大成优选股票型证券投资基金

2007 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。

基金托管人中国银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2008 年 3 月 25 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及更新。

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：	大成优选
2、基金交易代码：	150002
3、基金运作方式：	契约型封闭式
4、基金合同生效日：	2007年 8 月 1 日
5、报告期末基金份额总额：	4,674,305,067.90 份
6、基金合同存续期：	5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：	2007年 9 月 7 日
二、基金产品说明	
1、投资目标：	追求基金资产长期增值。
2、投资策略：	本基金将在全球视野下，基于宏观经济研究，确定大类资产配置比例；通过上市公司基本面分析，主要采用优选个股的主动投资策略，获取超额收益。优选个股是指积极、深入、全面地了解上市公司基本面，动态评估公司价值，当股价低于合理价值区域时，买入并持有；在股价回复到合理价值的过程中，分享股价提升带来的超额收益。
3、业绩比较基准：	80%×沪深 300 指数+20%×中信标普全债指数
4、风险收益特征：	本基金是股票型基金，风险高于货币市场基金、债券型基金和混合型基金，属于较高风险收益特征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：	中国银行股份有限公司
2、信息披露负责人：	宁敏
3、联系电话：	010-66594977
4、传真：	010-66594942
5、电子邮箱：	tgxxpl@bank-of-china.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 北京市西城区复兴门内大街 1 号 中国银行股份有限公司托管及投资者服务部

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、新会计准则下基金最近三年主要财务指标

单位：人民币元

序号	项目	2007年 8 月 1 日（基金合同生效日）至 2007 年 12 月 31 日期间
1	基金本期利润	968,756,377.27
2	本期利润扣减本期公允价值变动损益后的净额	169,457,452.09
3	加权平均基金份额本期利润	0.2073
4	期末可供分配基金收益	75,971,390.07
5	期末可供分配基金份额收益	0.0163
6	期末基金资产净值	5,549,575,383.15
7	期末基金份额净值	1.187
8	基金加权平均净值收益率	17.84%
9	本期基金份额净值增长率	20.78%
10	基金份额累计净值增长率	20.78%

二、基金净值表现

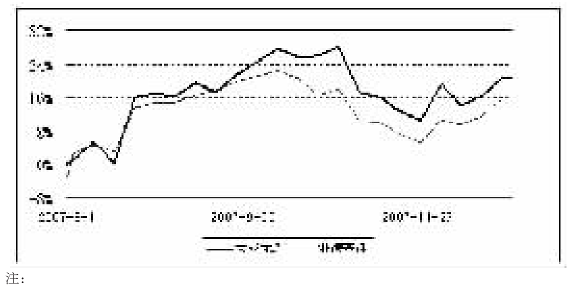
（一）本基金份额净值增长率与同期业绩比较基准收益率比较列表

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 3 个月	-0.60%	4.00%	-3.24%	2.97%	2.64%	1.03%
自基金合同生效起至今	20.78%	4.91%	15.90%	3.30%	4.88%	1.61%

（二）本基金合同生效以来基金份额净值变动情况

大成优选股票型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

(2007 年 8 月 1 日至 2007 年 12 月 31 日)



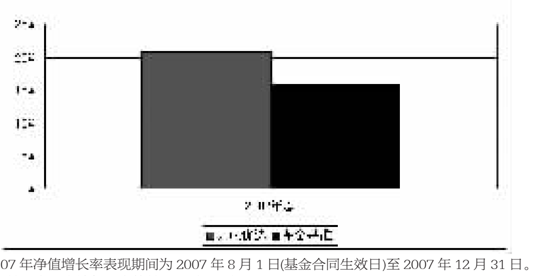
注：

1、本基金合同于 2007 年 8 月 1 日生效，截至报告日本基金合同生效未满一年。

2、按基金合同规定，本基金自基金合同生效之日起 3 个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的约定，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（二）投资组合中规定的各项比例：股票投资比例范围为基金资产的 60%-100%，其中，权证投资比例范围为基金资产净值的 0-3%。固定收益类证券和现金投资比例范围为基金资产的 0-40%，其中，资产支持证券投资比例范围为基金资产净值的 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比例最低可以为 0。

（三）本基金自基金合同生效以来每年的净值增长率，及与同期业绩比较基准的收益率比较

大成优选基金净值增长率与业绩比较基准历史收益率的对比图



①2007 年净值增长率表现期间为 2007 年 8 月 1 日(基金合同生效日)至 2007 年 12 月 31 日。

三、自基金合同生效起至今的基金收益分配情况

单位：人民币元

年度	每 10 份基金份额分红数	备注
2007年	0.100	除息日 2007 年 12 月 17 日
2007年	0.100	除息日 2007 年 12 月 27 日

第四节 管理人报告

一、基金管理人及基金经理小组情况

（一）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 2 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%)、中国银河投资管理有限公司(25%)、广东证券股份有限公司(2%)。截至 2007 年 12 月 31 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、基金景福、大成优选股票型证券投资基金，以及 10 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、大成景阳领先股票型证券投资基金。

（二）基金经理小组简介

刘明先生，基金经理，硕士，15 年金融证券从业经历。曾任厦门证券公司鹭江营业部总经理、厦门产权交易中心副总经理及香港时富金融服务集团投资经理，2004 年 3 月加盟大成基金管理有限公司，2004 年 10 月 22 日 -2008 年 1 月 12 日曾任景宏证券投资基金基金经理，现同时任大成基金管理有限公司投资部总监。

