（上接D41版）

（73）中国国际金融有限公司
注册地址：北京市建国门外大街1号国贸大厦2座27层及28层
办公地址：北京市建国门外大街甲6号SK大厦
法定代表人：李剑阁
联系人：王雪筠
客服电话：010-85679238、010-85679169
网址：www.ciccs.com.cn
（74）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
（75）国信证券有限责任公司
注册地址：呼和浩特市新城区锡林南路18号
法定代表人：孔佑杰
联系电话：010-88086830
联系人：陈韦杉
传真：010-66412537
网址：www.rxzq.com.cn
（76）华龙证券有限责任公司
注册地址：甘肃省兰州市静宁路308号
法定代表人：李晓安
联系人：李昕田
联系电话：0931-8490208
甘肃省客服电话：96668
网址：www.hlzqgs.com
（77）财富证券有限责任公司
办公地址：湖南长沙芙蓉中路二段80号顺天国际财富中心26层
法人代表：周晖
客户服务热线：0731-84403319
联系人：胡智
电话：0731-84779521
传真：0731-84403439
网址：www.cfzq.com
（78）广发华福证券有限责任公司
注册地址：福州市五四路157号新天地大厦7、8层
法定代表人：黄金琳
客服电话：0591-96326
联系人：张腾
电话：0591-87278701/
传真：0591-87841150
网址：www.gfhfzq.com.cn
（79）大通证券股份有限公司
客服电话：4008-169-169
联系人：谢立军
电话：0411-39673202
网址：www.daton.com.cn
（80）中原证券股份有限公司
地址：郑州市经三路15号广汇国际贸易大厦
法定代表人：石保上
客服电话：0371-967218、4008139666
联系人：程月艳、耿铭
联系电话：0371-65585670
联系传真：0371-65585665
网址：www.ccnew.com
（81）西南证券股份有限公司
地址：重庆市渝中区临江支路2号合景国际大厦A幢
法定代表人：王珠林
客服电话：4008096096
联系人：徐雅筠、杨再巧
网址：www.swsc.com.cn
（82）山西证券股份有限公司
注册地址：山西省太原市府西街69号山西国际贸易中心东塔楼
法定代表人：侯巍
客服电话：0351-8686868
联系人：张治国
电话：0351-8686703
传真：0351-8686619
网址：www.i618.com.cn
（83）天源证券经济有限公司
注册地址：青海省西宁市长江路53号汇通大厦六楼
办公地址：深圳市福田区民田路新华保险大厦18楼
法定代表人：林小明
电话：0755-33331188
传真：0755-33329815
统一客服电话：4006543218
公司网站地址：www.tyzq.com.cn
（84）天风证券有限责任公司
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
（85）国盛证券有限责任公司
注册地址：江西省南昌市北京西路88号江信国际金融大厦
办公地址：江西省南昌市北京西路88号江信国际金融大厦4楼
法定代表人：曾小普
联系人：徐美云
电话：0791-6285337
传真：0791-6282293
网址：www.gsstock.com
（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
住所：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、宋萍萍
联系人：宋萍萍
（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有限公司
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：上海市湖滨路202号普华永道中心11楼
法人代表：杨绍信
经办注册会计师：汪棣、金毅
电话：021-23238888
传真：021-23238800
