

大成内需增长股票型证券投资基金  
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。

基金托管人中国银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2014 年 3 月 27 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       | 大成内需增长股票         |
| 基金主代码      | 090015           |
| 交易代码       | 090015           |
| 基金运作方式     | 契约型开放式           |
| 基金合同生效日    | 2011 年 6 月 14 日  |
| 基金管理人      | 大成基金管理有限公司       |
| 基金托管人      | 中国银行股份有限公司       |
| 报告期末基金份额总额 | 378,692,059.90 份 |
| 基金合同存续期    | 不定期              |

### 2.2 基金产品说明

|        |  |
|--------|--|
| 投资目标   | 本基金主要投资于受益于内需增长的行业中的优质上市公司，力争充分分享中国经济增长以及经济结构转型带来的投资收益，追求基金资产的长期稳健增值。  |
| 投资策略   | 本基金采用积极主动的投资策略。以宏观经济和政策研究为基础，通过影响证券市场整体运行的内外部因素分析，实施大类资产配置；分析以内需增长为重要推动力的中国经济转型进程中的政策导向与经济结构调整的特点，研究国内消费需求以及与之紧密关联的投资需求的增长规律，结合经济周期与产业变迁路径的分析，实行业配置；以相关的投资主题和内需增长受益行业为线索，通过公司基本面的考量，精选优质上市公司股票，力求实现基金资产的长期稳健增值。为有效控制投资风险，本基金将根据风险管理的原则适度进行股指期货投资，股指期货投资将根据风险管理的原则，以套期保值为目的，并按照中国金融期货交易所套期保值管理的有关规定执行，对冲系统性风险和某些特殊情况下的流动性风险等。 |
| 业绩比较基准 | 80%×沪深 300 指数+20%×中证综合债券指数   |
| 风险收益特征 | 本基金为股票型基金，基金的风险与预期收益都要高于混合型基金、债券型基金和货币市场基金，属于证券投资基金中较高风险、较高预期收益的品种。  |

### 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    | 中国银行股份有限公司 |
| 信息披露负责人 | 姓名   | 杜鹏            | 唐州徽        |
|         | 联系电话 | 0755-83183388 | 95566      |

|        |      |                      |                      |
|--------|------|----------------------|----------------------|
|        | 电子邮箱 | dupeng@dcfund.com.cn | fcid@bankofchina.com |
| 客户服务电话 |      | 4008885558           | 95566                |
| 传真     |      | 0755-83199588        | 010-66594942         |

## 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<br>大成基金管理有限公司<br>北京市西城区复兴门内大街 1 号中国银行股份有限公司托管及投资者服务部 |

## § 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 6 月 14 日 (基金合同生效日)-2011 年 12 月 31 日 |
|---------------|----------------|----------------|--|
| 本期已实现收益       | 99,721,126.71  | -95,661,407.26 | -15,776,459.70                             |
| 本期利润          | 95,414,425.25  | 40,815,634.37  | -128,790,668.60                            |
| 加权平均基金份额本期利润  | 0.2600         | 0.0713         | -0.1304                                    |
| 本期基金份额净值增长率   | 25.73%         | 8.10%          | -17.30%                                    |
| 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  | 0.0701         | -0.2072        | -0.1727                                    |
| 期末基金资产净值      | 425,528,585.51 | 486,260,622.12 | 539,424,163.53                             |
| 期末基金份额净值      | 1.124          | 0.894          | 0.827                                      |

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。

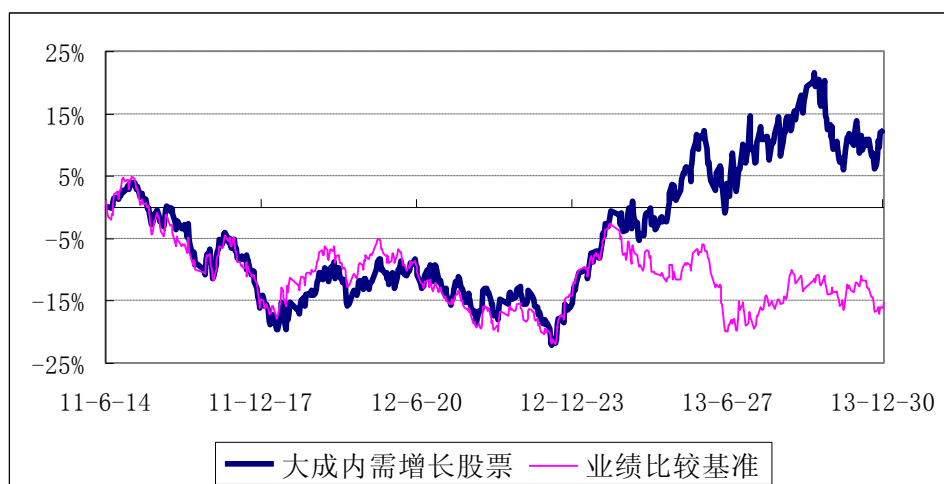
2、所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

### 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

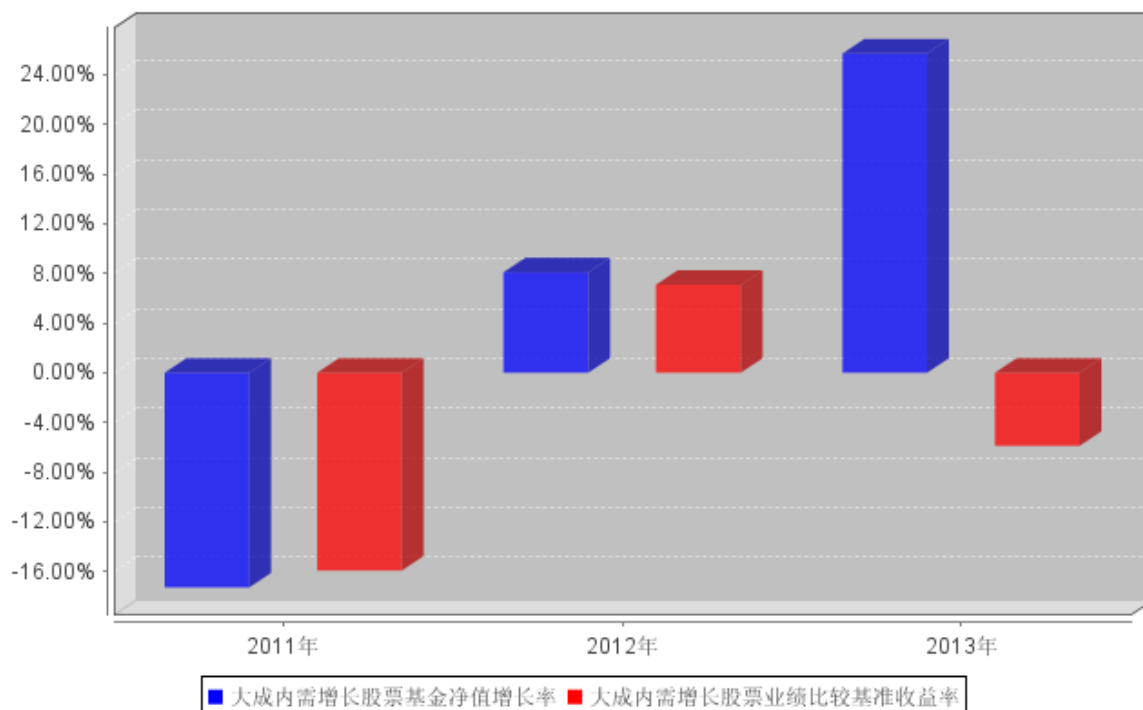
| 阶段         | 份额净值增长率① | 份额净值增长率标准差② | 业绩比较基准收益率③ | 业绩比较基准收益率标准差④ | ①—③    | ②—④   |
|------------|----------|-------------|------------|---------------|--------|-------|
| 过去三个月      | -5.86%   | 1.43%       | -2.93%     | 0.90%         | -2.93% | 0.53% |
| 过去六个月      | 10.52%   | 1.54%       | 4.30%      | 1.03%         | 6.22%  | 0.51% |
| 过去一年       | 25.73%   | 1.49%       | -5.90%     | 1.12%         | 31.63% | 0.37% |
| 自基金合同生效起至今 | 12.40%   | 1.28%       | -15.30%    | 1.07%         | 27.70% | 0.21% |

