

大成价值增长证券投资基金 2007 年半年度报告

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 8 月 27 日

重要提示

本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。本半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。

本基金托管人中国农业银行根据本基金合同规定，于 2007 年 8 月 22 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。

本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及更新。

本报告期为 2007 年 1 月 1 日至 2007 年 6 月 30 日止，本报告中财务资料未经审计。

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 基金管理人报告	3
第四节 基金托管人报告	4
第五节 财务会计报告	5
第六节 投资组合报告	12
第七节 基金份额持有人情况	19
第八节 开放式基金份额变动.....	19
第九节 重大事件揭示	19
第十节 备查文件目录	22

第一节 基金简介

一、基金基本资料

- | | |
|-----------------|--------------------|
| 1、基金名称: | 大成价值增长证券投资基金 |
| 2、基金简称: | 大成价值增长 |
| 3、基金交易代码: | 090001 |
| 4、基金运作方式: | 契约型开放式 |
| 5、基金合同生效日: | 2002 年 11 月 11 日 |
| 6、报告期末基金份额总额: | 2,408,746,116.43 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: | 以价值增长类股票为主构造投资组合,在有效分散投资风险的基础上,通过资产配置和投资组合的动态调整,达到超过市场的风险收益比之目标,实现基金资产的长期稳定增值。 |
| 2、投资策略: | 本基金投资策略分三个层次:资产配置和行业配置遵循自上而下的积极策略,个股选择遵循自下而上的积极策略。本基金的股票投资重点关注:低 P/B 值、具有可持续增长潜力、盈利水平超过行业平均水平、具有核心竞争力的优势企业。 |
| 3、业绩比较基准: | 中信价值指数×80%+中信国债指数×20% |
| 4、风险收益特征: | 无 |

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: | 项俊波 |
| 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》 |
| 登载半年度报告正文的管理人互联网 | http://www.dcfund.com.cn |

网址:**基金半年度报告置备地点:**

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

基金注册登记机构办公地址:

深圳市福田区深南大道 7088 号招商银行大厦 32 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	指标名称	2007年1月1日至2007年6月30日
1	基金本期净收益	1,112,073,239.27
2	基金份额本期净收益	0.3401
3	期末可供分配基金收益	1,055,055,912.99
4	期末可供分配基金份额收益	0.4380
5	期末基金资产净值	3,463,802,029.42
6	期末基金份额净值	1.4380
7	基金加权平均净值收益率	28.01%
8	本期基金份额净值增长率	61.76%
9	基金份额累计净值增长率	320.73%

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1个月	-1.90%	2.40%	-6.38%	2.77%	4.48%	-0.37%
过去3个月	31.19%	1.96%	27.94%	2.30%	3.25%	-0.34%
过去6个月	61.76%	1.89%	80.24%	2.24%	-18.48%	-0.35%
过去1年	117.27%	1.57%	130.13%	1.80%	-12.86%	-0.23%
过去3年	254.27%	1.22%	178.65%	1.40%	75.62%	-0.18%
自基金合 同生效起 至今	320.73%	1.08%	151.04%	1.27%	169.69%	-0.19%

2、基金合同生效以来基金份额净值的变动情况及同期业绩比较基准的变动

大成价值增长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

(2002年11月11日至2007年6月30日)



注：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七条之（六）投资组合中规定的各项比例。

第三节 基金管理人报告

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 2007 年 6 月 30 日，本基金管理人共管理 3 只封闭式证券投资基金：基金景宏、基金景阳、基金景福以及 9 只开放式证券投资基金：大成价值增长证券投资基金、大成债券投资基金、大成蓝筹稳健证券投资基金、大成精选增值混合型证券投资基金、大成货币市场证券投资基金、大成沪深 300 指数证券投资基金、大成财富管理 2020 生命周期证券投资基金、大成积极成长股票型证券投资基金、大成创新成长混合型证券投资基金。

2、基金经理小组简介

杨建华，基金经理，工商管理硕士，经济学博士研究生，先后毕业于北京航空航天大学 and 西南财经大学。9 年证券从业经历，曾任光大证券研究所研究员、四川启明星投资公司总经理助理。2004 年 4 月进入大成基金管理有限公司，2006 年 1 月起担任大成价值增长证券投资基金基金经理，现同时兼任基金景阳基金经理。

黄万青女士，基金经理助理，经济学硕士，8 年证券从业经历。先后毕业于同济大学 and 中国人民大学，1999 年加入大成基金管理有限公司，先后任交易部交易员、债券基金经理助理、景福基金经理助理、固定收益小组股票型基金债券投资经理。2007 年 7 月起担任大成价值增长基金基金经理助理。

何光明先生，基金经理助理，13 年证券从业经历。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、策略分析师和基金经理。2007 年 7 月起不再担任大成价值增长基金基金经理助理。

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》、《大成价值增长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，大成价值增长基金的投资范围、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、2007 年上半年证券市场回顾和基金运作回顾

2007年上半年沪深股市大幅上涨，其中上证综合指数上涨42.8%，同期沪市近700只股票涨幅超过50%，只有100多只股票（约占沪市上市公司10%的比例）涨幅小于40%，跑输大盘。从行业板块看，贸易、化纤、纺织服装、有色、煤炭、家电、医药、电力等估值相对低而且行业基本面向好的行业涨幅居前，而通信、传媒、金融、石化等由于去年底被过度追捧而估值相对较高的行业落后于大盘。从主题投资看，购并重组和资产注入是市场追逐的热点，外延式增长的预期是低价绩差股股价上涨的动力。

