董事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。本半年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意,并由董事长签发。

基金托管人中国农业银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2014年8月22日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容,保证复核内容不存在虚假记载、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和运用基金资产,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。投资有风险,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及其更新。

本半年度报告摘要摘自半年度报告正文,投资者欲了解详细内容,应阅读半年度报告正文。

本报告中财务资料未经审计 。

本报告期自2014年01月01日起至06月30日止。

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金简称	大成景安短融债券	
基金主代码	000128	
交易代码	000128	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2013年5月24日	
基金管理人	大成基金管理有限公司	
基金托管人	中国农业银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	396,232,829.54份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称;	大成景安短融债券A	大成景安短融债券B
下属分级基金的交易代码;	000128	000129
报告期末下属分级基金的份额总额	285,416,150.08份	110,816,679.46份

2.2 基金产品说明

投资目标	在严格控制风险并保持流动性的基础上,主要通过对短期融资券和其他固定收益类证券的积极主动管理,力争超越同期银行定期存款利率,获取绝对回报。
投资策略	本基金主要目标是在努力保持本金稳妥、高流动性特点的同时,通过适当延长基金投资组合的久期、更高比例的短期融资券以及其它期限较短信用债券的投资,争取获取更高的投资收益。
业绩比较基准	中债短融总指数
风险收益特征	本基金为较低风险、较低收益的债券型基金产品,其风险收益水平高于货币市场基金,但低于混合型基金和股票型基金。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		大成基金管理有限公司	中国农业银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	杜鹏	李芳菲
	联系电话	0755-83183388	010-66060069
	电子邮箱	dupeng@dcfund.com.cn	lifangfei@abchina.com
客户服务电话		4008885558	95599
传真		0755-83199588	010-68121816

2.4 信息披露方式

登载基金半年度报告正文的管理人互联网网址	http://www.dcfund.com.cn
基金半年度报告备置地点	深圳市福田区深南大道7088号招商银行大厦32层大成基金管理有限公司 北京市西城区复兴门内大街28号凯晨世贸中心东座F9中国农业银行股份有限公司托管业务部

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位:人民币元

基金级别	大成景安短融债券A	大成景安短融债券B
3.1.1期间数据和指标	报告期(2014年1月1日-2014年6月30日)	报告期(2014年1月1日-2014年6月30日)
本期已实现收益	4,721,699.66	1,702,768.52
本期利润	5,099,235.33	2,188,662.38
加权平均基金份额本期利润	0.0427	0.0631
本期基金份额净值增长率	4.98%	5.18%
3.1.2期末数据和指标	报告期末(2014年6月30日)	
期末可供分配基金份额利润	0.0655	0.0679
期末基金资产净值	306,846,559.58	119,399,772.58
期末基金份额净值	1.075	1.077

注:1、本期已实现收益指本期利息收入、投资收益、其他收入(不含公允价值变动收益)扣除相关费用后的余额,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、所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用,计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

大成景安短融债券A

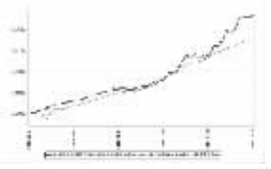
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	0.75%	0.10%	0.46%	0.02%	0.29%	0.08%
过去三个月	3.07%	0.10%	1.57%	0.02%	1.50%	0.08%
过去六个月	4.98%	0.09%	3.47%	0.02%	1.51%	0.07%
过去一年	6.97%	0.07%	5.80%	0.02%	1.17%	0.05%
自基金合同生效起至今	7.50%	0.07%	5.68%	0.03%	1.82%	0.04%

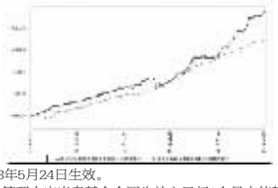
大成景安短融债券B

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	0.84%	0.11%	0.46%	0.02%	0.38%	0.09%
过去三个月	3.26%	0.10%	1.57%	0.02%	1.69%	0.08%
过去六个月	5.18%	0.09%	3.47%	0.02%	1.71%	0.07%
过去一年	7.06%	0.08%	5.80%	0.02%	1.26%	0.06%
自基金合同生效起至今	7.70%	0.08%	5.68%	0.03%	2.02%	0.05%

