

关于召开开业证券投资基金基金份额持有人大会的第二次提示性公告

大成基金管理有限公司(以下简称“基金管理人”)已于2006年11月10日在《中国证券报》、《上海证券报》和《证券时报》发布了《证券投资基金召开基金份额持有人大会公告》,为使本次基金份额持有人大会顺利召开,现发布关于召开开业证券投资基金基金份额持有人大会的第二次提示性公告。

- 一、会议议程
根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《证券投资基金基金合同》的有关规定,经与基金托管人中国农业银行协商,开业证券投资基金(以下简称“本基金”或“基金”)的基金管理人决定以现场方式召开本基金的基金份额持有人大会,会议的具体安排如下:
1.会议时间:2006年12月11日上午9时30分。
2.会议地点:圣玛利亚酒店(北京东三环北路8号)。
3.召开方式:现场方式。

- 二、会议审议事项
基金转型有关事项的议案(见附件一)。

- 三、会议的议事程序和表决方式
1.基金管理人宣布开会并宣读会议开始语;
2.大会主持人宣布与会的基金份额持有人和代理人人数及其所持有的基金份额总数、占权益登记日基金份额的比例;

- 3.大会主持人宣读会议议程及注意事项;
4.大会主持人公布出席人和见证律师姓名;
5.大会主持人宣读议案;
6.享有表决权的与会人员对议案进行审议,并进行表决;

- 7.监票人对基金份额持有人表决后当即进行清点,计票过程将由公证机关予以公证;
8.大会主持人当场公布计票结果;
9.形成大会决议,并由见证律师就本次会议召开的程序以及持有人大会形成的决议的合法性、合规性发表法律意见。

- 四、基金份额持有人的权益登记日
本次基金份额权益登记日为2006年11月17日,即在2006年11月17日上海证券交易所交易结束后,在中国证券登记结算有限责任公司(以下简称“中登公司”)上海分公司登记在册的本基金全体基金份额持有人均有权参加本次基金份额持有人大会。

- 五、出席会议需要携带的文件
1.个人基金份额持有人出席会议的,需要提交本人身份证(或其他能够表明其身份的有效证件或证明)原件及复印件、上海证券账户卡(包括A股账户卡或基金账户卡,下同)。

- 2.个人基金份额持有人委托他人出席会议的,应当提交基金份额持有人的身份证(或其他能够表明其身份的有效证件或证明)原件及复印件、代理人的身份证(或其他能够表明其身份的有效证件或证明)原件及复印件、基金份额持有人签字的授权委托书(内容及格式见本公告附件二)、上海证券账户卡。

- 3.机构投资者出席会议的,需要提交加盖公章的企业营业执照复印件(事业单位、社会团体或其他单位使用加盖公章的有权部门的批文,开户证明或登记证书复印件等)、单位出席会议的授权委托书(内容及格式见本公告附件二)、被授权人或代表出席大会会议的个人身份证(或其他能够表明其身份的有效证件或证明)原件及复印件、上海证券账户卡。

- 六、出席会议的人员
1.权益登记日上海证券交易所交易结束后,在中登公司上海分公司登记在册的本基金的个人基金份额持有人或其代理人、机构投资者均有权出席。

- 2.基金管理人代表。
3.基金托管人代表。
4.基金管理人聘请的见证律师、公证人员等。
5.其他相关人员。

- 七、基金份额持有人大会决议
为提前了解基金份额持有人大会到会情况,保证持有人大会顺利召开,并进行相关准备工作,参会基金份额持有人需办理预登记,持有人大会召开时,基金份额持有人的须办理正式参会登记,请予以积极配合。

- (一)现场方式预登记
1.基金份额持有人采用现场方式进行预登记的,应当提供下列文件:
(1)具备合法投资资格的个人基金份额持有人,凭本人身份证(或其他能够表明其身份的有效证件或证明)原件及复印件、上海证券账户卡进行预登记。

- (2)个人基金份额持有人委托他人出席会议的,代理人凭授权委托书、委托人身份证(或其他能够表明其身份的有效证件或证明)原件及复印件、本人身份证(或其他能够表明其身份的有效证件或证明)原件及复印件、委托人上海证券账户卡进行预登记。

- (3)具备合法投资资格的机构投资者基金份额持有人,凭企业营业执照(事业单位、社会团体或其他单位可使用有权部门的批文,开户证明或登记证书等)复印件、单位授权委托书,被授权人或代表单位出席会议的个人身份证(或其他能够表明其身份的有效证件或证明)原件及复印件、上海证券账户卡进行预登记。

