大成优选股票型证券投资基金(LOF)更新招募说明书摘要

2015年第1期

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
二〇一五年三月

重要提示

大成优选股票型证券投资基金(LOF)(以下简称"本基金")由大成优选股票型证券投资基金转型而来。依据中国证监会2012年7月11日证监许可(2012)919号文核准的大成优选股票型证券投资基金基金份额持有人大会决议,大成优选股票型证券投资基金由封闭式基金转为上市开放式基金、调整存续期限、终止上市、调整投资目标、范围和策略、修订基金合同,并更名为"大成优选股票型证券投资基金(LOF)"。自2012年7月27日起,由《大成优选股票型证券投资基金基金合同》修订而成的《大成优选股票型证券投资基金(LOF)基金合同》生效,原《大成优选股票型证券投资基金基金合同》同日起失效。

基金管理人保证本招募说明书的内容真实、准确、完整。本招募说明书经中国证监会核准,但中国证监会对本基金的核准,并不表明其对本基金的价值和收益作出实质性判断或保证,也不表明投资于本基金没有风险。

投资有风险,投资者申购基金时应认真阅读本招募说明书。

基金的过往业绩并不预示其未来表现。

基金管理人依照恪尽职守、诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用基金财产,但不保证基金一定盈利,也不保证最低收益。

本招募说明书更新已经本基金托管人复核。本招募说明书所载内容截止日为2015年1月27日,有关财务数据和净值表现截止日为2014年12月31日(财务数据未经审计)。

一、基金管理人

(一)基金管理人概况
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32层
设立日期:1999年4月12日
注册资本:贰亿元人民币
股权结构:公司股东为中泰信托有限责任公司(持股比例48%)、中国银河投资管理有限公司(持股比例25%)、光大证券股份有限公司(持股比例25%)、广东证券股份有限公司(持股比例2%)四家公司。
法定代表人:刘卓
电话:0755-83183388
传真:0755-83199588
联系人:肖冰

大成基金管理有限公司设有股东会、董事会、监事会,下设二十个部门,分别是股票投资部、数量投资部、社保基金及机构投资部、固定收益部、委托投资部、研究部、交易管理部、营销策划及产品开发部、信息技术部、客户服务部、市场部、总经理办公室、董事会办公室、人力资源部、计划财务部、行政部、基金运营部、监察稽核部、风险管理部和国际业务部。公司在北京、上海、西安、成都、武汉、福州、沈阳、广州、青岛和南京等地设立了十家分公司,拥有两家子公司,分别为大成国际资产管理有限公司及大成创新资本管理有限公司。此外,公司还设立了投资决策委员会、投资风险控制委员会和战略规划委员会等专业委员会。

公司以"责任、回报、专业、进取"为经营理念,坚持"诚实信用、勤勉尽责"的企业精神,致力于开拓基金及证券市场业务,以稳健灵活的投资策略和注重绩优、高成长的投资组合,力求为投资者获得更大投资回报。

(二)证券投资基金管理情况

截至2015年1月27日,本基金管理人共管理4只ETF及1只ETF联接基金:大成中证100交易型开放式指数证券投资基金、深证成长40交易型开放式指数证券投资基金及大成深证成长40交易型开放式指数证券投资基金联接基金、中证500深市交易型开放式指数证券投资基金、中证500沪市交易型开放式指数证券投资基金,2只QDII基金:大成标普500等权重指数证券投资基金、大成纳斯达克100指数证券投资基金及41只开放式证券投资基金(大成高新技术产业股票型证券投资基金于2015年2月3日成立):大成景丰债券型证券投资基金(LOF)、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、大成竞争优势股票型证券投资基金、大成景恒保本混合型证券投资基金、大成内需增长股票型证券投资基金、大成可转债增强债券型证券投资基金、大成消费主题股票型证券投资基金、大成新锐产业股票型证券投资基金、大成优选股票型证券投资基金(LOF)、大成月添利理财债券型证券投资基金、大成现金增利货币市场证券投资基金、大成月月盈短期理财债券型证券投资基金、大成现金宝场内实时申赎货币市场基金、大成景安短融债券型证券投资基金、大成景兴信用债债券型证券投资基金、大成景旭纯债债券型证券投资基金、大成景祥分级债券型证券投资基金、大成信用增利一年定期开放债券型证券投资基金、大成健康产业股票型证券投资基金、大成中小盘股票型证券投资基金(LOF)、大成灵活配置混合型证券投资基金、大成丰财宝货币市场基金、大成景益平稳收益混合型证券投资基金、大成添利宝货币市场基金、大成景利混合型证券投资基金和大成产业升级股票型证券投资基金(LOF)。

(三)主要人员情况
1、公司高级管理人员
董事会:

刘卓先生,董事长,工学学士。曾任职于共青团哈尔滨市委、哈尔滨银行股份有限公司、中泰信托有限责任公司;2007年6月, 任哈尔滨银行股份有限公司执行董事;2008年8月,任哈尔滨银行股份有限公司董事会秘书;2012年4月,任哈尔滨银行股份有限公司副董事长;2012年11月至今, 任中泰信托有限责任公司监事会主席。2014年12月15日起任大成基金管理有限公司董事长。

靳天鹏先生,副董事长,国际法学硕士。1991年7月至1993年2月,任职于共青团河南省委;1993年3月至12月,任职于深圳市国际经济与法律咨询公司;1994年1月至6月,任职于深圳市蛇口律师事务所;1994年7月至1997年4月,任职于蛇口招商港务股份有限责任公司;1997年5月至今, 任光大证券股份有限公司零售交易业务总部副总经理。

罗登攀先生,董事、总经理,耶鲁大学经济学博士。具注册金融分析师(CFA)、金融风险管理师(FRM)资格。曾任毕马威(KPMG)法律诉讼部资深咨询师、金融部资深咨询师,以及SLCG证券诉讼和咨询公司合伙人;2009年至2012年,任中国证券监督管理委员会规划委专家顾问委员,机构部副处负责人,兼任国家"千人计划"专家;2013年2月至2014年10月,任中信并购基金管理有限公司董事总经理,执委会委员。2014年11月26日起任大成基金管理有限公司总经理。

周维雄先生,董事,金融学博士,北京大学光华管理学院高级管理人员工商管理硕士(EMBA)。1987年8月至1993年4月,任厦门大学财经系教师;1993年4月至1996年8月,任华夏证券有限公司厦门分公司经理;1996年8月至1999年2月,任人民日报社事业发展局企业管理处副处长;1999年2月至今任职于中泰信托有限责任公司,历任副总裁、总裁,现任中泰信托有限责任公司董事、总裁。

