大成新锐产业股票型证券投资基金

2012 年度 报告摘要

2012年12月31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
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25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3月20日（基金合同生效日）起至12月31日止。

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金简称	大成新锐产业股票
基金主代码	090018
交易代码	090018
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2012年3月20日
基金管理人	大成基金管理有限公司
基金托管人	中国农业银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	198,688,850.76份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金主要投资于新锐产业中的优质上市公司，分享中国经济增长新锐力量的成长收益，追求基金资产的长期稳健增值。
投资策略	本基金采用自上而下、自下而上相结合的积极主动的投资策略。以宏观经济和政策研究为基础，通过影响证券市场整体运行的内外部因素分析，实施大类资产配置；分析中国经济结构转型背景下社会意识（可持续发展观等）、经济基础、科技进步、消费升级与产业政策等各个方面对新锐产业发展的综合影响，研究各个新锐产业发展所处的阶段特征和商业前景，结合各个新锐产业股票群体的流动性、整体估值水平和动量，实施新锐产业之行业配置。对新锐产业各公司在所属行业的竞争优势进行细致分析（包括技术变迁路径与核心技术、技术制式与商业模式、市场策略与需求融合、人力资源等诸多方面），结合股票基本面指标分析（包括成长性指标、估值水平），精选优质上市公司股票，力求实现基金资产的长期稳健增值。
业绩比较基准	80%×沪深300指数+20%×中证综合债券指数
风险收益特征	本基金为股票型基金，基金的风险与预期收益都要高于混合型基金、债券型基金和货币市场基金，属于证券投资基金中较高风险、较高预期收益的品种。

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3月20日(基金合同生效日)-2012年12月31日
本期已实现收益	-8,741,075.10
本期利润	2,633,388.52
加权平均基金份额本期利润	0.0056
本期基金份额净值增长率	-0.90%
3.1.2 期末数据和指标	2012年末
期末可供分配基金份额利润	-0.0683
期末基金资产净值	196,918,810.16
期末基金份额净值	0.991

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。

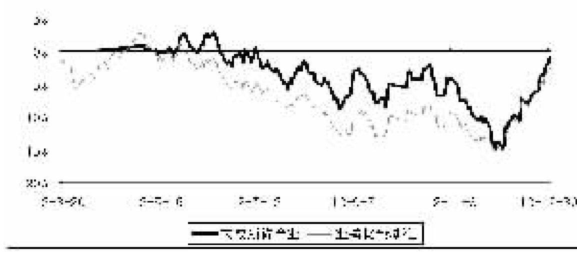
3、本基金合同于2012年3月20日生效，截至报告日本基金合同生效未满一年。

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	4.10%	1.14%	8.16%	1.02%	-4.06%	0.12%
过去六个月	0.00%	1.12%	2.27%	0.99%	-2.27%	0.13%
自基金合同生效起至今	-0.90%	0.97%	-2.48%	0.96%	1.58%	0.01%

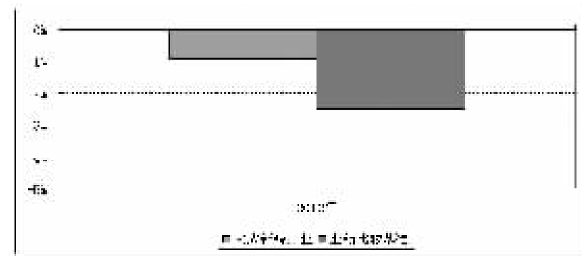
3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较



注：1、本基金合同于2012年3月20日生效，截至报告日本基金合同生效未满一年。

2、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 自基金合同生效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：2012年净值增长率表现期间为2012年3月20日(基金合同生效日)至2012年12月31日。

