大成优选股票型证券投资基金（LOF）

2012年12月31日

【2012】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
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一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2013年3月22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。

大成优选股票型证券投资基金本报告期自2012年1月1日起至7月26日止，大成优选股票型证券投资基金（LOF）本报告期自2012年7月27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（转型前）

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

注：本基金在交易所行情系统净值揭示等其他信息披露场合下，可简称为“大成优选”。

2.1 基金基本情况（转型后）

基金简称	大成优选股票(LOF)
基金主代码	160916
交易代码	160916
基金运作方式	上市契约型开放式(LOF)
基金合同生效日	2012年7月27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	2,277,127,966.38份
基金合同存续期	不定期
基金份额上市的证券交易所	深圳证券交易所
上市日期	2012年12月28日

注：本基金在交易所行情系统净值揭示等其他信息披露场合下，可简称为“优选LOF”。

2.2 基金产品说明（转型前）

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%×中信标普金融指数
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。

2.2 基金产品说明（转型后）

投资目标	在有效控制风险的基础上，追求基金资产长期稳健增值。
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	沪深300指数收益率×80%+中证综合债券指数收益率×20%
风险收益特征	本基金属于较票型基金，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，属于较高风险收益特征的开放式基金。

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	2012年 转型前(2012年1月1日—2012年7月26日)	2012年 转型后(2012年7月27日—2012年12月31日)	2011年	2010年
本期已实现收益	-338,866,016.42	-436,181,363.99	-56,770,775.81	1,155,478,696.92
本期利润	133,751,208.80	132,269,190.08	-1,473,935,052.41	690,122,315.48
加权平均基金份额本期利润	0.0286	0.0410	-0.3153	0.1476
本期基金份额净值增长率	3.85%	5.91%	-29.56%	15.78%
3.1.2 期末数据和指标	2012年末		2011年末	2010年末
期末可供分配基金份额利润	-0.2180	-0.2628	-0.2466	0.0007
期末基金资产净值	3,655,270,311.80	2,476,384,747.57	3,521,519,103.00	4,995,454,155.41
期末基金份额净值	0.782	1.088	0.753	1.069

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。

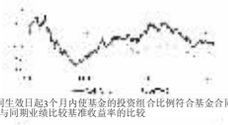
2.所述基金业绩指标不包括持有人交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

3.2 基金净值表现（转型前）

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

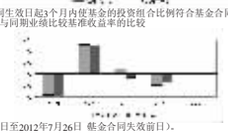
阶段	转型前 份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	-6.12%	2.02%	-8.33%	1.68%	2.21%	0.34%
过去六个月	-21.80%	2.20%	-4.39%	1.76%	-17.41%	0.44%
过去一年	-22.03%	2.64%	-16.06%	2.14%	-5.97%	0.50%
过去三年	-20.30%	2.75%	-27.70%	2.45%	7.40%	0.30%
自基金合同生效起至今	-17.65%	3.65%	-35.33%	3.42%	17.68%	0.23%

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：本基金已按基金合同规定，自基金合同生效日起3个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的约定。

3.2.3 过去五年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



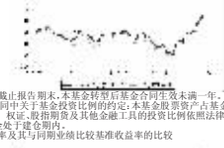
注：2012年净值增长率期间为2012年1月1日至2012年7月26日（基金合同失效前日）。

3.2 基金净值表现（转型后）

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	转型后 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	7.09%	1.02%	8.16%	1.02%	-1.07%	0.00%
自基金合同生效起至今	5.91%	0.89%	6.11%	1.02%	-0.20%	-0.13%

3.2.2 自基金转型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

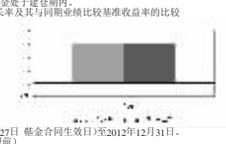


注：1、本基金转型日期为2012年7月27日，截止报告期末，本基金转型后基金合同生效未满一年。

2、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约定：本基金股票资产占基金资产的比例为60%-95%；现金以及到期日在一年以内的政府债券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。

本基金的建仓期为6个月，本报告期末基金处于建仓期内。

3.2.3 自基金转型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年净值增长率期间为2012年7月27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（转型前）

