大成价值增长证券投资基金

2014 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:2015年3月28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2015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2014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	大成价值增长混合
基金主代码	090001
前端交易代码	090001
后端交易代码	091001
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2002年11月11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	8,176,803,559.38份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	以价值增长类股票为主构造投资组合,在有效分散投资风险的基础上,通过资产配置和投资组合的动态调整,达到超过市场的风险收益比之目标,实现基金资产的长期稳定增值。
投资策略	本基金投资策略分三个层次:资产配置和行业配置遵循自上而下的积极策略,个股选择遵循自下而上的积极策略。本基金的股票投资重点关注:低P/B值、具有可持续增长潜力、盈利水平超过行业平均水平、具有核心竞争力的优势企业。
业绩比较基准	沪深300指数×80%+中信标普国债指数×20%。

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	林葛
	联系电话	0755-83183388	010-66060069
	电子邮箱	dupeng@dcfund.com.cn	tgxxpl@abchina.com
客户服务电话		4008885558	95599
传真		0755-83199588	010-68121816

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	2014年	2013年	2012年
本期已实现收益	830,326,713.71	596,276,636.57	-1,627,181,979.83
本期利润	1,839,440,773.24	89,695,047.22	94,539,896.65
加权平均基金份额本期利润	0.1978	0.0081	0.0080
本期基金份额净值增长率	31.42%	1.16%	1.13%
3.1.2 期末数据和指标	2014年末	2013年末	2012年末
期末可供分配基金份额利润	-0.1169	-0.3201	-0.3279
期末基金资产净值	7,306,254,492.32	6,971,125,177.11	7,768,911,509.27
期末基金份额净值	0.8935	0.6799	0.6721

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。

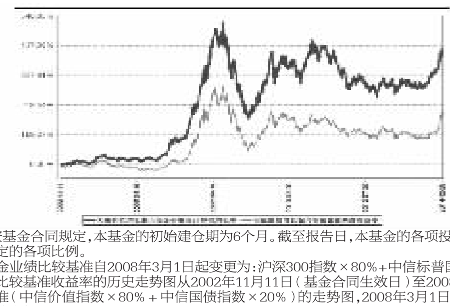
2、所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用,计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

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	18.33%	1.17%	34.71%	1.32%	-16.38%	-0.15%
过去六个月	31.86%	0.94%	49.14%	1.06%	-17.28%	-0.12%
过去一年	31.42%	0.90%	41.58%	0.97%	-10.16%	-0.07%
过去三年	34.44%	1.04%	42.98%	1.04%	-8.54%	0.00%
过去五年	5.86%	1.10%	4.37%	1.09%	1.49%	0.01%
自基金合同生效起至今	424.93%	1.28%	197.85%	1.39%	227.08%	-0.11%

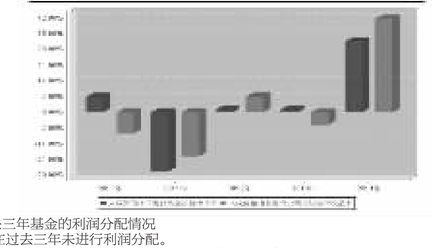
3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较



注:1、按基金合同规定,本基金的初始建仓期为6个月。截至报告日,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。

2、本基金业绩比较基准自2008年3月1日起变更为:沪深300指数×80%+中信标普国债指数×20%,本基金业绩比较基准收益率的历史走势图从2002年11月11日(基金合同生效日)至2008年2月29日为原业绩比较基准(中信价值指数×80%+中信国债指数×20%)的走势图,2008年3月1日起为变更后的业绩比较基准的走势图。

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

本基金在过去三年未进行利润分配。

§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2014年12月31日,本基金管理人共管理4只ETF及1只ETF联接基金:大成中证100交易型开放式指数证券投资基金、深证成长40交易型开放式指数证券投资基金及大成深证成长40交易型开放式指数证券投资基金联接基金、中证500深市交易型开放式指数证券投资基金、中证500沪市交易型开放式指数证券投资基金,2只QDII基金:大成标普500等权重指数证券投资基金、大成纳斯达克100指数证券投资基金及40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、大成竞争优势股票型证券投资基金、大成景恒保本混合型证券投资基金、大成内需增长股票型证券投资基金、大成可转债增强债券型证券投资基金、大成消费主题股票型证券投资基金、大成新锐产业股票型证券投资基金、大成优选股票型证券投资基金(LOF)、大成月添利理财债券型证券投资基金、大成现金增利货币市场证券投资基金、大成月月盈短期理财债券型证券投资基金、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、大成景祥分级债券型证券投资基金、大成信用增利一年定期开放债券型证券投资基金、大成健康产业股票型证券投资基金、大成中小盘股票型证券投资基金(LOF)、大成灵活配置混合型证券投资基金、大成丰财宝货币市场基金、大成景益平稳收益混合型证券投资基金、大成添利宝货币市场基金、大成景利混合型证券投资基金和大成产业升级股票型证券投资基金(LOF)。