3.3 过去三年基金的利润分配情况

本基金自2012年3月20日(基金合同生效日)以来未有收益分配事项。

§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		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
刘安田先生	本基金基金经理	2012年3月20日	-	9年	金融学硕士。曾任职于中国证券研究设计中心、友邦华泰基金管理公司、工银瑞信基金管理公司。曾担任行业研究员、宏观经济及策略研究员、基金经理助理。2008年8月加入大成基金，曾任大成基金管理有限公司研究部总监助理。2010年4月7日起任大成精选增值混合型证券投资基金基金经理。2012年3月20日起任大成新锐产业股票型证券投资基金基金经理。2013年3月8日起任景宏证券投资基金基金经理。具有基金从业资格。国籍：中国
袁巍先生	本基金基金经理助理	2012年8月7日	-	3年	经济学硕士，2009年6月加入大成基金管理有限公司，现任研究部新兴产业行业研究主管。2012年8月7日至2013年3月11日担任大成精选增值混合型证券投资基金和大成新锐产业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。

3、本基金基金经理助理袁巍先生于2013年3月11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》、《大成新锐产业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，大成新锐产业股票型证券投资基金的投资范围、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，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间股票交易存在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

回顾2012年，是艰难曲折的一年，但也是全球经济弱复苏的一年。从全球各区域来看，美国表现最为强劲，就业情况改善明显，房地产市场企稳回升，制造业表现突出。欧洲、日本虽持续衰退但已度过最差时期，未来有望在持续宽松货币政策刺激下逐步走稳。

国内经济也在年末呈现出一些积极的复苏信号，工业、投资数据均得到改善。尽管大宗商品价格、房地产竣工面积和制造业固定资产投资数据势头不一，但从目前数据来看，周期性复苏的势头基本上得以确定。在微观层面上，零售、汽车销售、和地产数据均加速增长。同时，新领导的上台陆续推出的深化改革动作使得整体市场对下一次改革红利的期待再一次升温，推动市场整体信心回升。

这些映射在资本市场上，全球市场基本在2012年大部分以上涨结束。2012年全年道琼斯指数收涨7.26%，纳斯达克指数收涨15.91%，富时100收涨5.84%，德国DAX收涨29.06%，日经指数收涨22.94%。而上证指数依靠12月单月14.60%的涨幅最终全年收涨3.17%。

上证指数主要的上涨集中在12月单月，从市场的上涨结构中，涨幅较好的板块集中在地产、金融、建筑、汽车、家电，基本上为早周期板块，个股方面一些超跌股和概念股也大幅上涨。虽然本基金未能完全按照指数高贝塔的配置，白酒由于塑化剂事件行业整体大幅跑输指数。尽管本基金成立于2012年3月份的市场高点，但本基金通过精选个股和行业配置，基本上没有给投资者带来损失。

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0.991元，本报告期基金份额净值增长率为-0.90%，同期业绩比较基准收益率为-2.48%，高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

从中国的情况来看，经济复苏势头预计将持续，经济回升主要得益于内需改善，消费潜力逐渐释放，基础设施和服务业投资加速带动投资回升，缓和制造业产能过剩和房地产调控带来的压力。但由于中国长期的问题并没有得到改变，后续要密切关注通胀的变化。

预计工业企业盈利在经历了2012年断崖式下降后开始恢复，但需要明确的是这种恢复并不会呈现出一种过去十年持续增长的态势。目前工业企业的ROE回升在未来更倾向于是一种震荡回升。中国经济正处于新旧周期交替期，经济增速回落，政策不断放松，但经济却难以恢复往昔活力，主要是潜在增速回落。从这一点来看，2013年并不具备出现大牛市启动的条件，目前判断更多是一种修复性的震荡回升，但整体走势要好于2012年。

基于以上，本基金并不倾向于全面布局整条投资产业链，优先选择去库存比较彻底的行业，在市场完全预期工业企业盈利恢复的时候开始回避一些产能保有量较大行业。同时，基于对转型新经济的预期，本基金将继续维持对金融、医疗保健、TMT以及高端装备制造业等新经济中个股的配置力度，并且随着经济的波动进行仓位和行业的轮动。

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

在托管大成新锐产业股票型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《大成新锐产业股票型证券投资基金基金合同》、《大成新锐产业股票型证券投资基金托管协议》的约定，对大成新锐产业股票型证券投资基金管理人—大成基金管理有限公司2012年3月20日（基金合同生效日）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大成新锐产业股票型证券投资基金的投资运作、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大成新锐产业股票型证券投资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2012年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：大成新锐产业股票型证券投资基金

