

(上接B058版)

联系电话:010-58326388*1598

网站: http://www.csrc.gov.cn

客户服务电话:400-166-1188

(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:深圳市深南大道7088号招商银行大厦33层

法定代表人:刘卓

电话:0755-53183388

传真:0755-53195239

联系人:范瑛

(三)担保人

名称:深圳市高新投集团有限公司

住所:深圳市深南大道7028号时代科技大厦22层、23层

办公地址:深圳市深南大道7028号时代科技大厦22层、23层

法定代表人:陶军

电话:0755-52852588

传真:0755-52852565

联系人:史玉洁

(四)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7号财富中心写字楼A座40层

办公地址:北京市朝阳区东三环中路7号财富中心写字楼A座40层

负责人:王玲

电话:0755-22163333

传真:0755-22163390

经办律师:靳广军、冯文

联系人:冯文

(五)会计师事务所和经办注册会计师

名称:安永华明会计师事务所

住所:北京市东城区长安街1号东方广场安永大楼17层01-12层

办公地址:北京市东城区长安街1号东方广场安永大楼17层

01-12层

执行事务合伙人:吴晋平

电话:(010) 58153000,(0755) 25028288

传真:(010) 85182898,(0755) 25026188

签章注册会计师:昌华、高鹤

联系人:昌华、高鹤

四、基金的名称

大成恒稳增长股票型证券投资基金

保本到期后基金名称变更为大成恒稳增长股票型证券投资基金

五、基金的类型

保本基金

六、基金的运作方式

开放式

七、基金的投资目标

(一)保本周期内的投资目标

本基金通过运用组合保险策略,在符合保本条件的投資金额提供保本保障的基础上,追求基金资产的长期增值。

(二)保本到期变更后的的大成恒稳增长股票型证券投资基金投资目标

本基金将秉承价值投资的基本理念,依据宏观经济长期运行趋势和市场环境的变化预期,自上而下稳健配置资产,自下而上精选证券,有效分散风险,力求实现基金资产的长期稳定增长。

八、基金的投资范围

本基金投资范围限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(包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票)、债券(包括国债、金融债、企业债、公司债、央行票据、中期票据、可转换债券、短期融资券以及经法律法规或中国证监会允许投资的其他债券类金融工具)、银行存款、资产支持证券、权证、股指期货以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具(但须符合中国证监会的相关规定)。

本基金投资组合的资产配置范围为:股票占基金资产的比例为60%~95%;债券、资产支持证券、货币市场工具等固定收益类资产占基金资产的比例为0%~40%,其中权证不超过基金资产净值的3%;债券、银行存款、货币市场工具等安全资产占基金资产的比例为60%~100%,其中现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的5%。如法律法规或监管机构今后允许本基金投资其他品种,基金管理人在履行适当程序后,可以将其纳入投资范围。

(二)保本到期变更后的的大成恒稳增长股票型证券投资基金投资范围

本基金投资范围限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(包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票)、债券(包括国债、金融债、企业债、公司债、央行票据、中期票据、可转换债券、短期融资券以及经法律法规或中国证监会允许投资的其他债券类金融工具)、银行存款、资产支持证券、权证、股指期货以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具(但须符合中国证监会的相关规定)。

本基金投资组合的资产配置范围为:股票占基金资产的比例为60%~95%;债券、资产支持证券、货币市场工具等固定收益类资产占基金资产的比例为0%~40%,其中权证不超过基金资产净值的3%;债券、银行存款、货币市场工具等安全资产占基金资产的比例为60%~100%,其中现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的5%。如法律法规或监管机构今后允许本基金投资其他品种,基金管理人在履行适当程序后,可以将其纳入投资范围。

(一)保本周期内的投资策略

(1)类属资产配置策略

本基金将采用VPI可变组合保险策略(Variable Proportion Portfolio Insurance),VPI策略是国际投资管理领域中一种常见的投资组合保险机制,将资金资产优化分配在保本资产和风险资产上;并根据数据分析,市场波动等来调整风险资产与保本资产在投资组合中的比重,在最大程度上保证基金资产的损失不超过扣除相关费用后的安全垫的基础上,积极参与市场可能出现的风险收益,从而在保证本金安全的前提下实现基金资产的长期稳定增长。

