

### 通乾证券投资基金 2007 年半年度报告摘要

名称	数量(股)	总成本	总市值	估值方法	转让受限情况	可流通日
中国远洋	449,400	3,810,912.00	8,309,400.00	按市价估值	前股中签未流通	2007-9-26

本基金会截止 2007 年 6 月 30 日止,持有以下因重大事项未公告的股票,该股票从 2007 年 5 月 8 日起停牌:

名称	数量(股)	总成本	总市值	估值方法	转让受限原因	可流通日
农产品	1,000,000	19,254,180.86	21,560,000.00	按市价估值	重大事项未公告	未知

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《关于调整证券(股票)印花印花税税率的通知》,经国务院批准,财政部决定从 2007 年 5 月 30 日起,调整证券(股票)交易印花税率,由 1%调整为 3‰。

七. 投资组合报告  
(一) 本报告期内基金资产组合情况

项目	金额(元)	占基金资产净值比例
银行存款和清算备付金	72,356,067.24	1.40%
股票投资市值	3,933,506,307.24	75.95%
债券投资市值	1,065,048,038.22	20.56%
资产支持证券市值	370,822,293.31	0.58%
公允价值变动	54,259,210.00	1.06%
其他资产	24,154,631.30	0.47%
资产合计	5,179,355,556.31	100.00%

(二) 本报告期内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	54,100,000.00	1.06%
B 采掘业	147,806,276.08	2.89%
C 制造业	1,753,839,383.53	34.28%
C0 食品、饮料	93,990,000.00	1.84%
C1 纺织、服装、皮毛	---	---
C2 木材、家具	---	---
C3 造纸、印刷	---	---
C4 石油、化学、塑胶、塑料	223,267,123.16	4.36%
C5 电子	---	---
C6 金属、非金属	491,381,801.20	9.62%
C7 机械、设备、仪表	733,817,463.96	14.34%
C8 医药、生物制品	210,883,005.22	4.12%
C99 其他制造业	---	---
D 电力、煤气及水的生产和供应业	---	---
E 建筑业	---	---
F 交通运输、仓储业	130,517,406.00	2.55%
G 信息技术业	---	---
H 批发和零售贸易	187,027,960.00	3.66%
I 金融、保险业	1,235,166,946.51	24.14%
J 房地产业	347,688,400.00	6.80%
K 社会服务业	77,361,925.12	1.51%
L 综合类	---	---
M 合计	3,933,506,307.24	76.89%

2. 本报告期内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的比例
1	600150	沪东重机	389,320,744.37	10.8%
2	601398	工商银行	241,688,689.64	6.96%
3	000002	万科 A	149,482,515.64	4.30%
4	600685	广船国际	146,475,529.38	4.22%
5	000401	冀东水泥	119,247,565.81	3.43%
6	600028	中国石化	118,735,989.63	3.42%
7	700001	深发展 A	112,072,907.20	3.23%
8	002045	广州国光	110,567,792.98	3.18%
9	600016	民生银行	108,859,528.48	3.13%
10	600060	中国联通	106,383,731.16	3.12%
11	000858	五粮液	106,946,285.32	3.08%
12	600870	厦华电子	106,301,557.38	3.06%
13	601006	大秦铁路	88,151,377.13	2.64%
14	000825	太钢不锈	83,750,879.25	2.41%
15	600030	中信证券	83,424,753.24	2.40%
16	600348	国际新能	82,938,002.31	2.39%
17	600019	宝钢股份	82,901,303.78	2.39%
18	600675	中华企业	82,168,046.81	2.37%
19	600713	南京医药	80,864,013.66	2.33%
20	600320	振华港机	79,388,389.55	2.29%
21	600809	山西汾酒	76,507,275.74	2.20%
22	600406	国电南瑞	71,265,147.89	2.05%
23	600031	三一重工	71,209,464.09	2.05%
24	601628	中国人寿	70,188,362.31	2.02%
25	600005	宝钢股份	69,694,834.14	2.01%

