

大成沪深 300 指数证券投资基金

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。

本报告期为 2006 年 4 月 6 日起至 2006 年 12 月 31 日止。本报告财务资料已经审计。安永华明会计师事务所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	2
第三节 管理人报告	3
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	30
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: | 大成沪深 300 指数证券投资基金 |
| 2、基金简称: | 大成 300A |
| 3、基金交易代码: | 519300 |
| 4、基金运作方式: | 契约型开放式 |
| 5、基金合同生效日: | 2006 年 4 月 6 日 |
| 6、报告期末基金份额总额: | 313,896,083.57 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: | 通过严格的投资程序约束和数量化风险管理手段,实现指数投资偏离度和跟踪误差的最小化。在正常市场情况下,本基金日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.35%,年跟踪误差不超过 4%。 |
| 2、投资策略: | 本基金采用被动式指数投资策略。原则上,股票投资组合的构建主要按照标的指数的成份股组成及其权重来拟合、复制标的指数,并原则上根据标的指数成份股及其权重的变动而进行相应调整。 |
| 3、业绩比较基准: | 沪深 300 指数 |
| 4、风险收益特征: | 本基金为指数基金,是风险中等、获得证券市场平均收益率的产品。 |

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》

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：中国证券登记结算有限责任公司

基金注册登记机构办公地址：北京市西城区金融大街 27 号投资广场 23 层

第二节 主要财务指标和基金净值表现

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 4 月 6 日（基金合同生效日）至 12 月 31 日
1	基金本期净收益	250,292,293.23
2	基金份额本期净收益	0.2900
3	期末可供分配基金收益	114,138,689.18
4	期末可供分配基金份额收益	0.3636
5	期末基金资产净值	529,407,223.42
6	期末基金份额净值	1.6866
7	基金加权平均净值收益率	25.76%
8	本期基金份额净值增长率	68.66%
9	基金份额累计净值增长率	68.66%

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：

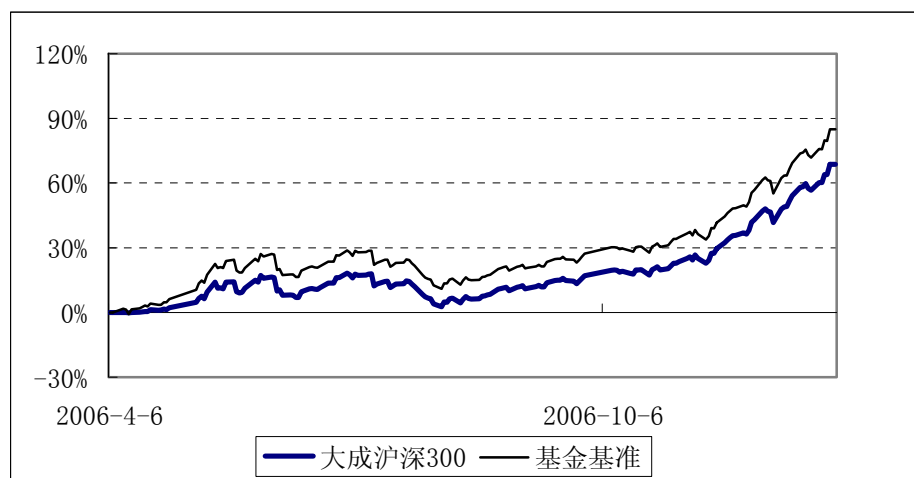
阶段	净值增长率 ①	净值增长率 标准差②	业绩比较基 准收益率③	业绩比较基 准收益率标 准差④	①-③	②-④
过去三个月	44.15%	1.37%	45.45%	1.44%	-1.30%	-0.07%
过去六个月	45.30%	1.35%	46.42%	1.42%	-1.12%	-0.07%
自基金合同生效 起至今	68.66%	1.41%	85.01%	1.52%	-16.35%	-0.11%

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：

大成沪深 300 指数证券投资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

(2006 年 4 月 6 日至 2006 年 12 月 31 日)



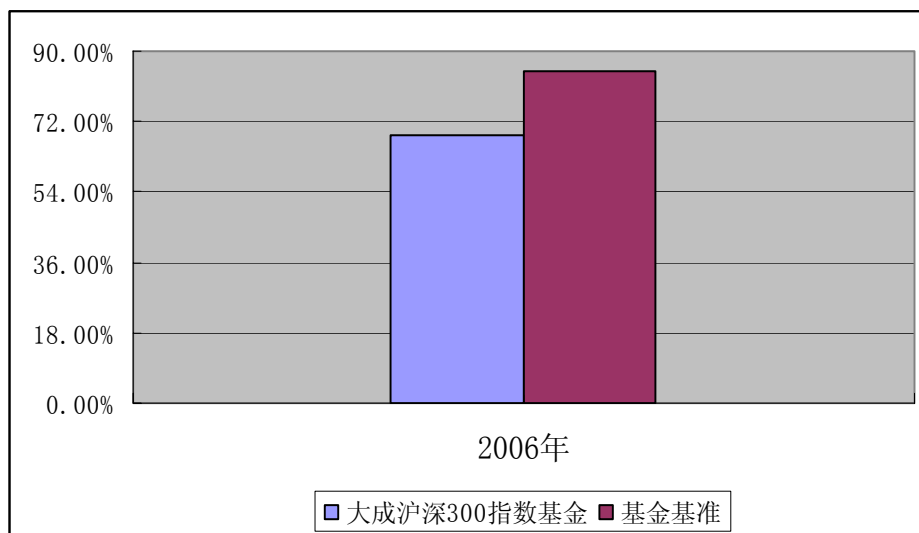
注：（1）本基金合同生效日为2006年4月6日；

（2）按《基金合同》规定，本基金的初始建仓期为6个月。截至报告日，本基金的各项投资比例已达到基金合同第十二条之（六）投资组合中规定的各项比例。

（3）2006年5月27日，本基金管理人在证券时报发布《大成基金管理有限公司关于基金经理变更的公告》，聘任杨丹先生担任大成沪深300指数证券投资基金基金经理职务，原基金经理施永辉先生不再担任大成沪深300指数证券投资基金基金经理职务。

3、本基金过往三年每年的净值增长率，及与同期业绩比较基准的收益率比较：

大成沪深300指数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



三、过往三年每年的基金收益分配情况

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

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，2006 年 4 月起兼任大成沪深 300 指数证券投资基金基金经理。

2006 年 5 月 27 日，本基金管理人在证券时报发布《大成基金管理有限公司关于基金经理变更的公告》，聘任杨丹先生担任大成沪深 300 指数证券投资基金经理职务，原基金经理施永辉先生不再担任大成沪深 300 指数证券投资基金经理职务。

杨丹先生，基金经理，理学硕士，6 年证券从业经验。2001 年加盟大成基金管理有限公司，先后任职于基金经理部、研究部、金融工程部，长期从事指数化投资及金融工程研究工作。2006 年 5 月起担任大成沪深 300 指数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》、《大成沪深 300 指数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，大成沪深 300 指数基金的投资范围、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、2006 年市场回顾与运作情况

2006 年是我国证券市场在经历了重大制度变革后，重新走向繁荣的一年，在中国证券发展史上，具有非常重要的意义。沪深 300 指数从 2006 年初的 923 点上涨到 06 年底的 2041 点，涨幅高达 121%，给投资者带来了非常丰厚的回报，形成了巨大的财富效益。

在 2006 年，我国证券市场最重大的制度变革——股权分置改革取得了成功，沪深两市绝大部分上市公司完成了股权分置改革，从根本上解决了我国证券市场长期以来存在的深层次问题，使得具有控股地位的非流通股股东与流通股股东的利益趋于一致，上市公司更加专注于提高公司的经营业绩；同时控股股东也开始关心公司股价，加强了与投资者的信息沟通，增加了公司的透明度。投资者能够更好的对公司经营动态及时把握，能够充分挖掘上市公司的投资价值。

2006 年，我国整体经济水平保持了平稳快速的增长。该年我国 GDP 增幅达到 10.7%，居民消费价格总水平上涨 1.5%，没有出现明显的通货膨胀；固定资产投资同比增幅回落，宏观调控的效果正逐步显现，规模以上工业企业实现利润增长 31%，实体经济保持了高速健康

