景业证券投资基金 2006年年度报告摘要

第一节 重要提示

基金管理人的董事会及董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带责任。本年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人中国农业银行根据本基金合同规定，于2007年3月26日复核了本报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

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

本年度报告摘要摘自年度报告正文，投资者欲了解详细内容，应阅读年度报告正文。

第二节 基金简介

一、基金基本资料	
1、基金简称：	基金景业
2、基金交易代码：	500017
3、基金运作方式：	契约型封闭式
4、基金合同生效日（规范后）：	2000年8月15日
5、报告期末基金份额总额：	500,000,000份
6、基金合同存续期：	15年
7、基金份额上市的证券交易所：	上海证券交易所
8、上市日期：	2001年12月19日
二、基金产品说明	
1、投资目标：	在优化组合投资基础上，尽可能规避投资风险，谋求基金资产增值和收益的最大化。
2、投资策略：	本基金以中长线投资为主，辅以适当的短线操作，并注重投资对象的良好流动性和投资组合的合理分散性。投资对象重点关注具有一定技术含量、成长性良好的新兴产业如信息业、新材料等以及适当关注传统产业成长性良好以及新兴产业转型的企业。
3、业绩比较基准：	无
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、信息披露负责人：	杜鹏
3、联系电话：	0755-83183388
4、传真：	0755-83199588
5、电子邮箱：	dupeng@dcfund.com.cn
四、基金托管人	
1、名称：	中国农业银行
2、信息披露负责人：	李芳菲
3、联系电话：	010-68435588
4、传真：	010-68424181
5、电子邮箱：	lifangfei@abchina.com
五、信息披露	
登载年度报告正文的管理人互联网网址：	http://www.dcfund.com.cn
基金年度报告置备地点：	深圳市福田区深南大道7088号招商银行大厦32层 大成基金管理有限公司 北京市海淀区西三环北路100号金玉大厦 中国农业银行托管业务部

第三节 主要财务指标和基金净值表现及收益分配情况

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

一、主要财务指标

序号	项目	2006年	2005年	2004年
1	基金本期净收益（元）	295,501,548.54	1,681,312.36	8,943,494.12
2	基金份额本期净收益（元）	0.5910	0.0034	0.0179
3	期末可供分配基金份额收益（元）	0.4217	-0.1693	-0.1726
4	期末基金资产净值（元）	905,851,461.22	453,096,864.41	427,357,700.70
5	期末基金份额净值（元）	1.8117	0.9062	0.8547
6	本期基金份额净值增长率	99.92%	6.03%	-1.59%

二、基金净值表现

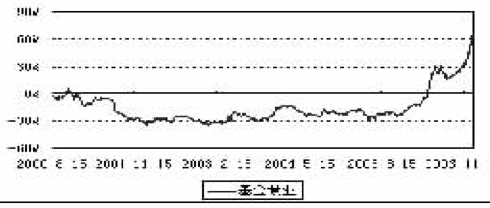
1、基金历史各时间段净值增长率

阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②
过去3个月	34.04%	2.33%
过去6个月	29.05%	2.59%
过去1年	99.92%	2.93%
过去3年	108.60%	2.47%
过去5年	133.08%	2.36%
自基金合同生效起至今	65.84%	2.40%

2、基金合同生效以来基金份额净值的变动情况

基金景业累计份额净值增长率历史走势图

（2000年8月15日至2006年12月31日）



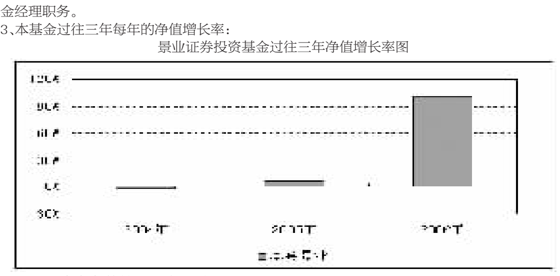
注：(1)按基金合同规定，本基金自基金上市之日起6个月内为建仓期，截至报告日本基金的各项投资比例已达到基金合同第七条之（五）投资组合中规定的各项比例：本基金投资于股票、债券的比例，不得低于基金资产总值的80%；投资于国家债券的比例，不得低于基金资产净值的20%；持有一家上市公司的股票，不超过基金资产净值的10%。

(2)2006年12月11日，景业证券投资基金转型获基金份额持有人大会决议通过，并获中国证监会2006年12月27日证监基金字[2006]263号文核准。自2007年1月16日起，景业证券投资基金在上海证券交易所终止上市，其由《景业证券投资基金基金合同》修订而成的《大成积极成长股票型证券投资基金基金合同》正式生效。

(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》，聘任瞿蕴理女士担任景业证券投资基金经理职务，原基金经理徐彬先生不再担任景业证券投资基金经理职务。