注:大成景安短融债券B类基金份额为零时,本基金将停止计算B类基金份额净值和份额累计净值,暂停计算期间的B类基金份额净值和份额累计净值将按照A类基金份额净值和份额累计净值披露,作为参考净值。具体见基金管理人2013年12月25日《关于大成景安短融债券型证券投资基金B类基金份额净值和份额累计净值计算与披露方法的说明》的公告。

3.2.2 自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变动的比较





注:1、本基金合同于2013年5月24日生效。

2、按基金合同规定,基金管理人应当自基金合同生效之日起6个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的约定。截至报告期末,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

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

大成基金管理有限公司经中国证监会证监基金字[1999]10号文批准,于1999年4月12日正式成立,是中国证监会批准成立的首批十家基金管理公司之一,注册资本为2亿元人民币,注册地为深圳。目前公司由四家股东组成,分别为中泰信托有限责任公司(48%)、光大证券股份有限公司(25%)、中国银河投资管理有限公司(25%)、广东证券股份有限公司(2%)。截至2014年6月30日,本基金管理人共管理1只封闭式证券投资基金:景福证券投资基金,4只ETF及1只ETF联接基金:深证成长40交易型开放式指数证券投资基金、大成深证成长40交易型开放式指数证券投资基金联接基金、大成中证500沪市交易型开放式指数证券投资基金、大成中证100交易型开放式指数证券投资基金、大成中证500深市交易型开放式指数证券投资基金,1只QDII基金:大成标普500等权重指数证券投资基金及37只开放式证券投资基金:大成景丰债券型证券投资基金(LOF)、大成价值增长证券投资基金、大成债券投资基金、大成蓝筹稳健证券投资基金、大成精选增值混合型证券投资基金、大成货币市场证券投资基金、大成沪深300指数证券投资基金、大成财富管理2020生命周期证券投资基金、大成积极成长股票型证券投资基金、大成创新成长混合型证券投资基金(LOF)、大成景阳领先股票型证券投资基金、大成强化收益债券型证券投资基金、大成策略回报股票型证券投资基金、大成行业轮动股票型证券投资基金、大成中证红利指数证券投资基金、大成核心双动力股票型证券投资基金、大成竞争优势股票型证券投资基金、大成内需增长股票型证券投资基金、大成消费主题股票型证券投资基金、大成可转债增强债券型证券投资基金、大成新锐产业股票型证券投资基金、大成景恒保本混合型证券投资基金、大成优选股票型证券投资基金(LOF)、大成现金增利货币市场基金、大成月添利理财债券型证券投资基金、大成理财21天债券型发起式基金、大成现金宝场内实时申赎货币市场基金、大成景安短融债券型证券投资基金、大成景兴信用债债券型证券投资基金、大成景旭纯债债券型证券投资基金、大成景祥分级债券型证券投资基金、大成中小盘股票型证券投资基金(LOF)、大成健康产业股票型证券投资基金、大成信用增利一年定期开放债券型证券投资基金、大成灵活配置混合型证券投资基金、大成招财宝货币市场基金、大成景益平稳收益混合型证券投资基金。

