（上接B34版）

法定代表人：张智河
联系人：谢立军
电话：[illegible]
传真：[illegible]
客户服务热线：[illegible]
网址：[illegible]

[illegible] 山西证券股份有限公司
注册地址：山西省太原市府西街[illegible]号山西国际贸易中心东塔楼
法定代表人：侯巍
客服电话：[illegible]
联系人：张治国
电话：[illegible]
传真：[illegible]
网址：[illegible]

[illegible] 金元证券股份有限公司
注册地址：海南省海口市南宝路[illegible]号证券大厦[illegible]　邮政编码：[illegible]
办公地址：深圳市深南大道[illegible]号时代金融中心[illegible]楼　邮政编码：[illegible]
法定代表人：陆涛
客服电话：[illegible]
联系人：金春
电话：[illegible]
传真：[illegible]
网址：[illegible]

[illegible] 天源证券经济有限公司
注册地址：青海省西宁市长江路[illegible]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[illegible]楼
法定代表人：林小明
电话：[illegible]
传真：[illegible]
统一客服电话：[illegible]
公司网站地址：[illegible]

[illegible] 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[illegible]号高科大厦四楼
法定代表人：余磊
联系人：翟璎
联系电话：[illegible]　传真：[illegible]
公司网站：[illegible]

[illegible] 国盛证券有限责任公司
注册地址：江西省南昌市北京西路[illegible]号江信国际金融大厦
办公地址：江西省南昌市北京西路[illegible]号江信国际金融大厦[illegible]楼
法定代表人：曾小普
联系人：徐美云
电话：[illegible]
传真：[illegible]
网址：[illegible]

[illegible] 大连银行股份有限公司
注册地址：大连市中山区中山路[illegible]号天安国际大厦[illegible]楼
法定代表人：陈占维
客服电话：[illegible]
联系人：李鹏
电话：[illegible]
传真：[illegible]
网址：[illegible]

（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[illegible]号招商银行大厦[illegible]层
办公地址：深圳市福田区深南大道[illegible]号招商银行大厦[illegible]层
法定代表人：张树忠
电话：[illegible]
传真：[illegible]
联系人：范瑛

（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[illegible]号财富中心写字楼[illegible]楼
办公地址：北京市朝阳区东三环中路[illegible]号财富中心写字楼[illegible]楼
负责人：王玲
电话：[illegible]
传真：[illegible]
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
名称：安永华明会计师事务所
住所：北京市东城区东长安街员号东方广场安永大楼[illegible]层
办公地址：北京市东城区东长安街员号东方广场安永大楼[illegible]层
法定代表人：葛明
电话：[illegible]
传真：[illegible]
签章注册会计师：张小东、周刚
联系人：李妍明

四、基金的名称
大成核心双动力股票型证券投资基金

五、基金的类型
股票型

六、基金的运作方式
开放式

七、基金的投资目标
以稳健的投资策略为主，采用合理的方法适当提升风险收益水平，力争获取超越业绩比较基准的中长期投资收益。

八、基金的投资范围
本基金的投资对象为具有较好流动性的金融工具，包括国内依法发行交易的股票、债券、权证及法律、法规或监管机构允许基金投资的其他金融工具。

本基金是股票基金，对股票类资产的投资比例不低于基金资产的[illegible]，在满足股票投资比例要求的基础上，可以投资于非股票类金融工具。

本基金股票资产占基金资产的比例范围为[illegible]，权证不超过基金资产净值的[illegible]，固定收益类证券和现金投资比例范围为基金资产的[illegible]，现金或到期日在一年以内的政府债券的比例不低于基金资产净值的[illegible]。

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。

九、基金的投资策略
本基金采用自上而下的方式实施大类资产间的战略配置，并采用“核心—双卫星”策略管理股票资产。核心策略指“稳健成长策略”，主要采用合理价格成长选股策略（[illegible]以下简称“[illegible]策略”），精选受益于内需增长的行业和企业的股票进行投资，稳健获取市场总体收益。双卫星策略指“积极进取策略”和“超额收益策略”。积极进取策略以中小板、创业板股票为主要投资对象，精选高成长性个股构建投资组合，采用该策略选取的股票呈现较高的风险收益特征，即具有较高的贝塔值；超额收益策略以大成数量化行业配置模型（以下简称“[illegible]模型”）为基础，进行数量化投资管理，优选预期超额收益优势明显的行业构建投资组合，力争获取持续的超额收益。

