景福证券投资基金

[2013] 年度报告摘要

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。

本报告中财务资料已经审计。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	大成景福封闭
基金主代码	184701
交易代码	184701
基金运作方式	契约型封闭式
基金合同生效日	1999年12月30日
基金管理人	大成基金管理有限公司
基金托管人	中国农业银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	3,000,000,000.00份
基金合同存续期	15年
基金份额上市的证券交易所	深圳证券交易所
上市日期	2000年1月10日

注:本基金在交易所行情系统净值揭示等其他信息披露场合下,可简称为“基金景福”。

2.2 基金产品说明

投资目标	通过指数化投资和积极投资的有机组合,实现投资风险和收益的优化平衡,力求使基金取得超过市场的投资收益,实现基金资产的长期稳定增值。
投资策略	本基金的指数投资部分采用分层抽样法,选择代表上证A股市场整体特征的股票构建投资组合;积极投资部分则投资于高成长行业或价值低估行业的股票。整体投资力求超越基准指数表现。

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	-3,818,739.51	-415,582,016.40	238,357,272.21
本期利润	25,135,068.81	105,679,114.42	-1,141,816,936.45
加权平均基金份额本期利润	0.0084	0.0352	-0.3806
本期基金份额净值增长率	0.90%	3.91%	-29.78%
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	-0.0557	-0.0641	-0.0993
期末基金资产净值	2,832,784,828.32	2,807,649,759.51	2,701,970,645.09
期末基金份额净值	0.9443	0.9359	0.9007

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。

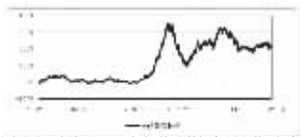
2、所述基金业绩指标不包括持有人交易基金的各项费用,计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

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

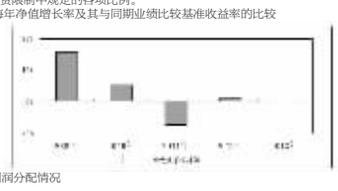
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	-8.40%	2.62%	-	-	-	-
过去六个月	-1.42%	2.19%	-	-	-	-
过去一年	0.90%	2.12%	-	-	-	-
过去三年	-26.38%	2.37%	-	-	-	-
过去五年	43.85%	2.65%	-	-	-	-
自基金合同生效起至今	205.27%	2.69%	-	-	-	-

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,本基金应在合同生效后三个月内达到规定的投资比例。截至报告日,本基金的各项投资比例已达到基金合同第七条之(七)投资限制中规定的各项比例。

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	2.2000	660,000,000.00	-	660,000,000.00	2010年度收益分配
合计	2.2000	660,000,000.00	-	660,000,000.00	

§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		
杨丹先生	本基金基金经理	2008年8月23日	-	12年	理学硕士。2001年加入大成基金管理有限公司,先后任职于基金经理部、研究部、金融工程部、股票投资部,2006年5月27日至2011年6月14日曾任大成沪深300指数证券投资基金基金经理。2011年6月14日至2013年7月17日任大成内需增长股票型证券投资基金基金经理。2008年8月23日开始担任景福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	-	5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》、《景福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,基金景福的投资范围、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。

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6%的有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A股市场上演了持续的结构分化行情,整体指数走熊,但一些行业和个股反倒走出大牛行情。细分来看,上证综指下跌6.75%,而中小板指上涨17.54%,创业板指更是上涨达到82.73%。

从相对长的视角看,全年经济运行还是较为平稳的,我们预计全年GDP增长不会与7.5%的预计值出现较大偏差。由于新一届政府的施政理念和措施与上届明显不同,使得市场参与主体的预期变化较为剧烈,也就造成了股市的大幅波动。回顾2013年主导A股市场的几个关键词,一是经济结构转型,虽然结构转型提了很多年,但2013年开始相关政策开始密集出台;二是移动互联这一新的技术开始颠覆一些传统行业,创造了新的盈利模式;三是货币政策保持了中性偏紧,全社会无风险利率上升,地方政府债务始终构成担忧。

分板块看,传媒、计算机、通信和电子元器件涨幅最大,是贯穿全年的投资热点,家电、医药保持了传统消费稳定增长的特性,涨幅居前。而传统的房地产产业链表现最差,地产、煤炭、有色,建材、钢铁等板块都是持续下跌,在结构转型背景下,市场给这一类行业的估值越来越低。由于反腐的持续深入,白酒等过去对公务接待市场有依赖的行业基本面受到持续打击,跌幅也较大。

