

大成中小盘股票型证券投资基金(LOF)  
(原景宏证券投资基金转型)  
2014 年年度报告摘要  
2014 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：2015 年 3 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 2015 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。

自 2014 年 4 月 10 日景宏证券投资基金终止上市起，原景宏证券投资基金名称变更为大成中小盘股票型证券投资基金(LOF)。原景宏证券投资基金本报告期自 2014 年 1 月 1 日至 2014 年 4 月 9 日止，大成中小盘股票型证券投资基金(LOF)本报告期自 2014 年 4 月 10 日(基金合同生效日)起至 12 月 31 日止。

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况（转型前）

基金简称	大成景宏封闭
场内简称	基金景宏
基金主代码	184691
交易代码	184691
基金运作方式	契约型封闭式
基金合同生效日	1999 年 5 月 4 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	2,000,000,000.00 份
基金合同存续期（若有）	15 年
基金份额上市的证券交易所（若有）	深圳证券交易所
上市日期（若有）	1999-05-18

注：经深圳证券交易所《终止上市通知书》（深证上[2014]127 号）同意，本基金于 2014 年 4 月 9 日进行终止上市权益登记，2014 年 4 月 10 日终止上市。

### 2.1 基金基本情况（转型后）

基金简称	大成中小盘(LOF)
场内简称	大成小盘
基金主代码	160918
交易代码	160918
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2014 年 4 月 10 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	351,218,842.97 份
基金合同存续期（若有）	不定期
基金份额上市的证券交易所（若有）	深圳证券交易所
上市日期（若有）	2014-04-30

### 2.2 基金产品说明（转型前）

投资目标	为投资者减少和分散投资风险，确保基金资产的安全并谋求基金长期稳定的投资收益。
投资策略	本基金分别在资产配置、行业配置、个股选择三个层次上采取积极主动的策略进行投资。根据宏观经济状况和市场未来趋势进行资产配置；依据对行业景气的判断进行行业权重配置；在个股方面，选择治理结构完善、管理有方、信息透明、行业竞争力强、财务状况良好而且其内在价值被市场低估的上市公司进行投资。

业绩比较基准	无
风险收益特征	无

## 2.2 基金产品说明（转型后）

投资目标	本基金主要通过投资于股票市场中具有较高成长性的中小盘股票，追求基金资产的长期增值。
投资策略	本基金采用自上而下与自下而上相结合的方法进行主动投资策略，以宏观经济和政策研究为基础，通过分析影响证券市场整体运行的内外部因素，进行自上而下的资产配置和组合管理，同时自下而上的精选各个行业中具有良好治理结构、在细分行业具有竞争优势以及有较高成长性的中小盘股票进行投资。
业绩比较基准	中证 700 指数收益率×80%+中证综合债券指数收益率×20%
风险收益特征	本基金属于股票型基金，其预期收益及风险水平高于混合基金、债券基金与货币市场基金，属于高风险收益特征的开放式基金。

## 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	2014 年 1 月 1 日-2014 年 12 月 31 日		2013 年	2012 年
	转型前 (2014 年 1 月 1 日-2014 年 4 月 9 日)	转型后 (2014 年 4 月 10 日-2014 年 12 月 31 日)		
本期已实现收益	-52,924,854.37	88,398,271.92	79,708,653.10	-201,343,026.76
本期利润	-74,475,485.59	49,223,575.76	75,987,462.72	41,096,948.85
加权平均基金份额本期利润	-0.0372	0.0603	0.0380	0.0205
本期基金份额净值增长率	-3.97%	15.12%	4.22%	2.33%
3.1.2 期末数据和指标	2014 年末 (2014 年 4 月 9 日)	报告期末 (2014 年 12 月 31 日)	2013 年末	2012 年末
期末可供分配基金份额利润	-0.1413	0.0367	-0.1148	-0.1547
期末基金资产净值	1,801,518,616.19	364,097,546.25	1,875,994,101.78	1,800,006,639.06
期末基金份额净值	0.9008	1.037	0.9380	0.9000

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 (转型前)

#### 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

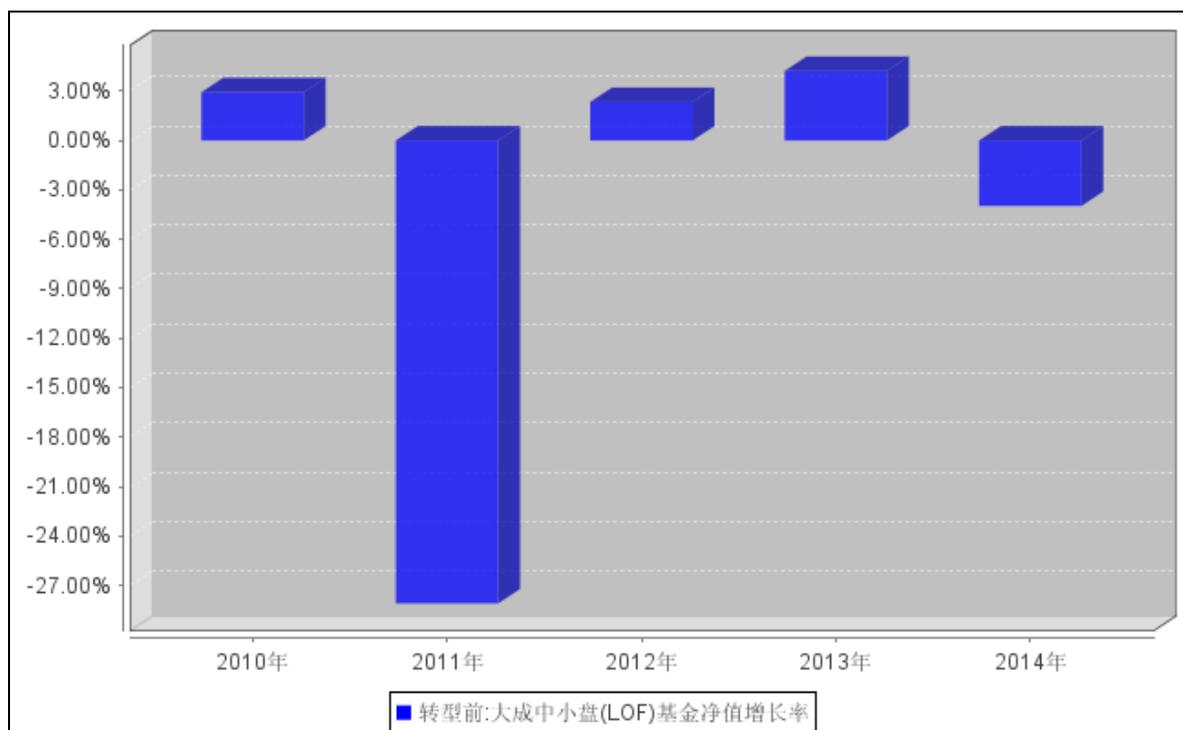
阶段	转型前					
	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	-3.70%	2.20%	0.00%	0.00%	-3.70%	2.20%
过去六个月	0.90%	2.28%	0.00%	0.00%	0.90%	2.28%
过去一年	5.62%	2.12%	0.00%	0.00%	5.62%	2.12%
过去三年	-28.66%	2.61%	0.00%	0.00%	-28.66%	2.61%
过去五年	2.69%	2.62%	0.00%	0.00%	2.69%	2.62%
自基金合同生效起至今	318.49%	2.89%	0.00%	0.00%	318.49%	2.89%

