大成现金增利货币市场基金

2014 第二季度报告

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: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	4,262,842,333.99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	2,877,902,304.33份	1,384,940,029.66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)	
	大成现金增利货币A	大成现金增利货币B
1. 本期已实现收益	29,615,928.46	16,648,801.75
2.本期利润	29,615,928.46	16,648,801.75
3.期末基金资产净值	2,877,902,304.33	1,384,940,029.66

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

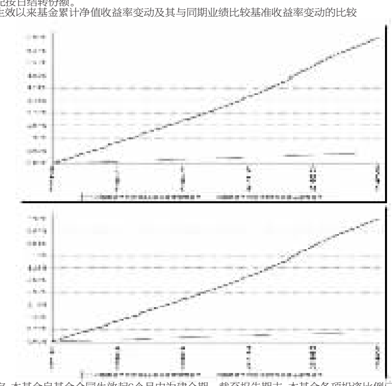
阶段	净值收益率①	净值收益率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	1.0735%	0.0049%	0.0873%	0.0000%	0.9862%	0.0049%

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
过去三个月	1.1334%	0.0049%	0.0873%	0.0000%	1.0461%	0.0049%

注:本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:按基金合同规定,本基金自基金合同生效起6个月内为建仓期。截至报告期末,本基金各项投资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		
王立女士	本基金基金经理	2012年11月20日	2014年4月4日	12年	经济学硕士。曾任职于申银万国证券股份有限公司,南京市商业银行资金营运中心。2005年4月加入大成基金管理有限公司,曾任大成货币市场基金基金经理助理。2012年11月20日至2014年4月4日任大成现金增利货币市场基金基金经理。2007年1月12日起担任大成货币市场基金基金经理。2009年5月23日起兼任大成债券投资基金基金经理。2013年2月1日起兼任大成月添利理财债券型证券投资基金基金经理。2013年7月23日起任大成景旭纯债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
李达夫先生	本基金基金经理	2013年3月7日	-	8年	数量经济学硕士。2006年7月至2008年4月就职于东莞农商银行资金营运中心,历任交易员、研究员。2008年4月至2012年9月就职于国投瑞银基金管理有限公司固定收益部,2011年6月30日至2012年9月15日担任国投瑞银货币市场基金基金经理。2012年9月加入大成基金管理有限公司。2013年3月7日至2014年4月4日任大成货币市场证券投资基金。2013年3月7日起任大成现金增利货币市场基金基金经理。2013年7月17日起兼任大成景安短融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

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》、《大成现金增利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,大成现金增利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。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

2014年二季度,受房地产投资大幅下滑的拖累,经济增长持续回落,4,5月工业增加值同比增长低于9%。受食品价格影响,CPI同比数据波动较大,但涨幅仍然较为温和。3月汇改后,人民币汇率预期发生变化,跨境资本套利空间缩小,二季度外汇占款增量出现明显下降。随着经济下行压力的增大,宏观政策迎来实质放松,央行通过再贷款、定向降准等定向宽松的方式降低社会融资成本,同时在公开市场上保持净投放。存贷比、信贷额度等监管指标陆续松动,财政支出力度也明显加大。

市场表现方面,市场资金面持续宽松,收益率曲线整体呈现平坦化下行,具体来看,1年期金融债收益率下行幅度超过50bp;各评级短融收益率下行50-80bp。

二季度本基金在投资管理过程中继续贯彻稳健操作的原则,高度重视组合的流动性管理和安全性管理。具体来说,本基金对基金份额持有人结构分析、未来投资期内持有人申购赎回带来的基金流动性变化预测以及货币市场利率判断的基础上,辅以情景分析等技术和数量手段进行资产配置决策。针对货币市场资金面的波动情况,灵活调节各类资产投资比例以及投资期限,做好流动性管理,同时进行主动和组合的收益管理。本基金着眼于货币市场流动性管理的本义,在投资管理过程中始终贯彻稳健操作的原则,合理安排投资组合和期限结构,在保证流动性的前提下通过积极主动管理提高组合投资收益。

