# 深证成长40交易型开放式指数证券投资基金

## 2014 第二季度 报告

2014年6月30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7月18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7月16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4月1日起至6月30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 | 1,245,639,725.00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。<br>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4月1日 - 2014年6月30日) |
|---|---|
| 1.本期已实现收益 | -60,620,383.94 |
| 2.本期利润 | 21,909,596.00 |
| 3.加权平均基金份额本期利润 | 0.0172 |
| 4.期末基金资产净值 | 859,094,307.45 |
| 5.期末基金份额净值 | 0.690 |

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。

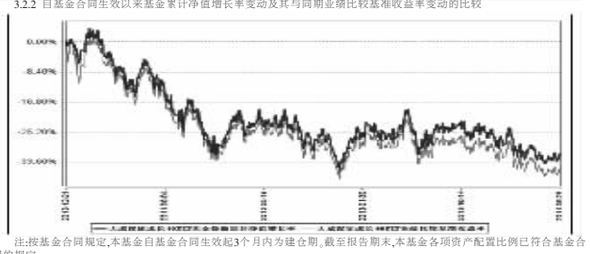
2、本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入(不含公允价值变动收益)扣除相关费用后的余额,本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

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 | 2.37% | 0.95% | 1.19% | 0.96% | 1.18% | -0.01% |

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 | | |
| 苏宋毅先生 | 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 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年二季度公司旗下主动投资组合间股票交易存在3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%的有1笔,原因为投资策略需要;投资组合间债券交易存在1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;投资组合间虽然存在同向交易行为,但结合交易价差分析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

随着实体经济不断恶化,二季度政府宏观调控的思路产生了一定的变化,"稳增长"的目标权重有所增加,体现为连续的微刺激加码投资、定向宽松、调整存贷比等一系列政策,上述措施也起到了一定的作用,五、六月数据表明,宏观经济下滑已经得到了缓解,尽管断言宏观经济见底回升还为时尚早。

政策放松以及宏观经济好转的预期也反映到A股市场。二季度市场止跌回稳,在重要指数点位附近反复震荡,市场基准沪深300指数本季小幅上涨0.88%。市场期待已久的IPO终于在季末重启,虽然造成了少许波动,但也增强了靴子落地后的反弹信心。中小板、创业板再度成为反弹的标兵,本季分别上涨4.35%和5.79%。在行业方面,受国际摩擦刺激的国防军工表现优异,以TMT为代表的新兴产业也有较高涨幅;而交运、食品饮料、纺织服装等板块则落后于大市。

本基金标的指数深证成长40指数上涨1.19%,涨幅高于大盘。二季度,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1.52%,日均偏离度0.06%,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0.690元,本报告期基金份额净值增长率为2.37%,同期业绩比较基准收益率为1.19%,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

宏观经济下季度仍然处于探底、转型的过程当中,总体下行趋势一时难以改变;而政府的应对方式及其政策的效果则存在较高的不确定性。虽然之前零星的"托底"政策确实起到了稳增长的效果,但其代价则是延缓了改革进程,而且依靠投资拉动经济的传统刺激方式边际作用递减,长期来看该政策不可延续。下一阶段,只要社会就业情况不触及政府预期区间下限,即使经济增速下滑,大规模的刺激政策也不会出台。此外,经济转型无法迅速完成,新兴行业短期还未能构成重要支撑,实体经济仍然不能乐观。

至于货币政策,其症结在于央行释放的流动性难以惠及实体经济。由于制度性的原因,资源要素配置被扭曲,央行通过各种手段释放的流动性主要流向效率较低的领域,总体社会融资成本依然高企。上述情况短期内难以改变,下季度货金面仍将维持结构性宽松的局面。

对于A股市场,基本面和资金面均不构成牛市的基础,除非有重大制度性变革,就此反转的可能性极低。另一方面,当前大市处于低位,且IPO重启已经落地,市场向下空间也相对有限。预计下季度A股市场仍然呈震荡态势,但波动率有望走出低谷。股市增量资金难觅,存量博弈的格局难以打破,以创业板为代表的成长股、概念股将成为投资者博弈的主要对象。在波动增大的情况下,半年报业绩对上述高估值股票尤为关键。