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		
汤义峰先生	本基金基金经理,数量投资部总监	2013年3月8日	-	8年	中国科学院管理学博士。曾就职于博时基金管理有限公司,历任金融工程师、股票投资部数量化研究员、数量化研究员兼任博时特许价值股票型证券投资基金及裕泽证券投资基金的基金经理助理。2010年3月12日至2012年6月11日曾任博时裕富沪深300指数证券投资基金基金经理及博时特许价值股票型证券投资基金基金经理。2012年11月26日起任大成优选股票型证券投资基金(LOF)基金经理,2013年3月8日起担任大成价值增长证券投资基金基金经理,现同时担任大成基金管理有限公司数量投资部总监。具有基金从业资格。国籍:中国
石国武先生	本基金基金经理	2013年4月18日	-	11年	工学硕士。2002年12月至2012年11月就职于博时基金管理有限公司,历任系统分析员、股票投资部投资经理助理,特定资产部投资经理。2012年11月加入大成基金管理有限公司。2013年4月18日起担任大成价值增长证券投资基金基金经理。2014年8月23日起任大成核心双动力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
夏高先生	本基金基金经理助理	2013年3月25日	-	3年	清华大学工学博士,2011年1月至2012年5月就职于博时基金管理有限公司股票投资部,2012年7月加入大成基金管理有限公司,历任数量投资部高级数量分析师及基金经理助理。2014年12月6日起任大成中证红利指数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。

3、本基金基金经理助理夏高先生于2015年1月14日离任,该事项已按法规要求及公司相关制度办理,变更流程合法合规。

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》、《大成价值增长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,本基金的投资范围、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。

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23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5笔,原因为投资策略需要;主动投资组合间债券交易存在2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

2014年,沪深300表现为51.66%,中证500表现为39%,创业板指表现为12.8%,在远离宏观成为投资者2013年的共识之后,以一带一路和金融股为代表的蓝筹股王者归来,A股市场的风格表现和2013年完全逆转。全年来看,宏观经济表现和投资者主流预期基本一致,继续延续区间震荡逐级下移的走势,货币当局的政策立场和操作发生明显变化,年初异常紧张的流动性持续宽松,其中,11月份的降息成为了引爆蓝筹股的导火索。中国经济新常态和全球利率新中性是对2014年中国和全球经济表现和金融市场走势贴切的阐述。

中国股票市场来看,伴随着中国新一轮改革的步伐,资本市场的制度建设明显加快,沪港通、指数期权、新三板以及注册制等已经或即将逐步推出,中国资本市场将日益向国际成熟资本市场靠拢。从投资者结构看,虽然散户依然占据成交的多数,但大小非股东、产业资本、保险、公募基金和海外资本慢慢走上舞台,市场博弈主体的多元化将为资本市场的投资带来新的挑战和机会。

2014年,大成价值增长基金秉持多策略优选个股的投资思路,在市场复杂的博弈格局中保持投资定力,业绩表现稳定良好,和基金经理构建组合的预期一致。

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0.8935元,本报告期份额净值增长率为31.42%,同期业绩比较基准增长率为41.58%,低于同期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2015年,宏观经济和政策方面预计和投资者预期差异不大,经济总体继续维持平稳偏弱的态势,政府将维持积极的财政政策和宽松的货币环境,宏观方面最大的挑战可能来自汇率,但考虑中国庞大的外汇储备、大宗商品价格下跌红利带来的巨大的经常性贸易顺差,我们预期出现黑天鹅的概率不高。政府的工作重心将立足于既定改革措施的持续出台和切实落地,我们期待新一轮的社会经济改革能改善中国社会和经济的中长期前景,为资本市场长期发展树立投资信心。由于互联网企业巨头的强势崛起带来极大的财富效应和社会效应,社会对创新尤其是TMT行业的热情持续升温,与政府培育新增长点的想法一致,将是弱势经济表现中的一抹亮色。