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1.0735%,B类净值收益率1.1334%,期间业绩比较基准收益率为0.0873%。

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2014年三季度,稳增长的力度加大,经济出现底部企稳的迹象,但房地产市场销售依旧低迷,房地产投资持续下滑仍然是下半年经济增长面临的主要下行风险。猪肉价格波动给通胀带来一定不确定性,但在总需求仍然偏弱的背景下,通胀压力不大。受宏观环境不景气、民营企业及地方政府融资需求上升的影响,银行的风险偏好难以明显上升,利率传导不畅,企业仍然面临融资难、融资贵的问题,预计政策仍将持一定的刺激力度,有望从"宽货币"转向"宽货币、宽信用、宽财政"的全面刺激。债市行情有望从二季度的以资本利得为主的快牛行情过渡到以票息收入为主的慢牛行情。

本基金在三季度将密切关注金融市场的变化,在稳健操作的原则下,高度重视组合的流动性管理和安全性管理。基于市场基本面和资金面以及投资人结构变化的判断,本基金二季度将继续保持投资组合的高流动性,严格控制利率风险和流动性风险。在具体投资品种上,本基金投资将以短期融资券为主,同时继续充分利用市场机会进行交易套利。我们将始终把确保基金资产的安全性和基金收益的稳定性放在首位,在严格控制流动性风险的基础上,坚持规范运作、审慎投资的原则为基金份额持有人争取长期稳定的投资回报。

§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	固定收益投资	2,167,331,538.72	42.71
	其中:债券	2,167,331,538.72	42.71
	资产支持证券	-	0.00
2	买入返售金融资产	511,352,087.03	10.08
	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	2,338,340,651.86	46.08
4	其他资产	56,949,474.66	1.12
5	合计	5,073,973,752.27	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	9.33	
	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	807,978,836.01	18.95
	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

本报告期内本基金债券正回购的资金余额未超过基金资产净值的20%。

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	72
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	90
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	45

报告期内投资组合平均剩余期限超过180天情况说明

本报告期内本货币市场基金投资组合平均剩余期限未超过90天。

注:根据基金合同约定,本基金投资组合的平均剩余期限在每个交易日不得超过90天。

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	71.11	18.95
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	2.56	0.00
2	30天(含)-60天	5.80	0.00
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	1.18	0.00
3	60天(含)-90天	12.47	0.00
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	2.35	0.00
4	90天(含)-180天	11.76	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)	16.56	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	117.69	18.95

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	651,631,525.21	15.29
	其中:政策性金融债	651,631,525.21	15.29
4	企业债券	-	0.00
5	企业短期融资券	1,515,700,013.51	35.56
6	中期票据	-	0.00
7	其他	-	0.00
8	合计	2,167,331,538.72	50.84
9	剩余存续期超过397天的浮动利率债券	259,729,561.64	6.09

5.5 报告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

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	100209	10国开09	1,900,000	191,140,949.60	4.48
2	011489001	14鞍钢SCP001	1,800,000	180,140,359.20	4.23
3	130249	13国开49	1,000,000	100,741,974.51	2.36
4	100236	10国开36	1,000,000	100,269,863.64	2.35
5	130215	13国开15	1,000,000	99,342,192.35	2.33
6	041358061	13陕煤化CP001	800,000	80,351,235.83	1.88
7	011461005	14五矿股SCP005	800,000	80,001,540.73	1.88
8	100230	10国开30	500,000	50,199,305.03	1.18
9	041453007	14苏交通CP001	500,000	50,086,975.46	1.17
10	011415003	14中铝业SCP003	500,000	50,082,144.15	1.17

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	1
报告期内偏离度的最高值	0.2511%
报告期内偏离度的最低值	0.0154%
报告期内每个工作日偏离度的绝对值的简单平均值	0.0892%

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1.00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。

5.8.4 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	52,274,056.30
4	应收申购款	4,675,418.36
5	其他应收款	-
6	待摊费用	-
7	其他	-
8	合计	56,949,474.66