为有效控制投资风险，本基金采用稳健成长策略进行投资管理的股票资产不低于基金股票资产合计的[illegible]，采用积极进取策略和超额收益策略进行投资管理的股票资产不高于基金股票资产合计的[illegible]。本基金将在上述范围内，根据市场情况，不断优化各投资策略所管理资产之间的相对比例，追求超越业绩比较基准的中长期投资收益。

[illegible]类资产配置
通过综合分析宏观经济、政策环境、利率走势、技术指标、资金构成等可能影响证券市场的重要因素，结合公司研究开发的定量模型工具，判断市场时机，进行积极的资产配置，合理确定基金在股票、债券、现金等各类资产类别上的投资比例。

[illegible]股票投资策略
[illegible]稳健成长策略
稳健成长策略采用定性和定量相结合的手段，深入研究货币政策和财政政策，分析国内投资需求和消费需求，结合产业变迁路径，实施股票类别间的战术配置，捕捉内需增长效应下的投资机会，以获取稳健投资收益为目标，以沪深[illegible]指数成份股及其备选成份股为投资对象，构建投资组合。

[illegible]行业配置策略
主要投资于受益国内投资需求和消费需求增长的行业，分享国内经济高速增长所带来的行业利润的增长。基于行业研究小组的研究成果，综合分析宏观经济环境、国家财政政策和货币政策、农村城镇化进程、基础设施建设、居民消费升级等多种影响内需的因素，结合各个行业对投资需求和消费需求增长的盈利敏感程度，比较不同行业的相对投资价值，确定行业配置方案。

[illegible]股精选策略
在上述行业配置策略的基础上，精选相应行业中基本面良好、经营稳健、能长期受益于我国内需增长的优质企业，并以[illegible]策略为辅助，进一步挖掘具有较高的投资价值的高成长性股票，提高投资稳健性，降低组合风险。

[illegible]策略的核心思想是以相对合理的价格买入成长性较高的股票，将股票的价值属性和成长属性相结合，在投资价值和成长潜力之间获得平衡。运用[illegible]策略，可以从以下两方面挖掘股票的投资价值：

[illegible]对成长型公司的价值属性进行分析，可以发现相对其成长水平较具投资价值的股票，在价值回归的过程中获得收益，规避成长性较高但已被市场过度高估的股票。

[illegible]对价值型公司的成长属性进行分析，可以发现相对投资价值较具成长性的股票，在成长潜力释放的过程中获得收益，规避市场价格未合理反映其成长性不足的股票。

图具[illegible]投资理念

[illegible]积极进取策略
积极进取策略以中小板、创业板股票为投资对象，积极投资于具有较高成长潜力的优质企业。基于上述投资策略，积极进取策略选取具有较高贝塔值的股票，力求获取较高的中长期资本增值。

[illegible]中小板股票
相对于沪深主板市场，中小板上市公司具有成长性更高、收益潜力更大，个股风险也更高的特点。通过深入研究，把握中小板块中优质企业的成长机会，可以获得较高的中长期投资收益。

[illegible]创业板股票
创业板上市公司成长潜力巨大。在时机成熟时，可以采用和中小板类似的投资策略，精选创业板上市公司中具有核心竞争力、公司治理结构良好、市场前景广阔的企业进行投资。

未来，基金管理人还将根据证券市场的发展情况，寻求其他积极投资机会，不断丰富和优化本策略。

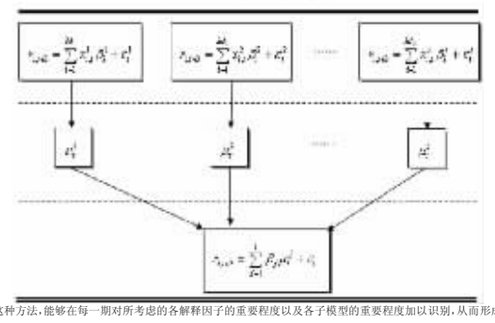
[illegible]超额收益策略
超额收益策略以大成基金公司研发的[illegible]模型为基础，进行数量化投资管理，旨在获取持续的超额收益。

