

大成新锐产业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 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       | 大成新锐产业股票         |
| 基金主代码      | 090018           |
| 交易代码       | 090018           |
| 基金运作方式     | 契约型开放式           |
| 基金合同生效日    | 2012 年 3 月 20 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 | 164,946,454.00 份 |
| 基金合同存续期    | 不定期              |

### 2.2 基金产品说明

|        |  |
|--------|--|
| 投资目标   | 本基金主要投资于新锐产业中的优质上市公司，分享中国经济增长新锐力量的成长收益，追求基金资产的长期稳健增值。  |
| 投资策略   | 本基金采用自上而下、自下而上相结合的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；分析中国经济结构转型背景下社会意识（可持续发展观等）、经济基础、科技进步、消费升级与产业政策等各个方面对新锐产业发展的综合影响，研究各个新锐产业发展所处的阶段特征和商业前景，结合各个新锐产业股票群体的流动性、整体估值水平和动量，实施新锐产业之行业配置。对新锐产业各公司在所属行业内的竞争优势进行细致分析（包括技术变迁路径与核心技术、技术制式与商业模式、市场策略与需求融合、人力资源等诸多方面），结合股票基本面指标分析（包括成长性指标、估值水平），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。 |
| 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<br>大成基金管理有限公司<br>北京市西城区复兴门内大街 28 号凯晨世贸中心东座 F9 中国农业银行股份有限公司托管业务部 |

## § 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 3 月 20 日(基金合同生效日)-2012 年 12 月 31 日 |
|---------------|----------------|---|
| 本期已实现收益       | 35,953,681.27  | -8,741,075.10                             |
| 本期利润          | 30,654,443.56  | 2,633,388.52                              |
| 加权平均基金份额本期利润  | 0.2521         | 0.0056                                    |
| 本期基金份额净值增长率   | 35.98%         | -0.90%                                    |
| 3.1.2 期末数据和指标 | 2013 年末        | 2012 年末                                   |
| 期末可供分配基金份额利润  | 0.1414         | -0.0683                                   |
| 期末基金资产净值      | 188,264,761.30 | 196,918,810.16                            |
| 期末基金份额净值      | 1.141          | 0.991                                     |

注：1、本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入(不含公允价值变动收益)扣除相关费用后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

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

3、本基金合同生效日为 2012 年 3 月 20 日，2012 年度主要财务指标的计算期间为 2012 年 3 月 20 日（基金合同生效日）至 2012 年 12 月 31 日。

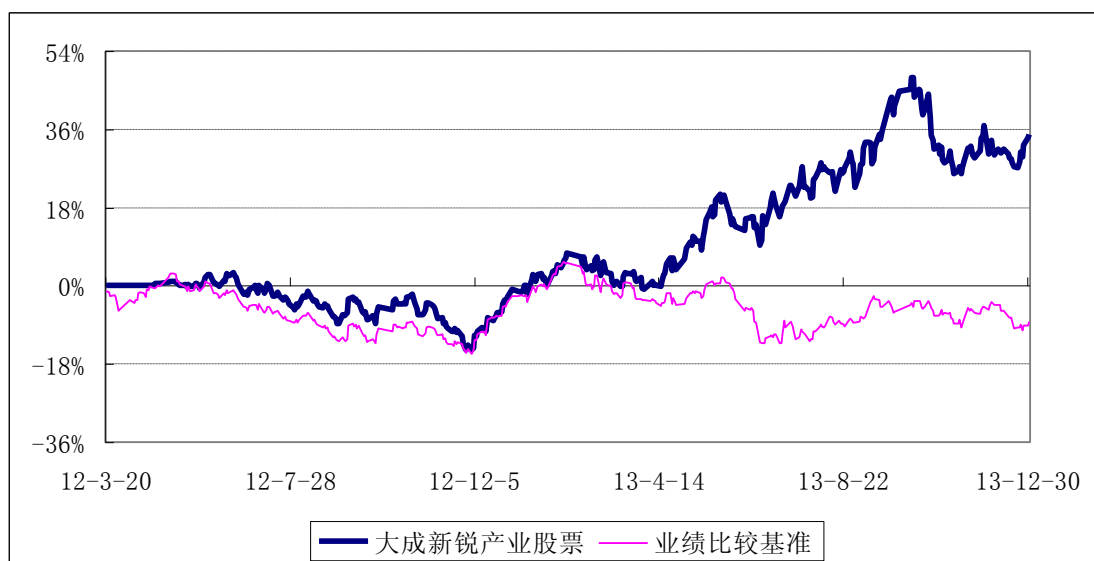
### 3.2 基金净值表现

#### 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 |
|----|----------|-------------|------------|---------------|-----|-----|
|----|----------|-------------|------------|---------------|-----|-----|

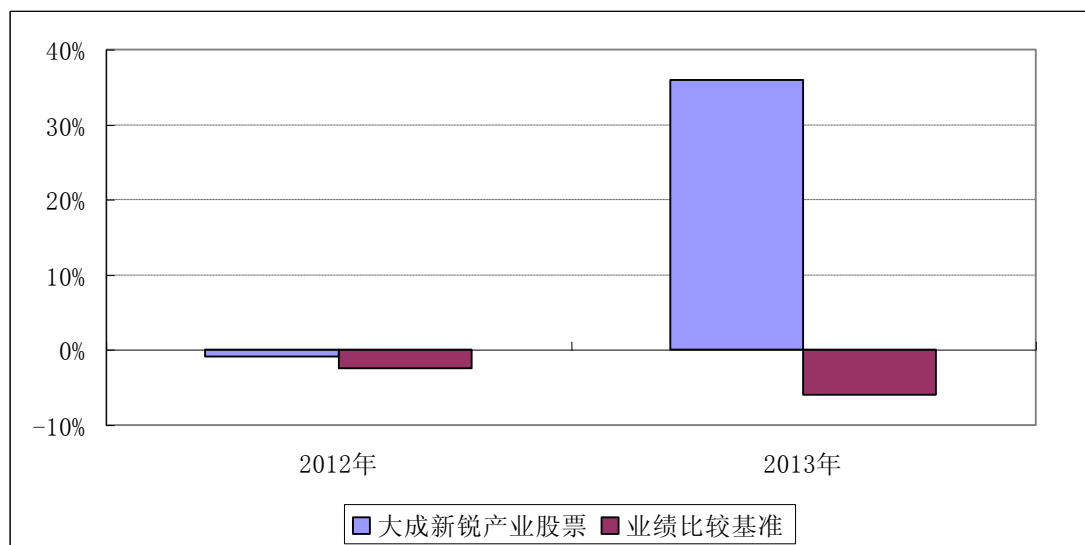
|            |        |       |        |       |        |       |
|------------|--------|-------|--------|-------|--------|-------|
| 过去三个月      | -6.94% | 1.53% | -2.93% | 0.90% | -4.01% | 0.63% |
| 过去六个月      | 18.10% | 1.66% | 4.30%  | 1.03% | 13.80% | 0.63% |
| 过去一年       | 35.98% | 1.59% | -5.90% | 1.12% | 41.88% | 0.47% |
| 自基金合同生效起至今 | 34.76% | 1.35% | -8.23% | 1.05% | 42.99% | 0.30% |

