深证成长40交易型开放式指数证券投资基金

2014 第一季度 报告

2014年3月31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
报告送出日期:2014年4月21日

§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。

基金托管人中国农业银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2014年4月17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。

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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2014年1月1日起至3月31日止。

§2 基金产品概况

基金简称	大成深证成长40ETF
交易代码	159906
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2010年12月21日
报告期末基金份额总额	1,353,639,725.00份
投资目标	紧密跟踪标的指数,追求与标的指数相似的投资回报。
投资策略	本基金主要采取完全复制法,即完全按照标的指数的成份股组成及其权重构建投资组合,并根据标的指数成份股及其权重的变动进行相应调整。 当预期指数成份股发生调整和成份股发生配股、增发、分红等行为时,或因基金的申购和赎回等对本基金跟踪标的指数的效果可能带来影响时,或因某些特殊情况导致流动性不足时,或其他原因导致无法有效复制和跟踪标的指数时,基金管理人可以对投资组合管理进行适当变通和调整,从而使得投资组合紧密地跟踪标的指数。
业绩比较基准	深证成长40价格指数
风险收益特征	本基金属股票基金,预期风险与预期收益高于混合基金、债券基金与货币市场基金。本基金为指数型基金,主要采用完全复制法跟踪标的指数的表现,具有与标的指数以及标的指数所代表的股票市场相似的风险收益特征。
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

注:本基金在交易所行情系统净值揭示等其他信息披露场合下,可简称为"深成长"。

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位:人民币元

主要财务指标	报告期(2014年1月1日 - 2014年3月31日)
1.本期已实现收益	-7,443,147.66
2.本期利润	-107,445,871.14
3.加权平均基金份额本期利润	-0.0770
4.期末基金资产净值	912,877,939.52
5.期末基金份额净值	0.674

注:1、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。

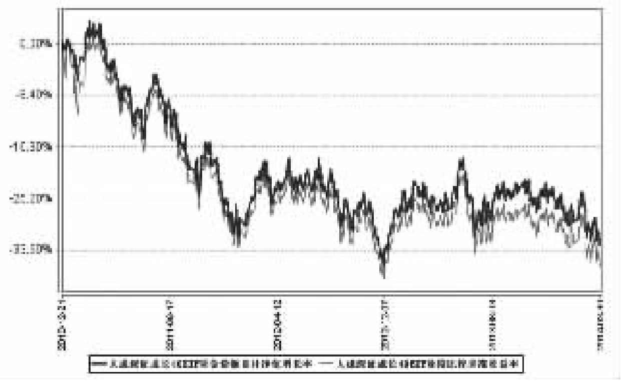
2、本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入(不含公允价值变动收益)扣除相关费用后的余额,本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

3.2 基金净值表现

3.2.1 本报告期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	净值增长率①	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	-10.37%	1.42%	-10.16%	1.44%	-0.21%	-0.02%

3.2.2 自基金合同生效以来基金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:按基金合同规定,本基金自基金合同生效起3个月内为建仓期。截至报告期末,本基金各项资产配置比例已符合基金合同的规定。

§4 管理人报告

4.1 基金经理(或基金经理小组)简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
苏秉毅先生	本基金基金经理	2012年2月9日	-	10年	经济学硕士。2004年9月至2008年5月就职于华夏基金管理有限公司基金运作部。2008年加入大成基金管理有限公司,历任产品设计师、高级产品设计师、基金经理助理、基金经理。2011年3月3日至2012年2月8日担任深证成长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基金经理助理。2012年8月28日至2014年1月23日担任大成中证500沪市交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理。2014年1月24日至2014年2月17日任大成健康产业股票型证券投资基金基金经理。2012年2月9日起担任深证成长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基金经理。2012年8月24日起任中证500沪市交易型开放式指数证券投资基金基金经理。2013年1月1日开始兼任大成沪深300指数证券投资基金基金经理。2013年2月7日起任大成中证100交易型开放式指数证券投资基金基金经理。现同时担任大成基金管理有限公司数量投资部总监助理。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》、《深证成长40交易型开放式指数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,深证成长40交易型开放式指数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 公平交易专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

