大成理财21天债券型发起式证券投资基金

2014 半年度 报告摘要

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
送出日期:2014年8月28日

§1 重要提示

基金管理人的董事会、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的法律责任。本半年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意,并由董事长签发。

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8月26日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、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及其更新。

本半年度报告摘要摘自半年度报告正文,投资者欲了解详细内容,应阅读半年度报告正文。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2014年01月01日起至06月30日止。

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金简称	大成理财21天债券发起式	
基金主代码	090023	
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	
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	
报告期末基金份额总额	2,194,034,186.92份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称:	大成理财21天债券发起式A	大成理财21天债券发起式B
下属分级基金的交易代码:	090023	091023
报告期末下属分级基金的份额总额	41,879,838.05份	2,152,154,348.87份

2.2 基金产品说明

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。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		大成基金管理有限公司	中国银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	杜鹏	王永民
	联系电话	0755-83183388	010-66594896
	电子邮箱	dupeng@dcfund.com.cn	fcid@bankofchina.com
客户服务电话		4008885558	95566
传真		0755-83199588	010-66594942

2.4 信息披露方式

登载基金半年度报告报告正文的管理人互联网网址	http://www.dcfund.com.cn
基金半年度报告报告备置地点	深圳市福田区深南大道7088号招商银行大厦32层大成基金管理有限公司 北京市西城区复兴门内大街1号中国银行股份有限公司托管及投资者服务部

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位:人民币元

基金级别	大成理财21天债券发起式A	大成理财21天债券发起式B
3.1.1 期间数据和指标	报告期(2014年1月1日－2014年6月30日)	报告期(2014年1月1日－2014年6月30日)
本期已实现收益	1,450,001.45	36,489,936.13
本期利润	1,450,001.45	36,489,936.13
本期净值收益率	2.6607%	2.8088%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2014年6月30日)	
期末基金资产净值	41,879,838.05	2,152,154,348.87
期末基金份额净值	1.0000	1.0000
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2014年6月30日)	
累计净值收益率	6.9509%	7.4470%

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 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	份额净值收益率①	份额净值收益率标准差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
过去一个月	0.3792%	0.0008%	0.1110%	0.0000%	0.2682%	0.0008%
过去三个月	1.2189%	0.0014%	0.3366%	0.0000%	0.8823%	0.0014%
过去六个月	2.6607%	0.0112%	0.6695%	0.0000%	1.9912%	0.0112%
过去一年	4.7700%	0.0082%	1.3500%	0.0000%	3.4200%	0.0082%
自基金合同生效起至今	6.9509%	0.0092%	2.1415%	0.0000%	4.8094%	0.0092%

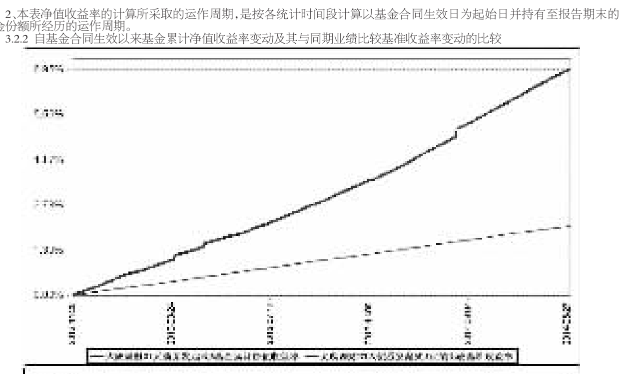
大成理财21天债券发起式B

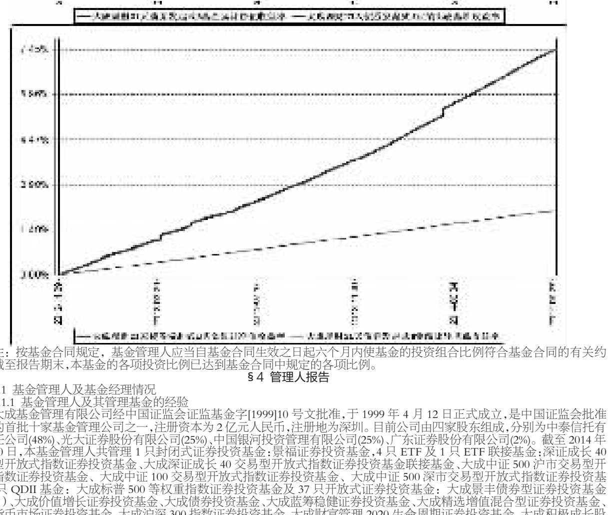
阶段	份额净值收益率①	份额净值收益率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	0.4038%	0.0008%	0.1110%	0.0000%	0.2928%	0.0008%
过去三个月	1.2927%	0.0014%	0.3366%	0.0000%	0.9561%	0.0014%
过去六个月	2.8088%	0.0112%	0.6695%	0.0000%	2.1393%	0.0112%
过去一年	5.0742%	0.0082%	1.3500%	0.0000%	3.7242%	0.0082%
自基金合同生效起至今	7.4470%	0.0092%	2.1415%	0.0000%	5.3055%	0.0092%

注:1、本基金根据每日基金收益情况,以基金净收益为基准,为投资者每日计算当日收益并分配,并在运作期期末集中支付。

2、本表净值收益率的计算所采取的运作周期,是按各统计时间段计算以基金合同生效日为起始日并持有至报告期末的基金份额所经历的运作周期。

3.2.2 自基金合同生效以来基金累计净值收益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,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各项比例。

