大成策略回报股票型证券投资基金

更新的招募说明书摘要

（2009 年第 2 期）

基金管理人：大成基金管理有限公司 基金托管人：中国光大银行股份有限公司

重要提示

大成策略回报股票型证券投资基金（以下简称“本基金”）经中国证监会 2008 年 9 月 5 日证监许可【2008】1103 号文核准募集。本基金的基金合同于 2008 年 11 月 26 日正式生效。

基金管理人保证招募说明书的内容真实、准确、完整。本招募说明书经中国证监会审核同意，但中国证监会对本基金募集的核准，并不表明其对本基金的价值和收益做出实质性判断或保证，也不表明投资于本基金没有风险。

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，基金管理人不保证基金一定盈利，也不保证最低收益。

投资有风险，投资者申购基金时，请仔细阅读本基金的招募说明书及基金合同。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。

本摘要根据基金合同和基金招募说明书编写，并经中国证监会核准。基金合同是约定基金当事人之间权利、义务的法律文件。基金投资者自依基金合同取得基金份额，即成为基金份额持有人和基金合同的当事人，其持有基金份额的行为本身即表明其对基金合同的承认和接受，并按照《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》、基金合同及其他有关规定享有权利、承担义务。基金投资者欲了解基金份额持有人的权利和义务，应详细查阅基金合同。

本更新的招募说明书已经本基金托管人复核。所载内容截至日为 2009 年 11 月 26 日，有关财务数据和净值表现截止日为 2009 年 9 月 30 日（财务数据未经审计）。

一、基金管理人

（一）基金管理人概况

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

设立日期：1999 年 4 月 12 日

注册资本：贰亿元人民币

股权结构：公司股东为中泰信托投资有限公司（持股比例 48%）、中国银河投资管理有限公司（持股比例 25%）、光大证券股份有限公司（持股比例 25%）、广东证券股份有限公司（持股比例 2%）四家公司。

法定代表人：张树忠

电话：0755-83183388

传真：0755-83199588

联系人：肖冰

大成基金管理有限公司设有股东会、董事会、监事会，下设十五个部门，分别是股票投资部、固定收益部、委托投资部、研究部、交易管理部、金融工程部、信息技术部、客户服务部、市场部、总经理办公室、人力资源部、综合财务部、基金运营部、监察稽核部和国际业务部。公司在北京、上海、西安、成都、武汉、福州和沈阳等地设立了七家分公司，并在香港设立了子公司。此外，公司还设立了投资决策委员会、投资风险控制委员会、产品委员会、战略规划委员会和信息技术治理委员会等专业委员会。

公司以“稳健、高效”为经营理念，坚持“诚实信用、勤勉尽责”的企业精神，致力于开拓基金及证券市场业务，以稳健灵活的投资策略和注重绩优、高成长的投资组合，力求为投资者获得更大投资回报。公司所有人员在最近三年内均未受到所在单位及有关管理部门的处罚。

（二）证券投资基金管理情况

截至 2009 年 11 月 26 日，本基金管理人共管理 3 只封闭式证券投资基金：基金景宏、基金景福、大成优选股票型证券投资基金，及 13 只开放式证券投资基金：大成价值增长证券投资基金、大成债券投资基金、大成蓝筹稳健证券投资基金、大成精选增值混合型证券投资基金、大成货币市场证券投资基金、大成沪深 300 指数证券投资基金、大成财富管理 2020 生命周期证券投资基金、大成积极成长股票型证券投资基金、大成创新成长股票型证券投资基金(LOF)、大成景阳领先股票型证券投资基金、大成强化收益债券型证券投资基金、大成策略回报股票型证券投资基金和大成行业轮动股票型证券投资基金等。

（三）主要人员情况

1. 公司高级管理人员

董事会：

张树忠先生，董事长，经济学博士。1989 年 7 月—1993 年 2 月，任中央财经大学财政系讲师；1993 年 2 月—1997 年 3 月，任华夏证券股份有限公司投资银行总部总经理、研究发展部总经理；1997 年 3 月—2003 年 7 月，任光大证券股份有限公司总裁助理兼北方总部总经理、资产管理总监；2003 年 7 月—2004 年 6 月，任光大保德信基金管理公司董事、副总经理；2004 年 6 月—2006 年 12 月，任大通证券股份有限公司副总经理；2007 年 1 月—2008 年 1 月，任大通证券股份有限公司总经理；2008 年 1 月—2008 年 4 月，任职中国人保资产管理股份有限公司；2008 年 4 月起任中国人保资产管理股份有限公司副总裁、党委委员；2008 年 11 月起同时担任大成基金管理有限公司董事长。

王颢先生，董事总经理，国际工商管理专业博士。2000 年 12 月—2002 年 9 月，任招商证券股份有限公司深圳管理总部副总经理、机构管理部副总经理；2002 年 9 月加入大成基金管理有限公司，历任助理总经理、副总经理；2008 年 11 月起担任大成基金管理有限公司总经理。

刘虹先生，董事，博士，高级经济师。1985 年 7 月—1998 年 11 月，任国家计委国土局主任科员、副处长（主持工作）；1998 年 11 月—2000 年 9 月，任中国农业发展银行资金计划部计划处副处长（主持工作）；2000 年 9 月—2004 年 9 月，任中国人寿保险（集团）公司战略规划部战略研究与规划处处长；2004 年 9 月—2006 年 2 月，任中国人寿保险（集团）公司战略规划部副总经理；2006 年 2 月—2007 年 6 月，任中国人寿保险股份有限公司发展改革部总经理；2007 年 6 月—2007 年 8 月，任中国人民保险集团公司高级专家；2007 年 8 月至今，任人保投资控股有限公司总裁、党委书记；2009 年 11 月起，兼任中国华闻投资控股有限公司总裁、党委书记。

杨赤忠先生，董事，大学本科。历任深圳蓝天基金管理公司投资与研究部经理；长盛基金管理有限公司研究部副总监、基金经理；大成基金管理有限公司研究总监；光大证券证券投资部总经理。现任光大证券助理总裁。

孙学林先生，董事，博士研究生在读，中国注册会计师，注册资产评估师。1997 年 5 月—2000 年 4 月，任职于中国长城信托投资公司；2000 年 4 月—2007 年 2 月，任职于中国银河证券有限公司审计与合规管理部；现任中国银河投资管理有限公司资产管理部总经理。