联系人：金毅
四、基金的名称
大成债券投资基金
办公地址：上海市湖滨路202号普华永道中心11楼
法人代表：杨绍信
经办注册会计师：汪棣、金毅
电话：021-23238888
传真：021-23238800
联系人：金毅
四、基金的名称
本基金名称：大成创新成长混合型证券投资基金（LOF）
五、基金的类型
本基金类型：混合型基金
六、基金的运作方式
本基金运作方式：契约型上市开放式
七、基金的投资目标
在控制风险和保证流动性的前提下，超越业绩比较基准，寻求基金资产的长期稳健增值。
八、基金的投资范围
本基金的投资范围限于国内依法发行上市的股票、债券及中国证监会批准的允许基金投资的其他金融工具。
本基金股票投资比例范围为基金资产的40%-95%；现金和固定收益类证券投资比例范围为基金资产的5%-60%，其中资产支持证券投资比例范围为0-20%，现金和到期日在一年以内的政府债券等短期金融工具的投资比例不低于基金资产净值的5%。
如法律法规或中国证监会修改基金投资品种的规定，基金管理人在履行相应程序后，可以依据新的规定修订基金的投资范围；如法律法规或中国证监会变更对权证或资产支持证券等投资的比例限制，基金管理人可相应调整基金的投资比例规定，不需经基金份额持有人大会审议。
九、基金的投资策略
本基金以股票投资为主，采用积极的投资策略，精选具备持续增长能力、价格处于合理区间的优质股票构建投资组合；本基金以固定收益品种投资为辅，确保投资组合具有良好的流动性。
1、资产配置策略
本基金在经济因素分析、经济周期分析、经济政策分析的基础上完成战略资产配置（SAA）。其中：经济因素分析主要包括利率分析、汇率分析和通货膨胀率分析；经济周期分析主要通过对国民生产总值、工业生产总值、消费总量、投资总量等宏观统计数据的周期性波动的定量分析完成；经济政策分析包括存款准备金率、再贴现率和公开市场操作等货币政策分析以及政府购买水平、政府转移支付水平和税率变动情况等财政政策分析。
本基金在通过战略资产配置确定各类别资产权重后，根据对投资组合中各类资产短期收益率变化的预测，确定资产类别定价差异，实现从相对较高估值资产到相对较低估值资产的再配置，即战术资产配置（TAA），以获得更高的投资收益。
2、股票投资策略
本基金的股票投资策略包获取超额收益和控制风险两个层面。
（1）收益层面
盈利的增长是支持股票价格快速、长期上涨的动力，而盈利增长水平是众多因素共同作用的结果，其中行业因素是影响企业增长性的主要外部因素；科技创新、消费趋势等则是影响企业增长性的主要内部因素。本基金将主要通过行业分析和企业研究进行股票投资的收益性选择。
①行业分析
本基金将通过行业发展现状分析、行业竞争结构分析和行业发展趋势分析，评价行业增长潜力：
A.行业发展现状分析，主要包括：
（A）行业增长率、产品集中度、企业地域分布分析；
（B）发达国家行业发展状况及行业梯度转移趋势分析；
（C）政府政策导向分析等。
B.行业竞争结构分析，主要包括：
（A）行业价值链分析及行业内主导竞争作用力分析；
（B）行业内主要竞争者财务状况及其竞争策略分析；
（C）行业所处周期及需求状况分析等。
C.行业未来发展趋势分析，主要包括：
（A）行业未来需求趋势及行业演变规律分析；
（B）行业内购并整合的可能性分析等。
②企业研究
本基金通过对企业利润增长水平的定量分析和企业创新能力、管理水平的定性分析，评价企业的增长潜力：
A.利润增长水平分析，主要包括：
（A）企业主营业务收入增长率分析；
（B）企业净利润增长率分析；
（C）企业净资产收益率分析；
（D）企业资产负债水平分析等。
B.企业创新能力分析，主要包括：
（A）企业主营产品是否符合产业升级趋势，是否顺应大众消费潮流；
（B）企业是否采取了不易被模仿和不易受到竞争对手反击的创新，确保企业在较长一段时间内独享创新带来的超额利润，并扩大市场占有率；
（C）企业是否具有品牌优势、资源独占等核心竞争优势等。
C.企业管理水平分析，主要包括：
（A）企业是否具有明确的发展战略；
（B）企业是否具有较高的资源配置效率；
（C）企业管理团队是否重视股东权益等。
（2）风险层面
