大成蓝筹稳健证券投资基金

更新的招募说明书摘要

2008年第1期

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06月03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2008年06月03日，有关基金净值表现截止日为2008年03月31日，有关基金投资组合及财务数据截止日为2008年03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04月12日
注册资本：贰亿元人民币
股权结构：中泰信托投资有限责任公司（持股48%）、中国银河投资管理有限责任公司（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、国际业务部和综合管理部；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2008年06月03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10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、大成创新成长混合型证券投资基金和大成景阳领先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—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副主任委员；2004年1月起任大成基金管理有限公司总经理。

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月起始任光大证券股份有限公司董事；2003年2月起，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。现任中国银河投资管理有限公司办公室主任。

蔡红标先生，董事，经济学博士。1994年02月至1997年02月在华泰证券有限责任公司工作。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。

杨建文先生，独立董事，经济学博士，研究员，国务院特殊津贴获得者。1982年—1996年，上海社会科学院经济研究所研究室主任；1996年起，任上海社会科学院部门经济研究所副所长、总支书记；兼任十一届上海市工商联（商会）副会长、上海市人民政府特聘决策咨询研究专家、上海市国有资产规划投资委员会常任委员、上海国际金融研究中心副理事长、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。

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月起，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责任公司副总裁；2005年4月起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，2007年6月27日起担任大成积极成长股票型证券投资基金基金经理。

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。

刘彩晖女士，副总经理，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1月至7月任深圳中航集团公司人力资源部副总经理；2006年8月至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投资管理部经理；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。

李宏伟先生，董事会秘书兼助理总经理，法学硕士。1991年07月–1992年05月，任南京旭普电子有限公司总经理助理；1992年06月–1997年02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03月–1998年04月，任光大证券有限公司深圳营业部总经理；1998年05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01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。

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，12年证券从业经验。曾任中科院资源环境信息中心担任助理研究员，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01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06月03日—2006年01月20日

3、公司投资决策委员会

公司投资决策委员会6名成员组成，设主任和执行主任各1名，其他委员4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、大成积极成长股票型证券投资基金基金经理；刘明，投资部总监，大成优选股票型证券投资基金基金经理，投资决策委员会委员；卢纪平，交易部总监，投资决策委员会委员；杨建华，投资部副总监，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，投资部副总监，大成债券投资基金基金经理，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）基金托管人的基本情况

名称：中国银行股份有限公司（简称"中国银行"）
住所及办公地址：北京市西城区复兴门内大街1号
首次注册登记日期：1983年10月31日
变更注册登记日期：2004年8月26日
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
法定代表人：肖 钢
基金托管业务批准文号：中国证监会证监基字【1998】24号
托管及投资者服务部总经理：董杰
托管部门联系人：宁敏
电话：（010）66594977
传真：（010）66594942
发展概况：

中国银行业务涵盖商业银行、投资银行和保险三大领域，其中，商业银行业务是中国银行的传统主营业务，包括公司金融业务、个人金融业务及金融市场业务。中国银行提供的公司金融业务包括存款业务、贷款业务、国际结算及贸易融资业务，以及银行汇票、本票、支票、汇兑、银行承兑汇票、委托收款、托收承付、集中支付、支票圈存及票据托管等其他公司金融业务；个人金融业务包括储蓄存款业务、个人贷款业务、个人中间业务、"中银理财"服务、私人银行业务和银行卡业务等；金融市场业务主要包括本外币金融工具的自营与代客业务、本外币各类证券或指数投资业务、债务资本市场业务、代客理财和资产管理业务、金融代理及托管业务等。

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，截至2007年末底，中国银行境内外机构共有10,834家，其中在中国内地拥有37家一级分行、直属分行，拥有283家二级分行及9,824家分支机构；在境外有689家分行、子公司及代表处，是中国国际化程度最高的银行。

2007年，中国银行营业收入快速增长，风险管理水平不断提高，资产质量明显改善，实现税后利润620.17亿元人民币，较上年增加139.59亿元人民币，增幅29.05%，其中，股东应享税后利润562.29亿元人民币，较上年增加136.05亿元人民币，增幅31.92%；截止2007年末，中国银行资本充足率为13.34%，核心资本充足率为10.67%；中国银行不良贷款率为3.12%，较2006年末下降0.92个百分点。