## 3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率历史走势图



注：按基金合同规定，本基金自基金合同生效之日起 6 个月内为建仓期。报告期内，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（该基金转型前无业绩比较基准）。

## 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

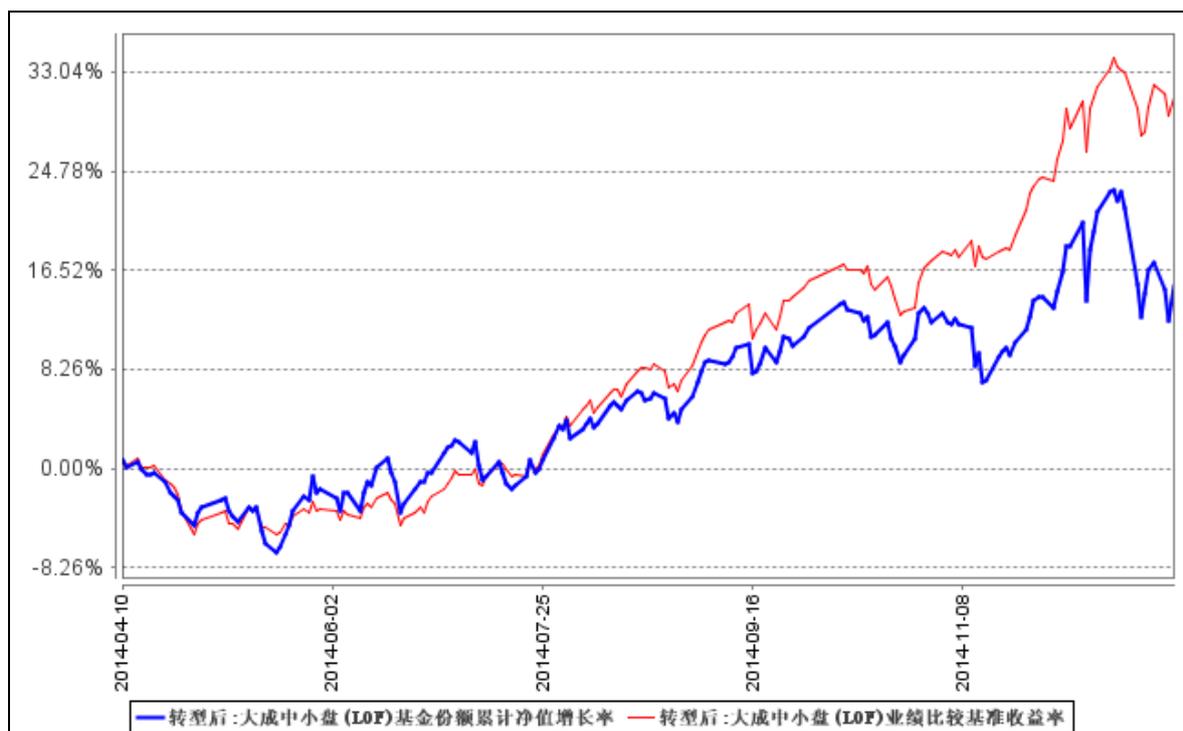


### 3.2 基金净值表现（转型后）

#### 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

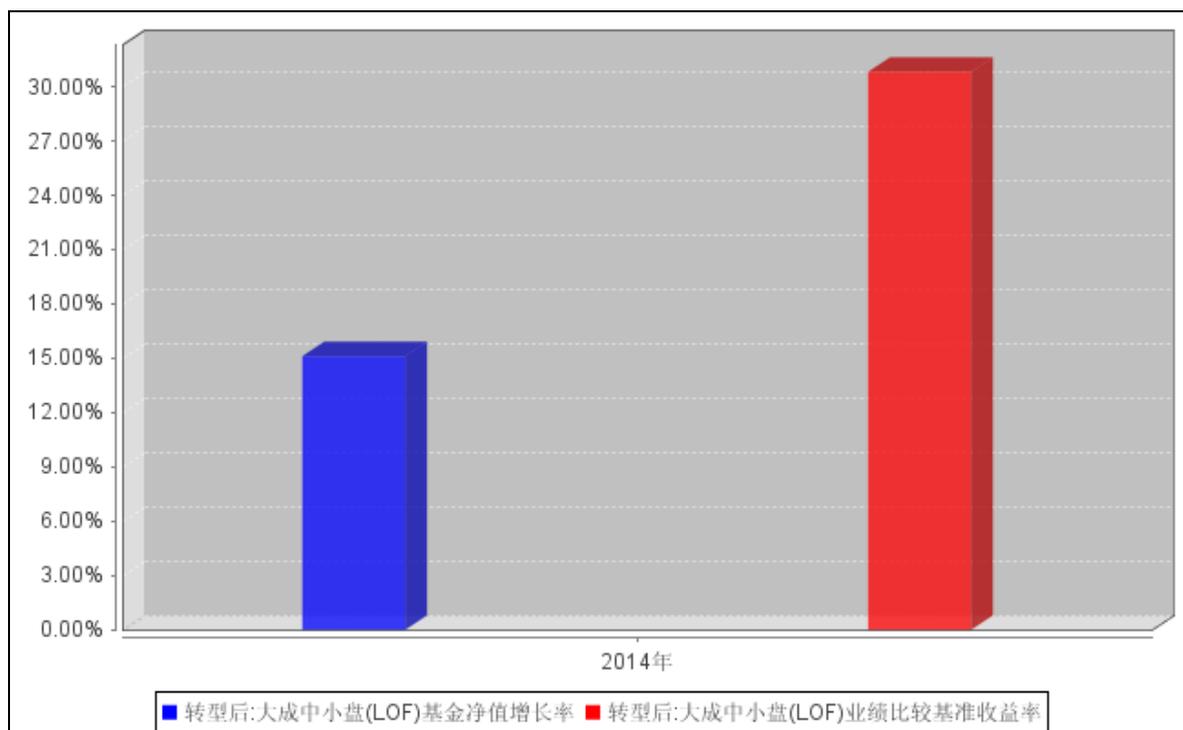
转型后						
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去三个月	2.98%	1.60%	13.19%	1.12%	-10.21%	0.48%
过去六个月	13.71%	1.27%	33.04%	0.94%	-19.33%	0.33%
自基金合同生效起至今	15.12%	1.20%	30.84%	0.90%	-15.72%	0.30%

#### 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：1、本基金于2014年4月10日转型，截至报告期末，本基金转型后基金合同生效未满一年。  
2、按基金合同规定，基金管理人应当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。截至报告期末，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 自基金转型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



