（上接B26版）

网址：www.fund123.cn

（10）中国民族证券有限责任公司

注册地址：北京市朝阳区北四环中路27号院5号楼40层-43层

法人代表：赵大建

联系人：李微

客户服务电话：400-889-5618

网址：www.c5618.com

（二）注册登记机构

名称：大成基金管理有限公司

住所：深圳市福田区深南大道7088号招商银行大厦32层

办公地址：深圳市福田区深南大道7088号招商银行大厦33层

法定代表人：张树忠

电话：0755-83183388

传真：0755-83195229

联系人：范瑛

（三）律师事务所和经办律师

名称：北京市金杜律师事务所

注册地址：北京市朝阳区东三环中路7号财富中心写字楼A座40层

办公地址：北京市朝阳区东三环中路7号财富中心写字楼A座40层

负责人：王玲

电话：0755-22163333

传真：0755-22163390

经办律师：靳庆军、冯艾

联系人：冯艾

（四）会计师事务所和经办注册会计师

会计师事务所名称：普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）

注册地址：上海市浦东新区陆家嘴环路1318号星展银行大厦6楼

办公地址：上海市黄浦区湖滨路202号企业天地2号楼普华永道中心11楼

法人代表：杨绍信

经办注册会计师：薛竞、叶尔甸

电话：021-23238888

传真：021-23238800

联系人：刘莉

四、基金的名称

本基金名称：大成财富管理2020生命周期证券投资基金

五、基金的类型

本基金类型：混合型基金

六、基金的运作方式

本基金运作方式：契约型、开放式

七、基金的投资目标

本基金投资于具有良好流动性的权益证券、固定收益证券和/或货币市场工具等，通过调整资产配置策略和精选证券，以超越业绩比较基准，寻求在一定风险承受水平下的当期收益和资本增值的整体最大化。在2020年12月31日以前，本基金侧重于资本增值，当期收益为辅；在2020年12月31日之后，本基金侧重于当期收益，资本增值为辅。

八、基金的投资方向

本基金投资于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、债券及中国证监会允许基金投资的其他金融工具。本基金持有的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%。

本基金根据时间的变化逐步调整权益类证券和固定收益类（及货币市场工具）证券的资产配置比例。

本基金各个时间段的资产配置比例如下表所示：

时间段	权益类证券比例范围	固定收益类证券及货币市场工具比例范围
基金合同生效日至2010年12月31日	0—95%	5%—100%
2011年1月1日至2015年12月31日	0—75%	25%—100%
2016年1月1日至2020年12月31日	0—50%	50%—100%
2021年1月1日以及该日以后	0—20%	80%—100%

在特殊市况下或有足够充分的理由时，基于投资者利益最大化的原则，在不损害投资者利益且不违背法律法规的前提下，本基金在履行相应程序后，可适当偏离上述比例范围，并予以公告。

九、基金的投资策略

本基金在组合构建中强调风险收益比的合理优化，将纪律性和科学性结合起来，建立较全面的资产、个券投资价值评价体系，不断优化投资组合配置。

本基金的投资策略分为两个层次：第一个层次是资产配置策略，即在权益类证券、固定收益证券和货币市场工具之间的配置比例；第二个层次是权益类证券和固定收益类证券等的投资。

1、资产配置策略

随着时间的流逝，从整体趋势来看，本基金投资于权益类证券的比例持续递减，投资于固定收益类或货币市场工具的比例持续增加，使得整个基金组合的资产配置变得相对更加稳健，从追求资本增值为主转变为追求当期收益为主。

在前期，本基金类似于一只股票型或偏股型基金，风险收益水平相对较高，投资方法相对进取，以获得较高的资本投资回报。以后，逐步演变为一只低风险债券型基金，风险收益水平相对较低，投资方法趋于稳健，以获得稳定的当期收益。这种演变是渐进的，以适应投资者随着年龄增长或者剩余期限的减少而逐渐降低风险偏好的要求。