4.1.2 基金经理(或基金经理小组)及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理(助理)期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
陶铄先生	本基金基金经理	2013年5月24日	-	7年	中国科学院管理学硕士。曾任职于招商银行总行、普华永道会计师事务所、穆迪投资者服务有限公司、中国国际金融有限公司。曾担任中国国际金融有限公司固定收益部高级经理、副总经理。2010年9月加入大成基金管理有限公司,历任研究员、基金经理助理。2012年2月9日至2013年10月15日任大成景丰分级债券型证券投资基金基金经理。2012年9月20日至2014年4月4日任大成月添利理财债券型证券投资基金基金经理。2012年11月29日至2014年4月4日任大成理财21天债券型发起式证券投资基金基金经理。2013年5月24日起任大成景安短融债券型证券投资基金基金经理。2013年6月4日起任大成景兴信用债债券型证券投资基金基金经理。2013年10月16日起任大成景丰债券型证券投资基金(LOF)基金经理。2014年1月28日起任大成信用增利一年定期开放债券型证券投资基金基金经理。具有基金从业资格。国籍:中国
李达夫先生	本基金基金经理	2013年7月17日	-	8年	数量经济学硕士。2006年7月至2008年4月就职于东莞农商银行资金营运中心,历任交易员、研究员。2008年4月至2012年9月就职于国投瑞银基金管理有限公司固定收益部,2011年6月30日至2012年9月15日担任国投瑞银货币市场基金基金经理。2012年9月加入大成基金管理有限公司。2013年3月7日至2014年4月4日任大成货币市场证券投资基金。2013年3月7日起任大成现金增利货币市场基金基金经理。2013年7月17日起兼任大成景安短融债券型证券投资基金基金经理。具有基金从业资格。国籍:中国

注:1、任职日期、离任日期为本基金管理人作出决定之日。

2、证券从业年限的计算标准遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

本报告期内,本基金管理人严格遵守《证券法》、《证券投资基金法》、《大成景安短融债券型证券投资基金基金合同》和其他有关法律法规的规定,在基金管理运作中,大成景安短融债券型证券投资基金的投资范围、投资比例、投资组合、证券交易行为、信息披露等符合有关法律法规、行业监管规则和基金合同等规定,本基金没有发生重大违法违规行为,没有运用基金财产进行内幕交易和操纵市场行为以及进行有损基金投资人利益的关联交易,整体运作合法、合规。本基金将继续以取信于市场、取信于社会投资公众为宗旨,承诺将一如既往地本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金财产,在规范基金运作和严格控制投资风险的前提下,努力为基金份额持有人谋求最大利益。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

报告期内,基金管理人严格执行了公平交易的原则和制度。基金管理人对旗下所有投资组合间连续4个季度的日内、3日内及5日内股票及债券交易同向交易价差分析及相应交易情形的分析结果表明:债券交易同向交易频率较低;股票同向交易溢价率较大主要来源于市场因素(如个股当日价格振幅较高)及组合经理交易时机选择,即投资组合成交时间不一致以及成交价格的日内较大变动导致个别些组合间的成交价格差异较大。结合交易价差分布统计分析和潜在利益输送金额统计结果表明投资组合间不存在利益输送的可能性。

4.3.2 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同向交易、反向交易等可能存在异常交易的行为进行分析。2014年上半年公司旗下主动投资组合间股票交易存在11笔同日反向交易,原因是投资组合投资策略需要。主动型投资组合与指数型投资组合之间或指数型投资组合之间存在股票同日反向交易,参与交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量超过该股当日成交量5%的仅有3笔,原因为投资策略需要;投资组合间存在1笔债券同日反向交易,原因为投资策略需要。投资组合间相邻交易日反向交易的市场成交比例、成交均价等交易结果数据表明该类交易不对市场产生重大影响,无异常;投资组合间虽然存在同向交易行为,但结合交易价差分布统计分析和潜在利益输送金额统计结果表明投资组合间不存在利益输送的可能性。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2014年上半年,受房地产投资大幅下滑的拖累,经济增长持续回落,上半年GDP同比增长7.4%,低于2013年7.7%的增速。受食品价格影响,CPI同比有所波动,但涨幅仍然较为温和,上半年同比增长2.3%。PPI持续位于负值区间,上半年同比增长-1.8%。3月汇改后,人民币汇率预期发生变化,跨境资本套利空间缩小,二季度外汇占款仅增长660亿,明显低于一季度的7500亿。随着经济下行压力的增大,宏观政策迎来实质放松,央行通过再贷款、定向降准等定向宽松的方式降低社会融资成本,存贷比、信贷额度等监管指标陆续松动,财政支出力度也明显加大。

