大成蓝筹稳健证券投资基金

更新的招募说明书摘要

基金管理人:大成基金管理有限公司 基金托管人:中国银行股份有限公司

重 要 提 示

大成蓝筹稳健证券投资基金(以下简称"本基金")经中国证监会证监基金字【2004】36号文核准募集,基金合同于2004年6月3日正式生效。

本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。

本摘要根据基金合同和基金的招募说明书编写,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《证券投资基金法》、《证券投资基金运作办法》、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。

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财产,但不保证基金一定盈利,也不保证最低收益。

投资人申购本基金时应认真阅读招募说明书。

投资有风险,过往业绩并不预示其未来表现。

本摘要所载内容截止日为2007年6月3日,有关基金净值表现截止日为2007年3月31日,有关基金投资组合及财务数据截止日为2007年3月31日,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: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。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2007年6月3日,本基金管理人共管理4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,及8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和大成积极成长股票型证券投资基金。

(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年至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年至1991年,任英国里丁大学经济系金融财务讲师;1991年至1997年,加拿大魁北克大学管理学院金融终身教授;1997年至2000年,任深圳证券交易所综合研究所所长;2000年至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。

蔡红标先生,董事,中共党员,经济学博士。1994年02月至1997年02月,任华泰证券有限责任公司业务主任。1997年3月至1997年6月,任深圳证券交易所综合研究所研究员。1997年06月至1997年09月,任招商证券有限责任公司研究部研究员。1997年10月至2000年05月,任联合证券有限责任公司研究部副总经理级研究员,分管公司证券市场研究咨询业务。2000年6月至2001年11月,任二十一世纪科技投资有限公司(招商银行控股)证券投资部副总经理。2001年11月至今,在中国华闽投资控股有限公司,任总裁助理、计划部副总经理,担任联合证券有限责任公司董事、中国人民健康保险股份有限公司董事、中国财产再保险股份有限公司监事。

徐浩明先生,董事,硕士研究生。1988年7月至1991年4月,任职于上海体制改革研究所;1991年4月至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月至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月起始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年至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年至1994年,在厦门大学会计师事务所兼职,任审计员;1994年至1995年,任厦门会计师事务所项目经理;1996年至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年至1994年兼任台湾大学纽约校友会理事,1988年至1992兼任纽约华人参政会理事、会长,1991年至1996年兼任银川市人民政府顾问,1992年至1996年兼任台湾国民大会代表,1999年至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。1995年至2006年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,2006年任上海邦信阳律师事务所北京分所资深顾问。

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月至1994年8月,任山东财政学院经贸系副主任、副教授;1994年9月至1995年8月北京大学西方经济学博士研究生;1995年9月至1998年8月在光大证券有限公司工作,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月至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月至1987年6月,任财政部人教司副处长、处长;1987年6月至1994年6月,任财政部行政司副司长、司长;1994年6月至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。

沈原先生,监事,法学学士。1993年7月至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月至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有限责任公司,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:

周一锋先生,副总经理,经济学硕士。1984年至1992年,历任上海市社会科学院经济研究所研究人员、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。2000年12月至2002年9月,任招商证券深圳管理总部副总经理、机构管理部副总经理;2002年9月至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月至1992年5月,任南京旭普电子有限公司总经理助理;1992年6月至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月至1998年4月,任光大证券有限公司深圳营业部副总经理;1998年5月至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年至1994年,历任原中国银行陕西省信托咨询公司证券部驻上证所出市代表、上海业务部负责人;1994年至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月至今,任大成基金管理有限公司督察长兼监察稽核部经理。

刘彩晖女士,助理总经理,管理学硕士。1999年至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年至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01月至07月任深圳中航集团公司人力资源部副总经理;2006年08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

