# 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

## 2014 半年度 报告摘要

2014年6月30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：2014年8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。本半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2014年8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。

本半年度报告摘要摘自半年度报告正文，投资者欲了解详细内容，应阅读半年度报告正文。

本报告中财务资料未经审计 。

本报告期自2014年01月01日起至06月30日止。

### §2 基金简介

2.1 基金基本情况

| | |
|---|---|
| 基金简称 | 大成深证成长40ETF联接 |
| 基金主代码 | 090012 |
| 交易代码 | 090012 |
| 基金运作方式 | 契约型开放式 |
| 基金合同生效日 | 2010年12月21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 | 1,239,358,974.49份 |
| 基金合同存续期 | 不定期 |

2.1.1 目标基金基本情况

| | |
|---|---|
| 基金名称 | 深证成长40交易型开放式指数证券投资基金 |
| 基金主代码 | 159906 |
| 基金运作方式 | 交易型开放式(ETF) |
| 基金合同生效日 | 2010年12月21日 |
| 基金份额上市的证券交易所 | 深圳证券交易所 |
| 上市日期 | 2011年2月23日 |
| 基金管理人名称 | 大成基金管理有限公司 |
| 基金托管人名称 | 中国农业银行股份有限公司 |

2.2 基金产品说明

| | |
|---|---|
| 投资目标 | 通过投资于深证成长40交易型开放式指数证券投资基金，紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差最小化。 |
| 投资策略 | 本基金以深证成长40ETF作为其主要投资标的，方便特定的客户群通过本基金投资深证成长40ETF。本基金并不参与深证成长40ETF的管理。本基金主要以一级市场申购的方式投资于目标ETF，获取基金份额净值上涨带来的收益；在目标ETF基金份额二级市场交易流动性较好的情况下，也可以通过二级市场买卖目标ETF的基金份额。 |
| 业绩比较基准 | 深证成长40价格指数×95%+银行活期存款利率(税后)×5% |
| 风险收益特征 | 本基金属股票基金，预期风险与预期收益高于混合基金、债券基金与货币市场基金。本基金为指数型基金，紧密跟踪标的指数，具有与标的指数以及标的指数所代表的股票市场相似的风险收益特征。 |

2.2.1 目标基金产品说明

| | |
|---|---|
| 投资目标 | 紧密跟踪标的指数，追求与标的指数相似的投资回报。 |
| 投资策略 | 本基金主要采取完全复制法，即完全按照标的指数的成份股组成及其权重构建投资组合，并根据标的指数成份股及其权重的变动进行相应调整。当预期指数成份股发生调整和成份股发生配股、增发、分红等行为时，或因基金的申购和赎回等对本基金跟踪标的指数的效果可能带来影响时，或因某些特殊情况导致流动性不足时，或其他原因导致无法有效复制和跟踪标的指数时，基金管理人可以对投资组合管理进行适当变通和调整，从而使得投资组合紧密地跟踪标的指数。 |
| 业绩比较基准 | 深证成长40价格指数 |
| 风险收益特征 | 本基金属股票基金，预期风险与预期收益高于混合基金、债券基金与货币市场基金。本基金为指数型基金，主要采用完全复制法跟踪标的指数的表现，具有与标的指数以及标的指数所代表的股票市场相似的风险收益特征。 |

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 | 010-68121816 |

2.4 信息披露方式

| | |
|---|---|
| 登载基金半年度报告正文的管理人互联网网址 | http://www.dcfund.com.cn |
| 基金半年度报告备置地点 | 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<br>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 主要财务指标和基金净值表现

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 | 报告期(2014年1月1日 - 2014年6月30日 ) |
|---|---|
| 本期已实现收益 | -53,278,684.12 |
| 本期利润 | -84,989,385.42 |
| 加权平均基金份额本期利润 | -0.0630 |
| 本期基金份额净值增长率 | -7.92% |
| 3.1.2 期末数据和指标 | 报告期末( 2014年6月30日 ) |
| 期末可供分配基金份额利润 | -0.2907 |
| 期末基金资产净值 | 879,109,545.08 |
| 期末基金份额净值 | 0.709 |

