

大成蓝筹稳健证券投资基金

2006 年年度报告

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

送出日期：2007 年 3 月 30 日

重要提示

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。本年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人中国银行股份有限公司银行根据本基金合同规定，于 2007 年 3 月 28 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、财务会计报告、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。

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资产，但不保证基金一定盈利。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。

本报告财务资料已经审计。普华永道中天会计师事务所有限公司为本基金出具了无保留意见的审计报告，请投资者注意阅读。

目 录

| | | |
|------|----------------------|----|
| 第一节 | 基金简介 | 1 |
| 第二节 | 主要财务指标和基金净值表现及收益分配情况 | 2 |
| 第三节 | 管理人报告 | 4 |
| 第四节 | 托管人报告 | 7 |
| 第五节 | 审计报告 | 7 |
| 第六节 | 财务会计报告 | 8 |
| 第七节 | 投资组合报告 | 19 |
| 第八节 | 基金份额持有人情况 | 24 |
| 第九节 | 开放式基金份额变动 | 25 |
| 第十节 | 重大事项揭示 | 25 |
| 第十一节 | 备查文件目录 | 27 |

第一节 基金简介

一、基金基本资料

- | | |
|-----------------|------------------|
| 1、基金名称: | 大成蓝筹稳健证券投资基金 |
| 2、基金简称: | 大成蓝筹稳健基金 |
| 3、基金交易代码: | 090003 |
| 4、基金运作方式: | 契约型开放式 |
| 5、基金合同生效日: | 2004 年 6 月 3 日 |
| 6、报告期末基金份额总额: | 316,822,365.84 份 |
| 7、基金合同存续期: | 无 |
| 8、基金份额上市的证券交易所: | 无 |
| 9、上市日期: | 无 |

二、基金产品说明

- | | |
|-----------|--|
| 1、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,实现基金资产的中长期稳定增值。 |
| 2、投资策略: | 本基金资产配置策略利用修正的恒定比例投资组合保险策略(CPPI)来动态调整基金中股票、债券和现金的配置比例;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;个股选择策略则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。 |
| 3、业绩比较基准: | 70%×天相 280 指数+30%×中信国债指数 |
| 4、风险收益特征: | 本基金属于较低风险证券投资基金,适于承受一定风险,追求当期收益和长期资本增值的基金投资人。 |

三、基金管理人

- | | |
|------------|---|
| 1、名称: | 大成基金管理有限公司 |
| 2、注册地址: | 深圳市福田区深南大道 7088 号招商银行大厦 32 层 |
| 3、办公地址: | 深圳市福田区深南大道 7088 号招商银行大厦 32 层 |
| 4、邮政编码: | 518040 |
| 5、国际互联网址: | http://www.dcfund.com.cn |
| 6、法定代表人: | 胡学光 |
| 7、信息披露负责人: | 杜鹏 |
| 8、联系电话: | 0755-83183388 |
| 9、传真: | 0755-83199588 |
| 10、电子邮箱: | dupeng@dcfund.com.cn |

四、基金托管人

- | | |
|---------|------------------|
| 1、名称: | 中国银行股份有限公司 |
| 2、注册地址: | 北京市西城区复兴门内大街 1 号 |

- 3、办公地址：北京市西城区复兴门内大街 1 号
 4、邮政编码：100818
 5、国际互联网址：<http://www.boc.cn>
 6、法定代表人：肖钢
 7、信息披露负责人：宁敏
 8、联系电话：010-66594977
 9、传真：010-66594942
 10、电子邮箱：tgxxpl@bank-of-china.com
- 五、信息披露
 信息披露报纸名称：《证券时报》、《上海证券报》、《中国证券报》
 登载年度报告正文的管理人互联网网 <http://www.dcfund.com.cn>
 址：
 基金年度报告置备地点：深圳市福田区深南大道 7088 号招商银行大厦 32 层大成基金管理有限公司
 北京市西城区复兴门内大街 1 号
 中国银行股份有限公司托管及投资者服务部
- 六、其他有关资料
 基金注册登记机构名称：大成基金管理有限公司上海分公司
 基金注册登记机构办公地址：上海市广东路 689 号海通证券大厦 19 层

第二节 主要财务指标和基金净值表现及收益分配情况

下述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

一、主要财务指标

单位：人民币元

| 序号 | 财务指标 | 2006 年 | 2005 年 | 2004 年 |
|----|--------------|----------------|----------------|------------------|
| 1 | 基金本期净收益 | 291,200,596.88 | -86,458,692.18 | 22,265,682.27 |
| 2 | 基金份额本期净收益 | 0.8042 | -0.0852 | 0.0123 |
| 3 | 期末可供分配基金收益 | 145,617,347.22 | -62,303,731.54 | -32,261,205.29 |
| 4 | 期末可供分配基金份额收益 | 0.4596 | -0.0739 | -0.0262 |
| 5 | 期末基金资产净值 | 530,436,191.90 | 802,098,775.52 | 1,200,632,922.18 |
| 6 | 期末基金份额净值 | 1.6742 | 0.9510 | 0.9738 |
| 7 | 基金加权平均净值收益率 | 66.37% | -9.03% | 1.23% |
| 8 | 本期基金份额净值增长率 | 129.02% | -2.34% | -1.65% |
| 9 | 基金份额累计净值增长率 | 119.96% | -3.95% | -1.65% |

二、基金净值表现

1、基金历史各时间段净值增长率与同期业绩比较基准收益率比较列表：

| 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 |
|----|------------|---------------|----------------|-----------------------|-----|-----|
| | | | | | | |

| | | | | | | |
|------------|---------|-------|--------|-------|--------|-------|
| 过去 3 个月 | 41.12% | 1.49% | 29.96% | 1.03% | 11.16% | 0.46% |
| 过去 6 个月 | 36.60% | 1.42% | 30.03% | 1.01% | 6.57% | 0.42% |
| 过去 1 年 | 129.02% | 1.43% | 65.34% | 1.00% | 63.67% | 0.42% |
| 自基金合同生效起至今 | 119.96% | 1.12% | 45.20% | 1.00% | 74.76% | 0.12% |

2、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 2006 年 12 月 31 日)

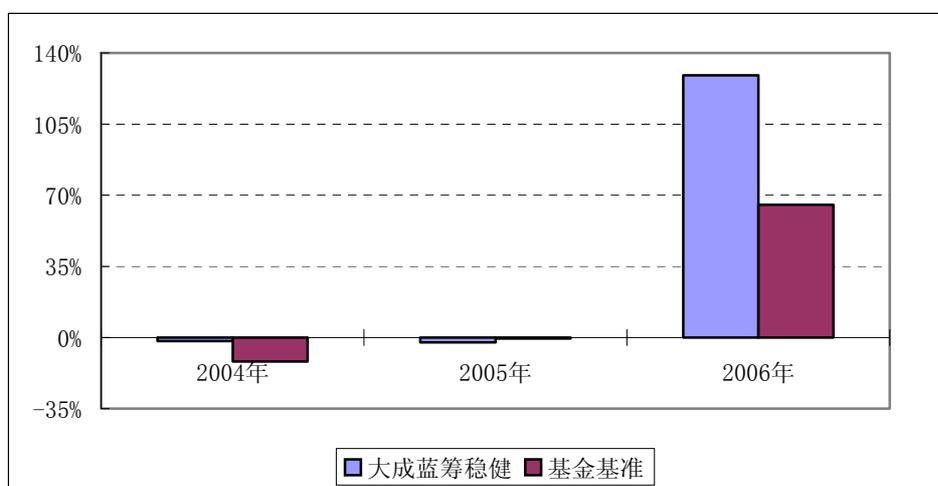


注：(1)按基金合同规定，本基金自基金合同生效起 6 个月内为建仓期。依据本基金 2005 年 8 月 31 日《关于调整大成蓝筹稳健证券投资基金资产配置比例的公告》，本基金投资股票比例为基金资产净值的 30%~95%，投资债券比例为基金资产净值的 0%~65%，现金或到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%，法律法规另有规定时从其规定。截至报告日本基金的各项投资比例已达到基金合同中规定的各项比例。

(2)2006 年 1 月 21 日，本基金管理人发布《大成基金管理有限公司关于基金经理变更的公告》，聘任施永辉先生担任大成蓝筹稳健证券投资基金经理职务，原基金经理王加英先生不再担任大成蓝筹稳健证券投资基金经理职务。

3、本基金自基金合同生效以来每年的净值增长率，及与同期业绩比较基准的收益率比较：

大成蓝筹稳健证券投资基金净值增长率与业绩比较基准历史收益率的对比图



注：本基金合同生效日为 2004 年 6 月 3 日，2004 年度计算期间为 2004 年 6 月 3 日至 2004

年 12 月 31 日。

三、过往三年每年的基金收益分配情况

| 年度 | 每 10 份基金份额分红数 | 备注 |
|--------|---------------|----|
| 2006 年 | 3.400 | |
| 2005 年 | 0.000 | |
| 2004 年 | 0.100 | |
| 合计 | 3.500 | |

第三节 管理人报告

一、基金管理人及基金经理小组情况

1、基金管理人情况

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,于 1999 年 4 月 12 日正式成立,是中国证监会批准成立的首批十家基金管理公司之一,注册资本为 1 亿元人民币,注册地为深圳。目前公司由四家股东组成,分别为中泰信托投资有限责任公司(48%)、光大证券股份有限公司(25%)、中国银河证券有限责任公司(25%)、广东证券股份有限公司(2%)。截至 2006 年 12 月 31 日,本基金管理人共管理 5 只封闭式证券投资基金:基金景宏、基金景阳、基金景博、基金景福、基金景业,以及 7 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。

2、基金经理简介

王加英先生,基金经理,经济学硕士,9 年证券从业经历。先后任职于平安证券有限责任公司资产管理部、大成基金管理有限公司研究部、基金经理部。历任基金景福基金经理助理、基金景宏基金经理。2004 年 6 月起担任大成蓝筹稳健证券投资基金经理。

2006 年 1 月 21 日,本基金管理人发布《大成基金管理有限公司关于基金经理变更的公告》,聘任施永辉先生担任大成蓝筹稳健证券投资基金经理职务,原基金经理王加英先生不再担任大成蓝筹稳健证券投资基金经理职务。

