

大成优选股票型证券投资基金（LOF）
（原大成优选股票型证券投资基金转型）

2012 年第 3 季度报告

2012 年 9 月 30 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：2012 年 10 月 25 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 2012 年 10 月 23 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。

本报告中财务资料未经审计。

自 2012 年 7 月 27 日大成优选股票型证券投资基金终止上市日起，原大成优选股票型证券投资基金名称变更为大成优选股票型证券投资基金（LOF）。原大成优选股票型证券投资基金本报告期自 2012 年 7 月 1 日至 2012 年 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 日至 2012 年 9 月 30 日止。

§ 2 基金产品概况

转型后：

基金简称	大成优选股票（LOF）
交易代码	160916
基金运作方式	契约型上市开放式（LOF）
基金合同生效日	2012 年 7 月 27 日
报告期末（2012 年 9 月 30 日） 基金份额总额	3,167,971,900.02 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
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；在股价恢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。
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场合下，可简称为“优选 LOF”。

转型前：

基金简称	大成优选封闭
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
报告期末(2012 年 7 月 26 日)基金 份额总额	4,674,305,067.90 份
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。
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

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位：人民币元

主要财务指标	转型后	转型前
	报告期(2012 年 7 月 27 日 — 2012 年 9 月 30 日)	报告期(2012 年 7 月 1 日 — 2012 年 7 月 26 日)
1. 本期已实现收益	-107,475,750.94	-182,617,665.92
2. 本期利润	-31,889,292.54	-133,559,228.11
3. 加权平均基金份额本期利润	-0.0091	-0.0286
4. 期末基金资产净值	3,219,987,695.35	3,655,270,311.80
5. 期末基金份额净值	1.016	0.782

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、本基金已于 2012 年 8 月 29 日对原大成优选股票型证券投资基金退市时的基金份额进行了折算，基金折算比例为 1:0.763173881。

3.2 基金净值表现

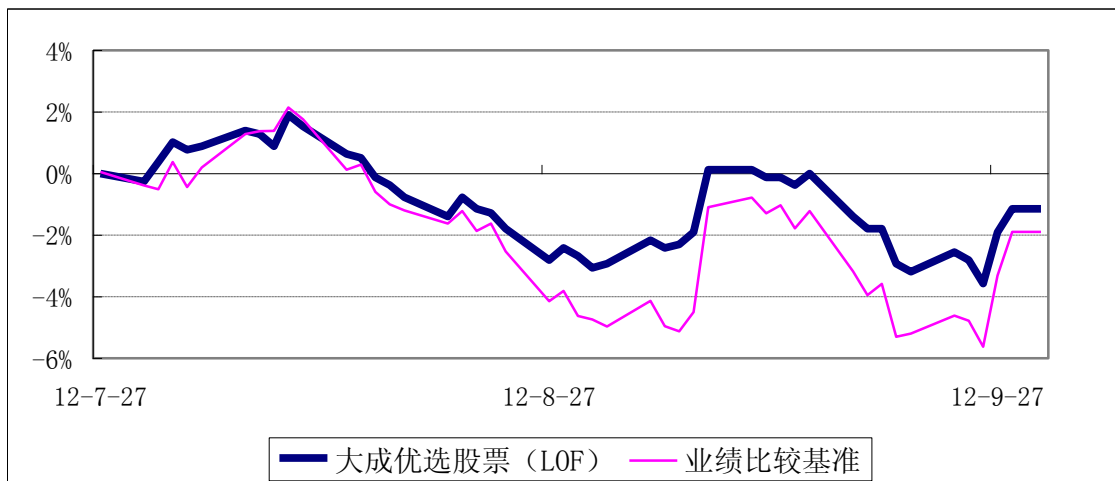
转型后：

3.2.1 大成优选股票型证券投资基金（LOF）

3.2.1.1 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
2012.7.27-2012.9.30	-0.85%	0.67%	-1.90%	1.00%	1.05%	-0.33%

3.2.1.2 自基金合同生效以来（2012 年 7 月 27 日 — 2012 年 9 月 30 日）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：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，本报告期本基金处于建仓期内。

