大成债券投资基金

更新的招募说明书摘要

2006年第2号

基金管理人:大成基金管理有限公司　　基金托管人:中国农业银行

重要提示

大成债券投资基金（以下简称“本基金”）经中国证券监督管理委员会证监基金字【2003】44号文核准募集,本基金基金合同于2003年6月12日生效。本基金为契约型开放式基金。

本基金管理人保证更新的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做出的任何决定,均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。

投资有风险,投资人申购基金时应认真阅读本更新的招募说明书。基金的过往业绩并不预示其未来表现。

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。基金投资人自依基金合同取得基金份额,即成为基金份额持有人和本基金合同的当事人,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》(以下简称“《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。基金投资人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,也不保证最低收益。

本招募说明书(更新)所载内容截至日为2006年12月12日,有关财务数据和净值表现截止日为2006年9月30日,本报告中所列财务数据未经审计。

一、基金管理人

(一)基金管理人概况

本基金管理人大成基金管理有限公司是经中国证监会证监基金字[1999]10号文批准发起设立,概况介绍如下:

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:胡学光

成立日:1999年4月12日

注册资本:1亿元人民币

股权结构:公司股东为中泰信托投资有限责任公司(持股48%)、中国银河证券有限责任公司(持股25%)、光大证券股份有限公司(持股25%)、广东证券股份有限公司(持股2%)。

电话:0755-83183388

传真:0755-83199588

联系人:李宏伟

大成基金管理有限公司设有股东会、董事会、监事会,下设十一个部门,分别是投资部、交易部、金融工程部、规划发展部、委托投资部、市场部、监察稽核部、信息技术部、基金运营部、客户服务中心和综合管理部;此外,还设立了投资决策委员会和风险控制委员会。

公司拥有一支充满活力的高素质、高学历、具备丰富市场经验的专家队伍,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。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,力求为投资人获得更大投资回报。

(二)证券投资基金管理情况

截至2006年12月12日,本基金管理人共管理5只封闭式证券投资基金:基金景宏、基金景阳、基金景博、基金景福、基金景业,以及7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。

(三)主要人员情况

1、公司高级管理人员

董事会:

胡学光先生,董事长,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月起任大成基金管理有限公司董事长。

于华先生,董事,总经理,工商管理硕士,金融博士,美国注册金融分析师(CFA),1989年-1991年,任英国里丁大学经济系金融财务讲师;1991年-1997年,加拿大魁北克大学管理学院金融终身教授;1997年-2000年,任深圳证券交易所综合研究所所长;2000年-2004年1月,任加拿大鲍尔集团亚太分公司基金与保险业务副总裁,加拿大伦敦人寿保险公司北京代表处首席代表;现任中国证券业协会基金业委员会委员;2004年1月起任大成基金管理有限公司总经理。

王政先生,董事,大学本科。曾任职于人民日报社理论部,1992年后调人民日报社事业发展局(部)工作。1991年-1999年,历任广联(南宁)投资股份有限公司总经理助理、副总经理、总经理;2000年-2002年,任海南民生燃气(集团)股份有限公司董事、总经理;1999年-2001年,任中国华闻投资控股有限公司常务副总裁;2001年至今,任中泰信托投资有限责任公司总裁。

徐浩明先生,董事,硕士研究生。1988年7月-1991年4月,任职于上海体制改革研究所;1991年4月-2000年6月,历任交通银行研究开发部副主任科员、主任科员,办公室综合处副处长、处长,党委办公室综合处处长兼党委秘书;2000年6月-2003年2月,历任中国光大集团有限公司董事会秘书,执董办及党办副主任,办公厅、党办、执董办主任;2002年9月起任光大证券股份有限公司董事;2003年2月至今,任光大证券股份有限公司董事、副总裁、总裁。

王长林先生,董事,研究生,高级经济师。曾任中国农业银行天津分行计划处副处长、信息中心副总经理,中国长城信托投资公司计划财务部总经理。现任中国银河证券有限责任公司财务资金部总经理。