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。

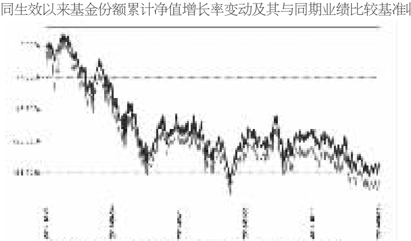
2.所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

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 |
|---|---|---|---|---|---|---|
| 过去一个月 | 2.01% | 0.91% | 1.40% | 0.92% | 0.61% | -0.01% |
| 过去三个月 | 2.16% | 0.92% | 1.15% | 0.91% | 1.01% | 0.01% |
| 过去六个月 | -7.92% | 1.15% | -8.61% | 1.15% | 0.69% | 0.00% |
| 过去一年 | -1.66% | 1.17% | -3.14% | 1.18% | 1.48% | -0.01% |
| 过去三年 | -23.10% | 1.22% | -25.23% | 1.23% | 2.13% | -0.01% |
| 自基金合同生效起至今 | -29.10% | 1.17% | -33.40% | 1.23% | 4.30% | -0.06% |

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：按基金合同规定，本基金自基金合同生效起6个月内为建仓期。截至报告期末，本基金各项资产配置比例已符合基金合同的规定。

### §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6月30日，本基金管理人共管理1只封闭式证券投资基金：景福证券投资基金，4只ETF及1只ETF联接基金：深证成长40交易型开放式指数证券投资基金、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、大成中证500沪市交易型开放式指数证券投资基金、大成中证100交易型开放式指数证券投资基金、大成中证500深市交易型开放式指数证券投资基金，1只QDII基金：大成标普500等权重指数证券投资基金及37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、大成内需增长股票型证券投资基金、大成消费主题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、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、大成中小盘股票型证券投资基金(LOF)、大成健康产业股票型证券投资基金、大成信用增利一年定期开放债券型证券投资基金、大成灵活配置混合型证券投资基金、大成招财宝货币市场基金、大成景益平稳收益混合型证券投资基金。

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 | | |
| 苏秉毅先生 | 本基金基金经理 | 2012年2月9日 | - | 10年 | 经济学硕士。2004年9月至2008年5月就职于华夏基金管理有限公司基金运作部。2008年加入大成基金管理有限公司，历任产品设计师、高级产品设计师、基金经理助理、基金经理。2011年3月3日至2012年2月8日担任深证成长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基金经理助理。2012年8月28日至2014年1月23日担任大成中证500沪市交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理。2014年1月24日至2014年2月17日任大成健康产业股票型证券投资基金基金经理。2012年2月9日起担任深证成长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基金经理。2012年8月24日起任中证500沪市交易型开放式指数证券投资基金基金经理。2013年1月1日开始兼任大成沪深300指数证券投资基金基金经理。2013年2月7日起任大成中证100交易型开放式指数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助理。具有基金从业资格。国籍：中国 |
| 谌湛先生 | 本基金基金经理助理 | 2013年1月4日 | - | 5年 | 金融工程硕士。2009年加入大成基金管理有限公司，历任金融工程师、数量投资分析师。2013年1月4日起担任深证成长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基金经理助理。2013年9月12日起担任大成中证500深市交易型开放式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。

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》、《大成深证成长40交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金合同》和其他有关法律法规的规定，在基金管理运作中，大成深证成长40交易型开放式指数证券投资基金联接基金的投资范围、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些组合间的成交价格差异较大。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。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

公司风险管理部定期对公司旗下所有投资组合间同向交易、反向交易等可能存在异常交易的行为进行分析。2014年上半年公司旗下主动投资组合间股票交易存在11笔同日反向交易，原因是投资组合投资策略需要。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3笔，原因为投资策略需要；投资组合间存在1笔债券同日反向交易，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；投资组合间虽然存在同向交易行为，但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。

