

# 大成内需增长股票型证券投资基金 2014 年半年度报告摘要

2014 年 6 月 30 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 8 月 28 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。本半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 8 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。

本半年度报告摘要摘自半年度报告正文，投资者欲了解详细内容，应阅读半年度报告正文。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2014 年 01 月 01 日起至 06 月 30 日止。

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金简称	大成内需增长股票
场内简称	-
基金主代码	090015
交易代码	090015
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2011 年 6 月 14 日
基金管理人	大成基金管理有限公司
基金托管人	中国银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	325,696,469.90 份
基金合同存续期	不定期

### 2.2 基金产品说明

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

### 2.3 基金管理人和基金托管人

项目	基金管理人	基金托管人
名称	大成基金管理有限公司	中国银行股份有限公司

信息披露负责人	姓名	杜鹏	王永民
	联系电话	0755-83183388	010-66594896
	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

登载基金半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>
基金半年度报告备置地点	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 主要财务指标和基金净值表现

### 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	报告期(2014 年 1 月 1 日 - 2014 年 6 月 30 日)
本期已实现收益	1,244,347.19
本期利润	10,459,080.04
加权平均基金份额本期利润	0.0279
本期基金份额净值增长率	7.47%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2014 年 6 月 30 日)
期末可供分配基金份额利润	0.0879
期末基金资产净值	393,345,774.44
期末基金份额净值	1.208

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。

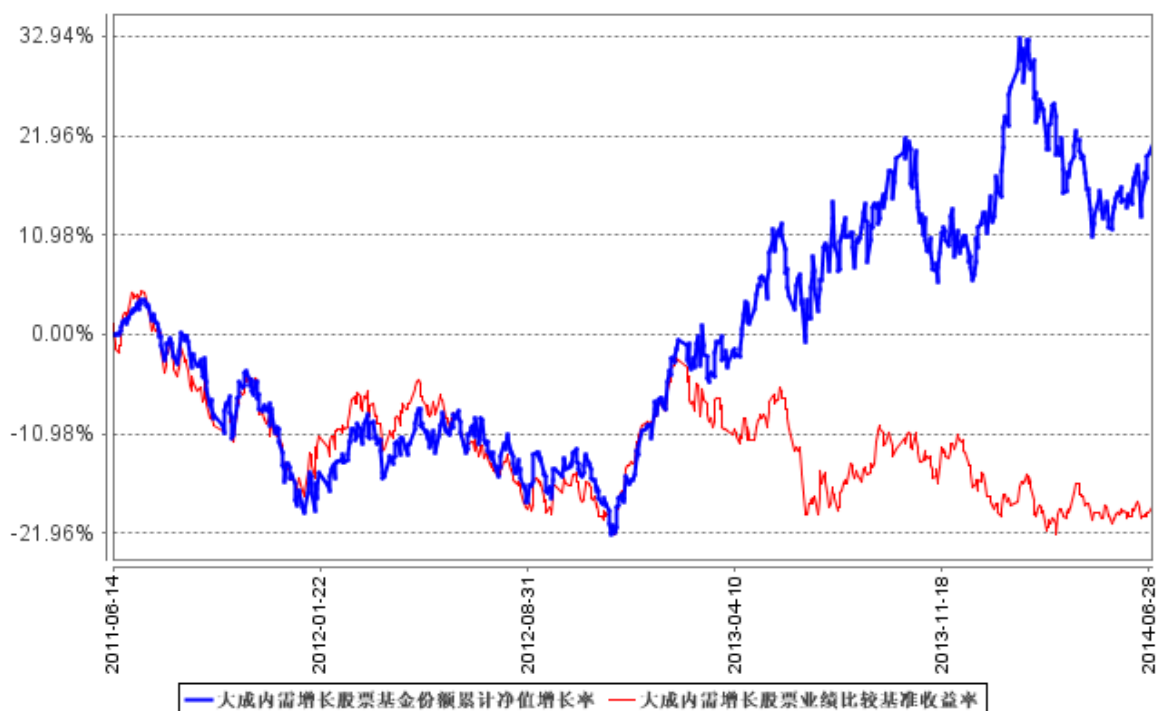
2、所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

