(上接C12版)

法定代表人:卢长才
客服电话:0755-83199599
联系人:张婷
电话:0755-83199511
传真:0755-83199545
网址:www.cscc.com.cn
(7)中国建银投资证券有限责任公司
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18层至20层
办公地址:深圳市福田区益田路与福中路交界处荣超商务中心A栋18层至20层
法定代表人:杨明辉
联系人:刘毅
客户电话:400 600 8008
电话:0755-82023442
传真:0755-82026539
网址:www.cjis.cn
(8)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.cicc.com.cn
(9)华鲁证券有限公司
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
(10)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
(11)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
(12)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
(13)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
(14)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
(15)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
(16)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
(17)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
(18)金元证券股份有限公司
注册地址:海南省海口市南宝路36号证券大厦4层(邮政编码:570206)
办公地址:深圳市深南大道4001号时代金融中心17楼(邮政编码:518034)
法定代表人:陆涛
客服电话:4008-888-228
联系人:金春
电话:0755-83025022
传真:0755-83025625
网址:www.jyzq.cn
(19)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
(20)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:翟璐
联系电话:(027)87618882/(028)86711410 传真:(027)87618863
公司网站:www.tfzq.com
(21)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
(22)大连银行股份有限公司
注册地址:大连市中山区中山路88号天安国际大厦49楼
法定代表人:陈占维
客服电话:4006640099
联系人:李鹏
电话:0411-82308602
传真:0411-82311420
网址:www.bankofdl.com
(三)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32层
法定代表人:张树忠
电话:0755-83183388
传真:0755-83195229
联系人:范璞、许婧璐
(四)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
(五)会计师事务所和经办注册会计师
公司名称:安永华明会计师事务所
注册地址:北京市东城区东长安街1号东方广场东方经贸城安永大楼16层
办公地址:北京市东城区东长安街1号东方广场东方经贸城安永大楼16层
法定代表人:葛明
经办注册会计师:张小东、周刚
电话:010-58153000
传真:010-85188298
联系人:李丽明

四、基金的名称
大成货币市场证券投资基金

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
在保持本金安全和资产流动性基础上追求较高的当期收益。

八、基金的投资方向
本基金可投资于剩余期限在1年以内(含1年)的回购、央行票据、银行定期存款、大额存单,剩余期限在397天(含397天)以内的债券以及中国证监会、中国人民银行允许基金投资的其他具有良好流动性的货币市场工具。

九、基金的投资策略
本基金通过组合平均剩余期限决策、类属配置和品种选择三个层次进行投资管理,以实现超越投资基准的投资目标。
1.组合平均剩余期限决策:
即每月月初通过宏观经济指标、债券市场情况及短期利率预测模型判断短期利率走势,确定本月组合平均剩余期限的浮动范围。具体来说是利率看涨则缩短组合平均剩余期限,看跌时相对加长组合剩余期限。
2.类属配置
本基金将短期金融工具按剩余期限分为3类,4个月以下、5-8个月、9个月以上品种,而各期限品种内部按投资工具的特征可划分为回购、短期债(含国债、金融债、企业债)、央行票据三类。本基金管理人在评估各品种在流动性、收益率稳定性基础上,结合预先制定的组合平均期限范围确定类属资产配置。
3.品种选择
本基金管理人通过综合考虑品种流动性、收益率的基础上,选择品种构建组合。具体来说,遵循以下原则:
①对于短期券和央行票据原则上采取买入并持有的投资策略,但持有过程中会结合短期资金利率走势、信用度和与回购收益率比较分析综合评估其在收益性和流动性方面投资价值。选择到期收益率高于回购收益率或者预期收益率有下降空间的品种。
②回购以短期品种为主,具体期限的选择可评估品种间利率期限结构的合理性,选择收益率相对高的品种进行投资。

十、基金的业绩比较基准
自2008年06月01日起,本基金业绩比较基准由原"税后一年期银行定期存款利率",变更为"税后活期存款利率"。

十一、基金的风险收益特征
本基金为货币市场基金,属于证券投资基金中的低风险品种;预期收益和风险都低于债券基金、混合基金、股票基金。

十二、基金的投资组合报告(截至2011年9月30日)
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。
基金托管人中国光大银行股份有限公司根据基金合同规定,于2011年12月29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。
本投资组合报告有关数据的期间为:2011年7月1日至2011年9月30日。
1.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	固定收益投资	499,321,393.24	56.14
	其中:债券	499,321,393.24	56.14
	资产支持证券	-	0.00
2	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
3	银行存款和结算备付金合计	380,266,888.42	42.75
4	其他资产	9,837,199.88	1.11
5	合计	889,425,481.54	100.00