郭海洋先生，基金经理助理，金融学硕士，3 年证券从业经历。曾任华西证券投资研究部研究员、大成基金管理公司投资部研究员。2008 年 1 月 12 日起担任本基金基金经理助理。

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》、《大成优选股票型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，大成优选的投资范围、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，2007 年 9 月 4 日，本基金由于系统原因出现清算款项不足，基金管理人及时进行了妥善处理；本报告期内本基金还主动投资了分离交易可转债附送的马钢权证 CWB1，已及时全部卖出。前述事项均未对基金份额持有人利益成任何损失。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

（一）本基金业绩表现

截至报告期末，本基金份额净值为 1.187 元，本报告期本基金份额净值增长率为 20.78%，同期业绩比较基准增长率为 15.90%，优于同期业绩比较基准的表现。

（二）市场回顾与操作情况

增长与调控贯穿于 2007 年经济活动的各方面，宏观经济保持高增长，GDP 增速达到 11.4%，同时通货膨胀上升，全年 CPI 涨 4.8%，为近年来的新高；宏观调控的力度加大，全年加息 6 次，上调存款准备金率 10 次，同时人民币升值速度明显加快，货币政策工具得到充分应用。与基本面密切相关的沪深股市涨幅巨大，沪深 300 指数涨幅达到 161.57%，但波幅加大，在政策面和基本面的约束下经历了两次重大调整，第一次是 5 月底以提高印花税为导火索的调整，结束了题材股、低价股的疯狂炒作；第二次是 10 月见年度最高点 6124 点后的调整，此次的调整是以蓝筹股下跌、估值水平下降为特征，标志着此轮大牛市的一个阶段性调整，在宏观调控、收紧流动性的大背景下，以流动性过剩为基础的估值提升难以为继，市场特征面临重大转变。

本基金 8 月初成立时正是股票市场结束调整恢复上涨的初期，基于对市场趋势向好的判断，本基金迅速进行了大比例建仓，组合的仓位主要集中在包括银行、保险、证券在内的金融板块上，另外对具备竞争优势的地产、钢铁、医药等龙头公司集中持股。利用封闭式基金的优势，本基金还参与了几家公司的定向增发。从此后的市场演变情况来看，金融、地产、钢铁等大盘蓝筹股正是此轮行情上涨的核心，基金净值在短期内得以较快上升。

第四季度基金组合基本稳定，少量减持金融、钢铁股，但依然保持了这两个板块的较高仓位，少量增持医药、机械类股票。

（三）市场展望与投资策略

经过近几月的调整，市场在相当程度上回归理性，估值水平的下降为 2008 年行情创造条件，后市可以谨慎看多，但对收益率的预期要降低。在国家货币政策工具的有效运用下，流动性过剩的状况已经有所改观，对股市上升空间的判断回归基本面因素。2008 年是奥运年，经济繁荣预期依然存在，但在偏紧的货币政策和控制固定资产投资增速的大环境下，经济增幅可能略有回落。在美元降息国内加息背景下，再加上人民币升值预期，如果股市财富效应好转，不排除流动性推动估值再度提升的可能性。

由于次贷危机下美国经济放缓，来自发达国家的外部需求有减弱风险，对于我国这样高度外向型经济而言，启动内需显得尤为重要。例如在启动全面医改的背景下，医药类公司面临巨大发展机会，我们对于内需型行业公司的关注力度将加大。短期而言，在通货膨胀背景下，相比垄断性行业我们更看好竞争性行业中的领先公司，市场定价机制使该类公司能够转嫁成本压力；资源型公司将持续受益，但合理估值是基础；对于竞争优势明显的金融类公司我们持续看好。

本基金作为创新型封闭式基金从 2007 年 8 月 1 日基金合同生效到年底历时 5 个月时间，期间经历了股票市场在本轮牛市以来的最高点和其后的大调整，本基金由于持股较为集中，净值阶段性的波动率较大，但我们对中长期的净值表现充满信心。由于是上市基金，投资者不得不承受二级市场短期价格波动的风险，我们依然要提醒投资者的是，理论上基金二级市场的价格应该围绕净值波动，过多的溢价意味着风险，过多的折价则蕴藏着机会。最后，作为本基金的管理人，面对各方投资者的厚爱和信任，我们深表感谢的同时，更觉责任的重大，我们唯有更勤勉的工作，以良好的净值增长表现来回报本基金的长期持有人。

第五节 托管人报告

本报告期内，中国银行股份有限公司（以下称“本托管人”）在对大成优选股票证券投资基金（以下称“本基金”）的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了应尽的义务。

本报告期内，本托管人根据《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，对本基金管理人的投资运作进行了必要的监督，对基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算以及基金费用开支等方面进行了认真地复核。报告期内，本基金在投资运作过程中出现一次资金头寸不足的情形，托管人进行了提示，并向监管部门进行了报告；另外，本基金在二级市场上主动投资了分离型可转债附送的权证（马钢 CWB1），托管人对此进行了提示并向监管部门报告。

本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、投资组合报告等内容真实、准确和完整。

第六节 审计报告

本基金 2007 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（2008）第 20299 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)