施永辉先生,基金经理,理学硕士,11 年证券从业经验。曾在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。2006 年 1 月起担任大成蓝筹稳健证券投资基金基金经理。

二、基金运作合规守信情况说明

本报告期内,本基金管理人严格遵守《证券法》、《证券投资基金法》、《大成蓝筹稳健证券投资基金基金合同》和其他有关法律法规的规定,在基金管理运作中,大成蓝筹稳健基金的投资范围、投资比例、投资组合、证券交易行为、信息披露等符合有关法律法规、行业监管规则和基金合同等规定,本基金没有发生重大违法违规行为,没有运用基金财产进行内幕交易和操纵市场行为以及进行有损基金投资人利益的关联交易,整体运作合法、合规。本基金将继续以取信于市场、取信于社会投资公众为宗旨,承诺将一如既往地本着诚实信用、勤

勤勉尽责的原则管理和运用基金财产，在规范基金运作和严格控制投资风险的前提下，努力为基金份额持有人谋求最大利益。

三、基金经理工作报告

1、本基金业绩表现

截至报告期末，本基金份额净值为 1.6742 元，本报告期份额净值增长率为 129.02%，同期业绩比较基准增长率为 65.34%，远好于同期业绩比较基准的表现。

2、2006年投资回顾

回顾2006年，对于我国证券市场来说是具备划时代意义的一年，它既是股市走势的转折之年，也是证券市场体系基础建设承前启后的一年。这一年内不光A股市场告别了长达5年的“熊市”，而且阻碍证券市场发展的根本性问题——股权分置亦在今年内得到有效解决，我国证券市场未来的发展道路由此变得光明，大国崛起背景下的资本市场也逐渐迈上崭新的繁荣之路。

首先，从宏观经济来看，国内GDP增长率达到10.7%，创下了1997年以来的又一个新高。经济运行继续保持着“高增长、低通胀、效益比较好”的基本态势，这种“又好又快”的经济基础为证券市场的快速发展提供了良好的基础条件。

其次，人民币稳步升值、经济发展模式转换、消费升级使得金融房地产、消费服务、装备工业等行业的龙头公司逐步成为市场的主流。资本市场的各项功能，特别是融资功能得到了恢复。特别是工商银行和中国银行、中国人寿等一大批中国本土骨干企业在A股IPO成功昭示，国内资本市场的吸引力开始增强，取得本土企业定价权的意义逐步得到认同。当然，也正是因为这些大型蓝筹公司的上市，使得市场的行业结构从制造业转换成金融业，尤其是银行股占据主导的格局，市场波动特征开始发生变化。

本基金基本坚持了年初制定的“在风险一定的条件下追求收益率的最大化”的指导原则，资产配置上基本以股票投资为主。行业配置上，除在第三季度食品饮料配置有点偏离市场热点外，全年基本上把握住了市场的运行特征，上半年以有色、食品饮料、医药等行业小盘成长为主，而下半年特别是第四季度大幅增持银行、钢铁等大盘蓝筹股为主。从全年的绩效来看，这个策略相当有效。

3、市场展望和投资策略

展望 2007 年，随着人民币升值趋于加速的态势和股权分置改革完成后国内资本市场的逐步完善，资本市场将依然充满投资魅力。首先，影响股市走势的基本面因素依然保持前期良好的态势。宏观经济依然保持“高增长、低通胀”的运行格局，而沪深 300 成分股为代表的上市公司整体业绩仍有 20-25% 的增长，同时人民币持续、稳步升值使得海外投资者更加关注人民币资产。这种环境下，证券市场脱离经济基本面走坏的可能性很小。其次，从资金供求关系来看仍然有利于证券市场，贸易顺差继续加剧、央行不断通过发行票据对冲外汇储备的增长显示市场的流动性仍然过剩，社会资金成本仍处于低位。

但是，我们也注意到，目前市场的估值水平已经较2006年底有较大幅度的提高，同时一些大盘蓝筹股股价的上涨幅度较大程度超出企业盈利增长的幅度。而更令人不安的是，越来越多的分析师在企业没有明显业绩提升时而频繁上调上市公司的目标价。因此，本基金认为，在长期看好市场的战略前提下，在战术层面仍需要很长一段时间来耐心观察市场估值水平的变化，一方面要视上市公司的2006年报和2007年一季度报甚至半年报来检验企业盈利增长是否符合预期重估企业价值，另一方面也需要时间观察在股指期货等重大金融创新政策出台后对于市场投资者投资行为改变的影响。因此在市场的这段敏感时期，市场的震荡风险将较

2006年远远加大，某种程度上，在市场未取得新的共识前，宽幅震荡将成为一种常态。

综合以上判断，本基金认为在2007年要取得超额收益不但要加强交易能力，而且也要适当延长操作周期，关键位置要坚决持股。在策略上，本基金将基本维持过往的投资布局，在风格继续平衡为主的基础上，加强行业配置的锐度，即“坚持以符合消费服务升级的公司为龙头，以资产类公司和经济水桶短板类产业（如装备、物流）的公司为两翼”，并在此基础上，视不同市场阶段的投资主题适当进行策略性的调整。从这个意义上看，2007年考验投资者的不仅有投资眼光，同时还有心理承受能力。

四、内部监察工作报告

本报告期内，依据相关的法律法规、基金合同以及内部监察稽核制度，本基金管理人对基金运作、内部管理、制度执行及遵纪守法情况进行了监察稽核。内部监察稽核的重点是：国家法律法规及行业监管规则的执行情况；基金合同的遵守情况；内部规章制度的执行情况；资讯管制和保密工作落实情况；员工职业操守规范情况，目的是规范基金财产的运作，防范和控制投资风险，确保经营业务的稳健运行和受托资产的安全完整，维护基金份额持有人的合法权益。

1、根据最新的法律法规、规章、规范性文件、证券市场中出现的与基金运作相关的新事物以及实践中产生的新问题，我公司及时制定了相应的制度，并对以前的制度进行不断修订和完善，确保公司内控制度的适时性、全面性和合法合规性。2006年以来，我公司根据新业务发展需要制定了《流通受限证券投资管理制度》、《投资流通受限证券流动性风险处置预案》、《权证投资操作细则》、《资产支持证券投资操作细则》等制度，并根据制度执行与评估存在的问题，进一步修改完善了《股票投资操作细则》、《股票投资限制表制度》、《基金投资关联交易管理制度》等制度。

2、全面加强风险监控，不断提高风险管理水平。2006年，公司进一步细化了各部门风险监控点，并在各部门定期自查的基础上，公司监察稽核部根据《季度监察稽核项目表》和《公司各部门内部监察稽核明细表》，对公司各部门进行认真复查，并对研究报告、投资决策、投资指令、交易执行和基金销售、运营、客户服务等关键业务方面进行了重点复查。同时，公司各部门针对监察稽核部提出的风险隐患，全面进行落实改进，从而较好地杜绝了各种可能违反基金合同及法律法规行为的发生。

3、不断加强风险控制手段，提高监察稽核效率。一方面，公司充分利用信息技术系统，将法律、法规和公司规定的各种投资禁止、投资限制措施和量化监控指标在投资管理软件系统中进行阈值设置，出现超出阈值的情况，系统将及时报警并拒绝执行指令。这些技术手段的使用将风险的事前防控定型化、客观化、流程化，从而有效控制了风险，提高了监察稽核效率。另一方面，公司继续加强数量化风险控制开发与投入，提高基金投资的决策效率和风险管理能力。2006年，我公司对自主开发的大成 VaR 风险管理系统等进行了全面改造。目前，该系统已逐步成为各基金经理小组基金投资组合风险管理的主要工具之一。此外，公司还加强与境外先进资产管理机构的学习，引进境外科学的风险控制措施和手段，提高风险控制水平。

4、严格按照中国证监会对反商业贿赂的工作部署要求，积极开展了治理商业贿赂工作。根据中国证监会有关《通知》的精神和要求，我公司开展了治理商业贿赂的一系列工作，如成立了治理商业贿赂工作领导小组及办事机构；制定了《防止不正当交易及商业贿赂内部控制制度》；设立了举报电话和举报信箱等等，并组织公司全体员工进行了相关反商业贿赂的有关培训，对各种商业贿赂行为的样态进行了全面的分析，使大家认识到了商业贿赂的严重后果，较好地杜绝了商业贿赂现象的产生。

5、努力培育全员风险管理文化。首先，开展多种形式的法律培训，使员工对规范基金业务的法律规定有深刻的理解，约束日常工作行为。如新员工入职培训中有专门的法律培训，就基金销售、基金投资、基金公司运作等法律法规给大家进行详细的讲解，并组织大家进行考试。其次，及时向全公司传达与基金相关的法律法规，供大家学习并要求大家将其贯彻到日常工作中。第三，监察稽核部认真解答各业务部门提出的法律问题，并尽力提供法律依据，对于疑难问题向公司的外部律师咨询或者直接向证监会或者交易所请示，避免了基金业务中的盲目性，防范了可能发生的投诉及诉讼风险，维护了基金份额持有人的利益及公司形象。从而也有利于大家逐步树立合法合规的经营意识，培育全员的风险管理文化。

在本报告期内，本基金管理人运用基金财产进行投资严格按照招募说明书所披露的投资决策程序进行，没有发生重大违法违规行为，没有运用基金财产进行内幕交易和操纵市场以及有损基金投资人利益的关联交易，亦无任何员工发生违法违规行为。

第四节 托管人报告

本报告期内，中国银行股份有限公司（以下称“本托管人”）在对大成蓝筹稳健证券投资基金（以下称“本基金”）的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管合同的有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了应尽的义务。

本报告期内，本托管人根据《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管合同的规定，对本基金管理人的投资运作进行了必要的监督，对基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算以及基金费用开支等方面进行了认真地复核，未发现本基金管理人存在损害基金份额持有人利益的行为。

