(上接B82版)

联系人:潘世友
电话:021-54509998
传真:021-64383798
客服电话:400-1818-188
网址:www.1234567.com.cn
109、上海好买基金销售有限公司
注册地址:上海市虹口区场中路685弄37号4号楼449室
办公地址:上海市浦东新区浦东南路1118号鄂尔多斯国际大厦903~906
法定代表人:杨文斌
客服电话:400-700-9665
联系人:张茹
联系电话:021-58870011
传真:021-68596916
网址:www.ehowbuy.com
110、蚂蚁(杭州)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:徐昳绯
电话:021-60897840
传真:0571-26698533
客服电话:4000-766-123
网址:www.fund123.cn
111、上海长量基金销售投资顾问有限公司
注册地址:上海市浦东新区高翔路526号2幢220室
办公地址:上海市浦东新区浦东大道555号裕景国际B座16层
法定代表人:张跃伟
客服电话:400-820-2899
网址:www.erichfund.com
112、浙江同花顺基金销售有限公司
注册地址:杭州市西湖区文二西路1号元茂大厦903室
办公地址:浙江省杭州市西湖区翠柏路7号电子商务产业园2号楼
法人代表:凌顺平
联系人:林海明
电话:0571-88911818-8580
传真:0571-88911818-8002
客服电话:4008-773-772
网站地址:www.5ifund.com
113、北京恒天明泽基金销售有限公司
注册地址:北京市经济技术开发区宏达北路10号五层5122室
办公地址:北京市朝阳区东三环北路甲19号SOHO嘉盛中心30层3001室
法定代表人:周斌
客服电话:4008980618
网址:www.chtfund.com
114、北京汇成基金销售有限公司
注册地址:北京市海淀区中关村大街11号11层1108
法定代表人:王伟刚
联系人:丁向坤
电话:010-56282140
传真:010-62680827
客服电话:400-619-9059
网址:www.fundzone.cn
115、北京晟视天下投资管理有限公司
注册地址:北京市怀柔区九渡河镇黄坎村735号03室
法定代表人:蒋煜
联系人:孙悦
电话:010-58170823
传真:010-58170800
客服电话:400-818-8866
网址:http://fund.shengshiview.com
116、北京钱景基金销售有限公司
注册地址:北京市海淀区丹棱街6号1幢9层1008-1012
办公地址:北京市海淀区丹棱街6号中关村金融大厦(丹棱soho)1008
法定代表人:赵荣春
联系人:魏争
网站:www.qianjing.com
客服电话:400-893-6885
117、上海万得投资顾问有限公司
注册地址:中国(上海)自由贸易试验区福山路33号11楼B座
办公地址:上海市浦东新区福山路33号8楼
法定代表人:王廷富
联系人:姜吉灵
联系电话:021-5132 7185
传真:021-5071 0161
客服电话:400-821-0203
118、泰诚财富基金销售(大连)有限公司
注册地址:辽宁省大连市沙河口区星海中龙园3号
法定代表人:林卓
联系人:张晓辉
电话:0411-88891212
传真:0411-84396536
客服电话:400-6411-999
网址:www.taichengcaifu.com
119、上海凯石财富基金销售有限公司
注册地址:上海市黄浦区西藏南路765号602-115室
法定代表人:陈继武
客服电话:4000178000
联系人:葛佳蕊
电话:021-63333319
传真:021-63332523
网址:www.vstonewealth.com
120、北京虹点基金销售有限公司
注册地址:北京市朝阳区工人体育场北路甲2号裙房2层222单元
办公地址:北京市朝阳区工人体育场北路甲2号裙房2层222单元
法定代表人:胡伟
传真: 010-65951887
电话:010-65951887
客服电话:400-618-0707
网址:www.hongdianfund.com
121、武汉市伯嘉基金销售有限公司
注册地址:湖北省武汉市江汉区武汉中央商务区泛海国际SOHO城(一期)第7栋23层1号、4号
法定代表人:陶捷
联系人:杨帆
电话:027-87006003、87006009
网站:www.buyfunds.cn
公司传真:027-87006010
客服电话:400-027-9899
122、上海陆金所资产管理有限公司
注册地址:上海市浦东新区陆家嘴环路1333号14楼09单元
法定代表人:郭坚
办公地址:上海市浦东新区陆家嘴环路1333号14楼
联系人:宁博宇
客服电话:4008219031
网站:www.lufunds.com
123、珠海盈米财富管理有限公司
注册地址:珠海市横琴新区宝华路6号105室-3491
法定代表人:肖雯
办公地址:广州市海珠区琶洲大道东1号保利国际广场南塔12楼B1201-1203
联系人:黄敏嫦
网站:www.yingmi.cn
客服电话:020-89629066
124、奕丰金融服务(深圳)有限公司
注册地址:深圳市前海深港合作区前湾一路1号A栋201室(入住深圳市前海商务秘书有限公司)
办公地址:深圳市南山区海德三路海岸大厦东座1115室,1116室及1307室
法定代表人:TAN YIK KUAN
联系人:叶健
电话:0755-89460507
传真:0755-21674453
客服电话:400-684-0500
网址:www.ifastps.com.cn
125、北京肯特瑞财富投资管理有限公司
注册地址:北京市海淀区中关村东路66号1号楼22层2603-06
办公地址:北京市大兴区亦庄经济技术开发区科创十一街18号院京东集团总部
法定代表人:江卉
电话:个人业务:95118 、400 098 8511
企业业务:400 088 8816
传真: 010-8919566
网址:fund.jd.com
126、深圳市金斧子基金销售有限公司
注册地址:深圳市南山区粤海街道科苑路16号东方科技大厦18楼
办公地址:深圳市南山区粤海街道科苑路科兴科学园B3单元7楼
法定代表人:赖任军
联系人:张烨
电话:0755-66892301
传真:0755-66892399
客服电话:400-950-0888
网址:www.jfzinv.com
127、北京蛋卷基金销售有限公司
注册地址:北京市朝阳区阜通东大街 1 号院6 号楼2 单元 21 层222507
法定代表人:钟斐斐
客服电话:4000618518
联系人:袁永娇
电话:010-61840688
传真:010-61840699
网址:https://danjuanapp.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:刘卓
电话:0755-83183388
传真:0755-83195229
联系人:黄慕平
(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
名称:普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)
住所:中国(上海)自由贸易试验区陆家嘴环路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
执行事务合伙人:李丹
电话:021-23238189
联系人:俞伟敏
经办注册会计师:张振波、俞伟敏

