大成创新成长混合型证券投资基金(LOF) 2007年半年度报告摘要

(景博证券投资基金转型)

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

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。

本报告中财务资料未经审计。自2007年6月12日景博证券投资基金终止上市之日起,原景博证券投资基金基金名称变更为大成创新成长混合型证券投资基金(LOF)。原景博证券投资基金报告期自2007年1月1日至2007年6月11日止,大成创新成长混合型证券投资基金报告期自2007年6月12日起至2007年6月30日止。

本半年度报告摘要摘自半年度报告正文,投资者欲了解详细内容,应阅读半年度报告正文。

第二节 基金简介

(一)大成创新成长混合型证券投资基金(LOF)

一、基金基本资料	
1、基金简称:	大成创新
2、基金代码:	160910
3、基金运作方式:	契约型上市开放式
4、基金合同生效日:	2007年6月12日
5、报告期末基金份额总额:	12,077,768,060.22份
6、基金合同存续期:	无
7、基金份额上市的证券交易所:	深圳证券交易所
8、上市日期	待定
二、基金产品说明	
1、投资目标:	在控制风险和保证流动性的前提下,超越业绩比较基准,寻求基金资产的长期稳健增值。
2、投资策略:	本基金以股票投资为主,采用积极的投资策略,精选具备持续增长能力,价格处于合理区间的优质股票构建投资组合;本基金以固定收益品种投资为辅,确保投资组合具有良好的流动性。
3、业绩比较基准:	沪深300指数×70%+中国债券总指数×30%
4、风险收益特征:	本基金为混合型基金,风险收益水平高于货币市场基金和债券型基金,属于中高风险的证券投资基金品种。
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	
登载半年度报告正文的管理人互联网网址:	http://www.dcfund.com.cn
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

(二)原景博证券投资基金

一、基金基本资料	
1、基金简称:	基金景博
2、基金交易代码:	184695
3、基金运作方式:	契约型封闭式
4、基金合同生效日(规范后):	1999年11月12日
5、报告期末基金份额总额:	1,000,000,000份
6、基金合同存续期:	15年
7、基金份额上市的证券交易所:	深圳证券交易所
8、上市日期:	1999年11月15日
二、基金产品说明	
1、投资目标:	在尽可能地分散和规避投资风险的前提下,谋求基金资产增值和收益的最大化。
2、投资策略:	本基金为中小型成长企业基金,股票投资对象主要是深沪两市总股本规模或总市值处于市场平均规模以下的具有良好成长潜力的公司。并注重投资对象的良好流动性和投资组合的合理分散性。
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	
登载半年度报告正文的管理人互联网网址:	http://www.dcfund.com.cn
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

第三节 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	转型后(自2007年6月12日(基金合同生效日)起至2007年6月30日止)	转型前(自2007年1月1日起至2007年6月11日(基金合同失效日)止)
1	基金本期净收益	2,536,929.95	430,938,691.79
2	基金份额本期净收益	0.0005	0.4344
3	期末可供分配基金收益	256,324,381.33	253,787,451.46
4	期末可供分配基金份额收益	0.0212	0.2538
5	期末基金资产净值	11,691,752,074.76	2,207,153,700.24
6	期末基金份额净值	0.968	2.2072
7	基金加权平均净值收益率	0.04%	22.53%
8	本期基金份额净值增长率	-8.23%	70.37%
9	基金份额累计净值增长率	-8.23%	219.36%

二、基金净值表现

(一)大成创新成长混合型证券投资基金净值表现(自2007年6月12日(基金合同生效日)起至2007年6月30日止)

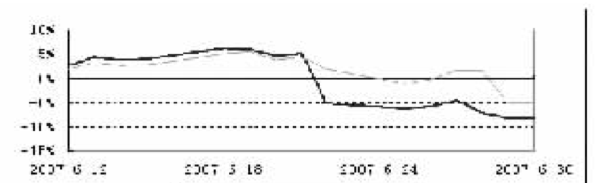
1、本报告期基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

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
自基金成立日起至今	-8.23%	2.93%	-3.20%	1.81%	-5.03%	1.12%

2、自基金合同生效以来基金份额净值的变动情况,并与同期业绩比较基准的变动的比较

大成创新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

(2007年6月12日至2007年6月30日)



注:1、按基金合同规定,大成创新成长股票型证券投资基金自基金合同生效之日起3个月内为建仓期。

2、2007年5月15日,景博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2007年6月4日证监基金字[2007]155号文核准。自2007年6月12日起,景博证券投资基金在深圳证券交易所终止上市,其由《景博证券投资基金基金合同》修订而成的《大成创新成长混合型证券投资基金基金合同》正式生效。

3、大成基金管理有限公司已于2007年6月22日对投资者持有的原景博证券投资基金(以下简称"基金景博")进行了基金份额转换操作。经本基金托管人中国农业银行确认,拆分基准日(6月22日)基金份额净值为2.2113元,精确到小数点后第9位为2.211341193元(第9位以后舍去),本基金管理人按照1:2.211341193的转换比例将原基金景博的基金财产进行了拆分。拆分后,基金份额净值变为1.000元,相应地,原基金景博每1份基金份额转换为2.211341193份,基金份额计算结果保留到整数位,所产生的误差归入基金财产。原基金景博的基金总份额由1,000,000,000份转换为2,211,341,193份。

