

大成沪深 300 指数证券投资基金

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

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。

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 21 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利。

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

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 管理人报告	3
第四节 托管人报告	5
第五节 财务会计报告	5
第六节 投资组合报告	11
第七节 基金份额持有人情况	29
第八节 开放式基金份额变动	29
第九节 重大事件揭示	29
第十节 备查文件目录	32

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: | 9,529,560,503.37 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》
 登载半年度报告正文的管理人互联网网 <http://www.dcfund.com.cn>
 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：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	2007 年 1 月 1 日至 2007 年 6 月 30 日
1	基金本期净收益	774,222,913.27
2	基金份额本期净收益	0.1803
3	期末可供分配基金收益	459,541,325.96
4	期末可供分配基金份额收益	0.0482
5	期末基金资产净值	11,905,653,661.28
6	期末基金份额净值	1.2493
7	基金加权平均净值收益率	14.04%
8	本期基金份额净值增长率	66.10%
9	基金份额累计净值增长率	180.14%

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	-3.35%	2.95%	-4.17%	3.05%	0.82%	-0.10%
过去 3 个月	25.83%	2.35%	35.31%	2.53%	-9.48%	-0.18%
过去 6 个月	66.10%	2.36%	84.42%	2.52%	-18.32%	-0.16%
过去 1 年	141.34%	1.90%	170.03%	2.02%	-28.69%	-0.12%

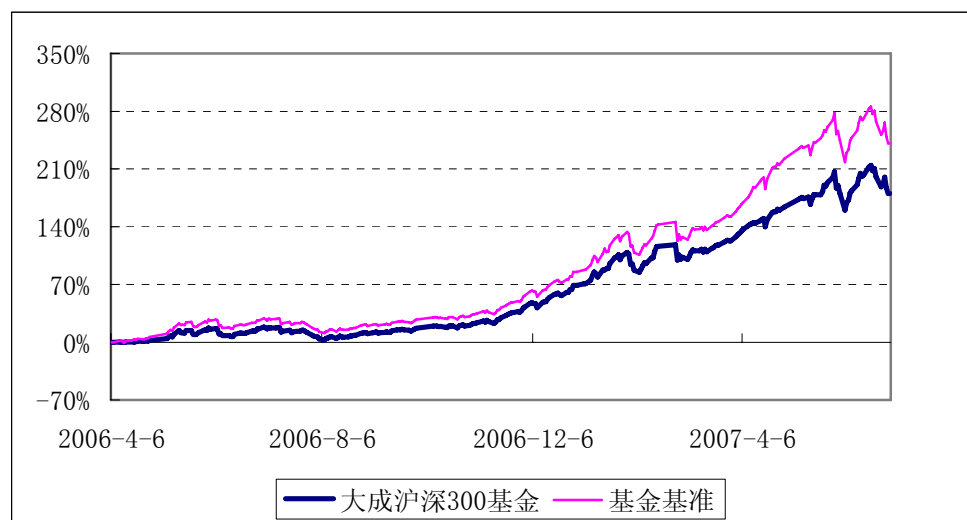
自基金合同生效起至今	180.14%	1.84%	241.19%	1.97%	-61.05%	-0.13%
------------	---------	-------	---------	-------	---------	--------

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 2007 年 6 月 30 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。

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 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、基金经理简介

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、证券市场回顾与基金运作情况

2007 年上半年继续延续了 2006 年以来的牛市格局，沪深 300 指数依然保持了强劲的上涨趋势。从年初的 2600 多点站上了 4200 多点，指数收益率高达 60% 以上。与 2006 年整体稳步上涨的趋势不同，本轮牛市在 6 月份出现快速的巨幅震荡，市场风险明显增大。

市场的强势直接得到了基本面的强劲支撑。2007 年上半年，我国宏观经济保持了快速增长的势头，企业利润的增加推动了固定资产投资快速增长，城乡收入和消费稳定增长。物价虽然依然低位增长，但在进入二季度后已经显露了通货膨胀的迹象。贸易顺差持续扩大，使得上半年的顺差达到 1125 亿美元，货币流动性压力进一步增大。人民币汇率升值有所加速，我们预计小幅升值的趋势不会改变。

宏观经济形势也使得政策面有所趋紧，我们注意到央行已经开始密切关注资产价格的变化，而包括上调基准利率、提高法定存款准备金率在内已经出台和未来预期将出台的宏观调控政策的主要目标将集中在对过度流动性的收缩上。

回顾一季度市场，虽然出现了 2 月 27 日大盘接近跌停的全面下跌，但整体而言，市场依然保持了稳步攀升的走势，指数依然连创新高。

二季度以来，市场整体估值水平已经上升到了相对较高的水平。一些题材股、低价股和绩差股在 4、5 月份表现非常抢眼，巨大的财富效应吸引了大批新增资金的跟风，将其价格水平推到了明显高估的水平。市场的投资者结构也发生了较大的变化，个人投资者在这一阶段蜂拥入市，市场的日开户数一度达到 30 万户的水平，个人投资者在市场的比重提升显著，市场呈现出了较典型的资金推动的特征。

随着估值压力不断增大，5 月底财政部出台调高印花税的通知，成为股市调整的导火索。沪深 300 指数从 5 月 29 日 4168 点，短短 5 个交易日内，最低跌到 3246 点，最大跌幅超过 20%，一大批股票被腰斩，投资者信心受到极大挫伤，市场成交量快速下降。尽管牛市的格局并没有改变，但在 4000 点位置上的宽幅震荡，和不断出台的调控政策，依然体现出短期市场走势的不确定性和投资者复杂而矛盾的心理。

本报告期，沪深 300 指数基金依然保持了良好的投资业绩，半年收益率超过 65%。随着市场不断创出新高，指数基金的投资优势逐步显现出来，同时也得到了越来越多投资者的认同。

2、证券市场展望和基金投资策略

在宏观经济向好、流动性充裕以及本币持续升值的大环境没有改变的情况下，我国股市牛市基础依然坚固。市场在经历了充分震荡调整以后，整体估值水平能够回到一个相对合理的位置。随着半年报、三季报的公布，我们预计一批绩优公司的业绩将不断超预期增长，市场将重新具备吸引力，以高成长性为特征的绩优股会引领市场再次走好。

股指期货的各项准备工作正在紧锣密鼓的准备，年内推出的预期依然存在。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，投资者对沪深 300 指数的战略性投资以及套利投资者对于沪深 300 指数现货的需求都将大大增加，这将会使得基金规模取得长足的增长。

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。

第四节 托管人报告

在托管大成沪深 300 指数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 指数证券投资基金托管协议》的约定，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 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。

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沪深 300 指数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 21 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		447,292,126.46	24,489,541.31
清算备付金		29,420,013.61	141,588.18
交易保证金		250,000.00	250,000.00
应收证券清算款		297,574,038.47	9,987,208.48
应收股利		5,681,605.70	0.00
应收利息	4(1)	112,709.91	5,348.25
应收申购款		38,541,372.58	486,332.41
其他应收款	4(2)	0.00	0.00
股票投资市值		11,253,747,955.83	503,346,921.79
其中：股票投资成本		10,178,998,129.34	316,120,476.69
债券投资市值		0.00	0.00
其中：债券投资成本		0.00	0.00
权证投资		11,802,615.05	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	4 (3)	0.00	0.00
其他资产		0.00	0.00
资产总计		12,084,422,437.61	538,706,940.42
负债			
应付证券清算款		0.00	0.00
应付赎回款		154,879,346.19	8,084,450.71
应付赎回费		582,831.05	30,469.85
应付管理人报酬		8,093,362.57	331,378.10
应付托管费		1,618,672.54	66,275.61
应付佣金	4 (5)	13,098,789.32	396,612.61
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 (6)	401,555.11	250,530.12
卖出回购证券款		0.00	0.00
短期借款		0.00	0.00
预提费用	4 (7)	94,219.55	140,000.00
其他负债		0.00	0.00
负债合计		178,768,776.33	9,299,717.00
持有人权益			
实收基金	4 (8)	9,529,560,503.37	313,896,083.57
未实现利得	4 (9)	1,916,551,831.95	101,372,450.67
未分配收益		459,541,325.96	114,138,689.18
持有人权益合计		11,905,653,661.28	529,407,223.42
负债及持有人权益总计		12,084,422,437.61	538,706,940.42
基金份额净值		1.2493	1.6866