（一）2007 年 12 月 31 日资产负债表

	2007年 12 月 31 日
资产	
银行存款	74,456,758.52
结算备付金	985,770.09
存出保证金	1,229,955.29
交易性金融资产	5,300,155,652.67
其中：股票投资	5,300,155,652.67
衍生金融资产	141,696,423.69
应收证券清算款	53,316,282.48
应收利息	17,023.03
资产总计	5,571,857,865.77
负债和所有者权益	
负债	
应付证券清算款	13,671,302.02
应付管理人报酬	5,733,570.21
应付托管费	1,146,714.05
应付交易费用	1,130,896.34
应付利息	0.00
其他负债	600,000.00
负债合计	22,282,482.62
所有者权益	
实收基金	4,674,305,067.90
未分配利润	875,270,315.25
所有者权益合计	5,549,575,383.15
负债和所有者权益总计	5,571,857,865.77
基金份额总额(份)	4,674,305,067.90
基金份额净值	1.187

（二）2007 年 8 月 1 日（基金合同生效日）至 12 月 31 日止利润表

	2007年 8 月 1 日（基金合同生效日）至 2007 年 12 月 31 日
收入	1,028,091,765.30
利息收入	655,154.41
其中：存款利息收入	655,154.41
投资收益	227,935,642.41
其中：股票投资收益	222,211,443.97
衍生工具收益	5,515,398.44
股利收益	208,800.00
公允价值变动收益	799,298,925.18
其他收入	202,043.30
费用	59,335,388.03
管理人报酬	28,449,051.99
托管费	5,689,810.45
交易费用	24,674,291.68
其他费用	522,233.91
利润总额	968,756,377.27

（三）2007 年 8 月 1 日（基金合同生效日）至 12 月 31 日止所有者权益(基金净值)变动表

	2007年 8 月 1 日（基金合同生效日）至 2007 年 12 月 31 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
期初所有者权益(基金净值)	4,674,305,067.90	-	4,674,305,067.90
本期经营活动产生的基金净值变动数(本期净利润)	-	968,756,377.27	968,756,377.27
本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动数	-	-93,486,062.02	-93,486,062.02
期末所有者权益(基金净值)	4,674,305,067.90	875,270,315.25	5,549,575,383.15

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

大成优选股票型证券投资基金(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”)证监基金字(2007]第 190 号《关于同意大成优选股票型证券投资基金募集的批复》核准，由大成基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《大成优选股票型证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型封闭式，存续期限为五年；但基金合同生效满 12 个月后，若基金折价率连续 50 个交易日超过 20%，可以转换运作方式，成为上市开放式基金(LOF)。本基金首次设立募集不包括认购资金利息共募集 4,673,566,466.18 元，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 098 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《大成优选股票型证券投资基金基金合同》于 2007 年 8 月 1 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 4,674,305,067.90 份基金份额，其中认购资金利息折合 738,601.72 份基金份额。本基金的基金管理人为大成基金管理有限公司，基金托管人为中国银行股份有限公司。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《大成优选股票型证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金的投资范围为国内依法发行上市的股票、权证、债券、资产支持证券及中国证监会批准的允许基金投资的其他金融工具。本基金投资组合中，股票投资比例范围为基金资产的 60%-100%，其中权证投资比例范围为基金资产净值的 0-3%；固定收益类证券和现金投资比例范围为基金资产的 0-40%，其中资产支持证券投资比例范围为基金资产净值的 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比例最低可以为 0。

本财务报表由本基金的基金管理人大成基金管理有限公司于 2008 年 3 月 21 日批准报出。

附注 2、财务报表编制基础、主要会计政策和会计估计及其变更

(1)财务报表编制基础

本基金的财务报表按照企业会计准则、《证券投资基金会计核算业务指引》、《大成优选股票型证券投资基金基金合同》和中国证券监督管理委员会允许的如财务报表附注 2 所列示的基金行业实务操作的有关规定编制。

(2)遵循企业会计准则的声明

本基金 2007 年 8 月 1 日(基金合同生效日)至 2007 年 12 月 31 日止期间财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金 2007 年 12 月 31 日的财务状况以及 2007 年 8 月 1 日(基金合同生效日)至 2007 年 12 月 31 日止期间的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

(3)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。本财务报表的实际编制期间为 2007 年 8 月 1 日(基金合同生效日)至 2007 年 12 月 31 日。

(4)记帐本位币

本基金的记账本位币为人民币。

(5)金融资产和金融负债的分类和抵消

金融资产于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、贷款和应收款项、可供出售金融资产及持有至到期投资。金融资产的分类取决于本基金对金融资产的持有意图和持有能力。本基金目前持有的股票投资和衍生工具(主要为权证投资)划分为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，其他金融资产划分为贷款和应收款项，暂无金融资产划分为可供出售金融资产或持有至到期投资。除衍生工具所产生的金融资产外，以公允价值计量且其公允价值变动计入损益的金融资产在资产负债表中以交易性金融资产列示。衍生工具所产生的金融资产在资产负债表中以衍生金融资产列示。

金融负债于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债及其他金融负债。本基金目前暂无划分为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。除衍生工具所产生的金融负债外，以公允价值计量且其公允价值变动计入损益的金融负债在资产负债表中以交易性金融负债列示。衍生工具所产生的金融负债在资产负债表中以衍生金融负债列示。

本基金持有的资产和承担的负债基本为金融资产和金融负债。当本基金依法有权抵销债权债务且交易双方准备按净额结算时，金融资产与金融负债按抵销后的净额在资产负债表列示。

(6)基金资产的估值原则

公允价值是指在公平交易中熟悉情况的交易双方自愿进行资产交换或者债务清偿的金额。存在活跃市场的金融资产或金融负债以活跃市场中的报价确定公允价值。不存在活跃市场的金融资产或金融负债采用估值技术确定公允价值。采用估值技术得出的结果反映估值日在公平交易中可能采用的交易价格。估值技术包括参考熟悉情况并自愿交易的各方最近进行的市场交易中使用的价格、参照实质上相同的其他金融工具的当前公允价值、现金流量折现法和期权定价模型等。本基金以上述原则确定的公允价值进行基金资产估值，主要资产的估值方法如下：

