（上接B346版）

折算引起的实收基金份额变动于基金份额折分日根据折算前的基金份额数及确定的折算比例计算认列。由于申购和赎回引起的实收基金变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日认列。

6.4.4.8 损益平准金

损益平准金包括已实现平准金和未实现平准金。已实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现损益占基金净值比例计算的金额。未实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未实现损益占基金净值比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日认列，并于期末全额转入未分配利润/(累计亏损)。

6.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

股票投资在持有期间应取得的现金股利扣除由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额确认为投资收益。债券投资在持有期间应取得的按票面利率或者发行价计算的利息扣除在适用情况下由债券发行企业代扣代缴的个人所得税后的净额确认为利息收入。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在持有期间的公允价值变动确认为公允价值变动损益；于处置时，其处置价格与初始确认金额之间的差额确认为投资收益，其中包括从公允价值变动损益结转的公允价值累计变动额。

应收款项在持有期间确认的利息收入按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

6.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬和托管费在费用涵盖期间按基金合同约定的费率和计算方法逐日确认。

其他金融负债在持有期间确认的利息支出按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

6.4.4.11 基金的收益分配政策

每一基金份额享有同等分配权。本基金收益以现金形式分配，其中场外基金份额持有人可选择现金红利或将现金红利按分红除权日的基金份额净值自动转为基金份额进行再投资，场内基金份额持有人只能选择现金分红。若期末未分配利润中的未实现部分为正数，包括基金经营活动产生的未实现损益以及基金份额交易产生的未实现平准金等，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润中的已实现部分；若期末未分配利润的未实现部分为负数，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润，即已实现部分相抵未实现部分后的余额。

经宣告的拟分配基金收益于分红除权日从所有者权益转出。

6.4.4.12 分部报告

本基金以内部组织结构、管理要求、内部报告制度为依据确定经营分部，以经营分部为基础确定报告分部并披露分部信息。经营分部是指本基金内同时满足下列条件的组成部分：(1) 该组成部分能够在日常活动中产生收入、发生费用；(2) 本基金的基金管理人能够定期评价该组成部分的经营成果，以决定向其配置资源、评价其业绩；(3) 本基金能够取得该组成部分的财务状况、经营成果和现金流量等有关会计信息。如果两个或多个经营分部具有相似的经济特征，并且满足一定条件的，则合并为一个经营分部。

本基金目前以一个单一的经营分部运作，不需要披露分部信息。

6.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计

根据本基金的估值原则和中国证监会允许的基金行业估值实务操作，本基金确定以下类别债券投资的公允价值时采用的估值方法及其关键假设如下：

(1) 对于证券交易所上市的债券，若出现交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)等情况，本基金根据中国证监会公告[2008]38号《关于进一步规范证券投资基金估值业务的指导意见》，根据具体情况采用现金流量折现法等估值技术进行估值。

(2) 在银行间同业市场交易的债券品种，根据中国证监会证监会计字[2007]21号《关于证券投资基金执行<企业会计准则>估值业务及份额净值计价有关事项的通知》采用估值技术确定公允价值。本基金持有的银行间同业市场债券按现金流量折现法估值，具体估值模型、参数及结果由中央国债登记结算有限责任公司独立提供。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期未发生会计政策变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

6.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[1998]55号《关于证券投资基金税收问题的通知》、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。

6.4.7 关联方关系

6.4.7.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

本基金本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

6.4.7.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

| 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、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") | 基金发起人、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、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。

6.4.8 本报告期间的关联方交易

6.4.8.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.8.1.1 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6月30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 | 1.08% |

6.4.8.1.2 权证交易

无。

6.4.8.1.3 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6月30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 | 1.07% | 11,256.39 | 0.87% | |
| | | | | | |

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。

6.4.8.2 关联方报酬

6.4.8.2.1 基金管理费

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2014年4月10日至2014年6月30日 |
|---|---|
| 当期应支付的管理费 | 3,966,386.83 |
| 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1.5%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。

6.4.8.2.2 基金托管费

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2014年4月10日至2014年6月30日 |
|---|---|
| 当期应支付的托管费 | 661,064.52 |

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。

6.4.8.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

无。

6.4.8.4 各关联方投资本基金的情况

6.4.8.4.1 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6月30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 |
| 期初持有的基金份额 | - |
| 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 | 1.49% |

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。

6.4.8.4.2 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6月30日 | |
|---|---|---|
| | 持有的基金份额 | 持有的基金份额占基金总份额的比例 |
| 光大证券股份有限公司 | 6,000,000.00 | 0.75% |
| 广东证券股份有限公司 | 6,000,000.00 | 0.75% |

注：1、本基金除管理人之外的其他关联方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。

2、本报告期间除基金管理人之外的其他关联方无交易本基金的情况。

6.4.8.5 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6月30日 | |
|---|---|---|
| | 期末余额 | 当期利息收入 |
| 中国银行 | 87,828,926.46 | 515,102.38 |

