大成创新成长混合型证券投资基金(LOF) 2008年半年度报告摘要

(原景博证券投资基金转型)

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2008年8月20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2008年1月1日起至2008年6月30日止。本报告中财务资料未经审计。

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、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:	15,705,372,352.10份
6、基金合同存续期:	不定期
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10月25日
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。 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	
信息披露报纸名称:	《证券时报》、《上海证券报》、《中国证券报》
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	2008年1月1日至2008年6月30日
1	本期利润	–9,351,484,641.87
2	本期利润扣减本期公允价值变动损益后的净额	–2,906,148,490.06
3	加权平均份额本期利润	–0.5659
4	期末可供分配利润	–2,288,334,321.44
5	期末可供分配份额利润	–0.1457
6	期末基金资产净值	11,842,067,467.99
7	期末基金份额净值	0.754
8	基金加权平均净值利润率	–54.24%
9	本期基金份额净值增长率	–43.14%
10	基金份额累计净值增长率	–28.52%

二、基金净值表现

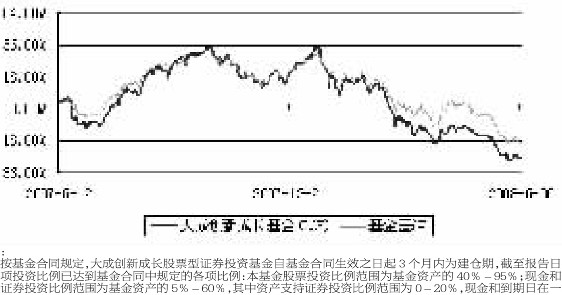
(一)基金历史各时间段净值增长率与同期业绩比较基准收益率比较列表

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	–15.47%	2.23%	–16.59%	2.39%	1.12%	–0.16%
过去3个月	–20.63%	2.19%	–19.02%	2.33%	–1.61%	–0.14%
过去6个月	–43.14%	2.42%	–35.33%	2.18%	–7.81%	0.24%
过去1年	–22.11%	2.12%	–16.71%	1.86%	–5.40%	0.26%
自基金合同生效起至今	–28.52%	2.17%	–19.37%	1.86%	–9.15%	0.31%

(二)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2008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,截至报告日本基金的各项投资比例已达到基金合同中规定的各项比例: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%。

②因工作需要,大成基金管理有限公司增聘倪明先生为大成创新成长混合型证券投资基金(LOF)基金经理,与王维刚先生共同管理大成创新成长混合型证券投资基金。该变更事项已于2008年1月12日公开披露。

③因工作需要,大成基金管理有限公司决定聘请王维钢先生为大成积极成长股票型证券投资基金基金经理,王维钢先生不再担任大成创新成长混合型证券投资基金基金经理。该变更事项已于2008年8月23日公开披露。

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2008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等。

(二)基金经理小组简介

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。12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月加入大成基金管理有限公司,2007年1月12日至2008年8月22日担任景博证券投资基金(2007年6月转型为大成创新成长混合型证券投资基金)基金经理。

倪明先生,基金经理,厦门大学金融系博士研究生,澳门大学工商管理硕士,4年证券从业经验。2004年加入大成基金管理有限公司后先后任投资部固定收益小组信用分析师、大成债券基金基金经理助理、大成精选增值混合型基金基金经理助理、金融行业研究员。2008年1月12日起担任大成创新成长混合型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》、《大成创新成长证券投资基金(LOF)基金合同》和其他有关法律法规的规定,在基金管理运作中,大成创新成长基金的投资范围、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。本基金管理人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、公平交易专项说明

(一)公平交易制度的执行情况

本报告期内根据《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》的要求,本基金管理人制定并严格执行了《公平交易制度》和《异常交易监控与报告制度》,公平对待旗下各投资组合,所管理的不同投资组合的整体收益率、分投资类别(股票、债券)的收益率以及不同时间窗内(同日内、5日内、10日内)同向、反向交易的交易价格并未发现异常差异。