施永辉先生,大成蓝筹稳健证券投资基金经理,理学硕士,11年证券从业经验。曾任中科院资源环境信息中心相任助理研究员,甘肃证券资产管理部研究员,招商证券研发中心高级分析师、总经理助理。2003年加盟大成基金管理有限公司,历任公司研究部高级研究员、投资部副总监、大成精选增值混合型证券投资基金经理助理。自2006年1月21日起至今担任本基金经理。

(2)历任基金经理

历任基金经理姓名	管理本基金时间
王加英	2004年6月3日—2006年1月20日

3、公司投资决策委员会

公司投资决策委员会由4名成员组成,设主任和执行主任各一名,其他委员2名。名单如下:

于华,总经理,投资决策委员会主任;周一锋,副总经理兼投资总监,投资决策委员会执行主任;刘明,投资部副总监兼投资投资主管,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。

上述人员之间不存在亲属关系。

二、基金托管人

(一)基金托管人基本情况

本基金之基金托管人为中国银行股份有限公司(简称"中国银行"),基本情况如下:

住所:北京市西城区复兴门内大街1号

办公地址:北京市西城区复兴门内大街1号

法定代表人:肖 钢

企业类型:股份有限公司

注册资本:人民币贰仟伍佰叁拾捌亿叁仟玖佰壹拾陆万贰仟零玖元

存续期间:持续经营

成立日期:1983年10月31日

基金托管业务批准文号:中国证监会证监基字【1998】24号

托管部门总经理:秦立儒

托管部门联系人:宁敏

电话:(010)66594977

传真:(010)66594942

发展概况:

中国银行业务覆盖传统商业银行、投资银行和保险领域,并在全球范围内为个人客户和公司客户提供全面和优质的金融服务,截至2006年底,在世界27个国家和地区拥有分支机构,与1500家国外代理行及47000家分支机构保持了代理业务关系,凭借全球化的网络及其优质的服务、雄厚的实力,本行在国内市场保持着独特的竞争优势。

在近百年的岁月里,中国银行以其稳健的经营、雄厚的实力、成熟的产品和丰富的经验深得广大客户信赖,打造了卓越的品牌,与客户建立了长期稳固的合作关系。中国银行主营商业银行业务,包括公司业务、个人金融业务和资金业务。中国银行向公司客户提供包括贷款、票据贴现、贸易融资、存款、结算、清算、现金管理等各项金融产品和度身定制的财务综合解决方案。中国银行为个人客户提供一系列个人或家庭银行产品及服务,包括储蓄存款、消费信贷、支付结算、银行卡和财富管理等。在多年的发展历程中,中国银行曾创造了中国银行业的许多第一,所创新和研发的一系列金融产品与服务均开创历史之先河,在业界独领风骚,享有盛誉,目前在外汇存贷款、国际结算、外汇资金和贸易融资等领域居于领先地位,且保持了持续快速增长。截至2006年底,中国银行境内外分支机构共有11,241家,其中境内拥有37家一级分行、直属分行,283家二级分行及10277家分支机构,境外分支机构643家分行、子公司及代表处,是中国国际化程度最高的银行。中国银行在国内同业中率先引进国际管理技术人才和经营理念,不断向国际化一流大银行的目标迈进。

中国银行有近百年辉煌而悠久的历史,在中国金融史上扮演了十分重要的角色。中国银行于1912年由孙中山先生批准成立,至1949年中华人民共和国成立的37年间,中国银行先后是当时的国家中央银行、国际汇兑银行和外贸专业银行。在动荡的历史年代,中国银行作为民族金融的支柱,以服务大众、振兴民族金融业为己任,稳健经营,锐意进取,各项业务取得了长足发展。

新中国成立后,中国银行成为国家指定的外汇外贸专业银行,继续保持和发扬了顽强创业的企业精神,为国家对外经贸发展、开展经济建设作出了贡献。1994年随着金融体制改革的深化,中国银行由外汇外贸专业银行向功能完善、服务全面的国有商业银行转化,与其它三家国有商业银行一道成为国家金融业的支柱。1994年和1995年,中国银行先后成为香港地区、澳门地区发钞银行。为提高竞争优势,中国银行从2000年初开始围绕建立良好的公司治理机制采取了一系列的改革。2001年,中国银行成功重组了香港中银集团,将10家成员银行合并成当地注册的"中国银行(香港)有限公司",2002年7月,重组后的中国银行(香港)有限公司在香港联交所成功上市,成为国内首家在境外上市的国有商业银行。

