

大成蓝筹稳健证券投资基金 更新的招募说明书摘要

2009 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

二〇〇九年七月

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。

基金管理人承诺以恪尽职守、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招募说明书。

基金的过往业绩并不预示其未来表现。

本招募说明书更新已经本基金托管人复核。本更新的招募说明书所载内容截止日为2009年06月03日，有关财务数据和基金净值表现截止日为2009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：张树忠

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：肖冰

大成基金管理有限公司设有股东会、董事会、监事会，下设十五个部门，分别是股票投资部、固定收益部、委托投资部、研究部、交易管理部、金融工程部、信息技术部、客户服务部、市场部、总经理办公室、人力资源部、综合财务部、基金运营部、监察稽核部和国际业务部，并在北京、上海、西安、成都、武汉、福州和沈阳等地设立了七家分公司；此外，还设立了投资决策委员会、投资风险控制委员会和战略规划委员会。

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，力求为投资者获得更大投资回报。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

截止2009年6月3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12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、大成景阳领先股票型证券投资基金、大成强化收益债券型证券投资基金、大成策略回报股票型证券投资基金。

（三）主要人员情况

董事会：

张树忠先生，董事长，经济学博士。1989年7月—1993年2月，任中央财经大学财政系讲师；1993年2月—1997年3月，任华夏证券股份有限公司投资银行总部总经理、研究发展部总经理；1997年3月—2003年7月，任光大证券股份有限公司总裁助理兼北方总部总经理、资产管理总监；2003年7月—2004年6月，任光大保德信基金管理公司董事、副总经理；2004年6月—2006年12月，任大通证券股份有限公司副总经理；2007年1月—2008年1月，任大通证券股份有限公司总经理；2008年1月—2008年4月，任职中国人保资产管理股份有限公司；2008年4月起任中国人保资产管理股份有限公司副总裁、党委委员；2008年11月起同时担任大成基金管理有限公司董事长。

王颢先生，董事总经理，国际工商管理专业博士。2000年12月—2002年9月，任招商证券股份有限公司深圳管理总部副总经理、机构管理部副总经理；2002年9月加入大成基金管理有限公司，历任助理总经理、副总经理；2008年11月起担任大成基金管理有限公司总经理。

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投资部董事总经理。

曾北川先生，董事，博士。1989年8月—1992年6月，任建设部中国城乡建设发展总公司项目经理；1992年6月—1994年3月，任中国建设银行总行房地产信贷部房地产信贷项目经理；1994年4月—1998年5月，任国家开发银行国际金融局信贷一处信贷项目经理、国家开发银行国际金融局综合计划处副处长；1998年5月—2001年10月，任华夏银行北京管理部副总经理、华夏银行北京管理部副总经理（主持工作）；2001年10月—2006年10月，任华夏银行总行营业部常务副总经理（党组副书记）、华夏银行总行稽核部总经理（监事会监事、审计委员会委员）；2006年10月—2008年4月，任中国人寿保险股份有限公司市场拓展部总经理；2008年4月，任人保金控投资有限公司筹备组成员；2008年7月起任中国华闻投资控股有限公司总裁、党委书记。

杨赤忠先生，董事，大学本科。历任深圳蓝天基金管理公司投资与研究部经理；长盛基金管理有限公司研究部副总监、基金经理；大成基金管理有限公司研究总监；光大证券证券投资部总经理。现任光大证券助理总裁。

蔺春林先生，独立董事，大学本科。1970—1971年，解放军信阳坦克师锻炼；1971—1987年，任兵器部5107、5137厂生产会计员、财务处长；1987年—1998年，任湖北省财政厅中央企业处副处长、财政部驻湖北省专员助理；1998年—2005年，任财政部驻江西

专员办专员助理、副专员、专员、党组书记；2005年8月，任中央纪委、中组部金融巡视组组长；2007年1月退休。

于绪刚先生，独立董事，法学博士，环太平洋律师协会会员、全国律协金融证券委员会委员、华中科技大学兼职教授及研究生导师、北京工商大学客座教授、华北电力大学客座教授。1990年—1995年，任河北省保定市中级人民法院助理审判员；1995年—1998年，北京大学法学硕士学习；1999年，香港大学法律学院访问学者、香港法律教育信托基金访问学者；1999年—2001年，北京大学法学博士学习；2001年起任大成律师事务所律师、高级合伙人、管委会委员。