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4月6日(基金合同生效日)至2006年6月30日
一、收入		798,682,692.90	122,051,606.44
1、股票差价收入	4 (10)	720,564,206.86	88,986,409.60
2、债券差价收入	4 (11)	1,001,390.30	0.00
3、权证差价收入	4 (12)	8,373,286.60	13,902,932.28
4、债券利息收入		2,740.70	0.00
5、存款利息收入		1,836,264.70	730,040.28
6、股利收入		58,193,736.47	15,950,044.05
7、买入返售证券收入		0.00	1,053,481.63
8、其他收入	4 (13)	8,711,067.27	1,428,698.60
二、费用		24,459,779.63	3,212,600.67
1、基金管理人报酬		20,285,004.93	2,621,876.41
2、基金托管费		4,057,000.94	524,375.32

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	4 (14)	117,773.76	66,348.94
其中：上市年费		0.00	0.00
信息披露费		49,588.57	15,798.95
审计费用		44,630.98	28,438.45
三、基金净收益		774,222,913.27	118,839,005.77
加：未实现利得		899,325,996.44	117,229,762.70
四、基金经营业绩		1,673,548,909.71	236,068,768.47

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 至2007年6月30日	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		774,222,913.27	118,839,005.77
加：期初基金净收益		114,138,689.18	0.00
加：本期损益平准金		235,455,204.86	-27,039,369.25
可供分配基金净收益		1,123,816,807.31	91,799,636.52
减：本期已分配基金净收益	4 (15)	664,275,481.35	0.00
期末基金净收益		459,541,325.96	91,799,636.52

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4月6日(基金合同 生效日)至2006年6月30日
一、期初基金净值		529,407,223.42	1,813,356,066.47
二、本期经营活动			
基金净收益		774,222,913.27	118,839,005.77
未实现利得		899,325,996.44	117,229,762.70
经营活动产生的基金净值 变动数		1,673,548,909.71	236,068,768.47
三、本期基金份额交易			
基金申购款		17,349,505,802.59	215,644,057.95
基金赎回款		-6,982,532,793.09	-1,142,957,115.35
基金份额交易产生的基金 净值变动数		10,366,973,009.50	-927,313,057.40
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		-664,275,481.35	0.00
五、期末基金净值		11,905,653,661.28	1,122,111,777.54

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、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

*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。

(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 20,285,004.93 元, 其中已支付基金管理人人民币 12,191,642.36 元, 尚余人民币 8,093,362.57 元未支付(2006 年 4 月 6 日(基金合同生效日)至 2006 年 6 月 30 日共计提基金管理费 2,621,876.41 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 0.15%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 4,057,000.94 元, 其中已支付基金托管人人民币 2,438,328.40 元, 尚余人民币 1,618,672.54 元未支付(2006 年 4 月 6 日(基金合同生效日)至 2006 年 6 月 30 日共计提基金托管费 524,375.32 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 447,292,126.46 元。本期由基金托管人保

管的银行存款产生的利息收入为 1,694,146.81 元（2006 年 6 月 30 日基金托管人保管的银行存款余额为 52,306,397.47 元，2006 年 4 月 6 日（基金合同生效日）至 6 月 30 日由基金托管人保管的银行存款利息收入为 668,556.12 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	100,794.81
应收清算备付金利息	11,915.10
应收债券利息	0.00
合计	112,709.91

（2）其他应收款

无。

（3）待摊费用

无。

（4）投资估值增值

项目	2007年6月30日
股票估值增值	1,074,749,826.49
债券估值增值	0.00
权证估值增值	11,802,615.05
合计	1,086,552,441.54

（5）应付佣金

券商名称	2007年6月30日
联合证券	3,530,640.71
国金证券	3,662,863.81
中银国际证券	5,905,284.80
合计	13,098,789.32

（6）其他应付款

项目	2007年6月30日
应付后端申购费	151,235.11
应付银行间回购结算费	320.00
应付深圳席位保证金	250,000.00
合计	401,555.11

（7）预提费用

项目	2007年6月30日
----	------------

预提审计费用	44,630.98
预提信息披露费	49,588.57
合计	94,219.55

(8) 实收基金

项目	2007年1月1日至2007年6月30日
期初数	313,896,083.57
加：本期因申购的增加数	14,599,578,619.19
减：本期因赎回的减少数	5,383,914,199.39
期末数	9,529,560,503.37

(9) 未实现利得

项目	2007年6月30日
投资估值增值	1,086,552,441.54
其中：股票投资估值增值	1,074,749,826.49
债券投资估值增值	0.00
权证投资估值增值	11,802,615.05
未实现利得平准金	829,999,390.41
其中：申购未实现利得平准金	2,340,808,637.57
赎回未实现利得平准金	-1,510,809,247.16
合计	1,916,551,831.95

(10) 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	3,705,977,650.58
减：卖出股票成本总额	2,982,300,615.93
减：应付佣金	3,112,827.79
股票差价收入	720,564,206.86

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 310,551.55 元，已全额冲减股票投资成本。

(11) 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	3,262,167.91
减：卖出债券成本总额	2,258,036.91
减：应收利息总额	2,740.70
债券差价收入	1,001,390.30

(12) 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	8,587,949.69
减：卖出权证成本总额	214,663.09
权证差价收入	8,373,286.60

(13) 其他收入

项目	2007年1月1日至2007年6月30日
赎回费收入	8,711,067.27

*本基金赎回费总额的25%归入基金资产。

(14) 其他费用

项目	2007年1月1日至2007年6月30日
信息披露费	49,588.57
审计费用	44,630.98
银行费用	14,254.21
债券账户维护费	9,000.00
其他	300.00
合计	117,773.76

(15) 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
2	664,275,481.35

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
601600	中国铝业	6,477,151	115,579,433.83	149,492,645.08	上一工作日收市价	重大事件停牌	2007-7-3
000061	农产品	773,457	16,106,458.43	16,938,708.30			未知
000768	西飞国际	1,210,679	30,221,299.11	37,373,660.73			2007-7-16

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	476,712,140.07	3.94%
股票	11,253,747,955.83	93.13%
债券	0.00	0.00%
权证	11,802,615.05	0.10%
其他资产	342,159,726.66	2.83%
合计	12,084,422,437.61	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	31,857,510.50	0.27%
B 采掘业	501,788,405.97	4.21%
C 制造业	4,149,495,177.38	34.85%
C0 食品、饮料	562,925,074.77	4.73%
C1 纺织、服装、皮毛	151,554,836.77	1.27%

C2 木材、家具	0.00	0.00%
C3 造纸、印刷	50,598,166.76	0.42%
C4 石油、化学、塑胶、塑料	393,089,581.45	3.30%
C5 电子	111,023,542.54	0.93%
C6 金属、非金属	1,484,901,777.21	12.47%
C7 机械、设备、仪表	1,077,641,209.68	9.05%
C8 医药、生物制品	274,133,336.36	2.30%
C99 其他制造业	43,627,651.84	0.37%
D 电力、煤气及水的生产和供应业	676,734,671.57	5.68%
E 建筑业	108,614,139.17	0.91%
F 交通运输、仓储业	820,540,924.97	6.89%
G 信息技术业	507,629,338.59	4.26%
H 批发和零售贸易	495,244,131.34	4.16%
I 金融、保险业	2,529,763,725.34	21.25%
J 房地产业	746,289,755.82	6.27%
K 社会服务业	225,115,207.23	1.89%
L 传播与文化产业	69,879,556.19	0.59%
M 综合类	390,795,411.76	3.28%
合计	11,253,747,955.83	94.52%