3、本基金过往三年每年的净值增长率：

景业证券投资基金过往三年净值增长率图



三、过往三年每年的基金收益分配情况

年度	每10份基金份额分红数	备注
2006年	4.000元	分红除权日2007年1月11日
2005年	无	
2004年	无	

第四节 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生命周期基金。

2、基金经理简介

徐彬先生，基金经理，硕士。11年证券从业经历，曾就职于君安证券研究所，历任大成基金管理公司研究部副经理、基金景博基金经理。2003年1月起担任基金景业基金经理，2006年1月起，兼任基金景福基金经理。

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》，聘任瞿蕴理女士担任景业证券投资基金经理职务，原基金经理徐彬先生不再担任景业证券投资基金经理职务。

瞿蕴理女士，基金经理，工学硕士。7年证券从业经历，曾就职于中兴通讯股份有限公司，大成基金管理有限公司策略分析师、投资决策委员会委员。现同时兼任大成财富管理2020生命周期证券投资基金基金经理。2006年5月起担任景业证券投资基金基金经理。

二、基金运作遵规守信情况说明

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》、《景业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，基金景业的投资范围、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年市场回顾和运作情况

2006年迎来了中国证券史上不可多得的一年。上证综指涨幅达到130.34%，取得全球涨幅之最；股市规模大幅度扩张，沪深两市总市值已经突破10万亿元。长期以来困扰中国股市健康发展的“股权分置”问题基本得以行之有效的解决，股市进入全流通时代，上市公司的价值开始以市值来衡量；股权激励政策的推出将上市公司管理层与经营绩效挂钩，这将有效的刺激公司的经营治理和业绩的释放。

经济的内生增长以及大量贸易顺差使得资金流动性过剩问题显得越来越突出，给资本市场带来的强劲的资金供给底线。人民币长期升值以及强劲的中国经济增长更使得全球资金增持中国，全球最大IPO的工行实现A+H同步上市标志着中国资本市场进入一个崭新的蓝筹时代。监管机构不断加强监督上市公司的有关行为，大力组织清理大股东侵占上市公司资产，为A股市场的带来良好的治理环境，切实保障了小股东的实际利益。

报告期末本基金已成功转型，转型过程中得到了持有人大会的全票通过。基金景业尽管受制于重仓股长期停牌等因素的干扰，仍旧取得了较为良好的业绩。以绩优成长股为核心持股风格，以食品饮料、商业零售、银行证券、地产等为核心持仓，并配置了军工、有色、机械等行业的股票。

2、2007年市场展望和投资策略

我们认为2007年股市的基础仍旧较好，宏观经济稳健高速发展，人民币升值大趋势不变，资金流动性过剩问题难以一时解决，因此市场仍旧存在较多机会。

在乐观期待中国股市2007年向好的同时，我们也有必要看到潜在的风险，股市的上涨会引发一系列的融资和套现行为，包括大量IPO上市、定向以及不定向增发股份，以及股改之后的“大小非”流通，这些因素都将改变市场资金和筹码的供求关系。另一方面，考虑到涨幅较大和估值水平提高较多的情况下，可能引发短期获利筹码的流失。股指期货的行将推出将也会在初期增加市场的波动性。因此，我们认为2007年的预期收益不能过分提高，仍旧要将眼光放得较为长远，等待长期收益较为合适。

在选股的时机上，我们继续秉承一贯的价值投资理念，寻找具备价值低估、长期发展前景良好的股票作为持股品种，而不会跟随市场一时的概念题材随意转动。不断平衡收益和风险之间的关系管理，争取长时间为股市创造回报。

第五节 托管人报告

本基金托管人—中国农业银行根据《景业证券投资基金基金合同》和《景业证券投资基金托管协议》，在托管景业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，对景业证券投资基金管理人—大成基金管理有限公司2006年1月1日至2006年12月31日基金的投资运作，进行了认真、独立的会计核算和必要的投资监督，认真履行了托管人的义务，没有从事任何损害基金份额持有人利益的行为。

本托管人认为，景业基金管理人在景业证券投资基金的投资运作、基金资产净值的计算、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景业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

第六节 审计报告

本基金2006年年度财务会计报告已经普华永道中天会计师事务所有限公司审计，注册会计师签字出具了普华永道中天审字(2007)第20260号标准无保留意见的审计报告。投资者欲了解本基金审计报告详细内容，应阅读年度报告正文。