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。

刘大为先生，独立董事，国家开发银行总会计师，高级经济师，享受政府特殊津贴专家。中国人民银行研究生部硕士生指导老师，首都经济贸易大学兼职教授，清华大学中国经济研究中心高级研究员。先后在北京市人民政府研究室（副处长、处长），北京市第一商业局（副局长），中国建设银行信托投资公司（总经理），中国投资银行（行长），国家开发银行（总会计师）工作。

监事会：

胡学光先生，监事长，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月至2008年8月任大成基金管理有限公司董事长。

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。

黄建农先生，监事，大学本科。曾任中国银河证券有限责任公司上海江苏北路营业部总经理，中国银河证券有限责任公司资产管理总部副总经理，总经理，中国银河投资管理公司投资管理部总经理。现任中国银河投资管理公司上海投资部董事总经理。

其他高级管理人员：

刘彩晖女士，副总经理，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1月—7月任深圳中航集团公司人力资源部副总经理；2006年8月—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上市代表、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月起，任大成基金管理有限公司督察长兼监察稽核部总监。

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，13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由9名成员组成，设主任委员1名，其他委员8名。名单如下：

刘明，投资总监，大成优选股票型证券投资基金基金经理，投资决策委员会主任委员；杨建华，股票投资部总监，负责公司股票投资业务，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，固定收益部总监，负责公司固定收益证券投资业务，大成强化收益债券型证券投资基金基金经理，投资决策委员会委员；曹雄飞，研究总监，大成精选增值混合型证券投资基金基金经理，投资决策委员会委员；邓韶勇，交易管理部总监，投资决策委员会委员；姚榕，研究部副总监，投资决策委员会委员；施永辉，大成蓝筹稳健证券投资基金基金经理，投资决策委员会委员；杨丹，大成沪深300指数证券投资基金基金经理、景福证券投资基金基金经理，投资决策委员会委员；王立，大成债券投资基金、大成

货币市场证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 2008 年末，中国银行境内外机构共有 10,789 家，其中内地机构 9,983 家，港澳及境外机构 806 家。内地商业银行部分，一级分行、直属分行 37 家，二级分行 284 家，基层分支机构 9,659 家，是中国国际化程度最高的银行。截至 2008 年末，中国银行资产总额 69,556.94 亿元，负债总额 64,617.93 亿元，归属于母公司所有者权益合计

4,682.72 亿元，分别比上年末增长 16.01%、16.63%和 10.24%。实现净利润 650.73 亿元，比上年增长 4.93%；实现归属于母公司所有者的净利润 635.39 亿元，同比增长 13.00%；每股收益为 0.25 元，比上年增加 0.03 元。不良贷款率由 3.12%下降至 2.65%。集团年末总市值达到 6,699.97 亿元，列全球上市银行第六位。

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 2008 年，中国银行连续被《环球金融》杂志评为“中国最佳外汇银行”，并评为 2008 年度中国最佳债券和现金管理银行；2008 年，中国银行在《银行家》杂志“世界 1000 家大银行”中排名第 10 位；2008 年中国银行被《财资》评为中国最佳贸易融资银行；2008 年中国银行被《金融亚洲》评为最佳贸易融资银行、最佳外汇交易银行、最佳派息政策承诺奖、亚洲最佳公司（最佳股利政策）；

2008 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外汇服务银行和中国本土最佳贸易服务银行；2008 年中国银行被《欧洲货币》评为中国区最佳商业银行、中国区债务资本市场最佳投资银行、香港区最佳商业银行和中国区最佳外汇服务奖；2008 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。

李早航先生，自 2004 年 8 月起任本行执行董事。2000 年 11 月加入本行并自此担任

本行副行长。于 1980 年 11 月至 2000 年 11 月任职于中国建设银行，曾工作于多个岗位，先后担任分行行长、总行多个部门的总经理及副行长。1978 年毕业于南京信息工程大学。2002 年 6 月起担任中银香港控股非执行董事。

