大成新锐产业股票型证券投资基金

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	大成新锐产业股票
交易代码	090018
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2012年3月20日
报告期末基金份额总额	134,738,548.97份
投资目标	投资于新锐产业中的优质上市公司,分享中国经济增长新锐力量的成长收益,追求基金资产的长期稳健增值。
投资策略	本基金采用自上而下、自下而上相结合的积极主动的投资策略。以宏观经济和政策研究为基础,通过影响证券市场整体运行的内外部因素分析,实施大类资产配置;分析中国经济结构转型背景下让会意识(包括持续发展观等)、经济基础、科技进步、消费升级与产业政策等各个方面对新锐产业发展的综合影响,研究各个新锐产业发展所处的阶段特征和商业前景,结合各个新锐产业股票群体的流动性、整体估值水平和动量,实施新锐产业之行业配置。对新锐产业各公司在所属行业的竞争优势进行细致分析(包括技术变迁路径与核心技术、技术制式与商业模式、市场策略与需求融合、人力资源等诸多方面),结合股票基本面指标分析(包括成长性指标、估值水平),精选优质上市公司股票,力求实现基金资产的长期稳健增值。
业绩比较基准	80%×沪深300指数+20%×中证综合债券指数
风险收益特征	本基金为股票型基金,基金的风险与预期收益都要高于混合型基金、债券型基金和货币市场基金,属于证券投资基金中较高风险、较高预期收益的品种。
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

§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	5,316,205.81
2.本期利润	-5,354,466.69
3.加权平均基金份额本期利润	-0.0362
4.期末基金资产净值	146,194,749.76
5.期末基金份额净值	1.085

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。

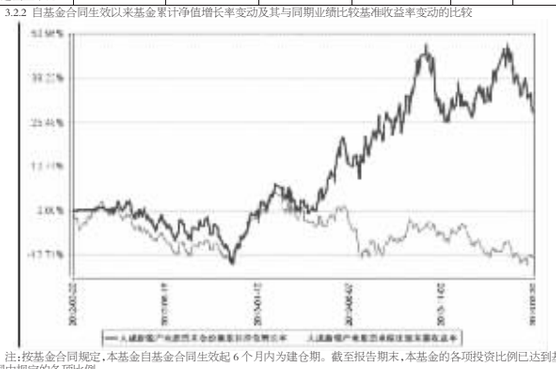
2.所述基金业绩指标不包括持有人交易基金的各项费用,计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

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	-4.91%	1.54%	-5.82%	0.95%	0.91%	0.59%

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。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		
袁巍先生	本基金基金经理	2013年4月8日	-	5年	经济学硕士,2009年6月加入大成基金管理有限公司,曾任研究部新兴产业行业研究主管。2012年8月7日至2013年3月11日担任大成精选增值混合型证券投资基金和大成新锐产业股票型证券投资基金基金经理助理。2013年4月8日起担任大成新锐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》、《大成新锐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,大成新锐产业股票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同股票交易存在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年年初开始,国内的流动性没有出现往年的季节性宽松。加上PPI、PMI、工业增加值等主要宏观经济指标的疲软,显示了实体经济依然处于疲惫下行的态势。在这种存量资金博弈,以及对宏观经济整体的不良预期下,市场出现了进一步的大小盘股分化、大市值的股票不断的下跌、小市值的有亮点的个股快速上涨。

到3月份之后,由于陆续有公司披露了年报和1季报的预览,部分预期过高的公司出现了低预期的情况。伴随着以创业板指数为代表的新兴产业板块出现大幅度的回调,资金的偏好出现了变化。地产、银行、水泥等传统行业出现明显的超额收益。

本基金管理人年初及时调整了持仓结构,增加了以互联网、传媒、计算为代表的新兴产业的配置,获得了显著的超额收益。3月份之后,根据市场发生的风险偏好的变化,调整组合的结构为均衡型,增加了金融、地产、消费等行业的配置。调整的效果比较明显,回避了小市值股票大幅回调的部分损失。

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1.085元,本报告期基金份额净值增长率为-4.91%,业绩比较基准收益率为-5.82%,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

海外经济在未来的一段时间依然处于非常复杂的状态。美国经济复苏的内生动力较强,但QE的退出预期可能会对资本市场造成负面的冲击。甚至QE退出之后,复苏的进程是否会受到影响暂时也难以判断。

国内经济经过几个月的观察,有可能处于失速的边缘。经过1年半连续上涨的新兴产业可能会面临大面积的盈利预测下调的阶段。同时,很可能会有货币放松拉动经济的政策出台。市场的风险偏好可能正在处于下降的通道当中,一味的追求空间和高估值的投资方法可能在几个季度的跨度内失效。