(2)组合保险定价模型对收益率的影响

本基金将秉承价值投资的基本理念,依据宏观经济长期运行趋势和市场环境的变化预期,自上而下稳健配置资产,自下而上精选证券,有效分散风险,力求实现基金资产的长期稳定增长。

(3)债券投资策略

本基金将通过组合投资策略,力求在保证基金资产总体的安全性、流动性的基础上获得一定的稳定收益。

本基金将采取积极组合投资策略,结合短期的宏观经济、货币政策研究和收益率分析,运用利率期限策略、债券互换策略,以及运用子策略、两级策略、梯形策略等收益率曲线追踪策略,以获取适当超额收益。

(4)股票投资策略

股票投资组合建立后,本基金将动态跟踪经济发展,上市公司盈利能力、估值水平变化,适时调整,以不断优化投资组合。

(5)债券投资策略

本基金将通过组合投资策略将投资组合避险和有效管理为目的,通过定期调整债券仓位和空头套期保值来应对系统性风险,对组合构建与调整中的流动性风险,力求风险收益的优化。

(6)定期存款投资策略

本基金将通过定期存款投资组合,以达到适度增强收益或防御风险的目的,为此,本基金将通过定期存款、质押式回购、逆回购、货币基金、可分离交易债券、短期融资券以及经法律法规或中国证监会允许投资的其他债券类金融工具、银行存款、资产支持证券、权证、股指期货以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具(但须符合中国证监会的相关规定)。

本基金投资组合的资产配置范围为:股票占基金资产的比例为60%~95%;债券、资产支持证券、货币市场工具等固定收益类资产占基金资产的比例为0%~40%,其中权证不超过基金资产净值的3%;债券、银行存款、货币市场工具等安全资产占基金资产的比例为60%~100%,其中现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的5%。本基金所持有的股票市值和买入、卖出股指期货合约的价值,合计(轧差)不超过基金资产的40%。如法律法规或监管机构今后允许本基金投资其他品种,基金管理人在履行适当程序后,可以将其纳入投资范围。

(二)保本到期变更后的的大成恒稳增长股票型证券投资基金投资范围

本基金投资范围限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(包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票)、债券(包括国债、金融债、企业债、公司债、央行票据、中期票据、可转换债券、短期融资券以及经法律法规或中国证监会允许投资的其他债券类金融工具)、银行存款、资产支持证券、权证、股指期货以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具(但须符合中国证监会的相关规定)。

本基金投资组合的资产配置范围为:股票占基金资产的比例为60%~95%;债券、资产支持证券、货币市场工具等固定收益类资产占基金资产的比例为0%~40%,其中权证不超过基金资产净值的3%;债券、银行存款、货币市场工具等安全资产占基金资产的比例为60%~100%,其中现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的5%。如法律法规或监管机构今后允许本基金投资其他品种,基金管理人在履行适当程序后,可以将其纳入投资范围。

(三)类属资产配置策略

本基金将采用VPI可变组合保险策略(Variable Proportion Portfolio Insurance),VPI策略是国际投资管理领域中一种常见的投资组合保险机制,将资金资产优化分配在保本资产和风险资产上;并根据数据分析,市场波动等来调整风险资产与保本资产在投资组合中的比重,在最大程度上保证基金资产的损失不超过扣除相关费用后的安全垫的基础上,积极参与市场可能出现的风险收益,从而在保证本金安全的前提下实现基金资产的长期稳定增长。

(4)组合保险定价模型对收益率的影响

本基金将秉承价值投资的基本理念,依据宏观经济长期运行趋势和市场环境的变化预期,自上而下稳健配置资产,自下而上精选证券,有效分散风险,力求实现基金资产的长期稳定增长。

(5)股票投资策略

本基金将通过组合投资策略,力求在保证基金资产总体的安全性、流动性基础上,在实际投资中兼顾股票组合的稳定性与收益性,选择具有足够的安全边际和高流动性的上市公司进入股票投资组合。

(6)定期存款投资策略

本基金将通过定期存款投资组合,以达到适度增强收益或防御风险的目的,为此,本基金将通过定期存款、质押式回购、逆回购、货币基金、可分离交易债券、短期融资券以及经法律法规或中国证监会允许投资的其他债券类金融工具、银行存款、资产支持证券、权证、股指期货以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具(但须符合中国证监会的相关规定)。

