景福证券投资基金

【2012】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：2013年3月26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2013年3月22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有限公司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2012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	2012年	2011年	2010年
本期已实现收益	-415,582,016.40	238,357,272.21	580,918,316.81
本期利润	105,679,114.42	-1,141,816,936.45	777,371,186.49
加权平均基金份额本期利润	0.0352	-0.3806	0.2591
本期基金份额净值增长率	3.91%	-29.78%	20.32%
3.1.2 期末数据和指标	2012年末	2011年末	2010年末
期末可供分配基金份额利润	-0.0641	-0.0993	0.2350
期末基金资产净值	2,807,649,759.51	2,701,970,645.09	4,503,787,581.54
期末基金份额净值	0.9359	0.9007	1.5013

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。

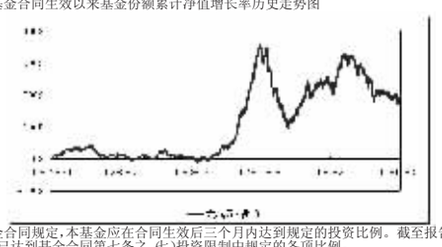
2、所述基金业绩指标不包括持有人交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

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

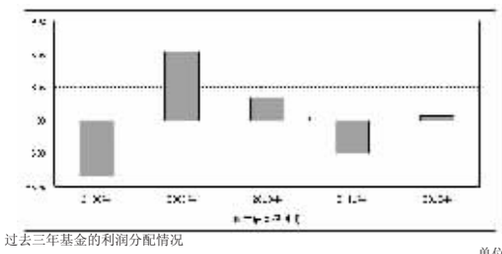
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	2.88%	2.51%	-	-	-	-
过去六个月	-0.54%	2.81%	-	-	-	-
过去一年	3.91%	2.46%	-	-	-	-
过去三年	-12.21%	2.58%	-	-	-	-
过去五年	-29.73%	3.10%	-	-	-	-
自基金合同生效起至今	202.58%	2.75%	-	-	-	-

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
2012	-	-	-	-	
2011	2.2000	660,000,000.00	-	660,000,000.00	2010年度收益分配
2010	3.8000	1,140,000,000.00	-	1,140,000,000.00	2009年度收益分配
合计	6.0000	1,800,000,000.00	-	1,800,000,000.00	

§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字〔999〕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2012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，2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，1只创新型基金：大成景丰分级债券型证券投资基金，1只QDII基金：大成标普500等权重指数基金及25只开放式证券投资基金：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。

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
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。2008年8月23日开始担任景福证券投资基金基金经理。2011年6月14日开始兼任大成内需增长股票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	-	4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，资产管理人制订了《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》。资产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些组合间的成交价格差异较大，但参与交易所公开竞价同日同向交易成交较少的单边交易量均不超过该股当日成交量10%。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。

4.3.3 异常交易行为的专项说明

2012年基金管理人旗下主动投资组合股票交易存在6笔同日反向交易，原因是投资组合投资策略需要，且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均不超过该股当日成交量5%。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%的情况有9次，原因是指数型投资组合投资策略需要。投资组合间债券交易存在4笔同日反向交易，原因是投资组合投资策略需要，且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均不超过该股当日成交量5%。投资组合间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

2012年的市场经历了大幅震荡，最终在4季度否极泰来，12月份沪深300指数在大金融板块和房地产相关的权重板块带动下大涨，全年涨幅达到7.55%。

经济方面，1-8月份各项经济数据显示经济增速下行，但从9月份开始，在基建投资的带动下，各项经济数据开始企稳，随后房地产和汽车的销售逐步走出低谷，CPI企稳。美国政府继续通过QE政策来刺激需求，其经济全年表现较好，股市也表现良好。欧债危机经过一年多的折腾，警报暂时解除，但经济状况迟迟不见起色。

影响中国资本市场的另外一件大事是2012年四季度召开的中国共产党十八次全国代表大会，会议选举出了新一届的领导人，对未来十年的中国政治经济走向具有重要意义。从市场反馈的情况看，对未来十年的政治经济体质改革，对新型城镇化的发展，目前都持较为乐观的态度。

全年货币投放的节奏较为均衡，但是社会融资总量超出了市场预期。12年年初对房地产信托到期兑付以及地方政府融资平台偿债能力的担忧，随着经济的企稳回升和银行地方融资平台贷款的展期得到消除。四季度政府加大了对基建投资的力度，目前看来是四季度经济企稳回升的主要原因。