本年度报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容真实、准确和完整。

中国银行股份有限公司

2007 年 3 月 28 日

第五节 审计报告

普华永道中天审字(2007)第 20263 号

大成蓝筹稳健证券投资基金全体基金份额持有人：

我们审计了后附的大成蓝筹稳健证券投资基金（以下简称“大成蓝筹稳健基金”）会计报表，包括 2006 年 12 月 31 日的资产负债表、2006 年度的经营业绩表和基金净值变动表以及会计报表附注。

一、管理层对会计报表的责任

按照企业会计准则、《金融企业会计制度》、《证券投资基金会计核算办法》、《大成蓝筹稳健证券投资基金基金合同》和中国证券监督管理委员会允许的如会计报表附注所列示的基金行业实务操作的有关规定编制会计报表是大成蓝筹稳健基金的基金管理人大成基金管理有限公司管理层的责任。这种责任包括：

(1) 设计、实施和维护与会计报表编制相关的内部控制，以使会计报表不存在由于舞弊或错误而导致的重大错报；

- (2) 选择和运用恰当的会计政策；
 (3) 作出合理的会计估计。

二、注册会计师的责任

我们的责任是在实施审计工作的基础上对会计报表发表审计意见。我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。中国注册会计师审计准则要求我们遵守职业道德规范，计划和实施审计工作以对会计报表是否不存在重大错报获取合理保证。

审计工作涉及实施审计程序，以获取有关会计报表金额和披露的审计证据。选择的审计程序取决于注册会计师的判断，包括对由于舞弊或错误导致的会计报表重大错报风险的评估。在进行风险评估时，我们考虑与会计报表编制相关的内部控制，以设计恰当的审计程序，但目的并非对内部控制的有效性发表意见。审计工作还包括评价管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计的合理性，以及评价会计报表的总体列报。

我们相信，我们获取的审计证据是充分、适当的，为发表审计意见提供了基础。

三、审计意见

我们认为，上述会计报表已经按照企业会计准则、《金融企业会计制度》、《证券投资基金会计核算办法》、《大成蓝筹稳健证券投资基金基金合同》和中国证券监督管理委员会允许的如会计报表附注所列示的基金行业实务操作的有关规定编制，在所有重大方面公允反映了大成蓝筹稳健基金 2006 年 12 月 31 日的财务状况以及 2006 年度的经营成果和基金净值变动。

普华永道中天

注册会计师

汪 棣

会计师事务所有限公司

中国·上海市

注册会计师

陈 宇

2007 年 3 月 26 日

第六节 财务会计报告

一、基金会计报表(除特别注明外，金额单位为人民币元)

1、2006年12月31日资产负债表

| | 附注 | 2006年12月31日 | 2005年12月31日 |
|-----------|------|----------------|----------------|
| 资产 | | | |
| 银行存款 | | 32,916,462.02 | 49,363,536.58 |
| 清算备付金 | | 1,701,861.24 | 1,457,982.56 |
| 交易保证金 | 6(1) | 888,549.12 | 530,018.23 |
| 应收证券清算款 | | 628,918.18 | 8,375,737.52 |
| 应收股利 | | 0.00 | 0.00 |
| 应收利息 | 6(2) | 8,611.77 | 3,286,416.55 |
| 应收申购款 | | 8,741,031.88 | 30,783.00 |
| 其他应收款 | 6(3) | 0.00 | 0.00 |
| 股票投资市值 | | 490,509,576.73 | 605,450,119.67 |
| 其中：股票投资成本 | | 361,243,297.97 | 564,959,343.46 |
| 债券投资市值 | | 0.00 | 136,747,376.00 |
| 其中：债券投资成本 | | 0.00 | 137,660,924.44 |
| 权证投资 | | 478,250.00 | 0.00 |
| 其中：权证投资成本 | | 196,700.00 | 0.00 |

| | | | |
|------------|-------|----------------|----------------|
| 买入返售证券 | | 0.00 | 0.00 |
| 待摊费用 | 6 (4) | 0.00 | 0.00 |
| 其他资产 | | 0.00 | 0.00 |
| 资产总计 | | 535,873,260.94 | 805,241,970.11 |
| 负债 | | | |
| 应付证券清算款 | | 0.00 | 0.00 |
| 应付赎回款 | | 2,563,439.04 | 590,174.16 |
| 应付赎回费 | | 5,820.36 | 1,128.32 |
| 应付管理人报酬 | | 536,129.41 | 1,007,246.14 |
| 应付托管费 | | 89,354.90 | 167,874.34 |
| 应付佣金 | 6 (5) | 1,482,925.33 | 669,571.63 |
| 应付利息 | | 0.00 | 0.00 |
| 应付收益 | | 0.00 | 0.00 |
| 未交税金 | | 0.00 | 0.00 |
| 其他应付款 | 6 (6) | 509,400.00 | 507,200.00 |
| 卖出回购证券款 | | 0.00 | 0.00 |
| 短期借款 | | 0.00 | 0.00 |
| 预提费用 | 6 (7) | 250,000.00 | 200,000.00 |
| 其他负债 | | 0.00 | 0.00 |
| 负债合计 | | 5,437,069.04 | 3,143,194.59 |
| 持有人权益 | | | |
| 实收基金 | 6 (8) | 316,822,365.84 | 843,438,689.00 |
| 未实现利得 | 6 (9) | 67,996,478.84 | 20,963,818.06 |
| 未分配收益 | | 145,617,347.22 | -62,303,731.54 |
| 持有人权益合计 | | 530,436,191.90 | 802,098,775.52 |
| 负债及持有人权益总计 | | 535,873,260.94 | 805,241,970.11 |
| 基金份额净值 | | 1.6742 | 0.9510 |

所附附注为本会计报表的组成部分

2、2006年1月1日至12月31日止期间经营业绩表

| | 附注 | 2006年度 | 2005年度 |
|------------|--------|----------------|----------------|
| 一、收入 | | 299,390,796.16 | -68,795,626.39 |
| 1、股票差价收入 | 6 (10) | 283,007,357.81 | -96,797,319.32 |
| 2、债券差价收入 | 6 (11) | -323,343.66 | 7,970,329.64 |
| 3、权证差价收入 | 6 (12) | 10,254,847.28 | 1,739,589.15 |
| 4、债券利息收入 | | 74,857.66 | 5,199,681.86 |
| 5、存款利息收入 | | 434,956.10 | 989,251.30 |
| 6、股利收入 | | 5,137,038.02 | 11,629,302.20 |
| 7、买入返售证券收入 | | 0.00 | 0.00 |
| 8、其他收入 | 6 (13) | 805,082.95 | 473,538.78 |
| 二、费用 | | 8,190,199.28 | 17,663,065.79 |
| 1、基金管理人报酬 | | 6,702,775.08 | 14,516,282.26 |
| 2、基金托管费 | | 1,117,129.24 | 2,419,380.44 |
| 3、卖出回购证券支出 | | 0.00 | 294,863.00 |

| | | | |
|----------|-------|----------------|----------------|
| 4、利息支出 | | 0.00 | 0.00 |
| 5、其他费用 | 6(14) | 370,294.96 | 432,540.09 |
| 其中：上市年费 | | 0.00 | 0.00 |
| 信息披露费 | | 300,000.00 | 300,000.00 |
| 审计费用 | | 50,000.00 | 100,000.00 |
| 三、基金净收益 | | 291,200,596.88 | -86,458,692.18 |
| 加：未实现利得 | | 89,970,600.99 | 62,627,970.19 |
| 四、基金经营业绩 | | 381,171,197.87 | -23,830,721.99 |

所附附注为本会计报表的组成部分

3、2006年1月1日至12月31日止期间基金收益分配表

| | 附注 | 2006年度 | 2005年度 |
|--------------|-------|----------------|----------------|
| 本期基金净收益 | | 291,200,596.88 | -86,458,692.18 |
| 加：期初基金净收益 | | -62,303,731.54 | 6,986,348.63 |
| 加：本期损益平准金 | | 9,701,343.01 | 17,168,612.01 |
| 可供分配基金净收益 | | 238,598,208.35 | -62,303,731.54 |
| 减：本期已分配基金净收益 | 6(15) | 92,980,861.13 | 0.00 |
| 期末基金净收益 | | 145,617,347.22 | -62,303,731.54 |

所附附注为本会计报表的组成部分

4、2006年1月1日至12月31日止期间基金净值变动表

| | 附注 | 2006年度 | 2005年度 |
|----------------------|-------|-------------------|------------------|
| 一、期初基金净值 | | 802,098,775.52 | 1,200,632,922.18 |
| 二、本期经营活动： | | | |
| 基金净收益 | | 291,200,596.88 | -86,458,692.18 |
| 未实现利得 | | 89,970,600.99 | 62,627,970.19 |
| 经营活动产生的基金净值变动数 | | 381,171,197.87 | -23,830,721.99 |
| 三、本期基金份额交易： | | | |
| 基金申购款 | | 460,231,159.27 | 101,270,704.18 |
| 基金赎回款 | | -1,020,084,079.63 | -475,974,128.85 |
| 基金份额交易产生的基金净值变动数 | | -559,852,920.36 | -374,703,424.67 |
| 四、本期向持有人分配收益： | | | |
| 向基金持有人分配收益产生的基金净值变动数 | 6(15) | -92,980,861.13 | 0.00 |
| 五、期末基金净值 | | 530,436,191.90 | 802,098,775.52 |

所附附注为本会计报表的组成部分

二、会计报表附注

(除特别标明外，金额单位为人民币元)

附注1. 基金基本情况

大成蓝筹稳健证券投资基金(以下简称“本基金”)经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监基金字[2004]第36号《关于同意大成蓝筹稳健证券投资基金设立的批复》核准，由大成基金管理有限公司依照《证券投资基金管理暂行办法》及其实施细则、《开放式证券投资基金试点办法》等有关规定和《大成蓝筹稳健证券投资基金基金契约》(后