2004年7月14日,中国银行在与国际同业和国内同业的激烈竞争中,凭借雄厚的实力和优良的服务,脱颖而出,作为我国银行业的优秀代表携手北京2008年奥运会,成为北京奥运会唯一的银行合作伙伴。

中国银行于2003年被国务院确定为国有独资商业银行股份制改造试点银行,围绕"资本充足、内控严密、运营安全、服务和效益良好、具有国际竞争力的现代化股份制商业银行"的目标,进一步完善符合现代企业制度要求的公司治理机制,稳步推进国有商业银行的股份制改造工作。2004年8月26日,中国银行股份有限公司成立,中国银行成为国家控股的股份制商业银行,标志着中国银行向建立良好公司治理机制的现代化股份制商业银行的目标迈进了一大步,中国银行的历史翻开了新的一页。

2006年6月1日,中国银行在香港联交所成功挂牌上市,共集资754.27亿港元。继成功发行H股并上市之后,2006年7月5日,中国银行在上海证券交易所成功发行A股,是中国资本市场第一家国有商业银行股,是金流通背景下的第一家"潮汐"股。在国际和国内资本市场同时上市,进一步提高了资本实力,中国银行进入了一个新的发展时期。在势如破竹的中国金融银行业改革的大潮中,在"新兴+转轨"的中国资本市场改革的大趋势中,中国银行将健康、快速、持续发展,创造更新的辉煌、谱写更绚丽的篇章!

中国银行多年来围绕客户需求所做的不懈努力,得到了来自业界、客户和权威第三方的广泛认可。从1990年以来,中国银行一直荣登《财富》500强排行榜,并被《财富》(中文版)评选为2006年最受赞赏的中国公司;自1992年,中国银行八次被《欧洲货币》杂志评为"中国最佳银行"或"中国最佳本地银行",并于2005年被《欧洲货币》评为中国及香港"最佳商业银行"(2005年房地产奖项);2004至2006年,中国银行连续三年被《环球金融》杂志评为"中国最佳贸易融资银行"和"中国最佳外汇银行";在中央电视台和《销售与市场》杂志共同主办的"2005中国营销盛典"中,被评为"2005年度中国企业营销创新奖"(是获奖企业中唯一的金融企业);根据英国《金融时报》2005年8月进行的调查,中国银行是中国的十大国际品牌之一;另外,中国银行被国家工商总局授予"中国驰名商标"。

2006年在《银行家》杂志"世界1000家大银行"中排名第17位,被《财资》杂志评为2006年度AAA奖项中国地区最佳现金管理银行、中国地区最佳贸易融资银行,同时《亚洲货币》杂志也将中国银行评为"中国最佳现金管理银行";被《新兴市场》杂志评为"2006年亚洲地区年度最佳银行",被《亚洲风险》杂志评为"2006年度中国最佳银行";获得了《亚洲法律事务》杂志2006年"银行和财经服务公司法务组大奖",是国内唯一获得该奖项的金融机构;被《投资者关系》杂志评选为"中国市场企业交易最佳投资者关系"、"香港市场IPO最佳投资者关系";在第十四届中国国际金融(银行)技术暨设备展览会上,本行的产品获得"金融业务创新奖";此外,积极推进企业文化建设,营造诚信、绩效、责任、创新、和谐的氛围,于2005年,被《中国人才》(《China Staff》)授予"中国大陆'最佳人力资源战略奖'",这是大中华区人力资源管理领域的最高评奖;2006年再次荣获"优信咨询(Universum)"评选的"大学生心目中最理想雇主奖"。