### 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：2012 年净值增长率表现期间为 2012 年 3 月 20 日(基金合同生效日)至 2012 年 12 月 31 日。

### 3.3 自基金合同生效以来基金的利润分配情况

单位：人民币元

| 年度   | 每10份基金份额<br>分红数 | 现金形式发放<br>总额  | 再投资形式发<br>放总额 | 年度利润分配合<br>计  | 备注 |
|------|-----------------|---------------|---------------|---------------|----|
| 2013 | 2.0000          | 72,012,874.82 | 2,613,606.60  | 74,626,481.42 |    |
| 2012 | -               | -             | -             | -             |    |
| 合计   | 2.0000          | 72,012,874.82 | 2,613,606.60  | 74,626,481.42 |    |

## § 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       |        |   |
| 袁巍先生  | 本基金基金经理 | 2013年4月8日       | -          | 4年     | 经济学硕士，2009年6月加入大成基金管理有限公司，曾任研究部新兴产业行业研究主管。2012年8月7日至2013年3月11日担任大成精选增值混合型证券投资基金和大成新锐产业股票型证券投资基金基金经理助理。2013年4月8日起担任大成新锐产业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  |
| 刘安田先生 | 本基金基金经理 | 2012年3月20日      | 2013年7月17日 | 9年     | 金融学硕士。曾任职于中国证券研究设计中心、友邦华泰基金管理公司、工银瑞信基金管理公司。曾担任行业研究员、宏观经济及策略研究员、基金经理助理。2008年8月加入大成基金，曾任大成基金管理有限公司研究部总监助理。2012年3月20日至2013年7月17日任大成新锐产业股票型证券投资基金基金经理。2010年4月7日起任大成精选增值混合型证券投资基金基金经理。2013年3月8日起任景宏证券投资基金基金经理。具有基金从业资格。国籍：中国 |

注：1、任职日期、离任日期为本基金管理人作出决定之日。

2、证券从业年限的计算标准遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

**4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明**

本报告期内，本基金管理人严格遵守《证券法》、《证券投资基金法》、《大成新锐产业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，大成新锐产业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

回顾过去的 2013 年，经济增长乏力、资金成本高启、经济结构转型压力是贯穿整个资本市场的主旋律，尤其是在十八届三中全会之后，市场对经济结构转型的预期呈现加速的态势。

体现在资本市场上，今年市场行情的演绎也是极度分化。在以上所述大宏观背景下，代表传



统经济的沪深 300 收跌 7.65%；而代表经济结构转型的创业板上涨 82.73%，中小板上涨 17.54%。市场对成长股的追捧和对周期股的抛弃走向极致。

本基金在过去一年中专注于自下而上选择符合经济结构转型方向的成长股，取得了较好收益。基金全年 35.98%，大幅跑赢基准。

#### 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 1.141 元，本报告期基金份额净值增长率为 35.98%，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

未来中国经济继续走在十字路口，旧经济发展模式不可持续已得到了中央的认可，经济结构转型已是大势所趋。GDP 增速在小区间的窄幅波动并不会对证券市场的走势产生很大的影响，市场的走势更多的是取决于中国经济长期增长模式的信心。

2013 年是成长和周期的分化，代表新兴经济的成长股基本上都录得较大涨幅。往后看 2014 年可能是成长股内部的分化。真正用业绩证明自身的成长股将会继续受到市场的追捧，甚至不排除阶段性极度泡沫化的状态。

未来，本基金将以更严格的业绩标准继续自下而上选择成长股，以期取得更好收益。

#### 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。本报告期内大成新锐产业股票已分配利润 74,626,481.42 元（每十份基金份额分红 2.00 元），符合基金合同规定的分红比例。

### **§ 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**

在托管大成新锐产业股票型证券投资基金的过程中，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《大成新锐产业股票型证券投资基金基金合同》、《大成新锐产业股票型证券投资基金托管协议》的约定，对大成新锐产业股票型证券投资基金管理人—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新锐产业股票型证券投资基金的投资运作、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新锐产业股票型证券投资基金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 年年度财务会计报告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:大成新锐产业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            | 21,629,708.66                   | 29,761,115.16                    |
| 结算备付金           | 2,237,511.36                    | 209,201.57                       |
| 存出保证金           | 296,277.24                      | 65,054.17                        |
| 交易性金融资产         | 167,370,020.23                  | 163,924,658.84                   |
| 其中:股票投资         | 167,370,020.23                  | 163,924,658.84                   |
| 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         | 7,032,171.96                    | 3,695,884.30                     |
| 应收利息            | 9,164.34                        | 6,492.61                         |
| 应收股利            | -                               | -                                |
| 应收申购款           | 74,062.45                       | 870.62                           |
| 递延所得税资产         | -                               | -                                |
| 其他资产            | -                               | -                                |
| 资产总计            | 198,648,916.24                  | 197,663,277.27                   |
| <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         | 8,387,436.23                    | -                                |
| 应付赎回款           | 101,291.87                      | 209,146.34                       |
| 应付管理人报酬         | 305,658.19                      | 234,315.12                       |

|               |                |                |
|---------------|----------------|----------------|
| 应付托管费         | 50,943.05      | 39,052.50      |
| 应付销售服务费       | -              | -              |
| 应付交易费用        | 1,398,565.45   | 111,164.94     |
| 应交税费          | -              | -              |
| 应付利息          | -              | -              |
| 应付利润          | -              | -              |
| 递延所得税负债       | -              | -              |
| 其他负债          | 140,260.15     | 150,788.21     |
| 负债合计          | 10,384,154.94  | 744,467.11     |
| <b>所有者权益：</b> |                |                |
| 实收基金          | 164,946,454.00 | 198,688,850.76 |
| 未分配利润         | 23,318,307.30  | -1,770,040.60  |
| 所有者权益合计       | 188,264,761.30 | 196,918,810.16 |
| 负债和所有者权益总计    | 198,648,916.24 | 197,663,277.27 |