第七节 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

	2006年12月31日	2005年12月31日
资产		
银行存款	83,987,512.37	1,469,476.70
清算备付金	5,676,925.98	1,392,377.07
交易保证金	660,000.00	660,000.00
应收证券清算款	0.00	0.00
应收股利	0.00	0.00
应收利息	1,420,682.15	1,106,687.57
应收申购款	0.00	0.00
其他应收款	2,982,097.54	2,982,097.54
股票投资市值	719,189,484.73	350,849,784.69
其中：股票投资成本	524,839,409.79	313,866,985.79
债券投资市值	182,553,559.40	100,281,129.00
其中：债券投资成本	182,456,383.53	99,528,947.36
权证投资	540,778.00	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	997,011,040.17	458,741,552.57
负债		
应付证券清算款	83,225,607.58	51,496.19
应付赎回款	0.00	0.00
应付赎回费	0.00	0.00
应付管理人报酬	1,056,120.70	553,958.05
应付托管费	176,020.14	92,326.36
应付佣金	2,621,726.75	916,876.53
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	3,770,103.78	3,770,031.03
卖出回购证券款	0.00	0.00
短期借款	0.00	0.00
预提费用	310,000.00	260,000.00
其他负债	0.00	0.00
负债合计	91,159,578.95	5,644,688.16
持有人权益		
实收基金	500,000,000.00	500,000,000.00
未实现利得	194,988,028.81	37,734,980.54
未分配收益	210,863,432.41	-84,638,116.13
持有人权益合计	905,851,461.22	453,096,864.41
负债及持有人权益总计	997,011,040.17	458,741,552.57
基金份额净值	1.8117	0.9062

2、2006年度经营业绩表

	2006年度	2005年度
一、收入	307,421,176.43	9,835,181.28
1、股票差价收入	285,063,631.49	-10,793,802.14
2、债券差价收入	688,892.36	3,338,473.64
3、权证差价收入	8,219,519.23	8,017,650.41
4、债券利息收入	3,908,587.75	2,691,976.17
5、存款利息收入	428,178.50	389,492.62
6、股利收入	9,093,944.46	6,154,321.65
7、买入返售证券收入	0.00	0.00
8、其他收入	18,422.64	37,068.93
二、费用	11,919,627.89	8,153,868.92
1、基金管理人报酬	9,417,876.86	6,398,968.97
2、基金托管费	1,570,668.69	1,066,579.61
3、卖出回购证券支出	463,936.44	230,043.99
4、利息支出	0.00	0.00
5、其他费用	467,145.90	458,276.35
其中：上市年费	60,000.00	60,000.00
信息披露费	300,000.00	300,000.00
审计费用	60,000.00	60,000.00
三、基金净收益	295,501,548.54	1,681,312.36
加：未实现利得	157,253,048.27	24,057,851.35
四、基金经营业绩	452,754,596.81	25,739,163.71

3、2006年度基金收益分配表

	2006年度	2005年度
本期基金净收益	295,501,548.54	1,681,312.36
加：期初基金净收益	-84,638,116.13	-86,319,428.49
加：本期损益平准金	0.00	0.00
可供分配基金净收益	210,863,432.41	-84,638,116.13
减：本期已分配基金净收益	0.00	0.00
期末基金净收益	210,863,432.41	-84,638,116.13

4、2006年度基金净值变动表

	2006年度	2005年度
一、期初基金净值	453,096,864.41	427,357,700.70
二、本期经营活动：		
基金净收益	295,501,548.54	1,681,312.36
未实现利得	157,253,048.27	24,057,851.35
经营活动产生的基金净值变动数	452,754,596.81	25,739,163.71
三、本期基金份额交易：		
基金申购款	0.00	0.00
基金赎回款	0.00	0.00
基金份额交易产生的基金净值变动数	0.00	0.00
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	0.00
五、期末基金净值	905,851,461.22	453,096,864.41

二、会计报表附注

(除特别标明外，金额单位为人民币元)

1. 本年度会计报表编制基础、主要会计政策、会计估计与上年度报告相比发生变更的内容

(1)会计报表编制基础发生变更的内容

根据《景业证券投资基金基金合同》中的规定，本基金存续期至2007年3月30日终止。根据于2006年12月11日召开的本基金基金份额持有人大会中表决通过的《关于景业证券投资基金转型有关事项的议案》，经中国证监会证监基金字[2006]263号《关于核准景业证券投资基金基金份额持有人大会决议的批复》批准，本基金本次基金份额持有人大会的表决结果核准于现有存续期结束前转型为开放式基金并相应延长存续期至不定期，因此本基金本年度会计报表仍以持续经营假设为编制基础。

(2) 基金资产的估值原则新增：

因认购新发行分离交易可转债而取得的权证从实际取得日起到卖出成交日或行权日止，上市交易的权证投资按估值日在证券交易所挂牌的该权证投资的市场交易均价估值；未上市交易的权证投资按公允价值估值。

(3)证券投资成本计价方法新增：

(i)认购新发行的分离交易可转债于成交日先按支付的全部价款确认为债券投资，后于权证实际取得日按本会计报表附注1(2)(ii)中所示的方法单独核算权证成本，并相应调整债券投资成本。

(ii) 因认购新发行的分离交易可转债而取得的权证在实际取得日，按权证公允价值占分离交易可转债全部公允价值的比例将购买分离交易可转债实际支付全部价款的一部分确认为权证成本。