- 2.基金管理人办理现场预登记的地点为:
(1)基金管理人深圳总部
深圳市福田区深南大道7088号招商银行大厦32层。

- (2)基金管理人北京分公司
北京市朝阳区朝外大街16号中国人寿大厦1201室。

- (3)基金管理人上海分公司
上海市广东路689号海通证券大厦19层。

- (4)传真方式预登记:在预登记时间内,基金份额持有人可凭上述证件向基金管理人进行预登记,传真号码为0756-83195091(深圳)、010-85222273(北京)或021-63513928(上海)。

- (5)网络预登记:2006年11月21日-2006年12月8日,每天9:00-17:00,周六、周日及法定节假日除外。基金管理人将在基金份额持有人办理现场预登记或传真方式预登记。

- 八、会议召开条件
经对汇总总份额者出席的权益登记日持有基金份额的全部有效凭证所对应的基金份额占本基金的权益登记日基金份额的50%以上。

- 九、形成基金份额持有人大会决议的条件
1.基金份额持有人所持的每份基金份额有一票表决权。
2.基金份额持有人在表决书上填写“同意”、“反对”或“弃权”,未填、错填、字迹无法辨认或表决意见与预填的表决意见未填的表决票均视为基金份额持有人放弃表决权,其所持基金份额的表决结果均计为“弃权”。

- 3.关于基金转型有关事项的议案应当由出席会议的基金份额持有人所持表决权的2/3以上通过,十分重要提示。

本次会议将于2006年12月11日上午9时30分召开,届时基金管理人、基金托管人和基金管理人聘请的见证律师将对参加大会的基金份额持有人资格的合法性进行审查并予以登记,请出席会议人员务必按照本公告的要求,携带必需的文件提前半小时至会议地点,以便验证入场。

本基金已于2006年11月16日开始停牌,基金管理人将于公告基金份额持有人大会决议生效后向上海证券交易所申请复牌。

- 十一、持有人大会联系方式
1.深圳
联系人:郑小兰
联系电话:0756-83193188-3508
传真:0756-83196091

- 2.北京
联系人:张宇辉
联系电话:010-85633389-6501
传真:010-85225273

- 3.上海
联系人:阮艺力
联系电话:021-53699688-6515
传真:021-63513929

- 4.基金管理人全国客户服务热线:400-8886668(固话长途费)

- 5.基金管理人网址:www.dcfund.com.cn
附件一:《关于开业证券投资基金转型有关事项的议案》
附件二:《授权委托书》
附件三:《证券投资基金基金转型方案说明书》

大成基金管理有限公司
二〇〇六年十二月四日

附件一:
关于开业证券投资基金转型有关事项的议案
(审议稿)

开业证券投资基金持有人:
鉴于开业证券投资基金(下称“开业基金”)将于2007年3月30日到期,为维护基金份额持有人利益,根据《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》和《开业证券投资基金基金合同》的有关规定,基金管理人大成基金管理有限公司经与基金托管人中国农业银行协商一致,提议对开业基金实施转型。《开业证券投资基金转型方案说明书》见附件三。

为实施开业基金转型方案,提议授权基金管理人办理本次开业基金转型的有关具体事宜,包括但不限于根据市场情况确定转型的具体时间和方式,并可以在不涉及基金合同当事人权利义务关系变化对基金份额持有人利益无实质不利影响的前提下对《开业证券投资基金基金合同》进行必要的修改和补充。

以上议案,请予审议。
大成基金管理有限公司
二〇〇六年十一月十日

附件二:
授权委托书

兹委托 先生/女士代表本人(或本机构)于 年 月 日召开的开业证券投资基金基金份额持有人大会,并代为行使对以下所有议案的表决权。
委托人(签字/盖章):
个人委托身份证号码:
委托人持有基金份额数:
被授权人姓名:
被授权人身份证号码:
委托日期: 年 月 日
受托日期: 年 月 日
注:此授权委托书须填写完整或按以上格式自制并填写完整并签字盖章后均为有效。

