大成健康产业股票型证券投资基金

【2014】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:中国银行股份有限公司
送出日期:2015年3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。

基金托管人中国银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2015年3月26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。

根据中国证监会2014年1月24日下发的《关于大成中证500沪市交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金份额持有人大会决议备案的回函》(基金部函[2014]51号),大成中证500沪市交易型开放式指数证券投资基金联接基金转型为大成健康产业股票型证券投资基金,修改基金合同中的基金名称、基金类别、基金的投资目标、投资范围、投资理念和投资策略、业绩比较基准、风险收益特征、基金投资组合比例限制、基金的费用等条款。

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。

本年度报告摘要摘自年度报告正文,投资者欲了解证券内容,应阅读年度报告正文。

本报告财务资料已经审计。安永华明会计师事务所(特殊普通合伙)为本基金出具了无保留意见的审计报告,请投资者注意阅读。

本报告期自2014年01月01日起至12月31日止。

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金简称	大成健康产业股票
基金主代码	090020
交易代码	090020
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2012年8月28日
基金管理人	大成基金管理有限公司
基金托管人	中国银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	36,061,686.85份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金主要投资于与健康产业相关的优质上市公司,在控制风险的前提下,力争为投资者创造超越业绩比较基准的长期资本增值。
投资策略	本基金采用自上而下和自下而上相结合的主动投资策略,以宏观经济和政策研究为基础,通过分析影响证券市场整体运行的内外部因素,实施大类资产配置;通过对健康产业各个子行业发展生命周期、行业景气度、行业竞争格局、技术水平及其发展趋势等多角度,综合评估各个行业的投资价值,实施行业配置;对健康产业各公司在所属行业的竞争优势进行分析,结合股票基本面指标(包括成长性指标和估值指标),精选优质上市公司股票,构建投资组合。 为有效控制投资风险,本基金将根据风险管理的原则适度进行股指期货投资。股指期货投资将根据风险管理的原则,以套期保值为目的,并按照中国金融期货交易所套期保值管理的有关规定执行,对冲系统性风险和某些特殊情况下的流动性风险等。
业绩比较基准	申万医药生物行业指数×80%+中证综合债券指数×20%
风险收益特征	本基金为股票型基金,属于较高风险、较高预期收益的基金品种,其风险与预期收益高于混合基金、债券基金与货币市场基金。

注:根据中国证监会2014年1月24日下发的《关于大成中证500沪市交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金份额持有人大会决议备案的回函》(基金部函[2014]51号),大成中证500沪市交易型开放式指数证券投资基金联接基金转型为大成健康产业股票型证券投资基金,修改基金合同中的基金名称、基金类别、基金的投资目标、投资范围、投资理念和投资策略、业绩比较基准、风险收益特征、基金投资组合比例限制、基金的费用等条款。修订后的《大成健康产业股票型证券投资基金基金合同》自2014年1月24日起正式生效。

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	中国银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	杜鹏	王永民
	联系电话	0755-83183388	010-66594896
	电子邮箱	dupeng@dcfund.com.cn	fcid@bankofchina.com
客户服务电话		4008885558	95566
传真		0755-83199588	010-66594942

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1号中国银行股份有限公司托管业务部

§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

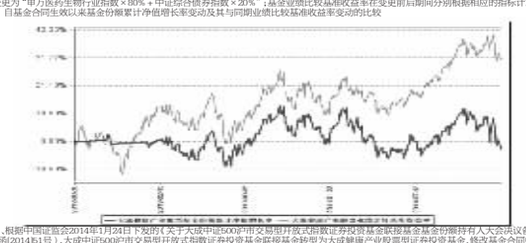
3.1.1 期间数据和指标	2014年	2013年	2012年8月28日(基金合同生效日)-2012年12月31日
本期已实现收益	-2,196,186.92	3,613,627.62	1,288,773.59
本期利润	-3,524,264.17	4,869,984.64	1,288,773.59
加权平均基金份额本期利润	-0.0644	0.1245	0.0097
本期基金份额净值增长率	-7.01%	6.14%	-0.60%
3.1.2 期末数据和指标	2014年末	2013年末	2012年末
期末可供分配基金份额利润	-0.0191	0.0545	-0.0058
期末基金资产净值	35,373,079.73	54,349,333.21	56,609,998.62
期末基金份额净值	0.981	1.055	0.994

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
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