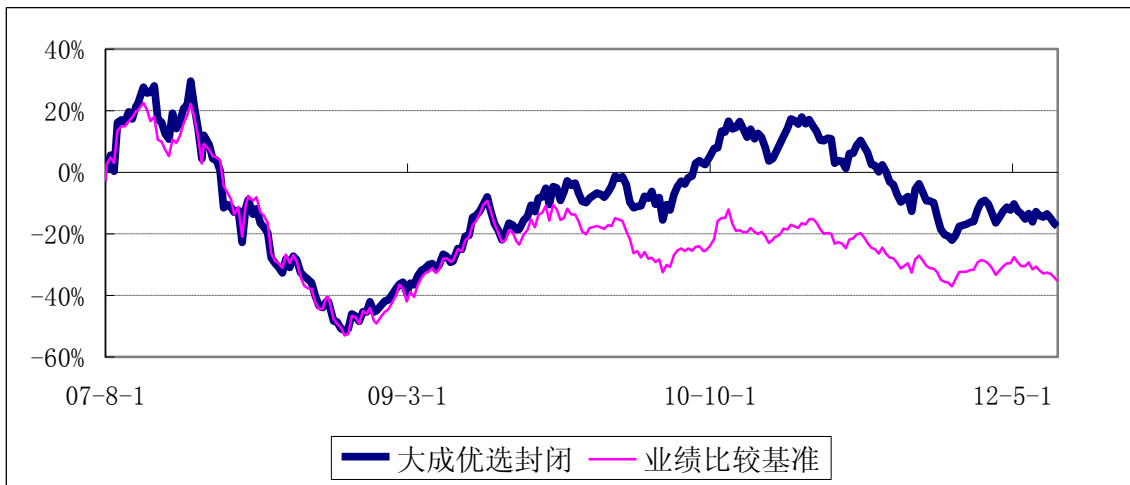
转型前：

3.2.2 大成优选股票型证券投资基金

3.2.2.1 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
2012.7.1-2012.7.26	-3.58%	1.46%	-3.66%	1.00%	0.08%	0.46%

3.2.2.2 自基金合同生效以来（2007年8月1日—2012年7月26日）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2012年7月26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。

§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	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
刘明先生	本基金基金经理、助理总经理	2012年7月27日	-	19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日起任大成优选股票型证券投资基金（2012年7月27日

					封转开为大成优选股票型证券投资基金（LOF）基金经理，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。
--	--	--	--	--	--

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（LOF）基金（原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 公平交易专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

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，公司制订了《大成基金管理有限公司公平交易制度》、《大成基金管理有限公司异常交易监控与报告制度》。公司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、二级市场交易等投资管理活动，内容包括授权、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 异常交易行为的专项说明

公司风险管理部定期对公司旗下所有投资组合间同向交易、反向交易等可能存在异常交易的行为进行分析。2012年三季度公司旗下主动投资组合间股票交易不存在同日反向交易。主动型投资组合与指数型投资组合之间或指数型投资组合之间存在股票同日反向交易，经查，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 6 次，原因是指数型投资组合投资策略需要；投资组合间不存在债券同日反向交易；投资组合间相邻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；投资组合间虽然存在同向交易行为，但结合交易价差分布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。

4.4 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

三季度，国内宏观经济呈现增长和通胀底部波动、政策微调有序推进态势：

经济指标方面，9 月份汇丰 PMI 预览值环比回升 0.2，显示中小企业的景气下行可能趋缓。资金市场利率在预期货币政策加码与央行逆回购操作博弈中逐级上行，中长期信贷未明显改善，但社会融资总量同比显著增长。消费和投资总体增速平稳，其中基建投资持续回升而地产、制造投资存在进一步下行风险，进出口增速则迅速下滑。物价方面，CPI 触底回升，PPI 负增长态势继续扩大。

宏观政策方面，稳增长和扩大就业成为着力点。7 月份中央政治局会议首次提出“着力稳定和扩大就业”，此外增值税转型、中部地区崛起战略、鼓励民间投资和企业技术改造等微调政策陆续出炉，9 月份发改委集中公布基础设施项目、国务院亦推出促外贸等稳增长措施、金融业“十二五”规划也获批发布。但钓鱼岛争端显性化，影响 FDI 和国内贸易，市场对周边安全形势的担忧有所提升。

海外经济方面，除美国温和复苏外，其他发达国家和新兴市场经济大多疲软。利好因素是欧盟对重债国的金融救援机制逐渐形成共识，随后美联储推出开放式 QE3，日央行也大幅增加资产购买规模。欧债危机的暂时平复以及欧美日央行联手注入流动性的预期，大幅提升市场风险偏好，全球股指普遍反弹。同时，欧债余波不断，9 月底南欧部分国家再次出现民众游行，对市场情绪造成负面冲击。

A 股市场则更多受国内因素拖累，独立于海外市场走出一波下跌新低行情。一方面，市场认识到去库存叠加去产能周期的特征将使本轮经济调整周期延长；另一方面，短期货币政策预期不明，前期财政、产业政策效果尚未显现，而系统性的经济改革措施预计要到政府换届后才会明朗。因此，A 股市场的盈利和估值受到双重挤压，传媒、医药等稳定类行业跌幅较小，机械、纺织服装等跌幅较大。

报告期内本基金基于对宏观经济和市场大势的判断，即在前期判断的“结构性行情”中，坚

持自下而上、精选个股、注重安全边际的投资思路，坚定持有估值较低且成长确定的食品饮料、家电、金融、医药、客车等板块；同时在报告期内的投研工作中，基金管理人更加关注上市公司治理结构等因素，进一步平衡超额收益与组合净值波动的关系，致力于更好维护基金持有人的稳健回报。

