大成财富管理 2020 生命周期证券投资基金

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
2007年第 2 号

重 要 提 示

大成财富管理 2020 生命周期证券投资基金（以下简称"本基金"）经中国证监会证监基金字【2006】142 号文核准募集,基金合同于 2006 年 9 月 13 日正式生效。

本基金管理人保证本更新的招募说明书摘要的内容真实、准确、完整。本更新的招募说明书摘要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。

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。

投资有风险,投资人申购本基金时应认真阅读本更新的招募说明书。

基金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《基金法》、《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。

本更新招募说明书摘要所载内容截止日为 2007 年 09 月 13 日, 有关基金净值表现截止日为 2007 年 06 月 30 日,有关基金投资组合及财务数据截止日为 2007 年 06 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
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%）、中国银河证券有限责任公司（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:胡学光
总经理:于华
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,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 2007 年 09 月 13 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、基金景福、大成优选股票型证券投资基金,及 9 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等。

（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。

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,在中国华闻投资控股有限公司,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－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 年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,1995 年－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－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公司副总裁;2005 年 4 月任大成基金管理有限公司助理总经理,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－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－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证所出市代表、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 月至今,任大成基金管理有限公司督察长兼监察稽核部总监。

刘彩晖女士,助理总经理,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 01 月－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

占冠良先生,基金经理,硕士,1977 年 12 月出生,毕业于北京大学金融工程与数学专业。2001 年 7 月至 2004 年 6 月,就职于招商证券有限公司研发中心金融工程部、策略部;2004 年 7 月加盟大成基金管理有限公司,任行业分析师。 2007 年 6 月 27 日起担任大成财富管理 2020 生命周期基金基金经理。

（2）历任基金经理

历任基金经理姓名	管理本基金时间
瞿蕴理	2006年 09 月 13 日至 2007 年 06 月 27 日
占冠良	2007年 6 月 27 日至今

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 1 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;周一烽,副总经理,投资决策委员会执行主任;刘明,投资部总监,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:

办公及住所地址: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,与其他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,是全流通背景下的第一家"海归"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 月起担任中国银行股份有限公司副董事长、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 2003 年 11 月起任中国银行行长助理,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
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:0755–83199588
联系人:杨春明
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）名称: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:郑丽芳、梁静静
电话:0755－83195090,83195236
传真:0755－83195091
（2）大成基金北京投资理财中心
地址:北京市朝阳区朝阳门外大街 16 号中国人寿大厦 1201 室
联系人:王艳、廖红军
电话:010－85252345/46
传真:010－85252273/2274/2275
（3）大成基金上海投资理财中心
地址:上海市广东路 689 号海通证券大厦 19 层
联系人:杨静、徐舲
电话:021－63513925/26
传真:021－63513928
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
客户电话:95566
网址:www.boc.cn
（2）中国邮政储蓄银行
注册地址:北京市西城区宣武门西大街 131 号
法定代表人:陶礼明
客户服务电话:11185
传真:010－66415194
网址:www.cpsrb.com
（3）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
（4）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
（5）深圳发展银行股份有限公司
办公地址:深圳市深南东路 5047 号深圳发展银行大厦
法定代表人:法兰克纽曼（Frank N.Newman）
联系电话:（0755）82088888–8811
传真电话:（0755）82080714
联系人:周勤
客户服务电话:95501
网址:www.sdb.com.cn
（6）深圳市平安银行
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
公司网站: www.18ebank.com
（7）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
（8）国泰君安股份有限公司
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
（9）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
客户服务电话:021－962505
电话:021－54038844
联系人:孙洪喜
网址:www.sw2000.com.cn
（10）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:0755－82130833－2181
传真:0755－82133302
联系人:林建闽
网址:www.guosen.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
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
（12）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
（13）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:010–65186080
联系人:魏明
网址:www.csc108.com
（14）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:400－8888－111
电话:0755－82943511
联系人:黄健
网址:www.newone.com.cn
（15）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
客户服务电话:400－8888－555（限固定电话）,0755－25125666
联系人:范雪玲
网址:www.lhzq.com
（16）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:021－68815009
客服电话:021－68823685
联系人:刘晨
网址:www.ebscn.com
（17）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
客户服务电话:021－962503
电话:021－53594566－4125
传真:021－53858549
联系人:金芸
网址:www.htsec.com
（18）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
（19）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:叶黎成
电话:0755－82450826
传真:0755－82433794
联系人:余江
客户服务电话:95511
网址:www.pa18.com
（20）东北证券有限责任公司
注册地址:长春市人民大街 138－1 号
通讯地址:长春市自由大路 1138 号 1007 室
法定代表人:李树
客户服务电话:0431－5096733
电话:0431－5096710
传真:0431－5680032
联系人:高新宇
网址:www.nesc.cn
（21）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
电话:0531－82024184、0531－82024147
传真:0531－82024197
联系人:傅咏梅
网址:www.qlzq.com.cn
（22）世纪证券有限责任公司
注册地址:深圳市深南大道 7088 号招商银行大厦 41 层
办公地址:深圳市深南大道 7088 号招商银行大厦 41 层
法定代表人:段强
电话:0755－83199511
传真:0755－83199545
联系人:夏尚
网址:www.csco.com.cn
（23）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
联系电话:021－68604866－8302
联系人:张静
网址:www.bocichina.com.cn
（24）中信万通证券有限责任公司
办公地址:青岛市东海西路 28 号
法定代表人:史洁民
联系电话:0532–85022026
传真:0532–85022026
联系人:丁韶燕
网址:www.zxwt.com.cn
客户咨询电话:0532–96577
（25）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 号主楼五楼
法定代表人:吴张
咨询电话:020–961303
联系人:江欣
联系电话:020–87320991
网址:www.gzs.com.cn
（26）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
咨询电话:0571–96598
传真:0571–85783771
联系人:龚晓军
联系电话:0571–85783750
网址:www.bigsun.com..cn
（27）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
（28）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
（29）华泰证券
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
电话:025–84457777–950、248
联系人:李金龙、张小波
客户咨询电话:025–84579897
（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: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
名称:北京市金杜律师事务所
住所:北京市朝阳区东三环中路 39 号建外 SOHO A 座 31 层
负责人:王玲
电话:0755－22163333
传真:0755－22163390
联系人:宋萍萍
经办律师:靳庆军、宋萍萍
（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

大成财富管理 2020 生命周期证券投资基金

五、基金类型

混合型基金

六、基金的运作方式

契约型、开放式

七、基金的投资目标

本基金投资于具有良好流动性的权益证券、固定收益证券和 / 或货币市场工具等,通过调整资产配置策略和精选证券,以超越业绩比较基准,寻求在一定风险承受水平下的当期收益和资本增值的整体最大化。在 2020 年 12 月 31 日以前,本基金侧重于资本增值,当期收益为辅;在 2020 年 12 月 31 日之后,本基金侧重于当期收益,资本增值为辅。

八、基金的投资方向

本基金投资于具有良好流动性的金融工具,包括国内依法发行上市的股票、债券及中国证监会允许基金投资的其他金融工具。本基金持有的现金以及到期日在一年以内的政府债券的比例不低于基金资产净值的 5%。

本基金根据时间的变化逐步调整权益类证券和固定收益类（及货币市场工具）证券的资产配置比例。

本基金各个时间段的资产配置比例如下表所示:

时间段	权益类证券比例范围	固定收益类证券及货币市场工具比例范围
基金合同生效日至 2010 年 12 月 31 日	0—95%	5%—100%
2011年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日	0—75%	25%—100%
2016年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日	0—50%	50%—100%
2021年 1 月 1 日以及该日以后	0—20%	80%—100%

在特殊市况下或有足够而合理的理由时,基于投资者利益最大化的原则,在不损害投资者利益且不违背法律法规的前提下,本基金在履行相应程序后,可适当偏离上述比例范围,并予以公告。