(五) 本报告期内债券投资组合

债券种类	市值(元)	占基金资产净值比例
国债	710,402,749.12	13.89%
金融债	354,645,319.12	6.83%
合计	1,065,048,068.22	20.82%

(六) 本报告期内前五名债券投资明细

序号	债券名称	市值(元)	占基金资产净值比例
1	02国债01	443,470,032.00	8.67%
2	06国债 01	262,396,465.44	5.13%
3	06国债 14	92,248,535.68	1.80%
4	02国债 06	74,530,000.00	1.46%
5	07国债(4)	51,695,000.00	1.01%

(七) 本报告期内本基金投资资产支持证券

种类	市值(元)	占基金资产净值比例
资产支持证券	30,032,281.31	0.59%

(八) 投资组合报告附注  
1. 报告期内本基金投资的前十名证券的发行主体无被监管部门立案调查,或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚。  
2. 本基金投资的前十名股票中,没有投资于超出基金合同规定备选股票库之外股票。  
3. 其他资产:  
项目 金额(元)  
交易保证金 2,700,381.70  
应收利息 20,581,204.12  
应收股利 216,007.20  
待摊费用 647,033.28  
合计 24,154,631.30

4. 报告期末本基金未持有处于转股期的可转换债券  
5. 本报告期内本基金未投资权证

权证名称	本期买入数量(份)	成本总额(元)	类别(被动持有/主动投资)
五粮 YGC1	1,710,000	42,703,303.29	主动投资
深发 SPC1	1,320,000	---	被动投资
深发 SPC2	2,000,000	---	被动投资
长电 CW B1	2,458,148	21,781,223.97	主动投资

6. 基金投资资产支持证券明细

资产支持证券名称	市值(元)	占基金资产净值比例
鹏元 02	30,032,281.31	0.59%

附注: 1. 基金份额持有人户数、持有人结构及前十名持有人  
项目 2007年6月30日  
持有人户数 82,712 户  
境内持有基金份额 24,180,293 份  
机构投资者持有份额 840,140,509 份  
机构投资者持有基金份额占基金份额比例 42.01%  
个人投资者持有份额 1,159,859,491 份  
个人投资者持有基金份额占基金份额比例 57.99%

2. 截止 2007 年 6 月 30 日,前十名持有人名称、持有份额及占基金份额的比例如下

序号	持有人名称	期末持有份额(份)	占基金份额的比例
1	中国人寿保险股份有限公司	149,376,524	7.47%
2	中国人寿保险(集团)公司	117,858,121	5.89%
3	中国太平洋保险(集团)有限公司	87,768,919	4.39%
4	中国太平洋人寿保险股份有限公司	69,319,481	3.47%
5	新华安泰(集团)保险股份有限公司	43,773,704	2.19%
6	全国社保基金一零九组合	40,503,145	2.03%
7	光大证券-工行-光大阳光 2 号集合资产管理计划	36,205,666	1.81%
8	中国人保财险保险股份有限公司	27,763,382	1.39%
9	全国社保基金六零四组合	27,307,883	1.37%
10	全国社保基金六零一组合	25,630,481	1.28%