2、权益类证券投资策略

①配置战术品种和战略品种

基金既要持有保证现实需求的战术性品种，也要持有保证未来发展的战略性品种。战术性品种往往是市场已经高度认同、大量资金涌入的热门品种，一般而言，能在短期内产生良好的收益。战略性品种往往是被市场遗忘、产生错误定价的冷门品种，通常短期内收益较小、然而长期而言往往产生高额收益。

本基金将在基金投资组合中既配置能够产生即期收益的战术性品种，也配置能够产生远期收益的战略性品种，既保证基金的短期收益，也可以获得长期收益。

②深出重点行业、重点个股

超额收益来自于对市场时机的判断以及对行业和个股的把握。本基金将重视宏观因素对行业和企业带来的影响；采用定性与定量相结合的方法，对行业的未来预期做出较为准确的判断，对股票未来盈利能力及成长性进行全面的分析，发现行业的价值和未来的成长潜力，挖掘价值被市场低估的股票。本基金将重点投资于业绩持续稳定增长、在行业内具有垄断地位、行业特征与世界经济发展和中国经济发展趋势相一致、现金流状况良好、负债率较低、预期销售收入、净利润快速增长并能够维持较高的净资产收益率的上市公司。

③不同行业的选股思路

不同行业和公司具有不同的经营特征和模式，本基金将根据不同行业的特点，运用不同的选股方法：

①对于高速增长的行业，特别是新兴行业，基本采取普选个股的方式选择投资标的。

高速成长的行业中的大部分公司都能获得良好的收益，而行业竞争格局尚不清晰，并不能断定孰优孰劣，因此普选个股有助于充分分享该行业的高速增长。

②对于高度竞争性行业或者处于衰退阶段的行业，此类行业中部分公司经营优良，并且获得持续发展和长久的行业地位，而大部分公司无法抵御竞争将遭到淘汰。因此，本基金将选择管理层的经营水平和公司的内在竞争力较强的上市公司，估值水平视公司的经营发展态势而定。

③对于周期性行业、波动性和周期性是其主要特征，在行业低谷期此类股票会被大量抛售，导致投资风险较大。对于此类股票，本基金的投资重点在于当市场预期和市场定价发生错误时，进行波段操作，充分获取超额收益。

3、固定收益类证券投资策略

固定收益类证券的资产配置将随着时间的推移逐步增加。

本基金将在严格控制组合风险的前提下，进行总体的战略资产配置。同时，基于收益的要求，在战术资产配置、类属配置、个券选择和交易执行层面上实施积极的策略，以期在承担有限风险的前提下获得较高的投资收益。战术资产配置上，本基金将通过深入分析宏观经济、政策影响和市场信用利差结构等各种变量并参照市场基准久期，确定出目标久期。类属配置上，将通过各类属资产的比例配置、期限配置以及市场配置实现超额收益。

个券选择和多样化的交易策略将成为本基金日常获取超额收益的重要手段。

①战略资产配置策略

战略资产配置通过综合宏观经济预测、情景分析和申购、赎回现金流情况决定。其中，宏观经济预测主要基于定性和定量相结合的研究报告。兼顾申购、赎回等方面的现金流分析，确保基金的流动性要求。

②战术资产配置策略

本基金将采取以“目标久期”为中心的债券资产配置方式，通过分析宏观经济、政策影响等各种变量并参照市场基准久期，借助市场收益率曲线结构分析和市场信用利差结构分析，确定本基金债券资产配置的组合久期和战术资产配置策略。

宏观及市场分析是债券投资确定目标久期的重要环节，本基金将基于分析结果对市场利率变化的时间、方向、幅度做出初步预测。此外，本基金还将借助久期和收益率曲线进行组合的目标久期决策，通过假定利率变化幅度的各种情形，分析投资组合的风险-收益状况，并根据投资组合的风险承受能力确定组合的目标久期区间。在此基础上，本基金还会借助情景分析方法研究收益率曲线变化，考察投资基准和投资组合在收益率曲线变化时的风险-收益特征及久期情况，最后确定组合在某一季度内的目标久期区间。