经过前5个月的快速上涨，市场出现一定程度上的非理性繁荣，5月底印花税的提高是市场调整的导火线，经过大幅的震荡，市场的风险得到一定的释放，市场开始逐步回归理性。

基于去年下半年以来大盘蓝筹股已强劲上升，相当多的蓝筹股其未来两年的业绩增长和政策利好因素都已在股价中充分体现，因此，从年初以来，我们就开始思考全流通大背景下外延增长驱动问题。我们认为，上市公司股改后，其大股东的利益和流通股股东的利益逐步得到统一，在目前中国经济资产证券化比例仍偏低的情况下，充分利用资本市场这个平台，迅速做大做强企业是已上市和尚未上市企业共同的心愿。在外有政策支持、内有国有资产需要全面整合和民营企业借助资本市场迅速壮大的推动下，优质资产注入和整体上市等外延增长将成为未来相当长一段时间 A 股市场非常重要的驱动力。

按照这种思路，轻大盘重个股是我们主要的对策。我们在年初对基金组合进行了适当的调整，主要仓位配置在地产、证券、银行、钢铁、化工、零售等行业，适当减持了组合中估值偏贵的蓝筹股，增持有外延增长预期或者内涵增长可能进一步超预期的蓝筹股。在控制风险的前提下，以适度分散方式买入股改中承诺有优质资产注入、央企控股和地方国资控股的有优质资产注入和整体上市预期的个股，并进行适度的波段操作，同时一直维持较高的股票仓位。

2007 年上半年上证综合指数上涨 42.8%，本基金净值上涨 61.76%，远好于同期上证指数的表现。

2、2007 年下半年证券市场展望和基金投资策略

展望 2007 年下半年，我们对市场继续持乐观态度。我们认为由于流动性泛滥以及通胀压力的增加，政府在下半年还会出台一系列的紧缩措施，但宏观经济的快速增长、人民币升值速度的加快、上市公司业绩的超预期释放等将进一步夯实市场的牛市基础，市场总体趋势将是震荡向上，上市公司盈利的增长预期使得市场的整体估值水平将再上一台阶。

在行业及个股选择策略上，我们重点看好如下三类主题：第一类是人民币升值受益最大的资产类、金融服务类行业，如房地产、银行、保险等行业；第二类是在消费升级的背景下受益较大的品牌消费品、零售、酒店旅游等行业；第三类是具有出口比较优势的机械装备、钢铁、有色金属等。我们以上述三类主题为主线，从中选择价值成长股，动态调整组合，不断优化组合，争取以较好的回报答谢基金份额持有人对本基金的厚爱。

第四节 基金托管人报告

在托管大成价值增长证券投资基金的过程中，本基金托管人——中国农业银行严格遵守《证券投资基金法》相关法律法规的规定以及《大成价值增长证券投资基金合同》、《大成价值增长证券投资基金托管协议》的约定，对大成价值增长证券投资基金管理人——大成基金管理有限公司 2007 年 1 月 1 日至 2007 年 6 月 30 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，大成基金管理有限公司在大成价值增长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。

本托管人认为，大成基金管理有限公司的信息披露事务符合《证券投资基金信息披露管理办法》及其他相关法律法规的规定，基金管理人所编制和披露的大成价值增长证券投资基金半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、投资组合报告等信息真实、准确、完整，未发现有关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 8 月 22 日

第五节 财务会计报告（未经审计）

一、基金会计报表(除特别注明外，金额单位为人民币元)

1、2007 年 6 月 30 日资产负债表

	附注	2007 年 6 月 30 日	2006 年 12 月 31 日
资产			
银行存款		19,539,653.94	98,455,299.17
清算备付金		11,108,044.58	4,418,714.16
交易保证金		2,976,164.85	1,160,000.00
应收证券清算款		10,149,296.93	7,242,926.54
应收股利		791,964.00	0.00
应收利息	4(1)	12,031,186.90	741,489.87
应收申购款		3,195,855.41	508,577.30
其他应收款		0.00	0.00
股票投资市值		2,716,153,139.80	422,299,312.42
其中：股票投资成本		1,933,690,092.17	274,897,299.09
债券投资市值		702,543,549.80	115,470,145.00
其中：债券投资成本		707,914,294.79	114,240,661.43
权证投资		14,777,370.00	0.00
其中：权证投资成本		0.00	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		3,493,266,226.21	650,296,464.46
负债			
应付证券清算款		0.00	100,107,000.00
应付赎回款		19,420,045.28	347,000.29
应付赎回费		31,108.75	682.86
应付管理人报酬		4,774,516.23	720,029.30
应付托管费		795,752.70	120,004.87

应付佣金	4 (3)	3,480,031.65	789,218.01
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	4 (4)	783,230.00	782,037.60
卖出回购证券款		0.00	0.00
短期借款		0.00	0.00
预提费用	4 (5)	179,512.18	370,000.00
其他负债		0.00	0.00
负债合计		29,464,196.79	103,235,972.93
持有人权益			
实收基金	4 (6)	2,408,746,116.43	260,795,579.64
未实现利得	4 (7)	-18,297,192.06	52,424,488.06
未分配收益		1,073,353,105.05	233,840,423.83
持有人权益合计		3,463,802,029.42	547,060,491.53
负债及持有人权益总计		3,493,266,226.21	650,296,464.46
基金份额净值		1.4380	2.0977