§4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

大成基金管理有限公司经中国证监会证监基金字[1999]10号文批准,于1999年4月12日正式成立,是中国证监会批准成立的首批十家基金管理公司之一,注册资本为2亿元人民币,注册地为深圳。目前公司由四家股东组成,分别为中泰信托有限责任公司(48%)、光大证券股份有限公司(25%)、中国银河投资管理有限公司(25%)、广东证券股份有限公司(2%)。截至2014年6月30日,本基金管理人共管理1只封闭式证券投资基金:景福证券投资基金,4只ETF及1只ETF联接基金:深证成长40交易型开放式指数证券投资基金、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、大成中证500沪市交易型开放式指数证券投资基金、大成中证100交易型开放式指数证券投资基金、大成中证500深市交易型开放式指数证券投资基金,1只QDII基金:大成标普500等权重指数证券投资基金及37只开放式证券投资基金:大成景丰债券型证券投资基金(LOF)、大成价值增长证券投资基金、大成债券投资基金、大成蓝筹稳健证券投资基金、大成精选增值混合型证券投资基金、大成货币市场证券投资基金、大成沪深300指数证券投资基金、大成财富管理2020生命周期证券投资基金、大成积极成长股票型证券投资基金、大成创新成长混合型证券投资基金(LOF)、大成景阳领先股票型证券投资基金、大成强化收益债券型证券投资基金、大成策略回报股票型证券投资基金、大成行业轮动股票型证券投资基金、大成中证红利指数证券投资基金、大成核心双动力股票型证券投资基金、大成竞争优势股票型证券投资基金、大成内需增长股票型证券投资基金、大成消费主题股票型证券投资基金、大成可转债增强债券型证券投资基金、大成新锐产业股票型证券投资基金、大成景恒保本混合型证券投资基金、大成优选股票型证券投资基金(LOF)、大成现金增利货币市场基金、大成月添利理财债券型证券投资基金、大成理财21天债券型发起式基金、大成现金宝场内实时申赎货币市场基金、大成景安短融债券型证券投资基金、大成景兴信用债债券型证券投资基金、大成景旭纯债债券型证券投资基金、大成景祥分级债券型证券投资基金、大成中小盘股票型证券投资基金(LOF)、大成健康产业股票型证券投资基金、大成信用增利一年定期开放债券型证券投资基金、大成灵活配置混合型证券投资基金、大成招财宝货币市场基金、大成景益平稳收益混合型证券投资基金。

4.1.2 基金经理(或基金经理小组)及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理(助理)期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
陶铄先生	本基金基金经理	2012年11月29日	2014年4月4日	7年	中国科学院管理学硕士。曾任职于招商银行总行、普华永道会计师事务所、穆迪投资者服务有限公司、中国国际金融有限公司。曾担任中国国际金融有限公司固定收益部高级经理、副总经理。2010年9月加入大成基金管理有限公司,历任研究员、基金经理助理。2012年2月9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。2012年9月20日至2014年4月4日任大成月添利理财债券型证券投资基金基金经理。2012年11月29日至2014年4月4日任大成理财21天债券型发起式证券投资基金基金经理。2013年5月24日起任大成景安短融债券型证券投资基金基金经理。2013年6月4日起任大成景兴信用债债券型证券投资基金基金经理。2013年10月16日起任大成景丰债券型证券投资基金(LOF)基金经理。2014年1月28日起任大成信用增利一年定期开放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
屈伟南先生	本基金基金经理	2013年2月1日	－	12年	工商管理硕士。曾任职于郑州纺织工学院、融通基金管理有限公司。2006年3月加入大成基金管理有限公司,历任基金会计、固定收益研究员、基金经理助理。2013年2月1日起任大成理财21天债券型发起式证券投资基金基金经理。2013年3月27日起任大成现金宝场内实时申赎货币市场基金基金经理。2013年11月19日起任大成景祥分级债券型证券投资基金基金经理。2014年6月18日起任大成招财宝货币市场基金基金经理。2014年7月28日起任大成添利宝货币市场基金基金经理。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》、《大成理财21天债券型发起式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,大成理财21天债券型发起式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 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

报告期内,基金管理人严格执行了公平交易的原则和制度。基金管理人对旗下所有投资组合间连续4个季度的日内、3日内及5日内股票及债券交易同向交易价差分析及相应交易情形的分析结果表明:债券交易同向交易频率较低;股票同向交易溢价率较大主要来源于市场因素(如个股当日价格振幅较高)及组合经理交易时机选择,即投资组合在一定交易时间不一致以及成交价格的日内较大变动导致个别些组合间的成交价格差异较大。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。

4.3.2 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年上半年公司旗下主动投资组合间股票交易存在11笔同日反向交易,原因是投资组合投资策略需要。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3笔,原因为投资策略需要;投资组合间存在1笔债券同日反向交易,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 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2014年上半年,世界经济继续温和复苏。美国经济活动重新加速,第二季度GDP环比折年率增长4.0%,欧元区经济则继续微弱复苏。我国受房地产开发投资增速放缓,经济增速持续下滑。一、二季度GDP增速分别为7.4%和7.5%,低于2013年的7.7%。通胀方面,受食品价格影响,上半年CPI同比仅为2.3%。受国内外需求的影响,PPI上半年同比为-1.8%。因此,从整体宏观环境来看,对债券市场较为有利。在经济持续放缓、企业盈利下滑等背景下,央行态度较去年下半年明显好转。央行通过再贷款、定向降准等定向宽松的方式降低融资成本,同时在公开市场上持续保持净投放。上半年银行间7天回购利率均值由去年下半年的4.36%降至3.69%,3月SHIBOR回落至4.75%。各期限收益率亦出现大幅下行,其中1年国开债下行120BP,AAA、AA+、AA短融均下行165BP以上。