的发展。相应的，食品、金融、有色金融、房地产、机械、商业、电器设备、传媒等许多行业的上市公司业绩上升明显，其股价也均有上佳表现。

由于我国经济整体实力的不断提升，在全球经济一体化的情况下，全球经济对中国经济的依赖在不断的增强，目前中国已经成为世界经济圈中非常重要的力量。在这种大背景下，我国的人民币汇率面临的较大的升值压力。可以预见，人民币适度的缓慢升值将是一个较长期的过程。在全球资本流动性泛滥的前提下，会有更多的国外资金流入中国，这必然造成人民币资产（包括股票、地产）价格的长期上涨，这也给我国长期牛市提供了另一个外在推动力。

本基金合同生效于 2006 年 4 月 6 日，截至到 2006 年 12 月 31 日，基金累计收益约为 68.66%。在基金建仓完成后，从 6 月 30 日开始计算，基金的平均日偏离度为 0.0071%，年化跟踪误差仅为 1.13%，很好的达到了基金合同的要求。

在基金正式成立时，恰逢上证指数在经过 05 年年底到 06 年 3 月初大涨 300 余点以后，市场步入了调整阶段。当时的市场走势尚不明朗，投资者分歧较大，选择何种建仓策略是基金面临的第一个重要的选择。

在审慎的全面考虑了我国宏观经济的发展前景、证券市场的估值水平以及证券市场的制度性建设等多方因素，我们认为中国的证券市场已经具备了持续走强的基础，一轮长达数年的大牛市已经到来。因此，我们采取了较积极的建仓策略。在基金成立后的两周，基金对指数收益贡献较大的蓝筹股进行快速建仓，在五一放假之前，基金的仓位达到了 50%。在五一长假后的头三天，市场出现连续大涨，我们果断的实行了快速建仓，在短短三天内将仓位调整到了 90%以上，分享到了随后而来的市场大幅上涨带来的收益。

在快速达到基金仓位的目标配置水平以后，本基金投资的重点就是对跟踪误差的管理。本基金通过指数化交易策略以及严格的数量化误差控制方法，将申购、赎回对跟踪误差的影响控制在较低的范围。由于 G 股的大面积停牌以及 G 股复牌后大幅涨跌，都给基金的跟踪误差管理带来了较大的影响。但随着股权分置改革的不断推进，未股改公司越来越少，该因素对基金的影响明显降低。

在四季度，人民币的稳步持续升值以及金融资本流动性泛滥扮演了牛市助推器的角色。金融地产等市场大盘蓝筹股在四季度不断演绎了大象跳舞的景象，沪深 300 指数在四季度上涨幅度高达 45%，给投资者带来了丰厚的收益。值得注意的是，随着机构投资者，尤其是 2006 年下半年证券投资基金规模的迅速增长，机构投资者在市场中扮演的角色越来越重要，其投资理念对市场影响深远，大盘蓝筹股再次受到投资者的青睐，我国证券市场正在快速的走向成熟。这种变化，将使得市场的有效性得到更多的提高，也同样意味着指数基金将面临更大的发展前景。四季度本基金以超过 40%的收益率位列所有开放式股票基金的前 1/5 强的优良业绩，已经充分体现了牛市中指数基金的优势。

2、2007 年市场展望和投资策略

展望 2007 年，我们认为随着经济宏观调控效果的不显，我国经济增长将更趋于持续稳定的增长；人民币小幅稳步升值的步伐也将保持稳定，在宏观经济情况保持良好的背景下，我们认为中国证券市场长期牛市的基础依然没有改变。

值得注意的是，由于 2006 年股市在业绩增长和估值提升的双重动力下，整体上涨幅度巨大，市场获利回吐的压力较大；同时 2007 年也存在较大的大非减持的压力；再则，从静态的估值上来看，市场整体基本已经趋于合理区域，明显价值低估的品种已经很难找到。因此，预计市场在下一阶段会出现大幅震荡的走势，来充分消化市场本身的压力。

我们认为市场的推动因素在 2007 年将表现多元化的格局。一方面，公司经营业绩的持续增长将是推动股价上涨的最主要动力。另一方面，在央企整体上市的大背景下，一大批公司将获得控股股东的优质资产注入，大幅提高公司本身的盈利能力和资产质量。我们认为这

种外延式的业绩增长将在未来两年都是一个非常重要的股市驱动因素。类似的，由于股权分置改革的完成，许多民营企业也有类似的动力将优质资产注入。

2007 年对沪深 300 指数基金影响最大的事件莫过于以沪深 300 指数为标的的股指期货合约的推出。中国证券市场这一重大的产品创新必将给本基金带来巨大的发展机遇，同时也对基金的投资管理提出了更高的要求。一方面，沪深 300 指数在市场的的重要性会获得极大的提升，会有更多的资金关注跟踪沪深 300 指数，同时套利交易者对现货的新增需求也将大幅增加，这必然带来沪深 300 指数基金规模的大幅增长；另一个方面，由于套利交易者的套利需求，也对指数跟踪误差提出了更高的要求；同时，套利交易者在指数基金上现货头寸的频繁申购赎回，也会给指数基金的跟踪误差管理带来更大的难度。

本基金将坚持被动型的指数化投资理念，继续深入研究更加高效的交易策略、风险控制方法，以期更好的跟踪指数，积极应对大额、频繁申购赎回及其他突发事件的影响，力争将跟踪误差控制在更低的水平，努力扮演好指数现货的角色。

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、制度执行及遵规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《大成沪深 300 指数证券投资基金基金合同》和《大成沪深 300 指数证券投资基金托管协议》，在托管大成沪深 300 指数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，对大成沪深 300 指数证券投资基金管理人—大成基金管理有限公司 2006 年 4 月 6 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，大成沪深 300 指数基金管理人在大成沪深 300 指数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沪深 300 指数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

安永华明(2007)审字第 60469430_H02 号

大成沪深 300 指数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沪深 300 指数证券投资基金（简称“大成沪深 300 指数基金”）的财务报表，包括 2006 年 12 月 31 日的资产负债表和自 2006 年 4 月 6 日（基金合同生效日）至 2006 年 12 月 31 日止的经营业绩表、基金净值变动表及基金收益分配表以及财务报表附注。

一、基金管理人 对财务报表的责任

按照企业会计准则、《金融企业会计制度》及《证券投资基金会计核算办法》的规定编

制财务报表是大成沪深 300 指数基金的基金管理人的责任。这种责任包括：（1）设计、实施和维护与财务报表编制相关的内部控制，以使财务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财务报表发表审计意见。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财务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，以获取有关财务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财务报表重大错报风险的评估。在进行风险评估时，我们考虑与财务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，以及评价财务报表的总体列报。

我们相信，我们获取的审计证据是充分的、适当的，为发表审计意见提供了基础。

三、审计意见

我们认为，大成沪深 300 指数基金财务报表已经按照企业会计准则、《金融企业会计制度》及《证券投资基金会计核算办法》的规定编制，在所有重大方面公允地反映了大成沪深 300 指数基金 2006 年 12 月 31 日的财务状况和自 2006 年 4 月 6 日（基金合同生效日）至 2006 年 12 月 31 日止的经营成果和净值变动及收益分配情况。

安永华明会计师事务所

中国注册会计师 谢 枫

中国 北京

中国注册会计师 罗 智

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
资产		
银行存款		24,489,541.31
清算备付金		141,588.18
交易保证金		250,000.00
应收证券清算款	6（1）	9,987,208.48
应收股利		0.00
应收利息	6（2）	5,348.25
应收申购款		486,332.41
其他应收款	6（3）	0.00
股票投资市值		503,346,921.79
其中：股票投资成本		316,120,476.69
债券投资市值		0.00
其中：债券投资成本		0.00
权证投资		0.00
其中：权证投资成本		0.00
买入返售证券		0.00

待摊费用	6 (4)	0.00
其他资产		0.00
资产总计		538,706,940.42
负债		
应付证券清算款		0.00
应付赎回款		8,084,450.71
应付赎回费		30,469.85
应付管理人报酬		331,378.10
应付托管费		66,275.61
应付佣金	6 (6)	396,612.61
应付利息		0.00
应付收益		0.00
未交税金		0.00
其他应付款	6 (7)	250,530.12
卖出回购证券款		0.00
短期借款		0.00
预提费用	6 (8)	140,000.00
其他负债		0.00
负债合计		9,299,717.00
持有人权益		
实收基金	6 (9)	313,896,083.57
未实现利得	6 (10)	101,372,450.67
未分配收益		114,138,689.18
持有人权益合计		529,407,223.42
负债及持有人权益总计		538,706,940.42
基金份额净值		1.6866