通过[illegible]模型，分析各行业超额收益与估值、动量、大宗商品、国内实体经济、国际实体经济、国内外经济差异、通胀、金融条件等[illegible]类因素、共计百余个因子的内在关系规律，预测各行业超额收益，并根据预测结果，在稳健成长策略和积极进取策略的投资范围以外，精选优质股票，进行行业配置。

[illegible]运用模型进行行业配置
运用[illegible]模型，预测各个行业未来一段时间内的超额收益，根据预测结果，按照事先确定的配置规则实施行业配置。

[illegible]模型由[illegible]子模型组成，每个子模型分别对应各自的解释变量。在模型运用过程中，首先对每个子模型采用[illegible]方法进行线性回归，计算各个子模型关于每个行业未来一段时间内的超额收益预测值；在此基础上，以每个子模型的预测值作为解释变量，采用[illegible]方法再次进行线性回归，计算关于每个行业未来一段时间内的超额收益综合预测值，即模型的最终预测结果，具体构建方法见下图。

图因大成行业收益预测模型构建方法



通过这种方法，能够在每一期对所考虑的各解释因子的重要程度以及各子模型的重要程度加以识别，从而形成行业配置依据。

[illegible]因子的选择
因子的选择对于预测结论的正确性至关重要。[illegible]模型借鉴海外主流行业预测模型的因子选择标准，结合国内投研领域通常采用的因子群，根据我国各类统计数据的现实情况，按照以下原则筛选纳入模型的因子：

[illegible]全面性原则
就[illegible]模型自身特点而言，因子涵盖范围越全面，预测结论越准确。本基金确定的宏观因子、估值因子和动量因子等[illegible]因子群，能够较好的将宏观指标、企业基本面指标和交易市场指标全部纳入到模型当中。

[illegible]相关性原则
对于初步筛选的因子，本基金分别采用相关性分析和模型的实证验证两种方法进行第二次筛选，在保证所选因子对行业收益具有较强的预测功能的同时，尽量削减预测功能重复、相关性较低因子，进一步提升预测结论的准确性。

[illegible]完整性原则
[illegible]模型基于统计原理对未来行业收益进行预测，对样本数量要求较高，所以只选择具有足够历史样本且数据来源可靠、稳定、连续的因子。

[illegible]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，力求在保证资产总体的安全性、流动性的基础上获取稳定收益。

[illegible]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。

[illegible]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。

[illegible]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。

[illegible]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。

[illegible]他金融工具投资策略
[illegible]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，争取获得较高的回报。权证投资策略主要为：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，并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。

[illegible]可以利用规模优势和定价优势，积极参与新股申购、定向增发等，把握一级市场的投资机会。

[illegible]在充分考虑收益性、流动性和风险特征的基础上，积极运用监管机构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。

（一）投资决策流程
本基金采用投资决策委员会领导下的基金经理负责制。本基金的投资决策流程如下：

[illegible]投资策略配置、大类资产配置和股票资产类别配置的决策程序
[illegible]投资决策委员会根据核心策略和两个卫星策略的过往表现，结合对未来投资策略有效性的判断，向基金经理提出投资策略配置指导性意见。

基金经理根据投资决策委员会的指导性意见并结合自己的研究分析结果，拟定基金投资策略配置建议书，经投资决策委员会批准后，制定详细的投资策略配置计划并经授权后执行。

[illegible]大类资产配置
宏观研究员就政治形势、政策趋势、宏观经济形势、利率走势以及证券市场发展趋势等进行分析，向投资决策委员会和基金经理提交研究报告。