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
过去三个月	-8.74%	1.53%	-0.74%	1.09%	-8.00%	0.44%
过去六个月	-0.81%	1.27%	12.69%	0.90%	-13.50%	0.37%
过去一年	-7.01%	1.25%	12.63%	0.95%	-19.64%	0.30%
自基金合同生效起至今	-1.90%	1.11%	32.07%	1.21%	-33.97%	-0.10%

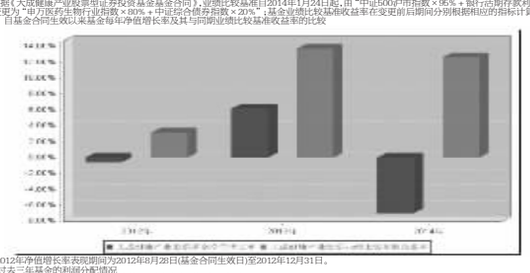
注:根据《大成健康产业股票型证券投资基金基金合同》,业绩比较基准自2014年1月24日起,由"中证500沪市指数×95%+银行活期存款利率(税后)×5%"变更为"申万医药生物行业指数×80%+中证综合债券指数×20%",基金业绩比较基准收益率在变更前后期间分别根据相应的指标计算。

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.根据中国证监会2014年1月24日下发的《关于大成中证500沪市交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金份额持有人大会决议备案的回函》(基金部函[2014]51号),大成中证500沪市交易型开放式指数证券投资基金联接基金转型为大成健康产业股票型证券投资基金,修改基金合同中的基金名称、基金类别、基金的投资目标、投资范围、投资理念和投资策略、业绩比较基准、风险收益特征、基金投资组合比例限制、基金的费用等条款。修订后的《大成健康产业股票型证券投资基金基金合同》自2014年1月24日起正式生效,截至报告期末本基金合同生效未满一年。
2.按照《大成健康产业股票型证券投资基金基金合同》规定,基金管理人应当自2014年1月24日(基金合同生效日)起六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,基金的投资组合比例已达到基金合同中规定的各项比例。
3.根据《大成健康产业股票型证券投资基金基金合同》,业绩比较基准自2014年1月24日起,由"中证500沪市指数×95%+银行活期存款利率(税后)×5%"变更为"申万医药生物行业指数×80%+中证综合债券指数×20%",基金业绩比较基准收益率在变更前后期间分别根据相应的指标计算。

3.2.3 自基金合同生效以来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



注:2012年净值增长率表现期间为2012年8月28日(基金合同生效日)至2012年12月31日。

3.3 过去三年基金的利润分配情况
本基金自2012年8月28日(基金合同生效日)以来未有利润分配事项。

§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中资基金管理公司之一,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12月31日,本基金管理人共管理4只ETF及1只ETF联接基金:大成中证100交易型开放式指数证券投资基金、深证成长40交易型开放式指数证券投资基金及大成深证成长40交易型开放式指数证券投资基金联接基金、中证500沪市交易型开放式指数证券投资基金、中证500沪市交易型开放式指数证券投资基金联接基金、沪深300指数证券投资基金、沪深300指数证券投资基金联接基金、大成标普500等权重指数证券投资基金、大成100指数证券投资基金及40只开放式证券投资基金:大成景丰债券型证券投资基金(LOP)、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、大证利民债券型证券投资基金、大证财富管理2020年债券型证券投资基金、大证稳健长短期债券证券投资基金、大成创新成长混合型证券投资基金(LOP)、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、大成景颐债券型证券投资基金、大成新经济产业股票型证券投资基金、大成沪深300指数证券投资基金、大成可转债债券型证券投资基金、大成新兴产业股票型证券投资基金、大成优选股票型证券投资基金(LOP)、大成月添利理财债券型证券投资基金、大成现金增利货币市场证券投资基金、大成月月盈短期理财债券型证券投资基金、大成固定短债内定开债券型证券投资基金、大成景安短债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、大成景祥债券型证券投资基金、大成信用债券一年定期开放债券型证券投资基金、大成鑫瑞产业股票型证券投资基金、大成中小盘股票型证券投资基金(LOP)、大成灵活配置混合型证券投资基金、大成丰时宝货币市场基金、大成景益平稳收益债券型证券投资基金、大成添利宝货币市场基金、大成景利混合型证券投资基金和大成产业升级股票型证券投资基金(LOP)。