市场表现方面,中债综合财富指数上半年上涨5.82%,为2008年以来表现最好的半年,其中一季度上涨2.46%,二季度上涨3.28%。板块方面,企业债指数回报最高,上半年回报达到7.05%。金融债和国债指数回报次之,其中长久期品种表现最好,10年期金融债半年回报达到9.7%。中票指数半年回报为5.58%,短融指数为3.5%。交易所高收益债分化继续加大,随着保增长力度的加大,市场风险偏好提升,6月份部分高收益产业债大幅反弹,但半年回报仍然明显差于同期限高等级信用债或城投债。

上半年,本基金在控制风险的基础上,采取积极的组合策略提高了组合久期和杠杆水平,并根据个券风险收益比变化进行了调仓。通过利率品种进行波段操作以增强收益。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本报告期内,大成景安短融债券A份额净值增长率为4.98%,大成景安短融债券B份额净值增长率为5.18%,同期业绩比较基准增长率为3.47%,基金份额净值增长率高于同期业绩比较基准的表现。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望2014年下半年,稳增长的力度加大,经济出现底部企稳的迹象,但房地产市场销售依旧低迷,房地产投资持续下滑仍然是下半年经济增长面临的主要下行风险。猪肉价格波动给通胀带来一定不确定性,但在总需求仍然偏弱的背景下,通胀压力不大。受宏观环境不景气、不良贷款压力上升的影响,银行的风险偏好难以明显提升,利率传导不畅,企业仍然面临融资难、融资贵的问题,预计政策仍将保持一定的刺激力度,有望从"宽货币"转向"宽货币、宽信用、宽财政"的全面刺激。债市行情有望从上半年的以资本利得为主的快牛行情过度到以票息收入为主的慢牛行情。

基于以上判断,下半年本基金将以信用债作为主要配置,降低组合久期,保持一定的杠杆,并根据个券风险收益变化做动态调整。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本基金管理人指导基金估值业务的领导小组为公司估值委员会,公司估值委员会主要负责估值政策和估值程序的制定、修订以及执行情况的监督。估值委员会由股票投资部、研究部、固定收益部、风险管理部、基金运营部、监察稽核部、委托投资部指定人员组成。公司估值委员会的相关成员均具备相应的专业胜任能力和相关工作经历,估值委员会成员中包括两名投资组合经理。

股票投资部、研究部、固定收益部、风险管理部和委托投资部负责关注相关投资品种的动态,评判基金持有的投资品种是否处于不活跃的交易状态或者最近交易日后经济环境发生了重大变化或证券发行机构发生了影响证券价格的重大事件,从而确定估值日需要进行估值测算或者调整的投资品种;提出合理的数量分析模型对需要进行估值测算或者调整的投资品种进行公允价值定价与计量;定期对估值政策和程序进行评价,以保证其持续适用;基金运营部负责日常的基金资产的估值业务,执行基金估值政策,并负责与托管行沟通估值调整事项;监察稽核部负责审核估值政策和程序的一致性,监督估值委员会工作流程中的风险控制,并负责估值调整事项的信息披露工作。

本基金的日常估值程序由基金运营部基金估值核算员执行,并与托管银行的估值结果核对一致。基金估值政策的议定和修改采用集体讨论机制,基金经理及投资经理作为估值小组成员,对本基金持仓证券的交易情况、信息披露情况保持应有的职业敏感,向估值委员会提供估值参考信息,参与估值政策讨论。对需采用特别估值程序的证券,基金管理人及时启动特别估值程序,由估值委员会讨论议定特别估值方案并与托管行沟通后由基金运营部具体执行。

本基金管理人参与估值流程各方之间不存在任何重大利益冲突,截止报告期末未与外部估值定价服务机构签约。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金管理人严格按照本基金基金合同的规定进行收益分配。本报告期内本基金无收益分配事项。

§5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

在托管本基金的过程中,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义务,没有从事任何损害基金份额持有人利益的行为。

5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

本托管人认为, 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规定进行。

5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容的真实、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,未发现有损害基金持有人利益的行为。

§6 半年度财务会计报告(未经审计)