孙学林先生,董事,博士研究生在读。具注册会计师,注册资产评估师资格。现任中国银河投资管理有限公司投资二部董事总经理、投资决策委员会委员。2012年6月起,兼任镇江银河创业投资有限公司总经理、投资决策委员会委员。

黄隽女士,独立董事,经济学博士。现任中国人民大学经济学院教授、博士生导师,中国人民大学经济学院副院长助理,中国人民大学艺术品金融研究所副所长。

叶林先生,独立董事,法学博士。现任中国人民大学法学院教授、民商法教研室主任,博士研究生导师、国家社会科学重点基地中国民商事法律科学研究中心兼职教授。

吉敏女士,独立董事,金融学博士,现任东北财经大学讲师,教研室主任,东北财经大学金融学国家级教学团队成员, 东北财经大学开发金融研究中心助理研究员,主要从事金融业产业组织结构、银行业竞争方面的研究。参与两项国家自然科学基金、三项国家社科基金、三项教育部人文社会科学一般项目、多项省级创新团队项目,并负责撰写项目总结报告,在国内财经类期刊发表多篇学术论文。

金李先生,独立董事,博士。现任英国牛津大学商学院终身教职正教授(博士生导师)和北京大学光华管理学院讲席教授(博士生导师),金融系联合系主任,院长助理,北京大学国家金融研究中心主任。曾在美国哈佛大学商学院任教十多年,并兼任哈佛大学费正清东亚研究中心执行理事。

监事会:

陈希先生,监事长,中国人民大学经济学专业研究生,高级经济师。2006年被亚洲风险与危机管理协会授予"企业风险管理师"资格。2007年起任中国银河投资管理有限公司董事、常务副总裁(至2012年7月)、党委委员;2010年7月起,兼任吉林省国家生物产业创业投资有限责任公司董事长兼总经理、吉林省国家汽车电子产业创业投资有限责任公司董事,2012年6月起, 兼任镇江银河创业投资有限公司董事长;2012年7月起至今,任中国银河投资管理有限公司总裁。

吴朝雷女士,职工监事,硕士学位。1988年9月-1990年12月任浙江省永嘉县峙口乡人民政府妇联主任、团委书记;1991年10月-1998年2月任浙江省温州市鹿城区人民政府民政科长;1998年3月-2001年6月, 任浙江省温州市人民检察院起诉处助理检察员;2001年6月-2007年8月,就职于北京市宣武区人民检察院,任三级检察官;2007年8月起任民生人寿北京公司人事部经理。2007年11月-2009年12月, 任中国人民人寿保险股份有限公司人力资源部副总经理;2010年1月加入大成基金管理有限公司,任纪委副书记、大成慈善基金会常务副秘书长。

李本刚先生,职工监事,管理学硕士。2001年至2010年先后就职于西南证券股份有限公司、中关村证券股份有限公司和建信基金管理有限公司,历任研究员、高级研究员。2010年8月加入大成基金管理有限公司,历任研究部高级研究员、行业研究主管。2012年9月4日起任大成内需增长股票型证券投资基金基金经理。2014年4月16日起任大成消费主题股票型证券投资基金基金经理。2014年5月14日任大成灵活配置混合型证券投资基金基金经理。现任股票投资部价值组投资总监。

其他高级管理人员:

杜鹏女士,督察长,研究生学历。1992年-1994年,历任原中国银行陕西省信托咨询公司证券部驻上交所出市代表、上海业务部负责人;1994年-1998年,历任广东省南方金融服务总公司投资基金管理部证券投资部副经理、广东华侨信托投资公司证券总部资产管理部经理;1998年9月参与大成基金管理有限公司的筹建;1999年3月起,任大成基金管理有限公司督察长。2009年3月19日起兼任大成国际资产管理有限公司董事。

杨春明先生,副总经理,硕士研究生。曾先后任职于长春税务学院、吉林省国际信托投资公司、招商证券股份有限公司。2005年6月加入大成基金管理有限公司,历任基金运营部总监、市场部总经理、公司助理总经理。2009年7月13日起任大成国际资产管理有限公司董事。2010年11月起任大成基金管理有限公司副总经理。2013年10月25日起任大成创新资本管理有限公司总经理。

肖冰先生,副总经理,工商管理硕士。曾任联合证券有限责任公司国际业务部总经理助理、鹏华基金管理有限公司市场部总监、泰达宏利基金管理有限公司市场部总监、景顺长城基金管理有限公司营销主管。2004年3月加入大成基金管理有限公司,历任市场部总监、综合管理部总监、公司董事会秘书。2009年7月13日起任大成国际资产管理有限公司董事。2010年11月起任大成基金管理有限公司副总经理兼董事会秘书。

刘明先生,副总经理,经济学硕士。1992年至1996年曾任厦门证券公司鹭江营业部总经理。1996年至2000年曾任厦门产权交易中心副总经理。2001年至2004年曾任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,曾任景宏证券投资基金基金经理、大成优选股票型证券投资基金基金经理及大成优选股票型证券投资基金(LOF)基金基金经理,公司助理总经理。现任股票投资决策委员会主席。2013年10月起任大成基金管理有限公司副总经理。

钟鸣远先生,副总经理,金融学硕士。曾任国家开发银行深圳分行资金计划部职员,联合证券有限责任公司固定收益部投资经理,泰康人寿保险股份有限公司固定收益部研究员,新华资产管理股份有限公司固定收益部高级投资经理,易方达基金管理有限公司固定收益总部总经理兼固定收益投资部总经理。2014年3月加入大成基金管理有限公司,任公司助理总经理。2015年1月起任大成基金管理有限公司副总经理。

肖剑先生,副总经理,公共管理硕士。曾任深圳市南山区委(政府)办公室副主任, 深圳市广聚能源股份有限公司副总经理兼广聚投资控股公司执行董事、总经理,深圳市人民政府国有资产监督管理委员会副处长、处长。2015年1月加入大成基金管理有限公司,任公司副总经理。

2、基金经理

汤义峰先生,中国科学院管理学博士,8年金融证券从业经历。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日曾任博时裕富沪深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日起担任大成价值增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

(2)历任基金经理

姓名:	任期起始日	任期结束日
刘明	2012年7月27日	2014年1月29日

3、公司投资决策委员会(股票投资)

公司股票投资决策委员会由9名成员组成,设股票投资决策委员会主席1名,其他委员8名。名单如下:

刘明,公司副总经理,股票投资决策委员会主席;焦巍,股票投资部总监,股票投资决策委员会委员; 汤义峰, 数量投资部总监, 大成优选股票型证券投资基金(LOF)基金经理,大成价值增长证券投资基金基金经理,股票投资决策委员会委员;刘安田,股票投资部混合组投资总监,大成精选增值混合型证券投资基金经理,大成中小盘股票型证券投资基金(LOF)基金经理,股票投资决策委员会委员;周德昕,股票投资部成长组投资总监,大成财富管理2020生命周期证券投资基金基金经理,股票投资决策委员会委员;李本刚,股票投资部价值组投资总监,大成内需增长股票型证券投资基金基金经理,大成消费主题股票型证券投资基金基金经理,大成灵活配置混合型证券投资基金基金经理,股票投资决策委员会委员;王文祥,研究部总监,大成产业升级股票型证券投资基金(LOF)基金经理,股票投资决策委员会委员;于雷,交易管理部总监,股票投资决策委员会委员;蒋卫强,风险管理部总监,股票投资决策委员会委员。

上述人员之间不存在亲属关系。

二、基金托管人

(一)基本情况
名称:中国银行股份有限公司(简称"中国银行")
住所及办公地址:北京市西城区复兴门内大街1号
首次注册登记日期:1983年10月31日
注册资本:人民币贰仟柒佰玖拾壹亿肆仟柒佰贰拾贰万叁仟壹佰玖拾伍元整
法定代表人:田国立
基金托管业务批准文号:中国证监会证监基字【1998】24 号
托管业务部总经理:李爱华
托管部门信息披露联系人:王永民
客服电话:95566
传真:(010)66594942

(二)基金托管部门及主要人员情况

中国银行托管业务部设立于1998年,现有员工110余人,大部分员工具有丰富的银行、证券、基金、信托从业经验,且具有海外工作、学习或培训经历,60%以上的员工具有硕士以上学位或高级职称。为给客户提供专业化的托管服务,中国银行已在境内、外分行开展托管业务。

作为国内首批开展证券投资基金托管业务的商业银行, 中国银行拥有证券投资基金、基金(一对多、一对一)、社保基金、保险资金、QFII、RQFII、QDII、境外三类机构、券商资产管理计划、信托计划、企业年金、银行理财产品、股权基金、私募基金、资金托管等门类齐全、产品丰富的托管业务体系。在国内,中国银行首家开展绩效评估、风险分析等增值服务,为各类客户提供个性化的托管增值服务,是国内领先的大型中资托管银行。

(三)证券投资基金托管情况

截至2014年12月31日,中国银行已托管307只证券投资基金, 其中境内基金282只,QDII基金25只,覆盖了股票型、债券型、混合型、货币型、指数型等多种类型的基金,满足了不同客户多元化的投资理财需求,基金托管规模位居同业前列。

(四)托管业务的内部控制制度

中国银行托管业务部风险管理与控制工作是中国银行全面风险控制工作的组成部分,秉承中国银行风险控制理念,坚持"规范运作、稳健经营"的原则。中国银行托管业务部风险控制工作贯穿业务各环节,包括风险识别,风险评估,工作程序设计与制度建设,风险检视,工作程序与制度的执行,工作程序与制度执行情况的内部监督、稽核以及风险控制工作的事后评价。

2007年起, 中国银行连续聘请外部会计会计师事务所开展托管业务内部控制审阅工作。先后获得基于 "SAS70"、"AAF01/06" "ISAE3402"和 "SSAE16" 等国际主流内控审阅准则的无保留意见的审阅报告。2013年,中国银行同时获得了基于"ISAE3402"和"SSAE16"双准则的内部控制审计报告。中国银行托管业务内控制度完善,内控措施严密,能够有效保证托管资产的安全。

(五)托管人对管理人运作基金进行监督的方法和程序

根据《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》的相关规定,基金托管人发现基金管理人的投资指令违反法律、行政法规和其他有关规定,或者违反基金合同约定的,应当拒绝执行,及时通知基金管理人,并及时向国务院证券监督管理机构报告。基金托管人如发现基金管理人依照交易程序已经生效的投资指令违反法律、行政法规和其他有关规定,或者违反基金合同约定的,应当及时通知基金管理人,并及时向国务院证券监督管理机构报告。

