大成景恒保本混合型证券投资基金

【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。

基金托管人中国银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2014年3月27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。安永华明会计师事务所(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	大成景恒保本混合
基金主代码	090019
交易代码	090019
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2012年6月15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	589,848,006.05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,将基金资产动态优化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,在大幅来保证风险资产可能的损失金额不超过扣除相关费用后的安全垫的基础上,积极参与分享市场可能出现的风险收益,从而在保证本金安全的前提下实现基金资产长期稳定增值。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、中期票据、可转换债券、可分离交易债券、短期融资券、银行存款、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、股指期货、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	中国银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	杜鹏	唐州徽
	联系电话	0755-83183388	95566
	电子邮箱	dupeng@dcfund.com.cn	fcid@bankofchina.com
客户服务电话		4008888558	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	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	2013年	2012年6月15日(基金合同生效日)-2012年12月31日
本期已实现收益	-14,364,772.17	6,970,050.85
本期利润	-4,044,727.35	-2,793,601.97
加权平均基金份额本期利润	-0.0055	-0.0029
本期基金份额净值增长率	-0.90%	-0.30%
3.1.2 期末数据和指标	2013年末	2012年末
期末可供分配基金份额利润	-0.0178	-0.0027
期末基金资产净值	582,621,025.10	887,410,843.43
期末基金份额净值	0.988	0.997

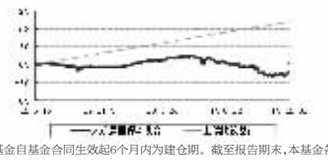
注:1.本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入(不含公允价值变动收益)扣除相关费用后的余额,本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。
2.所述基金业绩指标不包括持有人交易基金的各项费用,计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

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

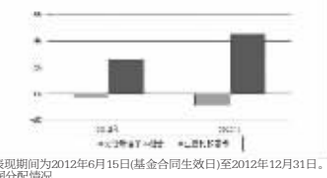
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	-0.70%	0.13%	1.11%	0.01%	-1.81%	0.12%
过去六个月	-1.89%	0.11%	2.24%	0.01%	-4.13%	0.10%
过去一年	-0.90%	0.11%	4.53%	0.01%	-5.43%	0.10%
自基金合同生效起至今	-1.20%	0.09%	7.20%	0.01%	-8.40%	0.08%

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起6个月内为建仓期。截至报告期末,本基金各项资产配置比例已符合基金合同的规定。

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:2012年净值增长率表现期间为2012年6月15日(基金合同生效日)至2012年12月31日。

3.3 过去三年基金的利润分配情况

本基金自2012年6月15日(基金合同生效日)以来未有收益分配事项。

§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/深市ETF及大成中证500沪/深市ETF联接基金、中证100ETF、中证500深市ETF,1只ODII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、大成盛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 任职日期	离任日期	证券从业年限	说明
王磊先生	本基金基金经理	2013年7月17日	-	9年	经济学硕士。2003年5月至2012年10月曾任证券时报社公司新闻部记者、世纪证券投资银行部业务董事、国信证券经济研究所分析师及资产管理总部专户投资经理、中银基金管理有限公司专户理财部投资经理及总监(主持工作)。2012年11月加入大成基金管理有限公司。2013年6月7日起担任大成强化收益债券型证券投基金基金经理。2013年7月17日起任大成景恒保本混合型证券投资基金基金经理。2013年11月9日起任大成可转债增强债券型证券投资基金基金经理。具有基金从业资格。国籍:中国
朱文辉先生	本基金基金经理	2012年6月15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31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
黄海峰先生	本基金基金经理助理	2013年10月28日	-	9年	南开大学经济学学士,2004年7月至2010年5月就职于深圳农村商业银行,任资金部投资经理;2010年5月至2012年10月就职于博时基金管理有限公司,任交易部交易员;2012年7月至2013年5月就职于银华基金管理有限公司,任固定收益部基金经理助理;2013年7月加入大成基金管理有限公司固定收益部。2013年10月14日起任大成现金宝场内实时申赎货币市场基金基金经理助理。2013年10月28日起大成景恒保本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遵规守信情况的说明

本报告期内,本基金管理人严格遵守《证券法》、《证券投资基金法》、《大成景恒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,大成景恒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,内容包括投权、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,因投资组合成交时间不一致以及成交价格的日内较大变动导致个别些组合间的成交价格差异较大,但结合交易价差专项统计分析,未发现违反公平交易原则的异常情况。