本基金管理人在下一阶段将会围绕放松政策的假设,结合自上而下和自下而上的方法,在涉及的几个板块中精选公司,控制风险的同时加大这些板块的配置。

§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	117,455,677.51	77.34
	其中:股票	117,455,677.51	77.34
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	33,485,727.15	22.05
7	其他资产	925,129.34	0.61
8	合计	151,866,534.00	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	-	0.00
B	采矿业	-	0.00
C	制造业	55,800,932.90	38.17
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	0.00
E	建筑业	3,497,506.00	2.39
F	批发和零售业	2,884,164.57	1.97
G	交通运输、仓储和邮政业	4,321,386.04	2.96
H	住宿和餐饮业	-	0.00
I	信息传输、软件和信息技术服务业	13,000,255.91	8.89
J	金融业	11,175,619.42	7.64
K	房地产业	11,387,164.95	7.79
L	租赁和商务服务业	7,435,950.00	5.09
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	1,502,865.00	1.03
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	6,449,832.72	4.41
S	综合	-	0.00
	合计	117,455,677.51	80.34

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	300058	蓝色光标	148,719	7,435,950.00	5.09
2	300133	华策影视	273,762	6,449,832.72	4.41
3	601965	中国汽研	408,222	6,102,918.90	4.17
4	002223	鱼跃医疗	140,500	4,306,325.00	2.95
5	000002	万 科A	532,001	4,303,888.09	2.94
6	000848	承德露露	198,700	4,192,570.00	2.87
7	601998	中信银行	895,200	4,144,776.00	2.84
8	002410	广联达	105,471	3,838,089.69	2.63
9	000709	河北钢铁	1,967,600	3,797,468.00	2.60
10	601117	中国化学	562,300	3,497,506.00	2.39

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

本基金投资股指期货以投资组合避险和有效管理为目的,通过套期保值策略,对冲系统性风险,应对组合构建与调整中的流动性风险,力求风险收益的优化。

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 报告期内基金投资的前十名证券的发行主体无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备选股票库之外股票。

5.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	345,077.14
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	7,985.62
5	应收申购款	572,066.58
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	925,129.34

5.11.4 报告期未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

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)	流通受限情况说明
1	002223	鱼跃医疗	4,306,325.00	2.95	重大事项停牌

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	164,946,454.00
报告期期间基金总申购份额	28,016,442.73
减:报告期期间基金总赎回份额	58,224,347.76
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	134,738,548.97

§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新锐产业股票型证券投资基金的文件;

2、《大成新锐产业股票型证券投资基金基金合同》;

3、《大成新锐产业股票型证券投资基金基金管理协议》;

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

大成创新成长混合型证券投资基金(LOF)

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	大成创新成长混合
交易代码	160910
基金运作方式	上市契约型开放式(LOF)
基金合同生效日	2007年6月12日
报告期末基金份额总额	9,147,519,246.73份
投资目标	在控制风险和保证流动性的前提下,超越业绩比较基准,寻求基金资产的长期稳健增值。
投资策略	本基金以股票投资为主,采用积极的投资策略,精选具备持续增长能力、价格处于合理区间的优质股票构建投资组合;本基金以固定收益品种投资为辅,确保投资组合具有良好的流动性。
业绩比较基准	沪深300指数×70%+中国债券总指数×30%
风险收益特征	本基金为混合型基金,风险收益水平高于货币市场基金和债券型基金,属于中高风险的证券投资基金品种。
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"大成创新"。

§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	-294,534,896.72
2.本期利润	-500,173,192.92
3.加权平均基金份额本期利润	-0.0539
4.期末基金资产净值	6,335,328,686.65
5.期末基金份额净值	0.693

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。

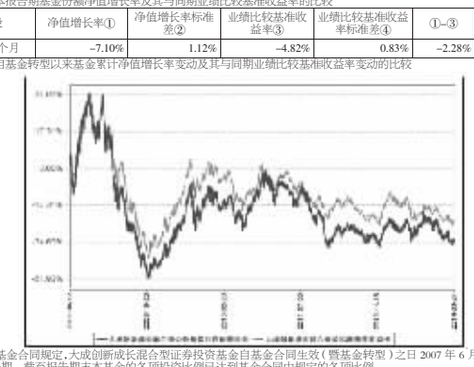
2、所述基金业绩指标不包括持有人交易基金的各项费用,计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

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	-7.10%	1.12%	-4.82%	0.83%	-2.28%	0.29%

3.2.2 自基金转型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,大成创新成长混合型证券投资基金自基金合同生效(暨基金转型)之日2007年6月12日起3个月内为建仓期。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		
杨建勋先生	本基金基金经理	2011年4月22日	-	13年	北京大学经济学院经济学硕士。曾任职于沈阳会计师事务所、鹏华基金管理有限公司、工银瑞信基金管理有限公司。2004年8月12日至2006年9月27日,担任普润基金基金经理;2005年2月26日至2006年11月23日,担任鹏华行业成长证券投资基金基金经理。2007年3月19日至11月12日,担任工银瑞信精选平衡混合型基金基金经理;2007年3月19日至2009年5月17日,担任工银瑞信稳健成长股票型基金基金经理。2007年7月18日至2010年5月20日,担任工银瑞信红利股票型基金基金经理。2010年6月加入大成基金管理有限公司。2010年11月26日至2012年9月5日,担任大成行业轮动股票型证券投资基金基金经理。2011年4月22日开始兼任大成创新成长混合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》、《大成创新成长混合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,大成创新成长混合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同股票交易存在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年一季度沪深300指数下跌7.89%,创业板指数上涨1.79%。一季度市场中表现较好的行业主要是计算机软件、新能源汽车、移动互联等板块,表现较差的行业主要是能源、环保、证券等。

