基金管理人:大成基金管理有限公司
基金托管人:中国工商银行股份有限公司
送出日期:2014年3月29日

大成保本混合型证券投资基金

【2013】年度报告摘要

§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。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2014年3月20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	大成保本混合
基金主代码	090013
交易代码	090013
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2011年4月20日
基金管理人	大成基金管理有限公司
基金托管人	中国工商银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	542,644,033.08份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	依照保证合同,本基金通过运用组合保险策略,在为符合保本条件的投资金额提供保本保障的基础上,追求基金资产的长期增值。
投资策略	本基金投资采用VPPI可变组合保险策略(Variable Proportion Portfolio Insurance)。VPPI策略是国际投资管理领域中一种常见的投资组合保险机制,将基金资产分配在保本资产和风险资产上;并根据数量分析、市场波动等来调整、修正风险资产与保本资产在投资组合中的比重,在保证风险资产可能的损失额不超过扣除相关费用后的保本资产的潜在收益与基金前期收益的基础上,参与分享市场可能出现的风险收益,从而保证本金安全,并实现基金资产长期增值。保本资产主要包括货币市场工具和债券等低风险资产,其中债券包括国债、金融债、企业债、公司债、债券回购、央行票据、可转换债券、可分离债券、短期融资券、资产支持证券以及经法律法规或中国证监会允许投资的其他债券类金融工具;风险资产主要包括股票、权证等高风险资产。
业绩比较基准	3年期银行定期存款利率(税后),指按照基金合同生效日或新的保本周期开始日中国人民银行公布并执行的同期金融机构人民币存款基准利率(按照四舍五入的方法保留到小数点后第2位,单位为百分数)计算的与当期保本周期同期限的税后收益率。
风险收益特征	本基金为保本混合型基金产品,属证券投资基金中的低风险收益品种。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		大成基金管理有限公司	中国工商银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	杜鹏	蒋松云
	联系电话	0755-83183388	010-66105799
	电子邮箱	dupeng@dcfund.com.cn	custody@icbc.com.cn
客户服务电话		4008885558	95588
传真		0755-83199588	010-66105798

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55号中国工商银行托管业务部

§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4月20日(基金合同生效日)-2011年12月31日
本期已实现收益	13,120,041.74	22,762,580.90	20,367,960.90
本期利润	7,662,922.13	18,964,922.84	28,200,469.52
加权平均基金份额本期利润	0.0119	0.0203	0.0206
本期基金份额净值增长率	0.67%	1.96%	2.20%
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	0.0390	0.0382	0.0150
期末基金资产净值	563,798,692.24	798,859,138.14	1,204,700,984.55
期末基金份额净值	1.039	1.042	1.022

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

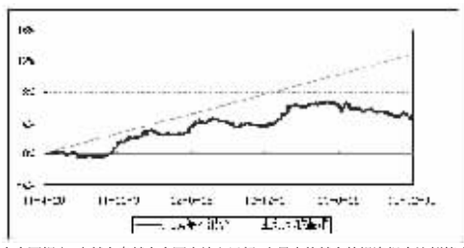
2、所述基金业绩指标不包括持有人交易基金的各项费用,计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

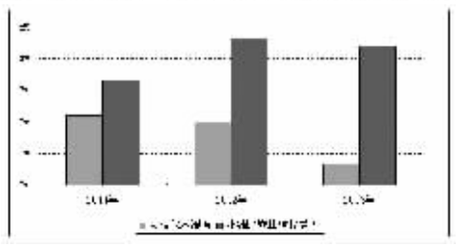
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	-0.48%	0.10%	1.07%	0.01%	-1.55%	0.09%
过去六个月	-1.05%	0.10%	2.17%	0.01%	-3.22%	0.09%
过去一年	0.67%	0.11%	4.39%	0.01%	-3.72%	0.10%
自基金合同生效起至今	4.90%	0.09%	12.83%	0.01%	-7.93%	0.08%