蔺春林先生，独立董事，大学本科。1970—1971 年，解放军信阳坦克师锻炼；1971—1987 年，任兵器部 5107、5137 厂生产会计员、财务处长；1987 年—1998 年，任湖北省财政厅中央企业处副处长、财政部驻湖北省专员助理；1998 年—2005 年，任财政部驻江西专员办专员助理、副专员、专员、党组书记；2005 年 8 月，任中央纪委、中组部金融巡视组局长；2007 年 1 月退休。

于绪刚先生，独立董事，法学博士，环太平洋律师协会会员、全国律协金融证券委员会委员、华中科技大学兼职教授及研究生导师、北京工商大学客座教授、华北电力大学客座教授。1990 年—1995 年，任河北省保定市中级人民法院助理审判员；1995 年—1998 年，北京大学法学硕士学习；1999 年，香港大学法律学院访问学者、香港法律教育信托基金访问学者；1999 年—2001 年，北京大学法学博士学习；2001 年起任大成律师事务所律师、高级合伙人、管委会委员。

万曾炜先生，独立董事，经济学博士，研究员，曾任上海市政府发展研究中心处长，上海市浦东新区综合规划土地局党组书记、局长，浦东新区发展计划局党组书记，上海浦东发展集团和上海浦东投资建设有限公司筹建负责人和法人代表，现任上海市公积金管理中心党委书记、主任，上海市政府特聘决策咨询专家。

刘大为先生，独立董事，国家开发银行总会计师，高级经济师，享受政府特殊津贴专家。中国人民银行研究生部硕士生指导老师，首都经济贸易大学兼职教授，清华大学中国经济研究中心高级研究员。先后在北京市人民政府研究室（副处长、处长），北京市第一商业局（副局长），中国建设银行信托投资公司（总经理），中国投资银行（行长），国家开发银行（总会计师）工作。

监事会：

胡学光先生，监事长，硕士，高级经济师，广东省高级经济师评审委员会委员。曾在湖北金融高等专科学校任教，广州金融高等专科学校任金融系副主任；1992 年—2003 年 4 月，在广东证券股份有限公司先后任“广证基金”、“广证受益”经理、部门总经理、总裁助理、副总裁，兼任中山大学岭南学院兼职教授、中天证券研究院副院长，广东证券博士后科研工作站指导导师；2003 年 5 月至 2008 年 8 月任大成基金管理有限公司董事长。

宁加岭先生，监事，大学本科。1983 年 2 月—1987 年 6 月，任财政部人教司副处长、处长；1987 年 6 月—1994 年 6 月，任财政部行政司副司长、司长；1994 年 6 月—1999 年 6 月，任财政部德宝实业总公司总经理、法人代表；1999 年 6 月起，任职于财政部离退休老干部局。

黄建农先生，监事，大学本科。曾任中国银河证券有限责任公司上海江苏北路营业部总经理，中国银河证券有限责任公司资产管理总部副总经理，总经理，中国银河投资管理公司投资管理部总经理。现任中国银河投资管理公司上海投资部董事总经理。

其他高级管理人员：

刘彩晖女士，副总经理，管理学硕士。1999 年—2002 年，历任江南信托投资有限公司投资银行部副总经理、总经理；2002 年—2006 年，历任江南证券有限公司总裁助理、投资银行部总经理、机构管理部总经理，期间还任江南宏富基金管理公司筹备组副组长；2006 年 1 月—7 月任深圳中航集团公司人力资源部副总经理；2006 年 8 月—2008 年 5 月，任大成基金管理有限公司助理总经理；2008 年 5 月起任大成基金管理有限公司副总经理。

杜鹏女士，督察长，研究生学历。1992 年—1994 年，历任原中国银行陕西省信托咨询公司证券部驻上交所出市代表、上海业务部负责人；1994 年—1998 年，历任广东省南方金融服务总公司投资基金管理部证券投资部副经理、广东华侨信托投资公司证券总部资产管理部经理；1998 年 9 月参与大成基金管理有限公司的筹建；1999 年 3 月起，任大成基金管理有限公司督察长兼监察稽核部总监。

2. 基金经理

（1）现任基金经理

周建春先生，管理工程硕士，10 年证券从业经历。1998 年 1 月—1999 年 9 月，任职于湖南省国际信托投资公司基金管理部、证券管理总部，从事投资和研究工作；1999 年 10 月加入大成基金管理有限公司，历任高级研究员、景博证券投资基金经理助理、景博证券投资基金基金经理（2002 年 1 月 11 日—2004 年 3 月 31 日）、景福证券投资基金经理助理。

（2）历任基金经理

无。

3. 公司投资决策委员会

公司投资决策委员会由 9 名成员组成，设主任委员 1 名，其他委员 8 名。名单如下：

刘明，投资总监，大成优选股票型证券投资基金基金经理，投资决策委员会主任委员；杨建华，股票投资部总监，负责公司股票投资业务，大成景阳领先股票型证券投资基金基金经理，投资决策委员会委员；陈尚前，固定收益部总监，负责公司固定收益证券投资业务，大成强化收益债券型证券投资基金基金经理，投资决策委员会委员；曹雄飞，研究部总监，大成精选增值混合型证券投资基金基金经理，投资决策委员会委员；邓韶勇，交易管理部总监，投资决策委员会委员；施永辉，股票投资部副总监，大成蓝筹稳健证券投资基金基金经理，投资决策委员会委员；王立，大成债券投资基金、大成货币市场证券投资基金基金经理，投资决策委员会委员；曹志刚，金融工程部首席金融工程师，投资决策委员会委员；刘安田，研究部总监助理，首席宏观策略分析师，投资决策委员会委员。

上述人员之间不存在亲属关系。

二、基金托管人

（一）基本情况

名称：中国光大银行股份有限公司

注册地址：北京市西城区复兴门外大街 6 号光大大厦

办公地址：北京市西城区复兴门外大街 6 号光大大厦

成立日期：1992 年 8 月 18 日

批准设立机关：国务院

批准设立文号：国函[1992]7 号

基金托管业务批准文号：证监基金字【2002】75 号

注册资本：282.1689 亿元人民币

法定代表人：唐双宁

组织形式：股份有限公司

存续期间：持续经营

电话：（010）68560675

联系人：石立平

经营范围：

吸收公众存款；发放短期、中期和长期贷款；办理国内外结算；办理票据贴现；发行金融债券；代理发行、代理兑付、承销政府债券；买卖政府债券；从事同业拆借；买卖、代理买卖外汇；提供信用证服务及担保；代理收付款项及代理保险业务；提供保管箱服务；经中国人民银行和国家外汇管理局批准的其他业务。

