

大成创新成长混合型证券投资基金（LOF）

2013 年年度报告摘要

2013 年 12 月 31 日

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

送出日期：2014 年 3 月 29 日

§ 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。

基金托管人中国农业银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2014 年 3 月 26 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。

本年度报告摘要摘自年度报告正文，投资者欲了解详细内容，应阅读年度报告正文。

本报告中财务资料已经审计。普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）为本基金出具了无保留意见的审计报告，请投资者注意阅读。

本报告期自 2013 年 01 月 01 日起至 12 月 31 日止。

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金简称	大成创新成长混合（场内基金简称：大成创新）
基金主代码	160910
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
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
报告期末基金份额总额	9,413,437,038.64 份
基金合同存续期	不定期
基金份额上市的证券交易所	深圳证券交易所
上市日期	2007 年 10 月 25 日

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”。

2.2 基金产品说明

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。

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	中国农业银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	杜鹏	李芳菲
	联系电话	0755-83183388	010-66060069
	电子邮箱	dupeng@dcfund.com.cn	lifangfei@abchina.com
客户服务电话		4008885558	95599
传真		0755-83199588	010-63201816

2.4 信息披露方式

登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	http://www.dcfund.com.cn
基金年度报告备置地点	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 28 号凯晨世贸中心东座 F9 中国农业银行托管业务部
--	--

§ 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

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	2013 年	2012 年	2011 年
本期已实现收益	147,051,821.27	-990,255,804.37	-135,864,828.05
本期利润	-185,014,047.40	792,184,181.61	-3,231,874,215.71
加权平均基金份额本期利润	-0.0193	0.0770	-0.2913
本期基金份额净值增长率	-2.61%	11.01%	-30.09%
3.1.2 期末数据和指标	2013 年末	2012 年末	2011 年末
期末可供分配基金份额利润	-0.2007	-0.2170	-0.2101
期末基金资产净值	7,025,442,225.54	7,674,762,098.33	7,273,049,640.02
期末基金份额净值	0.746	0.766	0.690

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。

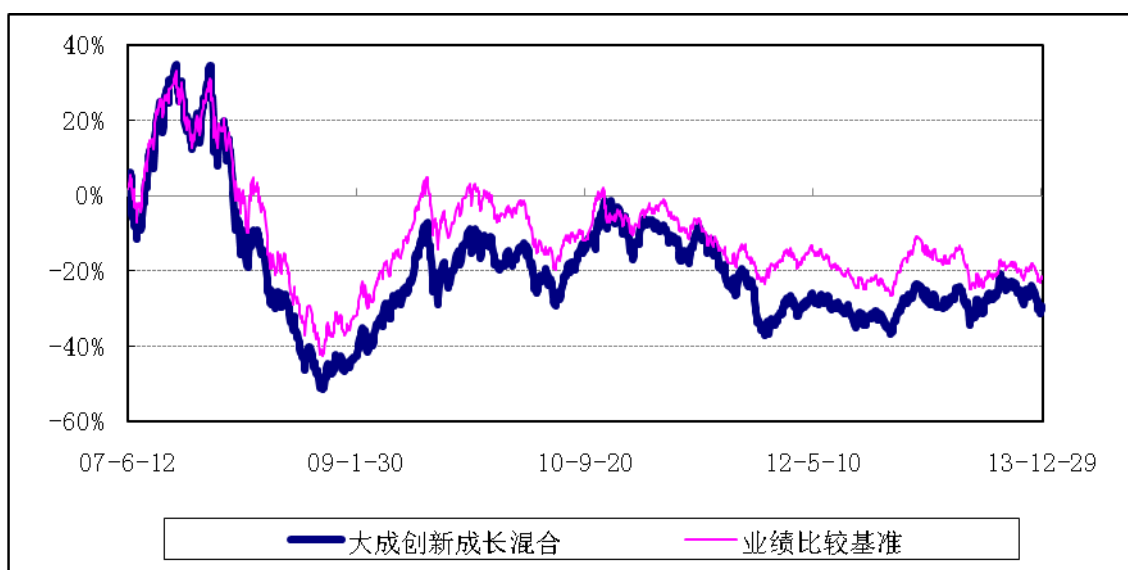
2、所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