注：报告截止日 2013 年 12 月 31 日，基金份额净值 1.141 元，基金份额总额 164,946,454.00 份。

## 7.2 利润表

会计主体：大成新锐产业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 3 月 20 日(基金合<br>同生效日)至 2012 年 12 月<br>31 日 |
|------------------------|---|--|
| <b>一、收入</b>            | 37,957,598.95                             | 9,888,314.11   |
| 1. 利息收入                | 193,837.60                                | 8,192,891.68   |
| 其中：存款利息收入              | 193,168.71                                | 8,192,891.68   |
| 债券利息收入                 | 668.89                                    | -  |
| 资产支持证券利息收入             | -   | -  |
| 买入返售金融资产收入             | -   | -  |
| 其他利息收入                 | -   | -  |
| 2. 投资收益（损失以“-”填列）      | 42,510,944.06                             | -12,006,438.83   |
| 其中：股票投资收益              | 41,808,220.39                             | -13,965,091.98   |
| 基金投资收益                 | -   | -  |
| 债券投资收益                 | 119,194.41                                | -  |
| 资产支持证券投资收益             | -   | -  |
| 衍生工具收益                 | -   | -  |
| 股利收益                   | 583,529.26                                | 1,958,653.15   |
| 3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列） | -5,299,237.71                             | 11,374,463.62  |
| 4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）     | -   | -  |

|                            |                      |                     |
|----------------------------|----------------------|---------------------|
| 5. 其他收入（损失以“-”号填列）         | 552,055.00           | 2,327,397.64        |
| <b>减：二、费用</b>              | <b>7,303,155.39</b>  | <b>7,254,925.59</b> |
| 1. 管理人报酬                   | 2,117,806.13         | 5,408,159.83        |
| 2. 托管费                     | 352,967.62           | 901,359.98          |
| 3. 销售服务费                   | -                    | -                   |
| 4. 交易费用                    | 4,666,422.85         | 631,338.70          |
| 5. 利息支出                    | -                    | -                   |
| 其中：卖出回购金融资产支出              | -                    | -                   |
| 6. 其他费用                    | 165,958.79           | 314,067.08          |
| <b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b> | <b>30,654,443.56</b> | <b>2,633,388.52</b> |
| 减：所得税费用                    | -                    | -                   |
| <b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>   | <b>30,654,443.56</b> | <b>2,633,388.52</b> |

### 7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：大成新锐产业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）                        | 198,688,850.76  | -1,770,040.60  | 196,918,810.16  |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）               | -   | 30,654,443.56  | 30,654,443.56   |
| 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）      | -33,742,396.76  | 69,060,385.76  | 35,317,989.00   |
| 其中：1. 基金申购款                            | 392,490,629.85  | 126,297,750.24 | 518,788,380.09  |
| 2. 基金赎回款                               | -426,233,026.61                                       | -57,237,364.48 | -483,470,391.09 |
| 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） | -   | -74,626,481.42 | -74,626,481.42  |
| 五、期末所有者权益（基金净值）                        | 164,946,454.00  | 23,318,307.30  | 188,264,761.30  |
| 项目                                     | 上年度可比期间<br>2012 年 3 月 20 日（基金合同生效日）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）                        | 2,049,911,272.87  | -             | 2,049,911,272.87  |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）               | -                 | 2,633,388.52  | 2,633,388.52      |
| 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）      | -1,851,222,422.11 | -4,403,429.12 | -1,855,625,851.23 |
| 其中：1. 基金申购款                            | 6,433,223.26      | -159,887.81   | 6,273,335.45      |
| 2. 基金赎回款                               | -1,857,655,645.37 | -4,243,541.31 | -1,861,899,186.68 |
| 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）                        | 198,688,850.76    | -1,770,040.60 | 196,918,810.16    |

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           |
| 中国农业银行股份有限公司(“中国农业银行”) | 基金托管人           |
| 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 3 月 20 日(基金合同生效日)至 2012 年<br>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  | 235,646,211.70                         | 7.64%                | 112,165,164.22   | 23.73%               |

**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  | 208,525.66                                 | 7.57%          | -        | 0.00%            |
| 关联方名称 | 上年度可比期间<br>2012年3月20日(基金合同生效日)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  | 95,758.18                                  | 23.60%         | -        | 0.00%            |

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3月20日(基金合同生效日)<br>至2012年12月31日 |
|-----------------|---------------------------------|--|
|                 | 当期发生的基金应支付的管理费                  | 2,117,806.13                                   |
| 其中：支付销售机构的客户维护费 | 824,089.55                      | 2,109,072.43                                   |

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3月20日(基金合同生效日)<br>至2012年12月31日 |
|----|---------------------------------|--|
|    |                                 |  |



|                |            |            |
|----------------|------------|------------|
| 当期发生的基金应支付的托管费 | 352,967.62 | 901,359.98 |
|----------------|------------|------------|

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：

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本基金未发生基金管理人运用固有资金投资本基金的情况。

##### 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可比期间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3月20日(基金合同生效日)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                      | 21,629,708.66 | 171,188.90                                 | 29,761,115.16 |

注：本基金的银行存款由基金托管人中国农业银行保管，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**

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              | 167,370,020.23 | 84.25         |
|    | 其中：股票             | 167,370,020.23 | 84.25         |
| 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      | 23,867,220.02  | 12.01         |
| 6  | 其他各项资产            | 7,411,675.99   | 3.73          |
| 7  | 合计                | 198,648,916.24 | 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         | -              | 0.00          |
| B  | 采矿业              | 5,736,752.00   | 3.05          |
| C  | 制造业              | 123,911,895.47 | 65.82         |
| D  | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | 2,581,875.00   | 1.37          |
| E  | 建筑业              | -              | 0.00          |
| F  | 批发和零售业           | 3,715,503.00   | 1.97          |
| 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  | 14,366,947.65  | 7.63          |

|   |               |                |       |
|---|---------------|----------------|-------|
| J | 金融业           | 6,353,267.31   | 3.37  |
| K | 房地产业          | -              | 0.00  |
| L | 租赁和商务服务业      | 2,664,695.60   | 1.42  |
| 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 | 3,596,754.00   | 1.91  |
| 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     | 4,442,330.20   | 2.36  |
| S | 综合            | -              | 0.00  |
|   | 合计            | 167,370,020.23 | 88.90 |

