

# 大成景恒保本混合型证券投资基金 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。安永华明会计师事务所（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	大成景恒保本混合
基金主代码	090019
交易代码	090019
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2012 年 6 月 15 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	589,848,006.05 份
基金合同存续期	不定期

### 2.2 基金产品说明

投资目标	本基金通过运用组合保险策略，在为符合保本条件的投资金额提供保本保障的基础上，追求基金资产的长期增值。
投资策略	本基金投资采用 VPPI 可变组合保险策略（Variable Proportion Portfolio Insurance）。VPPI 策略是国际投资管理领域中一种常见的投资组合保险机制，将基

	金资产动态优化分配在保本资产和风险资产上；并根据数量分析、市场波动等来调整、修正风险资产与保本资产在投资组合中的比重，在大概率保证风险资产可能的损失金额不超过扣除相关费用后的安全垫的基础上，积极参与分享市场可能出现的风险收益，从而在保证本金安全的前提下实现基金资产长期稳定增值。保本资产主要包括货币市场工具和债券等低风险资产，其中债券包括国债、金融债、企业债、公司债、债券回购、央行票据、中期票据、可转换债券、可分离交易债券、短期融资券、银行存款、资产支持证券以及经法律法规或中国证监会允许投资的其他债券类金融工具；风险资产主要包括股票、股指期货、权证等高风险资产。
业绩比较基准	3 年期银行定期存款利率（税后）。指按照基金合同生效日或新的保本周期开始日中国人民银行公布并执行的同期金融机构人民币存款基准利率（按照四舍五入的方法保留到小数点后第 2 位，单位为百分数）计算的与当期保本周期同期限的税后收益率。
风险收益特征	本基金为保本混合型基金产品，属证券投资基金中的低风险收益品种。

### 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	<a href="http://www.dcfund.com.cn">http://www.dcfund.com.cn</a>
基金年度报告备置地点	深圳市福田区深南大道 7088 号招商银行大厦 32 层大成基金管理有限公司 北京市西城区复兴门内大街 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6月15日(基金合同生效日)-2012年12月31日
本期已实现收益	-14,364,772.17	6,970,050.85
本期利润	-4,044,727.35	-2,793,601.97
加权平均基金份额本期利润	-0.0055	-0.0029
本期基金份额净值增长率	-0.90%	-0.30%
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	-0.0178	-0.0027
期末基金资产净值	582,621,025.10	887,410,843.43
期末基金份额净值	0.988	0.997

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

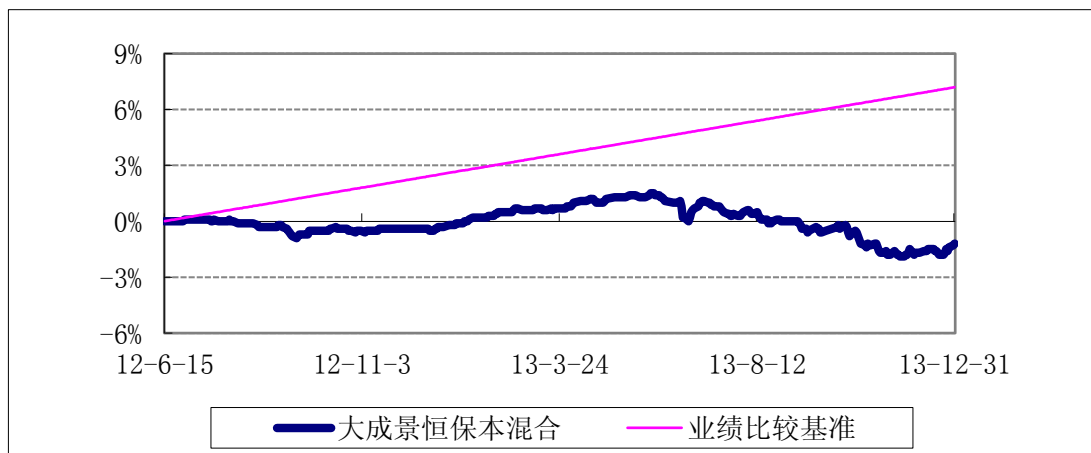
2、所述基金业绩指标不包括持有人交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