③类属配置

在确定目标久期后，本基金将对债券资产进行类属配置，即在对宏观经济、市场利率、债券供求等分析的基础上，预测各类属资产预期风险及收益情况，考虑债券品种期限和债券市场流动性及收益性现状，确定债券资产组合在国债、企业债、金融债等品种之间的类属分配。在本基金具体进行类属配置的过程中，将综合考虑模型辅助和主动预测相结合的方法。

在确定目标久期和类属资产比例后，本基金将对长、中、短期债券品种进行期限配置，根据不同情况，决定采用子弹、哑铃或者梯形策略实现不同期限债券品种的搭配。

④交易策略

在组合构建与调整过程中，本基金将采用一系列凸度策略、收益率利差策略和回购套利等多种交易策略，以提高组合整体投资收益率水平、控制组合的投资风险。

十、基金的业绩比较基准

时间段	业绩比较基准
基金合同生效日至2010年12月31日	75%×新华富时中国A600指数+25%×中国债券总指数
2011年1月1日至2015年12月31日	45%×沪深300指数+55%×中国债券总指数
2016年1月1日至2020年12月31日	25%×沪深300指数+75%×中国债券总指数
2021年1月1日以及该日以后	10%×沪深300指数+90%×中国债券总指数

注：大成基金管理有限公司根据《大成财富管理2020生命周期证券投资基金基金合同》的相关约定，经与基金托管人协商一致，并报中国证监会备案，自2011年1月1日起，大成财富管理2020生命周期证券投资基金使用的业绩比较基准由原“变更为“

时间段	业绩比较基准
基金合同生效日至2010年12月31日	75%×新华富时中国A600指数+25%×中国债券总指数
2011年1月1日至2015年12月31日	45%×沪深300指数+55%×中国债券总指数
2016年1月1日至2020年12月31日	25%×沪深300指数+75%×中国债券总指数
2021年1月1日以及该日以后	10%×沪深300指数+90%×中国债券总指数

”

在本基金的运作过程中，如果由于外部投资环境或法律法规的变化而使得调整业绩比较基准更符合基金份额持有人的利益，则基金管理人可以对业绩比较基准进行适当调整，并在报中国证监会核准后，提前公告后予以实施。

十一、基金的风险收益特征

本基金属于生命周期型基金，2020年12月31日为本基金的目标日期。从建仓期结束起至目标日期止，本基金的风险与收益水平将随着时间的流逝逐步降低。即本基金初始投资阶段的风险收益水平接近股票型基金；随着目标日期的临近，本基金逐步发展为一只低风险债券型基金。

十二、基金投资组合报告

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。

基金托管人中国银行股份有限公司根据基金合同规定，于2014年9月24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。

本投资组合报告所载数据取自大成财富管理2020生命周期证券投资基金2014年2季度报告，截至2014年6月30日（财务数据未经审计）。

1.报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额（元）	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	3,613,948.405.15	63.65
	其中：股票	3,613,948.405.15	63.65
2	固定收益投资	891,657,000.00	15.70
	其中：债券	891,657,000.00	15.70
	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
	买入返售金融资产	955,372,443.74	16.83
5	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	199,677,691.93	3.52
7	其他各项资产	17,479,049.29	0.31
8	合计	5,678,134,590.11	100.00

2.报告期末按行业分类的股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	24,906,152.75	0.45
B	采矿业	-	0.00
C	制造业	2,146,227,980.53	38.35
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	0.00
E	建筑业	-	0.00
F	批发和零售业	18,840,756.68	0.34
G	交通运输、仓储和邮政业	-	0.00
H	住宿和餐饮业	-	0.00
I	信息传输、软件和信息技术服务业	473,970,943.87	8.47
J	金融业	276,367,321.49	4.94
K	房地产业	94,797,741.16	1.69
L	租赁和商务服务业	203,347,735.98	3.63
M	科学研究和技术服务业	-	0.00
N	水利、环境和公共设施管理业	332,250,492.89	5.94
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	43,239,279.80	0.77
R	文化、体育和娱乐业	-	0.00
S	综合	-	0.00
	合计	3,613,948,405.15	64.57