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。

6.4.8.6 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。

6.4.8.7 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期无须说明的其他关联交易事项。

6.4.9 期末(2014年6月30日)本基金持有的流通受限证券

6.4.9.1 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。

6.4.9.2 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 |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| 300284 | 苏交科 | 2014年6月25日 | 重大事项停牌 | 8.75 | 2014年7月4日 | 9.18 | 2,241,574 | 16,216,191.53 | 19,613,772.50 | - |

6.4.9.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.9.3.1 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。

6.4.9.3.2 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 投资组合报告(转型前)

7.1 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 |

7.2 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(元) | 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 | 32,262,557.36 | 1.79 |
| S | 综合 | - | 0.00 |
| | 合计 | 1,368,753,484.14 | 75.98 |

7.3 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 | 002081 | 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。1.1.1 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。

7.4.3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。

7.5 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 |

7.6 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 |

7.7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。

7.8 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。

7.9 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。

7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

7.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未投资股指期货。

7.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期末未投资股指期货。

7.11报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.11.1 本期国债期货投资政策

本基金本报告期末未投资国债期货。

7.11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未投资国债期货。

7.11.3 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末未投资国债期货。

7.12投资组合报告附注

7.12.1 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分析，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。

7.12.2 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。

7.12.3 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 |

7.12.4 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。

7.12.5 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) | 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 |

1.9.6 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。

## §7 投资组合报告(转型后)

7.1 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 | 634,739,947.80 | 85.23 |
| | 其中：股票 | 634,739,947.80 | 85.23 |
| 2 | 固定收益投资 | 7,172,382.00 | 0.96 |
| | 其中：债券 | 7,172,382.00 | 0.96 |
| | 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 | 88,676,549.73 | 11.91 |
| 7 | 其他资产 | 14,157,872.96 | 1.90 |
| 8 | 合计 | 744,746,752.49 | 100.00 |

7.2 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(元) | 占基金资产净值比例(%) |
|---|---|---|---|
| A | 农,林,牧,渔业 | 9,378,600.00 | 1.28 |
| B | 采矿业 | - | 0.00 |
| C | 制造业 | 410,365,144.96 | 55.96 |
| 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 | 78,343,094.84 | 10.68 |
| J | 金融业 | 36,784,180.76 | 5.02 |
| K | 房地产业 | 51,539,107.19 | 7.03 |
| L | 租赁和商务服务业 | - | 0.00 |
| M | 科学研究和技术服务业 | 19,613,772.50 | 2.67 |
| N | 水利,环境和公共设施管理业 | 19,818,483.75 | 2.70 |
| 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 | 8,897,563.80 | 1.21 |
| S | 综合 | - | 0.00 |
| | 合计 | 634,739,947.80 | 86.56 |

7.3 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 | 000625 | 长安汽车 | 2,692,567 | 33,145,499.77 | 4.52 |
| 2 | 300124 | 汇川技术 | 946,715 | 29,537,508.00 | 4.03 |
| 3 | 002475 | 立讯精密 | 801,626 | 26,277,300.28 | 3.58 |
| 4 | 002415 | 海康威视 | 1,503,375 | 25,467,172.50 | 3.47 |
| 5 | 002410 | 广联达 | 855,036 | 22,607,151.84 | 3.08 |
| 6 | 000400 | 许继电气 | 1,076,523 | 21,584,286.15 | 2.94 |
| 7 | 600340 | 华夏幸福 | 833,074 | 20,968,472.58 | 2.86 |
| 8 | 600872 | 中炬高新 | 1,957,264 | 20,884,006.88 | 2.85 |
| 9 | 002185 | 华天科技 | 1,809,800 | 20,233,564.00 | 2.76 |
| 10 | 300070 | 碧水源 | 677,555 | 19,818,483.75 | 2.70 |

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)的半年度报告正文。

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 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 | 601166 | 兴业银行 | 30,571,291.35 | 4.17 |
| 2 | 300070 | 碧水源 | 24,325,112.54 | 3.32 |
| 3 | 002415 | 海康威视 | 20,701,571.85 | 2.82 |
| 4 | 002174 | 游族网络 | 18,278,188.69 | 2.49 |
| 5 | 002146 | 荣盛发展 | 15,861,904.50 | 2.16 |
| 6 | 600048 | 保利地产 | 15,079,275.90 | 2.06 |
| 7 | 000400 | 许继电气 | 14,551,588.86 | 1.98 |
| 8 | 002410 | 广联达 | 12,313,949.58 | 1.68 |
| 9 | 300124 | 汇川技术 | 10,274,286.76 | 1.40 |
| 10 | 002041 | 登海种业 | 9,845,203.56 | 1.34 |
| 11 | 300011 | 鼎汉技术 | 8,441,462.75 | 1.15 |
| 12 | 600109 | 国金证券 | 8,101,910.50 | 1.10 |
| 13 | 600597 | 光明乳业 | 8,006,884.13 | 1.09 |
| 14 | 601222 | 林洋电子 | 7,892,988.04 | 1.08 |
| 15 | 600340 | 华夏幸福 | 7,640,979.29 | 1.04 |
| 16 | 300104 | 乐视网 | 5,811,627.41 | 0.79 |
| 17 | 300115 | 长盈精密 | 5,275,538.23 | 0.72 |
| 18 | 300037 | 新宙邦 | 4,594,014.56 | 0.63 |
| 19 | 002353 | 杰瑞股份 | 3,994,986.01 | 0.54 |
| 20 | 000625 | 长安汽车 | 2,391,697.48 | 0.33 |