2.报告期债券回购融资情况

序号	项目	占基金资产净值的比例(%)	
1	报告期内债券回购融资余额	3.83	
	其中:买断式回购融资	0.00	
序号	项目	金额(元)	占基金资产净值的比例(%)
2	报告期末债券回购融资余额	-	0.00
	其中:买断式回购融资	-	0.00

注:报告期内债券回购融资余额占基金资产净值的比例为报告期内每个交易日融资余额占资产净值比例的简单平均值。
注:本报告期内无债券正回购的资金余额超过基金资产净值的20%的情况。
3.期末基金组合剩余期限
①投资组合平均剩余期限基本情况

项目	天数
报告期末投资组合平均剩余期限	59
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	93
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	37

报告期内投资组合平均剩余期限超过180天情况说明
注:本报告期内无投资组合平均剩余期限超过180天的情况。
②投资期末投资组合平均剩余期限分布比例

序号	平均剩余期限	各期限资产占基金资产净值的比例(%)	各期限负债占基金资产净值的比例(%)
1	30天以内	46.23	0.00
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	0.00	0.00
2	30天(含)-60天	5.64	0.00
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	5.64	0.00
3	60天(含)-90天	25.84	0.00
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	5.57	0.00
4	90天(含)-180天	16.94	0.00
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	3.43	0.00
5	180天(含)-397天(含)	4.48	0.00
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	0.00	0.00
	合计	99.13	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	摊余成本(元)	占基金资产净值的比例(%)
1	国家债券	29,960,939.01	3.38
2	央行票据	9,828,511.43	1.11
3	金融债券	219,799,766.00	24.77
	其中:政策性金融债	219,799,766.00	24.77
4	企业债券	79,885,645.15	9.00
5	企业短期融资券	159,846,531.65	18.01
6	中期票据	-	0.00
7	其他	-	0.00
8	合计	499,321,393.24	56.27
9	剩余存续期超过397天的浮动利率债券	129,888,229.31	14.64

5.报告期末按摊余成本占基金资产净值比例大小排名的前十名债券投资明细

序号	债券代码	债券名称	债券数量(张)	摊余成本(元)	占基金资产净值比例(%)
1	100310	10进出10	1,200,000	119,884,433.46	13.51
2	1181069	11昆钢集CP01	700,000	69,985,780.27	7.89
3	090411	09农发11(浮动)	500,000	50,002,584.16	5.64
4	1181105	11荣盛CP01	500,000	49,865,125.60	5.62
5	058031	05中信债1(浮动)	500,000	49,450,517.09	5.57
6	058017	05首都机场债(浮动)	300,000	30,435,128.06	3.43
7	1081348	10邮科院CP01	300,000	29,995,120.80	3.38
8	110020	11附息国债20	300,000	29,960,939.01	3.38
9	080221	08国开21	300,000	29,933,954.99	3.37
10	070211	07国开11(浮动)	200,000	19,978,793.39	2.25

6.影子定价"与"摊余成本法"确定的基金资产净值偏离

项目	偏离情况
报告期内偏离度的绝对值在0.25(含)-0.5%间的次数	-
报告期内偏离度的最高值	0.1119%
报告期内偏离度的最低值	-0.0420%
报告期内每个交易日偏离度的绝对值的简单平均值	0.0397%

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。
8.投资组合报告附注
①基金计价方法说明
本基金的债券投资及资产支持证券投资采用摊余成本法计价,即计价对象以买入成本列示,按票面利率或商定利率每日计提应收利息,按实际利率法在其剩余期限内摊销其买入时的溢价或折价。
本基金每日计提收益,通过每日分红使得基金份额净值维持在1.0000元。
②本报告期内不存在基金持有剩余期限小于397天但剩余存续期超过397天的浮动利率债券的摊余成本超过当日基金资产净值的20%的情况。
③本基金投资的前十名证券的发行主体本期未出现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。
④其他资产构成