3.报告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

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	002241	歌尔声学	10,021,655	267,177,322.30	4.77
2	000826	桑德环境	8,616,685	196,891,252.25	3.52
3	600872	中炬高新	17,291,753	184,503,004.51	3.30
4	002230	科大讯飞	6,704,150	178,330,390.00	3.19
5	600887	伊利股份	5,000,000	165,600,000.00	2.96
6	300058	蓝色光标	5,890,934	156,345,388.36	2.79
7	600261	阳光照明	15,297,129	151,135,634.52	2.70
8	000538	云南白药	2,399,888	125,274,153.60	2.24
9	000848	承德露露	6,181,593	122,828,252.91	2.19
10	300070	碧水源	4,035,282	118,031,998.50	2.11

4.报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	-	0.00
2	央行票据	-	0.00
3	金融债券	390,579,000.00	6.98
	其中：政策性金融债	390,579,000.00	6.98
4	企业债券	-	0.00
5	企业短期融资券	501,078,000.00	8.95
6	中期票据	-	0.00
7	可转债	-	0.00
8	其他	-	0.00
9	合计	891,657,000.00	15.93

5.报告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

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	140430	14农发30	1,400,000	140,490,000.00	2.51
2	011415002	14中铝业SCP002	1,000,000	100,460,000.00	1.80
3	110418	11农发18	1,000,000	99,760,000.00	1.78
4	100236	10国开36	900,000	90,198,000.00	1.61
5	011407002	14南电SCP002	800,000	79,968,000.00	1.43

6.报告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。

7.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

本基金本报告期末投资贵金属。

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。

9.报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

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。

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。

10.报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

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

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

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

11.投资组合报告附注

①本基金投资的前十名证券的发行主体本期无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。

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的股票。

③基金的其他资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	683,536.95
2	应收证券清算款	7,930,469.72
3	应收股利	-
4	应收利息	8,851,534.34
5	应收申购款	13,508.28
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	17,479,049.29

④报告期末基金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。

⑤报告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的情况。

⑥由于四舍五入原因，分项之和与合计可能有尾差。

十三、基金的业绩

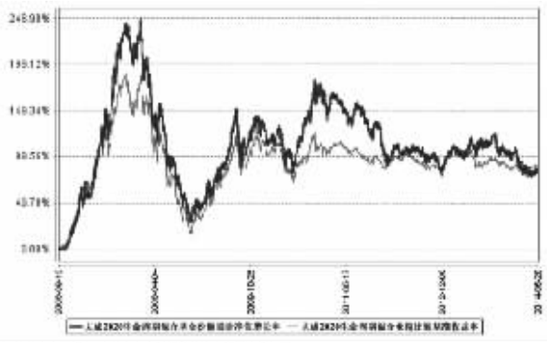
（一）本报告期基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

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
2006.9.13-2006.12.31	38.77%	1.18%	33.50%	0.97%	5.27%	0.21%
2007.1.1-2007.12.31	136.19%	2.00%	104.24%	1.72%	31.95%	0.28%
2008.1.1-2008.12.31	-56.52%	2.18%	-52.05%	2.29%	-4.47%	-0.11%
2009.1.1-2009.12.31	67.51%	1.80%	66.78%	1.53%	0.73%	0.27%
2010.1.1-2010.12.31	12.57%	1.52%	-4.47%	1.17%	17.04%	0.35%
2011.1.1-2011.12.31	-24.03%	1.02%	-8.95%	0.59%	-15.08%	0.43%
2012.1.1-2012.12.31	-2.24%	0.97%	5.28%	0.57%	-7.52%	0.40%
2013.1.1-2013.12.31	2.94%	1.07%	-4.09%	0.63%	7.03%	0.44%
2014.1.1-2014.6.30	-9.37%	0.99%	0.09%	0.47%	-9.46%	0.52%
2006.9.13-2014.6.30	86.22%	1.55%	90.74%	1.33%	-4.52%	0.22%

