

大成精选增值混合型证券投资基金

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：中国农业银行

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。

基金托管人中国农业银行根据本基金合同规定，于 2007 年 3 月 26 日复核了本报告中的财务指标、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，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	8
第六节 财务会计报告	9
第七节 投资组合报告	20
第八节 基金份额持有人情况	29
第九节 开放式基金份额变动	30
第十节 重大事件揭示	30
第十一节 备查文件目录	33

第一节 基金简介

一、基金基本资料

- | | |
|-----------------|--------------------|
| 1、基金名称: | 大成精选增值混合型证券投资基金 |
| 2、基金简称: | 大成精选增值 |
| 3、基金交易代码: | 090004 |
| 4、基金运作方式: | 契约型开放式 |
| 5、基金合同生效日: | 2004 年 12 月 15 日 |
| 6、报告期末基金份额总额: | 9,134,282,743.05 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: | 投资于具有竞争力比较优势和长期增值潜力的行业和企业,为投资者寻求持续稳定的投资收益。 |
| 2、投资策略: | 本基金利用大成基金自行开发的投资管理流程,采用“自上而下”资产配置和行业配置,“自下而上”精选股票的投资策略,主要投资于具有竞争力比较优势和长期增值潜力的行业和企业股票,通过积极主动的投资策略,追求基金资产长期的资本增值。 |
| 3、业绩比较基准: | 新华富时中国 A600 指数 $\times$ 75%+新华富时中国国债指数 $\times$ 25% |
| 4、风险收益特征: | 本基金属混合型证券投资基金,由于本基金采取积极的投资管理、主动的行业配置,使得本基金成为证券投资基金中风险程度中等偏高的基金产品,其长期平均的风险和预期收益低于成长型基金,高于价值型基金、指数型基金、纯债券基金和国债。 |

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: | 中国农业银行 |
| 2、注册地址: | 北京市海淀区复兴路甲 23 号 |
| 3、办公地址: | 北京市海淀区西三环北路 100 号金玉大厦 |
| 4、邮政编码: | 100036 |

5、国际互联网址：<http://www.abchina.com>
 6、法定代表人：杨明生
 7、信息披露负责人：李芳菲
 8、联系电话：010-68435588
 9、传真：010-68424181
 10、电子邮箱：lifangfei@abchina.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址：<http://www.dcfund.com.cn>

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
 北京市海淀区西三环北路 100 号金玉大厦
 中国农业银行托管业务部

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

序号	财务指标	2006 年	2005 年	2004 年
1	基金本期净收益(元)	151,128,422.78	11,418,062.39	-156,962.92
2	基金份额本期净收益(元)	0.3384	0.0159	-0.0001
3	期末可供分配基金收益(元)	2,091,437,056.21	-999,698.83	-160,351.98
4	期末可供分配基金份额收益(元)	0.2290	-0.0020	-0.0001
5	期末基金资产净值(元)	9,442,424,716.55	506,441,547.63	1,367,845,350.72
6	期末基金份额净值(元)	1.0337	0.9980	1.0008
7	基金加权平均净值收益率	28.64%	1.59%	-0.01%
8	本期基金份额净值增长率	150.55%	-0.28%	0.08%
9	基金份额累计净值增长率	150.05%	-0.20%	0.08%

注：基金管理人于 2006 年 12 月 21 日对本基金进行了基金份额拆分操作。当日大成精选增值基金拆分前基金份额净值为 1.9205 元，精确到小数点后第 9 位为 1.920501878 元（第 9 位以后舍去），本基金管理人按照 1:1.920501878 的拆分比例将大成精选增值基金的基金财产进行了拆分。拆分后，基金份额净值变为 1.00 元，相应地，原来每 1 份基金份额变为 1.920501878 份，基金份额计算结果保留到小数点后 2 位，小数点 2 位以后的部分舍去，舍去部分所代表的资产归基金财产所有。

二、基金净值表现

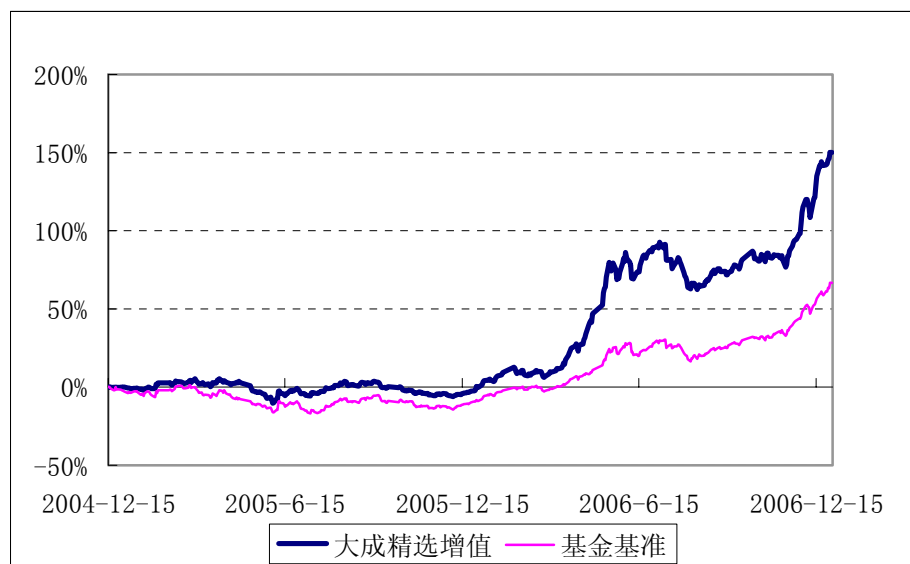
1、基金历史各时间段净值增长率与同期业绩比较基准收益率比较列表：

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	37.84%	1.53%	28.29%	1.05%	9.55%	0.48%
过去 6 个月	32.24%	1.45%	30.32%	1.05%	1.92%	0.40%
过去 1 年	150.55%	1.55%	83.15%	1.05%	67.40%	0.50%
自基金合同生效起 至今	150.05%	1.26%	66.80%	1.04%	83.25%	0.22%

2、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

大成精选增值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

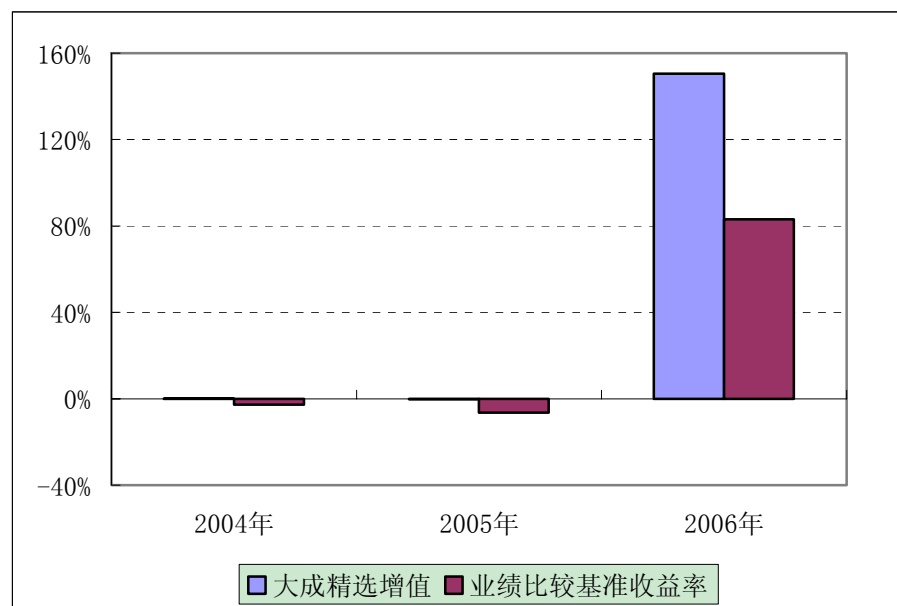
(2004 年 12 月 15 日至 2006 年 12 月 31 日)



