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

大成竞争优势股票型证券投资基金(原大成保本混合型证券投资基金转型)

【2014】半年度报告摘要

§1 重要提示

基金管理人的董事会及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责任。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2014年8月20日复核了本报告中的财务指标、净值表现和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。

大成保本混合型证券投资基金基金合同于2011年4月20日正式生效。本基金保本周期为三年(自本基金基金合同生效之日起至三个公历年后对应日止。如该对应日为非工作日,保本周期到期日顺延至下一个工作日),即2014年4月21日(周一)为本基金第一个保本周期到期日。

根据《大成保本混合型证券投资基金基金合同》(以下简称"《基金合同》")的约定,"保本周期届满时,在符合法律法规有关担保人、或保本义务人资质要求,并经基金管理人和基金托管人认可的担保人、或保本义务人同意为下一个保本周期提供保本保障,与本基金管理人签订保证合同或风险买断合同,同时本基金满足法律法规和本合同规定的基金存续要求的情况下,本基金继续存续并进入下一保本周期,下一保本周期的具体起它日期以本基金管理人届时公告为准。如保本周期到期日,本基金未能符合上述保本基金存续条件,则本基金按按《基金合同》的约定,变更为"大成竞争优势股票型证券投资基金"。同时,基金的投资目标、投资范围、投资策略以及基金费率等相关内容也将根据《基金合同》的相关约定作相应修改。上述变更必须经基金份额持有人大会决议,在报中国证监会备案后,提前在临时公告或《大成竞争优势股票型证券投资基金招募说明书》中予以说明。"

大成保本混合型证券投资基金第一个保本周期到期,按照基金合同的约定变更为非保本的"大成竞争优势股票型证券投资基金",基金托管人及基金注册登记机构不变,基金代码亦保持不变,为"090013"。转型后基金的投资目标、投资范围、投资策略以及基金费率等按照《大成竞争优势股票型证券投资基金基金合同》相关规定进行运作。就前述修改变更事项,本基金管理人已按照相关法律法规及《基金合同》的约定履行了相关手续及各项信息披露工作。

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。

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。

自2014年4月22日原大成保本混合型证券投资基金名称变更为大成竞争优势股票型证券投资基金。原大成保本混合型证券投资基金本报告期自2014年1月1日至2014年4月21日止,大大成竞争优势股票型证券投资基金本报告期自2014年4月22日至2014年6月30日止。

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

转型前:

基金简称	大成保本混合
基金主代码	090013
交易代码	090013
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2011年4月20日
基金管理人	大成基金管理有限公司
基金托管人	中国工商银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	462,220,984.84份
基金合同存续期(若有)	不定期

注:上表中"报告期末"指2014年4月21日。

2.1 基金基本情况

转型后:

基金简称	大成竞争优势股票
基金主代码	090013
交易代码	090013
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2014年4月22日
基金管理人	大成基金管理有限公司
基金托管人	中国工商银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	126,289,372.17份
基金合同存续期(若有)	不定期

注:上表中"报告期末"指2014年6月30日。

2.2 基金产品说明

转型前:

投资目标	依照保证合同,本基金通过运用租赁保险策略,在为符合保本条件的投资金额提供保本保障的基础上,追求基金资产的长期增值。
投资策略	本基金投资采用VPPI(可变组合保险策略)(Variable Proportion Portfolio Insurance),VPPI策略是国际投资管理领域中一种常见的投资组合保险机制,将基金资产分配在保本资产和风险资产上,并根据数量分析,市场波动等因素调整,缺正风险资产与保本资产在投资组合中的比重,在保证风险资产可能的损失额不超过扣除相关费用后的保本资产的最在收益与基金期末收益的基础上,参与分享市场可能出现的风险收益,从而保证本金安全,并实现基金资产长期增值。保本资产主要包括货币市场工具和债券等低风险资产,其中债券包括国债、金融债、企业债、公司债、债券回购、央行票据、可转换债券、可分离债券、短期融资券、资产支持证券以及经法律法规或中国证监会允许投资的其他债券类金融工具,风险资产主要包括股票、权证等高风险资产。
业绩比较基准	3年期银行定期存款利率(税后)。指按照基金合同生效日或新的保本周期开始日中国人民银行公布并执行的同期金融机构人民币存款基准利率(按照四舍五入的方法保留到小数点后第2位,单位为百分数)计算的与当期保本周期同期限的税后收益率。
风险收益特征	本基金为保本混合型基金产品,属证券投资基金中的低风险收益品种。