杨建文先生,独立董事,经济学博士。1982年-1996年,上海社会科学院经济研究所研究室主任;1996年至今,上海社会科学院部门经济研究所副所长,总支书记;目前兼任上海市工商联(商会)副会长、上海市人民政府决策咨询研究专家、上海市国有资产规划投资委员会常任委员、上海市对外文化交流协会经济金融分会召集人、上海国际金融研究中心执行理事、上海社会科学院金融研究中心主任。

胡春元先生,独立董事,经济学(会计)博士,中国注册会计师。1991年-1994年,在厦门大学会计师事务所兼职,任审计员;1994年-1995年,任厦门会计师事务所项目经理;1996年-1997年,在深圳大华天诚会计师事务所兼职从事审计与管理咨询工作;1997年11月起,在深圳大华天诚会计师事务所专职从事审计与管理咨询工作,历任经理、合伙人(1999)、高级合伙人、注册会计师。

查竞传先生,独立董事,比较法硕士,美国纽约州注册律师,1984年创办竞诚国际律师事务所,1984年-1994年兼任台湾大学纽约校友会理事,1988年-1992兼任纽约华人参政会理事、会长,1991年-1996年兼任银川市人民政府顾问,1992年-1996年兼任台湾国民大会代表,1999年-2001年兼任中国大学生创业投资大赛评委、清华大学创业投资大赛顾问或评委,现任美国竞诚国际律师事务所纽约总部合伙人兼北京代表处首席代表。

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,上海市浦发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。

监事会:

周洪先生,监事长,经济学博士,1988年8月-1994年8月,任山东财政学院经贸系副主任、副教授;1994年9月-1995年8月北京大学西方经济学博士研究生;1995年9月-1998年8月在光大证券股份有限公司工作,历任研究部负责人、办公室副主任、总裁办主任、总裁助理职务;1998年9月起参与大成基金管理有限公司的筹建,1999年3月-2005年5月,任大成基金管理有限公司副总经理。

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月至今,任职于财政部离退休老干部局。

沈烁先生,监事,法学学士。1993年7月—1997年6月任职于福建九州商社有限公司,企业管理部、法律顾问室经理助理,1997年7月—2002年2月任职于厦门联合信托投资公司,法律事务部总经理,2002年3月至今任中泰信托投资责任公司,法律事务部总经理兼稽核审计部副总经理。

其他高级管理人员:

周一烽先生,副总经理,经济学硕士。1984年-1992年,历任上海市社会科学院经济研究所研究员、宏观经济研究室副主任、上海企业发展研究所副所长;1992年起历任广联(南宁)投资有限公司总经理特别助理及证券投资业务负责人、上海广联投资有限公司总经理;2001年起任中泰信托投资有限责任公司副总裁;2005年4月任大成基金管理有限公司任助理总经理,2006年5月起任大成基金管理有限公司副总经理。

王颢先生,副总经理,国际工商管理专业博士。1993年2月-1994年2月,任安信财务顾问公司项目经理;1994年2月-1995年10月,任中国爱地集团贸易二部副经理;1995年10月-1997年3月,任深圳市瑞应实业公司经理;1997年3月-2000年12月,任深圳鑫光华事业发展公司总经理;2000年12月-2002年9月,任国通证券深圳管理总部副总经理、机构管理部副总经理;2002年9月-2004年6月,任大成基金管理有限公司助理总经理;2004年7月起任大成基金管理有限公司副总经理。

李宏伟先生,董事会秘书兼助理总经理,法学硕士。1991年7月-1992年5月,任南京旭普电子有限公司总经理助理;1992年6月-1997年2月,任深圳金地(集团)股份有限公司总经理办公室主任、董事会秘书、发展委主任;1997年3月-1998年4月,任光大证券股份有限公司深圳营业部副总经理;1998年5月-2003年12月,任南方基金管理有限公司综合管理部及市场部高级经理;2004年1月至今,任大成基金管理有限公司董事会秘书兼助理总经理。

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月一至今,任大成基金管理有限公司督察长兼监察稽核部总监。

田宇飚先生,助理总经理,研究生学历。1991年8月-1994年3月,任职于中国新技术创业投资公司,从事信贷、资金、证券投资及中国置业基金、亚洲开发银行的项目评估等工作;1994年5月起历任华夏证券有限公司海口营业部驻北京办事处负责人、华夏期货经纪公司北京营业部总经理、负责海南银通受益券管理人更换、参与筹建华夏基金管理公司;1999年3月-1999年12月,任大成基金管理有限公司综合部经理;2000年1月至今,任大成基金管理有限公司助理总经理。