所附附注为本会计报表的组成部分

2、2006年4月6日（基金合同生效日）至12月31日止期间经营业绩表

	附注	2006年4月6日(基金合同生效日) 至2006年12月31日
一、收入		256,972,388.64
1、股票差价收入	6 (11)	215,174,899.13
2、债券差价收入	6 (12)	857,417.66
3、权证差价收入	6 (13)	15,410,601.55
4、债券利息收入		3,901.98
5、存款利息收入		914,018.73
6、股利收入		20,962,190.42
7、买入返售证券收入		1,053,481.63
8、其他收入	6 (14)	2,595,877.54
二、费用		6,680,095.41
1、基金管理人报酬		5,418,729.00
2、基金托管费		1,083,745.87
3、卖出回购证券支出		0.00

4、利息支出		0.00
5、其他费用	6 (15)	177,620.54
其中：上市年费		0.00
信息披露费		50,000.00
审计费用		90,000.00
三、基金净收益		250,292,293.23
加：未实现利得		187,226,445.10
四、基金经营业绩		437,518,738.33

所附附注为本会计报表的组成部分

3、2006 年 4 月 6 日（基金合同生效日）至 12 月 31 日止期间基金收益分配表

	附注	2006年4月6日(基金合同生效日) 至2006年6月30日
本期基金净收益		250,292,293.23
加：期初基金净收益		0.00
加：本期损益平准金		-136,153,604.05
可供分配基金净收益		114,138,689.18
减：本期已分配基金净收益		0.00
期末基金净收益		114,138,689.18

所附附注为本会计报表的组成部分

4、2006 年 4 月 6 日（基金合同生效日）至 12 月 31 日止期间基金净值变动表

	附注	2006年4月6日(基金合同生效日) 至2006年12月31日
一、期初基金净值		1,813,356,066.47
二、本期经营活动：		
基金净收益		250,292,293.23
未实现利得		187,226,445.10
经营活动产生的基金净值变动数		437,518,738.33
三、本期基金份额交易：		
基金申购款		353,843,287.04
基金赎回款		-2,075,310,868.42
基金份额交易产生的基金净值变动数		-1,721,467,581.38
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		0.00
五、期末基金净值		529,407,223.42

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

大成沪深 300 指数证券投资基金（简称“本基金”）经中国证券监督管理委员会（简称“中国证监会”）证监基金字[2006]24 号文“关于同意大成沪深 300 指数证券投资基金募集的批复”批准，由大成基金管理有限公司作为基金发起人，向社会公开募集。根据中国证

监会基金监管部基金部函[2006]69号《关于大成沪深300指数证券投资基金备案确认的函》，本基金基金合同于2006年4月6日正式生效。

本基金募集期间为2006年3月2日至2006年3月31日，募集资金总额为人民币1,812,606,946.95元，折合1,812,606,946.95份基金份额。募集资金的银行存款利息为人民币749,119.52元，折合749,119.52份基金份额。上述资金已经安永华明会计师事务所验资。合同生效日基金份额为1,813,356,066.47份。

本基金为契约型开放式，存续期限不定。本基金的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。《大成沪深300指数证券投资基金基金合同》、《大成沪深300指数证券投资基金招募说明书》等文件已按规定报送中国证监会备案。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《大成沪深300指数证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金主要投资于具有良好流动性的金融工具，包括沪深300指数成份股、备选成份股、新股（如一级市场初次发行或增发）等，现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金财产净值的5%。本基金还可以投资于法律法规及中国证监会允许基金投资的其他金融工具。待金融衍生产品推出后，本基金可以依照法律法规或监管机构的规定运用金融衍生产品进行风险管理。本基金跟踪标的指数的投资组合资产原则上不低于基金财产净值的90%。除法律法规另有规定，本基金的股票投资比例可以提高到基金财产净值的100%。

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

本基金的会计报表乃按照《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》、中国证券监督管理委员会颁布的《证券投资基金信息披露管理办法》、《证券投资基金信息披露内容与格式准则》第2号《年度报告的内容与格式》和《证券投资基金信息披露编报规则》第3号《会计报表附注的编制及披露》的有关规定编制。

（2）会计期间

本基金会计年度为公历1月1日起至12月31日止。本基金本年度会计报表的实际编制期间为2006年4月6日（基金合同生效日）至2006年12月31日。

（3）记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

（4）记账基础和计价原则

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本附注所述的估值方法计价外，其余均以历史成本为计价原则。

（5）基金资产的估值原则

- A. 估值对象为基金所拥有的股票、债券及权证等；
- B. 银行存款、清算备付金按本金列示，并按本金与所适用的利率逐日计提利息计入“应收利息”科目；
- C. 上市流通的股票以其估值日在证券交易所挂牌交易的收盘价估值，该估值日无交易的，以最近一个交易日的收盘价计算；
- D. 未上市的股票的估值
 - (a) 送股、转增股、配股或增发的新股，以估值日证券交易所挂牌的同一股票的收盘价估值，该日无交易的，以最近一个交易日收盘价计算；
 - (b) 首次公开发行的股票，以其成本价计算。
- E. 在锁定期的非公开发行股票估值：
 - (a) 在2006年11月13日前新投资的非公开发行股票，以估值日证券交易所上市交易的同一股票的收盘价估值，该日无交易的，以最近一个交易日收盘价计算；

(b) 在 2006 年 11 月 13 日后新投资的非公开发行股票；

估值日在证券交易所上市交易的同一股票的收盘价低于非公开发行股票的初始取得成本时，应采用在证券交易所的同一股票的收盘价作为估值日该非公开发行股票的价值；

估值日在证券交易所上市交易的同一股票的收盘价高于非公开发行股票的初始取得成本时，应按以下公式确定估值日该非公开发行股票的价值：

$$FV = C + (P - C) \times (D1 - Dr) / D1$$

其中：FV 为估值日该非公开发行股票的价值；C 为该非公开发行股票的初始取得成本；P 为估值日在证券交易所上市交易的同一股票的收盘价；D1 为该非公开发行股票锁定期所含的交易天数；Dr 为估值日剩余锁定期，即估值日至锁定期结束所含的交易天数，不含估值日当天。

F. 上市债券以不含息价格计价，按估值日证券交易所挂牌的收盘价计算后的净价估值；该日无交易的，以最近交易日净价估值，并按债券票面价值与票面利率或内含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，在债券实际持有期间内逐日计提利息；其中，分离交易的可转债在权证确认日至上市前按照最能反映债券公允价值的价格估值。

G. 未上市债券以不含息价格计价，按成本估值，并按债券票面价值与票面利率或内含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，在债券实际持有期间内计提利息；

H. 银行间市场交易的债券按不含息成本与市价孰低法估值。不含息成本是指取得债券成本（不含应计利息），市价是指银行间同业市场公布的加权平均净价，如果该日没有交易的品种，以最近一日的市场平均价为基准；如该债券长期没有交易或交易异常，按下述第（J）条处理；当成本与市价不一致时，取最低价；

I. 配股权证，从配股除权日到配股确认日止，按收盘价高于配股价的差额估值；如果收盘价等于或低于配股价，则估值额为零；

J. 上市流通的权证以其估值日在证券交易所挂牌交易的收盘价估值，该估值日无交易的，以最近一个交易日的收盘价计算；

K. 未上市流通的权证，综合考虑标的股票价格、行权价格、剩余天数、市场无风险利率、标的股票价格波动以及市场情况等因素，按照最能反映权证公允价值的价格估值；

L. 如有确凿证据表明按上述规定不能客观反映基金资产公允价值的，基金管理人可根据具体情况，在与基金托管人商议后，按最能反映公允价值的价格估值；

M. 每个工作日都对基金资产进行估值；如有新增事项，按国家最新规定估值。

（6）证券投资的成本计价方法

按移动加权平均法计算库存证券的成本。当日有买入和卖出时，先计算成本后计算买卖证券价差。

A. 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；

上交所买入股票成本：由买入金额、买入印花税、买入过户费、买入经手费、买入证管费和买入佣金组成；

深交所买入股票成本：由买入金额、买入印花税、买入经手费和买入佣金组成；

上海股票的佣金是按买卖股票成交金额的 1‰ 减去经手费和证管费计算。深圳股票的佣金是按买卖股票成交金额的 1‰ 减经手费计算。

因股权分置改革而获得由非流通股股东支付的现金对价，于股权分置改革方案实施后的股票复牌日，冲减股票投资成本。

B. 债券投资

买入上市债券于成交日确认为债券投资，按应支付的全部价款入账，如果应支付的价款中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，后于权证确认日单独核算权证成本，并相应调整债券投资成本；