### 3.2 基金净值表现

#### 3.2.1 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

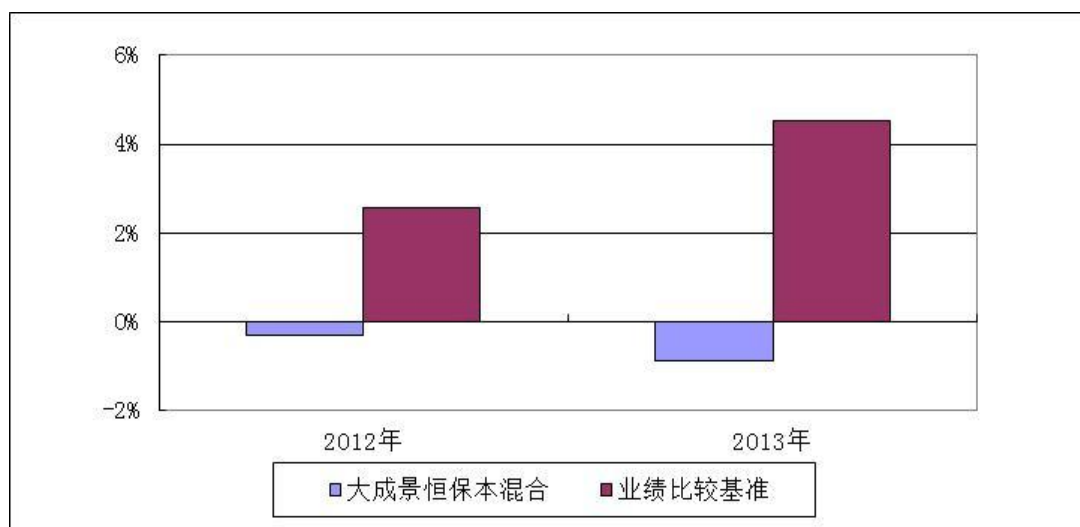
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	-0.70%	0.13%	1.11%	0.01%	-1.81%	0.12%
过去六个月	-1.89%	0.11%	2.24%	0.01%	-4.13%	0.10%
过去一年	-0.90%	0.11%	4.53%	0.01%	-5.43%	0.10%
自基金合同生效起至今	-1.20%	0.09%	7.20%	0.01%	-8.40%	0.08%

### 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起 6 个月内为建仓期。截至报告期末，本基金各项资产配置比例已符合基金合同的规定。

### 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 6 月 15 日(基金合同生效日)至 2012 年 12 月 31 日。

### 3.3 过去三年基金的利润分配情况

本基金自 2012 年 6 月 15 日(基金合同生效日)以来未有收益分配事项。

## § 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		
王磊先生	本基金基金经理	2013 年 7 月 17 日	-	9 年	经济学硕士。2003 年 5 月至 2012 年 10 月曾任证券时报社公司新闻部记者、世纪证券投资银行部业务董事、国信证券经济研究所分析师及资产管理总部专户投资经理、中银基金管理有限公司专户理财部投资经理及总监（主持工作）。2012 年 11 月加入大成基金管理有限公司。2013 年 6 月 7 日起担任大成强化收益债券型证券投资基金基金经理。2013

					年 7 月 17 日起任大成景恒保本混合型证券投资基金基金经理。2013 年 11 月 9 日起任大成可转债增强债券型证券投资基金基金经理。具有基金从业资格。国籍：中国
朱文辉先生	本基金经理	2012 年 6 月 15 日	2013 年 11 月 8 日	13 年	工商管理硕士。2000 年 9 月至 2002 年 1 月就职于平安保险集团总公司投资管理中心任债券研究员；2002 年 1 月至 2003 年 1 月就职于东方保险股份有限公司投资管理中心任债券投资经理。2003 年 1 月至 2005 年 12 月就职于生命人寿保险股份有限公司资产管理部任助理总经理；2006 年 1 月至 2010 年 12 月就职于汇丰晋信基金管理有限公司基金投资部任固定收益投资副总监，2008 年 12 月 3 日至 2010 年 12 月 4 日兼任汇丰晋信平稳增利债券型证券投资基金基金经理。2011 年加入大成基金管理有限公司，2011 年 6 月 4 日至 2013 年 11 月 8 日任大成保本混合型证券投资基金基金经理。2011 年 11 月 30 日至 2013 年 11 月 8 日任大成可转债增强债券基金基金经理。2012 年 6 月 15 日至 2013 年 11 月 8 日任大成景恒保本混合型证券投资基金基金经理。具有基金从业资格。国籍：中国
黄海峰先生	本基金经理助理	2013 年 10 月 28 日	-	9 年	南开大学经济学学士，2004 年 7 月至 2010 年 5 月就职于深圳农村商业银行，任资金部投资经理；2010 年 5 月至 2012 年 10 月就职于博时基金管理有限公司，任交易部交易员；2012 年 7 月至 2013 年 5 月就职于银华基金管理有限公司，任固定收益部基金经理助理；2013 年 7 月加入大成基金管理有限公司固定收益部。2013 年 10 月 14 日起任大成现金宝场内实时申赎货币市场基金基金经理助理。2013 年