世纪信誉,环球共享。中国银行将秉承"以客户为中心,以市场为导向,强化公司治理,追求卓越效益,创建国际一流大银行"的宗旨,依托其雄厚的实力、遍布全球的分支机构、成熟的产品和丰富的经验,竭诚为客户提供全方位、高品质的银行服务,与广大客户携手共创美好未来。

财务概况:

2006年,中国银行资产总额53252.73亿元人民币,股东权益(不含少数股东权益)合计3882.54亿元人民币,分别比上年增长12.28%和66.03%,实现净利润418.92亿元人民币,比上年增长52.38%,总资产回报率和权益净回报率分别达到0.94%和13.86%,同比提高0.22个百分点和0.70个百分点;资产质量持续改善,2006年末不良贷款比率从2005年末的4.62%进一步下降到4.04%,下降0.58个百分点,资本充足率为13.59%,核心资本充足率为11.44%,分别较上年增加3.17个百分点及3.36个百分点。

(二)主要人员情况

肖钢先生,自2004年8月起任中国银行股份有限公司董事长、党委书记。自2003年3月起任中国银行董事长、党委书记、行长,自1996年10月起任中国人民银行行长助理,期间曾兼任中国人民银行计划资金司司长、货币政策司司长、广东省分行行长及国家外汇管理局广东省分局局长。1989年10月至1996年10月,历任中国人民银行政策研究室副主任、主任、中国外汇交易中心总裁、计划资金司司长等职。肖先生出生于1958年8月,1981年毕业于湖南财经学院,1996年获得中国人民大学法学硕士学位。

李礼辉先生,自2004年8月起担任中国银行副董事长、党委副书记、行长。2002年9月至2004年8月担任海南省副省长。1994年7月至2002年9月担任中国工商银行副行长。1988年至1994年7月历任中国工商银行国际业务部总经理、新加坡代表处首席代表、福建省分行副行长等职。李先生出生于1952年5月,1977年毕业于厦门大学经济系财政金融专业,1999年获得北京大学光华管理学院金融学专业博士研究生学历和经济学博士学位。

王永利先生,自2006年8月起担任中国银行股份有限公司副行长。自2004年8月起任中国银行股份有限公司行长助理,自2003年11月起任中国银行副行长。1997年4月至2003年11月历任中国银行财务部、资产负债管理部副总经理、总经理、福建省分行常务副行长及行长,以及河北省分行行长等职。王先生出生于1964年4月,1987年毕业于中国人民大学,2005年获得厦门大学博士学位。

秦立儒先生,自2005年10月起担任中国银行股份有限公司托管及投资者服务部总经理。2005年5月至2005年10月任中国银行股份有限公司托管及投资者服务部负责人。2004年4月至2005年5月任中国银行股份有限公司全球金融市场部总经理。2002年7月至2004年4月任中国银行(香港)有限公司资金部总经理;1999年6月至2002年7月任香港中银集团外汇交易中心总经理;1997年9月至1999年6月任广东省银行香港分行(香港中银集团)总经理;1995年11月至1997年9月任中国银行总行资金部副总经理,主管全球资金交易;1991年5月至1995年11月历任中国银行纽约分行资金部经理、助理总经理、副总经理;1987年10月至1991年5月历任中国银行总行资金部副处长、处长;1982年8月至1987年9月任中国银行卢森堡分行外汇部经理;1978年2月至1982年7月,先后在中国银行总行财会部、中国银行伦敦分行、卢森堡分行从事资金交易工作。秦先生出生于1955年5月,1978年毕业于北京外贸学院。

