

大成优选股票型证券投资基金(LOF)

2013 第四季度 报告

2013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:中国银行股份有限公司
报告送出日期:2014年1月22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。

基金托管人中国银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2014年1月20日复核了本报告中的财务指标、净值表现和投资组合等信息,保证其真实、准确、完整。除基金管理人可能存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏外,其他所载信息和数据不存在虚假记载、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,也不保证基金份额持有人不受本金损失。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。

本报告所载资料未进行审计。

本报告自2013年10月1日起至12月31日止。

| 基金名称 | 大成优选股票 LOF |
|------------|--|
| 交易代码 | 160916 |
| 基金运作方式 | 上市契约开放式(LOF) |
| 基金合同生效日 | 2012年7月27日 |
| 报告期末基金份额总额 | 1,653,738,791.98份 |
| 投资目标 | 在有效控制风险的基础上,追求基金资产长期增值增值。 |
| 投资策略 | 本基金将在全市场下,通过定量的模型,确定大宗资产配置比例,通过上市公司基本面分析,主要采用自上而下和自下而上的投资策略,挖掘优质标的,优选个股和个股组合,买入并持有在估值合理范围内的优质标的,分享中国宏观经济长期增长带来的投资机会。 |
| 业绩比较基准 | 沪深300指数收益率*80%+中证全债指数收益率*20% |
| 风险收益特征 | 本基金属于股票型基金,其预期收益及风险水平高于混合基金,债券基金与货币市场基金,属于高风险收益特征的投资品种。 |
| 基金管理人 | 大成基金管理有限公司 |
| 基金托管人 | 中国银行股份有限公司 |

注:本基金在交易所行情系统净值揭示等其他信息披露平台上,可能称为“优选LOF”。

§3 主要财务指标和基金净值表现

| 单位:人民币元 | 报告期(2013年10月1日至2013年12月31日) |
|----------------|-----------------------------|
| 1.本期已实现收益 | 10,929,309.70 |
| 2.本期利润 | -43,731,042.94 |
| 3.加权平均基金份额本期利润 | -0.0266 |
| 4.期末基金资产净值 | 1,855,260,353.51 |
| 5.期末基金份额净值 | 1.122 |

注1:本基金已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入(不含公允价值变动损益)扣除相关费用后的余额,本期利润为本基金已实现收益加上本期公允价值变动收益。

注2:本基金净值增长率扣除费用后的净值增长率,其扣除费用(不含公允价值变动损益)扣除相关费用后的余额,本期利润为本基金已实现收益加上本期公允价值变动收益。

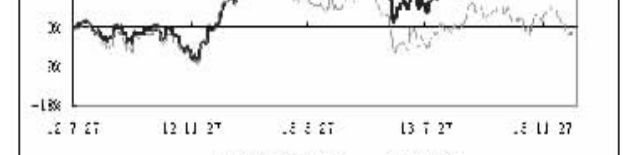
§3.2 基金净值表现

3.2.1 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 | 净值增长率 | 净值增长率标准差 | 业绩比较基准收益率 | 业绩比较基准收益率标准差 | ①-③ | ②-④ |
|-------|--------|----------|-----------|--------------|-------|-------|
| 过去三个月 | -2.01% | 1.01% | -2.93% | 0.90% | 0.92% | 0.11% |

§3.2 基金净值表现

3.2.2 自基金转型以来基金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:大成优选股票型证券投资基金(LOF)合同中关于基金投资比例的规定:本基金股票资产占基金资产的比例为60%-95%,其中投资于A类股票的资产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按照法律法规及监管机构的相关规定执行。

本基金的投资比例为:股票资产占基金资产的比例为60%-95%,其中投资于A类股票的资产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按照法律法规及监管机构的相关规定执行。

§4 管理人报告

4.1 基金经理(或基金经理小组)简介

| 姓名 | 职务 | 任本基金基金经理的期限 | 证券从业年限 | 说明 |
|-----|---------|--------------|--------|--|
| 刘明达 | 本基金基金经理 | 2012年7月27日至今 | 20年 | 硕士,曾任银河证券公募基金事业部基金经理,鹏华证券研究中心副经理兼基金管理部基金经理,2004年10月22日至2008年1月12日曾任基金管理部基金经理,2007年8月11日至2012年7月27日担任大成优选股票型证券投资基金基金经理,2012年7月27日担任大成优选股票型证券投资基金基金经理。 |