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。

（四）证券投资基金托管情况

截止 2008 年 12 月末，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、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、银河竞争优势成长、国投瑞银稳定增利债券型、嘉实研究精选股票、长盛创新先锋灵活配置、国泰金鹿保本二期、易方达中小盘股票型、友邦华泰价值、工银瑞信大盘蓝筹、银华领先策略股票型、泰达荷银集利债券型基金、华宝兴业大盘精选股票型基金、华夏策略精选灵活配置混合型基金、富兰克林国海强化收益债券型等 64 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，以信息技术手段为依托，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：张树忠

电话：0755-83183388

传真：0755-83199588

联系人：梁靖

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：梁靖、瞿宗怡

(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：徐舫、朱君

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

客服电话：95566

传真：010-66594946

电话：010-66594977

网址：www.boc.cn

(2) 中国农业银行股份有限公司

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

(3) 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

办公地址：北京市西城区闹市口大街1号长安兴融中心1号楼

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

(4) 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

(5) 深圳市平安银行股份有限公司

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、4006699999

公司网站：www.18ebank.com

(6) 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 (FrankN.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

(7) 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

法定代表人：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

(8) 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：胡怀邦

客服电话：95559

联系人：曹榕

电话：021-58781234

传真：021-58408842

网址：www.bankcomm.com

(9) 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：潘玲

客户服务电话：95561

网址：www.cib.com.cn

(10) 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

(11) 中国光大银行股份有限公司

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：李伟

电话：010-68560675

传真：010-68560661

网址：www.cebbank.com

(12) 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：董云巍

电话：010-58351666-8155

传真：010-83914283

网址：www.cmbc.com.cn

(13) 广东发展银行股份有限公司

注册地址：广州市农林下路83号

法定代表人：李若虹

客服电话：95508

电话：020-87310888

网址：www.gdb.com.cn

(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：侯巍

客服电话：400-666-1618

联系人：张治国

电话：0351-8686703

传真：0351-8686619

网址：www.i618.com.cn

（15）东方证券股份有限公司

住所：上海市中山南路318号新源广场2号楼21-29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

（16）东北证券股份有限公司

注册地址：长春市自由大路1138号

办公地址：长春市自由大路1138号

法定代表人：矫正中

联系人：潘锴

电话：85096709

客户服务电话：0431-96688-00431-85096733

网址：www.nesc.cn

（17）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

传真：027-85481900

网址：www.cjsc.com.cn

（18）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：上海浦东新区银城中路168号上海银行大厦

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

（19）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：北京市朝阳区门内大街188号

法定代表人：张佑君

客服电话：400-8888-108

联系人：魏明

电话：010-85130579

网址：www.csc108.com

（20）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

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

（21）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

（22）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

(23) 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：胡长生

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

(24) 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：盛宗凌

电话：0755-82492000

传真：0755-82492962

网址：www.lhzq.com

(25) 申银万国证券股份有限公司

通讯地址：上海市常熟路239号2楼

法定代表人：丁国荣

客服电话：021-962505

联系人：曹晔

电话：021-54033888

传真：021-54038844

网址：www.sw2000.com.cn

(26) 海通证券股份有限公司

注册地址：上海市淮海中路98号

法定代表人：王开国

客服电话：95553、400-888-8001

联系人：金芸

电话：021-23219000

传真：021-63602722

网址：www.htsec.com

(27) 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各地营业部咨询电话

联系人：陈忠

电话：010-84683893

传真：010-84865560

网址：www.cs.ecitic.com

(28) 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：4008001001

联系人：张茜萍

电话：0755-82558335

传真：0755-82558335

网址：www.axzq.com.cn

(29) 光大证券股份有限公司

办公地址：上海市静安区新闻路1508号

法定代表人：徐浩明

客服电话：400888788;10108998

联系人：刘晨、李芳芳

电话：021-22169081

传真：021-22169134

网址: www.ebscn.com

(30) 华林证券有限责任公司

办公地址: 珠海市拱北夏湾华平路96号二层202-203房

法定代表人: 段文清

客服电话: 0750—3160388各地营业部客户服务电话

联系人: 杨玲

电话: 0755-82707855

传真: 0755-82707850

网址: www.chinalions.com

(31) 中信万通证券有限责任公司

注册地址: 青岛市崂山区苗岭路29号澳柯玛大厦15层(1507-1510室)