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

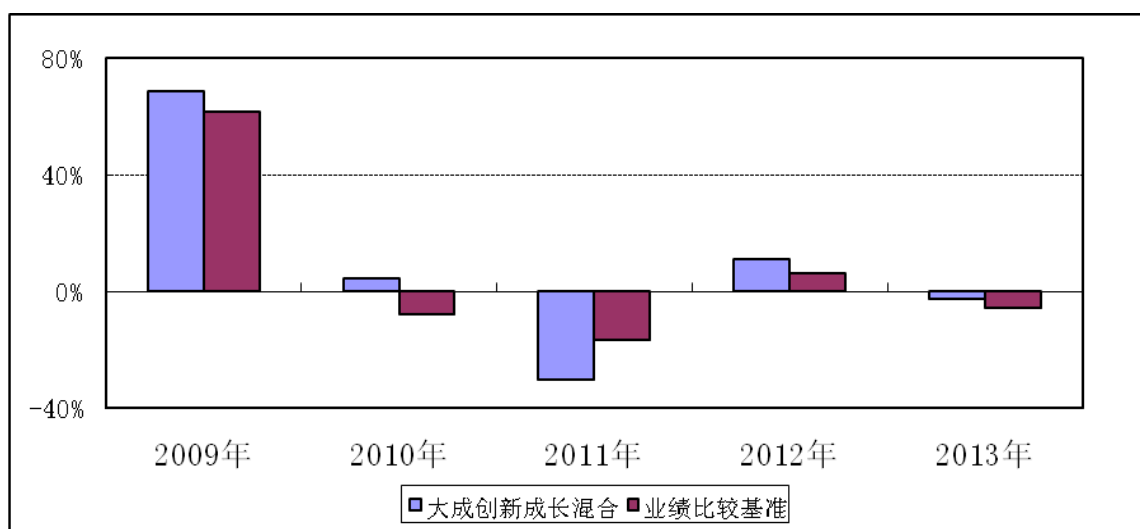
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去三个月	-5.81%	1.12%	-2.93%	0.79%	-2.88%	0.33%
过去六个月	3.61%	1.25%	2.98%	0.91%	0.63%	0.34%
过去一年	-2.61%	1.25%	-5.56%	0.98%	2.95%	0.27%
过去三年	-24.42%	1.20%	-16.05%	0.93%	-8.37%	0.27%
过去五年	33.21%	1.38%	25.19%	1.09%	8.02%	0.29%
自基金合同生效起至今	-29.27%	1.58%	-21.53%	1.34%	-7.74%	0.24%

3.2.2 自基金转型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，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。

3.2.3 过去五年基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较



3.3 过去三年基金的利润分配情况

无。

§ 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 2013 年 12 月 31 日，本基金管理人共管理 2 只封闭式证券投资基金：景宏证券投资基金及景福证券投资基金，4 只 ETF 及 2 只 ETF 联接基金：深证成长 40ETF、大成深证成长 40ETF 联接基金、中证 500 沪市 ETF 及大成中证 500 沪市 ETF 联接基金、中证 100ETF、中证 500 深市 ETF，1 只 QDII 基金：大成标普 500 等权重指数基金及 31 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、大成保本混合型证券投资基金、大成内需增长股票型证券投资基金、大成中证内地消费主题指数证券投资基金、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及大成景祥分级债券型证券投资基金。

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		
杨建勋 先生	本基金基 金经理	2011 年 4 月 22 日	-	12 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，担任普润基金基金经理；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
虞亚新先生	本基金基金经理助理	2012 年 8 月 7 日	-	5 年	经济学硕士，2008 年 7 月至 2010 年 6 月就职于长江证券研究部，2010 年 6 月加入大成基金管理有限公司，现任研究部上游研究小组主管，2012 年 8 月 7 日担任大成创新成长混合型证券投资基金基金经理助理。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，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 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度和控制方法

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，基金管理人制订了《大成基金管理有限公司公平交易制度》及《大成基金管理有限公司异常交易监控与报告制度》。基金管理人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 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。

基金管理人运用统计分析方法和工具，对旗下所有投资组合连续 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进行分析。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些组合间的成交价格差异较大，但结合交易价差专项统计分析，未发现违反公平交易原则的异常情况。

4.3.3 异常交易行为的专项说明

报告期内，基金管理人旗下所有投资组合未发现存在异常交易行为。主动投资组合间股票交易存在 11 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% 的仅有 2 笔，原因为投资策略需要；主动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。