在风险控制方面，本基金通过相对价值法和贴现现金流法的综合运用，在横向和纵向比较的基础上，客观评价企业的估值水平，选择价值被市场低估或者处于合理估值区间的股票，作为控制投资风险的重要手段，主要考察指标包括：
①资产重置价格
②市盈率（PE）
③市净率（PB）
④贴现现金流（DCF）
⑤经济价值息税折旧摊销前利润（EVA/EBITDA）
本基金将根据宏观经济状况、收益实现情况合理分配收益层面和风险层面的权重，做到可攻可守、进退有度，以期在合理控制风险的前提下，实现基金财产的长期稳健增值。
3、固定收益品种投资策略
本基金可以投资于国债、央行票据、金融债、企业债和资产支持证券等固定收益品种。本基金固定收益品种投资将采取较为积极的策略，通过利率预测分析、收益率曲线变动分析、信用度分析、收益率利差分析等，力求在保证基金资产总体的安全性、流动性的基础上获取一定的收益。
4、其他金融工具投资策略
本基金将在充分考虑收益性、流动性和风险特征的基础上，积极运用中国证监会允许基金投资的其他金融工具，以期降低组合风险，锁定既有收益，在一定程度上实现基金财产的保值、增值。
十、基金的业绩比较基准
沪深300指数×70%+中国债券总指数×30%
在本基金的运作过程中，如果由于外部投资环境或法律法规的变化而使得调整业绩比较基准更符合基金份额持有人的利益，则基金管理人可以对业绩比较基准进行适当调整，在报中国证监会核准后，公告并予以实施。
十一、基金的风险收益特征
本基金为混合型基金，风险收益水平高于货币市场基金和债券型基金，属于中高风险的证券投资基金品种。
十二、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。
基金托管人中国农业银行股份有限公司根据基金合同规定，于2011年6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。
本投资组合数据截止到2011年3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	9,291,162,047.93	84.81
	其中：股票	9,291,162,047.93	84.81
2	固定收益投资	340,080,942.48	3.10
	其中：债券	340,080,942.48	3.10
	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	1,309,410,623.29	11.95
6	其他资产	14,939,815.89	0.14
7	合计	10,955,593,429.59	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	9,505,992.60	0.09
B	采掘业	137,779,534.55	1.26
C	制造业	5,764,289,983.37	52.90
C0	食品、饮料	2,188,721,059.74	20.09
C1	纺织、服装、皮毛	-	0.00
C2	木材、家具	-	0.00
C3	造纸、印刷	78,800,000.00	0.72
C4	石油、化学、塑胶、塑料	984,828,830.95	9.04
C5	电子	304,402,748.60	2.79
C6	金属、非金属	241,269,598.57	2.21
C7	机械、设备、仪表	888,793,300.92	8.16
C8	医药、生物制品	1,004,885,130.22	9.22
C99	其他制造业	72,589,314.37	0.67
D	电力、煤气及水的生产和供应业	-	0.00
E	建筑业	221,864,011.74	2.04
F	交通运输、仓储业	-	0.00
G	信息技术业	174,043,750.77	1.60
H	批发和零售贸易	1,099,937,114.40	10.09
I	金融、保险业	1,244,620,491.42	11.42
J	房地产业	-	0.00
K	社会服务业	323,384,292.64	2.97
L	传播与文化产业	161,095,218.35	1.48
M	综合类	154,641,658.09	1.42
	合计	9,291,162,047.93	85.27