多年来中国银行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。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，中国银行脱颖而出，成为北京2008年奥运会唯一的银行合作伙伴；自1990年以来，中国银行一直荣登《财富》500强排行榜；2004至2007年，中国银行连续被《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"；2007年，中国银行在《银行家》杂志"世界1000家大银行"中排名第9位；2007年中国银行被《金融亚洲》评为"亚洲最佳公司（最佳管理、最佳公司治理、最佳股利政策）"和"中国最佳外汇交易银行"；2007年中国银行被《亚洲货币》杂志和《贸易融资》杂志分别评为"中国最佳现金管理银行"和"中国最佳贸易融资银行"；在"和讯财经风云榜"中，中国银行被评为"中国银行业杰出服务奖"、"中国银行业理财产品测评最具投资价值奖"；2007年中国银行再次荣获"优信咨询（Universum）"评选的"最理想雇主奖"。

（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月至2006年8月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。

董杰先生，自2007年11月27日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。自2005年9月起任中国银行天津市分行副行长、党委委员，1983年7月至2005年9月历任中国银行深圳市分行沙头角支行行长、深圳市分行信贷经营处处长、公司业务处处长、深圳市分行行长助理、党委委员等职。董先生出生于1962年11月，获得西南财经大学博士学位。

（三）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，现有员工90余人；另外，在上海市分行、深圳市分行设有托管业务团队。

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。

（四）证券投资基金托管情况

截止到2007年末，中国银行已托管景宏、同盛、华夏行业精选、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、易方达稳健收益、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、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、海富通股票、海富通精选2号、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、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、大成优选、泰达荷银行业精选、国泰沪深300指数、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、友邦华泰积极成长、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等52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、创新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。

（五）基金托管人的内部控制制度

1、内部控制目标

中国银行努力构建严密内部控制体系，以保证各项业务持续健康发展。中国银行内控建设的总目标是：以完善的内部控制组织体系为保障，以体现制衡原则、健全有效的制度为基础，以精细化的过程为着眼点，以激励约束机制和问责制为引导，以信息科技手段为依托，大力培育合规文化，努力构建全面系统、动态、主动和可证实的内部控制体系。

为实现上述目标，中国银行从明确职责入手，完善内部控制组织体系建设；从制度建设入手，夯实内部控制基础；从细节入手，实现精细化的过程控制；从完善激励约束机制和问责制入手，引导内部控制目标的实现；从加强信息技术手段入手，提高内部控制水平和质量；从加强教育培训入手，促进合规文化的形成。

2、内部控制组织结构

中国银行股份有限公司自2004年08月26日成立以来，按照国家有关法律法规制定了新的公司章程，形成了由股东大会、董事会、监事会和高级管理层构建的现代股份公司治理架构。

(1)董事会负责制订总体风险偏好、审阅及批准本行的风险管理目标及策略。董事会下设风险政策委员会，并成立了稽核委员会。

风险政策委员会主要职责包括评估和监督本行风险管理政策及内部控制政策的实施、监督已确立的风险领域敞口、监控和评估本行风险偏好、审核本行法律与合规事务程序的有效性和监督其实施，以及审查及批准超出授予本行行长信贷审批权限的信贷决定。总行风险管理部是风险政策委员会的秘书机构，风险管理部拟订风险管理策略及工作计划，并牵头拟定及管理风险管理政策及管理风险管理政策及程序。

中国银行历来重视内部稽核职能，中国银行的内部稽核是内部独立客观的监督与评价活动，对本行风险管理和内部控制的适当性和有效性进行审查与评估，负责跟进被稽核发现的问题及监督整改行动。2005年11月，董事会及稽核委员会采纳了内部稽核章程，进一步明确内部稽核职能独立于业务部门，并由董事会的稽核委员会领导，在董事会授权下，稽核委员会负责提名总稽核及评估其表现、审查及核准内部稽核政策、内部稽核组织架构、年度内部稽核计划及预算，以及审查内部稽核职能的有效性。中国银行已于境内一级分行及主要海外分行与子公司设立内部稽核部门，各家境内一级分行内部稽核工作负责人均由总行委任及考核，向总行的内部稽核部门及分行行长报告。中国银行建立了问责制，明确界定了内部稽核部门及稽核人员的责任，相关的内部稽核部门或人员的工作表现被纳入年度绩效考核。

(2)中国银行股份有限公司高级管理层负有整体管理责任，管理本行风险的各个方面，包括风险管理策略、措施和信贷政策，并批准风险管理的内部规则、措施及程序。高级管理层下设内部控制委员会、资产负债管理委员会、资产处置委员会和反洗钱工作委员会。