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,无风险乘数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

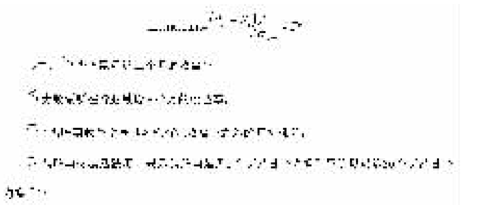
●财务状况良好,具备较好的抗风险能力

●由基金管理人内设的研究部公司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P/B从小到大排序(删除业绩为负的股票),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。



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

为增强本基金业绩与业绩比较基准的可比性以及增强基金业绩评价的透明性,本公司决定自2015年9月14日起将本基金业绩比较基准由"70%×天相280指数+30%×中信标普国债指数"变更为"70%×天相280指数+30%×中债综合指数"。

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2017年6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2017年3月31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	3,234,441,162.86	87.44
	其中:股票	3,234,441,162.86	87.44
2	基金投资	–	0.00
3	固定收益投资	–	0.00
	其中:债券	–	0.00
	资产支持证券	–	0.00
4	贵金属投资	–	0.00
5	金融衍生品投资	–	0.00
6	买入返售金融资产	231,360,907.05	6.25
	其中:买断式回购的买入返售金融资产	–	0.00
7	银行存款和结算备付金合计	232,131,405.13	6.28
8	其他资产	1,034,653.46	0.03
9	合计	3,698,968,128.50	100.00

(二)报告期末按行业分类的股票投资组合

(1)报告期末按行业分类的境内股票投资组合

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	116,228,612.00	3.18
C	制造业	2,073,202,518.10	56.72
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	–	0.00
E	建筑业	–	0.00
F	批发和零售业	85,261,060.71	2.33
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	123,008,901.23	3.37
J	金融业	360,516,924.74	9.86
K	房地产业	185,604,583.36	5.08
L	租赁和商务服务业	270,422,565.60	7.40
M	科学研究和技术服务业	–	0.00
N	水利、环境和公共设施管理业	–	0.00
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	20,195,997.12	0.55
S	综合	–	0.00
	合计	3,234,441,162.86	88.50