					10 月 28 日起大成景恒保本混合型证券投资基金基金经理助理。具有基金从业资格。国籍：中国
--	--	--	--	--	--

注：1、任职日期、离任日期为本基金管理人作出决定之日。

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

#### 4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人严格遵守《证券法》、《证券投资基金法》、《大成景恒保本混合型证券投资基金基金合同》和其他有关法律法规的规定，在基金管理运作中，大成景恒保本混合型证券投资基金的投资范围、投资比例、投资组合、证券交易行为、信息披露等符合有关法律法规、行业监管规则和基金合同等规定，本基金没有发生重大违法违规行为，没有运用基金财产进行内幕交易和操纵市场行为以及进行有损基金投资人利益的关联交易，整体运作合法、合规。本基金将继续以取信于市场、取信于社会投资公众为宗旨，承诺将一如既往地本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金财产，在规范基金运作和严格控制投资风险的前提下，努力为基金份额持有人谋求最大利益。

#### 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

##### 4.3.1 公平交易制度和控制方法

根据《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》的规定，基金管理人制订了《大成基金管理有限公司公平交易制度》及《大成基金管理有限公司异常交易监控与报告制度》。基金管理人旗下投资组合严格按照制度的规定，参与股票、债券的一级市场申购、二级市场交易等投资管理活动，内容包括授权、研究分析、投资决策、交易执行、业绩评估等与投资活动相关的各个环节。研究部负责提供投资研究支持，投资部门负责投资决策，交易管理部负责实施交易并实时监控，监察稽核部负责事前监督、事中检查和事后稽核，风险管理部负责对交易情况进行合理性分析，通过多部门的协作互控，保证了公平交易的可操作、可稽核和可持续。

##### 4.3.2 公平交易制度的执行情况

报告期内，基金管理人严格执行了公平交易的原则和制度。

基金管理人运用统计分析方法和工具，对旗下所有投资组合间连续 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 年宏观经济运行平稳，全年 GDP 同比增长 7.7%，通胀形势稳定，全年 CPI 增长 2.6%。从 2013 年情况看，基本面因素基本符合市场预期，全年债券市场走势主要受到了政策面和资金面超预期扰动，债券市场经历罕见的剧烈波动。中债综合财富（总值）指数全年下跌 0.47%，其中下半年下跌 2.74%，半年跌幅创历史之最。股票市场行情严重分化，创业板指全年暴涨 82.73%，上证 50 则大跌 15.23%。在大盘股拖累下，整体震荡下行，沪深 300 指数跌幅为 7.65%，中证可转债指数跌幅为 1.42%。

在组合操作上，下半年基于对债市偏空看法，我们全面降低资产久期，减持了长久期债券，在收益不断走高过程中逐步增持中高评级优质信用债，力争在控制久期和信用风险前提下提高组合静态收益，以积累更高安全垫。股票仓位维持稳定，适时降低大盘股仓位，通过分散持股和精选个股来增强收益。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末，本基金份额净值为 0.988 元，本报告期份额净值增长率为 -0.90%，同期业绩比较基准增长率为 4.53%，低于业绩比较基准的表现。

### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望 2014 年，从国外看，欧美日低利率有望维持，发达经济体复苏趋势渐强，但新兴市场在美国缩减 QE 规模影响下可能面临资金外流、货币贬值和经济失衡等问题，整体看外围市场不确定性和复杂性比 2013 年有所增加。从国内看，我国的经济面临调结构和改革压力，短期内难以出现一个整体的向上趋势，改革的力度和进程将更为深刻地影响经济运行。基于上述基本判断，我们认为资本市场整体震荡为主，债券市场关注资金面和央行货币政策变化，股票市场主要抓改革和产业热点。

本基金 2014 年将继续保持高比例的固定收益证券投资，加大波段操作力度，重点关注宏观经济数据指标和政策动向，根据基本面、资金面和政策面灵活调整债券资产仓位和久期，在确保安全性和流动性基础上博取更高收益。权益类操作将密切关注改革、结构调整和新兴产业发展态势，通过仓位控制来调整风险敞口，深入挖掘个股来增强收益。

我们非常感谢基金份额持有人的信任和支持，我们将按照本基金合同和风险收益特征的要求，严格控制投资风险，积极进行资产配置，适时调整组合结构，研究新的投资品种和挖掘投资机会，力争获得与基金风险特征一致的稳定收益回报给投资者。