6.1 资产负债表

会计主体:大成景安短融债券型证券投资基金

报告截止日:2014年6月30日

单位:人民币元

资 产	本期末 2014年6月30日	上年度末 2013年12月31日
资 产:		
银行存款	9,455,441.93	9,519,713.45
结算备付金	5,488,004.22	2,815,948.60
存出保证金	27,507.73	35,448.42
交易性金融资产	563,278,985.94	161,138,072.70
其中:股票投资	-	-
基金投资	-	-
债券投资	563,278,985.94	161,138,072.70
资产支持证券投资	-	-
贵金属投资	-	-
衍生金融资产	-	-
买入返售金融资产	30,000,165.00	-
应收证券清算款	16,174,714.20	-
应收利息	7,125,470.40	1,754,536.24
应收股利	-	-
应收申购款	73,631,900.00	9,498,300.00
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	-
资产总计	705,182,189.42	184,762,019.41
负债和所有者权益	本期末 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	213,176,492.82	64,599,770.60
应付证券清算款	18,428,244.58	1,033,633.18
应付赎回款	46,916,458.96	6,060,985.17
应付管理人报酬	128,820.02	48,456.20
应付托管费	45,087.01	16,959.67
应付销售服务费	77,771.11	35,360.90
应付交易费用	23,379.58	5,379.60
应交税费	-	-
应付利息	26,419.45	5,177.66
应付利润	-	-
递延所得税负债	-	-
其他负债	113,183.73	130,000.00
负债合计	278,935,857.26	71,935,722.98
所有者权益:		
实收基金	396,232,829.54	110,218,424.47
未分配利润	30,013,502.62	2,607,871.96
所有者权益合计	426,246,332.16	112,826,296.43
负债和所有者权益总计	705,182,189.42	184,762,019.41

注:1.报告截止日2014年6月30日,大成景安短融债券A类基金份额净值人民币1.075元,大成景安短融债券B类基金份额净值人民币1.077元;基金份额总额396,232,829.54份,其中大成景安短融债券A类基金份额285,416,150.08份,大成景安短融债券B类基金份额110,816,679.46份。

2.本基金合同生效日为2013年5月24日,上年度可比期间2013年5月24日(基金合同生效日)至2013年6月30日。

6.2 利润表

会计主体:大成景安短融债券型证券投资基金

本报告期:2014年1月1日至2014年6月30日

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5月24日(基金合同生效日)至2013年6月30日
一、收入	10,005,291.77	22,938,293.68
1.利息收入	5,925,782.59	22,891,617.27
其中:存款利息收入	74,225.81	22,224,088.11
债券利息收入	5,827,688.26	10,060.41
资产支持证券利息收入	-	-
买入返售金融资产收入	23,868.52	657,468.75
其他利息收入	-	-
2.投资收益(损失以"-"填列)	3,116,310.09	-
其中:股票投资收益	-	-
基金投资收益	-	-
债券投资收益	3,116,310.09	-
资产支持证券投资收益	-	-
贵金属投资收益	-	-
衍生工具收益	-	-
股利收益	-	-
3.公允价值变动收益(损失以"-"号填列)	863,429.53	46,676.41
4.汇兑收益(损失以"-"号填列)	-	-
5.其他收入(损失以"-"号填列)	99,769.56	-
减:二、费用	2,717,394.06	3,004,797.46
1.管理人报酬	315,542.45	1,632,516.72
2.托管费	110,439.89	571,380.84
3.销售服务费	184,838.97	762,453.73
4.交易费用	18,671.15	51.33
5.利息支出	1,932,603.68	-
其中:卖出回购金融资产支出	1,932,603.68	-
6.其他费用	155,297.92	38,394.84
三、利润总额(亏损总额以"-"号填列)	7,287,897.71	19,933,496.22
减:所得税费用	-	-
四、净利润(净亏损以"-"号填列)	7,287,897.71	19,933,496.22