#### 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。

### 3.2.3 自基金合同生效以来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



注：2011 年净值增长率表现期间为 2011 年 6 月 14 日(基金合同生效日)至 2011 年 12 月 31 日。

### 3.3 过去三年基金的利润分配情况

本基金过去三年未进行利润分配。

## § 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            |        |  |
| 李本刚先生 | 本基金基金经理   | 2012 年 9 月 4 日  | -               | 12 年   | 管理学硕士。2001 年至 2010 年先后就职于西南证券股份有限公司、中关村证券股份有限公司和建信基金管理有限公司，历任研究员、高级研究员。2010 年 8 月加入大成基金管理有限公司，历任研究部高级研究员、行业研究主管。2012 年 9 月 4 日起任大成内需增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 |
| 邓涛先生  | 本基金基金经理助理 | 2011 年 7 月 29 日 | -               | 5 年    | 经济学硕士，2008 年 6 月至 2009 年 2 月就职于长江证券研究部，2009 年 2 月加入大成基金管理有限公司，现任研究部总监助理，2011 年 7 月 29 日起担任景福证券投资基金和大成内需增长股票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                            |
| 杨丹先生  | 本基金基金经理   | 2011 年 6 月 14 日 | 2013 年 7 月 17 日 | 12 年   | 理学硕士。2001 年加入大成基金管理有限公司，先后任职于基金经理部、研究部、金融工程部、股票投资部。2006 年 5 月 27 日至 2011 年 6 月 14 日曾任大成沪深 300 指数证  |

|  |  |  |  |  |   |
|--|--|--|--|--|---|
|  |  |  |  |  | 券投资基金基金经理。2011 年 6 月 14 日至 2013 年 7 月 17 日任大成内需增长股票型证券投资基金基金经理。2008 年 8 月 23 日开始担任景福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》、《大成内需增长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，大成内需增长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 年的中国证券市场典型特征是结构分化，以创业板为代表的新模式、新产业取得惊人的收益，以沪深 300 为代表的传统产业则录得负收益。因此，在 2013 年组合构建过程中，行业配置重要性上升。

回顾本基金 2013 年运作，有经验也有不足。年初重点抓住了受益转型的 TMT 行业，为全年取得超额收益奠定了良好的基础；但是对中国经济转型的深刻性认识不足，过早降低相关行业权重，使得基金下半年表现不够出色。

##### 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 1.124 元，本报告期基金份额净值增长率为 25.73%，同期业绩比较基准收益率为-5.90%，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

经过 2013 年，中国经济转型已经深入人心，传统周期性行业衰落已经成为资本市场的共识。但是，这一切已经在资本市场上得到充分的反应，凡是与转型相关的上市公司，其估值处于相对高位，预期差较小，降低了能够获得超额收益的空间。

为了应对资本市场这种改变，2014 年需要提高个股选择在组合构建过程中的重要性，如果说 2013 年是行业配置成为投资过程的关键，那么 2014 年个股选择将成为投资超额收益的“胜负手”，只有正确选择合适的个股，才能获得超额收益。

#### 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，中国银行股份有限公司（以下称“本托管人”）在对大成内需增长股票型证券投资基金（以下称“本基金”）的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了应尽的义务。

## 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

本报告期内，本托管人根据《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，对本基金管理人的投资运作进行了必要的监督，对基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算以及基金费用开支等方面进行了认真地复核，未发现本基金管理人存在损害基金份额持有人利益的行为。

## 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

本报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告（注：财务会计报告中的“金融工具风险及管理”部分未在托管人复核范围内）、投资组合报告等数据真实、准确和完整。

## § 6 审计报告

本基金 2013 年年度财务会计报告已经普华永道中天会计师事务所有限公司(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：大成内需增长股票型证券投资基金

报告截止日：2013 年 12 月 31 日

单位：人民币元

| 资产         | 本期末<br>2013 年 12 月 31 日 | 上年度末<br>2012 年 12 月 31 日 |
|------------|-------------------------|--------------------------|
| <b>资产：</b> |                         |                          |
| 银行存款       | 14,811,214.25           | 73,615,275.65            |
| 结算备付金      | 15,051,216.14           | 1,556,245.74             |
| 存出保证金      | 360,114.18              | 104,855.92               |
| 交易性金融资产    | 336,383,261.16          | 412,888,284.98           |
| 其中：股票投资    | 336,383,261.16          | 412,888,284.98           |
| 基金投资       | -                       | -                        |
| 债券投资       | -                       | -                        |
| 资产支持证券投资   | -                       | -                        |
| 衍生金融资产     | -                       | -                        |
| 买入返售金融资产   | -                       | -                        |
| 应收证券清算款    | 13,346,854.83           | 3,061,610.47             |
| 应收利息       | 6,917.22                | 20,304.28                |
| 应收股利       | -                       | -                        |

|                 |                            |                             |
|-----------------|----------------------------|-----------------------------|
| 应收申购款           | 50,732,127.43              | 1,482.78                    |
| 递延所得税资产         | -                          | -                           |
| 其他资产            | -                          | -                           |
| 资产总计            | 430,691,705.21             | 491,248,059.82              |
| <b>负债和所有者权益</b> | <b>本期末<br/>2013年12月31日</b> | <b>上年度末<br/>2012年12月31日</b> |
| <b>负 债:</b>     |                            |                             |
| 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         | -                          | 2,359,488.19                |
| 应付赎回款           | 2,567,465.27               | 431,769.02                  |
| 应付管理人报酬         | 476,518.85                 | 577,414.04                  |
| 应付托管费           | 79,419.80                  | 96,235.69                   |
| 应付销售服务费         | -                          | -                           |
| 应付交易费用          | 1,880,323.62               | 1,341,703.97                |
| 应交税费            | -                          | -                           |
| 应付利息            | -                          | -                           |
| 应付利润            | -                          | -                           |
| 递延所得税负债         | -                          | -                           |
| 其他负债            | 159,392.16                 | 180,826.79                  |
| 负债合计            | 5,163,119.70               | 4,987,437.70                |
| <b>所有者权益:</b>   |                            |                             |
| 实收基金            | 378,692,059.90             | 544,179,652.88              |
| 未分配利润           | 46,836,525.61              | -57,919,030.76              |
| 所有者权益合计         | 425,528,585.51             | 486,260,622.12              |
| 负债和所有者权益总计      | 430,691,705.21             | 491,248,059.82              |