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

2013 年 A 股市场沪深 300 指数下跌 7.65%，而同期创业板指数上涨 82.73%。两个指数巨大的反差是国内证券市场前所未见的现象，数据背后有着深刻的经济和社会心理因素。从宏观经济角度看，2013 年是新的中央领导集体施政第一年，积极推动经济转型升级，在政策方面出台诸多推动新兴产业发展的措施，在调控方式上显示出许多与以往不同的思路；从社会心理角度看，雾霾等环境问题、食品安全、房价等因素促使全社会对经济增长模式转型创新达成高度一致。

本基金在 2013 年的持股结构仍以低估值的传统行业和消费行业为主，逐渐增持了医药生物、环保等行业。本基金目前主要持仓的板块是金融地产、通讯、食品饮料、建筑装饰、医药健康等行业。

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 0.746 元，本报告期基金份额净值增长率为-2.61%，同期业绩比较基准收益率为-5.56%，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

2014 年稳增长、调结构、促改革的宏观经济政策将延续，预计实体经济仍将平稳运行。通胀压力有所缓解，将为宏观经济政策的出台提供有利环境。地方政府债务整体处于可控范围，发生债务危机的可能性很小。欧美经济的复苏将带动出口复苏，有望为 2014 年经济增长带来新的动力。

实体经济的平稳运行为调结构和促改革提供了强力支持，调结构和促改革的力度有望超预期，符合经济结构调整方向的行业在政策扶植下有望持续成长。传统板块已经反应了大部分的悲观预期，存在预期修正机会。我们特别关注传统行业与新经济、新技术、新模式相结合而带来的投资机会，目前许多传统行业中的公司正在积极摸索自身主营业务与互联网相融合的途径，不仅可能为公司带来更大的发展空间，还可能进一步发掘出新的商业模式。

在投资上，我们将继续保持相对均衡的配置，我们将继续持有具有估值优势的业绩增速有保证的成长股和具备一定安全边际的蓝筹股，重点关注同时具备转型动力和能力的传统行业中的优秀公司，继续提高对日常消费、医药、环保等板块的投资比例。

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

在托管大成创新成长混合型证券投资基金（LOF）的过程中，本基金托管人中国农业银行股份有限公司严格遵守《证券投资基金法》相关法律法规的规定以及《大成创新成长混合型证券投资基金基金合同》、《大成创新成长混合型证券投资基金托管协议》的约定，对大成创新成长混合型证券投资基金（LOF）管理人—大成基金管理有限公司 2013 年 1 月 1 日至 2013 年 12 月 31 日基金的投资运作，进行了认真、独立的会计核算和必要的投资监督，认真履行了托管人的义务，没有从事任何损害基金份额持有人利益的行为。

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

本托管人认为，大成基金管理有限公司在大成创新成长混合型证券投资基金（LOF）的投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支及利润分配等问题上，不存在损害基金份额持有人利益的行为；在报告期内，严格遵守了《证券投资基金法》等有关法律法规，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人认为，大成基金管理有限公司的信息披露事务符合《证券投资基金信息披露管理办法》及其他相关法律法规的规定，基金管理人所编制和披露的大成创新成长混合型证券投资基金（LOF）年度报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告等信息真实、准确、完整，未发现有关损害基金持有人利益的行为。

§ 6 审计报告

本基金 2013 年年度财务报表已经普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）审计，注册会计师签字出具了标准无保留意见的审计报告。投资者欲了解本基金审计报告详细内容，应阅读年度报告正文。

§ 7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体：大成创新成长混合型证券投资基金（LOF）

报告截止日：2013 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资 产	本期末 2013 年 12 月 31 日	上年度末 2012 年 12 月 31 日
资 产：		
银行存款	363,412,201.13	1,728,344,676.58
结算备付金	2,804,484.53	4,541,953.65
存出保证金	1,118,301.63	4,110,240.84
交易性金融资产	6,633,449,045.28	5,750,123,217.31
其中：股票投资	6,103,137,862.98	5,301,811,217.31
基金投资	-	-
债券投资	530,311,182.30	448,312,000.00
资产支持证券投资	-	-
衍生金融资产	-	-
买入返售金融资产	-	289,750,634.63
应收证券清算款	88,293,125.67	-
应收利息	1,978,924.58	12,299,197.69
应收股利	-	-
应收申购款	9,617.20	18,599.77
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	-
资产总计	7,091,065,700.02	7,789,188,520.47
负债和所有者权益	本期末 2013 年 12 月 31 日	上年度末 2012 年 12 月 31 日
负 债：		
短期借款	-	-
交易性金融负债	-	-
衍生金融负债	-	-
卖出回购金融资产款	-	-
应付证券清算款	48,269,732.94	92,284,802.33
应付赎回款	3,247,511.56	2,359,753.19
应付管理人报酬	9,050,250.84	9,116,975.24
应付托管费	1,508,375.16	1,519,495.87
应付销售服务费	-	-
应付交易费用	2,282,501.92	6,385,002.92
应交税费	-	-
应付利息	-	-
应付利润	-	-

