大成保本混合型证券投资基金

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。

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讫日期以本基金管理人届时公告为准。如保本周期到期后，本基金未能符合上述保本基金存续条件，则本基金将按《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。上述变更无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，将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。

本基金管理人就上述事项已在《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》发布了《关于大成保本混合型证券投资基金第一个保本周期到期后变更为大成竞争优势股票型证券投资基金及相关业务安排的第一次提示性公告》等相关公告。

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	大成保本混合
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
报告期末基金份额总额	502,936,870.94份
投资目标	依照保证合同，本基金通过运用组合保险策略，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、市场波动等来调整、修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潜在收益与基金前期收益的基础上，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。
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
基金保证人	中国投资担保有限公司

§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	1,679,077.33
2.本期利润	3,690,395.44
3.加权平均基金份额本期利润	0.0070
4.期末基金资产净值	526,106,428.63
5.期末基金份额净值	1.046

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。

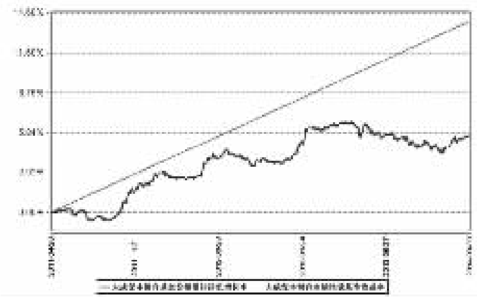
2、所述基金业绩指标不包括持有人交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

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	0.67%	0.12%	1.04%	0.01%	−0.37%	0.11%

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：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		
陈尚前先生	本基金基金经理、固定收益部总监	2011年4月20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日起兼任大成保本混合型证券投资基金基金经理，现同时担任公司固定收益部总监，固定收益投资决策委员会主席，负责公司固定收益证券投资业务，并兼任大成国际资产管理有限公司董事。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》、《大成保本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，大成保本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，受产能淘汰、社会融资总量增速下滑和开工淡季的多重影响，基建投资和房地产投资增速明显放缓，经济动能明显减弱，1、2月份的工业增加值同比增速只有8.6%，降至过去几年来的低点。而消费需求和出口也波澜不惊，对经济增长的支撑力度并不明显，一季度GDP不排除有跌破7.5%的可能。而一季度的CPI走势可控，低于3%。央行继续通过公开市场操作调节银行间流动性，降低市场波动性。为维护春节假期资金面的稳定，央行年前通过逆回购操作向市场投放5250亿，而随着现金年后陆续回流银行，央行通过正回购逐步回收流动性。总体看，一季度资金面总体呈现逐渐宽松的态势，银行间7天回购利率由年初的4.98%回落至3月中旬的2.5%附近。3月下旬由于临近季末，资金面有所收紧，但是紧张程度并未超出市场预期。

在基本面下滑、通胀水平温和以及宽松资金面的带动下，债券市场收益率大幅下行，中债综合财富指数一季度上涨2.46%。股票市场走势分化明显，在经济下滑的背景下，沪深300指数和中小板指数1季度分别下跌7.89%和7.73%，而创业板指数上涨1.79%。转债方面，1季度中证可转债指数下跌1.2%，但个券分化较大。受益于国企改革消息的刺激，隧道转债和石化转债一季度分别上涨5.9%和6.75%。东华转债受良好基本面表现和市场情绪的带动，一季度涨幅达到22%，民生转债由于下修转股价提议被否，放量大跌，一季度跌幅达到8.16%。偏债型转债则表现波澜不惊。

一季度，根据本基金的产品特征，我们基于"严格风险控制，追求稳健收益"的投资原则以及本产品保本周期到期特殊性进行投资管理：由于本基金保本周期将于2014年4月份结束，基金在管理过程逐步调整组合，主要持有与保本剩余期限一致的商业银行协议存款和高等级短期信用债，不再进行债券和权益类资产的主动管理。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末，本基金份额净值为1.046元，本报告期份额净值增长率为0.67%，同期业绩比较基准增长率为1.04%，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年二季度，由于中央政府保增长态度较为明确，也出台了相应刺激基建投资的措施，但刺激政策的效果如何有待进一步跟踪和观察。随着房地产企业融资渠道的放开，房地产的调控政策是否会有所松动也将成为市场关注点。此外各类债券的供给将维持在高位，央行模糊操作也将时刻考验投资机构的神经，公开市场操作和货币供应量将成为重要的观察指标。

当前各类债券的绝对收益率水平仍位于历史高位，信用利差位于历史低位，银行投资利率品种仍将受制于银行存款增速、外汇占款增速和央行货币政策的影响，如果观测到实体经济和货币供应有明显下滑，中央银行有望适度放松货币政策，这将提振市场情绪。