2、非指数投资部分

无。

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	600000	浦发银行	12,203,739	446,534,810.01	3.75%
2	600036	招商银行	16,152,034	397,016,995.72	3.33%
3	600030	中信证券	7,336,132	388,594,912.04	3.26%
4	000002	万 科 A	19,059,623	364,419,991.76	3.06%
5	600016	民生银行	26,010,520	297,300,243.60	2.50%
6	600900	长江电力	15,129,072	228,751,568.64	1.92%
7	601318	中国平安	2,981,636	213,216,790.36	1.79%
8	600019	宝钢股份	16,314,127	179,455,397.00	1.51%
9	600519	贵州茅台	1,492,737	178,650,764.16	1.50%
10	601600	中国铝业	6,477,151	149,492,645.08	1.26%
11	000858	五 粮 液	4,724,884	148,644,850.64	1.25%
12	600050	中国联通	25,274,141	148,359,207.67	1.25%
13	600028	中国石化	10,845,340	143,375,394.80	1.20%
14	601398	工商银行	28,509,297	142,831,577.97	1.20%
15	000001	深发展 A	5,015,242	138,019,459.84	1.16%
16	600009	上海机场	3,549,829	134,929,000.29	1.13%
17	002024	苏宁电器	2,622,662	123,160,207.52	1.03%
18	600011	华能国际	10,891,402	116,864,743.46	0.98%
19	601006	大秦铁路	7,701,165	116,595,638.10	0.98%

20	601628	中国人寿	2,672,228	109,855,293.08	0.92%
21	600104	上海汽车	6,326,613	109,260,606.51	0.92%
22	601166	兴业银行	3,107,050	109,026,384.50	0.92%
23	600177	雅戈尔	4,023,319	107,060,518.59	0.90%
24	600309	烟台万华	1,831,769	98,109,547.64	0.82%
25	600005	武钢股份	9,535,583	95,927,964.98	0.81%
26	000527	美的电器	3,050,452	92,733,740.80	0.78%
27	600018	上港集团	11,886,323	91,405,823.87	0.77%
28	600320	振华港机	4,589,348	91,190,344.76	0.77%
29	000063	中兴通讯	1,657,253	90,154,563.20	0.76%
30	000898	鞍钢股份	4,521,899	79,992,393.31	0.67%
31	000039	中集集团	2,509,853	73,588,889.96	0.62%
32	601988	中国银行	14,618,875	73,386,752.50	0.62%
33	600739	辽宁成大	2,129,658	72,813,007.02	0.61%
34	600015	华夏银行	6,046,354	72,798,102.16	0.61%
35	600881	亚泰集团	3,253,301	72,483,546.28	0.61%
36	000069	华侨城 A	1,788,349	71,176,290.20	0.60%
37	000568	泸州老窖	1,679,617	70,711,875.70	0.59%
38	000402	金融街	2,412,010	69,948,290.00	0.59%
39	000623	吉林敖东	1,399,177	69,609,055.75	0.58%
40	600849	上海医药	3,973,247	68,935,835.45	0.58%
41	600010	宝钢股份	9,336,619	65,262,966.81	0.55%
42	600628	新世界	3,309,886	63,582,910.06	0.53%
43	000825	太钢不锈	3,124,436	62,676,186.16	0.53%
44	600031	三一重工	1,397,306	61,802,844.38	0.52%
45	600811	东方集团	1,961,271	60,524,823.06	0.51%
46	000651	格力电器	1,640,928	57,268,387.20	0.48%
47	000652	泰达股份	2,021,529	57,168,840.12	0.48%
48	600583	海油工程	1,570,245	56,842,869.00	0.48%
49	600585	海螺水泥	961,276	56,676,832.96	0.48%
50	600642	申能股份	4,010,223	56,103,019.77	0.47%
51	000024	招商地产	1,113,836	54,689,347.60	0.46%
52	601328	交通银行	4,613,250	50,699,617.50	0.43%
53	000792	盐湖钾肥	1,138,741	50,537,325.58	0.42%
54	600001	邯郸钢铁	7,906,163	50,362,258.31	0.42%
55	600717	天津港	2,000,072	50,341,812.24	0.42%
56	600383	金地集团	1,470,904	50,334,334.88	0.42%
57	600795	国电电力	3,835,069	50,316,105.28	0.42%
58	600887	伊利股份	1,567,080	48,830,212.80	0.41%
59	000983	西山煤电	1,705,941	48,158,714.43	0.40%
60	000562	宏源证券	1,611,911	47,228,992.30	0.40%
61	600037	歌华有线	1,790,693	46,880,342.74	0.39%
62	600660	福耀玻璃	1,496,575	45,675,469.00	0.38%

63	600048	保利地产	993,447	45,629,020.71	0.38%
64	600649	原水股份	3,121,698	43,797,422.94	0.37%
65	000157	中联重科	1,131,627	43,567,639.50	0.37%
66	600675	中华企业	1,895,465	43,046,010.15	0.36%
67	600832	东方明珠	2,652,247	42,939,878.93	0.36%
68	600694	大商股份	690,236	42,484,025.80	0.36%
69	600655	豫园商城	1,628,554	42,374,975.08	0.36%
70	600150	沪东重机	303,076	41,897,226.24	0.35%
71	000629	攀钢钢钒	5,051,908	41,779,279.16	0.35%
72	601111	中国国航	4,187,088	40,991,591.52	0.34%
73	000751	锌业股份	2,073,508	40,868,842.68	0.34%
74	000709	唐钢股份	3,180,961	40,652,681.58	0.34%
75	600601	方正科技	3,326,664	40,352,434.32	0.34%
76	600331	宏达股份	823,306	39,889,175.70	0.34%
77	600143	金发科技	997,071	38,427,116.34	0.32%
78	000060	中金岭南	1,302,033	38,149,566.90	0.32%
79	000878	云南铜业	1,097,333	37,857,988.50	0.32%
80	600026	中海发展	1,637,135	37,621,362.30	0.32%
81	000768	西飞国际	1,210,679	37,373,660.73	0.31%
82	600100	同方股份	1,077,924	36,972,793.20	0.31%
83	600690	青岛海尔	2,308,901	36,942,416.00	0.31%
84	000027	深能源 A	1,611,202	36,606,509.44	0.31%
85	600631	百联股份	2,159,742	36,262,068.18	0.30%
86	600497	驰宏锌锗	548,921	36,245,253.63	0.30%
87	600839	四川长虹	3,954,302	35,232,830.82	0.30%
88	600786	东方锅炉	548,949	34,572,808.02	0.29%
89	600895	张江高科	1,991,587	34,414,623.36	0.29%
90	000793	华闻传媒	3,984,054	33,386,372.52	0.28%
91	600029	南方航空	3,860,831	33,125,929.98	0.28%
92	600718	东软股份	783,334	32,641,527.78	0.27%
93	600875	东方电机	507,336	32,408,623.68	0.27%
94	000839	中信国安	1,125,788	31,522,064.00	0.26%
95	600688	S 上石化	2,747,408	31,430,347.52	0.26%
96	000630	铜都铜业	1,621,671	30,827,965.71	0.26%
97	600663	陆家嘴	1,195,875	30,387,183.75	0.26%
98	600068	葛洲坝	2,321,700	30,135,666.00	0.25%
99	600635	大众公用	2,734,513	29,149,908.58	0.24%
100	000031	中粮地产	1,262,854	28,565,757.48	0.24%
101	600879	火箭股份	1,053,541	28,013,655.19	0.24%
102	000680	山推股份	1,763,125	27,822,112.50	0.23%
103	600123	兰花科创	927,941	27,763,994.72	0.23%
104	600008	首创股份	2,422,950	27,645,859.50	0.23%
105	600308	华泰股份	1,123,580	27,628,832.20	0.23%