### 3.3 过去三年基金的利润分配情况

本基金在过去三年未进行利润分配。

## § 4 管理人报告

### 4.1 基金管理人及基金经理情况

#### 4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

大成基金管理有限公司经中国证监会证监基金字[1999]10号文批准,于1999年4月12日正式成立,是中国证监会批准成立的首批十家基金管理公司之一,注册资本为2亿元人民币,注册地为深圳。目前公司由四家股东组成,分别为中泰信托有限责任公司(48%)、光大证券股份有限公司(25%)、中国银河投资管理有限公司(25%)、广东证券股份有限公司(2%)。截至2014年12月31日,本基金管理人共管理4只ETF及1只ETF联接基金:大成中证100交易型开放式指数证券投资基金、深证成长40交易型开放式指数证券投资基金及大成深证成长40交易型开放式指数证券投资基金联接基金、中证500深市交易型开放式指数证券投资基金、中证500沪市交易型开放式指数证券投资基金,2只QDII基金:大成标普500等权重指数证券投资基金、大成纳斯达克100指数证券投资基金及40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、大成景恒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、大成可转债增强债券型证券投资基金、大成消费主题股票型证券投资基金、大成新锐产业股票型证券投资基金、大成优选股票型证券投资基金 (LOF)、大成月添利理财债券型证券投资基金、大成现金增利货币市场证券投资基金、大成月月盈短期理财债券型证券投资基金、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、大成信用增利一年定期开放债券型证券投资基金、大成健康产业股票型证券投资基金、大成中小盘股票型证券投资基金 (LOF)、大成灵活配置混合型证券投资基金、大成丰财宝货币市场基金、大成景益平稳收益混合型证券投资基金、大成添利宝货币市场基金、大成景利混合型证券投资基金和大成产业升级股票型证券投资基金 (LOF)。

#### 4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介（转型前）

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		
刘安田先生	本基金基金经理	2013年3月8日	-	10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
侯春燕女士	本基金基金经理助理	2012年11月8日	-	5年	经济学硕士，2010年3月加入大成基金管理有限公司。2012年11月8日起担任景宏证券投资基金基金经理助理（该基金于2014年4月10日转型成为大成中小盘股票型证券投资基金(LOF)）。2012年11月8日至2013年3月11日担任大成行业轮动股票型证券投资基金基金经理助理。2013年3月11日起担任大成精选增值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。

#### 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介（转型后）

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		
刘安田先生	本基金基金经理	2014年4月10日	-	10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。2013年3月8日至2014年4月9日任景宏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。2014 年 4 月 10 日起任大成中小盘股票型证券投资基金(LOF)基金经理。现任股票投资部混合组投资总监。具有基金从业资格。国籍：中国
侯春燕女士	本基金基金经理助理	2014 年 4 月 10 日	-	5 年	经济学硕士，2010 年 3 月加入大成基金管理有限公司。2012 年 11 月 8 日起担任景宏证券投资基金基金经理助理（该基金于 2014 年 4 月 10 日转型成为大成中小盘股票型证券投资基金(LOF)）。2012 年 11 月 8 日至 2013 年 3 月 11 日担任大成行业轮动股票型证券投资基金基金经理助理。2013 年 3 月 11 日起担任大成精选增值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》、《大成中小盘股票型证券投资基金（LOF）基金合同》和其他有关法律、法规的规定，在基金管理运作中，本基金的投资范围、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 23 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 5 笔，原因为投资策略需要；主动投资组合间债券交易存在 2 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

2014 年全年以央行降息为分水岭，前期创业板大幅跑赢大盘蓝筹股，降息之后低 PE、低 PB 的股票结束 2009 年 7 月以来的持续下跌走势大幅上涨，同期创业板大幅杀跌。本基金全年一直坚守有核心竞争优势的成长股，在前三个季度有较好表现，但是在 4 季度未能及时抓住金融地产为代表的蓝筹股的投资机会。

#### 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 1.037 元。本报告期内,转型前基金份额净值增长率为-3.97% (该基金转型前无业绩比较基准);转型后基金份额净值增长率为 15.12%,同期业绩比较基准收益率为 30.84%,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

2015 年年初以来市场处于大盘蓝筹的抵抗式下跌和创业板指的强势上涨中,最大的投资逻辑是“互联网改变一切”。互联网+金融、互联网+医疗、互联网+家装、互联网+物流/钢贸等相关股票大幅上涨,“互联网+X”的股票成为市场追捧的热点。本基金未来将围绕互联网+X、国防军工、再生资源回收、工业自动化、新兴消费以及有核心竞争力的制造类企业做新兴产业的轮动配置。注册制的放开是成长股未来一段最确定的投资风险,我们会考虑仓位控制等手段来降低回撤风险。

#### 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。截止报告期末本基金管理人

已与中央国债登记结算有限责任公司签署服务协议，由其按约定提供在银行间同业市场交易的债券品种的估值数据。

#### 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。

#### 4.8 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

无。

### § 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”）在对大成中小盘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(转型前)

本基金 2014 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。

## § 6 审计报告 (转型后)

本基金 2014 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(转型前)

### 7.1 资产负债表(转型前)

会计主体: 景宏证券投资基金

报告截止日: 2014 年 4 月 9 日

单位: 人民币元

资产	本期 2014 年 1 月 1 日至 2014 年 4 月 9 日	上年度末 2013 年 12 月 31 日
<b>资产:</b>		
银行存款	117,775,821.81	39,445,324.38
结算备付金	1,622,631.94	3,746,757.17
存出保证金	279,751.27	288,961.51
交易性金融资产	1,676,482,012.14	1,821,486,223.15
其中: 股票投资	1,368,753,484.14	1,427,105,426.45
基金投资	-	-
债券投资	307,728,528.00	394,380,796.70
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	-	9,855,850.27
应收利息	7,963,439.53	6,430,937.22
应收股利	-	-
应收申购款	-	-
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	-
资产总计	1,804,123,656.69	1,881,254,053.70
<b>负债和所有者权益</b>	<b>本期 2014 年 1 月 1 日至 2014 年 4 月 9 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	-	193,526.57
应付赎回款	-	-
应付管理人报酬	651,059.44	2,354,230.83
应付托管费	108,509.91	392,371.80
应付销售服务费	-	-
应付交易费用	1,157,992.81	1,759,822.72
应交税费	-	-
应付利息	-	-
应付利润	-	-
递延所得税负债	-	-
其他负债	687,478.34	560,000.00
负债合计	2,605,040.50	5,259,951.92
<b>所有者权益：</b>		
实收基金	2,000,000,000.00	2,000,000,000.00
未分配利润	-198,481,383.81	-124,005,898.22
所有者权益合计	1,801,518,616.19	1,875,994,101.78
负债和所有者权益总计	1,804,123,656.69	1,881,254,053.70

注：报告截止日 2014 年 4 月 9 日，基金份额净值 0.9008 元，基金份额总额 2,000,000,000.00 份。

## 7.2 利润表

会计主体：景宏证券投资基金

本报告期：2014 年 1 月 1 日至 2014 年 4 月 9 日

单位：人民币元

项目	本期 2014 年 1 月 1 日至 2014 年 4 月 9 日	上年度可比期间 2013 年 1 月 1 日至 2013 年 12 月 31 日
<b>一、收入</b>	-63,566,665.42	120,666,189.07
1. 利息收入	4,364,381.74	14,279,292.49
其中：存款利息收入	80,923.25	410,907.36
债券利息收入	4,283,458.49	13,868,385.13
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）	-46,380,415.94	110,041,964.62
其中：股票投资收益	-46,555,408.11	96,674,008.91
基金投资收益	-	-
债券投资收益	-134,310.01	-2,440,241.10
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	309,302.18	15,808,196.81
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	-21,550,631.22	-3,721,190.38
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）	-	
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	-	66,122.34
<b>减：二、费用</b>	<b>10,908,820.17</b>	<b>44,678,726.35</b>
1. 管理人报酬	7,504,957.49	27,558,813.63
2. 托管费	1,250,826.21	4,593,135.60
3. 销售服务费	-	-
4. 交易费用	1,948,791.86	12,027,173.96
5. 利息支出	-	-
其中：卖出回购金融资产支出	-	-
6. 其他费用	204,244.61	499,603.16
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>	<b>-74,475,485.59</b>	<b>75,987,462.72</b>
减：所得税费用	-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>	<b>-74,475,485.59</b>	<b>75,987,462.72</b>