（二）自基金合同生效以来基金份额净值的变动情况，并与同期业绩比较基准的变动的比较

大成2020基金累计份额净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图

（2006年9月13日至2014年6月30日）



注：按基金合同规定，本基金各个时间段的资产配置比例如下：

时间段	权益类证券比例范围	固定收益类证券及货币市场工具比例范围
基金合同生效日至2010年12月31日	0-95%	5%-100%
2011年1月1日至2015年12月31日	0-75%	25%-100%
2016年1月1日至2020年12月31日	0—50%	50%-100%
2021年1月1日以及该日以后	0—20%	80%-100%

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的各项投资比例已达到基金合同中规定的各项比例。

十四、基金的费用与税收

（一）与基金运作有关的费用

1.基金运作费用种类

①基金管理人的管理费；

②基金托管人的托管费；

③基金的证券交易费用；

④基金合同生效以后的信息披露费用；

⑤基金份额持有人大会费用；

⑥基金合同生效以后的会计师费和律师费；

⑦按照国家有关法律法规规定可以列入的其他费用。

2.基金运作费用计提方法、计提标准和支付方式

①基金管理人的管理费

本基金的年管理费率如下：

时间段	年管理费率
基金合同生效日至2010年12月31日	1.5%
2011年1月1日至2015年12月31日	1.4%
2016年1月1日至2020年12月31日	1.2%
2021年1月1日以及该日以后	0.8%

计算方法如下：

H=E×年管理费率÷当年天数

H为每日应计提的管理费

E为前一日基金资产净值

管理费每日计提，逐日累计，对于已确认的管理费，由基金托管人按月划付。基金管理人应于次月前5个工作日内将上月已确认管理费的计算结果书面通知基金托管人并做出划付指令；基金托管人应在次月前10个工作日内完成复核，并从基金财产中一次性支付已确认管理费给基金管理人。

②基金托管人的托管费

本基金的年托管费率如下：

时间段	年托管费率
基金合同生效日至2015年12月31日	0.25%
2016年1月1日至2020年12月31日	0.23%
2021年1月1日以及该日以后	0.20%

计算方法如下：

H=E×年托管费率÷当年天数

H为每日应计提的基金托管费

E为前一日的基金资产净值

托管费每日计提，逐日累计，对于已确认的托管费，由基金托管人按月划付。基金管理人应于次月前5个工作日内将上月已确认托管费的计算结果书面通知基金托管人并做出划付指令；基金托管人应在次月前10个工作日内完成复核，并从基金财产中一次性支付已确认托管费给基金托管人。

③本条第1款第③)至第⑦)小项费用由基金管理人和基金托管人根据有关法规及相应协议的规定，列入当期基金费用。

3.不列入基金费用的项目

本条第1款约定以外的其他费用，以及基金管理人和基金托管人因未履行或未完全履行义务导致的费用支出或基金财产的损失等不列入基金费用。基金合同生效之前的律师费、会计师费和信息披露费用等不得从基金财产中列支。

4.基金管理费、基金托管费的调整

基金管理人和基金托管人等可根据基金发展情况调整基金管理费率、基金托管费率等相关费率或改变收费模式。调高基金管理费率、基金托管费率，须召开基金份额持有人大会审议，除非获得监管机构的豁免、基金合同或相关法律法规另有规定；调低基金管理费率、基金托管费率等相关费率或在不提高整体费率水平的情况下改变收费模式，无须召开基金份额持有人大会。

基金管理人最迟于新的费率实施日前2日在至少一种中国证监会指定媒体上予以公告，并报中国证监会备案。

（二）与基金销售相关费用

1.基金收费模式的分类与基金份额的分类

本基金分为A类和B类两种收费模式，对应A类和B类两种不同的份额。

A类收费模式是指前端收费模式，投资者选择A类，需要在认（申）购时一次性交纳认（申）购费用；B类收费模式是指后端收费模式，投资者选择B类，在认（申）购时无需交纳认（申）购费用，而是在赎回时交纳认（申）购费用。