### 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
过去一个月	5.13%	1.22%	0.48%	0.62%	4.65%	0.60%
过去三个月	4.23%	1.10%	1.29%	0.70%	2.94%	0.40%
过去六个月	7.47%	1.35%	-4.60%	0.83%	12.07%	0.52%
过去一年	18.78%	1.45%	-0.50%	0.94%	19.28%	0.51%
过去三年	18.78%	1.30%	-21.17%	1.04%	39.95%	0.26%
自基金合同生效起至今	20.80%	1.29%	-19.19%	1.04%	39.99%	0.25%

#### 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。

## § 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 2014 年 6 月 30 日，本基金管理人共管理 1 只封闭式证券投资基金：景福证券投资基金，4 只 ETF 及 1 只 ETF 联接基金：深证成长 40 交易型开放式指数证券投资基金、大成深证成长 40 交易型开放式指数证券投资基金联接基金、大成中证 500 沪市交易型开放式指数证券投资基金、大成中证 100 交易型开放式指数证券投资基金、大成中证 500 深市交易型开放式指数证券投资基金，1 只 QDII 基金：大成标普 500 等权重指数证券投资基金及 37 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、大成竞争优势股票型证券投资基金、大成内需增长股票型证券投资基金、大成消费主题股票型证券投资基金、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、大成景祥分级债券型证券投资基金、大成中小盘股票型证券投资基金（LOF）、大成健康产业股票型证券投资基金、大成信用增利一年定期开放债券型证券投资基金、大成灵活配置混合型证券投资基金、大成招财宝货币市场基金、大成景益平稳收益混合型证券投资基金。

#### 4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		

李本刚先生	本基金基金经理	2012 年 9 月 4 日	-	13 年	管理学硕士。2001 年至 2010 年先后就职于西南证券股份有限公司、中关村证券股份有限公司和建信基金管理有限公司，历任研究员、高级研究员。2010 年 8 月加入大成基金管理有限公司，历任研究部高级研究员、行业研究主管。2012 年 9 月 4 日起任大成内需增长股票型证券投资基金基金经理。2014 年 4 月 16 日起任大成消费主题股票型证券投资基金基金经理。2014 年 5 月 14 日任大成灵活配置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
邓涛先生	本基金基金经理助理	2011 年 7 月 29 日	-	6 年	经济学硕士，2008 年 6 月至 2009 年 2 月就职于长江证券研究部，2009 年 2 月加入大成基金管理有限公司，现任研究部总监助理，2011 年 7 月 29 日起担任景福证券投资基金和大成内需增长股票型证券投资基金基金经理助理。具有基金从业资格。国籍：中国

注：1、任职日期、离任日期为本基金管理人作出决定之日。

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

#### 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

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

#### 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

##### 4.3.1 公平交易制度的执行情况

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分析及相应交易情形的分析结果表明：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组合间的成交价格差异较大。结合交易价差分布统计分析和潜在利益输送金额统计结果表明投资组合间不存在利益输送的可能性。

#### 4.3.2 异常交易行为的专项说明

公司风险管理部定期对公司旗下所有投资组合间同向交易、反向交易等可能存在异常交易的行为进行分析。2014 年上半年公司旗下主动投资组合间股票交易存在 11 笔同日反向交易,原因是投资组合投资策略需要。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 3 笔,原因为投资策略需要;投资组合间存在 1 笔债券同日反向交易,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;投资组合间虽然存在同向交易行为,但结合交易价差分布统计分析和潜在利益输送金额统计结果表明投资组合间不存在利益输送的可能性。