### 7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：景宏证券投资基金

本报告期：2014 年 1 月 1 日至 2014 年 4 月 9 日

单位：人民币元

项目	本期 2014 年 1 月 1 日至 2014 年 4 月 9 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）	2,000,000,000.00	-124,005,898.22	1,875,994,101.78
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-74,475,485.59	-74,475,485.59
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）	-	-	-
其中：1. 基金申购款	-	-	-
2. 基金赎回款	-	-	-
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）	-	-	-

填列)			
五、期末所有者权益(基金净值)	2,000,000,000.00	-198,481,383.81	1,801,518,616.19
项目	上年度可比期间 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)	2,000,000,000.00	-199,993,360.94	1,800,006,639.06
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	75,987,462.72	75,987,462.72
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)	-	-	-
其中：1. 基金申购款	-	-	-
2. 基金赎回款	-	-	-
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)	2,000,000,000.00	-124,005,898.22	1,875,994,101.78

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>罗登攀</u>	<u>肖剑</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、税项与最近一期年度报告相一致的说明

财政部于 2014 年颁布《企业会计准则第 39 号——公允价值计量》、《企业会计准则第 40 号——合营安排》、《企业会计准则第 41 号——在其他主体中权益的披露》和修订后的《企业会计准则第 2 号——长期股权投资》、《企业会计准则第 9 号——职工薪酬》、《企业会计准则第 30 号——财务报表列报》、《企业会计准则第 33 号——合并财务报表》以及《企业会计准则第 37 号——金融工具列报》，要求除《企业会计准则第 37 号——金融工具列报》自 2014 年度财务报表起施行外，其他准则自 2014 年 7 月 1 日起施行。上述准则对本基金本报告期无重大影响。

除上述会计政策变更事项，本报告期所采用的其他会计政策、会计估计、税项与最近一期年度报告相一致。

## 7.4.2 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”)	基金发起人、基金管理人
中国银行股份有限公司(“中国银行”)	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”)	基金发起人、基金管理人的股东
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”)	基金发起人、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”)	基金管理人的合营企业

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。

## 7.4.3 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

## 7.4.3.1 通过关联方交易单元进行的交易

## 7.4.3.1.1 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 4 月 9 日		上年度可比期间 2013 年 1 月 1 日至 2013 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	-	0.00%	76,781,190.03	0.97%

## 7.4.3.1.2 权证交易

无。

## 7.4.3.1.3 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 4 月 9 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	-	0.00%	-	0.00%
关联方名称	上年度可比期间 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	69,901.29	0.98%	62,867.89	3.57%
------	-----------	-------	-----------	-------

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。

#### 7.4.3.2 关联方报酬

##### 7.4.3.2.1 基金管理费

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4月9日	2013年1月1日至2013年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	7,504,957.49	27,558,813.63
其中：支付销售机构的客户维护费 <sup>1</sup>	-	-

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。若由于卖出回购证券和现金分红以外原因造成基金持有现金比例超过基金资产净值的 20%，超过部分不计提管理人报酬。

##### 7.4.3.2.2 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4月9日	2013年1月1日至2013年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	1,250,826.21	4,593,135.60

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

日托管费 = 前一日基金资产净值 X 0.25% / 当年天数。

#### 7.4.3.3 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。

## 7.4.3.4 各关联方投资本基金的情况

## 7.4.3.4.1 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	上年度可比期间
	2014年1月1日至2014年4月9日	2013年1月1日至2013年12月31日
基金合同生效日(1999年5月4日)持有的基金份额	-	-
期初持有的基金份额	12,000,000.00	12,000,000.00
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	-	-
期末持有的基金份额	12,000,000.00	12,000,000.00
期末持有的基金份额占基金总份额比例	0.60%	0.60%

## 7.4.3.4.2 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

份额单位：份

关联方名称	本期末		上年度末	
	2014年4月9日		2013年12月31日	
	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例
光大证券	6,000,000.00	0.30%	6,000,000.00	0.30%
广东证券	6,000,000.00	0.30%	6,000,000.00	0.30%

## 7.4.3.5 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4月9日		2013年1月1日至2013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	117,775,821.81	69,159.54	39,445,324.38	341,011.05

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。

## 7.4.3.6 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。

## 7.4.3.7 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。

## 7.4.4 期末（2014年4月9日）本基金持有的流通受限证券

## 7.4.4.1 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/增发而流通受限证券。

## 7.4.4.2 期末持有的暂时停牌股票

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
300273	和佳股份	2014年3月11日	重大事项停牌	34.86	2014年5月12日	30.47	1,382,380	32,839,228.16	48,189,766.80	-
300003	乐普医疗	2014年3月20日	重大事项停牌	21.58	2014年6月10日	19.31	999,902	17,879,556.96	21,577,885.16	-
002437	誉衡药业	2014年4月8日	重大事项停牌	53.94	2014年6月26日	50.23	300,000	12,783,895.51	16,182,000.00	-

注：本基金截至2014年4月9日（基金合同失效前日）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。

## 7.4.4.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

## 7.4.4.3.1 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中作为抵押的债券。

## 7.4.4.3.2 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中作为抵押的债券。

## §7 年度财务报表(转型后)

## 7.1 资产负债表（转型后）

会计主体：大成中小盘股票型证券投资基金(LOF)

报告截止日：2014年12月31日

单位：人民币元

资产	转型后至报告期末
<b>资产：</b>	
银行存款	37,034,824.75
结算备付金	612,559.89
存出保证金	361,389.62
交易性金融资产	328,553,234.25

其中：股票投资	328,553,234.25
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	-
应收利息	7,144.34
应收股利	-
应收申购款	-
递延所得税资产	-
其他资产	-
资产总计	366,569,152.85
<b>负债和所有者权益</b>	<b>转型后至报告期末</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	556.38
应付赎回款	475,198.14
应付管理人报酬	612,528.89
应付托管费	102,088.16
应付销售服务费	-
应付交易费用	496,235.03
应交税费	-
应付利息	-
应付利润	-
递延所得税负债	-
其他负债	785,000.00
负债合计	2,471,606.60
<b>所有者权益：</b>	
实收基金	351,218,842.97
未分配利润	12,878,703.28
所有者权益合计	364,097,546.25
负债和所有者权益总计	366,569,152.85

注：1. 报告截止日 2014 年 12 月 31 日，基金份额净值 1.037 元，基金份额总额 351,218,842.97 份。

2. 本财务报表的实际编制期间为 2014 年 4 月 10 日(基金合同生效日)至 2014 年 12 月 31 日止期间。

## 7.2 利润表

会计主体：大成中小盘股票型证券投资基金(LOF)