在组合投资方面,一季度,由于组合规模大幅增长,因此适时调整了久期策略,加大了组合的剩余期限。在类属配置方面,以同业存款的为主,适度增加短融的配置额度。二季度由于组合规模相对稳定,因此在类属配置方面,主要延续了前期的配置思路,以同业存款和逆回购为主,保持组合静收益,同时适度增加短融的配置力度。在短融投资方面,新增短融以AA+和AA为主。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

报告期内本基金A级净值收益率为2.6607%,B级净值收益率2.8088%,期间业绩比较基准收益率为0.6695%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望下半年,由于主要城市地产销量同比持续大幅下降,发电增速未有明显改善,经济增速难以乐观。目前经济虽在"微刺激"政策的带动下呈现出复苏迹象,但这一复苏头对稳增长政策高度依赖,并面临着来自地产和基数效应的压力,因而并不稳固。去年3季度,GDP增速从去年2季度的7.5%回升至7.8%。这种基数的上升,会给今年3季度的经济和投资同比增速带来向下压力。在总需求回落的背景下,通胀总体不需担忧。在政府要求降低社会融资成本的指导理想下,预计下半年央行仍会保持政策的连续性和稳定性,坚持"总量稳定、结构优化"的取向,保持货币市场稳定。因此,目前短端信用和利率绝对收益率水平虽较年初大幅下行,但仍处历史高位,具一定的配置价值。但随着经济的进一步下行,对于低评级短融的投资上应谨慎对待。

基于上述分析,2014年下半年,组合将适度提高组合剩余期限。在类属配置方面,我们将密切跟踪市场的变化,在充分做好流动性管理的前提下,适度加大短融的配置比例。同时密切关注同业存款政策的变化,力争在保持组合流动性的前提下,为投资者带来长期稳定的投资收益。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本基金管理人指导基金估值业务的领导小组为公司估值委员会,公司估值委员会主要负责估值政策和估值程序的制定、修订以及执行情况的监督。估值委员会由股票投资部、研究部、固定收益部、风险管理部、基金运营部、监察稽核部、委托投资部指定人员组成。公司估值委员会的相关成员均具备相应的专业胜任能力和相关工作经历,估值委员会成员中包括两名投资组合经理。

股票投资部、研究部、固定收益部、风险管理部和委托投资部负责关注相关投资品种的动态,评判基金持有的投资品种是否处于不活跃的交易状态或者最近交易日后经济环境发生了重大变化或证券发行机构发生了影响证券价格的重大事件,从而确定估值日需要进行估值测算或者调整的投资品种;提出合理的数量分析模型对需要进行估值测算或者调整的投资品种进行公允价值定价与计量;定期对估值政策和程序进行评价,以保证其持续适用;基金运营部负责日常的基金资产的估值业务,执行基金估值政策,并负责与托管行沟通估值调整事项;监察稽核部负责审核估值政策和程序的一致性,监督估值委员会工作流程中的风险控制,并负责估值调整事项的信息披露工作。

本基金的日常估值程序由基金运营部基金估值核算员执行,并与托管银行的估值结果核对一致。基金估值政策的议定和修改采用集体讨论机制,基金经理及投资经理作为估值小组成员,对本基金持仓证券的交易情况、信息披露情况保持应有的职业敏感,向估值委员会提供估值参考信息,参与估值政策讨论。对需采用特别估值程序的证券,基金管理人及时启动特别估值程序,由估值委员会讨论议定特别估值方案并与托管行沟通后由基金运营部具体执行。

本基金管理人参与估值流程各方之间不存在任何重大利益冲突,截止报告期末未与外部估值定价服务机构签约。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金管理人严格按照本基金基金合同的规定进行收益分配。据本基金基金合同中收益分配有关原则的规定:本基金根据每日基金收益情况,以基金净收益为基准,为投资者每日计算当日收益并分配,并在运作期期末集中支付。本报告期内本基金应分配利润37,939,937.58元,报告期内已分配利润37,939,937.58元。

§5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内,中国银行股份有限公司(以下称"本托管人")在对大成理财21天债券型发起式证券投资基金(以下称"本基金")的托管过程中,严格遵守《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的有关规定,不存在损害基金份额持有人利益的行为,完全尽职尽责地履行了应尽的义务。

5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

本报告期内,本托管人根据《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定,对本基金管理人的投资运作进行了必要的监督,对基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算以及基金费用开支等方面进行了认真地复核,未发现本基金管理人存在损害基金份额持有人利益的行为。

5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本报告中的财务指标、净值收益表现、收益分配情况、财务会计报告(注:财务会计报告中的"金融工具风险及管理"部分未在托管人复核范围内)、投资组合报告等数据真实、准确和完整。

§6 半年度财务会计报告(未经审计)