递延所得税负债	-	-
其他负债	1,265,102.06	2,760,392.59
负债合计	65,623,474.48	114,426,422.14
所有者权益：		
实收基金	8,469,239,781.88	9,010,013,867.01
未分配利润	-1,443,797,556.34	-1,335,251,768.68
所有者权益合计	7,025,442,225.54	7,674,762,098.33
负债和所有者权益总计	7,091,065,700.02	7,789,188,520.47

注：报告截止日 2013 年 12 月 31 日，基金份额净值 0.746 元，基金份额总额 9,413,437,038.64 份。

7.2 利润表

会计主体：大成创新成长混合型证券投资基金（LOF）

本报告期：2013 年 1 月 1 日至 2013 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项 目	本期 2013 年 1 月 1 日至 2013 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2012 年 1 月 1 日至 2012 年 12 月 31 日
一、收入	-32,282,690.88	940,773,949.80
1. 利息收入	18,055,913.69	20,421,435.76
其中：存款利息收入	11,888,735.22	13,916,849.75
债券利息收入	3,033,558.48	5,236,084.26
资产支持证券利息收入	-	-
买入返售金融资产收入	3,133,619.99	1,268,501.75
其他利息收入	-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）	281,550,517.54	-862,125,666.46
其中：股票投资收益	158,104,780.42	-937,272,372.83
基金投资收益	-	-
债券投资收益	1,062,706.61	-298,800.00
资产支持证券投资收益	-	-
衍生工具收益	-	-
股利收益	122,383,030.51	75,445,506.37
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	-332,065,868.67	1,782,439,985.98
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）	-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	176,746.56	38,194.52
减：二、费用	152,731,356.52	148,589,768.19
1. 管理人报酬	110,615,864.99	112,340,245.80
2. 托管费	18,435,977.51	18,723,374.35
3. 销售服务费	-	-
4. 交易费用	23,003,858.19	16,872,278.43

5. 利息支出	-	-
其中：卖出回购金融资产支出	-	-
6. 其他费用	675,655.83	653,869.61
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）	-185,014,047.40	792,184,181.61
减：所得税费用	-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）	-185,014,047.40	792,184,181.61

7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：大成创新成长混合型证券投资基金（LOF）

本报告期：2013 年 1 月 1 日至 2013 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2013 年 1 月 1 日至 2013 年 12 月 31 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）	9,010,013,867.01	-1,335,251,768.68	7,674,762,098.33
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-185,014,047.40	-185,014,047.40
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）	-540,774,085.13	76,468,259.74	-464,305,825.39
其中：1. 基金申购款	481,609,511.81	-61,985,108.80	419,624,403.01
2. 基金赎回款	-1,022,383,596.94	138,453,368.54	-883,930,228.40
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）	8,469,239,781.88	-1,443,797,556.34	7,025,442,225.54
项目	上年度可比期间 2012 年 1 月 1 日至 2012 年 12 月 31 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）	9,488,928,009.94	-2,215,878,369.92	7,273,049,640.02
二、本期经营活动产生的	-	792,184,181.61	792,184,181.61

基金净值变动数（本期利润）			
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）	-478,914,142.93	88,442,419.63	-390,471,723.30
其中：1. 基金申购款	31,874,781.17	-6,057,276.70	25,817,504.47
2. 基金赎回款	-510,788,924.10	94,499,696.33	-416,289,227.77
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）	9,010,013,867.01	-1,335,251,768.68	7,674,762,098.33

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.4 财务报表由下列负责人签署：

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

7.4 报表附注

7.4.1 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。

7.4.2 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128 号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2008]1 号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85 号《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》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1) 以发行基金方式募集资金不属于营业税征收范围，不征收营业税。基金买卖股票、债券的差价收入不予征收营业税。