注:1. 上数据由中国证券登记结算有限责任公司上海分公司提供。  
3. 截止 2007 年 6 月 30 日,本基金管理人的基金从业人员未持有本基金份额。  
九. 重大风险提示  
(一) 本报告期内未召开基金份额持有人大会。  
(二) 本报告期基金管理人的股权变动事项  
经公司董事会审议通过,并报中国证监会及中国商务部审核批准,本基金管理人融通基金管理有限责任公司原陕西省国际信托投资股份有限公司、华林证券有限责任公司分别将其持有的公司 20% 出资全部转让给兴资产管理公司(Nikko Asset Management Co., Ltd.),原股东联合证券有限责任公司将其持有的公司 20% 股权全部转让给新时代证券有限责任公司。  
具体内容请参阅 2007 年 4 月 13 日及 6 月 20 日刊登于中国证券报、上海证券报、证券时报的公告。  
(三) 本报告期基金管理人重大人事变动  
1. 高级管理人员变动  
经公司董事会审议并报中国证监会审核批准,免去张英魂先生的公司副总经理职务,聘任刘桐林先生为公司副总经理。  
具体内容请参阅 2007 年 2 月 3 日及 2 月 5 日刊登于中国证券报、上海证券报、证券时报的公告。  
2. 基金经理变动  
经公司董事会审议并报中国证监会审核批准,免去张英魂先生的基金经理职务,聘任郝德伦先生担任基金经理。  
具体内容请参阅 2007 年 2 月 2 日刊登于中国证券报、上海证券报、证券时报的公告。  
(四) 本报告期基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动  
(五) 本基金管理人、基金财产、基金托管业务在报告期内无涉诉事项。  
(六) 本报告期内,基金管理人、托管人及其高级管理人员无违法违规事项。  
(七) 本基金投资运作在本报告期内未发生变更。  
(八) 本基金在本报告期收益分配事项。

公告日	权益登记日	除权日	每 10 份基金份额分红数	披露报纸
2007年3月27日	2007年3月30日	2007年4月2日	1.600元	中国证券报、上海证券报、证券时报

(九) 本基金在报告期内未改聘为其审计的会计师事务所。  
(十) 基金租用证券公司专用交易席位的情况  
本基金选择了西北证券、国泰君安、建信证券、申银万国、国信证券、天融证券、中国国际、海通证券、中金公司、银河证券、南京证券、渤海证券、中信证券和民族证券作为本基金专用交易席位。本报告期内截止报告期末上席席位。  
2007 年 1 月 1 日至 2007 年 6 月 30 日止,本基金通过各机构的交易席位的成交及交易金额情况如下:

1. 股票交易金额与佣金支付情况:

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(元)	占本期佣金总额比例
河北证券	2	---	---	---	---
国泰君安	2	227,202,379.00	2.50%	177,786.71	2.44%
建信证券	2	---	---	---	---
银河万国	1	444,172,111.44	4.89%	360,125.62	4.93%
国信证券	2	3,355,859,586.73	38.93%	2,854,285.58	38.11%
天融证券	1	---	---	---	---
中国银河	1	866,034,414.60	9.53%	706,327.29	9.68%
海通证券	1	56,922,970.82	0.63%	46,677.14	0.64%
中金公司	1	2,165,809,363.65	23.84%	1,694,767.93	23.22%
银河证券	1	---	---	---	---
南京证券	1	---	---	---	---
渤海证券	1	551,745,052.75	6.07%	451,070.54	6.18%
中信证券	1	1,229,524,714.56	13.54%	1,002,653.53	13.74%
民族证券	1	6,135,558.56	0.07%	4,801.07	0.07%
合计	18	9,083,406,153.11	100.00%	7,298,406.36	100.00%

2. 债券、回购及权证交易情况:

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	权证成交金额(元)	占本期该类交易成交总金额比例
中金公司	---	---	---	---	42,416,385.09	24.58%
国信证券	214,949,983.80	43.86%	952,000,000.00	29.88%	127,517,535.62	73.88%
中国银河	90,208,040.10	18.41%	580,000,000.00	18.20%	---	---
申银万国	47,324,601.10	9.66%	602,600,000.00	18.91%	2,660,001.00	1.54%
渤海证券	---	---	772,000,000.00	8.54%	---	---
中信证券	137,626,720.00	28.08%	200,000,000.00	24.48%	---	---
合计	490,109,345.90	100.00%	3,186,600,000.00	100.00%	172,593,921.91	100.00%