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	大成现金增利货币A	大成现金增利货币B
报告期期初基金份额总额	567,845,544.90	300,360,346.05
报告期期间基金总申购份额	12,564,392,599.61	3,961,048,306.01
减:报告期期间基金总赎回份额	10,254,335,840.18	2,876,468,622.40
报告期期末基金份额总额	2,877,902,304.33	1,384,940,029.66

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.1 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

序号	交易方式	交易日期	交易份额(份)	交易金额(元)	适用费率
1	赎回	2014年4月15日	5,016,910.34	5,028,734.17	0.00%
合计			5,016,910.34	5,028,734.17	

§8 影响投资者决策的其他重要信息

8.1 基金管理人子公司-大成创新资本管理有限公司持有本基金份额变动情况

单位:份

	大成现金增利货币A	大成现金增利货币B
报告期期初持有的本基金份额	-	-
报告期期间买入/申购总份额	3,014,800.94	10,000,000.00
报告期期间卖出/赎回总份额	-3,032,728.63	-10,014,800.94
报告期期末持有的本基金份额	-	-
报告期期末持有的本基金份额占基金总份额比例(%)	0.00	0.00

注:本报告期间基金管理人子公司固有资金持有份额变化均由收益分配引起。

8.2 基金管理人子公司-大成创新资本管理有限公司运用固有资金投资本基金交易明细

大成现金增利货币A

序号	交易方式	交易日期	交易份额(份)	交易金额(元)	适用费率
1	份额强制调增	2014-5-13	3,014,800.94	3,014,800.94	0.00%
2	赎回	2014-6-11	-3,032,728.63	-3,037,249.50	0.00%

大成现金增利货币B

序号	交易方式	交易日期	交易份额(份)	交易金额(元)	适用费率
1	申购	2014-4-14	5,000,000.00	5,000,000.00	0.00%
2	申购	2014-4-17	5,000,000.00	5,000,000.00	0.00%
3	赎回	2014-4-24	-2,000,000.00	-2,000,000.00	0.00%
4	赎回	2014-5-12	-5,000,000.00	-5,000,000.00	0.00%
5	份额强制调减	2014-5-13	-3,014,800.94	-3,014,800.94	0.00%

§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增利货币市场基金的文件;
2、《大成现金增利货币市场基金基金合同》;
3、《大成现金增利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
2014年7月18日

大成消费主题股票型证券投资基金

2014 第二季度报告

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: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。

根据中国证监会2014 年3月25日下发的《关于大成中证内地消费主题指数证券投资基金基金份额持有人大会决议备案的回函》(基金部函[2014]179号),大成中证内地消费主题指数证券投资基金自2014年3月25日起变更为大成消费主题股票型证券投资基金,修改基金合同中基金名称、基金类别、投资目标、投资理念、投资范围、投资策略、业绩比较基准、基金的费用等条款。

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	大成消费主题股票
交易代码	090016
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
报告期末基金份额总额	60,946,887.38份
投资目标	本基金主要投资于消费行业相关的优质上市公司,在严格控制风险的前提下,力争为投资者创造超越业绩比较基准的长期资本增值。
投资策略	本基金采用主动投资策略。以宏观经济分析和政策研究为基础,通过分析影响中国证券市场整体运行的内外部因素,实施大类资产配置;分析各个消费子行业在中国经济转型不同阶段行业景气度变化情况和发展趋势,实施行业配置;在各个行业内通过对公司基本面的考量,精选优质上市公司股票,构建投资组合。
业绩比较基准	中证内地消费主题指数×80%+中证综合债券指数×20%。
风险收益特征	本基金属于股票型基金,风险与收益水平高于混合基金、债券基金与货币市场基金。
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

注:根据中国证监会2014 年3月25日下发的《关于大成中证内地消费主题指数证券投资基金基金份额持有人大会决议备案的回函》(基金部函[2014]179号),大成中证内地消费主题指数证券投资基金自2014年3月25日起变更为大成消费主题股票型证券投资基金,修改基金合同中基金名称、基金类别、投资目标、投资理念、投资范围、投资策略、业绩比较基准、基金的费用等条款,修订后的《大成消费主题股票型证券投资基金基金合同》自2014年3月25日起正式生效。