所附附注为本会计报表的组成部分

2、2007 年 1 月 1 日至 6 月 30 日止期间经营业绩表

	附注	2007年1月1日 至2007年6月30日	2006年1月1日 至2006年6月30日
一、收入		1,151,245,309.52	230,055,454.83
1、股票差价收入	4 (8)	1,113,557,918.88	214,088,974.38
2、债券差价收入	4 (9)	2,377,195.03	-360,142.85
3、权证差价收入	4 (10)	7,244,265.04	8,645,330.22
4、债券利息收入		10,934,189.56	2,195,731.67
5、存款利息收入		1,441,402.77	139,336.09
6、股利收入		12,611,529.60	4,858,756.87
7、买入返售证券收入		0.00	0.00
8、其他收入	4 (11)	3,078,808.64	487,468.45
二、费用		39,172,070.25	6,453,315.38
1、基金管理人报酬		29,687,846.76	5,184,354.12
2、基金托管费		4,947,974.50	864,059.11
3、卖出回购证券支出		4,316,385.93	184,059.04
4、利息支出		0.00	0.00
5、其他费用	4 (12)	219,863.06	220,843.11
其中：上市年费		0.00	0.00
信息披露费		148,767.52	148,767.52
审计费用		30,744.66	51,076.39
三、基金净收益		1,112,073,239.27	223,602,139.45
加：未实现利得		633,103,162.33	81,031,189.80
四、基金经营业绩		1,745,176,401.60	304,633,329.25

所附附注为本会计报表的组成部分

3、2007 年 1 月 1 日至 6 月 30 日止期间基金收益分配表

	附注	2007年1月1日	2006年1月1日
--	----	-----------	-----------

		至2007年6月30日	至2006年6月30日
基金净收益		1,112,073,239.27	223,602,139.45
加：期初基金净收益		233,840,423.83	39,519,781.39
加：本期损益平准金		259,520,058.05	-70,752,831.29
可供分配基金净收益		1,605,433,721.15	192,369,089.55
减：本期已分配基金净收益	4（13）	532,080,616.10	17,666,305.11
期末基金净收益		1,073,353,105.05	174,702,784.44

所附附注为本会计报表的组成部分

4、2007年1月1日至6月30日止期间基金净值变动表

	附注	2007年1月1日 至2007年6月30日	2006年1月1日 至2006年6月30日
一、期初基金净值		547,060,491.53	920,175,454.23
二、本期经营活动			
基金净收益		1,112,073,239.27	223,602,139.45
未实现利得		633,103,162.33	81,031,189.80
经营活动产生的基金净值变动数		1,745,176,401.60	304,633,329.25
三、本期基金份额交易			
基金申购款		6,767,844,182.66	228,219,806.23
基金赎回款		-5,064,198,430.27	-804,632,213.79
基金份额交易产生的基金净值变动数		1,703,645,752.39	-576,412,407.56
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	4（13）	-532,080,616.10	-17,666,305.11
五、期末基金净值		3,463,802,029.42	630,730,070.81

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. 主要会计政策及会计估计

本基金本报告期会计报表所采用的会计政策、会计估计与上年度会计报表是一致的。

附注2. 本报告期重大会计差错的内容和更正金额

无。

附注3. 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、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2007年6月7日被河南省中牟县人民法院冻结，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	2007年1月1日 至 2007 年 6 月 30 日		2006 年 1 月 1 日 至 2006 年 6 月 30 日	
	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	3,210,145,647.09	30.93%	527,175,142.90	22.25%
银河证券	204,883,049.44	1.97%	261,300,275.15	11.03%
合计	3,415,028,696.53	32.90%	788,475,418.05	33.28%

B 债券买卖

关联方名称	2007年1月1日 至 2007 年 6 月 30 日		2006 年 1 月 1 日 至 2006 年 6 月 30 日	
	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	501,403,750.80	35.78%	70,285,732.50	24.44%

C 债券回购

关联方名称	2007年1月1日 至 2007 年 6 月 30 日		2006 年 1 月 1 日 至 2006 年 6 月 30 日	
	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	1,791,000,000.00	57.85%	372,800,000.00	81.97%

D 权证买卖

关联方名称	2007年1月1日 至 2007 年 6 月 30 日		2006 年 1 月 1 日 至 2006 年 6 月 30 日	
	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	39,388,538.36	79.54%	5,796,764.86	48.85%

E 佣金

关联方名称	2007年1月1日 至 2007 年 6 月 30 日		2006 年 1 月 1 日 至 2006 年 6 月 30 日	
	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	2,619,179.97	31.35%	427,844.35	22.52%
银河证券	160,321.95	1.92%	204,469.51	10.76%
合计	2,779,501.92	33.27%	632,313.86	33.28%

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，并由券商承担的证券结算风险基金后的净额列示。

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。

A 本报告期与关联方进行银行间债券买卖和回购交易情况：

无。

B 上年度可比期间 2006 年 1 月 1 日至 2006 年 6 月 30 日与关联方进行银行间债券买卖和回购交易情况：

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 1.5% 的年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 1.5\% / \text{当年天数}$$

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两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 29,687,846.76 元，其中已支付基金管理人人民币 24,913,330.53 元，尚余人民币 4,774,516.23 元未支付。（2006 年 1 月 1 日至 2006 年 6 月 30 日共计提基金管理费 5,184,354.12 元，已全部支付。）

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 0.25% 的年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 0.25\% / \text{当年天数}$$

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两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 4,947,974.50 元，其中已支付基金托管人人民币 4,152,221.80 元，尚余人民币 795,752.70 元未支付。（2006 年 1 月 1 日至 2006 年 6 月 30 日共计提基金托管费 864,059.11 元，已全部支付）。