2、基金经理

(1)现任基金经理

陈尚前先生,基金经理,南开大学经济学博士,9年债券从业经历。曾任中国平安保险公司投资管理中心债券投资室主任和招商证券公司研究发展中心策略部经理。2002年加盟大成基金管理有限公司,现任公司投资部副总监,负责公司固定收益证券投资业务。自本基金成立日2003年6月12日至今担任本基金经理。

(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六名成员组成,设主任和执行主任各一名,其他委员四名。名单如下:

于华,总经理,投资决策委员会主任;周一烽,副总经理兼投资总监,投资决策委员会执行主任;刘明,投资部副总监兼股票投资主管,投资决策委员会委员和基金景宏基金经理;卢纪平,交易部总监,投资决策委员会委员;王加英,投资部总监助理兼研究主管,投资决策委员会委员;瞿蕴理,投资部策略小组组长兼基金景业和大成财富管理2020生命周期基金基金经理,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)基金托管人概况

基金托管人:中国农业银行

法定代表人:杨明生

注册资本:361亿元人民币

住所:北京市海淀区复兴路甲23号

办公地址:北京市西三环北路100号金玉大厦

组织形式:国有独资企业

营业期限:持续经营

(二)主要人员情况

杨明生先生:中国农业银行党委书记、行长。50岁,硕士研究生、高级经济师。曾任中国农业银行辽宁省分行办公室副主任,农行沈阳市分行副行长、党组成员,农行工业信贷部主任助理、副主任、主任,农行天津市分行副行长、党组副书记(主持工作),农行天津市分行行长、党组书记,农行副行长、党委副书记。现任农行党委书记、行长。

杨琨先生:中国农业银行副行长。47岁,硕士研究生、高级经济师。曾任中国农业银行人事部劳动工资处处长,农行人事教育部副主任,农行市场开发部总经理,农行安徽省分行行长、党委书记。现任中国农业银行副行长。

张军洲先生:基金托管部总经理。43岁,博士,高级经济师,曾任中国农业银行信托投资公司总经理助理、副总经理,农行总行法律事务部副总经理、总经理。现任基金托管部总经理。

刘树军先生:基金托管部副总经理。46岁,工商管理硕士,高级经济师、高级记者。曾任中国农业银行长春分行办公室主任、农行总行办公室正处级秘书,农行总行信贷部工业信贷处处长。现任基金托管部副总经理。

余晓晨先生:托管业务部副总经理。42岁,经济学硕士、高级经济师。曾任香港农银证券公司总经理、托管业务部市场开发处处长、境外资产托管处处长、委托资产托管处处长。现任托管业务部副总经理。

(三)证券投资基金托管业务情况

1、部门设置及员工:1998年5月,中国农业银行证券投资基金托管部经中国证监会和中国人民银行批准成立,2004年9月更名为托管业务部,内设技术保障处、营运中心、委托资产托管处、证券投资基金托管处、综合管理处、风险管理处、境外资产托管处和投资银行处,拥有先进的安全防范设施和基金清算、核算、交易监督快捷处理系统,现有员工79名。

2、基金托管业务经营情况

截止2006年9月30日,中国农业银行托管的封闭式证券投资基金和开放式证券投资基金共43只,基金裕阳、基金裕隆、基金汉盛、基金景阳、基金景博、基金景福、基金天华、基金同德、基金景业、基金鸿阳、基金丰和、基金久嘉、富国动态平衡开放式基金、长盛成长价值开放式基金、宝盈鸿利收益开放式基金、大成价值增长开放式基金、大成债券开放式基金、银河稳健开放式基金、银河收益开放式基金、长盛债券开放式基金、长信利息收益开放式基金、长盛动态精选开放式基金、景顺长城内需增长开放式基金、万家保本增值开放式基金、大成精选增值混合型证券投资基金、长信银利精选开放式基金、富国天瑞强势开放式基金、鹏华货币市场基金、国联分红增利开放式基金、国泰货币市场基金、新世纪优选分红证券投资基金、交银施罗德精选股票证券投资基金、泰达荷银货币市场基金、交银施罗德货币市场基金、景顺长城资源垄断股票型证券投资基金(LOF)、信诚四季红混合型证券投资基金、富兰克林国海弹性市值股票型证券投资基金、大成沪深300指数证券投资基金、富国天时货币市场基金、益民货币市场基金、华夏平稳增长混合型证券投资基金、长城安心回报混合型证券投资基金、中邮核心精选股票型证券投资基金,托管基金份额达539亿份。

