大成现金宝场内实时申赎货币市场基金

【2013】第三季度报告

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：2013年10月23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2013年10月21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2013年7月1日起至9月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	大成现金宝货币	
交易代码	519898	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2013年3月27日	
报告期末基金份额总额	102,172,937,770.00份	
投资目标	安全性和流动性优先，在此基础上追求适度收益。	
投资策略	本基金通过结构化投资策略，分散化投资策略，利率趋势评估策略，滚动配置策略和相对价值评估策略多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	银行活期存款利率(税后)	
风险收益特征	本基金为货币市场基金，为证券投资基金中的低风险品种。本基金长期的风险和预期收益低于股票型基金、混合型基金、债券型基金。	
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	
下属两级基金的基金简称	现金宝A	现金宝B
下属两级基金的交易代码	519898	519899
报告期末下属两级基金的份额总额	62,142,531,752.00份	40,030,406,018.00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(2013年7月1日－2013年9月30日)	
	现金宝A	现金宝B
1. 本期已实现收益	5,511,554.01	5,048,300.92
2.本期利润	5,511,554.01	5,048,300.92
3.期末基金资产净值	621,425,317.52	400,304,060.18

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。由于货币市场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

现金宝A

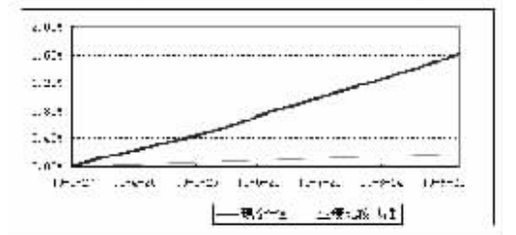
阶段	净值收益率①	净值收益率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	0.8233%	0.0010%	0.0882%	0.0000%	0.7351%	0.0010%

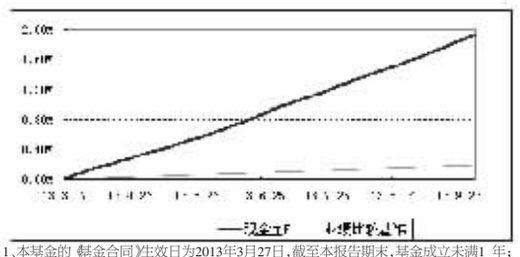
现金宝B

阶段	净值收益率①	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
过去三个月	0.9755%	0.0010%	0.0882%	0.0000%	0.8873%	0.0010%

注：本货币基金收益分配按日结转份额。

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：1、本基金的《基金合同》生效日为2013年3月27日，截至本报告期末，基金成立未满1年；

2、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。截至建仓期满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		
屈伟南先生	本基金基金经理	2013年3月27日	－	11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。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》、《大成现金宝场内实时申赎货币市场基金基金合同》和其他有关法律法规的规定，在基金管理运作中，大成现金宝场内实时申赎货币市场基金的投资范围、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。2013年3季度公司旗下主动投资组合间股票交易存在1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1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

2013年三季度，经济增长明显好于市场预期，8月工业增加值反弹至10.4%。通胀温和上升，但上升幅度较小，同比未超过3%。因此，从整体宏观环境来看，呈现温和增长和温和通胀，对债券市场影响偏中性。7月末央行重启了逆回购操作，三季度累计净投放超过3500亿，7天回购利率也较为稳定的维持在3.5%-4%的区间。但同时央行续发了3年期央票，对市场心理层面造成了较大的影响，央行锁长放短的行为影响了机构投资者的配置策略。3季度各期限收益率始终维持在较高水平，各类货币市场工具收益率易上难下，一个月、三个月shibor利率三季度均值分别达到5.01%和4.7%，高于上半年均值79个基点、63个基点。1年期金融债收益率甚至超越2011年高点，各评级短融收益率也超过历史34分位数。

本季度，组合保持了中性久期的配置策略，在类属配置方面，加大了银行同业存款的配置比例，大幅降低了债券的投资规模，适度提高了组合的静态收益。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