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

(4) 收入/(损失)的确认和计量发生变更的内容

权证差价收入于卖出权证成交日按卖出权证成交总额与其成本和相关费用的差额确认。

(5)基金的收益分配政策发生变更的内容：

根据2006年11月13日发布的《大成基金管理有限公司关于修改旗下封闭式基金收益分配条款的公告》，基金收益分配次数由每会计年度分配一次变更为每年度至少分配一次，收益分配比例由不低于基金净收益的90%变更为不低于基金可分配收益的90%。

2. 本报告期重大会计差错的内容和更正金额

无。

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(“大成基金”)	基金管理人、基金发起人
中国农业银行	基金托管人
天津信托投资有限责任公司(“天津信托”)	基金发起人
光大证券股份有限公司(“光大证券”)	基金管理人的股东
中泰信托投资有限责任公司	基金管理人的股东
中国银河证券有限责任公司(“银河证券”)(*)	基金管理人的股东
广东证券股份有限公司(“广东证券”)(**)	基金管理人的股东

本报告期内关联方关系未发生变化

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

** 中国证监会于2005年11月6日作出对广东证券取消业务许可并责令关闭的行政处罚。广东证券持有的大成基金股权的继承机构尚待明确。

下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

（2）通过关联方席位进行的交易及佣金情况

A 股票买卖

关联方名称	2006年度		2005年度	
	本期成交金额	占本期该类交易成交总金额比例	本期成交金额	占本期该类交易成交总金额比例
银河证券	1,131,832,391.93	13.07%	1,055,118,218.50	25.29%
光大证券	2,186,411,978.01	25.24%	765,604,540.45	18.35%
合计	3,318,244,369.94	38.31%	1,820,722,758.95	43.64%

B 债券买卖

关联方名称	2006年度		2005年度	
	本期成交金额	占本期该类交易成交总金额比例	本期成交金额	占本期该类交易成交总金额比例
银河证券	53,366,276.60	9.92%	233,688,565.70	41.00%
光大证券	25,484,511.36	4.74%	0.00	0.00%
合计	78,850,787.96	14.66%	233,688,565.70	41.00%

C 债券回购

关联方名称	2006年度		2005年度	
	本期成交金额	占本期该类交易成交总金额比例	本期成交金额	占本期该类交易成交总金额比例
银河证券	0.00	0.00%	100,000,000.00	19.19%

D 权证买卖

关联方名称	2006年度		2005年度	
	本期成交金额	占本期该类交易成交总金额比例	本期成交金额	占本期该类交易成交总金额比例
银河证券	16,429,182.43	35.08%	0.00	0.00%
光大证券	7,657,505.32	16.35%	6,592,287.28	82.21%
合计	24,086,687.75	51.43%	6,592,287.28	82.21%

E 佣金

关联方名称	2006年度		2005年度	
	金额	占本期佣金总金额比例	金额	占本期佣金总金额比例
银河证券	927,560.68	13.30%	862,032.25	25.68%
光大证券	1,710,892.23	24.54%	599,092.74	17.85%
合计	2,638,452.91	37.84%	1,461,124.99	43.53

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

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

（3）与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易

本基金在本年度与基金托管人中国农业银行通过银行间同业市场进行的债券交易如下：

	2006年度	2005年度
买入债券结算金额	39,829,400.00	29,886,000.00
卖出回购证券协议金额	0.00	38,800,000.00
卖出回购证券利息支出	0.00	9,487.39

（4）关联方报酬

A 基金管理人报酬

支付基金管理人大成基金管理有限公司的基金管理人报酬按前一日基金资产净值1.50%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。

其计算公式为：日基金管理人报酬＝前一日基金资产净值X 1.50%／当年天数。

本基金在本年度需支付基金管理人报酬9,417,876.86元(2005年：6,398,968.97元)。B 基金托管人报酬

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

日基金托管费＝前一日基金资产净值X 0.25%／当年天数。

本基金在本年度需支付基金托管费1,570,668.69元(2005年：1,066,579.61元)。

C 由关联方保管的银行存款余额及由此产生的利息收入

本基金的银行存款由基金托管人中国农业银行保管，并按银行间同业利率计息。基金托管人于2006年12月31日保管的银行存款余额为83,987,512.37元(2005年：1,469,476.70元)。本年度由基金托管人保管的银行存款产生的利息收入为361,207.85元(2005年：339,368.84元)。

（5）基金各关联方投资本基金的情况

	2006年12月31日		2005年12月31日	
	基金份额	净值	基金份额	净值
大成基金	23,408,298.00	42,408,813.49	7,928,035.00	7,184,385.32
天津信托	2,500,000.00	4,529,250.00	2,500,000.00	2,265,500.00

4.报告期末流通转让受到限制的基金资产

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

股票代码	股票名称	停牌日期	年末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量	年末成本总额	年末估值总额
方案沟通协商阶段停牌：								
000423	S阿胶	06/12/04	13.72	未知	未知	1,056,215	12,361,796.31	14,491,269.80
方案实施阶段停牌：								
000895	S双汇	06/06/01	31.02	未知	未知	1,539,410	26,247,572.71	47,752,498.20
600102	S莱钢	06/09/20	6.18	未知	07/01/18	1,410,000	8,147,231.95	8,713,800.00
合计							46,756,600.97	70,957,568.00

