

# 大成债券投资基金 更新的招募说明书摘要

2009年第2期

基金管理人：大成基金管理有限公司

基金托管人：中国农业银行股份有限公司

二〇一〇年一月

## 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的核准，并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。

本基金管理人承诺依照恪尽职守、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。

投资有风险，投资者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。基金投资者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《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。基金投资者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》。

本招募说明书更新已经本基金托管人复核。本招募说明书（更新）所载内容截止日为2009年12月12日，有关财务数据和净值表现截止日为2009年9月30日，本报告中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：张树忠

成立日：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责任公司（持股 48%）、中国银河投资管理有限公司（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。公司在北京、上海、西安、成都、武汉、福州和沈阳等地设立了七家分公司，并在香港设立了子公司。此外，公司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等专业委员会。

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

截至 2009 年 12 月 12 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 13 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(LOF)、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和大成行业轮动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：

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。

刘虹先生，董事，博士，高级经济师。1985 年 7 月—1998 年 11 月，任国家计委国土局主任科员、副处长（主持工作）；1998 年 11 月—2000 年 9 月，任中国农业发展银行资金计划部计划处副处长（主持工作）；2000 年 9 月—2004 年 9 月，任中国人寿保险（集团）公司战略规划部战略研究与规划处处长；2004 年 9 月—2006 年 2 月，任中国人寿保险（集团）公司战略规划部副总经理；2006 年 2 月—2007 年 6 月，任中国人寿保险股份有限公司发展改革部总经理；2007 年 6 月—2007 年 8 月，任中国人民保险集团公司高级专家；2007 年 8 月至今，任人保投资控股有限公司总裁、党委书记；2009 年 11 月起，兼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。

孙学林先生，董事，博士研究生在读，中国注册会计师，注册资产评估师。1997年5月—2000年4月，任职于中国长城信托投资公司；2000年4月—2007年2月，任职于中国银河证券有限公司审计与合规管理部；现任中国银河投资管理有限公司资产管理部总经理。

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，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，现任浦东改革与发展研究院院长。

刘大为先生，独立董事，国家开发银行顾问，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

王立女士，基金经理，经济学硕士。6年证券从业经历，曾任职于申银万国证券股份有限公司、南京市商业银行资金营运中心。2005年4月加盟大成基金管

理有限公司，曾任交易部银行间市场债券交易员、大成货币市场基金基金经理助理。2007年1月起担任大成货币市场基金基金经理，2009年5月起同时担任大成债券投资基金基金经理。

## (2) 历任基金经理

| 历任基金经理姓名 | 管理本基金时间         |
|----------|-----------------|
| 陈尚前      | 2003年6月—2009年5月 |

## 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，研究部总监，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；施永辉，股票投资部副总监，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；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；曹志刚，金融工程部首席金融工程师，投资决策委员会委员；刘安田，研究部总监助理，首席宏观策略分析师，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) 基本情况

名称：中国农业银行股份有限公司（以下简称“中国农业银行”）

住所：北京市东城区建国门内大街69号

办公地址：北京市海淀区西三环北路100号金玉大厦

法定代表人：项俊波

成立时间：2009年1月15日

注册资本：2600亿元人民币

存续期间：持续经营

联系电话：010-68424199

联系人：李芳菲

中国农业银行股份有限公司是中国金融体系的重要组成部分，总行设在北京。经国务院批准，中国农业银行整体改制为中国农业银行股份有限公司并于2009年1月15日依法成立。中国农业银行股份有限公司承继原中国农业银行全部资产、负债、业务、机构网点和员工。中国农业银行网点遍布中国城乡，成为国内网点最多、业务辐射范围最广，服务领域最广，服务对象最多，业务功能齐全的大型国有商业银行之一。在海外，中国农业银行同样通过自己的努力赢得了良好的信誉，每年位居《财富》世界500强企业之列。作为一家城乡并举、联通国际、功能齐备的大型国有商业银行，中国农业银行一贯秉承以客户为中心的经营理念，坚持审慎稳健经营、可持续发展，立足县域和城市两大市场，实施差异化竞争策略，着力打造“伴你成长”服务品牌，依托覆盖全国的分支机构、庞大的电子化网络和多元化的金融产品，致力为广大客户提供优质的金融服务，与广大客户共创价值、共同成长。

中国农业银行是中国第一批开展托管业务的国内商业银行，经验丰富，服务优质，业绩突出，2004年被英国《全球托管人》评为中国“最佳托管银行”。2007年中国农业银行通过了美国SAS70内部控制审计，并获得无保留意见的SAS70审计报告，表明了独立公正第三方对中国农业银行托管服务运作流程的风险管理、内部控制的健全有效性的全面认可。