(2)报告期末按行业分类的沪港通投资股票投资组合

无

(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

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	300058	蓝色光标	29,619,120	270,422,565.60	7.40
2	600271	航天信息	12,342,222	259,186,662.00	7.09
3	600079	人福医药	12,361,231	244,010,699.94	6.68
4	300124	汇川技术	8,967,815	196,843,539.25	5.39
5	002236	大华股份	11,328,397	180,914,500.09	4.95
6	600887	伊利股份	9,385,241	177,474,907.31	4.86
7	002475	立讯精密	6,249,037	158,100,636.10	4.33
8	600340	华夏幸福	5,478,736	149,350,343.36	4.09
9	002450	康得新	6,860,697	131,176,526.64	3.59
10	601633	长城汽车	9,936,525	125,001,484.50	3.42

(四)报告期末按券种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券投资。

(五)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

本基金本报告期末未持有债券投资。

(六)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。

(七)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贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属投资。

(八)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权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

(九)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

本基金本报告期末未投资股指期货。

(2)本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期末未投资股指期货。

(十)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

本基金本报告期末未投资国债期货。

(2)报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未投资国债期货。

(3)本期国债期货投资评价

本基金本报告期末未投资国债期货。

(十一)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、本基金投资的前十名股票中,没有投资于超出基金合同规定的备选股票库之外的股票。

3、其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	726,658.00
2	应收证券清算款	–
3	应收股利	–
4	应收利息	135,527.58
5	应收申购款	172,467.88
6	其他应收款	–
7	待摊费用	–
8	其他	–
9	合计	1,034,653.46

4、报告期末基金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

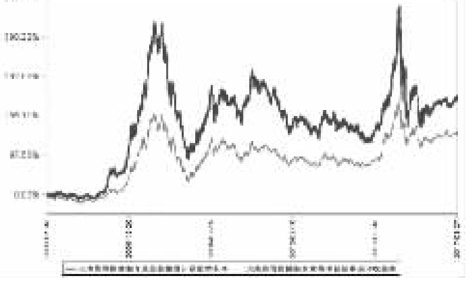
基金管理人依照恪尽职守、诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用基金财产,但不保证基金一定盈利,也不保证最低收益。基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险,投资者在做出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。

(一)自基金合同生效日(2004年6月3日)至2017年3月31日以来完整会计年度的基金份额净值增长率以及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
2004.06.03-2004.12.31	-1.65%	0.71%	-11.78%	0.96%	10.13%	-0.25%
2005.01.01-2005.12.31	-2.34%	0.93%	-1.68%	0.94%	-0.66%	-0.01%
2006.01.01-2006.12.31	129.02%	1.43%	65.34%	1.00%	63.67%	0.42%
2007.01.01-2007.12.31	127.40%	1.95%	105.10%	1.63%	22.3%	0.32%
2008.01.01-2008.12.31	-58.55%	2.20%	-49.54%	2.13%	-9.01%	0.07%
2009.01.01-2009.12.31	71.23%	1.81%	61.81%	1.40%	9.42%	0.41%
2010.01.01-2010.12.31	5.78%	1.41%	-8.75%	1.11%	14.53%	0.30%
2011.01.01-2011.12.31	-29.67%	1.21%	-17.07%	0.92%	-12.60%	0.29%
2012.01.01-2012.12.31	6.65%	1.27%	7.65%	0.90%	-1.00%	0.37%
2013.01.01-2013.12.31	-5.01%	1.31%	-4.94%	0.99%	-0.07%	0.32%
2014.01.01-2014.12.31	19.43%	1.19%	36.52%	0.86%	-17.09%	0.33%
2015.01.01-2015.12.31	13.18%	2.97%	6.76%	1.74%	6.42%	1.23%
2016.01.01-2016.12.31	-10.68%	1.56%	-6.96%	0.99%	-3.72%	0.57%
2017.01.01-2017.03.31	3.88%	0.59%	3.09%	0.37%	0.79%	0.22%
2004.06.03-2017.03.31	235.59%	1.65%	151.76%	1.26%	83.83%	0.39%

(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:

大成蓝筹稳健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



注:本基金合同规定,基金管理人应当自基金合同生效日起六个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的约定。建仓期结束时,本基金的投资组合比例符合基金合同的约定。依据本基金2005年8月31日《关于调整大成蓝筹稳健证券投资基金资产配置比例的公告》,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。

