

大成景阳领先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 26 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书及其更新。

本年度报告摘要摘自年度报告正文，投资者欲了解详细内容，应阅读年度报告正文。

本报告财务资料已经审计。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 | 大成景阳领先股票 |
| 基金主代码 | 519019 |
| 交易代码 | 519019 |
| 基金运作方式 | 契约型开放式 |
| 基金合同生效日 | 2007 年 12 月 11 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 | 3,318,983,705.74 份 |
| 基金合同存续期 | 不定期 |

2.2 基金产品说明

| | |
|--------|---|
| 投资目标 | 追求基金资产长期增值 |
| 投资策略 | 本基金将通过定量与定性分析相结合的方式，选择代表我国新兴经济体特点、具有核心竞争力的领先上市公司进行投资，分享中国经济高速成长果实，获取超额收益。还将在基金合同允许的范围内，根据国内外宏观经济情况、国内外证券市场估值水平，阶段性不断调整股票资产和其它资产之间的大类资产配置比例。其中，全球主要股市的市盈率比较、我国 GDP 增速、上市公司总体盈利增长速度、股市和债市的预期收益率比较以及利率水平，是确定大类资产配置比例的主要因素。 |
| 业绩比较基准 | 80%×沪深 300 指数+20%×中信标普全债指数 |
| 风险收益特征 | 大成景阳领先股票型证券投资基金是股票型基金，风险高于货币市场基金、债券基金和混合型基金，属于高风险收益的基金品种。 |

2.3 基金管理人和基金托管人

| 项目 | | 基金管理人 | 基金托管人 |
|---------|------|----------------------|-----------------------|
| 名称 | | 大成基金管理有限公司 | 中国农业银行股份有限公司 |
| 信息披露负责人 | 姓名 | 杜鹏 | 李芳菲 |
| | 联系电话 | 0755-83183388 | 010-66060069 |
| | 电子邮箱 | dupeng@dcfund.com.cn | lifangfei@abchina.com |
| 客户服务电话 | | 4008885558 | 95599 |
| 传真 | | 0755-83199588 | 010-63201816 |

2.4 信息披露方式

| | |
|---------------------|---|
| 登载基金年度报告正文的管理人互联网网址 | http://www.dcfund.com.cn |
|---------------------|---|

| | |
|------------|---|
| 基金年度报告备置地点 | 深圳市福田区深南大道 7088 号招商银行大厦 32 层大成基金管理有限公司 北京市西城区复兴门内大街 28 号凯晨世贸中心 东座 F9 中国农业银行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 | 2011 年 |
|---------------|------------------|------------------|-------------------|
| 本期已实现收益 | -19,544,119.43 | -553,636,068.75 | -175,910,482.19 |
| 本期利润 | 14,387,077.36 | -34,756,149.63 | -1,501,834,683.63 |
| 加权平均基金份额本期利润 | 0.0040 | -0.0086 | -0.2468 |
| 本期基金份额净值增长率 | -0.16% | -1.42% | -29.07% |
| 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 | -0.1311 | -0.1254 | -0.0304 |
| 期末基金资产净值 | 2,068,582,312.69 | 2,401,139,493.82 | 2,642,065,682.82 |
| 期末基金份额净值 | 0.623 | 0.624 | 0.633 |

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。

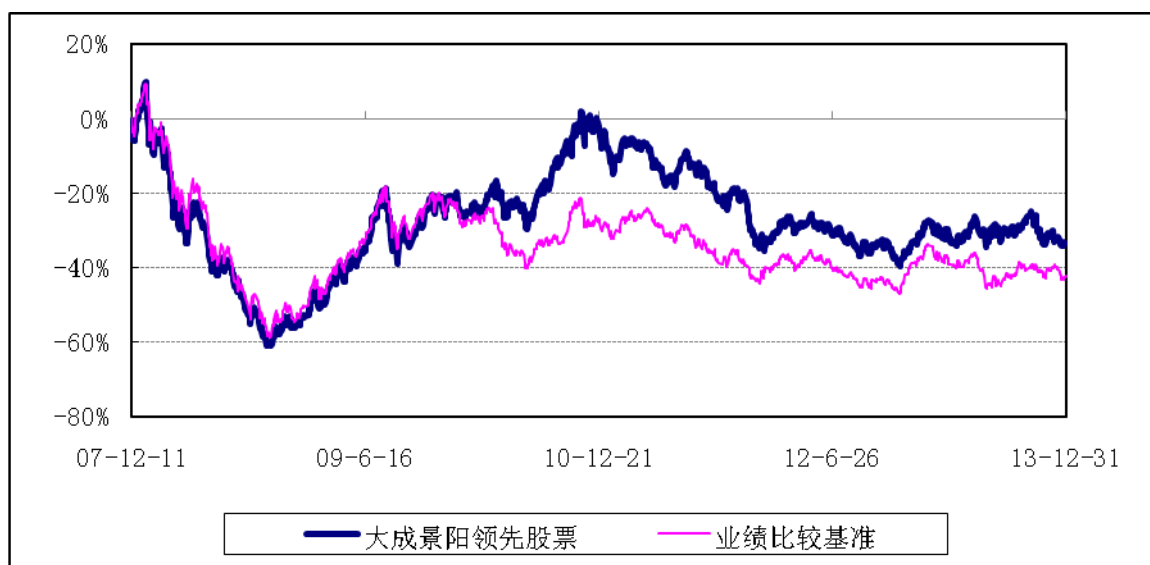
2、所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