投资者在认（申）购本基金时，每笔认（申）购只能选择A类或B类之一种。

本基金将来若增加新的收费模式，对应地，可能会增加新的基金份额种类，并可能需计算新基金份额类别的基金份额净值。

2.申购费率

本基金申购费用由基金申购人承担，不列入基金财产，主要用于本基金的市场推广、销售、客户服务等各项费用。

①A类基金份额（采用前端收费模式）申购费率如下：

申购金额M	基金合同生效日至2010年12月31日	2011年1月1日至2015年12月31日	2016年1月1日至2020年12月31日	2021年1月1日以及该日以后
M<50万	1.50%	1.40%	1.20%	1.00%
50万≤M<200万	1.20%	1.10%	1.00%	0.80%
200万≤M<500万	0.80%	0.70%	0.60%	0.50%
M≥500万	每笔1000元	每笔1000元	每笔1000元	每笔1000元

②B类基金份额（采用后端收费模式）申购费率如下：

①在2015年12月31日以及该日以前，本基金后端申购费率如下：

持有基金时间T	基金合同生效日至2015年12月31日
T<1年	1.80%
1年≤T<2年	1.20%
2年≤T<3年	0.80%
3年≤T<5年	0.40%
T≥5年	0

②在2015年12月31日以后，本基金后端申购费率将另行公告。

3.赎回费率

本基金赎回费用由基金赎回人承担，在基金份额持有人赎回基金份额时收取。赎回费率为0.30%。赎回费在扣除手续费后，余额不低于赎回费总额25%的部分，应当归入基金财产。

4.基金管理人可以根据法律法规的规定，在合适时机推出销售服务费收费模式。通过该模式申购获得的基金份额为C类基金份额。投资者申购赎回C类基金份额时无须交纳申购费和赎回费，而是按照一定的费率从基金财产中按日计提销售服务费。销售服务费用于支付销售机构佣金、营销费用以及基金份额持有人服务费等。基金管理人应通过定期的审计和监察稽核监督销售服务费的支出和使用情况，确保其用于约定的用途。相关年度报告应对该项费用的列支情况做专项说明。

5.网上交易费率，请见有关网站公告。

6.基金管理人可以在法律法规和基金合同规定范围内调整申购费率、赎回费率和销售服务费率。费率如发生变更，基金管理人应最迟于实施前2日在至少一种中国证监会指定媒体上予以公告。

7.申购份额与赎回支付金额的计算方式

①基金申购份额的计算：

①A类基金份额（采用前端收费模式）

净申购金额=申购金额/(1+申购费率)

申购费用=申购金额-净申购金额

申购份额=净申购金额/T日基金份额净值

②B类基金份额（采用后端收费模式）

申购份额=申购金额×T日基金份额净值

③说明：投资者以同样的金额申购本基金时，选择B类收费模式得到的申购份额将比选择A类收费模式多，但需在赎回时交纳申购费。

②基金净赎回金额的计算：

①A类基金份额（采用前端收费模式）

赎回总额=赎回份数×T日基金份额净值

赎回费用=赎回总额×赎回费率

赎回金额=赎回总额-赎回费用

②B类基金份额（采用后端收费模式）

赎回总额=赎回份额×T日基金份额净值

赎回费用=赎回总额×赎回费率

后端认购申购费用=赎回份额×认购/申购申请日的基金份额净值×该部分份额对应的后端认购/申购费率

赎回金额=赎回总额-赎回费用-后端认购/申购费用

8.基金转换费用详见有关公告。

（三）基金税收

本基金运作过程中涉及的各纳税主体，依照国家法律法规的规定履行纳税义务。

十五、对招募说明书更新部分的说明

本更新的招募说明书依据《中华人民共和国证券投资基金法》、《证券投资基金运作管理办法》、《证券投资基金销售管理办法》、《证券投资基金信息披露管理办法》及其他有关法律法规的要求，对2014年4月26日公布的《大成财富管理2020生命周期证券投资基金更新招募说明书（2014年第1期）》进行了更新，本更新招募说明书主要更新的内容如下：