中国农业银行证券投资基金托管部于1998年5月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，内设养老金管理中心、技术保障处、营运中心、委托资产托管处、保险资产托管处、证券投资基金托管处、境外资产托管处、综合管理处、风险管理处，拥有先进的安全防范设施和基金托管业务系统。

## （二）主要人员情况

中国农业银行托管业务部现有员工130名，其中高级会计师、高级经济师、高级工程师、律师等专家10余名，服务团队成员专业水平高、业务素质好、服务能力强，高级管理层均有20年以上金融从业经验和高级技术职称，精通国内外证券市场的运作。

### （三）基金托管业务经营情况

截止 2009 年 12 月 12 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 74 只，包括大成债券投资基金、华夏平稳增长混合型证券投资基金、大成积极成长股票型证券投资基金、大成景阳领先股票型证券投资基金、大成创新成长混合型证券投资基金、长盛同德主题增长股票型证券投资基金、裕阳证券投资基金、汉盛证券投资基金、裕隆证券投资基金、景福证券投资基金、鸿阳证券投资基金、丰和价值证券投资基金、久嘉证券投资基金、富国天源平衡混合型证券投资基金、长盛成长价值证券投资基金、宝盈鸿利收益证券投资基金、大成价值增长证券投资基金、银河稳健证券投资基金、银河收益证券投资基金、长盛中信全债指数增强型债券投资基金、长信利息收益开放式证券投资基金、长盛动态精选证券投资基金、景顺长城内需增长开放式证券投资基金、万家增强收益债券型证券投资基金、大成精选增值混合型证券投资基金、长信银利精选开放式证券投资基金、富国天瑞强势地区精选混合型证券投资基金、鹏华货币市场证券投资基金、中海分红增利混合型证券投资基金、国泰货币市场证券投资基金、新华优选分红混合型证券投资基金、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证券投资基金、景顺长城资源垄断股票型证券投资基金、大成沪深 300 指数证券投资基金、信诚四季红混合型证券投资基金、富国天时货币市场基金、富兰克林国海弹性市值股票型证券投资基金、益民货币市场基金、长城安心回报混合型证券投资基金、中邮核心优选股票型证券投资基金、景顺长城内需增长贰号股票型证券投资基金、交银施罗德成长股票型证券投资基金、长盛中证 100 指数证券投资基金、泰达荷银首选企业股票型证券投资基金、东吴价值成长双动力股票型证券投资基金、鹏华动力增长混合型证券投资基金、宝盈策略增长股票型证券投资基金、国泰金牛创新成长股票型证券投资基金、益民创新优势混合型证券投资基金、中邮核心成长股票型证券投资基金、华夏复兴股票型证券投资基金、富国天成红利灵活配置混合型证券投资基金、长信双利优选灵活配置混合型证券投资基金、富兰克林国海深化价值股票型证券投资基金、申万巴黎竞争优势股票型证券投资基金、新华优选成长股票型证券投资基金、金元比联成长动力灵活配置混合型证券投资基金、天治稳健双盈债券型证券投资基金、中海蓝筹灵活配置混合型证券投资基金、长信利丰债券型证券投资



基金、金元比联丰利债券型证券投资基金、交银施罗德先锋股票型证券投资基金、东吴进取策略灵活配置混合型开放式证券投资基金、建信收益增强债券型证券投资基金、银华内需精选股票型证券投资基金(LOF)、大成行业轮动股票型证券投资基金、交银施罗德上证 180 公司治理交易型开放式指数证券投资基金联接基金、上证 180 公司治理交易型开放式指数证券投资基金、富兰克林国海沪深 300 指数增强型证券投资基金、南方中证 500 指数证券投资基金(LOF)、景顺长城能源基建股票型证券投资基金、中邮核心优势灵活配置混合型证券投资基金。

### 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: 张树忠

电话: 0755-83183388

传真: 0755-83199588

联系人: 梁靖

公司网址: [www.dcfund.com.cn](http://www.dcfund.com.cn)

全国统一客户服务号码: 021-53599588、400-888-5558 (免固话长途费)

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) 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: 梁靖、瞿宗怡