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 2007 年 6 月 30 日保管的银行存款余额为 19,539,653.94 元。本期由基金托管人保管的银行存款产生的利息收入为 1,300,726.25 元（2006 年 6 月 30 日基金托管人保管的银行存款余额为 69,707,582.25 元，2006 年 1 月 1 日至 6 月 30 日由基金托管人保管的银行存款利息收入为 119,788.07 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。

C 大成基金管理有限公司基金从业人员投资本基金情况
无。

附注 4. 基金会计报表重要项目说明

(1) 应收利息

项目	2007年6月30日
应收银行存款利息	33,964.53
应收清算备付金利息	4,764.37
应收保证金利息	64.80
应收债券利息	11,992,393.20
合计	12,031,186.90

(2) 投资估值增值

项目	2007年6月30日
----	------------

股票估值增值	782,463,047.63
债券估值增值	-5,370,744.99
权证估值增值	4,642,356.59
合计	781,734,659.23

(3) 应付佣金

券商名称	2007年6月30日
海通证券	744,016.64
世纪证券	13,378.26
光大证券	1,232,266.56
招商证券	489,862.82
中金公司	840,185.42
银河证券	160,321.95
合计	3,480,031.65

(4) 其他应付款

项目	2007年6月30日
应付席位交易保证金	750,000.00
应付债券利息税	31,920.00
后端申购费	1,310.00
合计	783,230.00

(5) 预提费用

项目	2007年6月30日
预提审计费用	30,744.66
预提信息披露费	148,767.52
合计	179,512.18

(6) 实收基金

项目	2007年1月1日至2007年6月30日止
期初数	260,795,579.64
加：本期因申购的增加数	6,253,857,528.84
减：本期因赎回的减少数	4,105,906,992.05
期末数	2,408,746,116.43

(7) 未实现利得

项目	2007年6月30日
投资估值增值	781,734,659.23
其中：股票投资估值增值	782,463,047.63
债券投资估值增值	-5,370,744.99
权证投资估值增值	4,642,356.59
未实现利得平准金	-800,031,851.29
其中：申购（含转入）	-752,653,185.99
赎回（含转出）	-47,378,665.30
合计	-18,297,192.06

(8) 股票差价收入

项目	2007年1月1日至2007年6月30日
卖出股票成交总额	4,949,472,444.97

减：卖出股票成本总额	3,831,760,275.03
减：应付佣金	4,154,251.06
股票差价收入	1,113,557,918.88

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2,210.20元，已全额冲减股票投资成本。

(9) 债券差价收入

项目	2007年1月1日至2007年6月30日
卖出债券成交总额	877,941,152.45
减：卖出债券成本总额	864,346,139.63
减：应收利息总额	11,217,817.79
债券差价收入	2,377,195.03

(10) 权证差价收入

项目	2007年1月1日至2007年6月30日
卖出权证成交总额	12,803,926.57
减：卖出权证成本总额	5,559,661.53
权证差价收入	7,244,265.04

(11) 其他收入

项目	2007年1月1日至2007年6月30日
赎回基金补偿收入(*)	3,078,808.64

*本基金赎回费总额的25%归入基金资产。

(12) 其他费用

项目	2007年1月1日至2007年6月30日
信息披露费	148,767.52
审计费	30,744.66
债券账户维护费	10,250.00
回购交易费用	18,600.98
债券交易费	366.85
银行手续费	11,133.05
合计	219,863.06

(13) 本报告期已分配基金净收益

分配次数	2007年1月1日至2007年6月30日
1	532,080,616.10

附注5. 报告期末流通转让受到限制的基金资产

本基金截至2007年6月30日止投资的流通受限制的股票情况如下：

股票代码	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
601919	中国远洋	172,270	1,460,849.60	3,145,650.20	市价	网下申购新股尚未流通	2007-9-25

附注6. 其他重要事项

根据财政部、国家税务总局财税[2007]84号文，自2007年5月30日起，证券(股票)交易印花税税率，由现行1‰调整为3‰。

第六节 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	30,647,698.52	0.88%
股票	2,716,153,139.80	77.75%
债券	702,543,549.80	20.11%
权证	14,777,370.00	0.42%
其他资产	29,144,468.09	0.83%
合计	3,493,266,226.21	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	37,283,420.15	1.08%
B 采掘业	76,573,109.00	2.21%
C 制造业	1,345,759,780.17	38.85%
C0 食品、饮料	343,996,537.72	9.93%
C1 纺织、服装、皮毛	0.00	0.00%
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	278,921,434.32	8.05%
C5 电子	0.00	0.00%
C6 金属、非金属	223,055,082.62	6.44%
C7 机械、设备、仪表	311,390,209.66	8.99%
C8 医药、生物制品	188,396,515.85	5.44%
C99 其他制造业	0.00	0.00%
D 电力、煤气及水的生产和供应业	26,581,000.00	0.77%
E 建筑业	111,825,199.36	3.23%
F 交通运输、仓储业	33,005,389.86	0.95%
G 信息技术业	7,513,632.27	0.22%
H 批发和零售贸易	159,241,183.47	4.60%
I 金融、保险业	485,783,930.68	14.02%
J 房地产业	318,514,098.28	9.20%
K 社会服务业	38,472,426.26	1.11%
L 传播与文化产业	67,209,970.30	1.94%
M 综合类	8,390,000.00	0.24%
合计	2,716,153,139.80	78.42%