信用债方面，中高等级受制于利率品种的走势，低等级信用债受信用事件和负面跟踪评级的影响，投资的风险收益比较低，尤其应回避存在产能过剩行业、债务负担偏重、内部治理较差等问题的发行人。

转债市场方面，大盘蓝筹转债仍缺乏趋势性机会，把握阶段性反弹和中小盘转债品种的结构性机会将是投资的重点。权益类市场难以看到趋势性投资机会。

2014年二季度，本基金保本周期到期后将变更为非保本的股票型基金。我们非常感谢保本基金份额持有人的信任和支持，转型后基金管理人将按照新的基金合同和风险收益特征的要求，积极稳健管理，严格控制风险，研究新的投资品种和挖掘投资机会，力争获得与基金风险收益特征一致的收益回报给投资者。

§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	92,913,247.20	17.56
	其中：债券	92,913,247.20	17.56
	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	60,860,411.29	11.50
	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	370,705,141.19	70.05
7	其他资产	4,701,028.48	0.89
8	合计	529,179,828.16	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	16,072,547.20	3.05
2	央行票据	–	0.00
3	金融债券	39,556,000.00	7.52
	其中：政策性金融债	39,556,000.00	7.52
4	企业债券	2,973,900.00	0.57
5	企业短期融资券	30,216,000.00	5.74
6	中期票据	–	0.00
7	可转债	4,094,800.00	0.78
8	其他	–	0.00
9	合计	92,913,247.20	17.66

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	041352019	13南方水泥CP002	300,000	30,216,000.00	5.74
2	130236	13国开36	200,000	19,978,000.00	3.80
3	120414	12农发14	200,000	19,578,000.00	3.72
4	010303	03国债(3)	99,420	9,162,547.20	1.74
5	019307	13国债07	69,100	6,910,000.00	1.31

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

本基金本报告期末持有国债期货。

5.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末持有国债期货。

5.10.3 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末持有国债期货。

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的，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 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	143,571.05
2	应收证券清算款	–
3	应收股利	–
4	应收利息	4,553,298.05
5	应收申购款	4,159.38
6	其他应收款	–
7	待摊费用	–
8	其他	–
9	合计	4,701,028.48

5.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

序号	债券代码	债券名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例（%）
1	110015	石化转债	4,094,800.00	0.78

5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末未持有股票。

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	542,644,033.08
报告期期间基金总申购份额	616,040.18
减:报告期期间基金总赎回份额	40,323,202.32
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	502,936,870.94

§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

基金管理人本报告期末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

大成保本混合型证券投资基金第一个保本周期为2014年4月21日(周一)，本基金将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"，详细情况请见本报告的§1 重要提示。

§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保本混合型证券投资基金的文件；
2、《大成保本混合型证券投资基金基金合同》；
3、《大成保本混合型证券投资基金基金托管协议》；
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

大成标普500等权重指数证券投资基金

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

2.1 基金基本情况

基金简称	大成标普500 等权重指数QDII
交易代码	096001
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2011年3月23日
报告期末基金份额总额	97,088,945.41份
投资目标	通过严格的投资纪律约束和数量化风险管理手段，实现基金投资组合对标的指数的有效跟踪，追求跟踪误差最小化。
投资策略	本基金将按照标的指数的成份股及其权重构建基金股票投资组合，并根据标的指数成份股及其权重的变动而进行相应调整。但在因特殊情况（如股票停牌、流动性不足）导致无法获得足够数量的股票时，基金管理人将搭配使用其他合理方法进行适当的替代。 本基金还可能将一定比例的基金资产投资于与标普500等权重指数相关的公募基金、上市交易型基金，以优化投资组合的建立，达到节约交易成本和有效追踪标的指数表现的目的。
业绩比较基准	标普500等权重指数（全收益指数）
风险收益特征	本基金为美国股票指数型证券投资基金，风险与预期收益高于混合型基金、债券基金以及货币市场基金，属于预期风险较高的产品。
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

2.2 境外投资顾问和境外资产托管人

项目		境外资产托管人
名称	英文	Bank of China (Hong Kong) Limited
	中文	中国银行（香港）有限公司
注册地址		香港花园道1号中银大厦
办公地址		香港花园道1号中银大厦
邮政编码		–

§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	988,928.15
2.本期利润	4,101,653.37
3.加权平均基金份额本期利润	0.0436
4.期末基金资产净值	127,712,198.13
5.期末基金份额净值	1.315