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，截至报告日本基金的各项投资比例已达到基金合同第十四条（三）投资范围中规定的各项比例。

（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》，聘任曹雄飞先生担任大成精选增值混合型证券投资基金经理职务，原基金经理何光明先生不再担任大成精选增值混合型证券投资基金经理职务。

3、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：



注：本基金合同生效日为 2004 年 12 月 15 日，上述 2004 年期间为 2004 年 12 月 15 日至 2004 年 12 月 31 日止。

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	0.32 元	
2005 年	无	
2004 年	无	

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

何光明先生，基金经理，工业管理工程硕士，高级经济师，13 年证券从业经历。曾任职于湖南省国际信托投资公司基金管理部和证券管理总部，1999 年加入大成基金管理有限公司，历任研究员、基金经理助理、策略分析师。2004 年 12 月起任大成精选增值混合型证券投资基金基金经理。

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》，聘任曹雄飞先生担任大成精选增值混合型证券投资基金经理职务，原基金经理何光明先生不再担任大成精选增值混合型证券投资基金经理职务。

曹雄飞先生，基金经理，金融学硕士，8年证券从业经历。先后任职于招商证券北京地区总部研究部行业研究员、鹏华基金管理公司研究部宏观经济及投资策略分析师、景顺长城基金管理公司市场部高级经理。2004年3月以来历任大成基金管理有限公司研究部高级研究员、投资部总监助理、大成蓝筹稳健证券投资基金经理助理。2006年1月起担任大成精选增值混合型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》、《大成精选增值混合型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，大成精选增值基金的投资范围、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信信用、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 1.0337 元，本报告期份额净值增长率为 150.55%，同期业绩比较基准增长率为 83.15%，远好于同期业绩比较基准的表现。根据 Morningstar 的统计，在可比较的 80 只同类型基金中名列第 9 位，以优异的投资业绩被 Morningstar 评为四星级基金。

2、2006 年投资策略回顾

2006 年第一季度的 A 股市场呈现先扬后抑、大幅上涨的格局。总结一季度的 A 股市场，影响股市走势和结构变化的四个关键因素是“十一五规划”、建设社会主义新农村、人民币加速升值、股权分置改革。基于对 A 股市场的上述认识，本基金在第一季度重点配置于金融、地产、零售和有色金属板块，并根据市场热点的迅速切换，积极进行盘中操作，保持了较高的资产周转率。

进入二季度以来，本基金认为：货币政策紧缩、能源价格高企、商品价格大幅下跌、房地产新政等是影响二季度股市走势和结构变化的四个关键因素。上证综指由 3 月 31 日的 1298 点，4 月份一路爬升，进入 5 月份后更是快速拉升，最高上扬至 1695 点，涨幅达到 31%，日均成交高达 870 亿。在二季度的操作中，本基金的股票仓位以 92% 为轴心小幅变化并将核心资产集中配置于证券、有色金属、零售、食品饮料和军工板块，同时自下而上精选了少量周期性行业个股进行波段操作。

三季度 A 股市场牛市特征显著，指数快速下跌后稳步回升，板块轮动明显。股指于二季度达到近期新高，之后在宏观调控和信贷紧缩、IPO 和再融资密集推出、小非流通股解冻流通等因素推动下，自 7 月 13 日开始大幅振荡并快速下跌，单日跌幅高达 4.74%。其后，指数短暂盘整后继续振荡走低，最低跌至 1541 点。在招行 H 股愈行愈近、上市公司中报业绩普遍高于预期等众多利好因素的带动下，股市稳步上扬，截至 9 月 29 日，指数接近前期高位。三季度，本基金的股票仓位波动较大，以应对市场的系统性风险，但是，由于重仓持有的消费、有色金属、证券板块表现不佳，导致基金净值在前半期显著落后。9 月份以后，本基金提高了组合的进攻性，加之消费、机械、银行等类资产表现较好，基金净值大幅回升。

在资产配置方面，本基金主要配置于银行、机械装备、零售、食品饮料，减持了有色、军工板块。

四季度的股市经过第三季度的巩固调整，股市尽显牛市风采，指数大幅上扬，尽管期间有所振荡，结构、个股分化更明显，大盘蓝筹股，尤其是金融、地产、钢铁、机械等行业和板块表现优异，二线蓝筹年末的亮丽走势也同样精彩。四季度，本基金的股票维持在满仓，并且及时进行了热点板块的轮动操作，基金净值大幅增长。12 月的后半期，本基金实施了基金拆分，并进行持续营销。基金规模扩大至 90 亿以上，本基金在资金到位后迅速建仓大盘蓝筹股，以便于新老投资者充分分享牛市的成长。建仓的最后一周基金净值增长 4.5% 左右，取得了较好的投资业绩。2007 年新年的第一周之内，本基金利用市场大幅波动的机会，迅速完成建仓，基金规模也一度达到近 150 亿。本基金的净值在 12 月 29 日达到 1.03 元以上，到 1 月中旬时达到 1.27 元以上，业绩表现优异。应该说，拆分本身，导致了基金规模的急速扩大，但是，并未对本基金的投资管理运作产生显著的负面影响。

新春伊始，中国证券市场经历了本轮牛市以来最大的一次较大幅度调整。从我们目前得到的方方面面信息分析，并无实质性利空因素。即使是有实质性的利空，我们相信，本次调整并不能改变中国股市中长期的运行趋势，就像 06 年以来的几次阶段性大幅度调整一样。反而，本次市场大幅调整以及全球市场的普遍下跌，一方面增加了海外市场对中国市场的关注，并可能推动全球流动性向中国的输入；另一方面也使得全球投资者更多地关注中国经济和中国市场。

3、市场展望和投资策略

展望 2007 年，本基金经理认为，中国经济在下一阶段依然将保持稳定高速增长，优质上市公司的业绩将进一步改善。而人民币的持续升值将使得本国的资本市场更加受到国际资金的青睐，带来各类资产价格的持续上升。国际资金对中国市场的关注日益增加，资金流入高速增长；全球及中国经济流动性过剩。全球巨大的流动性和配置的结构调整，将对中国股票市场产生难以想象的资金支撑。而在顺差持续高速增长、人民币持续升值的预期的环境下，中国经济自身的流动性也将为市场提供充裕的资金。07 年以来，部分上市公司整体上市、资产注入等“外延式”扩张已经带来相关上市公司业绩的大幅提升，预计这一趋势在未来将更加强化。基于以上原因，我们认为中国 A 股市场处于牛市的初级阶段，07 年的中国股市将在调整中尽显牛市风采。