4.4 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

今年上半年，经济形势以及政府的思路都有所转变。起初，在促转型的指导思想下，政府对宏观经济增速下滑表现出较高的容忍度。然而，随着实体经济不断恶化，二季度政府宏观调控的思路产生了一定的变化，“稳增长”的目标权重有所增加，体现为连续的微刺激加码投资、定向宽松、调整存贷比等一系列政策。上述措施也起到了一定的作用，五、六月数据表明，宏观经济下滑已经得到了缓解，尽管断言宏观经济见底回升还为时尚早。

A股市场的走势也忠实反映了宏观经济基本面走势以及政策放松的效果，先是震荡下行，然后在重要指数点位附近反复震荡筑底。A股市场基准沪深300指数下跌7.08%。存量资金博弈的特征依旧明显，行业和风格轮换较为频繁。总体来说，以创业板为代表的成长股依然仍跑赢大市。在行业方面，计算机、通信、电子等行业领先大市，受消息面刺激的国防军工也有不错表现，而煤炭、农林牧渔、非银金融等行业则跌幅较深。

本基金标的指数深证成长40指数下跌9.09%，跌幅高于大盘。上半年，根据基金合同的约定，投资于目标ETF份额的资产不低于基金资产净值的90%，通过完全复制法等方式，使联接基金和目标ETF的走势基本一致。本报告期年化跟踪误差1.49%，日均偏离度0.07%，各项操作与指标均符合基金合同的要求。

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0.709元，本报告期基金份额净值增长率为-7.92%，同期业绩比较基准收益率为-8.61%，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

宏观经济下季度仍然处于探底、转型的过程当中，总体下行趋势一时难以改变，而政府的应对方式及其政策的效果则存在较高的不确定性。虽然之前密集的“托底”政策确实起到了稳增长的效果，但其代价则是延缓了改革进程，而且依靠投资拉动经济的传统刺激方式边际作用递减，长期来看该政策不可延续。下一阶段，只要社会就业情况不触及政府预期区间下限，即使经济增速下滑，大规模的刺激政策也不会出台。此外，经济转型无法迅速完成，新兴行业短期还未能构成重要支撑，实体经济仍然不能乐观。

至于货币政策，其症结在于央行释放的流动性难以惠及实体经济。由于制度性的原因，资源要素配置被扭曲，央行通过各种手段释放的流动性主要流向效率较低的领域，总体社会融资成本依然高企。上述情况短期内难以改变，下季度资金面仍将维持结构性宽松的局面。

对于A股市场，基本面和资金面均不构成牛市的基础，除非有重大制度性变革，就此反转的可能性极低。另一方面，当前大市处于低位，且IPO重启已经落地，市场向下空间也相对有限。预计下季度A股市场仍然呈震荡态势，但波动率有望走出低谷。股市增量资金难觅，存量博弈的格局难以打破，以创业板为代表的成长股、概念股将成为投资者博弈的主要对象。在波动增大的情况下，半年报业绩对上述高估值股票尤为关键。

组合管理上，我们将严格遵守基金合同约定，保持目标ETF份额不低于基金资产净值的90%，使联接基金和目标ETF的走势基本一致，力争实现紧密跟踪标的指数的投资目标。若由于申购赎回等原因需要调整组合，我们将主要通过一级市场申购或赎回的方式，增持或减持目标ETF份额。

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 6 月30 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 托管人对本半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半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 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：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