(2) 对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。

(3) 对基金取得的企业债券利息收入，应由发行债券的企业在向基金支付利息时代扣代缴 20% 的个人所得税。自 2013 年 1 月 1 日起，对基金从上市公司取得的股息红利所得，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。对基金持有的上市公司限售股，解禁后取得的股息、红利收入，按照上述规定计算纳税，持股时间自解禁日起计算；解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按 50% 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。

(4) 基金卖出股票按 0.1% 的税率缴纳股票交易印花税，买入股票不征收股票交易印花税。

7.4.3 关联方关系

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、基金销售机构
中国农业银行股份有限公司（“中国农业银行”）	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”）	基金管理人的全资子公司

注：1. 本基金基金管理人于 2013 年 10 月 29 日成立了全资子公司大成创新资本管理有限公司，其中大成基金管理有限公司持有 52% 的股权。

2. 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。

3. 下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

7.4.4 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.4.1 通过关联方交易单元进行的交易

7.4.4.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2013 年 1 月 1 日至 2013 年 12 月 31 日		上年度可比期间 2012 年 1 月 1 日至 2012 年 12 月 31 日	
	成交金额	占当期股票 成交总额的 比例	成交金额	占当期股票 成交总额的比 例
光大证券	551,916,231.60	3.58%	1,259,344,902.41	11.99%

7.4.4.1.2 权证交易

无。

7.4.4.1.3 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2013年1月1日至2013年12月31日			
	当期 佣金	占当期佣金 总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金 总额的比例
光大证券	488,395.95	3.52%	168,781.29	7.40%
关联方名称	上年度可比期间 2012年1月1日至2012年12月31日			
	当期 佣金	占当期佣金 总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金 总额的比例
光大证券	1,080,345.96	11.93%	213,148.25	3.34%

注：1. 上述佣金参考市场价格经本基金的基金管理人与对方协商确定，以扣除由中国证券登记结算有限责任公司收取的证管费和经手费的净额列示。

2. 该类佣金协议的服务范围还包括佣金收取方为本基金提供的证券投资研究成果和市场信息服务等。

7.4.4.2 关联方报酬

7.4.4.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2013年1月1日 至2013年12月31日	上年度可比期间 2012年1月1日 至2012年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	110,615,864.99	112,340,245.80
其中：支付销售机构的客户维护费	20,500,303.09	20,972,746.49

注：支付基金管理人大成基金的管理人报酬按前一日基金资产净值 1.5% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

$$\text{日管理人报酬} = \text{前一日基金资产净值} \times 1.5\% / \text{当年天数}。$$

7.4.4.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2013年1月1日 至2013年12月31日	上年度可比期间 2012年1月1日 至2012年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	18,435,977.51	18,723,374.35

注：支付基金托管人中国农业银行的托管费按前一日基金资产净值 0.25% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

$$\text{日托管费} = \text{前一日基金资产净值} \times 0.25\% / \text{当年天数}。$$

7.4.4.3 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。

7.4.4.4 各关联方投资本基金的情况**7.4.4.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况**

本报告期及上年度可比期间本基金管理人未投资于本基金。

7.4.4.4.2 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

本期末及上年度末除基金管理人之外的其他关联方未投资于本基金。

7.4.4.5 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 2013 年 1 月 1 日 至 2013 年 12 月 31 日		上年度可比期间 2012 年 1 月 1 日 至 2012 年 12 月 31 日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国农业银行	363,412,201.13	11,743,563.53	1,728,344,676.58	11,154,001.50

注：本基金的银行存款由基金托管人中国农业银行保管，按约定利率计息。

7.4.4.6 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。

7.4.4.7 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。

7.4.5 期末（2013 年 12 月 31 日）本基金持有的流通受限证券**7.4.5.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券**

金额单位：人民币元

7.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量（单位：股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
600460	士兰微	2013 年 9 月 5 日	2014 年 9 月 2 日	非公开发行	4.80	5.18	15,000,000	72,000,000.00	77,700,000.00	-
合计							15,000,000	72,000,000.00	77,700,000.00	

注：基金可使用以基金名义开设的股票账户，选择网上或者网下一种方式进行新股申购。其中基金作为一般法人或战略投资者认购的新股，根据基金与上市公司所签订申购协议的规定，在新股上市后的约定期限内不能自由转让；基金作为个人投资者参与网上认购获配的新股，从新股获配

日至新股上市日之间不能自由转让。此外，基金还可作为特定投资者，认购由中国证监会《上市公司证券发行管理办法》规范的非公开发行股票，所认购的股票自发行结束之日起 12 个月内不得转让。