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的开发与投入,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

本基金托管人—中国农业银行根据《大成精选增值证券投资基金基金契约》和《大成精选增值证券投资基金托管协议》,在托管大成精选增值证券投资基金的过程中,严格遵守《证券投资基金法》及各项法规规定,对大成精选增值证券投资基金管理人—大成基金管理有限公司 2006 年 1 月 1 日至 2006 年 12 月 31 日基金的投资运作,进行了认真、独立的会计核算和必要的投资监督,认真履行了托管人的义务,没有从事任何损害基金份额持有人利益的行为。

本托管人认为,大成精选增值基金管理人在大成精选增值证券投资基金的投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支等问题上,不存在损害基金份额持有人利益的行为;在报告期内,严格遵守了《证券投资基金法》等有关法律

法规，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

信息披露符合《证券投资基金信息披露管理办法》及其相关法规的规定，基金管理人所编制和披露的大成精选增值证券投资基金年度报告中的财务指标、净值表现、财务会计报告、投资组合报告等信息真实、准确、完整，未发现有损害基金持有人利益的行为。

中国农业银行托管业务部

2007 年 3 月 26 日

第五节 审计报告

普华永道中天审字(2007)第 20264 号

大成精选增值混合型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精选增值混合型证券投资基金(以下简称“大成精选增值基金”)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》、《大成精选增值混合型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精选增值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》、《大成精选增值混合型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精选增值基金 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
会计师事务所有限公司
中国·上海市
2007 年 3 月 26 日

注册会计师	汪	棣
注册会计师	陈	宇

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		705,356,989.88	95,263,081.57
清算备付金		3,522,681,393.97	527,212.56
交易保证金	6 (1)	660,000.00	910,000.00
应收证券清算款		0.00	12,128,827.18
应收股利		0.00	0.00
应收利息	6 (2)	1,398,402.12	693,593.87
应收申购款		200,543,853.11	14,908.82
其他应收款		0.00	0.00
股票投资市值		5,493,862,948.60	357,956,011.76
其中: 股票投资成本		5,079,436,311.61	343,204,981.84
债券投资市值		0.00	41,363,896.40
其中: 债券投资成本		0.00	41,362,953.31
权证投资		388,578.13	0.00
其中: 权证投资成本		159,818.75	0.00
买入返售证券		0.00	0.00
待摊费用		0.00	0.00
其他资产		0.00	0.00
资产总计		9,924,892,165.81	508,857,532.16
负债			
应付证券清算款		468,046,602.85	0.00
应付赎回款		4,432,821.97	472,828.94
应付赎回费		14,028.60	1,782.03
应付管理人报酬		3,600,967.41	567,657.56
应付托管费		600,161.20	94,609.60
应付佣金	6 (5)	5,016,267.23	340,506.40
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)	506,600.00	756,600.00
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	182,000.00
其他负债		0.00	0.00
负债合计		482,467,449.26	2,415,984.53
持有人权益			
实收基金	6 (8)	4,756,198,196.88	507,441,246.46
未实现利得	6 (9)	2,594,789,463.46	-5,005,525.72
未分配收益		2,091,437,056.21	4,005,826.89
持有人权益合计		9,442,424,716.55	506,441,547.63
负债及持有人权益总计		9,924,892,165.81	508,857,532.16
基金份额净值		1.0337	0.9980

所附附注为本会计报表的组成部分

2、2006年度经营业绩表

	附注	2006年度	2005年度
一、收入		160,677,177.19	24,591,206.55
1、股票差价收入	6 (10)	152,814,124.43	11,253,853.35
2、债券差价收入	6 (11)	-85,892.23	-1,280,232.78
3、权证差价收入	6 (12)	1,773,343.62	860,765.46
4、债券利息收入		22,569.52	575,442.87
5、存款利息收入		1,663,651.88	2,982,665.54
6、股利收入		3,447,138.95	8,936,668.42
7、买入返售证券收入		0.00	0.00
8、其他收入	6 (13)	1,042,241.02	1,262,043.69
二、费用		9,548,754.41	13,173,144.16
1、基金管理人报酬		7,846,839.81	10,964,135.38
2、基金托管费		1,307,806.60	1,827,355.82
3、卖出回购证券支出		0.00	0.00
4、利息支出		0.00	0.00
5、其他费用	6 (14)	394,108.00	381,652.96
其中：上市年费		0.00	0.00
信息披露费		300,000.00	286,649.22
审计费用		50,000.00	77,549.74
三、基金净收益		151,128,422.78	11,418,062.39
加：未实现利得		399,903,423.36	13,456,792.70
四、基金经营业绩		551,031,846.14	24,874,855.09

所附附注为本会计报表的组成部分

3、2006 年度基金收益分配表

	附注	2006年度	2005年度
本期基金净收益		151,128,422.78	11,418,062.39
加：期初基金净收益		4,005,826.89	-160,351.98
加：本期申购损益平准金		2,108,304,161.30	1,059,074.74
减：本期赎回损益平准金		116,833,297.35	8,310,958.26
可供分配基金净收益		2,146,605,113.62	4,005,826.89
减：本期已分配基金净收益	6 (15)	55,168,057.41	0.00

期末基金净收益		2, 091, 437, 056. 21	4, 005, 826. 89
---------	--	----------------------	-----------------

所附附注为本会计报表的组成部分

4、2006 年度基金净值变动表

	附注	2006年度	2005年度
一、期初基金净值		506, 441, 547. 63	1, 367, 845, 350. 72
二、本期经营活动：			
基金净收益		151, 128, 422. 78	11, 418, 062. 39
未实现利得		399, 903, 423. 36	13, 456, 792. 70
经营活动产生的基金净值变动数		551, 031, 846. 14	24, 874, 855. 09
三、本期基金份额交易：			
基金申购款		9, 358, 817, 769. 43	118, 949, 293. 95
其中：分红再投资		8, 702, 564. 74	0. 00
基金赎回款		-918, 698, 389. 24	-1, 005, 227, 952. 13
基金份额交易产生的基金净值变动数		8, 440, 119, 380. 19	-886, 278, 658. 18
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）	-55, 168, 057. 41	0. 00
五、期末基金净值		9, 442, 424, 716. 55	506, 441, 547. 63

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

大成精选增值混合型证券投资基金(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163号《关于同意大成精选增值混合型证券投资基金募集的批复》核准，由大成基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《大成精选增值混合型证券投资基金基金合同》发起。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1, 335, 857, 022. 86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246号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《大成精选增值混合型证券投资基金基金合同》于2004年12月15日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为1, 336, 450, 798. 33份基金份额，其中认购资金利息折合593, 775. 47份基金份额。本基金的基金管理人为大成基金管理有限公司，基金托管人为中国农业银行。

