

大成核心双动力股票型证券投资基金
2014 年半年度报告
2014 年 6 月 30 日

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

送出日期：2014 年 8 月 28 日

§ 1 重要提示及目录

1.1 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。本半年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

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 8 月 20 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及其更新。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2014 年 01 月 01 日起至 06 月 30 日止。

1.2 目录

§ 1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示.....	2
1.2 目录.....	3
§ 2 基金简介	5
2.1 基金基本情况.....	5
2.2 基金产品说明.....	5
2.3 基金管理人和基金托管人.....	5
2.4 信息披露方式.....	5
2.5 其他相关资料.....	6
§ 3 主要财务指标和基金净值表现	6
3.1 主要会计数据和财务指标.....	6
3.2 基金净值表现.....	6
§ 4 管理人报告	7
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	7
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	9
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	9
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明.....	10
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	11
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	11
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	12
§ 5 托管人报告	12
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	12
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明.....	12
5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见.....	12
§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）	12
6.1 资产负债表.....	12
6.2 利润表.....	13
6.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	14
6.4 报表附注.....	16
§ 7 投资组合报告	28
7.1 期末基金资产组合情况.....	28
7.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	28
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细.....	29
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	30
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	35
7.6 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.....	35
7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细.....	35
7.8 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贵金属投资明细.....	35
7.9 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.....	35
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....	35
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	35
7.12 投资组合报告附注.....	36
§ 8 基金份额持有人信息	37

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	37
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	37
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况.....	37
§ 9 开放式基金份额变动.....	37
§ 10 重大事件揭示.....	37
10.1 基金份额持有人大会决议.....	37
10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动.....	37
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	38
10.4 基金投资策略的改变.....	38
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	38
10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况.....	38
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	38
10.8 其他重大事件.....	39
§ 11 影响投资者决策的其他重要信息.....	40
§ 12 备查文件目录.....	40
12.1 备查文件目录.....	40
12.2 存放地点.....	40
12.3 查阅方式.....	40

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	大成核心双动力股票型证券投资基金
基金简称	大成核心双动力股票
基金主代码	090011
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
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
报告期末基金份额总额	123,672,675.95 份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

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。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		大成基金管理有限公司	中国工商银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	杜鹏	赵会军
	联系电话	0755-83183388	010-66105799
	电子邮箱	dupeng@dcfund.com.cn	custody@icbc.com.cn
客户服务电话		4008885558	95588
传真		0755-83199588	010-66105798
注册地址		深圳市福田区深南大道 7088 号招商银行大厦 32 层	北京市西城区复兴门内大街 55 号
办公地址		深圳市福田区深南大道 7088 号招商银行大厦 32 层	北京市西城区复兴门内大街 55 号
邮政编码		518040	100140
法定代表人		张树忠	姜建清

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《证券时报》、《上海证券报》、《中国证券报》
登载基金半年度报告正文的管理人互联网网址	http://www.dcfund.com.cn

基金半年度报告备置地点	深圳市福田区深南大道 7088 号招商银行大厦 32 层 大成基金管理有限公司 北京市西城区复兴门内大街 55 号中国工商银行托管业务部
-------------	--

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	大成基金管理有限公司	深圳市福田区深南大道 7088 号招商银行大厦 32 层

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2014 年 1 月 1 日 - 2014 年 6 月 30 日)
本期已实现收益	-7,315,808.58
本期利润	-11,616,940.96
加权平均基金份额本期利润	-0.0786
本期加权平均净值利润率	-9.34%
本期基金份额净值增长率	-8.25%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2014 年 6 月 30 日)
期末可供分配利润	-29,070,119.41
期末可供分配基金份额利润	-0.2351
期末基金资产净值	101,800,755.91
期末基金份额净值	0.823
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2014 年 6 月 30 日)
基金份额累计净值增长率	-17.70%

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、期末可供分配利润，采用期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数(为期末余额，不是当期发生数)。

3、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。

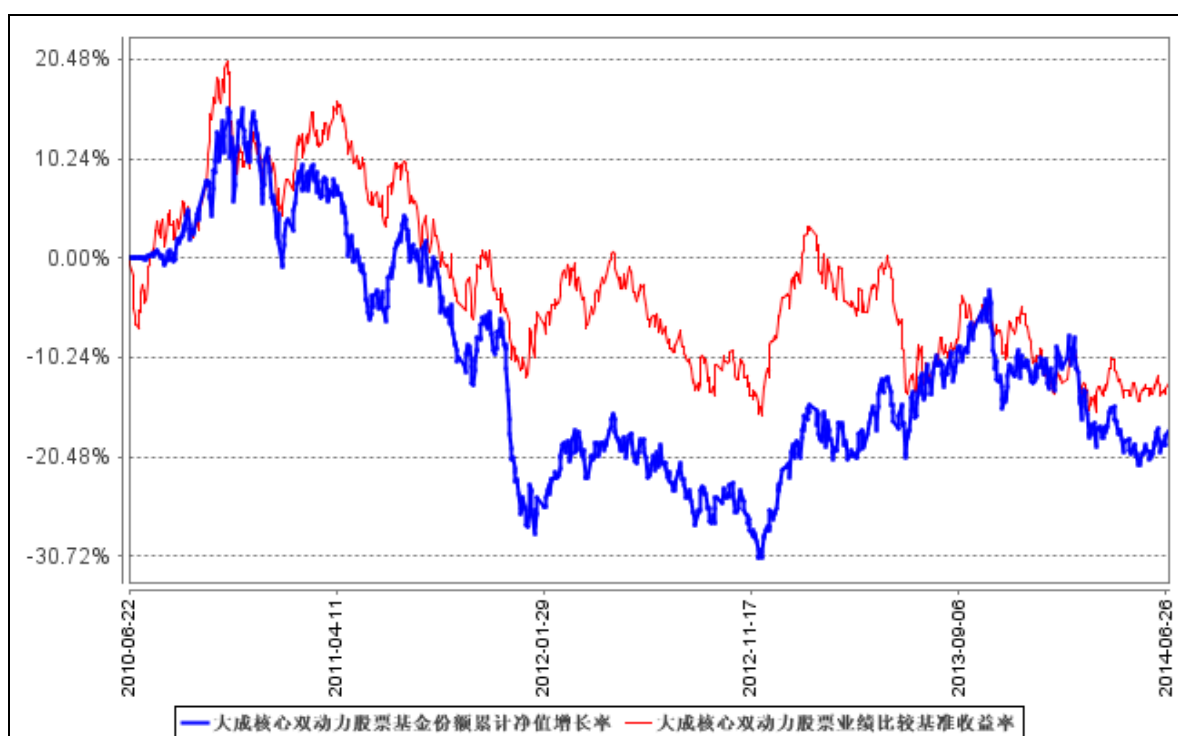
3.2 基金净值表现

3.2.1 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	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差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
----	----------	-------------	------------	---------------	-----	-----