#### 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”）在对大成景恒保本混合型证券投资基金（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遵规守信、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 年度财务会计报告已经安永华明会计师事务所（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：大成景恒保本混合型证券投资基金

报告截止日：2013 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资产	本期末 2013 年 12 月 31 日	上年度末 2012 年 12 月 31 日
<b>资产：</b>		
银行存款	101,338,954.94	44,963,254.68
结算备付金	2,644,997.67	263,860.96

存出保证金	96,615.23	-
交易性金融资产	420,772,397.24	835,661,746.40
其中：股票投资	52,200,444.54	-
基金投资	-	-
债券投资	368,571,952.70	835,661,746.40
资产支持证券投资	-	-
衍生金融资产	-	-
买入返售金融资产	79,500,489.25	-
应收证券清算款	-	-
应收利息	5,433,127.34	13,886,898.50
应收股利	-	-
应收申购款	989.79	-
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	-
资产总计	609,787,571.46	894,775,760.54
<b>负债和所有者权益</b>	<b>本期末</b>	<b>上年度末</b>
	<b>2013年12月31日</b>	<b>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	24,869,062.21	5,504,499.72
应付赎回款	904,649.15	669,004.69
应付管理人报酬	601,774.79	916,326.72
应付托管费	100,295.81	152,721.12
应付销售服务费	-	-
应付交易费用	321,477.80	2,125.00
应交税费	188,252.80	-
应付利息	-	-
应付利润	-	-
递延所得税负债	-	-
其他负债	181,033.80	120,239.86
负债合计	27,166,546.36	7,364,917.11
<b>所有者权益：</b>		
实收基金	589,848,006.05	889,849,565.84
未分配利润	-7,226,980.95	-2,438,722.41
所有者权益合计	582,621,025.10	887,410,843.43
负债和所有者权益总计	609,787,571.46	894,775,760.54

注：1、报告截止日 2013 年 12 月 31 日，基金份额净值人民币 0.9880 元，基金份额总额 589,848,006.05 份。

2、本基金合同生效日为 2012 年 6 月 15 日，本财务报表比较期间的实际编制期间为 2012 年 6 月

15 日(基金合同生效日)至 2012 年 12 月 31 日。

## 7.2 利润表

会计主体：大成景恒保本混合型证券投资基金

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 2013 年 1 月 1 日至 2013 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2012 年 6 月 15 日(基金合 同生效日)至 2012 年 12 月 31 日
<b>一、收入</b>	7,778,530.58	4,801,304.56
1. 利息收入	23,893,668.48	16,436,279.79
其中：存款利息收入	715,328.78	566,888.58
债券利息收入	22,079,244.47	12,408,437.64
资产支持证券利息收入	-	-
买入返售金融资产收入	1,099,095.23	3,460,953.57
其他利息收入	-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）	-27,763,476.24	-2,782,987.22
其中：股票投资收益	-4,470,714.45	-
基金投资收益	-	-
债券投资收益	-23,438,830.75	-2,782,987.22
资产支持证券投资收益	-	-
衍生工具收益	-	-
股利收益	146,068.96	-
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	10,320,044.82	-9,763,652.82
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）	-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	1,328,293.52	911,664.81
<b>减：二、费用</b>	11,823,257.93	7,594,906.53
1. 管理人报酬	8,905,866.07	6,305,915.52
2. 托管费	1,484,311.05	1,050,985.87
3. 销售服务费	-	-
4. 交易费用	1,001,389.64	6,674.57
5. 利息支出	-	-
其中：卖出回购金融资产支出	-	-
6. 其他费用	431,691.17	231,330.57
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>	-4,044,727.35	-2,793,601.97
减：所得税费用	-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>	-4,044,727.35	-2,793,601.97

## 7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：大成景恒保本混合型证券投资基金

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 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）	889,849,565.84	-2,438,722.41	887,410,843.43
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-4,044,727.35	-4,044,727.35
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）	-300,001,559.79	-743,531.19	-300,745,090.98
其中：1. 基金申购款	1,826,502.29	2,364.23	1,828,866.52
2. 基金赎回款	-301,828,062.08	-745,895.42	-302,573,957.50
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）	589,848,006.05	-7,226,980.95	582,621,025.10
项目	上年度可比期间 2012 年 6 月 15 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）	1,071,726,792.02	-	1,071,726,792.02
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-2,793,601.97	-2,793,601.97
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）	-181,877,226.18	354,879.56	-181,522,346.62
其中：1. 基金申购款	813,766.77	-3,441.62	810,325.15
2. 基金赎回款	-182,690,992.95	358,321.18	-182,332,671.77
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净	-	-	-