6.1 资产负债表

会计主体:大成理财21天债券型发起式证券投资基金

报告截止日:2014年6月30日

单位:人民币元

资产	本期末 2014年6月30日	上年度末 2013年12月31日
资产:		
银行存款	1,217,009,904.24	25,264,087.15
结算备付金	－	－
存出保证金	－	－
交易性金融资产	490,161,204.60	89,683,388.49
其中:股票投资	－	－
基金投资	－	－
债券投资	490,161,204.60	89,683,388.49
资产支持证券投资	－	－
贵金属投资	－	－
衍生金融资产	－	－
买入返售金融资产	700,001,200.00	34,920,172.38
应收证券清算款	－	－
应收利息	31,229,509.73	1,864,658.91
应收股利	－	－
应收申购款	－	137,000.00
递延所得税资产	－	－
其他资产	－	－
资产总计	2,438,401,818.57	151,869,306.93
负债和所有者权益	本期末 2014年6月30日	上年度末 2013年12月31日
负债:		
短期借款	－	－
交易性金融负债	－	－
衍生金融负债	－	－
卖出回购金融资产款	239,799,010.10	36,529,781.73
应付证券清算款	－	－
应付赎回款	－	－
应付管理人报酬	490,865.80	29,559.00
应付托管费	145,441.70	8,758.21
应付销售服务费	29,382.22	10,489.54
应付交易费用	27,983.81	16,675.18
应交税费	－	－
应付利息	69,616.40	3,241.71
应付利润	3,622,916.88	270,090.89
递延所得税负债	－	－
其他负债	182,414.74	159,000.00
负债合计	244,367,631.65	37,027,596.26
所有者权益:		
实收基金	2,194,034,186.92	114,841,710.67
未分配利润	－	－
所有者权益合计	2,194,034,186.92	114,841,710.67
负债和所有者权益总计	2,438,401,818.57	151,869,306.93

注:报告截止日2014年6月30日,基金份额净值1.0000元,基金份额总额2,194,034,186.92份,其中A类基金份额总额为41,879,838.05份,B类基金份额的份额总额为2,152,154,348.87份。

6.2 利润表

会计主体:大成理财21天债券型发起式证券投资基金

本报告期:2014年1月1日至2014年6月30日

单位:人民币元

项目	本期 2014年1月1日至2014年6月30日	上年度可比期间 2013年1月1日至2013年6月30日
一、收入	42,178,741.25	8,785,577.78
1.利息收入	41,652,649.15	7,612,663.10
其中:存款利息收入	32,280,615.16	3,946,402.87
债券利息收入	6,785,720.69	3,040,207.16
资产支持证券利息收入	－	－
买入返售金融资产收入	2,586,313.30	626,053.07
其他利息收入	－	－
2.投资收益(损失以"-"填列)	526,092.10	1,172,914.68
其中:股票投资收益	－	－
基金投资收益	－	－
债券投资收益	526,092.10	1,172,914.68
资产支持证券投资收益	－	－
贵金属投资收益	－	－
衍生工具收益	－	－
股利收益	－	－
3.公允价值变动收益(损失以"-"号填列)	－	－
4.汇兑收益(损失以"-"号填列)	－	－
5.其他收入(损失以"-"号填列)	－	－
减:二、费用	4,238,803.67	1,951,519.23
1.管理人报酬	1,974,461.14	510,756.93
2.托管费	585,025.47	151,335.39
3.销售服务费	155,458.24	328,620.06
4.交易费用	－	－
5.利息支出	1,305,882.63	734,690.13
其中:卖出回购金融资产支出	1,305,882.63	734,690.13
6.其他费用	217,976.19	226,116.72
三、利润总额(亏损总额以"-"号填列)	37,939,937.58	6,834,058.55
减:所得税费用	－	－
四、净利润(净亏损以"-"号填列)	37,939,937.58	6,834,058.55

6.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体:大成理财21天债券型发起式证券投资基金

本报告期:2014年1月1日 至 2014年6月30日

单位:人民币元

项目	本期 2014年1月1日至2014年6月30日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益(基金净值)	114,841,710.67	－	114,841,710.67
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	－	37,939,937.58	37,939,937.58
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数(净值减少以"-"号填列)	2,079,192,476.25	－	2,079,192,476.25
其中:1.基金申购款	4,197,317,891.68	－	4,197,317,891.68
2.基金赎回款	-2,118,125,415.43	－	-2,118,125,415.43
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以"-"号填列)	－	-37,939,937.58	-37,939,937.58
五、期末所有者权益(基金净值)	2,194,034,186.92	－	2,194,034,186.92

项目	上年度可比期间 2013年1月1日至2013年6月30日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益(基金净值)	1,334,791,660.06	－	1,334,791,660.06
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	－	6,834,058.55	6,834,058.55
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数(净值减少以"-"号填列)	-1,190,937,790.62	－	-1,190,937,790.62
其中:1.基金申购款	684,055,627.56	－	684,055,627.56
2.基金赎回款	-1,874,993,418.18	－	-1,874,993,418.18
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以"-"号填列)	－	-6,834,058.55	-6,834,058.55
五、期末所有者权益(基金净值)	143,853,869.44	－	143,853,869.44

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告6.1至6.4财务报表由下列负责人签署:

张树忠　　　刘彩晖　　　范瑛

基金管理人负责人　　主管会计工作负责人　　会计机构负责人

6.4 报表附注

6.4.1 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

6.4.2 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2004]78号《关于证券投资基金税收政策的通知》、财税[2008]1号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》及其他相关财税法规和实务操作,主要税项列示如下:

(1)以发行基金方式募集资金不属于营业税征收范围,不征收营业税。

(2)基金买卖债券的差价收入暂免征营业税和企业所得税。

(3)对基金取得的企业债券利息收入,由发行债券的企业在向基金派发利息时代扣代缴20%的个人所得税,暂不征收企业所得税。

6.4.3 关联方关系

6.4.3.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

6.4.3.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
大成基金管理有限公司("大成基金")	基金管理人、注册登记机构、基金销售机构
中国银行股份有限公司("中国银行")	基金托管人、基金代销机构
中泰信托有限责任公司	基金管理人的股东
光大证券股份有限公司("光大证券")	基金管理人的股东、基金代销机构
中国银河投资管理有限公司	基金管理人的股东
广东证券股份有限公司("广东证券")	基金管理人的股东
大成国际资产管理有限公司("大成国际")	基金管理人的子公司
大成创新资本管理有限公司("大成创新资本")	基金管理人的合资子公司

