

(上接B479版)

单位:人民币元

项目	本期 2014年12月26日至2014年12月31日
一收入	-19,949,794.70
1.利息收入	560,763.89
其中:存款利息收入	39,976.32
债券利息收入	510,776.57
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“-”号填列)	16,461,897.88
其中:股权投资收益	16,466,897.38
基金投资收益	-
债券投资收益	-
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	-3,260.30
3.公允价值变动收益(损失以“-”号填列)	-36,952,383.67
4.汇兑收益(损失以“-”号填列)	-
5.其他收入(损失以“-”号填列)	-
第二、四栏	1,440,084.47
1.管理费	779,146.56
2.托管费	129,857.59
3.销售服务费	-
4.交易费	523,766.05
5.利息支出	-
其中:卖出回购金融资产支出	-
6.其他费用	7,286.27
三、利润(亏损)总额(以“-”号填列)	-21,389,799.17
其中:归属于母公司的净利润	-21,389,799.17
四、期末所有者权益(基金净值)	-21,389,799.17

7.3 所有者权益(基金净值)变动表
会计主体:大成产业升级股票型证券投资基金(LOF)
本报告期:2014年12月26日至2014年12月31日

单位:人民币元

项目	本期 2014年12月26日至2014年12月31日	上期 2014年12月26日至2014年12月31日
一、期初所有者权益(基金净值)	3,000,000,000.00	163,582,289.74
二、本期损益	-21,389,799.17	-21,389,799.17
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动(基金净值)	-	-
其中:1.基金申购款	-	-
2.基金赎回款(以“-”号填列)	-	-
四、本期基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净收益减少以“-”号填列)	-	-
五、期末所有者权益(基金净值)	3,000,000,000.00	142,192,490.57

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 本期基金所采用的会计政策、会计估计与上一期年度报告保持一致的说明
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。

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、基金销售机构
中国银河证券股份有限公司(“中国银河银行”)	基金管理人、基金销售机构
中信银行股份有限公司	基金管理人、基金销售机构
光大证券股份有限公司(“光大证券”)	基金管理人、基金销售机构
中国银河投资管理有限公司	基金管理人、基金销售机构
广东证券股份有限公司(“广东证券”)	基金管理人、基金销售机构
大成创新资产管理有限公司(“大成创新资本”)	基金管理人、基金销售机构

注:1、中国证监会于2006年11月6日作出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以内按一般商业条款订立。

7.4.3 本基金的日常业务往来与关联方发生交易。
本基金本报告期未有通过关联方交易单元进行的交易。

7.4.3.1 关联方报酬
7.4.3.1.1 基金管理费

单位:人民币元

项目	本期 2014年12月26日至2014年12月31日
当期应支付的管理费	779,146.56
其中:支付给基金托管人的客户维护费	-

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1.50%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×1.50%/当年天数。
7.4.3.1.2 基金托管费

单位:人民币元

项目	本期 2014年12月26日至2014年12月31日
当期应支付的托管费	129,857.59

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×0.25%/当年天数。
7.4.3.2 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。

7.4.3.3 各关联方投资本基金的情况
7.4.3.3.1 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12月26日至2014年12月31日
基金合同生效日(2014年12月26日)持有的基金份额	7,500,000.00
期间申购及赎回情况	-
期间申购及赎回增加份额	-
期间赎回及卖出份额	-
期末持有的基金份额	7,500,000.00
期末持有的基金份额占基金总份额比例	0.25%

7.4.3.3.2 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	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%
广东证券	3,750,000.00	0.13%

7.4.3.4 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	期末余额	当期利息收入
中国农业银行	489,544,180.46	38,196.88