报告截止日：2014年6月30日

单位：人民币元

| 资 产 | 本期末<br>2014年6月30日 | 上年度末<br>2013年12月31日 |
|---|---|---|
| 资 产： | | |
| 银行存款 | 52,414,307.58 | 65,852,210.38 |
| 结算备付金 | - | - |
| 存出保证金 | 80,406.26 | 173,492.58 |
| 交易性金融资产 | 827,655,000.00 | 1,059,944,000.00 |
| 其中：股票投资 | - | - |
| 基金投资 | 827,655,000.00 | 1,059,944,000.00 |
| 债券投资 | - | - |
| 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 | - | 1,227,172.09 |
| 应收利息 | 9,597.10 | 13,476.10 |
| 应收股利 | - | - |
| 应收申购款 | 1,971.05 | 3,458.57 |
| 递延所得税资产 | - | - |
| 其他资产 | - | - |
| 资产总计 | 880,161,281.99 | 1,127,213,809.72 |
| 负债和所有者权益 | 本期末<br>2014年6月30日 | 上年度末<br>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 | - | - |
| 应付证券清算款 | 10,932.00 | - |
| 应付赎回款 | 766,818.69 | 1,296,641.34 |
| 应付管理人报酬 | 24,026.43 | 30,143.17 |
| 应付托管费 | 4,805.27 | 6,028.63 |
| 应付销售服务费 | - | - |
| 应付交易费用 | 76,376.87 | 176,961.93 |
| 应交税费 | - | - |
| 应付利息 | - | - |
| 应付利润 | - | - |
| 递延所得税负债 | - | - |
| 其他负债 | 168,777.65 | 140,391.98 |
| 负债合计 | 1,051,736.91 | 1,650,167.05 |
| 所有者权益： | | |
| 实收基金 | 1,239,358,974.49 | 1,462,685,288.34 |
| 未分配利润 | -360,249,429.41 | -337,121,645.67 |
| 所有者权益合计 | 879,109,545.08 | 1,125,563,642.67 |
| 负债和所有者权益总计 | 880,161,281.99 | 1,127,213,809.72 |

注：报告截止日2014年6月30日，基金份额净值0.709元，基金份额总额1,239,358,974.49份。

6.2 利润表

会计主体：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

本报告期：2014年1月1日至2014年6月30日

单位：人民币元

| 项 目 | 本期<br>2014年1月1日至2014年6月30日 | 上年度可比期间<br>2013年1月1日至2013年6月30日 |
|---|---|---|
| 一、收入 | -84,319,666.22 | -54,833,959.40 |
| 1.利息收入 | 220,018.65 | 303,786.59 |
| 其中：存款利息收入 | 220,018.65 | 303,786.59 |
| 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) | -52,833,559.80 | -24,902,344.15 |
| 其中：股票投资收益 | -1,984,618.09 | 777,551.54 |
| 基金投资收益 | -50,923,268.50 | -25,694,834.25 |
| 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 | 74,326.79 | 14,938.56 |
| 3.公允价值变动收益(损失以“-”号填列) | -31,710,701.30 | -30,245,161.67 |
| 4.汇兑收益(损失以“-”号填列) | - | - |
| 5.其他收入(损失以“-”号填列) | 4,576.23 | 9,759.83 |
| 减：二、费用 | 669,719.20 | 887,381.84 |
| 1.管理人报酬 | 169,012.31 | 277,022.90 |
| 2.托管费 | 33,802.42 | 55,404.57 |
| 3.销售服务费 | - | - |
| 4.交易费用 | 285,128.48 | 373,846.47 |
| 5.利息支出 | - | - |
| 其中：卖出回购金融资产支出 | - | - |
| 6.其他费用 | 181,775.99 | 181,107.90 |
| 三、利润总额(亏损总额以“-”号填列) | -84,989,385.42 | -55,721,341.24 |
| 减：所得税费用 | - | - |
| 四、净利润(净亏损以“-”号填列) | -84,989,385.42 | -55,721,341.24 |

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：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

本报告期：2014年1月1日至2014年6月30日

单位：人民币元

| 项目 | 本期<br>2014年1月1日至2014年6月30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） | 1,462,685,288.34 | -337,121,645.67 | 1,125,563,642.67 |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润) | - | -84,989,385.42 | -84,989,385.42 |
| 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） | -223,326,313.85 | 61,861,601.68 | -161,464,712.17 |
| 其中：1.基金申购款 | 7,618,274.83 | -2,149,638.99 | 5,468,635.84 |
| 2.基金赎回款 | -230,944,588.68 | 64,011,240.67 | -166,933,348.01 |
| 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） | 1,239,358,974.49 | -360,249,429.41 | 879,109,545.08 |
| 项目 | 上年度可比期间<br>2013年1月1日至2013年6月30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） | 1,857,349,404.57 | -462,246,510.45 | 1,395,102,894.12 |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润) | - | -55,721,341.24 | -55,721,341.24 |
| 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） | -12,589,998.48 | 2,827,037.73 | -9,762,960.75 |
| 其中：1.基金申购款 | 176,984,855.81 | -39,532,090.94 | 137,452,764.87 |
| 2.基金赎回款 | -189,574,854.29 | 42,359,128.67 | -147,215,725.62 |
| 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） | 1,844,759,406.09 | -515,140,813.96 | 1,329,618,592.13 |