序号	其他资产	金额(元)
1	存出保证金	-
2	应收证券清算款	-
3	应收利息	9,833,199.88
4	应收申购款	4,000.00
5	其他应收款	-
6	待摊费用	-
7	其他	-
8	合计	9,837,199.88

⑤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。

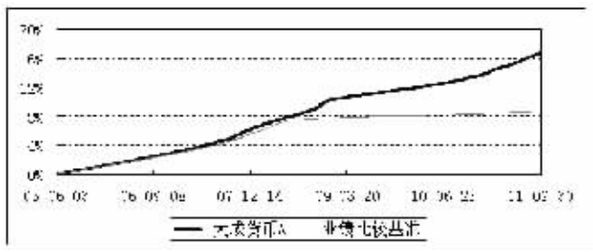
十三、基金业绩
基金管理人依照恪尽职守、诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用基金财产,但不保证基金一定盈利,也不保证最低收益。基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险,投资者在做出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书及其更新。
(一)基金合同生效日2005年6月3日,基金合同生效以来完整会计年度的投资业绩及与同期基准的比较如下表所示:
A类

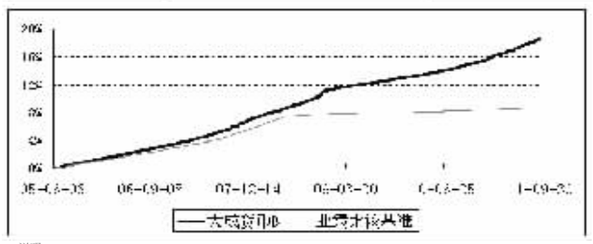
阶段	基金净值收益率①	基金净值收益率标准差②	比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
2005.6.3-2005.12.31	1.1421%	0.0044%	1.0455%	0.0000%	0.0966%	0.0044%
2006.1.1-2006.12.31	1.9658%	0.0033%	1.8800%	0.0005%	0.0858%	0.0028%
2007.1.1-2007.12.31	3.1996%	0.0062%	2.7850%	0.0019%	0.1446%	0.0043%
2008.1.1-2008.12.31	3.7332%	0.0129%	2.0136%	0.0045%	1.7196%	0.0084%
2009.1.1-2009.12.31	1.3162%	0.0034%	0.3600%	0.0000%	0.9562%	0.0034%
2010.1.1-2010.12.31	1.8066%	0.0043%	0.3600%	0.0000%	1.4466%	0.0043%
2011.1.1-2011.9.30	2.5302%	0.0043%	0.3437%	0.0002%	2.1865%	0.0041%
2005.6.3-2011.9.30	16.7585%	0.0069%	8.7867%	0.0032%	7.9178%	0.0037%

B类

阶段	基金净值收益率①	基金净值收益率标准差②	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
2005.6.3-2005.12.31	1.2832%	0.0044%	1.0455%	0.0000%	0.2377%	0.0044%
2006.1.1-2006.12.31	2.2124%	0.0033%	1.8800%	0.0005%	0.3324%	0.0028%
2007.1.1-2007.12.31	3.4504%	0.0062%	2.7850%	0.0019%	0.6654%	0.0043%
2008.1.1-2008.12.31	3.9814%	0.0129%	2.0136%	0.0045%	1.9678%	0.0084%
2009.1.1-2009.12.31	1.5599%	0.0035%	0.3600%	0.0000%	1.1999%	0.0035%
2010.1.1-2010.12.31	2.0525%	0.0043%	0.3600%	0.0000%	1.6925%	0.0043%
2011.1.1-2011.09.30	2.7144%	0.0043%	0.3437%	0.0002%	2.3707%	0.0041%
2005.6.3-2011.09.30	18.5512%	0.0069%	8.7867%	0.0032%	9.7645%	0.0037%

(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(2005年6月3日至2011年9月30日)