十四、费用概览

(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)基金的证券交易费用;
(4)基金合同生效后的基金信息披露费用;
(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和律师费;
(7)按照国家有关规定可以列入的其他费用。

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

基金管理人的基金管理费按基金资产净值的1.5%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1.5%年费率计提。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

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两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0.25%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0.25%年费率计提。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)上述第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。

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。基金合同生效之前的律师费、会计师费和信息披露费用不得从基金财产中列支。

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)与基金销售有关的费用

1、申购费用

申购费用是基金销售和服务过程中发生费用,由基金份额持有人承担,按交易金额的一定比例收取,不列入基金财产。

(1)投资者既可以选择申购时交纳申购费用,也可以选择赎回时交纳申购费用。投资者若选择申购时交纳称为前端申购费,投资者若选择在赎回时交纳则称为后端申购费。

(2)投资者选择交纳前端申购费时,按照申购金额采用比例费率,具体如下表所示:

申购金额M	费率
M<50万	1.5%
50万≤M<200万	1.0%
200万≤M<500万	0.6%
M≥500万	1000元/笔

计算公式如下:

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
申购份额=净申购金额/申购当日基金单位净值

(3)投资者选择后端申购费时,基金申购份额的计算公式为:

申购份数=申购金额/申购日基金份额净值

交纳的后端申购费按照持有时间采用比例费率,并随持有时间递减,具体计算公式如下:

后端申购费用=赎回份额×申购申请日的基金份额净值×该部分份额对应的后端申购费率

后端申购费率具体如下表所示:

持有年限	费率
T<1年	2.0%
1≤T<2年	1.5%
2≤T<3年	1.0%
3≤T<5年	0.5%
T≥5	0

2、赎回费用

本基金的赎回费用按持有期递减,最高不超过赎回总金额的0.50%;

赎回费用于支付相关手续费后余额归入基金财产,赎回费归入基金财产的比例不得低于赎回费总额的25%;具体费率如下:

持有期	赎回费率
T<365	0.5%
T≥365	0.25%

基金的净赎回金额为赎回金额扣减赎回费用和其他相关费用后的余额,计算公式如下:

赎回金额=赎回份数×申请日基金份额净值
赎回费用=赎回金额×赎回费率
净赎回金额=赎回金额-赎回费用-后端申购费用

3、基金管理人可根据市场情况,在不违背有关法律、法规和基金合同规定的情况下调整本基金的申购和赎回费率,调整结果将于前两日内在至少一种中国证监会指定的媒体上公告。

4、基金管理人可在不违背法律法规规定的情形下,根据市场情况制定基金促销计划,定期或不定期地开展基金促销活动。在基金促销活动期间,基金管理人可以对促销活动范围内的投资者调低基金的费率。

5、基金转换费用

(1)每笔基金转换视为转出基金的一笔基金赎回和转入基金的一笔基金申购。基金转换费用由转出基金赎回费用及基金申购补差费用两部分构成。

(2)转入基金时,从申购费用低的基金向申购费用高的基金转换时,每次收取申购补差费用;从申购费用高的基金向申购费用低的基金转换时,不收取申购补差费用。转入基金的申购补差费用按照转换金额对应的转出基金与转入基金的申购费率差额进行补差。

(3)转出基金时,如涉及的转出基金有赎回费用,收取该基金的赎回费用。收取的赎回费用25%归入基金资产,其余部分用于支付注册登记费等相关手续费。

(4)投资者可以发起多次基金转换业务,基金转换费用按每笔申请单独计算。

(5)基金管理人可以根据市场情况在不违背有关法律、法规和基金合同的规定之前提下,调整上述收费方式和费率水平,但最迟应于新收费办法开始实施日前2日内在至少一种中国证监会指定媒体上公告。

(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

本更新的招募说明书依据《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2017年1月18日公布的《大成蓝筹稳健证券投资基金更新的招募说明书(2016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,更新了"九、基金的投资"部分。
5. 根据最新数据,更新了"十、基金的业绩"部分。
6. 根据最新公告,更新了"二十二、其他应披露的事项"。
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
二〇一七年七月十八日

(上接B81版)