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	600132	重庆啤酒	13,991,668	963,046,508.44	8.84
2	600519	贵州茅台	3,637,226	654,155,096.10	6.00
3	600690	青岛海尔	22,437,198	632,055,867.66	5.80
4	002024	苏宁电器	46,623,246	598,176,246.18	5.49
5	000423	东阿阿胶	11,292,443	486,591,368.87	4.47
6	600859	王府井	9,407,182	382,966,379.22	3.51
7	600315	上海家化	9,999,950	379,498,102.50	3.48
8	600036	招商银行	25,999,933	366,339,055.97	3.36
9	600176	中国玻纤	11,467,865	364,792,785.65	3.35
10	000826	桑德环境	11,291,351	323,384,292.64	2.97

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	195,180,000.00	1.79
3	金融债券	139,314,000.00	1.28
	其中：政策性金融债	139,314,000.00	1.28
4	企业债券	-	0.00
5	企业短期融资券	-	0.00
6	可转债	5,586,942.48	0.05
7	其他	-	0.00
8	合计	340,080,942.48	3.12

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	1001072	10央行票据72	2,000,000	195,180,000.00	1.79
2	100226	10国开26	1,400,000	139,314,000.00	1.28
3	126729	燕京转债	46,680	5,586,942.48	0.05

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权证投资明细
本基金本报告期末未持有权证。
8、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本期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：
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。
（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	10,677,952.59
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	4,191,734.68
5	应收申购款	70,128.62
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	14,939,815.89

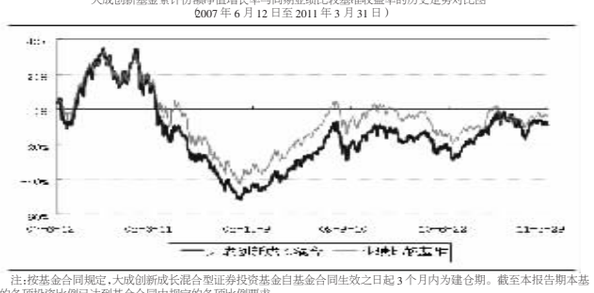
（4）报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细
本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。
（5）报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值（元）	占基金资净值比例（%）	流通受限情况说明
1	600315	上海家化	379,498,102.50	3.48	重大事项停牌

（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
2007.6.12-2007.12.31	25.71%	1.89%	24.67%	1.51%	1.04%	0.38%
2008.1.1-2008.12.31	-57.77%	2.18%	-49.72%	2.13%	-8.05%	0.05%
2009.1.1-2009.12.31	68.75%	1.80%	61.77%	1.44%	6.98%	0.36%
2010.1.1—2010.12.31	4.44%	1.40%	-7.82%	1.11%	12.26%	0.29%
2011.1.1-2011.03.31	-2.94%	1.28%	2.43%	0.96%	-5.37%	0.32%
2007.6.12-2011.3.31	-9.19%	1.81%	-4.25%	1.58%	-4.94%	0.23%

（二）自基金合同生效以来基金份额净值的变动情况，并与同期业绩比较基准的变动的比较
大成创新基金累计份额净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图
（2007年6月12日至2011年3月31日）



注：按基金合同规定，大成创新成长混合型证券投资基金自基金合同生效之日起3个月内为建仓期。截至本报告期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要求。
十四、基金的费用与税收
（一）与基金运作有关的费用
1、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）证券交易费用；
（4）基金合同生效后与基金相关的会计师费、律师费和信息披露费用；
（5）基金份额持有人大会费用；
（6）基金的资金汇划费用；
（7）按照有关法律法规规定或经中国证监会认定可以从基金资产中列支的其他费用。
2、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
在通常情况下，该项费用按前一日的基金资产净值1.5%的年费率计提，即本基金的年管理费率为1.5%。计算方法如下：
H=E×1.5%÷当年天数
H为每日应计提的基金管理费
E为前一日基金资产净值
管理费每日计算，逐日累计至每月月底，按月支付。基金托管人应于次月首日起10个工作日内按照基金管理人指令从基金财产中一次性支付。
（2）基金托管人的托管费
在通常情况下，该项费用按前一日的基金资产净值0.25%的年费率计提，即本基金的年托管费率为0.25%。计算方法如下：
H=E×0.25%÷当年天数
H为每日应支付的基金托管费
E为前一日的基金资产净值
托管费每日计算，逐日累计至每月月底，按月支付。基金托管人应于次月首日起10个工作日内按照基金管理人指令从基金财产中一次性支付。
（3）上述"1、基金费用的种类"第3至7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，由基金托管人从基金财产中支付。
（二）与基金销售有关的费用
1、申购费用
集中申购期申购费率与日常申购费率一致。
（1）场外申购费率