办公地址: 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: 丁韶燕

电话: 0532-85022026

传真: 0532-85022026

网址: www.zxwt.com.cn

(32) 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: 李涛

电话: 021-50586660

传真: 021-50586660-8880

网址: www.longone.com.cn

(33) 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

（34）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

电话：0571-96598

传真：0571-85783771

联系人：王勤

联系电话：0571-85783715

网址：www.bigsun.com.cn

（35）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号东山广场主楼五楼

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

（36）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

(37) 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

(38) 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

办公地址：上海陆家嘴环路958号华能联合大厦5层

法定代表人：陈学荣

客服电话：400-888-1551

联系人：钟康莺

电话：021-68634518

传真：021-68865680

网址：www.xcsc.com

(39) 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：400-888-8777、0551—95888

联系人：程维

电话：0551-2634400

传真：0551-2645709

网址：www.gyzq.com.cn

(40) 上海证券有限责任公司

注册地址：上海市西藏中路336号

办公地址：上海市西藏中路336号

法定代表人：蒋元真

客服电话：021-962518

联系人：谢秀峰

电话：021-51539888

传真：021-65081063

网址：www.962518.com

(41) 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：0551-96518、400-80-96518

联系人：甘霖

电话：0551-5161821

传真：0551-5161672

网址：www.hazq.com

(42) 兴业证券股份有限公司

住所：福建省福州市湖东路99号标力大厦

办公地址：上海市浦东新区陆家嘴东路166号中国保险大厦18楼

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

客服电话：400888123

(43) 财通证券经纪有限责任公司

注册地址：杭州市解放路111号金钱大厦

办公地址：杭州市解放路111号金钱大厦

法定代表人：沈继宁

联系人：乔骏

电话：0571-87925129

传真：0571-87925129

网址：www.ctsec.com

客户服务电话：0571-96336

(44) 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：400-8888-918

联系人：舒萌菲

电话：025-84784765

传真：025-84784830

网址：www.thope.com

(45) 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

联系人：吴颖

电话：0571-87901963

传真：0571-87902081

网址：www.stocke.com

(46) 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：4006515988

联系人：王兆权

电话：022-28451861

传真：022-28451892

客服电话：28455588

网址：www.ewww.com.cn

(47) 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

(48) 方正证券有限责任公司

注册地址:湖南省长沙市芙蓉中路二段华侨国际大厦22—24层

办公地址:湖南省长沙市建湘路479号

法定代表人:雷杰

客服电话: 0571-95571、0731-95571、13258915782

电话:0731-28823400571-87782047

传真:0731-2882332

网址: www.foundersc.com

(49) 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: 游锦辉

客服电话: 0769-961130

联系人: 张建平

电话: 0769-22119426

传真: 0769-22119423

网址: www.dgzq.com.cn

(50) 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

联系人: 覃清芳

电话: 0771-5539262

传真: 0771-5539033

网址: www.ghzq.com.cn

(51) 恒泰证券有限责任公司

注册地址: 内蒙古呼和浩特市新城区新华东街111号

法人代表: 刘汝军

客户服务电话: 0471-4961259

联系人: 常向东

电话: 0471-4913998

传真：0471-4930707

网址：www.cnht.com.cn

(52) 瑞银证券有限责任公司

注册地址：北京市西城区金融大街7号英蓝国际金融中心12层、15层

办公地址：北京市西城区金融大街7号英蓝国际金融中心12层、15层

法定代表人：刘弘