买入非上市债券和在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，按实际支付的全部价款入账，如果实际支付的价款中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；

买入贴息债券和零息债券视同到期一次性还本付息的债券，根据其发行价、到期价和发行期限按直线法推算内含利率后，按上述会计处理方法核算；

债券买卖不计佣金。

C. 权证投资

买入权证于成交日确认为权证投资，权证投资成本按成交日应支付的全部价款入账；

配股权证及由股权分置改革而被动获得的权证在确认日，记录所获分配的权证数量，该等权证初始成本为零。

因认购新发行的分离交易可转债而取得的权证在确认日，按权证公允价值占分离交易可转债公允价值与权证公允价值之和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。

D. 质押式买入返售证券

质押式买入返售证券成本：通过证券交易所进行质押式融券业务，按成交日扣除手续费后的应付金额确认买入返售证券投资；通过银行间市场进行质押式融券业务，按实际支付的价款确认买入返售证券投资。

(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

A. 股票差价收入于卖出股票成交日确认，并按卖出股票成交总额与其成本和相关费用的差额入账；

B. 债券差价收入

卖出上市债券——于成交日确认债券差价收入，并按应收取的全部价款与其成本、应收利息和相关费用的差额入账；

卖出非上市债券及银行间同业市场交易债券——于实际收到价款时确认债券差价收入，并按实际收到的全部价款与其成本、应收利息的差额入账。

C. 权证差价收入于卖出权证成交日确认，并按卖出权证成交总额与其成本和相关费用的差额入账；

D. 债券利息收入按债券票面价值与票面利率或内含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，在债券实际持有期间内逐日计提；

E. 存款利息收入按本金与适用的利率逐日计提的金额入账；

F. 股利收入于除息日确认，并按上市公司宣告的分红派息比例计算的金额扣除应由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额入账；

G. 买入返售证券收入按融出金额及约定利率在证券持有期内采用直线法逐日计提。

(9) 费用的确认和计量

A. 基金管理费按前一日的基金资产净值的0.75%的年费率逐日计提；

B. 基金托管费按前一日的基金资产净值的0.15%的年费率逐日计提；

C. 卖出回购证券支出按融入金额及约定利率，在回购期限内采用直线法逐日计提；

D. 信息披露费和审计费用按期初合理预估数额逐日预提；

E. 其他费用用于实际支付时确认费用。

(10) 基金的收益分配政策

A. 基金份额持有人可以事先选择将所获分配的现金收益,按照基金合同有关基金份额申购的约定转为基金份额;基金份额持有人事先未做出选择的,基金管理人应当支付现金;本基金默认的分红方式为现金分红。

B. 每一基金份额享有同等分配权;

C. 基金当期收益先弥补上期亏损后,方可进行当期收益分配;

D. 基金当期出现亏损,则可不进行收益分配;

E. 基金收益分配后每基金份额净值不能低于面值;

F. 在符合有关基金分红条件的前提下,基金收益分配每年不超过6次,成立不满3个月,收益可不分配;

G. 基金年度收益分配比例不低于基金年度已实现收益的50%;

H. 法律法规或监管机构另有规定的从其规定。

(11) 基金申购、赎回的确认

在收到基金投资人申购或赎回申请之日后,于下一个工作日内对该交易的有效性进行确认。于确认日按照前一日实收基金、未实现利得、未分配收益和损益平准金的余额占前一日基金净值的比例,将确认有效的申购或赎回款项分割为三部分,分别确认为实收基金、未实现利得、损益平准金的增加或减少。

(12) 实收基金

每份基金份额面值为1.00元。实收基金为对外发行的基金份额总额。由于申购、赎回引起的实收基金的变动分别于基金申购确认日、赎回确认日列示。

(13) 损益平准金

损益平准金为申购、赎回款中所含的按基金未分配净收益占基金净值比例计算的一部分金额,于计算基金申购、赎回确认日列示,并于期末全额转入未分配收益。

(14) 重大会计差错的内容和更正金额。

无。

附注3. 税项

(1) 印花税

根据财政部、国家税务总局财税字[2002]128号文《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》的规定,基金管理人运用基金买卖股票按照2%的税率征收印花税。

根据财税[2005]11号文《财政部、国家税务总局关于调整证券(股票)交易印花税税率的通知》的规定,从2005年1月24日起,调整证券(股票)交易印花税税率,由现行的2%调整为1%。

根据财政部、国家税务总局财税字[2005]103号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》的规定,自2005年6月13日起,股权分置改革过程中因非流通股股东向流通股股东支付对价而发生的股权转让,暂免征收印花税。

(2) 营业税、企业所得税

根据财政部、国家税务总局财税字[2002]128号文《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》的规定,以发行基金方式募集资金不属于营业税的征税范围,不征收营业税;根据财政部、国家税务总局财税字[2004]78号文《关于证券投资基金税收政策的通知》的规定,自2004年1月1日起,对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入,继续免征营业税和企业所得税。

根据财税[2005]103号文《财政部、国家税务总局关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》的规定,自2005年6月13日起,股权分置改革中非流通股股东通过对价方式向

流通股股东支付的股份、现金等收入，暂免征收流通股股东应缴纳的企业所得税和个人所得税。

(3) 个人所得税

根据财政部、国家税务总局财税字[2002]128号文《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》的规定，对基金取得的股票的股息、红利收入和债券的利息收入，由上市公司和债券发行企业在向基金派发股息、红利收入和债券的利息收入时代扣代缴20%的个人所得税。

根据财政部、国家税务总局财税字[2005]107号文《关于股息红利有关个人所得税政策的补充通知》的规定，对证券投资基金从上市公司分配取得的股息红利所得，按照财税[2005]102号文规定，自2005年6月13日起，扣缴义务人在代扣代缴个人所得税时，减按50%计算应纳税所得额。

附注4. 资产负债表日后事项

根据本基金收益分配政策，本基金管理人拟于资产负债表日后分配本基金2006年度收益，具体方案尚待本基金管理人确定。

除上述事项外，截至本财务报表批准报出日，本基金无其他须作披露的资产负债表日后事项。

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	基金管理人、基金销售机构
中国农业银行	基金托管人、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
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

*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。

(2) 通过关联方席位进行的证券交易及交易佣金

无。

(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

基金管理费按前一日的基金资产净值的0.75%的年费率计提。计算方法如下：

$H = E \times 0.75\% / \text{当年天数}$

H 为每日应支付的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计算，逐日累计至每月月底，按月支付；由基金托管人于次月前五个工作日内从基金资产中一次性支付给基金管理人。本基金于本期应支付基金管理人管理费共计人民币 5,418,729.00 元，其中已支付基金管理人人民币 5,087,350.90 元，尚余人民币

331,378.10 元未支付。

B 基金托管人报酬

基金托管费按前一日的基金资产净值的 0.15% 的年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 0.15\% / \text{当年天数}$$

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，逐日累计至每月月底，按月支付；由基金托管人于次月前五个工作日内从基金资产中一次性支取。本基金于本期应支付基金托管人托管费共计人民币 1,083,745.87 元，其中已支付基金托管人人民币 1,017,470.26 元，尚余人民币 66,275.61 元未支付。

C 由关联方保管的银行存款余额及由此产生的利息收入

本基金的全部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人民币 24,489,541.31 元。本会计期间由基金托管人保管的银行存款产生的利息收入为人民币 848,289.18 元，于 2006 年 12 月 31 日应收银行存款利息为人民币 5,284.55 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

2006 年 4 月 6 日(基金合同生效日)至 2006 年 12 月 31 日		
	基金份额(份)	适用费率
报告期间买入基金份额(认购)	30,005,750.00	1000 元/笔
报告期间申购	0.00	
报告期间赎回	30,005,750.00	0.50%
期末持有份额	0.00	
占基金总份额的比例	0.00%	

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) 应收证券清算款

项目	2006年12月31日
应收上海证券清算款	7,059,733.34
应收深圳证券清算款	2,927,475.14
合计	9,987,208.48

(2) 应收利息

项目	2006年12月31日
应收银行存款利息	5,284.55
应收清算备付金利息	63.70
应收债券利息	0.00
合计	5,348.25

(3) 其他应收款

无。

(4) 待摊费用

无。

(5) 投资估值增值

项目	2006年12月31日
股票估值增值	187,226,445.10
债券估值增值	0.00
合计	187,226,445.10

(6) 应付佣金

券商名称	2006年12月31日
联合证券	0.00
中银国际	282,627.55
国金证券	113,985.06
合计	396,612.61

(7) 其他应付款

项目	2006年12月31日
应付后端申购费	210.12
应付银行间回购结算费	320.00
应付券商席位保证金	250,000.00
合计	250,530.12