电话: 0755-83195236

传真: 0755-83195091

##### (2) 大成基金北京投资理财中心

###### 1) 东直门

电话: 010-58156152/53

传真: 010-58156315/23

地址：北京市东城区东直门南大街 5 号中青旅大厦 105 室

联系人：李宁

2) 平安里

电话：010-85252345/46

传真：010-85252272/73

地址：北京市西城区平安里西大街 28 号光大国际中心 1601 室

联系人：廖红军

(3) 大成基金上海投资理财中心

1) 广东路

地址：上海市广东路 689 号海通证券大厦 19 层

联系人：徐舫

电话：021-63513925/26

传真：021-63513928

2) 南京西路

地址：上海市静安区南京西路 580 号南证大厦 102、103 室

联系人：朱君

电话：021-62185377、62185277

传真：021-62185233

2. 代销机构

(1) 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](http://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) 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](http://www.spdb.com.cn)

(6) 浙商银行股份有限公司

注册地址：杭州市庆春路 288 号（办公地址同注册地址）

法定代表人：张达洋

客户服务热线：95105665

联系人：吴军阳

电话：0571-87659084

传真：0571-87659188

网址：[www.czbank.com](http://www.czbank.com)

(7) 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](http://www.sdb.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](http://www.bankcomm.com)

(9) 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

（10）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

（11）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

（12）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

（13）北京银行股份有限公司

注册地址：北京市西城区金融大街丙17号

法定代表人：闫冰竹

联系人：王曦

客服电话：010-96169（北京）、022-96269（天津）、021-53599688（上海）、  
029-85766888（西安）、0755-23957088（深圳）、0571-86590900（杭州）

网址：[www.bankofbeijing.com.cn](http://www.bankofbeijing.com.cn)

（14）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：021-38576977

传真：021-62521689

联系人：吴海平、翁敏芬

客服电话：021-962999

网址：[www.shrcb.com](http://www.shrcb.com)

（15）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](http://www.18ebank.com)

（16）温州银行股份有限公司

注册地址：温州市车站大道华海广场 1 号楼

法定代表人：夏瑞洲

客服电话：0577-96699

网址：[www.wzbank.cn](http://www.wzbank.cn)

（17）青岛银行股份有限公司

地址：青岛市市南区香港中路 68 号华普大厦

法定代表人：张广鸿

联系人：滕克

客服电话：96588（青岛）、400-66-96588（全国）

网址：[www.qdccb.com](http://www.qdccb.com)

（18）杭州银行股份有限公司

地址：杭州市凤起路 432 号

法定代表人：马时雍

联系人：陈振峰

客服电话：96523、4008888508

网址：[www.hzbank.com.cn](http://www.hzbank.com.cn)

（19）宁波银行股份有限公司

注册地址：宁波市江东区中山东路 294 号

法定代表人：陆华裕

电话：021-63586210

传真：021-63586215

联系人：胡技勋

客服电话：96528、上海地区 962528

网址：[www.nbc.com.cn](http://www.nbc.com.cn)

（20）东莞银行股份有限公司

注册地址：东莞市运河东一路 193 号

法定代表人：廖玉林

联系人：胡昱

客服电话：96228

网址：[www.dongguanbank.cn](http://www.dongguanbank.cn)

（21）江苏银行股份有限公司

地址：南京市洪武北路 55 号

法定代表人：黄志伟

联系人：田春慧

联系电话：025-58588167

客户服务电话：96098、400-86-96098

网址：[www.jsbchina.cn](http://www.jsbchina.cn)

(22) 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](http://www.cjsc.com.cn)

(23) 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](http://www.gtja.com)

(24) 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](http://www.csc108.com)

(25) 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](http://www.newone.com.cn)

(26) 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](http://www.gf.com.cn)

(27) 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](http://www.chinastock.com.cn)

(28) 华泰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](http://www.lhzq.com)

(29) 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：021-54047892

传真：021-54038844

网址：[www.sw2000.com.cn](http://www.sw2000.com.cn)

(30) 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](http://www.htsec.com)

(31) 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](http://www.cs.ecitic.com)

(32) 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

（33）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：4008888788、10108998

联系人：刘晨、李芳芳

电话：021-22169081

传真：021-22169134

网址：www.ebscn.com

（34）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

（35）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

(36) 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](http://www.longone.com.cn)

(37) 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](http://www.bigsun.com.cn)

(38) 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](http://www.gzs.com.cn)

(39) 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

（40）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

（41）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

（42）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

(43) 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

(44) 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

(45) 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

(46) 财通证券有限责任公司

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

(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

联系人：吴颖

电话：0571-87901963

传真：0571-87902081

网址：www.stocke.com

(48) 渤海证券股份有限公司

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

(49) 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：0731-2882340、0571-87782047

传真：0731-2882332

网址：www.foundersc.com

（50）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

（51）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

（52）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](http://www.hysec.com)

(53) 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：0755-33680000、400-6666-888