### 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 | 235,729   | 11,279,632.65 | 5.99         |
| 2  | 002475 | 立讯精密 | 262,743   | 8,780,871.06  | 4.66         |
| 3  | 002385 | 大北农  | 517,214   | 8,456,448.90  | 4.49         |
| 4  | 600527 | 江南高纤 | 1,131,741 | 7,899,552.18  | 4.20         |
| 5  | 601965 | 中国汽研 | 558,132   | 7,478,968.80  | 3.97         |
| 6  | 002035 | 华帝股份 | 598,219   | 7,316,218.37  | 3.89         |
| 7  | 002157 | 正邦科技 | 903,298   | 7,027,658.44  | 3.73         |
| 8  | 601318 | 中国平安 | 152,247   | 6,353,267.31  | 3.37         |
| 9  | 600372 | 中航电子 | 257,530   | 6,144,665.80  | 3.26         |
| 10 | 002683 | 宏大爆破 | 183,400   | 5,736,752.00  | 3.05         |

注：投资者欲了解本报告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  | 300058 | 蓝色光标 | 25,331,324.48 | 12.86          |
| 2  | 002236 | 大华股份 | 23,742,530.78 | 12.06          |

|    |        |      |               |       |
|----|--------|------|---------------|-------|
| 3  | 300133 | 华策影视 | 22,432,955.21 | 11.39 |
| 4  | 601166 | 兴业银行 | 22,212,667.31 | 11.28 |
| 5  | 300027 | 华谊兄弟 | 22,097,276.68 | 11.22 |
| 6  | 002292 | 奥飞动漫 | 21,233,229.19 | 10.78 |
| 7  | 600016 | 民生银行 | 21,057,110.45 | 10.69 |
| 8  | 300251 | 光线传媒 | 18,407,175.53 | 9.35  |
| 9  | 002241 | 歌尔声学 | 18,346,714.75 | 9.32  |
| 10 | 002475 | 立讯精密 | 18,274,537.81 | 9.28  |
| 11 | 002415 | 海康威视 | 18,171,701.58 | 9.23  |
| 12 | 600633 | 浙报传媒 | 16,347,479.81 | 8.30  |
| 13 | 002008 | 大族激光 | 15,521,119.58 | 7.88  |
| 14 | 300071 | 华谊嘉信 | 14,175,353.57 | 7.20  |
| 15 | 300115 | 长盈精密 | 14,080,520.33 | 7.15  |
| 16 | 600261 | 阳光照明 | 13,838,837.81 | 7.03  |
| 17 | 002064 | 华峰氨纶 | 13,725,264.08 | 6.97  |
| 18 | 002230 | 科大讯飞 | 13,665,927.85 | 6.94  |
| 19 | 600587 | 新华医疗 | 12,813,211.40 | 6.51  |
| 20 | 300253 | 卫宁软件 | 12,285,933.92 | 6.24  |
| 21 | 600967 | 北方创业 | 12,263,646.61 | 6.23  |
| 22 | 002309 | 中利科技 | 11,783,685.08 | 5.98  |
| 23 | 300228 | 富瑞特装 | 11,677,094.15 | 5.93  |
| 24 | 300207 | 欣旺达  | 11,600,784.75 | 5.89  |
| 25 | 600383 | 金地集团 | 11,300,905.00 | 5.74  |
| 26 | 601318 | 中国平安 | 11,232,291.09 | 5.70  |
| 27 | 300059 | 东方财富 | 11,044,071.05 | 5.61  |
| 28 | 000001 | 平安银行 | 11,037,786.95 | 5.61  |
| 29 | 300315 | 掌趣科技 | 10,784,835.55 | 5.48  |
| 30 | 600118 | 中国卫星 | 10,736,376.73 | 5.45  |
| 31 | 002157 | 正邦科技 | 10,621,321.39 | 5.39  |
| 32 | 300075 | 数字政通 | 10,357,743.90 | 5.26  |
| 33 | 600880 | 博瑞传播 | 10,251,895.33 | 5.21  |
| 34 | 002618 | 丹邦科技 | 10,145,227.55 | 5.15  |
| 35 | 002148 | 北纬通信 | 10,127,836.49 | 5.14  |
| 36 | 600879 | 航天电子 | 9,972,906.03  | 5.06  |
| 37 | 600859 | 王府井  | 9,889,323.82  | 5.02  |
| 38 | 300273 | 和佳股份 | 9,836,956.60  | 5.00  |

|    |        |      |              |      |
|----|--------|------|--------------|------|
| 39 | 300284 | 苏交科  | 9,826,149.88 | 4.99 |
| 40 | 300017 | 网宿科技 | 9,616,940.02 | 4.88 |
| 41 | 300336 | 新文化  | 9,310,407.79 | 4.73 |
| 42 | 601222 | 林洋电子 | 9,159,052.09 | 4.65 |
| 43 | 600637 | 百视通  | 9,015,595.60 | 4.58 |
| 44 | 600316 | 洪都航空 | 8,660,577.81 | 4.40 |
| 45 | 002146 | 荣盛发展 | 8,613,878.13 | 4.37 |
| 46 | 300168 | 万达信息 | 8,601,430.20 | 4.37 |
| 47 | 600837 | 海通证券 | 8,431,640.00 | 4.28 |
| 48 | 000656 | 金科股份 | 8,422,420.70 | 4.28 |
| 49 | 002385 | 大北农  | 8,331,911.12 | 4.23 |
| 50 | 000049 | 德赛电池 | 8,304,799.57 | 4.22 |
| 51 | 002202 | 金风科技 | 8,258,682.18 | 4.19 |
| 52 | 600180 | 瑞茂通  | 8,217,602.48 | 4.17 |
| 53 | 000826 | 桑德环境 | 7,845,942.72 | 3.98 |
| 54 | 600252 | 中恒集团 | 7,715,085.11 | 3.92 |
| 55 | 000977 | 浪潮信息 | 7,664,411.49 | 3.89 |
| 56 | 002400 | 省广股份 | 7,613,510.16 | 3.87 |
| 57 | 300070 | 碧水源  | 7,517,613.64 | 3.82 |
| 58 | 601766 | 中国南车 | 7,504,488.00 | 3.81 |
| 59 | 600372 | 中航电子 | 7,487,453.26 | 3.80 |
| 60 | 601965 | 中国汽研 | 7,449,106.76 | 3.78 |
| 61 | 600527 | 江南高纤 | 7,397,966.04 | 3.76 |
| 62 | 000002 | 万科A  | 7,295,907.00 | 3.71 |
| 63 | 002570 | 贝因美  | 7,292,206.71 | 3.70 |
| 64 | 002035 | 华帝股份 | 7,220,557.59 | 3.67 |
| 65 | 600893 | 航空动力 | 7,132,274.86 | 3.62 |
| 66 | 000712 | 锦龙股份 | 7,106,460.66 | 3.61 |
| 67 | 002353 | 杰瑞股份 | 6,930,240.07 | 3.52 |
| 68 | 000099 | 中信海直 | 6,864,008.53 | 3.49 |
| 69 | 000651 | 格力电器 | 6,727,401.88 | 3.42 |
| 70 | 300026 | 红日药业 | 6,698,141.53 | 3.40 |
| 71 | 600756 | 浪潮软件 | 6,691,611.13 | 3.40 |
| 72 | 600031 | 三一重工 | 6,654,994.36 | 3.38 |
| 73 | 600729 | 重庆百货 | 6,628,694.12 | 3.37 |
| 74 | 300287 | 飞利信  | 6,561,134.62 | 3.33 |