4.3.3 异常交易行为的专项说明

报告期内,基金管理人旗下所有投资组合未发现存在异常交易行为。主动投资组合间股票交易存在11笔同日反向交易,原因为投资策略需要。主动型投资组合与指数型投资组合之间或指数型投资组合之间存在股票同日反向交易,参与交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量超过该股当日成交量5%的仅有2笔,原因为投资策略需要;主动投资组合间债券交易存在1笔同日反向交易,原因为投资策略需要。投资组合间相邻交易日反向交易的市场成交比例、成交均价等交易结果数据表明该类交易不对市场产生重大影响,无异常。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2013年宏观经济运行平稳,全年GDP同比增长7.7%,通胀形势稳定,全年CPI增长2.6%。从2013年情况看,基本面因素基本符合市场预期,全年债券市场走势主要受到了政策面和资金面超预期扰动,债券市场经历罕见的剧烈波动。中债综合财富(总值)指数全年下跌0.47%,其中下半年下跌2.74%,半年跌幅创历史之最。股票市场行情严重分化,创业板指全年暴涨82.73%,上证50则大跌15.23%。在大盘股拖累下,整体震荡下行,沪深300指数跌幅为7.65%,中证可转债指数跌幅为1.42%。

在组合操作上,下半年基于对债市偏空看法,我们全面降低资产久期,减持了长久期债券,在收益不断走高过程中逐步增持中高评级优质信用债,力争在控制久期和信用风险前提下提高组合静态收益,以积累更高安全垫。股票仓位维持稳定,适时降低大盘股仓位,通过分散持股和精选个股来增强收益。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末,本基金份额净值为0.988元,本报告期份额净值增长率为-0.90%,同期业绩比较基准增长率为4.53%,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,从国外看,欧美日低利率有望维持,发达经济体复苏趋势渐强,但新兴市场在美国缩减QE规模影响下可能面临资金外流、货币贬值和经济失衡等问题,整体看外围市场不确定性和复杂性比2013年有所增加。从国内看,我国的经济面临调结构和改革压力,短期内难以出现一个整体的向上趋势,改革的力度和进程将更为深刻地影响经济运行。基于上述基本判断,我们认为资本市场整体震荡为主,债券市场关注资金面和央行货币政策变化,股票市场主要抓改革和产业热点。

本基金2014年将继续保持高比例的固定收益证券投资,加大波段操作力度,重点关注宏观经济数据指标和政策动向,根据基本面、资金面和政策面灵活调整债券资产仓位和久期,在确保安全性和流动性基础上博取更高收益。权益类操作将密切关注改革、结构调整和新兴产业发展态势,通过仓位控制来调整风险敞口,深入挖掘个股来增强收益。

我们非常感谢基金份额持有人的信任和支持,我们将按照本基金合同和风险收益特征的要求,严格控制投资风险,积极进行资产配置,适时调整组合结构,研究新的投资品种和挖掘投资机会,力争获得与基金风险特征一致的稳定收益回报给投资者。

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")在对大成景恒保本混合型证券投资基金(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

本基金2013年度财务会计报告已经安永华明会计师事务所(特殊普通合伙)审计,注册会计师签字出具了标准无保留意见的审计报告。投资者欲了解本基金审计报告详细内容,应阅读年度报告正文。

§7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体:大成景恒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	101,338,954.94	44,963,254.68
结算备付金	2,644,997.67	263,860.96
存出保证金	96,615.23	-
交易性金融资产	420,772,397.24	835,661,746.40
其中:股票投资	52,200,444.54	-
基金投资	-	-
债券投资	368,571,952.70	835,661,746.40
资产支持证券投资	-	-
衍生金融资产	-	-
买入返售金融资产	79,500,489.25	-
应收证券清算款	-	-
应收利息	5,433,127.34	13,886,898.50
应收股利	-	-
应收申购款	989.79	-
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	-
资产总计	609,787,571.46	894,775,760.54
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	24,869,062.21	5,504,499.72
应付赎回款	904,649.15	669,004.69
应付管理人报酬	601,774.79	916,326.72
应付托管费	100,295.81	152,721.12
应付销售服务费	-	-
应付交易费用	321,477.80	2,125.00
应交税费	188,252.80	-
应付利息	-	-
应付利润	-	-
递延所得税负债	-	-
其他负债	181,033.80	120,239.86
负债合计	27,166,546.36	7,364,917.11
所有者权益:		
实收基金	589,848,006.05	889,849,565.84
未分配利润	-7,226,980.95	-2,438,722.41
所有者权益合计	582,621,025.10	887,410,843.43
负债和所有者权益总计	609,787,571.46	894,775,760.54