2.2 基金产品说明

转型后:

投资目标	主要投资于具有持续竞争优势的企业,追求基金资产长期增值。
投资策略	通过对宏观经济运行状况及其政策动态、货币金融运行状况及其政策动态、证券市场运行状况及其政策动态等因素"自上而下"的定量和定性分析,评估各类资产的投资价值,研究各类资产价值的变化趋势,确定组合中股票、债券等各类资产的投资比例。
业绩比较基准	75%×沪深300指数+25%×中债综合指数
风险收益特征	本股票型基金预期风险收益水平高于混合基金、债券基金和货币市场基金。

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	中国工商银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	杜鹏	赵会军
	联系电话	0755-83183388	010-66105799
	电子邮箱	dupeng@dcfund.com.cn	custody@icbc.com.cn
客户服务电话		4008885558	95588
传真		0755-83199588	010-66105798

2.4 信息披露方式

登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	http://www.dcfund.com.cn
基金年度报告备置地点	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55号中国工商银行托管业务部

§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位:人民币元

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)	
	转型前(2014年1月1日-2014年4月21日)	转型后(2014年4月22日-2014年6月30日)
本期已实现收益	3,650,911.94	239,972.29
本期利润	4,902,018.49	5,978,872.61
加权平均基金份额本期利润	0.0094	0.0381
本期基金份额净值增长率	0.96%	4.19%
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	0.0486	0.0541
期末基金资产净值	484,670,307.38	138,057,931.76
期末基金份额净值	1.049	1.093

注:1,本期已实现收益指基金本期利息收入、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。

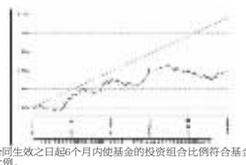
2,所述基金业绩指标不包括持有人交易基金的各项费用,计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

3.2 基金净值表现(转型前)

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

转型前						
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	0.38%	0.04%	0.35%	0.01%	0.03%	0.03%
过去三个月	1.45%	0.10%	1.04%	0.01%	0.41%	0.09%
过去六个月	0.38%	0.11%	2.12%	0.01%	-1.74%	0.10%
过去一年	-0.47%	0.11%	4.36%	0.01%	-4.83%	0.10%
过去三年	5.91%	0.09%	14.28%	0.01%	-8.37%	0.08%
自基金合同生效起至今	5.91%	0.09%	14.28%	0.01%	-8.37%	0.08%

3.2.2 自基金合同生效以来(2011年4月20日至2014年4月21日)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



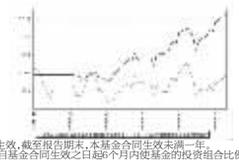
注:1,按基金合同规定,本基金自基金合同生效之日起6个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的约定,截至报告日本基金的各项投资比例已达到基金合同中规定的各项比例。

3.2 基金净值表现(转型后)

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

转型后						
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	3.11%	0.46%	0.49%	0.58%	2.62%	-0.12%
2014.4.22-2014.6.30	4.19%	0.35%	-0.12%	0.60%	4.31%	-0.25%

3.2.2 自基金转型以来(2014年4月22日至2014年6月30日)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2014年4月22日生效,截至报告期末,本基金合同生效未满一年。

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,本基金仍在建仓期。

§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,15只ODII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)、大成现金宝场内实时申赎货币市场基金、大成日盈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、大成积财宝货币市场基金、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(转型前)

