(上接D23版)

(6)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
(7)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
(8)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
(9)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
(10)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
(11)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
(12)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
(13)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
(14)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
(15)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
3.场内代销机构
场内代销机构是指由中国证监会核准的具有开放式基金代销资格，经上海证券交易所和中国证券登记结算有限责任公司认可的、可通过上海证券交易所交易系统办理开放式基金的认购、申购、赎回和转托管等业务的上海证券交易所会员。名单详见上海证券交易所网站。
基金管理人可根据有关法律法规的要求，选择其他符合要求的机构代理销售本基金，并及时公告。
(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
注册地址:北京市朝阳区东三环中路7号财富中心写字楼A座40层
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、冯艾
联系人:冯艾
(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
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:大成积极成长股票型证券投资基金。
五、基金的类型
本基金类型:股票型基金
六、基金的运作方式
本基金运作方式:契约型开放式
七、基金的投资目标
在优化组合投资基础上，主要投资于有良好成长潜力的上市公司，尽可能规避投资风险，谋求基金财产长期增值。
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、权证、债券、资产支持证券及中国证监会批准的允许基金投资的其他金融工具，主要投资对象为深、沪两市上市A股中成长性好、发展前景广阔的上市公司。
股票投资比例范围为基金资产的60%-95%，其中，权证投资比例范围为0-3%。固定收益类证券和现金投资比例范围为5%-40%，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比例不低于基金资产净值的5%。
此外，如法律法规或中国证监会修改对基金投资品种的规定，基金管理人在履行适当程序后，可以依据新的规定修订本