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		
杨挺先生	本基金基金经理	2014年6月26日	-	6年	工学硕士。曾任广发证券股份有限公司发展研究中心研究员;2012年8月起任职于大成基金管理有限公司研究部,历任研究部研究员、2014年3月18日起任大成健康产业股票型证券投资基金基金经理助理、2014年6月26日起任大成健康产业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》、《大成健康产业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;本基金没有发生违反法规行为,没有采取损害基金财产或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。本基金管理还以信守市场、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 公平交易制度和控制方法
根据《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》的规定,基金管理人制订了《大成基金管理有限公司公平交易制度》及《大成基金管理有限公司异常交易监控与处置制度》,基金管理人旗下投资组合严格按照制度的规定,参与股票、债券的一级市场申购、二级市场交易等投资管理活动,内容包括投权、研究分析、投资决策、交易执行、业绩评估等与投资管理活动相关的各个环节。研究部负责提供投资研究支持,投资部门负责投资决策,交易管理部负责实施交易并实时监控,监察稽核部负责事前监督、事中检查和事后稽核,风险管理部负责对交易情况进行合理性分析,通过多部门的协作互控,保证了公平交易的可操作、可稽核和可持续。
4.3.2 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。
基金管理人运用统计分析方法和工具,对旗下所有投资组合同连续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进行分析。分析结果表明:债券交易同向交易频率较低;股票同向交易频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,因投资组合成交时间不一致以及成交价格的日内较大波动导致个别组合间的成交价格差异较大,但结合交易价差与跟统计分析,未发现违反公平交易原则的异常情况。
4.3.3 异常交易行为的专项说明
报告期内,基金管理人旗下所有投组合未发现存在异常交易行为。主动投资组合同向股票交易存在23笔同日反向交易,原因为投资策略需要。主动型投资组合与指数型投资组合之间存在股票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5笔,原因为投资策略需要;主动投资组合间债券交易存在2笔同日反向交易,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。
4.4 管理人对报告期内基金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
14年中国经济面临较大下行压力,工业增长的动能不足,投资疲弱。回顾全年的经济局势,经济数据在基建投资扩张的拉动下5-6月曾出现短期的回暖,但随后14年延续落动势。工业增加值、PMI等数据的边际改善,使得市场对经济下行压力、利润造成侵蚀、基建投资、地产投资三大支柱投资在14年上半年基本下滑,拖累固定资产投资疲弱。在政策面上,随着宏观数据的回落,为改策放松打开了空间。14年基建投资加速,地产限购逐步放开,此外央行通过降息、定向降准、再贷款、SLO、SLF、MLF等多种手段促进资金利率的下降,需求端刺激政策密集推出。
人民币表现来看,上半年的上证指数可谓疯牛年,除了2月两会召开前的"春季躁动"与4月"沪港通"带来的主题行情之外,在2000点上下100点的空间内窄幅波动,乏点芳陈。而下半年的市场活跃度明显上升,7月下旬市场在万亿PSL带来的流动性宽松预期,"沪港通"开启在即以及海外资金的流入带来的A股"估值接轨"预期等因素的共同作用下,迎来一波脉冲式上涨行情。而经历短期的调整休息后,11月末大盘在消息的提振下,再度强势上攻,最终达上2000点的五年新高,为14年浓墨重彩。整个14年上证综指上涨52.87%,深证成指涨43.06%,创业板涨46.26%,行业表现上,14年涨幅最高的行业是多元金融(160%),保险(84%)、地产(74%)、公用事业(72%)和银行(72%),而涨幅最小的行业是医疗保健和日常消费和能源。
本基金在四季度基本保持了较高仓位运行,继续延续了三季度较为激进的配置思路,并开始逐步布局快车度行情。但是在11月中下旬开始对医药行业和创业板的下跌风险估计不足,在配置上没有回避并部分负债较高的创业板公司,这些公司在最后一个月发生了较大回撤,是本季度较为明显的失误。不过组合已经在年底完成了调整,目前组合基本兼顾了估值的安全性和标的的成长性。
4.4.2 报告期内基金的业绩表现
截止本报告期末,本基金份额净资产净值为0.981元,本报告期基金份额净值增长率为-7.01%,同期业绩比较基准收益率为12.63%,低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
展望2015年经济运行仍处于下行趋势中——人口要素意味着潜在经济增速已经显著下行,而政府转型意味着总需求存在萎缩的趋势,因此经济转型意味着增速的下行。展望2015年,经济运行仍将维持减速趋势,预计GDP同比增速将回落0.3个百分点至7.1%左右,CPI年月同比增速在1-2%的区间中运行,未来仍存在一定的通胀压力。
15年1-2月步入经济数据真空期,政策进一步宽松的趋势没有结束。目前来看,四季度以来的宏观数据虽然低于预期,但是仍然处于窄幅波动的区间之内,且随着近期地产销售的企稳回升,短期仍看不到宏观经济大幅恶化的可能;而从政策面来看,在较低的房价水平和通胀水平下,货币政策仍有进一步宽松的空间,且目前来自地产和"一带一路"的增量又不太平于让投资者担心政策宽松是无效的。
展望15年的股市表现,我们预计在上半年有一个较为明显的宏观经济环境(可以容忍短期小幅回落但不能发生系统性风险);2.宽松的政策环境和流动性环境;3.经济转型和各项改革的顺利推进。对于15年下半年的判断目前还比较模糊,以上三点条件可能会发生变化。
医药板块依然是我们长期看好的板块,但是板块也在经历转型,行业内部分化将会加剧,配置上主要结值风险和标的流通性,并注意医药电商和医药信息化的投资机会。
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明
本基金管理人和托管人共同组成的基金估值委员会,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。估值委员会由投资管理部、研究部、固定收益部、财务部、风险管理部、基金运作部、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有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具有投资组合经理。
报告期内,公司估值委员会成员未发生变动。
报告期内,基金管理人对本基金所持有的长期停牌股票进行了估值调整,其依据和方法是根据中国证监会证监会公告[2008]38号《关于开展证券投资基金估值业务的指导意见》,采用"指数法"对停牌股票进行估值。
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。本报告期末本基金无可供分配收益。
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明
本基金在本报告期内,曾于2014年10月17日至2014年12月31日出现了连续20个工作日资产净值低于五千万元的情形。