附件三:
开业证券投资基金转型方案说明书

一、声明
1.鉴于开业证券投资基金(简称“开业基金”)基金合同将于2007年3月30日到期,为维护基金份额持有人利益,根据《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》和《开业证券投资基金基金合同》(简称“基金合同”)等有关规定,基金管理人(大成基金管理有限公司)经与基金托管人(中国农业银行)协商一致,决定召开基金份额持有人大会,审议关于开业证券投资基金转型有关事项的议案。

2.本次开业基金转型方案经参加相关持有人大会表决的基金份额持有人所持表决权的2/3以上通过,存在无法获得相关持有人大会表决通过的可能。

3.持有人大会表决通过的事项须经中国证监会核准,自中国证监会核准之日起生效,中国证监会对本次开业基金转型所作任何决定或意见,均不表明其对本次转型方案或本基金的价值投资者的收益做出实质性判断或保证。

二、基金转型类型及主要目标
基金转型方案的主要内容如下:
(一)转换基金运作方式
开业基金封闭运作基金转型为开放式基金,在完成有关转型程序后,基金管理人最近在60个工作日内开放日常申购、赎回。

(二)调整基金存续期限
基金存续期由2007年3月30日到期调整为无限期。

(三)转换上市交易并变更交易方式
基金转型后开放基金,需经核准上市交易,基金管理人经持有人大会授权后,将向上海证券交易所申请基金的上市交易。

基金终止上市后将向上海证券交易所上市交易后,基金管理人将进行基金份额更名以及必要的信息变更;中登公司将作为投资者办理基金份额的初始登记。在基金开放赎回业务后,原基金份额持有人可通过场内基金份额持有人大会或场外基金份额持有人大会行使表决权。

(四)调整基金的投资目标、投资范围和投资策略
1.投资目标
基金的投资目标是“在优化组合投资基础上,尽可能规避投资风险,谋求基金资产增值和收益的最大化”。

2.投资范围
基金的投资范围是“本基金的投资范围限于国内依法公开发行、上市的企业债券、债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股中成长性良好,发展前景广阔的上市公司”。

投资范围调整为“本基金的投资范围限于国内依法公开发行、上市的企业债券、债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股中成长性良好,发展前景广阔的上市公司”。

投资范围调整为“本基金的投资范围限于国内依法公开发行、上市的企业债券、债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股中成长性良好,发展前景广阔的上市公司”。

投资范围调整为“本基金的投资范围限于国内依法公开发行、上市的企业债券、债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股中成长性良好,发展前景广阔的上市公司”。

投资范围调整为“本基金的投资范围限于国内依法公开发行、上市的企业债券、债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股中成长性良好,发展前景广阔的上市公司”。

投资范围调整为“本基金的投资范围限于国内依法公开发行、上市的企业债券、债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股中成长性良好,发展前景广阔的上市公司”。

投资范围调整为“本基金的投资范围限于国内依法公开发行、上市的企业债券、债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股中成长性良好,发展前景广阔的上市公司”。

投资范围调整为“本基金的投资范围限于国内依法公开发行、上市的企业债券、债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股中成长性良好,发展前景广阔的上市公司”。

投资范围调整为“本基金的投资范围限于国内依法公开发行、上市的企业债券、债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股中成长性良好,发展前景广阔的上市公司”。

投资范围调整为“本基金的投资范围限于国内依法公开发行、上市的企业债券、债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股中成长性良好,发展前景广阔的上市公司”。

投资范围调整为“本基金的投资范围限于国内依法公开发行、上市的企业债券、债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股中成长性良好,发展前景广阔的上市公司”。

投资范围调整为“本基金的投资范围限于国内依法公开发行、上市的企业债券、债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股中成长性良好,发展前景广阔的上市公司”。

投资范围调整为“本基金的投资范围限于国内依法公开发行、上市的企业债券、债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股中成长性良好,发展前景广阔的上市公司”。

投资范围调整为“本基金的投资范围限于国内依法公开发行、上市的企业债券、债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股中成长性良好,发展前景广阔的上市公司”。

投资范围调整为“本基金的投资范围限于国内依法公开发行、上市的企业债券、债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股中成长性良好,发展前景广阔的上市公司”。

投资范围调整为“本基金的投资范围限于国内依法公开发行、上市的企业债券、债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股中成长性良好,发展前景广阔的上市公司”。

投资范围调整为“本基金的投资范围限于国内依法公开发行、上市的企业债券、债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股中成长性良好,发展前景广阔的上市公司”。

投资范围调整为“本基金的投资范围限于国内依法公开发行、上市的企业债券、债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股中成长性良好,发展前景广阔的上市公司”。