长城证券网站：[www.cc168.com.cn](http://www.cc168.com.cn)

(54) 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](http://www.guodu.com)

(55) 江海证券有限公司

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](http://www.jhzq.com.cn)

(56) 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](http://www.ciccs.com.cn)

(57) 恒泰证券股份有限公司

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：张同亮

电话：021-68405273

网址：[www.cnht.com.cn](http://www.cnht.com.cn)

(58) 国金证券股份有限公司

注册地址：成都市东城根上街 95 号

办公地址：成都市东城根上街 95 号 6、16、17 楼

法定代表人：冉云

联系人：金喆

客户服务电话：028-86690126

网址：[www.gjq.com.cn](http://www.gjq.com.cn)

(59) 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](http://www.thope.com)

(60) 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

（61）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

（62）爱建证券有限责任公司

地址：上海市南京西路 758 号 24 楼

法定代表人：张建华

客服电话：021-63340678

联系人：陈敏

网址：www.ajzq.com

（63）英大证券有限责任公司

地址：深圳市福田区深南中路华能大厦三十、三十一层

法定代表人：赵文安

客服电话：0755-26982993

网址：www.vsun.com

（64）国信证券股份有限公司

注册地址：深圳市罗湖区红岭中路 1012 号国信证券大厦十六层至二十六层

法定代表人：何如

客服电话：95536

联系人：齐晓燕

电话：0755-82130833

传真：0755-82133302

网址：[www.guosen.com.cn](http://www.guosen.com.cn)

(65) 广发华福证券有限责任公司

注册地址：福州市五四路 157 号新天地大厦 8 层

办公地址：福州市五四路 157 号新天地大厦 8 层

法定代表人：黄金琳

客服电话：0591-87383623

联系人：张腾

传真：0591-87383610

网址：[www.gfhfzq.com.cn](http://www.gfhfzq.com.cn)

(66) 中原证券股份有限公司

地址：郑州市经三路 15 号广汇国际贸易大厦

法定代表人：石保上

客服电话：0371-967218、4008139666

联系人：程月艳、耿铭

网址：[www.ccnew.com](http://www.ccnew.com)

(67) 天相投资顾问有限公司

注册地址：北京市西城区金融街 19 号富凯大厦 B 座 701

法定代表人：林义相

客服电话：(010) 66045678

网址：[www.txsec.com](http://www.txsec.com)、[www.txjijin.com](http://www.txjijin.com)

(68) 西南证券股份有限公司

地址：重庆市渝中区临江支路 2 号合景国际大厦 A 幢

法定代表人：王珠林

客服电话：4008096096

联系人：徐雅筠、杨再巧

网址：[www.swsc.com.cn](http://www.swsc.com.cn)

(69) 信达证券股份有限公司

注册地址：北京市三里河东路 5 号中商大厦 10 层

法定代表人：张志刚

联系人：唐静

联系电话：010-63081000

传真：010-63080978

客服电话：400-800-8899

公司网址：www.cindasc.com

（70）国联证券股份有限公司

注册地址：江苏省无锡市县前东街 168 号

办公地址：江苏省无锡市县前东街 168 号国联大厦 703 室

法定代表人：范炎

客服电话：0510-82588168

联系人：袁丽萍

电话：0510-82831662

传真：0510-82830162

网址：www.glsc.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33层

法定代表人：张树忠

电话：0755-83183388

传真：0755-83195239

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：021-23238888

传真：021-23238800

联系人：金毅

#### 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一方差等模型，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

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。

基金托管人中国农业银行根据基金合同规定，于 2010 年 1 月 12 日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 2009 年 9 月 30 日，本报告中所列财务数据未经审计。

### 1. 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              | 24,593,810.59  | 4.15         |
|    | 其中：股票             | 24,593,810.59  | 4.15         |
| 2  | 固定收益投资            | 489,043,849.00 | 82.55        |
|    | 其中：债券             | 465,043,849.00 | 78.50        |
|    | 资产支持证券            | 24,000,000.00  | 4.05         |
| 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 | 69,902,603.73  | 11.80  |
| 6 | 其他资产         | 8,852,312.59   | 1.49   |
| 7 | 合计           | 592,392,575.91 | 100.00 |