三、相关服务机构

(一)销售机构及联系人

1、直销机构:

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:胡学光

电话:0755-83183388

传真:0755-83199588

联系人:杨春明

公司网址:www.dcfund.com.cn

全国统一客户服务号码:400-888-5558(免固话长途费)

2、代销机构

(1)中国农业银行

注册地址:北京市海淀区复兴路甲23号

办公地址:北京市西三环北路100号金玉大厦7—8层

法定代表人:杨明生

客服电话:95599

电话:010-68297268

传真:010-68297268

联系人:68424199

信息披露负责人:李芳菲

网址:www.abchina.com

(2)交通银行

办公地址:上海市浦东新区银城中路188号

法定代表人:蒋超良

客服电话:95559

联系电话:021-58408842

传真:(021)58408836

联系人:曹榕

网址:www.bankcomm.com

(3)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甲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

客户服务电话:95568

传真:(8610)58560794

联系电话:(8610)58560758,58560666-8988

联系人:吴杰

网站:www.cmbc.com.cn

(4)广东证券股份有限公司

注册地址:广州市解放南路123号金汇大厦

法定代表人:钟伟华

客户服务电话:020-96210

联系人:陈新

网址:www.stock2000.com.cn

(5)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:上海市延平路135号

法定代表人:祝幼一

客户服务电话:400-8888-666

电话:021-62580818-177

传真:021-62583439

联系人:芮敏祺

网站:www.gtja.com

(6)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:黎晓宏

客户服务电话:400-8888-108

电话:010-65183888

联系人:魏明

网站:www.csc108.com

(7)国信证券有限责任公司

注册地址:深圳市罗湖区红岭中路1012号国信证券大厦16-26层

法定代表人:何如

客户服务电话:800-810-8868

电话:0755-82130833转2181

传真:0755-82133302

联系人:林建闽

网址:www.guosen.com.cn

(8)兴业证券股份有限公司

注册地址:福建福州湖东路99号标力大厦

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

(9)长江证券有限责任公司

注册地址:武汉市新华下路特8号

法定代表人:明云成

电话:027-65799560

传真:027-85481532

联系人:梅萍

网址:www.cjsc.com.cn

(10)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

电话:010-84864818-63266

传真:010-84865560

联系人:陈忠

网址:www.ecitic.com

(11)中国银河证券有限责任公司

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:朱利

客户服务电话:010-68016655

联系人:郭京华

网址::www.chinastock.com.cn

(12)申银万国证券股份有限公司

通讯地址:上海市常熟路171号

法定代表人:王明权

客户服务电话:021-962505

电话:021-54038844

联系人:孙洪喜

网址:www.sw2000.com.cn

(13)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

办公地址:广州市天河区天河北路183号大都会广场36、38、41、42楼

法定代表人:王志伟

客户服务电话:020-87555888转各营业网点

电话:020-87555888-875

传真:020-87557985

联系人:肖中梅

网站:www.gf.com.cn

(14)中信万通证券有限责任公司

注册地址:青岛市东海西路28号

法定代表人:史洁民

客户服务电话:0532-5022026

联系人:陈向东

网站:www.wtzq.com.cn

(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:上海市广东路689号海通证券大厦19楼12-07单元

法定代表人:胡学光

电话:021-53599588

传真:021-63513900

联系人:徐生沪、焦珺

(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

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:上海市浦东新区东昌路568号

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:汪棣、薛竞

电话:(021)61238888

传真:(021)61238800

联系人:陈兆欣

四、基金的名称

大成债券投资基金

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

在力保本金安全和保持资产流动性基础上追求资产的长期稳定增值。

八、基金的投资方向

投资于债券类资产部分(包括流动性良好的、国内市场依法发行及交易的国债、金融债、公司债、企业债、可转换债券、正逆回购等,以及中国证监会允许基金投资的其他金融工具)不低于基金资产总值80%,本基金还可择机进行新股申购,但新股投资比例不超过基金资产总值20%。