本基金在一季度对持股结构进行了适当调整,增持了医药生物、食品饮料、环保等行业;减持了机械设备、金融等行业;本基金目前主要持仓的板块是银行、房地产、食品饮料、医药、通讯设备、建筑装饰等行业。

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0.693元,本报告期基金份额净值增长率为-7.10%,同期业绩比较基准收益率为-4.82%,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

进入2014年以来,受房地产、基建、消费等增速放缓影响,宏观经济的增长动力有所减弱,部分投资者担忧能否实现全年经济增速的目标。我们相信新政府施政一年多以来以简政放权为特点的市场化调控思路是解决中国经济诸多问题的有效措施,问题本身也意味着改善的空间。预计从二季度开始政府将陆续出台一些稳增长的针对性政策措施。在通胀压力低于预期和地方债务整体可控的背景下,中央政府客观上具有较大的政策调控空间。因此我们并不担心宏观经济出现失速的风险。

所以我们仍然维持年初以来对市场的判断,实体经济的平稳运行为调结构和促改革提供了强力支持,调结构和促改革的力度有望超预期,符合经济结构调整方向的行业在政策扶植下有望快速成长。传统板块已经反应了大部分的悲观预期,存在预期修正的机会。我们会特别关注那些主动适应互联网经济、积极探索新兴盈利模式的传统行业中的公司。一个公司的转型或者说拥抱新经济并不是简单的放弃传统行业然后收购一个处于新兴产业的公司。

我们认为A股市场在未来一个季度仍将是结构性行情。我们将继续保持相对均衡的配置,通过精挑个股来获得超额收益。我们将继续买入具有估值优势的业绩增速有保证的成长股和具备一定安全边际的大盘蓝筹股。

§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	5,492,682,568.14	86.15
	其中:股票	5,492,682,568.14	86.15
2	固定收益投资	486,355,251.20	7.63
	其中:债券	486,355,251.20	7.63
	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	393,768,958.72	6.18
7	其他资产	2,621,589.03	0.04
8	合计	6,375,428,367.09	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	61,335,128.75	0.97
B	采矿业	-	0.00
C	制造业	2,552,310,473.32	40.29
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	0.00
E	建筑业	703,636,772.08	11.11
F	批发和零售业	-	0.00
G	交通运输、仓储和邮政业	7,051,460.56	0.11
H	住宿和餐饮业	-	0.00
I	信息传输、软件和信息技术服务业	185,250,043.37	2.92
J	金融业	1,010,695,548.44	15.95
K	房地产业	699,766,433.88	11.05
L	租赁和商务服务业	-	0.00
M	科学研究和技术服务业	39,714,735.24	0.63
N	水利、环境和公共设施管理业	187,822,468.93	2.96
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	45,099,503.57	0.71
	合计	5,492,682,568.14	86.70

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	000002	万 科A	50,117,698	405,452,176.82	6.40
2	000063	中兴通讯	32,030,216	404,861,930.24	6.39
3	600036	招商银行	32,041,622	314,648,728.04	4.97
4	601166	兴业银行	32,873,929	312,959,804.08	4.94
5	600016	民生银行	40,169,492	307,698,308.72	4.86
6	600518	康美药业	17,026,970	275,836,914.00	4.35
7	600887	伊利股份	7,353,106	263,461,787.98	4.16
8	000895	双汇发展	6,678,955	262,416,141.95	4.14
9	000100	TCL集团	100,999,903	255,529,754.59	4.03
10	600383	金地集团	31,493,286	217,933,539.12	3.44

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	-	0.00
	其中:政策性金融债	-	0.00
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	486,355,251.20	7.68
8	其他	-	0.00
9	合计	486,355,251.20	7.68

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	110023	民生转债	3,089,880	273,485,278.80	4.32
2	113002	工行转债	2,141,980	212,869,972.40	3.36

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本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:

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4日的公告,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	2,724.95
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	305.70
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	3,030.65

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持有积极投资。

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	9,413,437,038.64
报告期期间基金总申购份额	8,972,755.90
减:报告期期间基金总赎回份额	274,890,547.81
报告期期间基金拆分变动份额	-
报告期期末基金份额总额	9,147,519,246.73

§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《关于核准景博证券投资基金基金份额持有人大会决议的批复》;

2、《大成创新成长混合型证券投资基金基金合同》;

3、《大成创新成长混合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

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

大成中证100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

§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	大成中证100ETF
交易代码	159923
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2013年2月7日
报告期末基金份额总额	109,285,812.00份
投资目标	本基金进行被动式指数化投资,紧密跟踪标的指数,追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化。
投资策略	本基金为被动式指数基金,采取完全复制法,即按照标的指数的成份股组成及其权重构建股票投资组合,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,或因其他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