值变动（净值减少以“-”号填列）			
五、期末所有者权益（基金净值）	889,849,565.84	-2,438,722.41	887,410,843.43

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：

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

## 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

#### 1. 印花税

经国务院批准，财政部、国家税务总局研究决定，自 2008 年 4 月 24 日起，调整证券（股票）交易印花税税率，由原先的 3‰调整为 1‰；

经国务院批准，财政部、国家税务总局研究决定，自 2008 年 9 月 19 日起，调整由出让方按证券（股票）交易印花税税率缴纳印花税，受让方不再征收，税率不变；

根据财政部、国家税务总局财税字[2005]103 号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》的规定，股权分置改革过程中因非流通股股东向流通股股东支付对价而发生的股权转让，暂免征收印花税。

#### 2. 营业税、企业所得税

根据财政部、国家税务总局财税字[2004]78 号文《关于证券投资基金税收政策的通知》的规定，自 2004 年 1 月 1 日起，对证券投资基金（封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金）管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入，继续免征营业税和企业所得税；

根据财政部、国家税务总局财税字[2005]103 号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》的规定，股权分置改革中非流通股股东通过对价方式向流通股股东支付的股份、现金等收入，暂免征收流通股股东应缴纳的企业所得税；

根据财政部、国家税务总局财税[2008]1 号文《关于企业所得税若干优惠政策的通知》的规定，对证券投资基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股权的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

#### 3. 个人所得税

根据财政部、国家税务总局财税字[2002]128 号文《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》的规定，对基金取得的股票的股息、红利收入、债券的利息收入及储蓄利息收入，由上市公司、债券发行企业及金融机构在向基金派发股息、红利收入、债券的利息收入及储蓄利息收入时代扣代缴 20%的个人所得税；

根据财政部、国家税务总局财税[2008]132 号《财政部国家税务总局关于储蓄存款利息所得有关个人所得税政策的通知》，自 2008 年 10 月 9 日起暂免征收储蓄存款利息所得个人所得税；

根据财政部、国家税务总局财税字[2005]107 号文《关于股息红利有关个人所得税政策的补充通知》的规定，自 2005 年 6 月 13 日起，对证券投资基金从上市公司分配取得的股息红利所得，按照财税[2005]102 号文规定，扣缴义务人在代扣代缴个人所得税时，减按 50%计算应纳税所得额；

根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2012]85 号文《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》的规定，自 2013 年 1 月 1 日起，个人从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，持股期限在 1 个月以内（含 1 个月）的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在 1 个月以上至 1 年（含 1 年）的，暂减按 50%计入应纳税所得额；持股期限超过 1 年的，暂减按 25%计入应纳税所得额。上述所得统一适用 20%的税率计征个人所得税；

根据财政部、国家税务总局财税字[2005]103 号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》的规定，股权分置改革中非流通股股东通过对价方式向流通股股东支付的股份、现金等收入，暂免征收流通股股东应缴纳的个人所得税。

#### 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	基金管理人的子公司
大成创新资本管理有限公司	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、以下关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。



## 7.4.4 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

## 7.4.4.1 通过关联方交易单元进行的交易

## 7.4.4.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2013年1月1日至2013年12月31日		上年度可比期间 2012年6月15日(基金合同生效日)至2012年 12月31日	
	成交金额	占当期股票 成交总额的 比例	成交金额	占当期股票 成交总额的比 例
光大证券	227,843,473.73	34.02%	-	0.00%

## 债券交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2013年1月1日至2013年12月31日		上年度可比期间 2012年6月15日(基金合同生效日)至2012年 12月31日	
	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 成交总额的比 例
光大证券	698,009,995.78	65.95%	-	0.00%

## 债券回购交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2013年1月1日至2013年12月31日		上年度可比期间 2012年6月15日(基金合同生效日)至2012年 12月31日	
	回购成交金额	占当期债券 回购 成交总额的 比例	回购成交金额	占当期债券 回购 成交总额的比 例
光大证券	2,885,000,000.00	69.42%	-	0.00%

## 7.4.4.1.2 权证交易

本期及上年度可比期间无关联方权证交易。

## 7.4.4.1.3 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2013年1月1日至2013年12月31日

	当期 佣金	占当期佣金 总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣 金总额的比例
光大证券	205,319.18	34.12%	23,921.40	7.62%
关联方名称	上年度可比期间 2012年6月15日(基金合同生效日)至2012年12月31日			
	当期 佣金	占当期佣金 总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣 金总额的比例
-	-	0.00	-	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	上年度可比期间
	2013年1月1日至2013年12月31日	2012年6月15日(基金合同生效日)至2012年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	8,905,866.07	6,305,915.52
其中：支付销售机构的客户维护费	3,658,709.24	2,591,158.65

