

## 2013年12月31日

[illegible][illegible]

1 报告期末基金资产净值情况			
序号	项目	金额 (元)	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	-	0.00
	其中:股票	-	0.00
2	固定收益投资	339,369,422.66	91.48
	其中:债券	339,369,422.66	91.48
	资产支持证券	-	0.00
3	金融衍生品投资	-	0.00
4	买入返售金融资产	-	0.00
	其中:买断式回购的买入返售金融资产	-	0.00
5	银行存款和结算备付金合计	5,061,819.66	1.36
6	其他资产	26,541,912.21	7.15
7	合计	370,973,154.53	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合  
本基金本报告期末未持有股票。

5.3 报告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  
本基金本报告期末未持有股票。

5.4 报告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 (元)	占基金资产净值比例 (%)
1	国债券	12,956,300.00	3.08



5.1 本期国债期货投资政策

本基金本报告未投资国债期货。

5.2 报告期末本基金投资的国债期货合约和损益明细

本基金本报告未投资国债期货。

5.3 本期国债期货投资评价

本基金本报告未投资国债期货。

5.4 投资股指期货概述

5.5 本基金投资的前十名证券的发行主体未出现被监管部门立案调查,或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形

5.6 本基金投资的前十名股票中,没有投资于超出基金合同规定的备选股票库之外的股票。

5.7 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	36,626.00
2	应收证券清算款	19,999,952.40
3	应收股利	
4	应收利息	6,504,613.82
5	应收申购款	700.09
6	其他应收款	
7	待摊费用	

8	其他		
9	合计		26,541,912.21

5.9.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细  
本基金报告期末未持有可转换债券。

5.9.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明  
本基金本报告期末未持有股票。

5.9.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分  
由于四舍五入原因,分项之和与合计可能有误差。

**§ 6 开放式基金资产变动**

项目	大成资管纯债债券A	大成资管纯债债券B
报告期期初基金份额总额	253,344,669.50	212,119,249.84
报告期期间基金总申购份额	162,008.11	524,210.09
减:报告期期间基金总赎回份额	89,562,063.46	121,759,389.72
减:报告期期间基金总拆分变动份额(份额减少以“-”填列)	--	--
报告期末基金份额总额	163,944,694.15	90,884,072.21

**§ 7 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细**  
本报告期基金管理人未运用固有资金投资本基金。

**§ 8 影响投资者决策的其他重要信息**

本基金本报告期无影响投资者决策的其他重要信息

**§ 9 备查文件目录**

9.1 备查文件目录

1、中国证监会批准设立大成宏观战略债券型证券投资基金的文件；

2、《大成宏观战略债券型证券投资基金合同》；

3、《大成宏观战略债券型证券投资基金托管协议》；

4、大成基金管理有限公司批准文件、营业执照、公司章程；

5、本招募说明书在指定报刊上披露的多种公告原稿。

9.2 存放地点

本招募说明书存放在基金管理人和托管人的办公住所。

9.3 查阅方式

投资者可在营业时间免费查阅，或登录本基金管理人网站<http://www.dcfund.com.cn>进行查阅。

大成基金管理有限公司  
2014年11月22日

5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名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。

5.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资明细  
本基金本报告期末未持有权证。

5.8 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明  
5.8.1 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。

5.8.2 本基金投资股指期货的投资政策  
本基金本报告期末未持仓股指期货。

5.9 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.9.1 本期国债期货投资政策

本基金本报告期未投资国债期货。

5.9.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期未投资国债期货。

5.10 本期国债期货投资统计数据

5.10.1 持仓组合报告表

5.10.2 报告期内本基金投资的前十名证券的发行主体被监管部门立案调查,或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情况

根据中国证券监督管理委员会(中国证监会)《公告》股份有限公司于2013年5月21日和2013年6月14日发布的公告,该上市公司的实际控制人曹永祥有限公司(以下简称“集团”)因违反《中华人民共和国证券法》(以下简称“《证券法》”)及《上市公司信息披露管理办法》(以下简称“《信息披露办法》”),涉嫌内幕交易和对关联方实施财务舞弊行为被中国证监会立案调查(简称“立案调查”)。该上市公司(以下简称“发行人”)在上市期间中的营业收入人民币 2,853.75 万元,净利润以人民币 1,510 万元计算,经审计账面净资产约 3 个月。

在上述公告发布后,本基金管理人对该上市公司进行进一步了解和分析,认为上述处罚不会对中国平保的投资价值和实质性影响,因此,本基金管理人未对投资组合构成重大改变。

5.10.3 本基金投资的前十名股票中未出现卖出或强制平仓的备选股票。

5.10.4 其他资产构成

序号	名称	金额 (元)
1	待偿保证金	1,393,812.30
2	应收关联方借款	7,521,247.68
3	应收股利	—
4	应收利息	5,770,542.68
5	应收关联方款	91,260.89
6	其他应收款	—
7	待摊费用	—
8	其他	—
9	合计	14,776,962.90

5.10.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

5.10.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

5.10.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入原因,分项之和与合计可能有尾差。

§6 开放式基金份额变动		单位:份
报告期期初基金份额总额		14,008,830,761.00
报告期期间基金总申购份额		18,354,144.07
减:报告期期间基金总赎回份额		517,661,419.11
报告期期间基金净申购份额		-
报告期期末基金份额总额		13,589,528,486.45

1. 中国证监会批准设立大成蓝筹稳健证券投资基金的文件；

2. 《大成蓝筹稳健证券投资基金合同》；

3. 《大成蓝筹稳健证券投资基金托管协议》；

4. 大成基金管理有限公司批准文件、营业执照、公司章程；

5. 本报告期内在指定报纸上披露的各种公告文稿。

9.2 存放地点

本季度报告存放在本基金管理人和托管人的住所。

9.3 查阅方式

投资者可在营业时间免费查阅，或登录本基金管理人网站<http://www.dcfund.com.cn>进行查阅。

**大成基金管理有限公司**  
2014年11月22日

---