7.4.5.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

于本报告期末，本基金未持有暂时停牌等流通受限股票。

7.4.5.3 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。

§ 8 投资组合报告

8.1 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	6,103,137,862.98	86.07
	其中：股票	6,103,137,862.98	86.07
2	固定收益投资	530,311,182.30	7.48
	其中：债券	530,311,182.30	7.48
	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	366,216,685.66	5.16
6	其他各项资产	91,399,969.08	1.29
7	合计	7,091,065,700.02	100.00

8.2 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	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	78,693,373.66	1.12
B	采矿业	—	0.00
C	制造业	1,709,366,989.55	24.33
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	—	0.00
E	建筑业	599,657,685.49	8.54
F	批发和零售业	20,754,301.59	0.30

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	221,470,634.94	3.15
J	金融业	2,383,415,367.66	33.93
K	房地产业	941,788,287.76	13.41
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	111,413,636.61	1.59
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	36,577,585.72	0.52
S	综合	-	0.00
	合计	6,103,137,862.98	86.87

8.3 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

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	600036	招商银行	43,041,622	468,723,263.58	6.67
2	000063	中兴通讯	32,030,216	418,634,923.12	5.96
3	000002	万科A	50,117,698	402,445,114.94	5.73
4	601169	北京银行	53,491,643	401,722,238.93	5.72
5	600000	浦发银行	40,677,159	383,585,609.37	5.46
6	601166	兴业银行	33,873,929	343,481,640.06	4.89
7	600016	民生银行	42,169,492	325,548,478.24	4.63
8	600887	伊利股份	8,053,106	314,715,382.48	4.48
9	601766	中国南车	52,702,948	264,041,769.48	3.76
10	600518	康美药业	13,247,129	238,448,322.00	3.39

注：投资者欲了解本报告期末基金投资的所有股票明细，应阅读登载于大成基金管理有限公司网站(<http://www.dcfund.com.cn>)的年度报告正文。

8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

8.4.1 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	600036	招商银行	659,985,350.94	8.60
2	601169	北京银行	584,242,508.13	7.61
3	000002	万科A	494,685,654.19	6.45
4	600000	浦发银行	462,783,467.69	6.03
5	601166	兴业银行	411,723,181.84	5.36
6	000063	中兴通讯	373,213,876.91	4.86
7	600016	民生银行	357,963,126.11	4.66
8	600030	中信证券	353,237,833.47	4.60
9	600518	康美药业	341,176,621.00	4.45
10	600048	保利地产	308,584,857.97	4.02
11	000651	格力电器	255,213,054.91	3.33
12	601766	中国南车	239,790,290.90	3.12
13	600073	上海梅林	237,822,440.91	3.10
14	600887	伊利股份	233,594,917.59	3.04
15	000157	中联重科	207,697,389.41	2.71
16	300070	碧水源	166,949,728.93	2.18
17	002482	广田股份	157,191,747.20	2.05
18	002325	洪涛股份	131,771,801.95	1.72
19	600837	海通证券	131,173,075.54	1.71
20	002375	亚厦股份	129,040,780.91	1.68

注：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。

8.4.2 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	600690	青岛海尔	421,061,498.09	5.49
2	601318	中国平安	385,271,137.88	5.02
3	000826	桑德环境	372,531,714.68	4.85

4	601628	中国人寿	281,809,197.20	3.67
5	000651	格力电器	261,424,312.40	3.41
6	600519	贵州茅台	258,579,535.60	3.37
7	000002	万 科 A	251,262,696.00	3.27
8	601601	中国太保	228,372,258.14	2.98
9	600585	海螺水泥	227,803,683.95	2.97
10	601992	金隅股份	194,084,976.51	2.53
11	000568	泸州老窖	186,585,902.36	2.43
12	300115	长盈精密	183,331,499.74	2.39
13	000157	中联重科	180,167,279.37	2.35
14	600073	上海梅林	176,814,627.47	2.30
15	600765	中航重机	159,245,407.14	2.07
16	000402	金 融 街	158,095,438.53	2.06
17	600153	建发股份	144,220,238.09	1.88
18	600030	中信证券	126,458,790.09	1.65
19	601898	中煤能源	123,510,802.11	1.61
20	600036	招商银行	122,460,380.58	1.60