更名为《大成蓝筹稳健证券投资基金基金合同》)发起,并于2004年6月3日募集成立。本基金为契约型开放式,存续期限不定,首次设立募集不包括认购资金利息共募集2,233,805,642.19元,业经普华永道中天会计师事务所有限公司普华永道(中天)验字(2004)第90号验资报告予以验证。本基金的基金管理人为大成基金管理有限公司,基金托管人为中国银行股份有限公司。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《大成蓝筹稳健证券投资基金基金合同》的有关规定,本基金的股票投资主要投资于上证180指数成份股、深证100指数成份股以及未来可能入选成份股的股票,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、企业债(包括可转债)等债券及中国证监会允许基金投资的其他金融工具。本基金资产中股票投资比例为基金资产净值的30%-95%,债券投资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投资比例不低于基金资产净值的5%。

附注2. 会计报表编制基础、主要会计政策及会计估计

(1) 会计报表编制基础

本基金的会计报表按照国家颁布的企业会计准则、《金融企业会计制度》、《证券投资基金会计核算办法》、《大成蓝筹稳健证券投资基金基金合同》和中国证监会允许的如会计报表附注所列示的基金行业实务操作的有关规定编制。本基金年度报告中会计报表的编制遵守基本会计假设。

(2) 会计年度

本基金会计年度为公历1月1日起至12月31日止。

(3) 记帐本位币

本基金的记帐本位币为人民币。

(4) 记帐基础和计价原则

本基金的记帐基础为权责发生制。除股票投资、债券投资和权证投资按市值计价外,所有报表项目均以历史成本计价。

(5) 基金资产的估值原则

(i) 股票投资

上市交易的股票按其估值日在证券交易所挂牌的市场交易收盘价估值;估值日无交易的,以最近交易日的市场交易收盘价估值。首次公开发行但未上市的股票,按成本估值;由于配股和非定向增发形成的暂时流通受限制的股票,按估值日在证券交易所挂牌的同一股票的市场交易收盘价估值。

(ii) 债券投资

证券交易所市场实行净价交易的国债按其估值日在证券交易所挂牌的市场交易收盘价估值;估值日无交易的,以最近交易日的市场交易收盘价估值。证券交易所市场未实行净价交易的企业债券及可转换债券按估值日市场交易收盘价减去债券收盘价中所含的债券应收利息得到的净价估值;估值日无交易的,以最近交易日的市场交易收盘价减去债券收盘价中所含的债券应收利息得到的净价估值。

(iii) 银行间同业市场交易的债券按不含息成本与市价孰低法估值,市价按估值日银行间同业市场公布的加权平均成交净价确定;估值日无交易的,按最近交易日的加权平均成交净价确定。如有确凿证据表明银行间同业市场交易的债券按上述办法进行估值不能客观反映

其公允价值，基金管理人在综合考虑市场成交价、市场报价、流动性、收益率曲线等因素的基础上，根据具体情况与基金托管人商定后，按最能反映公允价值的价格估值。未上市流通的债券按成本估值。

(iv) 权证投资

从获赠确认日、买入成交日或因认购新发行分离交易可转债而取得的权证从实际取得日起到卖出日或行权日止，上市交易的权证投资按估值日在证券交易所挂牌的该权证投资的市场交易收盘价估值；未上市交易的权证投资(包括配股权证)按公允价值估值。

(v) 实际投资成本与估值的差异计入“未实现利得/(损失)”科目。

(vi) 如有确凿证据表明按上述方法进行估值不能客观反映其公允价值，基金管理人应根据具体情况与基金托管人商定后，按最能反映公允价值的价格估值。

(6) 证券投资基金成本计价方法

(i) 股票投资

买入股票于成交日确认为股票投资。股票投资成本按成交日应支付的全部价款入账。收到股权分置改革过程中由非流通股股东支付的现金对价，于股权分置方案实施复牌日冲减股票投资成本。

卖出股票于成交日确认股票差价收入/(损失)。出售股票的成本按移动加权平均法于成交日结转。

(ii) 债券投资

买入证券交易所交易的债券于成交日确认为债券投资；买入银行间同业市场交易的债券于实际支付价款时确认为债券投资。债券投资按成交日应支付的全部价款入账，其中所包含债券起息日或上次除息日至购买日止的利息，作为应收利息单独核算，不构成债券投资成本。认购新发行的分离交易可转债于成交日先按支付的全部价款确认为债券投资，后于权证实际取得日按附注 2. (6) (iii) 所示的方法单独核算权证成本，并相应调整债券投资成本。

买入贴息债券视同到期一次性还本付息的附息债券，根据其发行价、到期价和发行期限按直线法推算内含票面利率后，按上述会计处理方法核算。

卖出证券交易所交易的债券于成交日确认债券差价收入/(损失)；卖出银行间同业市场交易的债券于实际收到全部价款时确认债券差价收入/(损失)。出售债券的成本按移动加权平均法结转。

(iii) 权证投资

获赠权证(包括配股权证)在确认日，按持有的股数及获赠比例计算并记录增加的权证数量；买入权证于成交日确认为权证投资，相应成本按成交日应支付的全部价款入账。因认购新发行的分离交易可转债而取得的权证在实际取得日，按权证公允价值占分离交易可转债全部公允价值的比例将购买分离交易可转债实际支付全部价款的一部分确认为权证成本。

卖出权证于成交日确认权证差价收入/(损失)。出售权证的成本按移动加权平均法于成交日结转。

(7) 待摊费用的摊销方法和摊销期限

待摊费用为已经发生的，影响到基金份额净值小数点后第五位的，应分摊计入本期和以后各期的费用。待摊费用按直线法在受益期内平均摊销。

(8) 收入的确认和计量

股票差价收入/(损失)于卖出股票成交日按卖出股票成交总额与其成本和相关费用的差额确认。

证券交易所交易的债券差价收入/(损失)于卖出成交日确认；银行间同业市场交易的债券差价收入/(损失)于实际收到全部价款时确认。债券差价收入/(损失)按应收取全部价款与其成本、应收利息和相关费用的差额确认。

权证差价收入/(损失)于卖出权证成交日按卖出权证成交总额与其成本及相关费用的差额确认。

债券利息收入按债券票面价值与票面利率或内含票面利率计算的金额扣除适用情况下应由债券发行企业代扣代缴的个人所得税后的净额确认，在债券实际持有期内逐日计提。

存款利息收入按存款的本金与适用利率逐日计提。

股利收入按上市公司宣告的分红派息比例计算的金额扣除由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额于除息日确认。

(9) 费用的确认和计量

本基金的基金管理人报酬按前一日基金资产净值 1.5%的年费率逐日计提。

本基金的基金托管费按前一日基金资产净值 0.25%的年费率逐日计提。

卖出回购证券支出按融入资金额及约定利率，在回购期限内采用直线法逐日计提。

(10) 实收基金

实收基金为对外发行的基金份额总额。由于申购和赎回引起的实收基金变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日认列。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

(11) 未实现利得/(损失)

未实现利得/(损失)包括因投资估值而产生的未实现估值增值/(减值)和未实现利得/(损失)平准金。

未实现利得/(损失)平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按未实现利得/(损失)占基金净值比例计算的金额。未实现利得/(损失)平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日认列。

(12) 损益平准金

损益平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按未分配基金净收益/(累计基金净损失)占基金净值比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日认列，并于期末全额转入未分配基金净收益/(累计基金净损失)。

(13) 基金的收益分配政策

每一基金份额享有同等分配权。本基金收益以现金形式分配，但基金份额持有人可选择现金红利或将现金红利按分红除权日的基金份额净值自动转为基金份额进行再投资。基金收益分配每年至少一次，收益分配比例不低于基金净收益的90%。基金当期收益先弥补上一年度亏损后，方可进行当年收益分配。基金当年亏损，则不进行收益分配。基金收益分配后，基金份额净值不能低于面值。

经宣告的拟分配基金收益于分红除权日从持有人权益转出。

(14) 为处理对基金财务状况及基金运作有重大影响的事项而采取的其他会计政策和会计估计。

无。

(15) 会计政策、会计估计 变更的内容、理由、影响数或影响数不能合理确定的理由。

无。

(16) 重大会计差错的内容和更正金额。

无。

附注3. 主要税项

根据财政部、国家税务总局财税 [2002]128号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税 [2004]78号《关于证券投资基金税收政策的通知》、财税[2005]11号《关于调整证券(股票)交易印花税税率的通知》、财税[2005]102号《关于股息红利个人所得税有关政策的通知》、财税[2005]103号《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》及其他相关税务法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1) 以发行基金方式募集资金，不属于营业税征收范围，不征收营业税。

(2) 基金买卖股票、债券的差价收入，暂免征营业税和企业所得税。

(3) 对基金取得的企业债券利息收入，由发行债券的企业在向基金派发利息时代扣代缴20%的个人所得税，暂不征收企业所得税。对基金取得的股票的股息、红利收入，自2005年6月13日起由上市公司在向基金派发股息、红利时暂减按50%(此前按100%)计入个人应纳税所得额，依照现行税法规定即20%代扣代缴个人所得税，暂不征收企业所得税。

(4) 基金买卖股票于2005年1月24日前按照0.2%的税率缴纳股票交易印花税，自2005年1月24日起减按0.1%的税率缴纳。

(5) 基金作为流通股股东在股权分置改革过程中收到由非流通股股东支付的股份、现金等对价，暂免征收印花税、企业所得税和个人所得税。

附注4. 资产负债表日后事项

无。

附注5. 关联方关系及关联方交易

(1) 关联方关系

| 关联方名称 | 与本基金的关系 |
|-------------------------|---------------------|
| 大成基金管理有限公司(“大成基金”) | 基金管理人、注册登记机构、基金销售机构 |
| 中国银行股份有限公司(“中国银行”) | 基金托管人、基金代销机构 |
| 光大证券股份有限公司 | 基金管理人的股东、基金代销机构 |
| 中国银河证券有限责任公司(“银河证券”)(*) | 基金管理人的股东、基金代销机构 |
| 广东证券股份有限公司(“广东证券”)** | 基金管理人的股东、基金代销机构 |
| 中泰信托投资有限责任公司 | 基金管理人的股东 |