投资决策委员会根据相关报告，对市场中长期发展趋势做出判断，向基金经理提出大类资产配置指导性意见。

基金经理根据投资决策委员会的指导性意见并结合自己的研究分析结果，拟定基金大类资产配置建议书，提交投资决策委员会审议。

投资决策委员会对基金大类资产配置建议书的可行性进行分析，形成投资决议并授权基金经理执行。

[illegible]股票资产类别配置
基金经理综合各研究员的研究成果，依据本基金投资策略，向投资决策委员会提交股票资产类别配置建议书。经投资决策委员会批准后，基金经理制定详细的股票资产类别配置计划并经授权后执行。

[illegible]资品种选择的决策程序

[illegible]股票投资的决策程序
本基金所投资的上市公司必须已经进入本基金股票投资备选库，进入备选库的股票必须经过股票投资基本库、股票投资初选库和股票投资备选库的筛选程序，具体过程如下：

[illegible]研究员根据法律法规和基金合同规定，判断股票是否存在明显风险，确定股票投资基本库；

[illegible]研究员通过大量研读证券公司研究报告，经过综合分析判断，在股票投资基本库的基础上确定股票投资初选库；

[illegible]研究员选择初选库中的股票，进行深入分析和实地调研后，提交投资研究联席会议讨论。投资研究联席会议经过充分讨论和论证，确定该股票是否进入股票投资备选库；

[illegible]基金经理从股票投资备选库中选择股票构建投资组合。

基金经理按照投资策略配置计划分别构建“稳健成长策略”投资组合、“积极进取策略”投资组合和“超额收益策略”投资组合。

[illegible]基金经理采用合理价格成长选股策略，从股票投资备选库中选择股票构建“稳健成长策略”投资组合。

于[illegible]基金经理在大量研读内部外部研究报告并和研究员充分沟通的基础上，从股票投资备选库中精选高成长性的个股，结合实地调研成果，构建“积极进取策略”投资组合。

[illegible]基金经理根据金融工程部提供的数量化配置建议，从股票投资备选库中优选预期超额收益优势明显行业中的股票，构建“超额收益策略”投资组合。

[illegible]债券投资的决策程序
本基金投资的债券包括国债、央票、金融债、公司债、企业债（含可转换债券）等债券品种。

基金经理根据经投资决策委员会审批的大类资产配置计划，向债券投资研究员提出债券投资需求，债券投资研究员在对利率变动趋势、债券市场发展方向和各债券品种的流动性、安全性和收益性等因素进行综合分析的基础上，提出债券投资建议。基金经理根据债券投资研究员的债券投资建议，制定债券投资方案。

十、基金的业绩比较基准
本基金业绩比较基准：[illegible]沪深[illegible]指数[illegible]中证综合债券指数
本基金作为股票型基金，股票资产占基金资产的比例范围为[illegible]，固定收益类证券和现金投资比例范围为基金资产的[illegible]，所以采用股票指数和债券指数加权复合的方法构建业绩比较基准。由于沪深[illegible]指数是反映沪深两市[illegible]股综合表现的跨市场成份指数，中证综合债券指数是综合反映银行间和交易所市场国债、金融债、企业债、央票及短融整体走势的跨市场债券指数，两者均具有良好的市场代表性，因此，选择沪深[illegible]指数作为股票投资部分的业绩比较基准，同时，选取中证综合债券指数作为债券投资部分的比较基准。

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，本基金可以与基金托管人协商一致并报中国证监会备案后变更业绩比较基准并及时公告。

十一、基金的风险收益特征
本基金是主动投资的股票型基金，预期风险收益水平高于混合基金、债券基金和货币市场基金。

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。

基金托管人中国工商银行根据基金合同规定，于[illegible]年[illegible]月[illegible]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[illegible]年[illegible]月[illegible]日。（财务数据未经审计）

[illegible]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（%）
[illegible]	权益投资	[illegible]	[illegible]
	其中：股票	[illegible]	[illegible]
[illegible]	固定收益投资	[illegible]	[illegible]
	其中：债券	[illegible]	[illegible]
	资产支持证券	[illegible]	[illegible]
[illegible]	金融衍生品投资	[illegible]	[illegible]
[illegible]	买入返售金融资产	[illegible]	[illegible]
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	[illegible]	[illegible]
[illegible]	银行存款和结算备付金合计	[illegible]	[illegible]
[illegible]	其他资产	[illegible]	[illegible]
[illegible]	合计	[illegible]	[illegible]