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

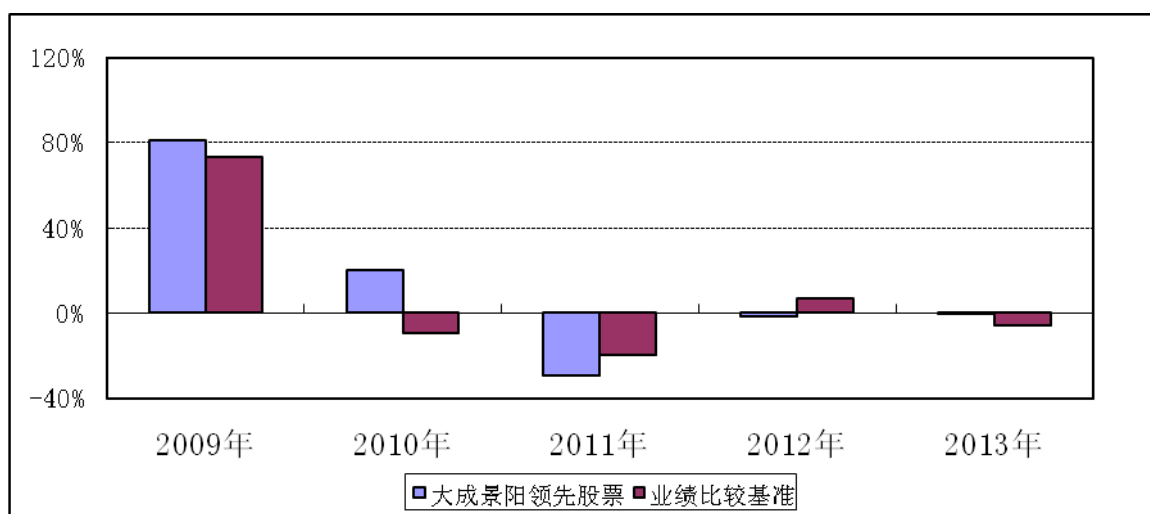
| 阶段 | 份额净值增长率① | 份额净值增长率标准差② | 业绩比较基准收益率③ | 业绩比较基准收益率标准差④ | ①-③ | ②-④ |
|------------|----------|-------------|------------|---------------|---------|-------|
| 过去三个月 | -9.84% | 1.24% | -2.81% | 0.90% | -7.03% | 0.34% |
| 过去六个月 | -0.64% | 1.23% | 4.67% | 1.04% | -5.31% | 0.19% |
| 过去一年 | -0.16% | 1.25% | -5.49% | 1.12% | 5.33% | 0.13% |
| 过去三年 | -30.19% | 1.16% | -18.68% | 1.06% | -11.51% | 0.10% |
| 过去五年 | 52.36% | 1.37% | 27.81% | 1.24% | 24.55% | 0.13% |
| 自基金合同生效起至今 | -33.38% | 1.56% | -42.11% | 1.52% | 8.73% | 0.04% |

3.2.2 自基金转型以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较



注：按基金合同规定，大成景阳领先股票型证券投资基金自基金合同生效（暨基金转型）之日 2007 年 12 月 11 日起 3 个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的约定。截至本报告期末，本基金的各项投资比例已符合基金合同中规定的各项投资比例。

3.2.3 过去五年基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较



3.3 过去三年基金的利润分配情况

单位：人民币元

| 年 度 | 每 10 份基金份 额分红数 | 现金形式发放总 额 | 再投资形式发 放总额 | 年度利润分配合 计 | 备注 |
|--------|-------------------|----------------|---------------|----------------|----|
| 2013 | - | - | - | - | |
| 2012 | - | - | - | - | |
| 2011 | 0.590 | 362,284,523.96 | 90,755,668.42 | 453,040,192.38 | |
| 合计 | 0.590 | 362,284,523.96 | 90,755,668.42 | 453,040,192.38 | |

