大成竞争优势股票型证券投资基金

【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:中国工商银行股份有限公司
送出日期:2015年3月28日

§1 重要提示

基金管理人的董事会及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责任。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2015年3月20日复核了本报告中的财务指标、净值表现和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。

大成保本混合型证券投资基金基金合同于2011年4月20日正式生效。本基金保本周期为三年(自本基金基金合同生效之日起至三个公历年后对应日止。如遇对应日为非工作日,保本周期顺延日期延至下一个工作日),即2014年4月21日(周一)为本基金第一个保本周期到期日。

根据《大成保本混合型证券投资基金基金合同》(以下简称“《基金合同》”)的约定,“保本周期届满时,在符合法律法规有关担保人、或保本义务人资质要求,并经基金管理人和基金托管人认可的担保人、或保本义务人同意为下一个保本周期提供保本保障,与本基金管理人签订保证合同或风险买断合同,同时本基金满足法律法规和本合同规定的基金续聘条件的情况下,本基金继续存续并进入下一保本周期;否则,本基金保本周期届满时,本基金未能符合上述保本基金存续条件,则本基金转入《基金合同》的约定,变更为“大成竞争优势股票型证券投资基金”。同时,基金的投资目标、投资范围、投资策略以及基金费率等相关内容也将根据《基金合同》的相关约定作相应修改。上述变更无需经基金份额持有人大会决议,在报中国证监会备案后,提前在临时公告或《大成竞争优势股票型证券投资基金招募说明书》中予以说明。

大成保本混合型证券投资基金第一个保本周期到期,按照基金合同的约定变更为非保本的“大成竞争优势股票型证券投资基金”,基金托管人及基金注册登记机构不变,基金代码亦保持不变,为“090013”。转型后基金的投资目标、投资范围、投资策略以及基金费率等按照《大成竞争优势股票型证券投资基金基金合同》相关规定进行运作。就前述修改变更事项,本基金管理人已按照相关法律法规及《基金合同》的约定履行了相关手续及各项信息披露工作。

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。

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。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。

自2014年4月22日起大成保本混合型证券投资基金名称变更为大成竞争优势股票型证券投资基金。原大成保本混合型证券投资基金本报告期自2014年1月1日至2014年4月21日止,大成竞争优势股票型证券投资基金本报告期自2014年4月22日至2014年12月31日止。

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

转型前:

基金简称	大成保本混合
基金主代码	090013
交易代码	090013
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2011年4月20日
基金管理人	大成基金管理有限公司
基金托管人	中国工商银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	462,220,984.84份
基金合同存续期(若有)	不定期

注:上期“报告期末”指2014年4月21日。

2.1 基金基本情况

转型后:

基金简称	大成竞争优势股票
基金主代码	090013
交易代码	090013
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2014年4月22日
基金管理人	大成基金管理有限公司
基金托管人	中国工商银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	84,634,277.34份
基金合同存续期(若有)	不定期

注:上期“报告期末”指2014年12月31日。

2.2 基金产品说明

转型前:

投资目标	依照保证合同,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,在保证风险资产可能的损失能不超过扣除相关费用后的保本资产的潜在收益与基金前期收益的基础上,参与分享市场可能出现的风险收益,从而保证本金安全,并实现基金资产长期增值。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、可转换债券、可分离债券、短期融资券、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、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)。假设期基金合同生效日或前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。

2.2 基金产品说明

转型后:

投资目标	主要投资于具有持续竞争优势的企业,追求基金资产长期增值。
投资策略	通过对宏观经济运行状况及其政策动态、货币金融运行状况及其政策动态、证券市场运行状况及其政策动态等因素一自上而下”的定量和定性分析,评估各类资产的投资价值,研究各类资产价值的变化趋势,确定组合中股票、债券等各类资产的投资比例。
业绩比较基准	75%×沪深300指数+25%×中债综合指数
风险收益特征	本股票型基金预期风险收益水平高于混合基金、债券基金和货币市场基金。