电话：010-59226788

传真：010-59226840

联系人：谢亚凡

客户服务电话：400-887-8827

网址：www.ubssecurities.com

(53) 宏源证券股份有限公司

注册地址：新疆乌鲁木齐市建设路2号

办公地址：北京市海淀区西直门北大街甲43号金运大厦B座6层

法定代表人：汤世生

联系人：韩梅

电话：010-62294608-6957

传真：010-62296854

客户服务电话：010-62294600

网址：www.hysec.com

(54) 长城证券有限责任公司

注册地址：深圳市福田区深南大道6008号特区报业大厦14、16、17层

法定代表人：黄耀华

联系人：匡婷

电话：0755-83516289

传真：0755-83516199

客户服务热线：0755-336800004006666888

长城证券网站：www.cc168.com.cn

(55) 国都证券有限责任公司

注册地址：深圳市福田区中心区金田路4028号荣超经贸中心26层11、12

办公地址：北京市东城区东直门南大街3号国华投资大厦9层

法定代表人：王少华

联系人：黄静

客户服务电话：800-810-8809

网址：www.guodu.com

(56) 江海证券经纪有限责任公司

办公地址：哈尔滨市香坊区赣水路56号

法人代表：孙名扬

电话：0451-82269286

客服热线：4006662288

联系人：葛新

网址：www.jhzq.com.cn

(57) 中国国际金融有限公司

注册地址：北京市建国门外大街1号国贸大厦2座27层及28层

办公地址：北京市建国门外大街甲6号SK大厦

法定代表人：李剑阁

联系人：王雪筠

客服电话：(010) 85679238 (010) 85679169

网址：www.ciccs.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：张树忠

电话：0755-83183388

传真：0755-83195229

联系人：范瑛

(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人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人关系
 - 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。

$$\text{Momentum} = \frac{(R_s - R_i)}{\sigma_{s-i}} \times Tr$$

其中： R_s 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_{s-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:

$$70\% \times \text{天相 280 指数} + 30\% \times \text{中信国债指数}$$

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

基金管理人的董事会及董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏,并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带责任。

基金托管人中国银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2009年6月26日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2009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

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	10,210,974,996.22	82.38
	其中:股票	10,210,974,996.22	82.38
2	固定收益投资	1,198,735,000.00	9.67
	其中:债券	1,198,735,000.00	9.67
	资产支持证券	-	0.00
3	金融衍生品投资	-	0.00
4	买入返售金融资产	-	0.00
	其中:买断式回购的买入返售金融资产	-	0.00
5	银行存款和结算备付金合计	683,115,129.70	5.51
6	其他资产	301,544,933.75	2.43
7	合计	12,394,370,059.67	100.00

(二) 报告期末按行业分类的股票投资组合

代码	行业类别	公允价值(元)	占基金资产净值
----	------	---------	---------

			比例（%）
A	农、林、牧、渔业	-	0.00
B	采掘业	477,480,000.00	3.90
C	制造业	4,787,754,478.74	39.07
C0	食品、饮料	544,183,474.80	4.44
C1	纺织、服装、皮毛	14,339,639.34	0.12
C2	木材、家具	-	0.00
C3	造纸、印刷	-	0.00
C4	石油、化学、塑胶、塑料	641,464,434.59	5.23
C5	电子	588,870.00	0.00
C6	金属、非金属	688,532,078.90	5.62
C7	机械、设备、仪表	1,669,677,633.89	13.62
C8	医药、生物制品	1,228,968,347.22	10.03
C99	其他制造业	-	0.00
D	电力、煤气及水的生产和供应业	731,530,592.72	5.97
E	建筑业	50,530,758.80	0.41
F	交通运输、仓储业	97,456,782.20	0.80
G	信息技术业	353,369,383.60	2.88
H	批发和零售贸易	225,126,531.50	1.84
I	金融、保险业	1,712,531,493.79	13.97
J	房地产业	1,365,542,962.47	11.14
K	社会服务业	236,154,487.64	1.93
L	传播与文化产业	34,735,584.26	0.28
M	综合类	138,761,940.50	1.13
	合计	10,210,974,996.22	83.32

