

## 大成深证成长40交易型开放式指数证券投资基金联接基金

## [2014]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:2014年10月27日

§ 1 重要提示  
基金管理人的董事会及高级管理人员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、完整性、及时性承担个别及连带责任。

基金管理人、基金托管人、代理销售机构和基金合同约定，于2014年10月23日复核了本报告中的财务指标、净值表现、投资组合报告和投资运作情况，基金合同约定的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。

基金定期报告未经审计。

本报告期自2014年7月1日起至2014年9月30日止。

## § 2 基金产品概况

2.1 基金产品情况

基金简称	大成深证成长40ETF联接
交易代码	160901
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2010年10月21日
报告期末基金的份额总额	1,136,031,531.55份

投资目标 通过投资于深证40成份股指数基金，紧密跟踪的指数，追求跟踪误差的最小化。

本基金是成长型基金，其风险收益特征与指数基金相似，具有较高的风险和收益。

本基金主要投资于深证40成份股指数基金，债券基金与货币市场基金。

风险收益特征 风险收益特征与指数基金相似，具有较高的风险和收益。

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

2.1.1 目标基金基本情况

基金名称 深证40交易型开放式指数证券投资基金

基金主代码 159906

基金运作方式 约契约开放式

基金合同生效日 2010年10月21日

报告期末基金的份额总额 1,136,031,531.55份

投资目标 通过投资于深证40成份股指数基金，紧密跟踪的指数，追求跟踪误差的最小化。

本基金是成长型基金，其风险收益特征与指数基金相似，具有较高的风险和收益。

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

2.1.2 目标基金产品说明

投资目标 紧密跟踪的指数，追求跟踪误差的最小化。

投资策略 本基金主要投资于深证40成份股指数基金，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

2.1.3 基金份额净值

基金名称 深证40交易型开放式指数证券投资基金

基金主代码 159906

基金运作方式 约契约开放式(ETF)

基金合同生效日 2010年10月21日

报告期末基金的份额总额 1,136,031,531.55份

投资目标 通过投资于深证40成份股指数基金，紧密跟踪的指数，追求跟踪误差的最小化。

本基金是成长型基金，其风险收益特征与指数基金相似，具有较高的风险和收益。

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

2.1.4 主要财务指标

单位:人民币元

报告期(2014年7月1日 - 2014年9月30日)

报告期初基金的份额总额 6,161,932,791.49份

报告期末基金的份额总额 6,161,932,791.49份

报告期基金净值增长 0.00%

报告期净值收益率 0.00%

报告期净值收益率的标准差 0.00%

报告期期间基金的交易费用 0.00%

报告期期间利息收入 0.00%

报告期期间管理人报酬 0.00%

报告期期间托管人报酬 0.00%

报告期期间申购赎回费 0.00%

报告期期间其他费用 0.00%

报告期期间交易费用 0.00%

报告期期间利息收入 0.00%

报告期期间管理人报酬 0.00%

报告期期间托管人报酬 0.00%

报告期期间申购赎回费 0.00%

报告期期间其他费用 0.00%

报告期期间交易费用 0.00%

报告期期间利息收入 0.00%

报告期期间管理人报酬 0.00%

报告期期间托管人报酬 0.00%

报告期期间申购赎回费 0.00%

报告期期间其他费用 0.00%

报告期期间交易费用 0.00%

报告期期间利息收入 0.00%

报告期期间管理人报酬 0.00%

报告期期间托管人报酬 0.00%

报告期期间申购赎回费 0.00%

报告期期间其他费用 0.00%

报告期期间交易费用 0.00%

报告期期间利息收入 0.00%

报告期期间管理人报酬 0.00%

报告期期间托管人报酬 0.00%

报告期期间申购赎回费 0.00%

报告期期间其他费用 0.00%

报告期期间交易费用 0.00%

报告期期间利息收入 0.00%

报告期期间管理人报酬 0.00%

报告期期间托管人报酬 0.00%

报告期期间申购赎回费 0.00%

报告期期间其他费用 0.00%

报告期期间交易费用 0.00%

报告期期间利息收入 0.00%

报告期期间管理人报酬 0.00%

报告期期间托管人报酬 0.00%

报告期期间申购赎回费 0.00%

报告期期间其他费用 0.00%

报告期期间交易费用 0.00%

报告期期间利息收入 0.00%

报告期期间管理人报酬 0.00%

报告期期间托管人报酬 0.00%

报告期期间申购赎回费 0.00%

报告期期间其他费用 0.00%

报告期期间交易费用 0.00%

报告期期间利息收入 0.00%

报告期期间管理人报酬 0.00%

报告期期间托管人报酬 0.00%

报告期期间申购赎回费 0.00%

报告期期间其他费用 0.00%

报告期期间交易费用 0.00%

报告期期间利息收入 0.00%

报告期期间管理人报酬 0.00%

报告期期间托管人报酬 0.00%

报告期期间申购赎回费 0.00%

报告期期间其他费用 0.00%

报告期期间交易费用 0.00%

报告期期间利息收入 0.00%

报告期期间管理人报酬 0.00%

报告期期间托管人报酬 0.00%

报告期期间申购赎回费 0.00%

报告期期间其他费用 0.00%

报告期期间交易费用 0.00%

报告期期间利息收入 0.00%

报告期期间管理人报酬 0.00%

报告期期间托管人报酬 0.00%

报告期期间申购赎回费 0.00%

报告期期间其他费用 0.00%

报告期期间交易费用 0.00%

报告期期间利息收入 0.00%

报告期期间管理人报酬 0.00%

报告期期间托管人报酬 0.00%

报告期期间申购赎回费 0.00%

报告期期间其他费用 0.00%

报告期期间交易费用 0.00%

报告期期间利息收入 0.00%

报告期期间管理人报酬 0.00%

报告期期间托管人报酬 0.00%

报告期期间申购赎回费 0.00%

报告期期间其他费用 0.00%

报告期期间交易费用 0.00%

报告期期间利息收入 0.00%

报告期期间管理人报酬 0.00%

报告期期间托管人报酬 0.00%

报告期期间申购赎回费 0.00%

报告期期间其他费用 0.00%

报告期期间交易费用 0.00%

报告期期间利息收入 0.00%

报告期期间管理人报酬 0.00%

报告期期间托管人报酬 0.00%

报告期期间申购赎回费 0.00%

报告期期间其他费用 0.00%

报告期期间交易费用 0.00%

报告期期间利息收入 0.00%

报告期期间管理人报酬 0.00%

报告期期间托管人报酬 0.00%

报告期期间申购赎回费 0.00%

报告期期间其他费用 0.00%

报告期期间交易费用 0.00%

报告期期间利息收入 0.00%

报告期期间管理人报酬 0.00%

报告期期间托管人报酬 0.00%

报告期期间申购赎回费 0.00%

报告期期间其他费用 0.00%

报告期期间交易费用 0.00%

报告期期间利息收入 0.00%

报告期期间管理人报酬 0.00%

报告期期间托管人报酬 0.00%

报告期期间申购赎回费 0.00%

报告期期间其他费用 0.00%

报告期期间交易费用 0.00%

报告期期间利息收入 0.00%

报告期期间管理人报酬 0.00%

报告期期间托管人报酬 0.00%

报告期期间申购赎回费 0.00%

报告期期间其他费用 0.00%

报告期期间交易费用 0.00%

报告期期间利息收入 0.00%

报告期期间管理人报酬 0.00%

报告期期间托管人报酬 0.00%

报告期期间申购赎回费 0.00%

报告期期间其他费用 0.00%

报告期期间交易费用 0.00%

报告期