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	中国工商银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	杜鹏	蒋松云
	联系电话	0755-83183388	010-66105799
	电子邮箱	dupeng@dcfund.com.cn	custody@icbc.com.cn
客户服务电话		4006888555	95588
传真		0755-83199588	010-66105798

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55号中国工商银行托管业务部

§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1月1日-2014年12月31日		2013年	2012年
	转型前(2014年1月1日-2014年4月21日)	转型后(2014年4月22日-2014年12月31日)		
本期已实现收益	3,650,911.94	13,153,269.94	13,120,041.74	22,762,580.90
本期利润	4,902,018.49	31,756,502.05	7,662,922.13	18,964,922.84
加权平均基金份额本期利润	0.0094	0.2700	0.0119	0.0203
本期基金份额净值增长率	0.96%	29.08%	0.67%	1.96%
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	0.0489	0.1919	0.0290	0.0382
期末基金资产净值	484,670,307.38	114,561,608.12	563,798,692.24	798,869,138.14
期末基金份额净值	1.049	1.354	1.039	1.042

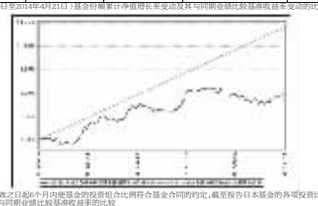
注:1.本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入(不含公允价值变动收益)扣除相关费用后的余额,本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。
2.所述基金业绩指标不包括持有人交易基金的各项费用,计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

3.2 基金净值表现(转型前)

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

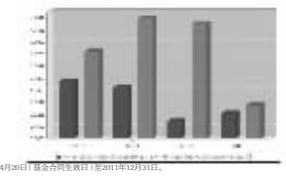
3.1.1 期间数据和指标			份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③
阶段	份额净值增长率①					
过去三个月	1.46%		0.10%	1.04%	0.01%	0.41%
过去六个月	0.38%		0.11%	2.12%	0.01%	-1.74%
过去一年	-0.47%		0.11%	4.36%	0.01%	-4.83%
过去三年	5.91%		0.09%	14.28%	0.01%	-8.37%
自基金合同生效起至今	5.91%		0.09%	14.28%	0.01%	-8.37%

3.2.2 自基金合同生效以来(2011年4月20日至2014年4月21日)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之日起6个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的约定,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。

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



注:2011年净值增长率表现期间为2011年4月20日(基金合同生效日)至2011年12月31日。

3.2 基金净值表现(转型后)

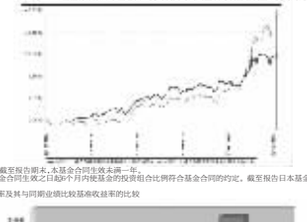
3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

转型后						
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	13.31%	1.16%	32.64%	1.24%	-19.33%	-0.08%
过去六个月	23.88%	0.94%	46.24%	0.99%	-22.36%	0.05%
自基金合同生效起至今	29.08%	0.82%	46.06%	0.91%	-16.98%	-0.09%

3.2.2 自基金转型以来(2014年4月22日至2014年12月31日)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.本基金合同于2014年4月22日生效,截至报告期末,本基金合同生效未满一年。
2.按基金合同规定,基金管理人应当自基金合同生效之日起6个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的约定。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。

3.2.3 自基金转型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:2014年净值增长率表现期间为2014年4月22日(转型后首日)至2014年12月31日。

3.3 过去三年基金的利润分配情况(转型前)

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
2014	-	-	-	-	-
2013	0.1000	7,540,649.65	-	7,540,649.65	
2012	-	-	-	-	-
合计	0.1000	7,540,649.65	-	7,540,649.65	

3.4 过去三年基金的利润分配情况(转型后)