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
资产：	
银行存款	29,761,115.16
结算备付金	209,201.57
存出保证金	65,054.17
交易性金融资产	163,924,658.84
其中：股票投资	163,924,658.84
基金投资	-
债券投资	-
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	3,695,884.30
应收利息	6,492.61
应收股利	-
应收申购款	870.62
递延所得税资产	-
其他资产	-
资产总计	197,663,277.27
负债和所有者权益	本期末 2012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	-
应付赎回款	209,146.34
应付管理人报酬	234,315.12
应付托管费	39,052.50
应付销售服务费	-
应付交易费用	111,164.94
应交税费	-
应付利息	-
应付利润	-
递延所得税负债	-
其他负债	150,788.21
负债合计	744,467.11
所有者权益：	
实收基金	198,688,850.76
未分配利润	-1,770,040.60
所有者权益合计	196,918,810.16
负债和所有者权益总计	197,663,277.27

注：1. 报告截止日2012年12月31日，基金份额净值0.991元，基金份额总额198,688,850.76份。

2. 本财务报表的实际编制期间为2012年3月20日(基金合同生效日)至2012年12月31日。

7.2 利润表

会计主体：大成新锐产业股票型证券投资基金

本报告期：2012年3月20日(基金合同生效日)至2012年12月31日

单位：人民币元

项目	本期 2012年3月20日(基金合同生效日)至2012年12月31日
一、收入	9,888,314.11
1.利息收入	8,192,891.68
其中：存款利息收入	8,192,891.68
债券利息收入	-
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）	-12,006,438.83
其中：股票投资收益	-13,965,091.98
基金投资收益	-
债券投资收益	-
资产支持证券投资收益	-
衍生工具收益	-
股利收益	1,958,653.15
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	11,374,463.62
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	2,327,397.64
减：二、费用	7,254,925.59
1.管理人报酬	5,408,159.83
2.托管费	901,359.98
3.销售服务费	-
4.交易费用	631,338.70
5.利息支出	-
其中：卖出回购金融资产支出	-
6.其他费用	314,067.08
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）	2,633,388.52
减：所得税费用	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）	2,633,388.52

7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：大成新锐产业股票型证券投资基金

本报告期：2012年3月20日(基金合同生效日)至2012年12月31日

单位：人民币元

项目	本期 2012年3月20日(基金合同生效日)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）	2,049,911,272.87	-	2,049,911,272.87
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	2,633,388.52	2,633,388.52
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）	-1,851,222,422.11	-4,403,429.12	-1,855,625,851.23
其中：1.基金申购款	6,433,223.26	-159,887.81	6,273,335.45
2.基金赎回款	-1,857,655,645.37	-4,243,541.31	-1,861,899,186.68
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）	198,688,850.76	-1,770,040.60	196,918,810.16

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：

王颢	刘彩晖	范瑛
基金管理公司负责人	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 基金基本情况

大成新锐产业股票型证券投资基金(以下简称“本基金”)经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2011]第1751号《关于核准大成新锐产业股票型证券投资基金募集的批复》核准，由大成基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《大成新锐产业股票型证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式，存续期限不定，首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币2,049,502,095.20元，业经普华永道中天会计师事务所有限公司普华永道中天验字(2012)第060号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《大成新锐产业股票型证券投资基金基金合同》于2012年3月20日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为2,049,911,272.87份基金份额，其中认购资金利息折合409,177.67份基金份额。本基金的基金管理人为大成基金管理有限公司，基金托管人为中国农业银行股份有限公司。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《大成新锐产业股票型证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的股票(含中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票)、债券(含中期票据)、货币市场工具、银行存款、权证、资产支持证券、股指期货及法律法规或监管机构允许基金投资的其他金融工具(但须符合中国证监会的相关规定)。本基金股票资产占基金资产净值的比例范围为60%-95%；现金以及到期日在一年以内的政府债券的比例不低于基金资产净值的5%；权证、股指期货及其他金融工具的投资比例依照法律法规或监管机构的规定执行；本基金将80%以上的股票资产投资于受益于新锐产业相关股票。本基金投资业绩比较基准为：沪深300指数×80%+中证综合债券指数×20%。