过去一个月	2.36%	0.84%	0.50%	0.58%	1.86%	0.26%
过去三个月	0.98%	0.80%	1.39%	0.65%	-0.41%	0.15%
过去六个月	-8.25%	1.07%	-3.98%	0.78%	-4.27%	0.29%
过去一年	0.00%	1.10%	-0.24%	0.88%	0.24%	0.22%
过去三年	-16.95%	1.14%	-19.18%	0.97%	2.23%	0.17%
自基金合同生效起至今	-17.70%	1.14%	-12.90%	1.00%	-4.80%	0.14%

3.2.2 自基金合同生效以来基金份额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，截至报告日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 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

大成基金管理有限公司经中国证监会证监基金字[1999]10号文批准，于1999年4月12日正式成立，是中国证监会批准成立的首批十家基金管理公司之一，注册资本为2亿元人民币，注册地为深圳。目前公司由四家股东组成，分别为中泰信托有限责任公司(48%)、光大证券股份有限公司(25%)、中国银河投资管理有限公司(25%)、广东证券股份有限公司(2%)。截至2014年6月30

日，本基金管理人共管理 1 只封闭式证券投资基金：景福证券投资基金，4 只 ETF 及 1 只 ETF 联接基金：深证成长 40 交易型开放式指数证券投资基金、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、大成中证 500 沪市交易型开放式指数证券投资基金、大成中证 100 交易型开放式指数证券投资基金、大成中证 500 深市交易型开放式指数证券投资基金，1 只 QDII 基金：大成标普 500 等权重指数证券投资基金及 37 只开放式证券投资基金：大成景丰债券型证券投资基金（LOF）、大成价值增长证券投资基金、大成债券投资基金、大成蓝筹稳健证券投资基金、大成精选增值混合型证券投资基金、大成货币市场证券投资基金、大成沪深 300 指数证券投资基金、大成财富管理 2020 生命周期证券投资基金、大成积极成长股票型证券投资基金、大成创新成长混合型证券投资基金（LOF）、大成景阳领先股票型证券投资基金、大成强化收益债券型证券投资基金、大成策略回报股票型证券投资基金、大成行业轮动股票型证券投资基金、大成中证红利指数证券投资基金、大成核心双动力股票型证券投资基金、大成竞争优势股票型证券投资基金、大成内需增长股票型证券投资基金、大成消费主题股票型证券投资基金、大成可转债增强债券型证券投资基金、大成新锐产业股票型证券投资基金、大成景恒保本混合型证券投资基金、大成优选股票型证券投资基金（LOF）、大成现金增利货币市场基金、大成月添利理财债券型证券投资基金、大成理财 21 天债券型发起式基金、大成现金宝场内实时申赎货币市场基金、大成景安短融债券型证券投资基金、大成景兴信用债债券型证券投资基金、大成景旭纯债债券型证券投资基金、大成景祥分级债券型证券投资基金、大成中小盘股票型证券投资基金（LOF）、大成健康产业股票型证券投资基金、大成信用增利一年定期开放债券型证券投资基金、大成灵活配置混合型证券投资基金、大成招财宝货币市场基金、大成景益平稳收益混合型证券投资基金。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
孙蓓琳女士	本基金基金经理	2012 年 7 月 28 日	2014 年 1 月 29 日	10 年	经济学硕士。2004 年 7 月至 2007 年 7 月就职于银华基金管理有限公司，历任宏观研究员、行业研究员。2007 年 7 月加入大成基金管理有限公司，历任行业研究员、基金经理助理、研究部总监助理、研究部副总监。2012 年 7 月 28 日至 2014 年 1 月 29 日任大成核心双动力股票型证券投资基金基金经理。2012 年 12 月 18 日起任大成积极成长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
宋向宇先生	本基金基金经理	2014 年 1 月 8 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 日起担任大成财富管理 2020 生命周期证券投资基金基金经理。2014 年 1 月 8 日起兼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。

3、宋向宇先生已于 2014 年 8 月 22 日离任本基金基金经理，本基金自 2014 年 8 月 23 日起增聘石国武先生为本基金基金经理，上述事项已按规定在中国证券业协会办理变更手续，报中国证券监督管理委员会深圳监管局备案，并按规定进行公开披露。

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

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 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

报告期内，基金管理人严格执行了公平交易的原则和制度。基金管理人旗下所有投资组合间连续 4 个季度的日内、3 日内及 5 日内股票及债券交易同向交易价差分析及相应交易情形的分析结果表明：债券交易同向交易频率较低；股票同向交易溢价率较大主要来源于市场因素（如个股当日价格振幅较高）及组合经理交易时机选择，即投资组合成交时间不一致以及成交价格的日内较大变动导致个别组合间的成交价格差异较大。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。

4.3.2 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 年上半年公司旗下主动投资组合间股票交易存在 11 笔同日反向交易，原因是投资组合投资策略需要。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% 的仅有 3 笔，原因为投资策略需要；投资组合间存在 1 笔债券同日反向交易，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 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2014 年年初开始，国内的流动性没有出现往年的季节性宽松。加上 PPI、PMI、工业增加值等主要宏观经济指标的疲软，显示了实体经济依然处于缓慢下行的态势。在这种存量资金博弈，以及对宏观经济整体的不良预期下，市场出现了进一步的大小盘股分化，大市值的股票不断的下跌，小市值的有亮点的个股快速上涨。到 3 月份之后，由于陆续有公司披露了年报和 1 季报的预览，部分预期过高的公司出现了低预期的情况。伴随着以创业板指数为代表的新兴产业板块出现大幅度的回调，资金的偏好出现了变化。地产、银行、水泥等传统行业出现明显的超额收益

2 季度美国和欧洲的主要经济体继续非常宽松的货币政策，但同时几个发达经济体的宏观数据没有如预期回升，因此宽松的流动性还会持续。在这种持续宽松的预期下，发达国家的资产价格和大部分新兴国家的资产价格都大幅上升，甚至部分商品价格也大幅度回升。

国内的宏观情况与海外类似，经济数据下滑，5 月份开始流动性放松的政策也逐步开始兑现。股市在经过 4 月的下跌之后，5-6 月份开始了明显的上涨。由于股市的赚钱效应不足，新增资金并没有流入，市场的机构继续存量资金腾挪的结构性行情。以创业板指数为代表的小市值股票快速反弹，部分创出新高，而以沪深 300 指数为代表的大市值蓝筹股上涨幅度很小。

本基金管理人根据基金契约的限制，年初布局了以消费为主要配置的基金组合，在 1-2 月份的小市值股票行情中没有获得超额收益。到 3 月份，增持了以地产为代表的传统经济产业链，获得了较为显著的超额收益。在 4 月份的下跌中回调的幅度较小，但是在随后的两个月的结构性行情中涨幅落后。

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 0.823 元，本报告期份额净值增长率为-8.25%，同期业绩比较基准增长率为-3.98%，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

展望 3 季度，在持续的宽松政策带动下，经济数据将会迎来小幅度的反弹，但是也不宜报以过高的期望。由于缺少增量资金，大市值的蓝筹股很难迎来像样幅度的上涨。与此同时，经过 5-6 月份的大幅上涨之后，在中报的检验关口，存量资金也很难进一步推动缺少基本面支持的小市值股票继续脱离权重指数走向新高。