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,公司制订了《大成基金管理有限公司公平交易制度》、《大成基金管理有限公司异常交易监控与报告制度》。公司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,内容包括授权、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 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1季度公司旗下主动投资组合间股票交易存在8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2笔,原因为投资策略需要;投资组合间不存在债券同日反向交易。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 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

新年的一季度,在促转型的指导思想下,政府对宏观经济增速下滑表现出较高的容忍度。从数据上来看,经济下滑的速度超出市场预期。尽管央行并没有加大货币投放,需求回落也造成了货币相对宽松的局面。另一方面,人民币的升值趋势被打断,在本季度出现了较大幅度的贬值,国际热钱有流出的迹象。

宏观经济基本面恶化的趋势还没有停止,再加上新股发行的压制,投资者的信心明显不足。A股市场基准沪深300指数本季下跌7.89%。存量资金博弈的特征依旧明显,行业和风格分化较大。创业板虽然在下半季出现回调,但全季仍跑赢大市,逆市收红,而中小板表现则向主板靠拢。在行业方面,计算机、通信、旅游等行业领先大市,而跌幅较深的行业以周期行业为主,如煤炭、非银等。

本基金标的指数深证成长40指数下跌10.16%,跌幅高于大盘。一季度,本基金申购赎回和份额交易情况均较为平稳。本基金基本保持满仓运作,严格根据标的指数成分股调整以及权重的变化及时调整投资组合。本季年化跟踪误差0.83%,日均偏离度0.04%,各项操作与指标均符合基金合同的要求。

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0.674元,本报告期基金份额净值增长率为-10.37%,同期业绩比较基准收益率为-10.16%,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

宏观经济增速向区间下限接近,会催生稳增长政策出台的预期。然而,即使以稳增长为目的的政策真正出台,也只能起到局部刺激"托底"的效果。经济要转型成功方能实现腾飞,而该过程需要较长的时间,无法在短期内一蹴而就,下季度实体经济仍然堪忧。至于货币政策,为配合经济转型,继续从紧的可能性非常高。即使货币放松,在当前资源配置扭曲的情况下,资金的使用效率无法提高,对经济增长贡献也很有限。

基于以上的分析,A股市场反转走牛的基础还不具备。即使周边环境有边际上的改善,仍难以支持大级别的行情。另一方面,大多数利空均已在市场上有所反映,市场向下空间也相对有限。预计下季度A股市场整体呈震荡格局,存量博弈仍将主导市场下一阶段走势,风格轮动可能会比较频繁,年报和一季报将是个股走势分化的驱动力量。相对而言,业绩较为确定、具有估值优势的蓝筹股机会更大,对于众多涨幅巨大且透支了成长预期的股票,一旦业绩不达预期则可能面临惨烈的杀跌。

组合管理上,我们将严格按照基金合同的相关约定,紧密跟踪标的指数,按照标的指数成分股组成及其权重的变化调整投资组合,努力实现跟踪误差的最小化。

§5 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	900,942,240.01	98.60
	其中:股票	900,942,240.01	98.60
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:买断式回购的买入返售金融资产	-	0.00
6	银行存款和结算备付金合计	12,814,874.41	1.40
7	其他资产	3,794.48	0.00
8	合计	913,760,908.90	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.1 报告期末指数投资按行业分类的股票投资组合

代码	行业类别	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	7,135,863.30	0.78
B	采矿业	11,699,737.20	1.28
C	制造业	691,815,302.01	75.78
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	0.00
E	建筑业	53,898,085.32	5.90
F	批发和零售业	-	0.00
G	交通运输、仓储和邮政业	-	0.00
H	住宿和餐饮业	-	0.00
I	信息传输、软件和信息技术服务业	14,241,648.60	1.56
J	金融业	-	0.00
K	房地产业	29,944,042.95	3.28
L	租赁和商务服务业	38,461,801.96	4.21
M	科学研究和技术服务业	-	0.00
N	水利、环境和公共设施管理业	53,745,758.67	5.89
O	居民服务、修理和其他服务业	-	0.00
P	教育	-	0.00
Q	卫生和社会工作	-	0.00
R	文化、体育和娱乐业	-	0.00
S	综合	-	0.00
	合计	900,942,240.01	98.69