本报告期：2014年4月10日至2014年12月31日

单位：人民币元

项 目	本期
	2014年4月10日至2014年12月31日
<b>一、收入</b>	63,881,578.43
1. 利息收入	938,865.53
其中：存款利息收入	776,685.23
债券利息收入	162,180.30
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）	95,572,855.41
其中：股票投资收益	91,706,601.71
基金投资收益	-
债券投资收益	-1,425,520.97
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	5,291,774.67
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	-39,174,696.16
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	6,544,553.65
<b>减：二、费用</b>	14,658,002.67
1. 管理人报酬	8,328,931.72
2. 托管费	1,388,155.33
3. 销售服务费	-
4. 交易费用	4,540,688.63
5. 利息支出	-
其中：卖出回购金融资产支出	-
6. 其他费用	400,226.99
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>	49,223,575.76
减：所得税费用	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>	49,223,575.76

## 7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：大成中小盘股票型证券投资基金(LOF)

本报告期：2014 年 4 月 10 日至 2014 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2014 年 4 月 10 日至 2014 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）	2,000,000,000.00	-198,481,383.81	1,801,518,616.19
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	49,223,575.76	49,223,575.76
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）	-1,648,781,157.03	162,136,511.33	-1,486,644,645.70
其中：1. 基金申购款	548,984.88	-12,917.26	536,067.62
2. 基金赎回款（以“-”号填列）	-1,649,330,141.91	162,149,428.59	-1,487,180,713.32
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）	351,218,842.97	12,878,703.28	364,097,546.25

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>罗登攀</u>	<u>肖剑</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

财政部于 2014 年颁布《企业会计准则第 39 号——公允价值计量》、《企业会计准则第 40 号——合营安排》、《企业会计准则第 41 号——在其他主体中权益的披露》和修订后的《企业会计准则第 2 号——长期股权投资》、《企业会计准则第 9 号——职工薪酬》、《企业会计准则第 30 号——财务报表列报》、《企业会计准则第 33 号——合并财务报表》以及《企业会计准则第 37 号——金融工具列报》，要求除《企业会计准则第 37 号——金融工具列报》自 2014 年度财务报表起施行外，其他准则自 2014 年 7 月 1 日起施行。上述准则对本基金本报告期无重大影响。

除上述会计政策变更事项，本报告期所采用的其他会计政策、会计估计、税项与最近一期年度报告相一致。

#### 7.4.2 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
中国银行股份有限公司(“中国银行”)	基金托管人、基金销售机构
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、基金销售机构
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”)	基金管理人的合营企业

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。

#### 7.4.3 本报告期间的关联方交易

##### 7.4.3.1 通过关联方交易单元进行的交易

##### 7.4.3.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2014年4月10日至2014年12月31日	
	成交金额	占当期股票 成交总额的比例
光大证券	12,720,309.20	0.48%

##### 7.4.3.1.2 权证交易

无。

##### 7.4.3.1.3 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4月10日至2014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	11,256.39	0.48%	-	-

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后的净额列示。

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。

## 7.4.3.2 关联方报酬

## 7.4.3.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期
	2014年4月10日至2014年12月31日
当期应支付的管理费	8,328,931.72
其中：支付销售机构的客户维护费	503.79

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。

## 7.4.3.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期
	2014年4月10日至2014年12月31日
当期应支付的托管费	1,388,155.33

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

日托管费=前一日基金资产净值 X 0.25% / 当年天数。

## 7.4.3.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

无。

## 7.4.3.4 各关联方投资本基金的情况

## 7.4.3.4.1 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
	2014年4月10日至2014年12月31日
基金合同生效日(2014年4月10日)持有的基金份额	12,000,000.00
期间申购/买入总份额	-
期间因拆分增加的份额	-
期间赎回/卖出总份额	-
期末持有的基金份额	12,000,000.00
期末持有的基金份额占基金总份额比例	3.42%

注：1、本报告期内基金管理人未运用固有资金投资本基金，自基金合同生效日起所持有的份额由基金转型而来。

2、本基金管理人投资本基金的费率标准严格按照法律法规及交易所相关规定计算并支付。

#### 7.4.3.4.2 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

份额单位：份

关联方名称	本期末 2014年12月31日	
	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例
光大证券	6,000,000.00	1.71%
广东证券	6,000,000.00	1.71%

#### 7.4.3.5 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 2014年4月10日至2014年12月31日	
	期末余额	当期利息收入
中国银行	37,034,824.75	758,535.13

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。

#### 7.4.3.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期末在承销期内参与关联方承销证券。

#### 7.4.3.7 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。

#### 7.4.4 期末（2014年12月31日）本基金持有的流通受限证券

##### 7.4.4.1 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/增发证券而流通受限股票。

##### 7.4.4.2 期末持有的暂时停牌股票

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
300011	鼎汉技术	2014/1/24	重大资产重组	20.25	2015/02/03	18.98	1,559,930	20,969,993.02	31,588,582.50	-
300315	掌趣科技	2014/07/14	重大事项	19.59	2015/02/16	17.41	568,480	10,783,181.95	11,136,523.20	
300324	旋极信息	2014/10/15	重大资产重组	53.82	2015/01/15	50.00	166,825	5,761,529.43	8,978,521.50	

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

#### 7.4.4.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

##### 7.4.4.3.1 银行间市场债券正回购

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

##### 7.4.4.3.2 交易所市场债券正回购

于本报告期末，本基金无从事交易所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(转型前)

#### 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	1,368,753,484.14	75.87
	其中：股票	1,368,753,484.14	75.87
2	固定收益投资	307,728,528.00	17.06
	其中：债券	307,728,528.00	17.06
	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	119,398,453.75	6.62
7	其他资产	8,243,190.80	0.46
8	合计	1,804,123,656.69	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	895,826,073.31	49.73
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	0.00
E	建筑业	13,490,000.00	0.75

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	232,033,013.00	12.88
J	金融业	65,122,223.99	3.61
K	房地产业	62,025,373.58	3.44
L	租赁和商务服务业	-	0.00
M	科学研究和技术服务业	35,780,242.90	1.99
N	水利、环境和公共设施管理业	32,274,000.00	1.79
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	32,202,557.36	1.79
S	综合	-	0.00
	合计	1,368,753,484.14	75.98

### 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	601318	中国平安	1,649,917	65,122,223.99	3.61
2	002475	立讯精密	1,519,804	57,524,581.40	3.19
3	002008	大族激光	3,449,818	52,782,215.40	2.93
4	300273	和佳股份	1,382,380	48,189,766.80	2.67
5	000625	长安汽车	4,499,915	48,149,090.50	2.67
6	600703	三安光电	1,699,956	42,226,907.04	2.34
7	600309	万华化学	2,299,841	41,351,141.18	2.30
8	600340	华夏幸福	1,300,360	38,724,720.80	2.15
9	300124	汇川技术	506,840	35,950,161.20	2.00
10	300284	苏交科	1,976,809	35,780,242.90	1.99

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	002008	大族激光	52,125,521.22	2.78
2	600703	三安光电	39,513,435.05	2.11
3	600588	用友软件	38,989,975.83	2.08
4	600406	国电南瑞	37,026,725.99	1.97
5	601515	东风股份	36,719,795.79	1.96
6	002065	东华软件	35,131,911.06	1.87
7	600597	光明乳业	34,515,733.27	1.84
8	002230	科大讯飞	32,856,708.66	1.75
9	002353	杰瑞股份	29,535,070.84	1.57
10	002410	广联达	28,626,356.25	1.53
11	300037	新宙邦	26,505,246.31	1.41
12	000400	许继电气	22,819,227.04	1.22
13	002108	沧州明珠	22,398,547.80	1.19
14	600330	天通股份	21,391,167.21	1.14
15	600741	华域汽车	21,098,451.14	1.12
16	000651	格力电器	19,993,953.22	1.07
17	300003	乐普医疗	17,879,556.96	0.95
18	002450	康得新	15,002,796.53	0.80
19	600153	建发股份	14,321,606.49	0.76
20	002683	宏大爆破	14,006,639.00	0.75