股票市场方面,基于宽松的政策环境、平稳的基本面、合理的估值水平和明显恢复的投资者信心,我们对资本市场总体表现相对乐观。投资策略上,我们将持续关注具备明显竞争优势和竞争能力持续提升的企业,积极发掘符合社会和经济发展新的需求趋势的行业和公司,其中,我们会重点关注国企改革和互联网企业的投资机会。

组合投资上,大成价值增长资产配置将保持积极态势,根据风险收益率提高行业配置的偏离度、提高组合换手率、丰富投资策略的多样性。个股选择上继续坚持根据公司业绩表现来优选个股,关注微观企业竞争力的消长、社会需求的变迁和行业集中度提升所带来利润率的持续提高,紧密跟踪公司业绩表现,合理评估公司价值,力争为投资者获取良好回报。

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。截止报告期末本基金管理人已与中央国债登记结算有限责任公司签署服务协议,由其按约定提供在银行间同业市场交易的债券品种的估值数据。

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。

4.8 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

无。

§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

在托管本基金的过程中,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基金合同、托管协议的约定,对本基金基金管理人—大成基金管理有限公司2014年1月1日至2014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本基金的投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、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本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2014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:大成价值增长证券投资基金
报告截止日:2014年12月31日

单位:人民币元

资 产	本期末 2014年12月31日	上年度末 2013年12月31日
资 产:		
银行存款	174,714,476.63	53,481,789.19
结算备付金	15,178,257.47	6,243,206.62
存出保证金	1,123,656.34	1,019,952.24
交易性金融资产	7,742,493,169.05	6,856,259,919.83
其中:股票投资	5,470,143,103.85	5,244,495,175.73
基金投资	-	-
债券投资	2,272,350,065.20	1,611,764,744.10
资产支持证券投资	-	-
贵金属投资	-	-
衍生金融资产	-	-
买入返售金融资产	194,850,732.28	-
应收证券清算款	14,908,073.13	40,027,644.66
应收利息	36,927,889.14	32,276,814.21
应收股利	-	-
应收申购款	561,109.03	69,168.31
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	-
资产总计	8,180,757,363.07	6,989,378,495.06
负债和所有者权益	本期末 2014年12月31日	上年度末 2013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	758,998,976.50	-
应付证券清算款	82,749,377.93	-
应付赎回款	11,897,872.47	3,755,308.01
应付管理人报酬	9,183,640.62	9,078,345.23
应付托管费	1,530,606.79	1,513,057.52
应付销售服务费	-	-
应付交易费用	7,749,934.22	3,359,079.07
应交税费	-	-
应付利息	1,814,285.54	-
应付利润	-	-
递延所得税负债	-	-
其他负债	578,176.68	547,528.12
负债合计	874,502,870.75	18,253,317.95
所有者权益:		
实收基金	8,176,803,559.38	10,253,770,748.18
未分配利润	-870,549,067.06	-3,282,645,571.07
所有者权益合计	7,306,254,492.32	6,971,125,177.11
负债和所有者权益总计	8,180,757,363.07	6,989,378,495.06

注:报告截止日2014年12月31日,基金份额净值0.8935元,基金份额总额8,176,803,559.38份。

7.2 利润表

会计主体:大成价值增长证券投资基金
本报告期:2014年1月1日至2014年12月31日

单位:人民币元

资 产	本期 2014年1月1日至2014年12月31日	上年度可比期间 2013年1月1日至2013年12月31日
一、收入	1,999,007,924.11	247,533,780.46
1.利息收入	58,206,882.52	57,435,947.25
其中:存款利息收入	1,292,207.45	2,147,339.70
债券利息收入	56,750,896.19	54,477,446.34
资产支持证券利息收入	-	-
买入返售金融资产收入	163,778.88	811,161.21
其他利息收入	-	-
2.投资收益(损失以"-"填列)	930,574,764.09	695,555,747.16
其中:股票投资收益	799,245,379.76	574,632,085.57
基金投资收益	-	-
债券投资收益	17,398,331.01	4,782,215.52
资产支持证券投资收益	-	-
贵金属投资收益	-	-
衍生工具收益	-	-
股利收益	113,931,053.32	116,141,446.07
3.公允价值变动收益(损失以"-"号填列)	1,009,114,059.53	-506,581,589.35
4.汇兑收益(损失以"-"号填列)	-	-
5.其他收入(损失以"-"号填列)	1,112,217.97	1,123,675.40
减:二、费用	159,567,150.87	157,838,733.24
1.管理人报酬	98,833,028.77	111,940,639.35
2.托管费	16,472,171.44	18,656,773.23
3.销售服务费	-	-
4.交易费用	40,057,388.50	26,626,509.44
5.利息支出	3,574,030.93	-
其中:卖出回购金融资产支出	3,574,030.93	-
6.其他费用	630,531.23	614,811.22
三、利润总额(亏损总额以"-"号填列)	1,839,440,773.24	89,695,047.22
减:所得税费用	-	-
四、净利润(净亏损以"-"号填列)	1,839,440,773.24	89,695,047.22