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署：

______张树忠______　　______刘彩晖______　　____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

6.4 报表附注

6.4.1 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一致的说明

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一致。

6.4.2 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[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，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。

6.4.3 关联方关系

6.4.3.1 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。

6.4.3.2 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 |
| 深证成长40交易型开放式指数证券投资基金（“深证成长40ETF基金”) | 本基金的目标ETF |
| 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。

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。

6.4.4 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.4.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.4.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

| 关联方名称 | 本期<br>2014年1月1日至2014年6月30日 | | 上年度可比期间<br>2013年1月1日至2013年6月30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 | 141,661,921.91 | 100.00% | 242,688,067.84 | 100.00% |

基金交易

金额单位：人民币元

| 关联方名称 | 本期<br>2014年1月1日至2014年6月30日 | | 上年度可比期间<br>2013年1月1日至2013年6月30日 | |
|---|---|---|---|---|
| | 成交金额 | 占当期基金成交总额的比例 | 成交金额 | 占当期基金成交总额的比例 |
| 光大证券 | 149,655,030.20 | 100.00% | 174,890,820.89 | 100.00% |

注：基金交易额中包括基金申购赎回和买入卖出成交金额，其中基金申购赎回金额149,655,030.20元(上年度可比期间：174,890,820.89元)，基金买入卖出金额零元(上年度可比期间：零元)。

6.4.4.1.2 权证交易

无。

6.4.4.1.3 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

| 关联方名称 | 本期<br>2014年1月1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 | 125,358.92 | 100.00% | 76,376.87 | 100.00% |
| 关联方名称 | 上年度可比期间<br>2013年1月1日至2013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 | 214,756.42 | 100.00% | 75,898.38 | 100.00% |

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。

6.4.4.2 关联方报酬

6.4.4.2.1 基金管理费

单位：人民币元

| 项目 | 本期<br>2014年1月1日至2014年6月30日 | 上年度可比期间<br>2013年1月1日至2013年6月30日 |
|---|---|---|
| 当期发生的基金应支付的管理费 | 169,012.31 | 277,022.90 |
| 其中：支付销售机构的客户维护费 | 834,407.26 | 1,152,547.37 |

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扣除所持有目标ETF基金份额部分的基金资产后的余额(若为负数，则取零)的0.5%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 - 前一日所持有目标ETF基金份额部分的基金资产)X 0.5% / 当年天数。

6.4.4.2.2 基金托管费

单位：人民币元

| 项目 | 本期<br>2014年1月1日至2014年6月30日 | 上年度可比期间<br>2013年1月1日至2013年6月30日 |
|---|---|---|
| 当期发生的基金应支付的托管费 | 33,802.42 | 55,404.57 |

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扣除所持有目标ETF基金份额部分的基金资产后的余额(若为负数，则取零)的0.1%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 - 前一日所持有目标ETF基金份额部分的基金资产)X 0.1% / 当年天数。

6.4.4.3 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。

6.4.4.4 各关联方投资本基金的情况

6.4.4.4.1 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<br>2014年1月1日至2014年6月30日 | 上年度可比期间<br>2013年1月1日至2013年6月30日 |
|---|---|---|
| 期初持有的基金份额 | 69,472,000.02 | 69,472,000.02 |
| 期间申购/买入总份额 | - | - |
| 期间因拆分变动份额 | - | - |
| 减：期间赎回/卖出总份额 | 69,472,000.02 | - |
| 期末持有的基金份额 | - | 69,472,000.02 |
| 期末持有的基金份额占基金总份额比例 | 0.00% | 3.77% |

注：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。

6.4.10.4.2 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无投资本基金的情况。

6.4.4.5 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<br>2014年1月1日至2014年6月30日 | | 上年度可比期间<br>2013年1月1日至2013年6月30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 | 52,414,307.58 | 218,351.30 | 82,664,955.17 | 300,632.83 |