注册地址:深圳市福田区华强北路赛格科技园4栋10层1006号
法定代表人:杨懿
办公地址:深圳市福田区华强北路赛格科技园4栋10层1006号
联系人:张燕
联系电话:010-58325388*1588
网站:www.new-rand.cn
客服电话:400-166-1188
111、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:刘洋
联系电话:021-20835785
传真:021-20835879
客服电话:400-920-0022
网址:http://licaike.hexun.com
112、诺亚正行(上海)基金销售投资顾问有限公司
注册地址:上海市虹口区飞虹路360弄9号3724室
法定代表人:汪静波
办公地址:上海市杨浦区昆明路508号北美广场B座12楼
联系人:徐诚
联系电话:021-38509639
网站:www.noah-fund.com
客服电话:400-821-5399
113、深圳众禄金融控股股份有限公司
办公地址:深圳市罗湖区深南东路5047号发展银行大厦25楼I、J单元
法定代表人:薛峰
联系人:童彩平
电话:0755-33227950
传真:0755-82080798
网址:www.zlfund.cn
客服电话:4006-788-887
114、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:潘世友
电话:021-54509998
传真:021-64383798
客服电话:400-1818-188
网址:www.1234567.com.cn
115、上海好买基金销售有限公司
注册地址:上海市虹口区场中路685弄37号4号楼449室
办公地址:上海市浦东新区浦东南路1118号鄂尔多斯国际大厦903~906
法定代表人:杨文斌
客服电话:400-700-9665
联系人:张茹
联系电话:021-58870011
传真:021-68596916
网址:www.ehowbuy.com
116、蚂蚁(杭州)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:徐昳绯
电话:021-60897840
传真:0571-26698533
客服电话:4000-766-123
网址:www.fund123.cn
117、上海长量基金销售投资顾问有限公司
注册地址:上海市浦东新区高翔路526号2幢220室
办公地址:上海市浦东新区浦东大道555号裕景国际B座16层
法定代表人:张跃伟
客服电话:400-820-2899
网址:www.erichfund.com
118、浙江同花顺基金销售有限公司
注册地址:杭州市西湖区文二西路1号元茂大厦903室
办公地址:浙江省杭州市西湖区翠柏路7号电子商务产业园2号楼
法人代表:凌顺平
联系人:林海明
电话:0571-88911818-8580
传真:0571-88911818-8002
客服电话:4008-773-772
网站地址:www.5ifund.com
119、北京汇成基金销售有限公司
注册地址:北京市海淀区中关村大街11号11层1108
法定代表人:王伟刚
联系人:丁向坤
电话:010-56282140
传真:010-62680827
客服电话:400-619-9059
网址:www.fundzone.cn
120、北京晟视天下投资管理有限公司
注册地址:北京市怀柔区九渡河镇黄坎村735号03室
法定代表人:蒋煜
联系人:孙悦
电话:010-58170823
传真:010-58170800
客服电话:400-818-8866
网址:http://fund.shengshiview.com
121、北京钱景基金销售有限公司
注册地址:北京市海淀区丹棱街6号1幢9层1008-1012
办公地址:北京市海淀区丹棱街6号中关村金融大厦(丹棱soho)1008
法定代表人:赵荣春
联系人:魏争
网站:www.qianjing.com
客服电话:400-893-6885
122、北京唐鼎耀华投资咨询有限公司
注册地址:北京市延庆县延庆经济开发区百泉街10号2栋236室
法定代表人:张冠宇
客服电话:400-819-9868
联系人:刘美薇
电话:010-85870662
传真:4008875666-129666
网址:www.tdyhfund.com
123、上海万得投资顾问有限公司
注册地址: 中国(上海)自由贸易试验区福山路33号11楼B座
办公地址:上海市浦东新区福山路33号8楼
法定代表人:王廷富
联系人:姜吉灵
联系电话:021-5132 7185
传真:021-5071 0161
客服电话:400-821-0203
124、泰诚财富基金销售(大连)有限公司