（三）报告期末按公允价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）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	600030	中信证券	27,600,000	702,972,000.00	5.74
2	000792	盐湖钾肥	11,099,921	641,464,434.59	5.23
3	600900	长江电力	65,496,911	623,530,592.72	5.09
4	601318	中国平安	14,910,148	583,135,888.28	4.76
5	600048	保利地产	25,001,412	550,281,078.12	4.49
6	600005	武钢股份	50,599,335	371,905,112.25	3.03
7	000800	一汽轿车	28,866,952	354,197,501.04	2.89
8	000002	万科A	39,599,948	327,887,569.44	2.68
9	600583	海油工程	21,000,000	326,960,000.00	2.67
10	000538	云南白药	8,005,206	292,190,019.00	2.38

（四）报告期末按券种分类的债券投资组合

序号	债券品种	公允价值（元）	占基金资产净值
----	------	---------	---------

			比例（%）
1	国家债券	-	0.00
2	央行票据	531,255,000.00	4.34
3	金融债券	667,480,000.00	5.45
	其中：政策性金融债	667,480,000.00	5.45
4	企业债券	-	0.00
5	企业短期融资券	-	0.00
6	可转债	-	0.00
7	其他	-	0.00
8	合计	1,198,735,000.00	9.78

（五）报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券明细

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	080308	08 进出 08	3,500,000	368,410,000.00	3.01
2	080217	08 国开 17	3,000,000	299,070,000.00	2.44
3	0801040	08 央行票据 40	2,500,000	240,425,000.00	1.96
4	0801058	08 央行票据 58	2,000,000	193,020,000.00	1.58
5	0801112	08 央行票据 112	1,000,000	97,810,000.00	0.80

（六）报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名资产支持证券投资
 明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

（七）报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

（八）投资组合报告附注

1、报告期内本基金投资的前十名证券的发行主体本期被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形：

根据青海盐湖钾肥股份有限公司董事会 2009 年 2 月 27 日“受到有关部门相关处罚的提示性公告”，由于盐湖钾肥销售部门在 2008 年部分销售期间，未及时严格履行监管部门制订的氯化钾销售临时指导价格（公司氯化钾售价超出指导价），监管部门对公司 2008 年进行了 500 万元的相关经济处罚。

本基金认为，该处罚不会对盐湖钾肥投资价值构成实质性负面影响。

本基金对盐湖钾肥投资决策说明：本公司的投研团队经过充分调研，认为盐湖钾肥符合本基金价值投资的理念，投资盐湖钾肥的相关投资决策已获得公司投资决策委员会批准，本基金投资盐湖钾肥的全部流程符合公司投资制度的规定。

2、本基金投资的前十名股票未超出基金合同规定的备选股票库。

3、其他资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	3,796,003.15
2	应收证券清算款	265,873,295.19
3	应收股利	-
4	应收利息	29,977,550.61
5	应收申购款	1,898,084.80
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	301,544,933.75

4、报告期末基金持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

5、报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值(元)	占基金资产净值比例（%）	流通受限情况说明
1	600900	长江电力	623,530,592.72	5.09	长期停牌
2	600583	海油工程	63,600,000.00	0.52	非公开发行