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



注:按基金合同规定,本基金自基金合同生效之日起6个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的约定,建仓期结束时本基金的各项投资比例已达到基金合同中规定的各项比例。

3.2.3 自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较



注:2011净值增长率表现期间为2011年4月20日(基金合同生效日)至2011年12月31日。

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	0.1000	7,540,649.65	-	7,540,649.65	
2012	-	-	-	-	
2011	-	-	-	-	
合计	0.1000	7,540,649.65	-	7,540,649.65	

§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		
陈尚前先生	本基金基金经理、固定收益部总监	2011年4月20日	-	14年	南开大学经济学博士。曾任中国平安保险公司投资管理中心债券投资室主任和招商证券股份有限公司研究发展中心策略部经理。2002年加盟大成基金管理有限公司,2003年6月至2009年5月曾任大成债券基金基金经理。2008年8月6日开始担任大成强化收益债券基金基金经理,2010年10月15日至2013年10月15日任大成景丰分级债券型证券投资基金基金经理,2011年4月20日起兼任大成保本混合型证券投资基金基金经理,2013年10月16日起兼任大成景丰债券型证券投资基金(LOF)基金经理,现同时担任公司固定收益部总监,固定收益投资决策委员会主席,负责公司固定收益证券投资业务,并兼任大成国际资产管理有限公司董事。具有基金从业资格。国籍:中国
朱文辉先生	本基金基金经理	2011年6月4日	2013年11月8日	13年	工商管理硕士。2000年9月至2002年1月就职于平安保险集团总公司投资管理中心任债券研究员;2002年1月至2003年1月就职于东方保险股份有限公司投资管理中心任债券投资经理。2003年1月至2005年12月就职于生命人寿保险股份有限公司资产管理部任助理总经理;2006年1月至2010年12月就职于汇丰晋信基金管理有限公司基金投资部任固定收益投资副总监,2008年12月3日至2010年12月4日兼任汇丰晋信平稳增利债券型证券投资基金基金经理。2011年加入大成基金管理有限公司,2011年6月4日至2013年11月8日任大成保本混合型证券投资基金基金经理。2011年11月30日至2013年11月8日任大成可转债增强债券基金基金经理。2012年6月15日至2013年11月8日任大成景恒保本混合型证券投资基金基金经理。具有基金从业资格。国籍:中国

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

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度和控制方法

根据《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》的规定,基金管理人制订了《大成基金管理有限公司公平交易制度》及《大成基金管理有限公司异常交易监控与报告制度》。基金管理人旗下投资组合严格按照制度的规定,参与股票、债券的一级市场申购、二级市场交易等投资管理活动,内容包括授权、研究分析、投资决策、交易执行、业绩评估等与投资管理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。

【2013】年度报告摘要

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

在中央政府经济增长"上下限管理"的指导思路下,2013年经济运行总体较为平稳。在库存周期和基建投资等的扰动下,GDP在7.4%-7.8%的区间内震荡。CPI全年呈先低后高走势;在鲜菜和猪肉价格超季节性回落的带动下,四季度CPI走势明显低于市场预期;全年CPI同比上涨2.6%,总体处于可控状态。

2013年资金市场经历了大幅波动。前五个月外汇占款大幅增长,在强劲的社会融资需求特别是以地方融资平台和房地产市场为代表的强劲需求带动下,资金市场呈现供需两旺的局面。但社会融资总量大幅扩张,尤其是非标资产的快速扩张、银行机构加杠杆行为也引起了监管机构的关注。在金融市场创新层出不穷的背景下,监管机构综合运用价格手段和数量手段来调控资金市场,主要包括"锁长放短"、持续上调逆回购利率以及严厉的窗口指导和SLO等等,下半年资金市场处于持续偏紧且波动的状态。市场参与主体在历史惯性思维的指导下,对监管机构态度的变化预期严重不足,叠加年中偏紧的资金面,投资机构尤其银行的情绪及投资行为发生了剧烈变化,最终导致2013年下半年债券市场大幅调整。其中关键期限的利率品种收益率创出历史次新高,而信用品种上行幅度也超过100bp。