报告期内本基金A类净值收益率为0.8233%，B类净值收益率0.9755%，期间业绩比较基准收益率为0.0882%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望四季度，综合发电量和信贷，库存周期难以持续带动经济增长向上超预期，通胀同比均值在3.1%附近，高点难以突破3.5%，幅度可控。因此从整体宏观环境来看，相比较3季度，对债券市场不利因素略有增加，但不明显，整体仍为中性。货币政策难有大的调整，但在财政存款转向净投放及QE退出低于预期的影响下，银行间流动性有望逐步改善。目前，利率债的风险释放较为充分，短融的信用利差位于历史中位数附近，其收益率有望在资金面和利率债的带动下逐步下行。但我们也看到四季度可能存在的风险点，例如新股发行和地方政府债务规模超预期带来的事件冲击。

基于上述分析，4季度，将适度提高组合久期，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，合理搭配短融、银行同业存款和利率债等品种的投资，继续提高银行同业存款的配置比例，力争为投资者带来长期稳定的投资收益。

§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	固定收益投资	399,676,039.96	37.67
	其中：债券	399,676,039.96	37.67
	资产支持证券	－	0.00
2	买入返售金融资产	194,000,000.00	18.29
	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	430,766,523.38	40.60
4	其他资产	36,480,316.26	3.44
5	合计	1,060,922,879.60	100.00

5.2 报告期债券回购融资情况

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	1.79
	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	－	0.00
	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

本报告期内无债券正回购的资金余额超过基金资产净值的20%的情况。

5.3 基金投资组合平均剩余期限

5.3.1 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	69
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	100
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	37

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120天"，本报告期内，本基金未发生超标情况。

5.3.2 报告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	59.19	2.45
	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	10.78	0.00
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	4.91	0.00
3	60天(含)-90天	0.98	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	6.85	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)	22.46	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		100.27	2.45

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	摊余成本(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	140,148,053.66	13.72
	其中：政策性金融债	140,148,053.66	13.72
4	企业债券	－	0.00
5	企业短期融资券	259,527,986.30	25.40
6	中期票据	－	0.00
7	其他	－	0.00
8	合计	399,676,039.96	39.12
9	剩余存续期超过397天的浮动利率债券	50,157,786.20	4.91

5.5 报告期末按摊余成本占基金资产净值比例大小排名的前十名债券投资明细

序号	债券代码	债券名称	债券数量(张)	摊余成本(元)	占基金资产净值比例(%)
1	130211	13国开11	500,000	50,157,786.20	4.91
2	130214	13国开14	500,000	49,986,052.83	4.89
3	130210	13国开10	400,000	40,004,214.63	3.92
4	041352005	13西王CP001	300,000	30,037,024.70	2.94
5	041351023	13八钢CP003	300,000	30,015,287.99	2.94
6	041353028	13横店CP001	300,000	29,958,413.35	2.93
7	041354020	13新希望CP001	300,000	29,916,436.26	2.93
8	041354007	13亿利集CP001	200,000	20,021,484.90	1.96
9	041359032	13鲁晋王曲CP001	200,000	19,954,865.03	1.95
10	041354011	13亿利CP001	200,000	19,944,628.81	1.95

5.6 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	－
报告期内偏离度的最高值	0.0054%
报告期内偏离度的最低值	-0.1968%
报告期内每个工作日偏离度的绝对值的简单平均值	0.1099%

5.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名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 投资组合报告附注

5.8.1 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0.01元。

5.8.2 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。

5.8.3 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。

5.8.4 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	－
2	应收证券清算款	－
3	应收利息	8,064,368.50
4	应收申购款	28,405,680.14
5	其他应收款	10,267.62
6	待摊费用	－
7	其他	－
8	合计	36,480,316.26

5.8.5 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。

§6 开放式基金份额变动

单位：份

项目	现金宝A	现金宝B
报告期期初基金份额总额	182,720,890,007.00	49,878,272,230.00
报告期期间基金总申购份额	741,116,534,522.00	376,204,964,665.00
减：报告期期间基金总赎回份额	861,694,892,777.00	386,052,830,877.00
报告期期末基金份额总额	62,142,531,752.00	40,030,406,018.00