(十) 其他重大事项  
1. 自 2007 年 7 月 1 日起,按照中国证监会的规定,本基金开始实施新的会计准则。  
2. 基金管理人人事变动  
经公司董事会及股东会审议批准并报中国证监会深圳证监局审核通过,公司第二届董事会由以下人员组成:孟立华、曹凤岐、张力、林文彬、Miyazato Hiroki(宫田昭博)、Allen Yan(颜瀚)、马金声、吕秋彬、吴治平、叶中贵、陈斌、张力、林文彬及何志坚。  
具体内容请参阅 2007 年 8 月 4 日刊登于中国证券报、上海证券报、证券时报的公告。  
融通基金管理有限公司  
2007 年 8 月 29 日

(3) 关联方报酬

A. 基金管理人报酬  
基金管理费按前一日基金资产净值的 1.5% 的年费率计提。计算方法如下:  
H=Ex1.5%/当年天数  
H 为每日应支付的基金管理费  
E 为前一日基金资产净值  
基金管理人每日计算,逐日累计至每月月底,按月支付;由基金托管人于次月前两个工作日内从基金资产中一次性支付给基金管理人。本基金于本期应支付基金管理人管理费共计人民币 32,011,283.15 元。(2006 年同期:16,945,202.03 元)  
B. 基金托管人报酬  
基金托管费按前一日基金资产净值的 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 为前一日基金资产净值  
基金托管人每日计算,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。本基金于本期应支付基金托管人托管费共计人民币 5,335,210.54 元。(2006 年同期:2,824,200.33 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建设银行保管,并按银行间同业存款利率计息,由基金托管人保管的银行存款余额及产生的利息收入情况如下:

项目	2007-6-30	2006-6-30
银行存款余额	60,161,822.77	192,236,603.67
银行存款产生的利息收入	560,939.97	328,748.74

(4) 与关联方银行间同业市场的债券(含回购)交易  
本基金本报告期及 2006 年同期未与关联方通过银行间同业市场进行债券(含回购)交易。  
(5) 持有基金份额  
A. 基金管理人持有本基金份额

项目	2007-1-1 至 2007-6-30	2006-1-1 至 2006-6-30
年初持有基金份额(份)	10,000,000	10,000,000
加:本期购入	---	---
减:本期卖出	---	---
期末持有基金份额(份)	10,000,000	10,000,000
基金管理人持有基金份额占基金份额的比例	0.50%	0.50%

基金管理人持有本基金基金份额的交易费用按交易所公布的基金交易费率计算并支付。  
B. 基金管理人主要股东及其控制的机构持有本基金份额

项目	2007-6-30	2006-6-30
持有基金份额(份)	---	---
占基金份额比例	0.25%	0.25%

附注 4. 流通受限的基金资产  
本基金截止 2007 年 6 月 30 日止,持有以下因受限行下锁定期股票,自该新股上市交易之日起锁定一定期限后可上市流通

(三) 本报告期内前十名股票投资明细

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	000001	深发展 A	14,300,000	411,983,000.00	8.06%
2	600036	招商银行	16,300,000	400,165,000.00	7.82%
3	000402	金融街	7,960,000	233,148,400.00	4.56%
4	000732	盐湖钾肥	3,900,114	170,727,123.16	3.33%
5	000061	中国重汽	3,256,022	164,103,508.80	3.21%
6	600030	中信证券	3,000,000	160,530,000.00	3.14%
7	600169	太原重工	6,578,253	156,693,986.46	3.06%
8	600647	山东黄金	2,016,168	147,806,276.08	2.89%
9	600015	沪东重机	1,000,000	136,270,000.00	2.66%
10	000078	云南铜业	3,750,000	130,087,500.00	2.54%

注:投资者欲了解本报告期内基金投资的持仓明细,应阅读登载于融通基金管理有限公司网站的年度报告正文。  
(四) 本报告期内基金投资的重大变动  
1. 本报告期内基金资产净值 2%或前二十名股票明细