本基金在2012年全年重点配置了食品饮料、医药生物、电子元器件和非银行金融板块。阶段性的持有了汽车、建材、工程机械等周期性板块。

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0.9359元，本报告期基金份额净值增长率为3.91%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

2012年四季度经济底部企稳的态势已经明确，本轮由基建投资带动的补库存，进而刺激经济复苏的预期已经部分反映到周期股的涨幅中去。目前需要密切关注2013年两会后中国经济政策的动向。总体来看，对2013年的市场，我们比2012年要乐观，一方面，经济企稳后企业盈利增速将会逐步回升，另外一方面，新的政府领导人上台后带来的改革红利也值得期待。

与此同时，我们对一些隐含的风险因素也会紧密跟踪。日本政府重启"印钞机"可能引发新一轮通胀威胁全球经济复苏，美国的"财政悬崖"问题在中长期还可能对经济构成威胁，"欧债危机"在2013年有可能继续发酵。

2013年的配置有两条主线，一是关注民生，我们预判这是新一届政府将要重点关注和加大投入的领域，二是资源价格改革，这是经济结构转型，提高经济运行效率的必要手段。本基金将保持一贯的自下而上选择成长个股进行长期投资的风格。

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，由估值委员会讨论设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2012年1月1日至2012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、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，景福证券投资基金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、利润分配情况、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2012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：2012年12月31日

单位：人民币元

资产	本期末 2012年12月31日	上年度末 2011年12月31日
资产：		
银行存款	123,140,615.99	118,333,950.03
结算备付金	2,444,418.45	2,926,666.42
存出保证金	1,000,000.00	1,160,000.00
交易性金融资产	2,665,259,916.89	2,585,747,113.98
其中：股票投资	2,098,743,465.99	2,032,304,360.38
基金投资	-	-
债券投资	566,516,450.90	553,442,753.60
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	11,151,988.04	6,253,249.83
应收利息	11,276,256.63	10,707,991.70
应收股利	-	-
应收申购款	-	-
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	-
资产总计	2,814,273,196.00	2,725,128,971.96
负债和所有者权益	本期末 2012年12月31日	上年度末 2011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	-	9,539,494.29
应付赎回款	-	-
应付管理人报酬	2,797,681.08	3,066,283.27
应付托管费	559,536.24	613,256.66
应付销售服务费	-	-
应付交易费用	1,814,510.79	1,462,584.27
应交税费	-	-
应付利息	-	-
应付利润	-	6,825,000.00
递延所得税负债	-	-
其他负债	1,451,708.38	1,651,708.38
负债合计	6,623,436.49	23,158,326.87
所有者权益：		
实收基金	3,000,000,000.00	3,000,000,000.00
未分配利润	-192,350,240.49	-298,029,354.91
所有者权益合计	2,807,649,759.51	2,701,970,645.09
负债和所有者权益总计	2,814,273,196.00	2,725,128,971.96

注：报告截止日2012年12月31日，基金份额净值0.9359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：2012年1月1日至2012年12月31日

单位：人民币元

项 目	本期 2012年1月1日至2012年12月31日	上年度可比期间 2011年1月1日至2011年12月31日
一、收入	157,206,889.00	-1,068,673,926.79
1.利息收入	22,934,014.19	27,106,594.31
其中：存款利息收入	492,224.73	576,354.69
债券利息收入	22,441,789.46	26,530,239.62
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）	-386,988,256.01	284,388,687.56
其中：股票投资收益	-423,032,655.76	262,487,184.06
基金投资收益	-	-
债券投资收益	-1,442,232.20	-6,691,016.28
资产支持证券投资收益	-	-
衍生工具收益	-	-
股利收益	37,486,631.95	28,592,519.78
3.公允价值变动收益（损失以"-"号填列）	521,261,130.82	-1,380,174,208.66
4.汇兑收益（损失以"-"号填列）	-	-
5.其他收入（损失以"-"号填列）	-	5,000.00
减：二、费用	51,527,774.58	73,143,009.66
1.管理人报酬	34,547,875.94	45,043,375.16
2.托管费	6,909,575.06	9,008,674.98
3.销售服务费	-	-
4.交易费用	9,351,551.79	16,077,864.86
5.利息支出	236,241.59	545,583.94
其中：卖出回购金融资产支出	236,241.59	545,583.94
6.其他费用	482,530.20	2,467,510.72
三、利润总额（亏损总额以"-"号填列）	105,679,114.42	-1,141,816,936.45
减：所得税费用	-	-
四、净利润（净亏损以"-"号填列）	105,679,114.42	-1,141,816,936.45