三、相关服务机构

(一)销售机构及联系人
1. 直销机构:
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32层
法定代表人:刘卓
电话:0755-83183388
传真:0755-83199588
联系人:王为开
公司网址:www.dcfund.com.cn
大成基金客户服务热线:400-888-5558(免长途固话费)
大成基金管理有限公司现分别在深圳、上海设有投资理财中心,并在武汉分公司开通了直销业务:
(1)大成基金深圳投资理财中心
地址:深圳市福田区深南大道7088号招商银行大厦32层
联系人:王欢欢、白小雪
电话:0755-83195236/22223555/22223556
传真: 83195239/83195235/83195242/83195232
(2)大成基金上海投资理财中心
地址:上海市浦东新区陆家嘴东路161号101室
联系人:徐舲
电话:021-62185377/62185277/63513925/62173331
传真:021-63513928/62185233
2、代销机构
(1)中国银行股份有限公司
注册地址:北京西城区复兴门内大街1号
法定代表人:田国立
客服电话:95566
联系人:王娟
电话:010-66594909
传真:010-66594942
网址:www.boc.cn
(2)中国建设银行股份有限公司
注册地址:北京市西城区金融大街25号
办公地址:北京市西城区闹市口大街1号长安兴融中心1号楼
法定代表人:王洪章
联系人:王琳
电话:010-67596084
传真:010-66275654
客服电话:95533
网址:www.ccb.com
(3)中国农业银行股份有限公司
注册地址:北京市东城区建国门内大街69号
法定代表人:蒋超良
客服电话:95599
电话:010-85109219
传真:010-85109219
网址:www.abchina.com
(4)中国工商银行股份有限公司
注册地址:北京市西城区复兴门内大街55号
法定代表人:姜建清
客服电话:95588
电话:010-66107900
传真:010-66107914
网址:www.icbc.com.cn
(5)青岛银行股份有限公司
地址:青岛市市南区香港中路68号华普大厦
法定代表人:张广鸿
联系人:滕克
客服电话:96588(青岛)、400-66-96588(全国)
网址:www.qdccb.com
(6)国信证券股份有限公司
注册地址:深圳市罗湖区红岭中路1012号国信证券大厦六层
法定代表人:何如
客服电话:95536
联系人:齐晓燕
电话:0755-82130833
传真:0755-82133952
网址: www.guosen.com.cn
(7)招商证券股份有限公司
注册地址:深圳市福田区益田路江苏大厦A座38-45层
法定代表人:宫少林
客服电话: 95565
联系人:林生迎
电话:0755-82960223
传真:0755-82943636
网址:www.newone.com.cn
(8)中国银河证券股份有限公司
注册地址:北京市西城区金融大街35号国际企业大厦C座
法定代表人:陈有安
客服电话:4008-888-888
联系人:田薇
联系电话:010-66568430
传真:010-66568990
网址:www.chinastock.com.cn
(9)申银万国证券股份有限公司
通讯地址:上海市常熟路171号
法定代表人:丁国荣
客服电话:021-962505
联系人:黄维琳、曹晔
电话:021-54033888
传真:021-54038844
网址:www.sywg.com
(10)东方证券股份有限公司
地址:上海市中山南路318号新源广场2号楼22-29楼
法定代表人:潘鑫军
客户电话:95503
联系人:吴宇
电话:021-63325888-3108
传真:021-63326173
网址:www.dfzq.com.cn
(11)海通证券股份有限公司
注册地址:上海市淮海中路98号
法定代表人:王开国
客服电话:95553、400-888-8001
联系人:金芸、李笑鸣
电话:021-23219000
传真:021-63602722
网址:www.htsec.com
(12)中信证券股份有限公司
注册地址:深圳市深南路7088号招商银行大厦
法定代表人:王东明
客服电话:010-84588888
联系人:陈忠
电话:010-84588888
传真:010-84865560
网址:www.cs.ecitic.com
(13)安信证券股份有限公司
注册地址:深圳市福田区金田路4018号安联大厦35层、28层A02单元
法定代表人:牛冠兴
客服电话:4008 001 001
联系人:陈剑虹
电话:0755-82825551
传真:0755-82558355
网址:www.essence.com.cn
(14)光大证券股份有限公司
办公地址:上海市静安区新闸路1508号
法定代表人:徐浩明
客服电话:400-888-8788、95525
联系人:刘晨、李芳芳
电话:021-22169081
传真:021-22169134
网址:www.ebscn.com
(15)中信证券(山东)有限责任公司
注册地址:青岛市崂山区苗岭路29号澳柯玛大厦15层(1507-1510室)
办公地址:青岛市东海西路28号
法定代表人:张智河
客服电话:0532-96577
联系人:吴忠超
电话:0532-85022326
传真:0532-85022605
网址:www.zxwt.com.cn
(16)中信证券(浙江)有限责任公司
注册地址:浙江省杭州市滨江区江南大道588号恒鑫大厦主楼19、20层
法定代表人:沈强
客服电话:95548
联系人:王霈霈
电话:0571-87112507
传真:0571-85783771
网址:www.bigsun.com.cn
(17)广州证券有限责任公司
注册地址:广州市先烈中路69号东山广场主楼十七楼
法定代表人:刘东
客服电话:961303
联系人:林洁茹
联系电话:020-87322668
传真:020-87325036
网址:www.gzs.com.cn
(18)平安证券有限责任公司
办公地址:深圳市福田区金田路大中华国际交易广场8楼
法定代表人:杨宇翔
客服电话:95511转8
联系人:郑舒丽
电话:0755-22626391
传真:0755-82400862
网址:www.pingan.com
(19)华泰证券股份有限公司
注册地址:江苏省南京市中山东路90号华泰证券大厦
法定代表人:吴万善
客服电话:4008-888-168、95597
联系人:舒萌菲
电话:025-84457777
传真:025-84579763
网址:www.htsc.com.cn
(20)湘财证券有限责任公司
注册地址:长沙市黄兴中路63号中山国际大厦12楼
法定代表人:林俊波
客服电话:400-888-1551
联系人:钟康莺
电话:021-68634518-8503
传真:021-68865938
网址:www.xcsc.com
(21)上海证券有限责任公司
注册地址:上海市西藏中路336号
法定代表人:龚德雄
客服电话:021-962518,4008918918
联系人:张瑾
电话:021-53519888
传真:021-63608830
网址:www.962518.com
(22)渤海证券股份有限公司
注册地址:天津市经济技术开发区第二大街42号写字楼101室
法定代表人:杜庆平
联系人:王兆权
电话:022-28451861
传真:022-28451892
客服电话:4006515988
网址:www.bhzq.com
(23)东莞证券有限责任公司
注册地址:东莞市莞城区可园南路1号金源中心30楼
法定代表人:张运勇
客服电话:0769-961130
联系人:梁健伟
电话:0769-22119341
传真:0769-22116999
网址:www.dgzq.com.cn
(24)宏源证券股份有限公司
注册地址:新疆乌鲁木齐市文艺路233号
办公地址:北京市西城区太平桥大街19号
法定代表人:冯戎
客户服务电话:4008000562
联系人:李巍
电话:010-88085858
传真:010-88085195
网址:www.hysec.com
(25)长城证券有限责任公司
注册地址:深圳市福田区深南大道6008号特区报业大厦14、16、17层
法定代表人:黄耀华
客户服务热线:0755-33680000、400-6666-888
联系人:高峰
电话:0755-83516094
传真:0755-83516199
网址:www.cgws.com
(26)国都证券有限责任公司
注册地址:北京市东城区东直门南大街3号国华投资大厦9层10层
法定代表人:常喆
客户服务电话:400-818-8118
联系人:黄静
电话:010-84183333
传真:010-84183311-3389
网址:www.guodu.com
(27)江海证券有限公司
办公地址:哈尔滨市香坊区赣水路56号
法人代表:孙名扬
电话:0451-82336863
客服热线:4006662288
联系人:徐世旺
网址:www.jhzq.com.cn
(28)国金证券股份有限公司
注册地址:成都市东城根上街95号
法定代表人:冉云
客户服务电话:4006600109
联系人:刘一宏
电话:028-86690070
传真:028-86690126
网址:www.gjzq.com.cn
(29)爱建证券有限责任公司
地址:上海市南京西路758号23楼
法定代表人:郭林
客服电话:021-63340678
联系人:陈敏
电话:021-32229888
传真:021-62878783
网址:www.ajzq.com
(30)华西证券有限责任公司
注册地址:四川省成都市陕西街239号
法定代表人:杨炯洋
客户服务热线:4008888818
联系人:金达勇
电话:0755-83025723
传真:0755-83025991
网址:www.hx168.com.cn
(31)天相投资顾问有限公司
注册地址:北京市西城区金融街19号富凯大厦B座701
法定代表人:林义相
客服电话:010-66045678
联系人:林爽
传真:010-66045527
网址:www.txsec.com
(32)信达证券股份有限公司
地址:北京市西城区闹市口大街9号院1号楼
法定代表人:张志刚
客户服务电话:4008008899
联系人:唐静
联系电话:010-63081000
传真:010-63080978
公司网址:www.cindasc.com
(33)华宝证券有限责任公司
地址:上海市浦东新区环球金融中心57楼
法定代表人:陈林
客户服务电话:400-820-9898
联系人:汪明丽
电话:021-68778075
传真:021-68868117
网址:www.cnhbstock.com
(34)广发证券股份有限公司
注册地址:广州天河区天河北路183-187号大都会广场43楼(4301-4316房)
办公地址: 广东省广州天河北路大都会广场5、18、19、36、38、39、41、42、43、44楼
法定代表人:孙树明
客服电话:95575联系人:黄岚
电话:020-87555888
传真:020-87555305
网址:www.gf.com.cn
(35)中国中投证券有限责任公司
注册地址:深圳市福田区益田路与福中路交界处荣超商务中心A栋第18层-21层及第04层01.02.03.05.11.12.13.15.16.18.19.20.21.22.23单元?
办公地址:深圳市福田区益田路6003号荣超商务中心A栋第04、18层至21层?
法定代表人:龙增来
联系人:刘毅
客户电话:400 600 8008
电话:0755-82023442
传真:0755-82026539
网址:www.china-invs.cn
(36)齐鲁证券有限公司
办公地址:山东省济南市经十路20518号
法定代表人:李玮
客户服务电话:95538
联系人:吴阳
电话:0531-81283938
传真:0531-81283900
网址:www.qlzq.com.cn
(37)民生证券股份有限公司
地址:北京市东城区建国门内大街28号民生金融中心A座
法定代表人:余政
客服电话:4006198888
联系人:赵明
联系电话:010-85127622
联系传真:010-85127917
公司网址:www.mszq.com
(38)天风证券股份有限公司
注册地址:湖北省武汉市东湖新技术开发区关东园路2号高科大厦四楼
法定代表人:余磊
联系人:翟璟
联系电话:(027)87618882/(028) 86711410
传真:(027)87618863
公司网站:www.tfzq.com
(39)华鑫证券有限责任公司
注册地址:深圳市福田区金田路4018号安联大厦28层A01、B01(b)单元
办公地址:上海市肇嘉浜路750号
法定代表人:洪家新
联系人:陈敏
网站:www.cfsc.com.cn
客户服务电话:021-32109999;029-68918888;4001099918
(40)中山证券有限责任公司
注册地址:深圳市福田区益田路6009号新世界中心29层
法定代表人:吴永良
客服电话:400-1022-011
网址:www.zszq.com.cn
(41)国泰君安证券股份有限公司
注册地址:上海市浦东新区商城路618号
法定代表人:万建华
客服电话:95521
联系人:芮敏祺
电话:021-38676666
传真:021-38670161
网址:www.gtja.com
(42)中信建投股份有限公司
注册地址:北京市朝阳区安立路66号4号楼
法定代表人:王常青
客服电话:4008888108
联系人:权唐
电话:010-85130577
传真:010-65182261
网址:www.csc108.com
(43)华融证券股份有限公司
注册地址:北京市西城区金融大街8号
法定代表人:祝献忠
联系人:黄恒
联系电话:010-58568062
传真:010-58568062
客户服务电话:010-58568118
网址:www.hrsec.com.cn
(44)和讯信息科技有限公司
注册地址:北京市朝阳区朝外大街22号泛利大厦10层
法定代表人:王莉
联系人:常春艳
联系电话:0755-82721122
传真:0755-82029055
客户服务电话:4009200022
网址:http://licaike.hexun.com
(45)上海天天基金销售有限公司
注册地址:上海市徐汇区龙田路195号3C座9楼
法人代表:其实
联系人:高莉莉
电话:021-54509988
传真:021-64383798
客户服务电话:400-1818-188
网址:www.1234567.com.cn
(46)杭州数米基金销售有限公司
注册地址:杭州市余杭区仓前街文一西路1218号1栋202室
法人代表:陈柏青
联系人:张裕
电话:0571-2882935
传真:0571-26698533
客户服务电话:4000-766-123
网址: www.fund123.cn
(47)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.e5618.com
3、场内代销机构
指具有基金代销业务资格、并经深圳证券交易所和中国证券登记结算有限责任公司认可的深圳证券交易所会员单位,具体名单详见深圳证券交易所网站(www.szse.cn)。
(二)注册登记机构
名称:中国证券登记结算有限责任公司
注册地址:北京市西城区金融大街27号投资广场23层
办公地址:北京市西城区金融大街27号投资广场23层
法定代表人:陈耀先
电话:010-58598839
传真:010-58598907
联系人:朱立元
(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:大成优选股票型证券投资基金(LOF)。