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	000651	格力电器	70,460,823.07	3.76
2	600837	海通证券	47,190,793.49	2.52
3	300024	机器人	46,126,769.59	2.46
4	600383	金地集团	42,071,527.33	2.24
5	601166	兴业银行	31,941,511.08	1.70

6	600104	上汽集团	29,644,097.80	1.58
7	600252	中恒集团	28,182,696.69	1.50
8	002294	信立泰	27,642,364.05	1.47
9	002477	雏鹰农牧	27,231,824.30	1.45
10	600330	天通股份	25,641,068.81	1.37
11	600729	重庆百货	24,643,754.15	1.31
12	002415	海康威视	22,944,457.78	1.22
13	000671	阳光城	21,921,940.89	1.17
14	002064	华峰氨纶	17,453,163.49	0.93
15	000596	古井贡酒	16,117,638.57	0.86
16	300315	掌趣科技	15,250,146.20	0.81
17	002174	游族网络	15,123,241.65	0.81
18	600153	建发股份	12,964,700.29	0.69
19	002690	美亚光电	12,315,364.95	0.66
20	002683	宏大爆破	12,124,548.88	0.65

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	654,615,304.90
卖出股票收入（成交）总额	642,409,257.96

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

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	8,487,528.00	0.47
2	央行票据	20,008,000.00	1.11
3	金融债券	279,233,000.00	15.50
	其中：政策性金融债	279,233,000.00	15.50
4	企业债券	-	0.00
5	企业短期融资券	-	0.00
6	中期票据	-	0.00
7	可转债	-	0.00
8	其他	-	0.00
9	合计	307,728,528.00	17.08

**8.6 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**

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	130227	13 国开 27	900,000	89,928,000.00	4.99
2	090209	09 国开 09	700,000	69,622,000.00	3.86
3	130218	13 国开 18	500,000	50,000,000.00	2.78
4	110317	11 进出 17	400,000	39,876,000.00	2.21
5	1101032	11 央行票据 32	200,000	20,008,000.00	1.11

**8.7 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。

**8.8 报告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**

本基金本报告期末未持有贵金属投资。

**8.9 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。

**8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明**

本基金本报告期末未投资股指期货。

**8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明**

本基金本报告期末未投资国债期货。

**8.12 投资组合报告附注****8.12.1 本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。

8.12.2 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。

8.12.3 其他资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	279,751.27
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	7,963,439.53
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	8,243,190.80

8.12.4 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。

8.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值	占基金资产净值比例 (%)	流通受限情况说明
1	300273	和佳股份	48,189,766.80	2.68	重大事项停牌

8.12.6 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 投资组合报告(转型后)

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	328,553,234.25	89.63
	其中：股票	328,553,234.25	89.63
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	37,647,384.64	10.27
7	其他资产	368,533.96	0.10
8	合计	366,569,152.85	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	251,328,379.57	69.03
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	20,115,044.70	5.52
J	金融业	-	0.00
K	房地产业	32,790,954.80	9.01
L	租赁和商务服务业	-	0.00
M	科学研究和技术服务业	12,639,348.78	3.47
N	水利、环境和公共设施管理业	11,679,506.40	3.21
O	居民服务、修理和其他服务业	-	0.00
P	教育	-	0.00
Q	卫生和社会工作	-	0.00
R	文化、体育和娱乐业	-	0.00
S	综合	-	0.00
	合计	328,553,234.25	90.24

## 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(转型后)

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	300011	鼎汉技术	1,559,930	31,588,582.50	8.68
2	000625	长安汽车	1,337,528	21,975,585.04	6.04
3	002179	中航光电	896,498	21,049,773.04	5.78
4	600340	华夏幸福	471,158	20,542,488.80	5.64
5	000768	中航飞机	719,400	13,625,436.00	3.74
6	300007	汉威电子	477,608	13,506,754.24	3.71
7	002610	爱康科技	808,621	13,479,712.07	3.70
8	300284	苏交科	1,152,174	12,639,348.78	3.47
9	300124	汇川技术	432,115	12,613,436.85	3.46
10	600277	亿利能源	1,400,000	12,488,000.00	3.43

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末基金资产净值 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	占期末基金资产净值比例(%)
1	002146	荣盛发展	39,216,718.61	10.77
2	601166	兴业银行	30,571,291.35	8.40
3	600109	国金证券	28,842,287.60	7.92
4	002179	中航光电	26,937,034.85	7.40
5	002174	游族网络	26,610,670.40	7.31
6	300070	碧水源	26,161,972.54	7.19
7	600759	洲际油气	25,104,734.25	6.90
8	300011	鼎汉技术	20,969,993.02	5.76
9	002415	海康威视	20,701,571.85	5.69
10	300007	汉威电子	19,825,805.57	5.45
11	600048	保利地产	17,720,941.90	4.87
12	300199	翰宇药业	17,698,770.02	4.86
13	002610	爱康科技	17,510,321.34	4.81
14	600261	阳光照明	16,539,810.12	4.54
15	300131	英唐智控	14,947,914.11	4.11

16	000768	中航飞机	14,838,343.08	4.08
17	002022	科华生物	14,833,501.91	4.07
18	601117	中国化学	14,736,739.66	4.05
19	000400	许继电气	14,551,588.86	4.00
20	600277	亿利能源	14,508,197.93	3.98
21	300124	汇川技术	14,440,058.04	3.97
22	300115	长盈精密	13,535,904.00	3.72
23	600580	卧龙电气	13,279,569.53	3.65
24	002041	登海种业	12,800,824.36	3.52
25	600118	中国卫星	12,634,035.51	3.47
26	000848	承德露露	12,487,995.64	3.43
27	002410	广联达	12,313,949.58	3.38
28	600340	华夏幸福	12,045,139.70	3.31
29	300224	正海磁材	12,024,667.96	3.30
30	300236	上海新阳	11,657,242.41	3.20
31	600500	中化国际	11,442,005.94	3.14
32	300351	永贵电器	11,282,608.74	3.10
33	300212	易华录	10,687,851.38	2.94
34	002555	顺荣股份	10,577,732.96	2.91
35	300049	福瑞股份	10,372,352.66	2.85
36	600183	生益科技	10,046,610.80	2.76
37	600690	青岛海尔	9,900,390.26	2.72
38	300328	宜安科技	9,782,036.82	2.69
39	300324	旋极信息	9,746,991.64	2.68
40	002390	信邦制药	9,164,990.07	2.52
41	002699	美盛文化	8,527,856.91	2.34
42	002008	大族激光	8,515,397.87	2.34
43	002358	森源电气	8,308,850.48	2.28
44	600837	海通证券	8,268,589.00	2.27
45	002292	奥飞动漫	8,220,069.18	2.26
46	600597	光明乳业	8,006,884.13	2.20
47	601222	林洋电子	7,892,988.04	2.17