(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；估值日无交易且最近交易日后经济环境未发生重大变化的，按最近交易日的市场交易收盘价估值；估值日无交易且最近交易日后经济环境发生了重大变化的，参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易市价以确定公允价值并估值。

首次公开发行但未上市的股票按采用估值技术确定的公允价值估值，在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下按成本估值。

首次公开发行有明确锁定期的股票，在同一股票上市交易后，在锁定期内按估值日证券交易所挂牌的同一股票的市场交易收盘价估值。

由于送股、转增股、配股和公开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。

非公开发行在锁定期内的股票若在证券交易所挂牌的同一股票的市场交易收盘价低于非公开发行股票的初始投资成本，按估值日证券交易所挂牌的同一股票的市场交易收盘价估值；若在证券交易所挂牌的同一股票的市场交易收盘价高于非公开发行股票的初始投资成本，按锁定期内已经过交易天数占锁定期内总交易天数的比例将两者之间差价的一部分确认为估值增值。

(ii)权证投资

从买入交易日起到卖出交易日或行权日止，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；估值日无交易且最近交易日后经济环境未发生重大变化的，按最近交易日的市场交易收盘价估值；估值日无交易且最近交易日后经济环境发生了重大变化的，参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易市价以确定公允价值并估值。

首次发行未上市交易的权证投资按采用估值技术确定的公允价值估值，在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下按成本估值；因持有股票而享有的配股权证以及停止交易但未行权的权证按采用估值技术确定的公允价值估值。

(iii)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，本基金的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。

(7)证券投资基金成本计价方法

(i)以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产

(a)股票投资

买入股票于交易日确认为股票投资。股票投资成本按交易日股票的公允价值确认，取得时发生的相关交易费用直接记入当期损益。

卖出股票于交易日确认股票投资收益 /(损失)。出售股票的成本按移动加权平均法于交易日结转。

(b)权证投资

买入权证于交易日确认为权证投资。权证投资成本按交易日权证的公允价值确认，取得时发生的相关交易费用直接记入当期损益。

卖出权证于交易日确认衍生工具收益 /(损失)。出售权证的成本按移动加权平均法于交易日结转。

(ii)贷款和应收款项

贷款和应收款项以公允价值作为初始确认金额，采用实际利率法以摊余成本进行后续计量，终止确认或摊销时的收入或支出计入当期损益，直线法与实际利率法确定的金额差异较小的可采用直线法。

(iii)其他金融负债

其他金融负债以公允价值作为初始确认金额，采用实际利率法以摊余成本进行后续计量，终止确认或摊销时的收入或支出计入当期损益，直线法与实际利率法确定的金额差异较小的可采用直线法。

(8)收入 /（损失）的确认和计量

股票投资收益 /（损失）于卖交易日按卖出股票成交金额与其成本的差额确认。

衍生工具收益 /（损失）于交易日按卖出权证成交金额与其成本的差额确认。

股利收益于除息日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确认。

存款利息收入按存款的本金与适用利率逐日计提。

公允价值变动收益 /（损失）于估值日按以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产的公允价值变动形成的利得或损失确认。

(9)费用的确认和计量

本基金的管理人报酬由管理费和业绩报酬两部分构成，其中管理费按前一日基金资产净值 1.25%的年费率逐日计提。

业绩报酬在同时满足如下条件的前提下按基金合同规定的如下计算方法计提：

业绩报酬的计提条件：

(i)基金份额净值不得低于基金份额初始面值。

(ii)符合基金收益分配条件或其他法定要求。

(iii)基金净值增长率超过可提取业绩报酬的收益率。可提取业绩报酬的收益率不得低于 6%，且需为基金业绩比较基准同期增长率和同期可比的全部基金加权平均净值增长率上浮 5%二者中的最大值。

(iv)每年提取的业绩报酬与当年提取的基金管理费总和不得超过期初基金资产净值平均值的 5%。

(v)未发生基金转换运作方式。

业绩报酬的计算公式：

业绩报酬 = Delta × 期初基金资产净值平均值 × 10%，

其中：

(a)Delta = 基金净值增长率 - 可提取业绩报酬的收益率。

基金净值增长率 =（期末基金资产净值 - 期初基金资产净值 + 当期收益分配）/ 期初基金资产净值。

可提取业绩报酬的收益率 = max(6%，基金业绩比较基准同期增长率，同期可比的全部基金加权平均净值增长率 + 5%)；同期可比的基金是指其基金合同已在当期业绩报酬对应时间区间之前生效的股票型证券投资基金(不包括指数基金)，包括开放式基金和封闭式基金；加权平均净值增长率是指全部同期可比基金按照其当期资产净值加权计算的基金份额净值平均增长率；当期资产净值是指同期可比基金在提取业绩报酬对应时间区间的期初资产净值与期末资产净值的算术平均值。

(b)期初基金资产净值平均值 = 期初前 15 个交易日基金资产净值的算术平均值。

每个会计年度结束后 30 个工作日内提取前一年业绩报酬，由基金管理人从基金资产中一次性支付给基金管理人。

本基金的托管费按前一日基金资产净值 0.25%的年费率逐日计提。

(10)实收基金

实收基金为对外发行的基金份额总额。每份基金份额面值为 1.00 元。

(11)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。在符合有关基金收益分配条件的前提下，基金收益分配每年至少 2 次，每次收益分配比例不低于净收益的 60%。全年基金收益分配比例不得低于年度基金已实现净收益的 90%；如当年基金成立未满三个月，则不需分配收益。基金可分配收益不包括基金经营活动产生的未实现收益部分。基金当期可分配收益先弥补以前年度亏损后，方可进行当年收益分配。基金当年亏损，则不进行收益分配。基金收益分配后，基金份额净值不能低于面值。