无。

§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[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。目前公司由国家投资控股公司(持股49%)、光大证券股份有限责任公司(49%)、中国远洋投资管理有限公司(2%)、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41只开放式证券投资基金:大成中证100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、2151GDI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46只开放式证券投资基金:大成景丰债券型证券投资基金、大成债券投资基金、大成稳健增利债券投资基金、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、大成中证500双动力股票型证券投资基金、大成景气精选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、大成稳健价值混合型证券投资基金(LOF)、大成新经济股票型证券投资基金、大成创新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、大成新小盘动力股票型证券投资基金、大成量化策略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、大成精选增值混合型证券投资基金(LOF)、大成新型成长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、大成货币市场证券投资基金、大成景气精选股票型证券投资基金、大成景安短债债券型证券投资基金、大成景安融债债券型证券投资基金、大成景顺积极配置股票型证券投资基金、大成景兴信用债券型证券投资基金、大成景利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、大成景润债券型证券投资基金、大成景瑞债券型证券投资基金、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(转型前)

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		
陈尚前先生	本基金基金经理	2011年4月20日	2014年4月21日	15年	南开大学经济学博士,曾任中国平安保险公司投资管理中心债券投资主任和新疆证券股份有限公司研究发展中心策略部经理,2002年加盟大成基金管理有限公司,2003年6月至2009年5月曾任大成债券基金基金经理,2008年8月6日至2014年4月4日任大成强化收益债券基金基金经理,2010年10月15日至2013年10月15日任大成景丰分级债券型证券投资基金基金经理,2013年10月16日至2014年4月4日任大成景丰中级债券型证券投资基金(LOF)基金经理,2011年4月20日至2014年4月21日任大成保本混合型证券投资基金基金经理,2014年4月22日至2014年4月24日任大成竞争优势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
徐欣先生	本基金基金经理	2014年4月25日	2014年4月24日	15年	管理学硕士,曾就职于中国东方资产管理公司投资管理部,2007年加入大成基金研究部,曾任中韵制造行业研究主管,2011年7月28日至2012年10月27日曾任景兴证券投资基金和大成行业轮动股票型证券投资基金基金经理助理,2012年10月31日起任大成策略回报股票型证券投资基金基金经理,2014年4月25日起兼任大成竞争优势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
-	-	-	-	8年	经济学硕士,曾就职于中国证券投资基金评估业务部,2006年加入大成基金研究部,曾任大成景丽纯债债券基金、大成景利纯债债券基金、大成景瑞债券基金基金经理助理,2014年4月24日任大成竞争优势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》、《大成保本混合型证券投资基金基金合同》、《大成竞争优势股票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,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、行业管理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,本基金投资决策以及进行市场、基金交易等方面的运作程序合规完备,公司内部各项风控指标均符合法律法规和基金合同的规定进行,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证券交易监控与报告制度》,基金管理人属于投资组合严格按照制度的规定,参与投资、信息获取、信息传递、组合管理、交易执行、交易结果、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相关制度。

基金管理人以指数计算方法和工具,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;股票同向交易最价事较大主要来源于市场因素(如个股当日价格振幅较高)及组合投资决策时机选择,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组合同时成交价格差异较大,但组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成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

本基金在2014年4月由保本基金转型而来,由于基金类型的变化,基金份额变化巨大,主要由于上述原因,本基金在转长封闭内仓位很低,对投资收益率造成了一定的影响。本基金建仓时主要买入了以地产、银行、家电为主的价值股和一些百马成长股,一直持有至年末,期间调仓很少,当时选择这个股也是基于本基金一贯的理念:有竞争优势的公司和合适的价格。

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1.354元。本报告期内,转型前基金份额净值增长率为0.96%,同期业绩比较基准收益率为1.28%,低于业绩比较基准的表现;转型后基金份额净值增长率为29.08%,同期业绩比较基准收益率为46.06%,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16年,在股个基金业连续两年取得较高的绝对收益之后,本基金认为应该降低对未来投资收益率的期望,价值股的性价比优势不再,成长股更需要去伪存真。我们将结合自己的能力期望在选择一些团队素质、股东中长期的可持续并做强强联手不失公允的公司。我们将争取为持有人创造更多的价值。

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负责基金、公司负责基金经理、公司负责基金会计主管、公司负责基金风控主管、估值委员会由股票投资部、研发部、固定收益部、风险管理部和基金管理、基金会计、监察稽核部、委托投资管理部之人员组成。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。