注1:任职日期、解聘日期为本基金管理人聘任及解聘之日。

4.2 报告期内基金的投资策略和业绩表现

本基金报告期内,本基金管理人秉承“稳健投资、长期增值”的投资理念,严格执行基金合同约定的投资策略,在有效控制风险的基础上,追求基金资产长期增值增值。

本基金报告期内,本基金管理人秉承“稳健投资、长期增值”的投资理念,严格执行基金合同约定的投资策略,在有效控制风险的基础上,追求基金资产长期增值增值。

本基金报告期内,本基金管理人秉承“稳健投资、长期增值”的投资理念,严格执行基金合同约定的投资策略,在有效控制风险的基础上,追求基金资产长期增值增值。

本基金报告期内,本基金管理人秉承“稳健投资、长期增值”的投资理念,严格执行基金合同约定的投资策略,在有效控制风险的基础上,追求基金资产长期增值增值。

本基金报告期内,本基金管理人秉承“稳健投资、长期增值”的投资理念,严格执行基金合同约定的投资策略,在有效控制风险的基础上,追求基金资产长期增值增值。

本基金报告期内,本基金管理人秉承“稳健投资、长期增值”的投资理念,严格执行基金合同约定的投资策略,在有效控制风险的基础上,追求基金资产长期增值增值。

本基金报告期内,本基金管理人秉承“稳健投资、长期增值”的投资理念,严格执行基金合同约定的投资策略,在有效控制风险的基础上,追求基金资产长期增值增值。

本基金报告期内,本基金管理人秉承“稳健投资、长期增值”的投资理念,严格执行基金合同约定的投资策略,在有效控制风险的基础上,追求基金资产长期增值增值。

本基金报告期内,本基金管理人秉承“稳健投资、长期增值”的投资理念,严格执行基金合同约定的投资策略,在有效控制风险的基础上,追求基金资产长期增值增值。

本基金报告期内,本基金管理人秉承“稳健投资、长期增值”的投资理念,严格执行基金合同约定的投资策略,在有效控制风险的基础上,追求基金资产长期增值增值。

本基金报告期内,本基金管理人秉承“稳健投资、长期增值”的投资理念,严格执行基金合同约定的投资策略,在有效控制风险的基础上,追求基金资产长期增值增值。

本基金报告期内,本基金管理人秉承“稳健投资、长期增值”的投资理念,严格执行基金合同约定的投资策略,在有效控制风险的基础上,追求基金资产长期增值增值。

本基金报告期内,本基金管理人秉承“稳健投资、长期增值”的投资理念,严格执行基金合同约定的投资策略,在有效控制风险的基础上,追求基金资产长期增值增值。

本基金报告期内,本基金管理人秉承“稳健投资、长期增值”的投资理念,严格执行基金合同约定的投资策略,在有效控制风险的基础上,追求基金资产长期增值增值。

本基金报告期内,本基金管理人秉承“稳健投资、长期增值”的投资理念,严格执行基金合同约定的投资策略,在有效控制风险的基础上,追求基金资产长期增值增值。

本基金报告期内,本基金管理人秉承“稳健投资、长期增值”的投资理念,严格执行基金合同约定的投资策略,在有效控制风险的基础上,追求基金资产长期增值增值。

本基金报告期内,本基金管理人秉承“稳健投资、长期增值”的投资理念,严格执行基金合同约定的投资策略,在有效控制风险的基础上,追求基金资产长期增值增值。

本基金报告期内,本基金管理人秉承“稳健投资、长期增值”的投资理念,严格执行基金合同约定的投资策略,在有效控制风险的基础上,追求基金资产长期增值增值。

本基金报告期内,本基金管理人秉承“稳健投资、长期增值”的投资理念,严格执行基金合同约定的投资策略,在有效控制风险的基础上,追求基金资产长期增值增值。

本基金报告期内,本基金管理人秉承“稳健投资、长期增值”的投资理念,严格执行基金合同约定的投资策略,在有效控制风险的基础上,追求基金资产长期增值增值。

本基金报告期内,本基金管理人秉承“稳健投资、长期增值”的投资理念,严格执行基金合同约定的投资策略,在有效控制风险的基础上,追求基金资产长期增值增值。

本基金报告期内,本基金管理人秉承“稳健投资、长期增值”的投资理念,严格执行基金合同约定的投资策略,在有效控制风险的基础上,追求基金资产长期增值增值。

本基金报告期内,本基金管理人秉承“稳健投资、长期增值”的投资理念,严格执行基金合同约定的投资策略,在有效控制风险的基础上,追求基金资产长期增值增值。

本基金报告期内,本基金管理人秉承“稳健投资、长期增值”的投资理念,严格执行基金合同约定的投资策略,在有效控制风险的基础上,追求基金资产长期增值增值。

本基金报告期内,本基金管理人秉承“稳健投资、长期增值”的投资理念,严格执行基金合同约定的投资策略,在有效控制风险的基础上,追求基金资产长期增值增值。

本基金报告期内,本基金管理人秉承“稳健投资、长期增值”的投资理念,严格执行基金合同约定的投资策略,在有效控制风险的基础上,追求基金资产长期增值增值。

本基金报告期内,本基金管理人秉承“稳健投资、长期增值”的投资理念,严格执行基金合同约定的投资策略,在有效控制风险的基础上,追求基金资产长期增值增值。

本基金报告期内,本基金管理人秉承“稳健投资、长期增值”的投资理念,严格执行基金合同约定的投资策略,在有效控制风险的基础上,追求基金资产长期增值增值。

本基金报告期内,本基金管理人秉承“稳健投资、长期增值”的投资理念,严格执行基金合同约定的投资策略,在有效控制风险的基础上,追求基金资产长期增值增值。

本基金报告期内,本基金管理人秉承“稳健投资、长期增值”的投资理念,严格执行基金合同约定的投资策略,在有效控制风险的基础上,追求基金资产长期增值增值。