§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	-1,466,702.99
2.本期利润	1,541,377.64
3.加权平均基金份额本期利润	0.0413
4.期末基金资产净值	60,310,697.61
5.期末基金份额净值	0.990

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。

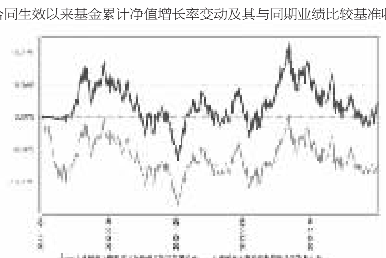
3.2 基金净值表现

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	1.96%	0.89%	0.67%	0.79%	1.29%	0.10%

注:根据《大成消费主题股票型证券投资基金基金合同》,业绩比较基准自2014 年3 月25 日起,由"中证内地消费主题指数收益率×95%+银行活期存款利率(税后)×5%。"变更为"中证内地消费主题指数×80%+中证综合债券指数×20%。";基金业绩比较基准收益率在变更前后期间分别根据相应的指标计算。

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:1、根据中国证监会2014 年3月25日下发的《关于大成中证内地消费主题指数证券投资基金基金份额持有人大会决议备案的回函》(基金部函[2014]179号),大成中证内地消费主题指数证券投资基金自2014年3月25日起变更为大成消费主题股票型证券投资基金,修改基金合同中基金名称、基金类别、投资目标、投资理念、投资范围、投资策略、业绩比较基准、基金的费用等条款,修订后的《大成消费主题股票型证券投资基金基金合同》自2014年3月25日起正式生效,截至报告期末本基金合同生效未满一年。

2、按《大成消费主题股票型证券投资基金基金合同》规定,基金管理人应当自2014 年3月25日(基金合同生效日)起六个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的约定,截止报告期末,本基金处于建仓期内。

3、本基金自2014 年3月25日(基金合同生效日)至报告期末的基金份额累计净值增长率为1.23%,同期业绩比较基准收益率为-0.83%。

4、根据《大成消费主题股票型证券投资基金基金合同》,业绩比较基准自2014 年3 月25 日起,由"中证内地消费主题指数收益率×95%+银行活期存款利率(税后)×5%。"变更为"中证内地消费主题指数×80%+中证综合债券指数×20%。";基金业绩比较基准收益率在变更前后期间分别根据相应的指标计算。

§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		
刘波先生	本基金基金经理	2013年3月7日	2014年4月15日	7年	清华大学工程物理学士。2002年2月至2003年10月就职于欧洲粒子物理研究中心(CERN),任研究助理。2008年1月至2009年1月就职于JP Morgan (London),任数量分析师。2009年2月至2010年2月就职于全欧收益投资和交易有限公司,任外汇投资经理。2010年6月至2012年1月就职于海通证券衍生产品部,任高级数量分析师。2012年2月加入大成基金管理有限公司数量投资部。2013年3月7日至2014年3月25日任大成中证内地消费主题指数证券投资基金基金经理。2014年3月25日至2014年4月15日任大成消费主题股票型证券投资基金基金经理。2013年3月7日起任大成中证红利指数证券投资基金基金经理。具有基金从业资格。国籍:中国
李本刚先生	本基金基金经理	2014年4月16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》、《大成消费主题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,大成消费主题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。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

2014年2季度整体经济仍然低迷,经济下行风险仍然存在。在周期行业整体起色不大,而以TMT为代表的成长股经过从2014年2月至4月中旬的近两个月的调整之后,部分股票的估值已经进入合理区间,因此在2014年2季度获得一定的超额收益。