投资投资部、研究部、固定收益部、风险管理部和委托投资管理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长时间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算或者调整的投资品种;提出方案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算;定期对估值政策和程序进行评价,以保证其持续适用;基金经理负责日常的基金资产的估值业务,执行基金估值政策,并负责与托管行有通信管理事项;监察稽核部负责监察和程序的一致性,负责信息委员会工作流程中的风险控制,并负责估值账务中的信息披露工作。

本基金的日常估值程序由基金经理根据算法执行,并与托管银行的估值结果相对一致。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,对本基金持有金融资产的估值方法和估值结果提出建议,信息披露负责人将根据法律法规要求,向信息委员会提供估值数字信息,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论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的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 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

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

本报告期内,本基金托管人在对大成竞争优势股票型证券投资基金(原大成保本混合型证券投资基金转型)的托管过程中,严格遵守《证券投资基金法》及其他法律法规和基金合同的有关规定,不存在任何损害基金份额持有人利益的行为,完全保证资金地履行了基金托管人应尽的义务。

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,大成竞争优势股票型证券投资基金(原大成保本混合型证券投资基金转型)的管理人——大成基金管理有限公司在大成竞争优势股票型证券投资基金(原大成保本混合型证券投资基金转型)的投资运作、基金资产净值计算、会计核算、利润分配、信息披露等环节有关法律法规、行业管理规则和基金合同等规定,未发现有违反法律法规和基金合同的规定进行,在规范基金运作和严格控制基金资产的风险管理、估值、会计核算、信息披露等方面的运作程序合规完备的前提下,努力为基金份额持有人谋求最大利益。

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

本托管人依法对大成基金管理有限公司编制和披露的大成竞争优势股票型证券投资基金(原大成保本混合型证券投资基金转型)2014年年度报告中财务指标、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进行了核查,以上内容真实、准确和完整。

5.6 审计报告(转型前)

本基金2014年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。

5.6 审计报告(转型后)

本基金2014年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。

5.7 年度财务报表(转型前)

7.1 资产负债表(转型前)

会计主体:大成保本混合型证券投资基金

报告截止日:2014年4月21日(保本周期到期日)

单位:人民币元

资产	报告期初至转型前	上年度末 2013年12月31日
资产:		
银行存款	468,918,906.73	53,411,203.28
结算备付金	-	273,467.94
存出保证金	81,327.68	263,309.71
交易性金融资产	19,646,000.00	529,379,748.03
其中:股票投资	-	33,471,907.53
基金投资	-	-
债券投资	19,646,000.00	505,907,780.50
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	-	-
应收证券清算款	-	288,373.71
应收利息	480,046.22	10,877,218.88
应收股利	-	-
应收申购款	8,643.46	1,980.64
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	-
资产总计	489,134,923.09	604,495,362.19
负债和所有者权益	报告期初至转型前	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	-	39,159,741.26
应付证券清算款	-	-
应付赎回款	3,724,969.06	497,609.97
应付管理人报酬	352,307.22	584,269.59
应付托管费	58,717.88	97,376.60
应付销售服务费	-	-
应付交易费用	50,474.82	103,447.55
应交税费	64,016.00	64,016.00
应付利息	-	10,588.12
应付利润	-	-
递延所得税负债	-	-
其他负债	214,130.73	179,630.86
负债合计	4,464,615.71	40,696,669.95
所有者权益:		
实收基金	462,220,984.84	542,644,033.08
未分配利润	22,449,322.54	21,154,659.16
所有者权益合计	484,670,307.38	563,798,692.24
负债和所有者权益总计	489,134,923.09	604,495,362.19

注:1.报告截止日2014年4月21日,基金份额净值1.049元,基金份额总额462,220,984.84份。
2.本期各项财务指标数据同期为2014年1月1日至2014年4月21日(保本周期到期日)。

7.2 利润表

会计主体:大成基金保本混合型证券投资基金

本报告期:2014年1月1日至2014年4月21日(保本周期到期日)