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末基金资产净值 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	占期末基金资产净值比例 (%)
1	601318	中国平安	71,120,138.48	19.53
2	002008	大族激光	66,046,759.42	18.14
3	002475	立讯精密	63,264,470.87	17.38
4	002415	海康威视	52,834,036.82	14.51
5	000625	长安汽车	43,938,711.97	12.07
6	600109	国金证券	42,189,905.44	11.59
7	300273	和佳股份	39,399,281.74	10.82
8	002410	广联达	38,213,430.35	10.50
9	300133	华策影视	37,397,512.09	10.27
10	600703	三安光电	36,981,975.66	10.16
11	600340	华夏幸福	36,597,806.09	10.05
12	000400	许继电气	36,242,466.26	9.95
13	300124	汇川技术	33,842,510.22	9.29
14	002065	东华软件	33,464,296.06	9.19
15	600406	国电南瑞	33,199,271.79	9.12
16	600309	万华化学	31,024,117.46	8.52
17	300037	新宙邦	31,009,321.26	8.52
18	002353	杰瑞股份	30,972,890.04	8.51
19	601166	兴业银行	30,222,905.18	8.30
20	000826	桑德环境	30,204,283.49	8.30
21	600588	用友软件	30,134,378.72	8.28
22	600867	通化东宝	29,408,903.87	8.08
23	002185	华天科技	29,015,013.62	7.97
24	600597	光明乳业	28,835,230.88	7.92
25	002570	贝因美	28,834,166.37	7.92
26	002174	游族网络	28,764,669.38	7.90
27	300284	苏交科	28,752,264.09	7.90
28	000581	威孚高科	28,611,562.59	7.86
29	002146	荣盛发展	28,594,993.36	7.85
30	600759	洲际油气	26,624,197.87	7.31
31	600872	中炬高新	26,432,890.21	7.26
32	601515	东风股份	26,061,785.34	7.16
33	600118	中国卫星	25,039,879.04	6.88
34	002230	科大讯飞	24,387,011.69	6.70
35	300224	正海磁材	24,372,738.58	6.69
36	300017	网宿科技	23,882,640.86	6.56

37	002108	沧州明珠	23,592,984.56	6.48
38	300024	机器人	23,315,979.25	6.40
39	600089	特变电工	23,032,864.41	6.33
40	000413	东旭光电	21,949,524.22	6.03
41	300003	乐普医疗	21,933,197.60	6.02
42	300146	汤臣倍健	21,566,338.85	5.92
43	002285	世联行	21,496,848.43	5.90
44	600804	鹏博士	21,484,060.99	5.90
45	600196	复星医药	21,334,799.39	5.86
46	300199	翰宇药业	19,725,581.17	5.42
47	600741	华域汽车	19,557,066.23	5.37
48	600048	保利地产	19,510,851.02	5.36
49	300090	盛运股份	19,155,773.54	5.26
50	300070	碧水源	18,208,755.53	5.00
51	300315	掌趣科技	16,888,481.22	4.64
52	600261	阳光照明	16,462,900.36	4.52
53	601117	中国化学	16,126,410.00	4.43
54	002437	誉衡药业	16,100,386.58	4.42
55	600580	卧龙电气	14,658,497.91	4.03
56	300328	宜安科技	14,036,236.17	3.86
57	002041	登海种业	13,886,016.11	3.81
58	002663	普邦园林	12,998,825.95	3.57
59	300115	长盈精密	12,929,947.10	3.55
60	300351	永贵电器	12,746,272.20	3.50
61	600500	中化国际	11,536,617.02	3.17
62	002358	森源电气	10,806,466.54	2.97
63	601222	林洋电子	10,277,799.07	2.82
64	600183	生益科技	10,126,921.77	2.78
65	600690	青岛海尔	9,463,276.72	2.60
66	300212	易华录	9,212,847.34	2.53
67	600837	海通证券	8,818,895.03	2.42
68	002699	美盛文化	8,448,421.57	2.32

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	777,732,670.15
卖出股票收入（成交）总额	1,869,089,017.02

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序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。

#### 8.8 报告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

本基金本报告期末未持有贵金属投资。

#### 8.9 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。

#### 8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

##### 8.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金本报告期末投资股指期货。

##### 8.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金投资股指期货将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。

#### 8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

##### 8.11.1 本期国债期货投资政策

本基金本报告期末投资国债期货。

##### 8.11.2 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。

##### 8.11.3 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末投资国债期货。

## 8.12 投资组合报告附注

8.12.1 本基金投资的前十名证券的发行主体未出现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。

8.12.2 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。

## 8.12.3 其他资产构成

单位:人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	361,389.62
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	7,144.34
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	368,533.96

## 8.12.4 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。

## 8.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值(元)	基金资产净值比例(%)	流通受限情况说明
1	300011	鼎汉技术	31,588,582.50	8.68	重大事项

## 8.12.6 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。

## §9 基金份额持有人信息(转型前)

## 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

21,664	92,319.05	1,461,202,954.00	73.06%	538,797,046.00	26.94%
--------	-----------	------------------	--------	----------------	--------

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 期末上市基金前十名持有人

序号	持有人名称	持有份额（份）	占上市总份额比例
1	中国人寿保险（集团）公司	213,872,895.00	10.69%
2	中国人寿保险股份有限公司	199,733,717.00	9.99%
3	泰康人寿保险股份有限公司—分红—个人分红—019L-FH002 深	97,846,901.00	4.89%
4	伦敦市投资管理有限公司—客户资金	96,023,951.00	4.80%
5	幸福人寿保险股份有限公司—分红	81,858,785.00	4.09%
6	中国太平洋财产保险—传统—普通保险产品—013C-CT001 深	67,993,120.00	3.40%
7	阳光人寿保险股份有限公司—分红保险产品	66,978,433.00	3.35%
8	中国太平洋人寿保险股份有限公司—分红—个人分红	66,377,187.00	3.32%
9	中国太保集团股份有限公司—本级—集团自有资金—012G-ZY001 深	53,806,092.00	2.69%
10	阳光财产保险股份有限公司—自有资金	52,119,299.00	2.61%

## 9.3 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	-	0.00%

## 9.4 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、基金投资和研发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 基金份额持有人信息(转型后)

## 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
16,272	21,584.25	148,000,820.00	42.14%	203,218,022.97	57.86%

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 期末上市基金前十名持有人

序号	持有人名称	持有份额(份)	占上市总份额比例
1	大成基金管理有限公司	12,000,000.00	4.47%
2	幸福人寿保险股份有限公司-自有资金	7,449,089.00	2.77%
3	广东证券股份有限公司	6,000,000.00	2.23%
4	光大证券股份有限公司	6,000,000.00	2.23%
5	中经信投资有限公司	6,000,000.00	2.23%
6	北京德恒有限责任公司	3,800,000.00	1.42%
7	上海久辉工贸有限公司	3,400,000.00	1.27%
8	上海华成激光磁盘有限公司	3,063,820.00	1.14%
9	中国人寿保险(集团)公司企业年金计划-中国 农业银行股份有限公司	2,858,400.00	1.06%
10	新华人寿保险股份有限公司	2,500,903.00	0.93%

## 9.3 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	-	0.00%

## 9.4 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、基金投资和研 究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

## § 10 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2014年4月10日）基金份额总额	2,000,000,000.00
基金合同生效日起至报告期期末基金总申购份额	548,984.88
减：基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回份额	1,649,330,141.91
基金合同生效日起至报告期期末基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-
报告期期末基金份额总额	351,218,842.97

