大成优选股票型证券投资基金

【2010】年度报告摘要

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：2011年3月31日

§1 重要提示

1.1 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。

基金托管人中国银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2011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2010年1月1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	大成优选封闭
基金主代码	150002
交易代码	150002
基金运作方式	契约型封闭式。基金合同生效满12个月后，若基金折价率连续50个交易日超过20%，则基金管理人将在30个工作日内召集基金份额持有人大会，审议有关基金转换运作方式为上市开放式基金(LOF)的事项。
基金合同生效日	2007年8月1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
报告期末基金份额总额	4,674,305,067.90 份
基金合同存续期	5年
基金份额上市的证券交易所	深圳证券交易所
上市日期	2007年9月7日

2.2 基金产品说明

投资目标	追求基金资产长期增值
投资策略	本基金将在全球视野下，基于宏观经济研究，确定大类资产配置比例；通过上市公司基本面分析，主要采用优选个股的主动投资策略，获取超额收益。优选个股是指积极、深入、全面地了解上市公司基本面，动态评估公司价值，当股价低于合理价值区域时，买入并持有；在股价回复到合理价值的过程中，分享股价提升带来的超额收益。
业绩比较基准	80%×沪深300指数+20%×中信标普全债指数
风险收益特征	本基金是股票型基金，风险高于货币市场基金、债券型基金和混合型基金，属于较高风险收益特征的证券投资基金品种。

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	中国银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	杜鹏	唐州徽
	联系电话	0755-83183388	010-66594855
	电子邮箱	dupeng@dcfund.com.cn	tgxxpl@bank-of-china.com
客户服务电话		4008885558	95566
传真		0755-83199588	010-66594942

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1号中国银行股份有限公司托管及投资者服务部

§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	2010 年	2009 年	2008 年
本期已实现收益	1,155,478,696.92	-101,467,169.88	-972,450,784.33
本期利润	690,122,315.48	1,913,413,623.32	-3,003,405,274.84
加权平均基金份额本期利润	0.1476	0.4093	-0.6425
本期基金份额净值增长率	15.78%	76.88%	-54.49%
3.1.2 期末数据和指标	2010 年末	2009 年末	2008 年末
期末可供分配基金份额利润	0.0007	-0.2265	-0.4683
期末基金资产净值	4,995,454,155.41	4,398,817,901.95	2,485,404,278.63
期末基金份额净值	1.069	0.941	0.532

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。

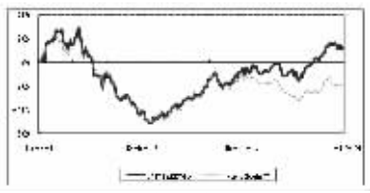
2.所述基金业绩指标不包括持有人交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

3.2 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

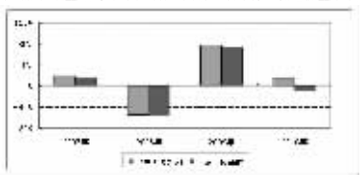
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	7.02%	2.41%	5.00%	3.11%	2.02%	-0.70%
过去六个月	29.70%	2.52%	17.34%	2.58%	12.36%	-0.06%
过去一年	15.78%	2.59%	-9.34%	2.60%	25.12%	-0.01%
过去三年	-6.79%	3.96%	-31.09%	4.06%	24.30%	-0.10%
自基金合同生效起至今	12.57%	4.07%	-20.13%	4.10%	32.70%	-0.03%

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之日起3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：2007年净值增长率表现期间为2007年8月1日（基金合同生效日）至2007年12月31日。

3.3 过去三年基金的利润分配情况

单位：人民币元

年度	每10份基金份额分红数	现金形式发放总额	再投资形式发放总额	年度利润分配合计	备注
2010年	0.2000	93,486,062.02	-	93,486,062.02	-
2009年	-	-	-	-	-
2008年	0.1300	60,765,829.68	-	60,765,829.68	2007年度收益分配
合计	0.3300	154,251,891.70	-	154,251,891.70	-

§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，分别为中泰信托投资有限责任公司（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2010年12月31日，本基金管理人共管理3只封闭式证券投资基金：景宏证券投资基金、景福证券投资基金、大成优选股票型证券投资基金；1只ETF及1只ETF联接基金：深证成长40ETF及大成深证成长40ETF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及15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、大成创新成长股票型证券投资基金（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和大成核心双动力股票型证券投资基金。