本基金管理人在下一阶段将会精选沪深 300 成分股，构造核心组合，保持组合的波动性不会过大。同时以自下而上的方法选择业绩持续增长，估值合理的小市值个股作为进攻品种。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本基金管理人指导基金估值业务的领导小组为公司估值委员会，公司估值委员会主要负责估值政策和估值程序的制定、修订以及执行情况的监督。估值委员会由股票投资部、研究部、固定收益部、风险管理部、基金运营部、监察稽核部、委托投资部指定人员组成。公司估值委员会的相关成员均具备相应的专业胜任能力和相关工作经历，估值委员会成员中包括两名投资组合经理。

股票投资部、研究部、固定收益部、风险管理部和委托投资部负责关注相关投资品种的动态，评判基金持有的投资品种是否处于不活跃的交易状态或者最近交易日后经济环境发生了重大变化或证券发行机构发生了影响证券价格的重大事件，从而确定估值日需要进行估值测算或者调整的投资品种；提出合理的数量分析模型对需要进行估值测算或者调整的投资品种进行公允价值定价与计量；定期对估值政策和程序进行评价，以保证其持续适用；基金运营部负责日常的基金资产的估值业务，执行基金估值政策，并负责与托管行沟通估值调整事项；监察稽核部负责审核估值政策和程序的一致性，监督估值委员会工作流程中的风险控制，并负责估值调整事项的信息披露工作。

本基金的日常估值程序由基金运营部基金估值核算员执行，并与托管银行的估值结果核对一致。基金估值政策的议定和修改采用集体讨论机制，基金经理及投资经理作为估值小组成员，对本基金持仓证券的交易情况、信息披露情况保持应有的职业敏感，向估值委员会提供估值参考信息，参与估值政策讨论。对需采用特别估值程序的证券，基金管理人及时启动特别估值程序，由估值委员会讨论议定特别估值方案并与托管行沟通后由基金运营部具体执行。

本基金管理人参与估值流程各方之间不存在任何重大利益冲突，截止报告期末未与外部估值定价服务机构签约。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金管理人严格按照本基金基金合同的规定进行收益分配。本报告期内本基金无收益分配事项。

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内，本基金托管人在对大成核心双动力股票型证券投资基金的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他法律法规和基金合同的有关规定，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

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

本报告期内，大成核心双动力股票型证券投资基金的管理人——大成基金管理有限公司在大成核心双动力股票型证券投资基金的投资运作、基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格计算、基金费用开支等问题上，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。本报告期内，大成核心双动力股票型证券投资基金未进行利润分配。

5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人依法对大成基金管理有限公司编制和披露的大成核心双动力股票型证券投资基金 2014 年半年度报告中财务指标、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进行了核查，以上内容真实、准确和完整。

§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：大成核心双动力股票型证券投资基金

报告截止日：2014 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2014 年 6 月 30 日	上年度末 2013 年 12 月 31 日
资产：			
银行存款	6.4.3.1	9,792,074.97	27,240,463.50
结算备付金		609,192.21	338,093.79
存出保证金		228,911.09	87,389.53
交易性金融资产	6.4.3.2	89,874,192.56	120,705,242.91
其中：股票投资		89,874,192.56	120,705,242.91

基金投资		-	-
债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	6.4.3.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.3.4	-	-
应收证券清算款		2,038,250.57	1,624,573.91
应收利息	6.4.3.5	2,205.55	5,954.46
应收股利		-	-
应收申购款		4,763.81	29,154.79
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.3.6	-	-
资产总计		102,549,590.76	150,030,872.89
负债和所有者权益	附注号	本期末 2014年6月30日	上年度末 2013年12月31日
负 债:			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.3.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		-	-
应付赎回款		48,786.82	51,105.21
应付管理人报酬		124,700.84	191,315.96
应付托管费		20,783.46	31,885.99
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.3.7	385,872.71	167,747.91
应交税费		-	-
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.3.8	168,691.02	40,015.53
负债合计		748,834.85	482,070.60
所有者权益:			
实收基金	6.4.3.9	123,672,675.95	166,802,657.87
未分配利润	6.4.3.10	-21,871,920.04	-17,253,855.58
所有者权益合计		101,800,755.91	149,548,802.29
负债和所有者权益总计		102,549,590.76	150,030,872.89

注：报告截止日 2014 年 6 月 30 日，基金份额净值人民币 0.823 元，基金份额总额 123,672,675.95 份。

6.2 利润表

会计主体：大成核心双动力股票型证券投资基金

本报告期：2014 年 1 月 1 日至 2014 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2014 年 1 月 1 日至 2014 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2013 年 1 月 1 日至 2013 年 6 月 30 日
一、收入		-8,356,462.32	11,247,854.75
1. 利息收入		82,595.75	146,223.93
其中：存款利息收入	6.4.3.11	82,595.75	123,368.39
债券利息收入		-	1,043.90
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	21,811.64
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		-4,140,803.88	17,509,781.03
其中：股票投资收益	6.4.3.12	-6,112,874.46	16,366,138.70
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.3.13	-	-
资产支持证券投资收益		-	-
贵金属投资收益	6.4.3.14	-	-
衍生工具收益	6.4.3.15	-	-
股利收益	6.4.3.16	1,972,070.58	1,143,642.33
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.3.17	-4,301,132.38	-6,415,733.18
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.3.18	2,878.19	7,582.97
减：二、费用		3,260,478.64	2,363,393.55
1. 管理人报酬	6.4.6.2.1	928,948.54	1,238,823.58
2. 托管费	6.4.6.2.2	154,824.79	206,470.51
3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用	6.4.3.19	1,996,114.81	832,049.29
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 其他费用	6.4.3.20	180,590.50	86,050.17
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-11,616,940.96	8,884,461.20
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-11,616,940.96	8,884,461.20

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：大成核心双动力股票型证券投资基金

本报告期：2014 年 1 月 1 日至 2014 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2014 年 1 月 1 日至 2014 年 6 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益(基金净值)	166,802,657.87	-17,253,855.58	149,548,802.29
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	-11,616,940.96	-11,616,940.96
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数(净值减少以“-”号填列)	-43,129,981.92	6,998,876.50	-36,131,105.42
其中：1. 基金申购款	3,328,009.52	-521,850.24	2,806,159.28
2. 基金赎回款	-46,457,991.44	7,520,726.74	-38,937,264.70
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以“-”号填列)	-	-	-
五、期末所有者权益(基金净值)	123,672,675.95	-21,871,920.04	101,800,755.91
项目	上年度可比期间 2013 年 1 月 1 日至 2013 年 6 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益(基金净值)	212,888,517.02	-46,496,017.39	166,392,499.63
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	8,884,461.20	8,884,461.20
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数(净值减少以“-”号填列)	-22,410,353.32	3,932,052.26	-18,478,301.06
其中：1. 基金申购款	4,413,845.01	-762,509.29	3,651,335.72
2. 基金赎回款	-26,824,198.33	4,694,561.55	-22,129,636.78
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以“-”号填列)	-	-	-
五、期末所有者权益(基金净值)	190,478,163.70	-33,679,503.93	156,798,659.77