内部控制委员会负责监督全行内部控制体系的总体运行，决定内部控制基本制度，评估内部控制体系的有效性，以及识别内部控制体系存在的不足和缺陷，督导改进措施的落实，审阅及批准本行主要内部控制政策及相关实施计划，制订本行有关操作风险识别、评估、监测、控制、计量等管理制度和报告制度，并不时聘用内部和外部专家评估内部控制的有效性和提供改进建议。法律与合规部是内部控制委员会的秘书机构，该部负责管理法律风险、合规风险，并牵头协调内部控制管理。

资产负债管理委员会监督本行整体资产和负债的管理，以及根据风险政策委员会所采用的一般风险管理政策，制订有关管理政策。资产负债管理部是资产负债管理委员会的秘书机构，该部按照资产负债管理委员会制订的政策，管理本行流动性，预测本行流动性的需求和风险，并对内重新分配资金以满足流动性管理的需要。

资产处置委员会审核有关处置不良资产的战略及政策，负责审批处置、清收及收回金额超出境内一级分行及海外分行的授权限额的不良贷款的建议。授信执行部是资产处置委员会的秘书机构。

反洗钱工作委员会负责反洗钱及打击恐怖主义融资事宜，法律与合规部是反洗钱工作委员会的秘书机构。

(3)托管及投资者服务部总经理对托管业务的风险控制负第一责任。部门内部设有专门的风险控制小组，作为部内风险管理与内部控制的审议和决策机构，负责审议决定托管及投资者服务部风险管理战略、基本原则、风险管理目标和重大政策措施，检查和监督风险管理战略、方针和政策的执行情况。针对托管业务的特点，托管及投资者服务部内部设立高级合规官和风险与合规管理团队，具体开展部门内部内控及风险管理的相关工作。

3、内部控制制度及措施

中国银行开办各类基金托管业务均获得相应的授权，并在辖内实行业务授权管理和从业人员核准资格管理。中国银行自1998年开办托管业务以来严格按照相关法律法规的规定以及监管部门的监管要求，以控制和防范基金托管业务风险为主线，制定并逐步完善了包括托管业务授权管理制度、业务操作规程、员工职业道德规范、保密守则等在内的各项业务管理制度，将风险控制落实到每个工作环节；在敏感部位建立了安全保密区和隔离墙，安装了录音监听系统，以保证基金信息的安全；建立了有效核对和监控制度、应急制度和稽查制度，保证托管基金资产与银行自有资产以及各类托管资产的相互独立和资产的安全；制定了内部信息管理制度，严格遵循基金信息披露规定和要求，及时准确地披露相关信息。

4、其他事项

最近一年内，基金托管人基金托管业务部门及其高级管理人员无重大违法违规行为，未受到中国证监会、中国银监会及其他有关机关的处罚。

（六）托管人对管理人运作基金进行监督的方法和程序

基金托管人负有对基金管理人的投资运作行使监督权的职责。根据《基金法》、《证券投资基金会计核算办法》、基金合同的相关规定，托管人就基金的投资范围、投资组合比例、投资限制、基金管理人报酬和基金托管人托管费的计提比例和支付方法、基金会计核算、基金资产估值和基金净值的计算、收益分配等事项，对基金管理人进行业务监督、复核。基金托管人在履行上述职责过程中，如发现基金管理人的投资指令违反法律、行政法规和其他有关规定，或者违反基金合同约定的，应当拒绝执行，立即通知基金管理人，并及时向国务院证券监督管理机构报告。基金托管人如发现基金管理人依据交易程序已经生效的投资指令违反法律、行政法规和其他有关规定，或者违反基金合同约定的，应当立即通知基金管理人，并及时向国务院证券监督管理机构报告。