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		
陈尚前先生	本基金基金经理	2011年4月20日	2014年4月21日	15年	南开大学经济学博士。曾任中国平安保险公司投资管理中心债券投资室主任和招商证券股份有限公司研究发展中心策略部经理。2002年加盟大成基金管理有限公司,2003年6月至2009年5月曾任大成债券基金基金经理。2008年8月6日至2014年4月4日任大成强化收益债券基金基金经理,2010年10月15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,2013年10月16日至2014年4月4日任大成景丰债券型证券投资基金(LOF)基金经理,2011年4月20日至2014年4月21日任大成保本混合型证券投资基金基金经理,2014年4月22日至2014年4月24日任大成竞争优势股票型证券投资基金基金经理,具有基金从业资格。国籍:中国
陈尚前先生	本基金基金经理	2014年4月22日	2014年4月24日	15年	南开大学经济学博士。曾任中国平安保险公司投资管理中心债券投资室主任和招商证券股份有限公司研究发展中心策略部经理。2002年加盟大成基金管理有限公司,2003年6月至2009年5月曾任大成债券基金基金经理。2008年8月6日至2014年4月4日任大成强化收益债券基金基金经理,2010年10月15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,2013年10月16日至2014年4月4日任大成景丰债券型证券投资基金(LOF)基金经理,2011年4月20日至2014年4月21日任大成保本混合型证券投资基金基金经理,2014年4月22日至2014年4月24日任大成竞争优势股票型证券投资基金基金经理,具有基金从业资格。国籍:中国
徐彦先生	本基金基金经理	2014年4月25日	-	8年	管理学硕士。曾就职于中国东方资产管理公司投资管理部,2007年加入大成基金研究部,曾任中游制造行业研究主管,2011年7月29日至2012年10月27日任景宏证券投资基金和大成行业轮动股票型证券投资基金基金经理助理。2012年10月31日起任大成策略回报股票型证券投资基金基金经理。2014年4月25日起兼任大成竞争优势股票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 管理人对投资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》、《大成保本混合型证券投资基金基金合同》、《大成竞争优势股票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,本基金的投资范围、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,未曾发现有发生违规行为,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况的分析结果表明: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)及组合经理交易计划执行进度,因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总组合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

公司风险管理指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,参与交易的股票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

本基金四月末转为股票型基金之后,按一贯思路在合适的价格买入了一些有核心竞争力的优质公司。但由于处在建仓期且基金规模变化太大,股票仓位较低,这对收益率有一定的负面影响。待基金规模比较稳定后,将把股票仓位提高到正常水平。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截止本报告期末,本基金份额资产净值为1.093元。本报告期内,转型前基金份额净值增长率为0.96%,同期业绩比较基准收益率为1.28%,低于业绩比较基准的表现;转型后基金份额净值增长率为4.19%,同期业绩比较基准收益率为-0.12%,高于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

对指数整体不悲观,除非出现新的信息改变这种大方向上的判断。

但由于传统内、外需边际上都见顶,传统三公司确实面临瓶颈,较长时间内整体不可能突破这个瓶颈。但环中也蕴含着好;对于传统行业中真正有竞争力的企业而言,现在反而是他们扩大份额的前段,那些习惯赚客易钱而没有真正积累的公司将被淘汰;优秀传统公司的转型升级也走在同行前面,这并非因为他们聪明长转型,而是因为不断进化是优秀的一种体现。

新经济毫无疑问是方向,但在当前的估值下要对行业趋势、盈利模式和管理团队有很深的理解才能挑选出真正的牛股,目前普涨的格局不可持续。我们将在自己的能力范围内发掘这类股票。

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可获得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调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调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启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

本报告期内,本基金托管人在对大成竞争优势股票型证券投资基金(原大成保本混合型证券投资基金转型)的托管过程中,严格遵守《证券投资基金法》及其他法律法规和基金合同的有关规定,不存在任何损害基金份额持有人利益的行为,完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