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署：

<u>张树忠</u>	<u>刘彩晖</u>	<u>范瑛</u>
基金管理人负责人	主管会计工作负责人	会计机构负责人

6.4 报表附注

6.4.1 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

6.4.2 税项

6.4.2.1 印花税

经国务院批准，财政部、国家税务总局研究决定，自2008年4月24日起，调整证券（股票）交易印花税税率，由原先的3‰调整为1‰；经国务院批准，财政部、国家税务总局研究决定，自2008年9月19日起，调整由出让方按证券（股票）交易印花税税率缴纳印花税，受让方不再征收，税率不变；根据财政部、国家税务总局财税字[2005]103号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》的规定，股权分置改革过程中因非流通股股东向流通股股东支付对价而发生的股权转让，暂免征收印花税。

6.4.2.2 营业税、企业所得税

根据财政部、国家税务总局财税字[2004]78号文《关于证券投资基金税收政策的通知》的规定，自2004年1月1日起，对证券投资基金（封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金）管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入，继续免征营业税和企业所得税；根据财政部、国家税务总局财税字[2005]103号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》的规定，股权分置改革中非流通股股东通过对价方式向流通股股东支付的股份、现金等收入，暂免征收流通股股东应缴纳的企业所得税；根据财政部、国家税务总局财税[2008]1号文《关于企业所得税若干优惠政策的通知》的规定，对证券投资基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股权的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

6.4.2.3 个人所得税

根据财政部、国家税务总局财税字[2002]128号文《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》的规定，对基金取得的股票的股息、红利收入、债券的利息收入及储蓄利息收入，由上市公司、债券发行企业及金融机构在向基金派发股息、红利收入、债券的利息收入及储蓄利息收入时代扣代缴20%的个人所得税；根据财政部、国家税务总局财税[2008]132号《财政部国家税务总局关于储蓄存款利息所得有关个人所得税政策的通知》，自2008年10月9日起暂免征收储蓄

存款利息所得个人所得税；根据财政部、国家税务总局财税字[2005]107 号文《关于股息红利有关个人所得税政策的补充通知》的规定，自 2005 年 6 月 13 日起，对证券投资基金从上市公司分配取得的股息红利所得，按照财税[2005]102 号文规定，扣缴义务人在代扣代缴个人所得税时，减按 50%计算应纳税所得额；根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2012]85 号文《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》的规定，自 2013 年 1 月 1 日起，个人从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，持股期限在 1 个月以内（含 1 个月）的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在 1 个月以上至 1 年（含 1 年）的，暂减按 50%计入应纳税所得额；持股期限超过 1 年的，暂减按 25%计入应纳税所得额。上述所得统一适用 20% 的税率计征个人所得税；根据财政部、国家税务总局财税字[2005]103 号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》的规定，股权分置改革中非流通股股东通过对价方式向流通股股东支付的股份、现金等收入，暂免征收流通股股东应缴纳的个人所得税。

6.4.3 重要财务报表项目的说明

6.4.3.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2014 年 6 月 30 日
活期存款	9,792,074.97
定期存款	-
其中：存款期限 1-3 个月	-
其他存款	-
合计：	9,792,074.97

6.4.3.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2014 年 6 月 30 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	87,895,679.89	89,874,192.56	1,978,512.67
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	-	-
	银行间市场	-	-
	合计	-	-
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-

合计	87,895,679.89	89,874,192.56	1,978,512.67
----	---------------	---------------	--------------

6.4.3.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末未持有衍生金融工具。

6.4.3.4 买入返售金融资产

本基金本报告期末未持有买入返售金融资产。

6.4.3.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2014年6月30日
应收活期存款利息	1,864.03
应收定期存款利息	-
应收其他存款利息	-
应收结算备付金利息	246.69
应收债券利息	-
应收买入返售证券利息	-
应收申购款利息	2.13
应收黄金合约拆借孳息	-
其他	92.70
合计	2,205.55

6.4.3.6 其他资产

本基金本报告期末未持有其他资产。

6.4.3.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2014年6月30日
交易所市场应付交易费用	385,872.71
银行间市场应付交易费用	-
合计	385,872.71

6.4.3.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2014年6月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	89.52
预提费用	168,601.50
合计	168,691.02

6.4.3.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2014年1月1日至2014年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	166,802,657.87	166,802,657.87
本期申购	3,328,009.52	3,328,009.52
本期赎回(以“-”号填列)	-46,457,991.44	-46,457,991.44
本期末	123,672,675.95	123,672,675.95

注：申购含红利再投、转换入份额，赎回含转换出份额。

6.4.3.10 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-30,804,140.54	13,550,284.96	-17,253,855.58
本期利润	-7,315,808.58	-4,301,132.38	-11,616,940.96
本期基金份额交易产生的变动数	9,049,829.71	-2,050,953.21	6,998,876.50
其中：基金申购款	-683,583.95	161,733.71	-521,850.24
基金赎回款	9,733,413.66	-2,212,686.92	7,520,726.74
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-29,070,119.41	7,198,199.37	-21,871,920.04

6.4.3.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2014年1月1日至2014年6月30日
	活期存款利息收入
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	-
结算备付金利息收入	7,873.72
其他	1,308.21
合计	82,595.75

6.4.3.12 股票投资收益

6.4.3.12.1 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2014年1月1日至2014年6月30日
	卖出股票成交总额
减：卖出股票成本总额	673,700,618.20
买卖股票差价收入	-6,112,874.46

6.4.3.13 债券投资收益

本基金本报告期内无债券投资收益。

6.4.3.14 贵金属投资收益

本基金本报告期内无贵金属投资收益。

6.4.3.15 衍生工具收益

本基金本报告期内无衍生工具收益。

6.4.3.16 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2014年1月1日至2014年6月30日
股票投资产生的股利收益	1,972,070.58
基金投资产生的股利收益	-
合计	1,972,070.58

6.4.3.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2014年1月1日至2014年6月30日
1. 交易性金融资产	-4,301,132.38
——股票投资	-4,301,132.38
——债券投资	-
——资产支持证券投资	-
——贵金属投资	-
——其他	-
2. 衍生工具	-
——权证投资	-
3. 其他	-
合计	-4,301,132.38

6.4.3.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2014年1月1日至2014年6月30日
基金赎回费收入	2,646.59
转换费收入	231.60
合计	2,878.19

注：1、本基金的赎回费率按持有期间递减，赎回费总额的 25% 归入基金资产。

2、本基金的转换费由申购补差费和转出基金的赎回费两部分构成，其中转出基金的赎回费的25%归入转出基金的基金资产。

6.4.3.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2014年1月1日至2014年6月30日
交易所市场交易费用	1,996,114.81
银行间市场交易费用	-
合计	1,996,114.81

6.4.3.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2014年1月1日至2014年6月30日
审计费用	19,835.79
信息披露费	148,765.71
银行汇划费用	2,189.00
中债登债券托管帐户维护费	9,000.00
其他	800.00
合计	180,590.50