5.2.2 报告期末积极投资按行业分类的股票投资组合

本基金本报告期末未有积极投资。

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

5.3.1 报告期末指数投资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	000651	格力电器	3,024,934	84,698,152.00	9.28
2	000333	美的集团	1,592,623	71,795,444.84	7.86
3	000858	五 粮 液	3,869,716	64,508,165.72	7.07
4	002415	海康威视	2,866,529	50,020,931.05	5.48
5	000157	中联重科	9,114,136	44,385,842.32	4.86
6	002241	歌尔声学	1,559,909	39,933,670.40	4.37
7	300070	碧水源	982,173	32,441,174.19	3.55
8	002236	大华股份	1,108,228	31,684,238.52	3.47
9	002450	康得新	1,538,402	30,552,663.72	3.35
10	300124	汇川技术	398,121	28,278,534.63	3.10

5.3.2 报告期末积极投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名股票投资明细

本基金本报告期末未有积极投资。

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

5.5 报告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

本基金本报告期末未持有债券。

5.6 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序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

5.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金本报告期末投资股指期货。

5.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期末投资股指期货。

5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.10.1 本期国债期货投资政策

本基金本报告期末投资国债期货。

5.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末投资国债期货。

5.10.3 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末投资国债期货。

5.11 投资组合报告附注

5.11.1 本基金投资的前十名证券的发行主体未出现本期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。

5.11.2 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。

5.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	1,230.88
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	2,563.60
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	3,794.48

5.11.4 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。

5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

5.11.5.1 报告期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末指数投资前十名股票中不存在流通受限情况。

5.11.5.2 报告期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末未有积极投资。

5.11.6 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	1,453,639,725.00
报告期期间基金总申购份额	-
减:报告期期间基金总赎回份额	100,000,000.00
报告期期间基金拆分变动份额(份额减少以"-"填列)	-
报告期期末基金份额总额	1,353,639,725.00

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

基金管理人未持有本基金份额。

7.2 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 备查文件目录

8.1 备查文件目录

1、中国证监会批准设立深证成长40交易型开放式指数证券投资基金的文件;
2、《深证成长40交易型开放式指数证券投资基金基金合同》;
3、《深证成长40交易型开放式指数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刊上披露的各种公告原稿。

8.2 存放地点

本季度报告存放在本基金管理人和托管人的办公住所。

8.3 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4月21日

大成景旭纯债债券型证券投资基金

2014 第一季度 报告

2014年3月31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
报告送出日期:2014年4月21日

§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4月17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。

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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2014年1月1日起至3月31日止。

§2 基金产品概况

基金简称	大成景旭纯债债券	
交易代码	000152	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2013年7月23日	
报告期末基金份额总额	162,282,267.83份	
投资目标	本基金为纯债基金,管理人主要通过分析影响债券市场的各类要素,对债券组合的平均久期、期限结构、类属品种进行有效配置,力争为投资人提供长期稳定的投资回报。	
投资策略	本基金将有效结合"自上而下"的资产配置策略以及"自下而上"的债券精选策略,在综合判断宏观经济基本面、证券市场走势等宏观因素的基础上,灵活配置基金资产在各类资产之间的配置比例,并通过严谨的信用分析以及对券种收益水平、流动性的客观判断,综合运用多种投资策略,精选个券构建投资组合。	
业绩比较基准	中债综合指数	
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。	
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	
下属两级基金的基金简称	大成景旭纯债债券A	大成景旭纯债债券C
下属两级基金的交易代码	000152	000153
报告期末下属两级基金的份额总额	107,793,881.66份	54,488,386.17份