§7 基金管理人运用固有资金投资本公司管理基金情况

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现金宝场内实时申赎货币市场基金的文件；

2、《大成现金宝场内实时申赎货币市场基金基金合同》；

3、《大成现金宝场内实时申赎货币市场基金托管协议》；

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
2013年10月23日

大成行业轮动股票型证券投资基金

【2013】第三季度报告

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：2013年10月23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2013年10月21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2013年7月1日起至9月30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	090009
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2009年9月8日
报告期末基金份额总额	350,185,055.83份
投资目标	利用行业轮动效应，优化行业配置，获取超额投资收益，实现基金资产长期稳健增值。
投资策略	本基金将重点围绕我国经济周期动力机制与发展规律，研究我国国民经济发展过程中的结构化特征，捕捉行业轮动效应下的投资机会，自上而下的实施大类资产间的战略配置和股票类别间的战术配置，精选优质行业的优质股票，获取超额投资收益，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(2013年7月1日－2013年9月30日)
1.本期已实现收益	3,617,541.13
2.本期利润	29,527,611.11
3.加权平均基金份额本期利润	0.0816
4.期末基金资产净值	302,756,396.56
5.期末基金份额净值	0.865

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。

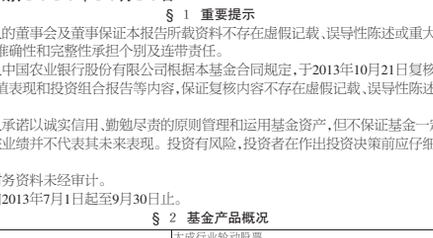
2.所述基金业绩指标不包括持有人交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

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	10.47%	0.98%	7.45%	1.15%	3.02%	-0.17%

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		
曹维飞先生	本基金基金经理、首席投资官、股票投资部总监	2013年3月8日	－	14年	北京大学中国经济研究中心国际金融硕士，曾任职于招商证券北京地区总部，鹏华基金管理公司、银顺长城基金管理公司、大成基金管理公司、建信基金管理有限责任公司等，曾担任行业研究员、宏观经济及投资策略研究员、市场销售和市场推广以及基金经理助理、基金经理等职。2006年1月至2007年6月曾任大成精选增值混合型证券投资基金基金经理；2007年10月至2008年11月曾任建信优选成长股票型证券投资基金基金经理，2008年12月加入大成基金管理有限公司曾担任研究部总监，2009年3月至2010年8月曾任大成精选增值混合型证券投资基金基金经理；2010年2月12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，2013年3月8日起担任大成行业轮动股票型证券投资基金基金经理，现同时兼任首席投资官、股票投资部总监及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
徐雄晖先生	本基金基金经理	2013年4月8日	－	5年	经济学硕士，2008年加入大成基金管理有限公司，曾任研究部社会服务行业研究主管，2010年2月25日至2013年3月11日担任大成景阳领先股票型证券投资基金基金经理助理及大成核心双动力证券投资基金基金经理助理，2013年4月8日起担任大成行业轮动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》、《大成行业轮动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，大成行业轮动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。2013年3季度公司旗下主动投资组合间股票交易存在1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1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

3季度国内经济有所企稳，海外经济波澜不惊。通货膨胀保持稳定，货币政策相对中性。在改革红利预期下，市场信心明显恢复，沪深300指数上涨9.5%，传媒、商业零售、餐饮旅游领涨大盘，建材、白酒涨幅落后。操作上，本基金适当提高了仓位，进一步增持了医药、大众食品和商业零售，在金融地产上进行了一定波段操作。

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0.865元，本报告期基金份额净值增长率为10.47%，同期业绩比较基准收益率为7.45%，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4季度，尚需观察地产对经济拉动的持续性，不排除经济下行的风险或通胀进一步上行的风险，届时货币政策的选择会对投资产生较大影响。由于国内外经济状况的复杂性，在适当关注系统性风险的前提下，我们将减少仓位的选择，更多关注组合个股自身成长带来的回报。