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。

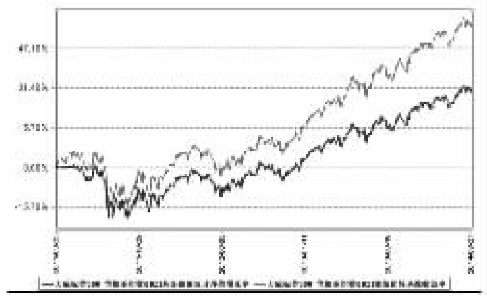
3.2 基金净值表现

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	3.20%	0.66%	2.96%	0.69%	0.24%	−0.03%

注：同期业绩比较基准以美元计价，不包含人民币汇率变动等因素产生的效应。

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、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。

2、同期业绩比较基准以美元计价，不包含人民币汇率变动等因素产生的效应。

§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		
冉凌浩先生	本基金基金经理	2011年8月26日	–	11年	金融学硕士。2003年4月至2004年6月就职于国信证券研究部，任研究员；2004年6月至2005年9月就职于华西证券研究部，任高级研究员；2005年9月加入大成基金管理有限公司，历任金融工程师、境外市场研究员及基金经理助理。2011年8月26日开始担任大成标普500等权重指数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 境外投资顾问为本基金提供投资建议的主要成员简介

本基金本报告期内无境外投资顾问。

4.3 报告期内本基金运作遵规守信情况说明

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》、《大成标普500等权重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，大成标普500等权重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。

4.4 公平交易专项说明

4.4.1 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。

4.4.2 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。

4.5 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.5.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2014年1季度，发达国家经济增长表现平稳，股票市场表现稍显平淡。从欧洲来看，已经基本确定走出经济衰退，实现小幅的正增长，同时欧洲再爆发系统性金融危机的概率较小。

美国本土遭遇近二十年来最严寒天气，其间社会经济活动减弱，因此美国首两个月的宏观经济数据表现中规中矩。但是，在严冬过后，社会经济活动逐步恢复到正常状况，宏观经济数据也随之走高。1季度末公布的较好的宏观经济数据也令投资者相信美国宏观经济的基本面依然强劲。

美国联邦储备委员会更换了主席。新任主席也被市场公认为鸽派，对宽松货币政策持支持立场。美联储在不严重影响宏观经济的情况下逐步缩减量化宽松政策，而此行为仅造成美国股票市场在极短期内的波动，并没有改变美股的上涨趋势。

人民币兑美元汇率改变了多年以来人民币持续升值的趋势，而出现了人民币兑美元贬值的情形。由于本基金资产中的绝大部分是以美元计价的美国股票及小量美元现金，因此美元兑人民币的升值有利于本基金净值的表现。

在本报告期内，本基金的目标指数上涨2.96%，美元兑人民币中间价上涨0.91%，经汇率调整后的目标指数上涨3.89%。在本报告期内，本基金净值上涨3.20%，低于经汇率调整后的目标指数0.69%。在本报告期内，本基金的经汇率调整后的年化跟踪误差为0.96%，日均偏差绝对值为0.047%，均显著低于本基金合同中的目标值。

4.5.2 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1.315元，本报告期基金份额净值增长率为3.20%同期业绩比较基准收益率2.96%，高于业绩比较基准的表现。

4.6 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2季度，美国经济活动预计会摆脱寒冬的短暂影响，恢复较为强劲的增长。经济增长的来源依然在于个人消费的持续增加和住宅市场的持续回暖，同时企业投资有望快速增加，进一步推动经济增长。

新任美联储主席有望继续保持鸽派风格，在不对经济造成严重的负面影响的情况下，继续逐步消减量化宽松政策的规模。由于市场已经对此举措有足够的预期，因此预计不会改变美国股票市场的长期趋势。

当前标普500指数的动态市盈率接近16倍，基本处于历史平均区间内。未来指数盈利的持续增加有望推动标普500指数持续上涨。

本基金为被动型指数基金，其投资目标就是要复制指数的收益率。本基金将坚持被动型的指数化投资理念，持续实施高效的组合管理策略、交易策略及风险控制方法，以期更好的跟踪指数，力争将跟踪误差控制在较低的水平。

§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（人民币元）	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	120,280,475.08	92.34
	其中：普通股	120,280,475.08	92.34
	优先股	–	0.00
	存托凭证	–	0.00
	房地产信托凭证	–	0.00
2	基金投资	–	0.00
3	固定收益投资	–	0.00
	其中：债券	–	0.00
	资产支持证券	–	0.00
4	金融衍生品投资	–	0.00
	其中：远期	–	0.00
	期货	–	0.00
	期权	–	0.00
	权证	–	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	货币市场工具	–	0.00
7	银行存款和结算备付金合计	8,830,564.63	6.78
8	其他资产	1,148,684.04	0.88
9	合计	130,259,723.75	100.00

