

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
送出日期:2014年3月29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。本基金年度报告经三分之二以上独立董事签字同意，并由基金经理签章。

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3月25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。

本年度报告摘要摘自年度报告全文，投资者欲了解详细内容，应阅读年度报告全文。

本报告中财务数据已审计，普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)为本基金出具了无保留意见的审计报告，报告投资者注意阅读。

本报告期自2013年01月01日起至2013年12月31日止。

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金简称	大成中证内地消费主题指数证券投资基金
基金代码	190016
交易代码	190016
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2011年11月8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
报告期末基金份额总额	64,265,985.56份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	通过严格的投资和序时均值和数量化风险管理手段，紧密跟踪标的指数，追求数量化收益和回报误差最小化。
本基金为指数基金，采用完全复制法的指数方法跟踪标的指数，即按照标的指数所包含的股票的权重比例，购买该指数包含的所有股票，以便尽可能地减小跟踪误差。	本基金将坚持长期的指数化投资策略，继续深入研究更加高效的交易策略、风险管理方法，以期更好的跟踪指数，积极应对市场，频繁申购赎回及其他突发事件的影响，力争将跟踪误差控制在更低的水平，为投资者提供专业化服务。
4.4 报告期内本基金的业绩表现	截至本报告期末，本基金份额净值为1.04元，本报告期基金份额净值增长率为8.64%，同期业绩比较基准收益率为7.13%，业绩比较基准收益率。
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	2014年宏观经济在外汇环境动荡、国内经济全面改革方面展开，宏观经济发展政策相机定位等多力量作用下“GDP增速呈底部”、“经济回暖”的态势。相信2014年，股市会出现V型走势，先震荡后不断上涨，然后预计今年会有所改善。
4.6 管理人报告期内基金估值政策和程序的说明	本基金将坚持长期的指数化投资策略，继续深入研究更加高效的交易策略、风险管理方法，以期更好的跟踪指数，积极应对市场，频繁申购赎回及其他突发事件的影响，力争将跟踪误差控制在更低的水平，为投资者提供专业化服务。
4.7 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	2014年宏观经济在外汇环境动荡、国内经济全面改革方面展开，宏观经济发展政策相机定位等多力量作用下，“GDP增速呈底部”、“经济回暖”的态势。相信2014年，股市会出现V型走势，先震荡后不断上涨，然后预计今年会有所改善。
4.8 管理人对报告期内基金评价结果的说明	本基金将坚持长期的指数化投资策略，继续深入研究更加高效的交易策略、风险管理方法，以期更好的跟踪指数，积极应对市场，频繁申购赎回及其他突发事件的影响，力争将跟踪误差控制在更低的水平，为投资者提供专业化服务。
4.9 管理人对基金持续监督情况的说明	本基金将坚持长期的指数化投资策略，继续深入研究更加高效的交易策略、风险管理方法，以期更好的跟踪指数，积极应对市场，频繁申购赎回及其他突发事件的影响，力争将跟踪误差控制在更低的水平，为投资者提供专业化服务。
4.10 管理人对基金面临的流动性风险的说明	本基金将坚持长期的指数化投资策略，继续深入研究更加高效的交易策略、风险管理方法，以期更好的跟踪指数，积极应对市场，频繁申购赎回及其他突发事件的影响，力争将跟踪误差控制在更低的水平，为投资者提供专业化服务。
4.11 管理人对基金面临的声誉风险的说明	本基金将坚持长期的指数化投资策略，继续深入研究更加高效的交易策略、风险管理方法，以期更好的跟踪指数，积极应对市场，频繁申购赎回及其他突发事件的影响，力争将跟踪误差控制在更低的水平，为投资者提供专业化服务。
4.12 管理人对基金面临的合规风险的说明	本基金将坚持长期的指数化投资策略，继续深入研究更加高效的交易策略、风险管理方法，以期更好的跟踪指数，积极应对市场，频繁申购赎回及其他突发事件的影响，力争将跟踪误差控制在更低的水平，为投资者提供专业化服务。