§ 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 | | |
| 刘泽兵先生 | 本基金基金经理、社保基金及机构投资部副总 | 2012年7月28日 | - | 12年 | 管理学硕士。2001年2月至2012年2月就职于融通基金管理有限公司,历任市场部总监助理、研究员、研究策划部总监助理及基金经理助理等职务。2007年9月28日 |

| | | | | | |
|------|-----------|-----------------|---|-----|--|
| | 监 | | | | 至 2012 年 1 月 19 日任通乾证券投资基金基金经理。2012 年 2 月加入大成基金管理有限公司。2012 年 7 月 28 日起任大成景阳领先股票型证券投资基金基金经理, 现同时任社保基金及机构投资部副总监。具有基金从业资格。国籍: 中国 |
| 李博先生 | 本基金基金经理助理 | 2013 年 3 月 11 日 | - | 3 年 | 电子工程硕士, 2010 年 8 月至 2011 年 5 月就职于国信证券投研中心, 2011 年 5 月加入大成基金管理有限公司, 现任研究部新兴产业小组研究主管。2013 年 3 月 11 日起担任大成景阳领先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 |

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》、《大成景阳领先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, 大成景阳领先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，经济运行维持 7% 附近平稳格局。伴随着中国经济总量突破 50 万亿关口，经济发展速度也由过去 8%-10% 的高速发展区间回落到一个 6%-8% 的中等发展区间。由于经济体量增大、资源以及环保约束，我们判断未来相当长一段时间内经济运行将维持在一个中等增速的区间。

二级市场方面，指数运行出现了巨大差异，沪深 300 指数全年下跌 7.65%，上证指数下跌 6.75%，创业板指数上涨 82.73%。行业表现方面，能源、材料、周期跌幅较大，而信息、可选消费、医药等行业涨幅较大。市场对经济转型期间需求稳定、增速较快、代表未来方向的行业和公司给予了较高定价；而对于增速下降、前景波折的行业和公司予以抛弃。本基金全年仓位维持稳定，行业配置上，减持了房地产、金融、白酒、煤炭；增加了医药、软件、传媒的配置。操作过程中虽对强周期类资产保持了警惕，但在金融、装饰类资产上仍出现了误判，拖累了净值表现。四季度，市场风格剧变，以传媒、通信为代表的成长股跌幅巨大，本基金虽进行了一定的减持操作，但总体配置仍偏重，导致净值出现较大回撤，确需深刻检讨和改进。

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 0.623 元，本报告期份额净值增长率为-0.16%，同期业绩比较基准增长率为-5.49%，高于业绩比较基准的表现。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

2014 年，评估拉动 GDP 的各大类经济部门情况，我们倾向于经济发展为一个弱势格局，同时货币政策仍将保持平稳。传统产业产能过剩以及过高的经营杠杆仍是制约经济长期增长的重要因素；而经济转型无法一蹴而就，转型与改革仍是较长时间的重要话题。从总的经济体量、货币存量以及主要工业产品产量等重要指标判断，未来国内经济大起大落均不现实，结构转型仍将持续较长时间。

基于上述，本基金将减少基于政策以及宏观变量的博弈性操作，以稳增长以及调结构两个大的方向为指引，配置需求稳定、估值较低的资产作为防守端；专心致志基于未来发展前景布局成长性行业和个股作为进攻类资产。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

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

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

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

估值委员会讨论议定特别估值方案并与托管行沟通后由基金运营部具体执行。

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

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

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

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

在托管大成景阳领先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《大成景阳领先股票型证券投资基金基金合同》、《大成景阳领先股票型证券投资基金托管协议》的约定，对大成景阳领先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景阳领先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景阳领先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：大成景阳领先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 2013 年 12 月 31 日 | 上年度末 2012 年 12 月 31 日 |
|-----------------|---------------------------------|----------------------------------|
| 资产： | | |
| 银行存款 | 366,040,497.75 | 610,934,364.68 |
| 结算备付金 | 2,163,842.13 | 1,072,013.09 |
| 存出保证金 | 722,593.03 | 827,037.86 |
| 交易性金融资产 | 1,713,738,383.41 | 1,826,643,514.86 |
| 其中：股票投资 | 1,713,738,383.41 | 1,826,643,514.86 |
| 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 | - | - |
| 应收利息 | 74,089.80 | 127,146.87 |
| 应收股利 | - | - |
| 应收申购款 | 57,420.09 | 117,561.25 |
| 递延所得税资产 | - | - |
| 其他资产 | - | - |
| 资产总计 | 2,082,796,826.21 | 2,439,721,638.61 |
| 负债和所有者权益 | 本期末 2013 年 12 月 31 日 | 上年度末 2012 年 12 月 31 日 |
| 负债： | | |
| 短期借款 | - | - |
| 交易性金融负债 | - | - |
| 衍生金融负债 | - | - |
| 卖出回购金融资产款 | - | - |
| 应付证券清算款 | 8,591,172.04 | 20,751,461.95 |
| 应付赎回款 | 1,056,247.78 | 12,169,831.29 |
| 应付管理人报酬 | 2,668,979.90 | 2,925,101.26 |
| 应付托管费 | 444,829.98 | 487,516.88 |
| 应付销售服务费 | - | - |
| 应付交易费用 | 1,253,081.14 | 1,779,259.71 |
| 应交税费 | - | - |
| 应付利息 | - | - |
| 应付利润 | - | - |

| | | |
|---------------|------------------|------------------|
| 递延所得税负债 | - | - |
| 其他负债 | 200,202.68 | 468,973.70 |
| 负债合计 | 14,214,513.52 | 38,582,144.79 |
| 所有者权益： | | |
| 实收基金 | 2,200,819,727.47 | 2,552,198,094.55 |
| 未分配利润 | -132,237,414.78 | -151,058,600.73 |
| 所有者权益合计 | 2,068,582,312.69 | 2,401,139,493.82 |
| 负债和所有者权益总计 | 2,082,796,826.21 | 2,439,721,638.61 |