6.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体:大成景安短融债券型证券投资基金

本报告期:2014年1月1日至2014年6月30日

单位:人民币元

项目	本期 2014年1月1日至2014年6月30日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益(基金净值)	110,218,424.47	2,607,871.96	112,826,296.43
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	7,287,897.71	7,287,897.71
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数(净值减少以"-"号填列)	286,014,405.07	20,117,732.95	306,132,138.02
其中:1.基金申购款	1,815,347,723.29	121,522,928.04	1,936,870,651.33
2.基金赎回款	-1,529,333,318.22	-101,405,195.09	-1,630,738,513.31
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以"-"号填列)	-	-	-
五、期末所有者权益(基金净值)	396,232,829.54	30,013,502.62	426,246,332.16
项目	上年度可比期间 2013年5月24日(基金合同生效日)至2013年6月30日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益(基金净值)	4,454,390,252.97	-	4,454,390,252.97
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	19,933,496.22	19,933,496.22
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数(净值减少以"-"号填列)	-3,529,663,021.54	-14,838,191.86	-3,544,501,213.40
其中:1.基金申购款	12,628,615.13	50,853.83	12,679,468.96
2.基金赎回款	-3,542,291,636.67	-14,889,045.69	-3,557,180,682.36
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以"-"号填列)	-	-	-
五、期末所有者权益(基金净值)	924,727,231.43	5,095,304.36	929,822,535.79

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署:

_____张树忠_____ _____刘彩晖_____ _____范瑛_____

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 报表附注

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相一致的说明

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相一致。

6.4.2 税项

1.营业税、企业所得税

根据财政部、国家税务总局财税字[2004]78号文《关于证券投资基金税收政策的通知》的规定,自2004年1月1日起,对证券投资基金(封闭式证券投资基金、开放式证券投资基金)管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入,继续免征营业税和企业所得税;

根据财政部、国家税务总局财税[2008]1号文《关于企业所得税若干优惠政策的通知》的规定,对证券投资基金从证券市场中取得的收入,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。

2.个人所得税

根据财政部、国家税务总局财税字[2002]128号文《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》的规定,对基金取得的股票的股息、红利收入、债券的利息收入及储蓄利息收入,由上市公司、债券发行企业及金融机构在向基金派发股息、红利收入、债券的利息收入及储蓄利息收入时代扣代缴20%的个人所得税;

根据财政部、国家税务总局财税[2008]132号《财政部国家税务总局关于储蓄存款利息所得有关个人所得税政策的通知》,自2008年10月9日起暂免征收储蓄存款利息所得个人所得税。

6.4.3 关联方关系

6.4.3.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

本基金本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

6.4.3.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

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、注册登记机构、基金销售机构
中国农业银行股份有限公司(“中国农业银行”)	基金托管人、基金代销机构
中泰信托有限责任公司	基金管理人的股东
光大证券股份有限公司(“光大证券”)	基金管理人的股东、基金代销机构
中国银河投资管理有限公司	基金管理人的股东
广东证券股份有限公司(“广东证券”)	基金管理人的股东
大成国际资产管理有限公司(“大成国际”)	基金管理人的子公司
大成创新资本管理有限公司(“大成创新资本”)	基金管理人的合资子公司

注:1. 中国证监会于2005年11月6日作出对广东证券取消业务许可并责令关闭的行政处罚。

2. 下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立

6.4.4 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.4.1 通过关联方交易单元进行的交易

本基金本期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行交易。

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5月24日(基金合同生效日)至2013年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	315,542.45	1,632,516.72
其中:支付销售机构的客户维护费	120,856.01	652,934.87

注:基金管理费按前一日的基金资产净值的0.40%的年费率计提。计算方法如下:

H=E×0.40%/当年天数

H为每日应计提的基金管理费

E为前一日基金资产净值

基金管理费每日计算,逐日累计至每月月末,按月支付,由基金管理人向基金托管人发送基金管理费划款指令,基金托管人复核后于次月前3个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。若遇法定节假日、公休假等,支付日期顺延。

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5月24日(基金合同生效日)至2013年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	110,439.89	571,380.84

注:基金托管人的基金托管费按基金财产净值的0.14%年费率计提。计算方法如下:

H=E×0.14%/当年天数

H为每日应计提的基金托管费

E为前一日的基金财产净值

基金托管费每日计算,逐日累计至每月月末,按月支付,由基金管理人向基金托管人发送基金托管费划款指令,基金托管人复核后于次月前3个工作日内从基金财产中一次性支取。若遇法定节假日、公休日等,支付日期顺延。