[illegible]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（%）
[illegible]	农、林、牧、渔业	[illegible]	[illegible]
[illegible]	采掘业	[illegible]	[illegible]
[illegible]	制造业	[illegible]	[illegible]
[illegible]	食品、饮料	[illegible]	[illegible]
[illegible]	纺织、服装、皮毛	[illegible]	[illegible]
[illegible]	木材、家具	[illegible]	[illegible]
[illegible]	造纸、印刷	[illegible]	[illegible]
[illegible]	石油、化学、塑胶、塑料	[illegible]	[illegible]
[illegible]	电子	[illegible]	[illegible]
[illegible]	金属、非金属	[illegible]	[illegible]
[illegible]	机械、设备、仪表	[illegible]	[illegible]
[illegible]	医药、生物制品	[illegible]	[illegible]
[illegible]	其他制造业	[illegible]	[illegible]
[illegible]	电力、煤气及水的生产和供应业	[illegible]	[illegible]
[illegible]	建筑业	[illegible]	[illegible]
[illegible]	交通运输、仓储业	[illegible]	[illegible]
[illegible]	信息技术业	[illegible]	[illegible]
[illegible]	批发和零售贸易	[illegible]	[illegible]
[illegible]	金融、保险业	[illegible]	[illegible]
[illegible]	房地产业	[illegible]	[illegible]
[illegible]	社会服务业	[illegible]	[illegible]
[illegible]	传播与文化产业	[illegible]	[illegible]
[illegible]	综合类	[illegible]	[illegible]
	合计	[illegible]	[illegible]

[illegible]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（%）
[illegible]	[illegible]	格力电器	[illegible]	[illegible]	[illegible]
[illegible]	[illegible]	国电南瑞	[illegible]	[illegible]	[illegible]
[illegible]	[illegible]	康美药业	[illegible]	[illegible]	[illegible]
[illegible]	[illegible]	伊利股份	[illegible]	[illegible]	[illegible]
[illegible]	[illegible]	五粮液	[illegible]	[illegible]	[illegible]
[illegible]	[illegible]	贵州茅台	[illegible]	[illegible]	[illegible]
[illegible]	[illegible]	铁龙物流	[illegible]	[illegible]	[illegible]
[illegible]	[illegible]	兰花科创	[illegible]	[illegible]	[illegible]
[illegible]	[illegible]	中国太保	[illegible]	[illegible]	[illegible]
[illegible]	[illegible]	双汇发展	[illegible]	[illegible]	[illegible]

[illegible]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。

[illegible]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。

[illegible]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。

[illegible]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。

[illegible]投资组合报告附注
[illegible]本基金投资的前十名证券的发行主体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。

[illegible]年[illegible]月[illegible]日，本基金投资的前十名证券之一五粮液因信息披露违法被中国证券监督管理委员会罚款[illegible]万元。本基金认为，该处罚不会对五粮液投资价值构成实质性负面影响。

[illegible]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。

[illegible]基金的其他资产构成

序号	名称	金额（元）
[illegible]	存出保证金	[illegible]
[illegible]	应收证券清算款	[illegible]
[illegible]	应收股利	[illegible]
[illegible]	应收利息	[illegible]
[illegible]	应收申购款	[illegible]
[illegible]	其他应收款	[illegible]
[illegible]	待摊费用	[illegible]
[illegible]	其他	[illegible]
[illegible]	合计	[illegible]

[illegible]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可转换债券。

[illegible]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
[illegible]	[illegible]	双汇发展	[illegible]	[illegible]	审核重大资产重组事项

[illegible]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
基金管理人依照格尽职守、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	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	[illegible]	[illegible]
[illegible]（基金合同生效日）至[illegible]	[illegible]	[illegible]	[illegible]	[illegible]	[illegible]	[illegible]
[illegible]过去三个月	[illegible]	[illegible]	[illegible]	[illegible]	[illegible]	[illegible]
[illegible]至[illegible]年[illegible]月[illegible]日	[illegible]	[illegible]	[illegible]	[illegible]	[illegible]	[illegible]
[illegible]年[illegible]月[illegible]日至[illegible]年[illegible]月[illegible]日	[illegible]	[illegible]	[illegible]	[illegible]	[illegible]	[illegible]