本基金报告期内,本基金管理人秉承“稳健投资、长期增值”的投资理念,严格执行基金合同约定的投资策略,在有效控制风险的基础上,追求基金资产长期增值增值。

本基金报告期内,本基金管理人秉承“稳健投资、长期增值”的投资理念,严格执行基金合同约定的投资策略,在有效控制风险的基础上,追求基金资产长期增值增值。

本基金报告期内,本基金管理人秉承“稳健投资、长期增值”的投资理念,严格执行基金合同约定的投资策略,在有效控制风险的基础上,追求基金资产长期增值增值。

本基金报告期内,本基金管理人秉承“稳健投资、长期增值”的投资理念,严格执行基金合同约定的投资策略,在有效控制风险的基础上,追求基金资产长期增值增值。

本基金报告期内,本基金管理人秉承“稳健投资、长期增值”的投资理念,严格执行基金合同约定的投资策略,在有效控制风险的基础上,追求基金资产长期增值增值。

本基金报告期内,本基金管理人秉承“稳健投资、长期增值”的投资理念,严格执行基金合同约定的投资策略,在有效控制风险的基础上,追求基金资产长期增值增值。

本基金报告期内,本基金管理人秉承“稳健投资、长期增值”的投资理念,严格执行基金合同约定的投资策略,在有效控制风险的基础上,追求基金资产长期增值增值。

本基金报告期内,本基金管理人秉承“稳健投资、长期增值”的投资理念,严格执行基金合同约定的投资策略,在有效控制风险的基础上,追求基金资产长期增值增值。

本基金报告期内,本基金管理人秉承“稳健投资、长期增值”的投资理念,严格执行基金合同约定的投资策略,在有效控制风险的基础上,追求基金资产长期增值增值。

本基金报告期内,本基金管理人秉承“稳健投资、长期增值”的投资理念,严格执行基金合同约定的投资策略,在有效控制风险的基础上,追求基金资产长期增值增值。

本基金报告期内,本基金管理人秉承“稳健投资、长期增值”的投资理念,严格执行基金合同约定的投资策略,在有效控制风险的基础上,追求基金资产长期增值增值。

本基金报告期内,本基金管理人秉承“稳健投资、长期增值”的投资理念,严格执行基金合同约定的投资策略,在有效控制风险的基础上,追求基金资产长期增值增值。

本基金报告期内,本基金管理人秉承“稳健投资、长期增值”的投资理念,严格执行基金合同约定的投资策略,在有效控制风险的基础上,追求基金资产长期增值增值。

本基金报告期内,本基金管理人秉承“稳健投资、长期增值”的投资理念,严格执行基金合同约定的投资策略,在有效控制风险的基础上,追求基金资产长期增值增值。

本基金报告期内,本基金管理人秉承“稳健投资、长期增值”的投资理念,严格执行基金合同约定的投资策略,在有效控制风险的基础上,追求基金资产长期增值增值。

本基金报告期内,本基金管理人秉承“稳健投资、长期增值”的投资理念,严格执行基金合同约定的投资策略,在有效控制风险的基础上,追求基金资产长期增值增值。

本基金报告期内,本基金管理人秉承“稳健投资、长期增值”的投资理念,严格执行基金合同约定的投资策略,在有效控制风险的基础上,追求基金资产长期增值增值。

本基金报告期内,本基金管理人秉承“稳健投资、长期增值”的投资理念,严格执行基金合同约定的投资策略,在有效控制风险的基础上,追求基金资产长期增值增值。

本基金报告期内,本基金管理人秉承“稳健投资、长期增值”的投资理念,严格执行基金合同约定的投资策略,在有效控制风险的基础上,追求基金资产长期增值增值。

本基金报告期内,本基金管理人秉承“稳健投资、长期增值”的投资理念,严格执行基金合同约定的投资策略,在有效控制风险的基础上,追求基金资产长期增值增值。

本基金报告期内,本基金管理人秉承“稳健投资、长期增值”的投资理念,严格执行基金合同约定的投资策略,在有效控制风险的基础上,追求基金资产长期增值增值。

本基金报告期内,本基金管理人秉承“稳健投资、长期增值”的投资理念,严格执行基金合同约定的投资策略,在有效控制风险的基础上,追求基金资产长期增值增值。

本基金报告期内,本基金管理人秉承“稳健投资、长期增值”的投资理念,严格执行基金合同约定的投资策略,在有效控制风险的基础上,追求基金资产长期增值增值。

本基金报告期内,本基金管理人秉承“稳健投资、长期增值”的投资理念,严格执行基金合同约定的投资策略,在有效控制风险的基础上,追求基金资产长期增值增值。

本基金报告期内,本基金管理人秉承“稳健投资、长期增值”的投资理念,严格执行基金合同约定的投资策略,在有效控制风险的基础上,追求基金资产长期增值增值。

本基金报告期内,本基金管理人秉承“稳健投资、长期增值”的投资理念,严格执行基金合同约定的投资策略,在有效控制风险的基础上,追求基金资产长期增值增值。

本基金报告期内,本基金管理人秉承“稳健投资、长期增值”的投资理念,严格执行基金合同约定的投资策略,在有效控制风险的基础上,追求基金资产长期增值增值。

本基金报告期内,本基金管理人秉承“稳健投资、长期增值”的投资理念,严格执行基金合同约定的投资策略,在有效控制风险的基础上,追求基金资产长期增值增值。

本基金报告期内,本基金管理人秉承“稳健投资、长期增值”的投资理念,严格执行基金合同约定的投资策略,在有效控制风险的基础上,追求基金资产长期增值增值。

本基金报告期内,本基金管理人秉承“稳健投资、长期增值”的投资理念,严格执行基金合同约定的投资策略,在有效控制风险的基础上,追求基金资产长期增值增值。