注:1.中国证监会于2005年11月6日作出对广东证券取消业务许可并责令关闭的行政处罚。

2.下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.4 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.4.1 通过关联方交易单元进行的交易

本报告期内及上年度可比期间本基金无通过关联方交易单元进行的交易。

6.4.4.2 关联方报酬

6.4.4.2.1 基金管理费

单位:人民币元

项目	本期 2014年1月1日至2014年6月30日	上年度可比期间 2013年1月1日至2013年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	1,974,461.14	510,756.93
其中:支付销售机构的客户维护费	66,743.14	209,427.37

注:支付基金管理人大成基金 的管理人报酬按前一日基金资产净值0.27%的年费率计提,逐日累计至每月月底,按月支付。其计算公式为:

日管理人报酬=前一日基金资产净值 X 0.27% / 当年天数。

6.4.4.2.2 基金托管费

单位:人民币元

项目	本期 2014年1月1日至2014年6月30日	上年度可比期间 2013年1月1日至2013年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	585,025.47	151,335.39

注:支付基金托管人中国银行的托管费按前一日基金资产净值0.08%的年费率计提,逐日累计至每月月底,按月支付。其计算公式为:

日托管费=前一日基金资产净值 X 0.08% / 当年天数。

6.4.4.2.3 销售服务费

单位:人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期 2014年1月1日至2014年6月30日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	大成理财21天债券发起式A	大成理财21天债券发起式B	合计
大成基金	6,396.56	66,900.24	73,296.80
中国银行	75,719.62	3,275.61	78,995.23
合计	82,116.18	70,175.85	152,292.03

获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2013年1月1日至2013年6月30日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	大成理财21天债券发起式A	大成理财21天债券发起式B	合计
大成基金	2,953.10	13.71	2,966.81
中国银行	317,757.81	7,895.44	325,653.25
合计	320,710.91	7,909.15	328,620.06

注:支付基金销售机构的销售服务费按前一日基金资产净值的约定年费率计提,逐日累计至每月月底,按月支付给大成基金,再由大成基金计算并支付给各基金销售机构。A类基金份额和B类基金份额约定的销售服务费年费率分别为0.30%和0.01%。销售服务费的计算公式为:

日销售服务费=前一日基金资产净值 X 约定年费率 / 当年天数。

6.4.4.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

单位:人民币元

银行间市场交易的各关联方名称	本期 2014年1月1日至2014年6月30日					
	债券交易金额		基金逆回购		基金正回购	
	基金买入	基金卖出	交易金额	利息收入	交易金额	利息支出
中国银行	－	10,355,487.81	－	－	305,050,000.00	20,546.29

银行间市场交易的各关联方名称	上年度可比期间 2013年1月1日至2013年6月30日					
	债券交易金额		基金逆回购		基金正回购	
	基金买入	基金卖出	交易金额	利息收入	交易金额	利息支出
中国银行	－	－	－	－	59,000,000.00	7,905.17

6.4.4.4 各关联方投资本基金的情况

6.4.4.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

份额单位:份

项目	本期 2014年1月1日至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
基金合同生效日(2012年11月29日)持有的基金份额	－	－
期初持有的基金份额	－	10,423,393.38
期间申购/买入总份额	－	91,108,754.59
期间因拆分变动份额	－	－
减:期间赎回/卖出总份额	－	－
期末持有的基金份额	－	101,532,147.97
期末持有的基金份额占基金总份额比例	0.00%	4.63%

项目	上年度可比期间 2013年1月1日至2013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
基金合同生效日(2012年11月29日)持有的基金份额	－	－
期初持有的基金份额	－	10,021,809.07
期间申购/买入总份额	－	200,375.34
期间因拆分变动份额	－	－
减:期间赎回/卖出总份额	－	－
期末持有的基金份额	－	10,222,184.41
期末持有的基金份额占基金总份额比例	0.00%	11.87%

注:1、期间申购份额包含期间收益再投资份额,基金管理人大成基金管理有限公司于本报告期间申购本基金90,000,000.00份,申购本基金的费率与本基金法律文件规定一致。

2、基金管理人大成基金管理有限公司发起认购本基金的交易委托中国银行办理,认购本基金的费率与本基金法律文件规定一致。

6.4.4.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

大成理财21天债券发起式B

份额单位:份

关联方名称	本期末 2014年6月30日		上年度末 2013年12月31日	
	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例
大成创新资本	10,089,298.18	0.46%	－	0.00%

注:基金管理人子公司－大成创新资本于本报告期间申购本基金10,000,000.00份,申购本基金的费率与本基金法律文件规定一致;大成创新资本固有资金持有份额变化由收益分配引起。

6.4.4.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位:人民币元

关联方名称	本期 2014年1月1日至2014年6月30日		上年度可比期间 2013年1月1日至2013年6月30日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国银行	2,009,904.24	4,747.94	3,120,683.31	15,469.71

注:本基金的银行活期存款由基金托管人中国银行保管,按银行同业利率计息。

6.4.4.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本报告期内及上年度可比期间本基金未在承销期内参与关联方承销证券。

6.4.4.7 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期及上年度可比期间无须作说明的其他关联交易事项。