五、基金的类型

本基金类型:股票型基金

六、基金的运作方式

本基金运作方式:契约型上市开放式

七、基金存续期限

本基金存续期限:不定期限

八、基金的投资目标

追求基金资产长期增值。

九、基金的投资范围

本基金的投资范围为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(含中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票)、债券(含中期票据)、货币市场工具、银行存款、权证、资产支持证券、股指期货及法律法规或监管机构允许基金投资的其他金融工具(但须符合中国证监会的相关规定)。

如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种,基金管理人在履行适当程序后,可以将其纳入投资范围。

基金的投资组合比例为: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。

十、基金的策略

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。

1、大类资产配置

将根据国内外宏观经济情况、国内外证券市场估值水平阶段性不断调整权益类资产和其他资产之间的大类资产配置比例。其中,全球主要股市的市盈率比较、GDP 增速、上市公司总体盈利增长速度、债市和股市的预期收益率比较和利率水平是确定大类资产配置比例的主要因素。

2、股票投资策略

本基金的股票投资采取自下而上优选个股的策略,以深入的基本面研究为基础,精选价值相对低估的优质上市公司股票,构建股票投资组合。

(1)建立初选股票池

本基金通过建立初选股票池,避免投资于具有较大风险的股票。已公告资产重组或基本面发生重大变化的 ST、*ST 股票,经过基金投资团队严格评估后合格的,仍可进入基金初选股票池。

(2)建立备选股票池

在初选股票池的基础上,本基金将按照以下5个因素,对初选股票池成份股进行筛选,确定备选股票池。
上市公司是否有易于理解而且稳定的盈利模式;
财务状况是否良好;
上市公司的行业地位;
上市公司对上下游的定价能力;
是否具有良好的治理结构。