本基金投资组合的资产配置范围为:股票占基金资产的比例为60%~95%;债券、资产支持证券、货币市场工具等固定收益类资产占基金资产的比例为0%~40%,其中权证不超过基金资产净值的3%;债券、银行存款、货币市场工具等安全资产占基金资产的比例为60%~100%,其中现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的5%。本基金所持有的股票市值和买入、卖出股指期货合约的价值,合计(轧差)不超过基金资产的40%。如法律法规或监管机构今后允许本基金投资其他品种,基金管理人在履行适当程序后,可以将其纳入投资范围。

(二)保本到期变更后的的大成恒稳增长股票型证券投资基金投资范围

本基金投资范围限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(包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票)、债券(包括国债、金融债、企业债、公司债、央行票据、中期票据、可转换债券、短期融资券以及经法律法规或中国证监会允许投资的其他债券类金融工具)、银行存款、资产支持证券、权证、股指期货以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具(但须符合中国证监会的相关规定)。

本基金投资组合的资产配置范围为:股票占基金资产的比例为60%~95%;债券、资产支持证券、货币市场工具等固定收益类资产占基金资产的比例为0%~40%,其中权证不超过基金资产净值的3%;债券、银行存款、货币市场工具等安全资产占基金资产的比例为60%~100%,其中现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的5%。如法律法规或监管机构今后允许本基金投资其他品种,基金管理人在履行适当程序后,可以将其纳入投资范围。

(三)类属资产配置策略

本基金将采用VPI可变组合保险策略(Variable Proportion Portfolio Insurance),VPI策略是国际投资管理领域中一种常见的投资组合保险机制,将资金资产优化分配在保本资产和风险资产上;并根据数据分析,市场波动等来调整风险资产与保本资产在投资组合中的比重,在最大程度上保证基金资产的损失不超过扣除相关费用后的安全垫的基础上,积极参与市场可能出现的风险收益,从而在保证本金安全的前提下实现基金资产的长期稳定增长。

(4)组合保险定价模型对收益率的影响

本基金将秉承价值投资的基本理念,依据宏观经济长期运行趋势和市场环境的变化预期,自上而下稳健配置资产,自下而上精选证券,有效分散风险,力求实现基金资产的长期稳定增长。

(5)股票投资策略

本基金将通过组合投资策略,力求在保证基金资产总体的安全性、流动性基础上,在实际投资中兼顾股票组合的稳定性与收益性,选择具有足够的安全边际和高流动性的上市公司进入股票投资组合。

(6)定期存款投资策略

本基金将通过定期存款投资组合,以达到适度增强收益或防御风险的目的,为此,本基金将通过定期存款、质押式回购、逆回购、货币基金、可分离交易债券、短期融资券以及经法律法规或中国证监会允许投资的其他债券类金融工具、银行存款、资产支持证券、权证、股指期货以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具(但须符合中国证监会的相关规定)。

本基金投资组合的资产配置范围为:股票占基金资产的比例为60%~95%;债券、资产支持证券、货币市场工具等固定收益类资产占基金资产的比例为0%~40%,其中权证不超过基金资产净值的3%;债券、银行存款、货币市场工具等安全资产占基金资产的比例为60%~100%,其中现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的5%。本基金所持有的股票市值和买入、卖出股指期货合约的价值,合计(轧差)不超过基金资产的40%。如法律法规或监管机构今后允许本基金投资其他品种,基金管理人在履行适当程序后,可以将其纳入投资范围。

(二)保本到期变更后的的大成恒稳增长股票型证券投资基金投资范围

本基金投资范围限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(包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票)、债券(包括国债、金融债、企业债、公司债、央行票据、中期票据、可转换债券、短期融资券以及经法律法规或中国证监会允许投资的其他债券类金融工具)、银行存款、资产支持证券、权证、股指期货以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具(但须符合中国证监会的相关规定)。

本基金投资组合的资产配置范围为:股票占基金资产的比例为60%~95%;债券、资产支持证券、货币市场工具等固定收益类资产占基金资产的比例为0%~40%,其中权证不超过基金资产净值的3%;债券、银行存款、货币市场工具等安全资产占基金资产的比例为60%~100%,其中现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的5%。如法律法规或监管机构今后允许本基金投资其他品种,基金管理人在履行适当程序后,可以将其纳入投资范围。