#### 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

2014 年上半年受到地产销量下滑的负面影响,整体经济仍然低迷。在宏观经济整体起色不大,以 TMT 为代表的成长股成为资本市场超额收益明显的板块。借助并购,切入新兴领域成为传统企业转型的重要手段。不过,这种跨界并购的效果值得进一步观察,其中风险需要引起关注。

在 2014 年上半年本基金通过自上而下选股,重点在游戏等新兴领域进行了配置,获得一定超额收益。

##### 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 1.208 元,本报告期基金份额净值增长率为 7.47%,同期业绩比较基准收益率为-4.60%,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

展望下半年,在整体宏观经济低迷背景下,“托底”思维下,政府整体经济政策有望进行改变,采用更为积极的态度在各领域作出一些调整,促进经济阶段性恢复。不过,在整体经济结构调整背景下,指望经济出现大幅度回升并不太现实。

由于上半年创业板的良好表现,所谓的转型、成长股整体估值已经出现泡沫化倾向,缺乏基本面支撑的概念化股票值得进一步警惕。因此在 2014 年下半年,考虑到市场将进行估值切换,业绩成为衡量真成长与伪成长的唯一标准,只有确定性的高增长才能消化估值持续上升带来的压力。因此继续选择有业绩、真成长、估值合理的公司仍是配置的主线。



#### 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

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

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

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

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

#### 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

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

### § 5 托管人报告

#### 5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

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

## 5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

本报告期内，本托管人根据《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，对本基金管理人的投资运作进行了必要的监督，对基金资产净值的计算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 托管人对本半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、财务会计报表（注：财务会计报表中的“金融工具风险及管理”部分未在托管人复核范围内）、投资组合报告中的数据真实、准确和完整。

## § 6 半年度财务会计报告（未经审计）

### 6.1 资产负债表

会计主体：大成内需增长股票型证券投资基金

报告截止日：2014 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	本期末 2014 年 6 月 30 日	上年度末 2013 年 12 月 31 日
<b>资产：</b>		
银行存款	21,069,097.81	14,811,214.25
结算备付金	2,386,836.08	15,051,216.14
存出保证金	274,511.69	360,114.18
交易性金融资产	370,121,469.41	336,383,261.16
其中：股票投资	370,121,469.41	336,383,261.16
基金投资	-	-
债券投资	-	-
资产支持证券投资	-	-
贵金属投资	-	-
衍生金融资产	-	-
买入返售金融资产	-	-
应收证券清算款	5,051,543.62	13,346,854.83
应收利息	7,045.17	6,917.22
应收股利	-	-
应收申购款	297,444.12	50,732,127.43
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	-
资产总计	399,207,947.90	430,691,705.21
<b>负债和所有者权益</b>	<b>本期末 2014 年 6 月 30 日</b>	<b>上年度末 2013 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	-	-
应付赎回款	3,936,575.20	2,567,465.27
应付管理人报酬	569,712.73	476,518.85
应付托管费	94,952.10	79,419.80
应付销售服务费	-	-
应付交易费用	1,072,913.35	1,880,323.62
应交税费	-	-
应付利息	-	-
应付利润	-	-
递延所得税负债	-	-
其他负债	188,020.08	159,392.16
负债合计	5,862,173.46	5,163,119.70
<b>所有者权益：</b>		
实收基金	325,696,469.90	378,692,059.90
未分配利润	67,649,304.54	46,836,525.61
所有者权益合计	393,345,774.44	425,528,585.51
负债和所有者权益总计	399,207,947.90	430,691,705.21