九、基金的投资策略

本基金在组合构建中强调风险收益比的合理优化,将纪律性和科学性结合起来,建立较全面的资产、个券投资价值评价体系,不断优化投资组合配置。

本基金的投资策略分为两个层次:第一个层次是资产配置策略,即在权益类证券、固定收益证券和货币市场工具之间的配置比例;第二个层次是权益类证券和固定收益类证券等的投资。

1、资产配置策略

随着时间的流逝,从整体趋势来看,本基金投资于权益类证券的比例持续递减,投资于固定收益类或货币市场工具的比例持续增加,使得整个基金组合的资产配置变得相对更加稳健,从追求资本增值为主转变为追求当期收益为主。

在前期,本基金类似于一只股票型或偏股型基金,风险收益水平相对较高,投资方法相对进取,以获得较高的资本投资回报。以后,逐步演变为一只低风险债券型基金,风险收益水平相对较低,投资方法趋于稳健,以获得稳定的当期收益。这种演变是渐进的,以适应投资者随着年龄增长或者剩余期限的减少而逐渐降低风险偏好的要求。

2、权益类证券投资策略

（1）配置战术品种和战略品种

基金既要持有保证现实需求的战术性品种,也要持有保证未来发展的战略性品种。战术性品种往往是市场已经高度认同、大量资金涌入的热门品种,一般而言,能在短期内产生良好的收益。战略性品种往往是被市场遗忘、产生错误定价的冷门品种,通常短期内收益较小,然而长期而言往往产生高额收益。

本基金将在基金投资组合中既配置能够产生即期收益的战术性品种,也配置能够产生远期收益的战略性品种,既保证基金的短期收益,也可以获得长期收益。

（2）突出重点行业、重点个股

超额收益来自于对市场时机的判断以及对行业和个股的把握。本基金将重视宏观因素对行业和企业带来的影响;采用定性与定量相结合的方法,对行业的未来预期做出较为准确的判断,对股票未来盈利能力及成长性进行全面的分析,发现行业的价值和未来的成长潜力,挖掘价值被市场低估的股票。本基金将重点投资于业绩持续稳定增长,在行业内具有垄断地位、行业特征与世界经济发展和中国经济发展趋势相一致,现金流状况良好、负债率较低,预期销售收入、净利润快速增长并能够维持较高的净资产收益率的上市公司。

（3）不同行业的选股思路

不同行业和公司具有不同的经营特征和模式,本基金将根据不同行业的特点,运用不同的选股方法:

① 对于高速增长的行业,特别是新兴行业,基本采取普选个股的方式选择投资标的。

高速成长的行业中的大部分公司都能获得良好的收益,而行业竞争格局尚不清晰,并不能断定孰优孰劣,因此普选个股有助于充分分享该行业的高速增长。

② 对于高度竞争性行业或者处于衰退阶段的行业,此类行业中部分公司经营优良,并且获得持续发展和长久的行业地位,而大部分公司无法抵御竞争将遭到淘汰。因此,本基金将选择管理层的经营水平和公司的内在竞争力较强的上市公司,估值水平视公司的经营发展态势而定。

③ 对于周期性行业,波动性和周期性是其主要特征,在行业低谷期此类股票会被大量抛售,导致投资风险较大。对于此类股票,本基金的投资重点在于当市场预期和市场定价发生错误时,进行波段操作,充分获取超额收益。

3、固定收益类证券投资策略

固定收益类证券的资产配置将随着时间的推移逐步增加。

本基金将在严格控制组合风险的前提下,进行总体的战略资产配置。同时,基于收益的要求,在战术资产配置、类属配置、个券选择和交易执行层面上实施积极的策略,以期在承担有限风险的前提下获得较高的投资收益。战术资产配置上,本基金将通过深入分析宏观经济、政策影响和市场信用利差结构等各种变量并参照市场基准久期,确定出目标久期。类属配置上,将通过各类属资产的比例配置、期限配置以及市场配置实现超额收益。