(三)类属资产配置策略

本基金将采用VPI可变组合保险策略(Variable Proportion Portfolio Insurance),VPI策略是国际投资管理领域中一种常见的投资组合保险机制,将资金资产优化分配在保本资产和风险资产上;并根据数据分析,市场波动等来调整风险资产与保本资产在投资组合中的比重,在最大程度上保证基金资产的损失不超过扣除相关费用后的安全垫的基础上,积极参与市场可能出现的风险收益,从而在保证本金安全的前提下实现基金资产的长期稳定增长。

(4)组合保险定价模型对收益率的影响

本基金将秉承价值投资的基本理念,依据宏观经济长期运行趋势和市场环境的变化预期,自上而下稳健配置资产,自下而上精选证券,有效分散风险,力求实现基金资产的长期稳定增长。

(5)股票投资策略

本基金将通过组合投资策略,力求在保证基金资产总体的安全性、流动性基础上,在实际投资中兼顾股票组合的稳定性与收益性,选择具有足够的安全边际和高流动性的上市公司进入股票投资组合。

(6)定期存款投资策略

本基金将通过定期存款投资组合,以达到适度增强收益或防御风险的目的,为此,本基金将通过定期存款、质押式回购、逆回购、货币基金、可分离交易债券、短期融资券以及经法律法规或中国证监会允许投资的其他债券类金融工具、银行存款、资产支持证券、权证、股指期货以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具(但须符合中国证监会的相关规定)。

本基金投资组合的资产配置范围为:股票占基金资产的比例为60%~95%;债券、资产支持证券、货币市场工具等固定收益类资产占基金资产的比例为0%~40%,其中权证不超过基金资产净值的3%;债券、银行存款、货币市场工具等安全资产占基金资产的比例为60%~100%,其中现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的5%。本基金所持有的股票市值和买入、卖出股指期货合约的价值,合计(轧差)不超过基金资产的40%。如法律法规或监管机构今后允许本基金投资其他品种,基金管理人在履行适当程序后,可以将其纳入投资范围。

(二)保本到期变更后的的大成恒稳增长股票型证券投资基金投资范围

本基金投资范围限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(包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票)、债券(包括国债、金融债、企业债、公司债、央行票据、中期票据、可转换债券、短期融资券以及经法律法规或中国证监会允许投资的其他债券类金融工具)、银行存款、资产支持证券、权证、股指期货以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具(但须符合中国证监会的相关规定)。

本基金投资组合的资产配置范围为:股票占基金资产的比例为60%~95%;债券、资产支持证券、货币市场工具等固定收益类资产占基金资产的比例为0%~40%,其中权证不超过基金资产净值的3%;债券、银行存款、货币市场工具等安全资产占基金资产的比例为60%~100%,其中现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的5%。本基金所持有的股票市值和买入、卖出股指期货合约的价值,合计(轧差)不超过基金资产的40%。如法律法规或监管机构今后允许本基金投资其他品种,基金管理人在履行适当程序后,可以将其纳入投资范围。

(三)类属资产配置策略

本基金将采用VPI可变组合保险策略(Variable Proportion Portfolio Insurance),VPI策略是国际投资管理领域中一种常见的投资组合保险机制,将资金资产优化分配在保本资产和风险资产上;并根据数据分析,市场波动等来调整风险资产与保本资产在投资组合中的比重,在最大程度上保证基金资产的损失不超过扣除相关费用后的安全垫的基础上,积极参与市场可能出现的风险收益,从而在保证本金安全的前提下实现基金资产的长期稳定增长。

(4)组合保险定价模型对收益率的影响

本基金将秉承价值投资的基本理念,依据宏观经济长期运行趋势和市场环境的变化预期,自上而下稳健配置资产,自下而上精选证券,有效分散风险,力求实现基金资产的长期稳定增长。

(5)股票投资策略

本基金将通过组合投资策略,力求在保证基金资产总体的安全性、流动性基础上,在实际投资中兼顾股票组合的稳定性与收益性,选择具有足够的安全边际和高流动性的上市公司进入股票投资组合。