7.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体:大成价值增长证券投资基金
本报告期:2014年1月1日至2014年12月31日

单位:人民币元

项目	本期 2014年1月1日至2014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)	10,253,770,748.18	-3,282,645,571.07	6,971,125,177.11
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	1,839,440,773.24	1,839,440,773.24
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)	-2,076,967,188.80	572,655,730.77	-1,504,311,458.03
其中:1.基金申购款	354,974,393.89	-79,932,492.05	275,041,901.84
2.基金赎回款	-2,431,941,582.69	652,588,222.82	-1,779,353,359.87
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)	8,176,803,559.38	-870,549,067.06	7,306,254,492.32
项目	上年度可比期间 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)	11,559,322,080.73	-3,790,410,571.46	7,768,911,509.27
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	89,695,047.22	89,695,047.22
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)	-1,305,551,332.55	418,069,953.17	-887,481,379.38
其中:1.基金申购款	553,770,677.53	-177,327,218.52	376,443,459.01
2.基金赎回款	-1,859,322,010.08	595,397,171.69	-1,263,924,838.39
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)	10,253,770,748.18	-3,282,645,571.07	6,971,125,177.11

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:

罗登攀 肖剑 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、税项与最近一期年度报告相一致的说明

财政部于2014年颁布《企业会计准则第39号——公允价值计量》、《企业会计准则第40号——合营安排》、《企业会计准则第41号——在其他主体中权益的披露》和修订后的《企业会计准则第2号——长期股权投资》、《企业会计准则第9号——职工薪酬》、《企业会计准则第30号——财务报表列报》、《企业会计准则第33号——合并财务报表》以及《企业会计准则第37号——金融工具列报》,要求除《企业会计准则第37号——金融工具列报》自2014年度财务报表起施行外,其他准则自2014年7月1日起施行。上述准则对本基金本报告期无重大影响。

除上述会计政策变更事项,本报告期所采用的其他会计政策、会计估计、税项与最近一期年度报告相一致。

7.4.2 关联方关系

项目	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
中国农业银行股份有限公司("中国农业银行")	基金托管人、基金销售机构
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、基金销售机构
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")	基金管理人的合营企业

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。

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

金额单位:人民币元

关联方名称	本期 2014年1月1日至2014年12月31日		上年度可比期间 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	成交金额	占当期股票成交总额的比例
光大证券	5,437,323,088.82	20.93%	874,261,046.84	5.07%

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 2014年1月1日至2014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	4,841,941.60	20.80%	961,810.30	12.43%
关联方名称	上年度可比期间 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	776,993.44	5.01%	56,203.71	1.67%

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 2014年1月1日至2014年12月31日	上年度可比期间 2013年1月1日至2013年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	98,833,028.77	111,940,639.35
其中:支付销售机构的客户维护费	15,629,013.16	17,358,897.98

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。

7.4.3.2.2 基金托管费

单位:人民币元

项目	本期 2014年1月1日至2014年12月31日	上年度可比期间 2013年1月1日至2013年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	16,472,171.44	18,656,773.23

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

银行间市场交易的各关联方名称	本期 2014年1月1日至2014年12月31日					
	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	-	-	-	-	200,000,000.00	124,657.53
银行间市场交易的各关联方名称	上年度可比期间 2013年1月1日至2013年12月31日					
	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	-	-	-	-	-	-

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

无。

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

无。

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 2014年1月1日至2014年12月31日		上年度可比期间 2013年1月1日至2013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	174,714,476.63	1,112,991.44	53,481,789.19	1,987,433.97