6.4.4.2.3 销售服务费

单位:人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期 2014年1月1日至2014年6月30日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	大成景安短融债券A	大成景安短融债券B	合计
大成基金管理有限公司	1,091.20	470.87	1,562.07
中国农业银行	177,142.23	73.68	177,215.91
合计	178,233.43	544.55	178,777.98
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2013年5月24日(基金合同生效日)至2013年6月30日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	大成景安短融债券A	大成景安短融债券B	合计
大成基金管理有限公司	145.79	-	145.79
中国农业银行	745,559.99	16,416.42	761,976.41
合计	745,705.78	16,416.42	762,122.20

注:本基金分设两级基金份额:A级基金份额和B级基金份额。本基金对A级基金份额和B级基金份额设置不同的销售服务费率。本基金A级基金份额的销售服务年费率为0.30%,B级基金份额的年费率为0.01%。对于由B类降级为A类的基金份额持有人,年销售服务费率应自其降级后的下一个工作日起适用A类基金份额的费率。对于由A类升级为B类的基金份额持有人,年销售服务费率应自其升级后的下一个工作日起享受B类基金份额的费率。在通常情况下,某级的销售服务费按前一日该级基金资产净值计提。计算方法如下:

H=E×R/当年天数

H为每日应计提的基金销售服务费

E为前一日的基金财产净值

R为该级基金对应的销售服务费年费率

销售服务费每日计提,按月支付。由基金管理人向基金托管人发送基金销售服务费划付指令,经基金托管人复核后于次月首日起3个工作日内从基金财产中一次性支付给销售机构, 若遇法定节假日、休息日,支付日期顺延。

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

单位:人民币元

本期 2014年1月1日至2014年6月30日						
银行间市场交易的各关联方名称	债券交易金额		基金逆回购		基金正回购	
	基金买入	基金卖出	交易金额	利息收入	交易金额	利息支出
中国农业银行	-	-	-	-	20,000,000.00	14,153.29
上年度可比期间 2013年5月24日(基金合同生效日)至2013年6月30日						
银行间市场交易的各关联方名称	债券交易金额		基金逆回购		基金正回购	
	基金买入	基金卖出	交易金额	利息收入	交易金额	利息支出
-	-	-	-	-	-	-

6.4.4.4 各关联方投资本基金的情况

本报告期内及上年度可比期间本基金均未发生各关联方投资本基金的情况。

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

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5月24日(基金合同生效日)至2013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
中国农业银行	9,455,441.93	50,182.59	354,061,339.40	147,360.13

注:本基金的银行存款由基金托管人中国农业银行保管,并按银行间同业利率计息。

6.4.4.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金于本期及上年度可比期间均未在承销期内参与关联方承销证券。

6.4.4.7 其他关联交易事项的说明

本基金于本期及上年度可比期间均无其他关联交易事项。

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

本基金本期末未持有因认购新发/增发证券而于报告期末流通受限证券。

6.4.5.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金本期末未持有暂时停牌等流通受限的股票。

6.4.5.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.5.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末2014年6月30日止,本基金从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额110,159,524.92元,是以如下债券作为抵押:

金额单位:人民币元

债券代码	债券名称	回购到期日	期末估值单价	数量(张)	期末估值总额
140212	14国开12	2014-7-3	100.17	100,000	10,017,000.00
140207	14国开07	2014-7-3	100.36	100,000	10,036,000.00
041456003	14包钢集CP001	2014-7-1	101.28	20,000	2,025,600.00
011495001	14中化工SCP001	2014-7-1	100.02	100,000	10,002,000.00
041452016	14玉柴CP001	2014-7-1	100.99	100,000	10,099,000.00
041461039	14华信资产CP001	2014-7-1	99.85	100,000	9,985,000.00
041464036	14张资产CP001	2014-7-1	100.26	100,000	10,026,000.00
101469010	14非台国资MTN001	2014-7-1	99.78	100,000	9,978,000.00
041454039	14九洲CP001	2014-7-1	100.12	200,000	20,024,000.00
041456027	14开滦C