(二)本投资组合与其他投资风格相似的投资组合之间的业绩比较

阶段	基金	净值增长率
过去六个月	大成创新成长混合型证券投资基金	–43.14%
	大成积极成长股票型证券投资基金	–40.03%
	大成景阳领先股票型证券投资基金	–42.11%

(三)异常交易行为的专项说明

本报告期内本基金不存在异常交易行为。

四、基金经理小组工作报告

(一)本基金业绩表现

截至报告期末,本基金份额净值为0.754元,本报告期份额净值增长率为–43.14%,同期业绩比较基准增长率为–35.33%,低于同期业绩比较基准的表现。

(二)2008年上半年证券市场与基金运作回顾

回顾2007年,我国的宏观经济运行总体呈现出高速增长的态势,GDP增速超过11%,而与此同时,通货膨胀已经呈现出全面上涨的趋势。在这样的背景下,2007年底的中央经济工作会议提出了"防止经济增长由偏快转向过热、防止价格由结构性上涨演变为明显通货膨胀"的目标作为当前宏观调控的首要任务,而货币政策监管也在最近十年内首次转变为从紧的货币政策。进入2008年以来,宏观经济的负面因素开始演变为事实,从紧的货币政策、持续高企的通货膨胀水平、美国的次贷危机愈演愈烈都对市场不断造成负面冲击,上证指数从2007年四季度最高的6100点大幅下跌至3300点,跌幅超过40%,市场风险已经由行业和板块轮动转变为系统性风险。

进入2季度以来,虽然已经经历了1季度的大幅下跌,且CPI也如预期在逐月回落,但企业盈利增速降低的预期、国际能源价格的持续上涨、美国及欧洲经济持续低迷依然是投资者心中挥散不去的阴云。而市场对政策的预期及心态不稳等不确定因素,也使得市场波动性加大,增加了投资操作的难度。虽然在2季度市场也经历了"4.24"的大幅反弹,但持续不断的负面信息依然给市场带来巨大的压力,指数再创新低,各个板块的轮番下跌体现出投资者的恐慌情绪和对未来走势复杂而矛盾的心理。

回顾本基金2008年上半年的投资情况,1季度,由于仓位和结构的原因,业绩表现并不尽如人意,重点持有的钢铁、有色、航空等板块和个股的表现不够理想。进入3月份以来,本基金管理人对仓位和结构进行了较大幅度的调整,整体仓位迅速下降,在结构方面减持了部分前期持仓较重的有色、钢铁、航空、公用事业等股票,适度增持了银行、地产、化工板块的重点股票。

进入2季度的以后,在较为谨慎的市场预期下本基金管理人将基金仓位降至较低的水平,在一定程度上回避了部分系统性风险,但在结构配置上依然存在需要反思的地方,本基金在金融、钢铁等板块上的配置增加了整个组合的暴露风险,而对于资源类股票投资力度的不足也在部分程度上影响了基金的整体表现。

(三)2008年下半年证券市场展望和基金投资策略

如果说从6000点持续下跌到3500点的过程中,依然不断伴随着市场各方对基本面判断的分歧,那么在现在的时点,对这一问题的争论已经没有必要。我们现在更需要思考的问题是2700点的市场点位已经在多大程度上反映了市场对于未来走势的悲观预期。从宏观经济和政策层面分析,我们认为在未来3个月美国和欧洲经济依然不会出现明显的好转,而一系列迹象也表明,由次贷危机带来的经济恶化情况依然不明朗,国内紧缩的货币政策放开的可能性也较小。除此以外,我们依然需要密切跟踪包括CPI、PPI和工业企业盈利等月度经济数据,才能对未来的市场发展做出更准确的判断。

虽然市场在短期内无法看到明显的反转,但不可否认的是,中国的宏观经济依然在持续健康的高速发展,资本市场中依然有一批优秀的企业值得投资。在当前的估值水平下,本基金管理人认为在对整体宏观经济形势依然保持谨慎的前提下,市场中的部分行业和公司已经进入了合理的价值投资区间,而我们要做的工作就是仔细选择,认真思考并投资这样的优秀企业。