注：1) 基金管理费按前一日基金资产净值的1.20%的年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 1.20\% / \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日基金资产净值

基金管理费每日计提，按月支付。经基金管理人与基金托管人核对一致后，由基金托管人于次月首日起3个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。保本周期内，本基金的担保费用从基金管理人的管理费收入中列支，由基金管理人支付给担保人。

2) 基金管理费于2013年末尚未支付的金额为人民币601,774.79元，基金管理费于2012年末尚未支付的金额为人民币916,326.72元。

##### 7.4.4.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2013年1月1日至2013年12月31日	2012年6月15日(基金合同生效日)至2012年12月31日

当期发生的基金应支付的托管费	1,484,311.05	1,050,985.87
----------------	--------------	--------------

注：1) 基金托管人的基金托管费按基金财产净值的 0.20% 年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 0.20\% / \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金财产净值

基金托管费每日计提，按月支付。经基金管理人与基金托管人核对一致后，由基金托管人于次月首日起 3 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金托管人。

2) 基金托管费于 2013 年末尚未支付的金额为人民币 100,295.81 元，基金托管费于 2012 年末尚未支付的金额为人民币 152,721.12 元。

#### 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

本基金本期及上年度可比期间未与关联方进行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

本基金的管理人于本报告期及上年度可比期间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

本基金除基金管理人之外的其他关联方于本报告期及上年度可比期间未持有本基金份额。

#### 7.4.4.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2013 年 1 月 1 日至 2013 年 12 月 31 日		上年度可比期间 2012 年 6 月 15 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
中国银行	51,338,954.94	296,765.36	44,963,254.68	464,088.98

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

本基金于本报告期及上年度可比期间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

本基金本期及上年度可比期间无其他关联交易事项。

**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**

本基金本报告期末未持有因认购新发/增发证券而于年末流通受限证券。

**7.4.5.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票**

本基金本报告期末未持有暂时停牌等流通受限的股票。

**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**

截至本报告期末 2013 年 12 月 31 日止，本基金未持有从事银行间市场债券正回购交易中作为抵押的债券。

**7.4.5.3.2 交易所市场债券正回购**

截至本报告期末 2013 年 12 月 31 日止，本基金未持有从事交易所市场债券正回购交易中作为抵押的债券。

**§ 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	52,200,444.54	8.56
	其中：股票	52,200,444.54	8.56
2	固定收益投资	368,571,952.70	60.44
	其中：债券	368,571,952.70	60.44
	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	79,500,489.25	13.04
	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	103,983,952.61	17.05
6	其他各项资产	5,530,732.36	0.91
7	合计	609,787,571.46	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	-	0.00
C	制造业	31,160,389.34	5.35
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	0.00
E	建筑业	4,623,755.20	0.79
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	2,980,800.00	0.51
J	金融业	7,493,500.00	1.29
K	房地产业	4,631,000.00	0.79
L	租赁和商务服务业	-	0.00
M	科学研究和技术服务业	-	0.00
N	水利、环境和公共设施管理业	-	0.00
O	居民服务、修理和其他服务业	-	0.00
P	教育	-	0.00
Q	卫生和社会工作	-	0.00
R	文化、体育和娱乐业	-	0.00
S	综合	1,311,000.00	0.23
	合计	52,200,444.54	8.96

### 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	600309	万华化学	200,000	4,140,000.00	0.71
2	002285	世联地产	200,000	3,152,000.00	0.54
3	000333	美的集团	50,000	2,500,000.00	0.43
4	300206	理邦仪器	100,000	2,460,000.00	0.42
5	600315	上海家化	49,934	2,108,712.82	0.36
6	601166	兴业银行	200,000	2,028,000.00	0.35
7	002686	亿利达	119,836	2,025,228.40	0.35
8	600887	伊利股份	50,000	1,954,000.00	0.34