5.2 报告期末在各个国家（地区）证券市场的股票及存托凭证投资分布

国家（地区）	公允价值（人民币元）	占基金资产净值比例（%）
美国	120,280,475.08	94.18
合计	120,280,475.08	94.18

5.3 报告期末按行业分类的股票及存托凭证投资组合

5.3.1 报告期末指数投资按行业分类的股票及存托凭证投资组合

行业类别	公允价值（人民币元）	占基金资产净值比例（%）
消费者非必需品	19,743,383.31	15.46
金融	19,652,830.47	15.39
信息技术	15,833,604.05	12.40
工业	15,564,527.23	12.19
医疗保健	12,906,985.79	10.11
能源	10,701,348.36	8.38
消费者常用品	9,775,042.89	7.65
基础材料	7,517,065.78	5.89
公用事业	7,379,346.70	5.78
电信服务	1,206,340.50	0.94
合计	120,280,475.08	94.18

注：以上分类采用全球行业分类标准（GICS）。

5.3.2 报告期末积极投资按行业分类的股票及存托凭证投资组合

本基金本报告期末未持有积极投资的股票及存托凭证。

5.4 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及存托凭证投资明细

5.4.1 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及存托凭证投资明细

序号	公司名称 (英文)	公司名称(中文)	证券代码	所在证券市场	所属国家(地区)	数量（股）	公允价值（人民币元）	占基金资产净值比例（%）
1	First Solar Inc	福思第一太阳能公司	FSLR UQ	纳斯达克交易所	美国	689	295,825.64	0.23
2	Frontier Communications Corp	公民通信	FTR UQ	纳斯达克交易所	美国	8,233	288,706.36	0.23
3	SanDisk Corp	SanDisk 公司	SNDK UQ	纳斯达克交易所	美国	575	287,206.17	0.22
4	Teradata Corp	美商天睿信息系统有限公司	TDC UN	纽约交易所	美国	921	278,714.68	0.22
5	Corning Inc	康宁公司	GLW UN	纽约交易所	美国	2,165	277,307.75	0.22
6	Exelon Corp	Exelon 公司	EXC UN	纽约交易所	美国	1,339	276,455.93	0.22
7	Edison Intl	爱迪生国际	EIX UN	纽约交易所	美国	793	276,178.41	0.22
8	Applied Materials Inc	应用材料	AMAT UQ	纳斯达克交易所	美国	2,189	274,995.06	0.22
9	Oracle Corp	甲骨文	ORCL UN	纽约交易所	美国	1,090	274,333.83	0.21
10	TE Connectivity Ltd.	泰科电子公司	TEL UN	纽约交易所	美国	734	271,886.77	0.21

5.4.2 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及存托凭证投资明细

本基金本报告期末未持有积极投资的股票及存托凭证。

5.5 报告期末按债券信用等级分类的债券投资组合

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五名债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

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。

5.8 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金融衍生品投资明细

本基金本报告期末未持有金融衍生品。

5.9 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基金投资明细

本基金本报告期末未持有基金。

5.10 投资组合报告附注

5.10.1 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的，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的。

5.10.2 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。

5.10.3 其他资产构成

序号	名称	金额（人民币元）
1	存出保证金	–
2	应收证券清算款	–
3	应收股利	122,717.11
4	应收利息	1,254.10
5	应收申购款	869,882.79
6	其他应收款	–
7	待摊费用	154,830.04
8	其他	–
9	合计	1,148,684.04

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

5.10.5.1 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

本基金本报告期末前十名指数投资中不存在流通受限情况。

5.10.5.2 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的股票及存托凭证。

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	87,946,838.33
报告期期间基金总申购份额	34,707,299.30
减:报告期期间基金总赎回份额	25,565,192.22
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	97,088,945.41

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.1 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

基金管理人本报告期末运用固有资金投资本基金。

§8 影响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标普500等权重指数证券投资基金的文件；
2、《大成标普500等权重指数证券投资基金基金合同》；
3、《大成标普500等权重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。

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

大成核心双动力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	大成核心双动力股票
交易代码	090011
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2010年6月22日
报告期末基金份额总额	159,728,643.82份
投资目标	以稳健的投资策略为主，采用合理的方法适当提升风险收益水平，力争获取超越业绩比较基准的中长期投资收益
投资策略	本基金采用自上而下的方式实施大类资产间的战略配置，并采用"核心-双卫星"策略管理股票资产。
业绩比较基准	75%×沪深300指数+25%×中证综合债券指数
风险收益特征	本基金是主动投资的股票基金，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。
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