基金管理人将采用定量分析与定性分析相结合的方式对以上5项因素进行分析。其中,上市公司的盈利模式主要通过其过去3年主营业务收入占营业收入比例、主营业务收入增长率等指标衡量; 财务状况主要通过其过去3年资产负债比例、毛利率和净资产收益率等指标衡量;行业地位主要通过其过去3年在行业中的市场占有率等指标衡量;对上下游的定价能力主要通过其过去3年经营性现金流占净利润的比例等指标衡量;治理结构主要通过其股东结构、董事会成员构成、管理层过往表现、权责制衡机制、信息披露透明性以及基金管理人投资团队实地调研结果等情况考察。

(3)深入分析

基金管理人投资团队将通过案头分析或公司实地调研等方式, 深入了解备选股票池成份股基本面数据的真实性,确保对上市公司内在价值估计的合理性。研究员将把上市公司的盈利能力与国际或国内同行业的公司作比较, 调研与公司有关的供应商、客户、竞争对手等各方的情况,通过行业主管机关、税务部门、海关等机构进行第三方数据核实。

(4)建立投资组合

本基金以备选股票池成份股的动态性价比作为选择其进入投资组合的重要依据,动态性价比主要根据上市公司未来两年的动态PE衡量。未来两年的动态 PE由基金管理人投资团队根据内外部研究资料并结合实地调研结果, 在对备选股票池成份股未来两年业绩预测的基础上,结合当前市场价格计算。

基金投资团队将对备选股票池成份股按行业进行动态性价比排序, 同时参考PEG、PB、现金流估值等指标以及对上市公司的定性分析,选择各行业中动态性价比最优的股票买入,构建股票组合。

(5)投资组合的调整

基金投资团队在买入个股之后,将动态跟踪上市公司的基本面变化,并根据基本面变化及时调整动态性价比排序; 在出现新的动态性价比更优的股票时,将以动态性价比更优的股票替代现有组合中性价比下降的股票。

3、债券投资策略

主要通过利率预测分析、收益率曲线变动分析、债券信用分析、收益率利差分析等策略配置债券资产,力求在保证债券资产总体的安全性、流动性的基础上获取稳定收益。

(1)利率预测分析

准确预测未来利率走势能为债券投资带来超额收益。当预期利率下调时,适当加大组合中长久期债券的投资比例, 为债券组合获取价差收益;当预期利率上升时,减少长久期债券的投资,降低债券组合的久期,以控制利率风险。

(2)收益率曲线变动分析

收益率曲线会随着时间、市场情况、市场主体的预期变化而改变。通过预测收益率曲线形状的变化,调整债券组合内部品种的比例,获得投资收益。

(3)债券信用分析

通过对债券的发行者、流动性、所处行业等因素进行深入、细致的调研,准确评价债券的违约概率,提早预测债券评级的改变,捕捉价格优势或套利机会。

(4)收益率利差分析

在预测和分析同一市场不同板块之间、不同市场的同一品种之间、不同市场不同板块之间的收益率利差的基础上,采取积极投资策略,选择适当品种,获取投资收益。

4、其他投资策略

(1)权证投资

本基金将在控制投资风险和保障基金财产安全的前提下,对权证进行投资。权证投资策略主要包括以下几个方面:1)采用市场公认的多种期权定价模型对权证进行定价,作为权证投资的价值基准;2)根据权证标的股票基本面的研究估值,结合权证理论价值进行权证趋势投资;3)利用权证衍生工具的特性,通过权证与证券的组合投资,达到改善组合风险收益特征的目的,包括但不限于杠杆交易策略、看跌保护组合策略等。

(2)股指期货投资

本基金投资股指期货将以投资组合避险和有效管理为目的, 通过套期保值策略,对冲系统性风险,应对组合构建与调整中的流动性风险,力求风险收益的优化。

套期保值实质上是利用股指期货多空双向和杠杆放大的交易功能, 改变投资组合的beta,以达到适度增强收益或控制风险的目的。为此,套期保值策略分为多头套期保值和空头套期保值。多头保值策略是指基于股市将要上涨的预期或建仓要求,需要在未来买入现货股票,为了控制股票买入成本而预先买入股指期货合约的操作;空头套期保值是指卖出期货合约来对冲股市系统性风险,控制与回避持有股票的风险的操作。

基金管理人依据对股市未来趋势的研判、本基金的风险收益目标以及投资组合的构成,决定是否对现有股票组合进行套期保值以及采用何种套期保值策略。

在构建套期保值组合过程中,基金管理人通过对股票组合的结构分析,分离组合的系统性风险(beta)及非系统性风险。基金管理人将关注股票组合beta值的易变性以及股指期货与指数之间基差波动对套期保值策略的干扰, 通过大量数据分析与量化建模,确立最优套保比率。

在套期保值过程中,基金管理人将不断精细和不断修正套保策略,动态管理套期保值组合。主要工作包括,基于合理的保证金管理策略严格进行保证金管理;对投资组合beta系数的实时监控,全程评估套期保值的效果和基差风险,当组合beta值超过事先设定的beta容忍度时,需要对套期保值组合进行及时调整;进行股指期货合约的提前平仓或展期决策管理。