本基金在投资组合的构建中偏爱消费类和新兴成长类行业,因此基本规避了跌幅靠后的传统产业。医药生物、电子元器件和通信是贯穿了全年的持仓,取得的收益也不错。部分行业如非银、商贸由于介入时点不对,取得的收益有限。2013年末本组合重仓持有的行业有医药生物、电子元器件、通信和商业贸易。

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0.9443元,本报告期基金份额净值增长率为0.90%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

如果说2013年是中国经济结构转型真正的元年,那么2014年就是转型深化的一年。困扰资本市场的影子银行、银行间利率抬升、地方政府债务快速等一系列问题仍将在2014年持续,这是经济转型的必然现象。不过,我们相信,中国政府手中仍有足够的资源和空间来应对上述问题,2014年经济增长仍是有惊无险,达到7.5%的增长速度并非难事。

资本市场将危机并存。可以明确的是,货币政策仍将保持中性偏紧,因此房地产相关行业和基建投资相关行业将面临较大的基本面风险。但某些领域在深化改革的大背景下也将迎来较大的投资机遇。我们将在下述方面寻找投资机会,一是十八届三中全会进一步强调了市场经济在资源配置中的地位和作用,民营资本将有机会进入传统垄断行业,激活过往传统垄断体制下低效资源;二是“新兴行业”在结构转型过程中必将快速崛起,移动互联网对传统行业盈利模式的颠覆和创新将在2014年大量涌现,环境问题凸显将会不断推动环保行业和清洁能源行业的发展;三是4G、移动支付、云计算、大数据等新技术领域将会涌现出大批富于创新的公司;四是人均收入水平提升,老龄人口占比提升以及政府在社会健康领域加大投入将会促使健康服务产业大发展。

在上述领域中以合理的估值水平选择股票进行投资是我们2014年最重要的工作,因为我们在看到上述巨大投资机会的同时,也发现一些股票已经在2013年被大幅抬升了估值,甚至透支了未来几年的业绩。因此,深入研究基本面出现超预期概率较大的公司,然后选择合适时点介入相关股票显得尤为重要。

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调整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调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

在托管景福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《景福证券投资基金基金合同》、《景福证券投资基金托管协议》的约定,对景福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景福证券投资基金的投资运作、基金资产净值的计算、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景福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年度财务会计报告已经普华永道中天会计师事务所有限公司审计,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:景福证券投资基金

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	51,825,837.75	123,140,615.99
结算备付金	2,370,946.63	2,444,418.45
存出保证金	811,823.79	1,000,000.00
交易性金融资产	2,780,618,096.59	2,665,259,916.89
其中:股票投资	2,186,857,438.99	2,098,743,465.99
基金投资	-	-
债券投资	593,760,657.60	566,516,450.90
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	5,023,944.71	11,151,988.04
应收利息	12,457,813.36	11,276,256.63
应收股利	-	-
应收申购款	-	-
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	-
资产总计	2,853,108,462.83	2,814,273,196.00
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	13,617,352.59	-
应付赎回款	-	-
应付管理人报酬	3,052,444.30	2,797,681.08
应付托管费	610,488.88	559,536.24
应付销售服务费	-	-
应付交易费用	1,801,640.36	1,814,510.79
应交税费	-	-
应付利息	-	-
应付利润	-	-
递延所得税负债	-	-
其他负债	1,241,708.38	1,451,708.38
负债合计	20,323,634.51	6,623,436.49
所有者权益:		
实收基金	3,000,000,000.00	3,000,000,000.00
未分配利润	-167,215,171.68	-192,350,240.49
所有者权益合计	2,832,784,828.32	2,807,649,759.51
负债和所有者权益总计	2,853,108,462.83	2,814,273,196.00