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。

7.4.4 期末(2014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

本基金本期末持有因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券。

7.4.4.2 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	
600103	青山纸业	2014/10/13	重大资产重组	3.66	2015/02/12	4.03	1,676,200	4,630,233.42	6,134,892.00	-
600105	永鼎股份	2014/10/13	重要事项未公告	9.86	2015/01/16	10.67	560,100	4,129,332.08	5,522,586.00	-
600236	桂冠电力	2014/12/04	重大资产重组	4.70	2015/01/30	5.17	6,000,000	19,374,502.13	28,200,000.00	-
600318	巢东股份	2014/09/29	重大资产重组	11.20	2015/02/06	12.32	451,128	3,812,416.77	5,052,633.60	-
600332	白云山	2014/12/04	重要事项未公告	27.11	2015/01/13	29.82	2,149,770	60,282,553.52	58,280,264.70	-
600584	长电科技	2014/11/03	重大资产重组	11.13	2015/01/14	12.24	999,903	11,255,037.23	11,128,920.39	-
600649	城投控股	2014/11/03	重大资产重组	7.23	未知	未知	699,982	5,028,111.60	5,060,869.86	-
600716	凤凰股份	2014/12/12	重要事项未公告	9.58	2015/01/12	8.79	689,600	5,646,937.29	6,606,368.00	-
600761	安徽合力	2014/12/26	重要事项未公告	15.65	2015/01/06	16.60	2,780,545	35,740,835.71	43,515,529.25	-
603003	龙宇燃油	2014/12/19	重要事项未公告	21.76	未知	未知	389,453	5,652,937.21	8,474,497.28	-
000501	鄂武商A	2014/12/24	重大事项	15.82	2015/01/16	17.20	822,495	11,569,213.34	13,011,870.90	-
002098	浔兴股份	2014/12/18	拟披露重大事项	15.85	2015/01/19	14.27	377,180	3,568,847.29	5,978,303.00	-
002437	誉衡药业	2014/11/21	重大事项	23.75	2015/01/26	26.13	199,991	4,928,724.34	4,749,786.25	-
002439	启明星辰	2014/12/08	重大资产重组	26.24	2015/03/12	28.86	123	2,703.96	3,227.52	-
002553	南方轴承	2014/12/29	拟披露重大事项	11.89	2015/01/06	12.20	403,241	4,739,101.01	4,794,535.49	-
300009	安科生物	2014/12/15	重大资产重组	17.82	2015/03/18	19.60	618,137	11,531,243.58	11,015,201.34	-
300018	中元华电	2014/12/22	拟披露重大事项	13.23	2015/03/26	14.55	400,000	4,959,476.98	5,292,000.00	-
300208	恒顺电气	2014/12/17	重大事项	13.36	2015/02/09	14.70	400,000	5,020,410.52	5,344,000.00	-
300296	利亚德	2014/09/29	筹划重大事项	22.74	2015/01/05	22.60	856,780	20,376,443.16	19,483,177.20	-
300315	掌趣科技	2014/07/14	重大事项	19.59	2015/02/16	17.41	1,208,758	21,719,473.10	23,679,569.22	-
300347	泰格医药	2014/12/11	重大事项	30.22	2015/01/22	33.24	302,775	11,057,763.97	9,149,860.50	-

注:本基金截至2014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

截止本报告期末2014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548,998,976.50元,是以如下债券作为质押:

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
080204	08国开04	2015/01/07	100.09	600,000	60,054,000.00
120239	12国开39	2015/01/07	99.87	1,000,000	99,870,000.00
130216	13国开16	2015/01/07	100.60	500,000	50,300,000.00
130420	13农发20	2015/01/07	100.45	600,000	60,270,000.00
140317	14进出17	2015/01/07	100.06	600,000	60,036,000.00
140410	14农发10	2015/01/07	100.05	500,000	50,025,000.00
140436	14农发36	2015/01/07	100.13	1,700,000	170,221,000.00
合计				5,500,000	550,776,000.00

7.4.4.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末2014年12月31日止,本基金从事证券交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额210,000,000.00元,于2015年1月5日到期。该类交易要求本基金转入质押库的债券,按证券交易所规定的比例折算为标准券后,不低于债券回购交易的余额。