注：报告截止日 2013 年 12 月 31 日，基金份额净值 0.623 元，基金份额总额 3,318,983,705.74 份。

7.2 利润表

会计主体：大成景阳领先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 2013 年 1 月 1 日至 2013 年 12 月 31 日 | 上年度可比期间 2012 年 1 月 1 日至 2012 年 12 月 31 日 |
|------------------------|---|--|
| 一、收入 | 65,375,043.52 | 19,437,322.18 |
| 1. 利息收入 | 3,372,343.66 | 3,636,116.02 |
| 其中：存款利息收入 | 3,301,650.82 | 3,620,282.71 |
| 债券利息收入 | 2,094.90 | - |
| 资产支持证券利息收入 | - | - |
| 买入返售金融资产收入 | 68,597.94 | 15,833.31 |
| 其他利息收入 | - | - |
| 2. 投资收益（损失以“-”填列） | 27,955,295.18 | -503,143,861.38 |
| 其中：股票投资收益 | -201,839.64 | -532,236,517.66 |
| 基金投资收益 | - | - |
| 债券投资收益 | 528,905.10 | - |
| 资产支持证券投资收益 | - | - |
| 衍生工具收益 | - | - |
| 股利收益 | 27,628,229.72 | 29,092,656.28 |
| 3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列） | 33,931,196.79 | 518,879,919.12 |
| 4. 汇兑收益（损失以“-”号填列） | - | - |
| 5. 其他收入（损失以“-”号填列） | 116,207.89 | 65,148.42 |
| 减：二、费用 | 50,987,966.16 | 54,193,471.81 |
| 1. 管理人报酬 | 35,119,860.33 | 38,880,969.47 |
| 2. 托管费 | 5,853,309.98 | 6,480,161.61 |
| 3. 销售服务费 | - | - |
| 4. 交易费用 | 9,591,189.53 | 8,391,553.44 |

| | | |
|----------------------------|----------------------|-----------------------|
| 5. 利息支出 | - | - |
| 其中：卖出回购金融资产支出 | - | - |
| 6. 其他费用 | 423,606.32 | 440,787.29 |
| 三、利润总额（亏损总额以“-”号填列） | 14,387,077.36 | -34,756,149.63 |
| 减：所得税费用 | - | - |
| 四、净利润（净亏损以“-”号填列） | 14,387,077.36 | -34,756,149.63 |

7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：大成景阳领先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 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） | 2,552,198,094.55 | -151,058,600.73 | 2,401,139,493.82 |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润） | - | 14,387,077.36 | 14,387,077.36 |
| 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） | -351,378,367.08 | 4,434,108.59 | -346,944,258.49 |
| 其中：1. 基金申购款 | 34,485,095.97 | -706,880.86 | 33,778,215.11 |
| 2. 基金赎回款 | -385,863,463.05 | 5,140,989.45 | -380,722,473.60 |
| 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） | 2,200,819,727.47 | -132,237,414.78 | 2,068,582,312.69 |
| 项目 | 上年度可比期间 2012 年 1 月 1 日至 2012 年 12 月 31 日 | | |
| | 实收基金 | 未分配利润 | 所有者权益合计 |
| 一、期初所有者权益（基金净值） | 2,769,222,631.32 | -127,156,948.50 | 2,642,065,682.82 |
| 二、本期经营活动产生的 | - | -34,756,149.63 | -34,756,149.63 |

| | | | |
|--|------------------|-----------------|------------------|
| 基金净值变动数（本期利润） | | | |
| 三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列） | -217,024,536.77 | 10,854,497.40 | -206,170,039.37 |
| 其中：1. 基金申购款 | 70,283,305.92 | -2,467,243.37 | 67,816,062.55 |
| 2. 基金赎回款 | -287,307,842.69 | 13,321,740.77 | -273,986,101.92 |
| 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） | 2,552,198,094.55 | -151,058,600.73 | 2,401,139,493.82 |

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

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128 号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2008]1 号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85 号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

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

(2) 对基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股权的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