基于对宏观经济和市场的判断,本基金在2008年下半年的投资策略如下:在3季度,预计美国及欧洲经济的前景依然黯淡,国内企业利润增速可能出现下滑的风险,基于以上判断,本基金计划依然保持相对谨慎的仓位水平,在行业和个股配置方面,将重点关注并投资包括能源、医药、电力设备、基础设施建设等在内的行业龙头公司。

同时,在下半年需要密切关注的因素包括:美国经济是否已经渡过最黑暗的时期、大宗商品价格是否已经出现趋势性回落以及国内宏观经济在经济增长与通胀控制两方面平衡的实际效果,基于以上因素的变化对本基金的仓位和结构进行实时调整,同时本基金将在下半年密切关注能源价格改革带来的电力、石化行业的行业景气度提升,以及大宗商品价格回落的受益行业和个股的投资机会。

同时,本基金管理人郑重承诺,将继续保持勤勉尽责的工作态度,用良好的业绩回报投资者的长期信任和支持。

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(LOF)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《大成创新成长混合型证券投资基金(LOF)基金合同》、《大成创新成长混合型证券投资基金(LOF)托管协议》的约定,对大成创新成长混合型证券投资基金(LOF)管理人——大成基金管理有限公司2008年1月1日至2008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创新成长混合型证券投资基金(LOF)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创新成长混合型证券投资基金(LOF)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
2008年8月20日

第六节 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)

(一)2008年6月30日资产负债表

	2008年6月30日	2007年12月31日
资产:		
银行存款	909,434,929.94	2,194,207,395.33
结算备付金	24,414,926.34	3,020,373,676.03
存出保证金	2,860,167.20	1,160,000.00
交易性金融资产	8,147,499,124.10	19,716,944,967.75
其中:股票投资	7,932,426,209.70	19,716,255,687.75
债券投资	215,072,914.40	689,280.00
衍生金融资产	5,844,807.36	44,612,506.41
买入返售金融资产	1,938,204,184.00	0.00
应收证券清算款	858,639,598.44	0.00
应收利息	3,219,667.36	1,635,145.34
应收股利	4,337,187.93	0.00
应收申购款	1,315,073.51	0.00
其他资产	0.00	0.00
资产总计	11,895,769,666.18	24,978,933,690.86
负债:		
应付证券清算款	13,343,989.78	0.00
应付赎回款	5,204,263.46	178,130,169.05
应付管理人报酬	15,750,556.47	30,738,788.36
应付托管费	2,625,092.74	5,123,131.40
应付交易费用	15,847,940.76	21,075,091.16
应交税费	151,287.20	151,287.20
其他负债	779,067.78	1,364,345.70
负债合计	53,702,198.19	236,582,812.87
所有者权益:		
实收基金	14,130,401,789.43	16,790,498,498.11
未分配利润	–2,288,334,321.44	7,951,852,379.88
所有者权益合计	11,842,067,467.99	24,742,350,877.99
负债和所有者权益总计	11,895,769,666.18	24,978,933,690.86
基金份额总额(份)	15,705,372,352.10	18,661,889,584.94
基金份额净值	0.754	1.326

后附财务报表附注为本财务报表的组成部分

(二)2008年1月1日1至6月30日止期间利润表

	2008年1月1日至2008年6月30日	2007年6月12日(基金合同生效日)至2007年6月30日止期间
一、收入	–9,128,781,025.09	–355,046,971.32
1、利息收入	18,699,524.79	2,076,239.44
其中:存款利息收入	14,514,022.28	2,010,142.86
债券利息收入	126,511.45	66,096.58
买入返售金融资产收入	4,058,991.06	0.00
2、投资收益	–2,706,937,436.48	27,242,210.47
其中:股票投资收益	–2,767,784,034.45	26,161,666.07
债券投资收益	638,541.34	–3,642,098.20
衍生工具收益	884,271.40	0.00
股利收益	59,323,785.23	4,722,642.60
3、公允价值变动收益	–6,445,336,151.81	–384,365,421.94
4、其他收入	4,793,038.41	0.71
二、费用	222,703,616.78	26,781,520.67
1、管理人报酬	129,247,104.54	4,986,280.23
2、托管费	21,541,184.11	831,046.69
3、销售服务费	0.00	0.00
4、交易费用	71,612,386.75	20,928,806.79
5、利息支出	0.00	11,142.84
其中:卖出回购金融资产支出	0.00	11,142.84
6、其他费用	302,941.38	24,244.12
三、利润总额	–9,351,484,641.87	–381,828,491.99