注：报告截止日 2013 年 12 月 31 日，基金份额净值 1.124 元，基金份额总额 378,692,059.90 份。

## 7.2 利润表

会计主体：大成内需增长股票型证券投资基金

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<br>2013年1月1日至2013<br>年12月31日 | 上年度可比期间<br>2012年1月1日至2012<br>年12月31日 |
|-------------|---------------------------------|--------------------------------------|
| <b>一、收入</b> | 112,275,933.65                  | 54,520,453.51                        |
| 1. 利息收入     | 548,031.96                      | 504,900.32                           |
| 其中：存款利息收入   | 526,445.86                      | 504,900.32                           |
| 债券利息收入      | 734.72                          | -                                    |
| 资产支持证券利息收入  | -                               | -                                    |

|                            |                      |                      |
|----------------------------|----------------------|----------------------|
| 买入返售金融资产收入                 | 20,851.38            | -                    |
| 其他利息收入                     | -                    | -                    |
| 2. 投资收益（损失以“-”填列）          | 115,464,408.71       | -82,617,121.55       |
| 其中：股票投资收益                  | 112,936,850.16       | -90,116,202.76       |
| 基金投资收益                     | -                    | -                    |
| 债券投资收益                     | 102,387.52           | -                    |
| 资产支持证券投资收益                 | -                    | -                    |
| 衍生工具收益                     | -115,980.00          | -                    |
| 股利收益                       | 2,541,151.03         | 7,499,081.21         |
| 3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）     | -4,306,701.46        | 136,477,041.63       |
| 4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）         | -                    | -                    |
| 5. 其他收入（损失以“-”号填列）         | 570,194.44           | 155,633.11           |
| <b>减：二、费用</b>              | <b>16,861,508.40</b> | <b>13,704,819.14</b> |
| 1. 管理人报酬                   | 5,784,199.64         | 7,420,665.93         |
| 2. 托管费                     | 964,033.21           | 1,236,777.75         |
| 3. 销售服务费                   | -                    | -                    |
| 4. 交易费用                    | 9,710,637.74         | 4,631,593.91         |
| 5. 利息支出                    | -                    | -                    |
| 其中：卖出回购金融资产支出              | -                    | -                    |
| 6. 其他费用                    | 402,637.81           | 415,781.55           |
| <b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b> | <b>95,414,425.25</b> | <b>40,815,634.37</b> |
| 减：所得税费用                    | -                    | -                    |
| <b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>   | <b>95,414,425.25</b> | <b>40,815,634.37</b> |

### 7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：大成内需增长股票型证券投资基金

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<br>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）                       | 544,179,652.88                         | -57,919,030.76 | 486,260,622.12  |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）              | -                                      | 95,414,425.25  | 95,414,425.25   |
| 三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数<br>（净值减少以“-”号填列） | -165,487,592.98                        | 9,341,131.12   | -156,146,461.86 |
| 其中：1. 基金申购款                           | 489,331,237.52                         | 55,833,663.60  | 545,164,901.12  |

|  |   |                 |                 |
|--|---|-----------------|-----------------|
| 2. 基金赎回款                               | -654,818,830.50                             | -46,492,532.48  | -701,311,362.98 |
| 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）                        | 378,692,059.90                              | 46,836,525.61   | 425,528,585.51  |
| 项目                                     | 上年度可比期间<br>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）                        | 652,012,281.16                              | -112,588,117.63 | 539,424,163.53  |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）               | -   | 40,815,634.37   | 40,815,634.37   |
| 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）      | -107,832,628.28                             | 13,853,452.50   | -93,979,175.78  |
| 其中：1. 基金申购款                            | 62,669,294.69                               | -8,662,568.56   | 54,006,726.13   |
| 2. 基金赎回款                               | -170,501,922.97                             | 22,516,021.06   | -147,985,901.91 |
| 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）                        | 544,179,652.88                              | -57,919,030.76  | 486,260,622.12  |

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，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、注册登记机构、基金销售机构 |
| 中国银行股份有限公司(“中国银行”)     | 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<br>2013 年 1 月 1 日至 2013 年 12 月 31 日 |                      | 上年度可比期间<br>2012 年 1 月 1 日至 2012 年 12 月 31 日 |                      |
|-------|--|----------------------|---|----------------------|
|       | 成交金额                                   | 占当期股票<br>成交总额的<br>比例 | 成交金额  | 占当期股票<br>成交总额的比<br>例 |
| 光大证券  | 131,539,511.64                         | 2.07%                | 274,198,514.32                              | 9.09%                |

**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<br>2013年1月1日至2013年12月31日      |                |            |                  |
|-------|----------------------------------|----------------|------------|------------------|
|       | 当期<br>佣金                         | 占当期佣金<br>总量的比例 | 期末应付佣金余额   | 占期末应付佣金<br>总额的比例 |
| 光大证券  | 117,078.69                       | 2.05%          | 20,931.21  | 1.11%            |
| 关联方名称 | 上年度可比期间<br>2012年1月1日至2012年12月31日 |                |            |                  |
|       | 当期<br>佣金                         | 占当期佣金<br>总量的比例 | 期末应付佣金余额   | 占期末应付佣金<br>总额的比例 |
| 光大证券  | 235,608.71                       | 8.99%          | 121,297.12 | 9.04%            |

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<br>2013年1月1日至2013年12<br>月31日 | 上年度可比期间<br>2012年1月1日至2012年12月31<br>日 |
|-----------------|---------------------------------|--------------------------------------|
|                 | 当期发生的基金应支付的管理费                  | 5,784,199.64                         |
| 其中：支付销售机构的客户维护费 | 1,891,446.79                    | 2,492,086.36                         |

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：

日管理人报酬 = 前一日基金资产净值 X 1.5% / 当年天数。

**7.4.4.2.2 基金托管费**

单位：人民币元

| 项目 | 本期<br>2013年1月1日至2013年12<br>月31日 | 上年度可比期间<br>2012年1月1日至2012年12月31<br>日 |
|----|---------------------------------|--------------------------------------|
|    |                                 |                                      |



|                |            |              |
|----------------|------------|--------------|
| 当期发生的基金应支付的托管费 | 964,033.21 | 1,236,777.75 |
|----------------|------------|--------------|

注：支付基金托管人 中国银行 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：

日托管费 = 前一日基金资产净值 X 0.25% / 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

本报告期内及上年度可比期间基金管理人未运用固有资金投资本基金。

##### 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。

#### 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<br>2013年1月1日至2013年12月31日 |            | 上年度可比期间<br>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     |
| 中国银行  | 14,811,214.25               | 473,407.54 | 73,615,275.65                    | 490,693.07 |

注：本基金的银行存款由基金托管人中国银行保管，按银行同业利率计息。

#### 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

本基金本期末未持有因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券。

##### 7.4.5.2 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 |
|--------|------|-------------|--------|--------|------------|--------|---------|---------------|---------------|----|
| 002022 | 科华生物 | 2013年12月20日 | 重大事项   | 16.82  | 2014年1月27日 | 18.50  | 779,908 | 12,894,646.66 | 13,118,052.56 | -  |
| 000625 | 长安汽车 | 2013年12月31日 | 重大事项   | 11.45  | 2014年1月3日  | 11.72  | 500,000 | 5,196,990.24  | 5,725,000.00  | -  |
| 300071 | 华谊嘉信 | 2013年11月25日 | 重大资产重组 | 29.00  | 未知         | 未知     | 128,800 | 3,271,799.26  | 3,735,200.00  | -  |