金额单位：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
2012	-	-	-	-	
2011	-	-	-	-	
2010	0.2000	93,486,062.02	-	93,486,062.02	
合计	0.2000	93,486,062.02	-	93,486,062.02	

3.3过去三年基金的利润分配情况（转型前）

无利润分配。

§4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理

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［999］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21只封闭式证券投资基金；货币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；大成价值博长证券投资基金、大成优势证券投资基金、大成蓝筹稳健证券投资基金、大成鼎益证券投资基金、大成鼎丰债券证券投资基金、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（转型前）

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	2007年8月1日	2012年7月26日	20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日至2012年7月26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日起任大成优选股票型证券投资基金(LOF)基金，现同时任大成基金管理有限公司助理总经理，股票投资决策委员会主席。具有基金从业资格。国籍：中国
李畅先生	本基金基金经理助理	2011年7月29日	2012年7月26日	5年	硕士，2007年7月至2009年1月曾就职于中国证券监督委员会深圳监管局，2009年2月加入大成基金管理有限公司，历任银行、军工、有色等行业研究员，2011年7月29日起担任大成优选股票型证券投资基金经理助理。具有基金从业资格。国籍：中国。

基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介（转型后）

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	2012年7月27日	-	20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日至2012年7月26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日起任大成优选股票型证券投资基金(LOF)基金，现同时任大成基金管理有限公司助理总经理，股票投资决策委员会主席。具有基金从业资格。国籍：中国
洛义峰先生	本基金基金经理、数量投资部总监	2012年11月26日	-	6年	中国科学院管理学博士，曾就职于博时基金管理有限公司，历任金融工程师、股票投资部数量化研究员、数量化研究员兼任博时特许价值股票型证券投资基金及招裕泽证券投资基金的基金经理助理，2010年3月12日至2012年6月11日曾任博时监察沪深300指数证券投资基金基金经理及博时特许价值股票型证券投资基金基金经理。2012年11月26日起任大成优选股票型证券投资基金(LOF)基金经理，2013年3月8日起担任大成价值博长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。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、大成优选股票型证券投资基金（LOF）基金合同》和其他有关法律法规的规定在基金的投资范围、投资比例、投资组合、证券交易行为、信息披露等方面符合有关法律法规、行业监管规则和基金合同等规定，没有发生重大违法违规行为，没有运用基金财产进行牟取不公利益行为和损害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、二级市场买卖等投资管理活动，内容包括投权、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同进续4个季度的日内、3日内及4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%。给公交价差分析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。

2012年基金管理人旗下主动投资组合同股票交易存在6笔同日反向交易，原因是投资组合投资策略需要，目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0次，原因是指数型投资组合投资策略需要，投资组合间信息交易存在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%。投资组合间相空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

2012年A股走出N型震荡行情，上证指数上涨3.17%，深成指上涨2.22%，中小板指数下跌1.38%，创业板指数下跌2.14%，沪深300指数上涨7.55%。

回顾2012年国内宏观经济形势，经济增速远低于年初市场预期，前3个季度GDP增速不断下滑，前9个月规模以上工业企业利润持续负增长，付随着经济增速放缓，今年通货膨胀水平明显下降，但政策放松的力度相对有限。货币政策方面，央行仅下调了两次存贷款基准利率和两次存款准备金率，受制于财政收入增长缓慢以及土地出让收入下滑，基建投资增速回升幅度也有限。

2012年初，在市场预期政府将继续货币政策和房地产政策来维持经济增长的背景下，金融和地产板块领涨推动股指反弹。二季度，由于经济增速和企业盈利增速下滑超预期，宏观政策也一直维持稳健偏紧的态势，加上前期预期的地产限购放松、券老金入市等利好政策迟迟没有兑现，股指从5月开始就逐级下跌。随后，虽然监管部门出台了股票交易费用减免、停发新股、限制创业板大非解禁套现等一系列措施，仍难扭转市场对经济增长的悲观预期，股指持续下跌。上证综指于11月27日收盘跌破2000点，而年底12月，由于经济企稳信号明显、资金面改善以及国际政策利好因素的刺激，以银行为首的周期板块爆发式上涨，最终上证和沪深300指数收复前期跌幅。