注:1.本基金管理人于2013年10月29日成立了全资子公司大成创新资本管理有限公司，其中大成基金管理有限公司持有52%的股权。

2.中国证监会于2005年11月6日作出关于广东证券取消业务许可并责令关闭的行政处罚。

3.下述关联交易的正常商业范围包括一般商业条款订立。

4.4.1 通过关联方买卖单元进行的交易

4.4.1.1 股票交易

金额单位:人民币元

关联方名称	本期			上期可比期间		
	2013年1月1日至2013年12月31日	2012年1月1日至2012年12月31日	当期初余额	当期末余额	当期初余额	当期末余额
光大证券	19,386,953.69	14.44%	20,758,535.38	4.7%		

注:上述金额均指成交金额(成交单价乘以成交量)，不考虑相关交易费用。

4.4.1.2 权证交易

金额单位:人民币元

关联方名称	本期			上期可比期间		
	2013年1月1日至2013年12月31日	2012年1月1日至2012年12月31日	当期初余额	当期末余额	当期初余额	当期末余额
光大证券	17,334.44	14.37%	-	-	0.00%	-

注:上述金额均指成交金额(成交单价乘以成交量)，不考虑相关交易费用。

4.4.1.3 应支付关联方的佣金

金额单位:人民币元

关联方名称	本期			上期可比期间		
	2013年1月1日至2013年12月31日	2012年1月1日至2012年12月31日	当期初余额	当期末余额	当期初余额	当期末余额
光大证券	19,777.58	4.92%	34,445.70	24.01%	-	-

注:上述金额参照行业基本的基金管理人与对方协商确定，以扣除由中国证监会登记结算有限责任公司收取的证管费和经手费的净额计算。

4.4.2 该类基金会议的服务报酬已包括佣金收入为本基金提供的证券投资研究成果和市场信息服务费。

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

本基金管理人严格按照《基金法》、《证券投资基金运作管理办法》及《大成中证内地消费主题指数证券投资基金基金合同》的规定，进行了认真、独立的会计核算和必要的投资监督，认真履行了托管人的义务，没有从事任何损害基金份额持有人利益的行为。

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

本基金管理人认为，大成基金管理有限公司在大成中证内地消费主题指数证券投资基金的投资运作、基金管理的计算、基金申购赎回价格的计算、基金费用的支取等方面，不存在损害基金份额持有人利益的行为；在报告期内，严格遵守了《证券投资基金管理暂行办法》等法律法规，在各方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

5.3 托管人对年度报告编制过程中基金估值政策和程序的说明

其他相关法律法规的规定，基金管理人所编制的并披露的大成中证内地消费主题指数证券投资基金年度报告中的基金指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告等信息真实、准确、完整，未发现有损害基金份额持有人利益的行为。

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

本基金管理人认为，大成基金管理有限公司在大成中证内地消费主题指数证券投资基金的投资运作、基金管理的计算、基金申购赎回价格的计算、基金费用的支取等方面，不存在损害基金份额持有人利益的行为；在报告期内，严格遵守了《证券投资基金管理暂行办法》等法律法规，在各方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

5.5 托管人对年度报告编制过程中基金估值政策和程序的说明

其他相关法律法规的规定，基金管理人所编制的并披露的大成中证内地消费主题指数证券投资基金年度报告中的基金指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告等信息真实、准确、完整，未发现有损害基金份额持有人利益的行为。

5.6 托管人对年度报告编制过程中基金估值政策和程序的说明

其他相关法律法规的规定，基金管理人所编制的并披露的大成中证内地消费主题指数证券投资基金年度报告中的基金指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告等信息真实、准确、完整，未发现有损害基金份额持有人利益的行为。

5.7 托管人对年度报告编制过程中基金估值政策和程序的说明

其他相关法律法规的规定，基金管理人所编制的并披露的大成中证内地消费主题指数证券投资基金年度报告中的基金指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告等信息真实、准确、完整，未发现有损害基金份额持有人利益的行为。