(3) 对基金取得的企业债券利息收入，应由发行债券的企业在向基金支付利息时代扣代缴 20% 的个人所得税。自 2013 年 1 月 1 日起，对基金从上市公司取得的股息红利所得，持股期限在 1 个月以内(含 1 个月)的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在 1 个月以上至 1 年(含 1 年)的，暂减按 50% 计入应纳税所得额；持股期限超过 1 年的，暂减按 25% 计入应纳税所得额。对基金持有的上市公司限售股，解禁后取得的股息、红利收入，按照上述规定计算纳税，持

股时间自解禁日起计算；解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按 50%计入应纳税所得额。上述所得统一适用 20%的税率计征个人所得税。

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

7.4.3 关联方关系

| 关联方名称 | 与本基金的关系 |
|------------------------|-----------------|
| 大成基金管理有限公司(“大成基金”) | 基金管理人、基金销售机构 |
| 中国农业银行股份有限公司(“中国农业银行”) | 基金托管人、基金代销机构 |
| 中泰信托有限责任公司 | 基金管理人的股东 |
| 光大证券股份有限公司(“光大证券”) | 基金管理人的股东、基金代销机构 |
| 中国银河投资管理有限公司 | 基金管理人的股东 |
| 广东证券股份有限公司(“广东证券”) | 基金管理人的股东 |
| 大成国际资产管理有限公司(“大成国际”) | 基金管理人的子公司 |
| 大成创新资本管理有限公司(“大成创新资本”) | 基金管理人的全资子公司 |

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

2. 中国证监会于 2005 年 11 月 6 日作出对广东证券取消业务许可并责令关闭的行政处罚。
3. 下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

7.4.4 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.4.1 通过关联方交易单元进行的交易

7.4.4.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

| 关联方名称 | 本期 2013 年 1 月 1 日至 2013 年 12 月 31 日 | | 上年度可比期间 2012 年 1 月 1 日至 2012 年 12 月 31 日 | |
|-------|--|------------------|---|------------------|
| | 成交金额 | 占当期股票 成交总额的比例 | 成交金额 | 占当期股票 成交总额的比例 |
| 光大证券 | 34,130,132.77 | 0.54% | 169,899,274.87 | 3.17% |

7.4.4.1.2 权证交易

本报告期内及上年度可比期间本基金未通过关联方交易单元进行权证交易。

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 | 30,201.79 | 0.53% | 30,201.79 | 2.41% |

| 关联方名称 | 上年度可比期间 2012年1月1日至2012年12月31日 | | | |
|-------|----------------------------------|----------------|----------|------------------|
| | 当期 佣金 | 占当期佣金 总量的比例 | 期末应付佣金余额 | 占期末应付佣金 总额的比例 |
| 光大证券 | 143,320.83 | 3.11% | 7,350.05 | 0.41% |

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

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

7.4.4.2 关联方报酬

7.4.4.2.1 基金管理费

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2013年1月1日 至2013年12月31日 | 上年度可比期间 2012年1月1日 至2012年12月31日 |
|-----------------|---------------------------------|--------------------------------------|
| 当期发生的基金应支付的管理费 | 35,119,860.33 | 38,880,969.47 |
| 其中：支付销售机构的客户维护费 | 8,636,003.54 | 9,408,534.17 |

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

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

7.4.4.2.2 基金托管费

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2013年1月1日 至2013年12月31日 | 上年度可比期间 2012年1月1日 至2012年12月31日 |
|----------------|---------------------------------|--------------------------------------|
| 当期发生的基金应支付的托管费 | 5,853,309.98 | 6,480,161.61 |

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

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

7.4.4.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本报告期内及上年度可比期间本基金未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

份额单位：份

| 项目 | 本期 2013 年 1 月 1 日 至 2013 年 12 月 31 日 | 上年度可比期间 2012 年 1 月 1 日 至 2012 年 12 月 31 日 |
|----------------------------------|--|---|
| 基金合同生效日（2007 年 12 月 11 日）持有的基金份额 | - | - |
| 期初持有的基金份额 | - | 126,556,154.00 |
| 期间申购/买入总份额 | - | - |
| 期间因拆分变动份额 | - | - |
| 减：期间赎回/卖出总份额 | - | 126,556,154.00 |
| 期末持有的基金份额 | - | - |
| 期末持有的基金份额 占基金总份额比例 | 0.00% | 0.00% |

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 2013 年 1 月 1 日至 2013 年 12 月 31 日 | | 上年度可比期间 2012 年 1 月 1 日至 2012 年 12 月 31 日 | |
|-----------|--|--------------|---|--------------|
| | 期末余额 | 当期利息收入 | 期末余额 | 当期利息收入 |
| 中国农业银行 | 366,040,497.75 | 3,246,095.98 | 610,934,364.68 | 3,585,725.49 |

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

于本报告期末，本基金未持有因认购新发或增发证券而流通受限的证券。

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 |
|--------|------|-------------|---------|--------|-----------|--------|---------|--------------|--------------|----|
| 002518 | 科士达 | 2013年12月30日 | 重大事项未公告 | 18.90 | 2014年1月2日 | 19.01 | 198,281 | 3,615,762.11 | 3,747,510.90 | - |