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

本基金截至2006年12月31日止投资的流通受限制的股票情况如下：

股票代码	股票名称	成功申购日期	可流通日期	申购价格	期末估值单价	数量	期末成本总额	期末估值总额
002073	青岛软控	06/09/28	07/01/18	26.00	47.28	8,281	215,306.00	391,525.68
600017	日照港	06/09/28	07/01/17	4.70	7.18	48,847	229,580.90	350,721.46
601006	大秦铁路	06/07/26	07/02/01	4.95	8.09	283,860	1,405,107.00	2,296,427.40
601588	北辰实业	06/09/28	07/01/16	2.40	6.74	442,203	1,061,287.20	2,980,448.22
601628	中国人寿	06/12/28	07/04/09	18.88	18.88	149,940	2,830,867.20	2,830,867.20
601988	中国银行	06/06/28	07/01/05	3.08	5.27	589,463	1,815,546.04	3,106,470.01
合计							7,557,694.34	11,956,459.97

第八节 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	89,664,438.35	8.99%
股票	719,189,484.73	72.14%
债券	182,553,559.40	18.31%
权证	540,778.00	0.05%
其他资产	5,062,779.69	0.51%
合计	997,011,040.17	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	0.00	0.00%
B 采掘业	13,264,977.00	1.46%
C 制造业	360,131,853.98	39.76%
C0 食品、饮料	94,099,315.48	10.39%
C1 纺织、服装、皮毛	6,816,344.40	0.75%
C2 木材、家具	0.00	0.00%
C3 造纸、印刷	68,670,419.78	7.58%
C4 石油、化学、塑胶、塑料	3,034,179.00	0.33%
C5 电子	0.00	0.00%
C6 金属、非金属	67,452,384.00	7.45%
C7 机械、设备、仪表	87,309,136.12	9.64%
C8 医药、生物制品	32,750,075.20	3.62%
C99 其他制造业	0.00	0.00%
D 电力、煤气及水的生产和供应业	0.00	0.00%
E 建筑业	0.00	0.00%
F 交通运输、仓储业	10,495,505.52	1.16%
G 信息技术业	52,383,444.40	5.78%
H 批发和零售贸易	36,295,734.85	4.01%
I 金融、保险业	160,734,862.51	17.74%
J 房地产业	59,576,729.66	6.58%
K 社会服务业	25,068,713.67	2.77%
L 传播与文化产业	0.00	0.00%
M 综合类	1,237,663.14	0.13%
合计	719,189,484.73	79.39%

三、报告期末按市值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票明细

序号	股票代码	股票名称	数 量(股)	市 值(元)	占基金资产净值比例
1	600963	岳阳纸业	6,125,818	68,670,419.78	7.58%
2	601398	工商银行	9,863,298	59,475,686.94	6.57%
3	600019	宝钢股份	6,894,200	58,738,584.00	6.48%
4	000002	万 科 A	3,419,152	52,894,281.44	5.84%
5	600030	中信证券	1,811,500	49,399,605.00	5.45%
6	000895	S 双 汇	1,539,410	47,752,498.20	5.27%
7	600718	东软股份	1,958,338	46,608,444.40	5.15%
8	000568	泸州老窖	1,535,796	39,070,650.24	4.31%
9	000625	长安汽车	3,633,035	32,297,681.15	3.57%
10	600036	招商银行	1,815,500	29,465,565.00	3.25%