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)	市值占基金资产净值比例
1	600309	烟台万华	3,608,731	193,283,632.36	5.58%
2	600030	中信证券	2,700,000	143,019,000.00	4.13%
3	000651	格力电器	4,000,000	139,600,000.00	4.03%
4	600000	浦发银行	3,300,000	120,747,000.00	3.49%
5	000825	太钢不锈	6,000,000	120,360,000.00	3.47%
6	000858	五粮液	3,799,930	119,545,797.80	3.45%
7	000002	万科A	6,000,000	114,720,000.00	3.31%

8	600036	招商银行	4,000,000	98,320,000.00	2.84%
9	600748	上实发展	4,100,000	79,786,000.00	2.30%
10	600195	中牧股份	3,767,153	79,562,271.36	2.30%
11	600713	南京医药	6,000,000	76,140,000.00	2.20%
12	600879	火箭股份	2,700,000	71,793,000.00	2.07%
13	600383	金地集团	2,097,222	71,766,936.84	2.07%
14	600266	北京城建	2,400,000	68,016,000.00	1.96%
15	000895	双汇发展	1,090,477	63,138,618.30	1.82%
16	000898	鞍钢股份	3,499,878	61,912,841.82	1.79%
17	000001	深发展A	2,200,000	60,544,000.00	1.75%
18	600628	新世界	2,937,057	56,420,864.97	1.63%
19	600037	歌华有线	2,000,000	52,360,000.00	1.51%
20	000031	中粮地产	2,309,512	52,241,161.44	1.51%
21	601318	中国平安	686,868	49,117,930.68	1.42%
22	601666	平煤天安	2,690,900	48,463,109.00	1.40%
23	000568	泸州老窖	999,849	42,093,642.90	1.22%
24	000666	经纬纺机	4,671,760	40,410,724.00	1.17%
25	600519	贵州茅台	331,352	39,656,207.36	1.14%
26	600616	第一食品	1,500,000	37,680,000.00	1.09%
27	600058	五矿发展	1,486,824	33,750,904.80	0.97%
28	600820	隧道股份	2,999,928	33,359,199.36	0.96%
29	600161	天坛生物	1,000,000	32,110,000.00	0.93%
30	000525	红太阳	2,682,202	29,718,798.16	0.86%
31	600125	铁龙物流	2,599,922	28,677,139.66	0.83%
32	000860	顺鑫农业	2,200,000	28,512,000.00	0.82%
33	000933	神火股份	1,000,000	28,110,000.00	0.81%
34	600642	申能股份	1,900,000	26,581,000.00	0.77%
35	600231	凌钢股份	2,800,000	26,124,000.00	0.75%
36	000978	桂林旅游	1,321,095	23,449,436.25	0.68%
37	600750	江中药业	1,264,413	23,290,487.46	0.67%
38	000423	东阿阿胶	873,209	22,808,219.08	0.66%
39	000619	海螺型材	1,788,460	21,264,789.40	0.61%
40	000559	万向钱潮	2,200,000	19,294,000.00	0.56%
41	000852	江钻股份	729,981	18,614,515.50	0.54%
42	600299	星新材料	400,000	18,204,000.00	0.53%
43	002037	久联发展	1,285,173	16,450,214.40	0.47%
44	600138	中青旅	610,939	15,022,990.01	0.43%
45	000917	电广传媒	999,998	14,849,970.30	0.43%
46	000039	中集集团	499,940	14,658,240.80	0.42%
47	000790	华神集团	822,596	14,313,170.40	0.41%
48	601166	兴业银行	400,000	14,036,000.00	0.41%
49	600823	世茂股份	500,000	13,100,000.00	0.38%
50	600129	太极集团	719,787	12,401,930.01	0.36%
51	000090	深天健	500,000	10,450,000.00	0.30%
52	600327	大厦股份	899,599	9,895,589.00	0.29%
53	000680	山推股份	600,000	9,468,000.00	0.27%
54	600631	百联股份	499,930	8,393,824.70	0.24%

55	600607	上实医药	500,000	8,390,000.00	0.24%
56	600570	恒生电子	499,909	7,513,632.27	0.22%
57	600202	哈空调	499,998	7,459,970.16	0.22%
58	600201	金宇集团	606,009	7,332,708.90	0.21%
59	000663	永安林业	744,369	5,471,112.15	0.16%
60	000530	大冷股份	500,000	4,750,000.00	0.14%
61	000972	新中基	308,440	3,300,308.00	0.10%
62	601919	中国远洋	172,270	3,145,650.20	0.09%
63	601008	连云港	81,000	1,182,600.00	0.03%