(二)原景博证券投资基金净值表现(自基金合同生效起至2007年6月11日(基金合同失效日)止)

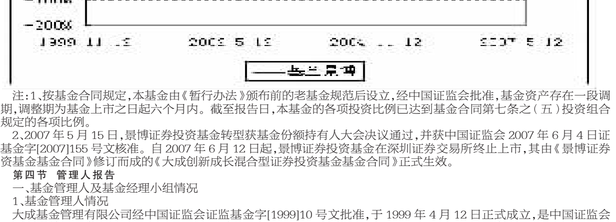
1、基金历史各时间段净值增长率

阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②
自2007年5月1日起至2007年6月11日(基金合同生效日)止	10.83%	2.02%
自2007年4月1日起至2007年6月11日(基金合同生效日)止	47.33%	2.65%
自2007年1月1日起至2007年6月11日(基金合同生效日)止	70.41%	4.14%
自2006年7月1日起至2007年6月11日(基金合同生效日)止	116.62%	3.55%
自2004年7月1日起至2007年6月11日(基金合同生效日)止	217.28%	2.93%
自2002年7月1日起至2007年6月11日(基金合同生效日)止	175.09%	2.58%
自基金合同生效起至2007年6月11日(基金合同生效日)止	219.36%	2.44%

2、基金合同生效以来基金份额净值的变动情况

景博证券投资基金累计份额净值增长率走势图

(1999年11月12日至2007年6月11日)



注:1、按基金合同规定,本基金由《暂行办法》颁布前的老基金规范后设立,经中国证监会批准,基金资产存在一段调整期,调整期为基金上市之日起六个月内。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。

2、2007年5月15日,景博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2007年6月4日证监基金字[2007]155号文核准。自2007年6月12日起,景博证券投资基金在深圳证券交易所终止上市,其由《景博证券投资基金基金合同》修订而成的《大成创新成长混合型证券投资基金基金合同》正式生效。

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

王维钢先生,基金经理,浙江大学管理硕士、南开大学经济学博士生。10年证券从业经历,1996年起历任君安证券有限公司研究所首批高级研究员、国泰君安证券股份有限公司业务董事、鹏华基金管理有限公司策略主管、国信证券有限公司投资经理、巨田基金管理有限公司策略主管。2006年12月加盟大成基金管理有限公司,2007年1月12日起担任基金景博基金经理(2007年6月12日起改制为大成创新成长混合型证券投资基金)。

牛春晖先生,基金经理,硕士,9年证券从业经历。曾任国泰君安研究所研究员、大成基金管理有限公司研究部副经理、基金经理部基金景宏基金经理助理。2004年10月起担任基金景博基金经理。2007年1月12日起不再担任基金景博基金经理。

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》、《景博证券投资基金基金合同》(截至2007年6月11日)、《大成创新成长混合型证券投资基金基金合同》(2007年6月12日基金合同生效以来)和其他有关法律法规的规定,在基金管理运作中,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年上半年证券市场与基金运作回顾

2007年上半年中国经济增长在高位基础上进一步加快,明显高于预期,主要是外贸顺差高速增长并进一步加快,消费品市场进一步活跃和投资增长保持高速,使得社会总需求的扩张加快,对经济增长的拉动作用加强。

由于上半年出现较为显著的股票供需结构性失衡,蓝筹股供给不足、受限股流通规模猛增、资金供给持续增长并伴随外部资金到位预期增强,市场出现结构性过度上涨并积累了相当程度的风险。蓝筹股供给面临增长瓶颈,优质大型国企上市排队进度快于监管部门的项目储备,红筹股诸如中移动等海外注册央企上市公司需要等待才能在内地发行上市;许多资产注入预期的公司股价上涨过快,这抑制了大股东增发注入优质资产的热情,构成大股东和流通股东新一轮博弈与对峙。资金供给方面,新增资金供给继续持续增长,公众储蓄资金持续流入公募基金市场,中美战略对话确认新增QFII额度200亿美元,而保监会在等待宣布调高保险公司股票资产比例上限的时机。

当前市场总体估值水平已不低,但年度行业估值均值的持续快速下降是中国经济强劲增长的具体表现,主要研究机构分析师持续调高部分重点行业和公司盈利预测为长期投资者提供了估值下降的可能性。

我们认为全流通时代的到来,使围绕上市公司的利益博弈发生了颠覆性变化,全流通后控股股东的利益与二级市场股价密切挂钩,注入优质资产可以增厚每股收益,从而有利于二级市场股价有更好表现。整体上市通过消除大量关联交易和通过优质资产注入增厚每股业绩,能够显著提升上市公司的内在价值,定向增发是大股东提高持股比例的必然选择。另外,并购重组也将激活市场。在全流通时代,上市公司并购将风起云涌,但上市公司面临的潜在并购风险大大增加,原有股东会开展反收购行为,从而使上市公司控制权的市场争夺日趋频繁和激烈。在这种大思路的指引下,我们在投资实践中更多地关注资产注入与整体上市的定向增发提升上市公司真实价值的题材,对并购活动采取相对审慎的态度。此外,券商类股也对07年以来本基金净值增长作出了显著的贡献。因此,我们选择的投资目标,除了动态估值要相对偏低以外,未来成长性也要好,这样才有潜力成为并持续成为蓝筹公司。