## 2. 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            | -             | 0.00         |
| C   | 制造业            | 8,408,800.44  | 1.44         |
| C0  | 食品、饮料          | 575,330.96    | 0.10         |
| C1  | 纺织、服装、皮毛       | 9,900.00      | 0.00         |
| C2  | 木材、家具          | -             | 0.00         |
| C3  | 造纸、印刷          | 889,148.16    | 0.15         |
| C4  | 石油、化学、塑胶、塑料    | -             | 0.00         |
| C5  | 电子             | 957,353.82    | 0.16         |
| C6  | 金属、非金属         | 546,272.00    | 0.09         |
| C7  | 机械、设备、仪表       | 2,293,904.36  | 0.39         |
| C8  | 医药、生物制品        | 2,103,832.26  | 0.36         |
| C99 | 其他制造业          | 1,033,058.88  | 0.18         |
| D   | 电力、煤气及水的生产和供应业 | -             | 0.00         |
| E   | 建筑业            | 11,451,417.20 | 1.96         |
| F   | 交通运输、仓储业       | 1,147,239.66  | 0.20         |
| G   | 信息技术业          | 1,729,566.51  | 0.30         |
| H   | 批发和零售贸易        | -             | 0.00         |
| I   | 金融、保险业         | -             | 0.00         |
| J   | 房地产业           | 804,137.76    | 0.14         |
| K   | 社会服务业          | 1,052,649.02  | 0.18         |
| L   | 传播与文化产业        | -             | 0.00         |
| M   | 综合类            | -             | 0.00         |
|     | 合计             | 24,593,810.59 | 4.21         |

## 3. 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投资明

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  | 601668 | 中国建筑 | 1,250,647 | 5,803,002.08 | 0.99         |
| 2  | 601618 | 中国中冶 | 1,015,902 | 5,648,415.12 | 0.97         |
| 3  | 002294 | 信立泰  | 21,680    | 1,589,144.00 | 0.27         |
| 4  | 601107 | 四川成渝 | 166,026   | 1,147,239.66 | 0.20         |
| 5  | 601888 | 中国国旅 | 89,359    | 1,052,649.02 | 0.18         |
| 6  | 002290 | 禾盛新材 | 31,806    | 1,033,058.88 | 0.18         |
| 7  | 002278 | 神开股份 | 39,497    | 904,481.30   | 0.15         |
| 8  | 002292 | 奥飞动漫 | 22,752    | 889,148.16   | 0.15         |



|    |        |      |        |            |      |
|----|--------|------|--------|------------|------|
| 9  | 002285 | 世联地产 | 23,028 | 804,137.76 | 0.14 |
| 10 | 002288 | 超华科技 | 32,819 | 621,263.67 | 0.11 |

#### 4. 报告期末按债券品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      | 115,712,693.70 | 19.79        |
| 2  | 央行票据      | 62,142,000.00  | 10.63        |
| 3  | 金融债券      | 131,626,000.00 | 22.51        |
|    | 其中：政策性金融债 | 104,854,000.00 | 17.94        |
| 4  | 企业债券      | 154,884,896.30 | 26.49        |
| 5  | 企业短期融资券   | -              | 0.00         |
| 6  | 可转债       | 678,259.00     | 0.12         |
| 7  | 其他        | -              | 0.00         |
| 8  | 合计        | 465,043,849.00 | 79.55        |

#### 5. 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投资明

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  | 080225  | 08国开25   | 800,000 | 79,824,000.00 | 13.65        |
| 2  | 0801035 | 08央行票据35 | 600,000 | 62,142,000.00 | 10.63        |
| 3  | 126012  | 08上港债    | 596,670 | 57,787,489.50 | 9.88         |
| 4  | 010203  | 02国债(3)  | 317,000 | 32,096,250.00 | 5.49         |
| 5  | 010004  | 20国债(4)  | 310,000 | 31,492,900.00 | 5.39         |

#### 6. 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

| 序号 | 证券代码   | 证券名称 | 数量（份）   | 公允价值(元)       | 占基金资产净值比例(%) |
|----|--------|------|---------|---------------|--------------|
| 1  | 119009 | 宁建04 | 240,000 | 24,000,000.00 | 4.11         |

#### 7. 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。

#### 8. 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、处罚的情形。

(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 | 名称 | 金额（元） |
|----|----|-------|
|----|----|-------|

|   |         |              |
|---|---------|--------------|
| 1 | 存出保证金   | 410,000.00   |
| 2 | 应收证券清算款 | 983,677.48   |
| 3 | 应收股利    | -            |
| 4 | 应收利息    | 6,858,470.32 |
| 5 | 应收申购款   | 600,164.79   |
| 6 | 其他应收款   | -            |
| 7 | 待摊费用    | -            |
| 8 | 其他      | -            |
| 9 | 合计      | 8,852,312.59 |