§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	5,470,143,103.85	66.87
	其中:股票	5,470,143,103.85	66.87
2	固定收益投资	2,272,350,065.20	27.78
	其中:债券	2,272,350,065.20	27.78
	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	194,850,732.28	2.38
	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	189,892,734.10	2.32
7	其他各项资产	53,520,727.64	0.65
8	合计	8,180,757,363.07	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	14,954,450.50	0.20
B	采矿业	8,789,250.00	0.12
C	制造业	2,856,710,744.72	39.10
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	319,480,490.97	4.37
E	建筑业	307,653,024.62	4.21
F	批发和零售业	338,626,625.84	4.63
G	交通运输、仓储和邮政业	47,165,662.86	0.65
H	住宿和餐饮业	-	0.00
I	信息传输、软件和信息技术服务业	208,393,015.51	2.85
J	金融业	1,013,192,565.82	13.87
K	房地产业	172,117,996.33	2.36
L	租赁和商务服务业	21,221,890.57	0.29
M	科学研究和技术服务业	134,417,755.61	1.84
N	水利、环境和公共设施管理业	9,664,330.00	0.13
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	9,149,860.50	0.13
R	文化、体育和娱乐业	-	0.00
S	综合	8,605,440.00	0.12
	合计	5,470,143,103.85	74.87

8.3 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	000333	美的集团	17,502,352	480,264,538.88	6.57
2	601166	兴业银行	28,696,400	473,490,600.00	6.48
3	601318	中国平安	5,003,053	373,778,089.63	5.12
4	000651	格力电器	5,700,032	211,585,187.84	2.90
5	002051	中工国际	6,989,379	190,949,834.28	2.61
6	000848	承德露露	6,031,075	132,623,339.25	1.82
7	002039	黔源电力	9,285,798	132,415,479.48	1.81
8	000063	中兴通讯	6,771,780	122,298,346.80	1.67
9	000625	长安汽车	7,143,248	117,363,564.64	1.61
10	300351	永贵电器	2,832,181	115,326,410.32	1.58

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)的年度报告正文。

8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

8.4.4 累计买入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	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	000333	美的集团	261,498,736.56	3.75
2	600016	民生银行	237,060,686.99	3.40
3	002051	中工国际	203,133,983.35	2.91
4	000848	承德露露	166,220,298.63	2.38
5	600718	东软集团	160,772,277.05	2.31
6	000063	中兴通讯	158,296,229.25	2.27
7	000651	格力电器	149,277,725.39	2.14
8	601318	中国平安	138,490,845.17	1.99
9	600859	王府井	135,443,703.38	1.94
10	002039	黔源电力	128,775,162.91	1.85
11	000513	丽珠集团	112,542,077.12	1.61
12	600036	招商银行	111,970,945.26	1.61
13	300012	华测检测	108,191,263.70	1.55
14	000858	五 粮 液	104,462,195.71	1.50
15	000625	长安汽车	103,405,978.73	1.48
16	600572	康恩贝	101,838,509.07	1.46
17	300351	永贵电器	100,642,036.18	1.44
18	000915	山大华特	94,626,183.15	1.36
19	002410	广联达	93,463,808.82	1.34
20	002262	恩华药业	89,995,119.00	1.29

注:本项中"本期累计买入金额"按买入成交金额(成交单价乘以成交数量)填列,不考虑相关交易费用。

8.4.5 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	600000	浦发银行	567,661,520.57	8.14
2	600016	民生银行	531,507,492.60	7.62
3	601318	中国平安	348,324,969.60	5.00
4	600036	招商银行	341,891,961.80	4.90
5	000002	万 科A	290,034,901.37	4.16
6	601668	中国建筑	220,571,685.78	3.16
7	000826	桑德环境	196,059,909.65	2.81
8	600518	康美药业	194,790,917.58	2.79
9	000333	美的集团	157,967,722.20	2.27
10	600030	中信证券	157,200,740.96	2.26
11	601166	兴业银行	142,692,645.37	2.05
12	002051	中工国际	135,874,835.60	1.95
13	600859	王府井	128,608,998.53	1.84
14	600718	东软集团	109,625,426.04	1.57
15	002410	广联达	107,877,935.78	1.55
16	601766	中国南车	104,604,225.76	1.50
17	000651	格力电器	103,852,142.32	1.49
18	600572	康恩贝	100,628,781.90	1.44
19	600383	金地集团	99,373,323.28	1.43
20	002008	大族激光	95,501,199.37	1.37

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。

8.4.6 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	12,278,449,828.51
卖出股票收入(成交)总额	13,701,426,780.79

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。

8.5 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	30,090,594.50	0.41
2	央行票据	-	0.00
3	金融债券	1,443,416,000.00	19.76
	其中:政策性金融债	1,443,416,000.00	19.76
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	798,843,470.70	10.93
8	其他	-	0.00
9	合计	2,272,350,065.20	31.10