注：报告截止日 2014 年 6 月 30 日，基金份额净值 1.208 元，基金份额总额 325,696,469.90 份。

## 6.2 利润表

会计主体：大成内需增长股票型证券投资基金

本报告期：2014 年 1 月 1 日至 2014 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项 目	本期 2014 年 1 月 1 日至 2014 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2013 年 1 月 1 日至 2013 年 6 月 30 日
<b>一、收入</b>	18,135,590.53	71,701,118.49
1. 利息收入	297,993.77	319,796.21
其中：存款利息收入	297,993.77	298,678.73
债券利息收入	-	266.10
资产支持证券利息收入	-	-
买入返售金融资产收入	-	20,851.38
其他利息收入	-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）	7,548,921.47	76,372,643.60
其中：股票投资收益	5,528,526.39	74,127,538.12
基金投资收益	-	-
债券投资收益	-	53,154.30
资产支持证券投资收益	-	-
贵金属投资收益	-	-

衍生工具收益	-	-
股利收益	2,020,395.08	2,191,951.18
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	9,214,732.85	-5,269,177.69
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）	-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	1,073,942.44	277,856.37
<b>减：二、费用</b>	<b>7,676,510.49</b>	<b>7,434,751.84</b>
1. 管理人报酬	3,264,051.47	3,093,187.32
2. 托管费	544,008.50	515,531.18
3. 销售服务费	-	-
4. 交易费用	3,675,220.98	3,628,784.34
5. 利息支出	-	-
其中：卖出回购金融资产支出	-	-
6. 其他费用	193,229.54	197,249.00
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>	<b>10,459,080.04</b>	<b>64,266,366.65</b>
减：所得税费用	-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>	<b>10,459,080.04</b>	<b>64,266,366.65</b>

### 6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：大成内需增长股票型证券投资基金

本报告期：2014 年 1 月 1 日至 2014 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2014 年 1 月 1 日至 2014 年 6 月 30 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）	378,692,059.90	46,836,525.61	425,528,585.51
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	10,459,080.04	10,459,080.04
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）	-52,995,590.00	10,353,698.89	-42,641,891.11
其中：1. 基金申购款	708,197,797.95	151,012,164.86	859,209,962.81
2. 基金赎回款	-761,193,387.95	-140,658,465.97	-901,851,853.92
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)	325,696,469.90	67,649,304.54	393,345,774.44
项目	上年度可比期间 2013 年 1 月 1 日至 2013 年 6 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益(基金净值)	544,179,652.88	-57,919,030.76	486,260,622.12
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	64,266,366.65	64,266,366.65
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)	-226,051,908.02	-807,183.35	-226,859,091.37
其中：1. 基金申购款	134,993,533.74	3,304,713.66	138,298,247.40
2. 基金赎回款	-361,045,441.76	-4,111,897.01	-365,157,338.77
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)	318,127,744.86	5,540,152.54	323,667,897.40

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 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

## 6.4 报表附注

### 6.4.1 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一致。

### 6.4.2 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[2004]78 号《关于证券投资基金税收政策的通知》、财税[2005]102 号《关于股息红利个人所得税有关政策的通知》、财税[2005]107 号《关于股息红利有关个人所得税政策的补充通知》、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》及其他相关税务法规和实务操作，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。

(2) 基金买卖股票、债券的差价收入暂免征营业税和企业所得税。

(3) 对基金取得的企业债券利息收入，由发行债券的企业在向基金派发利息时代扣代缴 20% 的个人所得税，暂不征收企业所得税。2013 年 1 月 1 日以前，对基金取得的股票的股息、红利收入，由上市公司在向基金派发股息、红利时暂减按 50% 计入个人应纳税所得额，依照现行税法规定即 20% 代扣代缴个人所得税，暂不征收企业所得税。自 2013 年 1 月 1 日起，对基金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。

(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。

#### 6.4.3 关联方关系

##### 6.4.3.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

本基金本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

##### 6.4.3.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

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

注：1、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。

2、下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

## 6.4.4 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

## 6.4.4.1 通过关联方交易单元进行的交易

## 6.4.4.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2014年1月1日至2014年6月30日		上年度可比期间 2013年1月1日至2013年6月30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	456,308,845.91	18.68%	108,548,434.37	4.67%