§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	250,728,162.07	82.19
	其中：股票	250,728,162.07	82.19
2	固定收益投资	－	0.00
	其中：债券	－	0.00
	资产支持证券	－	0.00
3	金融衍生品投资	－	0.00
4	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
5	银行存款和结算备付金合计	53,980,929.10	17.69
6	其他资产	360,750.80	0.12
7	合计	305,069,841.97	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	6,306,093.76	2.08
B	采矿业	－	0.00
C	制造业	136,897,388.82	45.22
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	39,832,379.94	13.16
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	2,998,058.40	0.99
J	金融业	20,702,500.00	6.84
K	房地产业	12,211,717.40	4.03
L	租赁和商务服务业	25,681,500.00	8.48
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	6,098,523.75	2.01
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	250,728,162.07	82.82

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	285,000	19,095,000.00	6.31
2	600066	宇通客车	749,922	13,798,564.80	4.56
3	300146	汤臣倍健	199,917	13,194,522.00	4.36
4	002508	老板电器	359,971	13,102,944.40	4.33
5	600867	通化东宝	710,000	12,517,300.00	4.13
6	000848	承德露露	429,906	12,471,573.06	4.12
7	601601	中国太保	650,000	11,420,500.00	3.77
8	600887	伊利股份	230,000	10,276,400.00	3.39
9	601318	中国平安	260,000	9,282,000.00	3.07
10	002271	东方雨虹	380,000	9,127,600.00	3.01

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名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名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名的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

5.8 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.8.1 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。

5.8.2 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。

5.9 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.9.1 本期国债期货投资政策

本基金本报告期末投资国债期货。

5.9.2 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。

5.9.3 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末投资国债期货。

5.10 投资组合报告附注

5.10.1 本基金投资的前十名证券的发行主体本期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。

5.10.2 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。

5.10.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	255,348.74
2	应收证券清算款	－
3	应收股利	－
4	应收利息	11,922.35
5	应收申购款	93,479.71
6	其他应收款	－
7	待摊费用	－
8	其他	－
9	合计	360,750.80

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

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

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	371,332,269.54
报告期期间基金总申购份额	3,125,077.60
减：报告期期间基金总赎回份额	24,272,291.31
报告期期间基金拆分变动份额	－
报告期期末基金份额总额	350,185,055.83

§7 基金管理人运用固有资金投资本公司管理基金情况

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行业轮动股票型证券投资基金的文件；

2、《大成行业轮动股票型证券投资基金基金合同》；

3、《大成行业轮动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
2013年10月23日

大成现金增利货币市场基金

【2013】第三季度报告

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：2013年10月23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2013年10月18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2013年7月1日起至9月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	大成现金增利货币	
交易代码	090022	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2012年11月20日	
报告期末基金份额总额	505,157,304.51份	
投资目标	在保持资产的低风险和高流动性的前提下，争取获得超过基金业绩比较基准的收益率。	
投资策略	本基金投资管理将充分运用收益率策略与估值策略相结合的方法，对各类可投资资产进行合理的配置和选择。投资策略首先审慎考虑各类资产的收益性、流动性及风险性特征，在风险与收益的配比中，力求将各类风险降到最低，并在控制投资组合良好流动性的基础上为投资者获取稳定的收益。	
业绩比较基准	银行活期存款利率	
风险收益特征	本基金为货币市场基金，为证券投资基金中的低风险品种。本基金长期的风险和预期收益低于股票型基金、混合型基金、债券型基金。	
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	
下属两级基金的基金简称	大成现金增利货币A	大成现金增利货币B
下属两级基金的交易代码	090022	091022
报告期末下属两级基金的份额总额	269,671,876.33份	235,485,428.18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(2013年7月1日－2013年9月30日)	
	大成现金增利货币A	大成现金增利货币B
1. 本期已实现收益	1,894,404.15	1,653,601.75
2.本期利润	1,894,404.15	1,653,601.75
3.期末基金资产净值	269,671,876.33	235,485,428.18

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，由于货币市场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

大成现金增利货币A

阶段	净值收益率①	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
过去三个月	0.9508%	0.0055%	0.0882%	0.0000%	0.8626%	0.0055%

大成现金增利货币B

阶段	净值收益率①	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