2007年6月以来,市场在4000点上下300点范围内强势整理,封转开后的大成创新成长基金迎来了相对较好的建仓机会。我们认为,6月的强势整理对下半年的市场运行将更有利。虽然流动性调控前景的不明朗预期对投资者的持股信心存在消磨的阶段性作用,但是中国经济基本面基础坚实,基本面不支持骨干企业盈利前景全面转坏的判断,长期牛市的基础仍然稳健。而且股指期货推出也有利于机构投资者通过套期保值回避系统风险从而更倾向于长期投资,机构投资者的行为改善将有效对冲股指期货推出初期可能出现的波动加剧的压力。

本基金经理小组认为,尽管目前市场总体估值水平并不能判定为偏低,但整体上市、资产注入等资产证券化运作将优化中国上市公司资产质量,市值考核、股权激励、两税合并等内外部动力将驱动上市公司释放业绩并超预期增长,实质降低特定个股相对较高的动态估值水平。通过众多蓝筹公司自身盈利快速增长内生式降低估值水平和潜在蓝筹公司资产外延式降低估值水平,从动态考察来看中国资本市场仍有吸引力。

2、2007年下半年证券市场展望和基金投资策略

2007年下半年宏观环境总体上将保持稳定。在国际经济环境总体依然有利、国内居民收入、企业利润、财政收入改善的大背景下,07年下半年中国经济增长动力依然强劲。尽管近期出现了美国经济不确定性增加等因素,但由于欧元区、日本以及其他地区经济增长仍比较乐观,全球经济很可能继续保持较快增长,外部需求依然较强。未来一段时期我国贸易顺差增长有望放缓,但仍会维持在较高水平。下半年通货膨胀预期将进一步加强,流动性调控前景的不明朗对投资者的持股信心存在消磨的阶段性作用,但中国经济基本面基础坚实,不支持出现深幅调整的市场趋势。

预计宏观调控措施将是稳健而有预见性的,适度加息以抑制可能抬头的通货膨胀已成为共同的预期,受内外部升值压力驱动,人民币升值呈现加速趋势。基于对通货膨胀预期以及中央银行目标及政策困境判断,预计央行将一年期定期存款利率加息1-2次,幅度合计约0.54%。虽然07年上半年人民币相对美元出现持续升值,但人民币实际有效汇率并无明显上升趋势,下半年贸易顺差还有可能增加,同时投机资本还会继续流入。人民币实际有效汇率下半年加速升值的概率较大,但年升值幅度预计控制在5%以内。流动性管理将从以往单一由央行运用公开市场操作、存款准备金率和加息等多种方式回收流动性的管理方式转为财政部发行外汇投资公司特别国债、央行调整存款准备金率和加息、证监会推行QDII政策、商务部调整出口退税政策等多部委多种手段协同综合管理方式。但是,预计下半年金融市场流动性依然保持在过剩状态,流动性过剩向流动性紧缩转变的时机和条件并不成熟。

本基金将重点关注40个行业中买入评级的设备、金融、钢铁、有色、汽车5个行业,并依据行业评级确定行业资产配置比例。本基金将一如既往地锁定预期估值偏低且可持续高速增长的公司作为重点投资目标群,同时参考公司治理和流动性因素。

2007年下半年影响力最大的投资主题包括:人民币资产持续升值(土地与股权)、股东资产加速证券化、国家自主创新政策催生世界级制造企业、矿产与煤炭)资源与公共产品价格提升、内外动力驱动业绩释放、奥运和3G等题材刺激现代服务业发展。

最后,十分感谢基金份额持有人对本基金的厚爱与支持,我们将继续保持勤勉尽责的工作态度,力争用良好的业绩回报本基金份额持有人的长期信任和支持。

第五节 托管人报告

在托管大成创新成长混合型证券投资基金(原景博基金转型)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《景博证券投资基金基金合同》、《景博证券投资基金托管协议》、《大成创新成长混合型证券投资基金基金合同》、《大成创新成长混合型证券投资基金托管协议》的约定,对景博证券投资基金和大成创新成长混合型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11日景博基金和2007年6月12日至2007年6月30日大成创新基金的投资运作,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转型前景博证券投资基金的投资运作、基金资产净值的计算、基金费用开支和转型后大成创新基金的投资运作、基金资产净值的计算、基金费用开支、基金份额申购赎回价格等问题上,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创新成长混合型证券投资基金(原景博证券投资基金转型)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

第六节 财务会计报告(未经审计)

(一)大成创新成长混合型证券投资基金(报告期:2007年6月12日(基金合同生效日)至2007年6月30日止)