大成积极成长股票型证券投资基金更新的招募说明书摘要

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的，基金管理人可相应调整本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
本基金管理人在构建投资组合的过程中，遵循以下投资策略:
1.资产配置策略
本基金主要根据GDP增长率、工业增加值变化率、固定资产投资趋势、A股市场平均市盈率及其变化趋势、真实汇率、外贸顺差、消费者价格指数CPI增长率、M2、信贷增长率及增长结构等指标的变化，对宏观经济及证券市场的总体变动趋势进行定量分析，作出资产配置决策。本基金还将关注国家财政政策、货币政策、产业政策及汇率政策等，进行定性分析，作为定量分析的支持和补充。
2.股票投资策略
本基金力争通过深入、科学的基本面分析，挖掘具有良好成长性的上市公司。
(1)财务指标分析
企业的历史财务表现不但能刻画企业的经营情况、财务健康程度，还可以较大程度上反映其未来成长性。本基金将通过对上市公司过去3年主营业务收入增长率、主营业务利润率、净资产收益率和净利润增长率等财务指标的分析，选择上述财务指标优于行业平均水平的上市公司，建立基金初选股票池。
(2)成长性筛选
具有以下一项或多项特征的上市公司，将进入本基金备选股票池。
1)具有较高创新能力和投资效率的上市公司。创新能力主要通过上市公司研究费用支出、研究成果转化为企业盈利的效果等因素衡量;投资效率主要体现为历年增量投资实现的盈利增长。
2)能够充分从消费升级、产业调整、汇率变革等中国经济结构性变迁中获取收益，促进公司发展的行业龙头上市公司。
3)在行业内具有领先的技术水平或经营模式、创新产品、良好的销售网络、市场品牌或资源垄断等竞争优势，且保持长期发展优势的上市公司。
4)通过整合内部资源、加强企业经营管理等措施，企业盈利能力将会在未来1年内有明显提高的上市公司。
5)具有较强外延扩张能力的上市公司。特别是，有明确重组、购并计划或潜在机会，且重组、购并将显著提升上市公司盈利能力、市场占有率或产能水平，并将在未来1-2年内实施或实现的上市公司。
6)国家政策调整、国际经济形势变化等因素将会对企业盈利水平产生重大积极影响的上市公司。
(3)估值比较
本基金将根据上市公司所处行业、业务模式等特征，综合利用市盈率(P/E)、市净率(P/B)和折现现金流(DCF)等估值方法，进行估值比较。估值比较将从两方面对投资价值进行分析:一是上市公司在其所处行业内部的相对估值水平;二是与境外类似上市公司的估值水平差异，特别是与香港市场上市公司的差异。本基金将优选估值水平合理的上市公司，作为重点投资对象。
在选择重点投资对象时，对于信息技术、网络媒体、生物制药、环境保护、新材料等新兴产业中成长性好，具有较高技术含量的企业，以及传统产业中成长性突出或正在向新兴产业转型的企业，可以适当放宽估值水平要求。
(4)实地调研
对于本基金计划重点投资的上市公司，公司投资研究团队将实地调研上市公司，深入了解其管理团队能力、企业经营状况、重大投资项目进展以及财务数据真实性等。为了保证实地调研的准确性，投资研究团队还将通过上市公司的上游供货商、下游客户、竞争对手和业务合作伙伴，以及税务、海关等行政管理部门对调研结论进行核实。
(5)建立投资组合
本基金将在案头分析和实地调研的基础上，建立买入和卖出股票名单，并选择合理时机，稳步建立投资组合。在建立投资组合过程中，本基金还将注重投资对象的交易活跃程度，以保证整体组合具有良好的流动性。
对于少数成长性突出、基本面较好的上市公司，本基金将在保证组合安全性和流动性的前提下，进行适当集中投资并中长线持有;同时，本基金还将通过对具有较好流动性和短期投资机会的品种的短线操作，提高组合收益。
3.固定收益品种投资策略
本基金对固定收益品种的投资主要是为了保持投资组合具有良好流动性，以应对赎回申请。基金可投资于国债、央行票据、金融债、企业债和资产支持证券等固定收益品种。基金将根据对利率走势的判断、债券期限结构、信用等级及流动性等因素构建投资组合。
在组合构建与调整过程中，本基金将采用凸度策略、收益率利差策略和回购套利等多种交易方式，提高组合整体收益水平，并控制组合的投资风险。
4.其他投资策略
本基金还可按照有关法律法规和中国证监会的规定，投资于权证、资产支持证券等品种，用于分散组合投资风险，获取稳定收益。
十、基金的业绩比较基准
沪深300指数×80%+中证综合债券指数×20%
注:自2009年2月2日起，本基金的业绩比较基准由原“新华富时600成长指数收益率×80%+新华雷曼中国全债指数收益率×20%”，变更为“沪深300指数×80%+中证综合债券指数×20%”，该变更事项已于2009年1月23日公开披露。
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，并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。本基金主要投资于具有良好成长性的上市公司，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根据基金合同规定，于2012年2月9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取自大成积极成长股票型证券投资基金2011年第4季度报告，截止2011年12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	1,577,232,746.81	80.64
	其中:股票	1,577,232,746.81	80.64
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	-	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	331,732,057.86	16.96
6	其他资产	46,879,701.92	2.40
7	合计	1,955,844,506.59	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	16,631,454.84	0.85
B	采掘业	73,884,413.33	3.80
C	制造业	1,081,317,281.63	55.54
C0	食品、饮料	382,013,134.73	19.62
C1	纺织、服装、皮毛	44,378,303.79	2.28
C2	木材、家具	3,359,352.28	0.17
C3	造纸、印刷	-	0.00
C4	石油、化学、塑胶、塑料	-	0.00
C5	电子	24,903,679.02	1.28
C6	金属、非金属	-	0.00
C7	机械、设备、仪表	233,529,553.22	12.00
C8	医药、生物制品	393,133,258.59	20.19
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	29,659,358.64	1.52
F	交通运输、仓储业	-	0.00
G	信息技术业	130,801,394.60	6.72
H	批发和零售贸易	67,983,474.18	3.49
I	金融、保险业	92,673,314.39	4.76
J	房地产业	-	0.00
K	社会服务业	84,282,055.20	4.33
L	传播与文化产业	-	0.00
M	综合类	-	0.00
	合计	1,577,232,746.81	81.01