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 | 822,900,224.21 | 95.69 |
| | 其中:股票 | 822,900,224.21 | 95.69 |
| 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 | 34,411,938.24 | 4.00 |
| 7 | 其他资产 | 2,653,115.72 | 0.31 |
| 8 | 合计 | 859,965,278.17 | 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 | 2,360,357.35 | 0.27 |
| B | 采矿业 | 5,948,918.80 | 0.69 |
| C | 制造业 | 597,262,579.50 | 69.52 |
| D | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | - | 0.00 |
| E | 建筑业 | 54,095,696.47 | 6.30 |
| F | 批发和零售业 | 4,960,553.40 | 0.58 |
| 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 | 51,671,392.00 | 6.01 |
| J | 金融业 | - | 0.00 |
| K | 房地产业 | 17,458,782.29 | 2.03 |
| L | 租赁和商务服务业 | 35,678,885.00 | 4.15 |
| 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 | 53,463,059.40 | 6.22 |
| 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 | 822,900,224.21 | 95.79 |

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 | 2,776,234 | 81,760,091.30 | 9.52 |
| 2 | 000333 | 美的集团 | 3,657,557 | 70,664,001.24 | 8.23 |
| 3 | 002415 | 海康威视 | 2,678,929 | 45,381,057.26 | 5.28 |
| 4 | 002241 | 歌尔声学 | 1,470,309 | 39,198,437.94 | 4.56 |
| 5 | 002450 | 康得新 | 1,424,602 | 32,409,695.50 | 3.77 |
| 6 | 300070 | 碧水源 | 1,106,597 | 32,367,962.25 | 3.77 |
| 7 | 002236 | 大华股份 | 1,046,428 | 28,201,234.60 | 3.28 |
| 8 | 300104 | 乐视网 | 599,813 | 26,331,790.70 | 3.07 |
| 9 | 300058 | 蓝色光标 | 974,512 | 25,863,548.48 | 3.01 |
| 10 | 002081 | 金螳螂 | 1,821,298 | 25,789,579.68 | 3.00 |

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

本基金本报告期末无股指期货持仓。

5.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金股指期货投资将根据风险管理的原则,以套期保值为目的,对冲系统性风险和某些特殊情况下的流动性风险。

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 | 1,229.85 |
| 2 | 应收证券清算款 | 2,648,142.69 |
| 3 | 应收股利 | - |
| 4 | 应收利息 | 3,743.18 |
| 5 | 应收申购款 | - |
| 6 | 其他应收款 | - |
| 7 | 待摊费用 | - |
| 8 | 其他 | - |
| 9 | 合计 | 2,653,115.72 |

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 | 1,353,639,725.00 |
| 报告期期间基金总申购份额 | 18,000,000.00 |
| 减:报告期期间基金总赎回份额 | 126,000,000.00 |
| 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 | 1,245,639,725.00 |

### §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7月18日

# 大成内需增长股票型证券投资基金

## 2014 第二季度 报告

2014年6月30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7月18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7月16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4月1日起至6月30日止。

### §2 基金产品概况

| | |
|---|---|
| 基金简称 | 大成内需增长股票 |
| 交易代码 | 090015 |
| 基金运作方式 | 契约型开放式 |
| 基金合同生效日 | 2011年6月14日 |
| 报告期末基金份额总额 | 325,696,469.90份 |
| 投资目标 | 本基金主要投资于受益于内需增长的行业中的优质上市公司,力争充分分享中国经济增长以及经济结构转型带来的投资收益,追求基金资产的长期稳健增值。 |
| 投资策略 | 本基金采用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;分析以内需增长为重要推动力的中国经济转型进程中的政策导向与经济结构调整的特点,研究国内消费需求以及与之紧密关联的投资需求的增长规律,结合经济周期与产业变迁路径的分析,实施行业配置;以相关的投资主题和内需增长受益行业为线索,通过公司基本面的考量,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4月1日 - 2014年6月30日) |
|---|---|
| 1.本期已实现收益 | -22,289,734.96 |
| 2.本期利润 | 12,115,137.44 |
| 3.加权平均基金份额本期利润 | 0.0305 |
| 4.期末基金资产净值 | 393,345,774.44 |
| 5.期末基金份额净值 | 1.208 |