106	000932	华菱管线	3,185,012	27,168,152.36	0.23%
107	600098	广州控股	2,268,050	27,103,197.50	0.23%
108	000758	中色股份	1,064,712	26,937,213.60	0.23%
109	600741	巴士股份	2,755,782	26,813,758.86	0.23%
110	600569	安阳钢铁	3,130,580	26,422,095.20	0.22%
111	600004	白云机场	1,416,418	26,345,374.80	0.22%
112	000539	粤电力 A	2,437,809	26,328,337.20	0.22%
113	000933	神火股份	933,966	26,253,784.26	0.22%
114	601998	中信银行	2,820,000	25,944,000.00	0.22%
115	600348	国阳新能	700,026	25,872,960.96	0.22%
116	000410	沈阳机床	1,077,899	25,869,576.00	0.22%
117	000778	新兴铸管	1,888,663	25,855,796.47	0.22%
118	000401	冀东水泥	1,871,272	25,748,702.72	0.22%
119	601001	大同煤业	995,280	25,170,631.20	0.21%
120	600266	北京城建	883,589	25,040,912.26	0.21%
121	000538	云南白药	698,548	25,008,018.40	0.21%
122	600299	星新材料	542,092	24,670,606.92	0.21%
123	600271	航天信息	555,365	24,619,330.45	0.21%
124	600066	宇通客车	900,804	24,537,900.96	0.21%
125	600489	中金黄金	520,648	24,486,075.44	0.21%
126	600835	上海机电	984,893	24,445,044.26	0.21%
127	600550	天威保变	872,656	23,832,235.36	0.20%
128	600188	兖州煤业	1,673,857	23,768,769.40	0.20%
129	000800	一汽轿车	2,171,472	23,669,044.80	0.20%
130	600500	中化国际	1,657,084	23,381,455.24	0.20%
131	600269	赣粤高速	1,685,171	23,373,321.77	0.20%
132	000009	S 深宝安 A	2,010,693	23,324,038.80	0.20%
133	000960	锡业股份	716,165	23,282,524.15	0.20%
134	000625	长安汽车	1,398,653	23,049,801.44	0.19%
135	000488	晨鸣纸业	2,634,098	22,969,334.56	0.19%
136	600418	江淮汽车	2,188,485	22,957,207.65	0.19%
137	000088	盐田港	1,334,597	22,407,883.63	0.19%
138	600085	同仁堂	577,450	22,214,501.50	0.19%
139	600183	生益科技	1,795,418	22,029,778.86	0.19%
140	600196	复星医药	2,092,244	21,947,639.56	0.18%
141	000729	燕京啤酒	1,648,745	21,845,871.25	0.18%
142	000937	金牛能源	1,361,548	21,730,306.08	0.18%
143	600596	新安股份	502,360	21,696,928.40	0.18%
144	600653	申华控股	3,883,356	21,591,459.36	0.18%
145	600886	国投电力	1,382,565	21,402,106.20	0.18%
146	600588	用友软件	433,095	21,148,028.85	0.18%
147	600022	济南钢铁	1,576,471	20,683,299.52	0.17%
148	000422	湖北宜化	1,477,492	20,478,039.12	0.17%

149	600362	江西铜业	830,471	20,371,453.63	0.17%
150	600415	小商品城	199,529	20,152,429.00	0.17%
151	600868	梅雁水电	4,585,897	20,132,087.83	0.17%
152	600428	中远航运	919,194	20,121,156.66	0.17%
153	000897	津滨发展	1,341,644	20,070,994.24	0.17%
154	600456	宝钛股份	469,251	20,041,710.21	0.17%
155	600058	五矿发展	882,562	20,034,157.40	0.17%
156	600472	包头铝业	747,084	19,977,026.16	0.17%
157	600748	上实发展	1,016,256	19,776,341.76	0.17%
158	600108	亚盛集团	2,924,535	19,594,384.50	0.16%
159	000581	威孚高科	1,082,587	19,356,655.56	0.16%
160	600616	第一食品	769,603	19,332,427.36	0.16%
161	000089	深圳机场	1,929,406	19,274,765.94	0.16%
162	000807	云铝股份	1,203,175	19,262,831.75	0.16%
163	000528	柳 工	780,915	19,132,417.50	0.16%
164	600132	重庆啤酒	424,304	18,830,611.52	0.16%
165	600639	浦东金桥	955,947	18,554,931.27	0.16%
166	600282	南钢股份	1,388,415	18,521,456.10	0.16%
167	600600	青岛啤酒	710,989	18,407,505.21	0.15%
168	600361	华联综超	657,190	18,197,591.10	0.15%
169	600808	马钢股份	2,676,167	17,983,842.24	0.15%
170	600210	紫江企业	2,895,001	17,891,106.18	0.15%
171	600027	华电国际	2,650,817	17,839,998.41	0.15%
172	600110	中科英华	917,077	17,782,123.03	0.15%
173	000503	海虹控股	1,471,838	17,632,619.24	0.15%
174	600997	开滦股份	793,970	17,467,340.00	0.15%
175	600809	山西汾酒	518,725	17,418,785.50	0.15%
176	600779	水井坊	1,140,868	17,341,193.60	0.15%
177	600643	S 爱建	827,428	17,309,793.76	0.15%
178	000061	农 产 品	773,457	16,938,708.30	0.14%
179	600153	建发股份	873,892	16,682,598.28	0.14%
180	600797	浙大网新	1,890,451	16,598,159.78	0.14%
181	000021	长城开发	1,143,969	16,553,231.43	0.14%
182	600125	铁龙物流	1,498,029	16,523,259.87	0.14%
183	000717	韶钢松山	2,343,019	16,518,283.95	0.14%
184	000541	佛山照明	764,929	16,445,973.50	0.14%
185	600662	强生控股	1,239,615	16,238,956.50	0.14%
186	600020	中原高速	1,817,700	16,232,061.00	0.14%
187	600432	吉恩镍业	328,887	16,174,662.66	0.14%
188	000822	山东海化	1,341,315	15,814,103.85	0.13%
189	600062	双鹤药业	874,658	15,805,070.06	0.13%
190	600220	江苏阳光	1,909,621	15,773,469.46	0.13%
191	600161	天坛生物	489,502	15,717,909.22	0.13%