本报告期内关联方关系未发生变化

*银河证券持有的大成基金股权于2005年6月9日被郑州市中级人民法院冻结，该部分股权处理方案尚未明确。

**中国证监会于2005年11月6日作出对广东证券取消业务许可并责令关闭的行政处罚。广东证券作为本基金代销机构的资格在其业务处置方案明确前暂不变更。

下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

(2) 通过关联方席位进行的交易及佣金情况

A 股票买卖

| 关联方名称 | 2006 年度 | | 2005 年度 | |
|-------|----------------|----------------|----------------|----------------|
| | 本期成交金额 | 占本期该类交易成交总金额比例 | 本期成交金额 | 占本期该类交易成交总金额比例 |
| 银河证券 | 804,827,983.65 | 16.32% | 630,395,420.58 | 20.14% |

B 债券买卖

| 关联方名称 | 2006 年度 | | 2005 年度 | |
|-------|--------------|----------------|----------------|----------------|
| | 本期成交金额 | 占本期该类交易成交总金额比例 | 本期成交金额 | 占本期该类交易成交总金额比例 |
| 银河证券 | 4,477,740.00 | 4.58% | 470,146,810.60 | 30.03% |

C 债券回购

| 关联方名称 | 2006 年度 | | 2005 年度 | |
|-------|---------|----------------|----------------|----------------|
| | 本期成交金额 | 占本期该类交易成交总金额比例 | 本期成交金额 | 占本期该类交易成交总金额比例 |
| 银河证券 | 0.00 | 0.00 | 370,000,000.00 | 51.39% |

D 佣金

| 关联方名称 | 2006 年度 | | 2005 年度 | |
|-------|------------|------------|------------|------------|
| | 金额 | 占本期佣金总金额比例 | 金额 | 占本期佣金总金额比例 |
| 银河证券 | 659,908.36 | 16.59% | 508,588.72 | 20.30% |

E 权证

| 关联方名称 | 2006 年度 | | 2005 年度 | |
|-------|------------|------------|---------|------------|
| | 金额 | 占本期佣金总金额比例 | 金额 | 占本期佣金总金额比例 |
| 银河证券 | 758,800.54 | 5.27% | 0.00 | 0.00% |

上述佣金按市场佣金率计算，以扣除由中国证券登记结算有限责任公司收取证管费、经手费和由券商承担的证券结算风险基金后的净额列示。债券及权证交易不计佣金。

该类佣金协议的服务范围还包括佣金收取方为本基金提供的证券投资研究成果和市场信息服务。

(3) 与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易

无

(4) 关联方报酬

A 基金管理人报酬

支付基金管理人大成基金的基金管理人报酬按前一日基金资产净值 1.5% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。

其计算公式为：日基金管理人报酬 = 前一日基金资产净值 × 1.5% / 当年天数。

本基金在本年度需支付基金管理人报酬 6,702,775.08 元(2005 年：14,516,282.26 元)。

B 基金托管人报酬

支付基金托管人中国银行的基金托管费按前一日基金资产净值 0.25% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。

其计算公式为：日基金托管费 = 前一日基金资产净值 × 0.25% / 当年天数。

本基金在本年度需支付基金托管费 1,117,129.24 元(2005 年：2,419,380.44 元)。

C 由关联方保管的银行存款余额及由此产生的利息收入

本基金的银行存款由基金托管人中国银行保管，按银行同业利率计息。基金托管人于 2006 年 12 月 31 日保管的银行存款余额为 32,916,462.02 元(2005 年: 49,363,536.58 元)。本年度由基金托管人保管的银行存款产生的利息收入为 400,984.76 元(2005 年: 922,485.19 元)。

(5) 基金各关联方投资本基金的情况

A 大成基金管理有限公司期末持有本基金份额情况及报告期内持有份额的变化情况

无。

B 大成基金管理有限公司主要股东在期末持有本基金份额情况

无。

附注6. 基金会计报表重要项目说明

(1) 交易保证金

| 项目 | 2006 年 12 月 31 日 | 2005 年 12 月 31 日 |
|---------|------------------|------------------|
| 深圳结算保证金 | 750,000.00 | 391,469.11 |
| 权证交易保证金 | 138,549.12 | 138,549.12 |
| 合计 | 888,549.12 | 530,018.23 |

(2) 应收利息

| 项目 | 2006 年 12 月 31 日 | 2005 年 12 月 31 日 |
|-----------|------------------|------------------|
| 应收银行存款利息 | 7,783.57 | 25,962.94 |
| 应收结算备付金利息 | 765.90 | 656.10 |
| 应收交易保证金利息 | 62.30 | 62.30 |
| 应收债券利息 | 0.00 | 3,259,735.21 |
| 合计 | 8,611.77 | 3,286,416.55 |

(3) 其他应收款

无。

(4) 待摊费用

无。

(5) 应付佣金

| 券商名称 | 2006 年 12 月 31 日 | 2005 年 12 月 31 日 |
|--------------|------------------|------------------|
| 北京高华证券有限责任公司 | 545,485.25 | 0.00 |
| 长江证券有限责任公司 | 338,426.64 | 0.00 |
| 天一证券有限责任公司 | 320,138.66 | 69,522.92 |
| 中银国际证券有限责任公司 | 146,352.90 | 79,011.95 |
| 联合证券有限责任公司 | 124,560.19 | 142,672.77 |
| 招商证券股份有限公司 | 7,961.69 | 163,851.96 |
| 中国科技证券有限责任公司 | 0.00 | 175,070.42 |
| 中国银河证券有限责任公司 | 0.00 | 39,441.61 |
| 合计 | 1,482,925.33 | 669,571.63 |

(6) 其他应付款

| 项目 | 2006 年 12 月 31 日 | 2005 年 12 月 31 日 |
|----------------|------------------|------------------|
| 应付券商席位保证金 | 500,000.00 | 500,000.00 |
| 应付债券利息收入的个人所得税 | 7,200.00 | 7,200.00 |

| | | |
|----|------------|------------|
| 其他 | 2,200.00 | 0.00 |
| 合计 | 509,400.00 | 507,200.00 |

(7) 预提费用

| 项目 | 2006年12月31日 | 2005年12月31日 |
|-------|-------------|-------------|
| 信息披露费 | 200,000.00 | 100,000.00 |
| 审计费用 | 50,000.00 | 100,000.00 |
| 合计 | 250,000.00 | 200,000.00 |

(8) 实收基金

| | 基金份额 | 基金面值 |
|-------------|----------------|----------------|
| 2005年12月31日 | 843,438,689.00 | 843,438,689.00 |
| 本年申购 | 349,100,724.40 | 349,100,724.40 |
| 其中：红利再投资 | 28,615,246.30 | 28,615,246.30 |
| 本年赎回 | 875,717,047.56 | 875,717,047.56 |
| 2006年12月31日 | 316,822,365.84 | 316,822,365.84 |

(9) 未实现利得

| | 未实现估值 增值/(减值) (*) | 未实现利得 /(损失) 平准金 | 合计 |
|-------------|----------------------|--------------------|----------------|
| 2005年12月31日 | 39,577,227.77 | -18,613,409.71 | 20,963,818.06 |
| 本年净变动数 | 89,970,600.99 | 0.00 | 89,970,600.99 |
| 本年申购基金份额 | 0.00 | 9,748,150.55 | 9,748,150.55 |
| 其中：红利再投资 | 0.00 | -2,747,376.22 | -2,747,376.22 |
| 本年赎回基金份额 | 0.00 | -52,686,090.76 | -52,686,090.76 |
| 2006年12月31日 | 129,547,828.76 | -61,551,349.92 | 67,996,478.84 |

*未实现估值增值/(减值)按投资类别分项列示如下：

| 项目 | 2006年12月31日 | 2005年12月31日 |
|------------|----------------|---------------|
| 股票投资 | 129,266,278.76 | 40,490,776.21 |
| 权证投资 | 281,550.00 | 0.00 |
| 债券投资—交易所市场 | 0.00 | -913,548.44 |
| 合计 | 129,547,828.76 | 39,577,227.77 |

(10) 股票差价收入

| 项目 | 2006年度 | 2005年度 |
|------------|------------------|------------------|
| 卖出股票成交总额 | 2,715,382,154.26 | 1,711,261,115.34 |
| 减：应付佣金总额 | 2,275,858.88 | 1,434,607.29 |
| 减：卖出股票成本总额 | 2,430,098,937.57 | 1,806,623,827.37 |
| 股票差价收入 | 283,007,357.81 | -96,797,319.32 |

本基金于本年度获得股权分置改革中由非流通股股东支付的现金对价共计 3,618,790.53元(2005年：6,338,600.00元)，已全额冲减股票投资成本。

(11) 债券差价收入

| 项目 | 2006年度 | 2005年度 |
|------------|----------------|----------------|
| 卖出债券成交总额 | 134,886,091.42 | 895,884,011.49 |
| 减：卖出债券成本总额 | 131,653,888.74 | 873,925,590.80 |
| 减：应收利息总额 | 3,555,546.34 | 13,988,091.05 |
| 债券差价收入 | -323,343.66 | 7,970,329.64 |

(12) 权证差价收入

| 项目 | 2006 年度 | 2005 年度 |
|------------|---------------|--------------|
| 卖出权证成交总额 | 12,324,655.18 | 1,739,589.15 |
| 减：卖出权证成本总额 | 2,069,807.90 | 0.00 |
| 权证差价收入 | 10,254,847.28 | 1,739,589.15 |

(13) 其他收入

| 项目 | 2006年度 | 2005年度 |
|--------------|------------|------------|
| 赎回基金补偿收入(*) | 729,705.39 | 464,054.15 |
| 转换基金补偿收入(**) | 75,377.56 | 7.39 |
| 新股申购手续费返还 | 0.00 | 9,477.24 |
| 合计 | 805,082.95 | 473,538.78 |

*本基金的赎回费率按持有期间递减，赎回费总额的25%归入基金资产。

**本基金转换为大成货币市场证券投资基金所收取的转换费总额的25%归入基金资产。

(14) 其他费用

| 项目 | 2006年度 | 2005年度 |
|-----------|------------|------------|
| 信息披露费 | 300,000.00 | 300,000.00 |
| 审计费用 | 50,000.00 | 100,000.00 |
| 债券托管账户维护费 | 18,300.00 | 18,600.00 |
| 其他 | 1,994.96 | 13,940.09 |
| 合计 | 370,294.96 | 432,540.09 |