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。
7.4.3.5 本基金在承销期间参与关联方承销证券的情况
本基金本报告期未参与关联方承销证券。
7.4.3.6 其他关联交易事项的说明
本基金本报告期无须作说明的其他关联交易事项。
7.4.4 利润分配情况
7.4.4.1 利润分配情况——非货币市场基金
本报告期内本基金无利润分配事项。
7.4.5 期末(2014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
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。
7.4.5.2 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	期末成本总额	期末公允价值	备注
002010	天奇股份	2014年10月20日	重大资产重组	17,951,262.15	41,688,573.44	47,215,274.11
002010	天奇股份	2014年10月27日	重大资产重组	15,138,311.66	86,816,798.36	140,066,200.98
300011	鼎泰新材	2014年11月24日	重大资产重组	18,936,636.88	80,885,515.78	128,736,921.26
300150	新康股份	2014年12月1日	重大资产重组	16,551,200.00	2,930,171.55	3,302,000.00

注:本基金截至本报告期末持有以上因公布的重大的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。
7.4.5.3 期末债券正回购交易作为流动受限的债券
7.4.5.3.1 银行间市场债券正回购
于本报告期末,本基金无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。
7.4.5.3.2 交易所市场债券正回购
于本报告期末,本基金无从事交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

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	2,182,556,798.41	69.77
其中:股票		2,182,556,798.41	69.77
2	固定收益投资	646,153,556.20	20.36
其中:债券		646,153,556.20	20.36
3	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
7	其他金融资产投资	-	-
8	待摊费用	279,098,146.28	8.70
9	其他资产	68,906,096.51	2.17
合计		3,173,672,506.67	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

序号	行业类别	公允价值	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	1,627,174,523.47	51.43
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	46,077,888.00	1.42
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	2,361,000.00	0.07
H	住宿和餐饮业	47,087,164.80	1.49
I	信息传输、软件和信息技术服务业	107,069,743.06	3.41
J	金融业	320,809,320.51	10.14
K	房地产业	32,046,158.57	1.01
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
合计		2,182,556,798.41	69.89

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	601166	兴业银行	11,300,028	163,737,406.72	5.18
2	000026	万科A	8,715,849	144,944,568.87	4.58
3	002050	三花股份	9,286,311	142,522,463.18	4.51
4	300011	鼎泰新材	6,366,888	127,773,389.50	4.04
5	600070	恒达电子	1,649,960	97,291,226.00	3.05
6	002023	美盛森	6,001,598	89,063,684.64	2.82
7	002547	春兴精工	5,421,698	87,885,724.88	2.79
8	001096	张中动力	9,548,889	84,421,038.70	2.67
9	002884	西藏化工	4,471,690	81,384,750.00	2.57
10	600016	民生银行	7,520,043	80,765,261.82	2.55

注:投资者欲了解本报告期末基金指数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
8.4.1 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	601166	兴业银行	210,070,892.62	7.42%
2	000026	万科A	151,866,326.38	5.39%
3	002547	春兴精工	146,196,703.28	5.16%
4	602077	亿利能源	140,131,989.38	4.96%
5	002038	美盛森	127,588,000.79	4.50%
6	001096	张中动力	116,469,415.29	4.11%
7	002884	西藏化工	106,933,548.79	3.77%
8	601222	林洋电子	103,741,670.56	3.66%
9	002894	东山精密	101,075,624.62	3.60%
10	300303	聚飞光电	101,066,889.49	3.57%
11	002350	三花股份	89,989,975.83	3.13%
12	000742	一汽轿车	86,304,466.08	2.97%
13	600070	恒达电子	96,543,266.41	3.41%
14	600741	华胜天成	96,314,300.06	3.40%
15	002065	凯创智能	92,102,468.44	3.23%
16	600050	东方能源	92,167,161.04	3.26%
17	000668	东方能源	87,961,526.51	3.11%
18	600270	外运发展	87,159,263.74	3.08%
19	600016	民生银行	86,911,997.19	3.07%
20	000881	耀世中国	85,051,091.77	3.02%
21	002033	美盛森	82,333,966.87	2.97%
22	300011	鼎泰新材	80,386,533.28	2.86%
23	200225	北方稀土	76,609,940.67	2.73%
24	300088	长信科技	75,739,406.81	2.72%
25	300037	欣锐达	77,438,040.32	2.73%
26	600009	万华化学	77,472,032.62	2.73%
27	601018	锦纶科技	76,803,003.04	2.71%
28	000660	福耀玻璃	76,704,000.00	2.71%
29	002872	蒙泰生	76,941,051.76	2.68%
30	601318	中国平安	70,863,469.42	2.50%
31	600238	新钢股份	69,289,893.94	2.38%
32	002226	华信国际	67,038,726.10	2.37%
33	002650	加加食品	64,277,117.88	2.27%
34	002341	聚隆科技	64,138,136.26	2.26%
35	002340	格林美	60,833,274.00	2.15%
36	002711	欧陆通	60,728,668.81	2.14%
37	000963	华东医药	59,337,653.49	2.13%
38	002454	松发股份	59,188,320.28	2.12%
39	600183	生益科技	59,346,447.56	2.09%
40	600718	东数网络	56,680,066.18	2.00%