注:1.报告截止日2013年12月31日,基金份额净值人民币0.9880元,基金份额总额589,848,006.05份。
2.本基金合同生效日为2012年6月15日,本财务报表比较期间的实际编制期间为2012年6月15日(基金合同生效日)至2012年12月31日。

7.2 利润表

会计主体:大成景恒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6月15日(基金合同生效日)至2012年12月31日
一.收入	7,778,530.58	4,801,304.56
1.利息收入	23,893,668.48	16,436,279.79
其中:存款利息收入	715,328.78	566,888.58
债券利息收入	22,079,244.47	12,408,437.64
资产支持证券利息收入	-	-
买入返售金融资产收入	1,099,095.23	3,460,953.57
其他利息收入	-	-
2.投资收益(损失以"-"填列)	-27,763,476.24	-2,782,987.22
其中:股票投资收益	-4,470,714.45	-
基金投资收益	-	-
债券投资收益	-23,438,830.75	-2,782,987.22
资产支持证券投资收益	-	-
衍生工具收益	-	-
股利收益	146,068.96	-
3.公允价值变动收益(损失以"-"号填列)	10,320,044.82	-9,763,652.82
4.汇兑收益(损失以"-"号填列)	-	-
5.其他收入(损失以"-"号填列)	1,328,293.52	911,664.81
减:二.费用	11,823,257.93	7,594,906.53
1.管理人报酬	8,905,866.07	6,305,915.52
2.托管费	1,484,311.05	1,050,985.87
3.销售服务费	-	-
4.交易费用	1,001,389.64	6,674.57
5.利息支出	-	-
其中:卖出回购金融资产支出	-	-
6.其他费用	431,691.17	231,330.57
三.利润总额(亏损总额以"-"号填列)	-4,044,727.35	-2,793,601.97
减:所得税费用	-	-
四.净利润(净亏损以"-"号填列)	-4,044,727.35	-2,793,601.97

7.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体:大成景恒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)	889,849,565.84	-2,438,722.41	887,410,843.43
二.本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	-4,044,727.35	-4,044,727.35
三.本期基金份额交易产生的基金净值变动数	-300,001,559.79	-743,531.19	-300,745,090.98
(净值减少以"-"号填列)			
其中:1.基金申购款	1,826,502.29	2,364.23	1,828,866.52
2.基金赎回款	-301,828,062.08	-745,895.42	-302,573,957.50
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)	589,848,006.05	-7,226,980.95	582,621,025.10
项目	上年度可比期间 2012年6月15日(基金合同生效日)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)	1,071,726,792.02	-	1,071,726,792.02
二.本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	-2,793,601.97	-2,793,601.97
三.本期基金份额交易产生的基金净值变动数	-181,877,226.18	354,879.56	-181,522,346.62
(净值减少以"-"号填列)			
其中:1.基金申购款	813,766.77	-3,441.62	810,325.15
2.基金赎回款	-182,690,992.95	358,321.18	-182,332,671.77
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)	889,849,565.84	-2,438,722.41	887,410,843.43

报表附注为财务报表的组成部分。
本报告于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

1.印花税

经国务院批准,财政部、国家税务总局研究决定,自2008年4月24日起,调整证券(股票)交易印花税税率,由原先的3%调整为1%;

经国务院批准,财政部、国家税务总局研究决定,自2008年9月19日起,调整由出让方按证券(股票)交易印花税税率缴纳印花税,受让方不再征收,税率不变;

根据财政部、国家税务总局财税字[2005]103号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》的规定,股权分置改革过程中因非流通股股东向流通股股东支付对价而发生的股权转让,暂免征收印花税。

2.营业税、企业所得税

根据财政部、国家税务总局财税字[2004]78号文《关于证券投资基金税收政策的通知》的规定,自2004年1月1日起,对证券投资基金(封闭式证券投资基金,开放式证券投资基金)管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入,继续免征营业税和企业所得税;

根据财政部、国家税务总局财税字[2005]103号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》的规定,股权分置改革中非流通股股东通过对价方式向流通股股东支付的股份、现金等收入,暂免征收流通股股东应缴纳的企业所得税;

根据财政部、国家税务总局财税[2008]1号文《关于企业所得税若干优惠政策的通知》的规定,对证券投资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.个人所得税

根据财政部、国家税务总局财税字[2002]128号文《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》的规定,对基金取得的股票的股息、红利收入、债券的利息收入及储蓄利息收入,由上市公司、债券发行企业及金融机构在向基金派发股息、红利收入、债券的利息收入及储蓄利息收入时代扣代缴20%的个人所得税;