6、由于四舍五入原因，分项之和与合计可能有尾差。

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。

（一）自基金合同生效日(2004年06月03日)至2009年3月31日以来完整会计年度的基金份额净值增长率以及与同期业绩比较基准收益率的比较：

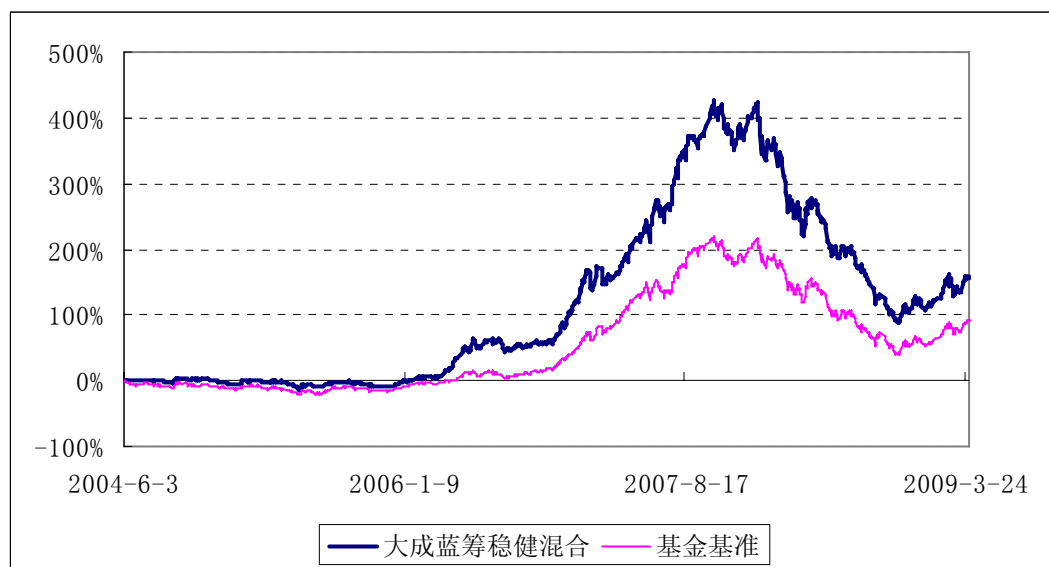
阶段	净值增长率 ①	净值增长率标准差 ②	业绩比较基准收益率 ③	业绩比较基准收益率标准差 ④	①—③	②—④
2004.06.03-2004.12.31	-1.65%	0.71%	-11.78%	0.96%	10.13%	-0.25%
2005.01.01-2005.12.31	-2.34%	0.93%	-1.68%	0.94%	-0.66%	-0.01%
2006.01.01-2006.12.31	129.02%	1.43%	65.34%	1.00%	63.67%	0.42%
2007.01.01-2007.12.31	127.40%	1.95%	105.10%	1.63%	22.3%	0.32%
2008.01.01-2008.12.31	-58.55%	2.20%	-49.54%	2.13%	-9.01%	0.07%
2009.01.01-2009.03.31	25.48%	1.95%	26.26%	1.64%	-0.78%	0.31%

2004.06.03-2009.03.31	160.14%	1.64%	89.77%	1.48%	70.37%	0.16%
-----------------------	---------	-------	--------	-------	--------	-------

(二) 自基金合同生效以来基金份额净值的变动情况，并与同期业绩比较基准的变动的比较

大成蓝筹稳健基金累计份额净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图

(2004年6月3日至2009年3月31日)



注：按基金合同规定，本基金自基金合同生效起6个月内为建仓期。依据本基金2005年8月31日《关于调整大成蓝筹稳健证券投资基金资产配置比例的公告》，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。截至报告日本基金的各项投资比例已达到基金合同中规定的各项比例。

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

基金管理人的基金管理费按基金资产净值的1.5%年费率计提。

在通常情况下，基金管理费按前一日基金资产净值的1.5%年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 1.5\% \div \text{当年天数}$$

H为每日应计提的基金管理费

E为前一日基金资产净值

基金管理费每日计提，按月支付。由基金管理人向基金托管人发送基金管理费划付指令，基金托管人复核后于次月首日起两日内从基金资产中一次性支付给基金管理人。

(2) 基金托管人的基金托管费

基金托管人的基金托管费按基金资产净值的0.25%年费率计提。

在通常情况下，基金托管费按前一日基金资产净值的0.25%年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 0.25\% \div \text{当年天数}$$

H为每日应计提的基金托管费

E为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计提，按月支付。由基金管理人向基金托管人发送基金托管费划付指令，基金托管人复核后于次月首日起5个工作日内从基金资产中一次性支付给基金托管人。

(3) 上述第1款第3项至第7项费用由基金托管人根据有关法规及相应协议的规定，按费用实际支出金额支付，列入当期基金费用。

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。基金合同生效之前的律师费、会计师费和信息披露费用不得从基金财产中列支。

4、基金管理费和基金托管费的调整

基金管理人和基金托管人可协商酌情调低基金管理费、基金托管费，无须召开基金份额持有人大会。

(二) 与基金销售有关的费用

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，不列入基金财产。

(1) 投资人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。投资人若选择申购时交纳称为前端申购费，投资人若选择在赎回时交纳则称为后端申购费。