经宣告的拟分配基金收益于分红除权日从所有者权益转出。

附注 3、主要税项

根据财政部、国家税务总局财税[1998]55 号《关于证券投资基金税收问题的通知》、财税 [2004]78 号《关于证券投资基金税收政策的通知》、财税[2005]102 号《关于股息红利个人所得税有关政策的通知》、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)基金买卖股票的差价收入暂免征营业税和企业所得税。

(3)对基金取得的股票的股息、红利收入，由上市公司在向基金派发股息、红利时暂减按 50%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)基金买卖股票按照 0.3%的税率缴纳股票交易印花税。

附注 4、资产负债表日后事项

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
中国银行股份有限公司(“中国银行”)	基金托管人
中泰信托投资有限责任公司(“中泰信托”)①	基金管理人的股东
光大证券股份有限公司(“光大证券”)	基金管理人的股东
广东证券股份有限公司(“广东证券”)②	基金管理人的股东
中国银河投资管理有限公司（“银河投资”)③	基金管理人的股东
中国银河证券股份有限公司(“银河证券”)③	与银河投资受同一母公司控制的关联方

①中泰信托持有的大成基金股权于 2007 年 9 月 17 日被北京市高级人民法院冻结，该部分股权处理方案尚未明确。

②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。

③经中国证监会批准，本公司原股东中国银河证券有限责任公司将证券经纪业务、投资银行业务及相关资产转让予中国银河证券股份有限公司。2007 年 5 月 30 日，经中国工商总局核准，中国银河证券有限责任公司更名为中国银河投资管理有限公司。

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)通过关联方交易单元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

(i)管理费

支付基金管理人大成基金的管理人报酬由管理费和业绩报酬两部分构成，其中管理费按前一日基金资产净值 1.25%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：

日基金管理人报酬 = 前一日基金资产净值 X 1.25% / 当年天数。

本基金在本会计期间需支付管理费 28,449,051.99 元，无需计提业绩报酬。

(ii)托管费

支付基金托管人中国银行的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：

日托管费 = 前一日基金资产净值 X 0.25% / 当年天数。

本基金在本会计期间需支付托管费 5,689,810.45 元。

(iii)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银行保管，按银行同业利率计息。基金托管人于 2007 年 12 月 31 日保管的银行存款余额为 74,456,758.52 元。本会计期间由基金托管人保管的银行存款产生的利息收入为 589,300.02 元。

(5)基金各关联方投资本基金的情况

	2007年 12 月 31 日	
	基金份额(份)	净值(元)
大成基金	35,672,293	42,343,011.79

基金管理人大成基金在本会计期间运用固有资金 34,800,000.00 元经代销机构购入本基金 35,672,293.00 份基金份额，认购手续费 6,960.00 元。于 2007 年 12 月 31 日，大成基金持有本基金总份额的 0.76%。

附注 6、重大会计差错的内容和更正金额

无。

附注 7、流通受限制不能自由转让的基金资产

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。

此外，基金还可作为特定投资者，认购由中国证监会《上市公司证券发行管理办法》规范的非公开发行股票，所认购的股票自发行结束之日起 12 个月内不得转让。

本基金截至 2007 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	流通受限类型	申购价格	期末估值单价	数量	期末成本总额	期末估值总额
001696	宗申动力	07/10/12	08/10/13	定向增发	19.00	20.10	3,000,000	57,000,000.00	60,300,000.00
000043	中航地产	07/09/24	08/09/25	定向增发	24.00	21.30	2,000,000	48,000,000.00	42,600,000.00
000050	深天马 A	07/08/27	08/08/25	定向增发	9.81	11.30	3,000,000	29,430,000.00	33,900,000.00
合 计								134,430,000.00	136,800,000.00

附注 8、风险管理

(1)风险管理政策和组织架构

本基金在日常经营活动中涉及的财务风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金的基金管理人制定了政策和程序来识别及分析这些风险，并设定适当的风险限额及内部控制流程，通过可靠的管理及信息系统持续监控上述各类风险。

本基金的基金管理人奉行全面风险管理体系的建设，在董事会下设立合规审计和风险控制委员会，负责监督公司的内部审计的实施，审核公司的财务信息及其披露，审查公司内部控制制度，对重大关联交易进行审计，就公司运作是否合法、合规、合理进行审议，对公司内部控制机制和内部控制制度进行考核以及行使董事会授予的其他职权。

在管理层层面设立投资风险控制委员会，讨论和制定公司日常投资过程中风险防范和控制措施；在业务操作层面风险管理职责主要由公司监察稽核部负责，协调并与各部门合作完成日常运作风险管理以及进行运作风险分析。监察稽核部由督察长分管。

本基金的基金管理人建立了以由最高监控(董事会合规审计和风险控制委员会、公司投资风险控制委员会)、日常监察(督察长和监察稽核部)、部门互控、岗位自控构成的风险管理架构体系。

(2)信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息，导致基金资产损失和收益变化的风险。本基金均投资于具有良好信用等级的证券，且通过分散化投资以分散信用风险。本基金投资于一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金的基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司发行的证券不得超过该证券的 10%。