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 1.016 元，本报告期基金份额净值增长率为-0.85%，同期业绩比较基准收益率为-1.90%，高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

展望四季度，国内经济将处于增长底部波动、通胀同比回升阶段。其中，基建投资增速连续反弹将使固定资产投资平稳增长，美国经济温和复苏可能使出口增速有所改善，但净出口全年仍将负向贡献 GDP，而消费增速则将保持相对稳定。

宏观政策方面，我们预计在 A 股指数重心持续下移的过程中，政府有望出台短期维稳措施与中长期制度红利，同时换届完成也有利于市场稳定预期。

海外经济方面，欧元区温和衰退已成定局。PMI 显示德国制造业持续不振，西班牙、意大利等国则受制于财政紧缩和由此导致的社会动荡。美国方面，年底前财政悬崖、债务上限等问题的化解和总统大选结果将是市场关注的焦点；大选后国会能否延长即将到期的财政刺激政策，或将成为美国经济持续复苏的关键。

结合资本市场现状，从短期视角看，我们认为四季度 A 股市场跟随经济基本面趋势在底部震荡的概率较大，但政策因素可能催生阶段性行情。从更具确定性的中长期视角出发，着眼于中国经济结构转型的长期进程，挖掘受益于内需稳定成长和经济结构转型的主流行业仍将是 we 继续坚持的主要投资方向。

综合以上国内外经济和政策走势，从大类资产配置角度，我们认为短期经济探底，政策放松，小幅上涨概率大；中期由于经济转型之路艰难，估值低位徘徊；长期则要等待经济转型成功的曙光；从行业配置角度，继续关注消费、内需、成长以及经济转型期行业利润的稳定性，重点配置保险、家电、食品、客车、医药等行业，积极关注符合经济转型趋势、行业潜在空间较大且具备核心竞争力的新兴产业个股；同时继续坚持本基金自下而上、精选个股、长期持有的投资风格。

§ 5 投资组合报告

转型后：大成优选股票型证券投资基金（LOF）

报告期（2012年7月27日 — 2012年9月30日）

5.1 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	2,303,470,449.39	71.35
	其中: 股票	2,303,470,449.39	71.35
2	固定收益投资	101,000,000.00	3.13
	其中: 债券	101,000,000.00	3.13
	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	822,256,163.81	25.47
6	其他资产	1,586,220.83	0.05
7	合计	3,228,312,834.03	100.00

5.2 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	采掘业	-	0.00
C	制造业	1,281,026,152.75	39.78
C0	食品、饮料	213,270,626.37	6.62
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	-	0.00
C5	电子	-	0.00
C6	金属、非金属	-	0.00
C7	机械、设备、仪表	788,979,319.94	24.50
C8	医药、生物制品	278,776,206.44	8.66
C99	其他制造业	-	0.00
D	电力、煤气及水的生产和供应业	-	0.00
E	建筑业	-	0.00
F	交通运输、仓储业	-	0.00
G	信息技术业	184,464,928.64	5.73
H	批发和零售贸易	-	0.00
I	金融、保险业	706,381,164.94	21.94
J	房地产业	33,720,000.00	1.05
K	社会服务业	-	0.00
L	传播与文化产业	97,878,203.06	3.04
M	综合类	-	0.00
	合计	2,303,470,449.39	71.54

5.3 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	601318	中国平安	5,412,951	227,019,164.94	7.05
2	600036	招商银行	21,700,000	220,472,000.00	6.85
3	600066	宇通客车	8,842,080	192,492,081.60	5.98
4	000651	格力电器	8,500,000	181,730,000.00	5.64
5	600519	贵州茅台	700,000	172,060,000.00	5.34
6	600518	康美药业	10,299,740	162,941,886.80	5.06
7	600690	青岛海尔	14,000,000	158,620,000.00	4.93
8	002142	宁波银行	17,000,000	153,850,000.00	4.78
9	000063	中兴通讯	12,199,904	136,150,928.64	4.23
10	000566	海南海药	5,350,989	109,374,215.16	3.40

5.4 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	国家债券	-	0.00
2	央行票据	-	0.00
3	金融债券	-	0.00
	其中：政策性金融债	-	0.00
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	101,000,000.00	3.14
8	其他	-	0.00
9	合计	101,000,000.00	3.14

5.5 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债券投资明细

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	113002	工行转债	1,000,000	101,000,000.00	3.14

5.6 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。

5.7 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权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

5.8 投资组合报告附注

5.8.1 报告期内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的，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

5.8.2 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股票。

5.8.3 其他资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	618,871.31
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	730,748.39
4	应收利息	216,896.70
5	应收申购款	19,704.43
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	1,586,220.83