投资范围调整为“本基金的投资范围限于国内依法公开发行、上市的企业债券、债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股中成长性良好,发展前景广阔的上市公司”。

投资范围调整为“本基金的投资范围限于国内依法公开发行、上市的企业债券、债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股中成长性良好,发展前景广阔的上市公司”。

投资范围调整为“本基金的投资范围限于国内依法公开发行、上市的企业债券、债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股中成长性良好,发展前景广阔的上市公司”。

投资范围调整为“本基金的投资范围限于国内依法公开发行、上市的企业债券、债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股中成长性良好,发展前景广阔的上市公司”。

投资范围调整为“本基金的投资范围限于国内依法公开发行、上市的企业债券、债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股中成长性良好,发展前景广阔的上市公司”。

投资范围调整为“本基金的投资范围限于国内依法公开发行、上市的企业债券、债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股中成长性良好,发展前景广阔的上市公司”。

投资范围调整为“本基金的投资范围限于国内依法公开发行、上市的企业债券、债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股中成长性良好,发展前景广阔的上市公司”。

投资范围调整为“本基金的投资范围限于国内依法公开发行、上市的企业债券、债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股中成长性良好,发展前景广阔的上市公司”。

投资范围调整为“本基金的投资范围限于国内依法公开发行、上市的企业债券、债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股中成长性良好,发展前景广阔的上市公司”。

投资范围调整为“本基金的投资范围限于国内依法公开发行、上市的企业债券、债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股中成长性良好,发展前景广阔的上市公司”。

投资范围调整为“本基金的投资范围限于国内依法公开发行、上市的企业债券、债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股中成长性良好,发展前景广阔的上市公司”。

投资范围调整为“本基金的投资范围限于国内依法公开发行、上市的企业债券、债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股中成长性良好,发展前景广阔的上市公司”。

投资范围调整为“本基金的投资范围限于国内依法公开发行、上市的企业债券、债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股中成长性良好,发展前景广阔的上市公司”。

投资范围调整为“本基金的投资范围限于国内依法公开发行、上市的企业债券、债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股中成长性良好,发展前景广阔的上市公司”。

投资范围调整为“本基金的投资范围限于国内依法公开发行、上市的企业债券、债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股中成长性良好,发展前景广阔的上市公司”。

投资范围调整为“本基金的投资范围限于国内依法公开发行、上市的企业债券、债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股中成长性良好,发展前景广阔的上市公司”。

投资范围调整为“本基金的投资范围限于国内依法公开发行、上市的企业债券、债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股中成长性良好,发展前景广阔的上市公司”。

投资范围调整为“本基金的投资范围限于国内依法公开发行、上市的企业债券、债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股中成长性良好,发展前景广阔的上市公司”。

投资范围和调整为:
“本基金的投资范围限于国内依法发行的股票、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股中成长性良好,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资产比例范围为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%。

如法律法规或中国证监会修改对基金投资范围的规定,基金管理人将在履行相应程序后,可依据新的规定修订本基金的投资范围,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。”

3.投资策略
基金投资策略策略:
“1.在选择投资对象时,重点关注信息产业、媒体、生物制药、环保、新材料等新兴产业中成长性良好,具有一流技术含量的企业。同时,也适当关注传统产业中成长性良好以及向新兴产业转型的企业。
2.中长线投资为主,辅以适当的短线操作,降低投资风险。
3.在建立投资组合时,注重投资对象的良好流动性和投资组合的合理分散性。”

投资策略调整为:
“1.资产配置策略
本基金将根据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、实际汇率、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具体变动趋势进行定量分析,做出资产配置决策。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
本基金将通过深入、科学的基本面分析,挖掘具有良好成长性的上市公司。

(1)财务分析策略
企业的历史财务表现不能全面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。本基金将通过对比上市公司过去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,建立基金初始投资组合。

(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)具有较强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发费用支出、研究成果转化为企业盈利的能力和效率、研发投入、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具体变动趋势进行定量分析,做出资产配置决策。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)企业充分消耗升级、产业升级、汇率改革等中国经济结构性变化中获取收益,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,且保持长期发展的上市公司。
4)通过整合内部资源,加强企业经营管理措施,企业盈利能力将在未来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,有明显重组、并购计划或在机会,且重组、并购将显著提升上市公司核心竞争力、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)国企改革预期。国际经济形势变化等因素将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、业务模式等特点,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。估值比较将主要从两方面对投资价值进行评价:一是上市公司在其所处行业的相对估值水平;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良好,具有较强技术创新能力,以及传统产业中成长性良好或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关注的上市公司,公司投资研究团队将实施调研上市公司,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对业绩数据真实性等。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应商、下游客户、竞争对手和基金合作伙伴,以及税务、海关等行政管理部门调研讨论并核实。