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位:人民币元

主要财务指标	报告期(2014年1月1日 - 2014年3月31日)	
	大成景旭纯债债券A	大成景旭纯债债券C
1.本期已实现收益	-26,867.04	-105,408.10
2.本期利润	1,034,205.21	349,193.47
3.加权平均基金份额本期利润	0.0073	0.0049
4.期末基金资产净值	108,636,074.49	54,756,695.42
5.期末基金份额净值	1.008	1.005

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 本报告期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

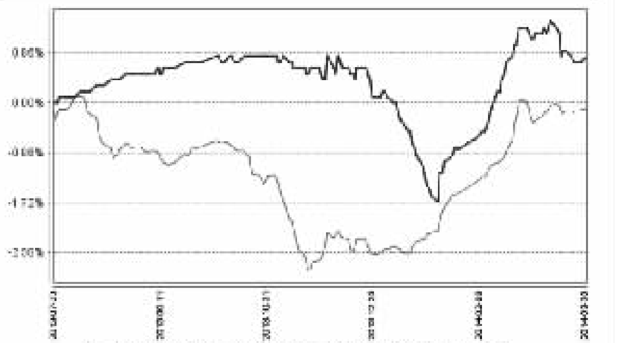
大成景旭纯债债券A

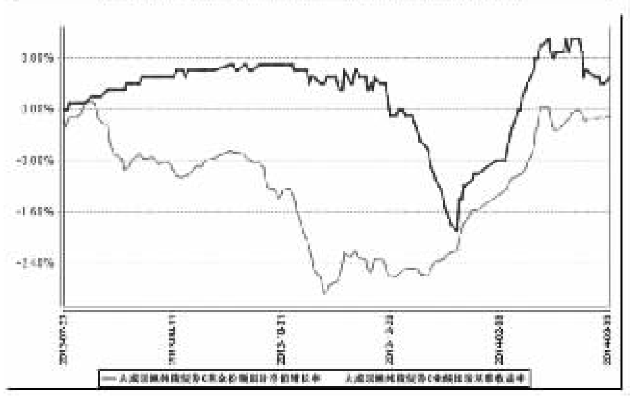
阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	0.80%	0.15%	2.46%	0.08%	-1.66%	0.07%

大成景旭纯债债券C

阶段	净值增长率①	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	0.70%	0.16%	2.46%	0.08%	-1.76%	0.08%

3.2.2 自基金合同生效以来基金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、本基金的基金合同生效日为2013年7月23日,截至本报告期末,基金成立未满1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六个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的有关约定。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比例。

§4 管理人报告

4.1 基金经理(或基金经理小组)简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
王立女士	本基金基金经理	2013年7月23日	-	12年	经济学硕士。曾任职于申银万国证券股份有限公司、南京市商业银行资金营运中心。2005年4月加入大成基金管理有限公司,曾任大成货币市场基金基金经理助理。2007年1月12日起担任大成货币市场证券投资基金基金经理。2009年5月23日起兼任大成债券投资基金基金经理。2012年11月20日至2014年4月4日任大成现金增利货币市场基金基金经理。2013年2月1日起兼任大成月添利理财债券型证券投资基金基金经理。2013年7月23日起任大成景旭纯债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
杨雅洁女士	本基金基金经理	2014年1月11日	-	6年	经济学硕士,2009年8月加入大成基金管理有限公司,曾任固定收益部宏观利率研究员。2013年1月14日至2014年1月10日任大成债券投资基金基金经理助理。2014年1月11日起任大成景旭纯债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》、《大成景旭纯债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,大成景旭纯债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 公平交易专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

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,公司制订了《大成基金管理有限公司公平交易制度》、《大成基金管理有限公司异常交易监控与报告制度》。公司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,内容包括授权、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 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1季度公司旗下主动投资组合间股票交易存在8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2笔,原因为投资策略需要;投资组合间不存在债券同日反向交易。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 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2014年一季度,经济增长放缓的势头在宏观数据上得到印证,1-2月工业增加值同比仅增长8.6%,低于去年四季度平均10%的增速。春节错位使得CPI同比数据波动较大,但涨幅温和可控。货币政策方面,央行在1月下旬选择针对四类机构开展常备借贷便利操作试点,同时通过公开市场正、逆回购操作加强对回购利率的引导,向市场传递降低回购利率波动性、加强回购利率上、下限管理的政策意图。汇率政策方面,央行于3月中旬扩大人民币汇率浮动幅度,增强人民币双向浮动弹性,打击跨境套利资金。超日债无法按期全额支付利息,使得中国信用债市场出现第一单实质违约。受此影响,市场信用风险偏好明显下降,低评级民企债券发行困难程度明显增加。