(15) 收益分配

| | 登记日 | 分红率 | 现金形式发放 | 再投资形式发放 | 发放红利合计 |
|---------|----------|---------------|---------------|---------------|---------------|
| 2006年度 | | | | | |
| 第一次中期分红 | 06/03/28 | 每10份基金份额0.10元 | 2,390,575.50 | 1,519,324.84 | 3,909,900.34 |
| 第二次中期分红 | 06/06/01 | 每10份基金份额0.80元 | 14,962,368.39 | 7,458,462.66 | 22,420,831.05 |
| 第三次中期分红 | 06/08/17 | 每10份基金份额2.50元 | 41,686,980.21 | 24,963,149.53 | 66,650,129.74 |
| | | | 59,039,924.10 | 33,940,937.03 | 92,980,861.13 |

附注7. 报告期末流通转让受到限制的基金资产

A、本基金截至 2006 年 12 月 31 日止持有以下因股权分置改革而暂时停牌的股票，这些股票将在上市公司完成与流通股股东的沟通协商程序后或在股权分置改革规定的程序结束后复牌。（估值方法：以最近交易日的市场交易收盘价估值。）

| 股票代码 | 股票名称 | 停牌日期 | 年末估值单价 | 复牌日期 | 复牌开盘单价 | 数量 | 年末成本总额 | 年末估值总额 |
|-------------|-------|----------|--------|------|--------|---------|---------------|---------------|
| 方案沟通协商阶段停牌： | | | | | | | | |
| 000423 | S 阿 胶 | 06/12/04 | 13.69 | 未知 | 未知 | 569,960 | 6,341,946.78 | 7,802,752.40 |
| 方案实施阶段停牌： | | | | | | | | |
| 000895 | S 双 汇 | 06/06/01 | 31.17 | 未知 | 未知 | 803,957 | 14,187,795.44 | 25,059,339.69 |
| 合 计 | | | | | | | 20,529,742.22 | 32,862,092.09 |

B、基金可使用以基金名义开设的股票账户，比照个人投资者和一般法人、战略投资者参与新股认购。其中基金作为一般法人或战略投资者认购的新股，根据基金与上市公司所签订认购协议的规定，在新股上市后的约定期限内不能自由转让；基金作为个人投资者参与网上认购获配的新股或增发新股，从新股获配日至新股上市日之间不能自由转让。（估值方法：上市交易的股票按其估值日在证券交易所挂牌的市场交易收盘价估值。）

本基金截至 2006 年 12 月 31 日止投资的流通受限制的股票情况如下：

| 股票代码 | 股票名称 | 成功申购日期 | 可流通日期 | 申购价格 | 年末估值单价 | 数量 | 年末成本总额 | 年末估值总额 |
|--------|------|----------|----------|------|--------|--------|------------|------------|
| 601588 | 北辰实业 | 06/09/28 | 07/01/16 | 2.40 | 6.68 | 53,927 | 129,424.80 | 360,232.36 |

附注8. 其他重要事项

无。

第七节 投资组合报告

一、本报告期末基金资产组合情况

| 项目 | 金额（元） | 占基金资产总值比例 |
|--------------|----------------|-----------|
| 银行存款和清算备付金合计 | 34,618,323.26 | 6.46% |
| 股票 | 490,509,576.73 | 91.53% |
| 债券 | 0.00 | 0.00% |
| 权证 | 478,250.00 | 0.09% |
| 资产支持证券 | 0.00 | 0.00% |
| 其他资产 | 10,267,110.95 | 1.92% |
| 合计 | 535,873,260.94 | 100.00% |

二、本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 | 8,555,901.48 | 1.61% |
| B 采掘业 | 18,240,000.00 | 3.44% |
| C 制造业 | 274,441,655.64 | 51.75% |
| C0 食品、饮料 | 54,098,878.96 | 10.20% |
| C1 纺织、服装、皮毛 | 7,056,000.00 | 1.33% |
| 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 | 27,270.00 | 0.01% |
| C5 电子 | 6,363,773.68 | 1.20% |
| C6 金属、非金属 | 82,779,253.79 | 15.61% |
| C7 机械、设备、仪表 | 80,051,085.17 | 15.09% |
| C8 医药、生物制品 | 44,065,394.04 | 8.31% |
| C99 其他制造业 | 0.00 | 0.00% |
| D 电力、煤气及水的生产和供应业 | 0.00 | 0.00% |
| E 建筑业 | 0.00 | 0.00% |
| F 交通运输、仓储业 | 7,743,654.40 | 1.46% |
| G 信息技术业 | 22,176,107.16 | 4.18% |
| H 批发和零售贸易 | 20,763,600.00 | 3.91% |
| I 金融、保险业 | 81,318,000.00 | 15.33% |

| | | |
|-----------|----------------|--------|
| J 房地产业 | 32,352,131.68 | 6.10% |
| K 社会服务业 | 24,152,526.37 | 4.55% |
| L 传播与文化产业 | 766,000.00 | 0.14% |
| M 综合类 | 0.00 | 0.00% |
| 合计 | 490,509,576.73 | 92.47% |

三、本报告期末按市值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

| 序号 | 股票代码 | 股票名称 | 数量(股) | 市值(元) | 占基金资产净值比例 |
|----|--------|-------|-----------|---------------|-----------|
| 1 | 600030 | 中信证券 | 1,300,000 | 35,594,000.00 | 6.71% |
| 2 | 601398 | 工商银行 | 5,000,000 | 31,000,000.00 | 5.84% |
| 3 | 000680 | 山推股份 | 3,618,000 | 29,595,240.00 | 5.58% |
| 4 | 600019 | 宝钢股份 | 3,009,800 | 26,064,868.00 | 4.91% |
| 5 | 000157 | 中联重科 | 1,140,846 | 25,361,006.58 | 4.78% |
| 6 | 000895 | S 双 汇 | 803,957 | 25,059,339.69 | 4.72% |
| 7 | 600276 | 恒瑞医药 | 749,989 | 24,194,645.14 | 4.56% |
| 8 | 000002 | 万 科 A | 1,237,468 | 19,106,505.92 | 3.60% |
| 9 | 000825 | 太钢不锈 | 1,398,083 | 18,258,963.98 | 3.44% |
| 10 | 600028 | 中国石化 | 2,000,000 | 18,240,000.00 | 3.44% |
| 11 | 600138 | 中青旅 | 1,211,747 | 15,522,479.07 | 2.93% |
| 12 | 600036 | 招商银行 | 900,000 | 14,724,000.00 | 2.78% |
| 13 | 600718 | 东软股份 | 609,924 | 14,388,107.16 | 2.71% |
| 14 | 000061 | 农 产 品 | 1,106,400 | 14,106,600.00 | 2.66% |
| 15 | 600887 | 伊利股份 | 500,000 | 13,250,000.00 | 2.50% |
| 16 | 600005 | 武钢股份 | 2,000,000 | 12,720,000.00 | 2.40% |
| 17 | 600161 | 天坛生物 | 582,995 | 12,067,996.50 | 2.28% |
| 18 | 000402 | 金 融 街 | 599,964 | 10,109,393.40 | 1.91% |
| 19 | 000401 | 冀东水泥 | 1,995,851 | 9,959,296.49 | 1.88% |
| 20 | 000807 | 云铝股份 | 874,402 | 9,321,125.32 | 1.76% |
| 21 | 000972 | 新 中 基 | 500,931 | 8,555,901.48 | 1.61% |
| 22 | 000423 | S 阿 胶 | 569,960 | 7,802,752.40 | 1.47% |
| 23 | 600797 | 浙大网新 | 1,200,000 | 7,788,000.00 | 1.47% |
| 24 | 000089 | 深圳机场 | 1,209,946 | 7,743,654.40 | 1.46% |
| 25 | 600809 | 山西汾酒 | 248,460 | 7,699,775.40 | 1.45% |
| 26 | 600177 | 雅戈尔 | 800,000 | 7,056,000.00 | 1.33% |
| 27 | 600686 | 金龙汽车 | 400,000 | 6,824,000.00 | 1.29% |
| 28 | 600631 | 百联股份 | 700,000 | 6,657,000.00 | 1.26% |
| 29 | 600296 | S 兰 铝 | 500,000 | 6,455,000.00 | 1.22% |
| 30 | 002008 | 大族激光 | 307,726 | 6,363,773.68 | 1.20% |
| 31 | 600600 | 青岛啤酒 | 399,983 | 5,555,763.87 | 1.05% |
| 32 | 600169 | 太原重工 | 649,811 | 5,386,933.19 | 1.02% |
| 33 | 600007 | 中国国贸 | 499,903 | 5,049,020.30 | 0.95% |
| 34 | 600835 | 上海机电 | 499,990 | 4,729,905.40 | 0.89% |
| 35 | 000581 | 威孚高科 | 600,000 | 4,644,000.00 | 0.88% |

| | | | | | |
|--------|--------|-------|---------|----------------|--------|
| 36 | 000069 | 华侨城 A | 162,700 | 3,581,027.00 | 0.68% |
| 37 | 000768 | 西飞国际 | 300,000 | 3,510,000.00 | 0.66% |
| 38 | 600663 | 陆家嘴 | 200,000 | 2,776,000.00 | 0.52% |
| 39 | 000568 | 泸州老窖 | 100,000 | 2,534,000.00 | 0.48% |
| 40 | 000917 | 电广传媒 | 100,000 | 766,000.00 | 0.14% |
| 41 | 601588 | 北辰实业 | 53,927 | 360,232.36 | 0.07% |
| 42 | 600596 | 新安股份 | 1,500 | 27,270.00 | 0.01% |
| 股票投资合计 | | | | 490,509,576.73 | 92.47% |