个券选择和多样化的交易策略将成为本基金日常获取超额收益的重要手段。

（1）战略资产配置策略

战略资产配置通过综合宏观经济预测、情景分析和申购、赎回现金流情况决定。其中,宏观经济预测主要基于定性和定量相结合的研究报告。兼顾申购、赎回等方面的现金流分析,确保基金的流动性要求。

（2）战术资产配置策略

本基金将采取以"目标久期"为中心的债券资产配置方式,通过分析宏观经济、政策影响等各种变量并参照市场基准久期,借助市场收益率曲线结构分析和市场信用利差结构分析,确定本基金债券资产配置的组合久期和战术资产配置策略。

宏观及市场分析是债券投资确定目标久期的重要环节,本基金将基于分析结果对市场利率变化的时间、方向、幅度做出初步预测。此外,本基金还将借助久期和收益率曲线进行组合的目标久期决策,通过假定利率变化幅度的各种情形,分析投资组合的风险－收益状况,并根据投资组合的风险承受能力确定组合的目标久期区间。在此基础上,本基金还会借助情景分析方法研究收益率曲线变化,考察投资基准和投资组合在收益率曲线变化时的风险－收益特征及久期情况, 最后确定组合在某一季度内的目标久期区间。

（3）类属配置

在确定目标久期后,本基金将对债券资产进行类属配置,即在对宏观经济、市场利率、债券供求等分析的基础上,预测各类属资产预期风险及收益情况,考虑债券品种期限和债券市场流动性及收益性现状,确定债券资产组合在国债、企业债、金融债等品种之间的类属分配。在本基金具体进行类属配置的过程中,将综合考虑模型辅助和主动预测相结合的方法。

在确定目标久期和类属资产比例后,本基金将对长、中、短期债券品种进行期限配置,根据不同情况,决定采用子弹、哑铃或者梯形策略实现不同期限债券品种的搭配。

（4）交易策略

在组合构建与调整过程中,本基金将采用一系列凸度策略、收益率利差策略和回购套利等多种交易策略,以提高组合整体投资收益率水平、控制组合的投资风险。

（五）投资组合管理
1、资产配置和行业配置的决策程序
（1）资产配置

宏观研究员就政治形势、政策趋势、宏观经济形势、利率走势以及证券市场发展趋势等进行分析,向投资决策委员会和基金经理提交研究报告。

投资决策委员会根据相关报告,对市场中长期发展趋势做判断,向基金经理提出资产配置指导性意见。

基金经理根据投资决策委员会的指导性意见并结合自己的研究分析结果,拟定《基金资产配置建议书》,提交投资决策委员会审议。

投资决策委员会对《基金资产配置建议书》的可行性进行分析,形成投资决议并授权基金经理执行。

（2）行业配置

基金经理综合各行业研究员的研究成果,根据不同行业景气的周期变化,向投资决策委员会提交行业配置建议书。经投资决策委员会批准后,基金经理制定详细的行业配置计划并经授权后执行。

2、投资品种选择的决策程序
（1）股票投资的决策程序

本基金所投资的上市公司必须已经进入本基金股票投资备选库,进入备选库的股票必须经过股票投资基本库、股票投资初选库和股票投资备选库的筛选程序,具体过程如下:

① 研究员根据法律法规和基金合同规定,判断股票是否存在明显风险,确定股票投资基本库;

② 研究员通过大量研读券商研究报告,根据自己的综合分析判断,在股票投资基本库的基础上确定股票投资初选库;

③ 研究员选择初选库中的股票,进行深入分析和实地调研后,提交投资研究联席会议讨论。投资研究联席会议经过充分讨论和论证,确定该股票是否进入股票投资备选库。

④ 基金经理从股票投资备选库中选择股票构建投资组合。

（2）债券投资的决策程序

本基金投资的债券包括国债、金融债、企业债（含可转换债券）等债券品种。

基金经理根据经投资决策委员会审批的资产配置计划,向债券投资研究员提出债券投资需求,债券投资研究员在对利率变动趋势、债券市场发展方向和各债券品种的流动性、安全性和收益性等因素进行综合分析的基础上,提出债券投资建议。基金经理根据债券投资研究员的债券投资建议,制定债券投资方案。