本基金在交易所进行的交易均与中国证券登记结算有限责任公司完成证券交收和款项清算，因此违约风险发生的可能性很小。

(3)流动性风险

流动性风险是指基金所持金融工具变现的难易程度。本基金的流动性风险来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难。本基金所持证券均在证券交易所上市，因此除在附注 7 中列示的部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况外，其余均能及时变现。本基金所持有的金融负债的合约约定到期日均为一年以内且不计息，因此账面余额即为未折现的合约到期现金流量。

本基金的基金管理人每日预测本基金的流动性需求，并同时通过独立的风险管理部门设定流动性比例要求，对流动性指标进行持续的监测和分析。

(4)市场风险

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动而发生波动的风险，包括市场价格风险、利率风险和外汇风险。

(i)市场价格风险

市场价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市交易的股票，所面临的最大市场价格风险由所持有的金融工具的公允价值决定。本基金通过投资组合的分散化降低市场价格风险，并且本基金的基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控。

本基金投资组合中股票投资比例为基金资产的 60%-100%，固定收益类证券和现金投资比例范围为基金资产的 0-40%。于 2007 年 12 月 31 日，本基金面临的整体市场价格风险列示如下：

	2007年 12 月 31 日	
	公允价值(元)	占基金资产净值的比例
交易性金融资产		
- 股票投资	5,300,155,652.67	95.51%
衍生金融资产		
- 权证投资	141,696,423.69	2.55%
	5,441,852,076.36	98.06%

本基金以“沪深 300 指数×80%+ 中信标普全债指数×20%”为基础衡量市场价格风险。于 2007 年 12 月 31 日，若“沪深 300 指数×80%+ 中信标普全债指数×20%”上升 5%且其他市场变量保持不变，本基金资产净值将相应增加约 34,972 万元；反之，若“沪深 300 指数×80%+ 中信标普全债指数×20%”下降 5%且其他市场变量保持不变，本基金资产净值则将相应下降约 34,972 万元。

(ii)利率风险

利率风险是指基金的财务状况和现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。本基金持有的大部分金融资产和金融负债不计息，因此本基金的收入及经营活动的现金流量在很大程度上独立于市场利率变化。本基金的生息资产主要为银行存款、结算备付金及存出保证金等。本基金的基金管理人每日对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控。

下表统计了本基金面临的利率风险敞口。表中所示为本基金资产及负债的公允价值，并按照合约规定的利率重新定价日或到期日孰早者予以分类。

2007年 12 月 31 日	1年以内	1至 5 年	5年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	74,456,758.52	-	-	-	74,456,758.52
结算备付金	985,770.09	-	-	-	985,770.09
存出保证金	-	-	-	1,229,955.29	1,229,955.29
交易性金融资产	-	-	-	5,300,155,652.67	5,300,155,652.67
衍生金融资产	-	-	-	141,696,423.69	141,696,423.69
应收证券清算款	-	-	-	53,316,282.48	53,316,282.48
应收利息	-	-	-	17,023.03	17,023.03
资产总计	75,442,528.61	-	-	5,496,415,337.16	5,571,857,865.77
负债					
应付证券清算款	-	-	-	13,671,302.02	13,671,302.02
应付管理人报酬	-	-	-	5,733,570.21	5,733,570.21
应付托管费	-	-	-	1,146,714.05	1,146,714.05
应付交易费用	-	-	-	1,130,896.34	1,130,896.34
其他负债	-	-	-	600,000.00	600,000.00
负债总计	-	-	-	22,282,482.62	22,282,482.62
利率敏感度缺口	75,442,528.61	-	-	5,474,132,854.54	5,549,575,383.15

于 2007 年 12 月 31 日，本基金未持有交易性债券投资，因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响。

(iii)外汇风险

本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无重大外汇风险。

第八节 投资组合报告

一、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
股票	5,300,155,652.67	95.12%
债券	0.00	0.00%
权证	141,696,423.69	2.54%
资产支持证券	0.00	0.00%
银行存款和清算备付金合计	75,442,528.61	1.35%
其他资产	54,563,260.80	0.98%
合计	5,571,857,865.77	100.00%

二、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	1,486,704.00	0.03%
B 采掘业	300,210,993.60	5.41%
C 制造业	2,052,877,359.11	36.99%
C0 食品、饮料	111,205,690.00	2.00%
C1 纺织、服装、皮毛	0.00	0.00%
C2 木材、家具	0.00	0.00%
C3 造纸、印刷	0.00	0.00%
C4 石油、化学、塑胶、塑料	2,300,079.60	0.04%
C5 电子	62,079,563.21	1.12%
C6 金属、非金属	1,164,375,886.30	20.98%
C7 机械、设备、仪表	267,030,815.90	4.81%
C8 医药、生物制品	445,885,324.10	8.03%
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	333,060,000.00	6.00%
G 信息技术业	70,012,368.29	1.26%
H 批发和零售贸易	8,896,786.86	0.16%
I 金融、保险业	2,129,642,554.41	38.37%
J 房地产业	290,756,078.90	5.24%
K 社会服务业	70,612,807.50	1.27%
L 传播与文化产业	0.00	0.00%
M 综合类	42,600,000.00	0.77%
合计	5,300,155,652.67	95.51%