9	600016	民生银行	250,000	1,930,000.00	0.33
10	000001	平安银行	150,000	1,837,500.00	0.32

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

#### 8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

##### 8.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	600016	民生银行	18,271,905.95	2.06
2	600036	招商银行	16,844,585.66	1.90
3	000656	金科股份	7,338,624.83	0.83
4	600837	海通证券	5,875,378.00	0.66
5	601628	中国人寿	5,870,800.00	0.66
6	600030	中信证券	5,869,477.61	0.66
7	000039	中集集团	5,745,120.28	0.65
8	601336	新华保险	5,722,537.83	0.64
9	002570	贝因美	5,609,334.11	0.63
10	600309	万华化学	5,450,000.88	0.61
11	601169	北京银行	5,400,403.61	0.61
12	600887	伊利股份	5,044,890.52	0.57
13	600276	恒瑞医药	4,728,093.42	0.53
14	600157	永泰能源	4,507,997.66	0.51
15	300206	理邦仪器	4,447,804.94	0.50
16	300002	神州泰岳	4,368,117.56	0.49
17	300133	华策影视	4,147,139.19	0.47
18	600108	亚盛集团	3,978,792.85	0.45
19	600073	上海梅林	3,838,940.21	0.43
20	002648	卫星石化	3,769,495.94	0.42

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	600036	招商银行	15,946,414.24	1.80
2	600016	民生银行	15,944,807.03	1.80
3	000656	金科股份	7,325,010.31	0.83
4	000039	中集集团	5,886,107.13	0.66
5	600030	中信证券	5,863,500.00	0.66
6	601336	新华保险	5,820,863.89	0.66
7	002570	贝因美	5,796,434.39	0.65
8	601628	中国人寿	5,549,753.13	0.63
9	601169	北京银行	5,019,544.70	0.57
10	600276	恒瑞医药	4,676,601.67	0.53
11	600108	亚盛集团	4,293,113.42	0.48
12	600157	永泰能源	4,267,416.47	0.48
13	300002	神州泰岳	4,198,619.43	0.47
14	002648	卫星石化	3,955,201.80	0.45
15	300133	华策影视	3,882,001.29	0.44
16	600837	海通证券	3,829,800.00	0.43
17	002226	江南化工	3,644,839.81	0.41
18	300207	欣旺达	3,485,779.74	0.39
19	600000	浦发银行	3,401,341.38	0.38
20	600518	康美药业	3,373,700.00	0.38

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

#### 8.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	362,279,884.19
卖出股票收入（成交）总额	307,537,109.19

注：买入股票成本、卖出股票收入均按买卖成交金额（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

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	-	0.00
2	央行票据	-	0.00
3	金融债券	29,793,000.00	5.11
	其中：政策性金融债	29,793,000.00	5.11
4	企业债券	70,779,165.00	12.15
5	企业短期融资券	159,444,000.00	27.37
6	中期票据	107,431,000.00	18.44
7	可转债	1,124,787.70	0.19

8	其他	-	0.00
9	合计	368,571,952.70	63.26

#### 8.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名债券投资明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	041351012	13 雅砻江 CP001	300,000	30,015,000.00	5.15
2	122214	12 大秦债	306,800	29,998,904.00	5.15
3	041361033	13 萧国资 CP001	300,000	29,865,000.00	5.13
4	130236	13 国开 36	300,000	29,793,000.00	5.11
5	1380375	13 即墨债	200,000	20,036,000.00	3.44

#### 8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

#### 8.8 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

#### 8.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

##### 8.9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金本报告期末投资股指期货。

##### 8.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期末投资股指期货。

#### 8.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

##### 8.10.1 本期国债期货投资政策

本基金本报告期末投资国债期货。

##### 8.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末投资国债期货。

##### 8.10.3 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末投资国债期货。



## 8.11 投资组合报告附注

### 8.11.1 报告期内基金投资的前十名证券的发行主体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

上海家化联合股份有限公司（“上海家化”）于 2013 年 11 月 21 日发布《关于收到中国证监会〈调查通知书〉的公告》，称公司于 2013 年 11 月 20 日收到中国证券监督管理委员会《调查通知书》（编号：沪调查通字 2013-1-64 号），因公司涉嫌未按规定披露信息，中国证券监督管理委员会决定对上海家化立案稽查。本基金投资上海家化的决策流程符合本基金管理人投资管理制度的相关规定。本基金管理人的投研团队对上海家化受调查事件进行了及时分析和跟踪研究，认为该调查不会对上海家化投资价值构成实质性负面影响。

### 8.11.2 本基金投资的前十名股票中，没有投资于超出基金合同规定的备选股票库之外的股票。

### 8.11.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	96,615.23
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	5,433,127.34
5	应收申购款	989.79
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	5,530,732.36

### 8.11.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
1	125089	深机转债	1,124,787.70	0.19

### 8.11.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

### 8.11.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入原因，分项之和与合计可能有尾差。

## § 9 基金份额持有人信息

## 9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

持有人户数 (户)	户均持有的 基金份额	持有人结构			
		机构投资者		个人投资者	
		持有份额	占总份 额比例	持有份额	占总份 额比例
4,185	140,943.37	7,788,059.84	1.32%	582,059,946.21	98.68%