注：本基金截至本报告期末持有以上因公布的重大事项可能产生重大影响而被暂时停牌的股票，该类股票将在所公布事项的重大影响消除后，经交易所批准复牌。

#### 7.4.5.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

##### 7.4.5.3.1 银行间市场债券正回购

于本报告期末，本基金无从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

##### 7.4.5.3.2 交易所市场债券正回购

于本报告期末，本基金无从事交易所市场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              | 336,383,261.16 | 78.10        |
|    | 其中：股票             | 336,383,261.16 | 78.10        |
| 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      | 29,862,430.39  | 6.93         |
| 6  | 其他各项资产            | 64,446,013.66  | 14.96        |
| 7  | 合计                | 430,691,705.21 | 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         | 5,453,626.64   | 1.28         |
| B  | 采矿业              | 20,603,455.52  | 4.84         |
| C  | 制造业              | 262,565,947.75 | 61.70        |
| D  | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | -              | 0.00         |
| E  | 建筑业              | -              | 0.00         |
| 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  | 37,809,031.25  | 8.89         |
| J  | 金融业              | -              | 0.00         |
| K  | 房地产业             | -              | 0.00         |
| L  | 租赁和商务服务业         | 9,951,200.00   | 2.34         |
| 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               | 336,383,261.16 | 79.05        |

## 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  | 002230 | 科大讯飞 | 329,849   | 15,783,274.65 | 3.71         |
| 2  | 002385 | 大北农  | 949,941   | 15,531,535.35 | 3.65         |
| 3  | 002035 | 华帝股份 | 1,187,976 | 14,528,946.48 | 3.41         |
| 4  | 600527 | 江南高纤 | 1,902,485 | 13,279,345.30 | 3.12         |

|    |        |      |         |               |      |
|----|--------|------|---------|---------------|------|
| 5  | 002022 | 科华生物 | 779,908 | 13,118,052.56 | 3.08 |
| 6  | 002683 | 宏大爆破 | 408,934 | 12,791,455.52 | 3.01 |
| 7  | 000581 | 威孚高科 | 400,000 | 12,320,000.00 | 2.90 |
| 8  | 002008 | 大族激光 | 911,680 | 12,298,563.20 | 2.89 |
| 9  | 000651 | 格力电器 | 350,000 | 11,431,000.00 | 2.69 |
| 10 | 002292 | 奥飞动漫 | 336,277 | 10,982,806.82 | 2.58 |

注：投资者欲了解本报告期末基金指数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  | 000001 | 平安银行 | 64,820,601.15 | 13.33          |
| 2  | 300027 | 华谊兄弟 | 49,646,101.05 | 10.21          |
| 3  | 002570 | 贝因美  | 48,247,867.87 | 9.92           |
| 4  | 300251 | 光线传媒 | 40,511,289.29 | 8.33           |
| 5  | 600801 | 华新水泥 | 40,032,071.12 | 8.23           |
| 6  | 002415 | 海康威视 | 40,015,364.67 | 8.23           |
| 7  | 600016 | 民生银行 | 39,428,136.50 | 8.11           |
| 8  | 600703 | 三安光电 | 38,686,101.80 | 7.96           |
| 9  | 600633 | 浙报传媒 | 38,176,045.03 | 7.85           |
| 10 | 000651 | 格力电器 | 37,787,215.79 | 7.77           |
| 11 | 002482 | 广田股份 | 35,573,227.26 | 7.32           |
| 12 | 002292 | 奥飞动漫 | 33,858,165.61 | 6.96           |
| 13 | 000063 | 中兴通讯 | 31,533,507.86 | 6.48           |
| 14 | 300133 | 华策影视 | 31,398,790.58 | 6.46           |
| 15 | 300315 | 掌趣科技 | 30,306,424.10 | 6.23           |
| 16 | 600887 | 伊利股份 | 30,285,879.82 | 6.23           |
| 17 | 000002 | 万科A  | 30,013,312.58 | 6.17           |
| 18 | 300336 | 新文化  | 29,973,637.65 | 6.16           |
| 19 | 300303 | 聚飞光电 | 29,732,532.86 | 6.11           |
| 20 | 600036 | 招商银行 | 27,885,305.56 | 5.73           |
| 21 | 600585 | 海螺水泥 | 27,552,442.78 | 5.67           |

|    |        |      |               |      |
|----|--------|------|---------------|------|
| 22 | 600067 | 冠城大通 | 27,334,594.50 | 5.62 |
| 23 | 601901 | 方正证券 | 27,244,400.19 | 5.60 |
| 24 | 300115 | 长盈精密 | 27,173,388.82 | 5.59 |
| 25 | 600637 | 百视通  | 26,383,779.05 | 5.43 |
| 26 | 002022 | 科华生物 | 26,307,454.01 | 5.41 |
| 27 | 002008 | 大族激光 | 26,282,819.26 | 5.41 |
| 28 | 000581 | 威孚高科 | 26,220,526.77 | 5.39 |
| 29 | 601928 | 凤凰传媒 | 26,110,384.03 | 5.37 |
| 30 | 601166 | 兴业银行 | 25,971,666.77 | 5.34 |
| 31 | 002230 | 科大讯飞 | 25,392,269.41 | 5.22 |
| 32 | 300207 | 欣旺达  | 25,332,932.12 | 5.21 |
| 33 | 601377 | 兴业证券 | 25,115,566.29 | 5.17 |
| 34 | 600880 | 博瑞传播 | 24,676,662.68 | 5.07 |
| 35 | 000333 | 美的集团 | 24,397,845.20 | 5.02 |
| 36 | 300301 | 长方照明 | 24,348,775.27 | 5.01 |
| 37 | 002313 | 日海通讯 | 24,211,839.09 | 4.98 |
| 38 | 300002 | 神州泰岳 | 23,928,585.51 | 4.92 |
| 39 | 300058 | 蓝色光标 | 23,509,992.69 | 4.83 |
| 40 | 002005 | 德豪润达 | 23,460,887.92 | 4.82 |
| 41 | 002148 | 北纬通信 | 23,034,366.86 | 4.74 |
| 42 | 600518 | 康美药业 | 22,739,409.01 | 4.68 |
| 43 | 600261 | 阳光照明 | 22,489,626.28 | 4.63 |
| 44 | 300284 | 苏交科  | 22,394,482.34 | 4.61 |
| 45 | 002064 | 华峰氨纶 | 22,238,869.31 | 4.57 |
| 46 | 601222 | 林洋电子 | 21,920,441.39 | 4.51 |
| 47 | 000049 | 德赛电池 | 20,502,505.90 | 4.22 |
| 48 | 300088 | 长信科技 | 20,340,165.61 | 4.18 |
| 49 | 002648 | 卫星石化 | 19,986,647.75 | 4.11 |
| 50 | 600196 | 复星医药 | 19,644,671.30 | 4.04 |
| 51 | 600332 | 白云山  | 19,282,934.44 | 3.97 |
| 52 | 002385 | 大北农  | 19,157,093.19 | 3.94 |
| 53 | 600467 | 好当家  | 18,520,438.53 | 3.81 |
| 54 | 002063 | 远光软件 | 18,420,322.54 | 3.79 |
| 55 | 002081 | 金螳螂  | 18,307,240.25 | 3.76 |
| 56 | 000527 | 美的电器 | 17,940,886.73 | 3.69 |
| 57 | 601607 | 上海医药 | 17,922,367.11 | 3.69 |