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)	期末市值(元)	市值占基金资产净值比例
1	600036	招商银行	12,683,395	502,642,943.85	9.06%
2	600030	中信证券	5,486,740	489,801,279.80	8.83%
3	600019	宝钢股份	24,490,866	427,120,703.04	7.70%
4	000001	深发展 A	9,500,000	366,700,000.00	6.61%
5	601006	大秦铁路	13,000,000	333,060,000.00	6.00%
6	000898	鞍钢股份	10,644,831	321,260,999.58	5.79%
7	600583	海油工程	5,764,420	300,210,993.60	5.41%
8	600005	武钢股份	13,600,000	267,920,000.00	4.83%
9	600000	浦发银行	5,000,000	264,000,000.00	4.76%
10	601166	兴业银行	4,706,781	244,093,662.66	4.40%

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、报告期内股票投资组合的重大变动

（一）报告期内累计买入价值超出期末基金资产净值 2%或前 20 名股票明细

序号	股票代码	股票名称	累计买入金额(元)	占期末基金资产净值的比例
1	600030	中信证券	475,010,327.60	8.56%
2	600036	招商银行	423,384,316.95	7.63%
3	600019	宝钢股份	421,407,045.84	7.59%
4	601398	工商银行	412,569,528.77	7.43%
5	000001	深发展 A	374,759,356.46	6.75%
6	000898	鞍钢股份	275,704,626.45	4.97%
7	600583	海油工程	252,072,523.12	4.54%
8	601166	兴业银行	248,512,203.22	4.48%
9	600005	武钢股份	225,235,614.50	4.06%
10	601006	大秦铁路	223,223,099.47	4.02%
11	600000	浦发银行	223,213,726.59	4.02%
12	600048	保利地产	198,095,395.84	3.57%
13	001696	宗申动力	189,595,069.50	3.42%
14	600276	恒瑞医药	165,128,566.40	2.98%
15	601318	中国平安	149,542,138.45	2.69%
16	600161	天坛生物	125,387,297.50	2.26%
17	000069	华侨城 A	96,051,600.52	1.73%
18	601328	交通银行	92,730,765.52	1.67%
19	000002	万 科 A	90,663,420.49	1.63%
20	600357	承德钒钛	86,871,864.63	1.57%

（二）报告期内累计卖出价值超出期末基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

序号	股票代码	股票名称	累计卖出金额(元)	占期末基金资产净值的比例
1	601398	工商银行	529,560,479.56	9.54%
2	600030	中信证券	122,931,917.75	2.22%
3	600019	宝钢股份	63,712,017.67	1.15%
4	600900	长江电力	63,521,014.69	1.14%
5	600357	承德钒钛	54,311,168.61	0.98%
6	600016	民生银行	46,972,196.61	0.85%
7	600005	武钢股份	43,208,497.67	0.78%
8	601166	兴业银行	42,774,356.83	0.77%
9	600307	酒钢宏兴	23,453,954.80	0.42%
10	600517	置信电气	20,986,541.11	0.38%
11	601006	大秦铁路	17,923,587.64	0.32%
12	000898	鞍钢股份	16,299,222.92	0.29%
13	600973	宝胜股份	13,798,027.28	0.25%
14	002038	双鹭药业	9,055,233.46	0.16%
15	601318	中国平安	5,211,334.51	0.09%
16	000001	深发展 A	5,037,803.03	0.09%
17	600000	浦发银行	5,034,967.69	0.09%
18	600549	厦门钨业	2,311,139.84	0.04%
19	002162	斯 米 克	1,390,434.71	0.03%
20	002160	常铝股份	1,113,491.38	0.02%

（三）报告期内买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额 单位：人民币元

项目	金额(元)
买入股票的成本总额	5,382,688,978.05
卖出股票的收入总额	1,094,861,092.91

五、报告期末按券种分类的债券投资组合

无。

六、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明细

无。

七、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。

八、报告期末本基金投资权证明细

（一）报告期末按市值占基金资产净直比例大小排序的所有权证明细

序号	权证名称	代码	数量(份)	市值（元）	市值占基金净资产比例	获得方式（被动持有或主动投资）
1	深发 SFC2	031004	5,329,137	141,696,423.69	2.55%	主动投资

（二）报告期内权证投资情况

权证代码	权证名称	期间买入数量（份）	期间买入成本（元）	期间卖出数量（份）	卖出收入（元）	期末数量（份）	备注
580010	马钢 CWB1	1,800,000	9,262,304.04	1,800,000	12,819,726.70	0	主动投资
031001	侨城 HQC1	350,000	16,015,951.58	350,000	17,686,747.35	0	主动投资
031003	深发 SFC1	40,000	797,300.00	40,000	1,084,480.01	0	主动投资
031004	深发 SFC2	5,329,137	132,513,822.07	0.00	0.00	5,329,137	主动投资

九、投资组合报告附注

（一）本期内基金投资的前十名证券无发行主体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。

（二）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。

（三）基金的其他资产构成

序号	其他资产	金额(元)
1	存出保证金	1,229,955.29
2	应收证券清算款	53,316,282.48
3	应收利息	17,023.03
4	其他应收款	0.00
5	待摊费用	0.00
6	其他	0.00
合 计		54,563,260.80

（四）报告期末基金持有的处于转股期的可转换债券明细

无。

（五）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(认购)	34,804,698
报告期间买入基金份额	867,595
报告期间卖出基金份额	0.00
报告期末持有基金份额	35,672,293

（六）本报告期内业绩风险准备金情况说明

期初结余	本期划入(元)	本期使用	期末结余(元)
0.00	2,844,905.19	0.00	2,844,905.19

注：

①基金管理人设立专门的业绩风险准备金，用于在基金净值增长率低于业绩比较基准增长率超过 5%时弥补持有人损失。

②基金管理人每月从已提取的上一月基金管理费中计提 10%作为业绩风险准备金，划入专门的业绩风险准备金账户。

（七）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(户)	157,598
报告期末平均每户持有的基金份额(份)	29,659.67