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
联系人：廖红军、李宁
（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：郑丽芳
（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：徐舲、朱君
2、代销机构
（1）中国农业银行
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
（4）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
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
（5）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
（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：蒋超良
客服电话：95559
联系人：杜宇
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）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）
客服电话：95501
联系人：周勤
电话：0755-82088888-8811
传真：0755-82080714
网址：www.sdb.com.cn
（9）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：唐双宁
客服电话：95595
联系人：张建春
电话：010-68560675
传真：010-68560661
网址：www.cebbank.com
（10）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：吴杰
电话：010-58560666
传真：010-83914283
网址：www.cmbc.com.cn
（11）兴业银行股份有限公司
办公地址：福州市五一中路元洪大厦25层
法定代表人：高建平
电话：（021）62677777
传真：（021）62569070
联系人：陈晓瑾
客户服务电话：95561
网址：www.cib.com.cn
（12）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
法人代表：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
（13）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：021-62126969
传真：021-62521689
联系人：吴海平，翁敏芬
客服电话：021–962999
网址：www.shrcb.com
（14）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
伟真：027-85481900
网址：www.cjsc.com.cn
（15）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
（16）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：010-65186080
网址：www.csc108.com
（17）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
客服电话：800-810-8868
联系人：林建闽
电话：0755-82130833-2181
传真：0755-82133302
网址：www.guosen.com.cn
（18）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
（19）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
（20）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：肖时庆
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
（21）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：马韶明
客服电话：400-8888-555
联系人：范雪玲
电话：0755-82492190
传真：0755-82492962
网址：www.lhzq.com
（22）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
客服电话：0351-8686868
联系人：张治国
电话：0351-8686703
传真：0351-8686709
网址：www.i618.com.cn
（23）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
联系人：孙洪喜
电话：021-54033888
传真：021-54038844
网址：www.sw2000.com.cn
（24）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
联系人：金芸
电话：021-53594566-4125
传真：021-53858549
网址：www.htsec.com
（25）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
联系人：陈忠
电话：010-84864818-63266
传真：010-84865560
网址：www. cs.ecitic.com
（26）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：020—96210
联系人：张茜萍
电话：0755-82825555
传真：0755-82558003
网址：www.essences.com.cn
（27）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：徐浩明
客服电话：10108998
联系人：刘晨
电话：021-68816000
传真：021-68817271
网址：www.ebscn.com
（28）中信万通证券股份有限公司
注册地址：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：陈向东
电话：0532-85022026
传真：0532-85022511
网址：www.wtzq.com.cn
（29）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：龙涛
电话：021-50588876
传真：021-50586660-8880
网址：www.longone.com.cn
（30）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
（31）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
开放式基金咨询电话：0571-96598
开放式基金业务传真：0571-85783771
联系人：王勤
联系电话：0571-85783715
网址：www. 96598.com..cn
（32）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
（33）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：陈就明
客服电话：961130
联系人：张建平
电话：0769-22119423
传真：0769-22119423
网址：www.dgzq.com.cn
（34）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
（35）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
（36）华林证券有限责任公司
办公地址：深圳市福田区民田路178号华融大厦5楼
法定代表人：姚桥盛
客服电话：0750—3160388
联系人：杨玲
电话：0755-82707855
传真：0755-82707850
网址：www.chinalions.com
（37）湘财证券股份有限公司
住所：长沙市黄兴中路63号中山国际大厦12楼
法定代表人：陈学荣
客服电话：400-888-1551
联系人：杜颖灏
电话：021-68634518
传真：021-50543470
网址：www.xcsc.com
（38）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：0551—95888
联系人：程维
电话：0551-2634400
传真：0551-2645709
网址：www.gyzq.com.cn
（39）上海证券有限责任公司
注册地址：上海市九江路111号
法定代表人：蒋元真
客服电话：021-962518
联系人：谢秀峰
电话：021-65076608-557
传真：021-65081063
网址：www.962518.com
（40）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：0551-5161671
联系人：唐泳
电话：0551-5161671
传真：0551-5161672
网址：www.huaans.com.cn
（41）兴业证券股份有限公司
注册地址：福建福州市湖东路99号标力大厦
办公地址：上海市浦东陆家嘴东路166号中保大厦18层
客服电话：021-68419393-1259
传真：021-68419867
网址：www.xyzq.com.cn
（42）财通证券经纪有限责任公司
法人代表：沈继宁
公司地址：杭州市解放路111号
客服电话：96336
联系人：乔骏
电话：0571-87925129
传真：0571-87925129
网址：www.ctsec.com
（43）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：400-8888-198
联系人：舒萌菲
电话：025-84784765
传真：025-84784830
网址：www.thope.com
电子邮箱：xtzqbgs@thope.com
（44）东方证券股份有限公司
住所：上海市浦东大道720号20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
（45）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
电话：0771-5539262
传真：0771-5539033
网址：www.ghzq.com.cn
（46）东北证券有限责任公司
地址：吉林省长春市自由大路1138号
法定代表人：李树
客服电话：0431—96688—0
联系人：高新宇
电话：0431-85096710
传真：0431-85680032
网址：www.nesc.cn
（47）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
客服电话：0571-87902079
联系人：吴颖
电话：0571-87901963
传真：0571-87902081
网址：www.stocke.com
（48）渤海证券有限责任公司
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：022-28455588
联系人：王兆权
电话：(022)28451861
传真：(022)28451892
客服电话：28455588
网址：www.bhzq.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32层
法定代表人：胡学光
电话：0755-83183388
传真：0755-83195229
联系人：范瑛、许韬略