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 任职日期	离任日期	证券从业年限	说明
刘明先生	本基金基金经理、助理总经理、投资总监	2007年8月1日	-	18年	硕士，曾任厦门证券公司鹭江营业部总经理、厦门产权交易中心副总经理及香港时富金融服务集团投资经理，2004年3月加盟大成基金管理有限公司，2004年10月22日-2008年1月12日曾任景宏证券投资基金基金经理，2007年8月1日起担任大成优选股票型证券投资基金基金经理，现同时任大成基金管理有限公司助理总经理、首席投资官、投资决策委员会主席。具有基金从业资格。国籍：中国。
郭海洋先生	本基金基金经理助理	2007年12月27日	-	6年	金融学硕士，曾任华西证券投资研究部研究员、大成基金管理公司研究部研究员。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》、《大成优选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，大成优选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 公平交易制度的执行情况

本基金管理人严格执行《公平交易制度》和《异常交易监控与报告制度》，公平对待旗下各投资组合，所管理的不同投资组合的整体收益率、分投资类别（股票、债券）的收益率以及不同时间窗内（同日内、5日内、10日内）同向、反向交易的交易价格并未发现异常差异。

4.3.2 本投资组合与其他投资风格相似的投资组合之间的业绩比较

根据各基金合同，目前本基金管理人旗下未有与本基金投资风格相似的其他基金。

4.3.3 异常交易行为的专项说明

本报告期内本基金不存在可能导致不公平交易和利益输送的异常交易行为。

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2010年，世界经济复苏蹒跚而行，调控政策一波三折。上半年全球主要经济体都面临一定的紧缩态势，这是2009年各经济体超乎寻常的扩张政策而在其后所必须支付的代价，实体经济均显现了复苏放缓的迹象，经济增长率还远低于潜在增长水平，就业依然没有出现明显的改善。随之，各国政府深怕货币政策退出而损害蹒跚向前的经济复苏，竞相采取新一轮的货币刺激政策。虽然美国经济中几大潜在风险：失业率居高不下、房地产市场低迷和政府巨额债务依然无法解决，但“就业增长——消费复苏”的正循环逐步形成，个人消费取代再库存成为支撑经济增长的主要动力，复苏势头有所巩固，美国经济有步入危机前的常态增长轨道的迹象。中国经济2010年整体而言表现强劲，已经出现过热的苗头，经济总量超过日本，位居全球第二。房地产和汽车两大消费市场继续增长，在一系列调控政策下房价再创新高，固定资产投资完成额维持高位，外贸数据一再超出市场预期。与此同时，通货膨胀压力大幅超出市场的前期判断，11月份CPI达到5.1%，超越5%的政府警戒线，核心CPI从1月的0%提高到11月的1.5%，2009年的天量货币投放开始带来全面的通胀压力。因此防通胀成为近期政府的调控重点，货币政策由“宽松”转变为“稳健”，3次上调银行存款准备金，2次加息接踵而来。与此同时政府仍在延续“调结构、促民生”的宏观政策，新兴产业发展规划相继出台。

股票市场充分反应了经济的变化和未来发展趋势，在过去的一年里A股市场为国际主要市场中表现最差的市场，沪深300指数下跌12.51%，但中小板指数上涨21.26%。究其原因既有基本面的原因，也有结构的原因，占指数比例较大的房地产、银行、钢铁、航运等传统周期类板块大幅下跌，估值水平一降再降，映射了经济发展模式的转变。而可能成为未来支柱性行业的新兴产业、装备制造等行业，以及业绩持续超预期的医药生物大幅上涨。基于对宏观经济和市场较为准确的判断和反映，本基金在报告期间取得了较好的投资业绩，一方面维持较为积极的仓位配置，和优选个股的投资思路，另一方面集中增持长期看好的大消费和节能减排板块中具有一定品牌和影响力的龙头公司，获取了显著的超额收益。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末，本基金份额净值为1.069元，本报告期份额净值增长率为15.78%，同期业绩比较基准增长率为-9.34%，高于同期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

前瞻性的看，海外经济复苏存在超预期的可能，占据美国经济70%的个人消费近来表现出来了良好的增长势头，失业率不断下降，第二次的量化宽松政策已经开始产生效果，各个研究机构近期不断上调美国经济预测。欧洲在央行一系列宽松政策下，虽然效用显著慢于美国，但已经出现了走好的曙光。海外经济复苏将会对中国带来一系列影响，如出口大幅增长、美元走强、资本回流、大宗原材料价格上涨以及输入性通胀等，将会使本不明朗的中国经济走势更为复杂。