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。

6.4.4.6 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。

6.4.4.7 其他关联交易事项的说明

于本报告期末，本基金持有1,199,500,000.00份目标ETF基金份额，占其总份额的比例为96.30%(2013年12月31日：本基金持有1,409,500,000.00份目标ETF基金份额，占其总份额的比例为96.96%)。

6.4.5 期末（ 2014年6月30日 ）本基金持有的流通受限证券

6.4.5.1 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或增发证券而流通受限的证券。

6.4.5.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

于本报告期末，本基金未持有因暂时停牌等流通受限股票。

6.4.5.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.5.3.1 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。

6.4.5.3.2 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

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 | - | 0.00 |
| | 其中：股票 | - | 0.00 |
| 2 | 基金投资 | 827,655,000.00 | 94.03 |
| 3 | 固定收益投资 | - | 0.00 |
| | 其中：债券 | - | 0.00 |
| | 资产支持证券 | - | 0.00 |
| 4 | 贵金属投资 | - | 0.00 |
| 5 | 金融衍生品投资 | - | 0.00 |
| 6 | 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 |
| 7 | 银行存款和结算备付金合计 | 52,414,307.58 | 5.96 |
| 8 | 其他各项资产 | 91,974.41 | 0.01 |
| 9 | 合计 | 880,161,281.99 | 100.00 |

7.2 期末按行业分类的股票投资组合

本基金本报告期末未持有股票。

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

本基金本报告期末未持有股票。

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初基金资产净值2%或前20名的股票明细

本基金本报告期内未买入股票。

7.4.2 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 | 000651 | 格力电器 | 14,453,650.01 | 1.28 |
| 2 | 000333 | 美的集团 | 11,392,191.93 | 1.01 |
| 3 | 000858 | 五 粮 液 | 10,293,504.39 | 0.91 |
| 4 | 002415 | 海康威视 | 9,027,114.89 | 0.80 |
| 5 | 002241 | 歌尔声学 | 7,357,854.02 | 0.65 |
| 6 | 000157 | 中联重科 | 7,034,311.19 | 0.62 |
| 7 | 002236 | 大华股份 | 5,441,309.76 | 0.48 |
| 8 | 002450 | 康得新 | 5,357,257.37 | 0.48 |
| 9 | 300070 | 碧水源 | 5,221,630.34 | 0.46 |
| 10 | 300058 | 蓝色光标 | 4,520,372.25 | 0.40 |
| 11 | 000661 | 长春高新 | 4,242,480.30 | 0.38 |
| 12 | 002304 | 洋河股份 | 4,174,356.18 | 0.37 |
| 13 | 000970 | 中科三环 | 3,958,772.00 | 0.35 |
| 14 | 300124 | 汇川技术 | 3,950,970.79 | 0.35 |
| 15 | 000568 | 泸州老窖 | 3,842,807.79 | 0.34 |
| 16 | 000826 | 桑德环境 | 3,828,385.95 | 0.34 |
| 17 | 002456 | 欧菲光 | 3,229,986.57 | 0.29 |
| 18 | 002475 | 立讯精密 | 2,461,794.55 | 0.22 |
| 19 | 002146 | 荣盛发展 | 2,416,188.48 | 0.21 |
| 20 | 002310 | 东方园林 | 2,173,975.54 | 0.19 |

注：卖出包括二级市场上主动的卖出、换股、要约收购、发行人回购及行权等减少的股票，卖出金额按成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

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 | - |
| 卖出股票收入(成交)总额 | 141,661,921.91 |

注：买入股票成本、卖出股票收入均按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

7.5 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。

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

本基金本报告期末未持有债券。

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。

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 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名基金投资明细

金额单位：人民币元

| 序号 | 基金名称 | 基金类型 | 运作方式 | 管理人 | 公允价值 | 占基金资产净值比例(%) |
|---|---|---|---|---|---|---|
| 1 | 深证成长40ETF | 股票型 | 交易型开放式(ETF) | 大成基金管理有限公司 | 827,655,000.00 | 94.15 |

