

## 大成优选股股票型证券投资基金(LOF)

[2013] 第四季度报告

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

报告送达日期:2014年1月22日

基金简称:大成优选股(LOF)

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

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,追求基金资产长期稳健增值。

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,通过上市公司的基本面分析,主要采用价值投资的主动管理策略,获取超额收益。优选个股指标深,深入全面地了解上市公司基本面,动态评估公司价值,当股价低于合理估值区域时,买入并持有,在股价回到合理估值的进程中,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:本基金属于股票基金,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开放式基金。

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方面披露场合,公司简称为“优选LOF”。

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

单位:人民币元

主要财务指标 报告期(2013年10月1日—2013年12月31日)

1.本期已实现收益 10,299,309.79

2.本期平均基金份额本期利润 -43,731,042.94

3.期末平均基金份额净值 -0.0256

4.期末基金份额净值 1,855,260,351.51

5.期末基金份额净值 1.122

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.本期平均基金份额净值是指截至报告期末的基金份额净值除以报告期末的基金份额总数;3.期末基金份额净值未扣除费用;4.本基金业经审计的2013年度报告披露于本公司网站。

§ 2 基金产品概况

基金简称:大成优选股(LOF)

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

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,追求基金资产长期稳健增值。

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,通过上市公司的基本面分析,主要采用价值投资的主动管理策略,获取超额收益。优选个股指标深,深入全面地了解上市公司基本面,动态评估公司价值,当股价低于合理估值区域时,买入并持有,在股价回到合理估值的进程中,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:本基金属于股票基金,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开放式基金。

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方面披露场合,公司简称为“优选LOF”。

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

单位:人民币元

主要财务指标 报告期(2013年10月1日—2013年12月31日)

1.本期已实现收益 10,299,309.79

2.本期平均基金份额本期利润 -43,731,042.94

3.期末平均基金份额净值 -0.0256

4.期末基金份额净值 1,855,260,351.51

5.期末基金份额净值 1.122

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.本期平均基金份额净值是指截至报告期末的基金份额净值除以报告期末的基金份额总数;3.期末基金份额净值未扣除费用;4.本基金业经审计的2013年度报告披露于本公司网站。

§ 2.1 基金业经审计的财务报告

审计意见:无

报告期间:2013年10月1日起至2013年12月31日止

报告期末:2013年12月31日

货币单位:人民币元

§ 3.1 主要财务指标

报告期(2013年10月1日—2013年12月31日)

1.本期已实现收益 10,299,309.79

2.本期平均基金份额本期利润 -43,731,042.94

3.期末平均基金份额净值 -0.0256

4.期末基金份额净值 1,855,260,351.51

5.期末基金份额净值 1.122

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.本期平均基金份额净值是指截至报告期末的基金份额净值除以报告期末的基金份额总数;3.期末基金份额净值未扣除费用;4.本基金业经审计的2013年度报告披露于本公司网站。

§ 3.2 基金业经审计的财务报告

审计意见:无

报告期间:2013年10月1日起至2013年12月31日止

报告期末:2013年12月31日

货币单位:人民币元

§ 3.3 主要财务指标和基金净值表现

报告期(2013年10月1日—2013年12月31日)

1.本期已实现收益 10,299,309.79

2.本期平均基金份额本期利润 -43,731,042.94

3.期末平均基金份额净值 -0.0256

4.期末基金份额净值 1,855,260,351.51

5.期末基金份额净值 1.122

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.本期平均基金份额净值是指截至报告期末的基金份额净值除以报告期末的基金份额总数;3.期末基金份额净值未扣除费用;4.本基金业经审计的2013年度报告披露于本公司网站。

§ 3.4 基金业经审计的财务报告

审计意见:无

报告期间:2013年10月1日起至2013年12月31日止

报告期末:2013年12月31日

货币单位:人民币元

§ 3.5 主要财务指标和基金净值表现

报告期(2013年10月1日—2013年12月31日)

1.本期已实现收益 10,299,309.79

2.本期平均基金份额本期利润 -43,731,042.94

3.期末平均基金份额净值 -0.0256

4.期末基金份额净值 1,855,260,351.51

5.期末基金份额净值 1.122

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.本期平均基金份额净值是指截至报告期末的基金份额净值除以报告期末的基金份额总数;3.期末基金份额净值未扣除费用;4.本基金业经审计的2013年度报告披露于本公司网站。