本基金报告期内,本基金管理人秉承“稳健投资、长期增值”的投资理念,严格执行基金合同约定的投资策略,在有效控制风险的基础上,追求基金资产长期增值增值。

本基金报告期内,本基金管理人秉承“稳健投资、长期增值”的投资理念,严格执行基金合同约定的投资策略,在有效控制风险的基础上,追求基金资产长期增值增值。

本基金报告期内,本基金管理人秉承“稳健投资、长期增值”的投资理念,严格执行基金合同约定的投资策略,在有效控制风险的基础上,追求基金资产长期增值增值。

本基金报告期内,本基金管理人秉承“稳健投资、长期增值”的投资理念,严格执行基金合同约定的投资策略,在有效控制风险的基础上,追求基金资产长期增值增值。

本基金报告期内,本基金管理人秉承“稳健投资、长期增值”的投资理念,严格执行基金合同约定的投资策略,在有效控制风险的基础上,追求基金资产长期增值增值。

本基金报告期内,本基金管理人秉承“稳健投资、长期增值”的投资理念,严格执行基金合同约定的投资策略,在有效控制风险的基础上,追求基金资产长期增值增值。

本基金报告期内,本基金管理人秉承“稳健投资、长期增值”的投资理念,严格执行基金合同约定的投资策略,在有效控制风险的基础上,追求基金资产长期增值增值。

本基金报告期内,本基金管理人秉承“稳健投资、长期增值”的投资理念,严格执行基金合同约定的投资策略,在有效控制风险的基础上,追求基金资产长期增值增值。

本基金报告期内,本基金管理人秉承“稳健投资、长期增值”的投资理念,严格执行基金合同约定的投资策略,在有效控制风险的基础上,追求基金资产长期增值增值。

| 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 | 61,946,032.47 | 3.34 |
| B | 采矿业 | - | 0.00 |
| C | 制造业 | 614,088,186.21 | 33.10 |
| D | 电力、热力、燃气及生产供应业 | - | 0.00 |
| E | 建筑业 | 34,897,546.00 | 1.88 |
| F | 批发和零售业 | 53,074,509.48 | 2.86 |
| G | 交通运输、仓储和邮政业 | 18,151,614.00 | 0.98 |
| H | 住宿和餐饮业 | - | 0.00 |
| I | 信息传输、软件和信息技术服务业 | 20,405,133.00 | 1.10 |
| J | 金融业 | 543,602,777.36 | 29.41 |
| K | 房地产业 | 196,297,107.56 | 10.58 |
| L | 租赁和商务服务业 | - | 0.00 |
| 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 | - | 0.00 |
| 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 | - | 0.00 |
| R | 文化、体育和娱乐业 | - | 0.00 |
| S | 综合 | - | 0.00 |
| 合计 | | 1,544,551,002.08 | 83.25 |

§3.3 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 | 600000 | 浦发银行 | 13,374,918 | 126,125,076.74 | 6.74 |
| 2 | 000033 | 荣盛发展 | 2,500,000 | 17,000,000.00 | 0.90 |
| 3 | 601166 | 兴业银行 | 12,220,962 | 124,214,614.68 | 6.70 |
| 4 | 600518 | 康美药业 | 6,600,000 | 118,800,000.00 | 6.40 |
| 5 | 600036 | 招商银行 | 10,740,000 | 116,958,000.00 | 6.30 |
| 6 | 600016 | 民生证券 | 15,000,000 | 115,800,000.00 | 6.24 |
| 7 | 000002 | 万科A | 13,099,000 | 105,192,197.00 | 5.67 |
| 8 | 601318 | 中国平安 | 1,499,978 | 62,904,081.94 | 3.37 |
| 9 | 601222 | 联华电子 | 3,525,736 | 48,388,616.72 | 2.61 |
| 10 | 600000 | 浦发银行 | 1,999,900 | 41,397,500.00 | 2.23 |

§3.4 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 | 国债投资 | - | 0.00 |
| 2 | 央行票据 | - | 0.00 |
| 3 | 金融债券 | - | 0.00 |
| 4 | 其中:政策性金融债 | - | 0.00 |
| 5 | 企业短期融资券 | - | 0.00 |
| 6 | 中期票据 | - | 0.00 |
| 7 | 可转债 | 98,510,980.00 | 5.31 |
| 8 | 其他 | - | 0.00 |
| 9 | 合计 | 98,510,980.00 | 5.31 |