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

	2007年6月30日
资产	
银行存款	5,909,835,242.71
清算备付金	6,025,112.97
交易保证金	1,670,592.16
应收证券清算款	0.00
应收股利	270,000.00
应收利息	1,958,865.43
应收申购款	0.00
其他应收款	449,526.21
股票投资市值	6,705,866,171.94
其中:股票投资成本	6,141,104,398.81
债券投资市值	0.00
其中:债券投资成本	0.00
权证投资	40,003,128.00
其中:权证投资成本	35,764,074.29
买入返售证券	0.00
待摊费用	0.00
其他资产	0.00
资产总计	12,666,078,639.42
负债	
应付证券清算款	962,358,260.31
应付赎回款	0.00
应付赎回费	0.00
应付管理人报酬	5,374,227.5
应付托管费	1,003,881.82
应付佣金	4,730,509.37
应付利息	0.00
应付收益	0.00
未交税金	0.00
其他应付款	651,412.20
卖出回购证券款	0.00
短期借款	0.00
预提费用	208,273.46
其他负债	0.00
负债合计	974,326,564.66
持有人权益	
实收基金	10,866,426,866.90
未实现利得	569,000,826.53
未分配收益	256,324,381.33
持有人权益合计	11,691,752,074.76
负债及持有人权益总计	12,666,078,639.42
基金份额净值	0.968

2、2007年6月12日至6月30日止期间经营业绩表

	2007年6月12日 至2007年6月30日
一、收入	8,389,643.83
1、股票差价收入	5,232,984.28
2、债券差价收入	-3,642,223.20
3、权证差价收入	0.00
4、债券利息收入	66,096.58
5、存款利息收入	2,010,142.86
6、股利收入	4,722,642.6
7、买入返售证券收入	0.00
8、其他收入	0.71
二、费用	5,852,713.88
1、基金管理人报酬	4,986,280.23
2、基金托管费	831,046.69
3、卖出回购证券支出	11,142.84
4、利息支出	0.00
5、其他费用	24,244.12
其中:上市年费	3,123.41
信息披露费	15,616.48
审计费用	3,123.41
三、基金净收益	2,536,929.95
加:未实现利得	-384,365,421.94
四、基金经营业绩	-381,828,491.99

3、2007年6月12日至6月30日止期间基金收益分配表

	2007年6月12日 至2007年6月30日
本期基金净收益	2,536,929.95
加:期初基金净收益	253,787,451.46
加:本期损益平准金	-0.08
可供分配基金净收益	256,324,381.33
减:本期已分配基金净收益	0.00
期末基金净收益	256,324,381.33

4、2007年6月12日至6月30日止期间基金净值变动表

	2007年6月12日 至2007年6月30日
一、期初基金净值	2,207,153,700.24
二、本期经营活动	
基金净收益	2,536,929.95
未实现利得	-384,365,421.94
经营活动产生的基金净值变动数	-381,828,491.99
三、本期基金份额交易	
基金申购款	9,866,426,867.22
基金赎回款	0.71
基金份额交易产生的基金净值变动数	9,866,426,866.51
四、本期向持有人分配收益	0.00
向基金持有人分配收益产生的基金净值变动数	0.00
五、期末基金净值	11,691,752,074.76

二、会计报表附注

(除特别标明外,金额单位为人民币元)

附注1.基金基本情况

大成创新成长混合型证券投资基金(以下简称"本基金")经中国证券监督管理委员会(以下简称"中国证监会")《关于核准景博证券投资基金基金份额持有人大会决议的批复》(证监基金字[2007]155号)核准,由景博证券投资基金转型而成。本基金为契约型上市开放式,存续期限不定。经向中国证监会备案,《大成创新成长混合型证券投资基金(LOF)基金合同》于2007年6月12日正式生效。本基金的基金管理人为大成基金管理有限公司,基金托管人为中国农业银行。

根据中国证券监督管理委员会《关于核准景博证券投资基金基金份额持有人大会决议的批复》(证监基金字[2007]155号)和《关于原景博证券投资基金基金份额拆分结果的公告》的有关规定,基金管理人大成基金管理有限公司确定2007年6月22日为本基金的基金份额拆分日。当日原景博基金资产净值为2,211,341,193.71元,拆分前基金份额总额为1,000,000,000份,拆分前基金份额净值为2.2113元。根据基金份额拆分公式,基金份额折算比例为2.211341193,拆分后原景博基金份额总额为2,211,341,193份,基金份额净值为1.000元。大成基金管理有限公司已根据上述拆分比例,对各基金份额持有人持有的基金份额进行了拆分,并由中国证券登记结算有限责任公司进行了变更登记。

依据中国证券监督管理委员会《关于核准景博证券投资基金基金份额持有人大会决议的批复》(证监基金字[2007]155号)、《大成创新成长混合型证券投资基金(LOF)招募说明书》和《大成创新成长混合型证券投资基金(LOF)集中申购期基金份额发售公告》的规定,本基金自2007年6月15日至2007年6月29日止期间开放集中申购,并于2007年6月18日公告提前结束集中申购。本次集中申购募集不包括申购资金利息共募集9,865,136,266.55元,按《大成创新成长混合型证券投资基金(LOF)集中申购期基金份额发售公告》的有关规定共折合为9,865,136,266.55份基金份额,截至2007年6月22日止,经确认的集中申购期间集中申购资金利息共计人民币1,290,600.67元,按每份集中申购价格1.00元折合为1,290,600.67份基金份额,业经普华永道中天会计师事务所有限公司普华永道中天验字(2007)第077号验资报告予以验证,并向中国证监会备案。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《大成创新成长混合型证券投资基金基金合同》的有关规定,本基金的投资范围限于国内依法发行上市的股票、债券及中国证监会批准的允许基金投资的其他金融工具。本基金股票投资比例范围为基金资产的40%-95%;现金和固定收益类证券投资比例范围为基金资产的5%-60%,其中资产支持证券投资比例范围为0-20%,现金和到期日在一年以内的政府债券等短期金融工具的投资比例不低于基金资产净值的5%。