四、本报告期股票投资组合的重大变动

1、本报告期内累计买入价值超出期初基金资产净值2%或前二十名股票明细

| 序号 | 股票代码 | 股票名称 | 累计买入金额(元) | 占期初基金资产净值比例 |
|----|--------|-------|---------------|-------------|
| 1 | 000002 | 万科 A | 89,476,501.97 | 11.16% |
| 2 | 600028 | 中国石化 | 81,982,107.00 | 10.22% |
| 3 | 600030 | 中信证券 | 69,059,764.50 | 8.61% |
| 4 | 600036 | 招商银行 | 65,635,786.89 | 8.18% |
| 5 | 000858 | 五粮液 | 52,001,078.54 | 6.48% |
| 6 | 600887 | 伊利股份 | 51,280,966.70 | 6.39% |
| 7 | 600050 | 中国联通 | 42,025,189.21 | 5.24% |
| 8 | 600491 | 龙元建设 | 40,573,286.48 | 5.06% |
| 9 | 600694 | 大商股份 | 34,132,049.76 | 4.26% |
| 10 | 601398 | 工商银行 | 34,103,562.28 | 4.25% |
| 11 | 000680 | 山推股份 | 31,840,138.88 | 3.97% |
| 12 | 600177 | 雅戈尔 | 31,040,484.38 | 3.87% |
| 13 | 600832 | 东方明珠 | 29,137,214.16 | 3.63% |
| 14 | 000898 | 鞍钢股份 | 28,371,708.32 | 3.54% |
| 15 | 600348 | 国阳新能 | 28,116,180.08 | 3.51% |
| 16 | 600005 | 武钢股份 | 27,539,669.64 | 3.43% |
| 17 | 000400 | 许继电气 | 27,178,179.31 | 3.39% |
| 18 | 000807 | 云铝股份 | 26,165,331.61 | 3.26% |
| 19 | 600631 | 百联股份 | 26,031,136.90 | 3.25% |
| 20 | 000402 | 金融街 | 24,799,661.34 | 3.09% |
| 21 | 600296 | S 兰铝 | 24,461,145.36 | 3.05% |
| 22 | 600331 | 宏达股份 | 23,746,195.70 | 2.96% |
| 23 | 600597 | 光明乳业 | 22,651,408.32 | 2.82% |
| 24 | 000060 | 中金岭南 | 22,552,554.12 | 2.81% |
| 25 | 600009 | 上海机场 | 22,501,506.84 | 2.81% |
| 26 | 600688 | S 上石化 | 22,367,241.26 | 2.79% |
| 27 | 000039 | 中集集团 | 20,846,535.50 | 2.60% |
| 28 | 600276 | 恒瑞医药 | 20,220,464.18 | 2.52% |
| 29 | 000157 | 中联重科 | 19,691,216.09 | 2.45% |
| 30 | 600598 | 北大荒 | 19,285,846.11 | 2.40% |
| 31 | 000061 | 农产品 | 19,235,838.27 | 2.40% |

| | | | | |
|----|--------|------|---------------|-------|
| 32 | 600019 | 宝钢股份 | 19,223,745.66 | 2.40% |
| 33 | 600718 | 东软股份 | 18,965,758.14 | 2.36% |
| 34 | 000825 | 太钢不锈 | 18,466,889.89 | 2.30% |
| 35 | 600138 | 中青旅 | 18,399,322.60 | 2.29% |
| 36 | 600596 | 新安股份 | 18,305,554.40 | 2.28% |
| 37 | 600547 | 山东黄金 | 16,973,714.48 | 2.12% |
| 38 | 600016 | 民生银行 | 16,572,610.60 | 2.07% |
| 39 | 600660 | 福耀玻璃 | 16,518,589.87 | 2.06% |

2、本报告期内累计卖出价值超出期初基金资产净值2%或前二十名股票明细

| 序号 | 股票代码 | 股票名称 | 累计卖出金额（元） | 占期初基金资产净值比例 |
|----|--------|-------|----------------|-------------|
| 1 | 600028 | 中国石化 | 106,985,600.73 | 13.34% |
| 2 | 000002 | 万科A | 105,455,458.46 | 13.15% |
| 3 | 600036 | 招商银行 | 75,007,359.92 | 9.35% |
| 4 | 600887 | 伊利股份 | 65,065,090.08 | 8.11% |
| 5 | 600348 | 国阳新能 | 63,105,029.81 | 7.87% |
| 6 | 600519 | 贵州茅台 | 62,111,321.29 | 7.74% |
| 7 | 600030 | 中信证券 | 57,220,426.15 | 7.13% |
| 8 | 000858 | 五粮液 | 55,606,094.68 | 6.93% |
| 9 | 600694 | 大商股份 | 52,889,448.33 | 6.59% |
| 10 | 600009 | 上海机场 | 51,996,575.32 | 6.48% |
| 11 | 600491 | 龙元建设 | 48,968,269.64 | 6.11% |
| 12 | 600050 | 中国联通 | 47,867,668.42 | 5.97% |
| 13 | 600000 | 浦发银行 | 44,842,857.46 | 5.59% |
| 14 | 000402 | 金融街 | 42,524,210.37 | 5.30% |
| 15 | 600900 | 长江电力 | 39,916,982.70 | 4.98% |
| 16 | 000538 | 云南白药 | 37,520,666.95 | 4.68% |
| 17 | 000839 | 中信国安 | 34,310,885.82 | 4.28% |
| 18 | 600832 | 东方明珠 | 32,168,610.56 | 4.01% |
| 19 | 000898 | 鞍钢股份 | 29,826,537.07 | 3.72% |
| 20 | 600331 | 宏达股份 | 29,787,921.86 | 3.71% |
| 21 | 000400 | 许继电气 | 29,497,229.51 | 3.68% |
| 22 | 600597 | 光明乳业 | 29,286,570.05 | 3.65% |
| 23 | 600296 | S 兰铝 | 28,956,184.60 | 3.61% |
| 24 | 600583 | 海油工程 | 27,734,862.45 | 3.46% |
| 25 | 600016 | 民生银行 | 27,576,318.48 | 3.44% |
| 26 | 600688 | S 上石化 | 26,152,417.04 | 3.26% |
| 27 | 000063 | 中兴通讯 | 25,550,267.18 | 3.19% |
| 28 | 600177 | 雅戈尔 | 25,010,665.98 | 3.12% |
| 29 | 600596 | 新安股份 | 22,861,370.27 | 2.85% |
| 30 | 600547 | 山东黄金 | 22,860,792.76 | 2.85% |
| 31 | 000060 | 中金岭南 | 22,130,286.66 | 2.76% |
| 32 | 000807 | 云铝股份 | 22,021,291.26 | 2.75% |

| | | | | |
|----|--------|---------|---------------|-------|
| 33 | 000039 | 中集集团 | 21,569,219.49 | 2.69% |
| 34 | 600631 | 百联股份 | 21,115,788.24 | 2.63% |
| 35 | 600085 | 同仁堂 | 20,927,334.53 | 2.61% |
| 36 | 600005 | 武钢股份 | 20,779,530.94 | 2.59% |
| 37 | 600269 | 赣粤高速 | 20,651,400.67 | 2.57% |
| 38 | 600660 | 福耀玻璃 | 20,648,226.67 | 2.57% |
| 39 | 002024 | 苏宁电器 | 20,322,691.16 | 2.53% |
| 40 | 600717 | 天津港 | 19,371,899.34 | 2.42% |
| 41 | 000978 | 桂林旅游 | 18,736,528.53 | 2.34% |
| 42 | 600598 | 北大荒 | 18,389,334.48 | 2.29% |
| 43 | 000612 | 焦作万方 | 18,290,748.59 | 2.28% |
| 44 | 600015 | 华夏银行 | 17,663,858.94 | 2.20% |
| 45 | 600011 | 华能国际 | 17,105,440.74 | 2.13% |
| 46 | 600019 | 宝钢股份 | 16,869,237.66 | 2.10% |
| 47 | 000001 | S 深发展 A | 16,835,315.98 | 2.10% |
| 48 | 600320 | 振华港机 | 16,707,776.51 | 2.08% |
| 49 | 600386 | 北京巴士 | 16,657,102.56 | 2.08% |

3、本报告期买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

| 项目 | 金额(元) |
|-----------|------------------|
| 买入股票的成本总额 | 2,230,001,682.61 |
| 卖出股票的收入总额 | 2,715,382,154.26 |

五、本报告期末按券种分类的债券投资组合

无。

六、本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投资明细

无。

七、报告期末按市值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券明细

无。

八、报告期末本基金投资权证证明细

1、报告期末按市值占基金资产净值比例大小排序的所有权证证明细

| 序号 | 权证代码 | 权证名称 | 数量(份) | 市值(元) | 占基金资产净值比例 |
|----|--------|---------|---------|------------|-----------|
| 1 | 031002 | 钢钒 GFC1 | 250,000 | 478,250.00 | 0.09% |

2、报告期内获得权证证明细

| 序号 | 权证代码 | 权证名称 | 报告期内 股权分置 改革获得 数量(份) | 报告期内 买入数量 (份) | 报告期内买入 成本(元) | 报告期内卖 出数量(份) | 报告期内卖出 收入(元) | 获得 方式 |
|----|--------|-------------|-------------------------------|---------------------|-----------------|-----------------|-----------------|--------------|
| 1 | 030002 | 五粮液 YGC1 | | 290,000 | 2,069,807.90 | 290,000 | 2,123,832.20 | 主动投资 |
| 2 | 580996 | 沪场 JTP1 | 750,000 | 0 | 0.00 | 750,000 | 1,488,818.10 | 股权分置 改革对价 |
| 3 | 580997 | 招行 CMP1 | 2,163,082 | 0 | 0.00 | 2,163,082 | 1,237,622.52 | 支付 |

| | | | | | | | | |
|----|--------|------------|-----------|---------|--------------|-----------|---------------|---|
| 4 | 580994 | 原水 CTP1 | 630,544 | 0 | 0.00 | 630,544 | 758,441.77 | |
| 5 | 580990 | 茅台 JCP1 | 1,728,000 | 0 | 0.00 | 1,728,000 | 6,715,940.59 | |
| 6 | 031002 | 钢钒 GFC1 | | 250,000 | 196,700.00 | 0 | 0.00 | 老股东配 售分离交 易可转债 115001 时 获配的权 证 |
| 合计 | | | | | 2,266,507.90 | | 12,324,655.18 | |

九、投资组合报告附注

1、本报告期内本基金投资的前十名证券中无发行主体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、处罚的证券;