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	600030	中信证券	330,044,755.63	60.33%
2	000002	万科A	215,570,484.13	39.41%
3	600309	烟台万华	202,957,467.64	37.10%
4	600320	振华港机	187,512,492.14	34.28%
5	600900	长江电力	156,005,943.62	28.52%
6	000858	五粮液	144,548,503.14	26.42%
7	000001	深发展A	129,022,505.92	23.58%
8	600005	武钢股份	126,101,922.66	23.05%
9	000623	吉林敖东	122,160,426.66	22.33%
10	600739	辽宁成大	121,564,717.78	22.22%
11	600000	浦发银行	112,331,116.74	20.53%
12	600549	厦门钨业	110,458,476.48	20.19%
13	000651	格力电器	109,444,681.64	20.01%
14	600016	民生银行	107,132,735.71	19.58%
15	600879	火箭股份	105,545,384.59	19.29%
16	600036	招商银行	102,237,387.32	18.69%
17	600009	上海机场	97,653,098.08	17.85%
18	000825	太钢不锈	96,093,588.87	17.57%
19	600019	宝钢股份	87,358,822.23	15.97%
20	000751	锌业股份	82,298,733.88	15.04%
21	600100	同方股份	79,997,294.31	14.62%
22	000898	鞍钢股份	77,800,911.49	14.22%
23	600748	上实发展	77,190,729.37	14.11%
24	601628	中国人寿	73,884,185.08	13.51%
25	600616	第一食品	67,465,356.14	12.33%
26	000157	中联重科	66,140,711.65	12.09%
27	600713	南京医药	65,447,431.06	11.96%
28	600059	古越龙山	63,870,722.07	11.68%
29	600195	中牧股份	62,319,108.84	11.39%
30	601166	兴业银行	61,662,399.82	11.27%
31	600795	国电电力	58,800,401.53	10.75%
32	000039	中集集团	58,156,621.43	10.63%
33	000917	电广传媒	56,752,775.60	10.37%
34	601666	平煤天安	51,892,313.56	9.49%
35	600037	歌华有线	51,751,911.53	9.46%

36	601318	中国平安	50,157,303.26	9.17%
37	000920	*ST 汇通	48,389,105.41	8.85%
38	600518	康美药业	46,491,165.26	8.50%
39	600519	贵州茅台	45,147,133.35	8.25%
40	600628	新世界	44,667,977.45	8.17%
41	600835	上海机电	43,284,543.59	7.91%
42	000666	经纬纺机	43,074,319.08	7.87%
43	600820	隧道股份	41,873,126.37	7.65%
44	600585	海螺水泥	41,021,072.64	7.50%
45	600380	健康元	39,903,985.72	7.29%
46	600323	南海发展	39,557,037.52	7.23%
47	600886	国投电力	39,068,931.60	7.14%
48	600058	五矿发展	38,960,728.52	7.12%
49	000972	新中基	38,843,495.69	7.10%
50	600266	北京城建	38,723,292.65	7.08%
51	600011	华能国际	38,171,040.78	6.98%
52	000031	中粮地产	38,038,827.54	6.95%
53	600348	国阳新能	37,553,845.01	6.86%
54	600718	东软股份	36,978,310.57	6.76%
55	000525	红太阳	35,214,374.44	6.44%
56	000652	泰达股份	34,209,300.46	6.25%
57	600125	铁龙物流	34,080,795.09	6.23%
58	600383	金地集团	33,989,778.74	6.21%
59	600161	天坛生物	32,866,100.00	6.01%
60	000978	桂林旅游	31,213,112.08	5.71%
61	000559	万向钱潮	29,921,578.21	5.47%
62	600183	生益科技	28,208,828.26	5.16%
63	000629	攀钢钢钒	27,711,534.66	5.07%
64	000568	泸州老窖	27,300,445.72	4.99%
65	600031	三一重工	25,219,818.29	4.61%
66	600694	大商股份	25,063,814.51	4.58%
67	000933	神火股份	25,012,938.83	4.57%
68	600415	小商品城	24,519,090.01	4.48%
69	000860	顺鑫农业	24,457,345.33	4.47%
70	600299	星新材料	24,156,516.36	4.42%
71	000063	中兴通讯	24,149,381.61	4.41%
72	600642	申能股份	24,039,722.62	4.39%
73	000619	海螺型材	22,138,812.01	4.05%
74	002037	久联发展	21,611,028.69	3.95%
75	600607	上实医药	20,893,285.51	3.82%
76	600316	洪都航空	20,566,993.14	3.76%
77	000069	华侨城 A	20,412,699.91	3.73%
78	000790	华神集团	20,078,779.99	3.67%
79	000852	江钻股份	20,018,201.75	3.66%
80	600022	济南钢铁	19,392,440.48	3.54%
81	600231	凌钢股份	18,596,687.23	3.40%
82	000060	中金岭南	15,750,073.87	2.88%

83	600811	东方集团	15,562,750.63	2.84%
84	600750	江中药业	14,916,259.32	2.73%
85	000600	建投能源	14,460,922.10	2.64%
86	002007	华兰生物	13,550,930.82	2.48%
87	600026	中海发展	13,497,858.27	2.47%
88	000888	峨眉山 A	13,046,040.00	2.38%
89	000090	深天健	11,439,830.10	2.09%
90	600327	大厦股份	11,387,751.16	2.08%
91	000530	大冷股份	11,109,536.42	2.03%