6.4.4 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.4.1 或有事项

本基金无需要说明的重大或有事项。

6.4.4.2 资产负债表日后事项

本基金无需做披露的资产负债表日后事项。

6.4.5 关联方关系

6.4.5.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

本基金本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

6.4.5.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
大成基金管理有限公司(“大成基金”)	基金管理人、注册登记机构、基金销售机构
中国工商银行股份有限公司(“工商银行”)	基金托管人、基金代销机构
中泰信托有限责任公司	基金管理人的股东
光大证券股份有限公司(“光大证券”)	基金管理人的股东、基金代销机构
中国银河投资管理有限公司	基金管理人的股东

广东证券股份有限公司(“广东证券”)	基金管理人的股东
大成国际资产管理有限公司(“大成国际”)	基金管理人的子公司
大成创新资本管理有限公司(“大成创新资本”)	基金管理人的合资子公司

注：1、中国证监会于 2005 年 11 月 6 日作出对广东证券取消业务许可并责令关闭的行政处罚。

2、下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.6 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.6.1 通过关联方交易单元进行的交易

无。

6.4.6.2 关联方报酬

6.4.6.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2014 年 1 月 1 日至 2014 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2013 年 1 月 1 日至 2013 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	928,948.54	1,238,823.58
其中：支付销售机构的客户维护费	307,492.63	409,484.97

注：基金管理费按前一日的基金资产净值的 1.5% 的年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 1.5\% / \text{当年天数}$$

H 为每日应支付的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计提，按月支付。由基金管理人向基金托管人发送基金管理费划付指令，经基金托管人复核后于次月首日起 2 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人，若遇法定节假日、休息日，支付日期顺延。

6.4.6.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2014 年 1 月 1 日至 2014 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2013 年 1 月 1 日至 2013 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	154,824.79	206,470.51

注：基金托管费按前一日的基金资产净值的 0.25% 的年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 0.25\% / \text{当年天数}$$

H 为每日应支付的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计提，按月支付。由基金管理人向基金托管人发送基金托管费划付指令，经基金托管人复核后于次月首日起 2 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金托管人，若遇法定节假日、休息日，支付日期顺延。

6.4.6.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本报告期内及上年度可比期间本基金未发生与关联方进行的银行间同业市场的债券(含回购)交易。

6.4.6.4 各关联方投资本基金的情况**6.4.6.4.1 报告期内基金管理人运用自有资金投资本基金的情况**

项目	本期 2014年1月1日至 2014年6月30日	上年度可比期间 2013年1月1日至 2013年6月30日
基金合同生效日(2010年6月22日)持有的基金份额	30,000,000.00	30,000,000.00
期初持有的基金份额	30,000,000.00	30,000,000.00
期间申购/买入总份额	-	-
期间因拆分变动份额	-	-
减:期间赎回/卖出总份额	30,000,000.00	-
期末持有的基金份额	-	30,000,000.00
期末持有的基金份额占基金总份额比例	-	15.75%

注:本基金管理人投资本基金的费率标准严格按照法律法规及交易所相关规定计算并支付。

6.4.6.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

本报告期末及上年度末除基金管理人之外的其他关联方无投资本基金的情况。

6.4.6.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位:人民币元

关联方名称	本期 2014年1月1日至2014年6月30日		上年度可比期间 2013年1月1日至2013年6月30日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国工商银行	9,792,074.97	73,413.82	42,271,788.42	119,095.85

注:本基金的银行存款由基金托管人中国工商银行保管,并按银行间同业利率计息。

6.4.6.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本报告期内及上年度可比期间本基金未在承销期内参与关联方承销证券。

6.4.6.7 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期及上年度可比期间无须作说明的其他关联交易事项。

6.4.7 利润分配情况

6.4.7.1 利润分配情况——非货币市场基金

本报告期内本基金无利润分配事项。

6.4.8 期末（2014年6月30日）本基金持有的流通受限证券

6.4.8.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

于本报告期末，本基金未持有因认购新发或增发证券而流通受限的证券。

6.4.8.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量（股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
300351	永贵电器	2014年6月23日	重大事项	25.10	2014年8月7日	27.61	80,610	1,888,945.00	2,023,311.00	-

6.4.8.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

于本报告期末，本基金无从事债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

6.4.9 金融工具风险及管理

6.4.9.1 风险管理政策和组织架构

本基金在日常经营活动中涉及的财务风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金管理人制定了政策和程序来识别及分析这些风险，并设定适当的风险限额及内部控制流程，通过可靠的管理及信息系统持续监控上述各类风险。

本基金的基金管理人奉行全面风险管理体系的建设，建立了以由高层监控（董事会合规审计和风险控制委员会、公司投资风险控制委员会）、专业监控（监察稽核部、风险管理部）、部门互控、岗位自控构成的风险管理架构体系。本基金的基金管理人在董事会下设立合规审计和风险控制委员会，对公司整体运营风险进行监督，监督风险控制措施的执行。在管理层层面设立投资风险控制委员会，通过定期会议讨论涉及投资风险的重大议题，形成正式决议提交投委会。在业务操作层面，监察稽核部履行合规控制职责，通过定期、不定期检查内控制度的执行情况、对重大风险点以专项稽核的方式确保公司内控制度、流程得到贯彻执行。风险管理部履行风险量化评估分析职责。

6.4.9.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息，导致基金资产损失和收益变化的风险。本基金均投资于具有良好

信用等级的证券，且通过分散化投资以分散信用风险。本基金投资于一家公司发行的股票市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司的证券，不得超过该证券市值的 10%。

本基金在交易所进行的交易均与中国证券登记结算有限责任公司完成证券交收和款项清算，因此违约风险发生的可能性很小；基金在进行银行间同业市场交易前均对交易对手进行信用评估，以控制相应的信用风险。

6.4.9.3 流动性风险

流动性风险是指基金所持金融工具变现的难易程度。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难。本基金所持有的证券在证券交易所上市，于本期末，除附注 6.4.8.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票外，均能及时变现。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的可回购交易债券投资的公允价值。于资产负债表日，本基金所持有的金融负债的合同约定剩余到期日均为一年以内且不计息，可赎回基金份额净值(所有者权益)无固定到期日且不计息，因此账面余额即为未折现的合约到期现金流量。

本基金管理人每日预测本基金的流动性需求，并同时通过独立的风险管理部门设定流动性比例要求，对流动性指标进行持续的监测和分析。

6.4.9.4 市场风险

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动而发生波动的风险，包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

6.4.9.4.1 利率风险

利率风险是指金融工具的公允价值或现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。利率敏感性金融工具均面临由于市场利率上升而导致公允价值下降的风险，其中浮动利率类金融工具还面临每个付息期间结束根据市场利率重新定价时对于未来现金流影响的风险。

本基金的基金管理人定期对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控，并通过调整投资组合的久期等方法对上述利率风险进行管理。

本基金持有的大部分金融资产和金融负债不计息，因此本基金的收入及经营活动的现金流量在很大程度上独立于市场利率变化。本基金的生息资产主要为银行存款、结算备付金等。下表统计了本基金的利率风险敞口。