## 6.4.4.1.2 权证交易

本基金本报告期及上年度可比期间未通过关联方交易单元进行权证交易。

## 6.4.4.1.3 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2014年1月1日至2014年6月30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	403,794.94	18.49%	403,794.94	37.64%
关联方名称	上年度可比期间 2013年1月1日至2013年6月30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	96,147.48	4.63%	96,147.48	7.69%

注：1. 上述佣金按市场佣金率计算，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。

## 6.4.4.2 关联方报酬

## 6.4.4.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2014年1月1日至2014年6月 30日	上年度可比期间 2013年1月1日至2013年6月30日
当期发生的基金应支付	3,264,051.47	3,093,187.32

的管理费		
其中：支付销售机构的客户维护费	11,004,949.18	1,013,524.87

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。

#### 6.4.4.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2014年1月1日至2014年6月30日	2013年1月1日至2013年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	544,008.50	515,531.18

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

日托管费=前一日基金资产净值 X 0.25% / 当年天数。

#### 6.4.4.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金本报告期及上年年度可比期间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。

#### 6.4.4.4 各关联方投资本基金的情况

##### 6.4.4.4.1 报告期内基金管理人运用自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基金管理人未运用自有资金投资本基金。

##### 6.4.4.4.2 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

本报告期内及上年度可比期间除基金管理人之外的其他各关联方无投资本基金的情况。

#### 6.4.4.5 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		上年度可比期间	
	2014年1月1日至2014年6月30日		2013年1月1日至2013年6月30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	21,069,097.81	275,439.96	87,023,466.46	277,023.27

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。

#### 6.4.4.6 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。



## 6.4.4.7 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期无须作说明的其他关联交易事项。

## 6.4.5 期末（2014 年 6 月 30 日）本基金持有的流通受限证券

## 6.4.5.1 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。

## 6.4.5.2 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
300271	华宇软件	2014 年 6 月 27 日	重大资产重组	40.30	-	-	268,500	9,352,147.40	10,820,550.00	-

## 6.4.5.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

## 6.4.5.3.1 银行间市场债券正回购

于本报告期末，本基金无银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

## 6.4.5.3.2 交易所市场债券正回购

于本报告期末，本基金无交易所市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

## § 7 投资组合报告

## 7.1 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	370,121,469.41	92.71
	其中：股票	370,121,469.41	92.71
2	固定收益投资	-	0.00
	其中：债券	-	0.00
	资产支持证券	-	0.00
3	贵金属投资	-	0.00

4	金融衍生品投资	-	0.00
5	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
6	银行存款和结算备付金合计	23,455,933.89	5.88
7	其他各项资产	5,630,544.60	1.41
8	合计	399,207,947.90	100.00

## 7.2 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（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	8,113,000.00	2.06
B	采矿业	-	0.00
C	制造业	309,268,247.48	78.63
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	0.00
E	建筑业	-	0.00
F	批发和零售业	-	0.00
G	交通运输、仓储和邮政业	-	0.00
H	住宿和餐饮业	-	0.00
I	信息传输、软件和信息技术服务业	36,889,550.00	9.38
J	金融业	-	0.00
K	房地产业	-	0.00
L	租赁和商务服务业	4,010,832.00	1.02
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	9,554,400.00	2.43
Q	卫生和社会工作	-	0.00
R	文化、体育和娱乐业	-	0.00
S	综合	2,285,439.93	0.58
	合计	370,121,469.41	94.10

## 7.3 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	002085	万丰奥威	740,000	15,732,400.00	4.00
2	002547	春兴精工	1,306,770	15,642,036.90	3.98
3	002219	恒康医疗	700,000	15,386,000.00	3.91
4	002555	顺荣股份	320,000	15,065,600.00	3.83
5	601222	林洋电子	660,000	14,909,400.00	3.79
6	300128	锦富新材	1,100,000	14,905,000.00	3.79
7	300083	劲胜精密	660,000	14,295,600.00	3.63
8	002396	星网锐捷	500,403	14,006,279.97	3.56
9	600081	东风科技	989,871	13,749,308.19	3.50
10	002484	江海股份	735,011	13,641,804.16	3.47