附注2.会计报表编制基础、主要会计政策及会计估计

(1)会计报表编制基础

本基金的会计报表按照企业会计准则、《金融企业会计制度》、《证券投资基金会计核算办法》、《大成创新成长混合型证券投资基金基金合同》和中国证监会允许的如会计报表附注所列示的基金行业实务操作的有关规定编制。

(2)会计年度

本基金会计年度为公历1月1日起至12月31日止。本基金2007年上半年度会计报表的实际编制时间为2007年6月12日(基金合同生效日)至2007年6月30日。

(3)记帐本位币

本基金的记帐本位币为人民币。

(4)记帐基础和计价原则

本基金的记帐基础为权责发生制。除股票投资、债券投资和权证投资按市值计价外,所有报表项目均以历史成本计价。

(5)基金资产的估值原则

(i) 股票投资

上市交易的股票按其估值日在证券交易所挂牌的市场交易收盘价估值;估值日无交易的,以最近交易日的市场交易收盘价估值。首次公开发行但未上市的股票,按成本估值;由于配股和非定向增发形成的暂时流通受限制的股票,按估值日在证券交易所挂牌的同一股票的市场交易收盘价估值。

(ii) 债券投资

证券交易所市场实行净价交易的国债按其估值日在证券交易所挂牌的市场交易收盘价估值;估值日无交易的,以最近交易日的市场交易收盘价估值。证券交易所市场未实行净价交易的企业债券及可转换债券按估值日市场交易收盘价减去债券收盘价中所含的债券应收利息得到的净价估值;估值日无交易的,以最近交易日的市场交易收盘价减去债券收盘价中所含的债券应收利息得到的净价估值。

银行间同业市场交易的债券按不含息成本与市价孰低法估值,市价按估值日银行间同业市场公布的加权平均成交净价确定;估值日无交易的,按最近交易日的加权平均成交净价确定。如有确凿证据表明银行间同业市场交易的债券按上述办法进行估值不能客观反映其公允价值,基金管理人在综合考虑市场成交价、市场报价、流动性、收益率曲线等因素的基础上,根据具体情况与基金托管人商定后,按最能反映公允价值的价格估值。

未上市流通的债券按成本估值。

(iii) 权证投资

从获赠确认日、买入成交日或因认购新发行分离交易可转债而取得的权证从实际取得日起到卖出成交日或行权日止,上市交易的权证投资按估值日在证券交易所挂牌的该权证投资的市场交易收盘价估值;未上市交易的权证投资(包括配股权证)按公允价值估值。

(iv) 实际投资成本与估值的差异计入"未实现利得/(损失)"科目。

(v) 如有确凿证据表明按上述方法进行估值不能客观反映其公允价值,基金管理人应根据具体情况与基金托管人商定后,按最能反映公允价值的价格估值。

(6)证券投资基金成本计价方法

(i) 股票投资

买入股票于成交日确认为股票投资。股票投资成本按成交日应支付的全部价款入账。收到股权分置改革过程中由非流通股股东支付的现金对价,于股权分置方案实施复牌日冲减股票投资成本。

卖出股票于成交日确认股票差价收入/(损失)。出售股票的成本按移动加权平均法于成交日结转。

(ii) 债券投资

买入证券交易所交易的债券于成交日确认为债券投资;买入银行间同业市场交易的债券于实际支付价款时确认为债券投资。债券投资按成交日应支付的全部价款入账,其中所包含债券起息日或上次除息日至购买日止的利息,作为应收利息单独核算,不构成债券投资成本。认购新发行的分离交易可转债于成交日先按支付的全部价款确认为债券投资,后于权证实际取得日按本会计报表附注2.(6)(iii)中所示的方法单独核算权证成本,并相应调整债券投资成本。

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

卖出证券交易所交易的债券于成交日确认债券差价收入/(损失);卖出银行间同业市场交易的债券于实际收到全部价款时确认债券差价收入/(损失)。出售债券的成本按移动加权平均法结转。

(iii) 权证投资

获赠权证(包括配股权证)在确认日,按持有的股数及获赠比例计算并记录增加的权证数量;买入权证于成交日确认为权证投资,相应成本按成交日应支付的全部价款入账。因认购新发行的分离交易可转债而取得的权证在实际取得日,按权证公允价值占分离交易可转债全部公允价值的比例将购买分离交易可转债实际支付全部价款的一部分确认为权证成本。

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

(7)收入的确认和计量

股票差价收入/(损失)于卖出股票成交日按卖出股票成交总额与其成本和相关费用的差额确认。

证券交易所交易的债券差价收入/(损失)于卖出成交日确认;银行间同业市场交易的债券差价收入/(损失)于实际收到全部价款时确认。债券差价收入/(损失)按应收取全部价款与其成本、应收利息和相关费用的差额确认。