6.4.9.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2014年6月30日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	9,792,074.97	-	-	-	9,792,074.97
结算备付金	609,192.21	-	-	-	609,192.21
存出保证金	228,911.09	-	-	-	228,911.09
交易性金融资产	-	-	-	89,874,192.56	89,874,192.56
应收证券清算款	-	-	-	2,038,250.57	2,038,250.57
应收利息	-	-	-	2,205.55	2,205.55
应收申购款	218.69	-	-	4,545.12	4,763.81
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	10,630,396.96	-	-	91,919,193.80	102,549,590.76
负债					
应付赎回款	-	-	-	48,786.82	48,786.82
应付管理人报酬	-	-	-	124,700.84	124,700.84
应付托管费	-	-	-	20,783.46	20,783.46
应付交易费用	-	-	-	385,872.71	385,872.71
其他负债	-	-	-	168,691.02	168,691.02
负债总计	-	-	-	748,834.85	748,834.85
利率敏感度缺口	10,630,396.96	-	-	91,170,358.95	101,800,755.91
本期末 2013年12月31日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	27,240,463.50	-	-	-	27,240,463.50
结算备付金	338,093.79	-	-	-	338,093.79
存出保证金	87,389.53	-	-	-	87,389.53
交易性金融资产	-	-	-	120,705,242.91	120,705,242.91
应收证券清算款	-	-	-	1,624,573.91	1,624,573.91
应收利息	-	-	-	5,954.46	5,954.46
应收申购款	634.65	-	-	28,520.14	29,154.79
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	27,666,581.47	-	-	122,364,291.42	150,030,872.89
负债					
应付赎回款	-	-	-	51,105.21	51,105.21
应付管理人报酬	-	-	-	191,315.96	191,315.96
应付托管费	-	-	-	31,885.99	31,885.99
应付交易费用	-	-	-	167,747.91	167,747.91
其他负债	-	-	-	40,015.53	40,015.53
负债总计	-	-	-	482,070.60	482,070.60
利率敏感度缺口	27,666,581.47	-	-	121,882,220.82	149,548,802.29

注：表中所示为本基金资产及负债的公允价值，并按照合约规定的利率重新定价日或到期日孰早予以分类。

6.4.9.4.1.2 利率风险的敏感性分析

本基金于 2014 年 6 月 30 日和 2013 年 12 月 31 日均未持有交易性债券投资，因此当利率发生合理、可能的变动时，为交易而持有的债券公允价值的变动对年末基金资产净值无重大影响。

6.4.9.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基金持有的金融工具以人民币计价，因此无重大外汇风险。

6.4.9.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场交易的股票和债券，所面临的最大其他价格风险由所持有的金融工具的公允价值决定。本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险，并且本基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控。

本基金的投资范围为：股票资产占基金资产的比例范围为 60%-95%，其中权证不超过基金资产净值的 3%。固定收益类证券和现金投资比例范围为基金资产的 5%-40%。其中，资产支持证券投资比例范围为基金资产净值的 0-20%，现金或到期日在一年以内的政府债券的比例不低于基金资产净值的 5%。于 2014 年 6 月 30 日，本基金面临的其他价格风险列示如下：

6.4.9.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2014 年 6 月 30 日		上年度末 2013 年 12 月 31 日	
	公允价值	占基金 资产净 值比例 (%)	公允价值	占基金资 产净值比 例 (%)
交易性金融资产-股票投资	89,874,192.56	88.28	120,705,242.91	80.71
交易性金融资产-基金投资	-	0.00	-	0.00
交易性金融资产-债券投资	-	0.00	-	0.00
交易性金融资产-贵金属投资	-	0.00	-	0.00
衍生金融资产-权证投资	-	0.00	-	0.00
其他	-	0.00	-	0.00
合计	89,874,192.56	88.28	120,705,242.91	80.71

6.4.9.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除业绩比较基准以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的 影响金额（单位：人民币元）	
		本期末 2014 年 6 月 30 日	上年度末 2013 年 12 月 31 日
	75%×沪深 300 指数+25%× 中证综合债券指数上升 5%	5,790,000.00	6,777,510.80
75%×沪深 300 指数+25%× 中证综合债券指数下降 5%	-5,790,000.00	-6,777,510.80	

6.4.10 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

无。

§ 7 投资组合报告

7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	89,874,192.56	87.64
	其中：股票	89,874,192.56	87.64
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	10,401,267.18	10.14
7	其他各项资产	2,274,131.02	2.22
8	合计	102,549,590.76	100.00

7.2 期末按行业分类的股票投资组合

金额单位：人民币元

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	33,604,329.60	33.01
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	2,004,340.00	1.97
E	建筑业	-	0.00
F	批发和零售业	2,167,700.00	2.13
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	4,414,127.50	4.34
J	金融业	34,795,063.46	34.18
K	房地产业	12,888,632.00	12.66
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	-	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	89,874,192.56	88.28

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	000001	平安银行	695,980	6,897,161.80	6.78
2	601166	兴业银行	682,300	6,843,469.00	6.72
3	000002	万科A	818,100	6,765,687.00	6.65
4	600036	招商银行	601,100	6,155,264.00	6.05
5	000333	美的集团	301,322	5,821,541.04	5.72
6	600000	浦发银行	624,300	5,649,915.00	5.55
7	601169	北京银行	648,796	5,229,295.76	5.14
8	000651	格力电器	177,000	5,212,650.00	5.12
9	601318	中国平安	102,185	4,019,957.90	3.95
10	000024	招商地产	297,250	3,097,345.00	3.04

11	600048	保利地产	610,000	3,025,600.00	2.97
12	300098	高新兴	110,300	2,298,652.00	2.26
13	002521	齐峰新材	226,500	2,294,445.00	2.25
14	002555	顺荣股份	48,635	2,289,735.80	2.25
15	002392	北京利尔	236,700	2,175,273.00	2.14
16	000026	飞亚达 A	265,000	2,167,700.00	2.13
17	002547	春兴精工	180,300	2,158,191.00	2.12
18	300001	特锐德	157,866	2,140,662.96	2.10
19	300059	东方财富	175,850	2,115,475.50	2.08
20	300351	永贵电器	80,610	2,023,311.00	1.99
21	300335	迪森股份	169,000	2,004,340.00	1.97
22	600438	通威股份	209,000	1,983,410.00	1.95
23	000880	潍柴重机	186,000	1,757,700.00	1.73
24	300011	鼎汉技术	139,000	1,654,100.00	1.62
25	002509	天广消防	140,000	1,451,800.00	1.43
26	600742	一汽富维	70,000	1,446,900.00	1.42
27	300202	聚龙股份	18,500	517,260.00	0.51
28	002029	七匹狼	42,100	340,168.00	0.33
29	002491	通鼎光电	20,686	337,181.80	0.33

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	600016	民生银行	17,884,604.73	11.96
2	000002	万科 A	13,525,611.66	9.04
3	601318	中国平安	12,063,276.00	8.07
4	000651	格力电器	11,718,627.28	7.84
5	000001	平安银行	11,544,129.11	7.72
6	002241	歌尔声学	10,928,147.07	7.31
7	300058	蓝色光标	10,630,697.89	7.11
8	600036	招商银行	10,370,243.00	6.93
9	601965	中国汽研	9,705,918.38	6.49
10	601169	北京银行	9,017,121.46	6.03
11	000333	美的集团	8,957,266.68	5.99
12	002008	大族激光	8,834,081.73	5.91