注：投资者欲了解本报告期末基金投资的所有股票明细，应阅读登载于大成基金管理有限公司网站（http://www.dcfund.com.cn）的年度报告正文。

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	600036	招商银行	170,236,505.09	37.57%
2	601398	工商银行	128,904,240.32	28.45%
3	000898	鞍钢股份	113,261,359.67	25.00%
4	600028	中国石化	106,516,715.49	23.51%
5	600016	民生银行	101,987,018.91	22.51%
6	000002	万 科 A	88,000,912.85	19.42%
7	600019	宝钢股份	71,367,054.24	15.75%
8	600005	武钢股份	69,919,643.94	15.43%
9	600887	伊利股份	69,900,309.35	15.43%
10	000568	泸州老窖	68,951,098.76	15.22%
11	600009	上海机场	67,689,768.10	14.94%
12	000930	丰原生化	67,286,059.81	14.85%
13	600519	贵州茅台	66,411,875.87	14.66%
14	600900	长江电力	64,241,565.53	14.18%
15	600029	S南航	61,899,563.54	13.66%
16	000063	中兴通讯	59,080,558.94	13.04%
17	600547	山东黄金	56,577,615.33	12.49%
18	600309	烟台万华	56,087,802.05	12.38%
19	600030	中信证券	55,735,150.24	12.30%
20	000709	唐钢股份	55,636,395.06	12.28%
21	600963	岳阳纸业	54,859,467.79	12.11%
22	000423	S 阿 胶	52,245,593.10	11.53%
23	000839	中信国安	52,033,680.13	11.48%
24	600220	江苏阳光	48,847,723.19	10.78%
25	600739	辽宁成大	47,800,003.33	10.55%
26	000538	云南白药	47,475,768.11	10.48%
27	000024	招商地产	46,829,793.56	10.34%
28	600550	天威保变	45,966,137.46	10.14%
29	600832	东方明珠	45,770,389.19	10.10%
30	000858	五 粮 液	45,367,929.73	10.01%
31	600316	洪都航空	42,689,575.44	9.42%
32	600718	东软股份	41,096,363.24	9.07%
33	000987	广州友谊	40,452,856.35	8.93%
34	000792	盐湖钾肥	38,968,474.23	8.60%
35	000629	新 钢 钒	36,715,622.79	8.10%
36	000623	吉林敖东	35,823,592.10	7.91%
37	600331	宏达股份	35,486,519.29	7.83%
38	000768	西飞国际	35,467,754.07	7.83%
39	000069	华侨城 A	35,027,127.37	7.73%
40	600117	西宁特钢	32,190,204.33	7.10%
41	000869	张 裕 A	31,482,866.19	6.95%
42	600879	火箭股份	31,045,616.68	6.85%
43	600797	浙大网新	28,896,975.75	6.38%
44	000625	长安汽车	28,485,481.53	6.29%
45	600867	通化东宝	27,996,606.62	6.18%
46	000878	云南铜业	27,234,896.74	6.01%
47	600361	华联综超	26,682,226.60	5.89%
48	000895	S 双 汇	26,247,572.71	5.79%
49	601006	大秦铁路	26,222,483.46	5.79%
50	600050	中国联通	25,355,450.00	5.60%
51	600688	S上石化	23,692,929.88	5.23%
52	600001	邯郸钢铁	23,672,943.41	5.22%
53	000927	一汽夏利	23,568,568.19	5.20%
54	600054	黄山旅游	23,400,658.89	5.16%
55	600296	S兰铝	23,197,666.92	5.12%
56	600010	包钢股份	22,819,001.30	5.04%
57	600150	沪东重机	22,518,005.66	4.97%
58	000911	南宁糖业	22,387,896.68	4.94%
59	600258	S首旅	21,496,906.55	4.74%
60	002008	大族激光	21,244,706.33	4.69%
61	600104	上海汽车	20,680,536.32	4.56%
62	600138	中青旅	20,678,248.10	4.56%
63	600583	海油工程	20,198,895.57	4.46%
64	000050	深天马 A	20,101,937.69	4.44%
65	000012	南 玻 A	19,774,837.59	4.36%
66	600031	三一重工	19,766,436.95	4.36%
67	000617	S 济 柴	19,619,805.97	4.33%
68	600491	龙元建设	19,240,746.24	4.25%
69	000917	电广传媒	19,216,602.92	4.24%
70	000888	峨眉山 A	18,819,251.23	4.15%
71	000807	云铝股份	18,697,635.13	4.13%
72	000825	太钢不锈	17,919,263.38	3.95%
73	600489	中金黄金	17,615,774.74	3.89%
74	600535	天士力	17,283,767.50	3.81%
75	600088	中视传媒	17,273,117.77	3.81%
76	600102	莱钢股份	17,040,682.67	3.76%
77	600211	S藏药业	17,004,446.90	3.75%
78	600750	江中药业	16,402,024.15	3.62%
79	600694	大商股份	16,210,554.32	3.58%
80	600151	航天机电	16,179,875.40	3.57%
81	600439	瑞贝卡	16,005,844.31	3.53%
82	600303	曙光股份	15,997,504.45	3.53%
83	600585	海螺水泥	15,887,810.10	3.51%
84	000061	农 产 品	15,820,923.43	3.49%
85	002053	云南盐化	15,775,367.96	3.48%
86	000549	S 湘火炬	15,493,630.42	3.42%
87	000761	本钢板材	15,090,294.67	3.33%
88	600327	大厦股份	15,041,899.77	3.32%
89	000550	江铃汽车	14,283,740.47	3.15%
90	000978	桂林旅游	14,273,143.58	3.15%
91	000758	中色股份	14,162,517.14	3.13%
92	600037	歌华有线	14,056,457.45	3.10%
93	600269	赣粤高速	13,760,172.78	3.04%
94	600048	保利地产	13,030,895.20	2.88%
95	000729	燕京啤酒	12,679,251.88	2.80%
96	600307	酒钢宏兴	12,670,841.66	2.80%
97	002024	苏宁电器	12,143,661.97	2.68%
98	600362	江西铜业	11,971,335.25	2.64%
99	600438	通威股份	11,901,998.32	2.63%
100	600795	国电电力	11,657,892.36	2.57%
101	600011	华能国际	11,402,104.19	2.52%
102	600858	银座股份	11,014,879.11	2.43%
103	000410	沈阳机床	10,973,467.44	2.42%
104	600675	中华企业	10,954,442.61	2.42%
105	000027	深能源 A	10,728,198.96	2.37%
106	600125	铁龙物流	10,457,265.40	2.31%
107	600754	锦江股份	10,406,518.49	2.30%
108	002030	达安基因	10,137,004.98	2.24%
109	600064	南京高科	9,945,189.54	2.19%
110	600330	天通股份	9,644,293.80	2.13%
111	000562	宏源证券	9,398,171.50	2.07%
112	600472	包头铝业	9,344,361.44	2.06%
113	600533	栖霞建设	9,184,968.04	2.03%
114	600084	新天国际	9,082,073.64	2.00%