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	4,674,305,067.90	100.00%
其中：机构投资者持有的基金份额	224,578,817.72	4.80%
个人投资者持有的基金份额	4,449,726,250.18	95.20%

三、报告期末本基金前十名持有人明细

序号	持有人名称	持有份额(份)	占总份额的比例
1	大成基金管理有限公司	35,672,293.00	0.76%
2	广发证券股份有限公司	13,708,055.00	0.29%
3	王正东	10,002,250.22	0.21%
4	冯碧英	10,001,250.00	0.21%
5	海南江豪投资有限公司	9,801,205.00	0.21%
6	大众保险股份有限公司	8,801,386.00	0.19%
7	高顺江	7,785,131.00	0.17%
8	青岛市市政工程设计研究院有限责任公司	7,545,188.00	0.16%
9	钟建辉	6,000,810.00	0.13%
10	裘索	6,000,000.00	0.13%

注：上表数据由中国证券登记结算有限责任公司提供。

第十节 重大事件揭示

一、本报告期内未召开基金份额持有人大会。

二、本报告期内基金管理人、基金托管人的基金托管部门重大人事变动情况：

（一）经大成基金管理有限公司 2007 年第一次临时股东会审议通过，同意王政先生不再担任大成基金管理有限公司董事职务，选举蔡红标先生任大成基金管理有限公司董事。该事项已按规定报告中国证监会备案，并于 2007 年 6 月 23 日公开披露。

（二）报告期内，本基金托管人的托管部门原总经理秦立儒先生已于 2007 年 11 月 27 日调任其他岗位，即日起由董杰先生担任托管部门负责人。

三、本报告期无涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

四、本报告期本基金投资策略无改变。

五、本基金在本报告期收益分配事项

本基金的基金管理人于 2007 年 12 月 12 日宣告 2007 年度第一次分红，向截至 2007 年 12 月 14 日止在本基金注册登记人中国证券登记结算有限责任公司深圳分公司登记在册的全体持有人，按每 10 份基金份额派发红利 0.10 元；于 2007 年 12 月 24 日宣告 2007 年度第二次分红，向截至 2007 年 12 月 26 日止在本基金注册登记人中国证券登记结算有限责任公司深圳分公司登记在册的全体持有人，按每 10 份基金份额派发红利 0.10 元。收益分配比例为 55.17%。

六、本基金聘任会计师事务所情况

本基金聘任的为本基金审计的会计师事务所为普华永道中天会计师事务所有限公司，本年度支付的审计费用为 10 万元整。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、托管人及其高级管理人员未受到监管部门稽查或处罚。

八、基金租用证券公司专用交易单元的有关情况：

本报告期内，本基金通过各机构交易单元的成交及佣金情况如下：

（一）股票交易量及佣金情况：

券商名称	交易单元数量(个)	股票成交金额（元）	占本期该类交易成交总金额比例	交易单元佣金额(元)	占本期佣金总额比例
申银万国	1	5,091,230,917.09	83.08%	4,174,794.26	83.73%
中金公司	1	895,330,577.15	14.61%	700,601.67	14.05%
华泰证券	1	141,713,259.00	2.31%	110,891.63	2.22%
合计	3	6,128,274,753.24	100.00%	4,986,287.56	100.00%

（二）债券及回购交易量情况：

无。

（三）权证交易情况

券商交易单元	权证成交金额（元）	占本期该类交易成交总金额比例
申银万国	22,082,030.74	12.12%
中金公司	160,145,001.01	87.88%
合计	182,227,031.75	100.00%

（四）本报告期交易单元租用变更情况：

本报告期内增加交易单元	本报告期内退租交易单元
申银万国、中金公司、华泰证券	无

（五）租用证券公司专用交易单元的选择标准和程序

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交易单元的选择标准和程序。

租用证券公司专用交易单元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。

租用证券公司专用交易单元的程序：首先根据租用证券公司专用交易单元的选择标准形成《券商服务评价表》，然后根据评分高低进行选择基金专用交易单元。

九、其他重要事项

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	大成优选基金基金合同生效公告	证券时报、中国证券报、上海证券报	2007年 8 月 2 日
2	大成基金管理有限公司关于增加注册资本的公告	证券时报、中国证券报、上海证券报	2007年 8 月 28 日
3	大成关于旗下基金投资非公开发行股票的公告	证券时报、中国证券报、上海证券报	2007年 8 月 29 日
4	大成优选基金上市交易公告书	证券时报、中国证券报、上海证券报	2007年 9 月 4 日
5	大成优选基金上市交易提示公告	证券时报、中国证券报、上海证券报	2007年 9 月 5 日
6	创新型封闭式基金大成优选基金上市交易提示性公告	证券时报、中国证券报、上海证券报	2007年 9 月 7 日
7	大成基金公司关于旗下基金投资非公开发行股票公告	证券时报、中国证券报、上海证券报	2007年 9 月 26 日
8	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	证券时报、中国证券报、上海证券报	2007年 10 月 13 日
9	大成优选股票型证券投资基金 2007 年第一次收益分配公告	证券时报、中国证券报、上海证券报	2007年 12 月 12 日
10	大成优选股票型证券投资基金 2007 年第二次收益分配公告	证券时报、中国证券报、上海证券报	2007年 12 月 24 日

大成基金管理有限公司

二〇〇八年三月二十六日