大成创新成长混合型证券投资基金（LOF）

【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10月23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7月1日起至9月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	大成创新成长混合
交易代码	160910
基金运作方式	上市契约型开放式（LOF）
基金合同生效日	2007年6月12日
报告期末基金份额总额	8,407,327,672.47份
投资目标	在控制风险和保证流动性的前提下，超越业绩比较基准，寻求基金资产的长期稳健增值。
投资策略	本基金以股票投资为主，采用积极的投资策略，精选具备持续增长能力，价格处于合理区间的优质股票构建投资组合；本基金以固定收益品种投资为辅，确保投资组合具有良好的流动性。
业绩比较基准	沪深300指数×70%+中国债券总指数×30%
风险收益特征	本基金为混合型基金，风险收益水平高于货币市场基金和债券型基金，属于中高风险的证券投资基金品种。
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

注：本基金在交易所行情系统净值揭示等其他信息披露场合下，可简称为“大成创新”。

§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7月1日 - 2014年9月30日）
1.本期已实现收益	38,359,874.16
2.本期利润	648,613,315.73
3.加权平均基金份额本期利润	0.0738
4.期末基金资产净值	6,464,445,366.17
5.期末基金份额净值	0.769

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。

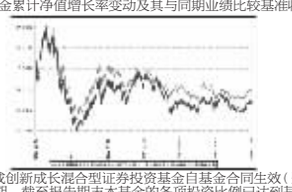
2、所述基金业绩指标不包括持有人交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

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	10.65%	0.78%	9.66%	0.63%	0.99%	0.15%

3.2.2 自基金转型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，大成创新成长混合型证券投资基金自基金合同生效（暨基金转型）之日2007年6月12日起3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		
杨建勋先生	本基金基金经理	2011年4月22日	-	13年	北京大学经济学院经济学硕士。曾任职于沈阳会计师事务所、鹏华基金管理有限公司、工银瑞信基金管理有限公司。2004年8月12日至2006年9月27日，担任曾润基金基金经理；2005年2月26日至2006年11月23日，担任鹏华行业成长证券投资基金基金经理。2007年3月19日至11月12日，担任工银瑞信精选平衡混合型基金基金经理；2007年3月19日至2009年5月17日，担任工银瑞信稳健成长股票型基金基金经理；2007年7月18日至2010年5月20日，担任工银瑞信红利股票型基金基金经理。2010年6月加入大成基金管理有限公司。2010年11月26日至2012年9月5日，担任大成行业轮动股票型证券投资基金基金经理。2011年4月22日开始兼任大成创新成长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》、《大成创新成长混合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，大成创新成长混合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年三季度公司旗下主动投资组合间股票交易存在4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2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年三季度，沪深300上涨为13.2%，创业板指数上涨为9.69%，中证500指数上涨为25.3%，股票市场表现活跃，小市值股票继续担当市场领头羊，并购市场火爆，投资者热情爆棚。宏观经济和政策来看，由于房地产销售起色不大，宏观经济各项指标表现一般，政府继续坚持“微刺激”的政策措施，由于市场热情集中在并购重组和主题投资，对经济的担忧情绪在资本市场反应不大。

本季度基金组合资产配置维持稳定，组合减持了银行、地产，增持了家电、汽车、医药、传媒行业股票，组合在基金契约范围内采用平衡基础上的个股优选策略。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末，本基金份额净值为0.769元，本报告期份额净值增长率为10.65%，同期业绩比较基准收益率为9.66%，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2014年四季度，预计政府保增长和促改革的措施会持续出台。从中央政府目前出台的各项改革措施和执行力来观察，我们对中国经济的中长期前景信心有进一步增强，预计资本市场将受益于投资者对长期发展前景信心的恢复。我们将持续关注具备明显竞争优势和竞争能力持续提升的企业，其中重点关注国企改革给企业竞争力和盈利能力带来的提升。