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

本报告期内,大成竞争优势股票型证券投资基金(原大成保本混合型证券投资基金转型)的管理人——大成基金管理有限公司在大成竞争优势股票型证券投资基金(原大成保本混合型证券投资基金转型)的投资运作、基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格计算、基金费用开支等问题上,不存在任何损害基金份额持有人利益的行为,在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。本报告期内,大成竞争优势股票型证券投资基金(原大成保本混合型证券投资基金转型)未进行利润分配。

5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人依法对大成基金管理有限公司编制和披露的大成竞争优势股票型证券投资基金(原大成保本混合型证券投资基金转型)2014年半年度报告中财务指标、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进行了核查,以上内容真实、准确和完整。

§6 半年度财务会计报告(未经审计)(转型前)

6.1 资产负债表(转型前)

会计主体:大成保本混合型证券投资基金

报告截止日:2014年4月21日

单位:人民币元

资产	报告期初至转型前	上年度末 2013年12月31日
资产:		
银行存款	468,918,905.73	53,411,263.28
结算备付金	-	273,467.94
存出保证金	81,327.68	263,309.71
交易性金融资产	19,646,000.00	539,379,748.03
其中:股票投资	-	33,471,967.53
基金投资	-	-
债券投资	19,646,000.00	505,907,780.50
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	-	288,373.71
应收证券清算款	-	10,877,218.88
应收利息	480,046.22	-
应收股利	-	1,980.64
应收申购款	8,643.46	-
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	604,495,362.19
资产总计	489,134,923.09	

负债和所有者权益	报告期初至转型前	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	-	39,159,741.26
应付证券清算款	-	-
应付赎回款	3,724,969.06	497,609.97
应付管理人报酬	352,307.22	584,259.59
应付托管费	58,717.88	97,376.60
应付销售服务费	-	-
应付交易费用	50,474.82	103,447.55
应交税费	64,016.00	64,016.00
应付利息	-	10,588.12
应付利润	-	-
递延所得税负债	-	-
其他负债	214,130.73	179,630.86
负债合计	4,464,615.71	40,696,669.95
所有者权益:		
实收基金	462,220,984.84	542,644,033.08
未分配利润	22,449,322.54	21,154,659.16
所有者权益合计	484,670,307.38	563,798,692.24
负债和所有者权益总计	489,134,923.09	604,495,362.19

注:报告截止日2014年4月21日,基金份额净值1.049元,基金份额总额462,220,984.84份。

6.2 利润表

会计主体:大成保本混合型证券投资基金

本报告期:2014年1月1日至2014年4月21日

单位:人民币元

项目	本期 2014年1月1日至2014年4月21日	上年度可比期间 2013年1月1日至2013年6月30日
一、收入	7,696,468.16	20,033,086.82
1.利息收入	6,732,894.72	9,862,345.57
其中:存款利息收入	3,582,416.96	178,942.14
债券利息收入	2,959,987.33	8,961,774.11
资产支持证券利息收入	-	-
买入返售金融资产收入	190,490.43	721,629.32
其他利息收入	-	-
2.投资收益(损失以"-"填列)	-508,938.77	13,590,809.46
其中:股票投资收益	-1,048,580.38	-132,023.57
基金投资收益	-	-
债券投资收益	540,141.61	13,707,167.82
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	-500.00	15,665.21
3.公允价值变动收益(损失以"-"号填列)	1,251,106.55	-3,915,059.75
4.汇兑收益(损失以"-"号填列)	-	-
5.其他收入(损失以"-"号填列)	221,405.66	494,991.54
减:二、费用	2,794,449.67	5,676,536.64
1.管理人报酬	1,977,436.54	4,410,929.69
2.托管费	329,572.79	735,154.94
3.销售服务费	-	-
4.交易费用	100,014.41	307,747.58
5.利息支出	247,300.15	-
其中:卖出回购金融资产支出	247,300.15	-
6.其他费用	140,125.78	222,704.43
三、利润总额(亏损总额以"-"号填列)	4,902,018.49	14,356,550.18
减:所得税费用	-	-
四、净利润(净亏损以"-"号填列)	4,902,018.49	14,356,550.18