具体来看,2013年中债综合财富总指数下跌2.1%,其中下半年跌幅高达4.16%,创历史之最。各类债券类资产中,利率债全年表现最差,其中国债上行约90-130bp,金融债上行130-180bp。中债国债和金融债指数分别下跌2.86%和1.6%。信用债也表现较弱,中债中期票据指数虽然全年上涨1.55%,但是仅下半年跌幅就达到1.15%;中债企业债指数全年回报达到1.76%,但受制于利率债市场表现较弱、供应量较大以及部分投资机构需求受限等因素,该指数下半年跌幅就达到2.02%。短融品种受益于久期较短,全年上涨达4.05%。

A股市场表现差异较大,创业板指数全年大涨82.73%,而沪深300表现不佳,全年跌幅达到7.65%。中证可转债指数下跌1.42%,受股市风格影响,个券表现差异较大。大多数中小盘转债都取得正回报,海直、川投等涨幅均超过10%。但大盘转债表现悉数不佳,工行、石化跌幅超过7%,今年上市的民生转债全年跌幅也超过3%。

基于保本基金不同阶段和不同安全垫的状况,我们基于"严格风险控制,追求稳健收益"的原则进行审慎投资.由于本基金保本周期将于2014年4月结束,2013年,组合保持了较高的与保本剩余期限接近的利率债和中高等级短期信用债的仓位,提高组合的持有期收益;在深入研究个券基本面的基础上,结合市场环境和基金本身投资策略,对部分转债和权益资产进行了积极管理和交易。虽然组合债券剩余期限较短,但在下半年的利率和信用债市场的大幅调整中净值依然受到冲击。

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1.039元,本报告期基金份额净值增长率为0.67%同期业绩比较基准收益率为4.39%,低于业绩比较基准的表现。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望2014年,房地产市场供需两旺的格局难以延续,房地产投资增速有望下降。政府债务管理、融资平台的监管政策等也将限制基建投资的资金来源,并带动基建投资增速下滑。而较高的社会融资成本、产能过剩以及环保监管等因素将使得制造业的投资难以明显反弹;外贸形势亦不容乐观。政府经济增长目标完成将面临压力和考验。

通胀在2014年仍难以掀起较大波澜,预计全年CPI 增速仍在3%以内。宏观基本面对债券市场总体偏正面;资金面情况仍将取决于监管层的态度及操作,今年以来央行已经增强与市场沟通,引导市场预期,并加强对资金波动性管理,预计2014年流动性环境好于2013年。信用风险将是2014年投资者面临的主要风险因素。

2014年,预计利率债受制于供给压力和利率市场化带来的银行资金成本的抬升,虽然存在较高的配置价值,但资本利得机会有待进一步的催化剂。而低等级产业债面临着基本面下滑及融资成本抬升的双重压力,信用风险溢价易升难降。城投债券的系统风险相对较小,且未来市政债的试点将是大概率事件,该类资产收益率具有较强的吸引力。股票市场预计仍然是结构性机会,同时波动率加大;可转债资产表现亦然,个券表现预计继续保持分化态势。

在保本周期结束前,本基金组合将主要持有与保本周期到期日期限完全一致的货币市场工具,包括协议存款、短期高等级信用债等;同时以较小的投资比例结合市场环境和策略投资于风险资产力争获得投资收益,回报基金持有人的信任和支持。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

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

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

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

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

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金管理人严格按照本基金基金合同的规定进行收益分配。本报告期内大成保本混合已分配利润7,540,649.65元(每十份基金份额分红0.1元),符合基金合同规定的分红比例。

§5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内,本基金托管人在对大成保本混合型证券投资基金的托管过程中,严格遵守《证券投资基金法》及其他法律法规和基金合同的有关规定,不存在任何损害基金份额持有人利益的行为,完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