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>）的半年度报告正文。

#### 7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

##### 7.4.1 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	600703	三安光电	44,289,696.66	10.41
2	600261	阳光照明	36,624,865.73	8.61
3	002292	奥飞动漫	32,105,631.03	7.54
4	300315	掌趣科技	30,410,770.92	7.15
5	002219	恒康医疗	25,529,632.36	6.00
6	600518	康美药业	25,368,212.36	5.96
7	600270	外运发展	24,375,594.41	5.73
8	002085	万丰奥威	22,142,949.06	5.20
9	002375	亚厦股份	21,448,501.54	5.04
10	002711	欧浦钢网	21,299,791.53	5.01
11	000002	万科A	20,978,065.13	4.93
12	002008	大族激光	19,718,775.66	4.63
13	002396	星网锐捷	19,436,428.99	4.57
14	002153	石基信息	19,282,297.41	4.53
15	600081	东风科技	19,264,380.65	4.53
16	300128	锦富新材	17,683,352.56	4.16
17	000625	长安汽车	17,479,418.50	4.11

18	002433	太安堂	17,336,337.68	4.07
19	300303	聚飞光电	17,051,480.01	4.01
20	002555	顺荣股份	16,638,531.80	3.91
21	300070	碧水源	16,547,955.76	3.89
22	300083	劲胜精密	16,402,730.63	3.85
23	002191	劲嘉股份	16,100,777.49	3.78
24	000651	格力电器	16,062,532.77	3.77
25	000998	隆平高科	15,299,196.27	3.60
26	600383	金地集团	15,026,943.35	3.53
27	601222	林洋电子	15,022,126.88	3.53
28	002547	春兴精工	14,861,685.14	3.49
29	600089	特变电工	14,503,805.36	3.41
30	002174	游族网络	13,403,013.89	3.15
31	600742	一汽富维	13,224,442.87	3.11
32	002299	圣农发展	13,056,203.47	3.07
33	300232	洲明科技	12,931,873.08	3.04
34	600880	博瑞传播	12,606,771.33	2.96
35	300058	蓝色光标	12,368,482.24	2.91
36	002108	沧州明珠	12,006,155.08	2.82
37	600446	金证股份	11,903,039.98	2.80
38	600794	保税科技	11,816,937.61	2.78
39	002035	华帝股份	11,731,592.26	2.76
40	601117	中国化学	11,668,038.33	2.74
41	002052	同洲电子	11,410,014.12	2.68
42	002484	江海股份	11,258,474.30	2.65
43	600196	复星医药	11,166,706.54	2.62
44	000024	招商地产	11,042,778.38	2.60
45	000001	平安银行	10,896,518.44	2.56
46	002449	国星光电	10,813,031.52	2.54
47	600422	昆明制药	10,128,673.60	2.38
48	600309	万华化学	10,099,028.83	2.37
49	600837	海通证券	10,051,150.91	2.36
50	000581	威孚高科	9,814,917.89	2.31
51	300219	鸿利光电	9,762,251.85	2.29
52	000739	普洛药业	9,654,852.30	2.27
53	601166	兴业银行	9,632,572.48	2.26

54	300271	华宇软件	9,352,147.40	2.20
55	002030	达安基因	9,340,722.16	2.20
56	600661	新南洋	9,096,052.24	2.14
57	002202	金风科技	8,842,978.62	2.08
58	600109	国金证券	8,816,670.82	2.07
59	300133	华策影视	8,750,358.63	2.06
60	002482	广田股份	8,637,679.83	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。