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	600887	伊利股份	5,724,535	116,952,250.05	6.01
2	600518	康美药业	9,693,674	108,763,022.28	5.59
3	600406	国电南瑞	3,228,108	100,716,969.60	5.17
4	600079	人福医药	5,049,430	97,302,516.10	5.00
5	000826	桑德环境	3,344,526	84,282,055.20	4.33
6	000538	云南白药	1,400,000	74,200,000.00	3.81
7	000423	东阿阿胶	1,649,703	70,854,743.85	3.64
8	600600	青岛啤酒	2,099,794	70,301,103.12	3.61
9	600031	三一重工	5,462,910	68,504,891.40	3.52
10	000895	双汇发展	924,942	64,699,692.90	3.32

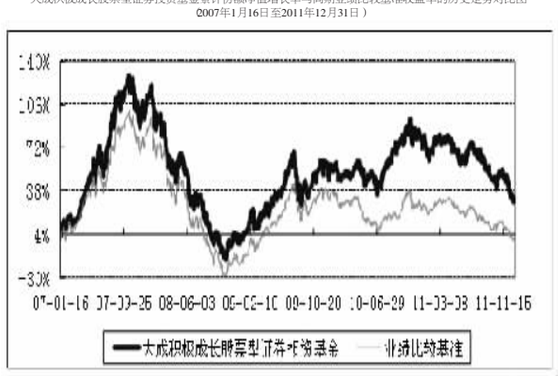
4. 报告期末按债券品种分类的债券投资组合
本基金本报告期末未持有债券。
5. 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名债券投资明细
本基金本报告期末未持有债券。
6.报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名资产支持证券投资明细
本基金本报告期末未持有资产支持证券。
7.报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资明细
本基金本报告期末未持有权证。
8.投资组合报告附注
(1)报告期内基金投资的前十名证券的发行主体被监管部门立案调查的，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。
本基金投资的前十名证券的发行主体未出现本期被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。
(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	1,106,121.39
2	应收证券清算款	42,815,760.61
3	应收股利	-
4	应收利息	57,009.38
5	应收申购款	16,297.90
6	其他应收款	2,884,512.64
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	46,879,701.92

(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的情况。
(6)由于四舍五入原因，分项之和与合计可能有尾差。
十三、基金的业绩
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。
下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。
(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
2007.1.16-2007.12.31	111.49%	1.98%	85.70%	1.75%	25.79%	0.23%
2008.1.1-2008.12.31	-54.32%	2.13%	-57.02%	2.44%	2.70%	-0.31%
2009.1.1-2009.12.31	64.30%	1.89%	72.86%	1.65%	-8.56%	0.24%
2010.1.1-2010.12.31	12.85%	1.34%	-9.26%	1.27%	22.11%	0.07%
2011.1.1-2011.12.31	-26.71%	1.20%	-19.44%	1.04%	-7.27%	0.16%
2011.7.1-2011.12.31	-22.46%	1.21%	-18.01%	1.08%	-4.45%	0.13%
2007.1.16-2011.12.31	31.28%	1.76%	0.84%	1.71%	30.44%	0.05%

(二)自基金合同生效以来基金累计份额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:
大成积极成长股票型证券投资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1月16日至2011年12月31日)



注:按基金合同规定，大成积极成长股票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，截至报告日本基金的各项投资比例已达到基金合同第十四条投资组合中规定的各项比例。
自2009年2月2日起，本基金的业绩比较基准由原“新华富时600成长指数收益率×80%+新华雷曼中国全债指数收益率×20%”，变更为“沪深300指数×80%+中证综合债券指数×20%”。
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
基金管理人的管理费每日计算，逐日累计至每月月底，按月支付，由基金托管人于次月首日起5个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。
(2)基金托管人的托管费
在通常情况下，基金托管人的托管费按前一日的基金资产净值的0.25%年费率计提。计算方法如下:
H=E×0.25%÷当年天数
H为每日应支付的基金托管费
E为前一日的基金资产净值
基金托管费每日计算，逐日累计至每月月底，按月支付，由基金托管人于次月首日起5个工作日内按照基金管理人指令从基金财产中一次性支取。
(3)上述1.基金费用第3-7项费用由基金托管人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。
(4)经基金管理人与基金托管人协商一致，可以调低基金管理费及基金托管费，并报中国证监会核准后公告，无须召开基金份额持有人大会通过。
(二)与基金销售有关的费用
1.申购费用
本基金申购费用由基金申购人承担，不列入基金财产。本基金申购费用在申购时交纳，开放日常申购、赎回后的具体费率如下:

申购金额M	日常申购费率
M<50万元	1.5%
50万≤M<200万元	1.0%
200万≤M<500万元	0.6%
M≥500万元	1000元/笔

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
申购份额=净申购金额/T日基金份额净值
对于办理场内申购的投资者，申购份数的计算采用截尾法保留至整数位，不足1份部分对应的申购资金将返回给投资者。对于办理场外申购的投资者，申购份数的计算以四舍五入的方法保留小数点后两位，由此误差产生的损失或收益归入基金财产。
2.赎回费用
本基金赎回费用由基金赎回人承担，在基金份额持有人赎回基金份额时收取。
(1)基金份额持有人在2007年3月30日之前赎回其持有的由原景业基金基金份额转型而来的基金份额的，赎回费率为2.5%。
(2)基金份额持有人在2007年3月30日之后赎回其持有的由原景业基金基金份额转型而来的基金份额的，赎回费率见下表。持有期限自开放日常申购、赎回之日起计算。

持有期限	赎回费率
3个月以内(不含3个月)	1.2%
3个月至1年(不含1年)	0.5%
1年到2年(不含2年)	0.2%
2年(含2年)以上	0

(3)对于集中申购期或开放日常申购之后申购的基金份额，其赎回费率如下。持有期限自注册登记机构确认投资者申购申请之日起计算。

持有期限	赎回费率
1年以内(不含1年)	0.5%
1年到2年(不含2年)	0.2%
2年(含2年)以上	0

(4)以上赎回费率安排中，须依法扣除所收取赎回费总额的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。
基金净赎回金额的计算:
赎回总额=赎回份数×T日基金份额净值
赎回费用=赎回总额×赎回费率
赎回金额=赎回总额-赎回费用
3.基金份额净值的计算:
T日的基金份额净值在当天收市后计算，并在T+1日公告。计算公式为计算日基金资产净值除以计算日发售在外的基金份额总数。遇特殊情况，可以适当延迟计算或公告，并报中国证监会备案。
(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)基金管理费、基金托管费和销售服务费的调整
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、基金托管费率和销售服务费率等相关费率或改变收费模式。调高基金管理费率、基金托管费率和销售服务费率，须召开基金份额持有人大会审议，除非获得监管机构的豁免、基金合同或相关法律法规另有规定;调低基金管理费率、基金托管费率和销售服务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。
基金管理人最迟于新的费率实施日前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，并根据本基金管理人对本基金实施的投资经营活动，对2011年8月30日公布的《大成积极成长股票型证券投资基金更新的招募说明书(2011年第2期)》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:
1.根据最新情况，对“三、基金管理人”部分内容进行了更新。
2.根据最新情况，对“四、基金托管人”部分内容进行了更新。
3.根据相关公告，对“五、相关服务机构”等相关信息进行了更新。
4.根据相关财务数据和公告，对“十、基金的投资”的“(十一)投资组合报告”进行了更新。
5.根据相关财务数据，对“十一、基金的业绩”进行了更新。
6.根据最新情况，对“二十三、对基金份额持有人的服务”进行了更新。
7.根据相关公告，对“二十四、其他应披露的事项”进行了更新，补充了2011年7月17日至2012年1月16日发布的公告。
8.根据最新情况，更新了“二十五、招募说明书更新部分的说明”。

大成基金管理有限公司
二〇一二年三月二日

(上接D18版)

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	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	149,472,000.00	5.81
	其中:政策性金融债	149,472,000.00	5.81
4	企业债券	1,790,215,558.67	69.63
5	企业短期融资券	300,894,000.00	11.70
6	中期票据	58,908,000.00	2.29
7	可转债	144,113,512.20	5.61
8	其他	-	-
9	合计	2,443,603,070.87	95.04

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	0980124	09浦发债	1,500,000	148,635,000.00	5.78
2	098052	09轻纺城债	1,000,000	100,200,000.00	3.90
3	098030	09芜湖建投债	1,000,000	100,120,000.00	3.89
4	1180010	11杭工投债	1,000,000	98,540,000.00	3.83
5	122092	11大秦01	821,860	83,155,794.80	3.23