如法律法规或监管机构以后允许,在履行适当程序后,本基金可以依法投资于其他衍生工具或结构性产品,用于基金的风险管理和增加收益。

四、投资限制

1、组合限制

基金的投资组合应遵循以下限制:
(1)本基金股票资产占基金资产的比例为60%-95%;
(2)保持不低于基金资产净值5%的现金或者到期日在一年以内的政府债券;
(3)本基金持有一家上市公司的股票,其市值不超过基金资产净值的10%;
(4)本基金管理人管理的全部基金持有一家公司发行的证券,不超过该证券的10%;
(5)本基金持有的全部权证,其市值不得超过基金资产净值的3%;
(6)本基金管理人管理的全部基金持有的同一权证,不得超过该权证的10%;
(7)本基金在任何交易日买入权证的总金额,不得超过上一交易日基金资产净值的0.5%;
(8)本基金投资于同一原始权益人的各类资产支持证券的比例,不得超过基金资产净值的10%;
(9)本基金持有的全部资产支持证券,其市值不得超过基金资产净值的20%;
(10)本基金持有的同一(指同一信用级别)资产支持证券的比例,不得超过该资产支持证券规模的10%;
(11) 本基金管理人管理的全部基金投资于同一原始权益人的各类资产支持证券,不得超过其各类资产支持证券合计规模的10%;
(12)本基金应投资于信用级别评级为BBB以上(含BBB)的资产支持证券。基金持有资产支持证券期间,如果其信用等级下降、不再符合投资标准,应在评级报告发布之日起3个月内予以全部卖出;
(13)基金财产参与股票发行申购,本基金所申报的金额不超过本基金的总资产,本基金所申报的股票数量不超过拟发行股票公司本次发行股票的总量;
(14) 本基金进入全国银行间同业市场进行债券回购的资金余额不得超过基金资产净值的40%;在全国银行间同业市场的债券回购最长期限为1年,债券回购到期后不得展期;
(15)在任何交易日日终,持有的买入股指期货合约价值,不得超过基金资产净值的10%;在任何交易日日终,持有的买入期货合约价值与有价证券市值之和,不得超过基金资产净值的95%,其中,有价证券指股票、债券(不含到期日在一年以内的政府债券)、权证、资产支持证券、买入返售金融资产(不含质押式回购)等;在任何交易日日终, 持有的卖出期货合约价值不得超过基金持有的股票总市值的20%;在任何交易日内交易(不包括平仓)的股指期货合约的成交金额不得超过上一交易日基金资产净值的20%;基金所持有的股票市值和买入、卖出股指期货合约价值,合计(轧差计算)应当符合基金合同关于股票投资比例的有关约定;每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后, 应当保持不低于基金资产净值5%的现金或到期日在一年以内的政府债券。

因证券市场波动、上市公司合并、基金规模变动、股权分置改革中支付对价等基金管理人之外的因素致使基金投资比例不符合上述规定投资比例的, 基金管理人应当在10个交易日内进行调整。

基金管理人应当自基金合同生效之日起6个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的有关约定。基金托管人对基金的投资的监督与检查自本基金合同生效之日起开始。

法律法规或监管部门取消上述限制,如适用于本基金,基金管理人在履行适当程序后,则本基金投资不再受相关限制。

2、禁止行为

为维护基金份额持有人的合法权益,基金财产不得用于下列投资或者活动:
(1)承销证券;
(2)向他人贷款或者提供担保;
(3)从事承担无限责任的投资;
(4)买卖其他基金份额,但是国务院另有规定的除外;
(5)向其基金管理人、基金托管人出资或者买卖其基金管理人、基金托管人发行的股票或者债券;
(6)买卖与其基金管理人、基金托管人有控股关系的股东或者与其基金管理人、基金托管人有其他重大利害关系的公司发行的证券或者承销期内承销的证券;
(7)从事内幕交易、操纵证券交易价格及其他不正当的证券交易活动;
(8)依照法律法规有关规定,由中国证监会规定禁止的其他活动

十一、基金的业绩比较基准

本基金的业绩比较基准为: 沪深300指数收益率×80%+中证综合债券指数收益率×20%

本基金为股票型基金。在综合考虑了基金股票组合的构建、投资标的以及市场上可得的股票指数的编制方法后, 本基金选择市场认同度较高并且作为股指期货标的的沪深300指数作为本基金股票组合的业绩比较基准。债券组合则采用中证综合债券指数收益率作为业绩比较基准。本基金的股票投资比例区间为60%-95%,取80%为基准指数中股票投资所代表的权重, 其余20%为基准指数中债券投资所对应的权重。因此,本基金的业绩比较基准确定为"沪深300指数收益率×80%+中证综合债券指数收益率×20%"。

如果今后法律法规发生变化,或者有更权威的、更能为市场普遍接受的业绩比较基准推出,或者是市场上出现更加适合用于本基金的业绩基准的股票指数时,本基金可以在征得基金托管人同意并报中国证监会备案后变更业绩比较基准并及时公告。

十二、基金的风险收益特征

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/收益特征的开放式基金。

十三、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2015年2月6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、误导性陈述或重大遗漏。本投资组合数据截止到2014年12月31日,其中的财务资料未经审计。

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	1,233,216,065.34	92.69
	其中:股票	1,233,216,065.34	92.69
2	固定收益投资	50,070,000.00	3.76
	其中:债券	50,070,000.00	3.76
	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
5	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
6	银行存款和结算备付金合计	42,488,795.02	3.19
7	其他资产	4,724,696.53	0.36
8	合计	1,330,499,556.89	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	-	0.00
B	采矿业	-	0.00
C	制造业	432,040,603.91	32.86
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	58,996,343.66	4.49
E	建筑业	124,233,535.54	9.45
F	批发和零售业	-	0.00
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	200,729,094.44	15.27
J	金融业	317,469,112.90	24.15
K	房地产业	46,974,477.12	3.57
L	租赁和商务服务业	-	0.00
M	科学研究和技术服务业	27,424,352.77	2.09
N	水利、环境和公共设施管理业	25,348,545.00	1.93
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	1,233,216,065.34	93.81

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	601166	兴业银行	7,800,206	128,703,399.00	9.79
2	600036	招商银行	6,000,052	99,540,862.68	7.57
3	002081	金 螳 螂	5,078,835	85,324,428.00	6.49
4	300059	东方财富	2,933,863	82,030,809.48	6.24
5	601318	中国平安	1,007,054	75,237,004.34	5.72
6	002039	黔源电力	4,137,191	58,996,343.66	4.49
7	300017	网宿科技	1,214,894	58,557,890.80	4.45
8	000333	美的集团	2,001,409	54,918,662.96	4.18
9	002508	老板电器	1,650,633	53,810,635.80	4.09
10	002285	世联行	3,123,303	46,974,477.12	3.57

4、报告期末按券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	50,070,000.00	3.81
	其中:政策性金融债	50,070,000.00	3.81
4	企业债券	-	0.00
5	企业短期融资券	-	0.00
6	中期票据	-	0.00
7	可转债	-	0.00
8	其他	-	0.00
9	合计	50,070,000.00	3.81

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	140443	14农发43	500,000	50,070,000.00	3.81

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、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贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

8、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

金额单位:元

代码	名称	持仓量(买/卖)(手)	合约市值	公允价值变动	风险说明
-	-	-	-	-	-
公允价值变动总额合计					-
股指期货投资本期收益					-1,464,480.00
股指期货投资本期公允价值变动					-436,560.00

(2)本基金投资股指期货的投资政策

本基金投资股指期货以投资组合避险和有效管理为目的,通过套期保值策略,对冲系统性风险,应对组合构建与调整中的流动性风险,力求风险收益的优化。报告期内,本基金股指期货交易的交易次数、交易金额及投资损益均未对基金总体风险产生重大影响,股指期货投资符合既定的投资政策和投资目标。

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
本基金本报告期未投资国债期货。
(2)报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细
本基金本报告期未投资国债期货。
(3)本期国债期货投资评价
本基金本报告期未投资国债期货。