申购金额M	费率
M<50万	1.50%
50万≤M<200万	1.00%
200万≤M<500万	0.60%
M≥500万	1000元/笔

投资者多次申购，须按每次申购所对应的费率档次分别计费。当需要采取比例确认方式对有效申购金额进行部分确认时，投资者申购费率按照申购申请确认金额所对应的费率计算。
（2）场内申购费率
深圳证券交易所会员单位应按照本基金招募说明书约定的场外集中申购费率设定投资者的场内集中申购费率。
（3）本基金申购费用由基金申购人承担，不列入基金财产，在投资者申购基金份额时缴纳，用于市场推广、销售、登记结算等各项费用。
（4）基金申购份额的计算
净申购金额=申购金额÷（1+申购费率）
申购费用=申购金额-净申购金额
申购份数=净申购金额/申购日基金份额净值
2、赎回费用
（1）场外赎回费率

持有期限	赎回费率
1年以内（不含1年）	0.50%
1年到2年（不含2年）	0.25%
2年（含2年）以上	0

通过跨市场转登记由场内转至场外的基金份额，其持有期限自转登记至场外的份额确认日起计算。
（2）场内赎回费率
场内赎回费率为固定比例0.5%。
（3）赎回费的25%归入基金财产，其余用于支付注册登记费、销售手续费等各项费用。
（4）基金赎回金额的计算
赎回总金额=赎回份数×T日基金份额净值
赎回费用=赎回总额×赎回费率
净赎回金额=赎回总额-赎回费用
赎回总金额、净赎回金额按四舍五入的原则保留到小数点后两位，由此误差产生的收益归基金财产所有，产生的损失由基金财产承担。
3、T日的基金份额净值在当天收市后计算，并在T+1日内公告。遇特殊情况，基金份额净值可以适当延迟计算或公告，并报中国证监会备案。
基金份额净值的计算公式
T基金份额净值=T日基金资产净值÷T日发行在外的基金份额总数
基金份额净值保留到小数点后3位，小数点后第4位四舍五入。
（三）不列入基金费用的项目
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，以及处理与基金运作无关的事项发生的费用等不列入基金费用。
（四）费率的调整
基金管理人和基金托管人等可根据基金发展情况调整基金管理费率、基金托管费率等相关费率或改变收费模式。调高基金管理费率和基金托管费率，须召开基金份额持有人大会审议；调低基金管理费率和基金托管费率等相关费率或在不提高整体费率水平的情况下改变收费模式，无须召开基金份额持有人大会。
将来法律法规许可的情况下，本基金可以依法提取业绩报酬和/或业绩风险准备金。
基金管理人最迟应于新的费率或收费模式实施前2日在至少一种指定媒体上予以公告，并报中国证监会备案。
（五）基金税收
本基金及基金份额持有人应依据国家有关规定依法纳税。
十五、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2011年1月26日公布的《大成债券投资基金（LOF）更新招募说明书（2010年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，更新了"九、基金的投资"部分。
5、根据最新数据，更新了"十、基金业绩"部分。
6、根据相关公告，对"二十七、其他应披露的事项"进行了更新，补充了2010年12月13日至2011年6月12日发布的公告。
7、根据最新情况，更新了"二十八、招募说明书更新部分的说明"。