组合投资上，我们将维持积极的资产配置，提高组合换手率，持续根据公司经营情况和风险收益比来优化组合个股，力争为基金持有人获取较高回报。

§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	5,767,134,260.47	88.74
	其中：股票	5,767,134,260.47	88.74
2	固定收益投资	299,537,172.80	4.61
	其中：债券	299,537,172.80	4.61
	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	417,921,192.01	6.43
7	其他资产	14,249,711.18	0.22
8	合计	6,498,842,336.46	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	2,752,344,151.93	42.58
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	0.00
E	建筑业	655,039,487.20	10.13
F	批发和零售业	-	0.00
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	181,547,788.09	2.81
J	金融业	1,365,823,498.39	21.13
K	房地产业	612,479,644.88	9.47
L	租赁和商务服务业	-	0.00
M	科学研究和技术服务业	23,920,390.48	0.37
N	水利、环境和公共设施管理业	175,979,299.50	2.72
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	5,767,134,260.47	89.21

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	601166	兴业银行	43,873,828	448,390,522.16	6.94
2	000651	格力电器	15,966,258	442,744,334.34	6.85
3	000002	万 科A	48,117,698	441,720,467.64	6.83
4	600036	招商银行	32,041,622	332,912,452.58	5.15
5	000625	长安汽车	23,217,475	318,079,407.50	4.92
6	600887	伊利股份	9,364,659	242,544,668.10	3.75
7	000848	承德露露	9,240,797	203,112,718.06	3.14
8	601555	东吴证券	18,542,481	190,987,554.30	2.95
9	000503	海虹控股	8,434,726	181,515,303.52	2.81
10	300070	碧水源	5,815,575	175,979,299.50	2.72

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	公允价值（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	160,144,000.00	2.48
	其中：政策性金融债	160,144,000.00	2.48
4	企业债券	-	0.00
5	企业短期融资券	-	0.00
6	中期票据	-	0.00
7	可转债	139,393,172.80	2.16
8	其他	-	0.00
9	合计	299,537,172.80	4.63

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

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	110023	民生转债	1,489,880	139,393,172.80	2.16
2	140410	14农发10	600,000	60,096,000.00	0.93
3	140213	14国开13	500,000	49,930,000.00	0.77
4	140204	14国开04	300,000	30,072,000.00	0.47
5	140207	14国开07	200,000	20,046,000.00	0.31

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

本基金本报告期末投资股指期货。

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

本基金本报告期末持有国债期货。

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

本基金本报告期末持有国债期货。

5.11 投资组合报告附注

5.11.1 本基金投资的前十名证券的发行主体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：

根据中国证监会批准设立大成核心双动力股票型证券投资基金的文件；

2、《大成核心双动力股票型证券投资基金基金合同》；

3、《大成核心双动力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10月27日

大成核心双动力股票型证券投资基金

【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：中国工商银行股份有限公司
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。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2014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2014年7月1日起至9月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	大成核心双动力股票
交易代码	090011
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2010年6月22日
报告期末基金份额总额	110,270,960.29份
投资目标	以稳健的投资策略为主，采用合理的方法适当提升风险收益水平，力争获取超越业绩比较基准的中长期投资收益
投资策略	本基金采用自上而下的方式实施大类资产间的战略配置，并采用“核心-双卫星”策略管理股票资产。
业绩比较基准	75%×沪深300指数+25%×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	中国工商银行股份有限公司

§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7月1日 - 2014年9月30日）
1.本期已实现收益	10,434,765.68
2.本期利润	10,526,787.89
3.加权平均基金份额本期利润	0.0893
4.期末基金资产净值	100,489,195.69
5.期末基金份额净值	0.911

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。

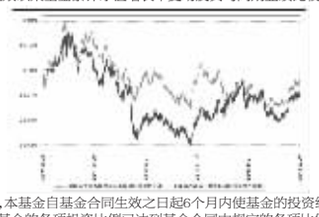
2、所述基金业绩指标不包括持有人交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