7.11 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

7.11.1 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。

7.11.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期末投资股指期货。

7.12 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.12.1 本期国债期货投资政策

本基金本报告期末投资国债期货。

7.12.2 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。

7.12.3 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末投资国债期货。

7.13 投资组合报告附注

7.13.1 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。

7.13.2 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。

7.13.3 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 | 80,406.26 |
| 2 | 应收证券清算款 | - |
| 3 | 应收股利 | - |
| 4 | 应收利息 | 9,597.10 |
| 5 | 应收申购款 | 1,971.05 |
| 6 | 其他应收款 | - |
| 7 | 待摊费用 | - |
| 8 | 其他 | - |
| 9 | 合计 | 91,974.41 |

7.13.4 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。

7.13.5 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。

7.13.6 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

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 |
| 36,935 | 33,555.14 | 45,928,558.91 | 3.71% | 1,193,430,415.58 | 96.29% |

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 | 19,803.58 | 0.002% |

8.3 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 |

### §9 开放式基金份额变动

单位：份

| | |
|---|---|
| 基金合同生效日(2010年12月21日)基金份额总额 | 3,129,970,939.79 |
| 本报告期期初基金份额总额 | 1,462,685,288.34 |
| 本报告期基金总申购份额 | 7,618,274.83 |
| 减:本报告期基金总赎回份额 | 230,944,588.68 |
| 本报告期基金拆分变动份额 | - |
| 本报告期期末基金份额总额 | 1,239,358,974.49 |

### §10 重大事件揭示

10.1 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。

10.2 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

1、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、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动：无。

10.3 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。

10.4 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。

10.5 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。

10.6 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。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 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 | 141,661,921.91 | 100.00% | 125,358.92 | 100.00% | - |
| 广发证券 | 1 | - | 0.00% | - | 0.00% | - |
| 国金证券 | 1 | - | 0.00% | - | 0.00% | - |
| 国泰君安 | 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% | - |
| 民生证券 | 1 | - | 0.00% | - | 0.00% | - |
| 南京证券 | 1 | - | 0.00% | - | 0.00% | - |
| 平安证券 | 1 | - | 0.00% | - | 0.00% | - |
| 齐鲁证券 | 1 | - | 0.00% | - | 0.00% | - |
| 瑞银证券 | 1 | - | 0.00% | - | 0.00% | - |
| 上海证券 | 1 | - | 0.00% | - | 0.00% | - |
| 申银万国 | 1 | - | 0.00% | - | 0.00% | - |
| 世纪证券 | 1 | - | 0.00% | - | 0.00% | - |
| 兴业证券 | 1 | - | 0.00% | - | 0.00% | - |
| 银河证券 | 2 | - | 0.00% | - | 0.00% | - |
| 英大证券 | 1 | - | 0.00% | - | 0.00% | - |
| 招商证券 | 1 | - | 0.00% | - | 0.00% | - |
| 中金公司 | 1 | - | 0.00% | - | 0.00% | - |
| 中信建投 | 1 | - | 0.00% | - | 0.00% | - |
| 中信证券 | 2 | - | 0.00% | - | 0.00% | - |
| 中银国际 | 1 | - | 0.00% | - | 0.00% | - |
| 安信证券 | 1 | - | 0.00% | - | 0.00% | - |
| 北京高华 | 1 | - | 0.00% | - | 0.00% | - |
| 长城证券 | 2 | - | 0.00% | - | 0.00% | - |
| 东北证券 | 1 | - | 0.00% | - | 0.00% | - |
| 方正证券 | 1 | - | 0.00% | - | 0.00% | - |

注：1. 本报告期内本基金退租交易单元：招商证券；新增交易单元：无。

2. 租用券商专用交易单元的选择标准和程序：

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交易单元。

10.7.2 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 | | 基金交易 | |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| | 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 | 成交金额 | 占当期基金成交总额的比例 |
| 光大证券 | - | 0.00% | - | 0.00% | - | 0.00% | 149,655,030.20 | 100.00% |

大成基金管理有限公司
2014年8月28日