注：本期累计卖出金额指卖出成交金额（成交单价乘以成交数量），不考虑相关交易费用。

8.4.3 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	8,241,004,042.71
卖出股票收入（成交）总额	7,314,253,714.80

注：上述金额均指成交金额（成交单价乘以成交数量），不考虑相关交易费用。

8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	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	-	0.00
	其中：政策性金融债	-	0.00
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	530,311,182.30	7.55
8	其他	-	0.00
9	合计	530,311,182.30	7.55

8.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名债券投资明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	110023	民生转债	3,244,810	313,221,509.30	4.46
2	113002	工行转债	2,141,980	217,089,673.00	3.09

8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名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。

8.8 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

8.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

8.9.1 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。

8.9.2 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。

8.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

8.10.1 本期国债期货投资政策

本基金本报告期末投资国债期货。

8.10.2 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。

8.10.3 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末投资国债期货。

8.11 投资组合报告附注

8.11.1 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。

8.11.2 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的备选股票库之外的股票。

8.11.3 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	1,118,301.63
2	应收证券清算款	88,293,125.67
3	应收股利	—
4	应收利息	1,978,924.58
5	应收申购款	9,617.20
6	其他应收款	—
7	待摊费用	—
8	其他	—
9	合计	91,399,969.08

8.11.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	110023	民生转债	313,221,509.30	4.46
2	113002	工行转债	217,089,673.00	3.09

8.11.5 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不存在流通受限情况。

8.11.6 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。

§9 基金份额持有人信息

9.1 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
458,345	20,537.89	536,875,168.82	5.70%	8,876,561,869.82	94.30%

注：持有人户数为有效户数，即存量份额大于零的账户数。

9.2 期末上市基金前十名持有人

序号	持有人名称	持有份额（份）	占上市总份额比例
1	吴颂今	2,222,398.00	2.01%
2	曾立志	2,022,629.00	1.83%
3	许书全	1,969,712.00	1.78%
4	易伟鸿	806,520.00	0.73%
5	孙巧云	775,507.00	0.70%
6	方群力	687,583.00	0.62%
7	陈彤华	622,272.00	0.56%
8	章萍	600,000.00	0.54%
9	陈远秀	568,690.00	0.51%
10	金凤云	555,599.00	0.50%

注：持有人为场内持有人。

9.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

无。

§ 10 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2007年6月12日）基金份额总额	1,000,000,000.00
本报告期期初基金份额总额	10,014,463,506.11
本报告期基金总申购份额	535,307,144.43
减：本报告期基金总赎回份额	1,136,333,611.90
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	9,413,437,038.64

§ 11 重大事件揭示

11.1 基金份额持有人大会决议

报告期内无基金份额持有人大会决议。

11.2 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

基金管理人在本报告期内重大人事变动情况：基金管理人于2013年10月11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》，刘明先生担任大成基金管理有限公司副总经理职务。

11.3 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。

11.4 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。

11.5 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普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)，本会计期间支付的审计费用为 165,000.00 元。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。

11.6 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。

11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

11.7.1 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	
招商证券	3	1,608,752,239.11	10.43%	1,460,272.64	10.51%	-
中信建投	3	1,339,356,724.43	8.68%	1,195,720.03	8.61%	-
齐鲁证券	1	981,871,334.10	6.37%	893,893.02	6.44%	-
宏源证券	1	913,617,376.85	5.92%	808,464.54	5.82%	-
兴业证券	2	910,394,031.47	5.90%	811,737.33	5.84%	-
英大证券	1	864,525,320.70	5.61%	787,064.51	5.67%	-
华创证券	1	860,545,518.52	5.58%	761,497.10	5.48%	-
上海证券	1	751,746,535.79	4.87%	684,385.89	4.93%	-
长城证券	2	634,193,189.71	4.11%	577,368.78	4.16%	-
东北证券	2	596,528,047.84	3.87%	539,072.62	3.88%	-
光大证券	2	551,916,231.60	3.58%	488,395.95	3.52%	-
瑞银证券	1	550,074,571.98	3.57%	500,785.46	3.61%	-
银河证券	4	517,519,514.49	3.36%	463,204.47	3.34%	-
北京高华	1	469,304,847.64	3.04%	427,255.72	3.08%	-