注：本基金截至 2013 年 12 月 31 日止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

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 | 1,713,738,383.41 | 82.28 |
| | 其中：股票 | 1,713,738,383.41 | 82.28 |
| 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 | 368,204,339.88 | 17.68 |
| 6 | 其他各项资产 | 854,102.92 | 0.04 |
| 7 | 合计 | 2,082,796,826.21 | 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 | - | 0.00 |
| B | 采矿业 | - | 0.00 |
| C | 制造业 | 1,125,552,736.67 | 54.41 |
| D | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | - | 0.00 |
| E | 建筑业 | 41,347,454.40 | 2.00 |
| 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 | 187,056,877.72 | 9.04 |
| J | 金融业 | 240,105,445.22 | 11.61 |
| K | 房地产业 | 24,989,416.90 | 1.21 |
| L | 租赁和商务服务业 | 29,354,452.50 | 1.42 |
| M | 科学研究和技术服务业 | 28,752,000.00 | 1.39 |
| 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 | 36,580,000.00 | 1.77 |
| S | 综合 | - | 0.00 |
| | 合计 | 1,713,738,383.41 | 82.85 |

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 | 000651 | 格力电器 | 5,000,000 | 163,300,000.00 | 7.89 |
| 2 | 600518 | 康美药业 | 8,900,000 | 160,200,000.00 | 7.74 |
| 3 | 601166 | 兴业银行 | 12,010,862 | 121,790,140.68 | 5.89 |
| 4 | 600887 | 伊利股份 | 3,000,000 | 117,240,000.00 | 5.67 |
| 5 | 300273 | 和佳股份 | 4,400,000 | 114,004,000.00 | 5.51 |
| 6 | 600016 | 民生银行 | 12,000,000 | 92,640,000.00 | 4.48 |
| 7 | 000503 | 海虹控股 | 3,199,928 | 66,878,495.20 | 3.23 |
| 8 | 002236 | 大华股份 | 1,559,610 | 63,756,856.80 | 3.08 |
| 9 | 300147 | 香雪制药 | 2,700,000 | 50,220,000.00 | 2.43 |
| 10 | 002570 | 贝因美 | 1,599,904 | 49,117,052.80 | 2.37 |

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 | 601169 | 北京银行 | 93,883,380.57 | 3.91 |
| 2 | 601166 | 兴业银行 | 78,831,801.58 | 3.28 |
| 3 | 300273 | 和佳股份 | 76,983,800.05 | 3.21 |
| 4 | 300251 | 光线传媒 | 72,656,807.55 | 3.03 |
| 5 | 600637 | 百视通 | 65,632,124.50 | 2.73 |
| 6 | 002106 | 莱宝高科 | 62,076,441.53 | 2.59 |
| 7 | 600016 | 民生银行 | 60,566,578.83 | 2.52 |
| 8 | 300104 | 乐视网 | 59,242,168.79 | 2.47 |
| 9 | 300315 | 掌趣科技 | 58,490,884.22 | 2.44 |
| 10 | 000503 | 海虹控股 | 57,050,449.08 | 2.38 |
| 11 | 002236 | 大华股份 | 54,974,756.68 | 2.29 |
| 12 | 600000 | 浦发银行 | 54,945,450.66 | 2.29 |
| 13 | 002309 | 中利科技 | 54,865,736.60 | 2.28 |
| 14 | 600880 | 博瑞传播 | 53,403,405.71 | 2.22 |
| 15 | 002570 | 贝因美 | 52,404,182.97 | 2.18 |
| 16 | 002148 | 北纬通信 | 51,047,363.05 | 2.13 |
| 17 | 600104 | 上汽集团 | 50,860,411.44 | 2.12 |
| 18 | 002450 | 康得新 | 49,523,167.17 | 2.06 |
| 19 | 600645 | 中源协和 | 48,882,037.25 | 2.04 |
| 20 | 300147 | 香雪制药 | 46,216,217.13 | 1.92 |

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 | 601169 | 北京银行 | 112,741,883.69 | 4.70 |
| 2 | 000002 | 万科A | 100,972,979.83 | 4.21 |
| 3 | 600519 | 贵州茅台 | 96,368,737.39 | 4.01 |
| 4 | 601601 | 中国太保 | 93,189,871.85 | 3.88 |