（二）主要人员情况

法定代表人唐双宁先生，历任中国人民建设银行辽宁省分行办公室副主任（主持工作），中国人民建设银行沈阳市分行常务副行长，中国人民银行沈阳市分行副行长、党组副书记，中国人民银行辽宁省分行党组成员兼沈阳市分行行长、党组书记，中国人民银行信贷管理司司长，中国人民银行货币金银局局长，中国人民银行银行监管一司司长，中国银行业监督管理委员会党委委员、副主席。现任中国光大集团董事长、党委书记，中国光大银行董事长、党委书记，光大证券股份有限公司董事长，中国光大控股有限公司董事会主席，中国光大国际有限公司董事会主席。

行长郭友先生，历任国家外汇管理局外汇储备业务中心外汇交易部主任，中国投资公司（新加坡）总经理，中国人民银行外资金融机构管理司副司长，中国光大银行副行长，中国光大（集团）总公司执行董事、副总经理兼中国光大控股有限公司行政总裁，现任中国光大（集团）总公司副董事长、中国光大银行副董事长、行长。

基金托管部总经理陈昌宏先生，北京大学法学学士、硕士。历任中共中央联络部干部，四川光大资产管理公司董事、常务副总经理，中国光大银行昆明分行副行长。现任中国光大银行股份有限公司投资与托管业务部总经理。

（三）托管基金情况

截止 2009 年 9 月 30 日，中国光大银行股份有限公司共托管国投瑞银融华债券型基金、摩根士丹利华鑫基础行业基金、国投瑞银景气行业基金、泰信先行策略基金、光大保德信量化核心基金、大成货币市场基金、摩根士丹利华鑫资源优选混合型基金（LOF）、招商安本增利债券型基金、国投瑞银创新动力基金、大成策略回报基金等共 10 只证券投资基金，托管基金资产规模 342.79 亿元。同时，开展了证券公司集合理财计划、信托公司资金信托计划、QDII、基金专户、企业年金基金等资产的托管业务。

三、相关服务机构

（一）销售机构及联系人

1. 直销机构

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：0755-83199588
联系人：梁靖
公司网址：www.dcfund.com.cn
大成基金客户服务热线：021-53599588、400-888-5558（免长途固话费）

大成基金管理有限公司现分别在深圳、北京、上海设有投资理财中心：

（1）大成基金深圳投资理财中心
地址：深圳市福田区深南大道 7088 号招商银行大厦 32 层
联系人：梁靖、瞿宗怡
电话：0755-83195236
传真：0755-83195091

（2）大成基金北京投资理财中心
1）东直门
电话：010-58156152/53
传真：010-58156315/23
地址：北京市东城区东直门南大街 5 号中青旅大厦 105 室
联系人：李宁
2）平安里
电话：010-85252345/46
传真：010-85252272/73
地址：北京市西城区平安里西大街 28 号光大国际中心 1601 室
联系人：廖红军

（3）大成基金上海投资理财中心
1）广东路
地址：上海市广东路 689 号海通证券大厦 19 层
联系人：徐舲
电话：021-63513925/26
传真：021-63513928
2）南京西路
地址：上海市静安区南京西路 580 号南证大厦 102、103 室
联系人：朱君
电话：021-62185377、62185277
传真：021-62185233

2. 代销机构

（1）中国农业银行股份有限公司
注册地址：北京市东城区建国门内大街 69 号
法定代表人：项俊波
客服电话：95599
联系人：蒋浩
电话：010-85109219
传真：010-85109219
网址：www.abchina.com

（2）中国银行股份有限公司
注册地址：北京西城区复兴门内大街 1 号
法定代表人：肖钢
客服电话：95566
传真：010-66594946
电话：010-66594977
网址：www.boc.cn

（3）中国建设银行股份有限公司
注册地址：北京市西城区金融大街 25 号
办公地址：北京市西城区闹市口大街 1 号长安兴融中心 1 号楼
法定代表人：郭树清
联系人：王琳
电话：010-67596084
传真：010-66275654
客服电话：95533
网址：www.ccb.com

（4）中国工商银行股份有限公司
注册地址：中国北京复兴门内大街 55 号
法定代表人：姜建清
客服电话：95588
联系人：田耕
电话：010-66107900
传真：010-66108013
网址：www.icbc.com.cn

（5）上海浦东发展银行股份有限公司
办公地址：上海市北京东路 689 号 17 楼
法定代表人：吉晓辉
联系人：倪苏云
客服热线：95528
电话：021-61618888
传真：021-63602431
网址：www.spdb.com.cn

（6）交通银行股份有限公司
办公地址：上海市浦东新区银城中路 188 号
法定代表人：胡怀邦
客服电话：95559
联系人：曹榕
电话：021-58781234
传真：021-58408842
网址：www.bankcomm.com

（7）招商银行股份有限公司
注册地址：深圳市福田区深南大道 7088 号招商银行股份有限公司大厦
法定代表人：秦晓
客服电话：95555
联系人：刘薇
电话：0755-83195915
传真：0755-83195061
网址：www.cmbchina.com

（8）中国光大银行股份有限公司
注册地址：北京市西城区复兴门外大街 6 号光大大厦
法定代表人：唐双宁
客服电话：95595
联系人：李伟
电话：010-68560675
传真：010-68560661
网址：www.cebbank.com

（9）中国民生银行股份有限公司
注册地址：北京市东城区正义路 4 号
办公地址：北京市西城区复兴门内大街 2 号
法定代表人：董文标
客服电话：95568
联系人：董云巍
电话：010-58351666-8155
传真：010-83914283
网址：www.cmbc.com.cn

（10）广东发展银行股份有限公司
注册地址：广州市农林下路 83 号
法定代表人：李若虹
客服电话：95508
电话：020-87310888
网址：www.gdb.com.cn

（11）北京银行股份有限公司
注册地址：北京市西城区金融大街丙 17 号
法定代表人：闫冰竹
联系人：王曦
客服电话：010-96169（北京）、022-96269（天津）、021-53599688（上海）029-85766888（西安）0755-23957088（深圳）0571-86590900（杭州）
网址：www.bankofbeijing.com.cn