192	000767	漳泽电力	1,498,419	15,508,636.65	0.13%
193	600357	承德钒钛	1,675,505	15,414,646.00	0.13%
194	600096	云天化	618,816	15,154,803.84	0.13%
195	600006	东风汽车	2,280,077	15,139,711.28	0.13%
196	600780	通宝能源	1,923,626	14,773,447.68	0.12%
197	000036	华联控股	2,166,171	14,729,962.80	0.12%
198	600547	山东黄金	200,650	14,705,638.50	0.12%
199	600350	山东高速	1,903,888	14,583,782.08	0.12%
200	600087	南京水运	1,117,374	14,525,862.00	0.12%
201	000559	万向钱潮	1,629,694	14,292,416.38	0.12%
202	000012	南玻A	1,081,170	14,260,632.30	0.12%
203	600820	隧道股份	1,280,901	14,243,619.12	0.12%
204	600851	海欣股份	1,551,096	13,990,885.92	0.12%
205	600812	华北制药	2,497,030	13,908,457.10	0.12%
206	000900	现代投资	813,240	13,800,682.80	0.12%
207	600256	广汇股份	1,461,085	13,763,420.70	0.12%
208	000930	丰原生化	2,125,179	13,622,397.39	0.11%
209	002008	大族激光	597,818	13,600,359.50	0.11%
210	600312	平高电气	596,461	13,593,346.19	0.11%
211	600761	安徽合力	472,402	13,463,457.00	0.11%
212	600549	厦门钨业	722,569	13,338,623.74	0.11%
213	600236	桂冠电力	1,187,551	12,944,305.90	0.11%
214	000636	风华高科	1,478,565	12,390,374.70	0.10%
215	600270	外运发展	943,315	12,338,560.20	0.10%
216	600598	北大荒	1,384,100	12,263,126.00	0.10%
217	600170	上海建工	1,046,689	12,256,728.19	0.10%
218	600535	天士力	688,390	12,060,592.80	0.10%
219	600007	中国国贸	643,312	12,004,201.92	0.10%
220	600102	莱钢股份	783,759	11,944,487.16	0.10%
221	000917	电广传媒	803,099	11,926,020.15	0.10%
222	600021	上海电力	1,391,518	11,800,072.64	0.10%
223	600316	洪都航空	299,071	11,687,694.68	0.10%
224	600787	中储股份	1,104,938	11,646,046.52	0.10%
225	600151	航天机电	863,842	11,471,821.76	0.10%
226	600033	福建高速	1,485,112	11,375,957.92	0.10%
227	000425	徐工科技	926,409	11,348,510.25	0.10%
228	000927	一汽夏利	1,355,452	11,331,578.72	0.10%
229	000682	东方电子	2,217,309	11,086,545.00	0.09%
230	600088	中视传媒	364,130	11,073,193.30	0.09%
231	600501	航天晨光	671,150	10,933,033.50	0.09%
232	000912	泸天化	723,563	10,708,732.40	0.09%
233	000100	*ST TCL	2,200,000	10,692,000.00	0.09%
234	600591	上海航空	1,674,753	10,450,458.72	0.09%

235	600221	海南航空	1,769,136	10,437,902.40	0.09%
236	600747	大显股份	2,181,568	10,231,553.92	0.09%
237	600754	锦江股份	671,506	10,059,159.88	0.08%
238	600874	创业环保	1,000,440	10,054,422.00	0.08%
239	600508	上海能源	725,505	9,946,673.55	0.08%
240	600770	综艺股份	711,376	9,496,869.60	0.08%
241	000400	许继电气	691,235	9,276,373.70	0.08%
242	600118	中国卫星	290,565	9,074,344.95	0.08%
243	000828	东莞控股	1,218,947	9,008,018.33	0.08%
244	600521	华海药业	409,086	8,926,256.52	0.07%
245	600012	皖通高速	1,169,877	8,902,763.97	0.07%
246	000970	中科三环	753,585	8,884,767.15	0.07%
247	600597	光明乳业	926,990	8,621,007.00	0.07%
248	600863	内蒙华电	1,495,432	8,419,282.16	0.07%
249	000550	江铃汽车	513,889	8,417,501.82	0.07%
250	600410	华胜天成	413,985	8,114,106.00	0.07%
251	000969	安泰科技	496,221	7,954,422.63	0.07%
252	000066	长城电脑	784,988	7,928,378.80	0.07%
253	600307	酒钢宏兴	876,931	7,769,608.66	0.07%
254	600060	海信电器	743,406	7,590,175.26	0.06%
255	600160	巨化股份	810,243	7,470,440.46	0.06%
256	600171	上海贝岭	1,069,645	7,380,550.50	0.06%
257	000786	北新建材	711,479	7,285,544.96	0.06%
258	000029	深深房 A	1,019,194	7,175,125.76	0.06%
259	000059	辽通化工	689,171	7,029,544.20	0.06%
260	600871	S 仪化	598,970	6,966,021.10	0.06%
261	600498	烽火通信	608,142	6,738,213.36	0.06%
262	000617	石油济柴	209,873	6,506,063.00	0.05%
263	002025	航天电器	244,661	6,505,535.99	0.05%
264	000962	东方钨业	529,154	6,365,722.62	0.05%
265	000708	大冶特钢	533,381	6,299,229.61	0.05%
266	600035	楚天高速	961,538	6,192,304.72	0.05%
267	600117	西宁特钢	869,721	6,079,349.79	0.05%
268	000997	新大陆	690,588	5,766,409.80	0.05%
269	600200	江苏吴中	1,184,416	5,566,755.20	0.05%
270	600190	锦州港	897,765	5,404,545.30	0.05%
271	600078	澄星股份	683,142	4,706,848.38	0.04%
272	600460	士兰微	416,535	4,127,861.85	0.03%
273	002051	中工国际	138,447	3,523,476.15	0.03%
274	000068	S 三星	430,000	3,272,300.00	0.03%
275	600834	申通地铁	104,110	1,120,223.60	0.01%

2、非指数股票投资部分

无。

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	430,303,354.65	81.28%
2	600000	浦发银行	399,546,770.16	75.47%
3	600036	招商银行	365,851,004.83	69.11%
4	600016	民生银行	350,550,318.34	66.22%
5	000002	万科A	298,477,633.81	56.38%
6	600900	长江电力	269,205,359.41	50.85%
7	600019	宝钢股份	233,361,876.12	44.08%
8	601318	中国平安	209,912,901.66	39.65%
9	601398	工商银行	201,536,886.20	38.07%
10	600050	中国联通	186,224,861.37	35.18%
11	600519	贵州茅台	177,604,372.97	33.55%
12	600011	华能国际	167,974,641.88	31.73%
13	600018	上港集团	164,758,956.43	31.12%
14	600028	中国石化	161,107,058.90	30.43%
15	601006	大秦铁路	141,392,305.97	26.71%
16	000858	五粮液	139,377,535.55	26.33%
17	000001	深发展A	134,708,739.70	25.45%
18	600009	上海机场	133,833,987.57	25.28%
19	002024	苏宁电器	128,775,877.75	24.32%
20	601166	兴业银行	128,375,825.70	24.25%
21	600005	武钢股份	126,958,424.89	23.98%
22	601628	中国人寿	125,696,856.97	23.74%
23	601600	中国铝业	118,791,385.83	22.44%
24	601988	中国银行	112,295,449.21	21.21%
25	600104	上海汽车	105,659,608.62	19.96%
26	000623	吉林敖东	102,046,749.93	19.28%
27	000063	中兴通讯	99,523,274.04	18.80%
28	000898	鞍钢股份	98,306,524.51	18.57%
29	600309	烟台万华	92,253,576.95	17.43%
30	600320	振华港机	88,224,508.97	16.66%
31	600010	包钢股份	85,612,460.16	16.17%
32	600015	华夏银行	78,793,415.71	14.88%
33	600642	申能股份	78,730,765.25	14.87%
34	600177	雅戈尔	78,562,917.31	14.84%
35	601328	交通银行	77,615,885.08	14.66%
36	600001	邯郸钢铁	77,442,120.89	14.63%
37	600881	亚泰集团	76,226,936.17	14.40%
38	600739	辽宁成大	74,034,304.53	13.98%
39	600849	上海医药	72,380,545.90	13.67%
40	000793	华闻传媒	71,530,491.68	13.51%