所附附注为本会计报表的组成部分

(三)2008年1月1日至6月30日止期间所有者权益(基金净值)变动表

	2008年1月1日至2008年6月30日止期间		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初基金资产净值	16,790,498,498.11	7,951,852,379.88	24,742,350,877.99
二、本期经营活动产生的基金净值变动数	0	–9,351,484,641.87	–9,351,484,641.87
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数	–2,660,096,708.68	–888,702,059.45	–3,548,798,768.13
其中:基金申购款	275,025,559.71	14,849,586.65	289,875,146.36
基金赎回款	–2,935,122,268.39	–903,551,646.10	–3,838,673,914.49
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动数	0.00	0.00	0.00
五、期末基金净值	14,130,401,789.43	–2,288,334,321.44	11,842,067,467.99

	2007年6月12日(基金合同生效日)至2007年6月30日止期间		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初基金资产净值	1,000,000,000.00	1,207,153,700.24	2,207,153,700.24
二、本期经营活动产生的基金净值变动数	0.00	–381,828,491.99	–381,828,491.99
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数	9,866,426,866.90	–0.39	9,866,426,866.51
其中:基金申购款	9,866,426,867.22	0.00	9,866,426,867.22
基金赎回款	–0.32	–0.39	–0.71
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动数	0.00	0.00	0.00
五、期末基金净值	10,866,426,866.90	825,325,207.86	11,691,752,074.76

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)

(一)主要会计政策及会计估计

本半年度会计报表所采用的会计政策、会计估计与上年度会计报表相一致。自2007年7月1日起,本基金开始执行财政部于2006年2月15日颁布的企业会计准则和中国证券业协会于2007年5月15日颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》及中国证监会允许的基金行业实务操作的有关规定。本基金已按照《企业会计准则第38号—首次执行企业会计准则》的要求,对2007年6月12日(基金合同生效日)起至2007年6月30日止期间的财务报表予以追溯调整。

(二)本报告期重大会计差错的内容和更正金额。

无。

(三)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、基金销售机构
中国农业银行	基金托管人、基金代销机构
中泰信托投资有限责任公司①	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、基金代销机构
中国银河投资管理有限公司("银河投资")②	基金管理人的股东
中国银河证券股份有限公司("银河证券")②	与银河投资受同一母公司控制的关联方、基金代销机构
广东证券股份有限公司("广东证券")③	基金管理人的股东

①中泰信托持有的大成基金管理有限公司股权于2007年9月17日被北京市高级人民法院冻结,该部分股权于2008年7月2日由北京市高级人民法院裁定解除冻结。。

②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。

③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。广东证券所属营业部已划归安信证券股份有限公司,广东证券作为本基金代销机构的资格亦由安信证券股份有限公司承担。

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交易及佣金情况

(1)股票买卖

关联方名称	2008年1月1日至2008年6月30日		2007年6月12日(基金合同生效日)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	本期成交金额	占本期该类交易成交总金额比例
银河证券	1,945,674,878.91	8.14%	1,858,379,524.89	35.76%

(2)席位佣金

关联方名称	2008年1月1日至2008年6月30日		2007年6月12日(基金合同生效日)至2007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	1,580,874.10	7.87%	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

(1)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,逐日累计至每月月底,按月支付。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

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。本基金于本期应支付基金管理人管理费共计人民币129,247,104.54元,其中已支付基金管理人人民币113,496,548.07元,尚余人民币15,750,556.47元未支付。(2007年6月12日(基金合同生效日)至2007年6月30日共计提基金管理费4,986,280.23元,已全部支付。)