6.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体:大成保本混合型证券投资基金

本报告期:2014年1月1日至2014年4月21日

单位:人民币元

项目	本期 2014年1月1日至2014年4月21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)	542,644,033.08	21,154,659.16	563,798,692.24
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	4,902,018.49	4,902,018.49
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)	-80,423,048.24	-3,607,355.11	-84,030,403.35
其中:1.基金申购款	752,859.77	31,952.88	784,812.65
2.基金赎回款	-81,175,908.01	-3,639,307.99	-84,815,216.00
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)	462,220,984.84	22,449,322.54	484,670,307.38

项目	上年度可比期间 2013年1月1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)	766,957,704.51	31,901,433.63	798,859,138.14
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	14,356,550.18	14,356,550.18
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)	-129,670,400.46	-6,652,311.76	-136,322,712.22
其中:1.基金申购款	2,376,937.78	119,933.90	2,496,871.68
2.基金赎回款	-132,047,338.24	-6,772,245.66	-138,819,583.90
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)	-	-7,540,649.65	-7,540,649.65
五、期末所有者权益(基金净值)	637,287,304.05	32,065,022.40	669,352,326.45

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

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]85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) 以发行基金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。

(3) 对基金取得的企业债券利息收入,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,按股期限在1个月以内(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,暂减按50%计入应纳税所得额;持股期限超过1年的,暂减按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,持股时间自解禁日起计算;解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按50%计入应纳税所得额。上述所得统一适用20%的税率计征个人所得税。

(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

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
中国工商银行股份有限公司("中国工商银行")	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

无。

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4月21日	上年度可比期间 2013年1月1日至2013年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	1,977,436.54	4,410,929.69
其中:支付销售机构的客户维护费	818,757.28	1,819,061.23

注:支付基金管理人大成基金的管理人报酬按前一日基金资产净值1.20%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 X 1.20% / 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4月21日	上年度可比期间 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	329,572.79	735,154.94

注:支付基金托管人中国工商银行的托管费按前一日基金资产净值0.20%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 X 0.20% / 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

本报告期内及上年度可比期间本基金未发生与关联方进行的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

本报告期内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。

6.4.4.4.2 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

本报告期末及上年度末除基金管理人之外的其他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4月21日		上年度可比期间 2013年1月1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
中国工商银行	468,918,905.73	29,905.00	34,159,596.49	151,010.84

注:本基金的银行存款由基金托管人中国工商银行保管,按银行同业利率计息。

6.4.4.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本报告期内及上年度可比期间本基金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

本基金本报告期内及上年度可比期间无须作说明的其他关联交易事项。

6.4.5 期末(2014年4月21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

于本报告期末,本基金未持有因认购新发或增发证券而流通受限的证券。

6.4.5.2 期末持有的暂时停牌股票

于本报告期末,本基金未持有暂时停牌等流通受限股票。

6.4.5.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

于本报告期末,本基金无从事债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

§6 半年度财务会计报告(未经审计)(转型后)

6.1 资产负债表(转型后)

会计主体:大成竞争优势股票型证券投资基金

报告截止日:2014年6月30日

单位:人民币元

资产	转型后至报告期末
资产:	
银行存款	33,343,684.07
结算备付金	515,742.83
存出保证金	61,365.89
交易性金融资产	106,753,591.08
其中:股票投资	86,949,591.08
基金投资	-
债券投资	19,804,000.00
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	-
应收证券清算款	-
应收利息	601,396.35
应收股利	-
应收申购款	2,174.33
递延所得税资产	-
其他资产	-
资产总计	141,277,954.55

负债和所有者权益	转型后至报告期末
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	-
应付证券清算款	2,338,104.82
应付赎回款	352,595.79
应付管理人报酬	176,021.46
应付托管费	29,336.91
应付销售服务费	-
应付交易费用