| | | | | |
|----|--------|------|---------------|------|
| 5 | 600837 | 海通证券 | 90,648,544.26 | 3.78 |
| 6 | 600048 | 保利地产 | 86,791,281.13 | 3.61 |
| 7 | 600637 | 百视通 | 80,438,956.66 | 3.35 |
| 8 | 600518 | 康美药业 | 76,782,906.34 | 3.20 |
| 9 | 600111 | 包钢稀土 | 72,325,886.92 | 3.01 |
| 10 | 601318 | 中国平安 | 71,756,222.22 | 2.99 |
| 11 | 000651 | 格力电器 | 64,209,421.80 | 2.67 |
| 12 | 300228 | 富瑞特装 | 57,540,391.36 | 2.40 |
| 13 | 002106 | 莱宝高科 | 54,717,839.64 | 2.28 |
| 14 | 000926 | 福星股份 | 54,085,501.40 | 2.25 |
| 15 | 000768 | 中航飞机 | 53,158,820.56 | 2.21 |
| 16 | 300078 | 中瑞思创 | 53,120,100.79 | 2.21 |
| 17 | 002353 | 杰瑞股份 | 51,982,787.89 | 2.16 |
| 18 | 600079 | 人福医药 | 49,990,489.35 | 2.08 |
| 19 | 600585 | 海螺水泥 | 49,731,421.64 | 2.07 |
| 20 | 600000 | 浦发银行 | 48,895,624.12 | 2.04 |

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 | 3,081,198,157.93 |
| 卖出股票收入（成交）总额 | 3,227,832,646.53 |

注：上述金额均指成交金额（成交单价乘以成交数量），不考虑相关交易费用。

8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

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 | 722,593.03 |
| 2 | 应收证券清算款 | - |
| 3 | 应收股利 | - |
| 4 | 应收利息 | 74,089.80 |
| 5 | 应收申购款 | 57,420.09 |
| 6 | 其他应收款 | - |
| 7 | 待摊费用 | - |
| 8 | 其他 | - |
| 9 | 合计 | 854,102.92 |

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的情况。

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 |
| 126,269 | 26,285.02 | 23,362,344.40 | 0.70% | 3,295,621,361.34 | 99.30% |

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 | 74,800.49 | 0.0022540% |

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（2007年12月11日）基金份额总额 | 1,000,000,000.00 |
| 本报告期期初基金份额总额 | 3,848,863,644.34 |
| 本报告期基金总申购份额 | 52,002,234.00 |
| 减：本报告期基金总赎回份额 | 581,882,172.60 |
| 本报告期基金拆分变动份额 | - |
| 本报告期期末基金份额总额 | 3,318,983,705.74 |

§ 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 100,000.00 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 | |
| 瑞银证券 | | 1851,500,857.07 | 13.50% | 775,202.10 | 13.72% | - |
| 华创证券 | | 1846,624,906.75 | 13.42% | 749,183.07 | 13.26% | - |
| 中信建投 | | 3465,716,255.65 | 7.38% | 412,117.07 | 7.30% | - |
| 银河证券 | | 4434,725,141.74 | 6.89% | 384,696.65 | 6.81% | - |
| 东北证券 | | 2339,862,509.96 | 5.39% | 301,134.71 | 5.33% | - |
| 齐鲁证券 | | 1339,053,487.72 | 5.37% | 308,674.69 | 5.46% | - |
| 兴业证券 | | 2329,146,745.45 | 5.22% | 291,262.85 | 5.16% | - |
| 上海证券 | | 1296,727,541.71 | 4.70% | 270,140.08 | 4.78% | - |

| | | | | | | |
|------|---|----------------|-------|------------|-------|---|
| 东兴证券 | 1 | 282,368,634.59 | 4.48% | 249,868.79 | 4.42% | - |
| 招商证券 | 3 | 236,050,989.30 | 3.74% | 214,633.98 | 3.80% | - |
| 北京高华 | 1 | 227,270,982.57 | 3.60% | 206,909.32 | 3.66% | - |
| 民生证券 | 1 | 224,656,082.93 | 3.56% | 204,524.91 | 3.62% | - |
| 红塔证券 | 1 | 194,335,398.52 | 3.08% | 176,921.55 | 3.13% | - |
| 浙商证券 | 1 | 181,453,387.29 | 2.88% | 160,568.30 | 2.84% | - |
| 国泰君安 | 2 | 167,889,770.00 | 2.66% | 148,571.46 | 2.63% | - |
| 国金证券 | 2 | 163,195,577.32 | 2.59% | 145,783.83 | 2.58% | - |
| 中银国际 | 2 | 151,979,739.66 | 2.41% | 135,591.84 | 2.40% | - |
| 中金公司 | 2 | 142,605,912.66 | 2.26% | 126,192.71 | 2.23% | - |
| 南京证券 | 1 | 124,641,788.44 | 1.98% | 113,472.23 | 2.01% | - |
| 华泰证券 | 1 | 97,579,255.34 | 1.55% | 86,348.65 | 1.53% | - |
| 天风证券 | 1 | 64,115,475.78 | 1.02% | 56,735.79 | 1.00% | - |
| 西部证券 | 1 | 63,641,310.49 | 1.01% | 56,316.16 | 1.00% | - |
| 光大证券 | 2 | 34,130,132.77 | 0.54% | 30,201.79 | 0.53% | - |
| 英大证券 | 1 | 21,916,111.22 | 0.35% | 19,953.02 | 0.35% | - |
| 国盛证券 | 1 | 18,623,694.54 | 0.30% | 16,479.54 | 0.29% | - |
| 方正证券 | 1 | 8,440,014.99 | 0.13% | 7,683.80 | 0.14% | - |
| 国信证券 | 1 | - | 0.00% | - | 0.00% | - |
| 宏源证券 | 1 | - | 0.00% | - | 0.00% | - |
| 世纪证券 | 1 | - | 0.00% | - | 0.00% | - |
| 平安证券 | 1 | - | 0.00% | - | 0.00% | - |
| 中信证券 | 2 | - | 0.00% | - | 0.00% | - |
| 长城证券 | 2 | - | 0.00% | - | 0.00% | - |
| 申银万国 | 1 | - | 0.00% | - | 0.00% | - |
| 广发证券 | 1 | - | 0.00% | - | 0.00% | - |
| 海通证券 | 1 | - | 0.00% | - | 0.00% | - |
| 安信证券 | 1 | - | 0.00% | - | 0.00% | - |