市场表现方面,中债综合财富指数一季度上涨2.46%,为2012年1季度以来指数表现最好的一个季度。板块方面,金融债表现好于国债,城投债好于产业债,银行间好于交易所。收益率曲线整体呈现陡峭化下行,具体来看,1年期金融债收益率下行幅度超过60bp,5-10年下行20-40bp。各评级短融收益率下行100-110bp,3-5年中票下行35-60bp。供需错位使得城投债交投火爆,收益率下行幅度超过50bp。超日事件对交易所高收益率产业债冲击明显,部分个券甚至跌破今年1月份的低点。

一季度,本基金在严格控制风险的基础上,采取积极的组合策略和严格的资产选择原则进行投资运作。本基金整体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。同时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,大成景旭纯债债券A份额净值增长率为0.80%,大成景旭纯债债券C份额净值增长率为0.70%,同期业绩比较基准增长率为2.46%,基金份额净值增长率低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年二季度,销售的下滑带动房地产投资下滑的趋势愈趋明显,土地出让金下滑、偏紧的货币环境和政治环境也对基建投资形成抑制,这意味着经济增速有进一步下滑的风险。受翘尾因素的影响,2014年CPI同比的高点将出现在二季度,但绝对水平仍在可控范围之内。随着监管趋严,并且伴随着信用风险的暴露,银行普遍开始压缩和控制非标的增量。从近期的社会融资数据来看,委托贷款和信托贷款的增速明显放缓,带动社会融资增速逐步下降,M2增速二季度可能将跌破13%。预计央行会维持银行间流动性相对宽松,但主动大幅放松货币政策的概率也较小。但货币政策也必须解决融资成本高企的问题,预计在长端可能通过定向宽松的方式降低融资成本。

基于以上判断,二季度本基金将以利率债以及资质较好的信用债作为主要配置。本基金将在已有大类资产配置基础上,根据市场环境变化适当动态管理各类资产的投资比例,灵活调整组合久期,同时努力把握当前经济环境下大类资产轮动的机会。

§5 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

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	264,856,153.52	94.19
	其中:债券	264,856,153.52	94.19
	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:买断式回购的买入返售金融资产	-	0.00
6	银行存款和结算备付金合计	9,397,598.06	3.34
7	其他资产	6,935,592.10	2.47
8	合计	281,189,343.68	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	国家债券	-	0.00
2	央行票据	-	0.00
3	金融债券	39,132,000.00	23.95
	其中:政策性金融债	39,132,000.00	23.95
4	企业债券	215,724,153.52	132.03
5	企业短期融资券	-	0.00
6	中期票据	10,000,000.00	6.12
7	可转债	-	0.00
8	其他	-	0.00
9	合计	264,856,153.52	162.10

5.5 报告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	债券代码	债券名称	数量(张)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	112190	11亚迪02	173,260	17,135,414.00	10.49
2	112060	12金风01	150,000	15,105,000.00	9.24
3	111064	11长交债	136,935	13,638,452.13	8.35
4	112112	12江泥01	121,070	12,046,465.00	7.37
5	122029	09万通债	118,030	11,903,325.50	7.29

5.6 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序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

5.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

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

本基金本报告期末投资国债期货。

5.9.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末投资国债期货。

5.9.3 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末投资国债期货。

5.10 投资组合报告附注

5.10.1 本基金投资的前十名证券的发行主体未出现本期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。

5.10.2 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。

5.10.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	55,576.05
2	应收证券清算款	1,036,318.91
3	应收股利	-
4	应收利息	5,842,705.08
5	应收申购款	992.06
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	6,935,592.10