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。

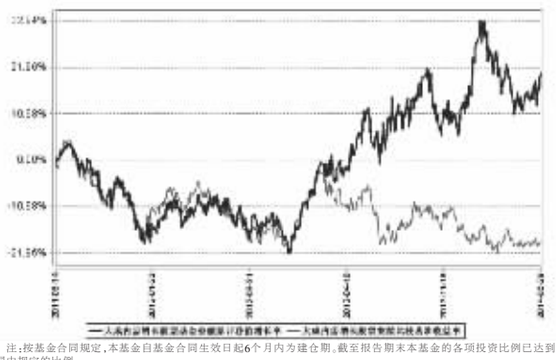
2、所述基金业绩指标不包括持有人交易基金的各项费用,计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

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 | 4.23% | 1.10% | 1.29% | 0.70% | 2.94% | 0.40% |

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日起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 | | |
| 李本刚先生 | 本基金基金经理 | 2012年9月4日 | - | 13年 | 管理学硕士。2001年至2010年先后就职于西南证券股份有限公司、中关村证券股份有限公司和建信基金管理有限公司,历任研究员、高级研究员。2010年8月加入大成基金管理有限公司,历任研究部高级研究员、行业研究主管。2012年9月4日起任大成内需增长股票型证券投资基金基金经理。2014年4月16日起任大成消费主题股票型证券投资基金基金经理。2014年5月14日任大成灵活配置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》、《大成内需增长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,大成内需增长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 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年二季度公司旗下主动投资组合间股票交易存在2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%的有1笔,原因为投资策略需要;投资组合间债券交易存在1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;投资组合间虽然存在同向交易行为,但结合交易价差分析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

截止本报告期末,本基金份额资产净值为1.208元,本报告期基金份额净值增长率为4.23%,同期业绩比较基准收益率为1.29%,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

展望3季度,在整体宏观经济低迷背景下,政府整体经济政策有望进行调整,采用更为积极地态度对宏观经济进行托底。不过,在整体经济结构调整背景下,指望经济出现大幅度回升并不太现实。

由于上半年创业板的良好表现,以TMT为代表的成长股整体估值继续上升,步入下半年,市场将逐步将估值参照切换至2015年的视角,唯有确定性的高增长才能消化估值持续上升带来的压力,因此继续选择有业绩、真成长、估值合理的公司仍将是配置的主线。

### §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 | 370,121,469.41 | 92.71 |
| | 其中:股票 | 370,121,469.41 | 92.71 |
| 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 | 23,455,933.89 | 5.88 |
| 7 | 其他资产 | 5,630,544.60 | 1.41 |
| 8 | 合计 | 399,207,947.90 | 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 | 8,113,000.00 | 2.06 |
| B | 采矿业 | - | 0.00 |
| C | 制造业 | 309,268,247.48 | 78.63 |
| 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 | 36,889,550.00 | 9.38 |
| J | 金融业 | - | 0.00 |
| K | 房地产业 | - | 0.00 |
| L | 租赁和商务服务业 | 4,010,832.00 | 1.02 |
| 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 | 9,554,400.00 | 2.43 |
| Q | 卫生和社会工作 | - | 0.00 |
| R | 文化、体育和娱乐业 | - | 0.00 |
| S | 综合 | 2,285,439.93 | 0.58 |
| | 合计 | 370,121,469.41 | 94.10 |