|     |        |      |              |      |
|-----|--------|------|--------------|------|
| 75  | 300291 | 华录百纳 | 6,520,308.60 | 3.31 |
| 76  | 600038 | 哈飞股份 | 6,477,154.99 | 3.29 |
| 77  | 601118 | 海南橡胶 | 6,471,679.08 | 3.29 |
| 78  | 300113 | 顺网科技 | 6,335,995.20 | 3.22 |
| 79  | 600583 | 海油工程 | 6,279,455.54 | 3.19 |
| 80  | 600150 | 中国船舶 | 6,274,151.29 | 3.19 |
| 81  | 300137 | 先河环保 | 6,254,480.80 | 3.18 |
| 82  | 601336 | 新华保险 | 6,236,916.23 | 3.17 |
| 83  | 601299 | 中国北车 | 6,181,106.66 | 3.14 |
| 84  | 300090 | 盛运股份 | 6,133,948.00 | 3.11 |
| 85  | 600741 | 华域汽车 | 6,122,076.56 | 3.11 |
| 86  | 002450 | 康得新  | 6,038,224.20 | 3.07 |
| 87  | 002261 | 拓维信息 | 5,918,184.31 | 3.01 |
| 88  | 600804 | 鹏博士  | 5,779,884.10 | 2.94 |
| 89  | 002081 | 金螳螂  | 5,745,703.78 | 2.92 |
| 90  | 600309 | 万华化学 | 5,702,961.87 | 2.90 |
| 91  | 600196 | 复星医药 | 5,687,319.32 | 2.89 |
| 92  | 002439 | 启明星辰 | 5,606,110.67 | 2.85 |
| 93  | 300002 | 神州泰岳 | 5,560,159.85 | 2.82 |
| 94  | 002683 | 宏大爆破 | 5,448,874.94 | 2.77 |
| 95  | 000671 | 阳光城  | 5,445,530.95 | 2.77 |
| 96  | 300323 | 华灿光电 | 5,422,220.40 | 2.75 |
| 97  | 002041 | 登海种业 | 5,286,036.08 | 2.68 |
| 98  | 600108 | 亚盛集团 | 5,271,968.43 | 2.68 |
| 99  | 600343 | 航天动力 | 5,052,216.40 | 2.57 |
| 100 | 600073 | 上海梅林 | 5,035,447.00 | 2.56 |
| 101 | 000783 | 长江证券 | 4,993,665.61 | 2.54 |
| 102 | 300005 | 探路者  | 4,985,473.00 | 2.53 |
| 103 | 600703 | 三安光电 | 4,966,647.00 | 2.52 |
| 104 | 600801 | 华新水泥 | 4,933,014.10 | 2.51 |
| 105 | 300136 | 信维通信 | 4,925,153.19 | 2.50 |
| 106 | 002375 | 亚厦股份 | 4,893,164.39 | 2.48 |
| 107 | 000800 | 一汽轿车 | 4,850,394.94 | 2.46 |
| 108 | 600340 | 华夏幸福 | 4,759,672.82 | 2.42 |
| 109 | 002229 | 鸿博股份 | 4,711,792.00 | 2.39 |
| 110 | 600525 | 长园集团 | 4,681,783.72 | 2.38 |

|     |        |        |              |      |
|-----|--------|--------|--------------|------|
| 111 | 002482 | 广田股份   | 4,676,961.90 | 2.38 |
| 112 | 002419 | 天虹商场   | 4,676,656.49 | 2.37 |
| 113 | 600887 | 伊利股份   | 4,650,979.66 | 2.36 |
| 114 | 600079 | 人福医药   | 4,649,400.68 | 2.36 |
| 115 | 600535 | 天士力    | 4,629,431.36 | 2.35 |
| 116 | 600067 | 冠城大通   | 4,493,461.60 | 2.28 |
| 117 | 002567 | 唐人神    | 4,491,597.46 | 2.28 |
| 118 | 600352 | 浙江龙盛   | 4,473,167.22 | 2.27 |
| 119 | 300052 | 中青宝    | 4,411,292.63 | 2.24 |
| 120 | 002023 | 海特高新   | 4,339,470.48 | 2.20 |
| 121 | 002414 | 高德红外   | 4,328,336.59 | 2.20 |
| 122 | 002465 | 海格通信   | 4,327,441.60 | 2.20 |
| 123 | 600855 | 航天长峰   | 4,310,628.00 | 2.19 |
| 124 | 002138 | 顺络电子   | 4,296,565.66 | 2.18 |
| 125 | 000012 | 南玻A    | 4,291,045.01 | 2.18 |
| 126 | 600720 | 祁连山    | 4,283,330.88 | 2.18 |
| 127 | 300303 | 聚飞光电   | 4,225,124.59 | 2.15 |
| 128 | 300045 | 华力创通   | 4,207,135.00 | 2.14 |
| 129 | 002253 | 川大智胜   | 4,195,130.62 | 2.13 |
| 130 | 300301 | 长方照明   | 4,147,335.58 | 2.11 |
| 131 | 002111 | 威海广泰   | 4,128,459.84 | 2.10 |
| 132 | 000876 | 新希望    | 4,106,041.13 | 2.09 |
| 133 | 600597 | 光明乳业   | 4,104,206.30 | 2.08 |
| 134 | 300074 | 华平股份   | 4,092,778.21 | 2.08 |
| 135 | 600315 | 上海家化   | 4,090,483.82 | 2.08 |
| 136 | 000100 | TCL 集团 | 4,064,178.33 | 2.06 |
| 137 | 002140 | 东华科技   | 4,055,419.60 | 2.06 |
| 138 | 000748 | 长城信息   | 4,002,014.07 | 2.03 |