大成基金管理有限公司
二〇一一年七月二十七日

（上接D43版）

（77）中国国际金融有限公司
注册地址：北京市建国门外大街1号国贸大厦2座27层及28层
办公地址：北京市建国门外大街甲6号SK大厦
法定代表人：李剑阁
联系人：王雪筠
客服电话：010-85679238、010-85679169
网址：www.ciccs.com.cn
（78）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
（79）国信证券有限责任公司
注册地址：呼和浩特市新城区锡林南路18号
法定代表人：孔佑杰
联系电话：010-88086830
联系人：陈韦杉
传真：010-66412537
网址：www.rxzq.com.cn
（80）华龙证券有限责任公司
注册地址：甘肃省兰州市静宁路308号
法定代表人：李晓安
联系人：李昕田
联系电话：0931-8490208
甘肃省客服电话：96668
网址：www.hlzqgs.com
（81）财富证券有限责任公司
办公地址：湖南长沙芙蓉中路二段80号顺天国际财富中心26层
法人代表：周晖
客户服务热线：0731-84403319
联系人：胡智
电话：0731-84779521
传真：0731-84403439
网址：www.cfzq.com
（82）广发华福证券有限责任公司
注册地址：福州市五四路157号新天地大厦7、8层
法定代表人：黄金琳
客服电话：0591-96326
联系人：张腾
电话：0591-87278701/
传真：0591-87841150
网址：www.gfhfzq.com.cn
（83）大通证券股份有限公司
客服电话：4008-169-169
联系人：谢立军
电话：0411-39673202
网址：www.daton.com.cn
（84）中原证券股份有限公司
地址：郑州市经三路15号广汇国际贸易大厦
法定代表人：石保上
客服电话：0371-967218、4008139666
联系人：程月艳、耿铭
联系电话：0371-65585670
联系传真：0371-65585665
网址：www.ccnew.com
（85）西南证券股份有限公司
地址：重庆市渝中区临江支路2号合景国际大厦A幢
法定代表人：王珠林
客服电话：4008096096
联系人：徐雅筠、杨再巧
网址：www.swsc.com.cn
（86）天源证券经济有限公司
注册地址：青海省西宁市长江路53号汇通大厦六楼
办公地址：深圳市福田区民田路新华保险大厦18楼
法定代表人：林小明
电话：0755-33331188
传真：0755-33329815
统一客服电话：4006543218
公司网站地址：www.tyzq.com.cn
（87）天风证券有限责任公司
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
（88）国盛证券有限责任公司
注册地址：江西省南昌市北京西路88号江信国际金融大厦
办公地址：江西省南昌市北京西路88号江信国际金融大厦4楼
法定代表人：曾小普
联系人：徐美云
电话：0791-6285337
传真：0791-6282293
网址：www.gsstock.com
（二）注册登记机构
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33层
法定代表人：张树忠
电话：0755-83183388
传真：0755-83195239
联系人：范瑛
（三）律师事务所和经办律师
律师事务所名称：通力律师事务所
注册地址：上海市浦东南路528号上海证券大厦南塔21楼
办公地址：上海市浦东南路528号上海证券大厦南塔21楼
经办律师：秦悦民、傅轶
电话：021-68818100
传真：021-68816880
（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有限公司
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：上海市湖滨路202号普华永道中心11楼
法人代表：杨绍信
经办注册会计师：汪棣、金毅
电话：021-23238888
传真：021-23238800
联系人：金毅
四、基金的名称
大成债券投资基金
五、基金的类型
基金类型：契约型
六、基金的运作方式
基金运作方式：开放式
七、基金的投资目标
在力保本金安全和保持资产流动性基础上追求资产的长期稳定增值。
八、基金的投资方向
投资于债券类资产部分（包括流动性良好的、国内市场依法发行及交易的国债、金融债、公司债、企业债、可转换债券、正逆回购等，以及中国证监会允许基金投资的其他金融工具）不低于基金资产总值80%，本基金还可择机进行新股申购，但新股投资比例不超过基金资产总值20%。
九、基金的投资策略
本基金通过整体资产配置、类属资产配置和个券选择三个层次进行投资管理，以实现投资目标。具体按照如下步骤执行：
（一）在整体资产配置层次上，通过对宏观经济、市场利率、债券供求、情景分析、申购、赎回现金流情况等因素的综合分析，决定债券、逆回购、现金三类资产的配置比例。
（二）在类属资产配置层次，根据市场和类属资产的风险收益特征，将市场细分为交易所国债、交易所企业债、银行间国债、银行间金融债四个子市场。在此基础上运用修正的均值-方差等模型，定期对投资组合类属资产进行最优化配置和调整，确定类属资产的最优权重。
（三）在债券选择上，采取积极策略，包括利率预期策略、收益率曲线策略、收益率利差策略等。
（四）本基金在满足基金日常申购、赎回流动性基础上根据新股基本面研究择机进行新股申购。
基金管理人可根据债券市场的变化对市场细分与模型运用等进行适当调整。
十、基金的业绩比较基准
中国债券总指数
十一、基金的风险收益特征
本基金80%以上投资于债券，为债券基金，预期收益和风险高于货币市场基金，低于混合型基金和股票基金。
十二、基金的投资组合报告
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。
基金托管人中国农业银行股份有限公司根据基金合同规定，于2011年6月27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。
本投资组合报告所载数据截至2011年3月31日，本报告中所列财务数据未经审计。
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	18,250.00	0.00
	其中：股票	18,250.00	0.00
2	固定收益投资	510,832,801.60	96.51
	其中：债券	510,832,801.60	96.51
	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	3,537,732.02	0.67
6	其他资产	14,894,018.04	2.81
7	合计	529,282,801.66	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	采掘业	-	0.00
C	制造业	18,250.00	0.00
C0	食品、饮料	-	0.00
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	18,250.00	0.00
C8	医药、生物制品	-	0.00
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	-	0.00
H	批发和零售贸易	-	0.00
I	金融、保险业	-	0.00
J	房地产业	-	0.00
K	社会服务业	-	0.00
L	传播与文化产业	-	0.00
M	综合类	-	0.00
	合计	18,250.00	0.00