说明:
1.依据本基金合同规定,本基金投资于同一公司发行的短期企业债券的比例,不得超过基金资产净值的10%;存放在具有基金托管资格的同一商业银行的存款,不得超过基金资产净值的30%;存放在不具有基金托管资格的同一商业银行的存款,不得超过基金资产净值的5%;除发生巨额赎回的情形外,基金的投资组合中债券正回购的资金余额在每个交易日均不得超过基金资产净值的20%。因发生巨额赎回致使货币市场基金债券正回购的资金余额超过基金资产净值20%的,基金管理人应当在5个交易日内进行调整;基金持有的剩余期限不超过397天但剩余存续期超过397天的浮动利率债券的摊余成本总计不得超过当日基金资产净值的20%;投资组合的平均剩余期限在每个交易日不得超过180天。本基金在3个月的初始建仓期结束后,基金投资组合比例已达到本基金合同的相关规定要求。
2.为使本基金业绩与其业绩比较基准具有更强的可比性,经大成基金管理有限公司申请,并经中国证监会同意,自2008年6月1日起,本基金业绩比较基准由"税后一年期银行定期存款利率"变更为"税后活期存款利率"。本基金业绩比较基准收益率的历史走势图从2005年6月3日(基金合同生效日)至2008年5月31日为原业绩比较基准(税后一年期银行定期存款利率)的走势图,2008年6月1日起为变更后的业绩比较基准的走势图。

十四、费用概览
(一)与基金运作有关的费用
1.与基金运作相关费用列示
①基金管理人的管理费;
②基金托管人的托管费;
③基金的证券交易费用;
④基金合同生效后的信息披露费用;
⑤基金份额持有人大会费用;
⑥基金合同生效后的会计师费;
⑦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。
2.与基金运作相关费用计提方法、计提标准和支付方式
①基金管理人的管理费
基金管理人的基金管理费按基金资产净值的0.33%年费率计提。
在通常情况下,基金管理费按前一日基金资产净值的0.33%年费率计提。计算方法如下:
H=E×0.33%÷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
基金管理费每日计提,按月支付。由基金管理人向基金托管人发送基金管理费划付指令,基金托管人复核后于次月首日起5个工作日内从基金资产中一次性支付给基金管理人。
②基金托管人的基金托管费
基金托管人的基金托管费按基金资产净值的0.1%年费率计提。
在通常情况下,基金托管费按前一日基金资产净值的0.1%年费率计提。计算方法如下:
H=E×0.1%÷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
基金托管费每日计提,按月支付。由基金管理人向基金托管人发送基金托管费划付指令,基金托管人复核后于次月首日起5个工作日内从基金资产中一次性支付给基金托管人。
③本条第1款第③项至第⑦项费用由基金托管人根据有关法规及相应协议的规定,按费用实际支出金额支付,列入当期基金费用。基金募集期间的律师费、会计师费、信息披露费用及其他费用不得从基金资产中列支。
3.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。
4.基金管理费和基金托管费的调整
基金管理人和基金托管人可协商酌情调低基金管理费、基金托管费,无须召开基金份额持有人大会。
(二)与基金销售相关费用
1.认购费用
本基金认购费用为零。
2.申购费用
本基金的申购费用为零。
3.赎回费用
本基金的赎回费用为零。
4.销售服务费
本基金A级基金份额的销售服务年费率为0.25%,B级基金份额的年费率为0.01%。在通常情况下,基金销售服务费按前一日基金资产净值的一定年费率计提。
销售服务费的计算方法如下:
H=E×R÷当年天数
H为每日应支付的基金销售服务费
E为前一日的基金资产净值
R为该级基金份额的销售服务年费率
基金销售服务费每日计算,逐日累计至每个月月末,按月支付,基金管理人应于次月前两个工作日内将上月基金销售服务费的计算结果书面通知基金托管人并做出划付指令;基金托管人应在收到计算结果后当日完成复核,并于当日从基金资产中一次性支付给管理人,若遇节假日、公休假等,支付日顺延延。
基金销售服务费主要用于支付销售机构佣金、以及基金管理人的基金行销广告费、促销活动费、份额持有人服务费等。基金管理人和基金托管人可根据基金规模等因素协商的情调低基金销售服务费率,无须召开基金份额持有人大会。如降低基金销售服务费率,基金管理人最迟须于新的费率开始实施前两日内在至少一种中国证监会指定的信息披露媒体公告。
5.转换费用
详情请见"六、基金转换"便新的招募说明书书全文"的有关部分。
(三)基金税收
本基金运作过程中涉及的各纳税主体,应按国家税收法律、法规履行其纳税义务。
按照国家现行税收法律、法规规定,个人投资者投资本基金所获增值部分免税,机构投资者投资本基金所获增值部分应按相关规定缴纳企业所得税。

