

信息披露 Disclosure

深证成长40交易型开放式指数证券投资基金

2013] 第四季度报告

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1月22日

§ 1 重要提示

基金管理人的董事会及监事会对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基金合同约定，于2014年1月20日复核了本报告中的财务指标、净值表现、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。

基金管理人提示投资者注意基金的风险，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10月1日起至12月31日止。

§ 2 基金产品概况

基金简称 大成深证成长40ETF

交易代码 159906

基金运作方式 交易型开放式

基金合同生效日 2010年12月21日

报告期末基金份额总额 1,453,639,725.00份

投资目标 紧密跟踪标的指数，追求与标的指数相似的投资回报。

本基金主要采取完全复制法，即完全按照标的指数的成份股组成及其权重进行投资组合，并根据标的指数成份股及其权重的变动进行相应调整。

当期期指成份股发生调整或成份股发生配股、增发、分红等行为时，或因基金的申购和赎回等对本基金跟踪标的指数的效果可能带来影响时，或因某些特殊原因导致流动性不足时，或其他原因导致无法有效复制和跟踪标的指数时，基金管理人可以对投资组合管理进行适当调整和调整，从而使得投资组合紧密地跟踪标的指数。

业绩比较基准 深证成指×40%+银行存款利率(税后)×60%

本基金是指数基金，预期风险与预期收益高于混合基金，债券基金与货币市场基金。本基金为指数基金，主要采用完全复制法跟踪标的指数的表现，具有与标的指数所代表的股票市场相似的风险收益特征。

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:本基金在交易所行情系统中简称为“深成指”。

§ 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10月1日 - 2013年12月31日)

1.本期已实现收益 -4,274,681.89

2.本期利润 -12,602,114.76

3.加权平均基金份额本期利润 -0.0080

4.期末基金份额净值 1,093,055,708.96

5.期末基金份额净值 0.752

注:上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将低于所列相关费用的金额。本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益)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。

3.2 基金净值表现

3.2.1 本基金报告期内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 准收益标准差③ ①-③ ②-④

过去三个月 -1.05% 1.19% -0.89% 1.21% -0.16% -0.02%

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3个月内为建仓期。截至报告期末，本基金各项资产已配置完毕且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 在本基金的基金管理人任职日期 离任日期 说明

苏秉毅先生 本基金基金经理 2012年2月9日 - 9年 经济学硕士。2004年9月至2006年5月就职于华夏基金管理有限公司基金运作部。2006年加入大成基金管理有限公司，历任产品经理设计助理、高级产品经理、基金经理助理、基金经理。2011年3月1日至2012年2月8日担任深证成长40交易型开放式指数证券投资基金基金经理。2012年2月9日起任大成深证成长40交易型开放式指数证券投资基金基金经理。2013年3月1日起任大成深证400交易型开放式指数证券投资基金基金经理。2013年4月21日起任大成深证300交易型开放式指数证券投资基金基金经理。2013年5月1日起任大成深证300交易型开放式指数证券投资基金基金经理。同时担任大成景阳股权投资基金公司董事。苏秉毅先生具有丰富的金融从业经验，具备良好的职业操守和严谨的工作态度，能够胜任基金经理的职责。

4.2 平均从业年限

根据《证券投资基金行业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公平交易制度》明确规定了大成基金管理公司旗下所有投资组合在投资决策、交易执行、业绩评估等环节遵循公平交易原则，确保投资决策在投资研究、分析、投资决策、交易执行、业绩评估等环节得到公平对待，监督监察稽核负责制度落实，监督集中交易和事后公开制度，防范利益输送行为以及进行有损基金投资人利益的关联交易，整体运作合规。大成基金管理公司严格控制投资风险的前提下，努力为基金份额持有人谋取最大利益。

4.3 公平交易执行情况

根据《证券投资基金行业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公平交易制度》明确规定了大成基金管理公司旗下所有投资组合在投资决策、交易执行、业绩评估等环节遵循公平交易原则，确保投资决策在投资研究、分析、投资决策、交易执行、业绩评估等环节得到公平对待，监督监察稽核负责制度落实，监督集中交易和事后公开制度，防范利益输送行为以及进行有损基金投资人利益的关联交易，整体运作合规。大成基金管理公司严格控制投资风险的前提下，努力为基金份额持有人谋取最大利益。