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	1,980.60	0.0003%

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本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6月15日）基金份额总额	1,071,726,792.02
本报告期期初基金份额总额	889,849,565.84
本报告期基金总申购份额	1,826,502.29
减：本报告期基金总赎回份额	301,828,062.08
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期末基金份额总额	589,848,006.05

## § 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：
----------------------

报告期内基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。
----------------------------

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安永华明会计师事务所（特殊普通合伙），本年度应支付的审计费用为 7 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	
光大证券	2	227,843,473.73	34.02%	205,319.18	34.12%	-
广发证券	1	181,286,893.91	27.07%	165,042.00	27.43%	-
招商证券	2	140,656,220.49	21.00%	124,919.70	20.76%	-
安信证券	2	68,069,948.94	10.16%	60,236.24	10.01%	-
英大证券	1	43,244,207.18	6.46%	38,267.07	6.36%	新增
长江证券	1	8,716,249.13	1.30%	7,935.27	1.32%	-
东方证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-

东海证券	1	-	0.00%	-	0.00%	新增
东莞证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
东吴证券	1	-	0.00%	-	0.00%	新增
中航证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
中金公司	2	-	0.00%	-	0.00%	-
中投证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
中信证券	2	-	0.00%	-	0.00%	-
中银国际	1	-	0.00%	-	0.00%	-
渤海证券	2	-	0.00%	-	0.00%	-
财富证券	1	-	0.00%	-	0.00%	新增
广州证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
国都证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
国海证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
国泰君安	1	-	0.00%	-	0.00%	新增
国信证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
海通证券	2	-	0.00%	-	0.00%	-
华宝证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
华福证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
华林证券	1	-	0.00%	-	0.00%	新增
华泰证券	2	-	0.00%	-	0.00%	新增
华鑫证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
江海证券	1	-	0.00%	-	0.00%	新增
民生证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
民族证券	1	-	0.00%	-	0.00%	新增
齐鲁证券	1	-	0.00%	-	0.00%	新增
申银万国	1	-	0.00%	-	0.00%	新增
天源证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
万和证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
万联证券	1	-	0.00%	-	0.00%	新增
西南证券	1	-	0.00%	-	0.00%	新增
湘财证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
银河证券	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：

- (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。

### 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
光大证券	698,009,995.78	65.95%	2,885,000,000.00	69.42%	-	0.00%
广发证券	264,778,933.68	25.02%	617,900,000.00	14.87%	-	0.00%
招商证券	34,004,926.20	3.21%	38,000,000.00	0.91%	-	0.00%
安信证券	2,061,855.40	0.19%	-	0.00%	-	0.00%
英大证券	642,254.61	0.06%	-	0.00%	-	0.00%
长江证券	58,908,997.16	5.57%	615,000,000.00	14.80%	-	0.00%
东方证券	-	0.00%	-	0.00%	-	0.00%
东海证券	-	0.00%	-	0.00%	-	0.00%
东莞证券	-	0.00%	-	0.00%	-	0.00%
东吴证券	-	0.00%	-	0.00%	-	0.00%
中航证券	-	0.00%	-	0.00%	-	0.00%
中金公司	-	0.00%	-	0.00%	-	0.00%
中投证券	-	0.00%	-	0.00%	-	0.00%
中信证券	-	0.00%	-	0.00%	-	0.00%
中银国际	-	0.00%	-	0.00%	-	0.00%
渤海证券	-	0.00%	-	0.00%	-	0.00%
财富证券	-	0.00%	-	0.00%	-	0.00%
广州证券	-	0.00%	-	0.00%	-	0.00%
国都证券	-	0.00%	-	0.00%	-	0.00%

国海证券	-	0.00%	-	0.00%	-	0.00%
国泰君安	-	0.00%	-	0.00%	-	0.00%
国信证券	-	0.00%	-	0.00%	-	0.00%
海通证券	-	0.00%	-	0.00%	-	0.00%
华宝证券	-	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%
华泰证券	-	0.00%	-	0.00%	-	0.00%
华鑫证券	-	0.00%	-	0.00%	-	0.00%
江海证券	-	0.00%	-	0.00%	-	0.00%
民生证券	-	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%
申银万国	-	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%
万联证券	-	0.00%	-	0.00%	-	0.00%
西南证券	-	0.00%	-	0.00%	-	0.00%
湘财证券	-	0.00%	-	0.00%	-	0.00%
银河证券	-	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