(8) 预提费用

项目	2006年12月31日
审计费用	90,000.00
信息披露费	50,000.00
合计	140,000.00

(9) 实收基金

项目	2006年4月6日(基金合同生效日) 至2006年12月31日
基金合同生效时的基金份额总额(*)	1,813,356,066.47
加: 本期因申购的增加数(**)	313,462,536.65
减: 本期因赎回的减少数(**)	1,812,922,519.55
期末数	313,896,083.57

*本基金自2006年3月2日至2006年3月31日止期间公开发售,共募集有效净认购资金1,812,606,946.95元。根据《大成沪深300指数证券投资基金招募说明书》的规定,本基金设立募集期内认购资金产生的利息收入749,119.52元在本基金成立后,折算为749,119.52份基金份额,划入基金份额持有人账户。

**根据《大成沪深300指数证券投资基金招募说明书》的相关规定,本基金申购、赎回业务自2006年4月24日起开始办理。

(10) 未实现利得

项目	2006年12月31日
投资估值增值	187,226,445.10
其中: 股票投资估值增值	187,226,445.10
债券投资估值增值	0.00
未实现利得平准金	-85,853,994.43
其中: 申购未实现利得平准金	14,823,369.22
赎回未实现利得平准金	-100,677,363.65
合计	101,372,450.67

(11) 股票差价收入

项目	2006年4月6日(基金合同生效日) 至2006年12月31日
卖出股票成交总额	1,872,288,480.06
减: 卖出股票成本总额	1,655,542,053.11
减: 应付佣金	1,571,527.82
股票差价收入	215,174,899.13

本基金于本报告期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 4,145,796.72 元, 已全额冲减股票投资成本。

(12) 债券差价收入

项目	2006年4月6日(基金合同生效日) 至2006年12月31日
卖出及到期兑付债券结算金额	4,163,921.70
减: 应收利息总额	3,901.98
减: 卖出及到期兑付债券成本总额	3,302,602.06
合计	857,417.66

(13) 权证差价收入

项目	2006年4月6日(基金合同生效日) 至2006年12月31日
卖出权证成交总额	15,898,799.49
减: 卖出权证成本总额	488,197.94
减: 应付佣金	0.00
权证差价收入	15,410,601.55

(14) 其他收入

项目	2006年4月6日(基金合同生效日) 至2006年12月31日
赎回基金补偿收入(*)	2,594,141.94
配股手续费返还	1,735.60
合计	2,595,877.54

*本基金赎回费总额的25%归入基金资产。

(15) 其他费用

项目	2006年4月6日(基金合同生效日) 至2006年12月31日
信息披露费	50,000.00
审计费用	90,000.00
银行间回购交易费用	1,062.50
银行间回购结算费用	320.00
交易所回购交易费用	14,163.18
债券账户维护费	7,820.00
银行费用	12,854.86
其他	1,400.00
合计	177,620.54

(16) 本报告期已分配基金净收益

无。

附注7. 报告期末流通转让受到限制的基金资产

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	期末估值单价（元）	复牌日期	复牌开盘单价（元）	数量（股）	期末估值总额（元）
方案沟通协商阶段停牌：							
000423	S 阿胶	2006-12-4	13.69	未知	未知	111,897	1,531,869.93
600786	S 东锅	2006-12-22	28.90	2007-2-13	30.35	37,678	1,088,894.20
方案实施阶段停牌：							
000895	S 双汇	2006-6-1	31.17	未知	未知	270,000	8,415,900.00
600102	莱钢股份	2006-9-20	6.13	2007-1-18	10.00	280,873	1,721,751.49

其他受限资产：

证券名称	数量（股）	总成本（元）	总市值（元）	估值方法	转让受限原因	受限期限
东方电机	26,600	550,497.86	720,860.00	停牌前一日 工作日市 场收市价	重大事项 停牌	2007-2-5

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	24,631,129.49	4.57%
股票	503,346,921.79	93.44%
债券	0.00	0.00%
权证	0.00	0.00%
其他资产	10,728,889.14	1.99%
合计	538,706,940.42	100.00%

二、本报告期末按行业分类的股票投资组合

1、指数投资部分

行业	市值（元）	占基金资产净值比例
A 农、林、牧、渔业	1,421,790.90	0.27%
B 采掘业	20,587,684.25	3.89%
C 制造业	191,590,486.14	36.18%
C0 食品、饮料	40,419,230.12	7.64%
C1 纺织、服装、皮毛	5,756,463.48	1.09%
C2 木材、家具	0.00	0.00%
C3 造纸、印刷	2,231,145.38	0.42%

C4 石油、化学、塑胶、塑料	16,633,969.35	3.14%
C5 电子	6,324,711.29	1.19%
C6 金属、非金属	67,774,571.64	12.80%
C7 机械、设备、仪表	39,411,266.21	7.44%
C8 医药、生物制品	11,227,239.51	2.12%
C99 其他制造业	1,811,889.16	0.34%
D 电力、煤气及水的生产和供应业	25,759,329.49	4.87%
E 建筑业	3,313,386.76	0.63%
F 交通运输、仓储业	40,936,462.51	7.73%
G 信息技术业	38,744,903.23	7.32%
H 批发和零售贸易	16,830,766.58	3.18%
I 金融、保险业	102,713,711.95	19.40%
J 房地产业	31,138,813.10	5.88%
K 社会服务业	8,581,779.38	1.62%
L 传播与文化产业	3,948,125.44	0.75%
M 综合类	17,345,442.06	3.28%
合计	502,912,681.79	95.00%

2、非指数投资部分

行业	市值(元)	占基金资产净值比例
I 金融、保险业	434,240.00	0.08%
合计	434,240.00	0.08%

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

1、指数投资部分

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	600036	招商银行	1,449,326	23,710,973.36	4.48%
2	600016	民生银行	2,151,026	21,940,465.20	4.14%
3	000002	万科A	1,145,772	17,690,719.68	3.34%
4	600030	中信证券	538,724	14,750,263.12	2.79%
5	600019	宝钢股份	1,560,799	13,516,519.34	2.55%
6	601398	工商银行	2,111,300	13,090,060.00	2.47%
7	600050	中国联通	2,522,753	11,781,256.51	2.23%
8	600000	浦发银行	503,240	10,724,044.40	2.03%
9	600519	贵州茅台	115,422	10,137,514.26	1.91%
10	600028	中国石化	1,061,809	9,683,698.08	1.83%
11	600900	长江电力	956,317	9,343,217.09	1.76%
12	600018	上港集团	1,232,707	8,616,621.93	1.63%
13	600718	东软股份	361,443	8,526,440.37	1.61%
14	000895	S 双 汇	270,000	8,415,900.00	1.59%
15	000858	五 粮 液	316,382	7,229,328.70	1.37%
16	601988	中国银行	1,248,509	6,779,403.87	1.28%
17	601006	大秦铁路	756,824	6,130,274.40	1.16%
18	600005	武钢股份	939,433	5,974,793.88	1.13%
19	000001	S 深发展 A	409,027	5,918,620.69	1.12%