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

#### 8.4.2 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  | 300058 | 蓝色光标 | 26,927,466.71 | 13.67           |

|    |        |      |               |       |
|----|--------|------|---------------|-------|
| 2  | 300027 | 华谊兄弟 | 24,758,707.83 | 12.57 |
| 3  | 300133 | 华策影视 | 24,697,483.69 | 12.54 |
| 4  | 002236 | 大华股份 | 22,900,819.98 | 11.63 |
| 5  | 600016 | 民生银行 | 21,866,515.87 | 11.10 |
| 6  | 002241 | 歌尔声学 | 21,508,209.40 | 10.92 |
| 7  | 601166 | 兴业银行 | 21,181,957.54 | 10.76 |
| 8  | 002292 | 奥飞动漫 | 21,166,859.81 | 10.75 |
| 9  | 300251 | 光线传媒 | 18,995,820.49 | 9.65  |
| 10 | 002415 | 海康威视 | 18,357,840.36 | 9.32  |
| 11 | 600837 | 海通证券 | 16,433,931.69 | 8.35  |
| 12 | 600633 | 浙报传媒 | 16,411,199.04 | 8.33  |
| 13 | 002008 | 大族激光 | 16,336,900.45 | 8.30  |
| 14 | 300228 | 富瑞特装 | 15,675,931.49 | 7.96  |
| 15 | 000826 | 桑德环境 | 15,180,566.49 | 7.71  |
| 16 | 300115 | 长盈精密 | 14,951,367.33 | 7.59  |
| 17 | 300071 | 华谊嘉信 | 14,947,346.61 | 7.59  |
| 18 | 601318 | 中国平安 | 14,583,974.62 | 7.41  |
| 19 | 300284 | 苏交科  | 14,021,538.68 | 7.12  |
| 20 | 002475 | 立讯精密 | 14,008,177.18 | 7.11  |
| 21 | 000656 | 金科股份 | 13,696,520.79 | 6.96  |
| 22 | 002064 | 华峰氨纶 | 13,505,201.32 | 6.86  |
| 23 | 300207 | 欣旺达  | 13,005,243.85 | 6.60  |
| 24 | 300253 | 卫宁软件 | 12,943,302.09 | 6.57  |
| 25 | 600967 | 北方创业 | 12,480,330.29 | 6.34  |
| 26 | 300059 | 东方财富 | 11,667,658.65 | 5.93  |
| 27 | 002230 | 科大讯飞 | 11,663,741.90 | 5.92  |
| 28 | 000001 | 平安银行 | 11,131,085.84 | 5.65  |
| 29 | 600383 | 金地集团 | 10,966,052.00 | 5.57  |
| 30 | 600637 | 百视通  | 10,917,352.45 | 5.54  |
| 31 | 300315 | 掌趣科技 | 10,914,163.46 | 5.54  |
| 32 | 002148 | 北纬通信 | 10,734,174.10 | 5.45  |
| 33 | 300075 | 数字政通 | 10,585,271.49 | 5.38  |
| 34 | 000651 | 格力电器 | 10,424,390.71 | 5.29  |
| 35 | 002618 | 丹邦科技 | 10,408,375.57 | 5.29  |
| 36 | 300336 | 新文化  | 10,200,679.32 | 5.18  |
| 37 | 600261 | 阳光照明 | 10,113,701.13 | 5.14  |
| 38 | 600587 | 新华医疗 | 9,825,639.85  | 4.99  |
| 39 | 300273 | 和佳股份 | 9,675,170.54  | 4.91  |



|    |        |      |              |      |
|----|--------|------|--------------|------|
| 40 | 600880 | 博瑞传播 | 9,549,625.53 | 4.85 |
| 41 | 600316 | 洪都航空 | 9,132,087.28 | 4.64 |
| 42 | 300168 | 万达信息 | 8,904,995.25 | 4.52 |
| 43 | 002202 | 金风科技 | 8,379,451.71 | 4.26 |
| 44 | 600518 | 康美药业 | 8,346,336.01 | 4.24 |
| 45 | 600859 | 王府井  | 8,307,072.87 | 4.22 |
| 46 | 000049 | 德赛电池 | 8,298,135.02 | 4.21 |
| 47 | 601336 | 新华保险 | 8,273,079.38 | 4.20 |
| 48 | 002570 | 贝因美  | 8,032,823.96 | 4.08 |
| 49 | 601633 | 长城汽车 | 7,885,053.33 | 4.00 |
| 50 | 300070 | 碧水源  | 7,851,175.42 | 3.99 |
| 51 | 000012 | 南玻A  | 7,839,073.92 | 3.98 |
| 52 | 002146 | 荣盛发展 | 7,836,471.63 | 3.98 |
| 53 | 002400 | 省广股份 | 7,810,526.02 | 3.97 |
| 54 | 300017 | 网宿科技 | 7,788,890.47 | 3.96 |
| 55 | 600879 | 航天电子 | 7,726,465.71 | 3.92 |
| 56 | 601118 | 海南橡胶 | 7,538,109.34 | 3.83 |
| 57 | 600180 | 瑞茂通  | 7,394,619.62 | 3.76 |
| 58 | 300287 | 飞利信  | 7,242,643.55 | 3.68 |
| 59 | 002309 | 中利科技 | 7,197,134.25 | 3.65 |
| 60 | 002482 | 广田股份 | 7,148,135.35 | 3.63 |
| 61 | 000002 | 万科A  | 7,140,409.62 | 3.63 |
| 62 | 600893 | 航空动力 | 7,135,264.11 | 3.62 |
| 63 | 002353 | 杰瑞股份 | 7,036,117.06 | 3.57 |
| 64 | 300113 | 顺网科技 | 7,028,961.18 | 3.57 |
| 65 | 600741 | 华域汽车 | 6,940,525.45 | 3.52 |
| 66 | 300291 | 华录百纳 | 6,747,329.55 | 3.43 |
| 67 | 600519 | 贵州茅台 | 6,724,061.09 | 3.41 |
| 68 | 000977 | 浪潮信息 | 6,681,776.58 | 3.39 |
| 69 | 600756 | 浪潮软件 | 6,646,360.16 | 3.38 |
| 70 | 600031 | 三一重工 | 6,591,855.04 | 3.35 |
| 71 | 300137 | 先河环保 | 6,431,849.97 | 3.27 |
| 72 | 600038 | 哈飞股份 | 6,309,936.22 | 3.20 |
| 73 | 000625 | 长安汽车 | 6,289,421.81 | 3.19 |
| 74 | 000099 | 中信海直 | 6,275,433.67 | 3.19 |
| 75 | 601299 | 中国北车 | 6,259,891.75 | 3.18 |
| 76 | 600118 | 中国卫星 | 6,254,115.03 | 3.18 |
| 77 | 300124 | 汇川技术 | 6,191,049.05 | 3.14 |