（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

本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

[illegible]年[illegible]月[illegible]日至[illegible]年[illegible]月[illegible]日）

注：按基金合同规定，本基金自基金合同生效之日起[illegible]个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的约定，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。

十四、费用概览
（一）基金费用的种类
[illegible]基金管理人的管理费；
[illegible]基金托管人的托管费；
[illegible]基金财产拨划支付的银行费用；
[illegible]基金合同生效后的基金信息披露费用；
[illegible]基金份额持有人大会费用；
[illegible]基金合同生效后与基金有关的会计师费和律师费；
[illegible]基金的证券交易费用；
[illegible]在中国证监会规定允许的前提下，本基金可以从基金财产中计提销售服务费，具体计提方法、计提标准在招募说明书或相关公告中载明；
[illegible]法可以在基金财产中列支的其他费用。

（二）上述基金费用由基金管理人在法律规定的范围内参照公允的市场价格确定，法律法规另有规定时从其规定。

（三）基金费用计提方法、计提标准和支付方式
[illegible]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[illegible]%的年费率计提。管理费的计算方法如下：
[illegible]为计提费用当天的天数
[illegible]为每日应计提的基金管理费
[illegible]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，由基金管理人向基金托管人发送基金管理费划款指令，基金托管人复核后于次月前[illegible]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。

[illegible]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[illegible]%的年费率计提。托管费的计算方法如下：
[illegible]为计提费用当天的天数
[illegible]为每日应计提的基金托管费
[illegible]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，由基金管理人向基金托管人发送基金托管费划款指令，基金托管人复核后于次月前[illegible]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[illegible]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：
[illegible]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；
[illegible]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；
[illegible]基金合同[illegible]生效前的相关费用，包括但不限于验资费、会计师和律师费、信息披露费用等费用；
[illegible]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）费用调整
基金管理人和基金托管人协商一致后，可根据基金发展情况调整基金管理费率、基金托管费率、基金销售费率等相关费率。

调低基金管理费率、基金托管费率或基金销售费率等费率，无须召开基金份额持有人大会。

基金管理人必须最迟于新的费率实施日前按照有关规定在至少一种指定媒体和基金管理人网站上公告。

（五）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。

十五、对招募说明书更新部分的说明
本更新招募说明书依据《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，并根据本基金管理人对本基金实施的投资经营活动，对[illegible]年[illegible]月[illegible]日公布的《大成核心双动力股票型证券投资基金更新招募说明书（[illegible]年第[illegible]号）》进行了内容补充和更新，本更新的招募说明书主要更新的内容如下：

[illegible]根据最新资料，更新了“三、基金管理人”部分。

[illegible]根据最新资料，更新了“四、基金托管人”部分。

[illegible]根据最新资料，更新了“五、相关服务机构”部分。

[illegible]根据最新数据，更新了“八、基金的投资”部分。

[illegible]根据最新数据，更新了“九、基金的业绩”部分。

[illegible]根据最新公告，更新了“二十二、其他应披露的事项”部分，披露了[illegible]年[illegible]月[illegible]日至[illegible]年[illegible]月[illegible]日的公告。

[illegible]根据最新情况，更新了“二十三、对招募说明书更新部分的说明”。

大成基金管理有限公司
二〇一二年八月四日

（上接B36版）

单位：万元

项目	[illegible]年[illegible]月[illegible]日	[illegible]年[illegible]月[illegible]日（[illegible]年度）	[illegible]年[illegible]月[illegible]日（[illegible]年度）	[illegible]年[illegible]月[illegible]日（[illegible]年度）	[illegible]年[illegible]月[illegible]日（[illegible]年度）	[illegible]年[illegible]月[illegible]日（[illegible]年度）	[illegible]年[illegible]月[illegible]日（[illegible]年[illegible]月[illegible]日）
资产总额	[illegible]	[illegible]	[illegible]	[illegible]	[illegible]	[illegible]	[illegible]
营业收入	[illegible]	[illegible]	[illegible]	[illegible]	[illegible]	[illegible]	[illegible]
净利润	[illegible]	[illegible]	[illegible]	[illegible]	[illegible]	[illegible]	[illegible]