8.6 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	113002	工行转债	3,020,530	450,632,870.70	6.17
2	113005	平安转债	1,930,000	348,210,600.00	4.77
3	140436	14农发36	1,700,000	170,221,000.00	2.33
4	120215	12国开15	1,500,000	149,880,000.00	2.05
5	140212	14国开12	1,100,000	110,143,000.00	1.51

8.7 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

本基金期末未持有资产支持证券。

8.8 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

本基金期末未持有贵金属投资。

8.9 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

本基金期末未持有权证。

8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

8.10.4 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金本报告期未投资股指期货。

8.10.5 本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期未投资股指期货。

8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

8.11.4 本期国债期货投资政策

本基金本报告期未投资国债期货。

8.11.5 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期未投资国债期货。

8.11.6 本期国债期货投资评价

本基金本报告期未投资国债期货。

8.12 投资组合报告附注

8.12.4 报告期内基金投资的前十名证券的发行主体无被监管部门立案调查的,或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情行

8.12.5 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。

8.12.6 期末其他各项资产构成

单位:人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	1,123,656.34
2	应收证券清算款	14,908,073.13
3	应收股利	-
4	应收利息	36,927,889.14
5	应收申购款	561,109.03
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	53,520,727.64

8.12.7 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

金额单位:人民币元

序号	债券代码	债券名称	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	113002	工行转债	450,632,870.70	6.17
2	113005	平安转债	348,210,600.00	4.77

8.12.8 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。

8.12.9 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。

§9 基金份额持有人信息

9.1 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
399,957	20,444.21	272,224,114.09	3.33%	7,904,579,445.29	96.67%

注:持有人户数为有效户数,即存量份额大于零的账户。

9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	持有份额总数(份)	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	1,598.53	0.00%

9.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

项目	持有基金份额总量的数量区间(万份)
本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	0
本基金基金经理持有本开放式基金	0

§10 开放式基金份额变动

单位:份

基金合同生效日(2002年11月11日)基金份额总额	2,604,752,899.89
本报告期期初基金份额总额	10,253,770,748.18
本报告期基金总申购份额	354,974,393.89
减:本报告期基金总赎回份额	2,431,941,582.69
本报告期基金拆分变动份额(份额减少以"-"填列)	-
本报告期期末基金份额总额	8,176,803,559.38

§11 重大事件揭示

11.1 基金份额持有人大会决议

报告期内无基金份额持有人大会决议。

11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

一、基金管理人在本报告期内重大人事变动情况:

基金管理人于2014年1月25日发布了《大成基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告》,经大成基金管理有限公司第五届董事会第二十八次会议审议通过,王颢先生不再担任大成基金管理有限公司总经理,由董事长张树忠先生代任公司总经理。

2、基金管理人于2014年11月28日发布了《大成基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告》,经大成基金管理有限公司第五届董事会第三十九次会议审议通过,由罗登攀先生任公司总经理。

3、基金管理人于2014年12月20日发布了《大成基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告》,经大成基金管理有限公司第五届董事会第三十九次会议审议通过,由刘卓先生任公司董事长及法定代表人,张树忠先生不再担任公司董事长。

二、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动:

因中国农业银行股份有限公司(以下简称"本行")工作需要,任命余晓晨先生主持本行托管业务部/养老金管理中心工作。余晓晨先生的基金行业高级管理人员任职资格已在中国基金业协会备案。

11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内没有涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

11.4 基金投资策略的改变

本基金投资策略在本报告期内没有重大改变。

11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金聘任的为本基金审计的会计师事务所为普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙),该事务所自基金合同生效日起为本基金提供审计服务至今。审计费用17.5万。

11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期,本基金管理人、托管人及高级管理人员未受到监管部门稽查或处罚。