根据《大成精选增值混合型证券投资基金招募说明书》和《大成精选增值混合型证券投资基金基金份额拆分公告》的有关规定，基金管理人大成基金管理有限公司确定2006年12月21日为本基金的基金份额拆分日。当日基金资产净值为548, 465, 382. 42元，拆分前基金份额总额为285, 584, 403. 04份，拆分前基金份额净值为1. 9205元。根据基金份额拆分公式，基金份额折算比例为1. 920501878，拆分后基金份额总额为548, 465, 382. 42份，折算后基金份额净值为1. 0000元。大成基金管理有限公司已根据上述拆分比例，对各基金份额持有人持有的基金份额进行了拆分，并于2006年12月22日进行了变更登记。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《大成精选增值混合型证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金的投资范围为国内依法公开发行、上市的股票、债券及法律、法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具。本基金投资组合中，股票投资比例为基金资产的40%-95%，债券投资比例为基金资产的0%-55%，现金及到期日在一年以内的政府国债的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》、《大成精选增值混合型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。

(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

本基金的记账本位币为人民币。

(4) 记帐基础和计价原则

本基金的记账基础为权责发生制。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。

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。

(iii) 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成交日或行权日止，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。

(iv) 实际投资成本与估值的差异计入“未实现利得/(损失)”科目。

(v) 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, 本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本会计报表附注2. (6) (iii) 中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) 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和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。

(8) 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1.50%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。

(9) 实收基金

实收基金包含对外发行的基金份额总额和实收基金份额拆分调整。实收基金份额拆分调整的初始金额为于基金份额拆分日根据基金份额拆分公式计算的拆分后的基金份额与拆分前的基金份额之间的差额。由于申购和赎回引起的实收基金份额和实收基金份额拆分调整变动分别于基金申购确认日和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。

(10) 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。

(11) 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)。

(12) 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。基金收益分配每年不超过六次,每次收益分配比例不低于当期已实现净收益的50%。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。年度分配在基金会计年度结束后四个月内完成。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。

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

基金管理人于2007年3月8日拟定2007年度第一次分红,向截至2007年3月7日止在本基金注册登记人大成基金管理有限公司登记在册的全体持有人,按每10份派发红利1.60元。

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
中国农业银行	基金托管人、基金代销机构
光大证券股份有限公司(“光大证券”)	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管理有限公司股权于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
光大证券	1,436,872,804.80	14.45%	584,348,794.68	20.63%
银河证券	2,447,561,014.57	24.62%	95,927,591.90	3.39%
合计	3,884,433,819.37	39.07%	680,276,386.58	24.02%

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
光大证券	0.00	0.00%	34,184,893.62	10.33%
银河证券	0.00	0.00%	30,630,939.20	9.26%
合计	0.00	0.00%	64,815,832.82	19.59%

C 债券回购

无。

D 权证买卖

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
光大证券	1,000,565.36	10.38%	346,800.00	40.29%
银河证券	354,000.00	3.67%	0.00	0.00%
合计	1,354,565.36	14.05%	346,800.00	40.29%

E 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
光大证券	1,124,364.07	13.97%	457,258.81	20.00%
银河证券	2,006,992.59	24.94%	78,537.05	3.44%
合计	3,131,356.66	38.91%	535,795.86	23.44%

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管理有限公司的基金管理人报酬按前一日基金资产净值 1.50% 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 × 1.50% / 当年天数。

本基金在本年度需支付基金管理人报酬 7,846,839.81 元 (2005 年：10,964,135.38 元)。

B 基金托管人报酬

支付基金托管人中国农业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 1,307,806.60 元 (2005 年：1,827,355.82 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农业银行保管，并按银行间同业利率计息。基金托管人于 2006 年 12 月 31 日保管的银行存款余额为 705,356,989.88 元 (2005 年：95,263,081.57 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 1,306,045.75 元 (2005 年：2,935,348.33 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	500,000.00	750,000.00
权证交易保证金	160,000.00	160,000.00
合计	660,000.00	910,000.00

(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	1,075,823.52	29,467.69
应收结算备付金利息	322,506.60	237.20
应收交易保证金利息	72.00	72.00
应收债券利息	0.00	663,816.98
合计	1,398,402.12	693,593.87

(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
中国银河证券有限责任公司	1,549,309.33	45,126.93
中银国际证券有限责任公司	1,073,644.54	160,919.20
申银万国证券股份有限公司	615,328.03	27,670.29
光大证券股份有限公司	601,723.95	64,104.29
联合证券有限责任公司	590,706.70	—
国泰君安证券股份有限公司	585,554.68	32,576.00
民生证券有限责任公司	—	10,109.69
合计	5,016,267.23	340,506.40

(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	750,000.00
应付债券利息收入的个人所得税	6,600.00	6,600.00
合计	506,600.00	756,600.00

(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	82,000.00
合计	250,000.00	182,000.00

(8) 实收基金

	份额（份）	金额
2005年12月31日	507,441,246.46	507,441,246.46
申购	489,512,906.72	489,512,906.72
其中：红利再投资	6,628,787.08	6,628,787.08

赎回	-711,369,750.14	-711,369,750.14
2006 年 12 月 21 日拆分前	285,584,403.04	285,584,403.04
基金份额拆分调整份额	262,880,979.38	0.00
申购	8,614,705,185.58	4,485,655,503.66
其中：红利再投资	0.00	0.00
赎回	-28,887,824.95	-15,041,709.82
2006 年 12 月 31 日	9,134,282,743.05	4,756,198,196.88

(9) 未实现利得

	未实现估值增值(a)	未实现利得/(损失) 平准金	合计
2005 年 12 月 31 日	14,751,973.01	-19,757,498.73	-5,005,525.72
本年净变动数	399,903,423.36	0.00	399,903,423.36
本年申购基金份额	0.00	2,275,345,197.75	2,275,345,197.75
其中：红利再投资	0.00	1,170,924.60	1,170,924.60
本年赎回基金份额	0.00	-75,453,631.93	-75,453,631.93
2006 年 12 月 31 日	414,655,396.37	2,180,134,067.09	2,594,789,463.46

未实现估值增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	414,426,636.99	14,751,029.92
债券投资—交易所市场	0.00	943.09
权证投资	228,759.38	0.00
合计	414,655,396.37	14,751,973.01

(10) 股票差价收入

项目	2006 年度	2005 年度
卖出股票成交总额	2,729,188,615.83	1,440,971,329.39
减：卖出股票成本总额	2,574,084,286.60	1,428,509,149.57
减：应付佣金	2,290,204.80	1,208,326.47
股票差价收入	152,814,124.43	11,253,853.35

本基金于本年度获得股权分置改革中由流通股股东支付的现金对价共计 1,552,395.67 元(2005 年：4,705,335.80 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
卖出及到期兑付债券结算金额	43,454,898.83	225,312,850.25
减：卖出及到期兑付债券成本总额	42,854,404.56	224,082,270.43
减：应收利息总额	686,386.50	2,510,812.60
债券差价收入	-85,892.23	-1,280,232.78