13	000895	双汇发展	8,696,028.27	5.81
14	002415	海康威视	8,601,710.87	5.75
15	601166	兴业银行	8,312,183.07	5.56
16	300070	碧水源	8,058,993.47	5.39
17	600887	伊利股份	7,981,785.10	5.34
18	600383	金地集团	7,907,265.12	5.29
19	000024	招商地产	7,450,871.97	4.98
20	000581	威孚高科	7,425,359.41	4.97
21	002065	东华软件	7,200,770.38	4.81
22	600000	浦发银行	6,915,236.84	4.62
23	002410	广联达	6,852,227.38	4.58
24	600048	保利地产	6,835,559.00	4.57
25	600050	中国联通	6,162,099.75	4.12
26	600422	昆明制药	6,037,068.92	4.04
27	300090	盛运股份	5,994,657.24	4.01
28	002202	金风科技	5,965,565.79	3.99
29	600859	王府井	5,932,970.59	3.97
30	002230	科大讯飞	5,919,757.50	3.96
31	300315	掌趣科技	5,917,938.10	3.96
32	600804	鹏博士	5,916,725.00	3.96
33	002191	劲嘉股份	5,860,317.59	3.92
34	002153	石基信息	5,807,966.12	3.88
35	600315	上海家化	5,804,907.87	3.88
36	002385	大北农	5,732,727.33	3.83
37	000100	TCL 集团	5,626,400.00	3.76
38	300017	网宿科技	5,621,118.85	3.76
39	002146	荣盛发展	5,461,939.56	3.65
40	300059	东方财富	5,319,961.88	3.56
41	002030	达安基因	5,295,057.48	3.54
42	300026	红日药业	5,179,277.10	3.46
43	601288	农业银行	5,148,486.00	3.44
44	300133	华策影视	5,035,792.31	3.37
45	300253	卫宁软件	4,850,981.43	3.24
46	300351	永贵电器	4,675,945.00	3.13
47	601808	中海油服	4,559,500.20	3.05
48	300147	香雪制药	4,431,293.27	2.96

49	000400	许继电气	4,424,879.60	2.96
50	000880	潍柴重机	4,416,594.65	2.95
51	600109	国金证券	4,381,918.55	2.93
52	600406	国电南瑞	4,351,072.14	2.91
53	300002	神州泰岳	4,304,340.60	2.88
54	002174	游族网络	4,040,871.72	2.70
55	000848	承德露露	3,947,161.84	2.64
56	300104	乐视网	3,906,645.71	2.61
57	002236	大华股份	3,893,134.72	2.60
58	000826	桑德环境	3,792,858.26	2.54
59	000538	云南白药	3,769,366.11	2.52
60	601633	长城汽车	3,692,389.11	2.47
61	002475	立讯精密	3,650,822.29	2.44
62	600978	宜华木业	3,542,943.60	2.37
63	600340	华夏幸福	3,432,973.59	2.30
64	600585	海螺水泥	3,139,867.54	2.10
65	600330	天通股份	3,089,716.00	2.07
66	601222	林洋电子	3,074,442.00	2.06
67	002635	安洁科技	3,045,329.89	2.04
68	002618	丹邦科技	3,014,506.50	2.02
69	002038	双鹭药业	2,992,988.00	2.00

注：本项中“本期累计买入金额”指买入成交金额（成交单价乘以成交数量），不考虑相关交易费用。

7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例（%）
1	600016	民生银行	17,368,519.00	11.61
2	600887	伊利股份	14,329,122.03	9.58
3	002415	海康威视	11,292,867.79	7.55
4	000333	美的集团	10,766,907.47	7.20
5	000895	双汇发展	10,715,145.60	7.16
6	300058	蓝色光标	10,609,400.20	7.09
7	002241	歌尔声学	10,340,986.78	6.91
8	000538	云南白药	9,577,645.92	6.40
9	601965	中国汽研	9,161,967.30	6.13

10	600859	王府井	8,731,722.16	5.84
11	000826	桑德环境	8,529,496.57	5.70
12	002008	大族激光	8,489,190.72	5.68
13	600383	金地集团	8,400,627.85	5.62
14	600804	鹏博士	8,147,351.94	5.45
15	300017	网宿科技	8,119,150.32	5.43
16	002450	康得新	8,110,926.17	5.42
17	000002	万科A	8,055,945.73	5.39
18	600315	上海家化	7,800,709.33	5.22
19	601318	中国平安	7,666,750.58	5.13
20	300070	碧水源	7,635,505.65	5.11
21	002410	广联达	7,410,021.76	4.95
22	002202	金风科技	6,660,233.02	4.45
23	002475	立讯精密	6,492,537.47	4.34
24	002191	劲嘉股份	6,443,057.45	4.31
25	002065	东华软件	6,419,586.13	4.29
26	000581	威孚高科	6,402,716.40	4.28
27	600050	中国联通	6,172,700.00	4.13
28	601633	长城汽车	5,813,782.91	3.89
29	600872	中炬高新	5,795,442.40	3.88
30	002146	荣盛发展	5,775,349.58	3.86
31	600422	昆明制药	5,662,284.91	3.79
32	300090	盛运股份	5,629,150.40	3.76
33	000651	格力电器	5,574,976.52	3.73
34	000100	TCL 集团	5,552,300.00	3.71
35	002081	金螳螂	5,401,438.75	3.61
36	600079	人福医药	5,351,679.64	3.58
37	002385	大北农	5,346,891.52	3.58
38	300026	红日药业	5,303,160.89	3.55
39	300315	掌趣科技	5,280,452.66	3.53
40	601288	农业银行	5,218,029.00	3.49
41	002030	达安基因	5,125,829.00	3.43
42	000001	平安银行	5,069,868.12	3.39
43	002153	石基信息	5,045,508.37	3.37
44	300133	华策影视	4,995,819.30	3.34
45	002230	科大讯飞	4,973,388.34	3.33
46	000400	许继电气	4,878,529.21	3.26
47	300253	卫宁软件	4,662,977.08	3.12

48	000024	招商地产	4,583,852.80	3.07
49	002174	游族网络	4,439,927.50	2.97
50	600446	金证股份	4,298,802.34	2.87
51	600036	招商银行	4,291,175.79	2.87
52	002063	远光软件	4,264,193.48	2.85
53	600109	国金证券	4,256,115.81	2.85
54	601808	中海油服	4,211,653.20	2.82
55	600406	国电南瑞	4,128,094.59	2.76
56	300002	神州泰岳	4,097,832.05	2.74
57	600048	保利地产	4,060,619.62	2.72
58	300104	乐视网	3,976,734.15	2.66
59	300147	香雪制药	3,940,260.44	2.63
60	601169	北京银行	3,883,989.90	2.60
61	002236	大华股份	3,783,837.28	2.53
62	600978	宜华木业	3,654,143.17	2.44
63	000848	承德露露	3,559,136.82	2.38
64	002292	奥飞动漫	3,555,532.32	2.38
65	600309	万华化学	3,333,442.03	2.23
66	300212	易华录	3,317,765.50	2.22
67	600525	长园集团	3,314,450.82	2.22
68	300059	东方财富	3,312,954.44	2.22
69	002085	万丰奥威	3,296,005.37	2.20
70	300323	华灿光电	3,280,757.11	2.19
71	600340	华夏幸福	3,215,650.27	2.15
72	002022	科华生物	3,179,590.84	2.13
73	002229	鸿博股份	3,165,431.92	2.12
74	002489	浙江永强	3,150,482.50	2.11
75	002570	贝因美	3,118,422.50	2.09
76	000880	潍柴重机	3,087,547.16	2.06
77	600585	海螺水泥	3,083,759.16	2.06
78	002038	双鹭药业	3,072,636.92	2.05
79	600018	上港集团	3,058,420.80	2.05