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额(元)	占期初基金资产净值的比例
1	000961	中国国航	181,998,712.21	5.24%
2	000792	盐湖钾肥	141,903,636.33	4.09%
3	600039	上海机场	128,260,103.81	3.69%
4	600102	莱钢股份	124,210,030.82	3.58%
5	600036	招商银行	119,979,847.21	3.45%
6	600647	山东黄金	118,936,947.84	3.42%
7	601166	兴业银行	118,496,323.10	3.41%
8	000078	云南铜业	115,301,373.03	3.32%
9	600050	中国联通	106,760,510.49	3.07%
10	000825	太钢不锈	106,039,613.76	3.02%
11	600189	太原重工	103,981,067.22	2.98%
12	600857	伊利股份	101,366,380.39	2.92%
13	600031	三一重工	98,749,793.97	2.84%
14	000402	金融街	96,342,230.27	2.77%
15	000872	新中基	84,470,021.07	2.43%
16	600713	南京医药	83,889,331.14	2.41%
17	000001	浦发银行	82,245,039.22	2.37%
18	601318	中国平安	79,237,990.93	2.28%
19	002024	苏宁电器	78,000,167.77	2.25%
20	600893	山东鲁商	77,207,794.69	2.22%
21	600030	中信证券	76,544,880.65	2.19%
22	600290	华仪电气	74,107,940.89	2.15%
23	600665	天地源	74,208,153.66	2.14%
24	600320	振华港机	72,029,678.40	2.07%
25	601628	中国人寿	70,259,301.12	2.02%

### 大成基金管理有限公司 关于旗下基金投资非公开发行股票的公告

根据中国证券监督管理委员会《关于基金投资非公开发行股票等流通受限证券有关问题的通知》等相关规定,大成基金管理有限公司(以下简称“本公司”)旗下大成创新成长混合型证券投资基金、大成优选股票型证券投资基金参加了深圳天马微电子股份有限公司(深天马 A,代码:000050)非公开发行股票的认购。深圳天马微电子股份有限公司已于 2007 年 8 月 27 日发布《深圳天马微电子股份有限公司非公开发行股票发行情况报告暨上市公告书》,公布了本次非公开发行结果。截止 2007 年 8 月 27 日,本公司旗下的基金投资深圳天马微电子股份有限公司非公开发行股票相关信息公告如下:

名称	认购数量(股)	总成本(元)	总成本占基金资产净值比例	账面价值(元)	账面价值占基金资产净值比例	限售期截止日
大成创新成长混合型证券投资基金	4,900,000	40,089,000.00	0.22%	40,167,000.00	0.22%	2008年8月24日
大成优选股票型证券投资基金	3,000,000	29,430,000.00	0.54%	29,490,000.00	0.54%	2008年8月24日

特此公告。  
大成基金管理有限公司  
二〇〇七年八月二十九日

### 大成蓝筹稳健证券投资基金 第六次分红结果公告

每 10 份基金份额派发现金红利 18.20 元  
根据《证券投资基金法》、《证券投资基金运作管理办法》、《大成蓝筹稳健证券投资基金基金合同》的有关规定及 2007 年 8 月 23 日大成基金管理有限公司(以下简称“本公司”)在《证券时报》、《中国证券报》和《上海证券报》上发布的《大成蓝筹稳健证券投资基金第六次分红预告》,经基金管理人计算并由基金托管人中国银行股份有限公司复核,本公司以截至 2007 年 8 月 28 日大成蓝筹稳健证券投资基金(以下简称“本基金”)的可分配收益 2,750,806,132.94 元为准,向权益登记日 2007 年 8 月 28 日在注册登记人大成基金管理有限公司登记在册的本基金的基金份额持有人实施收益分配,每 10 份基金份额派发现金收益 18.20 元。  
投资者欲了解本基金的详细情况,请仔细阅读本基金的《基金合同》及《招募说明书》等公告文件,亦可到本公司网站([www.dcfund.com.cn](http://www.dcfund.com.cn))及《招募说明书》等公告文件,亦可到本公司网站(