11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

11.7.4 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位:人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
光大证券	2	5,437,323,088.82	20.93%	4,841,941.60	20.80%	-
银河证券	4	3,602,449,187.99	13.87%	3,224,178.37	13.85%	-
招商证券	2	2,428,672,984.06	9.35%	2,178,841.69	9.36%	-
华创证券	1	1,443,972,534.23	5.56%	1,277,791.34	5.49%	-
兴业证券	2	1,329,442,276.40	5.12%	1,176,451.36	5.05%	-
海通证券	1	1,274,121,576.43	4.90%	1,127,491.41	4.84%	-
瑞银证券	1	1,205,997,266.11	4.64%	1,097,936.79	4.72%	-
中金公司	2	1,150,339,254.63	4.43%	1,026,769.29	4.41%	-
齐鲁证券	1	934,582,724.50	3.60%	850,841.87	3.65%	-
上海证券	1	905,936,761.51	3.49%	824,762.18	3.54%	-
民生证券	1	710,096,177.91	2.73%	646,469.33	2.78%	-
中信建投	3	639,838,691.68	2.46%	566,201.76	2.43%	-
英大证券	1	616,254,338.74	2.37%	561,037.00	2.41%	-
方正证券	1	539,473,804.70	2.08%	491,135.97	2.11%	-
长城证券	2	490,382,459.68	1.89%	446,444.13	1.92%	-
中信证券	2	480,472,741.82	1.85%	437,419.95	1.88%	-
安信证券	1	436,804,662.70	1.68%	397,665.82	1.71%	-
国信证券	1	353,697,373.45	1.36%	322,006.07	1.38%	-
西部证券	1	329,296,087.89	1.27%	291,398.41	1.25%	-
华泰证券	1	297,983,971.47	1.15%	263,695.39	1.13%	-
北京高华	1	245,140,746.30	0.94%	223,177.05	0.96%	-
国泰君安	2	221,512,407.76	0.85%	196,019.00	0.84%	-
湘财证券	1	207,719,117.65	0.80%	183,814.30	0.79%	-
平安证券	1	199,799,589.46	0.77%	181,898.32	0.78%	-
国金证券	2	159,896,078.79	0.62%	141,493.91	0.61%	-
中银国际	2	142,685,365.45	0.55%	129,900.59	0.56%	-
申银万国	1	110,696,189.81	0.43%	100,777.52	0.43%	-
东北证券	2	82,695,370.04	0.32%	73,177.88	0.31%	-
红塔证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
宏源证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
国盛证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
浙商证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
世纪证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
东兴证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
广发证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
南京证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
天风证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-

注:中国证监会颁布的《关于完善证券投资基金交易席位制度有关问题的通知》(证监基金字[2007]48号)的有关规定,本公司制定了租用证券公司交易单元的选择标准和程序。

租用证券公司交易单元的选择标准主要包括:

(一)财务状况良好,最近一年无重大违规行为;

(二)经营行为规范,内控制度健全,能满足各投资组合运作的保密性要求;

(三)研究实力较强,能提供包括研究报告、路演服务、协助进行上市公司调研等研究服务;

(四)具备各投资组合运作所需的高效、安全的通讯条件,有足够的交易和清算能力,满足各投资组合证券交易需要;

(五)能提供投资组合运作、管理所需的其他券商服务;

(六)相关基金合同、资产管理合同以及法律法规规定的其他条件。

租用证券公司交易单元的程序:首先根据租用证券公司交易单元的选择标准形成《券商服务评价表》,然后根据评分高低进行选择基金交易单元。

本报告期内增加基金交易单元:湘财证券。本报告期内退租基金交易单元:招商证券。

11.7.2基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位:人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例
光大证券	56,877,944.94	3.80%	-	0.00%	-	0.00%
银河证券	105,101,881.00	7.02%	-	0.00%	-	0.00%
招商证券	28,034,967.60	1.87%	300,000,000.00	18.90%	-	0.00%
瑞银证券	48,252,262.49	3.22%	28,000,000.00	1.76%	-	0.00%
中金公司	16,545,657.83	1.11%	300,000,000.00	18.90%	-	0.00%
齐鲁证券	9,162,270.96	0.61%	-	0.00%	-	0.00%
上海证券	53,421,406.12	3.57%	-	0.00%	-	0.00%
英大证券	113,207,086.46	7.57%	571,700,000.00	36.01%	-	0.00%
方正证券	412,284,851.99	27.55%	88,000,000.00	5.54%	-	0.00%
长城证券	141,118,091.75	9.43%	-	0.00%	-	0.00%
中信证券	70,763,516.70	4.73%	-	0.00%	-	0.00%
国信证券	395,092,586.20	26.40%	300,000,000.00	18.90%	-	0.00%
中银国际	46,417,741.48	3.10%	-	0.00%	-	0.00%

§12 影响投资者决策的其他重要信息

1、基金管理人于2015年1月13日发布了《大成基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告》,经大成基金管理有限公司第六届董事会第一次会议审议通过,刘彩晖女士不再担任公司副总经理。

2、基金管理人于2015年1月22日发布了《大成基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告》,经大成基金管理有限公司第六届董事会第一次会议审议通过,由肖剑先生、钟鸣远先生任公司副总经理。

大成基金管理有限公司
2015年3月28日