本基金通过自上而下选股,重点在游戏等新兴领域进行了配置,获得一定超额收益。

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0.990元,本报告期基金份额净值增长率为1.96%,同期业绩比较基准收益率为0.67%,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	29,276,594.74	47.56
	其中:股票	29,276,594.74	47.56
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	9,306,263.48	15.12
7	其他资产	22,972,189.18	37.32
8	合计	61,555,047.40	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	521,550.00	0.86
B	采矿业	-	0.00
C	制造业	22,967,848.48	38.08
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	691,336.08	1.15
G	交通运输、仓储和邮政业	724,800.00	1.20
H	住宿和餐饮业	-	0.00
I	信息传输、软件和信息技术服务业	3,079,388.18	5.11
J	金融业	-	0.00
K	房地产业	-	0.00
L	租赁和商务服务业	-	0.00
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	424,640.00	0.70
Q	卫生和社会工作	-	0.00
R	文化、体育和娱乐业	729,872.00	1.21
S	综合	137,160.00	0.23
	合计	29,276,594.74	48.54

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	002396	星网锐捷	57,700	1,615,023.00	2.68
2	002085	万丰奥威	61,900	1,315,994.00	2.18
3	300128	锦富新材	93,000	1,260,150.00	2.09
4	601222	林洋电子	52,700	1,190,493.00	1.97
5	300083	劲胜精密	51,300	1,111,158.00	1.84
6	002555	顺荣股份	23,400	1,101,672.00	1.83
7	002484	江海股份	54,800	1,017,088.00	1.69
8	600050	中国联通	300,000	969,000.00	1.61
9	002547	春兴精工	77,500	927,675.00	1.54
10	600081	东风科技	66,319	921,170.91	1.53

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投资。

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投资。

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投资。

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

本基金本报告期末未持有权证投资。

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

本基金本报告期末投资股指期货。

5.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金投资股指期货将以投资组合避险和有效管理为目的,通过套期保值策略,对冲系统性风险,应对组合构建与调整中的流动性风险,力求风险收益的优化。

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 报告期内基金投资的前十名证券的发行主体无被监管部门立案调查的,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 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	25,325.16
2	应收证券清算款	107,867.91
3	应收股利	-
4	应收利息	899.39
5	应收申购款	22,838,096.72
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	22,972,189.18

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无流通受限情况。

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	93,828,562.09
报告期期间基金总申购份额	30,246,091.12
减:报告期期间基金总赎回份额	63,127,765.83
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	60,946,887.38

§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大成中证内地消费主题指数证券投资基金的文件;
2、中国证监会《关于大成中证内地消费主题指数证券投资基金基金份额持有人大会决议备案的回函》;
3、《大成消费主题股票型证券投资基金基金合同》;
4、《大成消费主题股票型证券投资基金托管协议》;
5、大成基金管理有限公司批准文件、营业执照、公司章程;
6、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

大成新锐产业股票型证券投资基金

2014 第二季度报告

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: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15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	大成新锐产业股票
交易代码	090018
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2012年3月20日
报告期末基金份额总额	127,838,717.51份
投资目标	投资于新锐产业中的优质上市公司,分享中国经济增长新锐力量的成长收益,追求基金资产的长期稳健增值。
投资策略	本基金采用自上而下、自下而上相结合的积极主动的投资策略。以宏观经济和政策研究为基础,通过分析影响中国证券市场整体运行的内外部因素分析,实施大类资产配置;分析中国经济结构转型背景下社会意识(可持续发展观等)、经济基础、科技进步、消费升级与产业政策等各个方面对新锐产业发展的综合影响,研究各个新锐产业发展所处的阶段特征和商业前景,结合各个新锐产业股票群体的流动性、整体估值水平和动量,实施新锐产业之行业配置。对新锐产业各公司在所属行业的竞争优势进行细致分析(包括技术变迁路径与核心技术、技术制式与商业模式、市场策略与需求融合、人力资源等诸多方面),结合股票基本面指标分析(包括成长性指标、估值水平),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(2014年4月1日 - 2014年6月30日)
1.本期已实现收益	-9,576,285.19
2.本期利润	-4,752,812.77
3.加权平均基金份额本期利润	-0.0359
4.期末基金资产净值	134,168,540.03
5.期末基金份额净值	1.050

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。

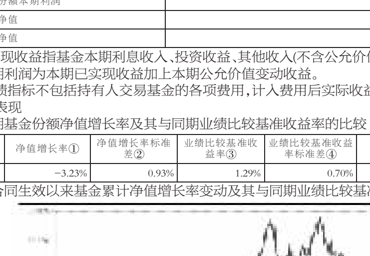
2.所述基金业绩指标不包括持有人交易基金的各项费用,计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