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

本基金本报告期末未持有股票。

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

项目	大成景旭纯债债券A	大成景旭纯债债券C
报告期期初基金份额总额	163,944,694.15	90,884,072.21
报告期期间基金总申购份额	216,308.35	425,347.51
减:报告期期间基金总赎回份额	56,367,120.84	36,821,033.55
报告期期间基金拆分变动份额(份额减少以"-"填列)	-	-
报告期期末基金份额总额	107,793,881.66	54,488,386.17

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

基金管理人未持有本基金份额。

7.2 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景旭纯债债券型证券投资基金的文件;
2、《大成景旭纯债债券型证券投资基金基金合同》;
3、《大成景旭纯债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、本报告期内在指定报刊上披露的各种公告原稿。

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4月21日

大成蓝筹稳健证券投资基金

2014 第一季度 报告

2014年3月31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
报告送出日期:2014年4月21日

§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。

基金托管人中国银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2014年4月17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。

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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2014年1月1日起至3月31日止。

§2 基金产品概况

基金简称	大成蓝筹稳健混合
交易代码	090003
前端交易代码	090003
后端交易代码	091003
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2004年6月3日
报告期末基金份额总额	13,184,638,936.69份
投资目标	通过精选符合本基金投资理念、流动性良好的证券,在控制非系统风险的前提下获取投资收益,同时辅助运用一系列数量分析方法,有效控制系统性风险,实现基金资产的中长期稳定增值。
投资策略	本基金资产配置策略利用修正的恒定比例投资组合保险策略(CPPI)来动态调整基金中股票、债券和现金的配置比例;行业配置采取较为积极的策略,以投资基准的行业权重为基础,以行业研究及比较分析为核心,通过适时增大或降低相应行业的投资权重,使整体投资表现跟上或超越投资基准;个股选择策略则采用蓝筹成分股优选策略,运用"价值-势头"选股方法,优选出被市场低估并有良好市场表现,处于价值回归阶段的天相280指数成分股投资。
业绩比较基准	天相280指数×70%+中信标普国债指数×30%
风险收益特征	本基金属于较低风险证券投资基金,适于承受一定风险,追求当期收益和长期资本增值的基金投资人。
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

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位:人民币元

主要财务指标	报告期(2014年1月1日 - 2014年3月31日)
1.本期已实现收益	-292,285,505.28
2.本期利润	-906,223,730.83
3.加权平均基金份额本期利润	-0.0676
4.期末基金资产净值	7,175,997,105.01
5.期末基金份额净值	0.5443

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。

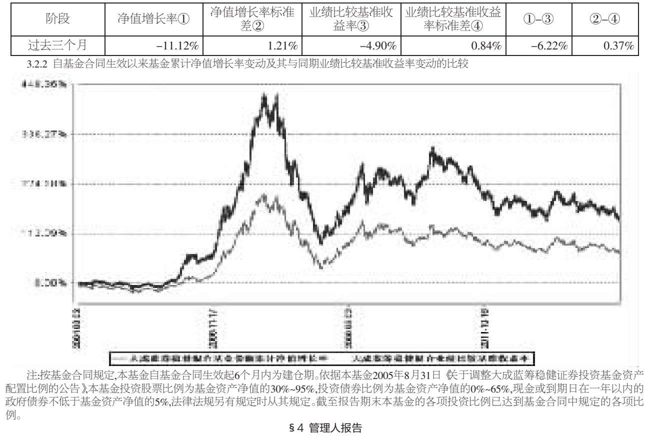
2、所述基金业绩指标不包括持有人交易基金的各项费用,计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

3.2 基金净值表现

3.2.1 本报告期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	净值增长率①	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	-11.12%	1.21%	-4.90%	0.84%	-6.22%	0.37%