本财务报表由本基金的基金管理人大成基金管理有限公司于2013年3月25日批准报出。

7.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于2006年2月15日颁布的《企业会计准则—基本准则》和38项具体会计准则、其后颁布的企业会计准则应用指南、企业会计准则解释以及其他相关规定(以下合称“企业会计准则”)、中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露XBRL模板第3号<年度报告和半年度报告>》、中国证券投资基金业协会颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《大成新锐产业股票型证券投资基金 基金合同》和在财务报表附注7.4.4所列示的中国证监会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2012年3月20日(基金合同生效日)至2012年12月31日止期间 财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金 2012 年12月31日 的财务状况以及 2012年3月20日(基金合同生效日)至2012年12月31日止期间的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

7.4.4 重要会计政策和会计估计

7.4.4.1 会计年度

本基金会计年度为公历1月1日起至12月31日止。本期财务报表的实际编制期间为2012年3月20日(基金合同生效日)至2012年12月31日。

7.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

(1)金融资产的分类

金融资产于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、应收款项、可供出售金融资产及持有至到期投资。金融资产的分类取决于本基金对金融资产的持有意图和持有能力。本基金现无金融资产分类为可供出售金融资产及持有至到期投资。

本基金目前以交易目的持有的股票投资、债券投资和衍生工具(主要为权证投资)分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。除衍生工具所产生的金融资产在资产负债表中以衍生金融资产列示外，以公允价值计量且其公允价值变动计入损益的金融资产在资产负债表中以交易性金融资产列示。

本基金持有的其他金融资产分类为应收款项，包括银行存款和其他各类应收款项等。应收款项是指在活跃市场中没有报价、回收金额固定或可确定的非衍生金融资产。

(2)金融负债的分类

金融负债于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债及其他金融负债。本基金目前暂无金融负债分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。本基金持有的其他金融负债包括和其他各类应付款项等。

7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

金融资产或金融负债于本基金成为金融工具合同的一方时，按公允价值在资产负债表内确认。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，取得时发生的相关交易费用计入当期损益；对于支付的价款中包含的债券起息日或上次除息日至购买日止的利息，单独确认为应收项目。应收款项和其他金融负债的相关交易费用计入初始确认金额。

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，按照公允价值进行后续计量；对于应收款项和其他金融负债采用实际利率法，以摊余成本进行后续计量。

金融资产满足下列条件之一的，予以终止确认：(1) 收取该金融资产现金流量的合同权利终止；(2) 该金融资产已转移，且本基金将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方；或者(3) 该金融资产已转移，虽然本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬，但是放弃了对该金融资产控制。

金融资产终止确认时，其账面价值与收到的对价的差额，计入当期损益。

当金融负债的现时义务全部或部分已经解除时，终止确认该金融负债或义务已解除的部分。终止确认部分的账面价值与支付的对价之间的差额，计入当期损益。

7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

本基金持有的股票投资、债券投资和衍生工具(主要为权证投资)按如下原则确定公允价值并进行估值：

(1)存在活跃市场的金融工具按其估值日的市场交易价格确定公允价值；估值日无交易，但最近交易日后经济环境未发生重大变化且证券发行机构未发生影响证券价格的重大事件的，按最近交易日的市场交易价格确定公允价值。

(2)存在活跃市场的金融工具，如估值日无交易且最近交易日后经济环境发生了重大变化，参考类似投资品种的现行市价及重大变化等因素，调整最近交易市价以确定公允价值。

(3)当金融工具不存在活跃市场，采用市场参与者普遍认同且被以往市场实际交易价格验证具有可靠性的估值技术确定公允价值。估值技术包括参考熟悉情况并自愿交易的各方最近进行的市场交易中使用的价格、参照实质上相同的其他金融工具的当前公允价值、现金流量折现法和期权定价模型等。采用估值技术时，尽可能最大程度使用市场参数，减少使用与本基金特定相关的参数。