3、交易指令的下达和执行

基金管理人设置独立的集中交易室,基金经理下达的投资指令通过集中交易室实施。集中交易室接到基金经理的投资指令后,根据有关规定对投资指令的合规性、合理性和有效性进行检查,确保投资指令在合法、合规的前提下得到高效的执行。

4、投资风险的监控和管理
（1）监察稽核部对投资风险的日常监管

监察稽核部通过交易系统检查包括投资集中度、投资组合比例、投资禁止、投资限制、投资权限等交易情况。

（2）基金绩效评估和风险管理

基金管理人设有基金绩效评估和风险管理小组,定期向基金绩效评估和风险管理会议提交基金绩效评估和风险管理报告。基金经理根据基金绩效评估和风险管理会议的意见对投资组合进行调整。

十、基金的业绩比较基准

时间段	业绩比较基准
基金合同生效日至 2010 年 12 月 31 日	75%×新华富时中国 A600 指数＋25%×中国债券总指数
2011年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日	45%×新华富时中国 A600 指数＋55%×中国债券总指数
2016年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日	25%×新华富时中国 A600 指数＋75%×中国债券总指数
2021年 1 月 1 日以及该日以后	10%×新华富时中国 A600 指数＋90%×中国债券总指数

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,提前公告后予以实施。

十一、基金的风险收益特征

本基金属于生命周期型基金,2020 年 12 月 31 日为本基金的目标日期。从建仓期结束起至目标日期止,本基金的风险与收益水平将随着时间的流逝逐步降低。即本基金初始投资阶段的风险收益水平接近股票型基金;随着目标日期的临近,本基金逐步发展为一只低风险债券型基金。

十二、基金投资组合报告(截至 2007 年 06 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。

基金托管人中国银行股份有限公司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 2007 年 06 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	133,433,793.19	6.37%
股票	1,944,936,500.36	92.92%
债券	0.00	0.00%
权证	0.00	0.00%
其他资产	14,729,099.06	0.70%
合计	2,093,099,392.61	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	20,047,070.00	0.97%
B 采掘业	63,532,173.49	3.08%
C 制造业	710,777,825.03	34.52%
C0 食品、饮料	143,965,285.09	6.99%
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	25,430,000.00	1.23%
C4 石油、化学、塑胶、塑料	0.00	0.00%
C5 电子	0.00	0.00%
C6 金属、非金属	165,208,367.50	8.02%
C7 机械、设备、仪表	247,025,278.44	11.99%
C8 医药、生物制品	120,595,138.40	5.86%
C99 其他制造业	8,553,755.60	0.42%
D 电力、煤气及水的生产和供应业	61,155,151.36	2.97%
E 建筑业	16,909,103.77	0.82%
F 交通运输、仓储业	252,078,343.80	12.24%
G 信息技术业	22,198,108.15	1.08%
H 批发和零售贸易	111,557,875.07	5.42%
I 金融、保险业	448,745,208.74	21.79%
J 房地产业	168,981,316.46	8.21%
K 社会服务业	43,258,414.25	2.10%
L 传播与文化产业	8,417,500.00	0.41%
M 综合类	17,278,410.24	0.84%
合计	1,944,936,500.36	94.44%

（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
1	601318	中国平安	2,470,246	176,647,291.46	8.58%
2	000002	万 科 A	7,400,000	141,488,000.00	6.87%
3	600036	招商银行	5,437,397	133,651,218.26	6.49%
4	600009	上海机场	3,000,000	114,030,000.00	5.54%
5	600030	中信证券	2,149,966	113,883,699.02	5.53%
6	000423	东阿阿胶	3,700,000	96,644,000.00	4.69%
7	601006	大秦铁路	4,099,909	62,072,622.26	3.01%
8	000027	深能源 A	2,691,688	61,155,151.36	2.97%
9	000858	五 粮 液	1,900,000	59,774,000.00	2.90%
10	600026	中海发展	2,267,873	52,115,721.54	2.53%

(下转 31 版)