中信证券	2	449,884,830.80	2.92%	409,573.06	2.95%	—
申银万国	1	431,645,709.79	2.80%	392,966.83	2.83%	—
广发证券	1	404,539,838.89	2.62%	368,293.80	2.65%	—
中银国际	2	357,575,857.10	2.32%	323,278.22	2.33%	—
民生证券	1	356,795,025.04	2.31%	324,825.54	2.34%	—
东兴证券	1	349,143,764.74	2.26%	308,959.16	2.22%	—
方正证券	1	345,432,088.54	2.24%	314,474.26	2.26%	—
海通证券	1	303,054,627.77	1.97%	268,174.68	1.93%	—
中金公司	2	288,125,783.32	1.87%	255,333.10	1.84%	—
红塔证券	1	157,927,561.19	1.02%	143,777.98	1.04%	—
西部证券	1	145,935,105.33	0.95%	129,138.17	0.93%	—
华泰证券	1	139,032,414.80	0.90%	123,032.06	0.89%	—
世纪证券	1	55,938,974.75	0.36%	50,926.47	0.37%	—
国金证券	2	51,428,613.80	0.33%	45,509.34	0.33%	—
天风证券	1	35,811,936.86	0.23%	31,690.16	0.23%	—
浙商证券	1	—	0.00%	—	0.00%	—
国盛证券	1	—	0.00%	—	0.00%	—
国泰君安	2	—	0.00%	—	0.00%	—
国信证券	1	—	0.00%	—	0.00%	—
安信证券	1	—	0.00%	—	0.00%	—
南京证券	1	—	0.00%	—	0.00%	—
平安证券	1	—	0.00%	—	0.00%	—

注：1. 本报告期内本基金未退租交易单元，新增交易单元：银河证券、东兴证券。

2. 租用券商专用交易单元的选择标准和程序：

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：

- （1）财务状况良好，最近一年无重大违规行为；
- （2）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；
- （3）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；
- （4）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；
- （5）能提供投资组合运作、管理所需的其他券商服务；
- （6）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。

11.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例
招商证券	19,843,848.20	3.60%	-	0.00%	-	0.00%
中信建投	-	0.00%	-	0.00%	-	0.00%
齐鲁证券	-	0.00%	-	0.00%	-	0.00%
宏源证券	-	0.00%	-	0.00%	-	0.00%
兴业证券	-	0.00%	-	0.00%	-	0.00%
英大证券	7,819,449.30	1.42%	-	0.00%	-	0.00%
华创证券	-	0.00%	-	0.00%	-	0.00%
上海证券	95,148,618.60	17.25%	-	0.00%	-	0.00%
长城证券	-	0.00%	-	0.00%	-	0.00%
东北证券	194,783,553.10	35.31%	-	0.00%	-	0.00%
光大证券	-	0.00%	-	0.00%	-	0.00%
瑞银证券	95,420,257.50	17.30%	-	0.00%	-	0.00%
银河证券	1,167,899.40	0.21%	-	0.00%	-	0.00%
北京高华	-	0.00%	-	0.00%	-	0.00%
中信证券	-	0.00%	-	0.00%	-	0.00%
申银万国	-	0.00%	-	0.00%	-	0.00%
广发证券	-	0.00%	-	0.00%	-	0.00%
中银国际	-	0.00%	-	0.00%	-	0.00%
民生证券	-	0.00%	-	0.00%	-	0.00%
东兴证券	-	0.00%	-	0.00%	-	0.00%
方正证券	31,175,849.60	5.65%	-	0.00%	-	0.00%
海通证券	-	0.00%	-	0.00%	-	0.00%
中金公司	106,230,250.80	19.26%	-	0.00%	-	0.00%
红塔证券	-	0.00%	-	0.00%	-	0.00%
西部证券	-	0.00%	-	0.00%	-	0.00%
华泰证券	-	0.00%	-	0.00%	-	0.00%
世纪证券	-	0.00%	-	0.00%	-	0.00%
国金证券	-	0.00%	-	0.00%	-	0.00%

天风证券	-	0.00%	-	0.00%	-	0.00%
浙商证券	-	0.00%	-	0.00%	-	0.00%
国盛证券	-	0.00%	-	0.00%	-	0.00%
国泰君安	-	0.00%	-	0.00%	-	0.00%
国信证券	-	0.00%	-	0.00%	-	0.00%
安信证券	-	0.00%	-	0.00%	-	0.00%
南京证券	-	0.00%	-	0.00%	-	0.00%
平安证券	-	0.00%	-	0.00%	-	0.00%

§ 12 影响投资者决策的其他重要信息

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。

大成基金管理有限公司
2014 年 3 月 29 日