7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

本基金持有的资产和承担的负债基本为金融资产和金融负债。当本基金依法1) 具有抵销已确认金额的法定权利且该种法定权利现在是可执行的；且2) 交易双方准备按净额结算时，金融资产与金融负债按抵销后的净额在资产负债表中列示。

7.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行基金份额所募集的总金额在扣除损益平准金分摊部分后的余额。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。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

7.4.4.8 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)。

7.4.4.9 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，其公允价值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。

7.4.4.10 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。

7.4.4.11 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，但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。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。

7.4.4.12 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。

7.4.4.13 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股票投资的公允价值时采用的估值方法及其关键假设如下：

对于证券交易所上市的股票，若出现重大事项停牌或交易不活跃(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《中国证券业协会基金估值工作小组关于停牌股票估值的参考方法》提供的指数收益法等估值技术进行估值。

7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

7.4.5.1 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。

7.4.5.2 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。

7.4.5.3 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。

7.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2005]102号《关于股息红利个人所得税有关政策的通知》、财税[2005]107号《关于股息红利有关个人所得税政策的补充通知》、财税[2008]1号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》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。

(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，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。对基金取得的股票的股息、红利收入，由上市公司在向基金派发股息、红利时暂减按50%计入个人应纳税所得额，依照现行税法规定即20%代扣代缴个人所得税。

(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。

7.4.7 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
中国农业银行股份有限公司（“中国农业银行”）	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。

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。

7.4.8 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.8.1 通过关联方交易单元进行的交易

7.4.8.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2012年3月20日(基金合同生效日)至2012年12月31日	
	成交金额	占当期股票成交总额的比例
光大证券	112,165,164.22	23.73%

7.4.8.1.2 权证交易

无。

7.4.8.1.3 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2012年3月20日(基金合同生效日)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	95,758.18	23.60%	-	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。

7.4.8.2 关联方报酬

7.4.8.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2012年3月20日(基金合同生效日)至2012年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	5,408,159.83
其中：支付销售机构的客户维护费	2,109,072.43

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。

7.4.8.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2012年3月20日(基金合同生效日)至2012年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	901,359.98

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。

7.4.8.3 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。

7.4.8.4 各关联方投资本基金的情况

本报告期内本基金未发生各关联方投资本基金的情况。

7.4.8.5 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 2012年3月20日(基金合同生效日)至2012年12月31日	
	期末余额	当期利息收入
中国农业银行	29,761,115.16	8,189,233.65

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。

7.4.8.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本报告期内本基金未在承销期内参与关联方承销证券。

7.4.8.7 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。

7.4.9 期末（ 2012年12月31日 ）本基金持有的流通受限证券

7.4.9.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

7.4.9.1.1 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
000826	桑德环境	12/12/31	13/01/09	配股申购	12.71	22.99	90,000	1,143,900.00	2,069,100.00	-

7.4.9.2 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	12/08/27	公告重大事项	9.69	-	-	250,000	3,024,039.60	2,422,500.00	-

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。

7.4.9.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

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	163,924,658.84	82.93
	其中：股票	163,924,658.84	82.93
2	固定收益投资	-	0.00
	其中：债券	-	0.00
	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	29,970,316.73	15.16
6	其他各项资产	3,768,301.70	1.91
7	合计	197,663,277.27	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	1,852,282.08	0.94
B	采掘业	3,064,600.00	1.56
C	制造业	80,071,460.44	40.66
C0	食品、饮料	16,950,375.40	8.61
C1	纺织、服装、皮毛	3,152,821.72	1.60
C2	木材、家具	-	0.00
C3	造纸、印刷	-	0.00
C4	石油、化学、塑胶、塑料	3,165,100.00	1.61
C5	电子	4,489,910.24	2.28
C6	金属、非金属	7,619,558.00	3.87
C7	机械、设备、仪表	33,807,036.01	17.17
C8	医药、生物制品	10,886,659.07	5.53
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	3,097,500.00	1.57
F	交通运输、仓储业	-	0.00
G	信息技术业	8,783,818.50	4.46
H	批发和零售贸易	-	0.00
I	金融、保险业	34,374,103.12	17.46
J	房地产业	16,651,000.00	8.46
K	社会服务业	10,503,219.50	5.33
L	传播与文化产业	5,526,675.20	2.81
M	综合类	-	0.00
	合计	163,924,658.84	83.24