(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<br>公允价值(元) | 占基金资产净值<br>比例 (%) | 流通受限情况说<br>明 |
|----|--------|------|--------------------|-------------------|--------------|
| 1  | 601668 | 中国建筑 | 5,803,002.08       | 0.99              | 网下申购锁定期      |
| 2  | 601618 | 中国中冶 | 5,648,415.12       | 0.97              | 网下申购锁定期      |
| 3  | 002294 | 信立泰  | 1,589,144.00       | 0.27              | 网下申购锁定期      |
| 4  | 601107 | 四川成渝 | 1,147,239.66       | 0.20              | 网下申购锁定期      |
| 5  | 601888 | 中国国旅 | 1,052,649.02       | 0.18              | 网下申购锁定期      |
| 6  | 002290 | 禾盛新材 | 1,033,058.88       | 0.18              | 网下申购锁定期      |
| 7  | 002278 | 神开股份 | 904,481.30         | 0.15              | 网下申购锁定期      |
| 8  | 002292 | 奥飞动漫 | 889,148.16         | 0.15              | 网下申购锁定期      |
| 9  | 002285 | 世联地产 | 804,137.76         | 0.14              | 网下申购锁定期      |
| 10 | 002288 | 超华科技 | 621,263.67         | 0.11              | 网下申购锁定期      |

(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) 基金合同生效日（2003年6月12日）至2009年9月30日以来完整会计年度的投资业绩及与同期业绩比较基准收益率的比较：

#### A、B类

| 阶段                   | 净值增<br>长率<br>① | 净值增长<br>率标准差<br>② | 业绩比较<br>基准收益<br>率<br>③ | 业绩比较<br>基准收益<br>率标准差<br>④ | ①-③   | ②-④    |
|----------------------|----------------|-------------------|------------------------|---------------------------|-------|--------|
| 2003.6.12—2003.12.31 | 2.90%          | 0.16%             | -1.41%                 | 0.29%                     | 4.31% | -0.13% |
| 2004.1.1—2004.12.31  | 1.81%          | 0.32%             | -3.32%                 | 0.35%                     | 5.13% | -0.03% |

|                     |        |       |        |       |        |        |
|---------------------|--------|-------|--------|-------|--------|--------|
| 2005.1.1—2005.12.31 | 11.33% | 0.29% | 10.55% | 0.21% | 0.78%  | 0.08%  |
| 2006.1.1—2006.12.31 | 6.29%  | 0.14% | 2.62%  | 0.10% | 3.67%  | 0.04%  |
| 2007.1.1—2007.12.31 | 8.79%  | 0.17% | -1.81% | 0.08% | 10.60% | 0.09%  |
| 2008.1.1—2008.12.31 | 11.10% | 0.15% | 14.89% | 0.20% | -3.79% | -0.05% |
| 2009.1.1—2009.9.30  | -0.54% | 0.13% | -1.77% | 0.12% | 1.23%  | 0.01%  |
| 2003.6.12—2009.9.30 | 49.03% | 0.21% | 20.96% | 0.21% | 28.07% | 0.00%  |