§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,中国银行股份有限公司(以下称"本托管人")在对大成健康产业股票型证券投资基金(以下称"本基金")的托管过程中,严格遵守《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的有关规定,不存在损害基金份额持有人利益的行为,完全履职责尽地履行了应尽的义务。
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,本托管人根据《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定,对本基金管理人的投资运作进行了必要的监督,对基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算以及基金费用开支等方面进行了认真地复核,未发现本基金管理人存在损害基金份额持有人利益的行为。
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
本报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告(注:财务会计报告中的"金融工具风险及管理"部分未在托管人复核范围内)、投资组合报告等数据真实、准确和完整。

§6 审计报告

本基金2014年年度财务会计报告已经安永华明会计师事务所(特殊普通合伙)审计,注册会计师签字出具了标准无保留意见的审计报告。投资者欲了解本基金审计报告详细内容,应阅读年度报告正文。

§7 年度财务报表

7.1 资产负债表
会计主体:大成健康产业股票型证券投资基金
报告截止日:2014年12月31日

单位:人民币元

资 产	本期末 2014年12月31日	上年度末 2013年12月31日
资 产:		
银行存款	5,861,249.64	14,075,300.25
结算备付金	135,748.05	-
存出保证金	31,174.87	11,514.96
交易性金融资产	29,417,825.78	49,913,189.15
其中:股票投资	29,417,825.78	3,077.14
基金投资	-	49,910,112.01
债券投资	-	-
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	1,014,621.71	88,234.00
应收利息	1,067.89	4,482.07
应收股利	-	-
应收申购款	75,684.44	105,541.38
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	1,488.88
资产总计	36,537,372.38	64,199,750.69
负债和所有者权益	本期末 2014年12月31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	-	-
应付证券清算款	536,415.09	9,536,219.35
应付赎回款	96,507.69	137,085.68
应付管理人报酬	49,185.43	3,791.22
应付托管费	8,197.55	758.24
应付销售服务费	-	-
应付交易费用	143,659.44	42,085.76
应交税费	-	-
应付利息	-	-
应付利润	-	-
递延所得税负债	-	-
其他负债	330,327.45	130,477.23
负债合计	1,164,292.65	9,850,417.48
所有者权益:		
实收基金	36,061,686.85	51,540,055.08
未分配利润	-688,607.12	2,809,278.13
所有者权益合计	35,373,079.73	54,349,333.21
负债和所有者权益总计	36,537,372.38	64,199,750.69

注:1.根据中国证监会2014年1月24日下发的《关于大成中证500沪市交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金份额持有人大会决议备案的回函》(基金部函[2014]51号),大成中证500沪市交易型开放式指数证券投资基金联接基金转型为大成健康产业股票型证券投资基金,修改基金合同中的基金名称、基金类别、基金的投资目标、投资范围、投资理念和投资策略、业绩比较基准、风险收益特征、基金投资组合比例限制、基金的费用等条款。修订后的《大成