41	000039	中集集团	70,294,237.77	13.28%
42	000825	太钢不锈	69,073,502.81	13.05%
43	600628	新世界	66,961,235.32	12.65%
44	600583	海油工程	65,120,628.05	12.30%
45	600832	东方明珠	64,552,051.14	12.19%
46	600795	国电电力	64,007,069.13	12.09%
47	000568	泸州老窖	63,758,725.84	12.04%
48	000527	美的电器	61,357,928.59	11.59%
49	600887	伊利股份	57,812,339.04	10.92%
50	000562	宏源证券	56,809,004.80	10.73%
51	000402	金 融 街	54,194,351.53	10.24%
52	000069	华侨城 A	53,922,448.83	10.19%
53	000629	攀钢钢钒	53,229,207.30	10.05%
54	601111	中国国航	52,025,342.33	9.83%
55	600585	海螺水泥	51,357,618.50	9.70%
56	600497	驰宏锌锗	50,843,138.13	9.60%
57	000100	*ST TCL	50,328,255.85	9.51%
58	600031	三一重工	49,549,503.07	9.36%
59	600811	东方集团	49,385,668.00	9.33%
60	000539	粤电力 A	49,110,169.88	9.28%
61	600037	歌华有线	48,193,333.23	9.10%
62	600631	百联股份	47,951,478.52	9.06%
63	000932	华菱管线	47,586,399.83	8.99%
64	000792	盐湖钾肥	47,195,678.17	8.91%
65	000060	中金岭南	47,093,295.00	8.90%
66	000651	格力电器	46,030,728.08	8.69%
67	000709	唐钢股份	45,443,475.16	8.58%
68	000652	泰达股份	44,307,476.76	8.37%
69	600048	保利地产	43,712,420.70	8.26%
70	601998	中信银行	43,537,000.78	8.22%
71	600717	天津港	43,507,113.10	8.22%
72	600655	豫园商城	43,165,405.03	8.15%
73	600601	方正科技	43,116,582.64	8.14%
74	000024	招商地产	42,945,792.92	8.11%
75	000839	中信国安	41,127,655.39	7.77%
76	600688	S 上石化	40,761,691.76	7.70%
77	600068	葛洲坝	40,704,100.54	7.69%
78	000751	锌业股份	40,693,345.70	7.69%
79	600649	原水股份	39,623,252.01	7.48%
80	600690	青岛海尔	38,940,315.53	7.36%
81	600150	沪东重机	38,694,392.74	7.31%
82	600694	大商股份	38,453,081.39	7.26%
83	600026	中海发展	38,374,238.68	7.25%

84	000423	东阿阿胶	37,763,105.68	7.13%
85	600100	同方股份	37,635,900.08	7.11%
86	600839	四川长虹	37,592,987.81	7.10%
87	600660	福耀玻璃	37,560,557.79	7.09%
88	000758	中色股份	37,400,503.88	7.06%
89	600663	陆家嘴	37,361,548.81	7.06%
90	600331	宏达股份	37,155,329.02	7.02%
91	000488	晨鸣纸业	36,839,623.80	6.96%
92	600143	金发科技	36,699,947.20	6.93%
93	000983	西山煤电	36,487,496.37	6.89%
94	600718	东软股份	35,377,048.05	6.68%
95	000157	中联重科	35,140,532.88	6.64%
96	600098	广州控股	35,086,954.92	6.63%
97	600653	申华控股	34,671,668.95	6.55%
98	600500	中化国际	34,221,970.99	6.46%
99	600029	南方航空	34,055,811.48	6.43%
100	000027	深能源 A	33,965,077.95	6.42%
101	600879	火箭股份	33,781,269.21	6.38%
102	600875	东方电机	33,711,718.87	6.37%
103	600786	东方锅炉	33,402,375.14	6.31%
104	600868	梅雁水电	33,361,696.88	6.30%
105	600383	金地集团	33,132,810.37	6.26%
106	600008	首创股份	33,050,957.64	6.24%
107	600271	航天信息	32,698,467.31	6.18%
108	600675	中华企业	31,824,661.12	6.01%
109	000878	云南铜业	31,303,068.95	5.91%
110	600895	张江高科	31,026,165.02	5.86%
111	000729	燕京啤酒	30,953,530.12	5.85%
112	000630	铜都铜业	30,667,477.57	5.79%
113	600183	生益科技	30,546,252.04	5.77%
114	000768	西飞国际	30,468,001.53	5.76%
115	600210	紫江企业	30,243,506.81	5.71%
116	000800	一汽轿车	30,093,912.49	5.68%
117	600489	中金黄金	30,063,260.65	5.68%
118	600741	巴士股份	28,939,602.49	5.47%
119	000031	中粮地产	28,928,339.67	5.46%
120	600123	兰花科创	28,524,670.74	5.39%
121	000538	云南白药	28,350,861.01	5.36%
122	000503	海虹控股	28,287,288.40	5.34%
123	000036	华联控股	28,266,592.12	5.34%
124	600269	赣粤高速	28,265,430.39	5.34%
125	600418	江淮汽车	28,184,810.76	5.32%
126	000088	盐田港	28,184,298.48	5.32%

127	600308	华泰股份	27,816,525.01	5.25%
128	000089	深圳机场	27,585,509.11	5.21%
129	600108	亚盛集团	27,477,894.61	5.19%
130	600616	第一食品	26,930,093.50	5.09%
131	000930	丰原生化	26,658,302.71	5.04%
132	600027	华电国际	26,599,462.79	5.02%
133	000625	长安汽车	26,574,761.63	5.02%
134	600569	安阳钢铁	26,543,758.80	5.01%
135	600362	江西铜业	26,269,574.36	4.96%
136	600797	浙大网新	26,250,487.19	4.96%
137	000778	新兴铸管	25,992,758.34	4.91%
138	000960	锡业股份	25,947,704.58	4.90%
139	000009	S 深宝安 A	25,929,946.42	4.90%
140	000933	神火股份	25,883,143.85	4.89%
141	600550	天威保变	25,672,348.07	4.85%
142	600808	马钢股份	25,662,706.45	4.85%
143	600220	江苏阳光	25,485,055.28	4.81%
144	600635	大众公用	25,478,130.39	4.81%
145	000869	张 裕 A	24,898,807.64	4.70%
146	600125	铁龙物流	24,864,222.47	4.70%
147	600058	五矿发展	24,819,436.28	4.69%
148	600596	新安股份	24,681,513.35	4.66%
149	600196	复星医药	24,607,197.56	4.65%
150	000401	冀东水泥	24,584,087.83	4.64%
151	600357	承德钒钛	24,579,432.09	4.64%
152	600886	国投电力	24,448,728.34	4.62%
153	600299	星新材料	24,293,690.49	4.59%
154	600022	济南钢铁	24,152,313.79	4.56%
155	600456	宝钛股份	23,944,762.62	4.52%
156	000022	深赤湾 A	23,925,035.79	4.52%
157	600835	上海机电	23,924,573.81	4.52%
158	600588	用友软件	23,829,577.78	4.50%
159	000021	长城开发	23,732,047.92	4.48%
160	600428	中远航运	23,484,189.99	4.44%
161	600779	水井坊	23,465,519.10	4.43%
162	601001	大同煤业	23,280,206.68	4.40%
163	600809	山西汾酒	23,135,004.23	4.37%
164	600066	宇通客车	23,110,687.19	4.37%
165	600004	白云机场	23,066,842.82	4.36%
166	600851	海欣股份	23,020,995.76	4.35%
167	600748	上实发展	22,944,571.09	4.33%
168	600188	兖州煤业	22,909,145.37	4.33%
169	000410	沈阳机床	22,863,946.78	4.32%