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	300195	长荣股份	500	18,250.00	0.00

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	6,102,440.00	1.20
2	央行票据	10,030,000.00	1.98
3	金融债券	151,178,000.00	29.81
	其中：政策性金融债	124,097,000.00	24.47
4	企业债券	262,109,114.40	51.68
5	企业短期融资券	-	0.00
6	可转债	81,413,247.20	16.05
7	其他	-	0.00
8	合计	510,832,801.60	100.72

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	080218	08国开18	700,000	68,691,000.00	13.54
2	126018	08江铜债	799,910	63,464,859.40	12.51
3	1180053	11宝城投债	400,000	40,464,000.00	7.98
4	100236	10国开36	400,000	40,412,000.00	7.97
5	113002	工行转债	298,970	35,804,647.20	7.06

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权证投资明细
本基金本报告期末未持有权证。
8.投资组合报告附注
（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。
（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	489,219.01
2	应收证券清算款	1,999,296.52
3	应收股利	-
4	应收利息	6,112,581.05
5	应收申购款	6,292,921.46
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	14,894,018.04

（4）报告期末基金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	35,804,647.20	7.06
2	113001	中行转债	32,422,050.40	6.39

（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。
（6）由于四舍五入原因，分项之和与合计可能有尾差。
十三、基金业绩
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。基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在做出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。
（一）基金合同生效日（2003年6月12日）至2011年3月31日以来完整会计年度的投资业绩及与同期业绩比较基准收益率的比较：

A、B类

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
2003.6.12-2003.12.31	2.90%	0.16%	-1.41%	0.29%	4.31%	-0.13%
2004.1.1-2004.12.31	1.81%	0.32%	-3.32%	0.35%	5.13%	-0.03%
2005.1.1-2005.12.31	11.33%	0.29%	10.55%	0.21%	0.78%	0.08%
2006.1.1-2006.12.31	6.29%	0.14%	2.62%	0.10%	3.67%	0.04%
2007.1.1-2007.12.31	8.79%	0.17%	-