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,大成保本混合型证券投资基金的管理人——大成基金管理有限公司在大成保本混合型证券投资基金的投资运作、基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格计算、基金费用开支等问题上,不存在任何损害基金份额持有人利益的行为,在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。本报告期内,大成保本混合型证券投资基金对基金份额持有人进行了1次利润分配,分配金额为7,540,649.65元。

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

本托管人依法对大成基金管理有限公司编制和披露的大成保本混合型证券投资基金2013年年度报告中财务指标、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进行了核查,以上内容真实、准确和完整。

§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:大成保本混合型证券投资基金

报告截止日:2013年12月31日

单位:人民币元

资 产	本期末 2013年12月31日	上年度末 2012年12月31日
资 产:		
银行存款	53,411,263.28	72,632,292.12
结算备付金	273,467.94	295,454.55
存出保证金	263,309.71	83,333.33
交易性金融资产	539,379,748.03	733,923,273.10
其中:股票投资	33,471,967.53	16,791,420.00
基金投资	-	-
债券投资	505,907,780.50	717,131,853.10
资产支持证券投资	-	-
衍生金融资产	-	-
买入返售金融资产	-	23,000,000.00
应收证券清算款	288,373.71	-
应收利息	10,877,218.88	9,245,298.41
应收股利	-	-
应收申购款	1,980.64	90,540.95
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	-
资产总计	604,495,362.19	839,270,192.46
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	39,159,741.26	-
应付证券清算款	-	38,446,069.84
应付赎回款	497,609.97	701,699.40
应付管理人报酬	584,259.59	822,209.29
应付托管费	97,376.60	137,034.86
应付销售服务费	-	-
应付交易费用	103,447.55	31,457.37
应交税费	64,016.00	64,016.00
应付利息	10,588.12	-
应付利润	-	-
递延所得税负债	-	-
其他负债	179,630.86	208,567.56
负债合计	40,696,669.95	40,411,054.32
所有者权益:		
实收基金	542,644,033.08	766,957,704.51
未分配利润	21,154,659.16	31,901,433.63
所有者权益合计	563,798,692.24	798,859,138.14
负债和所有者权益总计	604,495,362.19	839,270,192.46

注:报告截止日2013年12月31日,基金份额净值1.039元,基金份额总额542,644,033.08份。

7.2 利润表

会计主体:大成保本混合型证券投资基金

本报告期:2013年1月1日至2013年12月31日

单位:人民币元

项 目	本期 2013年1月1日至2013年12月31日	上年度可比期间 2012年1月1日至2012年12月31日
一、收入	18,766,582.34	33,232,572.39
1.利息收入	18,883,869.91	31,456,422.00
其中:存款利息收入	475,925.63	600,441.20
债券利息收入	17,311,070.95	30,101,787.35
资产支持证券利息收入	-	-
买入返售金融资产收入	1,096,873.33	754,193.45
其他利息收入	-	-
2.投资收益(损失以"-"填列)	4,528,712.41	3,672,087.17
其中:股票投资收益	-5,583,177.14	-3,235,996.69
基金投资收益	-	-
债券投资收益	10,061,324.34	6,754,213.56
资产支持证券投资收益	-	-
衍生工具收益	-	-
股利收益	50,565.21	153,870.30
3.公允价值变动收益(损失以"-"号填列)	-5,457,119.61	-3,797,658.06
4.汇兑收益(损失以"-"号填列)	-	-
5.其他收入(损失以"-"号填列)	811,119.63	1,901,721.28
减:二、费用	11,103,660.21	14,267,649.55
1.管理人报酬	8,139,493.90	11,667,116.85
2.托管费	1,356,582.35	1,944,519.39
3.销售服务费	-	-
4.交易费用	1,111,194.79	212,425.35
5.利息支出	72,838.90	-
其中:卖出回购金融资产支出	72,838.90	-
6.其他费用	423,550.27	443,587.96
三、利润总额(亏损总额以"-"号填列)	7,662,922.13	18,964,922.84
减:所得税费用	-	-
四、净利润(净亏损以"-"号填列)	7,662,922.13	18,964,922.84