170	000559	万向钱潮	22,841,671.56	4.31%
171	600549	厦门钨业	22,673,055.46	4.28%
172	600085	同仁堂	22,506,835.26	4.25%
173	000807	云铝股份	22,487,082.64	4.25%
174	600780	通宝能源	22,375,391.02	4.23%
175	000717	韶钢松山	22,207,758.71	4.19%
176	000528	柳 工	22,006,666.50	4.16%
177	000422	湖北宜化	21,994,638.82	4.15%
178	600006	东风汽车	21,897,538.76	4.14%
179	600256	广汇股份	21,836,151.78	4.12%
180	000636	风华高科	21,724,631.97	4.10%
181	600415	小商品城	21,662,295.88	4.09%
182	000680	山推股份	21,484,252.83	4.06%
183	600812	华北制药	21,286,510.05	4.02%
184	600282	南钢股份	20,760,557.90	3.92%
185	600348	国阳新能	20,584,829.46	3.89%
186	000822	山东海化	20,491,349.55	3.87%
187	600432	吉恩镍业	20,049,128.54	3.79%
188	000581	威孚高科	19,680,169.90	3.72%
189	600361	华联综超	19,439,118.68	3.67%
190	000012	南 玻 A	19,391,538.92	3.66%
191	600198	*ST 大唐	19,160,943.45	3.62%
192	000927	一汽夏利	19,084,601.44	3.60%
193	600236	桂冠电力	19,048,107.20	3.60%
194	600270	外运发展	19,017,337.90	3.59%
195	600643	S 爱建	18,905,171.42	3.57%
196	600266	北京城建	18,900,460.27	3.57%
197	600997	开滦股份	18,891,004.71	3.57%
198	000682	东方电子	18,879,159.78	3.57%
199	600350	山东高速	18,823,992.08	3.56%
200	000937	金牛能源	18,678,994.29	3.53%
201	000900	现代投资	18,595,939.40	3.51%
202	600747	大显股份	18,516,891.91	3.50%
203	000767	漳泽电力	18,477,173.13	3.49%
204	000828	东莞控股	18,435,317.47	3.48%
205	600087	南京水运	18,415,748.65	3.48%
206	600787	中储股份	18,231,873.15	3.44%
207	600020	中原高速	18,119,345.51	3.42%
208	000897	津滨发展	18,111,104.26	3.42%
209	600161	天坛生物	18,078,346.02	3.41%
210	600820	隧道股份	18,028,203.20	3.41%
211	600153	建发股份	17,927,495.82	3.39%
212	600761	安徽合力	17,721,132.95	3.35%

213	600132	重庆啤酒	17,667,258.13	3.34%
214	600096	云天化	17,649,246.45	3.33%
215	600639	浦东金桥	17,571,832.96	3.32%
216	000425	徐工科技	17,504,086.54	3.31%
217	600472	包头铝业	17,295,948.75	3.27%
218	000917	电广传媒	17,283,377.75	3.26%
219	600600	青岛啤酒	17,224,678.36	3.25%
220	000520	长航凤凰	16,833,406.63	3.18%
221	600662	强生控股	16,762,294.95	3.17%
222	600598	北大荒	16,433,016.94	3.10%
223	600102	莱钢股份	16,419,920.13	3.10%
224	600151	航天机电	16,316,063.64	3.08%
225	000061	农产品	16,113,905.31	3.04%
226	600062	双鹤药业	15,864,820.34	3.00%
227	600021	上海电力	15,667,225.08	2.96%
228	600312	平高电气	15,651,932.71	2.96%
229	600170	上海建工	15,607,545.70	2.95%
230	600547	山东黄金	15,398,687.03	2.91%
231	600754	锦江股份	15,248,824.13	2.88%
232	002008	大族激光	15,230,263.44	2.88%
233	600535	天士力	15,138,179.67	2.86%
234	600221	海南航空	14,860,555.02	2.81%
235	600007	中国国贸	14,783,600.41	2.79%
236	000541	佛山照明	14,645,613.21	2.77%
237	600501	航天晨光	14,614,528.03	2.76%
238	600033	福建高速	14,296,145.74	2.70%
239	000970	中科三环	14,097,221.75	2.66%
240	600171	上海贝岭	13,969,256.46	2.64%
241	600089	特变电工	13,803,952.25	2.61%
242	600110	中科英华	13,718,166.54	2.59%
243	600637	广电信息	13,565,780.58	2.56%
244	600863	内蒙华电	13,543,258.67	2.56%
245	600591	上海航空	13,536,588.30	2.56%
246	600012	皖通高速	13,514,257.13	2.55%
247	600118	中国卫星	13,454,482.01	2.54%
248	600597	光明乳业	13,406,950.55	2.53%
249	000962	东方钨业	13,390,967.37	2.53%
250	000601	韶能股份	13,184,584.05	2.49%
251	000912	泸天化	13,070,084.65	2.47%
252	600307	酒钢宏兴	12,739,412.48	2.41%
253	600160	巨化股份	12,674,241.77	2.39%
254	600316	洪都航空	12,483,111.31	2.36%
255	000400	许继电气	12,475,126.34	2.36%

256	600770	综艺股份	12,419,732.48	2.35%
257	600200	江苏吴中	12,335,594.40	2.33%
258	000698	沈阳化工	12,132,505.08	2.29%
259	000786	北新建材	12,073,421.92	2.28%
260	600267	海正药业	11,997,811.48	2.27%
261	600508	上海能源	11,994,574.22	2.27%
262	600498	烽火通信	11,954,821.14	2.26%
263	000029	深深房 A	11,927,779.63	2.25%
264	600970	中材国际	11,774,597.63	2.22%
265	600332	广州药业	11,773,478.60	2.22%
266	000875	吉电股份	11,662,401.94	2.20%
267	600874	创业环保	11,595,992.97	2.19%
268	600602	广电电子	11,452,996.35	2.16%
269	002025	航天电器	11,387,982.91	2.15%
270	000969	安泰科技	11,078,182.93	2.09%
271	000725	*ST 东方 A	10,988,856.66	2.08%
272	600410	华胜天成	10,925,423.67	2.06%
273	600117	西宁特钢	10,847,333.21	2.05%
274	000099	中信海直	10,734,311.85	2.03%
275	000059	辽通化工	10,661,526.11	2.01%
276	600121	郑州煤电	10,656,253.01	2.01%
277	000066	长城电脑	10,623,694.28	2.01%
278	600884	杉杉股份	10,591,824.70	2.00%
279	600190	锦州港	10,589,254.63	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	累计卖出金额（元）	占期初基金资产净值比例
1	600016	民生银行	97,132,983.93	18.35%
2	000002	万 科 A	82,066,295.12	15.50%
3	600030	中信证券	77,723,549.93	14.68%
4	600036	招商银行	74,758,384.70	14.12%
5	600019	宝钢股份	66,007,997.06	12.47%
6	600900	长江电力	63,655,598.22	12.02%
7	600000	浦发银行	54,632,887.99	10.32%
8	601398	工商银行	54,181,914.62	10.23%
9	600050	中国联通	53,780,107.64	10.16%
10	600028	中国石化	52,183,367.48	9.86%
11	000623	吉林敖东	51,010,592.60	9.64%
12	000001	深发展 A	44,859,175.84	8.47%
13	600018	上港集团	44,133,780.72	8.34%
14	601318	中国平安	43,586,575.91	8.23%
15	600519	贵州茅台	43,415,856.60	8.20%
16	000423	东阿阿胶	41,080,323.03	7.76%
17	601006	大秦铁路	38,783,753.73	7.33%