2、本报告期内累计卖出价值超出期初基金资产净值2%或前二十名股票明细

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额（元）	占期初基金资产净值比例
1	600036	招商银行	156,959,727.22	34.64%
2	600028	中国石化	142,910,942.54	31.54%
3	000898	鞍钢股份	119,305,743.07	26.33%
4	600519	贵州茅台	118,501,940.00	26.15%
5	600029	S南航	105,759,685.11	23.34%
6	000002	万 科 A	96,036,663.66	21.20%
7	600887	伊利股份	93,594,817.31	20.66%
8	600016	民生银行	92,919,460.08	20.51%
9	601398	工商银行	92,629,470.24	20.44%
10	000930	丰原生化	74,922,618.54	16.54%
11	600005	武钢股份	72,262,994.92	15.95%
12	000024	招商地产	69,375,202.62	15.31%
13	600009	上海机场	67,470,760.06	14.89%
14	600331	宏达股份	67,014,490.77	14.79%
15	600547	山东黄金	63,202,092.80	13.95%
16	600309	烟台万华	62,478,525.45	13.79%
17	600900	长江电力	62,038,773.06	13.69%
18	000063	中兴通讯	58,659,108.34	12.95%
19	600220	江苏阳光	57,232,388.18	12.63%
20	600316	洪都航空	57,008,167.50	12.58%
21	000568	泸州老窖	55,444,125.41	12.24%
22	000538	云南白药	54,814,224.46	12.10%
23	000709	唐钢股份	52,873,651.96	11.67%
24	000792	盐湖钾肥	51,547,255.17	11.38%
25	000858	五 粮 液	50,620,092.68	11.17%
26	600739	辽宁成大	49,804,097.62	10.99%
27	600832	东方明珠	49,772,694.73	10.99%
28	000839	中信国安	47,803,917.76	10.55%
29	000987	广州友谊	44,429,201.01	9.81%
30	600550	天威保变	43,669,227.04	9.64%
31	600858	银座股份	43,457,318.64	9.59%
32	000911	南宁糖业	42,204,514.12	9.31%
33	000623	吉林敖东	40,865,017.77	9.02%
34	600050	中国联通	40,851,194.16	9.02%
35	600150	沪东重机	40,288,378.37	8.89%
36	600030	中信证券	38,185,364.43	8.43%
37	000423	S 阿 胶	37,488,924.67	8.27%
38	000069	华侨城 A	37,198,335.12	8.21%
39	000768	西飞国际	35,402,868.89	7.81%
40	000629	新 钢 钒	35,040,963.31	7.73%
41	600019	宝钢股份	33,848,956.96	7.47%
42	600867	通化东宝	33,035,251.82	7.29%
43	600117	西宁特钢	32,539,338.55	7.18%
44	000869	张 裕 A	32,015,892.99	7.07%
45	600361	华联综超	31,002,221.06	6.84%
46	002008	大族激光	30,806,115.67	6.80%
47	600797	浙大网新	28,127,276.53	6.21%
48	600879	火箭股份	27,543,565.59	6.08%
49	601006	大秦铁路	25,125,894.54	5.55%
50	600054	黄山旅游	24,382,491.65	5.38%
51	000878	云南铜业	23,953,577.33	5.29%
52	600296	S兰铝	23,637,875.89	5.22%
53	600688	S上石化	23,413,294.36	5.17%
54	600001	邯郸钢铁	22,636,634.03	5.00%
55	600010	包钢股份	22,212,922.35	4.90%
56	600258	S首旅	21,950,145.59	4.84%
57	000807	云铝股份	21,208,629.07	4.68%
58	000888	峨眉山 A	21,154,259.68	4.67%
59	600583	海油工程	21,120,796.68	4.66%
60	600031	三一重工	20,618,396.51	4.55%
61	000550	江铃汽车	20,346,847.64	4.49%
62	600151	航天机电	20,325,346.77	4.49%
63	600491	龙元建设	20,086,904.55	4.43%
64	600718	东软股份	19,786,306.63	4.37%
65	000825	太钢不锈	19,577,200.39	4.32%
66	000050	深天马 A	19,163,153.05	4.23%
67	600694	大商股份	18,993,047.89	4.19%
68	000917	电广传媒	18,797,024.98	4.15%
69	000617	S 济 柴	18,286,026.76	4.04%
70	600489	中金黄金	17,741,222.30	3.92%
71	000061	农 产 品	17,459,177.50	3.85%
72	000012	南 玻 A	16,949,477.83	3.74%
73	600585	海螺水泥	16,757,827.26	3.70%
74	600211	S藏药业	16,588,483.45	3.66%
75	600535	天士力	16,256,903.82	3.59%
76	000761	本钢板材	16,213,029.53	3.58%
77	000978	桂林旅游	15,504,314.78	3.42%
78	000549	S 湘火炬	15,407,756.35	3.40%
79	600533	栖霞建设	15,336,975.24	3.38%
80	600303	曙光股份	15,323,561.51	3.38%
81	600088	中视传媒	15,158,137.78	3.35%
82	600269	赣粤高速	14,581,684.59	3.22%
83	600037	歌华有线	14,510,144.60	3.20%
84	600048	保利地产	13,852,592.38	3.06%
85	000758	中色股份	13,713,368.15	3.03%
86	002053	云南盐化	13,440,700.57	2.97%
87	600754	锦江股份	13,114,808.99	2.89%
88	000729	燕京啤酒	12,900,609.73	2.85%
89	000951	中国重汽	12,418,285.15	2.74%
90	600307	酒钢宏兴	12,263,357.84	2.71%
91	600362	江西铜业	11,949,442.04	2.64%
92	000410	沈阳机床	11,221,160.65	2.48%
93	600795	国电电力	11,091,072.00	2.45%
94	002024	苏宁电器	10,916,629.45	2.41%
95	600675	中华企业	10,775,701.65	2.38%
96	600276	恒瑞医药	10,744,633.22	2.37%
97	600438	通威股份	10,740,380.65	2.37%
98	000027	深能源 A	10,709,359.23	2.36%
99	600011	华能国际	10,625,778.79	2.35%
100	600026	中海发展	10,425,061.40	2.30%
101	600664	S哈药	10,065,324.71	2.22%
102	600439	瑞贝卡	10,017,088.58	2.21%
103	000997	新 大 陆	9,945,827.22	2.20%
104	600143	金发科技	9,234,329.31	2.04%
105	600748	上实发展	9,187,325.77	2.03%