九、基金的投资策略

本基金通过整体资产配置、类属资产配置和个券选择三个层次进行投资管理,以实现投资目标。具体按照如下步骤执行:

1、在整体资产配置层次上,通过对宏观经济、市场利率、债券供求、情景分析、申购、赎回现金流情况等因素的综合分析,决定债券、逆回购、现金三类资产的配置比例。

2、在类属资产配置层次,根据市场和类属资产的风险收益特征,将市场细分为交易所国债、交易所企业债、银行间国债、银行间金融债四个子市场。在此基础上运用修正的均值-方差等模型,定期对投资组合类属资产进行最优化配置和调整,确定类属资产的最优权重。

3、在债券选择上,采取积极策略,包括利率预期策略、收益率曲线策略、收益率利差策略等。

4、本基金在满足基金日常申购、赎回流动性基础上根据新股基本面研究择机进行新股申购。

基金管理人可根据债券市场的变化对市场细分与模型运用等进行适当调整。

十、基金的业绩比较基准

中国债券总指数

十一、基金的风险收益特征

本基金80%以上投资于债券,为债券基金,预期收益和风险高于货币市场基金,低于混合型基金和股票基金。

十二、基金的投资组合报告(截至2006年9月30日)

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,保证本报告所载内容不存在虚假记录、误导性陈述或重大遗漏。

基金托管人中国农业银行根据本基金合同规定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2006年9月30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

项目	金额(元)	占基金资产总值比例
银行存款和清算备付金合计	50,025,374.34	3.16%
股票	60,464,613.12	3.82%
债券	1,452,037,957.97	91.74%
权证	0.00	0.00%
其他资产	20,247,936.97	1.28%
合计	1,582,775,882.40	100.00%

(二)报告期末按行业分类的股票投资组合

行业	市值(元)	占基金资产净值比例
A 农、林、牧、渔业	629,900.00	0.05%
B 采掘业	10,422,196.74	0.81%
C 制造业	23,137,671.13	1.79%
C0 食品、饮料	0.00	0.00%
C1 纺织、服装、皮毛	0.00	0.00%
C2 木材、家具	0.00	0.00%
C3 造纸、印刷	0.00	0.00%
C4 石油、化学、塑胶、塑料	21,747,108.00	1.68%
C5 电子	1,390,563.13	0.11%
C6 金属、非金属	0.00	0.00%
C7 机械、设备、仪表	0.00	0.00%
C8 医药、生物制品	0.00	0.00%
C99 其他制造业	0.00	0.00%
D 电力、煤气及水的生产和供应业	0.00	0.00%
E 建筑业	0.00	0.00%
F 交通运输、仓储业	0.00	0.00%
G 信息技术业	0.00	0.00%
H 批发和零售贸易	0.00	0.00%
I 金融、保险业	15,703,294.32	1.22%
J 房地产业	8,894,616.00	0.69%
K 社会服务业	1,676,934.93	0.13%
L 传播与文化产业	0.00	0.00%
M 综合类	0.00	0.00%
合计	60,464,613.12	4.69%

(三)报告期末按市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)	市值(元)	市值占基金资产净值比例	备注
1	000936	G 华西村	5,436,777	21,747,108.00	1.69%	债转股
2	601988	中国银行	4,715,704	15,703,294.32	1.22%	申购新股
3	601588	北辰实业	3,706,090	8,894,616.00	0.69%	申购新股
4	601699	潞安能源	515,000	6,844,350.00	0.53%	申购新股
5	601001	大同煤业	453,466	3,577,846.74	0.28%	申购新股
6	002051	中工国际	116,373	1,676,934.93	0.13%	申购新股
7	002056	横店东磁	80,519	1,390,563.13	0.11%	申购新股
8	002069	獐子岛	10,000	629,900.00	0.05%	申购新股