(12) 权证差价收入

项目	2006 年度	2005 年度
卖出权证成交总额	5,786,844.21	860,765.46
减：卖出权证成本总额	4,013,500.59	0.00
权证差价收入	1,773,343.62	860,765.46

(13) 其他收入

项目	2006 年度	2005 年度
----	---------	---------

赎回基金补偿收入(*)	933,551.48	1,252,152.33
转换基金补偿收入(**)	108,689.54	1,353.09
新股手续费返还	0.00	8,538.27
合计	1,042,241.02	1,262,043.69

* 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	286,649.22
审计费用	50,000.00	77,549.74
债券托管账户维护费	23,650.00	7,500.00
其他	20,458.00	9,954.00
合计	394,108.00	381,652.96

(15) 本报告期已分配基金净收益

	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
第一次中期分红	2006/2/9	每 10 份基金份额 0.60 元	10,150,005.36	897,157.86	11,047,163.22
第二次中期分红	2006/3/27	每 10 份基金份额 0.30 元	4,445,461.32	475,253.75	4,920,715.07
第三次中期分红	2006/5/22	每 10 份基金份额 2.30 元	31,870,025.99	7,330,153.13	39,200,179.12
合计			46,465,492.67	8,702,564.74	55,168,057.41

附注 7. 报告期末流通受限制不能自由转让的基金资产

(1) 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
方案实施阶段停牌：								
000895	S 双 汇	2006/6/1	31.17	未知	未知	480,000	8,111,675.91	14,961,600.00
600258	S 首 旅	2006/12/21	19.34	2007/1/18	18.80	185,000	2,811,424.60	3,577,900.00
合 计							10,923,100.51	18,539,500.00

(2) 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申购协议的规定，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：首次公开发行但未上市的股票，按成本估值)

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
601628	中国人寿	2006/12/28	2007/4/9	18.88	18.88	4,653,550	87,859,024.00	87,859,024.00

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	4,228,038,383.85	42.60%
股票	5,493,862,948.60	55.36%
债券	0.00	0.00%
权证	388,578.13	0.00%
其他资产	202,602,255.23	2.04%
合计	9,924,892,165.81	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	181,336,381.71	1.92%
B 采掘业	531,488,986.92	5.63%
C 制造业	1,944,744,072.58	20.60%
C0 食品、饮料	186,074,073.96	1.97%
C1 纺织、服装、皮毛	19,884,298.28	0.21%
C2 木材、家具	0.00	0.00%
C3 造纸、印刷	40,879,082.37	0.43%
C4 石油、化学、塑胶、塑料	117,797,401.02	1.25%
C5 电子	0.00	0.00%
C6 金属、非金属	905,749,776.47	9.59%
C7 机械、设备、仪表	502,939,788.38	5.33%
C8 医药、生物制品	171,419,652.10	1.82%
C99 其他制造业	0.00	0.00%
D 电力、煤气及水的生产和供应业	308,510,935.18	3.27%
E 建筑业	206,940,043.63	2.19%
F 交通运输、仓储业	211,473,710.51	2.24%
G 信息技术业	337,101,379.30	3.57%
H 批发和零售贸易	151,108,921.20	1.60%
I 金融、保险业	1,334,553,219.69	14.13%
J 房地产业	197,915,726.59	2.09%
K 社会服务业	48,796,532.86	0.52%
L 传播与文化产业	20,227,954.71	0.21%
M 综合类	19,665,083.72	0.21%
合计	5,493,862,948.60	58.18%

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	600028	中国石化	52,274,516	476,743,585.92	5.05%
2	600019	宝钢股份	42,045,868	364,117,216.88	3.86%
3	600900	长江电力	28,334,894	276,831,914.38	2.93%
4	601398	工商银行	42,099,990	261,019,938.00	2.76%
5	600036	招商银行	15,782,932	258,208,767.52	2.73%
6	600030	中信证券	9,021,698	247,014,091.24	2.62%
7	600005	武钢股份	37,102,039	235,968,968.04	2.50%
8	000680	山推股份	27,332,861	223,582,802.98	2.37%
9	600016	民生银行	18,999,910	193,799,082.00	2.05%
10	600000	浦发银行	8,063,361	171,830,222.91	1.82%
11	000898	鞍钢股份	14,999,891	152,998,888.20	1.62%
12	000063	中兴通讯	3,518,301	137,565,569.10	1.46%
13	600276	恒瑞医药	4,142,589	133,639,921.14	1.42%
14	000002	万 科 A	8,499,939	131,239,058.16	1.39%
15	600491	龙元建设	18,687,026	130,996,052.26	1.39%
16	600050	中国联通	24,649,956	115,115,294.52	1.22%
17	600808	马钢股份	24,483,114	110,174,013.00	1.17%
18	000829	赣南果业	5,153,306	108,219,426.00	1.15%
19	601988	中国银行	17,170,000	93,233,100.00	0.99%
20	601628	中国人寿	4,653,550	87,859,024.00	0.93%
21	600879	火箭股份	4,944,760	76,099,856.40	0.81%
22	600718	东软股份	2,941,902	69,399,468.18	0.73%
23	000792	盐湖钾肥	2,843,400	66,990,504.00	0.71%
24	000768	西飞国际	5,549,911	64,933,958.70	0.69%
25	600009	上海机场	2,999,990	56,729,810.90	0.60%
26	000061	农 产 品	4,216,076	53,754,969.00	0.57%
27	600583	海油工程	1,527,540	52,959,811.80	0.56%
28	600528	中铁二局	7,419,765	51,270,576.15	0.54%
29	600887	伊利股份	1,832,597	48,563,820.50	0.51%
30	600026	中海发展	4,677,472	48,411,835.20	0.51%
31	600600	青岛啤酒	3,299,800	45,834,222.00	0.49%
32	601111	中国国航	7,999,999	41,199,994.85	0.44%
33	600308	华泰股份	2,999,199	40,879,082.37	0.43%
34	002069	獐 子 岛	549,996	40,721,703.84	0.43%
35	600694	大商股份	1,336,108	39,268,214.12	0.42%
36	001696	宗申动力	3,893,984	37,966,344.00	0.40%
37	600809	山西汾酒	1,211,598	37,547,422.02	0.40%
38	600596	新安股份	2,059,839	37,447,873.02	0.40%
39	000089	深圳机场	5,499,916	35,199,462.40	0.37%
40	000402	金 融 街	1,929,911	32,519,000.35	0.34%
41	600886	国投电力	4,399,864	31,679,020.80	0.34%