（12）上海农村商业银行股份有限公司
注册地址：上海市浦东新区浦东大道 981 号
法定代表人：李秀仑
电话：021-38576977
传真：021-62521689
联系人：吴海平、翁敏芬
客服电话：021－962999
网址：www.shrcb.com

（13）平安银行股份有限公司
注册地址：中国深圳市深南中路 1099 号
法定代表人：黄立哲
电话：0755-25859591
传真：0755-25878304
联系人：霍兆龙
客户服务热线：0755-961202、4006699999
公司网站：www.18ebank.com

（14）温州银行股份有限公司
注册地址：温州市车站大道华海广场 1 号楼
法定代表人：夏瑞洲
客服电话：0577-96699
网址：www.wzbank.cn

（15）青岛银行股份有限公司
地址：青岛市市南区香港中路 68 号华普大厦
法定代表人：张广鸿
联系人：滕克
客服电话：96588（青岛）、400-66-96588（全国）
网址：www.qdccb.com

（16）杭州银行股份有限公司
地址：杭州市凤起路 432 号
法定代表人：马时雍
联系人：陈振峰
客服电话：96523、4008888508
网址：www.hzbank.com.cn

（17）宁波银行股份有限公司
注册地址：宁波市江东区中山东路 294 号
法定代表人：陆华裕
电话：021-63586210
传真：021-63586215
联系人：胡技勋
客服电话：96528、上海地区 962528
网址：www.nbcb.com.cn

（18）东莞银行股份有限公司
注册地址：东莞市运河东一路 193 号
法定代表人：廖玉林
联系人：胡昱
客服电话：96228
网址：www.dongguanbank.cn

（19）江苏银行股份有限公司
地址：南京市洪武北路 55 号
法定代表人：黄志伟
联系人：田春慧
联系电话：025-58588167
客户服务电话：96098、400-86-96098
网址：www.jsbchina.cn

（20）长江证券股份有限公司
注册地址：湖北省武汉市新华路特 8 号长江证券大厦
法定代表人：胡运钊
联系人：李良
联系电话：021-63219781
客服电话：4008-888-999
委托电话：4008-888-318
传真：027-85481900
网址：www.cjsc.com.cn

（21）国泰君安证券股份有限公司
注册地址：上海市浦东新区商城路 618 号
通讯地址：上海市浦东新区银城中路 168 号上海银行大厦
法定代表人：祝幼一
客服电话：400-8888-666
联系人：芮敏祺
电话：021-62580818-213
传真：021-62583439
网址：www.gtja.com

（22）中信建投证券有限责任公司
注册地址：北京市朝阳区安立路 66 号 4 号楼
通讯地址：北京市朝阳门内大街 188 号
法定代表人：张佑君
客服电话：400-8888-108
联系人：魏明
电话：010-85130579
网址：www.csc108.com

（23）招商证券股份有限公司
注册地址：深圳市福田区益田路江苏大厦 A 座 38-45 层
法定代表人：宫少林
客服电话：4008888111、95565
联系人：黄健
电话：0755-82943511
传真：0755-83734343
网址：www.newone.com.cn

（24）广发证券股份有限公司
注册地址：广东省珠海市吉大海滨路光大国际贸易中心 26 楼 2611 室
法定代表人：王志伟
客服电话：020－87555888 转各营业网点
联系人：肖中梅
电话：020-87555888-875
传真：020-87557985
网址：www.gf.com.cn

（25）中国银河证券股份有限公司
通讯地址：北京市西城区金融大街 35 号国际企业大厦 C 座
法定代表人：胡长生
客服电话：4008-888-888
联系人：李洋
联系电话：010-66568047
传真：010-66568536
网址：www.chinastock.com.cn

（26）华泰联合证券有限责任公司
办公地址：深圳市深南东路 5047 号深圳发展银行大厦 10、24、25 层
法定代表人：马昭明
客服电话：400-8888-555
联系人：盛宗凌
电话：0755-82492000
传真：0755-82492962
网址：www.lhzq.com

（27）申银万国证券股份有限公司
通讯地址：上海市常熟路 239 号 2 楼
法定代表人：丁国荣
客服电话：021-962505
联系人：曹晔
电话：021-54047892
传真：021-54038844
网址：www.sw2000.com.cn

（28）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：张萍
传真：0755-83025625
网址：www.jyzq.cn

（29）海通证券股份有限公司
注册地址：上海市淮海中路 98 号
法定代表人：王开国
客服电话：95553、400-888-8001
联系人：金芸
电话：021-23219000
传真：021-63602722
网址：www.htsec.com

（30）中信证券股份有限公司
办公地址：北京朝阳区新源南路 6 号京城大厦
法定代表人：王东明
客服电话：010-84588888 各地营业部咨询电话
联系人：陈忠
电话：010-84683893
传真：010-84865560
网址：www.cs.ecitic.com

（31）安信证券股份有限公司
注册地址：深圳市福田区金田路 2222 号安联大厦 34 层、28 层 A02 单元
法定代表人：牛冠兴
客服电话：4008001001
联系人：张茜萍
电话：0755-82558335
传真：0755-82558335
网址：www.axzq.com.cn

（32）光大证券股份有限公司
办公地址：上海市静安区新闸路 1508 号
法定代表人：徐浩明
客服电话：4008888788、10108998
联系人：刘晨、李芳芳
电话：021-22169081
传真：021-22169134
网址：www.ebscn.com

（33）华林证券有限责任公司
办公地址：珠海市拱北夏湾华平路 96 号二层 202-203 房
法定代表人：段文清
客服电话：0750—3160388 各地营业部客户服务电话
联系人：杨玲
电话：0755-82707855
传真：0755-82707850
网址：www.chinalions.com

（34）中信万通证券有限责任公司
注册地址：青岛市崂山区苗岭路 29 号澳柯玛大厦 15 层（1507-1510 室）
办公地址：青岛市东海西路 28 号
法定代表人：史洁民
客服电话：0532-96577
联系人：丁韶燕
电话：0532-85022026
传真：0532-85022026
网址：www.zxwt.com.cn

（35）东海证券有限责任公司
注册地址：常州延陵西路 59 号常信大厦 18、19 楼
办公地址：上海市浦东区东方路 989 号中达广场 17 楼
法定代表人：朱科敏
客服电话：0519-88166222、0379-64902266、021-52574550
联系人：李涛
电话：021-50586660
传真：021-50586660-8880
网址：www.longone.com.cn