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	4,306,036,422.48
卖出股票的收入总额	4,376,790,312.16

五、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	132,578,559.40	14.63%
2	金 融 债	49,975,000.00	5.52%
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%
合 计		182,553,559.40	20.15%

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

序号	债券名称	市值（元）	占基金资产净值比例
1	21国债(15)	62,597,714.40	6.91%
2	06农发17	49,975,000.00	5.52%
3	21国债(3)	44,716,416.00	4.94%
4	99国债(8)	8,653,129.00	0.96%
5	20国债(4)	8,084,000.00	0.89%

七、投资组合报告附注

1、本报告期内本基金投资的前十名证券中无发行主体被监管部门立案调查的，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的证券。

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

3、权证投资情况

（1）报告期末持有所有权证明细

序号	权证代码	权证名称	数 量(份)	市 值(元)	占基金资产净值比例
1	031001	侨城HQC1	38,000	540,778.00	0.06%

（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	030002	五粮YGC1		300,000	2,910,410.37	300,000	2,142,366.28	主动投资
2	580001	武钢JTB1		5,300,000	4,179,818.05	5,300,000	5,840,766.60	
3	580005	万华HXB1		130,000	1,736,970.14	130,000	2,171,687.66	
4	580000	宝钢JTB1		627,030	923,362.95	627,030	1,005,695.39	
5	580007	长电CWB1		2,020,790	6,223,935.04	2,020,790	5,901,636.48	
6	030001	鞍钢JTC1		1,200,000	2,590,764.28	1,200,000	2,604,545.02	
7	580010	马钢CWB1		2,105,650	1,476,060.65	2,105,650	2,241,960.18	申购分离交易可转债(126001)时获配的权证
8	031001	侨城HQC1	38,000	0	0.00	0	0	股权分置改革对价支付
9	580990	茅台JCP1	2,112,000			2,112,000	6,162,075.47	
1	580997	招行CMP1	311,676	0	0.00	311,676	190,107.63	
合计					20,041,321.48		28,260,840.71	

4、其他资产的构成：

项目	金额（元）
交易保证金	660,000.00
应收利息	1,420,682.15
其他应收款	2,982,097.54
合计	5,062,779.69

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）
报告期期初持有基金份额	7,928,035
报告期间买入基金份额	15,480,263
报告期间卖出基金份额	0
报告期末持有基金份额	23,408,298

8、由于四舍五入原因，分项之和与合计可能有尾差。

第九节 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	25,468户
报告期末平均每户持有的基金份额	19,632.48份

二、报告期末基金份额持有人结构

(下转D45版)