（三）收购的控股股东资产盈利预测完成情况：

根据北京中证国华会计师事务有限公司出具的京中证北审二审字【[illegible]】[illegible]号盈利预测报告，控股股东收购资产预测[illegible]年度实现净利润[illegible]万元，实际实现净利润[illegible]万元，达到盈利预测的[illegible]。

（四）承诺事项的履行情况
公司前次募集资金使用没有其他承诺事项。

五、前次募集资金实际使用情况与定期报告和其他信息的有关内容对照

单位：万元

项目	[illegible]年度	[illegible]年度	[illegible]年度	[illegible]年度	[illegible]年度	合计
各年度实际使用募集资金总额	[illegible]	[illegible]	[illegible]	[illegible]	[illegible]	[illegible]
定期报告使用募集资金总额	[illegible]	[illegible]	[illegible]	[illegible]	[illegible]	[illegible]
差异金额	[illegible]	[illegible]	[illegible]	[illegible]	[illegible]	
差异原因	系公司[illegible]年用募集资金偿还贷款及募集资金专户定期存款尚未到期，用自有资金先行垫支[illegible]万元所致。	募集资金账户偿还自有资金账户[illegible]万元；航空航天军用特种导线项目自有资金垫支[illegible]万元；		募集资金账户偿还航空航天军用特种导线项目自有资金垫资[illegible]万元，小型集成化项目自有资金垫支[illegible]万元。	募集资金账户偿还小型集成化项目自有资金垫支款[illegible]万元。	

除上述差异外，公司前次募集资金实际使用情况与公司定期报告和其他信息披露的有关内容不存在差异。

特此公告。

航天时代电子技术股份有限公司董事会
二〇一二年八月四日

证券代码：[illegible]　证券简称：航天电子　公告编号：临[illegible]-[illegible]

航天时代电子技术股份有限公司 关于公司与航天科技财务有限责任公司 签署金融服务协议的关联交易公告

本公司及董事会全体成员保证公告内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏，并对其内容的真实、准确和完整承担个别及连带责任。

重要内容提示

荫交易内容

员航天时代电子技术股份有限公司（下称“公司”）拟与航天科技财务有限责任公司（下称“财务公司”）签署《金融服务协议》，由财务公司向公司提供存、贷款等金融服务。

园财务公司将为公司提供无担保综合授信业务，[illegible]年综合授信额度为人民币[illegible]亿元。

猿公司拟将部分日常资金存放于财务公司。日均存款额不超过人民币[illegible]亿元。

荫关联人回避事宜

公司董事会[illegible]年第七次会议审议本关联交易议案时，关联董事回避了表决。

荫交易对公司的影响

此项交易有利于公司开拓融资渠道，增加融资方式，降低融资成本，满足公司业务发展需要。此项交易未损害公司及其他股东的利益。

荫需提请投资者注意的其他事项

本次关联交易尚须获得公司股东大会批准，关联股东将在股东大会上回避表决。

一、关联交易概述

为开拓融资渠道，增加融资方式，降低融资成本，满足公司业务发展需要，公司拟与财务公司签订《金融服务协议》，由财务公司向公司提供存、贷款等金融服务。

鉴于财务公司系公司实际控制人中国航天科技集团公司控制的公司，与公司存在关联关系，故本次金融服务构成关联交易。

本次关联交易尚须获得公司股东大会批准，关联股东将在股东大会上回避表决。

二、关联方介绍

财务公司是由中国航天科技集团公司及其成员单位共同出资设立，经中国银行业监督委员会批准，为中国航天科技集团公司及其成员单位提供金融服务的非银行金融机构。

该公司成立于[illegible]年，注册资本[illegible]亿元，注册地址：北京市海淀区阜成路[illegible]号西配楼。主要经营业务为：对成员单位办理财务和融资顾问、信用鉴证及相关咨询、代理业务；协助成员单位实现交易款项的收付；经批准的保险代理业务；对成员单位提供担保；办理成员单位之间的委托贷款及委托投资；对成员单位办理票据承兑与贴现；办理内部转账结算及相应结算、清算方案设计；吸收成员单位的存款；办理贷款及融资租赁；从事同业拆借；经批准发行财务公司债券；承销成员单位的企业债券；对金融机构的股权投资；有价证券投资；产品买方信贷及融资租赁。