|     |        |      |              |      |
|-----|--------|------|--------------|------|
| 78  | 002450 | 康得新  | 6,154,028.82 | 3.13 |
| 79  | 600583 | 海油工程 | 6,151,767.81 | 3.12 |
| 80  | 300002 | 神州泰岳 | 6,144,807.54 | 3.12 |
| 81  | 002261 | 拓维信息 | 6,131,924.58 | 3.11 |
| 82  | 002081 | 金螳螂  | 6,110,669.90 | 3.10 |
| 83  | 002414 | 高德红外 | 5,998,386.77 | 3.05 |
| 84  | 600196 | 复星医药 | 5,950,616.64 | 3.02 |
| 85  | 600804 | 鹏博士  | 5,939,307.93 | 3.02 |
| 86  | 600073 | 上海梅林 | 5,717,483.90 | 2.90 |
| 87  | 000024 | 招商地产 | 5,713,416.14 | 2.90 |
| 88  | 600729 | 重庆百货 | 5,681,060.48 | 2.88 |
| 89  | 600765 | 中航重机 | 5,501,013.14 | 2.79 |
| 90  | 002038 | 双鹭药业 | 5,471,048.68 | 2.78 |
| 91  | 300323 | 华灿光电 | 5,404,685.97 | 2.74 |
| 92  | 600108 | 亚盛集团 | 5,365,142.00 | 2.72 |
| 93  | 000671 | 阳光城  | 5,354,066.03 | 2.72 |
| 94  | 002375 | 亚厦股份 | 5,303,769.11 | 2.69 |
| 95  | 002439 | 启明星辰 | 5,246,150.81 | 2.66 |
| 96  | 002041 | 登海种业 | 5,144,520.37 | 2.61 |
| 97  | 601601 | 中国太保 | 5,136,231.73 | 2.61 |
| 98  | 600801 | 华新水泥 | 5,070,894.74 | 2.58 |
| 99  | 300136 | 信维通信 | 5,043,855.76 | 2.56 |
| 100 | 600340 | 华夏幸福 | 5,029,385.06 | 2.55 |
| 101 | 600104 | 上汽集团 | 5,017,019.25 | 2.55 |
| 102 | 601766 | 中国南车 | 5,010,871.00 | 2.54 |
| 103 | 000783 | 长江证券 | 4,922,724.66 | 2.50 |
| 104 | 300104 | 乐视网  | 4,901,616.06 | 2.49 |
| 105 | 600703 | 三安光电 | 4,895,440.80 | 2.49 |
| 106 | 000800 | 一汽轿车 | 4,823,639.90 | 2.45 |
| 107 | 300052 | 中青宝  | 4,810,916.19 | 2.44 |
| 108 | 300005 | 探路者  | 4,798,684.00 | 2.44 |
| 109 | 002138 | 顺络电子 | 4,781,864.70 | 2.43 |
| 110 | 000568 | 泸州老窖 | 4,781,596.03 | 2.43 |
| 111 | 600887 | 伊利股份 | 4,691,392.11 | 2.38 |
| 112 | 000527 | 美的电器 | 4,684,047.60 | 2.38 |
| 113 | 600343 | 航天动力 | 4,681,170.66 | 2.38 |
| 114 | 300303 | 聚飞光电 | 4,652,230.34 | 2.36 |
| 115 | 600079 | 人福医药 | 4,644,985.28 | 2.36 |

|     |        |        |              |      |
|-----|--------|--------|--------------|------|
| 116 | 000776 | 广发证券   | 4,617,571.43 | 2.34 |
| 117 | 000748 | 长城信息   | 4,486,026.68 | 2.28 |
| 118 | 300301 | 长方照明   | 4,481,024.48 | 2.28 |
| 119 | 002419 | 天虹商场   | 4,474,639.89 | 2.27 |
| 120 | 600067 | 冠城大通   | 4,456,493.04 | 2.26 |
| 121 | 000712 | 锦龙股份   | 4,451,490.00 | 2.26 |
| 122 | 002229 | 鸿博股份   | 4,413,155.72 | 2.24 |
| 123 | 000100 | TCL 集团 | 4,389,630.09 | 2.23 |
| 124 | 600597 | 光明乳业   | 4,389,500.13 | 2.23 |
| 125 | 600352 | 浙江龙盛   | 4,383,232.56 | 2.23 |
| 126 | 002465 | 海格通信   | 4,311,212.95 | 2.19 |
| 127 | 600720 | 祁连山    | 4,280,864.22 | 2.17 |
| 128 | 002253 | 川大智胜   | 4,154,769.59 | 2.11 |
| 129 | 600315 | 上海家化   | 4,154,119.77 | 2.11 |
| 130 | 002142 | 宁波银行   | 4,138,461.24 | 2.10 |
| 131 | 300202 | 聚龙股份   | 4,087,379.28 | 2.08 |
| 132 | 600388 | 龙净环保   | 4,084,242.49 | 2.07 |
| 133 | 600525 | 长园集团   | 4,030,445.08 | 2.05 |
| 134 | 002023 | 海特高新   | 3,979,532.24 | 2.02 |

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 | 1,525,078,562.48 |
| 卖出股票收入（成交）总额 | 1,558,142,183.77 |

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

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

本基金投资股指期货以投资组合避险和有效管理为目的，通过套期保值策略，对冲系统性风险，应对组合构建与调整中的流动性风险，力求风险收益的优化。

## 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。

### 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   | 296,277.24   |
| 2  | 应收证券清算款 | 7,032,171.96 |
| 3  | 应收股利    | -            |
| 4  | 应收利息    | 9,164.34     |
| 5  | 应收申购款   | 74,062.45    |
| 6  | 其他应收款   | -            |
| 7  | 待摊费用    | -            |
| 8  | 其他      | -            |
| 9  | 合计      | 7,411,675.99 |

#### 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

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<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 |
| 6,437        | 25,624.74     | 11,475,916.13 | 6.96%      | 153,470,537.87 | 93.04%     |

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 | 82,864.22 | 0.0502%  |

注：1、本公司高级管理人员、基金投资和部门负责人持有该基金份额总量的数量区间：0。

2、本基金的基金经理持有本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（2012年3月20日）基金份额总额 | 2,049,911,272.87 |
| 本报告期期初基金份额总额              | 198,688,850.76   |
| 本报告期基金总申购份额               | 392,490,629.85   |
| 减：本报告期基金总赎回份额             | 426,233,026.61   |
| 本报告期基金拆分变动份额              | -                |
| 本报告期末基金份额总额               | 164,946,454.00   |