（36）中信金通证券有限责任公司
注册地址：杭州市中河南路 11 号万凯庭院商务楼 A 座
办公地址：杭州市中河南路 11 号万凯庭院商务楼 A 座
法定代表人：刘军
电话：0571-96598
传真：0571-85783771
联系人：王勤
联系电话：0571-85783715
网址：www.bigsun.com.cn

（37）广州证券有限责任公司
注册地址：广州市先烈中路 69 号主楼五楼
办公地址：广州市先烈中路 69 号东山广场主楼五楼
法定代表人：吴志明
客服电话：020-961303
联系人：江欣
联系电话：020-87320991
传真：020-87325036
网址：www.gzs.com.cn

（38）平安证券有限责任公司
办公地址：深圳市福田区八卦岭八卦三路平安大厦三楼
法定代表人：陈敬达
客服电话：95511
联系人：袁月
电话：0755-22627802
传真：0755-83433794
网址：www.pa18.com

（39）华泰证券有限责任公司
地址：江苏省南京市中山东路 90 号华泰证券大厦
法定代表人：吴万善
客服电话：4008-888-168、95597
联系人：李金龙、张小波
电话：025-84457777-950、248
网址：www.htsc.com.cn

（40）湘财证券有限责任公司
住所：长沙市黄兴中路 63 号中山国际大厦 12 楼
办公地址：上海陆家嘴环路 958 号华能联合大厦 5 层
法定代表人：陈学荣
客服电话：400-888-1551
联系人：钟康莺
电话：021-68634518
传真：021-68865680
网址：www.xcsc.com

（41）国元证券股份有限公司
注册地址：安徽省合肥市寿春路 179 号
公司办公地址：安徽省合肥市寿春路 179 号（邮政编码：230001）
法定代表人：凤良志
客服电话：400-888-8777、0551—95888
联系人：程维
电话：0551-2634400
传真：0551-2645709
网址：www.gyzq.com.cn

（42）上海证券有限责任公司
注册地址：上海市西藏中路 336 号
办公地址：上海市西藏中路 336 号
法定代表人：蒋元真
客服电话：021-962518
联系人：谢秀峰
电话：021-51539888
传真：021-65081063
网址：www.962518.com

（43）华安证券有限责任公司
住所：安徽省合肥市长江中路 357 号
法定代表人：李工
客服电话：0551-96518、400-80-96518
联系人：甘霖
电话：0551-5161821
传真：0551-5161672
网址：www.hazq.com

（44）兴业证券股份有限公司
住所：福建省福州市湖东路 99 号标力大厦
办公地址：上海市浦东新区陆家嘴东路 166 号中国保险大厦 18 楼
法定代表人：兰荣
电话：021-68419974
传真：021-68419867
联系人：杨盛芳
网址：www.xyzq.com.cn
客服电话：400888123

（45）财通证券有限责任公司
注册地址：杭州市解放路 111 号金钱大厦
办公地址：杭州市解放路 111 号金钱大厦
法定代表人：沈继宁
联系人：乔骏
电话：0571-87925129
传真：0571-87925129
网址：www.ctsec.com
客户服务电话：0571-96336

（46）浙商证券有限责任公司
地址：浙江省杭州市杭大路 1 号黄龙世纪广场 A 座 6-7 楼
法定代表人：吴承根
联系人：吴颖
电话：0571-87901963
传真：0571-87902081
网址：www.stocke.com

（47）渤海证券股份有限公司
注册地址：天津市经济技术开发区第一大街 29 号
办公地址：天津市河西区宾水道 3 号
法定代表人：张志军
客服电话：4006515988
联系人：王兆权
电话：022-28451861
传真：022-28451892
客服电话：28455588
网址：www.ewww.com.cn

（48）方正证券有限责任公司
注册地址：湖南省长沙市芙蓉中路二段华侨国际大厦 22－24 层
办公地址：湖南省长沙市建湘路 479 号
法定代表人：雷杰
客服电话：0571-95571、0731-95571、13258915782
电话：0731-2882340、0571-87782047
传真：0731-2882332
网址：www.foundersc.com

（49）东莞证券有限责任公司
办公地址：东莞市莞城区可园南路 1 号金源中心 30 楼
法定代表人：游锦辉
客服电话：0769-961130
联系人：张建平
电话：0769-22119426
传真：0769-22119423
网址：www.dgzq.com.cn

（50）瑞银证券有限责任公司
注册地址：北京市西城区金融大街 7 号英蓝国际金融中心 12 层、15 层
办公地址：北京市西城区金融大街 7 号英蓝国际金融中心 12 层、15 层
法定代表人：刘弘
电话：010-59226788
传真：010-59226840
联系人：谢亚凡
客户服务电话：400-887-8827
网址：www.ubssecurities.com

（51）宏源证券股份有限公司
注册地址：新疆乌鲁木齐市建设路 2 号
办公地址：北京市海淀区西直门北大街甲 43 号金运大厦 B 座 6 层
法定代表人：汤世生
联系人：韩梅
电话：010-62294608-6957
传真：010-62296854
客户服务电话：010-62294600
网址：www.hysec.com

（52）长城证券有限责任公司
注册地址：深圳市福田区深南大道 6008 号特区报业大厦 14、16、17 层
法定代表人：黄耀华
联系人：匡婷
电话：0755-83516289
传真：0755-83516199
客户服务热线：0755-33680000、400-6666-888
长城证券网站：www.cc168.com.cn

（53）国都证券有限责任公司
注册地址：深圳市福田中心区金田路 4028 号荣超经贸中心 26 层 11、12
办公地址：北京市东城区东直门南大街 3 号国华投资大厦 9 层
法定代表人：王少华
联系人：黄静
客户服务电话：800-810-8809
网址：www.guodu.com

（54）中银国际证券有限责任公司
注册地址：上海市浦东新区银城中路 200 号中银大厦 39F
法定代表人：平岳
联系人：张静
电话：021-68604866-8309
网址：www.bocichina.com.cn

（55）齐鲁证券有限公司
办公地址：山东省济南市经十路 128 号
法定代表人：李玮
联系人：傅咏梅
电话：0531-82024184、0531-82024147
传真：0531-82024197
网址：www.qlzq.com.cn