健康产业股票型证券投资基金基金合同》自2014年1月24日起正式生效,截至报告期末本基金合同生效未满一年。
2.报告截止日2014年12月31日,基金份额净值为人民币0.981元,基金份额总额36,061,686.85份。
7.2 利润表
会计主体:大成健康产业股票型证券投资基金
本报告期:2014年1月1日至2014年12月31日

单位:人民币元

项目	本期 2014年1月1日至2014年12月31日	上年度可比期间 2013年1月1日至2013年12月31日
一.收入	-826,699.75	5,410,090.04
1.利息收入	64,082.05	103,341.58
其中:存款利息收入	64,082.05	103,341.58
债券利息收入	-	-
资产支持证券利息收入	-	-
买入返售金融资产收入	-	-
其他利息收入	-	-
2.投资收益(损失以"-"填列)	293,498.66	3,688,911.88
其中:股票投资收益	-1,862,361.56	-581,610.54
基金投资收益	1,857,349.56	4,269,950.69
债券投资收益	-	-
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	298,510.66	571.73
3.公允价值变动收益(损失以"-"号填列)	-1,328,077.25	1,256,357.02
4.汇兑收益(损失以"-"号填列)	-	-
5.其他收入(损失以"-"号填列)	143,796.79	361,479.56
减:二.费用	2,697,564.42	540,105.40
1.管理人报酬	782,076.80	54,462.61
2.托管费	130,384.11	10,892.61
3.销售服务费	-	-
4.交易费用	1,395,076.57	319,266.62
5.利息支出	-	-
其中:卖出回购金融资产支出	-	-
6.其他费用	390,026.94	155,483.56
三.利润总额(亏损总额以"-"号填列)	-3,524,264.17	4,869,984.64
减:所得税费用	-	-
四.净利润(净亏损以"-"号填列)	-3,524,264.17	4,869,984.64

7.3 所有者权益(基金净值)变动表
会计主体:大成健康产业股票型证券投资基金
本报告期:2014年1月1日至2014年12月31日

单位:人民币元

项目	本期 2014年1月1日至2014年12月31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)	51,540,055.08	2,809,278.13	54,349,333.21
二.本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	-3,524,264.17	-3,524,264.17
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)	-15,478,368.23	26,378.92	-15,451,989.31
其中:1.基金申购款	96,689,473.12	6,099,549.62	102,789,022.74
2.基金赎回款	-112,167,841.35	-6,073,170.70	-118,241,012.05
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)	36,061,686.85	-688,607.12	35,373,079.73

项目	上年度可比期间 2013年1月1日至2013年12月31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)	56,942,995.26	-332,996.64	56,609,998.62
二.本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	4,869,984.64	4,869,984.64
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)	-5,402,940.18	-1,727,709.87	-7,130,650.05
其中:1.基金申购款	278,705,774.71	5,144,644.34	283,850,419.05
2.基金赎回款	-284,108,714.89	-6,872,354.21	-290,981,069.10
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)	51,540,055.08	2,809,278.13	54,349,333.21

报表附注为财务报表的组成部分。
本报告7.1至7.4财务报表由下列负责人签署:
罗登攀 肖剑 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
7.4 报表附注
7.4.1 本报告期所采用的会计政策、会计估计、税项与最近一期年度报告相一致的说明
财政部于2014年颁布《企业会计准则第39号——公允价值计量》、《企业会计准则第40号——合营安排》、《企业会计准则第41号——在其他主体中权益的披露》和修订后的《企业会计准则第2号——长期股权投资》、《企业会计准则第9号——职工薪酬》、《企业会计准则第30号——财务报表列报》、《企业会计准则第33号——合并财务报表》以及《企业会计准则第37号——金融工具列报》,要求除《企业会计准则第37号——金融工具列报》自2014年度财务报表起施行外,其他准则自2014年7月1日起施行。上述准则对本基金本报告期无重大影响。
除上述会计政策变更事项,本报告期所采用的其他会计政策、会计估计、税项与最近一期年度报告相一致。
7.4.2 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、注册登记机构、基金销售机构
中国银行股份有限公司("中国银行")	基金托管人、基金销售机构
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、基金销售机构
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")	基金管理人的合资企业