## § 11 重大事件揭示

## 11.1 基金份额持有人大会决议

本基金于2014年2月25日发布《关于景宏证券投资基金基金份额持有人大会表决结果的公告》，主要内容为：此次基金份额持有人大会审议了《关于景宏证券投资基金转型相关事项的议案》（以下简称“本次会议议案”），并由出具有效书面表决意见的基金份额持有人对本次会议议案进行表决，并最终通过了本次会议议案。本基金管理人于2014年3月21日收到中国证券监督管理委员会基金监管部签发的《关于景宏证券投资基金基金份额持有人大会决议备案的回函》（基金部函[2014]134号），景宏基金基金持有人大会决议报中国证监会备案手续完成，持有人大会决议于2014年3月24日生效。

## 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

一、基金管理人在本报告期内重大人事变动情况：

1、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。

2、基金管理人于2014年11月28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三十九次会议审议通过，由罗登攀先生任公司总经理。

3、基金管理人于2014年12月20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三十九次会议审议通过，由刘卓先生任公司董事长及法定代表人，张树忠先生不再担任公司董事长。

二、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动：

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。

报告期内本基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

### 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, 无涉及本基金托管业务的诉讼。

### 11.4 基金投资策略的改变

转型前, 本基金分别在资产配置、行业配置、个股选择三个层次上采取积极主动的策略进行投资。根据宏观经济状况和市场未来趋势进行资产配置; 依据对行业景气的判断进行行业权重配置; 在个股方面, 选择治理结构完善、管理有方、信息透明、行业竞争力强、财务状况良好而且其内在价值被市场低估的上市公司进行投资。

转型后, 本基金采用自上而下与自下而上相结合的方法进行主动投资策略, 以宏观经济和政策研究为基础, 通过分析影响证券市场整体运行的内外部因素, 进行自上而下的资产配置和组合管理, 同时自下而上的精选各个行业中具有良好治理结构、在细分行业具有竞争优势以及有较高成长性的中小盘股票进行投资。

### 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), 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。本年度支付的审计费用为 13.5 万元整。

### 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

本报告期内, 本基金托管人的托管业务部门及其相关高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

### 11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 (转型后)

#### 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	

华林证券	1	492,399,058.50	18.60%	435,730.18	18.41%	-
申银万国	1	266,367,628.59	10.06%	235,715.67	9.96%	-
国海证券	1	231,432,530.89	8.74%	204,795.92	8.65%	-
渤海证券	2	181,911,665.18	6.87%	162,525.42	6.87%	-
海通证券	2	174,512,529.42	6.59%	158,876.02	6.71%	-
东方证券	1	173,729,940.95	6.56%	158,163.16	6.68%	-
财富证券	1	167,862,568.51	6.34%	148,544.23	6.28%	-
齐鲁证券	2	135,740,343.83	5.13%	122,148.49	5.16%	-
万和证券	1	120,266,938.44	4.54%	109,490.58	4.63%	-
东吴证券	1	107,399,406.14	4.06%	95,038.06	4.02%	-
东海证券	1	78,216,166.53	2.96%	71,207.49	3.01%	-
中投证券	3	71,849,546.92	2.71%	65,411.39	2.76%	-
湘财证券	1	61,737,394.21	2.33%	56,205.27	2.37%	-
华泰证券	2	58,440,001.85	2.21%	51,714.92	2.19%	-
西南证券	1	58,222,777.45	2.20%	53,006.19	2.24%	-
中航证券	1	57,531,901.14	2.17%	50,911.11	2.15%	-
英大证券	1	50,881,251.21	1.92%	45,026.25	1.90%	-
中信证券	2	39,413,474.61	1.49%	35,881.14	1.52%	-
国都证券	1	35,608,122.07	1.35%	31,510.43	1.33%	-
华鑫证券	1	22,207,640.90	0.84%	20,217.97	0.85%	-
民族证券	1	17,170,485.06	0.65%	15,194.57	0.64%	-
江海证券	1	14,062,845.10	0.53%	12,802.95	0.54%	-
光大证券	2	12,720,309.20	0.48%	11,256.39	0.48%	-
国信证券	1	12,341,513.12	0.47%	10,921.17	0.46%	-
长江证券	1	4,795,647.35	0.18%	4,365.88	0.18%	-
长城证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
东莞证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
东兴证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
广发证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
广州证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
国泰君安	1	-	0.00%	-	0.00%	-
华宝证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
华福证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
民生证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
天源证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
万联证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-

银河证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
招商证券	2	-	0.00%	-	0.00%	-
中金公司	2	-	0.00%	-	0.00%	-
中银国际	1	-	0.00%	-	0.00%	-
安信证券	2	-	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。

本报告期内增加交易单元：齐鲁证券、东兴证券。

本报告期内退租交易单元：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
渤海证券	7,144,513.60	83.13%	-	0.00%	-	0.00%
中投证券	1,450,252.00	16.87%	-	0.00%	-	0.00%

### 11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况（转型前）

#### 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	
湘财证券	1	211,794,075.98	16.38%	192,818.15	16.66%	-
华林证券	1	195,864,807.94	15.15%	173,323.39	14.97%	-
中投证券	2	184,395,628.04	14.26%	167,871.92	14.50%	-
华宝证券	1	183,415,555.49	14.19%	162,304.58	14.02%	-
国海证券	1	164,115,860.13	12.70%	145,227.18	12.55%	-
中银国际	1	154,640,115.52	11.96%	136,843.02	11.82%	-
江海证券	1	50,742,548.94	3.93%	46,195.68	3.99%	-
申银万国	1	50,477,579.22	3.90%	44,667.21	3.86%	-
长江证券	1	39,962,675.30	3.09%	36,382.38	3.14%	-
海通证券	2	24,584,875.79	1.90%	22,382.26	1.93%	-
中信证券	2	18,720,424.26	1.45%	17,042.54	1.47%	-
万和证券	1	8,416,912.88	0.65%	7,662.73	0.66%	-
国信证券	1	5,533,531.37	0.43%	4,896.77	0.42%	-
华鑫证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
东海证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
光大证券	2	-	0.00%	-	0.00%	-
华泰证券	2	-	0.00%	-	0.00%	-
西南证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
东莞证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
东吴证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
东方证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
中航证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
英大证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
华福证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
民族证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
民生证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
万联证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
安信证券	2	-	0.00%	-	0.00%	-
国泰君安	1	-	0.00%	-	0.00%	-
国都证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
中金公司	2	-	0.00%	-	0.00%	-
招商证券	2	-	0.00%	-	0.00%	-

广发证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
财富证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
广州证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
银河证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
齐鲁证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
渤海证券	2	-	0.00%	-	0.00%	-
天源证券	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。

本报告期内增加交易单元：无。

本报告期内退租交易单元：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
中投证券	39,009,805.70	100.00%	-	0.00%	-	0.00%

## § 12 影响投资者决策的其他重要信息

1、基金管理人于 2015 年 1 月 13 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六届董事会第一次会议审议通过，刘彩晖女士不再担任公司副总经理。

2、基金管理人于 2015 年 1 月 22 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六届董事会第一次会议审议通过，由肖剑先生、钟鸣远先生任公司副总经理

3、本报告期内，本基金托管人中国银行的专门基金托管部门的名称由“托管及投资者服务部”更名为“托管业务部”。

大成基金管理有限公司  
2015 年 3 月 28 日