6.4.5 期末(2014年6月30日)本基金持有的流通受限证券

6.4.5.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

本基金本期末无因认购新发/增发证券而流通受限的证券。

6.4.5.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金本期末无暂时停牌等流通受限的股票。

6.4.5.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.5.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末2014年06月30日止,本基金从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额239,799,010.10元,是以如下债券作为抵押:

金额单位:人民币元

债券代码	债券名称	回购到期日	期末估值单价	数量(张)	期末估值总额
140207	14国开07	2014-07-04	100.36	1,200,000	120,432,000.00
130212	13国开12	2014-07-04	99.70	200,000	19,940,000.00
090306	09进出06	2014-07-04	100.18	100,000	10,018,000.00
041455023	14北方水泥CP002	2014-07-01	100.24	200,000	20,048,000.00
041459042	14包钢集CP002	2014-07-01	99.86	200,000	19,972,000.00
041359068	13桑德CP001	2014-07-01	100.99	200,000	20,198,000.00
041464036	14张资产CP001	2014-07-01	100.26	200,000	20,052,000.00
011420005	14中铝SCP005	2014-07-01	100.31	100,000	10,031,000.00
041472001	14宁技发CP001	2014-07-01	100.89	20,000	2,017,800.00
041461004	14浙手工CP001	2014-07-01	101.14	20,000	2,022,800.00
合计				2,440,000	244,731,600.00

6.4.5.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末2014年6月30日止,本基金无从事证券交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款的余额。

§7 投资组合报告

7.1 期末基金资产组合情况

金额单位:人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例(%)
1	固定收益投资	490,161,204.60	20.10
	其中:债券	490,161,204.60	20.10
	资产支持证券	－	0.00
2	买入返售金融资产	700,001,200.00	28.71
	其中:买断式回购的买入返售金融资产	－	0.00
3	银行存款和结算备付金合计	1,217,009,904.24	49.91
4	其他各项资产	31,229,509.73	1.28
5	合计	2,438,401,818.57	100.00

7.2 债券回购融资情况

金额单位:人民币元

序号	项目	占基金资产净值的比例(%)	
1	报告期内债券回购融资余额		10.05
	其中:买断式回购融资		0.00
序号	项目	金额	占基金资产净值的比例(%)
2	报告期末债券回购融资余额	239,799,010.10	10.93
	其中:买断式回购融资	－	0.00

注:报告期内债券回购融资余额占基金资产净值的比例为报告期内每个交易日融资余额占资产净值比例的简单平均值。

债券正回购的资金余额超过基金资产净值的20%的说明

本基金合同约定:"本基金进入全国银行间同业市场进行债券回购的资金余额不得超过基金资产净值的40%",本报告期内,本基金未发生超标情况。

7.3 基金投资组合平均剩余期限

7.3.1 投资组合平均剩余期限基本情况

项目	天数
报告期末投资组合平均剩余期限	87
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	137
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	54

报告期内投资组合平均剩余期限超过180天情况说明

本基金合同约定:"本基金投资组合的平均剩余期限在每个交易日均不得超过141天",本报告期内,本基金未发生超标情况。

7.3.2 期末投资组合平均剩余期限分布比例

序号	平均剩余期限	各期限资产占基金资产净值的比例(%)	各期限负债占基金资产净值的比例(%)
1	30天以内	32.68	10.93
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	0.00	0.00
2	30天(含)—60天	1.36	0.00
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	0.90	0.00
3	60天(含)—90天	56.52	0.00
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	0.00	0.00
4	90天(含)—180天	4.11	0.00
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	0.00	0.00
5	180天(含)—397天(含)	15.05	0.00
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	0.00	0.00
	合计	109.71	10.93

7.4 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位:人民币元

序号	债券品种	摊余成本	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	149,838,999.47	6.83
	其中:政策性金融债	149,838,999.47	6.83
4	企业债券	－	0.00
5	企业短期融资券	340,322,205.13	15.51
6	中期票据	－	0.00
7	其他	－	0.00
8	合计	490,161,204.60	22.34
9	剩余存续期超过397天的浮动利率债券	19,793,562.95	0.90

7.5 期末按摊余成本占基金资产净值比例大小排序的前十名债券投资明细

金额单位:人民币元

序号	债券代码	债券名称	债券数量(张)	摊余成本	占基金资产净值比例(%)
1	140207	14国开07	1,200,000	120,052,121.43	5.47
2	041366015	13包钢CP001	600,000	60,124,785.11	2.74
3	041455015	14瘦西湖CP001	300,000	30,000,752.71	1.37
4	011485001	14北控集SCP001	300,000	30,000,595.37	1.37
5	041360058	13广安爱众CP001	200,000	20,067,646.05	0.91
6	041359068	13桑德CP001	200,000	20,050,696.49	0.91
7	041459042	14包钢集CP002	200,000	20,002,387.36	0.91
8	041464036	14张资产CP001	200,000	20,001,835.56	0.91
9	041472010	14宁国投CP001	200,000	20,001,485.56	0.91
10	041455023	14北方水泥CP002	200,000	20,000,597.50	0.91

7.6 "影子定价"与"摊余成本法"确定的基金资产净值的偏离

项目	偏离情况
报告期内偏离度的绝对值在0.25(含)-0.5%间的次数	19
报告期内偏离度的最高值	0.4865%
报告期内偏离度的最低值	0.0211%
报告期内每个交易日偏离度的绝对值的简单平均值	0.1244%