§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	−6,244,310.70
2.本期利润	−13,136,657.21
3.加权平均基金份额本期利润	−0.0804
4.期末基金资产净值	130,223,559.97
5.期末基金份额净值	0.815

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。

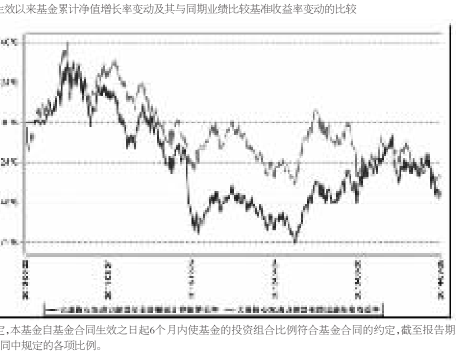
2、所述基金业绩指标不包括持有人交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

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	−9.14%	1.31%	−5.30%	0.89%	−3.84%	0.42%

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		
孙蓓琳女士	本基金基金经理	2012年7月28日	2014年1月29日	10年	经济学硕士。2004年7月至2007年7月就职于银华基金管理有限公司，历任宏观研究员、行业研究员。2007年7月加入大成基金管理有限公司，历任行业研究员、基金经理助理、研究部总监助理、研究部副总监。2012年7月28日至2014年1月29日任大成核心双动力股票型证券投资基金基金经理。2012年12月18日起任大成积极成长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
宋向宇先生	本基金基金经理	2014年1月8日	–	6年	经济学硕士，2008年7月加入大成基金管理有限公司，曾任研究部中游制造行业研究主管。2012年8月7日至2013年3月11日担任大成蓝筹稳健证券投资基金基金经理助理。2013年4月8日起担任大成财富管理2020生命周期证券投资基金基金经理。2014年1月8日起兼任大成核心双动力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》、《大成核心双动力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，大成核心双动力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缓慢下行的态势。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。

本基金管理人根据基金契约的限制，年初布局了以消费为主要配置的基金组合，在1-2月份的小市值股票行情中没有获得超额收益。到3月份，增持了以地产为代表的传统经济产业链，获得了较为显著的超额收益。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末，本基金份额净值为0.815元，本报告期份额净值增长率为-9.14%，同期业绩比较基准增长率为-5.30%，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

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	84,210,972.47	62.77
	其中：股票	84,210,972.47	62.77
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	49,768,187.05	37.10
7	其他资产	183,083.76	0.14
8	合计	134,162,243.28	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	41,297,084.44	31.71
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	–	0.00
E	建筑业	–	0.00
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	7,716,066.20	5.93
J	金融业	11,892,952.00	9.13
K	房地产业	23,304,869.83	17.90
L	租赁和商务服务业	–	0.00
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	–	0.00
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	84,210,972.47	64.67

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	000651	格力电器	365,158	10,224,424.00	7.85
2	000002	万 科A	1,000,000	8,090,000.00	6.21
3	601965	中国汽研	444,500	6,645,275.00	5.10
4	601288	农业银行	2,201,700	5,328,114.00	4.09
5	600887	伊利股份	139,917	5,013,226.11	3.85
6	000024	招商地产	236,568	4,461,672.48	3.43
7	600383	金地集团	616,760	4,267,979.20	3.28
8	002065	东华软件	96,070	3,877,385.20	2.98
9	600016	民生银行	500,900	3,836,894.00	2.95
10	600048	保利地产	370,800	2,821,788.00	2.17

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

本基金本报告期末持有国债期货。

5.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末持有国债期货。

5.10.3 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末持有国债期货。

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 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	160,767.76
2	应收证券清算款	–
3	应收股利	–
4	应收利息	9,764.13
5	应收申购款	12,551.87
6	其他应收款	–
7	待摊费用	–
8	其他	–
9	合计	183,083.76

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	166,802,657.87
报告期期间基金总申购份额	2,324,143.92
减:报告期期间基金总赎回份额	9,398,157.97
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	159,728,643.82

§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

单位：份

报告期期初管理人持有的本基金份额	30,000,000.00
报告期期间买入/申购总份额	–
报告期期间卖出/赎回总份额	–
报告期期末管理人持有的本基金份额	30,000,000.00
报告期期末持有的本基金份额占基金总份额比例（%）	18.78

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

基金管理人本报告期末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

本基金本报告期内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核心双动力股票型证券投资基金的文件；
2、《大成核心双动力股票型证券投资基金基金合同》；
3、《大成核心双动力股票型证券投资基金基金托管协议》；
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