**§ 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)，本年度应支付的审计费用为 4 万元整。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 |    |
| 兴业证券 | 2      | 509,415,052.16 | 16.52%       | 450,787.30 | 16.36%     | -  |
| 招商证券 | 3      | 459,421,329.20 | 14.90%       | 407,408.98 | 14.78%     | -  |
| 上海证券 | 1      | 438,210,017.15 | 14.21%       | 398,945.18 | 14.48%     | -  |
| 光大证券 | 2      | 235,646,211.70 | 7.64%        | 208,525.66 | 7.57%      | -  |
| 长城证券 | 2      | 199,772,706.47 | 6.48%        | 181,873.35 | 6.60%      | -  |
| 中信建投 | 3      | 193,572,937.17 | 6.28%        | 171,292.97 | 6.22%      | -  |
| 东兴证券 | 1      | 152,315,845.12 | 4.94%        | 134,785.87 | 4.89%      | -  |
| 中金公司 | 2      | 133,580,923.50 | 4.33%        | 118,421.06 | 4.30%      | -  |
| 红塔证券 | 1      | 132,679,747.74 | 4.30%        | 120,791.00 | 4.38%      | -  |
| 浙商证券 | 1      | 119,170,799.56 | 3.87%        | 105,457.30 | 3.83%      | -  |
| 银河证券 | 4      | 78,225,416.06  | 2.54%        | 70,414.55  | 2.56%      | -  |
| 中银国际 | 2      | 77,847,111.12  | 2.52%        | 70,352.04  | 2.55%      | -  |
| 华创证券 | 1      | 59,301,880.85  | 1.92%        | 52,477.17  | 1.90%      | -  |
| 申银万国 | 1      | 51,246,001.70  | 1.66%        | 46,654.20  | 1.69%      | -  |
| 世纪证券 | 1      | 45,858,215.03  | 1.49%        | 41,749.16  | 1.51%      | -  |
| 东北证券 | 2      | 45,292,264.14  | 1.47%        | 41,234.05  | 1.50%      | -  |
| 宏源证券 | 1      | 44,655,114.46  | 1.45%        | 39,515.99  | 1.43%      | -  |
| 国金证券 | 2      | 44,580,491.62  | 1.45%        | 39,449.96  | 1.43%      | -  |
| 国盛证券 | 1      | 25,355,254.51  | 0.82%        | 22,436.68  | 0.81%      | -  |
| 西部证券 | 1      | 22,246,845.92  | 0.72%        | 19,686.18  | 0.71%      | -  |
| 英大证券 | 1      | 14,826,581.07  | 0.48%        | 13,497.92  | 0.49%      | -  |
| 国泰君安 | 2      | -              | 0.00%        | -          | 0.00%      | -  |
| 中信证券 | 2      | -              | 0.00%        | -          | 0.00%      | -  |
| 国信证券 | 1      | -              | 0.00%        | -          | 0.00%      | -  |
| 海通证券 | 1      | -              | 0.00%        | -          | 0.00%      | -  |
| 方正证券 | 1      | -              | 0.00%        | -          | 0.00%      | -  |
| 广发证券 | 1      | -              | 0.00%        | -          | 0.00%      | -  |
| 安信证券 | 1      | -              | 0.00%        | -          | 0.00%      | -  |
| 北京高华 | 1      | -              | 0.00%        | -          | 0.00%      | -  |
| 天风证券 | 1      | -              | 0.00%        | -          | 0.00%      | -  |
| 华泰证券 | 1      | -              | 0.00%        | -          | 0.00%      | -  |
| 民生证券 | 1      | -              | 0.00%        | -          | 0.00%      | -  |

|      |   |   |       |   |       |   |
|------|---|---|-------|---|-------|---|
| 南京证券 | 1 | - | 0.00% | - | 0.00% | - |
| 平安证券 | 1 | - | 0.00% | - | 0.00% | - |
| 齐鲁证券 | 1 | - | 0.00% | - | 0.00% | - |
| 瑞银证券 | 1 | - | 0.00% | - | 0.00% | - |

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：

- (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专用席位。

本报告期内租用交易单元变更情况，新增席位：银河证券、东兴证券、东北证券，退租席位：无。

### 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 |
| 兴业证券 | -            | 0.00%        | -      | 0.00%          | -    | 0.00%        |
| 招商证券 | -            | 0.00%        | -      | 0.00%          | -    | 0.00%        |
| 上海证券 | -            | 0.00%        | -      | 0.00%          | -    | 0.00%        |
| 光大证券 | -            | 0.00%        | -      | 0.00%          | -    | 0.00%        |
| 长城证券 | -            | 0.00%        | -      | 0.00%          | -    | 0.00%        |
| 中信建投 | 76,717.30    | 4.03%        | -      | 0.00%          | -    | 0.00%        |
| 东兴证券 | -            | 0.00%        | -      | 0.00%          | -    | 0.00%        |
| 中金公司 | -            | 0.00%        | -      | 0.00%          | -    | 0.00%        |
| 红塔证券 | 1,537,776.00 | 80.69%       | -      | 0.00%          | -    | 0.00%        |



|      |            |        |   |       |   |       |
|------|------------|--------|---|-------|---|-------|
| 浙商证券 | -          | 0.00%  | - | 0.00% | - | 0.00% |
| 银河证券 | -          | 0.00%  | - | 0.00% | - | 0.00% |
| 中银国际 | -          | 0.00%  | - | 0.00% | - | 0.00% |
| 华创证券 | -          | 0.00%  | - | 0.00% | - | 0.00% |
| 申银万国 | -          | 0.00%  | - | 0.00% | - | 0.00% |
| 世纪证券 | -          | 0.00%  | - | 0.00% | - | 0.00% |
| 东北证券 | -          | 0.00%  | - | 0.00% | - | 0.00% |
| 宏源证券 | -          | 0.00%  | - | 0.00% | - | 0.00% |
| 国金证券 | -          | 0.00%  | - | 0.00% | - | 0.00% |
| 国盛证券 | -          | 0.00%  | - | 0.00% | - | 0.00% |
| 西部证券 | -          | 0.00%  | - | 0.00% | - | 0.00% |
| 英大证券 | 291,270.00 | 15.28% | - | 0.00% | - | 0.00% |
| 国泰君安 | -          | 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% |
| 海通证券 | -          | 0.00%  | - | 0.00% | - | 0.00% |
| 方正证券 | -          | 0.00%  | - | 0.00% | - | 0.00% |
| 广发证券 | -          | 0.00%  | - | 0.00% | - | 0.00% |
| 安信证券 | -          | 0.00%  | - | 0.00% | - | 0.00% |
| 北京高华 | -          | 0.00%  | - | 0.00% | - | 0.00% |
| 天风证券 | -          | 0.00%  | - | 0.00% | - | 0.00% |
| 华泰证券 | -          | 0.00%  | - | 0.00% | - | 0.00% |
| 民生证券 | -          | 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% |
| 齐鲁证券 | -          | 0.00%  | - | 0.00% | - | 0.00% |
| 瑞银证券 | -          | 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