（56）东北证券股份有限公司
注册地址：长春市自由大路 1138 号
办公地址：长春市自由大路 1138 号
法定代表人：矫正中
联系人：潘锴
电话：85096709
客户服务电话：0431-96688-0、0431-85096733
网址：www.nesc.cn

（57）江海证券有限公司
办公地址：哈尔滨市香坊区赣水路 56 号
法人代表：孙名扬
电话：0451-82269286
客服热线：4006662288
联系人：葛新
网址：www.jhzq.com.cn

（58）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

（59）恒泰证券有限责任公司
注册地址：内蒙古呼和浩特市新城区新华东街 111 号
法人代表：刘汝军
客户服务电话：0471-4961259
联系人：张同亮
电话：021-68405273
网址：www.cnht.com.cn

（60）国金证券股份有限公司
注册地址：成都市东城根上街 95 号
办公地址：成都市等城根上街 95 号 6、16、17 楼
法定代表人：冉云
联系人：金喆
客户服务电话：028-86690126
网址：www.gjzq.com.cn

（61）信泰证券有限责任公司
办公地址：江苏省南京市长江路 88 号国信大厦 18、19 楼（邮政编码：210005）
法定代表人：钱凯法
客服电话：400-8888-918
联系人：舒萌菲
电话：025-84784765
传真：025-84784830
网址：www.thope.com

（62）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 8 层
办公地址：福州市五四路 157 号新天地大厦 8 层
法定代表人：王比
客服电话：0591-87383623
联系人：张腾
传真：0591-87383610
网址：www.gfhfzq.com.cn

（63）国海证券有限责任公司
注册地址：广西南宁市滨湖路 46 号
办公地址：广西南宁市滨湖路 46 号
客服电话：400-888-8100（全国）、96100（广西）
法定代表人：张雅锋
联系人：覃清芳
电话：0771-5539262
传真：0771-5539033
网址：www.ghzq.com.cn

（64）江南证券有限责任公司
注册地址：南昌市抚河北路 291 号
办公地址：南昌市抚河北路 291 号六楼
法定代表人：姚江涛
客服电话：0791-6768763
联系人：余雅娜
电话：0791-6768763
传真：0791-6789414
网址：www.scstock.com

（65）世纪证券有限责任公司
办公地址：深圳市深南大道 7088 号招商银行大厦 40-42 楼
法定代表人：段强
客服电话：0755-83199511
联系人：刘军辉
电话：0755-83199511
传真：0755-83199545
网址：www.csco.com.cn
电子邮箱：liujh@csco.com.cn；

（66）爱建证券有限责任公司
地址：上海市南京西路 758 号 24 楼
法定代表人：张建华
客服电话：021-63340678
联系人：陈敏
网址：www.ajzq.com

（67）英大证券有限责任公司
地址：深圳市福田区深南中路华能大厦三十、三十一层
法定代表人：赵文安
客服电话：0755-26982993
网址：www.ysun.com

（68）国信证券股份有限公司
注册地址：深圳市罗湖区红岭中路 1012 号国信证券大厦十六层至二十六层
法定代表人：何如
客服电话：95536
联系人：齐晓燕
电话：0755-82130833
传真：0755-82133302
网址：www.guosen.com.cn

（69）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：400-666-1618
联系人：张治国
电话：0351-8686703
传真：0351-8686619
网址：www.i618.com.cn

（70）国联证券股份有限公司
注册地址：江苏省无锡市县前东街 168 号
办公地址：江苏省无锡市县前东街 168 号国联大厦 703 室
法定代表人：范炎
客服电话：0510-82588168
联系人：袁丽萍
电话：0510-82831662
传真：0510-82830162
网址：www.glsc.com.cn

（71）东方证券股份有限公司
住所：上海市中山南路 318 号新源广场 2 号楼 21-29 楼
法定代表人：王益民
客户电话：95503
联系人：吴宇
电话：021-63325888
传真：021-63327888
网址：www.dfzq.com.cn

（72）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
电话：0731-4403360
网址：www.cfzq.com

（73）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
网址：www.ccnew.com

（74）天相投资顾问有限公司
注册地址：北京市西城区金融街 19 号富凯大厦 B 座 701
法定代表人：林义相
客服电话：（010）66045678
网址：www.txsec.com、www.txjijin.com

（75）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

（76）信达证券股份有限公司
地址：北京市三里河东路 5 号中商大厦 10 层
法定代表人：张志刚
联系人：唐静
联系电话：010-88656100
传真：010-88656290
客服电话：400-800-8899
公司网址：www.cindasc.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：0755-83195229
联系人：范瑛

（三）律师事务所和经办律师
名称：北京市广盛律师事务所
注册地址：建国路 99 号中服大厦 25 层
办公地址：建国路 99 号中服大厦 25 层
负责人：夏善胜
电话：010-65813529
传真：010-65816534
经办律师：吴军、孟娟娟

（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 1233 号汇亚大厦 1604-1608 室
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：薛竞、金毅
电话：021-23238888
传真：021-23238800
联系人：金毅

四、基金的名称

大成策略回报股票型证券投资基金

五、基金的类型

契约型

六、基金的运作方式

开放式

七、基金的投资目标

追求基金资产的长期稳健增值，兼顾当期收益；同时，实施积极的分红政策，回报投资者。

八、基金的投资方向

本基金投资于国内依法公开发行的股票、权证、债券、资产支持证券及法律法规或监管机构允许基金投资的其他金融工具。

九、基金的投资策略

本基金在控制风险的前提下，采取趋势投资策略进行总体资产配置；在行业配置、个股投资上分别实施行业轮动投资策略、核心－卫星策略、价值投资策略、买入并持有策略，以期在承担中高风险的前提下获取尽可能高的投资收益；同时，强调收益管理，实施收益管理策略，以期在增长期及时锁定收益，制度性的减少未来可能的下跌风险，增加投资总收益。

1. 总体资产配置策略

本基金以股票投资为主、债券投资为辅进行积极资产配置。其中，股票资产占基金资产的比例范围为 60%－95%；债券资产占基金资产的比例范围为 0%－35%；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%。

本基金采取趋势投资策略进行总体资产配置，即通过对宏观经济运行状况及其政策动态、货币金融运行状况及其政策动态、证券市场运行状况及其政策动态等因素“自上而下”的定量和定性分析，形成对各个市场的趋势判断，在此基础上基于稳健的战略资产配置策略和积极的战术资产配置策略，确定组合中股票、债券和货币市场工具的投资比例。