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：2012年1月1日至2012年12月31日

单位：人民币元

项目	本期 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
项目	上年度可比期间 2011年1月1日至2011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	1,503,787,581.54	4,503,787,581.54
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-1,141,816,936.45	-1,141,816,936.45
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）	-	-660,000,000.00	-660,000,000.00
五、期末所有者权益（基金净值）	3,000,000,000.00	-298,029,354.91	2,701,970,645.09

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：

基金管理公司负责人：王颖　　主管会计工作负责人：刘彩晖　　会计机构负责人：范瑛

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 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

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。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。

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

关联方名称	本期 2012年1月1日至2012年12月31日		上年度可比期间 2011年1月1日至2011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	783,858,104.92	12.79%	756,410,448.32	7.22%

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 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%
关联方名称	上年度可比期间 2011年1月1日至2011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	642,946.16	7.38%	-	0.00%

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 2012年1月1日至2012年12月31日	上年度可比期间 2011年1月1日至2011年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	34,547,875.94	45,043,375.16
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。

7.4.3.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2012年1月1日至2012年12月31日	上年度可比期间 2011年1月1日至2011年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	6,909,575.06	9,008,674.98

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。

7.4.3.3 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 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
-	-	-	-	-	-	-
上年度可比期间 2011年1月1日至2011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	20,559,594.52	10,265,097.12	-	-	-	-

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 2012年1月1日至2012年12月31日	上年度可比期间 2011年1月1日至2011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%

7.4.3.4.2 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 2012年12月31日		上年度末 2011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%

7.4.3.5 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 2012年1月1日至2012年12月31日		上年度可比期间 2011年1月1日至2011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	123,140,615.99	451,629.02	118,333,950.03	500,515.43

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。

7.4.3.6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

本基金应付利润中应付关联方余额列示如下：

金额单位：人民币元

项目	本期末 2012年12月31日	上年度末 2011年12月31日
广东证券	-	6,825,000.00
合计	-	6,825,000.00

7.4.4 期末（2012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

金额单位：人民币元

7.4.4.1.1 受限证券类别：股票

证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量（单位：股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
000686	东北证券	2012/8/31	2013/9/3	非公开发行	11.79	13.46	3,000,000	35,370,000.00	40,380,000.00	-
000826	桑德环境	2012/12/31	2013/1/9	配股申购	12.71	22.99	629,987	8,007,134.77	14,483,401.13	-

注：基金可作为特定投资者，认购由中国证监会《上市公司证券发行管理办法》规范的非公开发行股票，所认购的股票自发行结束之日起12个月内不得转让。

7.4.4.2 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
000527	美的电器	2012/8/27	重大事项	9.69	-	-	11,737,597.00	135,022,189.60	113,737,314.93	-

注：本基金截至2012年12月31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，本基金无从事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	2,098,743,465.99	74.57
	其中：股票	2,098,743,465.99	74.57
2	固定收益投资	566,516,450.90	20.13
	其中：债券	566,516,450.90	20.13
	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	125,585,034.44	4.46
6	其他各项资产	23,428,244.67	0.83
7	合计	2,814,273,196.00	100.00

8.2 期末按行业分类的股票投资组合

8.2.1 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	采掘业	-	0.00
C	制造业	589,084,264.36	20.98
C0	食品、饮料	235,481,898.80	8.39
C1	纺织、服装、皮毛	-	0.00
C2	木材、家具	-	0.00
C3	造纸、印刷	-	0.00
C4	石油、化学、塑胶、塑料	-	0.00
C5	电子	114,907,444.56	4.09
C6	金属、非金属	-	0.00
C7	机械、设备、仪表	52,950,000.00	1.89
C8	医药、生物制品	185,744,921.00	6.62
C99	其他制造业	-	0.00
D	电力、煤气及水的生产和供应业	-	0.00
E	建筑业	36,960,000.00	1.32
F	交通运输、仓储业	-	0.00
G	信息技术业	-	0.00
H	批发和零售贸易	-	0.00
I	金融、保险业	481,967,788.25	17.17
J	房地产业	72,389,108.46	2.58
K	社会服务业	-	0.00
L	传播与文化产业	-	0.00
M	综合类	-	0.00
	合计	1,180,401,161.07	42.04

8.2.2 期末积极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	14,639,692.56	0.52
B	采掘业	-	0.00
C	制造业	586,240,147