5.8.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

序号	债券代码	债券名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	113002	工行转债	101,000,000.00	3.14

5.8.5 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情况。

5.8.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入原因，分项之和与合计可能有尾差。

转型前：大成优选股票型证券投资基金

报告期（2012年7月1日 — 2012年7月26日）

5.1 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	2,540,564,825.39	69.42
	其中：股票	2,540,564,825.39	69.42
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	1,000,000,000.00	27.33
	其中：买断式回购的买入返售金融资	-	0.00

	产		
5	银行存款和结算备付金合计	115,992,251.00	3.17
6	其他资产	2,896,175.58	0.08
7	合计	3,659,453,251.97	100.00

5.2 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	采掘业	-	0.00
C	制造业	1,401,050,339.85	38.33
C0	食品、饮料	241,651,891.70	6.61
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	-	0.00
C5	电子	-	0.00
C6	金属、非金属	-	0.00
C7	机械、设备、仪表	883,889,797.99	24.18
C8	医药、生物制品	275,508,650.16	7.54
C99	其他制造业	-	0.00
D	电力、煤气及水的生产和供应业	-	0.00
E	建筑业	-	0.00
F	交通运输、仓储业	-	0.00
G	信息技术业	176,854,317.21	4.84
H	批发和零售贸易	-	0.00
I	金融、保险业	862,692,715.14	23.60
J	房地产业	-	0.00
K	社会服务业	-	0.00
L	传播与文化产业	99,967,453.19	2.73
M	综合类	-	0.00
	合计	2,540,564,825.39	69.50

5.3 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	601318	中国平安	5,412,951	241,958,909.70	6.62
2	002142	宁波银行	22,404,271	218,217,599.54	5.97
3	600519	贵州茅台	865,609	216,783,117.96	5.93
4	600066	宇通客车	9,542,080	209,066,972.80	5.72
5	600036	招商银行	21,700,000	208,103,000.00	5.69
6	000651	格力电器	9,656,764	204,819,964.44	5.60

7	000001	深发展A	13,270,526	194,413,205.90	5.32
8	600690	青岛海尔	15,857,639	172,531,112.32	4.72
9	600518	康美药业	10,299,740	157,586,022.00	4.31
10	000063	中兴通讯	12,199,904	138,346,911.36	3.78

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

5.5 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债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

5.6 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。

5.7 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权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

5.8 投资组合报告附注

5.8.1 报告期内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的，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

5.8.2 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股票。

5.8.3 其他资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	618,871.31
2	应收证券清算款	322,826.31
3	应收股利	1,465,413.98
4	应收利息	489,063.98
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	2,896,175.58

5.8.4 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。

5.8.5 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情况。

5.8.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入原因，分项之和与合计可能有尾差。

§ 6 基金管理人运用固有资金投资原封闭式基金情况

单位：份

报告期期初管理人持有的封闭式基金份额	35,672,293.00
报告期初至转型前买入总份额	-
报告期初至转型前卖出总份额	-
转型前最后一日管理人持有的封闭式基金份额	35,672,293.00
转型前最后一日持有的封闭式基金份额占基金总份额比例 (%)	0.76

§ 7 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日 (2012 年 7 月 27 日) 基金份额总额	4,674,305,067.90
基金合同生效日起至报告期期末基金总申购份额	5,623,342.77
减：基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回份额	404,958,981.81
基金合同生效日起至报告期期末基金拆分变动份额 (份额减少“-”填列)	-1,106,997,528.84
本报告期末基金份额总额	3,167,971,900.02

§ 8 影响投资者决策的其他重要信息

本基金管理人设立专门的业绩风险准备金，每月从已提取的基金管理费中计提 10% 作为业绩风险准备金，用于在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。自基金合同生效日至本报告期末划入人民币 804,541.70 元，期末业绩风险准备金账户结余人民币 804,541.70 元。

§ 9 备查文件目录

9.1 备查文件目录

- 1、中国证监会批准设立大成优选股票型证券投资基金 (LOF) 的文件；
- 2、《大成优选股票型证券投资基金 (LOF) 基金合同》；
- 3、《大成优选股票型证券投资基金 (LOF) 托管协议》；
- 4、中国证监会批准设立大成优选股票型证券投资基金的文件；
- 5、《大成优选股票型证券投资基金基金合同》；
- 6、《大成优选股票型证券投资基金托管协议》；
- 7、大成基金管理有限公司批准文件、营业执照、公司章程；
- 8、本报告期内在指定报刊上披露的各种公告原稿。

9.2 存放地点

本季度报告存放在本基金管理人和托管人的住所。

9.3 查阅方式

投资者可在营业时间免费查阅，或登录本基金管理人网站 <http://www.dcfund.com.cn> 进行查阅。

大成基金管理有限公司
2012 年 10 月 25 日