2. 行业配置策略

本基金采用行业轮动投资策略进行行业配置，即紧密跟踪宏观经济和行业经济运行状况及其政策动态，关注产业结构调整，通过行业周期分析、行业特征指标分析、行业内竞争结构分析以及国际产业迁移进程分析等确定本基金各行业的投资比例，当预计某个行业的投资收益率发生变化时，动态调整各行业的投资比例。同时，利用数量化模型优化行业组合，增强本基金行业配置效率。

本基金将重点投资于符合国家宏观经济和产业发展政策，与国民经济增长高度相关，能够适应、满足、推动消费升级及产业升级等需要，具有垄断特征以及高附加值等行业，适时采用行业集中或者行业分散策略，获取行业超额收益，平抑宏观经济的周期性变化对股价波动带来的影响，保持基金分红水平与净值的长期协调稳定增长。

3. 个股选择策略

本基金采用核心－卫星策略，进行股票资产配置，即本基金股票资产主要投资于红利股，同时兼顾成长股的投资，以实现基金资产的长期资本增值；本基金投资于红利股不低于基金股票资产的 80%。

本基金对于红利股、成长股分别采用价值投资策略、买入并持有策略进行投资。

（1）红利股

对于红利股投资，本基金采用价值投资策略，即适时评估红利股的内在价值，并与其市场价格进行比较，投资处于合理估值范围内的红利股。红利股是指过去两年有分红记录的上市公司。本基金将综合考察企业的历史分红记录、现有分红能力、流动性等特征，挖掘具有长期分红潜力的红利股企业进行投资。主要考核标准包括：

① 历史分红记录良好，过去两年连续分红；

② 现金红利派息率高于市场平均水平；

③ 短期负债率较低，长期负债率处于合理范围以内，自由现金流良好。

（2）成长股

对于成长股的投资，本基金采用买入并持有投资策略，即通过精选具备持续成长潜力的股票进行长期投资，充分分享由于股票市场价值不断上升所带来的收益。本基金将综合考察企业估值水平、盈利能力、管理层能力、核心竞争力等特征，选择具有持续增长能力的企业投资。主要考核标准包括：

① 主营业务清晰，成长性良好

企业的盈利能力取决于主营业务的盈利能力。主营业务突出、成长性良好的企业具有较高的投资价值。本基金将深入分析企业的利润构成，通过对每股收益、每股收益增长率、净资产收益率等指标的定量分析，评价企业的盈利能力。

② 具备高效的管理团队，重视股东利益

企业的管理团队对企业的发展方向、资源的配置效率起着重要作用。本基金将通过实地调研、高层访谈等方式对企业管理层的管理能力、团队氛围、是否重视股东利益、是否具有制定和调整企业发展战略的能力等特征进行定性分析。

③ 具备核心竞争优势

资源独占、技术领先、品牌优势、企业凝聚力等特质所形成的核心竞争力是企业长期积累的结果，也是企业宝贵的无形资产，有助于企业以较低的成本获取较高的收益。本基金将通过定性和定量相结合的方法深入挖掘企业的核心竞争优势。

本基金将密切跟踪市场变化，结合本基金收益实现情况，适时调整（1）、（2）两个层面的权重分配，以期达至最优组合绩效。

4. 债券投资策略

本基金的债券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、债券信用分析、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稳定收益。

（1）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。

（2）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。本基金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。

（3）债券信用分析

本基金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。

（4）收益率利差分析

本基金将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。

5. 其他金融工具投资策略

本基金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。权证投资策略主要包括以下几个方面：主要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；根据权证对应公司基本面的研究估值，结合权证理论价值进行权证的趋势投资；利用权证衍生工具的特性，通过权证与证券的组合投资，来达到改善组合风险收益特征的目的，包括但不限于杠杆交易策略、看跌保护组合策略、保护组合成本策略、获利保护策略、买入跨式投资策略。

本基金将综合运用久期管理、收益率曲线、个券选择和把握市场交易机会等策略投资资产支持证券，在严格控制风险的情况下，通过信用研究和流动性管理，选择风险调整后的收益较高的品种进行投资，以期获得长期稳定收益。

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，在一定程度上实现基金资产的保值、增值。

6. 收益管理策略

本基金强调对收益的管理，以期在增长期及时锁定收益，制度性的减少未来可能的下跌风险，增加投资总收益。

本基金的收益管理策略分别体现在类属资产配置、股票投资、风险管理工具的运用和定期收益监控四个方面。本基金在类属资产配置过程中重视趋势预测，及时调整组合风险水平；本基金在股票投资过程中，重视短期收益和长期资本增值的匹配；本基金采用积极策略运用风险管理工具，对冲风险、锁定收益；本基金在运作过程中将制度性的按季监控收益实现状态，综合考虑证券市场趋势、投资计划安排等因素，在法律法规以及基金合同规定的范围内，最大限度的积极分配收益。

十、基金的业绩比较基准

80%×沪深 300 指数＋20%×中信标普全债指数。

中信标普全债指数的编制人中信标普指数信息服务有限公司已将“中信全债指数”更名为“中信标普全债指数”，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

本基金属于中高风险收益水平的股票型基金品种，其长期平均的预期收益和风险高于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。

基金托管人中国光大银行股份有限公司根据基金合同规定，于 2009 年 12 月 21 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 2009 年 9 月 30 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	715,805,890.66	85.29
	其中：股票	715,805,890.66	85.29
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	99,757,891.52	11.89
6	其他资产	23,687,779.52	2.82
7	合计	839,251,561.70	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	5,431,105.60	0.68
B	采掘业	45,684,883.06	5.71
C	制造业	243,664,727.94	30.48
C0	食品、饮料	78,585,433.39	9.83
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	41,921,979.20	5.24
C5	电子	–	0.00
C6	金属、非金属	32,261,521.68	4.04
C7	机械、设备、仪表	73,822,342.63	9.23
C8	医药、生物制品	17,073,451.04	2.14
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	31,039,127.38	3.88
H	批发和零售贸易	32,335,945.73	4.04
I	金融、保险业	248,259,936.73	31.05
J	房地产业	66,702,358.20	8.34
K	社会服务业	15,835,684.18	1.98
L	传播与文化产业	12,057,146.16	1.51
M	综合类	14,794,975.68	1.85
	合计	715,805,890.66	89.54