3.2.2 自基金合同生效以来基金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:按基金合同规定,本基金自基金合同生效起6个月内为建仓期。依据本基金2005年8月31日《关于调整大成蓝筹稳健证券投资基金资产配置比例的公告》,本基金投资股票比例为基金资产净值的30%~95%,投资债券比例为基金资产净值的0%~65%,现金或到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的5%,法律法规另有规定时从其规定。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 基金经理(或基金经理小组)简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
支兆华先生	本基金基金经理、研究部总监	2013年11月24日	-	13年	经济学硕士。2001年至2005年,在华夏基金管理有限公司从事产品开发工作。2006年加入大成基金管理有限公司,历任规划发展部总监助理、副总监、总经理办公室主任兼公司战略发展委员会秘书、数量投资部总监,现任研究部总监。2013年11月24日起任大成蓝筹稳健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》、《大成蓝筹稳健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,大成蓝筹稳健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 公平交易专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

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,公司制订了《大成基金管理有限公司公平交易制度》、《大成基金管理有限公司异常交易监控与报告制度》。公司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,内容包括授权、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 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1季度公司旗下主动投资组合间股票交易存在8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2笔,原因为投资策略需要;投资组合间不存在债券同日反向交易。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 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2014年一季度A股市场整体呈现出指数反复震荡,风格剧烈变化的趋势。在一季度前期,宏观经济基本面持续走弱,同时货币基金收益率对于风险偏好的影响犹存,因此市场延续了2013年对于高收益高波动的新兴产业和中小股票的热情,尤其以计算机和传媒板块涨幅较高。一季度后期,伴随着宏观经济下滑趋势进一步明确,短端利率不断走低,风险偏好逐步下降,同时政府调控也逐步转向稳增长,因此代表传统经济的蓝筹板块出现阶段性走强。

本基金在报告期内积极对于持仓结构和品种进行调整,一方面,沿着"创新+改革"的市场主线,尽量规避利率市场化带来的高利率弹性板块,在符合经济转型和模式改革方向的信息技术、互联网、节能环保和高端智能装备等行业中自下而上精选个股,另一方面,结合经济减速带来的投资时钟变化,加大了可选消费品、大众食品和医药行业等稳定行业的配置比例。

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0.5443元,本报告期基金份额净值增长率为-11.12%,同期业绩比较基准收益率为-4.90%,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2014年A股市场,我们认为,宏观经济基本面保持平稳,流动性调控逐步趋于中性,2014年企业的盈利增速与2013年持平,整体指数仍不具备趋势性行情的基础。但是利率市场化逐步推升资金成本的趋势仍将延续,将继续提升高收益高波动性产品的关注度,从中期来看,新兴行业和中小股票仍将有结构性机会,具体到二季度而言,由于进入信用债和信托到期偿付的高峰期,也需警惕由于刚性兑付带来的风险偏好阶段性大幅波动。

针对以上判断,本组合首先将在二季度加大对于市场系统性风险的关注,继续保持消费板块的基础配置,同时通过自上而下的投资思路确定配置方向和重点,沿着改革和创新的经济转型期投资主线,精选符合转型和改革方向的新兴行业作为配置重点,并积极关注新能源汽车、移动互联网和国企改革等主题领域,通过自下而上精选以上配置重点的优质标的,在有效控制风险的前提下,构建同时具备相对和绝对收益的组合。

§5 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	6,266,020,584.70	85.76
	其中:股票	6,266,020,584.70	85.76
2	固定收益投资	643,679,000.00	8.81
	其中:债券	643,679,000.00	8.81
	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	99,000,268.50	1.35
	其中:买断式回购的买入返售金融资产	-	0.00
6	银行存款和结算备付金合计	270,598,752.97	3.70
7	其他资产	27,011,487.54	0.37
8	合计	7,306,310,093.71	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