报告期内本基金基于对宏观经济和市场大势的判断，坚持自下而上、精选个股的投资思路，坚定持有估值较低且2012年成长确定的银行、保险、地产、家电、汽车等板块的龙头优质个股。

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1.088元，2012年7月27日至2012年12月31日基金份额净值增长率为5.91%，同期业绩比较基准收益率为6.11%，低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

展望2013年，预计国内宏观经济形势将好于2011、2012年，虽然仍处在长期经济增速下台阶的大背景下，但有望在一段时期内保持平稳复苏，经济增速对A股的负面影响将减弱。但同时，其他影响A股的重要因素却比往年更加错综复杂，如经济结构转型、新一届政府的政策方向、海外经济复苏进程等，这些因素的不确定性增加了今年基金投资操作的难度，但更可能成为获取超额收益的机会。

2012年四季度国内GDP同比增长7.9%，见底回升；12月，规模以上工业增加值同比增速10.3%，连续4个月回升，确认经济步入温和复苏。2013年房地产政策和货币政策的导向，是影响经济复苏程度的重要因素。目前一线城市房地产库存不高且需求旺盛，房价上涨压力较大，但可对稳定经济增长的考虑，出台更加严格的地产调控政策的概率不大，预计2013年房地产销售和投资都会稳定增长，货币政策方面，由于预期通胀水平会随着经济复苏回升，央行更可能采取降准和适当放松信贷额度的方式增加流动性。

中国经济转型的方向和方式也会在今年逐渐明朗。一季度末的“钢会”和下半年的十八届三中全会，将让市场更加清晰的了解新一届政府对于未来经济工作的布局重点，这些战略构想和规划不但对2013年，甚至对于中国未来十年的长期经济发展都会产生深远的影响。我们未来主要的投资方向是：在经济新旧转换过程中，将到新发展空间的行业，以及有能力在这些行业中成占市场、实现盈利快速增长的公司。

从国季度PMI等先行指标来看，美国经济是续温和复苏，欧元区有底部企稳迹象，中国四季度进出口增速在海外经济回暖的带动下温和复苏，预计2013年进出口复苏态势将持续，在关注出口对国内经济拉动的同时，需警惕由于欧美经济繁荣，大量资产从新兴市场撤出的风险。

基于以逐个析，着眼于中国经济结构转型的长期趋势，挖掘受益于内需稳定成长的大消费板块和受益于结构转型的新兴产业个股仍将是我们始终坚持的主要投资方向。从具体行业来看，我们继续坚定配置大消费中以家电、汽车、医药、食品饮料为代表的内需成长企业，及银行、地产等低估值板块，同时积极关注符合经济转型趋势、行业潜在空间较大并具备长期核心竞争力的新兴产业个股。

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是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调整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调整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估，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、并负责与托管方进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执行，基金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书面传递机制，基金经理及投资经理作为估值小组成员，对本基金估值涉及的交易情况、信息披露情况保持密切关注，基金内部和托管方以电话、邮件等方式进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执行，基金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书面传递机制，基金经理及投资经理作为估值小组成员，对本基金估值涉及的交易情况、信息披露情况保持密切关注，基金内部和托管方以电话、邮件等方式进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。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金管理人将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

本报告期内，中国银行股份有限公司（以下称“本托管人”）在对转型前大成优选股票型证券投资基金及转型后大成优选股票型证券投资基金（LOF）（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（转型前）