#### 7.4.2 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	600703	三安光电	43,541,111.38	10.23
2	600261	阳光照明	42,722,198.83	10.04
3	002292	奥飞动漫	34,545,705.23	8.12
4	300315	掌趣科技	32,740,163.14	7.69
5	002008	大族激光	25,249,319.43	5.93
6	000651	格力电器	25,025,979.10	5.88
7	600270	外运发展	24,097,806.77	5.66
8	002035	华帝股份	23,817,378.24	5.60
9	002219	恒康医疗	22,935,796.57	5.39
10	600518	康美药业	21,726,471.48	5.11
11	000998	隆平高科	21,437,567.20	5.04
12	000002	万科A	21,420,931.45	5.03
13	002230	科大讯飞	21,035,598.38	4.94
14	002022	科华生物	19,533,898.50	4.59
15	002711	欧浦钢网	19,459,138.00	4.57
16	600196	复星医药	19,190,116.25	4.51
17	300058	蓝色光标	18,753,813.61	4.41
18	002375	亚厦股份	18,323,558.77	4.31
19	600446	金证股份	17,698,199.80	4.16
20	600309	万华化学	16,759,887.01	3.94
21	002191	劲嘉股份	16,626,403.28	3.91
22	300070	碧水源	16,506,121.59	3.88
23	002385	大北农	15,216,104.10	3.58

24	600383	金地集团	15,189,722.02	3.57
25	000581	威孚高科	14,451,883.79	3.40
26	600089	特变电工	14,250,070.49	3.35
27	002085	万丰奥威	13,164,481.31	3.09
28	300128	锦富新材	12,978,237.96	3.05
29	600527	江南高纤	12,616,476.34	2.96
30	300303	聚飞光电	12,505,048.90	2.94
31	002683	宏大爆破	12,473,858.04	2.93
32	300232	洲明科技	12,365,188.45	2.91
33	300002	神州泰岳	12,360,840.73	2.90
34	002555	顺荣股份	12,102,659.16	2.84
35	002153	石基信息	12,035,204.75	2.83
36	601117	中国化学	11,893,047.91	2.79
37	000024	招商地产	11,774,689.87	2.77
38	601965	中国汽研	11,523,256.64	2.71
39	600880	博瑞传播	11,124,564.94	2.61
40	002108	沧州明珠	10,870,609.11	2.55
41	300115	长盈精密	10,867,790.52	2.55
42	000001	平安银行	10,788,264.42	2.54
43	002174	游族网络	10,614,917.42	2.49
44	000625	长安汽车	10,492,047.33	2.47
45	002570	贝因美	10,348,311.07	2.43
46	601166	兴业银行	10,138,871.44	2.38
47	002605	姚记扑克	9,913,685.92	2.33
48	002202	金风科技	9,845,834.36	2.31
49	600837	海通证券	9,835,348.94	2.31
50	600794	保税科技	9,805,885.42	2.30
51	601808	中海油服	9,772,105.52	2.30
52	002449	国星光电	9,545,071.04	2.24
53	000333	美的集团	9,494,777.54	2.23
54	600422	昆明制药	9,297,104.55	2.18
55	600810	神马股份	9,106,794.34	2.14
56	002482	广田股份	9,102,809.56	2.14
57	002126	银轮股份	8,679,258.81	2.04

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。

**7.4.3 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	1,231,849,406.73
卖出股票收入（成交）总额	1,212,854,457.72

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。

**7.5 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。

**7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细**

本基金本报告期末未持有债券。

**7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序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。

**7.8 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细**

本基金本报告期末投资贵金属。

**7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细**

本基金本报告期末未持有权证。

**7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明****7.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细**

本基金本报告期末未进行股指期货投资。

**7.10.2 本基金投资股指期货的投资政策**

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

**7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明****7.11.1 本期国债期货投资政策**

本基金本报告期末投资国债期货。

**7.11.2 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。

**7.11.3 本期国债期货投资评价**

本基金本报告期末未投资国债期货。

**7.12 投资组合报告附注**

**7.12.1 本基金投资的前十名证券的发行主体未出现本期被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。**

**7.12.2 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的股票。**

**7.12.3 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	274,511.69
2	应收证券清算款	5,051,543.62
3	应收股利	-
4	应收利息	7,045.17
5	应收申购款	297,444.12
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	5,630,544.60