注册地址:辽宁省大连市沙河口区星海中龙园3号
法定代表人:林卓
联系人:张晓辉
电话:0411-88891212
传真:0411-84396536
客服电话:400-6411-999
网址:www.taichengcaifu.com
125、上海基煜基金销售有限公司
住所:上海市崇明县长兴镇路潘园公路 1800 号 2 号楼 6153 室(上海泰和经济发展区)
办公地址:上海市杨浦区昆明路 518 号 a1002 室
法定代表人:王翔
联系人:安彬
客服电话:(021)6537 0077
网址:www.jiyufund.com.cn
126、上海凯石财富基金销售有限公司
注册地址:上海市黄浦区西藏南路765号602-115室
法定代表人:陈继武
客服电话:4000178000
联系人:葛佳蕊
电话:021-63333319
传真:021-63332523
网址:www.vstonewealth.com
127、北京虹点基金销售有限公司
注册地址:北京市朝阳区工人体育场北路甲2号裙房2层222单元
办公地址:北京市朝阳区工人体育场北路甲2号裙房2层222单元
法定代表人:胡伟
传真:010-65951887
电话:010-65951887
客服电话:400-618-0707
网址:www.hongdianfund.com
128、武汉市伯嘉基金销售有限公司
注册地址:湖北省武汉市江汉区武汉中央商务区泛海国际SOHO城(一期)第7栋23层1号、4号
法定代表人:陶捷
联系人:杨帆
电话:027-87006003、87006009
网站:www.buyfunds.cn
公司传真:027-87006010
客服电话:400-027-9899
129、上海陆金所资产管理有限公司
注册地址:上海市浦东新区陆家嘴环路1333号14楼09单元
法定代表人:郭坚
办公地址:上海市浦东新区陆家嘴环路1333号14楼
联系人:宁博宇
客服电话:4008219031
网站:www.lufunds.com
130、珠海盈米财富管理有限公司
注册地址:珠海市横琴新区宝华路6号105室-3491
法定代表人:肖雯
办公地址:广州市海珠区琶洲大道东1号保利国际广场南塔12楼B1201-1203
联系人:黄敏嫦
网站:www.yingmi.cn
客服电话:020-89629066
131、奕丰金融服务(深圳)有限公司
注册地址: 深圳市前海深港合作区前湾一路1号A栋201室(入住深圳市前海商务秘书有限公司)
办公地址:深圳市南山区海德三路海岸大厦东座1115室,1116室及1307室
法定代表人: TAN YIK KUAN
联系人:叶健
电话:0755-89460507
传真:0755-21674453
客服电话:400-684-0500
网址:www.ifastps.com.cn
132、北京肯特瑞财富投资管理有限公司
注册地址:北京市海淀区中关村东路66号1号楼22层2603-06
办公地址: 北京市大兴区亦庄经济技术开发区科创十一街18号院京东集团总部
法定代表人:江卉
电 话:个人业务:95118、400 098 8511
企业业务:400 088 8816
传　　真:010-8919566
网址:fund.jd.com
133、深圳市金斧子基金销售有限公司
注册地址:深圳市南山区粤海街道科苑路16号东方科技大厦18楼
办公地址:深圳市南山区粤海街道科苑路科兴科学园B3单元7楼
法定代表人:赖任军
联系人:张烨
电话:0755-66892301
传真:0755-66892399
客服电话:400-950-0888
网址:www.jfzinv.com
134、北京蛋卷基金销售有限公司
注册地址:北京市朝阳区阜通东大街 1 号院6 号楼2 单元 21 层222507
法定代表人:钟斐斐
客服电话:4000618518
联系人:袁永娇
电话:010-61840688
传真:010-61840699
网址:https://danjuanapp.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:刘卓
电话:0755-83183388
传真:0755-83195229
联系人:黄慕平
(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
名称:安永华明会计师事务所
住所:北京市东城区东长安街1号东方广场安永大楼17层01-12室
办公地址:北京市东城区东长安街1号东方广场安永大楼17层01-12室
执行事务合伙人:吴港平
电话:(010)58153000、(0755)25028288
传真:(010)85188298、(0755)25026188
签章注册会计师:昌华、高鹤
联系人:昌华