20	600009	上海机场	277,775	5,252,725.25	0.99%
21	000063	中兴通讯	120,797	4,723,162.70	0.89%
22	002024	苏宁电器	103,634	4,704,983.60	0.89%
23	000898	鞍钢股份	419,841	4,282,378.20	0.81%
24	600104	上海汽车	496,903	4,059,697.51	0.77%
25	600320	振华港机	344,131	4,046,980.56	0.76%
26	000039	中集集团	209,601	3,948,882.84	0.75%
27	000793	华闻传媒	390,093	3,518,638.86	0.66%
28	600015	华夏银行	473,408	3,498,485.12	0.66%
29	000069	华侨城 A	158,235	3,482,752.35	0.66%
30	600309	烟台万华	136,695	3,312,119.85	0.63%
31	600583	海油工程	93,914	3,255,998.38	0.62%
32	000402	金融街	190,486	3,209,689.10	0.61%
33	600832	东方明珠	279,162	3,190,821.66	0.60%
34	600887	伊利股份	118,516	3,140,674.00	0.59%
35	600642	申能股份	410,649	3,001,844.19	0.57%
36	000825	太钢不锈	224,978	2,938,212.68	0.56%
37	600037	歌华有线	114,967	2,858,079.62	0.54%
38	600177	雅戈尔	301,080	2,655,525.60	0.50%
39	000792	盐湖钾肥	108,215	2,549,545.40	0.48%
40	000839	中信国安	111,277	2,538,228.37	0.48%
41	600383	金地集团	135,800	2,509,584.00	0.47%
42	000568	泸州老窖	98,207	2,488,565.38	0.47%
43	600690	青岛海尔	243,793	2,247,771.46	0.42%
44	600881	亚泰集团	330,005	2,240,733.95	0.42%
45	600585	海螺水泥	73,242	2,197,260.00	0.42%
46	000024	招商地产	77,417	2,197,094.46	0.42%
47	600660	福耀玻璃	147,240	2,174,734.80	0.41%
48	600001	邯郸钢铁	471,487	2,055,683.32	0.39%
49	600694	大商股份	67,072	1,971,246.08	0.37%
50	000060	中金岭南	112,444	1,948,654.52	0.37%
51	600143	金发科技	46,900	1,878,814.00	0.35%
52	000623	吉林敖东	56,742	1,878,160.20	0.35%
53	600717	天津港	207,388	1,847,827.08	0.35%
54	000629	新 钢 钒	430,686	1,843,336.08	0.35%
55	600026	中海发展	174,775	1,808,921.25	0.34%
56	600031	三一重工	55,881	1,801,044.63	0.34%
57	600010	包钢股份	572,861	1,787,326.32	0.34%
58	600811	东方集团	202,486	1,765,677.92	0.33%
59	600879	火箭股份	113,314	1,743,902.46	0.33%
60	600795	国电电力	281,779	1,738,576.43	0.33%
61	600102	莱钢股份	280,873	1,721,751.49	0.33%
62	600688	S 上石化	276,840	1,688,724.00	0.32%

63	000651	格力电器	138,010	1,638,178.70	0.31%
64	600739	辽宁成大	90,144	1,607,267.52	0.30%
65	000157	中联重科	71,710	1,594,113.30	0.30%
66	600839	四川长虹	374,714	1,581,293.08	0.30%
67	000527	美的电器	130,718	1,549,008.30	0.29%
68	000983	西山煤电	172,418	1,543,141.10	0.29%
69	000423	S 阿 胶	111,897	1,531,869.93	0.29%
70	600308	华泰股份	111,178	1,515,356.14	0.29%
71	000729	燕京啤酒	154,931	1,513,675.87	0.29%
72	000562	宏源证券	123,633	1,503,377.28	0.28%
73	600029	S 南航	363,206	1,485,512.54	0.28%
74	000869	张 裕 A	29,781	1,483,689.42	0.28%
75	000027	深能源 A	172,317	1,435,400.61	0.27%
76	000709	唐钢股份	255,408	1,430,284.80	0.27%
77	600008	首创股份	248,104	1,426,598.00	0.27%
78	600205	S 山东铝	62,822	1,419,148.98	0.27%
79	600415	小商品城	18,171	1,408,252.50	0.27%
80	600456	宝钛股份	45,100	1,398,100.00	0.26%
81	600269	赣粤高速	164,554	1,397,063.46	0.26%
82	600296	S 兰铝	107,122	1,382,945.02	0.26%
83	000538	云南白药	55,238	1,374,873.82	0.26%
84	000528	柳 工	80,068	1,369,162.80	0.26%
85	600098	广州控股	232,055	1,331,995.70	0.25%
86	000932	华菱管线	311,431	1,317,353.13	0.25%
87	000089	深圳机场	203,100	1,299,840.00	0.25%
88	600089	特变电工	86,343	1,290,827.85	0.24%
89	000088	盐 田 港	140,347	1,286,981.99	0.24%
90	600675	中华企业	118,956	1,282,345.68	0.24%
91	000930	丰原生化	224,226	1,275,845.94	0.24%
92	600271	航天信息	36,080	1,263,160.80	0.24%
93	600601	方正科技	299,121	1,253,316.99	0.24%
94	600123	兰花科创	62,845	1,246,216.35	0.24%
95	000768	西飞国际	106,114	1,241,533.80	0.23%
96	000878	云南铜业	112,574	1,230,433.82	0.23%
97	600653	申华控股	413,301	1,227,503.97	0.23%
98	600361	华联综超	53,100	1,226,079.00	0.23%
99	600808	马钢股份	272,374	1,225,683.00	0.23%
100	600100	同方股份	113,356	1,225,378.36	0.23%
101	600649	原水股份	214,131	1,222,688.01	0.23%
102	600500	中化国际	178,426	1,216,865.32	0.23%
103	600631	百联股份	127,770	1,215,092.70	0.23%
104	600276	恒瑞医药	37,647	1,214,492.22	0.23%
105	600895	张江高科	175,215	1,212,487.80	0.23%

106	000625	长安汽车	135,524	1,208,874.08	0.23%
107	600797	浙大网新	184,860	1,199,741.40	0.23%
108	600011	华能国际	183,128	1,181,175.60	0.22%
109	600188	兖州煤业	166,683	1,178,448.81	0.22%
110	600809	山西汾酒	37,998	1,177,558.02	0.22%
111	000410	沈阳机床	57,871	1,160,313.55	0.22%
112	000630	铜都铜业	170,503	1,152,600.28	0.22%
113	600628	新世界	106,859	1,122,019.50	0.21%
114	600183	生益科技	134,931	1,109,132.82	0.21%
115	600600	青岛啤酒	78,554	1,091,115.06	0.21%
116	600198	大唐电信	85,000	1,090,550.00	0.21%
117	600779	水井坊	83,167	1,090,319.37	0.21%
118	600786	S 东锅	37,678	1,088,894.20	0.21%
119	000503	海虹控股	126,443	1,074,765.50	0.20%
120	600663	陆家嘴	77,131	1,070,578.28	0.20%
121	000680	山推股份	130,249	1,065,436.82	0.20%
122	600004	白云机场	140,752	1,061,270.08	0.20%
123	600085	同仁堂	61,101	1,049,715.18	0.20%
124	000036	华联控股	221,640	1,028,409.60	0.19%
125	600428	中远航运	94,242	1,024,410.54	0.19%
126	600418	江淮汽车	207,684	1,021,805.28	0.19%
127	000652	泰达股份	178,537	1,015,875.53	0.19%
128	600348	国阳新能	68,227	1,014,535.49	0.19%
129	000061	农产品	78,867	1,005,554.25	0.19%
130	600362	江西铜业	86,638	1,005,000.80	0.19%
131	600022	济南钢铁	127,210	976,972.80	0.18%
132	600125	铁龙物流	117,959	975,520.93	0.18%
133	000778	新兴铸管	177,000	971,730.00	0.18%
134	000539	粤电力 A	168,741	950,011.83	0.18%
135	600549	厦门钨业	55,271	949,555.78	0.18%
136	600299	星新材料	51,751	946,008.28	0.18%
137	600331	宏达股份	59,871	929,197.92	0.18%
138	000800	一汽轿车	229,276	923,982.28	0.17%
139	000031	中粮地产	98,524	908,391.28	0.17%
140	600835	上海机电	95,470	903,146.20	0.17%
141	600406	国电南瑞	38,780	886,123.00	0.17%
142	000100	TCL 集团	364,597	860,448.92	0.16%
143	600033	福建高速	166,578	847,882.02	0.16%
144	600357	承德钒钛	172,500	841,800.00	0.16%
145	600886	国投电力	116,700	840,240.00	0.16%
146	600350	山东高速	191,279	835,889.23	0.16%
147	600020	中原高速	177,678	835,086.60	0.16%
148	600096	云天化	60,546	833,718.42	0.16%