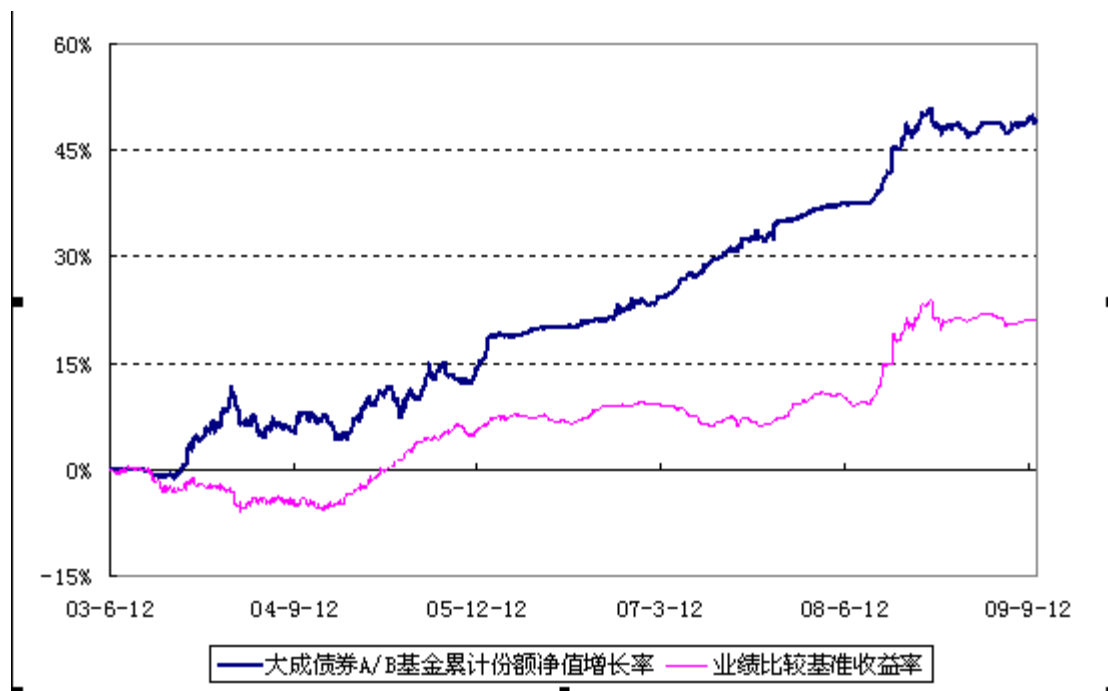
## C类

| 阶段                   | 净值增长率<br>① | 净值增长率标准差<br>② | 业绩比较基准收益率<br>③ | 业绩比较基准收益率标准差<br>④ | ①-③    | ②-④    |
|----------------------|------------|---------------|----------------|-------------------|--------|--------|
| 2003.6.12-2003.12.31 | 2.90%      | 0.16%         | -1.41%         | 0.29%             | 4.31%  | -0.13% |
| 2004.1.1-2004.12.31  | 1.81%      | 0.32%         | -3.32%         | 0.35%             | 5.13%  | -0.03% |
| 2005.1.1-2005.12.31  | 11.33%     | 0.29%         | 10.55%         | 0.21%             | 0.78%  | 0.08%  |
| 2006.1.1-2006.12.31  | 5.86%      | 0.14%         | 2.62%          | 0.10%             | 3.24%  | 0.04%  |
| 2007.1.1-2007.12.31  | 8.17%      | 0.17%         | -1.81%         | 0.08%             | 9.98%  | 0.09%  |
| 2008.1.1-2008.12.31  | 10.56%     | 0.15%         | 14.89%         | 0.20%             | -4.33% | -0.05% |
| 2009.1.1-2009.9.30   | -0.90%     | 0.13%         | -1.77%         | 0.12%             | 0.87%  | 0.01%  |
| 2003.6.12-2009.9.30  | 46.33%     | 0.21%         | 20.96%         | 0.21%             | 25.37% | 0.00%  |

(二)自基金合同生效以来基金份额净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率的比较

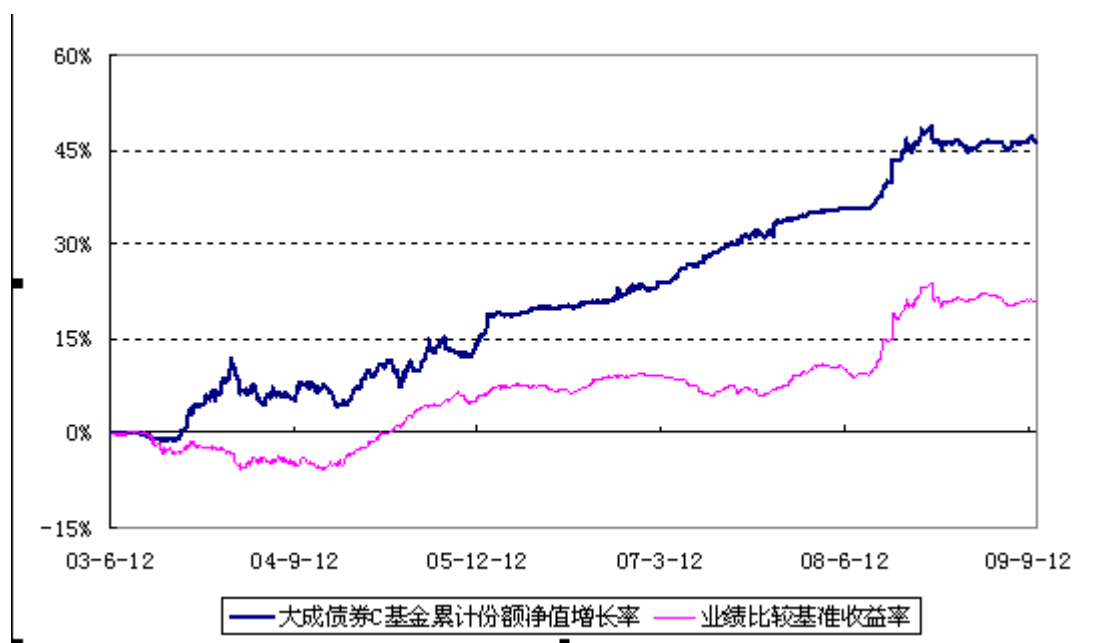
## 大成债券 A/B 基金累计份额净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图