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	601318	中国平安	199,937	9,055,146.73	4.60
2	000826	桑德环境	390,000	8,966,100.00	4.55
3	002230	科大讯飞	289,895	8,783,818.50	4.46
4	600837	海通证券	699,903	7,174,005.75	3.64
5	600519	贵州茅台	34,000	7,106,680.00	3.61
6	000656	金科股份	450,000	6,525,000.00	3.31
7	601601	中国太保	269,950	6,073,875.00	3.08
8	000568	泸州老窖	169,901	6,014,495.40	3.05
9	000024	招商地产	200,000	5,978,000.00	3.04
10	600104	上汽集团	330,000	5,821,200.00	2.96

注：投资者欲了解本报告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.con.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	600519	贵州茅台	11,726,906.39	5.96
2	000826	桑德环境	10,585,021.35	5.38
3	000651	格力电器	8,803,743.66	4.47
4	600518	康美药业	8,465,954.93	4.30
5	601318	中国平安	8,289,886.37	4.21
6	000012	南 玻A	7,962,692.79	4.04
7	600739	辽宁成大	7,906,841.34	4.02
8	600036	招商银行	7,889,016.20	4.01
9	002482	广田股份	7,204,996.46	3.66
10	000024	招商地产	7,052,815.11	3.58
11	600837	海通证券	7,032,347.70	3.57
12	600406	国电南瑞	6,967,874.97	3.54
13	002230	科大讯飞	6,798,788.18	3.45
14	002475	立讯精密	6,705,201.15	3.41
15	000417	合肥百货	6,657,620.44	3.38
16	000656	金科股份	6,265,235.60	3.18
17	000858	五 粮 液	5,937,239.86	3.02
18	300105	龙源技术	5,857,546.00	2.97
19	601601	中国太保	5,642,521.22	2.87
20	600742	一汽富维	5,629,984.21	2.86
21	000937	冀中能源	5,621,256.96	2.85
22	000568	泸州老窖	5,608,027.81	2.85
23	000625	长安汽车	5,536,604.83	2.81
24	000401	冀东水泥	5,503,434.46	2.79
25	600362	江西铜业	5,271,362.84	2.68
26	600104	上汽集团	5,057,138.78	2.57
27	002154	报 喜 鸟	4,840,454.17	2.46
28	600549	厦门钨业	4,635,554.20	2.35
29	002421	达实智能	4,451,594.25	2.26
30	600970	中材国际	4,411,788.34	2.24
31	601336	新华保险	4,264,662.44	2.17
32	600859	王府井	4,210,114.71	2.14
33	600079	人福医药	4,163,467.83	2.11
34	600261	阳光照明	3,995,248.01	2.03

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。

8.4.2 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	300105	龙源技术	6,394,392.65	3.25
2	600739	辽宁成大	6,084,245.40	3.09
3	000651	格力电器	5,621,332.34	2.85
4	600742	一汽富维	5,456,228.20	2.77
5	002482	广田股份	5,296,327.42	2.69
6	600406	国电南瑞	5,178,696.04	2.63
7	600036	招商银行	4,945,407.95	2.51
8	002421	达实智能	4,903,049.25	2.49
9	600557	康缘药业	4,655,386.69	2.36
10	600518	康美药业	4,653,966.75	2.36
11	000012	南 玻A	4,276,539.62	2.17
12	000625	长安汽车	4,222,140.65	2.14
13	002475	立讯精密	4,158,709.92	2.11
14	600519	贵州茅台	4,082,142.31	2.07
15	600362	江西铜业	3,942,247.30	2.00
16	000401	冀东水泥	3,858,300.72	1.96
17	600859	王府井	3,830,286.87	1.95
18	300115	长盈精密	3,797,394.04	1.93
19	000417	合肥百货	3,726,644.94	1.89
20	000858	五 粮 液	3,607,479.57	1.83