5.8 托管人对年度报告编制过程中基金估值政策和程序的说明

其他相关法律法规的规定，基金管理人所编制的并披露的大成中证内地消费主题指数证券投资基金年度报告中的基金指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告等信息真实、准确、完整，未发现有损害基金份额持有人利益的行为。

5.9 托管人对年度报告编制过程中基金估值政策和程序的说明

其他相关法律法规的规定，基金管理人所编制的并披露的大成中证内地消费主题指数证券投资基金年度报告中的基金指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告等信息真实、准确、完整，未发现有损害基金份额持有人利益的行为。

5.10 托管人对年度报告编制过程中基金估值政策和程序的说明

其他相关法律法规的规定，基金管理人所编制的并披露的大成中证内地消费主题指数证券投资基金年度报告中的基金指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告等信息真实、准确、完整，未发现有损害基金份额持有人利益的行为。

5.11 托管人对年度报告编制过程中基金估值政策和程序的说明

其他相关法律法规的规定，基金管理人所编制的并披露的大成中证内地消费主题指数证券投资基金年度报告中的基金指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告等信息真实、准确、完整，未发现有损害基金份额持有人利益的行为。

5.12 托管人对年度报告编制过程中基金估值政策和程序的说明

其他相关法律法规的规定，基金管理人所编制的并披露的大成中证内地消费主题指数证券投资基金年度报告中的基金指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告等信息真实、准确、完整，未发现有损害基金份额持有人利益的行为。

5.13 托管人对年度报告编制过程中基金估值政策和程序的说明

其他相关法律法规的规定，基金管理人所编制的并披露的大成中证内地消费主题指数证券投资基金年度报告中的基金指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告等信息真实、准确、完整，未发现有损害基金份额持有人利益的行为。

5.14 托管人对年度报告编制过程中基金估值政策和程序的说明

其他相关法律法规的规定，基金管理人所编制的并披露的大成中证内地消费主题指数证券投资基金年度报告中的基金指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告等信息真实、准确、完整，未发现有损害基金份额持有人利益的行为。

5.15 托管人对年度报告编制过程中基金估值政策和程序的说明

其他相关法律法规的规定，基金管理人所编制的并披露的大成中证内地消费主题指数证券投资基金年度报告中的基金指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告等信息真实、准确、完整，未发现有损害基金份额持有人利益的行为。

5.16 托管人对年度报告编制过程中基金估值政策和程序的说明

其他相关法律法规的规定，基金管理人所编制的并披露的大成中证内地消费主题指数证券投资基金年度报告中的基金指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告等信息真实、准确、完整，未发现有损害基金份额持有人利益的行为。

5.17 托管人对年度报告编制过程中基金估值政策和程序的说明

其他相关法律法规的规定，基金管理人所编制的并披露的大成中证内地消费主题指数证券投资基金年度报告中的基金指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告等信息真实、准确、完整，未发现有损害基金份额持有人利益的行为。

5.18 托管人对年度报告编制过程中基金估值政策和程序的说明

其他相关法律法规的规定，基金管理人所编制的并披露的大成中证内地消费主题指数证券投资基金年度报告中的基金指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告等信息真实、准确、完整，未发现有损害基金份额持有人利益的行为。

5.19 托管人对年度报告编制过程中基金估值政策和程序的说明

其他相关法律法规的规定，基金管理人所编制的并披露的大成中证内地消费主题指数证券投资基金年度报告中的基金指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告等信息真实、准确、完整，未发现有损害基金份额持有人利益的行为。

5.20 托管人对年度报告编制过程中基金估值政策和程序的说明

其他相关法律法规的规定，基金管理人所编制的并披露的大成中证内地消费主题指数证券投资基金年度报告中的基金指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告等信息真实、准确、完整，未发现有损害基金份额持有人利益的行为。

5.21 托管人对年度报告编制过程中基金估值政策和程序的说明