(2) 投资人选择交纳前端申购费时，按照申购金额采用比例费率，具体如下表所示：

申购金额 M	费率
M < 50 万	1.5%
50 万 ≤ M < 200 万	1.0%
200 万 ≤ M < 500 万	0.6%
M ≥ 500 万	1000 元/笔

计算公式如下：

净申购金额 = 申购金额 / (1 + 申购费率)

申购费用 = 申购金额 - 净申购金额

申购份额 = 净申购金额 / 申购当日基金份额净值

(3) 投资人选择后端申购费时，基金申购份额的计算公式为：

申购份数 = 申购金额 / 申购日基金份额净值

交纳的后端申购费按照持有时间采用比例费率，并随持有时间递减，具体计算公式如下：

后端申购费用 = 赎回份额 × 申购申请日的基金份额净值 × 该部分份额对应的后端申购费率

后端申购费率具体如下表所示：

持有年限	费率
T < 1 年	2.0%
1 ≤ T < 2 年	1.5%
2 ≤ T < 3 年	1.0%
3 ≤ T < 5 年	0.5%
T ≥ 5	0

2、赎回费用

本基金的赎回费用按持有期递减，最高不超过赎回总金额的0.50%；

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总额的25%；具体费率如下：

持有期	赎回费率
T < 365	0.5%
T ≥ 365	0.25%

基金的净赎回金额为赎回金额扣减赎回费用和其他相关费用后的余额，计算公式如下：

赎回金额 = 赎回份数 × 申请日基金份额净值

赎回费用=赎回金额×赎回费率

净赎回金额= 赎回金额－赎回费用－后端申购费用

3、基金管理人可根据市场情况，在不违背有关法律、法规和基金合同规定的情况下调整本基金的申购和赎回费率，调整结果将于前两日内在至少一种中国证监会指定的媒体上公告。

4、基金管理人可在不违背法律法规规定的情形下，根据市场情况制定基金促销计划，定期或不定期地开展基金促销活动。在基金促销活动期间，基金管理人可以对促销活动范围内的投资人调低基金的费率。

5、基金转换费用

(1) 每笔基金转换视为转出基金的一笔基金赎回和转入基金的一笔基金申购。基金转换费用由转出基金赎回费用及基金申购补差费用两部分构成。

(2) 转入基金时，从申购费用低的基金向申购费用高的基金转换时，每次收取申购补差费用；从申购费用高的基金向申购费用低的基金转换时，不收取申购补差费用。转入基金的申购补差费用按照转换金额对应的转出基金与转入基金的申购费率差额进行补差。

(3) 转出基金时，如涉及的转出基金有赎回费用，收取该基金的赎回费用。收取的赎回费用25%归入基金资产，其余部分用于支付注册登记费等相关手续费。

(4) 投资人可以发起多次基金转换业务，基金转换费用按每笔申请单独计算。

(5) 基金管理人可以根据市场情况在不违背有关法律、法规和基金合同的规定之前提下，调整上述收费方式和费率水平，但最迟应于新收费办法开始实施日前2日内在至少一种中国证监会指定媒体上公告。

(三) 基金税收

本基金运作过程中涉及的各项纳税主体，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，个人投资人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

本更新的招募说明书依据《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》及其他有关法律法规的要求，对 2009 年 1 月 16 日公布的《大成蓝筹稳健证券投资基金更新的招募说明书（2008 年 2 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. 根据最新资料，更新了“三、基金管理人”部分。
2. 根据最新资料，更新了“四、基金托管人”部分。
3. 根据最新资料，更新了“五、相关服务机构”部分。
4. 根据最新数据，更新了“九、基金的投资”部分。
5. 根据最新数据，更新了“十、基金的业绩”部分。
6. 根据最新公告，更新了“十四、基金费用与税收”。
7. 根据最新公告，更新了“二十二、其他应披露的事项”。

大成基金管理有限公司

2009年7月17日