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

租用证券公司交易单元的选择标准主要包括：

- （一）财务状况良好，最近一年无重大违规行为；
- （二）经营行为规范，内控制度健全，能满足各投资组合运作的保密性要求；
- （三）研究实力较强，能提供包括研究报告、路演服务、协助进行上市公司调研等研究服务；
- （四）具备各投资组合运作所需的高效、安全的通讯条件，有足够的交易和清算能力，满足

各投资组合证券交易需要：

(五) 能提供投资组合运作、管理所需的其他券商服务；

(六) 相关基金合同、资产管理合同以及法律法规规定的其他条件。

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

本报告期内本基金租用证券公司交易单元的变更情况如下：

本报告期内本基金新增交易单元：银河证券、东兴证券。本报告期内退租交易单元：申银万国。

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 |
| 瑞银证券 | - | 0.00% | - | 0.00% | - | 0.00% |
| 华创证券 | - | 0.00% | - | 0.00% | - | 0.00% |
| 中信建投 | - | 0.00% | - | 0.00% | - | 0.00% |
| 银河证券 | - | 0.00% | - | 0.00% | - | 0.00% |
| 东北证券 | - | 0.00% | - | 0.00% | - | 0.00% |
| 齐鲁证券 | - | 0.00% | 100,000,000.00 | 100.00% | - | 0.00% |
| 兴业证券 | - | 0.00% | - | 0.00% | - | 0.00% |
| 上海证券 | - | 0.00% | - | 0.00% | - | 0.00% |
| 东兴证券 | - | 0.00% | - | 0.00% | - | 0.00% |
| 招商证券 | - | 0.00% | - | 0.00% | - | 0.00% |
| 北京高华 | - | 0.00% | - | 0.00% | - | 0.00% |
| 民生证券 | - | 0.00% | - | 0.00% | - | 0.00% |
| 红塔证券 | 11,151,000.00 | 100.00% | - | 0.00% | - | 0.00% |
| 浙商证券 | - | 0.00% | - | 0.00% | - | 0.00% |
| 国泰君安 | - | 0.00% | - | 0.00% | - | 0.00% |
| 国金证券 | - | 0.00% | - | 0.00% | - | 0.00% |
| 中银国际 | - | 0.00% | - | 0.00% | - | 0.00% |
| 中金公司 | - | 0.00% | - | 0.00% | - | 0.00% |
| 南京证券 | - | 0.00% | - | 0.00% | - | 0.00% |

| | | | | | | |
|------|---|-------|---|-------|---|-------|
| 华泰证券 | - | 0.00% | - | 0.00% | - | 0.00% |
| 天风证券 | - | 0.00% | - | 0.00% | - | 0.00% |
| 西部证券 | - | 0.00% | - | 0.00% | - | 0.00% |
| 光大证券 | - | 0.00% | - | 0.00% | - | 0.00% |
| 英大证券 | - | 0.00% | - | 0.00% | - | 0.00% |
| 国盛证券 | - | 0.00% | - | 0.00% | - | 0.00% |
| 方正证券 | - | 0.00% | - | 0.00% | - | 0.00% |
| 国信证券 | - | 0.00% | - | 0.00% | - | 0.00% |
| 宏源证券 | - | 0.00% | - | 0.00% | - | 0.00% |
| 世纪证券 | - | 0.00% | - | 0.00% | - | 0.00% |
| 平安证券 | - | 0.00% | - | 0.00% | - | 0.00% |
| 中信证券 | - | 0.00% | - | 0.00% | - | 0.00% |
| 长城证券 | - | 0.00% | - | 0.00% | - | 0.00% |
| 申银万国 | - | 0.00% | - | 0.00% | - | 0.00% |
| 广发证券 | - | 0.00% | - | 0.00% | - | 0.00% |
| 海通证券 | - | 0.00% | - | 0.00% | - | 0.00% |
| 安信证券 | - | 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