根据财政部、国家税务总局财税[2008]132号《财政部国家税务总局关于储蓄存款利息所得有关个人所得税政策的通知》,自2008年10月9日起暂免征收储蓄存款利息所得个人所得税;

根据财政部、国家税务总局财税字[2005]107号文《关于股息红利有关个人所得税政策的补充通知》的规定,自2005年6月13日起,对证券投资基金从上市公司分配取得的股息红利所得,按照财税[2005]102号文规定,扣缴义务人在代扣代缴个人所得税时,减按50%计算应纳税所得额;

根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2012]85号文《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》的规定,自2013年1月1日起,个人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。上述所得统一适用20%的税率计征个人所得税;

根据财政部、国家税务总局财税字[2005]103号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》的规定,股权分置改革中非流通股股东通过对价方式向流通股股东支付的股份、现金等收入,暂免征收流通股股东应缴纳的个人所得税。

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	基金管理人的子公司
大成创新资本管理有限公司	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.以下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 成交金额	占当期股票成交总额的比例	上年度可比期间 2012年6月15日(基金合同生效日)至2012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	227,843,473.73	34.02%	-	0.00%

债券交易

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 成交金额	占当期债券成交总额的比例	上年度可比期间 2012年6月15日(基金合同生效日)至2012年12月31日 成交金额	占当期债券成交总额的比例
光大证券	698,009,995.78	65.95%	-	0.00%

债券回购交易

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 回购成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	上年度可比期间 2012年6月15日(基金合同生效日)至2012年12月31日 回购成交金额	占当期债券回购成交总额的比例
光大证券	2,885,000,000.00	69.42%	-	0.00%

7.4.4.1.2 权证交易

本期及上年度可比期间无关联方权证交易。

7.4.4.1.3 应支付关联方的佣金

金额单位:人民币元

关联方名称	本期 2013年1月1日至2013年12月31日 当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例
光大证券	205,319.18	34.12%	23,921.40	7.62%
关联方名称	上年度可比期间 2012年6月15日(基金合同生效日)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
-	-	0	-	0

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6月15日(基金合同生效日)至2012年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	8,905,866.07	6,305,915.52
其中:支付销售机构的客户维护费	3,658,709.24	2,591,158.65

注:1)基金管理费按前一日的基金资产净值的1.20%的年费率计提。计算方法如下:
H=E×1.20%/当年天数
H为每日应计提的基金管理费
E为前一日基金资产净值
基金管理费每日计提,按月支付。经基金管理人与基金托管人核对一致后,由基金托管人于次月首日起3个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。保本周期内,本基金的担保费用从基金管理人的管理费收入中列支,由基金管理人支付给担保人。
2)基金管理费于2013年末尚未支付的金额为人民币601,774.79元,基金管理费于2012年末尚未支付的金额为人民币916,326.72元。

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6月15日(基金合同生效日)至2012年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	1,484,311.05	1,050,985.87

注:1)基金托管人的基金托管费按基金财产净值的0.20%年费率计提。计算方法如下:
H=E×0.20%/当年天数
H为每日应计提的基金托管费
E为前一日的基金财产净值
基金托管费每日计提,按月支付。经基金管理人与基金托管人核对一致后,由基金托管人于次月首日起3个工作日内从基金财产中一次性支付给基金托管人。
2)基金托管费于2013年末尚未支付的金额为人民币100,295.81元,基金托管费于2012年末尚未支付的金额为人民币152,721.12元。

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

本基金本期及上年度可比期间未与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。

7.4.4.4 各关联方投资本基金的情况

7.4.4.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

本基金的管理人于本报告期及上年度可比期间未运用固有资金投资本基金。

7.4.4.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

本基金除基金管理人之外的其他关联方于本报告期及上年度可比期间未持有本基金份额。

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	本期 2013年1月1日至2013年12月31日 期末余额	当期利息收入	上年度可比期间 2012年6月15日(基金合同生效日)至2012年12月31日 期末余额	当期利息收入
名称 中国银行	51,338,954.94	296,765.36	44,963,254.68	464,088.98

注:本基金的银行存款由基金托管人中国银行保管,按银行间业利率计息。

7.4.4.6 本基金在期间内参与关联方承销证券的情况

本基金于本报告期及上年度可比期间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

本基金本期及上年度可比期间无其他关联交易事项。

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

本基金本报告期末未持有因认购新发/增发证券而于年末流通受限证券。

7.4.5.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金本报告期末未持有暂时停牌等流通受限的股票。

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,本基金未持有从事银行间市场债券正回购交易中作为抵押的债券。

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,本基金未持有从事