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	-3.23%	0.93%	1.29%	0.70%	-4.52%	0.23%

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		
袁巍先生	本基金基金经理	2013年4月8日	2014年5月29日	5年	经济学硕士,2009年6月加入大成基金管理有限公司,曾任研究部新兴产业行业研究主管。2012年8月7日至2013年3月11日担任大成精选增值混合型证券投资基金和大成新锐产业股票型证券投资基金基金经理助理。2013年4月8日至2014年5月29日任大成新锐产业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
徐雄晖先生	本基金基金经理	2014年5月29日	-	6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。2014年5月29日任大成新锐产业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》、《大成新锐产业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,大成新锐产业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。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

2季度以来,受房地产行业景气下滑的影响,经济面临向下压力。但随着政府稳增长政策的逐步落实,尤其是货币的定向宽松,经济有所企稳

市场层面,经历了4月份市场的惨烈下跌,5月份市场对经济的担忧逐步缓解,市场逐步企稳回升,总体上成长风格强于价值。

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1.050元,本报告期基金份额净值增长率为-3.23%,业绩比较基准收益率为1.29%,低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

短期的刺激虽然缓解了经济下行的压力,但逆周期的操作往往是将问题延后,经济持续性地好转尚需结构性问题的解决。后续我们将密切观察通胀的变化,一旦通胀重新抬头,政策的空间会大为缩小,经济面临的压力会进一步增加。

虽然对于经济和市场的长期我们充满信心,但随着绝大多数行业板块估值的大幅提升,短期中我们倾向于多一份谨慎。任何投资,一旦支付了过高的价格,必然会导致预期收益的下降以及风险的增加。后续一段时间我们将保持平均偏低的仓位,谨慎操作,进一步提高选股的要求,在控制风险的基础上,为持有人获取更好的长期回报。

§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	94,507,092.01	69.77
	其中:股票	94,507,092.01	69.77
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	40,669,106.00	30.03
7	其他资产	270,881.89	0.20
8	合计	135,447,079.90	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	-	0.00
B	采矿业	-	0.00
C	制造业	54,668,851.89	40.75
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	22,439,913.44	16.73
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	7,099,325.08	5.29
J	金融业	-	0.00
K	房地产业	-	0.00
L	租赁和商务服务业	8,661,832.00	6.46
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	1,637,169.60	1.22
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	94,507,092.01	70.44

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	600066	宇通客车	551,671	8,903,969.94	6.64
2	002508	老板电器	296,500	8,382,055.00	6.25
3	000848	承德露露	420,000	8,345,400.00	6.22
4	600859	王府井	457,000	7,220,600.00	5.38
5	300058	蓝色光标	270,800	7,187,032.00	5.36
6	002410	广联达	268,507	7,099,325.08	5.29
7	600729	重庆百货	330,000	6,448,200.00	4.81
8	300146	汤臣倍健	233,773	5,762,504.45	4.29
9	002022	科华生物	170,000	3,918,500.00	2.92
10	300303	聚飞光电	206,790	3,802,868.10	2.83

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

本基金本报告期末未持有权证。

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

本基金本报告期末投资股指期货。

5.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金投资股指期货将以投资组合避险和有效管理为目的,通过套期保值策略,对冲系统性风险,应对组合构建与调整中的流动性风险,力求风险收益的优化。

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 报告期内基金投资的前十名证券的发行主体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。

5.11.2 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备选股票库之外股票。

5.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	250,560.51
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	7,572.85
5	应收申购款	12,748.53
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	270,881.89

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。

5.11.6 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	134,738,548.97
报告期期间基金总申购份额	2,716,528.39
减:报告期期间基金总赎回份额	9,616,359.85
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	127,838,717.51

§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 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新锐产业股票型证券投资基金的文件;
2、《大成新锐产业股票型证券投资基金基金合同》;
3、《大成新锐产业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
2014年7月18日