|    |        |      |               |      |
|----|--------|------|---------------|------|
| 58 | 002035 | 华帝股份 | 17,846,210.68 | 3.67 |
| 59 | 002157 | 正邦科技 | 17,276,042.66 | 3.55 |
| 60 | 002138 | 顺络电子 | 17,093,676.11 | 3.52 |
| 61 | 000917 | 电广传媒 | 17,036,973.19 | 3.50 |
| 62 | 600267 | 海正药业 | 16,631,156.23 | 3.42 |
| 63 | 600383 | 金地集团 | 16,438,521.09 | 3.38 |
| 64 | 000656 | 金科股份 | 16,398,608.10 | 3.37 |
| 65 | 600522 | 中天科技 | 16,027,408.24 | 3.30 |
| 66 | 601098 | 中南传媒 | 15,631,382.18 | 3.21 |
| 67 | 600352 | 浙江龙盛 | 15,616,774.16 | 3.21 |
| 68 | 600498 | 烽火通信 | 15,607,431.63 | 3.21 |
| 69 | 002465 | 海格通信 | 15,514,136.85 | 3.19 |
| 70 | 000625 | 长安汽车 | 15,399,294.57 | 3.17 |
| 71 | 600309 | 万华化学 | 15,121,695.16 | 3.11 |
| 72 | 600162 | 香江控股 | 14,696,017.98 | 3.02 |
| 73 | 600388 | 龙净环保 | 14,657,682.70 | 3.01 |
| 74 | 002055 | 得润电子 | 14,601,213.72 | 3.00 |
| 75 | 600805 | 悦达投资 | 14,483,685.87 | 2.98 |
| 76 | 601808 | 中海油服 | 14,358,174.07 | 2.95 |
| 77 | 601888 | 中国国旅 | 14,352,016.49 | 2.95 |
| 78 | 600252 | 中恒集团 | 14,094,318.14 | 2.90 |
| 79 | 300052 | 中青宝  | 14,076,281.61 | 2.89 |
| 80 | 002106 | 莱宝高科 | 14,045,770.11 | 2.89 |
| 81 | 600030 | 中信证券 | 13,941,624.91 | 2.87 |
| 82 | 600750 | 江中药业 | 13,780,894.88 | 2.83 |
| 83 | 300075 | 数字政通 | 13,366,120.42 | 2.75 |
| 84 | 300310 | 宜通世纪 | 13,277,471.86 | 2.73 |
| 85 | 002308 | 威创股份 | 13,204,352.27 | 2.72 |
| 86 | 600827 | 友谊股份 | 13,165,586.93 | 2.71 |
| 87 | 300071 | 华谊嘉信 | 13,125,586.09 | 2.70 |
| 88 | 000537 | 广宇发展 | 13,103,754.06 | 2.69 |
| 89 | 600527 | 江南高纤 | 12,655,460.59 | 2.60 |
| 90 | 300134 | 大富科技 | 12,481,242.96 | 2.57 |
| 91 | 600372 | 中航电子 | 12,444,021.11 | 2.56 |
| 92 | 300020 | 银江股份 | 12,407,886.20 | 2.55 |
| 93 | 300291 | 华录百纳 | 12,302,551.38 | 2.53 |

|     |        |        |               |      |
|-----|--------|--------|---------------|------|
| 94  | 002683 | 宏大爆破   | 12,143,916.20 | 2.50 |
| 95  | 000800 | 一汽轿车   | 12,117,370.44 | 2.49 |
| 96  | 600649 | 城投控股   | 11,998,398.78 | 2.47 |
| 97  | 000100 | TCL 集团 | 11,976,786.20 | 2.46 |
| 98  | 000826 | 桑德环境   | 11,729,474.40 | 2.41 |
| 99  | 600804 | 鹏博士    | 11,621,677.77 | 2.39 |
| 100 | 002440 | 闰土股份   | 11,620,883.93 | 2.39 |
| 101 | 600612 | 老凤祥    | 11,559,686.48 | 2.38 |
| 102 | 002146 | 荣盛发展   | 11,473,525.46 | 2.36 |
| 103 | 000823 | 超声电子   | 11,254,195.06 | 2.31 |
| 104 | 300155 | 安居宝    | 11,233,363.34 | 2.31 |
| 105 | 600073 | 上海梅林   | 11,062,378.19 | 2.27 |
| 106 | 601006 | 大秦铁路   | 11,039,559.63 | 2.27 |
| 107 | 600741 | 华域汽车   | 11,033,425.85 | 2.27 |
| 108 | 300219 | 鸿利光电   | 10,799,410.10 | 2.22 |
| 109 | 300079 | 数码视讯   | 10,759,168.41 | 2.21 |
| 110 | 300256 | 星星科技   | 10,585,395.67 | 2.18 |
| 111 | 002226 | 江南化工   | 10,505,885.72 | 2.16 |
| 112 | 002317 | 众生药业   | 10,411,273.14 | 2.14 |
| 113 | 002271 | 东方雨虹   | 10,378,482.65 | 2.13 |
| 114 | 002658 | 雪迪龙    | 10,374,295.90 | 2.13 |
| 115 | 600271 | 航天信息   | 10,105,334.00 | 2.08 |
| 116 | 002605 | 姚记扑克   | 10,104,194.18 | 2.08 |
| 117 | 600835 | 上海机电   | 10,071,795.78 | 2.07 |
| 118 | 002462 | 嘉事堂    | 9,909,947.59  | 2.04 |
| 119 | 600832 | 东方明珠   | 9,802,049.07  | 2.02 |

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  | 000001 | 平安银行 | 64,703,003.73 | 13.31          |
| 2  | 300027 | 华谊兄弟 | 56,405,236.17 | 11.60          |
| 3  | 002570 | 贝因美  | 52,340,956.56 | 10.76          |
| 4  | 300251 | 光线传媒 | 52,174,653.04 | 10.73          |