18	000100	*ST TCL	38,459,981.87	7.26%
19	600009	上海机场	37,429,533.20	7.07%
20	000858	五 粮 液	35,997,160.67	6.80%
21	002024	苏宁电器	35,086,392.83	6.63%
22	600011	华能国际	34,513,090.52	6.52%
23	600005	武钢股份	34,353,303.27	6.49%
24	601988	中国银行	32,937,287.66	6.22%
25	000063	中兴通讯	30,175,844.46	5.70%
26	601166	兴业银行	28,598,193.60	5.40%
27	000869	张 裕 A	27,385,641.56	5.17%
28	000898	鞍钢股份	27,048,430.80	5.11%
29	600881	亚泰集团	26,786,334.22	5.06%
30	000022	深赤湾 A	26,578,685.18	5.02%
31	600642	申能股份	26,164,161.44	4.94%
32	600309	烟台万华	25,802,934.77	4.87%
33	600010	包钢股份	25,569,525.31	4.83%
34	600177	雅戈尔	25,300,235.86	4.78%
35	600739	辽宁成大	25,157,728.42	4.75%
36	000895	双汇发展	23,547,361.99	4.45%
37	601628	中国人寿	23,545,311.51	4.45%
38	600583	海油工程	23,075,577.64	4.36%
39	000039	中集集团	22,641,518.49	4.28%
40	000527	美的电器	22,473,611.13	4.25%
41	600198	*ST 大唐	22,185,715.48	4.19%
42	600104	上海汽车	21,852,041.79	4.13%
43	600001	邯郸钢铁	20,652,388.74	3.90%
44	000520	长航凤凰	20,581,588.01	3.89%
45	600832	东方明珠	19,820,368.95	3.74%
46	600811	东方集团	19,587,325.92	3.70%
47	000793	华闻传媒	19,551,778.46	3.69%
48	000539	粤电力 A	19,089,456.42	3.61%
49	000629	攀钢钢钒	18,759,714.49	3.54%
50	000825	太钢不锈	18,501,414.64	3.49%
51	600585	海螺水泥	17,948,677.93	3.39%
52	600884	杉杉股份	17,216,708.62	3.25%
53	000932	华菱管线	17,051,837.02	3.22%
54	600717	天津港	16,916,396.86	3.20%
55	601111	中国国航	16,800,666.85	3.17%
56	600601	方正科技	16,316,825.59	3.08%
57	000402	金 融 街	16,232,025.50	3.07%
58	600718	东软股份	15,717,941.37	2.97%
59	600089	特变电工	15,502,139.86	2.93%
60	600037	歌华有线	15,349,542.19	2.90%

61	600887	伊利股份	15,339,339.20	2.90%
62	000709	唐钢股份	15,244,609.70	2.88%
63	000651	格力电器	15,199,486.02	2.87%
64	000792	盐湖钾肥	15,028,074.89	2.84%
65	600795	国电电力	14,929,131.98	2.82%
66	600970	中材国际	14,714,990.19	2.78%
67	000751	锌业股份	14,604,352.50	2.76%
68	600694	大商股份	14,536,671.38	2.75%
69	600320	振华港机	14,250,425.98	2.69%
70	600267	海正药业	14,221,167.98	2.69%
71	600631	百联股份	14,098,004.05	2.66%
72	600100	同方股份	13,722,858.92	2.59%
73	600649	原水股份	13,623,812.61	2.57%
74	600026	中海发展	13,511,187.96	2.55%
75	000060	中金岭南	13,249,649.35	2.50%
76	601328	交通银行	13,071,449.78	2.47%
77	000698	沈阳化工	13,044,786.50	2.46%
78	000875	吉电股份	12,791,762.59	2.42%
79	000069	华侨城 A	12,790,542.14	2.42%
80	600637	广电信息	12,649,825.73	2.39%
81	600690	青岛海尔	12,593,135.32	2.38%
82	600497	驰宏锌锗	12,591,186.75	2.38%
83	000630	铜都铜业	12,557,735.48	2.37%
84	600015	华夏银行	12,327,828.14	2.33%
85	000027	深能源 A	12,257,005.96	2.32%
86	000601	韶能股份	12,080,152.38	2.28%
87	600048	保利地产	12,035,614.30	2.27%
88	000562	宏源证券	12,031,289.82	2.27%
89	600068	葛洲坝	11,997,824.60	2.27%
90	000983	西山煤电	11,966,958.31	2.26%
91	600150	沪东重机	11,964,700.65	2.26%
92	600008	首创股份	11,926,318.26	2.25%
93	600098	广州控股	11,776,060.18	2.22%
94	601998	中信银行	11,667,763.07	2.20%
95	600741	巴士股份	11,641,049.95	2.20%
96	600331	宏达股份	11,555,714.83	2.18%
97	600879	火箭股份	11,172,419.28	2.11%
98	600653	申华控股	11,111,323.80	2.10%
99	600688	S 上石化	11,054,147.78	2.09%
100	600602	广电电子	10,829,999.93	2.05%
101	600500	中化国际	10,723,313.08	2.03%
102	000839	中信国安	10,705,519.47	2.02%
103	600121	郑州煤电	10,681,894.29	2.02%

104	000878	云南铜业	10,563,337.11	2.00%
-----	--------	------	---------------	-------

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	12,847,775,601.12
卖出股票的收入总额	3,705,977,650.58

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	031003	深发SFC1	501,524	7,643,225.76	0.06%
1	031004	深发SFC2	250,762	4,159,389.29	0.03%

(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	501,524	0	0.00	501,524	0.00	股权分置改革对价支付
2	031004	深发SFC2	250,762	0	0.00	250,762	0.00	
3	580989	南航JTP1	3,197,785	0	0.00	3,197,785	8,033,201.66	
4	580013	武钢CWB1		92,635	214,663.09	92,635	554,748.03	A
合计					214,663.09		8,587,949.69	

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。

4、其他资产的构成

项目	金额（元）
应收交易保证金	250,000.00
应收证券清算款	297,574,038.47
应收股利	5,681,605.70
应收利息	112,709.91
应收申购款	38,541,372.58
合计	342,159,726.66

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、基金投资流通受限证券（非公开发行/网下申购）的情况

无。

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	402,232 户
报告期末平均每户持有的基金份额	23,691.70 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	9,529,560,503.37	100.00%
其中：机构投资者持有的基金份额	230,200,225.64	2.42%
个人投资者持有的基金份额	9,299,360,277.73	97.58%

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	1,813,356,066.47
本报告期期初基金份额总额	313,896,083.57
加：本报告期期间总申购份额	14,599,578,619.19
减：本报告期期间总赎回份额	5,383,914,199.39
本报告期末基金份额总额	9,529,560,503.37

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二次分红。向截至 2007 年 4 月 6 日和 2007 年 4 月 11 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 份基金份额分别可取得分配收益人民币 6.10 元和 7.10 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安永华明会计师事务所，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的情形。

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	4,305,681,531.90	26.04%	3,530,640.71	26.39%
国金证券	1	4,766,719,047.83	28.83%	3,729,976.80	27.88%
中银国际	1	7,461,177,436.68	45.13%	6,118,152.30	45.73%
合计	3	16,533,578,016.41	100.00%	13,378,769.81	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	818,530.50	25.09%	0.00	0.00%
国金证券	2,443,800.54	74.91%	0.00	0.00%
中银国际	0.00	0.00%	0.00	0.00%
合 计	3,262,331.04	100.00%	0.00	0.00%

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	8,033,824.26	93.54%
中银国际证券	554,791.02	6.46%
合 计	8,588,615.28	100.00%

4、本报告期内租用席位变更情况

无。

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
3	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
4	大成沪深 300 指数证券投资基金分红公告	证券时报	2007 年 4 月 4 日
5	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
6	大成沪深 300 指数证券投资基金第二次分红预告	证券时报	2007 年 4 月 9 日
7	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
8	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
9	大成沪深 300 指数证券投资基金第二次分红结果公告	证券时报	2007 年 4 月 12 日
10	大成基金管理有限公司增加广东发展银行为代销机构的公告	证券时报、中国证券报和上海证券报	2007 年 4 月 25 日
11	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
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增加广州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 6 月 14 日
17	大成基金管理有限公司关于增加深圳发	证券时报、中国证券	2007 年 6 月 19 日

	展银行为代销机构的公告	报和上海证券报	
18	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
19	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
20	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、《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 8 月 27 日