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7月16日公布的《大成货币市场证券投资基金更新的招募说明书(2011第1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.在"三、基金管理人"部分,更新了相关信息。
2.在"四、基金托管人"部分,更新了相关信息。
3.在"五、相关服务机构"中,根据相关公告,进行了更新。
4.在"九、基金的投资"中,根据最新资料,对"(十二)基金投资组合报告"的内容进行了更新。
5.在"十、基金业绩"中,根据最新资料,对"基金业绩"进行了补充和更新。
6.在"二十二、其他应披露的事项"中,披露了2011年6月4日至2011年12月3日发布的公告。
7.根据最新情况,更新了"二十三、招募说明书更新部分的说明"。

大成基金管理有限公司
二〇一二年一月十七日

大成蓝筹稳健证券投资基金更新的招募说明书摘要

(上接C10版)

电话:0531-81283938
传真:0531-81283900
网址:www.qlzq.com.cn
(82)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
(83)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
(84)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
(85)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
(86)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
(87)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
(88)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
(89)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
(90)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
(91)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:翟璐
联系电话:(027)87618882、(028)86711410
传真:(027)87618863
公司网站:www.tfzq.com
(92)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32层
法定代表人:张树忠
电话:0755-83183388
传真:0755-83195229
联系人:范璞

(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:上海市浦东新区陆家嘴环路1318号星展银行大厦3楼
上海市法人代表: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
大成蓝筹稳健证券投资基金

五、基金类型
契约型

六、基金的运作方式
开放式

七、基金的投资目标
通过精选符合本基金投资理念、流动性良好的证券,在控制非系统风险的前提下获取投资收益,同时辅助运用一系列数量分析方法,有效控制系统性风险,实现基金财产的中长期稳定增值。

八、基金的投资方向
本基金的股票投资主要投资于上证180指数成分股、深证100指数成分股以及未来可能入选成分股的股票,并适度投资于新股申购,股票增发申购等。债券投资以国债投资为主,并适度投资于国内依法公开发行、上市的金融债、企业(公司)债(包括可转债)等债券及中国证监会允许投资的其他金融工具。
本基金投资股票比例为基金资产净值的30%-95%,投资债券比例为基金资产净值的0%-65%,现金或到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的5%。法律法规另有规定时从其规定。

九、基金的投资策略
1.资产配置策略
本基金利用修正的恒定比例投资组合保险策略(CPPI)来动态调基金中股票、债券和现金的配置比例。其中,股票投资部分的80%投资于上证180指数成分股和深证100指数成分股。
利用CPPI来动态调整基金资产配置,需要动态确定一些相关的参数:无风险利率、初始股票仓位、风险乘数、修正调整幅度等。一般来说,无风险率采用平均隔夜资金拆借成本。初始股票仓位取决于建仓初期宏观经济环境、市场状况和资金供求情况以及未来的市场预期。因此,我们将深入分析、研究宏观经济环境、市场特征、资金供求状况以及对市场未来做合理预期,在此基础上谨慎做出投资期初的资产配置决策,构建投资期初的股票仓位。而风险乘数则是通过对市场的收益、风险特征所做的数量化分析以及对投资者的风险容忍程度的深入调查后确定的,一般介于2-5之间。
2.行业配置策略
本基金的行业配置采取较为积极的策略,以投资基准的行业权重为基础,以行业研究及比较分析为核心,通过适时增大或降低相应行业的投资权重,使整体投资表现跟上或超越投资基准。基金管理人将根据国家产业政策、行业周期和景气状况、行业发展前景预期、市场行业轮换情况等因素,综合判断行业投资价值,适当加大对处于产业复苏周期、被市场低估、行业景气指数上升、发展前景良好的行业的投资。具体根据基金管理人研究部的行业投资价值评估系统进行。
3、个股选择策略
个股选择策略采用蓝筹成分股优选策略,运用"价值一势头"选股方法,优选出被市场低估并有良好市场表现,处于价值回归阶段的天相280指数成分股投资,并采用积极的资产管理方式,以期获得资本的稳健增值。
选股程序:
①确定现有成分股和可能进入的股票
以上证180指数和深证100指数成分股作为基础备选股票库;再根据上证180指数和深证100指数编制原则,选出未来可能进入上证180指数或深证100指数成分股并符合本基金投资理念的股票,加入基础备选股票库;
②价值选股:
●蓝筹公司主要挑选标准:
●公司治理结构良好、行为规范、信息透明、注重公众股东利益和投资者关系
●主营业务鲜明并具有一定的竞争力
●经营管理能力和市场竞争能力在行业中具有明显优势
●具备长期持续稳定成长性,预期至少未来两年的主营业务收入和利润增长率高于GDP增长率
●财务状况良好,具备较好的抗风险能力
●由基金管理人内设的研究部门公分析人员根据上述蓝筹公司挑选标准,采用自下而上方式逐个筛选,形成基本面合规备选股票库。
●将基本面合规备选股票库按PB从小到大排序(剔除业绩为负的股票),选取前70%的股票作备选,产生投资备选股票库。
③势头选股:
将备选股票按如下公式计算势头,按势头从大到小排序,并参考排序结果形成最终股票组合。