注：烟台万华（600309）买入金额中包含权证万华 HXB1（580005）行权时买入金额 26,585,751.10 元。

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	600030	中信证券	329,740,853.63	60.28%
2	000002	万科 A	242,317,970.82	44.29%
3	600320	振华港机	221,899,361.60	40.56%
4	000623	吉林敖东	208,862,679.77	38.18%
5	600739	辽宁成大	196,936,959.27	36.00%
6	600900	长江电力	189,273,763.26	34.60%
7	600005	武钢股份	175,441,350.69	32.07%
8	600309	烟台万华	130,598,207.65	23.87%
9	000858	五粮液	126,838,196.67	23.19%
10	600016	民生银行	119,892,384.20	21.92%
11	000001	深发展 A	115,419,471.56	21.10%
12	600549	厦门钨业	115,129,445.26	21.05%
13	000157	中联重科	108,217,728.73	19.78%
14	600748	上实发展	96,353,154.22	17.61%
15	000751	锌业股份	95,401,879.28	17.44%
16	600009	上海机场	93,371,707.89	17.07%
17	600795	国电电力	86,233,827.84	15.76%
18	600100	同方股份	86,179,666.99	15.75%
19	600835	上海机电	83,233,777.29	15.21%
20	600019	宝钢股份	80,123,580.83	14.65%
21	600518	康美药业	79,126,613.48	14.46%
22	600879	火箭股份	72,328,670.57	13.22%
23	601628	中国人寿	70,435,646.65	12.88%
24	000651	格力电器	65,628,174.25	12.00%
25	000917	电广传媒	64,702,299.95	11.83%
26	600585	海螺水泥	58,842,491.29	10.76%
27	000920	*ST 汇通	57,749,652.23	10.56%
28	600059	古越龙山	57,711,591.15	10.55%
29	600380	健康元	57,561,855.10	10.52%
30	000652	泰达股份	55,830,135.13	10.21%
31	000972	新中基	51,560,428.64	9.42%
32	600616	第一食品	51,231,252.01	9.36%
33	000069	华侨城 A	49,428,725.39	9.04%
34	601166	兴业银行	49,269,165.90	9.01%

35	000039	中集集团	49,051,666.30	8.97%
36	600886	国投电力	43,161,814.96	7.89%
37	600809	山西汾酒	41,770,679.14	7.64%
38	600011	华能国际	41,298,630.38	7.55%
39	600323	南海发展	41,109,675.01	7.51%
40	600036	招商银行	36,095,521.64	6.60%
41	600348	国阳新能	36,048,800.60	6.59%
42	600718	东软股份	34,791,917.94	6.36%
43	600000	浦发银行	32,339,668.52	5.91%
44	600031	三一重工	31,484,397.94	5.76%
45	601318	中国平安	31,238,734.33	5.71%
46	000898	鞍钢股份	29,992,691.61	5.48%
47	600694	大商股份	29,954,137.29	5.48%
48	000825	太钢不锈	28,399,681.96	5.19%
49	600299	星新材料	28,179,328.22	5.15%
50	600022	济南钢铁	28,145,060.20	5.14%
51	000060	中金岭南	27,739,903.60	5.07%
52	600316	洪都航空	27,487,112.29	5.02%
53	600037	歌华有线	27,311,860.70	4.99%
54	600183	生益科技	26,342,198.03	4.82%
55	000629	攀钢钢钒	26,008,091.99	4.75%
56	000888	峨眉山A	25,784,923.00	4.71%
57	600607	上实医药	24,833,838.47	4.54%
58	601666	平煤天安	23,995,771.68	4.39%
59	600415	小商品城	23,995,648.07	4.39%
60	000063	中兴通讯	22,248,327.86	4.07%
61	600195	中牧股份	21,453,630.68	3.92%
62	600806	昆明机床	21,343,663.56	3.90%
63	002007	华兰生物	19,128,499.31	3.50%
64	000600	建投能源	17,564,276.36	3.21%
65	600811	东方集团	17,288,504.45	3.16%
66	600750	江中药业	17,024,460.30	3.11%
67	600880	博瑞传播	14,833,806.89	2.71%
68	600519	贵州茅台	14,721,670.63	2.69%
69	600713	南京医药	14,209,059.69	2.60%
70	600026	中海发展	13,255,098.84	2.42%
71	600529	山东药玻	12,280,802.98	2.24%
72	600858	银座股份	11,856,837.64	2.17%
73	000428	华天酒店	11,516,797.43	2.11%

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	5,490,555,278.31
卖出股票的收入总额	4,949,472,444.97

四、本报告期末按券种分类的债券投资组合

序号	债券品种	市值(元)	占基金资产净值比例
1	国 债	382,572,959.80	11.04%

2	金融债	319,970,590.00	9.24%
3	央行票据	0.00	0.00%
4	企业债	0.00	0.00%
5	可转债	0.00	0.00%
6	其他	0.00	0.00%
	合计	702,543,549.80	20.28%

五、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

序号	债券名称	市值(元)	占基金资产净值比例
1	02 国债(14)	170,213,472.50	4.91%
2	06 进出 05	110,022,440.00	3.18%
3	07 农发 02	99,950,000.00	2.89%
4	21 国债(12)	64,486,955.50	1.86%
5	20 国债(10)	62,084,731.80	1.79%

七、投资组合报告附注

1、报告期内基金投资的前十名证券的发行主体无被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的。

2、基金投资的前十名股票中，没有投资于超出基金合同规定备选股票库之外的股票。

3、权证投资情况

(1) 报告期末所有权证明细

序号	权证代码	权证名称	期末数量(份)	市值(元)	占基金资产净值比例
1	030002	五粮 YGC1	300,000	9,600,000.00	0.28%
2	031003	深发 SFC1	220,000	3,352,800.00	0.10%
3	031004	深发 SFC2	110,000	1,824,570.00	0.05%

(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	031003	深发 SFC1	220,000	0	0.00	0	0.00	股权分置改革对价支付
2	031004	深发 SFC2	110,000	0	0.00	0	0.00	
3	030002	五粮 YGC1		300,000	10,135,013.41	0	0.00	主动投资
4	580005	万华 HXB1		499,996	22,087,469.43	499,996	0.00	
5	580013	武钢 CWB1		2,399,198	5,559,661.53	2,399,198	12,803,926.57	A
合计					37,782,144.37		12,803,926.57	