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	653,482.03
2	应收证券清算款	3,273,917.37
3	应收股利	-
4	应收利息	797,297.13
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	4,724,696.53

(4)报告期末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形。
(6)由于四舍五入原因,分项之和与合计可能有尾差。

十四、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	净值增长率①	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
2012.07.27-2012.12.31	5.91%	0.89%	6.11%	1.02%	-0.20%	-0.13%
2013.01.01-2013.12.31	3.13%	1.23%	-5.90%	1.12%	9.03%	0.11%
2012.07.27-2014.12.31	41.15%	1.10%	42.36%	1.04%	-1.21%	0.06%
2014.01.01-2014.12.31	29.23%	1.06%	42.57%	0.97%	-13.34%	0.09%

(二)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

(2012年7月27日至2014年12月31日)



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,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。

十五、基金的费用与税收

一、基金费用的种类
1、基金管理人的管理费;
2、基金托管人的托管费;
3、《基金合同》生效后与基金相关的信息披露费用;
4、《基金合同》生效后与基金相关的会计师费、律师费和诉讼费;
5、基金份额持有人大会费用;
6、基金的证券交易费用;
7、基金的银行汇划费用;
8、基金上市初费及年费;
9、按照国家有关规定和《基金合同》约定,可以在基金财产中列支的其他费用。

二、基金费用计提方法、计提标准和支付方式

1、基金管理人的管理费

本基金的管理费按前一日基金资产净值的1.25%年费率计提。管理费的计算方法如下:
H=E×1.25%÷当年天数
H为每日应计提的基金管理费
E为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计算,逐日累计至每月月末,按月支付。经基金管理人与基金托管人核对一致后,由基金托管人于次月前3个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。若遇法定节假日、公休假等,支付日期顺延。

2、基金托管人的托管费

本基金的托管费按前一日基金资产净值的0.25%的年费率计提。托管费的计算方法如下:
H=E×0.25%÷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

基金托管费每日计算,逐日累计至每月月末,按月支付。经基金管理人与基金托管人核对一致后, 由基金托管人于次月前3个工作日内从基金财产中一次性支取。若遇法定节假日、公休日等,支付日期顺延。

上述"一、基金费用的种类中第3-9项费用",根据有关法规及相应协议规定,按费用实际支出金额列入当期费用,由基金托管人从基金财产中支付。

三、不列入基金费用的项目

下列费用不列入基金费用:
1、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;
2、基金管理人和基金托管人处理与基金运作无关的事项发生的费用;
3、《基金合同》生效前的相关费用;
4、其他根据相关法律法规及中国证监会的有关规定不得列入基金费用的项目。

四、基金税收

本基金运作过程中涉及的各纳税主体,其纳税义务按国家税收法律、法规执行。

十六、业绩风险准备金

1、基金管理人设立专门的业绩风险准备金,用于在基金净值增长率低于业绩比较基准增长率超过5%时弥补持有人损失。在符合相关条件的前提下,业绩风险准备金用于弥补持有人损失每年最多一次,在上一个会计年度结束后15个工作日内完成。

2、基金管理人每月从已提取的上一月基金管理费中计提10%作为业绩风险准备金,划入专门的业绩风险准备金账户。

3、业绩风险准备金计算公式
V=E×10%
V为每月需提取的业绩风险准备金;
E为已提取的上一月基金管理费。

4、业绩风险准备金累计达到基金资产净值的10%时,可不再提取。

5、若基金上一年度基金净值增长率低于基金业绩比较基准增长率超过5%,基金管理人需在上一个会计年度结束后15个工作日内, 将业绩风险准备金用于弥补持有人损失。若业绩风险准备金超过持有人损失,则基金管理人应将与持有人损失相等数额的业绩风险准备金划入基金财产, 其余资金仍作为业绩风险准备金存入专门账户;若业绩风险准备金不足以弥补持有人损失,则基金管理人和基金托管人应将全部业绩风险准备金划入基金财产。

基金净值增长率的计算方法依据《证券投资基金信息披露编报规则第1号<主要财务指标的计算及披露>》第八条,具体如下:

基金净值增长率=(本期第一次分红前单位基金资产净值÷期初单位基金资产净值)×(本期第二次分红前单位基金资产净值÷本期第一次分红后单位基金资产净值)×……×(期末单位基金资产净值÷本期最后一次分红后单位基金资产净值)-1

其中:
本期是指基金净值增长率计算期间;
分红前单位基金资产净值按除息日前一交易日的单位基金资产净值计算;
分红后单位基金资产净值=分红前单位基金资产净值-单位分红金额;
业绩比较基准增长率依据惯例,采用复合指数算法计算,具体如下:
沪深300指数第t日收益率=第t日沪深300指数÷ 第t-1日沪深300指数-1;
中证综合债券指数第t日收益率=第t日中证综合债券指数÷第 t-1日中证综合债券指数-1;
业绩比较基准第t日收益率=80%×沪深300指数第t日收益率+20%×中证综合债券指数第t日收益率;
业绩比较基准增长率=@(1+业绩比较基准第t日收益率)-1,n为业绩比较基准增长率计算期间交易日天数;
当业绩比较基准增长率-基金净值增长率>5%时, 发生持有人损失=期末基金份额×(业绩比较基准增长率-基金净值增长率)

如果今后法律法规发生变化,或者有更权威的、更能为市场普遍接受的计算方法,或者业绩比较基准发生变更,本基金净值增长率或业绩比较基准增长率计算方法将相应发生变更。

6、基金管理人应当在将业绩风险准备金划入基金财产的至少2个工作日前,在指定报刊和网站登载划入业绩风险准备金的有关公告, 披露划入业绩风险准备金的具体时间、方式和数量等信息。

7、基金管理人应在基金季报等相关信息披露文件中揭示业绩风险准备金的结余、划转和使用情况。

8、在基金合同终止的情形下,业绩风险准备金余额应作为基金管理人资产处理。

十七、对招募说明书更新部分的说明

本招募说明书依据《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9月11日公布的《大成优选股票型证券投资基金(LOF)更新招募说明书2014年第2期》进行了更新,并根据本基金管理人对本基金实施的投资经营活动进行了内容补充和更新,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,增加了"十一、基金的投资"的"(十一)投资组合报告部分。
5、根据最新数据,更新了"十二、基金的业绩"部分。
6、根据相关公告,对"二十四、其他应披露的事项"进行了更新,补充了2014年7月28日至2015年1月27日发布的公告。
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
二〇一五年三月十三日