4.4 报告期内基金的利润分配情况

本基金报告期内未进行利润分配。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的展望

根据公司研究报告显示，宏观经济形势存在低位徘徊、还有回升的迹象，实体经济处僵比艰难，传统行业尤甚，但结构性行情依然存在，而且幅度并不大，而且很难在短期内见底。经济基本面将逐步好转，但其力度还有待确认。

4.6 投资组合报告

本基金在交易所行情系统中简称为“深成指”。

4.7 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

8.1 备查文件目录

1.中国证监会批准设立深证成长40交易型开放式指数证券投资基金的文件；

2.基金合同、基金招募说明书、基金托管协议等法律文件；

3.深证成长40交易型开放式指数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.本公司定期报告在指定报刊上披露的各种公告原文。

6.基金代销机构的名单及地址。

7.基金销售机构的名称及地址。

8.其他法律法规及监管机关要求披露的文件。

8.2 备查文件目录

1.基金合同、基金招募说明书、基金托管协议等法律文件；

2.基金代销机构的名单及地址。

3.深证成长40交易型开放式指数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.本公司定期报告在指定报刊上披露的各种公告原文。

6.基金代销机构的名单及地址。

7.基金销售机构的名称及地址。

8.其他法律法规及监管机关要求披露的文件。

8.3 备查文件目录

投资者可在营业时间免费查阅，或登录本公司网站http://www.dcfund.com.cn进行查阅。

大成基金管理有限公司

2014年1月22日

由于经济转型成功尚远，若政府改革决心较大，则货币政策将继续从紧，即使进入新的年度

§ 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 1,077,730,514.14 98.52

其中:股票 1,077,730,514.14 98.52

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 15,384,343.64 1.41

6 其他资产 840,674.10 0.08

7 合计 1,093,559,531.88 100.00

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 15,120,043.20 1.38

B 采矿业 15,427,395.90 1.41

C 制造业 811,713,962.62 74.26

D 电力、热力、燃气及水生产和供应业 - 0.00

E 建筑业 64,400,720.40 5.89

F 批发和零售业 12,481,226.00 1.14

G 交通运输、仓储和邮政业 - 0.00

H 餐饮和住宿业 - 0.00

I 信息传输、软件和信息技术服务业 13,364,522.90 1.22

J 金融业 - 0.00

K 房屋建筑业 24,181,416.77 2.21

L 租赁和商务服务业 49,702,443.28 4.55

M 科学研究、技术服务业 - 0.00

N I 水利、环境和公共设施管理业 71,338,783.07 6.53

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

5.3 报告期末按行业分类的股票投资组合

注:按基金合同规定，本基金不持有股票。

5.4 报告期末按行业分类的债券投资组合

5.5 报告期末按品种分类的债券投资组合

5.6 报告期末按品种分类的资产支持证券投资

5.7 报告期末按品种分类的贵金属投资

5.8 报告期末按品种分类的保险及衍生物投资

5.9 报告期末按品种分类的股指期货投资

5.10 报告期末按品种分类的国债期货投资

5.11 报告期末按品种分类的股票期权投资

5.12 报告期末按品种分类的其他金融工具投资

5.13 报告期末按品种分类的境外投资

5.14 报告期末按品种分类的其他投资

5.15 报告期末按品种分类的其他资产

5.16 报告期末按品种分类的其他负债

5.17 报告期末按品种分类的其他资产

5.18 报告期末按品种分类的其他负债

5.19 报告期末按品种分类的其他资产

5.20 报告期末按品种分类的其他负债

5.21 报告期末按品种分类的其他资产

5.22 报告期末按品种分类的其他负债

5.23 报告期末按品种分类的其他资产

5.24 报告期末按品种分类的其他负债

5.25 报告期末按品种分类的其他资产

5.26 报告期末按品种分类的其他负债

5.27 报告期末按品种分类的其他资产