注：A：权证武钢 CWB1（580013）为申购分离交易可转债 07 武钢债（126005）时获配的权证；万华 HXB1（580005）的卖出数量为行权数量。

4、其他资产的构成

项目	金额(元)
交易保证金	2,976,164.85
应收证券清算款	10,149,296.93

应收股利	791,964.00
应收利息	12,031,186.90
应收申购款	3,195,855.41
合计	29,144,468.09

5、报告期末基金持有的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、基金投资流通受限证券（非公开发行/网下申购）的情况

序号	流通受限 证券名称	类型	流通受限截止日期	数量（股）	报告期末市值 （元）	占基金资产净 值比例
1	中国远洋	网下申购	2007-9-26	172,270	3,145,650.20	0.09%

8、本报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金情况
无。

9、由于四舍五入原因，分项之和与合计可能有尾差。

第七节 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	117,191 户
报告期末平均每户持有的基金份额	20,554.02 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	2,408,746,116.43	100.00%
其中：机构投资者持有的基金份额	165,571,761.72	6.87%
个人投资者持有的基金份额	2,243,174,354.71	93.13%

第八节 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	2,604,752,899.89
本报告期期初基金份额总额	260,795,579.64
加：本报告期间总申购份额	6,253,857,528.84
减：本报告期间总赎回份额	4,105,906,992.05
本报告期期末基金份额总额	2,408,746,116.43

第九节 重大事件揭示

一、本报告期内本基金未召开持有人大会。

二、本报告期本基金管理人、基金托管人的基金托管部门重大人事变动情况：

本报告期内，本基金托管人行长发生变更。依据国务院文件，2007年6月16日国务院决定任命项俊波同志为中国农业银行行长。依据相关法律规定，中国农业银行法定代表人变更为项俊波先生。

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一次分红。向截至 2007 年 1 月 24 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 14.20 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，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
光大证券	1	3,210,145,647.09	30.93%	2,619,179.97	31.35%
中金公司	1	1,099,215,444.78	10.59%	860,143.14	10.30%
海通证券	2	2,963,646,539.20	28.56%	2,401,523.09	28.75%
银河证券	1	204,883,049.44	1.97%	160,321.95	1.92%
联合证券	1	0.00	0.00%	0.00	0.00%
国泰君安	1	687,780,137.29	6.63%	562,637.54	6.74%
中信建投	1	534,463,281.61	5.15%	437,120.13	5.23%
招商证券	1	1,677,201,215.63	16.16%	1,312,419.12	15.71%
世纪证券	1	0.00	0.00%	0.00	0.00%
合计	10	10,377,335,315.04	100.00%	8,353,344.94	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
光大证券	501,403,750.80	35.78%	1,791,000,000.00	57.85%
国泰君安	132,176,360.90	9.43%	0.00	0.00%
海通证券	653,692,137.80	46.65%	1,305,000,000.00	42.15%
中信建投	112,667,205.70	8.04%	0.00	0.00%
中金公司	1,368,565.00	0.10%	0.00	0.00%
合计	1,401,308,020.20	100.00%	3,096,000,000.00	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
光大证券	39,388,538.36	79.54%
中金公司	10,134,000.00	20.46%
合计	49,522,538.36	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	联合证券23204

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	大成基金管理有限公司旗下部分开放式基金推出定投业务公告	证券时报、中国证券报和上海证券报	2007年1月8日
2	大成价值增长证券投资基金第六次分红公告	证券时报、中国证券报和上海证券报	2007年1月22日
3	大成价值增长证券投资基金第六次分红红利发放日提示性公告	证券时报、中国证券报和上海证券报	2007年1月25日
4	大成基金管理有限公司关于在交通银行开通基金“定期定额投资计划”的公告	证券时报、中国证券报和上海证券报	2007年3月14日
5	关于大成价值增长基金、大成沪深300指数基金增加代销机构的公告	证券时报、中国证券报和上海证券报	2007年3月14日
6	大成价值增长证券投资基金增加代销机构的公告	证券时报、中国证券报和上海证券报	2007年3月16日
7	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	2007年4月6日
8	大成基金管理有限公司增加东海证券为代销机构的公告	证券时报、中国证券报和上海证券报	2007年4月10日
9	关于旗下基金调整最低基金份额余额和最低赎回份额的公告	证券时报、中国证券报和上海证券报	2007年4月11日
10	大成基金管理有限公司增加江南证券有限责任公司为代销机构的公告	证券时报、中国证券报和上海证券报	2007年4月26日
11	大成基金管理有限公司增加中国光大银行代销旗下基金的公告	证券时报、中国证券报和上海证券报	2007年5月16日
12	关于旗下开放式基金在中国光大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	2007年5月18日
13	关于大成基金管理有限公司旗下开放式基金申购费用及申购份额的计算采用外扣法的公告	证券时报、中国证券报和上海证券报	2007年5月28日
14	大成基金管理有限公司修订旗下基金合同关于申购费用和申购份额计算方法的公告	证券时报、中国证券报和上海证券报	2007年5月28日
15	关于向中国建设银行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	2007年5月31日
16	大成基金管理有限公司关于更换董事的公告	证券时报、中国证券报和上海证券报	2007年6月23日
17	大成基金管理有限公司开通浦东发展银行东方借记卡网上交易公告	证券时报、中国证券报和上海证券报	2007年6月27日

18	大成基金管理有限公司关于基金运营部 登记结算中心搬迁的公告	证券时报、中国证券 报和上海证券报	2007 年 6 月 30 日
----	----------------------------------	----------------------	-----------------

第十节 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价值增长证券投资基金的文件；
- 2、《大成价值增长证券投资基金基金合同》；
- 3、《大成价值增长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
二〇〇七年八月二十七日