整体而言中国经济未来一年机遇与风险并存。一方面经济继续保持较高增速，明年是十二五的开局之年，基础设施投资和保障性住房投资仍会大规模展开，确保明年经济会相对较快地增长；另一方面通胀压力依然很大，货币的过量投放，大旱带来的夏粮减产，以及未来可能的输入性通胀，使得抑制高通胀将成为中央2011年最重要的工作目标，但通胀回落的同时必然伴随着经济的减速。从目前的经济形式来看，培育新的经济增长点的要求更加迫切，国家对新兴产业的规划日益清晰，逐步落实新兴产业的产业规划和扶持政策将贯穿2011年。此外央行正在理顺货币体系的机制，尤其是差别存款准备金率和利率的市场化这两个可能会出台的政策，这些新的机制会对市场和宏观经济造成何种影响，我们将密切关注。

对于A股市场而言，在经历2010年的结构性调整后，市场新的格局已经形成，传统周期性行业10倍估值，消费类行业20倍估值，而新兴产业30倍估值，这映射了潜在行业增速和未来经济格局的趋势。因此我们认为市场的结构性机会将会减少，市场更为均衡。从长期来看我们依然坚定看好大消费板块，中国经济必将从外需和投资拉动模式转向内需为主的增长模式，继续坚定持有具有一定品牌和影响力的龙头公司，同时密切关注新兴产业和高端装备制造业中成长性确定的个股。

2011年市场环境较过去的一年更为复杂，我们将坚持优选个股、自下而上的投资风格，努力工作，争取获得良好的收益水平。

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、固定收益部、金融工程部、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8名成员中包括两名投资组合经理。

股票投资部、固定收益部、金融工程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基金合同的规定进行收益分配。本报告期内已分配利润93,486,062.02元（每十份基金份额分红0.20元），符合基金合同规定的分红比例。

§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

本报告期内，中国银行股份有限公司（以下称“本托管人”）在对大成优选股票型证券投资基金（以下称“本基金”）的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了应尽的义务。

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

本报告期内，本托管人根据《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，对本基金管理人的投资运作进行了必要的监督，对基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算以及基金费用开支等方面进行了认真地复核，未发现本基金管理人存在损害基金份额持有人利益的行为。

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

本报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告（注：财务会计报告中的“金融工具风险及管理”部分未在托管人复核范围内）、投资组合报告等数据真实、准确和完整。

§6 审计报告

本基金2010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：大成优选股票型证券投资基金

报告截止日：2010年12月31日

单位：人民币元

资 产	本期末 2010年12月31日	上年度末 2009年12月31日
资 产：		
银行存款	382,626,409.41	62,702,726.21
结算备付金	6,541,109.91	4,461,477.76
存出保证金	637,549.12	1,626,194.55
交易性金融资产	4,883,753,456.22	4,229,306,695.06
其中：股票投资	4,883,753,456.22	4,229,306,695.06
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	-	108,141,238.53
应收利息	147,434.74	10,484.49
应收股利	-	-
应收申购款	-	-
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	-
资产总计	5,273,705,959.40	4,406,248,816.60
负债和所有者权益	本期期末 2010年12月31日	上年度末 2009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	258,708,342.62	-
应付赎回款	-	-
应付管理人报酬	5,408,689.71	4,503,669.99
应付托管费	1,081,737.94	900,733.98
应付销售服务费	-	-
应付交易费用	5,311,761.88	1,403,952.28
应交税费	22,558.40	22,558.40
应付利息	-	-
应付利润	7,118,713.44	-
递延所得税负债	-	-
其他负债	600,000.00	600,000.00
负债合计	278,251,803.99	7,430,914.65
所有者权益：		
实收基金	4,674,305,067.90	4,674,305,067.90
未分配利润	321,149,087.51	-275,487,165.95
所有者权益合计	4,995,454,155.41	4,398,817,901.95
负债和所有者权益总计	5,273,705,959.40	4,406,248,816.60