42	000410	沈阳机床	1,429,916	28,669,815.80	0.30%
43	000031	中粮地产	2,999,964	27,659,668.08	0.29%
44	600266	北京城建	2,151,126	24,673,415.22	0.26%
45	600511	国药股份	1,309,547	22,799,213.27	0.24%
46	600386	北京巴士	2,399,841	21,022,607.16	0.22%
47	600831	广电网络	1,149,969	20,227,954.71	0.21%
48	600138	中青旅	1,489,940	19,086,131.40	0.20%
49	600585	海螺水泥	600,000	18,000,000.00	0.19%
50	600521	华海药业	1,293,325	17,511,620.50	0.19%
51	600104	上海汽车	1,999,940	16,339,509.80	0.17%
52	000869	张裕A	304,392	15,164,809.44	0.16%
53	000895	S双汇	480,000	14,961,600.00	0.16%
54	600015	华夏银行	1,999,918	14,779,394.02	0.16%
55	600739	辽宁成大	799,952	14,263,144.16	0.15%
56	600189	吉林森工	1,608,917	13,691,883.67	0.15%
57	600299	星新材料	730,800	13,359,024.00	0.14%
58	000401	冀东水泥	2,663,465	13,290,690.35	0.14%
59	600754	锦江股份	1,158,368	13,286,480.96	0.14%
60	000568	泸州老窖	500,000	12,670,000.00	0.13%
61	002029	七匹狼	606,805	12,014,739.00	0.13%
62	600118	中国卫星	599,905	11,938,109.50	0.13%
63	600150	沪东重机	374,438	11,907,128.40	0.13%
64	600858	银座股份	558,027	11,361,429.72	0.12%
65	000709	唐钢股份	2,000,000	11,200,000.00	0.12%
66	000538	云南白药	430,000	10,702,700.00	0.11%
67	600631	百联股份	1,076,215	10,234,804.65	0.11%
68	000625	长安汽车	1,100,000	9,812,000.00	0.10%
69	600467	好当家	1,162,340	9,484,694.40	0.10%
70	000972	新中基	539,735	9,218,673.80	0.10%
71	600717	天津港	1,000,000	8,910,000.00	0.09%
72	000157	中联重科	400,000	8,892,000.00	0.09%
73	000428	华天酒店	670,000	8,542,500.00	0.09%
74	600895	张江高科	1,199,950	8,303,654.00	0.09%
75	600519	贵州茅台	90,000	7,904,700.00	0.08%
76	000726	鲁泰A	999,944	7,869,559.28	0.08%
77	600835	上海机电	800,000	7,568,000.00	0.08%
78	600495	晋西车轴	340,000	7,082,200.00	0.08%
79	000562	宏源证券	560,000	6,809,600.00	0.07%
80	600048	保利地产	150,000	6,498,000.00	0.07%
81	002073	青岛软控	129,520	6,132,772.00	0.06%
82	000987	广州友谊	350,000	5,967,500.00	0.06%

83	600693	东百集团	361,400	4,821,076.00	0.05%
84	600161	天坛生物	221,349	4,581,924.30	0.05%
85	000528	柳 工	231,193	3,953,400.30	0.04%
86	600258	首旅股份	185,000	3,577,900.00	0.04%
87	000858	五 粮 液	150,000	3,427,500.00	0.04%
88	000978	桂林旅游	300,000	3,345,000.00	0.04%
89	002093	国脉科技	153,380	3,082,938.00	0.03%
90	002022	科华生物	149,942	2,620,986.16	0.03%
91	002004	华邦制药	250,000	2,362,500.00	0.03%
92	601699	潞安环能	111,460	1,785,589.20	0.02%
93	000888	峨眉山 A	99,950	958,520.50	0.01%
合计				5,493,862,948.60	58.18%

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	600028	中国石化	506,099,315.89	99.93%
2	600019	宝钢股份	365,393,719.92	72.15%
3	600036	招商银行	315,132,519.83	62.22%
4	600030	中信证券	286,096,976.86	56.49%
5	600900	长江电力	283,272,719.61	55.93%
6	601398	工商银行	251,897,703.63	49.74%
7	600005	武钢股份	239,547,195.94	47.30%
8	000680	山推股份	230,332,311.29	45.48%
9	600016	民生银行	204,764,053.09	40.43%
10	600000	浦发银行	175,217,461.66	34.60%
11	000898	鞍钢股份	154,097,455.76	30.43%
12	000002	万 科 A	148,437,171.02	29.31%
13	000063	中兴通讯	142,845,489.67	28.21%
14	600491	龙元建设	136,726,374.92	27.00%
15	600276	恒瑞医药	117,370,997.21	23.18%
16	600050	中国联通	115,139,874.16	22.74%
17	000829	赣南果业	111,503,281.92	22.02%
18	600808	马钢股份	108,471,961.04	21.42%
19	600879	火箭股份	91,640,545.93	18.09%
20	601628	中国人寿	87,859,024.00	17.35%
21	000792	盐湖钾肥	84,315,459.50	16.65%
22	601988	中国银行	84,205,658.12	16.63%
23	600718	东软股份	74,268,861.31	14.66%
24	000768	西飞国际	71,400,135.23	14.10%
25	600694	大商股份	70,662,967.29	13.95%
26	600009	上海机场	70,478,456.84	13.92%

27	600583	海油工程	69,350,728.08	13.69%
28	600887	伊利股份	64,462,218.60	12.73%
29	600026	中海发展	62,279,163.10	12.30%
30	000061	农产品	59,479,239.07	11.74%
31	600528	中铁二局	51,092,622.65	10.09%
32	600600	青岛啤酒	46,185,236.35	9.12%
33	002069	獐子岛	43,558,055.01	8.60%
34	000402	金融街	42,443,973.28	8.38%
35	600596	新安股份	39,958,105.04	7.89%
36	600886	国投电力	39,574,514.81	7.81%
37	600308	华泰股份	38,642,045.80	7.63%
38	001696	宗申动力	37,692,417.48	7.44%
39	000031	中粮地产	37,325,975.53	7.37%
40	601111	中国国航	37,050,367.69	7.32%
41	000089	深圳机场	35,931,575.23	7.09%
42	600631	百联股份	34,928,422.96	6.90%
43	600831	广电网络	34,411,127.95	6.79%
44	000858	五粮液	33,864,476.05	6.69%
45	600266	北京城建	31,831,541.57	6.29%
46	600585	海螺水泥	31,712,974.95	6.26%
47	000410	沈阳机床	31,275,899.56	6.18%
48	600386	北京巴士	28,928,008.91	5.71%
49	600739	辽宁成大	28,924,247.14	5.71%
50	600895	张江高科	28,499,525.52	5.63%
51	600809	山西汾酒	28,172,480.16	5.56%
52	000423	S 阿胶	27,883,021.03	5.51%
53	000568	泸州老窖	25,863,635.10	5.11%
54	601006	大秦铁路	25,443,090.50	5.02%
55	600511	国药股份	25,383,961.51	5.01%
56	000039	中集集团	24,586,550.75	4.85%
57	000060	中金岭南	24,000,670.67	4.74%
58	600547	山东黄金	23,361,067.86	4.61%
59	000069	华侨城 A	22,836,305.72	4.51%
60	600015	华夏银行	22,696,627.72	4.48%
61	600150	沪东重机	22,495,358.54	4.44%
62	000562	宏源证券	22,250,560.34	4.39%
63	000758	中色股份	21,264,763.15	4.20%
64	000401	冀东水泥	21,140,204.45	4.17%
65	600299	星新材料	21,114,477.38	4.17%
66	000869	张裕 A	21,071,586.73	4.16%
67	600521	华海药业	21,066,032.17	4.16%