代码	行业类别	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	86,909,357.60	1.21
B	采矿业	154,663,629.01	2.16
C	制造业	3,946,809,826.18	55.00
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	0.00
E	建筑业	115,918,568.52	1.62
F	批发和零售业	117,450,536.36	1.64
G	交通运输、仓储和邮政业	-	0.00
H	住宿和餐饮业	-	0.00
I	信息传输、软件和信息技术服务业	534,864,967.98	7.45
J	金融业	591,172,307.00	8.24
K	房地产业	238,211,884.41	3.32
L	租赁和商务服务业	177,023,437.50	2.47
M	科学研究和技术服务业	34,411,526.28	0.48
N	水利、环境和公共设施管理业	154,280,762.70	2.15
O	居民服务、修理和其他服务业	-	0.00
P	教育	-	0.00
Q	卫生和社会工作	-	0.00
R	文化、体育和娱乐业	44,523,735.12	0.62
S	综合	69,780,046.04	0.97
	合计	6,266,020,584.70	87.32

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

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	601998	中信银行	41,462,324	191,970,560.12	2.68
2	601318	中国平安	4,959,746	186,288,059.76	2.60
3	600519	贵州茅台	1,070,572	165,617,488.40	2.31
4	600309	万华化学	8,899,779	155,479,139.13	2.17
5	600703	三安光电	6,550,228	149,017,687.00	2.08
6	600016	民生银行	18,193,872	139,365,059.52	1.94
7	600252	中恒集团	10,315,067	132,342,309.61	1.84
8	600406	国电南瑞	9,299,790	131,313,034.80	1.83
9	600893	航空动力	5,539,807	115,449,577.88	1.61
10	600804	鹏博士	7,829,732	106,640,949.84	1.49

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	国家债券	-	0.00
2	央行票据	-	0.00
3	金融债券	643,679,000.00	8.97
	其中:政策性金融债	643,679,000.00	8.97
4	企业债券	-	0.00
5	企业短期融资券	-	0.00
6	中期票据	-	0.00
7	可转债	-	0.00
8	其他	-	0.00
9	合计	643,679,000.00	8.97

5.5 报告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	债券代码	债券名称	数量(张)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	140316	14进出16	2,800,000	273,812,000.00	3.82
2	130236	13国开36	1,900,000	189,791,000.00	2.64
3	090407	09农发07	600,000	60,156,000.00	0.84
4	110247	11国开47	500,000	49,945,000.00	0.70
5	130243	13国开43	300,000	29,961,000.00	0.42

5.6 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序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属投资。

5.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金本报告期末投资股指期货。

5.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期末投资股指期货。

5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.10.1 本期国债期货投资政策

本基金本报告期末投资国债期货。

5.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末投资国债期货。

5.10.3 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末投资国债期货。

5.11 投资组合报告附注

5.11.1 报告期内本基金投资的前十名证券的发行主体本期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:

根据中国平安股票发行主体中国平安保险(集团)股份有限公司于2013年5月21日和2013年10月14日发布的公告,该上市公司的控股子公司平安证券有限责任公司(以下简称"平安证券")收到中国证券监督管理委员会(以下简称"中国证监会")《行政处罚和市场禁入事先告知书》。中国证监会决定对平安证券给予警告并没收其在万福生科(湖南)农业开发股份有限公司(以下简称"万福生科")发行上市项目中的业务收入人民币 2,555 万元,并处以人民币 5,110 万元的罚款,暂停其保荐机构资格 3 个月。

在上述公告公布后,本基金管理人对该上市公司进行了进一步了解和分析,认为上述处罚不会对中国平安的投资价值构成实质性负面影响,因此本基金管理人对其投资判断未发生改变。

5.11.2 本基金投资的前十名股票未超出基金合同规定的备选股票库。

5.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	1,185,602.97
2	应收证券清算款	17,300,438.86
3	应收股利	-
4	应收利息	8,440,574.18
5	应收申购款	84,871.53
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	27,011,487.54

5.11.4 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。

5.11.5 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。

5.11.6 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	13,589,528,486.45
报告期期间基金总申购份额	15,548,944.00
减:报告期期间基金总赎回份额	420,438,493.76
报告期期间基金拆分变动份额(份额减少以"-"填列)	-
报告期期末基金份额总额	13,184,638,936.69

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

本报告期基金管理人未持有本基金份额。

7.2 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刊上披露的各种公告原稿。

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4月21日