注：报告截止日2010年12月31日，基金份额净值1.069元，基金份额总额4,674,305,067.90份。

7.2 利润表

会计主体：大成优选股票型证券投资基金

本报告期：2010年1月1日至2010年12月31日

单位：人民币元

项 目	本期 2010年1月1日至2010年12月31日	上年度可比期间 2009年1月1日至2009年12月31日
一、收入	773,335,138.74	1,976,007,564.01
1.利息收入	2,498,675.85	4,939,360.13
其中：存款利息收入	2,498,675.85	1,585,054.97
债券利息收入	-	3,354,305.16
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)	1,236,182,400.39	-43,835,499.86
其中：股票投资收益	1,211,412,008.76	-77,374,204.30
基金投资收益	-	-
债券投资收益	-	15,492,368.34
资产支持证券投资收益	-	-
衍生工具收益	-	-
股利收益	24,770,391.63	18,046,336.10
3.公允价值变动收益(损失以“-”号填列)	-465,356,381.44	2,014,880,793.20
4. 汇兑收益(损失以“-”号填列)	-	-
5.其他收入(损失以“-”号填列)	10,443.94	22,910.54
减：二、费用	83,212,823.26	62,593,940.69
1.管理人报酬	55,872,617.43	43,697,240.76
2.托管费	11,174,523.50	8,739,448.10
3.销售服务费	-	-
4.交易费用	15,397,705.81	9,677,109.94
5.利息支出	-	-
其中：卖出回购金融资产支出	-	-
6.其他费用	767,976.52	480,141.89
三、利润总额	690,122,315.48	1,913,413,623.32
减：所得税费用	-	-
四、净利润(净亏损以“-”号填列)	690,122,315.48	1,913,413,623.32

7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：大成优选股票型证券投资基金

本报告期：2010年1月1日至2010年12月31日

单位：人民币元

项目	本期 2010年1月1日至2010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)	4,674,305,067.90	-275,487,165.95	4,398,817,901.95
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	690,122,315.48	690,122,315.48
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)	-	-	-
其中：1.基金申购款	-	-	-
2.基金赎回款	-	-	-
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）	-	-93,486,062.02	-93,486,062.02
五、期末所有者权益(基金净值)	4,674,305,067.90	321,149,087.51	4,995,454,155.41
项目	上年度可比期间 2009年1月1日至2009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)	4,674,305,067.90	-2,188,900,789.27	2,485,404,278.63
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	1,913,413,623.32	1,913,413,623.32
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)	-	-	-
其中：1.基金申购款	-	-	-
2.基金赎回款	-	-	-
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)	4,674,305,067.90	-275,487,165.95	4,398,817,901.95

注：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：

基金管理公司负责人：王颙　　主管会计工作负责人：刘彩晖　　会计机构负责人：范瑛

7.4 报表附注

7.4.1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相一致的说明

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相一致。

7.4.2 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
中国银行股份有限公司（“中国银行”）	基金托管人
光大证券股份有限公司（“光大证券”）	基金管理人的股东
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
中泰信托投资有限责任公司	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。

7.4.3 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.3.1 通过关联方交易单元进行的交易

7.4.3.1.1股票交易

关联方名称	本期 2010年1月1日至 2010年12月31日		上年度可比期间 2009年1月1日至 2009年12月31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	311,362,592.98	3.09%	-	-

7.4.3.1.2权证交易

无。

7.4.3.1.3应支付关联方的佣金

关联方名称	本期 2010年1月1日至2010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	252,983.51	3.03%	252,983.51	4.76%
关联方名称	上年度可比期间 2009年1月1日至2009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	-	-	-	-

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、经手费和适用期间内由券商承担的证券结算风险基金后的净额列示。

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。

7.4.3.2 关联方报酬

7.4.3.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2010年1月1日至 2010年12月31日	上年度可比期间 2009年1月1日至 2009年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	55,872,617.43	43,697,240.76
其中：支付给销售机构的客户维护费	-	-

注：支付基金管理人大成基金的管理人报酬由管理费和业绩报酬两部分构成，其中管理费按前一日基金资产净值1.25%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：

日管理人报酬=前一日基金资产净值 X 1.25% / 当年天数。

遵照本基金合同的规定及《关于大成优选股票型证券投资基金提取2010年度业绩报酬的公告》，2010年度业绩报酬41,846,205.12元于2011年1月27日提取（2009年度：无）。

7.4.3.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2010年1月1日至 2010年12月31日	上年度可比期间 2009年1月1日至 2009年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	11,174,523.50	8,739,448.10