|    |        |      |               |      |
|----|--------|------|---------------|------|
| 5  | 000527 | 美的电器 | 48,002,568.61 | 9.87 |
| 6  | 600016 | 民生银行 | 47,713,226.76 | 9.81 |
| 7  | 600637 | 百视通  | 47,194,531.25 | 9.71 |
| 8  | 002415 | 海康威视 | 42,150,035.21 | 8.67 |
| 9  | 600633 | 浙报传媒 | 40,289,038.14 | 8.29 |
| 10 | 600518 | 康美药业 | 39,418,058.78 | 8.11 |
| 11 | 600801 | 华新水泥 | 39,320,331.89 | 8.09 |
| 12 | 000826 | 桑德环境 | 38,035,456.86 | 7.82 |
| 13 | 300315 | 掌趣科技 | 38,028,586.58 | 7.82 |
| 14 | 000002 | 万科A  | 35,822,764.18 | 7.37 |
| 15 | 601377 | 兴业证券 | 35,326,447.29 | 7.26 |
| 16 | 002482 | 广田股份 | 34,651,774.65 | 7.13 |
| 17 | 601166 | 兴业银行 | 34,511,236.31 | 7.10 |
| 18 | 300133 | 华策影视 | 33,511,347.55 | 6.89 |
| 19 | 300336 | 新文化  | 30,916,184.36 | 6.36 |
| 20 | 300303 | 聚飞光电 | 30,660,136.68 | 6.31 |
| 21 | 000063 | 中兴通讯 | 30,336,355.86 | 6.24 |
| 22 | 600703 | 三安光电 | 30,081,390.23 | 6.19 |
| 23 | 600887 | 伊利股份 | 29,558,500.10 | 6.08 |
| 24 | 600383 | 金地集团 | 29,154,070.79 | 6.00 |
| 25 | 000651 | 格力电器 | 28,938,012.57 | 5.95 |
| 26 | 601928 | 凤凰传媒 | 28,498,261.39 | 5.86 |
| 27 | 601901 | 方正证券 | 27,908,977.40 | 5.74 |
| 28 | 300284 | 苏交科  | 27,882,415.85 | 5.73 |
| 29 | 600036 | 招商银行 | 27,425,967.55 | 5.64 |
| 30 | 300207 | 欣旺达  | 27,294,297.77 | 5.61 |
| 31 | 600067 | 冠城大通 | 27,066,936.61 | 5.57 |
| 32 | 300058 | 蓝色光标 | 26,479,417.19 | 5.45 |
| 33 | 600585 | 海螺水泥 | 26,313,028.82 | 5.41 |
| 34 | 300301 | 长方照明 | 24,602,939.70 | 5.06 |
| 35 | 000012 | 南玻A  | 24,589,774.34 | 5.06 |
| 36 | 002313 | 日海通讯 | 23,823,224.07 | 4.90 |
| 37 | 600880 | 博瑞传播 | 23,255,104.22 | 4.78 |
| 38 | 002292 | 奥飞动漫 | 23,203,845.42 | 4.77 |
| 39 | 000049 | 德赛电池 | 22,888,911.56 | 4.71 |
| 40 | 002005 | 德豪润达 | 22,369,467.66 | 4.60 |
| 41 | 002148 | 北纬通信 | 21,781,988.78 | 4.48 |
| 42 | 002106 | 莱宝高科 | 21,708,694.54 | 4.46 |



|    |        |      |               |      |
|----|--------|------|---------------|------|
| 43 | 002064 | 华峰氨纶 | 21,509,905.22 | 4.42 |
| 44 | 300115 | 长盈精密 | 21,441,718.15 | 4.41 |
| 45 | 601222 | 林洋电子 | 21,165,271.93 | 4.35 |
| 46 | 002648 | 卫星石化 | 20,726,278.76 | 4.26 |
| 47 | 600805 | 悦达投资 | 20,677,909.85 | 4.25 |
| 48 | 600332 | 白云山  | 20,649,499.39 | 4.25 |
| 49 | 300002 | 神州泰岳 | 20,232,043.20 | 4.16 |
| 50 | 300088 | 长信科技 | 19,983,575.99 | 4.11 |
| 51 | 600467 | 好当家  | 18,996,267.77 | 3.91 |
| 52 | 002081 | 金螳螂  | 18,320,479.23 | 3.77 |
| 53 | 600837 | 海通证券 | 18,018,243.52 | 3.71 |
| 54 | 601601 | 中国太保 | 17,914,257.40 | 3.68 |
| 55 | 002063 | 远光软件 | 17,505,100.07 | 3.60 |
| 56 | 002138 | 顺络电子 | 17,416,743.43 | 3.58 |
| 57 | 000917 | 电广传媒 | 17,410,441.60 | 3.58 |
| 58 | 601318 | 中国平安 | 17,368,970.63 | 3.57 |
| 59 | 002142 | 宁波银行 | 17,093,243.69 | 3.52 |
| 60 | 601169 | 北京银行 | 16,980,040.75 | 3.49 |
| 61 | 601607 | 上海医药 | 16,666,448.02 | 3.43 |
| 62 | 600498 | 烽火通信 | 16,404,029.48 | 3.37 |
| 63 | 600267 | 海正药业 | 16,249,250.09 | 3.34 |
| 64 | 600261 | 阳光照明 | 16,243,914.31 | 3.34 |
| 65 | 300147 | 香雪制药 | 16,231,590.55 | 3.34 |
| 66 | 000656 | 金科股份 | 16,124,822.49 | 3.32 |
| 67 | 600522 | 中天科技 | 16,116,714.16 | 3.31 |
| 68 | 000333 | 美的集团 | 16,099,879.36 | 3.31 |
| 69 | 002055 | 得润电子 | 16,094,023.27 | 3.31 |
| 70 | 000629 | 攀钢钒钛 | 16,018,586.57 | 3.29 |
| 71 | 600352 | 浙江龙盛 | 16,011,540.90 | 3.29 |
| 72 | 002157 | 正邦科技 | 15,949,054.96 | 3.28 |
| 73 | 601098 | 中南传媒 | 15,716,922.18 | 3.23 |
| 74 | 600000 | 浦发银行 | 15,459,847.02 | 3.18 |
| 75 | 000581 | 威孚高科 | 15,407,643.57 | 3.17 |
| 76 | 601888 | 中国国旅 | 15,193,780.14 | 3.12 |
| 77 | 002022 | 科华生物 | 14,980,656.60 | 3.08 |
| 78 | 300113 | 顺网科技 | 14,967,734.75 | 3.08 |
| 79 | 600162 | 香江控股 | 14,451,057.11 | 2.97 |
| 80 | 300020 | 银江股份 | 14,074,152.14 | 2.89 |