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、基金的投资范围

本基金的投资范围包括:

1、现金;

2、期限在 1 年以内(含 1 年)的银行存款、债券回购、中央银行票据、同业存单;

3、剩余期限在397 天以内(含 397 天)的债券、非金融企业债务融资工具、资产支持证券;

4、中国证监会、人民银行认可的其它具有良好流动性货币市场工具。法律规或监管机构允许货币市场基金投资其他货币市场工具的,在不改变基金投资目标、投资策略,不改变基金风险收益特征的条件下,本基金可参与其他货币市场工具的投资,不需召开持有人大会。具体比例限制按照相关法律法规和监管规定执行。

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、投资管理

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、交易策略

交易策略的运用旨在控制风险的前提下力争为基金创造超额收益。本基金管理人拟将运用如下策略:

1. 跨市场套利策略

由于目前交易所和银行间市场具有不同的短期利率期限结构和流动性特征,基金可从中捕捉投资机会。比如当交易所回购利率高于银行间市场回购利率时,可加大交易所市场回购比例或者进行两市场套利交易。

2. 跨品种套利策略

由于市场交易效率尚待提高,导致不同品种间收益率曲线结构易出现不合理的情形,这种失衡为投资创造了低风险套利机会。比如市场出现回购利率低于相同剩余期限的国债利率时,投资者可以融资买券,到期再将债券现金流偿还回购资金实现无风险套利。

3. 利率波动策略

短期利率水平会因市场环境的变化出现短暂的波动,利用这种时机调整组合品种的结构能为投资创造额外收益。比如在年初、年末、新股发行时利用市场资金面趋紧、利率走高增加逆回购比例,在CPI走低、资金面宽松的情况下增加到期期限相对较长的债券的投资比例。

4. 正回购放大策略

该交易策略运用于预期市场利率下跌或走势平稳的环境中。方法是将剩余期限相对较长的短期债进行正回购质押,融资后再购买短期债,若融资成本低于短期债收益率,该策略便可实现正收益。

5. 债券价值发掘

运用该种策略的目的在于识别被市场错误定价的债券,进而采取适当的交易以期获利。一方面基金管理人通过利率期限结构,评估处于同一风险层次的多只债券中,究竟哪些更具投资价值,另一方面,通过综合考察债券等级、息票率、所属行业等因素对利差的影响,评估一张短期风险债券的收益率究竟比无风险短期债券高多少才合理。

十一、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"。

十二、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。

十三、基金的投资组合报告(截至2017年3月31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2017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。

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	2,204,834,165.50	23.44
	其中:债券	2,204,834,165.50	23.44
	资产支持证券	–	0.00
2	买入返售金融资产	837,119,015.68	8.90
	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	6,303,167,283.85	67.01
4	其他资产	60,569,394.36	0.64
5	合计	9,405,689,859.39	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		2.61
	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。

债券正回购的资金余额超过基金资产净值的20%的说明

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	72
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	75
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	40

报告期内投资组合平均剩余期限超过120天情况说明

本报告期内无投资组合平均剩余期限超过120天的情况。

(2)报告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	22.93	2.62
	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	23.04	0.00
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	0.00	0.00
3	60天(含)-90天	34.34	0.00
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	0.00	0.00
4	90天(含)-120天	2.18	0.00
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	0.00	0.00
5	120天(含)-397天(含)	19.56	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	102.05	2.62

4.报告期内投资组合平均剩余存续期超过240天情况说明

本报告期内无投资组合平均剩余存续期超过240天的情况。

5. 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	–	0.00
2	央行票据	–	0.00
3	金融债券	400,070,825.13	4.37
	其中:政策性金融债	400,070,825.13	4.37
4	企业债券	–	0.00
5	企业短期融资券	89,961,134.25	0.98
6	中期票据	–	0.00
7	同业存单	1,714,802,206.12	18.73
8	其他	–	0.00
9	合计	2,204,834,165.50	24.08
10	剩余存续期超过397天的浮动利率债券	–	0.00

6. 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	111609365	16浦发CD365	4,000,000	394,304,013.90	4.31
2	111697822	16南京银行CD109	3,500,000	347,631,207.38	3.80
3	111707013	17招商银行CD013	3,000,000	299,649,281.21	3.27
4	111710100	17兴业银行CD100	3,000,000	297,814,070.78	3.25
5	160419	16农发19	2,000,000	200,011,904.25	2.18
6	111609362	16浦发CD362	2,000,000	198,655,235.30	2.17
7	120406	12农发06	1,500,000	150,054,534.30	1.64
8	111709110	17浦发银行CD110	1,500,000	146,887,430.13	1.60
9	011698868	16苏交通SCP017	900,000	89,961,134.25	0.98
10	160211	16国开11	500,000	50,004,386.58	0.55

7. "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	0
报告期内偏离度的最高值	-0.0116%
报告期内偏离度的最低值	-0.0616%
报告期内每个工作日偏离度的绝对值的简单平均值	0.0260%