(5)建立投资组合
本基金将采取买入并持有策略的基础上,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,本基金还将注重对投资对象的交易活跃程度,以保证投资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良好流动性和短期投资价值的品种的短线操作,提高组合收益。

3.固定收益基金投资策略
本基金对固定收益类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,本基金采取买入价差策略、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,获取超额收益。

(六)建立投资组合
本基金将采取买入并持有策略的基础上,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,本基金还将注重对投资对象的交易活跃程度,以保证投资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良好流动性和短期投资价值的品种的短线操作,提高组合收益。

3.固定收益基金投资策略
本基金对固定收益类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,本基金采取买入价差策略、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,获取超额收益。

(六)建立投资组合
本基金将采取买入并持有策略的基础上,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,本基金还将注重对投资对象的交易活跃程度,以保证投资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良好流动性和短期投资价值的品种的短线操作,提高组合收益。

3.固定收益基金投资策略
本基金对固定收益类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,本基金采取买入价差策略、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,获取超额收益。

(六)建立投资组合
本基金将采取买入并持有策略的基础上,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,本基金还将注重对投资对象的交易活跃程度,以保证投资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良好流动性和短期投资价值的品种的短线操作,提高组合收益。

3.固定收益基金投资策略
本基金对固定收益类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,本基金采取买入价差策略、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,获取超额收益。

(六)建立投资组合
本基金将采取买入并持有策略的基础上,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,本基金还将注重对投资对象的交易活跃程度,以保证投资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良好流动性和短期投资价值的品种的短线操作,提高组合收益。

3.固定收益基金投资策略
本基金对固定收益类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,本基金采取买入价差策略、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,获取超额收益。

(六)建立投资组合
本基金将采取买入并持有策略的基础上,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,本基金还将注重对投资对象的交易活跃程度,以保证投资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良好流动性和短期投资价值的品种的短线操作,提高组合收益。

3.固定收益基金投资策略
本基金对固定收益类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,本基金采取买入价差策略、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,获取超额收益。

(六)建立投资组合
本基金将采取买入并持有策略的基础上,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,本基金还将注重对投资对象的交易活跃程度,以保证投资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良好流动性和短期投资价值的品种的短线操作,提高组合收益。

3.固定收益基金投资策略
本基金对固定收益类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,本基金采取买入价差策略、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,获取超额收益。

(六)建立投资组合
本基金将采取买入并持有策略的基础上,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,本基金还将注重对投资对象的交易活跃程度,以保证投资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良好流动性和短期投资价值的品种的短线操作,提高组合收益。

3.固定收益基金投资策略
本基金对固定收益类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,本基金采取买入价差策略、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,获取超额收益。

(六)建立投资组合
本基金将采取买入并持有策略的基础上,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,本基金还将注重对投资对象的交易活跃程度,以保证投资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良好流动性和短期投资价值的品种的短线操作,提高组合收益。

3.固定收益基金投资策略
本基金对固定收益类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,本基金采取买入价差策略、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,获取超额收益。

(六)建立投资组合
本基金将采取买入并持有策略的基础上,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,本基金还将注重对投资对象的交易活跃程度,以保证投资组合具有良好的流动性。

州豫源基金和天津创业基金等6只基金经规范调整后合并而成的契约封闭式基金。

基金发起人于大成基金管理有限公司和天津信托投资公司。基金管理人于大成基金管理有限公司,基金托管人于大成基金管理有限公司和天津信托投资公司。基金管理人于大成基金管理有限公司,基金托管人于大成基金管理有限公司。

基金于2001年12月19日在上海证券交易所挂牌上市时总份额为372,874,343份。基金于2002年2月29日完成扩募后总份额增至5亿份,基金存续期延长5年至2007年3月30日。

(二)基金业绩表现
开业基金为投资者带来了较好回报,2006年11月3日累计基金份额净值为1.4237元。截止2006年10月底,基金自2002年3月完成扩募以来累计净值增长率达到79.71%,今年以来净值增长率为54.82%