|     |        |        |               |      |
|-----|--------|--------|---------------|------|
| 81  | 600252 | 中恒集团   | 14,038,246.92 | 2.89 |
| 82  | 002008 | 大族激光   | 13,870,885.47 | 2.85 |
| 83  | 300052 | 中青宝    | 13,740,631.10 | 2.83 |
| 84  | 600388 | 龙净环保   | 13,619,992.39 | 2.80 |
| 85  | 002230 | 科大讯飞   | 13,563,430.06 | 2.79 |
| 86  | 600030 | 中信证券   | 13,193,825.04 | 2.71 |
| 87  | 002271 | 东方雨虹   | 13,113,636.19 | 2.70 |
| 88  | 600750 | 江中药业   | 13,039,089.99 | 2.68 |
| 89  | 601328 | 交通银行   | 13,017,000.00 | 2.68 |
| 90  | 300310 | 宜通世纪   | 12,912,174.49 | 2.66 |
| 91  | 002146 | 荣盛发展   | 12,911,851.20 | 2.66 |
| 92  | 300075 | 数字政通   | 12,904,112.44 | 2.65 |
| 93  | 300291 | 华录百纳   | 12,853,693.83 | 2.64 |
| 94  | 000100 | TCL 集团 | 12,789,047.54 | 2.63 |
| 95  | 600827 | 友谊股份   | 12,773,751.57 | 2.63 |
| 96  | 300079 | 数码视讯   | 12,767,159.90 | 2.63 |
| 97  | 000537 | 广宇发展   | 12,553,552.66 | 2.58 |
| 98  | 600804 | 鹏博士    | 12,301,654.83 | 2.53 |
| 99  | 300134 | 大富科技   | 12,241,626.63 | 2.52 |
| 100 | 002308 | 威创股份   | 11,943,535.65 | 2.46 |
| 101 | 600741 | 华域汽车   | 11,813,617.77 | 2.43 |
| 102 | 300256 | 星星科技   | 11,593,988.08 | 2.38 |
| 103 | 002658 | 雪迪龙    | 11,557,948.68 | 2.38 |
| 104 | 300155 | 安居宝    | 11,546,397.65 | 2.37 |
| 105 | 600372 | 中航电子   | 11,535,112.75 | 2.37 |
| 106 | 002440 | 闰土股份   | 11,499,794.42 | 2.36 |
| 107 | 600649 | 城投控股   | 11,448,689.85 | 2.35 |
| 108 | 600196 | 复星医药   | 11,383,102.16 | 2.34 |
| 109 | 000800 | 一汽轿车   | 11,372,477.74 | 2.34 |
| 110 | 601006 | 大秦铁路   | 11,258,034.00 | 2.32 |
| 111 | 300071 | 华谊嘉信   | 11,014,283.49 | 2.27 |
| 112 | 600446 | 金证股份   | 11,003,422.31 | 2.26 |
| 113 | 002462 | 嘉事堂    | 10,941,309.78 | 2.25 |
| 114 | 000823 | 超声电子   | 10,775,862.97 | 2.22 |
| 115 | 300104 | 乐视网    | 10,762,880.32 | 2.21 |
| 116 | 002465 | 海格通信   | 10,537,115.67 | 2.17 |
| 117 | 600612 | 老凤祥    | 10,304,044.47 | 2.12 |
| 118 | 002317 | 众生药业   | 10,293,330.55 | 2.12 |

|     |        |      |               |      |
|-----|--------|------|---------------|------|
| 119 | 300298 | 三诺生物 | 10,277,985.13 | 2.11 |
| 120 | 300219 | 鸿利光电 | 10,277,475.05 | 2.11 |
| 121 | 000655 | 金岭矿业 | 10,194,217.05 | 2.10 |
| 122 | 002400 | 省广股份 | 10,128,012.10 | 2.08 |
| 123 | 600073 | 上海梅林 | 10,100,016.53 | 2.08 |
| 124 | 000776 | 广发证券 | 9,847,735.33  | 2.03 |
| 125 | 601766 | 中国南车 | 9,819,771.07  | 2.02 |
| 126 | 000625 | 长安汽车 | 9,791,246.05  | 2.01 |
| 127 | 600835 | 上海机电 | 9,770,557.25  | 2.01 |
| 128 | 002226 | 江南化工 | 9,750,693.53  | 2.01 |
| 129 | 600832 | 东方明珠 | 9,737,526.91  | 2.00 |
| 130 | 002185 | 华天科技 | 9,730,783.15  | 2.00 |

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。

#### 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 | 3,104,510,765.48 |
| 卖出股票收入（成交）总额 | 3,289,645,938.00 |

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。

#### 8.5 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。

#### 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

本基金本报告期末未持有债券。

#### 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

| 代码 | 名称 | 持仓量(买/卖)<br>(手) | 合约市值 | 公允价值变动 | 风险说明 |
|----|----|-----------------|------|--------|------|
|----|----|-----------------|------|--------|------|

|                |   |   |   |   |                  |
|----------------|---|---|---|---|------------------|
| -              | - | - | - | - | 本基金本报告期末无股指期货持仓。 |
| 公允价值变动总额合计     |   |   |   |   | 0.00             |
| 股指期货投资本期收益     |   |   |   |   | -115,980.00      |
| 股指期货投资本期公允价值变动 |   |   |   |   | 0.00             |

### 8.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金股指期货投资将根据风险管理的原则，以套期保值为目的，对冲系统性风险和某些特殊情况下的流动性风险。

### 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** 报告期内基金投资的前十名证券的发行主体无被监管部门立案调查的，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** 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。

#### 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   | 360,114.18    |
| 2  | 应收证券清算款 | 13,346,854.83 |
| 3  | 应收股利    | -             |
| 4  | 应收利息    | 6,917.22      |
| 5  | 应收申购款   | 50,732,127.43 |
| 6  | 其他应收款   | -             |
| 7  | 待摊费用    | -             |
| 8  | 其他      | -             |
| 9  | 合计      | 64,446,013.66 |

**8.11.4 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。

**8.11.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明**

金额单位：人民币元

| 序号 | 股票代码   | 股票名称 | 流通受限部分的公允价值   | 占基金资产净值比例 (%) | 流通受限情况说明 |
|----|--------|------|---------------|---------------|----------|
| 1  | 002022 | 科华生物 | 13,118,052.56 | 3.08          | 重大事项     |

**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<br>(户) | 户均持有的<br>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<br>额比例 | 持有份额           | 占总份<br>额比例 |
| 6,479        | 58,449.15     | 2,371,135.31 | 0.63%      | 376,320,924.59 | 99.37%     |

注：持有人户数为有效户数，即存量份额大于零的账户。

**9.2 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 | 15,184.07  | 0.0040%  |

注：1、本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有该只基金份额总量的数量区间：0；

2、该只基金的基金经理持有该只基金份额总量的数量区间：0。

**§ 10 开放式基金份额变动**

单位：份

|                           |                  |
|---------------------------|------------------|
| 基金合同生效日（2011年6月14日）基金份额总额 | 1,429,930,353.67 |
| 本报告期期初基金份额总额              | 544,179,652.88   |
| 本报告期基金总申购份额               | 489,331,237.52   |

|               |                |
|---------------|----------------|
| 减:本报告期基金总赎回份额 | 654,818,830.50 |
| 本报告期基金拆分变动份额  | -              |
| 本报告期期末基金份额总额  | 378,692,059.90 |

## § 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

基金托管人在本报告期内重大人事变动情况:

2013年3月17日中国银行股份有限公司公告,肖钢先生辞去中国银行股份有限公司董事长职务。

2013年6月1日中国银行股份有限公司公告,自2013年5月31日起,田国立先生就任本行董事长、执行董事、董事会战略发展委员会主席及委员。

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),本会计期间应支付的审计费用为50,000.00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 |    |
| 西南证券 | 1      | 979,441,780.67 | 15.38%       | 891,679.10 | 15.64%     | -  |
| 华宝证券 | 1      | 556,340,130.65 | 8.73%        | 492,309.16 | 8.63%      | -  |
| 国都证券 | 1      | 440,910,841.39 | 6.92%        | 390,164.47 | 6.84%      | -  |
| 财富证券 | 1      | 431,844,627.90 | 6.78%        | 382,143.76 | 6.70%      | -  |
| 万联证券 | 1      | 399,370,907.12 | 6.27%        | 353,406.42 | 6.20%      | -  |
| 长江证券 | 1      | 394,277,678.65 | 6.19%        | 358,950.50 | 6.29%      | -  |
| 英大证券 | 1      | 342,206,444.40 | 5.37%        | 302,822.95 | 5.31%      | -  |
| 安信证券 | 2      | 253,131,548.19 | 3.97%        | 227,973.00 | 4.00%      | -  |
| 中银国际 | 1      | 246,469,079.05 | 3.87%        | 218,103.29 | 3.82%      | -  |
| 申银万国 | 1      | 230,713,081.96 | 3.62%        | 204,158.42 | 3.58%      | -  |
| 东莞证券 | 1      | 224,482,342.04 | 3.52%        | 198,645.25 | 3.48%      | -  |
| 渤海证券 | 2      | 213,434,841.43 | 3.35%        | 188,871.11 | 3.31%      | -  |
| 中信证券 | 2      | 205,853,448.54 | 3.23%        | 187,409.15 | 3.29%      | -  |
| 国信证券 | 1      | 193,934,292.99 | 3.04%        | 171,613.10 | 3.01%      | -  |
| 国泰君安 | 1      | 193,463,974.18 | 3.04%        | 171,199.80 | 3.00%      | -  |
| 银河证券 | 1      | 170,355,722.31 | 2.67%        | 155,089.74 | 2.72%      | -  |
| 海通证券 | 2      | 150,067,329.47 | 2.36%        | 136,620.02 | 2.40%      | -  |
| 光大证券 | 2      | 131,539,511.64 | 2.07%        | 117,078.69 | 2.05%      | -  |
| 东方证券 | 1      | 123,999,693.02 | 1.95%        | 112,888.27 | 1.98%      | -  |
| 江海证券 | 1      | 113,856,422.56 | 1.79%        | 103,654.89 | 1.82%      | -  |
| 广州证券 | 1      | 102,088,146.79 | 1.60%        | 92,941.05  | 1.63%      | -  |
| 中金公司 | 2      | 64,987,714.69  | 1.02%        | 59,164.43  | 1.04%      | -  |
| 民生证券 | 1      | 41,669,119.24  | 0.65%        | 36,873.48  | 0.65%      | -  |
| 中航证券 | 1      | 39,028,378.16  | 0.61%        | 34,536.17  | 0.61%      | -  |
| 中投证券 | 2      | 35,919,756.32  | 0.56%        | 32,700.97  | 0.57%      | -  |
| 招商证券 | 2      | 34,487,686.88  | 0.54%        | 31,156.01  | 0.55%      | -  |
| 国海证券 | 1      | 30,541,158.19  | 0.48%        | 27,026.41  | 0.47%      | -  |
| 广发证券 | 1      | 24,776,120.33  | 0.39%        | 22,555.80  | 0.40%      | -  |
| 东吴证券 | 1      | -              | 0.00%        | -          | 0.00%      | -  |

|      |   |   |       |   |       |   |
|------|---|---|-------|---|-------|---|
| 东海证券 | 1 | - | 0.00% | - | 0.00% | - |
| 华福证券 | 1 | - | 0.00% | - | 0.00% | - |
| 华林证券 | 1 | - | 0.00% | - | 0.00% | - |
| 华鑫证券 | 1 | - | 0.00% | - | 0.00% | - |
| 民族证券 | 1 | - | 0.00% | - | 0.00% | - |
| 齐鲁证券 | 1 | - | 0.00% | - | 0.00% | - |
| 天源证券 | 1 | - | 0.00% | - | 0.00% | - |
| 万和证券 | 1 | - | 0.00% | - | 0.00% | - |
| 湘财证券 | 1 | - | 0.00% | - | 0.00% | - |
| 华泰证券 | 2 | - | 0.00% | - | 0.00% | - |

注：1、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。

2、报告期内租用交易单元变更情况，新增席位：华福证券、渤海证券、东海证券、东吴证券、国海证券、华林证券、华鑫证券、民生证券、民族证券、齐鲁证券、万和证券、万联证券、英大证券。

### 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 |
| 西南证券 | 887,346.00 | 35.63%       | -      | 0.00%          | -    | 0.00%        |



|      |              |        |               |         |   |       |
|------|--------------|--------|---------------|---------|---|-------|
| 华宝证券 | -            | 0.00%  | -             | 0.00%   | - | 0.00% |
| 国都证券 | -            | 0.00%  | -             | 0.00%   | - | 0.00% |
| 财富证券 | 200,855.84   | 8.06%  | -             | 0.00%   | - | 0.00% |
| 万联证券 | -            | 0.00%  | -             | 0.00%   | - | 0.00% |
| 长江证券 | -            | 0.00%  | -             | 0.00%   | - | 0.00% |
| 英大证券 | -            | 0.00%  | -             | 0.00%   | - | 0.00% |
| 安信证券 | -            | 0.00%  | 50,000,000.00 | 100.00% | - | 0.00% |
| 中银国际 | -            | 0.00%  | -             | 0.00%   | - | 0.00% |
| 申银万国 | -            | 0.00%  | -             | 0.00%   | - | 0.00% |
| 东莞证券 | -            | 0.00%  | -             | 0.00%   | - | 0.00% |
| 渤海证券 | -            | 0.00%  | -             | 0.00%   | - | 0.00% |
| 中信证券 | -            | 0.00%  | -             | 0.00%   | - | 0.00% |
| 国信证券 | -            | 0.00%  | -             | 0.00%   | - | 0.00% |
| 国泰君安 | -            | 0.00%  | -             | 0.00%   | - | 0.00% |
| 银河证券 | -            | 0.00%  | -             | 0.00%   | - | 0.00% |
| 海通证券 | -            | 0.00%  | -             | 0.00%   | - | 0.00% |
| 光大证券 | -            | 0.00%  | -             | 0.00%   | - | 0.00% |
| 东方证券 | -            | 0.00%  | -             | 0.00%   | - | 0.00% |
| 江海证券 | -            | 0.00%  | -             | 0.00%   | - | 0.00% |
| 广州证券 | -            | 0.00%  | -             | 0.00%   | - | 0.00% |
| 中金公司 | -            | 0.00%  | -             | 0.00%   | - | 0.00% |
| 民生证券 | -            | 0.00%  | -             | 0.00%   | - | 0.00% |
| 中航证券 | -            | 0.00%  | -             | 0.00%   | - | 0.00% |
| 中投证券 | -            | 0.00%  | -             | 0.00%   | - | 0.00% |
| 招商证券 | 1,402,420.40 | 56.31% | -             | 0.00%   | - | 0.00% |
| 国海证券 | -            | 0.00%  | -             | 0.00%   | - | 0.00% |
| 广发证券 | -            | 0.00%  | -             | 0.00%   | - | 0.00% |
| 东吴证券 | -            | 0.00%  | -             | 0.00%   | - | 0.00% |
| 东海证券 | -            | 0.00%  | -             | 0.00%   | - | 0.00% |
| 华福证券 | -            | 0.00%  | -             | 0.00%   | - | 0.00% |
| 华林证券 | -            | 0.00%  | -             | 0.00%   | - | 0.00% |
| 华鑫证券 | -            | 0.00%  | -             | 0.00%   | - | 0.00% |
| 民族证券 | -            | 0.00%  | -             | 0.00%   | - | 0.00% |
| 齐鲁证券 | -            | 0.00%  | -             | 0.00%   | - | 0.00% |
| 天源证券 | -            | 0.00%  | -             | 0.00%   | - | 0.00% |
| 万和证券 | -            | 0.00%  | -             | 0.00%   | - | 0.00% |
| 湘财证券 | -            | 0.00%  | -             | 0.00%   | - | 0.00% |

|      |   |       |   |       |   |       |
|------|---|-------|---|-------|---|-------|
| 华泰证券 | - | 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