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 | 002085 | 万丰奥威 | 740,000 | 15,732,400.00 | 4.00 |
| 2 | 002547 | 春兴精工 | 1,306,770 | 15,642,036.90 | 3.98 |
| 3 | 002219 | 恒康医疗 | 700,000 | 15,386,000.00 | 3.91 |
| 4 | 002555 | 顺荣股份 | 320,000 | 15,065,600.00 | 3.83 |
| 5 | 601222 | 林洋电子 | 660,000 | 14,909,400.00 | 3.79 |
| 6 | 300128 | 锦富新材 | 1,100,000 | 14,905,000.00 | 3.79 |
| 7 | 300083 | 劲胜精密 | 660,000 | 14,295,600.00 | 3.63 |
| 8 | 002396 | 星网锐捷 | 500,403 | 14,006,279.97 | 3.56 |
| 9 | 600081 | 东风科技 | 989,871 | 13,749,308.19 | 3.50 |
| 10 | 002484 | 江海股份 | 735,011 | 13,641,804.16 | 3.47 |

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

本基金本报告期末无股指期货持仓。

5.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金股指期货投资将根据风险管理的原则,以套期保值为目的,对冲系统性风险和某些特殊情况下的流动性风险。

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 | 274,511.69 |
| 2 | 应收证券清算款 | 5,051,543.62 |
| 3 | 应收股利 | - |
| 4 | 应收利息 | 7,045.17 |
| 5 | 应收申购款 | 297,444.12 |
| 6 | 其他应收款 | - |
| 7 | 待摊费用 | - |
| 8 | 其他 | - |
| 9 | 合计 | 5,630,544.60 |

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在流通受限情况的情况。

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 | 387,768,083.57 |
| 报告期期间基金总申购份额 | 375,825,690.49 |
| 减:报告期期间基金总赎回份额 | 437,897,304.16 |
| 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 | 325,696,469.90 |

### §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内需增长股票型证券投资基金的文件;

2、《大成内需增长股票型证券投资基金基金合同》;

3、《大成内需增长股票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7月18日

# 大成理财21天债券型发起式证券投资基金

## 2014 第二季度 报告

2014年6月30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7月18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7月16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4月1日起至6月30日止。

### §2 基金产品概况

| | |
|---|---|
| 基金简称 | 大成理财21天债券发起式 |
| 交易代码 | 090023 |
| 基金运作方式 | 契约型开放式 |
| 基金合同生效日 | 2012年11月29日 |
| 报告期末基金份额总额 | 2,194,034,186.92份 |
| 投资目标 | 以保持基金资产的安全性和适当流动性为首要目标,追求高于业绩比较基准的稳定收益。 |
| 投资策略 | 本基金通过平均剩余期限决策、类属配置、品种选择和其他衍生工具投资策略四个层次进行投资管理,以实现超越投资基准的投资目标。 |
| 业绩比较基准 | 七天通知存款税后利率 |
| 风险收益特征 | 本基金属于短期理财债券型证券投资基金,长期风险收益水平低于股票型基金、混合型基金,及普通债券型证券投资基金。 |
| 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 |
| 下属两级基金的基金简称 | 大成理财21天债券发起式A / 大成理财21天债券发起式B |
| 下属两级基金的交易代码 | 090023 / 091023 |
| 报告期末下属两级基金的份额总额 | 41,879,838.05份 / 2,152,154,348.87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4月1日 - 2014年6月30日) | |
|---|---|---|
| | 大成理财21天债券发起式A | 大成理财21天债券发起式B |
| 1. 本期已实现收益 | 587,064.35 | 27,630,050.95 |
| 2.本期利润 | 587,064.35 | 27,630,050.95 |
| 3.期末基金资产净值 | 41,879,838.05 | 2,152,154,348.87 |

注: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,由于本基金采用摊余成本法核算,因此,公允价值变动收益为零,本期已实现收益和本期利润的金额相等。

3.2 基金净值表现

3.2.1 本报告期基金份额净值收益率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

大成理财21天债券发起式A

| 阶段 | 净值收益率① | 净值收益率标准差② | 业绩比较基