149	000021	长城开发	99,972	832,766.76	0.16%
150	600598	北大荒	139,200	825,456.00	0.16%
151	600196	复星医药	133,842	823,128.30	0.16%
152	000807	云铝股份	77,034	821,182.44	0.16%
153	000717	韶钢松山	226,752	816,307.20	0.15%
154	000758	中色股份	98,885	815,801.25	0.15%
155	600132	重庆啤酒	32,244	809,324.40	0.15%
156	600270	外运发展	102,843	807,317.55	0.15%
157	600639	浦东金桥	68,506	807,000.68	0.15%
158	000009	S 深宝安 A	189,140	800,062.20	0.15%
159	600569	安阳钢铁	286,554	799,485.66	0.15%
160	600643	S 爱建	91,621	798,018.91	0.15%
161	000933	神火股份	70,926	795,080.46	0.15%
162	000970	中科三环	85,927	791,387.67	0.15%
163	000581	威孚高科	102,032	789,727.68	0.15%
164	600027	华电国际	258,707	789,056.35	0.15%
165	000900	现代投资	78,420	781,063.20	0.15%
166	600588	用友软件	25,747	778,331.81	0.15%
167	600266	北京城建	67,501	774,236.47	0.15%
168	600550	天威保变	41,866	764,054.50	0.14%
169	600210	紫江企业	283,134	744,642.42	0.14%
170	000927	一汽夏利	137,858	743,054.62	0.14%
171	600006	东风汽车	225,305	725,482.10	0.14%
172	000425	徐工科技	109,687	725,031.07	0.14%
173	000022	深赤湾 A	39,499	723,226.69	0.14%
174	600616	第一食品	51,865	720,923.50	0.14%
175	600875	东方电机	26,600	720,860.00	0.14%
176	600151	航天机电	84,471	718,848.21	0.14%
177	000488	晨鸣纸业	136,601	715,789.24	0.14%
178	600153	建发股份	87,093	713,291.67	0.13%
179	600058	五矿发展	96,342	705,223.44	0.13%
180	000012	南 玻 A	64,058	704,638.00	0.13%
181	600970	中材国际	24,000	693,600.00	0.13%
182	000400	许继电气	74,877	693,361.02	0.13%
183	600221	海南航空	192,365	692,514.00	0.13%
184	600741	巴士股份	187,952	680,386.24	0.13%
185	000401	冀东水泥	135,806	677,671.94	0.13%
186	600220	江苏阳光	162,996	674,803.44	0.13%
187	000960	锡业股份	75,951	673,685.37	0.13%
188	000937	金牛能源	110,321	657,513.16	0.12%
189	000912	泸 天 化	82,472	655,652.40	0.12%
190	000875	吉电股份	219,567	654,309.66	0.12%
191	600849	上海医药	95,243	648,604.83	0.12%

192	600021	上海电力	133,558	646,420.72	0.12%
193	600035	楚天高速	153,544	641,813.92	0.12%
194	000767	漳泽电力	124,713	636,036.30	0.12%
195	600655	豫园商城	53,000	622,220.00	0.12%
196	600997	开滦股份	78,893	620,887.91	0.12%
197	000682	东方电子	220,723	620,231.63	0.12%
198	600851	海欣股份	158,812	617,778.68	0.12%
199	000969	安泰科技	56,593	615,731.84	0.12%
200	600236	桂冠电力	115,307	614,586.31	0.12%
201	000559	万向钱潮	144,500	612,680.00	0.12%
202	000822	山东海化	124,571	602,923.64	0.11%
203	600138	中青旅	46,713	598,393.53	0.11%
204	600108	亚盛集团	283,969	596,334.90	0.11%
205	600508	上海能源	82,131	592,164.51	0.11%
206	000917	电广传媒	76,876	588,870.16	0.11%
207	600780	通宝能源	198,379	587,201.84	0.11%
208	600012	皖通高速	98,368	576,436.48	0.11%
209	600062	双鹤药业	74,782	573,577.94	0.11%
210	000422	湖北宜化	122,323	571,248.41	0.11%
211	600597	光明乳业	88,810	565,719.70	0.11%
212	600812	华北制药	234,321	557,683.98	0.11%
213	600171	上海贝岭	103,560	557,152.80	0.11%
214	600215	长春经开	106,566	548,814.90	0.10%
215	600256	广汇股份	97,568	544,429.44	0.10%
216	000550	江铃汽车	43,837	543,578.80	0.10%
217	000518	四环生物	233,481	539,341.11	0.10%
218	600060	海信电器	83,412	538,007.40	0.10%
219	600521	华海药业	39,600	536,184.00	0.10%
220	600170	上海建工	101,173	527,111.33	0.10%
221	600282	南钢股份	132,915	514,381.05	0.10%
222	600662	强生控股	124,536	505,616.16	0.10%
223	600820	隧道股份	100,729	502,637.71	0.09%
224	600088	中视传媒	33,434	501,175.66	0.09%
225	600654	飞乐股份	217,900	501,170.00	0.09%
226	600535	天士力	32,400	499,608.00	0.09%
227	000520	长航凤凰	153,108	499,132.08	0.09%
228	600747	大显股份	214,936	494,352.80	0.09%
229	000601	韶能股份	138,215	490,663.25	0.09%
230	600770	综艺股份	40,688	483,780.32	0.09%
231	600460	士兰微	53,900	479,171.00	0.09%
232	600863	内蒙华电	170,027	467,574.25	0.09%
233	000617	S 济 柴	27,000	458,730.00	0.09%
234	600110	中科英华	56,510	451,514.90	0.09%

235	000939	凯迪电力	55,434	442,917.66	0.08%
236	000541	佛山照明	46,535	438,825.05	0.08%
237	600754	锦江股份	38,148	437,557.56	0.08%
238	600591	上海航空	122,874	437,431.44	0.08%
239	600884	杉杉股份	81,261	433,933.74	0.08%
240	600621	上海金陵	118,999	426,016.42	0.08%
241	000659	珠海中富	135,781	423,636.72	0.08%
242	000066	长城电脑	77,401	423,383.47	0.08%
243	600652	爱使股份	110,659	422,717.38	0.08%
244	600602	广电电子	136,250	422,375.00	0.08%
245	600166	福田汽车	120,124	413,226.56	0.08%
246	000962	东方钨业	60,232	413,191.52	0.08%
247	000707	双环科技	104,686	408,275.40	0.08%
248	600548	深高速	81,534	403,593.30	0.08%
249	600087	南京水运	72,659	401,077.68	0.08%
250	600117	西宁特钢	97,568	393,199.04	0.07%
251	000698	沈阳化工	71,573	391,504.31	0.07%
252	600410	华胜天成	15,600	387,816.00	0.07%
253	000636	风华高科	107,600	386,284.00	0.07%
254	000029	深深房 A	75,544	370,165.60	0.07%
255	000786	北新建材	81,144	367,582.32	0.07%
256	600637	广电信息	91,444	356,631.60	0.07%
257	000726	鲁 泰 A	43,966	346,012.42	0.07%
258	000733	振华科技	70,673	344,884.24	0.07%
259	600581	八一钢铁	75,800	333,520.00	0.06%
260	600078	澄星股份	56,365	331,426.20	0.06%
261	600091	明天科技	75,968	324,383.36	0.06%
262	000068	S 三 星	66,255	304,110.45	0.06%
263	000708	大冶特钢	50,696	299,106.40	0.06%
264	000099	中信海直	72,363	294,517.41	0.06%
265	600377	宁沪高速	56,196	291,657.24	0.06%
266	600674	川投能源	65,902	287,991.74	0.05%
267	600057	夏新电子	72,684	287,828.64	0.05%
268	600740	山西焦化	34,616	287,658.96	0.05%
269	600399	抚顺特钢	59,221	190,099.41	0.04%
合计				502,912,681.79	95.00%

2、新股投资部分

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	601628	中国人寿	23,000	434,240.00	0.08%

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末基金资产净值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)	占期末基金资产净值比例
1	600036	招商银行	112,204,543.84	21.19%

2	600519	贵州茅台	53,574,390.64	10.12%
3	600028	中国石化	49,188,587.24	9.29%
4	600900	长江电力	48,693,600.52	9.20%
5	600050	中国联通	47,854,000.39	9.04%
6	600016	民生银行	43,619,314.87	8.24%
7	000002	万科A	42,662,421.62	8.06%
8	600019	宝钢股份	39,705,443.46	7.50%
9	600583	海油工程	36,662,091.59	6.93%
10	000001	S 深发展 A	28,965,131.29	5.47%
11	600030	中信证券	28,438,138.85	5.37%
12	600009	上海机场	26,275,576.30	4.96%
13	600348	国阳新能	25,861,191.14	4.88%
14	600000	浦发银行	24,673,208.02	4.66%
15	000858	五粮液	19,565,761.21	3.70%
16	600320	振华港机	19,384,025.78	3.66%
17	600018	上港集团	19,143,684.27	3.62%
18	000402	金融街	18,969,175.93	3.58%
19	000063	中兴通讯	17,724,768.58	3.35%
20	000069	华侨城 A	17,724,534.32	3.35%
21	600718	东软股份	17,681,168.96	3.34%
22	000898	鞍钢股份	16,477,063.26	3.11%
23	600362	江西铜业	16,203,097.54	3.06%
24	600005	武钢股份	15,398,025.70	2.91%
25	000930	丰原生化	15,296,450.12	2.89%
26	600085	同仁堂	15,229,011.33	2.88%
27	600832	东方明珠	15,007,360.31	2.83%
28	600015	华夏银行	14,637,336.40	2.76%
29	000039	中集集团	14,572,062.39	2.75%
30	000024	招商地产	14,425,053.81	2.72%
31	600887	伊利股份	13,266,284.69	2.51%
32	600104	上海汽车	12,654,997.28	2.39%
33	600269	赣粤高速	12,363,260.36	2.34%
34	600500	中化国际	11,955,276.41	2.26%
35	000060	中金岭南	11,473,504.03	2.17%
36	600177	雅戈尔	11,419,047.48	2.16%
37	600642	申能股份	11,373,742.16	2.15%
38	000021	长城开发	11,336,421.91	2.14%
39	600688	S 上石化	10,890,564.50	2.06%
40	600795	国电电力	10,847,536.21	2.05%
41	601988	中国银行	10,846,484.02	2.05%
42	600037	歌华有线	10,774,581.06	2.04%
43	600308	华泰股份	10,693,912.51	2.02%