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

债券利息收入按债券票面价值与票面利率或内含票面利率计算的金额扣除适用情况下应由债券发行企业代扣代缴的个人所得税后的净额确认,在债券实际持有期内逐日计提。

存款利息收入按存款的本金与适用利率逐日计提。

股利收入按上市公司宣告的分红派息比例计算的金额扣除由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额于除息日确认。

(8)费用的确认和计量

本基金的基金管理人报酬按前一日基金资产净值1.50%的年费率逐日计提。

本基金的基金托管费按前一日基金资产净值0.25%的年费率逐日计提。

(9)实收基金

实收基金包含对外发行基金份额所募集的总金额在扣除平准金分摊部分后的余额。

(10)未实现利得/(损失)

未实现利得/(损失)包括因投资估值而产生的未实现估值增值/(减值)和未实现利得/(损失)平准金。

未实现利得/(损失)平准金指在申购或赎回基金份额时,申购或赎回款项中包含的按未实现利得/(损失)占基金净值比例计算的金额。未实现利得/(损失)平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日认列。

(11)损益平准金

损益平准金指在申购或赎回基金份额时,申购或赎回款项中包含的按未分配基金净收益/(累计基金净损失)占基金净值比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日认列,并于期末全额转入未分配基金净收益/(累计基金净损失)。

(12)基金的收益分配政策

每一基金份额享有同等分配权。本基金收益以现金形式分配,但基金份额持有人可选择现金红利或将现金红利按分红除权日的基金份额净值自动转为基金份额进行再投资。基金收益分配每年不超过六次,每次收益分配比例不低于当期已实现净收益的50%。基金当期收益先弥补上一年度亏损后,方可进行当年收益分配。基金当年亏损,则不进行收益分配。

经宣告的拟分配基金收益于分红除权日从持有人权益转出。

附注3.主要税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2004]78号《关于证券投资基金税收政策的通知》、财税[2005]11号《关于调整证券(股票)交易印花税税率的通知》、财税[2005]102号《关于股息红利个人所得税有关政策的通知》、财税[2005]103号《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》、财税[2007]84号《关于调整证券(股票)交易印花税税率的通知》及其他相关税务法规和实务操作,主要税项列示如下:

(1) 以发行基金方式募集资金,不属于营业税征收范围,不征收营业税。

(2) 基金买卖股票、债券的差价收入,暂免征营业税和企业所得税。

(3) 对基金取得的企业债券利息收入,由发行债券的企业在向基金派发利息时代扣代缴20%的个人所得税,暂不征收企业所得税。对基金取得的股票的股息、红利收入,自2005年6月13日起由上市公司在向基金派发股息、红利时暂减按50%(此前按100%)计入个人应纳税所得额,依照现行税法规定即20%代扣代缴个人所得税,暂不征收企业所得税。

(4) 基金买卖股票按3‰的税率缴纳证券(股票)交易印花税。

(5) 基金作为流通股股东在股权分置改革过程中收到由非流通股股东支付的股份、现金等对价,暂免征收印花税、企业所得税和个人所得税。

附注4.本报告期重大会计差错的内容和更正金额

无。

附注5.关联方关系及关联方交易

(1)关联方关系

关联方名称	与本基金的关系
大成基金管理有限公司("大成基金")	基金管理人
中国农业银行	基金托管人
中泰信托投资有限责任公司	基金管理人的股东
光大证券股份有限公司	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。

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6月12日至2007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
银河证券	1,858,379,524.89	35.76%

B 佣金

关联方名称	2007年6月12日至2007年6月30日	
	金额	占本期佣金总金额比例
银河证券	1,454,190.37	34.73%

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)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,若本基金持有现金的比例超过资产净值的20%,超出部分不计提基金管理费。计算方法如下:

H=E×1.5%/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(扣除本基金持有现金比例超过20%部分的基金资产净值)

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2007年6月12日至2007年6月30日应支付基金管理人管理费共计人民币4,986,280.23元,其中已支付基金管理人人民币0.00元,尚余人民币4,986,280.23元未支付。

B 基金托管人报酬

基金托管费按前一日的基金资产净值的0.25%的年费率计提。计算方法如下:

H=E×0.25%/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2007年6月12日至2007年6月30日应支付基金托管人托管费共计人民币831,046.69元,其中已支付基金托管人人民币0.00元,尚余人民币831,046.69元未支付。

C 由关联方保管的银行存款余额及由此产生的利息收入

本基金的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5,909,835,242.71元。2007年6月12日至2007年6月30日由基金托管人保管的银行存款产生的利息收入为2,004,854.67元。

(4)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

项目名称	基金份额(份)
报告期期初持有基金份额(原景博基金份额)	35,252,079
报告期间买入基金份额	0
报告期间基金拆分折算份额	42,702,296
报告期间卖出基金份额	0
报告期末持有基金份额	77,954,375

注:报告期间基金拆分按照折算比例2.211341193折算后计算。

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6.报告期末流通转让受到限制的基金资产

无。

附注7.其他重要事项

无。

(二)原景博证券投资基金(报告期:2007年1月1日至2007年6月11日(基金合同失效日)止)