(三)证券投资基金托管情况

截止到2007年3月末,中国银行已托管景宏、同盛、兴安、同智优势成长、易方达平稳增长、易方达策略成长、易方达策略成长二号、易方达积极成长、易方达货币市场、易方达月月收益、易方达深证100交易型开放式指数、嘉实服务增值、嘉实成长收益、嘉实理财通系列(含嘉实稳健、嘉实增长、嘉实债券)、嘉实货币市场、嘉实沪深300指数、嘉实超短债、嘉实主题精选、银华优势企业、银华优质增长股票型、海富通收益增长、海富通货币市场、海富通股票、万家180指数、金鹰成份股优选、华夏回报、华夏回报二号、华夏大盘精选、景顺长城景系列(含景顺长城动力平衡、景顺长城货币市场、景顺长城优选股票)、景顺长城鼎益股票型、泰信天天收益、泰信优质生活、招商先锋、大成蓝筹稳健、大成财富管理2020、泰达荷银行业精选、国泰金象保本增值、国泰金鹿保本增值混合、国泰金鹏蓝筹价值、友邦华泰盛世中国、南方高增长、工银瑞信核心价值股票型、华宝兴业动力组合、华宝兴业先进成长股票型、国海富兰克林潜力组合基金等49只证券投资基金,覆盖了股票型、债券型、混合型、货币市场型、指数型、行业型等多种类型的基金和理财品种,满足了不同客户多元化的投资理财需求,基金托管规模位居同业前列。

(四)基金托管部门的设置及员工情况

中国银行总行于1998年设立基金托管部,为进一步树立以投资者为中心的服务理念,根据不断丰富和发展的托管对象和托管服务种类,中国银行于2005年3月23日正式将基金托管部更名为托管及投资者服务部,下设覆盖销售、市场、运营、风险与合规管理、信息技术、行政管理等各层面的多个团队;并在上海市分行、深圳市分行设立托管业务团队。

中国银行托管及投资者服务部现有员工90余人,其中硕士学历以上人员21人,具有一年以上海外工作和学习经历的人员有10余人。

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)

大成基金管理有限公司现分别在北京、深圳、上海设有投资理财中心:

(1)大成基金管理有限公司北京投资理财中心

办公地址:北京市朝阳区朝阳门外大街16号中国人寿大厦1201室(邮编:100020)

电话:010-85252345/46

传真:010-85252272/73/75

联系人:王艳、廖红军

(2)大成基金管理有限公司深圳投资理财中心

办公地址:深圳市福田区深南大道7088号招商银行大厦32层(邮编:518040)

电话:0755-83195090/5236

传真:0755-83195091

联系人:瞿宗怡、熊丽娟

(3)大成基金管理有限公司上海投资理财中心

办公地址:上海市广东路689号海通证券大厦19楼(邮编:200001)