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。

7.4.2 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 | 46,469,088.84 | 6.34 |
| 2 | 002008 | 大族激光 | 41,931,764.95 | 5.72 |
| 3 | 002475 | 立讯精密 | 37,120,527.28 | 5.06 |
| 4 | 000826 | 桑德环境 | 30,204,283.49 | 4.12 |
| 5 | 600588 | 用友软件 | 30,134,378.72 | 4.11 |
| 6 | 002570 | 贝因美 | 28,834,166.37 | 3.93 |
| 7 | 000581 | 威孚高科 | 28,611,562.59 | 3.90 |
| 8 | 300133 | 华策影视 | 27,847,167.21 | 3.80 |
| 9 | 601515 | 东风股份 | 26,061,785.34 | 3.55 |
| 10 | 300037 | 新宙邦 | 25,774,206.46 | 3.51 |
| 11 | 002415 | 海康威视 | 25,475,075.98 | 3.47 |
| 12 | 300273 | 和佳股份 | 25,339,373.53 | 3.46 |
| 13 | 002230 | 科大讯飞 | 24,387,011.69 | 3.33 |
| 14 | 600703 | 三安光电 | 24,003,333.11 | 3.27 |
| 15 | 002065 | 东华软件 | 23,656,262.22 | 3.23 |
| 16 | 600089 | 特变电工 | 23,032,864.41 | 3.14 |
| 17 | 000625 | 长安汽车 | 22,877,951.22 | 3.12 |
| 18 | 000413 | 东旭光电 | 21,949,524.22 | 2.99 |
| 19 | 600406 | 国电南瑞 | 21,633,620.86 | 2.95 |
| 20 | 300146 | 汤臣倍健 | 21,566,338.85 | 2.94 |
| 21 | 600804 | 鹏博士 | 21,484,060.99 | 2.93 |
| 22 | 600340 | 华夏幸福 | 20,142,749.57 | 2.75 |
| 23 | 601166 | 兴业银行 | 19,763,608.60 | 2.70 |
| 24 | 600741 | 华域汽车 | 19,557,066.23 | 2.67 |
| 25 | 600309 | 万华化学 | 19,479,830.67 | 2.66 |
| 26 | 300024 | 机器人 | 18,310,383.72 | 2.50 |
| 27 | 002410 | 广联达 | 18,094,276.24 | 2.47 |
| 28 | 600196 | 复星医药 | 17,754,736.06 | 2.42 |
| 29 | 002353 | 杰瑞股份 | 17,153,991.12 | 2.34 |
| 30 | 300315 | 掌趣科技 | 16,888,481.22 | 2.30 |
| 31 | 300284 | 苏交科 | 16,873,701.50 | 2.30 |

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。

7.4.3 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 | 236,844,742.99 |
| 卖出股票收入(成交)总额 | 939,722,344.37 |

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。

7.5 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 | 7,172,382.00 | 0.98 |
| 2 | 央行票据 | - | 0.00 |
| 3 | 金融债券 | - | 0.00 |
| | 其中：政策性金融债 | - | 0.00 |
| 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 | 7,172,382.00 | 0.98 |

7.6 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 | 010107 | 21国债(7) | 70,070 | 7,063,056.00 | 0.96 |
| 2 | 010213 | 02国债(13) | 1,140 | 109,326.00 | 0.01 |

7.7 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。

7.8 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。

7.9 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。

7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

7.10.1 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。

7.10.2 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。

7.11报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.11.1 本期国债期货投资政策

本基金本报告期末投资国债期货。

7.11.2 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。

7.11.3 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末投资国债期货。

7.12投资组合报告附注

7.12.1 本基金投资的前十名证券的发行主体未出现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。

7.12.2 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。

7.12.3 其他资产构成

单位：人民币元

| 序号 | 名称 | 金额 |
|---|---|---|
| 1 | 存出保证金 | 487,525.24 |
| 2 | 应收证券清算款 | 13,530,517.38 |
| 3 | 应收股利 | - |
| 4 | 应收利息 | 139,830.34 |
| 5 | 应收申购款 | - |
| 6 | 其他应收款 | - |
| 7 | 待摊费用 | - |
| 8 | 其他 | - |
| 9 | 合计 | 14,157,872.96 |

7.12.4 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。

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

7.12.6 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 基金份额持有人信息(转型前)

8.1 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。

8.2 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 | 