7.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体:大成保本混合型证券投资基金

本报告期:2013年1月1日至2013年12月31日

单位:人民币元

项目	本期 2013年1月1日至2013年12月31日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益(基金净值)	766,957,704.51	31,901,433.63	798,859,138.14
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	7,662,922.13	7,662,922.13
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)	-224,313,671.43	-10,869,046.95	-235,182,718.38
其中:1.基金申购款	3,956,635.69	188,882.36	4,145,518.05
2.基金赎回款	-228,270,307.12	-11,057,929.31	-239,328,236.43
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)	-	-7,540,649.65	-7,540,649.65
五、期末所有者权益(基金净值)	542,644,033.08	21,154,659.16	563,798,692.24
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)	1,178,359,027.14	26,341,957.41	1,204,700,984.55
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	18,964,922.84	18,964,922.84
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)	-411,401,322.63	-13,405,446.62	-424,806,769.25
其中:1.基金申购款	9,478,704.16	326,211.67	9,804,915.83
2.基金赎回款	-420,880,026.79	-13,731,658.29	-434,611,685.08
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)	766,957,704.51	31,901,433.63	798,859,138.14

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告7.1至7.4财务报表由下列负责人签署:

_ _ _张树忠 ____ _____刘彩晖_____ ____范瑛 ___

基金管理人负责人 主管会计工作负责人 会计机构负责人

7.4 报表附注

7.4.1 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

7.4.2 税项

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

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

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

(3) 对基金取得的企业债券利息收入,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、注册登记机构、基金销售机构
中国工商银行股份有限公司("中国工商银行")	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")	基金管理人的合资子公司

注:1. 本基金基金管理人于2013年10月29日成立了合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

无。

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	8,139,493.90	11,667,116.85
其中:支付销售机构的客户维护费	3,359,847.61	4,740,486.37

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1.20%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 1.20% / 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	1,356,582.35	1,944,519.39

注:支付基金托管人中国工商银行的托管费按前一日基金资产净值0.20%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 0.20% / 当年天数。

7.4.4.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本报告期内及上年度可比期间本基金未发生与关联方进行的银行间同业市场的债券(含回购)交易。

7.4.4.4 各关联方投资本基金的情况

本报告期内及上年度可比期间本基金未发生各关联方投资本基金的情况。

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
中国工商银行	3,411,263.28	269,562.66	72,632,292.12	571,351.43

注:本基金的银行存款由基金托管人中国工商银行保管,按银行同业利率计息。

7.4.4.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本报告期内及上年度可比期间本基金未在承销期内参与关联方承销证券。

7.4.4.7 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期及上年度可比期间无须作说明的其他关联交易事项。

7.4.5 期末(2013年12月31日)本基金持有的流通受限证券

7.4.5.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

本基金本期末未持有因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券。

7.4.5.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

于本报告期末,本基金未持有暂时停牌等流通受限股票。

7.4.5.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.5.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末2013年12月31日止,本基金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39,159,741.26元,是以如下债券作为抵押:

金额单位:人民币元

债券代码	债券名称	回购到期日	期末估值单价	数量(张)	期末估值总额
120414	12农发14	2014-01-06	96.55	200,000	19,310,000.00
130236	13国开36	2014-01-06	99.31	200,000	19,862,000.00
合计				400,000	39,172,000.00

7.4.5.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末2013年12月31日止,本基金无从事证券交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款的余额。

§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	33,471,967.53	5.54
	其中:股票	33,471,967.53	5.54
2	固定收益投资	505,907,780.50	83.69
	其中:债券	505,907,780.50	83.69
	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	53,684,731.22	8.88
6	其他各项资产	11,430,882.94	1.89
7	合计	604,495,362.19	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	21,781,650.89	3.86
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	0.00
E	建筑业	1,356,800.00	0.24
F	批发和零售业	1,420,572.00	0.25
G	交通运输、仓储和邮政业	-	0.00
H	住宿和