2、本报告期内累计卖出价值超出期末基金资产净值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	占期末基金资产净值比例
1	600036	招商银行	117,623,213.11	22.22%
2	600519	贵州茅台	56,690,728.10	10.71%
3	600028	中国石化	49,238,642.24	9.30%
4	600050	中国联通	48,605,055.79	9.18%
5	600900	长江电力	43,183,839.00	8.16%
6	600583	海油工程	41,762,701.19	7.89%
7	600016	民生银行	39,049,789.70	7.38%
8	000002	万 科 A	35,933,794.88	6.79%
9	600019	宝钢股份	34,441,412.42	6.51%
10	600030	中信证券	31,795,641.12	6.01%
11	600348	国阳新能	29,483,331.61	5.57%
12	600009	上海机场	26,705,305.15	5.04%
13	000001	S 深发展 A	25,584,338.72	4.83%
14	000858	五 粮 液	21,655,840.80	4.09%
15	600018	上港集团	20,690,056.12	3.91%
16	600320	振华港机	19,717,311.81	3.72%
17	600000	浦发银行	19,614,858.67	3.71%
18	000402	金 融 街	18,490,562.10	3.49%
19	000069	华侨城 A	17,401,729.95	3.29%
20	600362	江西铜业	17,386,183.76	3.28%
21	600104	上海汽车	15,353,435.75	2.90%
22	000063	中兴通讯	15,284,539.09	2.89%
23	000039	中集集团	15,237,907.91	2.88%
24	000930	丰原生化	15,096,045.29	2.85%
25	600085	同仁堂	14,960,828.21	2.83%
26	600832	东方明珠	14,177,719.58	2.68%
27	000898	鞍钢股份	13,624,057.04	2.57%
28	000024	招商地产	13,601,395.95	2.57%
29	600015	华夏银行	13,110,147.00	2.48%
30	600718	东软股份	12,920,711.67	2.44%
31	600005	武钢股份	12,725,687.15	2.40%
32	600500	中化国际	12,609,373.78	2.38%
33	600887	伊利股份	12,583,375.20	2.38%
34	000021	长城开发	12,205,049.37	2.31%
35	600269	赣粤高速	12,147,623.88	2.29%
36	600694	大商股份	11,317,840.91	2.14%
37	600795	国电电力	11,272,813.57	2.13%
38	600631	百联股份	11,235,944.08	2.12%
39	000060	中金岭南	11,209,868.54	2.12%
40	600879	火箭股份	10,981,861.68	2.07%
41	000423	S 阿 胶	10,873,586.30	2.05%
42	000629	新 钢 钒	10,809,597.20	2.04%

43	000793	华闻传媒	10,790,666.32	2.04%
44	600309	烟台万华	10,691,100.46	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	1,975,808,326.52
卖出股票的收入总额	1,872,288,480.06

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

无。

(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)	期末数 量(份)	获得 方式
1	038005	深能 JTP1	1,120,374	0	0.00	1,120,374	1,454,341.07	0	股权分 置改革 对价支 付
2	038006	中集 ZYP1	910,000	0	0.00	910,000	2,274,797.38	0	
3	038008	钾肥 JTP1	180,000	0	0.00	180,000	620,217.98	0	
4	580007	长电 CWB1	808,490	0	0.00	808,490	3,744,732.99	0	
5	580990	茅台 JCP1	2,051,498	0	0.00	2,051,498	5,808,842.86	0	
6	580008	国电 JTB1	118,403	0	0.00	118,403	266,757.41	0	
7	580009	伊利 CWB1	52,920	0	0.00	52,920	698,135.14	0	
8	580010	马钢 CWB1		495,190	347,128.19	495,190	665,978.93	0	老股东 配售分 离交易 可转债 获配权 证
9	031002	钢钒 GFC1		179,250	141,069.75	179,250	364,995.73	0	
合计					488,197.94		15,898,799.49		

4、其他资产的构成：

项目	金额（元）
应收证券清算款	9,987,208.48
应收交易保证金	250,000.00
应收利息	5,348.25
应收申购款	486,332.41
合计	10,728,889.14

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

项目名称	基金份额（份）
报告期间买入基金份额(认购)	30,005,750.00
报告期间卖出基金份额	30,005,750.00
报告期末持有基金份额	0.00

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	13,144 户
报告期末平均每户持有的基金份额	23,881.32 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	313,896,083.57	100.00%
其中：机构投资者持有的基金份额	13,980,359.55	4.45%
个人投资者持有的基金份额	299,915,724.02	95.55%

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	1,813,356,066.47
本报告期期初基金份额总额	1,813,356,066.47
加：本报告期间总申购份额	313,462,536.65
减：本报告期间总赎回份额	1,812,922,519.55
本报告期末基金份额总额	313,896,083.57

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：

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5月27日，本基金管理人在证券时报发布《大成基金管理有限公司关于基金经理变更的公告》，聘任杨丹先生担任大成沪深300指数证券投资基金经理职务，原基金经理施永辉先生不再担任大成沪深300指数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、本基金在本报告期无收益分配事项。

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安永华明会计师事务所，本年度支付的审计费用为9万元整。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
联合证券	1	1,977,889,127.36	51.47%	1,585,176.81	51.64%
国金证券	1	1,196,963,113.08	31.15%	936,635.15	30.51%
中银国际	1	667,878,042.55	17.38%	547,662.62	17.84%
合计	3	3,842,730,282.99	100.00%	3,069,474.58	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
联合证券	0.00		3,668,700,000.00	100.00%
国金证券	2,326,749.40	55.88%	0.00	0.00%
中银国际	1,837,380.50	44.12%	0.00	0.00%
合 计	4,164,129.90	100.00%	3,668,700,000.00	100.00%

3、权证交易情况

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
联合证券	9,554,316.34	60.09%
国金证券	4,714,823.72	29.65%
中银国际	1,630,997.93	10.26%
合 计	15,900,137.99	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
联合证券有限责任公司	无

国金证券有限责任公司	
中银国际证券有限责任公司	

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	大成沪深 300 指数证券投资基金基金合同、大成沪深 300 指数证券投资基金 基金份额发售公告、大成沪深 300 指数证券投资基金招募说明书	证券时报	2006 年 2 月 27 日
2	大成沪深 300 指数证券投资基金基金合同生效公告	证券时报	2006 年 4 月 7 日
3	大成沪深 300 指数证券投资基金开放申购与赎回业务公告	证券时报	2006 年 4 月 20 日
4	关于大成沪深 300 指数证券投资基金开放申购与赎回业务的补充公告	证券时报	2006 年 4 月 22 日
5	大成沪深 300 指数证券投资基金开放场内申购与赎回业务公告	证券时报	2006 年 4 月 25 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	大成基金管理有限公司关于旗下部分基金申购中国银行 A 股的公告	证券时报、中国证券报和上海证券报	2006 年 6 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
11	关于赎回大成沪深 300 指数证券投资基金的公告	证券时报	2006 年 11 月 22 日

第十一节 备查文件目录

一、备查文件目录：

- 1、《关于同意大成沪深 300 指数证券投资基金募集的批复》；
- 2、《关于大成沪深 300 指数证券投资基金备案确认的函》；
- 3、《大成沪深 300 指数证券投资基金基金合同》；
- 4、《大成沪深 300 指数证券投资基金托管协议》；
- 5、大成基金管理有限公司批准文件、营业执照、公司章程；
- 6、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