其中:R_i为股票最近三个月的收益率,
R_f为股票所在行业最近三个月的收益率,

为股票收益率与其对应行业收益率之差的月标准差,

Tr为股票交易活跃度,表示为股票最近5个交易日平均换手率除以最近30个交易日平均换手率。

4、债券投资策略
本基金的债券投资采用完全积极的投资策略,采用利率预测、久期管理、收益率曲线移动策略、相对价值评估、收益率利差策略、套利交易策略以及利用正逆回购进行杠杆操作等积极的投资策略,力求获得超过债券市场的收益。

十、基金的业绩比较基准
由于我国还没有统一指数,我们暂时采用天相投资顾问有限公司编制的天相280指数作为股票投资部分的基准,采用中信标普国债指数作为债券投资部分的基准。本基金的业绩比较基准如下:
70%×天相280指数+30%×中信标普国债指数
中信国债指数的编制人中信标普指数信息服务有限公司已将"中信国债指数"更名为"中信标普国债指数",指数的编制方法未发生变动,保持了较好的延续性和连接性。鉴于此,本基金业绩比较基准中对应的指数名称也做相应调整。

十一、基金的风险收益特征
本基金属于较低风险证券投资基金,适于能承受一定风险,追求当期收益和长期资本增值的基金投资者投资。本基金采用大成风险管理系统和基金绩效评估系统,该系统可以完成市场风险管理、压力测试、多因子风险分析、流动性风险控制等多项风险管理功能。

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。
基金托管人中国银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2011年12月26日复核了本基金投资组合报告中的财务指标、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9月30日,本报告中所列财务数据未经审计。
(一)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	10,262,233,635.13	90.43
	其中:股票	10,262,233,635.13	90.43
2	固定收益投资	881,380,000.00	7.77
	其中:债券	881,380,000.00	7.77
	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	166,666,539.34	1.47
6	其他资产	38,294,508.69	0.34
7	合计	11,348,574,683.16	100.00

(二)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	519,260,211.06	4.60
C	制造业	8,534,233,663.33	75.55
C0	食品、饮料	1,806,212,130.13	15.99
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	119,362,611.24	1.06
C5	电子	920,583,944.25	8.15
C6	金属、非金属	991,978,042.81	8.78
C7	机械、设备、仪表	2,452,628,957.93	21.71
C8	医药、生物制品	2,243,467,976.97	19.86
C99	其他制造业	-	0.00
D	电力、煤气及水的生产和供应业	63,150,000.00	0.56
E	建筑业	-	0.00
F	交通运输、仓储业	-	0.00
G	信息技术业	590,829,511.19	5.23
H	批发和零售贸易	50,058,356.55	0.44
I	金融、保险业	241,992,295.76	2.14
J	房地产业	152,961,868.27	1.35
K	社会服务业	109,747,728.97	0.97
L	传播与文化产业	-	0.00
M	综合类	-	0.00
	合计	10,262,233,635.13	90.84

(三)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

代码	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	600519	贵州茅台	5,775,000	1,100,657,250.00	9.74
2	000538	云南白药	15,865,451	896,397,981.50	7.94
3	600518	康美药业	39,000,000	551,850,000.00	4.89
4	002106	莱宝高科	22,055,410	543,665,856.50	4.81
5	600031	三一重工	35,650,202	513,719,410.82	4.55
6	600271	航天信息	16,359,819	441,878,711.19	3.91
7	000527	美的电器	27,500,000	405,350,000.00	3.59
8	002007	华兰生物	16,162,543	357,838,702.02	3.17
9	600418	江淮汽车	40,585,996	342,951,666.20	3.04
10	600104	上海汽车	20,418,082	326,280,950.36	2.89

(四)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	198,870,000