单位:人民币元

项 目	本期 2014年1月1日至 2014年4月21日	上年度可比期间 2013年1月1日至2013年12月31日
一、收入	7,696,468.16	18,766,582.34
1.利息收入	6,732,189.72	18,883,180.91
其中:存款利息收入	3,582,416.96	475,925.63
债券利息收入	2,969,987.33	17,311,070.95
资产支持证券利息收入	-	-
买入返售金融资产收入	190,490.43	1,096,873.33
其他利息收入	-	-
2.投资收益(损失以“-”号填列)	-506,938.77	4,528,712.41
其中:股票投资收益	-1,048,580.38	-5,583,177.14
基金投资收益	-	-
债券投资收益	540,141.61	10,061,324.34
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	-500.00	50,565.21
3.公允价值变动收益(损失以“-”号填列)	1,251,106.56	-5,457,119.61
4.汇兑收益(损失以“-”号填列)	-	-
5.其他收入(损失以“-”号填列)	221,405.66	811,119.63
减:二、费用	2,794,449.67	11,103,660.21
1、管理人报酬	1,977,436.54	8,139,493.90
2、托管费	329,572.79	1,356,582.35
3、销售服务费	-	-
4、交易费用	100,014.41	1,111,194.79
5、利息支出	247,300.15	72,838.90
其中:卖出回购金融资产支出	247,300.15	72,838.90
6、其他费用	140,125.78	423,550.27
三、利润总额(亏损总额以“-”号填列)	4,902,018.49	7,662,922.13
减:所得税费用	-	-
四、净利润(净亏损以“-”号填列)	4,902,018.49	7,662,922.13

7.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体:大成保本混合型证券投资基金

本报告期:2014年1月1日至2014年4月21日(保本周期到期日)

单位:人民币元

项目	本期 2014年1月1日至2014年4月21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)	542,644,033.08	21,154,659.16	563,798,692.24
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	4,902,018.49	4,902,018.49
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)	-80,423,048.24	-3,607,355.11	-84,030,403.35
其中:1.基金申购款	752,859.77	31,962.88	784,822.65
2.基金赎回款	-81,175,908.01	-3,639,307.99	-84,815,216.00
四、本期内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)	462,220,984.84	22,449,322.54	484,670,307.38

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)	766,967,704.51	31,901,433.63	798,869,138.14
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	7,662,922.13	7,662,922.13
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)	-224,313,671.43	-10,869,046.95	-235,182,718.38
其中:1.基金申购款	3,956,635.69	188,882.36	4,145,518.05
2.基金赎回款	-228,270,307.12	-11,057,929.31	-239,328,236.43
四、本期内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)	-	-7,540,649.65	-7,540,649.65
五、期末所有者权益(基金净值)	542,644,033.08	21,154,659.16	563,798,692.24

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

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27号——金融工具列报》以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

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
中国工商银行股份有限公司(“中国工商银行”)	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

无。

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4月21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	1,977,436.54	8,139,493.90
其中:支付销售机构的客户维护费	818,757.28	3,359,847.61

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1.20%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 1.20% / 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4月21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	329,572.79	1,356,582.35

注:支付基金托管人中国工商银行的托管费按前一日基金资产净值0.20%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 0.20% / 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

本报告期内及上年度可比期间本基金未发生与关联方进行的银行间同业市场的债券(含回购)交易。

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

本报告期内及上年度可比期间基金管理人未运用固有资金投资本基金。

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

本报告期末及上年度末除基金管理人之外的其他关联方未投资本基金的情况。

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4月21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
中国工商银行	468,918,906.73	29,906.00	3,411,263.28	269,562.66

注:本基金的银行存款由基金托管人中国工商银行保管,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应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股/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。

7.4.4.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末2014年4月21日止,本基金无从事银行间债券正回购交易形成的卖出回购证券款的余额。

7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末2014年4月21日止,本基金无从事证券交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款的余额。

7.4.12.3.3 交易所市场债券正回购

截至本报告期末2014年4月21日止,本基金无从事证券交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款的余额。

7.5 资产负债表(转型后)

会计主体:大成竞争优势股票型证券投资基金

报告截止日:2014年12月31日

单位