注:本期累计买入金额指买入成交金额(成交单乘以成交数量),不考虑相关交易费用。

8.4.2 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	002050	三花股份	258,012,687.80	9.14%
2	000967	伊泰银行	190,040,267.43	6.74%
3	000063	中兴通讯	176,226,269.49	6.22%
4	601222	林洋电子	169,599,601.36	6.00%
5	600889	王府井	169,408,879.58	5.98%
6	600518	康美药业	160,425,172.72	5.67%
7	000742	一汽轿车	148,066,717.73	4.97%
8	002065	凯创智能	136,466,162.46	4.82%
9	600270	外运发展	135,562,494.13	4.72%
10	300088	长信科技	126,299,596.48	4.46%
11	600660	福耀玻璃	122,387,891.20	4.31%
12	002081	金耀耀	118,216,213.67	4.17%
13	002475	立讯精密	117,040,698.97	3.93%
14	002226	华信国际	107,010,432.13	3.78%
15	600850	东方能源	105,521,648.04	3.74%
16	600016	民生银行	100,521,648.04	3.55%
17	000729	国茂股份	93,479,768.81	3.30%
18	000881	耀世中国	83,620,537.44	2.95%
19	000968	东方能源	77,683,761.30	2.74%
20	002654	松发股份	71,940,760.81	2.54%
21	300037	欣锐达	69,456,301.78	2.40%
22	002077	亿利能源	67,733,912.41	2.39%
23	300051	奥康医疗	66,250,306.46	2.34%
24	000963	华东医药	65,667,778.30	2.32%
25	601238	广汽集团	63,703,015.43	2.26%
26	002650	加加食品	62,631,314.82	2.21%
27	600009	万华化学	62,342,301.09	2.20%
28	600990	中恒电子	61,314,140.52	2.16%
29	600252	西部矿业	59,321,397.89	2.09%
30	300139	福锐网络	59,110,066.30	2.09%
31	600741	华胜天成	58,196,719.54	2.09%
32	600183	生益科技	57,429,231.66	2.07%
33	000001	平安银行	56,065,102.47	2.02%
34	002230	科大讯飞	56,649,547.08	2.00%

注:本期累计卖出金额指卖出成交金额(成交单乘以成交数量),不考虑相关交易费用。

8.4.3 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	卖出股票收入(成交)总额
6,177,546,907.51	6,515,066,283.02

注:上述金额均指成交金额(成交单乘以成交数量),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	32,131,132.20	1.02
2	央行票据	-	-
3	金融债券	609,417,716.00	19.20
其中:政策性金融债		609,417,716.00	19.20
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	待摊费用	4,602,768.00	0.15
8	其他	-	-
9	合计	646,153,556.20	20.42

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
----	------	------	------