68	600717	天津港	20,265,708.80	4.00%
69	600688	S 上石化	19,730,964.87	3.90%
70	600104	上海汽车	19,460,857.77	3.84%
71	000157	中联重科	19,290,758.99	3.81%
72	600089	特变电工	18,575,226.40	3.67%
73	600643	S 爱建	18,467,714.94	3.65%
74	000538	云南白药	18,225,915.76	3.60%
75	600037	歌华有线	17,319,814.45	3.42%
76	600205	S 山东铝	16,800,375.90	3.32%
77	601699	潞安环能	15,957,654.95	3.15%
78	002008	大族激光	15,832,744.29	3.13%
79	600832	东方明珠	15,740,195.63	3.11%
80	600138	中青旅	15,698,219.43	3.10%
81	000709	唐钢股份	15,618,876.75	3.08%
82	600500	中化国际	15,177,293.64	3.00%
83	600307	酒钢宏兴	14,723,222.04	2.91%
84	000028	一致药业	14,260,300.94	2.82%
85	600693	东百集团	14,057,007.09	2.78%
86	600269	赣粤高速	13,831,249.04	2.73%
87	600316	洪都航空	13,685,932.25	2.70%
88	600189	吉林森工	13,638,070.07	2.69%
89	002024	苏宁电器	13,462,255.41	2.66%
90	600475	华光股份	13,450,132.89	2.66%
91	600258	S 首旅	13,275,116.61	2.62%
92	600320	振华港机	13,182,919.74	2.60%
93	600456	宝钛股份	12,828,840.29	2.53%
94	600797	浙大网新	12,630,586.28	2.49%
95	600467	好当家	12,485,958.51	2.47%
96	600550	天威保变	12,483,278.50	2.46%
97	000428	华天酒店	12,478,450.70	2.46%
98	600754	锦江股份	12,394,734.49	2.45%
99	600151	航天机电	12,296,656.01	2.43%
100	000839	中信国安	12,068,617.83	2.38%
101	600118	中国卫星	11,948,450.80	2.36%
102	600296	S 兰铝	11,924,256.82	2.35%
103	600497	驰宏锌锗	11,766,835.37	2.32%
104	000625	长安汽车	11,667,165.37	2.30%
105	600271	航天信息	11,352,899.54	2.24%
106	600651	飞乐音响	10,987,174.40	2.17%
107	600858	银座股份	10,925,923.31	2.16%
108	600489	中金黄金	10,706,528.63	2.11%

109	000807	云铝股份	10,620,270.64	2.10%
110	000623	吉林敖东	10,594,686.47	2.09%
111	000528	柳 工	10,560,622.76	2.09%
112	600825	新华传媒	10,540,664.10	2.08%
113	000024	招商地产	10,468,966.40	2.07%
114	600327	大厦股份	10,468,660.35	2.07%
115	600787	中储股份	10,298,358.75	2.03%
116	600616	第一食品	10,267,832.04	2.03%
117	000800	一汽轿车	10,259,211.48	2.03%
118	000960	锡业股份	10,220,192.81	2.02%
119	000987	广州友谊	10,152,400.17	2.00%

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	本期累计卖出金额（元）	占期初基金资产净值比例
1	600036	招商银行	88,168,537.49	17.41%
2	600030	中信证券	75,783,359.90	14.96%
3	600028	中国石化	62,407,230.64	12.32%
4	600019	宝钢股份	48,073,401.41	9.49%
5	600000	浦发银行	41,294,218.16	8.15%
6	600900	长江电力	40,421,537.98	7.98%
7	000858	五 粮 液	39,965,392.10	7.89%
8	600009	上海机场	38,622,157.45	7.63%
9	000002	万 科A	36,597,761.20	7.23%
10	601398	工商银行	35,542,574.35	7.02%
11	600694	大商股份	34,885,181.71	6.89%
12	600005	武钢股份	33,819,181.06	6.68%
13	000423	S 阿 胶	31,253,263.51	6.17%
14	600583	海油工程	31,095,234.79	6.14%
15	000039	中集集团	30,535,620.63	6.03%
16	000063	中兴通讯	30,056,712.06	5.93%
17	600631	百联股份	29,036,129.92	5.73%
18	600887	伊利股份	27,814,251.33	5.49%
19	600497	驰宏锌锗	27,760,316.51	5.48%
20	600717	天津港	26,951,334.20	5.32%
21	000060	中金岭南	26,208,833.04	5.18%
22	600016	民生银行	25,915,922.85	5.12%
23	000069	华侨城A	25,157,251.56	4.97%
24	601006	大秦铁路	25,103,169.26	4.96%
25	000792	盐湖钾肥	24,659,924.46	4.87%
26	600348	国阳新能	24,431,646.91	4.82%
27	600547	山东黄金	24,205,588.34	4.78%
28	000839	中信国安	23,305,045.81	4.60%

29	600050	中国联通	22,000,632.15	4.34%
30	000538	云南白药	21,544,825.76	4.25%
31	000402	金 融 街	21,300,946.46	4.21%
32	600831	广电网络	20,921,332.57	4.13%
33	600320	振华港机	20,183,003.19	3.99%
34	600688	S 上石化	20,164,888.28	3.98%
35	600895	张江高科	20,060,852.04	3.96%
36	600089	特变电工	19,551,250.73	3.86%
37	002024	苏宁电器	19,476,733.22	3.85%
38	000758	中色股份	19,372,964.83	3.83%
39	000898	鞍钢股份	18,977,340.71	3.75%
40	600269	赣粤高速	18,650,380.57	3.68%
41	600037	歌华有线	18,585,027.75	3.67%
42	600205	S 山东铝	18,249,625.43	3.60%
43	600643	S 爱建	18,018,186.80	3.56%
44	000680	山推股份	17,867,956.46	3.53%
45	000568	泸州老窖	17,648,318.41	3.48%
46	600316	洪都航空	17,505,354.52	3.46%
47	600832	东方明珠	17,502,398.04	3.46%
48	000157	中联重科	17,500,343.24	3.46%
49	000869	张 裕 A	17,177,402.88	3.39%
50	002008	大族激光	16,827,143.46	3.32%
51	600026	中海发展	16,198,532.32	3.20%
52	600150	沪东重机	16,127,897.44	3.18%
53	600015	华夏银行	16,057,869.92	3.17%
54	600739	辽宁成大	15,922,111.06	3.14%
55	600500	中化国际	15,605,699.93	3.08%
56	600296	S 兰铝	15,324,175.82	3.03%
57	600489	中金黄金	15,203,445.84	3.00%
58	000562	宏源证券	14,945,967.77	2.95%
59	600585	海螺水泥	14,809,487.77	2.92%
60	600307	酒钢宏兴	14,746,942.26	2.91%
61	600029	S 南航	14,578,325.63	2.88%
62	000028	一致药业	14,567,239.48	2.88%
63	600456	宝钛股份	14,176,229.00	2.80%
64	601699	潞安环能	13,780,587.48	2.72%
65	600797	浙大网新	13,748,441.96	2.71%
66	600519	贵州茅台	13,726,855.15	2.71%
67	600675	中华企业	13,589,257.56	2.68%
68	600718	东软股份	13,570,772.09	2.68%
69	600879	火箭股份	13,241,752.43	2.61%