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
8.1本基金该报告期内投资前十名证券的发行主体均无被监管部门立案调查和在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚。
8.2基金投资的前十名股票未超出基金合同规定的投资范围。
8.3其他各项资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	333,333.32
2	应收证券清算款	757,196.33
3	应收股利	-
4	应收利息	44,102,009.20
5	应收申购款	1,390.24
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	45,193,929.09

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	113001	中行转债	44,951,982.40	1.75
2	110015	石化转债	40,914,605.70	1.59
3	110016	川投转债	21,735,014.40	0.85
4	125709	唐钢转债	17,280,440.10	0.67
5	110013	国投转债	4,307,569.20	0.17
6	110003	新钢转债	3,468,563.00	0.13
7	110011	歌华转债	2,795,954.40	0.11

8.5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)	占基金资产净值比例(%)	流通受限情况说明
1	601336	新华保险	974,781.12	0.04	新股网下申购锁定期3个月
2	002650	加加食品	45,000.00	0.00	新股网上申购未上市
3	002651	利君股份	25,000.00	0.00	新股网上申购未上市
4	002649	博彦科技	11,000.00	0.00	新股网上申购未上市
5	300284	苏交科	6,650.00	0.00	新股网上申购未上市

十三、基金的业绩
基金业绩截止日为2011年12月31日。
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。
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
基金合同生效之日2011年1月18日—2011年12月31日	-1.20%	0.13%	4.75%	0.01%	-5.95%	0.12%

2.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进行比较
建信保本混合型证券投资基金
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
(2011年1月18日至2011年12月31日)

建信保本混合型证券投资基金招募说明书(更新)摘要

注:1、本基金基金合同于2011年1月18日生效,截至基金业绩报告日未满一年。
2、本基金的投资组合比例为:股票、权证等风险资产占基金资产的0%-40%,其中,持有的全部权证的市值不超过基金资产净值的3%;债券、货币市场工具等安全资产占基金资产的60%-100%,其中基金保留的现金以及投资于到期日在一年以内的政府债券的比例合计不低于基金资产净值的5%。法律法规或监管机构以后允许本基金投资的其他品种,基金管理人在履行适当程序后,可以将其纳入投资范围,有关投资比例限制等遵循届时有效的规定执行。
3、2011年2月9日,中国人民银行上调了金融机构人民币存款基准利率。作为本基金业绩比较基准的三年期定期存款收益率由4.15%上调至4.5%。
4、2011年4月6日,中国人民银行上调了金融机构人民币存款基准利率。作为本基金业绩比较基准的三年期定期存款收益率由4.5%上调至4.75%。
5、2011年7月7日,中国人民银行上调了金融机构人民币存款基准利率。作为本基金业绩比较基准的三年期定期存款收益率由4.75%上调至5.00%。
十四、基金的费用概览
(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)、基金合同生效后与基金相关的信息披露费用;
(4)、基金合同生效后与基金相关的会计师费、律师费和诉讼费;
(5)、基金份额持有人大会费用;
(6)、基金的证券交易费用;
(7)、基金的银行汇划费用;
(8)、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。
本基金终止清算时所发生费用,按实际支出额从基金财产总值中扣除。
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
本基金的管理费按前一日基金资产净值的1.2%年费率计提。管理费的计算方法如下:
H=E×1.2%÷当年天数
H为每日应计提的基金管理费
E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2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。
在保本周期内,本基金的保证费用从基金管理人的管理费收入中列支。
(2)、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0.2%的年费率计提。托管费的计算方法如下:
H=E×0.2%÷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2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。
若保本周期到期后,本基金不符合保本基金存续条件,基金份额持有人将所持有本基金份额转为变更后的《建信积极配置混合型证券投资基金》的基金份额,管理费按前一日基金资产净值的1.5%的年费率计提,托管费按前一日基金资产净值的0.25%的年费率计提。计算方法同上。
上述(一)“基金费用的种类”中第3-7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列入当期费用,由基金托管人从基金财产中支付。
(二)基金销售时发生的费用
1、申购费
本基金的申购费用应在投资者申购基金份额时收取,不列入基金财产,主要用于本基金的市场推广、销售、注册登记等各项费用。
本基金申购费率随申购金额增加而递减。投资者可以多次申购本基金,申购费率按每笔申购申请单独计算。
本基金的申购费率如下表所示:

申购金额(M)	申购费率
M<100万元	1.2%
100万元≤M<500万元	1.0%
M≥500万元	1000元/笔

若保本周期到期后,本基金不符合保本基金存续条件,转为变更后的《建信积极配置混合型证券投资基金》,申购费率不高于基金申购金额的5%,具体费率以届时公告为准。
2、赎回费
本基金赎回费用由赎回基金份额的基金份额持有人承担,不低于赎回费总额的25%应归基金财产,其余用于支付注册登记费和其他必要的手续费。
本基金的赎回费率按照持有时间递减,即相关基金份额持有时间越长,所适用的赎回费率越低,具体赎回费率如下表所示:

持有期限(Y)	赎回费率
Y≤1年	2.0%
1年<Y≤2年	1.6%
2年<Y<3年	1.2%
Y≥3年	0%

若保本周期到期后,本基金不符合保本基金存续条件,转为变更后的《建信积极配置混合型证券投资基金》,赎回费率最高不超过5%,具体费率以届时公告为准。
基金管理人可以按照《基金合同》的相关规定调整申购费率或收费方式,或者调低赎回费率,基金管理人最迟应于新的费率或收费方式实施日前2个工作日在至少一家中国证监会指定的媒体公告。
3、基金转换费用
基金转换费用由转出和转入基金的申购费补差和转出基金的赎回费两部分构成,具体收取情况视每次转换时两只基金的申购费率差异情况和转出基金的赎回费率而定。基金转换费用由基金持有人承担,如转出基金有赎回费用的,收取该基金赎回费的25%归入基金财产。
基金转换费用的具体计算公式如下:
①转出金额 = 转出基金份额 × 转出基金当日基金份额净值
②转入金额:
①如果转入基金的申购费率 > 转出基金的申购费率,
转入金额=转出金额×(1-转出基金赎回费率)/(1+转入基金申购费率—转出基金申购费率)
②如果转出基金的申购费率 ≥ 转入基金的申购费率,
转入金额=转出金额×(1-转出基金赎回费率)
③转换费用=转出金额-转入金额
④转入份额 = 转入金额/转入基金当日基金份额净值
例:某客户将10,000份建信货币市场基金转换成本基金(假设本基金当日基金份额净值为1.05元),建信货币市场基金的基金份额净值为1.00元,无累计未付收益。
因建信货币市场基金的赎回费率为0%,申购费率为0%,转入金额对应的本基金申购费率为1.2%,则:
转出金额=转出基金份额×转出基金当日份额净值=10,000×1.00=10,000.00元
转入金额=转出金额×(1-转出基金赎回费率)/(1+转入基金申购费率—转出基金申购费率)=10,000×(1-0%)/(1+1.2%—0%)=9881.42元
转换费用=转出金额-转入金额=10,000-9881.42=118.58元
转入份额=转入金额/转入基金份额净值=9881.42/1.05=9410.88份
即在上述情形下,该投资者将10,000份建信货币市场基金转换为本基金,经过注册登记机构确认后,投资者需要支付转换费用118.58元,转换后获得本基金基金份额为9410.88份。
4、本基金自2011年3月1日开始办理基金转换业务。
(三)不列入基金费用的项目
下列费用不列入基金费用:
1、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;
2、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;
3、《基金合同》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;
4、其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。
十五、保本周期到期
(一)保本周期到期后基金的存续形式
保本周期届满时,在符合保本基金存续条件下,本基金继续存续并进入下一保本周期,该保本周期的具体起讫日期、保本及保本保障安排以本基金管理人届时公告为准。
如果保本周期到期后,本基金未能符合保本基金存续条件,则本基金将按《基金合同》的约定,变更为《建信积极配置混合型证券投资基金》;同时,基金的投资目标、投资范围、投资策略以及基金费率等相关内容也将根据《基金合同》约定相应变更。上