注：本项中“本期累计卖出金额”按卖出成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	647,170,700.23
--------------	----------------

卖出股票收入（成交）总额	667,587,743.74
--------------	----------------

注：本项中“买入股票的成本(成交)总额”及“卖出股票的收入(成交)总额”均按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

7.5 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。

7.6 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。

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有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。

7.8 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贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

7.9 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。

7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

7.10.1 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。

7.10.2 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。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.11.1 本期国债期货投资政策

本基金本报告期末持有国债期货。

7.11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末持有国债期货。

7.11.3 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末持有国债期货。

7.12 投资组合报告附注

7.12.1 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视为，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。

7.12.2 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股票。

7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	228,911.09
2	应收证券清算款	2,038,250.57
3	应收股利	-
4	应收利息	2,205.55
5	应收申购款	4,763.81
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	2,274,131.02

7.12.4 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。

7.12.5 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未存在流通受限情况。

7.12.6 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。

§ 8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

持有人户数 (户)	户均持有的 基金份额	持有人结构			
		机构投资者		个人投资者	
		持有份额	占总份 额比例	持有份额	占总份 额比例
6665	18,555.54	4,561,176.34	3.69%	119,111,499.61	96.31%

注：持有人户数为有效户数，即存量份额大于零的账户。

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	持有份额总数（份）	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	863,950.00	0.699%

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

项目	份额级别	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和研 究部门负责人持有本开放式基金	大成核心	0
	合计	0
本基金基金经理持有本开放式基金	大成核心	0
	合计	0

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2010年6月22日）基金份额总额	1,173,262,454.69
本报告期期初基金份额总额	166,802,657.87
本报告期基金总申购份额	3,328,009.52
减：本报告期基金总赎回份额	46,457,991.44
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	123,672,675.95

§ 10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内无基金份额持有人大会决议。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

1、基金管理人于2014年1月25日发布了《大成基金管理有限公司关于高级管理人员变更的

公告》，经大成基金管理有限公司第五届董事会第二十八次会议审议通过，王颢先生不再担任大成基金管理有限公司总经理，由董事长张树忠先生代任公司总经理。

2、本报告期内，因中国工商银行股份有限公司（以下简称“本行”）工作需要，周月秋同志不再担任本行资产托管部总经理。在新任资产托管部总经理李勇同志完成证券投资基金行业高级管理人员任职资格备案手续前，由副总经理王立波同志代为行使本行资产托管部总经理部分业务授权职责。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内没有涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

10.4 基金投资策略的改变

本基金投资策略在本报告期内没有重大改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金聘任的为本基金审计的会计师事务所为安永华明会计师事务所（特殊普通合伙），该事务所自基金合同生效日起为本基金提供审计服务至今。

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期，本基金管理人、托管人及高级管理人员未受到监管部门稽查或处罚。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
申银万国	1	825,633,739.87	62.83%	730,604.09	62.16%	-
中信证券	1	488,528,989.50	37.17%	444,757.24	37.84%	-

注：根据中国证监会颁布的《关于完善证券投资基金交易席位制度有关问题的通知》（证监基金字[2007]48号）的有关规定，本公司制定了租用证券公司交易单元的选择标准和程序。

租用证券公司交易单元的选择标准主要包括：

- （一）财务状况良好，最近一年无重大违规行为；
- （二）经营行为规范，内控制度健全，能满足各投资组合运作的保密性要求；
- （三）研究实力较强，能提供包括研究报告、路演服务、协助进行上市公司调研等研究服务；
- （四）具备各投资组合运作所需的高效、安全的通讯条件，有足够的交易和清算能力，满足各投资组合证券交易需要；
- （五）能提供投资组合运作、管理所需的其他券商服务；
- （六）相关基金合同、资产管理合同以及法律法规规定的其他条件。

租用证券公司交易单元的程序：首先根据租用证券公司交易单元的选择标准形成《券商服务评价表》，然后根据评分高低进行选择基金交易单元。

本报告期内租用交易单元变更情况:无。

10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

无。

10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	大成基金管理有限公司关于增加和讯信息科技有限公司为开放式基金代销机构并开通相关业务的公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2014/1/4
2	大成核心双动力股票型证券投资基金增聘基金经理公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2014/1/9
3	大成核心双动力股票型证券投资基金 2013 年第 4 季度报告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2014/1/22
4	大成基金管理有限公司关于旗下基金持有的“汤臣倍健”股票估值调整的公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2014/1/25
5	大成基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2014/1/25
6	大成核心双动力股票型证券投资基金更新招募说明书摘要（2013 年第 2 期）	中国证监会指定报刊及本公司网站	2014/1/30
7	大成核心双动力股票型证券投资基金更新招募说明书（2013 年第 2 期）	中国证监会指定报刊及本公司网站	2014/1/30
8	大成核心双动力股票型证券投资基金变更基金经理公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2014/1/30
9	大成核心双动力股票型证券投资基金变更基金经理公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2014/1/30
10	大成基金管理有限公司关于旗下基金持有的“和佳股份”股票估值调整的公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2014/3/18
11	关于大成基金管理有限公司北京理财中心办公地址变更的公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2014/3/19
12	大成核心双动力股票型证券投资基金 2013 年年度报告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2014/3/29
13	大成核心双动力股票型证券投资基金 2013 年年度报告摘要	中国证监会指定报刊及本公司网站	2014/3/29
14	大成基金管理有限公司关于调整网上直销系统中定期定额投资起点金额的公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2014/4/8
15	大成基金管理有限公司董事、监事、高级管理人员以及其他从业人员在子公司兼任职务及领薪情况的公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2014/4/11
16	关于增加中国民族证券有限责任公司为开放式基	中国证监会指定报	2014/4/17

	金代销机构并开通相关业务的公告	刊及本公司网站	
17	大成核心双动力股票型证券投资基金 2014 年第 1 季度报告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2014/4/21
18	关于增加杭州数米基金销售有限公司为代销机构及相关申购费率优惠的公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2014/6/5
19	大成基金管理有限公司关于调整旗下开放式基金基金转换业务规则的公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2014/6/30

§ 11 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§ 12 备查文件目录

12.1 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。

12.2 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。

12.3 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。

投资者对本报告书如有疑问，可咨询本基金管理人大成基金管理有限公司。

客户服务中心电话：400-888-5558（免长途通话费用）

国际互联网址：<http://www.dcfund.com.cn>

大成基金管理有限公司
2014 年 8 月 28 日