**7.12.4 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。

**7.12.5 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。

**7.12.6 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。

**§ 8 基金份额持有人信息****8.1 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
8,371	38,907.71	5,600,192.51	1.72%	320,096,277.39	98.28%



注：持有人户数为有效户数，即存量份额大于零的账户。

### 8.2 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	39,637.02	0.0122%

### 8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

项目	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和相关部门负责人持有本开放式基金	0
本基金基金经理持有本开放式基金	0

## § 9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2011年6月14日）基金份额总额	1,429,930,353.67
本报告期期初基金份额总额	378,692,059.90
本报告期基金总申购份额	708,197,797.95
减：本报告期基金总赎回份额	761,193,387.95
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期末基金份额总额	325,696,469.90

## § 10 重大事件揭示

### 10.1 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。

### 10.2 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：

2014年2月14日中国银行股份有限公司公告，自2014年2月13日起，陈四清先生担任本行行长。

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。

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。

### 10.3 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。

### 10.4 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。

### 10.5 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有限公司，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。

### 10.6 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。

### 10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

#### 10.7.1 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	456,308,845.91	18.68%	403,794.94	18.49%	-
渤海证券	2	308,868,917.53	12.64%	273,321.81	12.52%	-
民生证券	1	275,148,070.93	11.26%	243,482.02	11.15%	-
齐鲁证券	1	213,068,642.47	8.72%	193,975.89	8.88%	-
英大证券	1	177,651,079.64	7.27%	157,206.22	7.20%	-
民族证券	1	176,852,953.12	7.24%	156,499.23	7.17%	-
万和证券	1	172,747,132.68	7.07%	157,268.65	7.20%	-
东吴证券	1	169,843,546.50	6.95%	150,297.75	6.88%	-
东方证券	1	141,211,986.16	5.78%	128,559.36	5.89%	-
海通证券	2	139,480,427.62	5.71%	126,982.70	5.81%	-
中投证券	2	78,311,163.82	3.21%	71,294.41	3.26%	-
安信证券	2	63,400,915.39	2.60%	57,720.18	2.64%	-

东海证券	1	47,916,556.63	1.96%	43,623.44	2.00%	-
银河证券	1	11,065,254.02	0.45%	10,073.42	0.46%	-
华林证券	1	9,481,596.42	0.39%	8,390.45	0.38%	-
华鑫证券	1	1,520,391.01	0.06%	1,384.18	0.06%	-
江海证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
东莞证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
财富证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
长江证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
广发证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
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%	-
国信证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
华宝证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
华福证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
申银万国	1	-	0.00%	-	0.00%	-
天源证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
华泰证券	2	-	0.00%	-	0.00%	-
招商证券	2	-	0.00%	-	0.00%	-
中金公司	2	-	0.00%	-	0.00%	-
中信证券	2	-	0.00%	-	0.00%	-
万联证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
西南证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
湘财证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
中航证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
中银国际	1	-	0.00%	-	0.00%	-

注：1、根据中国证监会颁布的《关于完善证券投资基金交易席位制度有关问题的通知》（证监基金字[2007]48号）的有关规定，本公司制定了租用证券公司交易单元的选择标准和程序。

租用证券公司交易单元的选择标准主要包括：

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

(五) 能提供投资组合运作、管理所需的其他券商服务;

(六) 相关基金合同、资产管理合同以及法律法规规定的其他条件。

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

2、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:

本报告期内增加交易单元: 无;

本报告期内退租交易单元: 无。

#### 10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

无。

大成基金管理有限公司

2014 年 8 月 28 日