(四)报告期末按券种分类的债券投资组合

序号	债券品种	市值(元)	占基金资产净值比例
1	国　债	262,171,975.20	20.31%
2	金融债	271,759,400.00	21.06%
3	央行票据	98,036,065.22	7.60%
4	企业债	687,535,771.36	53.27%
5	可转债	44,534,746.19	3.45%
6	其他债券	88,000,000.00	6.82%
	合　计	1,452,037,957.97	112.51%

(五)报告期末按市值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券明细

序号	债券名称	市值(元)	占基金资产净值比例
1	05工行03	235,416,577.53	18.24%
2	02国债(14)	150,295,876.80	11.65%
3	20国债(10)	111,876,098.40	8.67%
4	05中行02浮	100,650,000.00	7.80%
5	06联通CP02	100,054,130.13	7.75%

(六)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无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。

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

项目	金额(元)
交易保证金	410,000.00
应收证券清算款	1,665,113.94
应收利息	17,470,337.60
应收申购款	702,485.43
合计	20,247,936.97

4、报告期末基金持有的处于转股期的可转换债券明细

债券代码	债券名称	市值(元)	占基金资产净值比例
125959	首钢转债	44,534,746.19	3.45%

5、权证投资情况

无。

6、报告期末按市值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券明细

代码	名称	市值(元)	占基金资产净值比例
119006	宁建01	11,000,000.00	0.85%
119007	宁建02	10,000,000.00	0.77%
119008	宁建03	23,000,000.00	1.78%
119009	宁建04	24,000,000.00	1.86%
119010	天电收益	20,000,000.00	1.55%

7、本报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金情况

无。

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。

本基金基金合同于2003年6月12日生效,基金合同生效以来的投资业绩及与同期基准的比较如下表所示:

A、B类

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
2003.06.12-2003.12.31	2.90%	0.16%	-1.41%	0.29%	4.31%	-0.13%
2004.01.01-2004.12.31	1.81%	0.32%	-3.32%	0.35%	5.13%	-0.03%
2005.01.01-2005.12.31	11.33%	0.29%	10.55%	0.21%	0.78%	0.08%
2006.01.01-2006.09.30	3.88%	0.11%	1.89%	0.11%	1.99%	0.00%
2003.06.12-2006.09.30	21.16%	0.25%	8.37%	0.26%	12.79%	-0.01%

C类

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
2003.06.12-2003.12.31	2.90%	0.16%	-1.41%	0.29%	4.31%	-0.13%
2004.01.01-2004.12.31	1.81%	0.32%	-3.32%	0.35%	5.13%	-0.03%
2005.01.01-2005.12.31	11.33%	0.29%	10.55%	0.21%	0.78%	0.08%
2006.01.01-2006.09.30	3.62%	0.11%	1.89%	0.11%	1.73%	0.00%
2003.06.12-2006.09.30	20.86%	0.25%	8.37%	0.26%	12.49%	-0.01%

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

在通常情况下,基金管理费按前一日基金资产净值的0.7%的年费率计提。计算方法如下:

H=E×0.7%÷当年天数;

H为每日应付的基金管理费;

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,由基金托管人于次月的前两个工作日内从基金资产中一次性支付给基金管理人。

(2)基金托管人的托管费

基金托管人的托管费按前一日的基金资产净值的0.20%的年费率计提。计算方法如下:

H=E×0.20%÷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,逐日累计至每月月末,按月支付,由基金托管人于次月的前两个工作日内从基金资产中一次性支取。

(3)上述(一)基金费用中第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,列入当期费用,由基金托管人从基金资产中支付。

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

基金管理人与基金托管人可根据市场和基金发展情况磋商酌情降低基金管理费及基金托管费,经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)与基金销售相关费用

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。

(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。投资者选择持续性收费模式,不收取申购费、赎回费。

(2)投资者选择交纳前端申购费时,按申购金额1.5%收取申购费。

(3)投资者选择交纳后端申购费时,按照持有时间采用比例费率,并随持有时间递减,具体如下表所示:

持有基金时间	后端
1年以内	2.0%
1年以上、2年以内(含1年)	1.5%
2年以上、3年以内(含2年)	1.0%
3年以上、5年以内(含3年)	0.5%
5年以上(含5年)	0

2、赎回费率

赎回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。

在前端和后端收费形式下,本基金的赎回费率为赎回基金总额的0.25%,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用总额的25%。