电话:021-63513925/26

传真:021-63513928

联系人:杨静、祝君

2、代销机构

(1)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

传真:010-66594946

客户服务咨询电话:95566

网址:www.bank-of-china.com

(2)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:蒋超良

客服电话:95559

联系电话:021-58781234

传真:021-58408842

联系人:杜宇

网址:www.bankcomm.com

(3)中国光大银行

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:王明权

客服电话:95595

联系电话:010-68560675

传真:010-68560661

联系人:张建春

网址:www.cebbank.com

(4)招商银行股份有限公司

注册地址:深圳市深南大道7088号招商银行大厦

法定代表人:秦晓

客服电话:95555

电话:0755-83198888

传真:0755-83195109

联系人:兰奇

网站:www.cmbchina.com

(5)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

基金业务联系人:吴杰

联系电话:010-58560666

传真:010-83914283

客服热线:95568

网址:www.cmbc.com.cn

(6)兴业银行股份有限公司

注册地址:福州市湖东路15号

法定代表人:高建平

电话:(021)62677777

联系人:苏健

客户服务电话:95561

网址:www.cib.com.cn

(7)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:021-62580818-213

传真:021-62583439

联系人:芮敏祺

网址:www.gtja.com

(8)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

客服电话:400-8888-108

电话:010-65186080

联系人:魏明

网址:www.csc108.com

(9)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

法定代表人:何如

客服电话:800-810-8868

电话:0755-82130833

传真:0755-82133302

联系人:林建闽

网址:www.guosen.com.cn

(10)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39-45层

法定代表人:宫少林

客户服务电话:4008888111,0755-26951111

传真:0755-82943511

联系人:黄健

网址:www.newone.com.cn

(11)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

电话:020-87555888-875

传真:020-87557985

联系人:肖中梅

网址:www.gf.com.cn

(12)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:朱利

客户服务电话:010-68016655

联系人:郭京华

网址:www.chinastock.com.cn

(13)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:马国强

客服电话:400-8888-555

联系人:范雪玲

网址:www.lhzq.com

(14)山西证券有限责任公司

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:吴晋安

电话:0351-8686703

传真:0351-8686709

联系人:张治国

客服电话:0351-8686868

网址:www.i618.com.cn

(15)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:丁国荣

客服电话:021-962505

电话:021-54033888

联系人:孙洪喜

网址:www.sw2000.com.cn

(16)海通证券股份有限公司

通讯地址:上海市淮海中路98号

法定代表人:王开国

客服电话:021-962503

电话:021-53594566-4125

传真:021-53858549

联系人:金芸

网址:www.htsec.com

(17)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

客户服务电话:400-8888-123

电话:021-68419974

传真:021-68419867

联系人:杨盛芳

网址:www.xyzq.com.cn

(18)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

(19)光大证券股份有限公司

注册地址:上海市浦东南路528号上海证券大厦南塔15楼

法定代表人:王明权

电话:021-68816000

传真:021-68817271

客服电话:021-68823685

联系人:刘晨

网址:www.ebscn.com

(20)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

联系人:邵一明

电话:021-50586660

传真:021-50586660-8880

客户服务热线:0519-8166222 0379-64912266

网址:www.longone.com.cn

(21)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

联系人:余雅娜

电话:0791-6768763

传真:0791-6789414

客户服务热线:0791-6768763

网址:www.scstock.com

(22)东方证券股份有限公司

注册地址:上海市中山南路318号2号楼22层-29层

法定代表人:王益民

联系人:吴宇

电话:021-50367888

传真:021-50366868

客户服务热线:021-962506

网站:www.dfzq.com.cn

(23)华泰证券有限责任公司

注册地址:南京市中山东路90号华泰证券大厦

法定代表人:吴万善

电话:025-84457777-721

传真:025-84579879

联系人:袁红彬

客服电话:025-84579897

网址:www.htsc.com.cn

(24)渤海证券有限责任公司

注册地址:天津市河西区宾水道3号

法定代表人:张志军

电话:022-28451883

传真:022-28451616

联系人:徐焕强

网址:www.ewww.com.cn

(25)长江证券有限责任公司

注册地址:武汉市新华路特8号

法定代表人:胡运钊

联系人:甘露

电话:021-63296362

传真:021-51062920

客户服务热线:4008-888-999

网址:www.cz318.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: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:0755-83195229

联系人:徐生沪

(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

基金运作方式: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,无风险率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。

$$\text{Momentum}=\frac{(R_t-R_f)}{\sigma_{t-1}}\times Tr$$

其中:R_t为股票最近三个月的收益率,

R_f为股票所在行业最近三个月的收益率,

σ_{t-1}为股票收益率与其对应行业收益率之差的月标准差,

Tr为股票交易活跃度,表示为股票最近5个交易日平均换手率除以最近30个交易日平均换手率。

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迎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

由于我国还没有统一指数,我们暂时采用天相投资顾问有限公司编制的天相280指数作为股票投资部分的基准,采用中信国债指数作为债券投资部分的基准。本基金的业绩比较基准如下:

70%×天相280指数+30%×中信国债指数

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人投资。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(截至2007年3月31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。

基金托管人中国银行股份有限公司根据本基金合同规定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2007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

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	35,608,451.66	5.81%
股票	569,522,738.45	92.91%
债券	0.00	0.00%
权证	0.00	0.00%
其他资产	7