7.1 资产负债表（转型前）

会计主体：大成优选股票型证券投资基金

报表截止日：2012年7月26日（基金合同失效前日）

单位：人民币元

资 产	2012年7月26日(基金合同失效前日)	上年度末 2011年12月31日
资产：		
银行存款	115,992,251.00	388,242,450.59
结算备付金	-	1,558,332.90
存出保证金	618,871.31	870,676.50
交易性金融资产	2,540,564,825.39	3,130,974,187.54
其中：股票投资	2,540,564,825.39	3,130,974,187.54
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	1,000,000,000.00	-
应收证券清算款	322,826.31	5,929,870.65
应收利息	489,063.98	76,113.02
应收股利	1,465,413.98	-
应收申购款	-	-
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	-
资产总计	3,659,453,251.97	3,527,651,631.20
负债和所有者权益	2012年7月26日(基金合同失效前日)	上年度末 2011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	-	-
应付管理人报酬	1,428,491.36	3,929,707.79
应付托管费	666,166.53	785,941.58
应付销售服务费	-	-
应付交易费用	1,300,320.68	482,565.23
应交税费	16,313.60	16,313.60
应付利息	-	-
应付利润	-	-
递延所得税负债	-	-
其他负债	771,648.00	918,000.00
负债合计	4,182,940.17	6,132,528.20
所有者权益：		
实收基金	4,674,305,067.90	4,674,305,067.90
未分配利润	-1,019,034,756.10	-1,152,785,964.90
所有者权益合计	3,655,270,311.80	3,521,519,103.00
负债和所有者权益总计	3,659,453,251.97	3,527,651,631.20

注：报告截止日2012年7月26日（基金合同失效前日），基金份额净值0.782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：2012年1月1日至2012年7月26日（基金合同失效前日）

单位：人民币元

项 目	本期 2012年1月1日至2012年7月26日	上年度可比期间 2011年1月1日至2011年12月31日
一、收入	168,536,466.86	-1,357,687,831.17
1.利息收入	2,789,369.09	2,491,611.76
其中：存款利息收入	1,696,380.51	2,491,611.76
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	1,092,988.58	-
其他利息收入	-	-
2.投资收益(损失以“-”填列)	-330,104,902.79	56,984,833.67
其中：股票投资收益	-380,044,616.31	16,115,508.25
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	49,939,713.52	40,869,325.42
3.公允价值变动收益(损失以“-”号填列)	472,617,225.22	-1,417,164,276.60
4.汇兑收益(损失以“-”号填列)	-	-
5.其他收入(损失以“-”号填列)	23,234,775.34	-
二、费用	34,785,258.06	116,247,221.24
1.管理人报酬	25,006,617.10	98,881,515.84
2.托管费	5,381,791.67	11,407,062.14
3.销售服务费	-	-
4.交易费用	4,056,006.66	5,455,981.03
5.利息支出	-	-
其中：卖出回购金融资产支出	-	-
6.其他费用	340,842.63	502,662.23
三、利润总额(亏损总额以“-”号填列)	133,751,208.80	-1,473,935,052.41
减：所得税费用	-	-
四、净利润(净亏损以“-”号填列)	133,751,208.80	-1,473,935,052.41

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：2012年1月1日至2012年7月26日

单位：人民币元

项目	本期 2012年1月1日至2012年7月26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	-1,152,785,964.90	3,521,519,103.00
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	133,751,208.80	133,751,208.80
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	-1,019,034,756.10	3,655,270,311.80

项目	上年度可比期间 2011年1月1日至2011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	321,149,087.51	4,995,454,155.41
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	-1,473,935,052.41	-1,473,935,052.41
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	-1,152,785,964.90	3,521,519,103.00

注：根据财政部颁布的《关于完善证券投资基金会计核算有关问题的通知》（财会[2007]48号）的有关规定，本公司制定了相应的会计政策。

本报告期内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。

7.4.1.4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
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
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。

7.4.3 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

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2012年1月1日至2012年7月26日		上年度可比期间 2011年1月1日至2011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	83,441,202.58	3.43%	200,029,965.58	5.77%

7.4.3.1.2 权证交易

无。

7.4.3.1.3 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1月1日至2012年7月26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	70,077.95	3.43%	-	-

关联方名称	上年度可比期间 2011年1月1日至2011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	162,525.36	5.64%	11,279.92	2.34%

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。

7.4.3.2 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 2012年1月1日至2012年7月26日	上年度可比期间 2011年1月1日至2011年12月31日
当期发生的基金应支付的管理人报酬	25,006,617.10	98,881,515.84
其中：支付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。

7.4.3.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2012年1月1日至2012年7月26日	上年度可比期间 2011年1月1日至2011年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	5,381,791.67	11,407,062.14

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

本报告期内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。

7.4.3.4 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 2012年1月1日至2012年7月26日	上年度可比期间 2011年1月1日至2011年12月31日
基金合同生效日持有的基金份额	35,672,293.00	35,672,293.00
期初持有的基金份额	-	-
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%

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。

7.4.3.4.2