2、本报告期内本基金投资的前十名股票中,无投资于基金合同规定备选股票库之外的股票;

3、其他资产的构成:

| 项目 | 金额(元) |
|---------|---------------|
| 交易保证金 | 888,549.12 |
| 应收证券清算款 | 628,918.18 |
| 应收股利 | 0.00 |
| 应收利息 | 8,611.77 |
| 应收申购款 | 8,741,031.88 |
| 合计 | 10,267,110.95 |

4、本报告期末本基金持有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。

第八节 基金份额持有人情况

一、报告期末基金份额持有人户数

| | |
|-----------------|-------------|
| 报告期末基金份额持有人户数 | 6,725 户 |
| 报告期末平均每户持有的基金份额 | 47,111.13 份 |

二、报告期末基金份额持有人结构

| 项目 | 数量(份) | 占总份额的比例 |
|-----------------|----------------|---------|
| 基金份额总额 | 316,822,365.84 | 100.00% |
| 其中:机构投资者持有的基金份额 | 149,908,715.39 | 47.32% |
| 个人投资者持有的基金份额 | 166,913,650.45 | 52.68% |

第九节 开放式基金份额变动

单位：份

| | |
|----------------|------------------|
| 基金合同生效日的基金份额总额 | 2,234,307,480.29 |
| 本报告期期初基金份额总额 | 843,438,689.00 |
| 加：本报告期期间总申购份额 | 349,100,724.40 |
| 减：本报告期期间总赎回份额 | 875,717,047.56 |
| 本报告期期末基金份额总额 | 316,822,365.84 |

第十节 重大事项揭示

一、本报告期内本基金未召开持有人大会。

二、基金管理人、基金托管人的基金托管部门的重大人事变动情况：

1、经大成基金管理有限公司第三届董事会第一次会议审议通过，决定聘任周一烽先生为公司副总经理，周一烽的高级管理人员任职资格已获中国证券监督管理委员会审核批准（证监基金字『2006』75号）。本基金管理人已于2006年5月13日在证券时报刊登了《大成基金管理有限公司关于聘任公司副总经理的公告》。

2、2006年1月21日，本基金管理人发布《大成基金管理有限公司关于基金经理变更的公告》，聘任施永辉先生担任大成蓝筹稳健证券投资基金经理职务，原基金经理王加英先生不再担任大成蓝筹稳健证券投资基金经理职务。

三、在本报告期内没有涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

四、本基金投资策略在本报告期内没有重大改变。

五、本基金在本报告期收益分配事项。

本基金在本报告期实施了三次分红。向截至2006年3月28日止在大成基金管理有限公司登记在册的本基金全体持有人实施分红，每10个基金份额可取得分配收益人民币0.10元；向截至2006年6月1日止在大成基金管理有限公司登记在册的本基金全体持有人实施分红，每10个基金份额可取得分配收益人民币0.80元，向截至2006年8月17日止在大成基金管理有限公司登记在册的本基金全体持有人实施分红，每10个基金份额可取得分配收益人民币2.50元。

六、本基金改聘会计师事务所情况

本基金聘任的为本基金审计的会计师事务所为普华永道中天会计师事务所有限公司，本年度支付的审计费用为5万元整。该事务所自基金合同生效日起为本基金提供审计服务至今。

七、本报告期，本基金管理人、托管人及高级管理人员未受到监管部门稽查或处罚。

八、基金租用证券公司专用交易席位的有关情况：

本报告期内，本基金通过各机构交易席位的成交及佣金情况如下：

1、股票交易量及佣金情况：

| 券商名称 | 席位数量 (个) | 股票成交金额 (元) | 占本期该类交易成交总金额比例 | 席位佣金额(元) | 占本期佣金总额比例 |
|------|-------------|------------------|----------------|--------------|-----------|
| 招商证券 | 1 | 930,406,140.16 | 18.87% | 762,037.32 | 19.16% |
| 中银国际 | 1 | 945,957,474.85 | 19.18% | 740,221.43 | 18.61% |
| 银河证券 | 1 | 804,827,983.65 | 16.32% | 659,908.36 | 16.59% |
| 高华证券 | 1 | 670,422,200.71 | 13.59% | 549,743.83 | 13.82% |
| 长江证券 | 1 | 612,748,386.06 | 12.42% | 502,449.78 | 12.63% |
| 天一证券 | 1 | 501,040,513.19 | 10.16% | 392,071.31 | 9.86% |
| 联合证券 | 2 | 466,375,773.85 | 9.46% | 371,105.07 | 9.33% |
| 合计 | 8 | 4,931,778,472.47 | 100.00% | 3,977,537.10 | 100.00% |

2、债券及回购交易量情况:

| 券商名称 | 债券成交金额 (元) | 占本期该类交易成交总金额比例 | 债券回购成交金额 (元) | 占本期该类交易成交总金额比例 |
|------|---------------|----------------|--------------|----------------|
| 招商证券 | 88,028,973.10 | 89.99% | 0.00 | 0.00 |
| 银河证券 | 4,477,740.00 | 4.58% | 0.00 | 0.00 |
| 联合证券 | 4,478,851.90 | 4.58% | 0.00 | 0.00 |
| 中银国际 | 835,007.80 | 0.85% | 0.00 | 0.00 |
| 合计 | 97,820,572.80 | 100.00% | 0.00 | 0.00 |

3、权证交易量情况:

| 券商名称 | 权证成交金额 (元) | 占本期该类交易成交总金额比例 |
|------|---------------|----------------|
| 招商证券 | 6,716,461.16 | 46.66% |
| 中银国际 | 4,193,645.48 | 29.13% |
| 联合证券 | 2,726,651.91 | 18.94% |
| 银河证券 | 758,500.54 | 5.27% |
| 合计 | 14,395,259.09 | 100.00% |

4、本报告期内租用席位变更情况

| 本报告期内增加席位 | 本报告期内退租席位 |
|-----------|-----------|
| 高华证券 | 科技证券、联合证券 |

5、租用证券公司专用席位的选择标准和程序

根据中国证监会《关于加强证券投资基金监管有关问题的通知》(证监基金<1998>29号)的有关规定,本公司制定了租用证券公司专用席位的选择标准和程序。

租用证券公司专用席位的选择标准主要包括:券商基本面评价(财务状况、经营状况)、券商研究机构评价(报告质量、及时性和数量)、券商每日信息评价(及时性和有效性)和券商协作表现评价等四个方面。

租用证券公司专用席位的程序:首先根据租用证券公司专用席位的选择标准形成《券商服务评价表》,然后根据评分高低进行选择基金专用席位。

九、其他重大事项

除上述事项之外,已在临时报告中披露过报告期内发生的其他重要事项如下:

| 序号 | 事项名称 | 信息披露报纸 | 披露日期 |
|----|--|------------------|------------|
| 1 | 关于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及大成精选增值混合型证券投资基金 | 证券时报、中国证券报和上海证券报 | 2006年2月23日 |

| | | | |
|----|--|------------------|------------------|
| | 金暂停申购及转换的公告 | | |
| 2 | 关于大成基金管理有限公司开通沪深 300 指数基金网上交易及对“银联通”网上交易实行费率优惠的公告 | 证券时报、中国证券报和上海证券报 | 2006 年 3 月 9 日 |
| 3 | 大成蓝筹稳健证券投资基金第二次分红公告 | 证券时报、中国证券报和上海证券报 | 2006 年 3 月 24 日 |
| 4 | 关于旗下三只基金暂停大额申购及转入业务的公告 | 证券时报、中国证券报和上海证券报 | 2006 年 4 月 14 日 |
| 5 | 关于开通全国统一客户服务号码 400-888-5558 的公告 | 证券时报、中国证券报和上海证券报 | 2006 年 5 月 8 日 |
| 6 | 关于向中国农业银行金穗借记卡持卡人开通开放式基金网上交易业务的公告 | 证券时报、中国证券报和上海证券报 | 2006 年 5 月 10 日 |
| 7 | 关于恢复旗下三只基金大额申购及转入业务的公告，大成价值增长证券投资基金、大成蓝筹稳健证券投资基金和大成精选增值混合型证券投资基金 | 证券时报、中国证券报和上海证券报 | 2006 年 5 月 11 日 |
| 8 | 大成蓝筹稳健证券投资基金第三次分红公告 | 证券时报、中国证券报和上海证券报 | 2006 年 5 月 30 日 |
| 9 | 大成基金管理有限公司关于旗下部分基金投资资产支持证券的公告 | 证券时报、中国证券报和上海证券报 | 2006 年 7 月 6 日 |
| 10 | 大成蓝筹稳健证券投资基金第四次分红公告 | 证券时报、中国证券报和上海证券报 | 2006 年 8 月 15 日 |
| 11 | 大成基金关于旗下部分基金申购北辰实业 A 股的公告 | 证券时报、中国证券报和上海证券报 | 2006 年 10 月 9 日 |
| 12 | 关于旗下开放式基金在交通银行开展网上银行申购费率优惠的公告 | 证券时报、中国证券报和上海证券报 | 2006 年 11 月 2 日 |
| 13 | 关于大成蓝筹稳健证券投资基金暂停大额申购及转入业务的公告 | 证券时报、中国证券报和上海证券报 | 2006 年 12 月 26 日 |

第十一节 备查文件目录

一、备查文件目录：

- 1、中国证监会批准设立大成蓝筹稳健证券投资基金的文件；
- 2、《大成蓝筹稳健证券投资基金基金合同》；
- 3、《大成蓝筹稳健证券投资基金托管协议》；
- 4、大成基金管理有限公司批准文件、营业执照、公司章程；
- 5、本报告期内在指定报刊上披露的各种公告原稿。

二、存放地点：

本期报告存放在本基金管理人和托管人的办公住所。

三、查阅方式：

投资者可在营业时间免费查阅，或登录本基金管理人网站 <http://www.dcfund.com.cn> 进行查阅。

投资者对本报告书如有疑问，可咨询本基金管理人大成基金管理有限公司。

客户服务中心电话：400-888-5558（免长途通话费用）

国际互联网址：<http://www.dcfund.com.cn>

大成基金管理有限公司

董事长：胡学光

2007 年 3 月 30 日