注：支付基金托管人中国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。

7.4.3.3 与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易

单位：人民币元

本期 2010年1月1日至2010年12月31日					
银行间市场交易的各关联方名称	债券交易金额		基金逆回购		基金正回购	
	基金买入	基金卖出	交易金额	利息收入	交易金额	利息支出
中国银行	-	-	-	-	-	-
上年度可比期间 2009年1月1日至2009年12月31日						
银行间市场交易的各关联方名称	债券交易金额		基金逆回购		基金正回购	
	基金买入	基金卖出	交易金额	利息收入	交易金额	利息支出
中国银行	-	159,607,819.86	-	-	-	-

7.4.3.4 各关联方投资本基金的情况

7.4.3.4.1 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 2010年1月1日至 2010年12月31日	上年度可比期间 2009年1月1日至 2009年12月31日
期初持有的基金份额	35,672,293.00	35,672,293.00
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	-	-
期末持有的基金份额	35,672,293.00	35,672,293.00
期末持有的基金份额占基金总份额比例	0.76%	0.76%

7.4.3.4.2 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

关联方名称	本期末 2010年12月31日		上年度末 2009年12月31日	
	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例	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	2,000,000.00	0.04%	-	-

7.4.3.5 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 2010年1月1日至2010年12月31日		上年度可比期间 2009年1月1日至2009年12月31日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国银行	382,626,409.41	2,465,583.85	62,702,726.21	1,547,564.50

注：本基金的银行存款由基金托管人中国银行保管，按银行同业利率计息。7.4.3.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

无。

7.4.3.7 其他关联交易事项的说明

无。

7.4.4 期末（2010年12月31日）本基金持有的流通受限证券

7.4.4.1 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

7.4.4.1.1 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
600011	华能国际	2010/12/29	2011/12/23	非公开发行	5.57	5.58	10,000,000	55,700,000.00	55,800,000.00
600703	三安光电	2010/10/15	2011/10/13	非公开发行	30.00	33.75	5,000,000	150,000,000.00	168,750,000.00
601933	永辉超市	2010/12/09	2011/03/15	网下申购	23.98	31.24	19,786	474,468.28	618,114.64
300134	大富科技	2010/10/14	2011/01/26	网下申购	49.50	66.00	46,728	2,313,036.00	3,084,048.00

注：基金可使用以基金名义开设的股票账户，选择网上或者网下一种方式进行新股申购。其中基金作为一般法人或战略投资者认购的新股，根据基金与上市公司所签订申购协议的规定，在新股上市后的约定期限内不能自由转让；基金作为个人投资者参与网上认购获配的新股，从新股获配日至新股上市日之间不能自由转让。此外，基金还可作为特定投资者，认购由中国证监会《上市公司证券发行管理办法》规范的非公开发行股票，所认购的股票自发行结束之日起12个月内不得转让。

7.4.4.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

无。

7.4.4.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.4.3.1 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。

7.4.4.3.2 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。

§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	4,883,753,456.22	92.61
	其中：股票	4,883,753,456.22	92.61
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	389,167,519.32	7.38
6	其他各项资产	784,983.86	0.01
7	合计	5,273,705,959.40	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	-	0.00
B	采掘业	40,231,181.10	0.81
C	制造业	3,136,734,020.63	62.79
C0	食品、饮料	406,877,374.26	8.14
C1	纺织、服装、皮毛	-	0.00
C2	木材、家具	-	0.00
C3	造纸、印刷	-	0.00
C4	石油、化学、塑胶、塑料	403,034,672.20	8.07
C5	电子	-	0.00
C6	金属、非金属	-	0.00
C7	机械、设备、仪表	2,010,438,188.21	40.25
C8	医药、生物制品	316,383,785.96	6.33
C99	其他制造业	-	0.00
D	电力、煤气及水的生产和供应业	55,800,000.00	1.12
E	建筑业	-	0.00
F	交通运输、仓储业	-	0.00
G	信息技术业	3,084,048.00	0.06
H	批发和零售贸易	412,584,792.44	8.26
I	金融、保险业	1,132,158,295.57	22.66
J	房地产业	-	0.00
K	社会服务业	-	0.00
L	传播与文化产业	103,161,118.48	2.07
M	综合类	-	0.00
	合计	4,883,753,456.22	97.76

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	600690	青岛海尔	17,501,841	493,726,934.61	9.88
2	000651	格力电器	26,552,875	481,403,623.75	9.64
3	000527	美的电器	26,984,261	469,526,141.40	9.40
4	002024	苏宁电器	31,447,838	411,966,677.80	8.25
5	601318	中国平安	7,313,029	410,699,708.64