70	600475	华光股份	13,055,514.67	2.58%
71	000031	中粮地产	12,278,378.17	2.42%
72	000001	S 深发展 A	12,156,104.00	2.40%
73	600795	国电电力	11,744,498.72	2.32%
74	000911	南宁糖业	11,734,175.24	2.32%
75	600693	东百集团	11,596,774.71	2.29%
76	600809	山西汾酒	11,523,743.53	2.28%
77	600271	航天信息	11,420,118.98	2.25%
78	600258	S 首旅	11,371,290.87	2.25%
79	600651	飞乐音响	11,368,485.42	2.24%
80	600151	航天机电	11,214,492.07	2.21%
81	600787	中储股份	10,977,679.31	2.17%
82	600616	第一食品	10,698,847.18	2.11%
83	600888	新疆众和	10,685,979.26	2.11%
84	600006	东风汽车	10,652,539.54	2.10%
85	000960	锡业股份	10,632,977.20	2.10%
86	600327	大厦股份	10,610,149.91	2.10%
87	000410	沈阳机床	10,528,724.06	2.08%
88	000807	云铝股份	10,446,227.87	2.06%
89	000800	一汽轿车	10,398,469.01	2.05%
90	600550	天威保变	10,332,644.05	2.04%
91	000617	S 济 柴	10,312,615.84	2.04%
92	000024	招商地产	10,295,787.18	2.03%
93	000623	吉林敖东	10,235,572.08	2.02%

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	7,311,868,012.04
卖出股票的收入总额	2,729,188,615.83

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、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、权证投资情况

(1) 报告期末持有所有权证明细

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	203,125	388,578.13	0.00%

(2) 报告期内获得权证明细

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	030001	鞍钢 JTC1		500,000	1,078,015.76	500,000	1,218,724.13	主动投资
2	580001	武钢 JTB1		400,000	371,828.81	400,000	353,972.57	
3	030002	五粮 YGC1		300,000	2,402,426.02	300,000	2,150,294.35	
4	580997	招行 CMP1	1,080,000	0	0.00	1,080,000	565,256.21	股权分置 改革对价 支付
5	038008	钾肥 JTP1	102,000	0	0.00	102,000	331,745.82	
6	031001	侨城 HQC1	76,000	0	0.00	76,000	906,281.32	
7	580010	马钢 CWB1		230,000	161,230.00	230,000	260,569.81	老股东配售
8	031002	钢钒 GFC1		203,125	159,818.75	0	0.00	分离交易可 转债时获配 的权证
合计					4,173,319.34		5,786,844.21	

4、其他资产的构成:

项目	金额(元)
交易保证金	660,000.00
应收利息	1,398,402.12
应收申购款	200,543,853.11
合计	202,602,255.23

5、本报告期末本基金持有处于转股期的可转换债券明细。

无。

6、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。

7、本报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金情况

无。

8、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	294,473 户
报告期末平均每户持有的基金份额	31,019.08 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	9,134,282,743.05	100.00%
其中：机构投资者持有的基金份额	251,330,196.96	2.75%
个人投资者持有的基金份额	8,882,952,546.09	97.25%

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	1,336,450,798.33
本报告期期初基金份额总额	507,441,246.46
加：本报告期期间总申购份额	9,367,099,071.68
其中：基金份额拆分调整份额	262,880,979.38
申购份额总额(含红利再投资)	9,104,218,092.30
减：本报告期期间总赎回份额	740,257,575.09
本报告期期末基金份额总额	9,134,282,743.05

注：大成基金管理有限公司于 2006 年 12 月 21 日对本基金进行了基金份额拆分操作。当日大成精选增值基金拆分前基金份额净值为 1.9205 元，精确到小数点后第 9 位为 1.920501878 元（第 9 位以后舍去），本基金管理人按照 1:1.920501878 的拆分比例将大成精选增值基金的基金财产进行了拆分。拆分后，基金份额净值变为 1.00 元，相应地，原来每 1 份基金份额变为 1.920501878 份，基金份额计算结果保留到小数点后 2 位，小数点 2 位以后的部分舍去，舍去部分所代表的资产归基金财产所有。

第十节 重大事件揭示

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》，聘任曹雄飞先生担任大成精选增值混合型证券投资基金经理职务，原基金经理何光明先生不再担任大成精选增值混合型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 2 月 9 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 份基金份额可取得分配收益人民币 0.60 元；向截至 2006 年 3 月 27 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 份基金份额可取得分配收益人民币 0.30 元；向截至 2006 年 5 月 22 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 份基金份额可取得分配收益人民币 2.30 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
银河证券	1	2,447,561,014.57	24.62%	2,006,992.59	24.94%
中银国际	1	2,160,711,497.02	21.73%	1,771,768.84	22.02%
光大证券	1	1,436,872,804.80	14.45%	1,124,364.07	13.97%
申银万国	1	1,377,772,677.84	13.86%	1,078,120.52	13.40%
联合证券	1	1,296,496,067.90	13.04%	1,063,120.01	13.21%
国泰君安	1	1,222,267,474.28	12.29%	1,002,250.55	12.46%
民生证券	1	0.00	0.00%	0.00	0.00%
合计	7	9,941,681,536.41	100.00%	8,046,616.58	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
中银国际	1,657,075.40	70.95%	0.00	0.00%
申银万国	678,531.48	29.05%	0.00	0.00%
合计	2,335,606.88	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
申银万国	7,087,034.77	73.52%
光大证券	1,000,565.36	10.38%
联合证券	565,300.00	5.86%
国泰君安	371,800.00	3.86%
银河证券	354,000.00	3.67%
中银国际	260,590.00	2.70%
合计	9,639,290.13	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
无	民生证券234306

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》(证监基字<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	大成精选增值混合型证券投资基金分红公告	证券时报、中国证券报和上海证券报	2006 年 2 月 7 日
2	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暂停申购及转换的公告	证券时报、中国证券报和上海证券报	2006 年 2 月 23 日
3	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
4	大成精选增值混合型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 23 日
5	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
6	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
7	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
8	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
9	大成精选增值混合型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 18 日
10	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
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	大成精选增值混合型证券投资基金预约申购公告	证券时报、中国证券报和上海证券报	2006 年 12 月 5 日
14	关于大成精选增值混合型证券投资基	证券时报、中国证券	2006 年 12 月 5 日

	金持续营销费率优惠的公告	报和上海证券报	
15	大成精选增值混合型证券投资基金基金份额拆分公告	证券时报、中国证券报和上海证券报	2006 年 12 月 5 日
16	关于大成精选增值证券投资基金基金份额拆分比例的公告	证券时报、中国证券报和上海证券报	2006 年 12 月 22 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精选增值混合证券投资基金的文件；
- 2、《大成精选增值混合证券投资基金基金合同》；
- 3、《大成精选增值混合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