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	601318	中国平安	912,801	46,279,010.70	5.79
2	000568	泸州老窖	1,141,255	33,552,897.00	4.20
3	601169	北京银行	1,941,609	33,453,923.07	4.18
4	002024	苏宁电器	1,972,907	32,335,945.73	4.04
5	000001	深发展 A	1,519,677	30,408,736.77	3.80
6	000002	万 科 A	2,699,960	28,133,583.20	3.52
7	601628	中国人寿	1,000,000	27,680,000.00	3.46
8	601166	兴业银行	783,298	26,467,639.42	3.31
9	600048	保利地产	1,080,000	26,071,200.00	3.26
10	600028	中国石化	2,299,912	25,989,005.60	3.25

4. 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。

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

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。

7. 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。

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不存在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	779,013.22
2	应收证券清算款	–
3	应收股利	113,400.00
4	应收利息	18,382.85
5	应收申购款	22,776,983.45
6	其他应收款	–
7	待摊费用	–
8	其他	–
9	合计	23,687,779.52

（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。

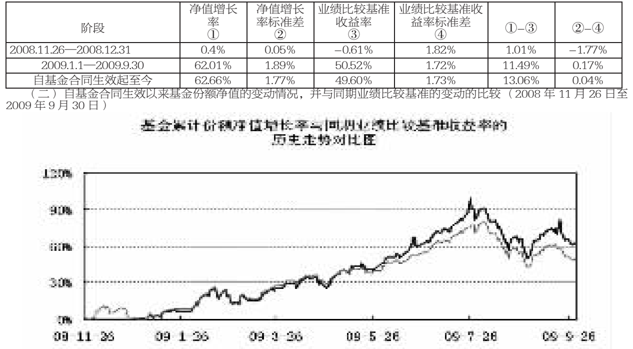
十三、基金业绩

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）自基金合同生效以来（2008 年 11 月 26 日）至 2009 年 9 月 30 日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
2008.11.26—2008.12.31	0.4%	0.05%	−0.61%	1.82%	1.01%	−1.77%
2009.1.1—2009.9.30	62.01%	1.89%	50.52%	1.72%	11.49%	0.17%
自基金合同生效起至今	62.66%	1.77%	49.60%	1.73%	13.06%	0.04%

（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（2008 年 11 月 26 日至 2009 年 9 月 30 日）



注：1、本基金合同于 2008 年 11 月 26 日生效，截至报告日本基金合同生效未满一年。

2、按基金合同规定，本基金自基金合同生效之日起 6 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中规定的各项比例。

十四、费用概览

（一）与基金运作有关的费用

1. 基金费用种类

（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）基金合同生效以后的信息披露费用；

（5）基金份额持有人大会费用；

（6）基金合同生效以后的会计师费和律师费；

（7）基金银行汇划费用；

（8）按照国家有关法律法规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

本基金的管理费按基金资产净值的 1.50% 年费率计提，即本基金的年管理费率为 1.50%。计算方法如下：

H＝E×年管理费率÷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

管理费每日计提，逐日累计。对于已确认的管理费，由基金托管人于次月前 5 个工作日内，依据基金管理人的指令从基金资产中一次性支付给基金管理人。

（2）基金托管人的托管费

本基金的托管费按基金资产净值的 0.25% 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×年托管费率÷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

托管费每日计提，逐日累计。对于已确认的托管费，由基金托管人于次月前 5 个工作日内，依据基金管理人的指令从基金资产中一次性支取。

（3）本条第 1 款第（3）至第（8）项费用由基金管理人和基金托管人根据有关法规及相应协议的规定，列入当期基金费用。

（二）与基金销售有关的费用

1. 申购与赎回的费用

本基金目前开通前端收费模式，将来根据市场发展状况和法律法规、监管机构的规定，可能增加新的收费模式，也可能相应增加新的基金份额种类，并可能需计算新基金份额类别的基金份额净值。增加新的收费模式，应当按照法律法规、监管机构的规定，履行适当的程序，并及时公告。新的收费模式的具体业务规则，请见有关公告、通知。

（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，主要用于本基金的市场推广、销售、客户服务等各项费用。

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

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

申购份额、净申购金额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由基金财产承担，产生的收益归基金财产所有。

（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。赎回费在扣除手续费后，余额不低于赎回费总额 25% 的部分，应当归入基金财产。

持有基金时间 T	赎回费率
T＜1 年	0.50%
1年≤T＜2 年	0.25%
T≥2 年	0

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

赎回总额、净赎回金额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由基金财产承担，产生的收益归基金财产所有。

（3）基金份额净值的计算

T 日基金份额净值＝T 日基金资产净值 / T 日基金份额总数

T 日的基金份额净值在当天收市后计算，并在 T+1 日公告。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。

2. 基金转换费用

基金管理人可以根据相关法律法规以及基金合同的规定，在条件成熟的情况下提供本基金与基金管理人管理的其他基金之间的转换服务。基金转换可以收取一定的转换费，相关规则由基金管理人届时根据相关法律法规及基金合同的规定制定并公告。

（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。基金合同生效前的相关费用，包括但不限于律师费、会计师费和信息披露费用等不得从基金财产中列支，其他具体不得列入基金费用的项目依据相关法律法规执行。

（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、基金托管费率等相关费率，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。

若将来法律法规或监管机构许可本基金或本类型的基金采取持续性销售服务费模式，则本基金可以依法引入持续性销售服务费收费模式；若引入该类收费模式没有增加现有基金份额持有人的费用负担，则无须召开基金份额持有人大会，法律法规或监管机构另有规定的除外。

基金管理人最迟于新的费率实施日前 2 日在至少一种中国证监会指定媒体上予以公告，并报中国证监会备案。

（五）基金税收

本基金运作过程中涉及的各纳税主体，依照国家法律法规的规定履行纳税义务。

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 2009 年 7 月 8 日公布的《大成策略回报股票型证券投资基金更新的招募说明书（2009 年第 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. 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“十、基金的投资”部分。
5. 根据最新数据，更新了“十一、基金的业绩”部分。
6. 根据最新公告，加入了“二十四、其他应披露的事项”。
7. 根据最新情况，加入了“二十五、对招募说明书更新部分的说明”。

大成基金管理有限公司
二〇一〇年一月六日