注：本项中“本期累计卖出金额”按卖出成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

8.4.3 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	320,170,684.92
卖出股票收入（成交）总额	153,655,397.72

注：本项中“买入股票的成本(成交)总额”及“卖出股票的收入(成交)总额”均按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

8.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名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。

8.8 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

8.9 投资组合报告附注

8.9.1 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、处罚的情形。

8.9.2 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股票。

8.9.3 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	65,054.17
2	应收证券清算款	3,695,884.30
3	应收股利	-
4	应收利息	6,492.61
5	应收申购款	870.62
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	3,768,301.70

8.9.4 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。

8.9.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值	占基金资产净值比例（%）	流通受限情况说明
1	000826	桑德环境	2,069,100.00	1.05	配股锁定；上市日：2013年1月9日

8.9.6 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。

§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
6,518	30,483.10	20,711,530.97	10.42%	177,977,319.79	89.58%

注：持有人户数为有效户数，即存量份额大于零的账户数。

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
基金管理公司所有从业人员持有本基金	3,954.00	0.0020%

注：1、本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有该基金份额总量的数量区间：0。

2、本基金的基金经理持有本基金份额总量的数量区间：0。

§10 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2012年3月20日 ）基金份额总额	2,049,911,272.87
本报告期期初基金份额总额	-
本报告期基金总申购份额	6,433,223.26
减：本报告期基金总赎回份额	1,857,655,645.37
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	198,688,850.76

§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

报告期内没有涉及本基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动。

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有限公司，本年度应支付的审计费用为8万元整。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。

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

11.7.1 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	112,165,164.22	23.73%	95,758.18	23.60%	-
中信建投	3	95,104,604.73	20.12%	77,665.18	19.14%	-
国泰君安	2	52,428,603.34	11.09%	43,939.82	10.83%	-
华泰证券	1	44,816,233.34	9.48%	39,657.86	9.78%	-
西部证券	1	27,029,248.76	5.72%	23,528.54	5.80%	-
招商证券	3	25,866,164.72	5.47%	22,179.67	5.47%	-
英大证券	1	22,690,313.32	4.80%	20,088.36	4.95%	-
兴业证券	2	22,074,744.60	4.67%	19,461.57	4.80%	-
南京证券	1	19,726,224.83	4.17%	17,958.64	4.43%	-
方正证券	1	15,569,309.11	3.29%	14,174.35	3.49%	-
申银万国	1	11,817,177.48	2.50%	10,758.13	2.65%	-
国金证券	2	8,174,680.71	1.73%	6,937.89	1.71%	-
平安证券	1	4,355,937.20	0.92%	3,965.73	0.98%	-
华创证券	1	3,648,229.09	0.77%	3,228.32	0.80%	-
国盛证券	1	2,707,744.00	0.57%	2,294.79	0.57%	-
银河证券	3	2,396,147.41	0.51%	2,181.47	0.54%	-
长城证券	2	1,697,003.50	0.36%	1,545.01	0.38%	-
瑞银证券	1	414,652.28	0.09%	377.52	0.09%	-
上海证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
齐鲁证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
世纪证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
天风证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
浙商证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
中金公司	2	-	0.00%	-	0.00%	-
中信证券	2	-	0.00%	-	0.00%	-
中银国际	2	-	0.00%	-	0.00%	-
东北证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
安信证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
北京高华	1	-	0.00%	-	0.00%	-
广发证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
民生证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
国信证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
海通证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
红塔证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
宏源证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-

注：根据中国证监会颁布的《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：

（1）财务状况良好，最近一年无重大违规行为；

（2）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；

（3）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；

（4）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；

（5）能提供投资组合运作、管理所需的其他券商服务；

（6）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专用席位。

以上所有交易单元均为本报告期新增交易单元。

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

无。

大成基金管理有限公司
2013年3月26日