（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）61238888
传真：（021）61238800
联系人：金毅

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—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。

Momentum = [illegible]

其中：R_t为股票最近三个月的收益率，

R_i为股票所在行业最近三个月的收益率，

σ_{t-i}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逆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

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2008年03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
股票	16,991,776,311.53	92.48%
债券	917,110,000.00	4.99%
权证	0.00	0.00%
资产支持证券	0.00	0.00%
银行存款和清算备付金合计	445,136,436.28	2.42%
其他资产	19,165,450.78	0.10%
合计	18,373,188,198.59	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	61,347,890.88	0.34%
B采掘业	1,539,156,772.93	8.46%
C制造业	6,175,611,533.42	33.95%
C0食品、饮料	728,349,565.60	4.00%
C1纺织、服装、皮毛	69,705,223.35	0.38%
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	1,441,618,851.12	7.93%
C5电子	133,867,956.62	0.74%
C6金属、非金属	2,103,483,807.05	11.56%
C7机械、设备、仪表	931,491,216.31	5.12%
C8医药、生物制品	683,784,183.17	3.76%
C99其他制造业	83,310,730.20	0.46%
D电力、煤气及水的生产和供应业	889,462,099.55	4.89%
E建筑业	0.00	0.00%
F交通运输、仓储业	1,091,901,549.59	6.00%
G信息技术业	500,443,607.00	2.75%
H批发和零售贸易	843,694,001.07	4.64%
I金融、保险业	4,238,619,493.70	23.30%
J房地产业	1,158,064,122.15	6.37%
K社会服务业	459,615,241.24	2.53%
L传播与文化产业	0.00	0.00%
M综合类	33,860,000.00	0.19%
合计	16,991,776,311.53	93.41%

（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	600036	招商银行	37,611,090	1,209,948,765.30	6.65%
2	601398	工商银行	192,626,561	1,180,800,818.93	6.49%
3	600900	长江电力	63,306,911	889,462,099.55	4.89%
4	000002	万科A	24,878,069	636,878,566.40	3.50%
5	600005	武钢股份	43,204,158	613,067,002.02	3.37%
6	600019	宝钢股份	46,951,252	582,665,037.32	3.20%
7	601939	建设银行	80,008,947	544,860,929.07	3.00%
8	600428	中远航运	14,937,846	491,903,268.78	2.70%
9	601318	中国平安	8,000,000	423,280,000.00	2.33%
10	600048	保利地产	14,202,185	422,515,003.75	2.32%

（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	0.00	0.00%
2	金融债	0.00	0.00%
3	央行票据	917,110,000.00	5.04%
4	企业债	0.00	0.06%
5	可转债	0.00	0.00%
6	其他	0.00	0.00%
	合　计	917,110,000.00	5.04%

（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	08央行票据25	384,360,000.00	2.11%
2	08央行票据36	99,150,000.00	0.55%
3	07央行票据91	96,720,000.00	0.53%
4	08央行票据07	96,140,000.00	0.53%
5	08央行票据19	96,090,000.00	0.53%

（六）报告期间本基金投资权证明细

（1）报告期末按市值占基金资产净直比例大小排序的所有权证明细

无。

（2）报告期内权证投资情况

权证代码	权证名称	期初数量（份）	期间买入数量（份）	期间买入成本（元）	期间卖出数量（份）	权证投资收益（元）	期末数量（份）	备注
580017	赣粤CWB1	0	612,081	2,701,606.58	612,081	334,196.23	0	主动投资
580018	中远CWB1	0	819,966	5,318,240.55	819,966	74,327.26	0	主动投资
580019	石化CWB1	0	459,853	1,307,674.40	459,853	215,407.75	0	被动持有
580020	上港CWB1	0	1,106,343	1,646,982.75	1,106,343	36,052.23	0	主动投资
031006	中兴ZXC1	0	130,550	1,311,638.81	130,550	68,759.15	0	被动持有

（七）报告期末资产支持证券市值占基金净资产的比例以及按市值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券明细

无。

（八）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

序号	其他资产	金额（元）
1	存出保证金	5,209,565.85
2	应收证券清算款	0.00
3	应收利息	6,018,611.23
4	应收申购款	7,937,273.70
5	其他应收款	0.00
6	待摊费用	0.00
	合　计	19,165,450.78

4、报告期末基金持有的处于转股期的可转换债券明细

无。

5、本报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金情况

无。

6、由于四舍五入原因，分项之和与合计可能有尾差。

（下转27版）