7.7 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

本报告期末未持有资产支持证券。

7.8 投资组合报告附注

7.8.1 本基金估值采用摊余成本法估值,即估值对象以买入成本列示,按票面利率或协议利率并考虑其买入时的溢价与折价,在其剩余存续期内按照实际利率法每日计提损益。本基金通过每日计算基金收益并分配的方式,使基金份额净值保持在人民币1.0000元。

7.8.2 本报告期内不存在基金持有剩余期限小于397天但剩余存续期超过397天的浮动利率债券的摊余成本超过当日基金资产净值的20%的情况。

7.8.3 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。

7.8.4 期末其他各项资产构成

单位:人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	－
2	应收证券清算款	－
3	应收利息	31,229,509.73
4	应收申购款	－
5	其他应收款	－
6	待摊费用	－
7	其他	－
8	合计	31,229,509.73

7.8.5 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。

§8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位:份

份额级别	持有人户数(户)	户均持有的基金份额	持有人结构			
			机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例
大成理财21天债券发起式A	573	73,088.72	2,890,561.88	6.90%	38,989,276.17	93.10%
大成理财21天债券发起式B	5	430,430,869.77	2,152,154,348.87	100.00%	－	0.00%
合计	578	3,795,906.90	2,155,044,910.75	98.22%	38,989,276.17	1.78%

注:1、上述机构/个人投资者持有份额占总份额比例的计算中,对分级份额,比例的分母采用各自级别的份额,对合计数,比例的分母采用下属分级基金份额的合计数(即期末基金份额总额)。

2、持有人户数为有效户数,即存量份额大于零的账户。

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数(份)	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	大成理财21天债券发起式A	50,135.40	0.1197%
	大成理财21天债券发起式B	－	0.0000%
	合计	50,135.40	0.0023%

注:上述占基金总份额比例的计算中,对分级份额,比例的分母采用各自级别的份额,对合计数,比例的分母采用下属分级基金份额的合计数(即期末基金份额总额)。

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

项目	份额级别	持有基金份额总量的数量区间(万份)
本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	大成理财21天债券发起式A	0
	大成理财21天债券发起式B	0
	合计	0
本基金基金经理持有本开放式基金	大成理财21天债券发起式A	0
	大成理财21天债券发起式B	0
	合计	0

8.4 发起式基金发起资金持有份额情况

项目	持有份额总数	持有份额占基金总份额比例(%)	发起份额总数	发起份额占基金总份额比例(%)	发起份额承诺持有期限
基金管理人固有资金	10,728,464.23	0.49	10,000,000.00	0.46	3年
基金管理人高级管理人员	－	0.00	－	0.00	－
基金经理等人员	－	0.00	－	0.00	－
基金管理人股东	－	0.00	－	0.00	－
其他	－	0.00	－	0.00	－
合计	10,728,464.23	0.49	10,000,000.00	0.46	－

注:本报告期间基金管理人固有资金持有份额变化均由收益分配引起。比例的分母采用各分级基金份额的合计数。

§9 开放式基金份额变动

单位:份

	大成理财21天债券发起式A	大成理财21天债券发起式B
基金合同生效日(2012年11月29日)基金份额总额	2,216,351,283.87	1,404,512,744.10
本报告期期初基金份额总额	29,044,154.85	85,797,555.82
本报告期基金总申购份额	243,535,569.62	3,953,782,322.06
减:本报告期基金总赎回份额	230,699,886.42	1,887,425,529.01
本报告期基金拆分变动份额	－	－
本报告期期末基金份额总额	41,879,838.05	2,152,154,348.87

§10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

报告期内无基金份额持有人大会决议。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本报告期内,基金管理人于2014年1月25日发布了《大成基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告》,经大成基金管理有限公司第五届董事会第二十八次会议审议通过,王颢先生不再担任大成基金管理有限公司总经理,由董事长张树忠先生代任公司总经理。

2014年2月14日中国银行股份有限公司公告,自2014年2月13日起,陈四清先生担任本行行长。

报告期内基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内没有涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

10.4 基金投资策略的改变

基金投资策略在本报告期内没有重大改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金聘任的为本基金审计的会计师事务所为普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙),该事务所自基金合同生效日起为本基金提供审计服务至今。

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期,本基金管理人、托管人及其高级管理人员未受到监管部门稽查或处罚。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位:人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
安信证券	2	－	0.00%	－	0.00%	－
渤海证券	2	－	0.00%	－	0.00%	－
财富证券	1	－	0.00%	－	0.00%	－
长江证券	1	－	0.00%	－	0.00%	－
东方证券	1	－	0.00%	－	0.00%	－
东海证券	1	－	0.00%	－	0.00%	－
东莞证券	1	－	0.00%	－	0.00%	－
东吴证券	1	－	0.00%	－	0.00%	－
光大证券	2	－	0.00%	－	0.00%	－
广发证券	1	－	0.00%	－	0.00%	－
广州证券	1	－	0.00%	－	0.00%	－
国都证券	1	－	0.00%	－	0.00%	－
国海证券	1	－	0.00%	－	0.00%	－
国泰君安	1	－	0.00%	－	0.00%	－
国信证券	1	－	0.00%	－	0.00%	－
海通证券	2	－	0.00%	－	0.00%	－
华宝证券	1	－	0.00%	－	0.00%	－
华福证券	1	－	0.00%	－	0.00%	－
华林证券	1	－	0.00%	－	0.00%	－
华泰证券	2	－	0.00%	－	0.00%	－
华鑫证券	1	－	0.00%	－	0.00%	－
江海证券	1	－	0.00%	－	0.00%	－
民生证券	1	－	0.00%	－	0.00%	－
民族证券	1	－	0.00%	－	0.00%	－
齐鲁证券	1	－	0.00%	－	0.00%	－
申银万国	1	－	0.00%	－	0.00%	－
天源证券	1	－	0.00%	－	0.00%	－
万和证券	1	－	0.00%	－	0.00%	－
万联证券	1	－	0.00%	－	0.00%	－
西南证券	1	－	0.00%	－	0.00%	－
湘财证券	1	－	0.00%	－	0.00%	－
银河证券	1	－	0.00%	－	0.00%	－
英大证券	1	－	0.00%	－	0.00%	－
招商证券	2	－	0.00%	－	0.00%	－
中航证券	1	－	0.00%	－	0.00%	－
中金公司	2	－	0.00%	－	0.00%	－
中投证券	3	－	0.00%	－	0.00%	－
中信证券	2	－	0.00%	－	0.00%	－
中银国际	1	－	0.00%	－	0.00%	－