1.根据最新资料，更新了“三、基金管理人”部分。

2.根据最新资料，更新了“四、基金托管人”部分。

3.根据最新资料，更新了“五、相关服务机构”部分。

4.根据最新数据，更新了“十、基金的投资”部分。

5.根据最新数据，更新了“十一、基金业绩”部分。

6.根据最新公告，更新了“二十四、其他应披露的事项”。

7.根据最新情况，更新了“二十五、招募说明书更新部分的说明”。

大成基金管理有限公司

二〇一四年十月二十八日

成都华泽钴镍材料股份有限公司

2014 第三季度报告

证券代码:000693　证券简称:华泽钴镍　公告编号:2014-048

第一节 重要提示

公司董事会、监事会及董事、监事、高级管理人员保证季度报告内容的真实、准确、完整，不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏，并承担个别和连带的法律责任。

所有董事均已出席了审议本次季报的董事会会议。

公司负责人王涛、主管会计工作负责人郭立红及会计机构负责人（会计主管人员）郭立红声明：保证季度报告中财务报表的真实、准确、完整。

第二节 主要财务数据及股东变化

一、主要会计数据和财务指标

公司是否因会计政策变更及会计差错更正等追溯调整或重述以前年度会计数据

□ 是 √ 否

	本报告期末	上年度末	本报告期末比上年度末增减
总资产（元）	4,620,372,445.27	3,411,117,290.24	35.45%
归属于上市公司股东的净资产（元）	1,310,737,362.53	1,172,964,059.45	11.75%

	本报告期	本报告期比上年同期增减	年初至报告期末	年初至报告期末比上年同期增减
营业收入（元）	3,716,635,845.86	168.71%	7,395,990,982.54	172.54%
归属于上市公司股东的净利润（元）	59,409,746.75	43.16%	128,709,761.20	169.34%
归属于上市公司股东的扣除非经常性损益的净利润（元）	59,409,746.75	43.16%	128,709,761.20	169.34%
经营活动产生的现金流量净额（元）	--	--	401,724,936.72	-533.25%
基本每股收益（元/股）	0.1099	43.85%	0.2370	169.62%
稀释每股收益（元/股）	0.1099	43.85%	0.2370	169.62%
加权平均净资产收益率	4.78%	0.93%	10.30%	5.87%

非经常性损益项目和金额

□ 适用 √ 不适用

公司报告期不存在非经常性损益项目。

二、报告期末股东总数及前十名股东持股情况表

1、报告期末普通股股东总数及前十名普通股股东持股情况表

单位：股

报告期末普通股股东总数						22,635
前10名普通股股东持股情况						
股东名称	股东性质	持股比例	持股数量	持有有限售条件的股份数量	质押或冻结情况	
					股份状态	数量
王辉	境内自然人	19.77%	107,441,716	107,441,716	质押	82,040,000
王涛	境内自然人	15.49%	84,191,525	84,191,525	质押	64,292,000
北京康博恒智科技有限责任公司	境内非国有法人	9.87%	53,654,164	53,654,164	冻结	53,654,164
鲁证创业投资有限公司	国有法人	4.31%	23,398,227	23,398,227		
西证股权投资有限公司	国有法人	4.31%	23,398,227	23,398,227		
东营市黄河三角洲投资中心（有限合伙）	境内非国有法人	4.31%	23,398,227	23,398,227	质押	15,963,100
杨宝国	境内自然人	3.90%	21,183,289	21,183,289		
新疆伟创富通股权投资有限合伙企业	境内非国有法人	3.90%	21,183,289	21,183,289		
陕西飞达科技发展有限责任公司	境内非国有法人	3.51%	19,065,170	19,065,170		
深圳市聚友网络投资有限公司	境内非国有法人	3.46%	18,779,062	18,779,062	冻结	18,779,062

前10名无限售条件普通股股东持股情况表

股东名称	持有无限售条件普通股股份数量	股份种类	
		股份种类	数量
易成生	803,340	人民币普通股	803,340
孙怀建	491,625	人民币普通股	491,625
肖本东	365,510	人民币普通股	365,510
张景琴	342,637	人民币普通股	342,637
袁长春	311,700	人民币普通股	311,700
乔刚强	311,443	人民币普通股	311,443
罗志强	308,400	人民币普通股	308,400
刘丽兰	300,000	人民币普通股	300,000
吕济民	259,983	人民币普通股	259,983
叶绍明	242,633	人民币普通股	242,633
上述股东关联关系或一致行动的说明	王辉、王涛为上市公司控股股东且为一致行动人，未知其他股东之间是否存在关联关系，也未知其是否构成一致行动人。		
前10名无限售条件普通股股东参与融资融券业务股东情况说明（如有）	无		