(2003年6月12日至2009年9月30日)



## 大成债券 C 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

(2003年6月12日至2009年9月30日)



注：1. 本基金于2006年4月24日起推出持续性收费模式，将前端收费模式定义为A类收费模式，后端收费模式定义为B类收费模式，二者对应的基金份额简称“大成债券A/B”；将持续性收费模式定义为C类收费模式，对应的基金份额简称“大成债券C”。

2. 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，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

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：

$$H=E \times 0.7\% \div \text{当年天数};$$

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：

$$H=E \times 0.20\% \div \text{当年天数}$$

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。

(2) 投资者选择交纳前端申购费时，申购费如下表所示：

| 申购金额 M            | 费率       |
|-------------------|----------|
| M < 50 万          | 0.8%     |
| 50 万 ≤ M < 200 万  | 0.5%     |
| 200 万 ≤ M < 500 万 | 0.3%     |
| M ≥ 500 万         | 1000 元/笔 |

(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             | 费率   |
|--------------------|------|
| 1 年以内              | 1.0% |
| 1 年以上、3 年以内（含 1 年） | 0.6% |
| 3 年以上、5 年以内（含 3 年） | 0.4% |
| 5 年以上（含 5 年）       | 0    |

(4) 基金申购份额的计算：

①前端收费模式即大成债 A：

大成债 A 的申购金额包括申购费用和净申购金额，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

申购份数 = 净申购金额 / 申购日基金份额净值

②后端收费模式即大成债 B：

申购份数 = 申购金额 / 申购日基金份额净值

③持续性销售服务费模式即大成债 C：

申购份数 = 申购金额 / 申购日基金份额净值

## 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。

(1) 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%。

(2) 在择持续性收费模式下，如持有时间小于 30 个自然日，赎回费率为

0.1%，赎回费用的 25% 计入大成债 C 的基金财产；如持有时间大于或等于 30 个自然日，赎回费率为 0。

(3) 基金赎回金额的计算：

①前端收费模式即大成债 A：

大成债A的净赎回金额为赎回金额扣减赎回费用，计算公式如下：

赎回金额=赎回份数×赎回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

②后端收费模式即大成债 B：

大成债B的净赎回金额为赎回金额扣减赎回费用、后端申购费用，计算公式如下：

赎回金额=赎回份数×赎回申请日基金份额净值

赎回费用=赎回金额×赎回费率

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

净赎回金额=赎回金额－赎回费用－后端申购费用

③持续性销售服务费模式即大成债 C：

根据 2009 年 8 月 11 日《关于增加大成债券投资基金 C 类份额赎回费的公告》，自 2009 年 8 月 28 日起，增加大成债 C 赎回费，即持有人在赎回其 2009 年 8 月 27 日（含该日）之前交易申请获得的大成债 C 份额（即 2009 年 8 月 27 日（含该日）之前提交的交易申请，并得到有效确认的份额）时无需缴纳赎回费；持有人在 2009 年 8 月 28 日（含该日）之后交易申请获得的大成债 C 份额（即 2009 年 8 月 28 日（含该日）之后提交的交易申请，并得到有效确认的份额），将按下述公式收取赎回费用，赎回费用的 25% 计入大成债 C 的基金财产。

大成债 C 的净赎回金额为赎回金额扣减赎回费用，计算公式如下：

赎回金额=赎回份数×赎回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

3. 申请日（T日）的基金份额净值在当天证券交易所收市后计算，并在T+1日公告。遇特殊情况，经中国证监会同意，可以适当延迟计算和公告。

基金份额净值的计算公式为：

基金份额净值 = 基金资产净值总额 / 发行在外的基金份额总数。

#### 4. 销售服务费

投资者选择持续性收费模式，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他公告中予以载明，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。

5. 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。

#### 6. 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》及其他有关法律法规的要求及《基金合同》的规定，对 2009 年 7 月 30 日公布的



《大成债券投资基金更新的招募说明书（2009年第1期）》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. 根据最新公告,更新了“七、申购与赎回”部分。
5. 根据最新数据,更新了“九、基金的投资”部分。
6. 根据最新数据,更新了“十、基金业绩”部分。
7. 根据最新公告,更新了“十四、费用与税收”部分。
8. 根据最新公告,更新了“二十二、其他应披露的事项”。
9. 根据最新公告,更新了“二十三、对招募说明书更新部分的说明”。

大成基金管理有限公司

2010年1月26日