注:根据中国证监会颁布的《关于完善证券投资基金交易席位制度有关问题的通知》(证监基金字[2007]48号)的有关规定,本公司制定了租用证券公司交易单元的选择标准和程序。

租用证券公司交易单元的选择标准主要包括:

(一)财务状况良好,最近一年无重大违规行为;

(二)经营行为规范,内控制度健全,能满足各投资组合运作的保密性要求;

(三)研究实力较强,能提供包括研究报告、路演服务、协助进行上市公司调研等研究服务;

(四)具备各投资组合运作所需的高效、安全的通讯条件,有足够的交易和清算能力,满足各投资组合证券交易需要;

(五)能提供投资组合运作、管理所需的其他券商服务;

(六)相关基金合同、资产管理合同以及法律法规规定的其他条件。

租用证券公司交易单元的程序:首先根据租用证券公司交易单元的选择标准形成《券商服务评价表》,然后根据评分高低进行选择基金交易单元。

本报告期内本基金租用证券公司交易单元的变更情况如下:

本报告期内增加交易单元:无。本报告期内退租交易单元:无。

10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位:人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例
安信证券	－	0.00%	－	0.00%	－	0.00%
渤海证券	－	0.00%	－	0.00%	－	0.00%
财富证券	－	0.00%	－	0.00%	－	0.00%
长江证券	－	0.00%	10,000,000.00	100.00%	－	0.00%
东方证券	－	0.00%	－	0.00%	－	0.00%
东海证券	－	0.00%	－	0.00%	－	0.00%
东莞证券	－	0.00%	－	0.00%	－	0.00%
东吴证券	－	0.00%	－	0.00%	－	0.00%
光大证券	－	0.00%	－	0.00%	－	0.00%
广发证券	－	0.00%	－	0.00%	－	0.00%
广州证券	－	0.00%	－	0.00%	－	0.00%
国都证券	－	0.00%	－	0.00%	－	0.00%
国海证券	－	0.00%	－	0.00%	－	0.00%
国泰君安	－	0.00%	－	0.00%	－	0.00%
国信证券	－	0.00%	－	0.00%	－	0.00%
海通证券	－	0.00%	－	0.00%	－	0.00%
华宝证券	－	0.00%	－	0.00%	－	0.00%
华福证券	－	0.00%	－	0.00%	－	0.00%
华林证券	－	0.00%	－	0.00%	－	0.00%
华泰证券	－	0.00%	－	0.00%	－	0.00%
华鑫证券	－	0.00%	－	0.00%	－	0.00%
江海证券	－	0.00%	－	0.00%	－	0.00%
民生证券	－	0.00%	－	0.00%	－	0.00%
民族证券	－	0.00%	－	0.00%	－	0.00%
齐鲁证券	－	0.00%	－	0.00%	－	0.00%
申银万国	－	0.00%	－	0.00%	－	0.00%
天源证券	－	0.00%	－	0.00%	－	0.00%
万和证券	－	0.00%	－	0.00%	－	0.00%
万联证券	－	0.00%	－	0.00%	－	0.00%
西南证券	－	0.00%	－	0.00%	－	0.00%
湘财证券	－	0.00%	－	0.00%	－	0.00%
银河证券	－	0.00%	－	0.00%	－	0.00%
英大证券	－	0.00%	－	0.00%	－	0.00%
招商证券	－	0.00%	－	0.00%	－	0.00%
中航证券	－	0.00%	－	0.00%	－	0.00%
中金公司	－	0.00%	－	0.00%	－	0.00%
中投证券	－	0.00%	－	0.00%	－	0.00%
中信证券	－	0.00%	－	0.00%	－	0.00%
中银国际	－	0.00%	－	0.00%	－	0.00%

10.8 偏离度绝对值超过0.5%的情况

本基金本报告期内无偏离度绝对值超过0.5%的情况。

§11 影响投资者决策的其他重要信息

本基金管理人于2014年8月7日在《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》及本公司网站(www.dcfund.com.cn)发布了"大成基金管理有限公司关于召开大成理财21天债券型证券投资基金基金份额持有人大会(通讯方式)的公告",经与本基金的基金托管人中国银行股份有限公司协商一致,决定以通讯方式召开本基金的基金份额持有人大会,审议本基金转型成为"大成月月盈短期理财债券型证券投资基金"等相关事宜,会议投票表决起止时间从2014年8月14日至2014年9月10日17:00止。截至报告送出日,会议投票表决仍在进行中,详情将见相关公告及附件。

大成基金管理有限公司
2014年8月28日