截至[illegible]年[illegible]月[illegible]日，财务公司[illegible]年总资产[illegible]亿元，净资产[illegible]亿元，[illegible]年实现营业收入[illegible]亿元，净利润[illegible]亿元。

三、关联交易的主要内容

（一）金融服务协议主要内容

员财务公司同意按照公司的要求或指示向公司或公司的分、子公司提供以下金融服务业务：[illegible]存款服务；[illegible]贷款及融资租赁服务；[illegible]结算服务；[illegible]经中国银行业监督管理委员会批准的可从事的其他业务。

园公司在财务公司的存款利率应不低于中国人民银行就该种类存款规定的利率下限，不低于一般商业银行向中国航天科技集团公司各成员提供同种类存款服务所适用的利率；同时，不低于财务公司吸收中国航天科技集团公司各成员单位同种类存款所定的利率；公司在财务公司的日均存款额不超过人民币[illegible]亿元；

猿公司在财务公司的贷款利率按照中国人民银行有关规定和财务公司有关管理办法执行基准利率下浮[illegible]；

源除存款和贷款外的其他各项金融服务，财务公司收费标准应不高于国内其他金融机构同等业务费用水平；同时，不高于财务公司向中国航天科技集团公司各成员单位开展同类业务费用的水平；

缘根据公司经营和发展的需要，财务公司将在符合国家有关法律、法规的前提下为公司定期提供无担保综合授信业务，[illegible]年综合授信额度为人民币[illegible]亿元。授信业务包括但不限于贷款、贴现、担保及其他形式的资金融通。

远财务公司应确保资金管理网络安全运行，保障资金安全，控制资产负债风险，满足公司支付需求。

苑本次金融服务协议的有效期为一年。

证券代码：[illegible]　证券简称：航天电子　公告编号：临[illegible]-[illegible]

航天时代电子技术股份有限公司 关于召开[illegible]年第一次临时股东大会的通知

本公司董事会及全体董事保证本公告内容不存在任何虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏，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。

重要内容提示：

荫现场会议召开时间：[illegible]年[illegible]月[illegible]日（星期一）下午[illegible]点[illegible]

网络投票时间：[illegible]年[illegible]月[illegible]日　上午[illegible]点[illegible]-[illegible]点[illegible]

下午[illegible]点[illegible]-[illegible]点[illegible]

荫股权登记日：[illegible]年[illegible]月[illegible]日（星期一）

荫现场会议召开地点：北京世纪金源大饭店（北京海淀区板井路[illegible]号）

荫会议召开方式：现场投票与网络投票相结合

荫本次股东大会提供网络投票

荫公司股票涉及融资融券业务

一、召开会议基本情况

员召集人：公司董事会

园现场会议召开时间：[illegible]年[illegible]月[illegible]日（星期一）下午[illegible]点[illegible]

猿股权登记日：[illegible]年[illegible]月[illegible]日（星期一）

源网络投票时间：通过上海证券交易所的交易系统进行网络投票时间为[illegible]年[illegible]月[illegible]日上午[illegible]点[illegible]-[illegible]点[illegible]下午[illegible]点[illegible]

缘现场会议召开地点：北京世纪金源大饭店（北京海淀区板井路[illegible]号）

远会议投票方式：本次股东大会采取现场投票与网络投票相结合的方式。公司将通过上海证券交易所交易系统向全体股东提供网络形式的投票平台，股东可以在网络投票时间内通过上述系统行使表决权。开展融资融券业务的证券公司（以下简称“证券公司”）可以通过