投资者选择持续性收费模式,不收取申购费、赎回费。

3、销售服务费

投资者选择持续性收费模式,不收取申购费、赎回费,而是按照0.30%/年的年费率从该类基金份额对应的基金财产中按日计提持续性销售服务费。

计算方法如下:

每日销售服务费=该收费模式下前一日基金资产净值总额×销售服务费率/年计提天数

销售服务费每日计算,逐日累计至每月月末,按月支付,由基金托管人于次月的前两个工作日内从基金资产中一次性支付给基金管理人。

销售服务费用于支付基金的营销费用和基金份额持有人服务费等。基金管理人须在招募说明书或最新的更新的招募说明书、基金份额发售公告或其它公告中予以载明,并需在定期的监察稽核报告、基金的半年度报告和年度报告里,依法对持续性销售服务费的计提、列支等情况进行专项说明。

对于采用持续性销售服务费模式的新的申购,每笔申购的最低金额为人民币1000元。

4、基金管理人可根据市场情况调整本基金的申购和赎回费率,调整结果将至少提前两日在至少一种中国证监会指定的媒体上公告。

5、基金转换费用:

详情请见“八、基金转换”(更新招募说明书全文)。

(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》及其它有关法律法规的要求及《基金合同》的规定,对2006年7月15日公布的《大成债券投资基金更新的招募说明书(2006年第1号)》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:

(1)更新了基金管理人管理基金的数目及名称,增加了新成立的大成财富管理2020生命周期证券投资基金

(2)“基金经理”增加了历任基金经理。

2、在“四、基金托管人”部分,更新了基金托管人托管基金只数及规模等相关信息。

3、在“五、相关服务机构”部分,更新了直销机构和代销机构的相关信息;

4、在“九、基金的投资”部分,更新了基金投资组合报告的内容;

5、在“十、基金业绩”部分,更新了基金业绩的内容;

6、在“二十二、其它应披露的事项”中披露了如下事项:

“(一)本基金管理人、基金托管人目前无重大诉讼事项。

(二)最近3年本基金管理人、基金托管人及高级管理人员没有受到任何处罚。

(三)2006年6月13日至2006年12月12日发布的公告:

1、2006年6月30日发布的《大成基金管理有限公司关于旗下部分基金申购中国银行A股的公告》;

2、2006年7月6日发布的《大成基金管理有限公司关于旗下部分基金投资资产支持证券的公告》;

3、2006年7月15日发布的《大成债券投资基金更新的招募说明书(2006年第1号)》、《大成债券投资基金更新的招募说明书摘要(2006年第1号)》;

4、2006年7月21日发布的《大成债券投资基金2006年第2季度报告》;

5、2006年8月29日发布的《大成债券投资基金2006年半年度报告》、大成债券投资基金2006年半年度报告摘要》;

6、2006年9月11日发布的《大成债券投资基金第十二次分红公告》;

7、2006年10月9日发布的《大成基金关于旗下部分基金申购北辰实业A股的公告》;

8、2006年10月25日发布的《大成债券投资基金第十三次分红公告》;

9、2006年10月26日发布的《大成债券投资基金2006年第3季度报告》;

10、2006年11月2日发布的《关于旗下开放式基金在交通银行开展网上银行申购费率优惠的公告》。

(四)《招募说明书》及在此之前公告的更新的招募说明书与本次更新的招募说明书内容若有不一致之处,以本次更新的招募说明书为准。”

大成基金管理有限公司

2007年1月23日

关于融通蓝筹成长证券投资基金暂停申购及基金转换入业务的公告

鉴于目前广大投资者踊跃申购本基金,致使本基金规模增长过快,根据《证券投资基金法》、《证券投资基金运作管理办法》及《融通通利系列证券投资基金基金合同》的有关规定,为保护现持有人的利益,基金管理人决定自2007年1月23日(含)至2007年1月29日暂停本基金的申购及基金转换入业务。

投资者可登陆融通基金管理有限公司网站(www.rtfund.com)或拨打客户服务电话(0755-26948088)咨询相关情况。

融通基金管理有限公司

2007年1月23日

证券代码:600067　　证券简称:冠城大通　　编号:临2007—003

#