公司前10名普通股股东、前10名无限售条件普通股股东在报告期内是否进行约定购回交易

□ 是 √ 否

公司股东在报告期内未进行约定购回交易。

第三节 重要事项

一、报告期主要会计报表项目、财务指标发生变动的情况及原因

√ 适用 □ 不适用

二、重要事项进展情况及其影响和解决方案的分析说明

√ 适用 □ 不适用

详细情况见重要事项概述

重要事项概述	披露日期	临时报告披露网站查询索引
2014年4月21日公司召开第八届董事会第三次会议，审议通过了《陕西华泽镍钴金属有限公司设立置业子公司的议案》，新设立的西安华泽置业有限公司，已于5月7日取得公司营业执照。公司已初步确定了由置业公司对昆明路8号的工业生产厂区进行整体开发的方案，目前，正与规划局、土地局沟通落实昆明路土地性质变更工作。	2014年04月22日	http://www.cninfo.com.cn/finalpage/2014-04-22/63887583.PDF
2014年4月21日公司召开第八届董事会第三次会议审议通过了《陕西华泽镍钴金属有限公司启动西安新材料项目的议案》，于7月初完成了项目可研报告的编制；8月底通过高新区管委会专家评审并于9月30日取得了高新区备案批复文件；项目的环保审核也正在履行相关程序中，将在环保审核通过后召开专家评审会；10月17日项目职评通过高新专家评审会。公司管理层已就上述项目进展情况向公司董事会战略与发展委员会进行了两次专题汇报。目前项目的安评、能评报告编制已全部完成，正等待相关部门的批复。	2014年04月22日	http://www.cninfo.com.cn/finalpage/2014-04-22/63887583.PDF
2014年4月21日公司召开第八届董事会第三次会议审议通过了《关于同意平安鑫海资源开发有限公司启动镍铁矿综合利用年产10万吨镍基新材料工程项目的议案》，截止本报告期该项目处于调研、论证、环评、安评等前期沟通中。	2014年04月22日	http://www.cninfo.com.cn/finalpage/2014-04-22/63887583.PDF
2014年4月21日公司召开第八届董事会第三次会议审议通过了《关于成都华泽钴镍材料股份有限公司和鲁证创业投资有限公司合作设立产业基金的议案》，新设立的深圳华泽鲁证投资管理有限公司已于2014年7月29日完成了工商注册。目前正在进行基金招募和项目前期调研工作。	2014年04月22日	http://www.cninfo.com.cn/finalpage/2014-04-22/63887583.PDF
2014年6月16日公司召开第八届董事会第七次会议审议通过了《成都华泽钴镍材料股份有限公司关于变更公司注册地址的议案》。目前公司正址前期事宜正在与当地政府沟通办理当中。	2014年06月18日	http://www.cninfo.com.cn/finalpage/2014-06-18/64147720.PDF
2014年6月25日公司召开第八届董事会第八次会议，审议通过了《成都华泽钴镍材料股份有限公司关于陕西华泽镍钴金属有限公司未完成2013年度业绩涉及补偿事宜的方案》，鉴于陕西华泽2013年实现的净利润数低于盈利预测净利润数，王辉、王涛应补偿的股份数量为45,219,258股，根据国家法律法规及协议约定，对王辉、王涛持有公司45,219,258股的股票及时办理划转到成都华泽钴镍材料股份有限公司董事会所设立的专门账户存放并锁定，该部分被锁定的股份不拥有表决权且不享有股利分配的权利。在盈利补偿承诺期限届满后，按盈利预测补偿协议规定执行。目前补偿股份的锁定正在办理中。	2014年06月26日 2014年06月26日	http://www.cninfo.com.cn/finalpage/2014-06-26/1200008027.PDF http://www.cninfo.com.cn/finalpage/2014-06-26/1200008028.PDF

三、公司或持