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11日资产负债表

	2007年6月11日	2006年12月31日
资产		
银行存款	24,684,142.07	192,943,126.53
清算备付金	6,025,112.97	6,366,461.00
交易保证金	1,670,592.16	1,160,000.00
应收证券清算款	0.00	1,612,095.69
应收股利	710,100.00	0.00
应收利息	6,572,407.08	2,447,540.10
应收申购款	0.00	0.00
其他应收款	0.00	0.00
股票投资市值	1,886,888,564.86	1,324,237,185.79
其中:股票投资成本	936,552,244.27	978,605,798.22
债券投资市值	484,828,001.50	337,450,119.41
其中:债券投资成本	486,420,317.31	337,701,798.62
权证投资	7,681,080.00	21,960,845.70
其中:权证投资成本	3,058,836.00	10,222,860.36
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	2,419,060,000.64	1,888,177,374.22
负债		
应付证券清算款	6,121,959.84	31,877,138.29
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	387,947.27	1,955,524.28
应付托管费	172,835.13	325,920.73
应付佣金	819,003.64	2,852,589.47
应付利息	66,857.16	288,300.00
应付收益	0.00	0.00
未交税金	0.00	0.00
其他应付款	4,151,287.20	651,448.08
卖出回购证券款	200,000,000.00	170,000,000.00
短期借款	0.00	0.00
预提费用	186,410.16	260,000.00
其他负债	0.00	0.00
负债合计	211,906,300.40	208,210,920.85
持有人权益		
实收基金	1,000,000,000.00	1,000,000,000.00
未实现利得	953,366,248.78	357,117,693.70
未分配收益	253,787,451.46	322,848,759.67
持有人权益合计	2,207,153,700.24	1,679,966,453.37
负债及持有人权益总计	2,419,060,000.64	1,888,177,374.22
基金份额净值	2.2072	1.6800

2、2007年1月1日至6月11日止期间经营业绩表

	2007年1月1日 至2007年6月11日	2006年1月1日 至2006年6月30日
一、收入	449,284,750.75	221,869,990.85
1、股票差价收入	415,316,198.89	200,123,054.59
2、债券差价收入	1,216,406.47	2,754,707.16
3、权证差价收入	23,875,214.36	7,327,713.46
4、债券利息收入	5,080,938.34	3,308,526.01
5、存款利息收入	436,475.34	258,172.49
6、股利收入	3,359,517.35	8,097,817.14
7、买入返售证券收入	0.00	0.00
8、其他收入	0.00	0.00
二、费用	18,346,058.96	9,941,376.40
1、基金管理人报酬	12,153,918.96	8,071,013.30
2、基金托管费	2,133,830.41	1,345,168.92
3、卖出回购证券支出	2,332,193.06	291,508.44
4、利息支出	0.00	0.00
5、其他费用	1,726,116.53	233,685.74
其中:上市年费	26,629.56	29,752.78
信息披露费	133,151.04	148,767.52
审计费用	26,629.56	30,646.92
三、基金净收益	430,938,691.79	211,928,614.45
加:未实现利得	596,248,555.08	184,931,554.41
四、基金经营业绩	1,027,187,246.87	396,860,168.86

3、2007年1月1日至6月11日止期间基金收益分配表

	2007年1月1日 至2007年6月11日	2006年1月1日 至2006年6月30日
本期基金净收益	430,938,691.79	211,928,614.45
加:期初基金净收益	322,848,759.67	-100,370,858.54
加:本期损益平准金	0.00	0.00
可供分配基金净收益	753,787,451.46	111,557,755.91
减:本期已分配基金净收益	500,000,000.00	0.00
期末基金净收益	253,787,451.46	111,557,755.91

4、2007年1月1日至6月11日止期间基金净值变动表

	2007年1月1日 至2007年6月11日	2006年1月1日 至2006年6月30日
一、期初基金净值	1,679,966,453.37	924,703,170.83
二、本期经营活动		
基金净收益	430,938,691.79	211,928,614.45
未实现利得	596,248,555.08	184,931,554.41
经营活动产生的基金净值变动数	1,027,187,246.87	396,860,168.86
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	500,000,000.00	0.00
五、期末基金净值	2,207,153,700.24	1,321,563,339.69

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2007年1月1日至2007年6月11日(基金合同失效日)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2.2007年1月1日至2007年6月11日(基金合同失效日)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("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
中泰信托投资有限责任公司	基金管理人的股东
光大证券股份有限公司	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
湘财证券有限责任公司("湘财证券")	基金发起人

2007年1月1日至2007年6月11日(基金合同失效日)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。

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11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
银河证券	355,810,958.36	11.17%	397,675,807.55	7.33%

B 佣金

关联方名称	2007年1月1日 至2007年6月11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
银河证券	278,424.20	10.89%	311,185.10	7.17%

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。

(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,若本基金持有现金的比例超过资产净值的20%,超出部分不计提基金管理费。计算方法如下:

H=E×1.5%/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(扣除本基金持有现金比例超过20%部分的基金资产净值)