注:1.根据中国证监会2014年1月24日下发的《关于大成中证500沪市交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金份额持有人大会决议备案的回函》(基金部函[2014]51号),大成中证500沪市交易型开放式指数证券投资基金联接基金转型为大成健康产业股票型证券投资基金,转型后与中证500沪市交易型开放式指数证券投资基金不再存在关联方关系。
2.中国证监会于2006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。
3.以下关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。
7.4.3 本报告期及上年度可比期间的关联方交易
7.4.3.1 通过关联方交易单元进行的交易
7.4.3.1.1 股票交易

金额单位:人民币元

关联方名称	本期 2014年1月1日至2014年12月31日		上年度可比期间 2013年1月1日至2013年12月31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	44,752,389.42	4.87%	-	0.00%

7.4.3.1.2 权证交易
本基金期内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。
7.4.3.1.3 应支付关联方的佣金

金额单位:人民币元

关联方名称	本期 2014年1月1日至2014年12月31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	39,660.31	4.83%	-	0.00%

关联方名称	上年度可比期间 2013年1月1日至2013年12月31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
-	-	0.00	-	0.00

注:1)上述佣金按市场佣金率计算,以不降低市场正常佣金率为原则,经双方协商确定的证券经纪业务佣金收取率。
(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。
7.4.3.2 关联方投资
7.4.3.2.1 基金管理费

单位:人民币元

项目	本期 2014年1月1日至2014年12月31日	上年度可比期间 2013年1月1日至2013年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	782,076.80	54,462.61
其中:支付销售机构的客户维护费	294,772.69	52,229.16

注:基金管理费每日计提,按月支付。本基金的管理费按前一日基金资产净值的1.50%年费率计提。管理费的计算方法如下:
H=E×1.50%/当年天数
H为每日应计提的基金管理费
E为前一日的基金资产净值
7.4.3.2.2 基金托管费

单位:人民币元

项目	本期 2014年1月1日至2014年12月31日	上年度可比期间 2013年1月1日至2013年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	130,384.11	10,892.61

注:基金托管费每日计提,按月支付。本基金的托管费按前一日基金资产净值的0.25%年费率计提。托管费的计算方法如下:
H=E×0.25%/当年天数
H为每日应计提的基金托管费
E为前一日的基金资产净值
7.4.3.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易
本基金本报告期末与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。
7.4.3.4 各关联方投资本基金的情况
7.4.3.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

份额单位:份

项目	本期 2014年1月1日至2014年12月31日	上年度可比期间 2013年1月1日至2013年12月31日
基金合同生效日(2012年8月28日)持有的基金份额	-	-
期初持有的基金份额	5,024,120.60	-
期间申购/买入总份额	-	5,024,120.60
期间因拆分变动份额	-	-
减:期间赎回/卖出总份额	-	-
期末持有的基金份额	5,024,120.60	5,024,120.60
期末持有的基金份额占基金份额比例	13.93%	9.75%

注:基金管理人申购基本基金的费率与本基金法律文件规定一致。
7.4.3.4.2 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报告期末及上年度末均未持有本基金份额。
7.4.3.5 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 2014年1月1日至2014年12月31日		上年度可比期间 2013年1月1日至2013年12月31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	5,861,249.64	57,378.79	14,075,300.25	67,354.06

注:本基金的银行存款由基金托管人中国银行保管,并按银行间同业利率计息。
7.4.3.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况
本基金于本报告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。
7.4.3.7 其他关联交易事项的说明
本基金本报告期无其他关联交易事项。
7.4 期末(2014年12月31日)本基金持有的流通受限证券
7.4.4.1 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/增发证券而于年末流通受限证券。
7.4.4.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位:人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量(股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
002437	誉衡药业	2014-11-21	重大事项	23.75	2015-01-26	26.13	37,000	827,109.35	878,750.00	-
300168	万达信息	2014-12-31	重大事项	46.20	2015-01-08	44.50	11,934	584,743.00	551,350.80	-

7.4.4.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券
7.4.4.3.1 银行间市场债券正回购
截至本报告期末,本基金未持有从事银行间市场债券正回购交易中作为抵押的债券。
7.4.4.3.2 交易所市场债券正回购
截至本报告期末,本基金未持有从事交易所市场债券正回购交易中作为抵押的债券。

§8 投资组合报告

8.1 期末基金资产组合情况

金额单位:人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	29,417,825.78	80.51
	其中:股票	29,417,825.78	80.51
2	固定收益投资	-	0.00
	其中:债券	-	0.00
	资产支持证券	-	0.00
3	贵金属投资	-	0.00
4	金融衍生品投资	-	0.00
5	买入返售金融资产	-	0.00
	其中:买断