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	10.69%	0.81%	10.21%	0.67%	0.48%	0.14%

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		
宋向宇先生	本基金基金经理	2014年1月8日	2014年8月22日	6年	经济学硕士，2008年7月加入大成基金管理有限公司，曾任研究部中游制造行业研究主管。2012年8月7日至2013年3月11日担任大成蓝筹稳健证券投资基金基金经理助理。2013年4月8日至2014年8月22日任大成财富管理2020生命周期证券投资基金基金经理。2014年1月8日至2014年8月22日任大成核心双动力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
石国武先生	本基金基金经理	2014年8月23日	-	11年	工学硕士，2002年12月至2012年11月就职于博时基金管理有限公司，历任系统分析员、股票投资部投资经理助理、特定资产部投资经理。2012年11月加入大成基金管理有限公司。2013年4月18日起担任大成价值增长证券投资基金基金经理。2014年8月23日起任大成核心双动力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》、《大成核心双动力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，大成核心双动力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年三季度公司旗下主动投资组合间股票交易存在4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2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年三季度，沪深300上涨为13.2%，创业板指数上涨为9.69%，中证500指数上涨为25.3%，股票市场表现活跃，小市值股票继续担当市场领头羊，并购市场火爆，投资者热情爆棚。宏观经济和政策来看，由于房地产销售起色不大，宏观经济各项指标表现一般，政府继续坚持“微刺激”的政策措施，由于市场热情集中在并购重组和主题投资，对经济的担忧情绪在资本市场反应不大。

本季度基金组合资产配置维持稳定，组合减持了银行、地产，增持了家电、汽车、医药、传媒行业股票，组合在基金契约范围内采用平衡基础上的个股优选策略。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末，本基金份额净值为0.911元，本报告期份额净值增长率为10.69%，同期业绩比较基准增长率为10.21%，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2014年四季度，预计政府保增长和促改革的措施会持续出台。从中央政府目前出台的各项改革措施和执行力来观察，我们对中国经济的中长期前景信心有进一步增强，预计资本市场将受益于投资者对长期发展前景信心的恢复。我们将持续关注具备明显竞争优势和竞争能力持续提升的企业，其中重点关注国企改革给企业竞争力和盈利能力带来的提升。

组合投资上，我们将维持积极的资产配置，提高组合换手率，持续根据公司经营情况和风险收益比来优化组合个股，力争为基金持有人获取较高回报。

§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	87,973,065.58	86.82
	其中：股票	87,973,065.58	86.82
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	10,732,787.61	10.59
7	其他资产	2,619,824.97	2.59
8	合计	101,325,678.16	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	49,848,754.68	49.61
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	4,680.00	0.00
E	建筑业	7,174,164.27	7.14
F	批发和零售业	1,112,000.00	1.11
G	交通运输、仓储和邮政业	1,952,000.00	1.94
H	住宿和餐饮业	-	0.00
I	信息传输、软件和信息技术服务业	4,089,327.39	4.07
J	金融业	21,278,466.06	21.17
K	房地产业	-	0.00
L	租赁和商务服务业	2,513,673.18	2.50
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	-	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	87,973,065.58	87.54

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	000651	格力电器	259,986	7,209,411.78	7.17
2	002051	中工国际	369,993	7,174,164.27	7.14
3	300351	永贵电器	194,710	6,955,041.20	6.92
4	601318	中国平安	149,959	6,199,305.06	6.17
5	601601	中国太保	300,000	5,823,000.00	5.79
6	300088	长信科技	279,966	5,092,581.54	5.07
7	600000	浦发银行	502,500	4,899,375.00	4.88
8	002555	顺荣股份	100,000	4,650,000.00	4.63
9	601166	兴业银行	426,300	4,356,786.00	4.34
10	000625	长安汽车	300,000	4,110,000.00	4.09

