

大成行业轮动股票型证券投资基金

2013第四季度报告

2013年12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

报告期出日期:2014年1月22日

§1 重要提示

基金管理人的董事及董事会根据本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对本报告的内容的真实性、准确性、完整性和合法性承担个别及连带责任。

基金经理人:中农农银银行股份有限公司根据基金合同的有关规定，于2014年1月13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项，保证复核结果不存在虚假记载、误导陈述或重大遗漏。

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。投资人风险，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。

本报告期自2013年10月1日起至12月31日止。

§2 基金产品概况

基金简称 大成行业轮动股票

交易代码 000909

基金运作方式 灵活型开放式

基金合同生效日 2009年9月8日

报告期末基金份额总额 324,920,726.90份

投资目标 利用行业轮动配置，优化行业配置，实现超额收益，实现基金资产长期稳健增值。

投资策略 本基金在行业轮动模型的决策流程中，识别行业轮动的规律，根据行业轮动的规律，执行行业轮动的策略，日上下的头尾大资金的轮动的配置和股票类别的股票配置，精选行业优质的股票，优化行业配置，实现超额收益。

业绩比较基准 90%×沪深300指数+20%×证监会行业分类组合

风险收益特征 本基金是一只股票型基金，预期风险水平高于混合基金、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 中国农业银行股份有限公司

§3 主要财务指标

单位:人民币元

主要财务指标 报告期(2013年10月1日-2013年12月31日)

1.本期实现利润 1,804,134.82

2.本期利润 -15,197,352.29

3.加权平均基金份额本期利润 -0.4660

4.期末基金资产净值 265,786,702.98

5.期末基金份额净值 0.818

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。

§2.2 基金净值表现

3.2.1 报告期内基金净值增长率增长差率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段 净值增长(%) 净值增长标准差(%) 业绩比较基准收益率(%) (1)-(3) (2)-(4)

过去三个月 -5.43% 1.27% -2.93% 0.90% -2.50% 0.37%

3.2.2 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

序号 股票代码 基金名称 公允价值(元) 占基金资产净值比例(%)

1 000909 大成行业轮动股票 829,980 14.54%

2 000909 天泽信息 199,917 14.51%

3 000588 蓝色光标 275,000 14.25%

4 002596 老板电器 359,971 14.21%

5 000859 王府井 760,000 13.80%

6 600729 百度 619,596 13.04%

7 601318 中国平安 270,000 11.26%

8 002410 广联达 350,000 11.05%

9 000848 乐普医疗 444,906 10.87%

10 601628 中信证券 599,949 9.07%

11 000588 天泽信息 228,37 3.42%

12 000909 大成行业轮动股票 346,863,144.93 12.81

13 000909 天泽信息 350,000,500.00 1.89

14 000909 天泽信息 17,870,000.00 0.72

15 000909 天泽信息 1,000,000.00 0.00

16 000909 天泽信息 1,000,000.00 0.00

17 000909 天泽信息 1,000,000.00 0.00

18 000909 天泽信息 1,000,000.00 0.00

19 000909 天泽信息 1,000,000.00 0.00

20 000909 天泽信息 1,000,000.00 0.00

21 000909 天泽信息 1,000,000.00 0.00

22 000909 天泽信息 1,000,000.00 0.00

23 000909 天泽信息 1,000,000.00 0.00

24 000909 天泽信息 1,000,000.00 0.00

25 000909 天泽信息 1,000,000.00 0.00

26 000909 天泽信息 1,000,000.00 0.00

27 000909 天泽信息 1,000,000.00 0.00

28 000909 天泽信息 1,000,000.00 0.00

29 000909 天泽信息 1,000,000.00 0.00

30 000909 天泽信息 1,000,000.00 0.00

31 000909 天泽信息 1,000,000.00 0.00

32 000909 天泽信息 1,000,000.00 0.00

33 000909 天泽信息 1,000,000.00 0.00

34 000909 天泽信息 1,000,000.00 0.00

35 000909 天泽信息 1,000,000.00 0.00

36 000909 天泽信息 1,000,000.00 0.00

37 000909 天泽信息 1,000,000.00 0.00

38 000909 天泽信息 1,000,000.00 0.00

39 000909 天泽信息 1,000,000.00 0.00

40 000909 天泽信息 1,000,000.00 0.00

41 000909 天泽信息 1,000,000.00 0.00

42 000909 天泽信息 1,000,000.00 0.00

43 000909 天泽信息 1,000,000.00 0.00

44 000909 天泽信息 1,000,000.00 0.00

45 000909 天泽信息 1,000,000.00 0.00

46 000909 天泽信息 1,000,000.00 0.00

47 000909 天泽信息 1,000,000.00 0.00

48 000909 天泽信息 1,000,000.00 0.00

49 000909 天泽信息 1,000,000.00 0.00

50 000909 天泽信息 1,000,000.00 0.00

51 000909 天泽信息 1,000,000.00 0.00

52 000909 天泽信息 1,000,000.00 0.00

53 000909 天泽信息 1,000,000.00 0.00

54 000909 天泽信息 1,000,000.00 0.00

55 000909 天泽信息 1,000,000.00 0.00

56 000909 天泽信息 1,000,000.00 0.00

57 000909 天泽信息 1,000,000.00 0.00

58 000909 天泽信息 1,000,000.00 0.00

59 000909 天泽信息 1,000,000.00 0.00

60 000909 天泽信息 1,000,000.00 0.00

61 000909 天泽信息 1,000,000.00 0.00

62 000909 天泽信息 1,000,000.00 0.00

63 000909 天泽信息 1,000,000.00 0.00

64 000909 天泽信息 1,000,000.00 0.00

65 000909 天泽信息 1,000,000.00 0.00

66 000909 天泽信息 1,000,000.00 0.00

67 000909 天泽信息 1,000,000.00 0.00

68 000909 天泽信息 1,000,000.00 0.00

69 000909 天泽信息 1,000,000.00 0.00

70 000909 天泽信息 1,000,000.00 0.00

71 000909 天泽信息 1,000,000.00 0.00

72 000909 天泽信息 1,000,000.00 0.00

73 000909 天泽信息 1,000,000.00 0.00

74 000909 天泽信息 1,000,000.00 0.00

75 000909 天泽信息 1,000,000.00 0.00

76 000909 天泽信息 1,000,000.00 0.00

77 000909 天泽信息 1,000,000.00 0.00

78 000909 天泽信息 1,000,000.00 0.00

79 000909 天泽信息 1,000,000.00 0.00

80 000909 天泽信息 1,000,000.00 0.00

81 000909 天泽信息 1,000,000.00 0.00

82 000909 天泽信息 1,000,000.00 0.00

83 000909 天泽信息 1,000,000.00 0.00

84 000909 天泽信息 1,000,000.00 0.00

85 000909 天泽信息 1,000,000.00 0.00

86 000909 天泽信息 1,000,000.00 0.00

87 000909 天泽信息 1,000,000.00 0.00

88 000909 天泽信息 1,000,000.00 0.00

89 000909 天泽信息 1,000,000.00 0.00

90 000909 天泽信息 1,000,000.00 0.00

91 000909 天泽信息 1,000,000.00 0.00

92 000909 天泽信息 1,000,000.00 0.00

93 000909 天泽信息 1,000,000.00 0.00

94 000909 天泽信息 1,000,000.00 0.00

95 000909 天泽信息 1,000,000.00 0.00

96 000909 天泽信息 1,000,000.00 0.00

97 000909 天泽信息 1,000