§3.5 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债券投资明细

| 序号 | 债券代码 | 债券名称 | 数量(元) | 公允价值(元) | 占基金资产净值比例(%) |
|----|--------|------|---------|---------------|--------------|
| 1 | 110023 | 民生转债 | 825,000 | 79,637,250.00 | 4.29 |
| 2 | 110002 | 工行转债 | 100,000 | 10,135,000.00 | 0.55 |
| 3 | 110005 | 平安转债 | 81,480 | 8,738,780.00 | 0.47 |

§3.6 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。

§3.7 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权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

§3.8 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

本基金本报告期末未持有股指期货。

§3.9 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

本基金本报告期末未持有国债期货。

§3.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

本基金本报告期末未持有国债期货。

§3.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

本基金本报告期末未持有国债期货。

§3.12 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

本基金本报告期末未持有国债期货。

§3.13 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

本基金本报告期末未持有国债期货。

§3.14 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

本基金本报告期末未持有国债期货。

§3.15 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

本基金本报告期末未持有国债期货。

§3.16 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

本基金本报告期末未持有国债期货。

§3.17 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

本基金本报告期末未持有国债期货。

§3.18 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

本基金本报告期末未持有国债期货。

§3.19 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

本基金本报告期末未持有国债期货。

§3.20 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

本基金本报告期末未持有国债期货。

§3.21 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

本基金本报告期末未持有国债期货。

§3.22 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

本基金本报告期末未持有国债期货。

§3.23 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

本基金本报告期末未持有国债期货。

§3.24 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

本基金本报告期末未持有国债期货。

§3.25 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

本基金本报告期末未持有国债期货。

§3.26 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

本基金本报告期末未持有国债期货。

§3.27 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

本基金本报告期末未持有国债期货。

§3.28 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

本基金本报告期末未持有国债期货。

§3.29 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

本基金本报告期末未持有国债期货。

§3.30 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

本基金本报告期末未持有国债期货。