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。

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

本基金本报告期末投资股指期货。

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

本基金本报告期末持有国债期货。

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

本基金本报告期末持有国债期货。

5.11 投资组合报告附注

5.11.1 本基金投资的前十名证券的发行主体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：

根据中国平安股票发行主体中国平安保险（集团）股份有限公司于2013年5月21日和2013年10月14日发布的公告，该上市公司的控股子公司平安证券有限责任公司（以下简称“平安证券”）收到中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）《行政处罚和市场禁入事先告知书》。中国证监会决定对平安证券给予警告并没收其在万福生科（湖南）农业开发股份有限公司（以下简称“万福生科”）发行上市项目中的业务收入人民币 2,555 万元，并处以人民币 5,110 万元的罚款，暂停其保荐机构资格 3 个月。

在上述公告公布后，本基金管理人对该上市公司进行了进一步了解和分析，认为上述处罚不会对中国平安的投资价值构成实质性负面影响，因此本基金管理人对其投资判断未发生改变。

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	165,284.17
2	应收证券清算款	2,443,988.73
3	应收股利	-
4	应收利息	2,879.97
5	应收申购款	7,672.10
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	2,619,824.97

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	123,672,675.95
报告期期间基金总申购份额	1,259,682.76
减：报告期期间基金总赎回份额	14,661,398.42
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	110,270,960.29

§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

基金管理人本报告期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核心双动力股票型证券投资基金的文件；

2、《大成核心双动力股票型证券投资基金基金合同》；

3、《大成核心双动力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10月27日

大成沪深300指数证券投资基金

【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10月23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7月1日起至9月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	大成沪深300指数
交易代码	519300
前端交易代码	519300
后端交易代码	519301
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2006年4月6日
报告期末基金份额总额	5,192,616,370.39份
投资目标	通过严格的投资程序约束和数量化风险管理手段，实现指数投资偏离度和跟踪误差的最小化。在正常市场情况下，本基金日均跟踪偏离度的绝对值不超过0.35%，年跟踪误差不超过4%。
投资策略	本基金采用被动式指数投资策略。原则上，股票投资组合的构建主要按照标的指数的成份股组成及其权重来拟合、复制标的指数，并原则上根据标的指数成份股及其权重的变动而进行相应调整。
业绩比较基准	沪深300指数
风险收益特征	本基金为指数基金，是风险中等、获得证券市场平均收益率的产品。
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7月1日 - 2014年9月30日）
1.本期已实现收益	-7,203,388.98
2.本期利润	553,430,831.82
3.加权平均基金份额本期利润	0.0953
4.期末基金资产净值	4,103,211,793.08
5.期末基金份额净值	0.7902

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。

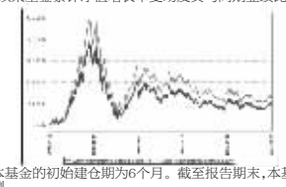
2、所述基金业绩指标不包括持有人交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

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	13.45%	0.82%	13.20%	0.89%	0.25%	-0.07%

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，本基金的初始建仓期为6个月。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		
苏荣毅先生	本基金基金经理	2013年1月1日	-	10年	经济学硕士。2004年9月至2008年5月就职于华夏基金管理有限公司基金运作部。2008年加入大成基金管理有限公司，历任产品设计师、高级产品设计师、基金经理助理、基金经理。2011年3月3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及大成深证成长40交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理助理。2012年8月28日至2014年1月23日担任大成中证500沪市交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理。2014年1月24日至2014年2月17日任大成健康产业股票型证券投资基金基金经理。2012年2月9日至2014年9月11日任深证成长40交易型开放式指数证券投资基金及大成深证成长40交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理。2012年8月24日起任中证500沪市交易型开放式指数证券投资基金基金经理。2013年1月1日开始兼任大成沪深300指数证券投资基金基金经理。2013年2月7日起任大成中证100交易型开放式指数证券投资基金基金经理。现同时担任大成基金管理有限公司数量投资部总监助理。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