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2007年1月1日至2007年6月11日应支付基金管理人管理费共计人民币12,153,918.96元,其中已支付基金管理人人民币11,765,971.69元,尚余人民币387,947.27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8,071,013.30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×0.25%/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2007年1月1日至2007年6月11日应支付基金托管人托管费共计人民币2,133,830.41元,其中已支付基金托管人人民币1,960,995.28元,尚余人民币172,835.13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1,345,168.92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11日保管的银行存款余额为24,684,142.07元。2007年1月1日至2007年6月11日由基金托管人保管的银行存款产生的利息收入为369,442.64元。(2006年6月30日由基金托管人保管的银行存款余额为202,485,970.57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218,914.38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

2007年1月1日 至2007年6月11日		2006年1月1日 至2006年6月30日	
持有份额(份)	占基金总份额的比例	持有份额(份)	占基金总份额的比例
35,252,079	3.53%	17,600,000	1.76%

注:本报告期大成基金管理有限公司增持本基金份额17,652,079份。

B 大成基金管理有限公司主要股东在期末持有本基金份额情况

无。

附注4.2007年6月11日流通转让受到限制的基金资产

无。

附注5.其他重要事项

1、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‰。

2、景博基金持有人大会于2007年5月15日以现场方式在北京召开,会议审议通过了《关于景博证券投资基金转型有关事项的议案》。本次持有人大会的公证费5,000.00元,律师费20,000.00元,合计25,000.00元,由基金资产承担。

第七节 投资组合报告

(一)大成创新成长混合型证券投资基金(报告期:2007年6月12日(基金合同生效日)至2007年6月30日止)

一、2007年6月30日基金资产组合情况

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	5,915,860,355.68	46.71%
股票	6,705,866,171.94	52.94%
债券	0.00	0.00%
权证	40,003,128.00	0.32%
其他资产	4,348,983.80	0.03%
合计	12,666,078,639.42	100.00%

二、2007年6月30日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	14,307,070.70	0.12%
B采掘业	522,800,962.24	4.47%
C制造业	3,273,786,664.15	28.01%
C0食品、饮料	186,807,408.91	1.60%
C1纺织、服装、皮毛	445,150,689.81	3.81%
C2木材、家具	0.00	0.00%
C3造纸、印刷	54,819,136.89	0.47%
C4石油、化学、塑胶、塑料	249,785,057.37	2.14%
C5电子	23,836,164.00	0.20%
C6金属、非金属	1,096,177,949.96	9.38%
C7机械、设备、仪表	888,229,302.38	7.60%
C8医药、生物制品	328,980,954.83	2.81%
C99其他制造业	0.00	0.00%
D电力、煤气及水的生产和供应业	185,665,645.59	1.59%
E建筑业	313,837,690.96	2.68%
F交通运输、仓储业	319,073,930.05	2.73%
G信息技术业	199,829,422.30	1.71%
H批发和零售贸易	284,663,776.54	2.43%
I金融、保险业	850,971,420.55	7.28%
J房地产业	275,313,645.72	2.35%
K社会服务业	248,563,306.68	2.13%
L传播与文化产业	9,672,324.75	0.08%
M综合类	207,380,311.71	1.77%
合计	6,705,866,171.94	57.36%

三、2007年6月30日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	600028	中国石化	36,943,940	488,398,886.80	4.18%
2	600030	中信证券	5,899,961	312,520,934.17	2.67%
3	600177	雅戈尔	11,446,082	304,580,242.02	2.61%
4	600036	招商银行	12,206,086	300,025,593.88	2.57%
5	000758	中色股份	8,818,937	223,119,106.10	1.91%
6	000898	鞍钢股份	12,069,882	213,516,212.58	1.83%
7	000338	潍柴动力	2,713,398	213,001,743.00	1.82%
8	000709	唐钢股份	11,911,538	152,229,455.64	1.30%
9	601398	工商银行	29,999,964	150,299,819.64	1.29%
10	000157	中联重科	3,561,415	137,114,477.50	1.17%

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)的半年度报告正文。

四、本报告期股票投资组合的重大变动

1、2007年6月12日至2007年6月30日累计买入价值超出期末基金资产净值2%或前二十名股票明细

序号	股票代码	股票名称	累计买入金额(元)	占期初基金资产净值比例
1	600028	中国石化	500,006,691.98	39.88%
2	600036	招商银行	246,796,206.10	19.68%
3	600177	雅戈尔	206,933,865.60	16.50%
4	000898	鞍钢股份	192,924,940.26	15.39%
5	600030	中信证券	160,791,638.49	12.82%
6	000709	唐钢股份	158,727,745.87	12.66%
7	601398	工商银行	153,077,610.63	12.21%
8	000157	中联重科	127,726,165.96	10.19%
9	600020	中原高速	120,911,590.37	9.64%
10	000060	中金岭南	114,846,574.19	9.16%
11	600649	原水股份	105,998,525.02	8.45%
12	600611	大众交通	105,520,629.32	8.42%
13	000401	冀东水泥	104,033,805.49	8.30%
14	000031	中粮地产	100,602,633.79	8.02%
15	000960	锡业股份	100,538,509.78	8.02%
16	600533	栖霞建设	98,090,159.30	7.82%
17	000758	中色股份	95,092,309.66	7.58%
18	600019	宝钢股份	92,630,565.05	7.39%
19	600063	皖维高新	88,783,377.31	7.08%
20	000878	云南铜业	88,690,060.83	7.07%

(下转A80版)