§ 3.6 基金业经审计的财务报告

审计意见:无

报告期间:2013年10月1日起至2013年12月31日止

报告期末:2013年12月31日

货币单位:人民币元

§ 3.7 主要财务指标和基金净值表现

报告期(2013年10月1日—2013年12月31日)

1.本期已实现收益 10,299,309.79

2.本期平均基金份额本期利润 -43,731,042.94

3.期末平均基金份额净值 -0.0256

4.期末基金份额净值 1,855,260,351.51

5.期末基金份额净值 1.122

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.本期平均基金份额净值是指截至报告期末的基金份额净值除以报告期末的基金份额总数;3.期末基金份额净值未扣除费用;4.本基金业经审计的2013年度报告披露于本公司网站。

§ 3.8 基金业经审计的财务报告

审计意见:无

报告期间:2013年10月1日起至2013年12月31日止

报告期末:2013年12月31日

货币单位:人民币元

§ 3.9 主要财务指标和基金净值表现

报告期(2013年10月1日—2013年12月31日)

1.本期已实现收益 10,299,309.79

2.本期平均基金份额本期利润 -43,731,042.94

3.期末平均基金份额净值 -0.0256

4.期末基金份额净值 1,855,260,351.51

5.期末基金份额净值 1.122

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.本期平均基金份额净值是指截至报告期末的基金份额净值除以报告期末的基金份额总数;3.期末基金份额净值未扣除费用;4.本基金业经审计的2013年度报告披露于本公司网站。

§ 3.10 基金业经审计的财务报告

审计意见:无

报告期间:2013年10月1日起至2013年12月31日止

报告期末:2013年12月31日

货币单位:人民币元

§ 3.11 主要财务指标和基金净值表现

报告期(2013年10月1日—2013年12月31日)

1.本期已实现收益 10,299,309.79

2.本期平均基金份额本期利润 -43,731,042.94

3.期末平均基金份额净值 -0.0256

4.期末基金份额净值 1,855,260,351.51

5.期末基金份额净值 1.122

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.本期平均基金份额净值是指截至报告期末的基金份额净值除以报告期末的基金份额总数;3.期末基金份额净值未扣除费用;4.本基金业经审计的2013年度报告披露于本公司网站。

§ 3.12 基金业经审计的财务报告

审计意见:无

报告期间:2013年10月1日起至2013年12月31日止

报告期末:2013年12月31日

货币单位:人民币元

§ 3.13 主要财务指标和基金净值表现

报告期(2013年10月1日—2013年12月31日)

1.本期已实现收益 10,299,309.79

2.本期平均基金份额本期利润 -43,731,042.94

3.期末平均基金份额净值 -0.0256

4.期末基金份额净值 1,855,260,351.51

5.期末基金份额净值 1.122

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.本期平均基金份额净值是指截至报告期末的基金份额净值除以报告期末的基金份额总数;3.期末基金份额净值未扣除费用;4.本基金业经审计的2013年度报告披露于本公司网站。

§ 3.14 基金业经审计的财务报告

审计意见:无

报告期间:2013年10月1日起至2013年12月31日止

报告期末:2013年12月31日

货币单位:人民币元

§ 3.15 主要财务指标和基金净值表现

报告期(2013年10月1日—2013年12月31日)

1.本期已实现收益 10,299,309.79

2.本期平均基金份额本期利润 -43,731,042.94

3.期末平均基金份额净值 -0.0256

4.期末基金份额净值 1,855,260,351.51

5.期末基金份额净值 1.122

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.本期平均基金份额净值是指截至报告期末的基金份额净值除以报告期末的基金份额总数;3.期末基金份额净值未扣除费用;4.本基金业经审计的2013年度报告披露于本公司网站。

§ 3.16 基金业经审计的财务报告

审计意见:无

报告期间:2013年10月1日起至2013年12月31日止

报告期末:2013年12月31日

货币单位:人民币元

§ 3.17 主要财务指标和基金净值表现