报告期内负偏离度的绝对值达到0.25%情况说明

报告期内未发生负偏离度的绝对值达到0.25%的情况。

报告期内正偏离度的绝对值达到0.5%情况说明

报告期内未发生正偏离度的绝对值达到0.5%的情况。

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。

9. 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。

(3)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	60,568,494.36
4	应收申购款	900.00
5	其他应收款	–
6	待摊费用	–
7	其他	–
8	合计	60,569,394.36

(4)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。

十四、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)基金合同生效日为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:

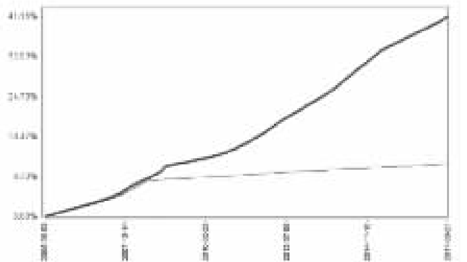
A类

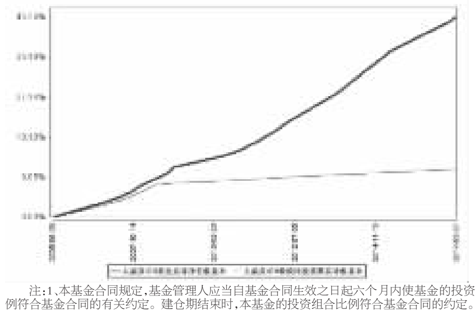
阶段	基金净值收益率①	基金净值收益率标准差②	比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
2005.6.3-2005.12.31	1.1421%	0.0044%	1.0455%	0.0000%	0.0966%	0.0044%
2006.1.1-2006.12.31	1.9658%	0.0033%	1.8800%	0.0005%	0.0858%	0.0028%
2007.1.1-2007.12.31	3.1996%	0.0062%	2.7850%	0.0019%	0.1446%	0.0043%
2008.1.1-2008.12.31	3.7332%	0.0129%	2.0136%	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%
2011.1.1-2011.12.31	3.5069%	0.0040%	0.4697%	0.0001%	3.0372%	0.0039%
2012.1.1-2012.12.31	3.7661%	0.0032%	0.4190%	0.0002%	3.3471%	0.0030%
2013.1.1-2013.12.31	3.6389%	0.0044%	0.3500%	0.0000%	3.2889%	0.0044%
2014.1.1-2014.12.31	4.4413%	0.0062%	0.3500%	0.0000%	4.0913%	0.0062%
2015.1.1-2015.12.31	3.2028%	0.0037%	0.3500%	0.0000%	2.8528%	0.0037%
2016.1.1-2016.12.31	2.4548%	0.0019%	0.3500%	0.0000%	2.1048%	0.0019%
2017.1.1-2017.03.31	0.8444%	0.0012%	0.0863%	0.0000%	0.7581%	0.0012%
2005.6.3-2017.03.31	41.1667%	0.0060%	10.8180%	0.0027%	30.3487%	0.0033%

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%
2011.1.1-2011.12.31	3.7550%	0.0040%	0.4697%	0.0001%	3.2853%	0.0039%
2012.1.1-2012.12.31	4.0149%	0.0032%	0.4190%	0.0002%	3.5959%	0.0030%
2013.1.1-2013.12.31	3.8893%	0.0044%	0.3500%	0.0000%	3.5393%	0.0044%
2014.1.1-2014.12.31	4.6930%	0.0062%	0.3500%	0.0000%	4.3430%	0.0062%
2015.1.1-2015.12.31	3.4502%	0.0037%	0.3500%	0.0000%	3.1002%	0.0037%
2016.1.1-2016.12.31	2.7025%	0.0019%	0.3500%	0.0000%	2.3525%	0.0019%
2017.1.1-2017.03.31	0.9042%	0.0012%	0.0863%	0.0000%	0.8179%	0.0012%
2005.6.3-2017.03.31	45.2409%	0.0060%	10.8180%	0.0027%	34.4229%	0.0033%

(二)自本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2017年3月31日)





注:1、本基金合同规定,基金管理人应当自基金合同生效之日起六个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的有关约定。建仓期结束时,本基金的投资组合比例符合基金合同的约定。

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。

十五、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)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)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. 基金认购费用

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,支付日期顺延。

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酌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在至少一种中国证监会指定的信息披露媒介公告。

(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。

十六、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》、《公开募集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2017年1月18日公布的《大成货币市场证券投资基金更新的招募说明书(2016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. 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2016年12月4日至2017年6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
2017年7月18日