注:报告截止日2013年12月31日,基金份额净值0.9443元,基金份额总额3,000,000,000.00份。

7.2 利润表

会计主体:景福证券投资基金

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	83,250,182.21	157,206,889.00
1.利息收入	23,607,738.38	22,934,014.19
其中:存款利息收入	526,814.50	492,224.73
债券利息收入	23,080,923.88	22,441,789.46
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)	30,607,839.70	-386,988,256.01
其中:股票投资收益	6,107,348.27	-423,032,655.76
基金投资收益	-	-
债券投资收益	-6,455,634.68	-1,442,232.20
资产支持证券投资收益	-	-
衍生工具收益	-	-
股利收益	30,956,126.11	37,486,631.95
3.公允价值变动收益(损失以“-”号填列)	28,953,808.32	521,261,130.82
4.汇兑收益(损失以“-”号填列)	-	-
5.其他收入(损失以“-”号填列)	80,795.81	-
减:二、费用	58,115,113.40	51,527,774.58
1.管理人报酬	37,083,422.58	34,547,875.94
2.托管费	7,416,684.43	6,909,575.06
3.销售服务费	-	-
4.交易费用	13,091,269.91	9,351,551.79
5.利息支出	-	236,241.59
其中:卖出回购金融资产支出	-	236,241.59
6.其他费用	523,736.48	482,530.20
三、利润总额(亏损总额以“-”号填列)	25,135,068.81	105,679,114.42
减:所得税费用	-	-
四、净利润(净亏损以“-”号填列)	25,135,068.81	105,679,114.42

7.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体:景福证券投资基金

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)	3,000,000,000.00	-192,350,240.49	2,807,649,759.51
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	25,135,068.81	25,135,068.81
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)	3,000,000,000.00	-167,215,171.68	2,832,784,828.32
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)	3,000,000,000.00	-298,029,354.91	2,701,970,645.09
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	105,679,114.42	105,679,114.42
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)	3,000,000,000.00	-192,350,240.49	2,807,649,759.51

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,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”)	基金发起人、基金管理人
中国农业银行股份有限公司(“中国农业银行”)	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。广东证券作为本基金发起人的权利义务及持有的基金份额的继承机构尚待明确。

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	1,590,816,537.40	18.40%	783,858,104.92	12.79%

7.4.4.1.2 权证交易

无。

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	1,448,274.96	18.64%	16,372.34	0.91%
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	701,141.34	13.20%	293,312.97	16.17%

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	37,083,422.58	34,547,875.94
其中,支付销售机构的客户维护费	-	-

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1.25%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:

日管理人报酬=前一日基金资产净值 X 1.25% / 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。

7.4.4.2.2 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	7,416,684.43	6,909,575.06

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:

日托管费=前一日基金资产净值 X 0.25% / 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

单位:人民币元

本期 2013年1月1日至2013年12月31日						
银行间市场交易的各关联方名称	债券交易金额		基金逆回购		基金正回购	
	基金买入	基金卖出	交易金额	利息收入	交易金额	利息支出
中国农业银行	60,812,416.44	-	-	-	-	-
上年度可比期间 2012年1月1日至2012年12月31日						
银行间市场交易的各关联方名称	债券交易金额		基金逆回购		基金正回购	
	基金买入	基金卖出	交易金额	利息收入	交易金额	利息支出
-	-	-	-	-	-	-

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(1999年12月30日)持有的基金份额	-	-
期初持有的基金份额	7,500,000.00	7,500,000.00
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	7,500,000.00	7,500,000.00
期末持有的基金份额占基金总份额比例	0.25%	0.25%

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

份额单位:份

关联方名称	本期末 2013年12月31日		上年度末 2012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	3,750,300.00	0.13%	3,750,300.00	0.13%
广东证券	3,750,000.00	0.13%	3,750,000.00	0.13%

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	51,825,837.75	452,368.86	123,140,615.99	451,629.02

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

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

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	2,186,857,438.99	76.65
	其中:股票	2,186,857,438.99	76.65
2	固定收益投资	593,760,657.60	20.81
	其中:债券	593,760,657.60	20.81
	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	54,196,784.38	1.90
6	其他各项资产	18,293,581.86	0.64
7	合计	2,853,108,462.83	100.00

8.2 期末按行业分类的股票投资组合

8.2.4 期末指数投资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	654,762,048.80	23.11
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	204,039,400.80	7.20
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	-	0.00
J	金融业	181,124,155.76	6.39
K	房地产业	-	0.00
L	租赁和商务服务业	-	0.00
M	科学研究和技术服务业	-	0.00
N	水利、环境和公共设施管理业	-	0.00
O	居民服务、修理和其他服务业	-	0.00
P	教育	-	0.00
Q	卫生和社会工作	-	0.00
R	文化、体育和娱乐业	-	0.00
S	综合	-	0.00
	合计	1,039,925,605.36