(2)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。本基金于本期应支付基金托管人托管费共计人民币21,541,184.11元,其中已支付基金托管人人民币18,916,091.37元,尚余人民币2,625,092.74元未支付。(2007年6月12日(基金合同生效日)至2007年6月30日共计提基金托管费831,046.69元,已全部支付)。

(3)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2008年6月30日保管的银行存款余额为909,434,929.94元。本期由基金托管人保管的银行存款产生的利息收入为14,102,949.69元(2007年6月30日基金托管人保管的银行存款余额为5,909,835,242.71元,2007年6月12日(基金合同生效日)至2007年6月30日由基金托管人保管的银行存款利息收入为2,004,854.67元)。

4、基金各关联方投资本基金的情况

(1)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	70,687,989.47
报告期间买入基金份额	0.00
报告期间赎回基金份额	0.00
报告期末持有基金份额	70,687,989.47

(2)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。

(四)报告期末流通转让受到限制的基金资产

1、流通受限制不能自由转让的股票

(1)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2008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	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(股)	期末成本总额(元)	期末估值总额(元)
000050	深天马A	07/08/27	08/08/25	非公开发行	9.81	6.97	4,900,000	48,069,000.00	34,153,000.00
000043	中航地产	07/09/24	08/09/25	非公开发行	24.00	9.20	2,000,000	48,000,000.00	18,400,000.00
001696	宗申动力	07/10/12	08/10/13	非公开发行	19.00	7.86	2,000,000	38,000,000.00	15,720,000.00
002257	立立电子	08/06/30	未定	新股网上申购	21.81	21.81	26,500	577,965.00	577,965.00
002258	科尔化学	08/06/30	08/07/08	新股网上申购	16.06	16.06	27,500	441,650.00	441,650.00
合计								135,088,615.00	69,292,615.00

(2)截至2008年6月30日止,本基金持有以下因未能按交易所信息披露的有关要求按时披露重要信息或因公布的重大事项可能产生重大影响而被暂时停牌的股票,这些股票将在重要信息披露完成后或所公布事项的重大影响消除后并经交易所批准后复牌。

股票代码	股票名称	停牌日期	期末估值单价	停牌原因	复牌日期	复牌开盘单价	数量(股)	期末成本总额(元)	期末估值总额(元)
600900	长江电力	08/05/08	14.65	公告重大事项	未定	未定	9,999,913	129,444,477.32	146,498,725.45
000024	招商地产	08/06/30	14.94	公告重大事项	08/07/01	14.50	6,696,244	159,135,392.80	100,041,885.36
000425	徐工科技	08/06/13	14.59	公告重大事项	08/07/25	15.98	2,170,841	42,177,070.38	31,672,570.19
000990	诚志股份	08/06/26	12.90	公告重大事项	08/07/30	14.19	1,145,916	14,063,127.96	14,782,316.40
合计								344,820,068.46	292,995,497.40

(3)流通受限制不能自由转让的债券

基金认购新发行分离交易可转债而取得的债券,从债券认购日至债券上市日期间,暂无法流通。本基金截至2008年6月30日止流通受限制的债券情况如下:

债券代码	债券名称	成功认购日期	可流通日期	单位成本	期末估值单价	认购数量(张)	期末成本总额(元)	期末估值总额(元)
126016	08宝钢债	08/06/25	08/07/04	77.60	75.08	305,180	23,681,947.80	22,912,914.40

2、流通受限制不能自由转让的权证

基金认购新发行分离交易可转债而取得的权证,从权证获配日至权证上市日期间,暂无法流通。本基金截至2008年6月30日止流通受限制的权证情况如下:

权证代码	权证名称	成功获配日期	可流通日期	单位成本	期末估值单价	获配数量(份)	期末成本总额(元)	期末估值总额(元)
580024	宝钢CWB1	08/06/25	08/07/04	1.40	1.1970	4,882,880	6,836,052.20	5,844,807.36

(五)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%,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;基金在进行银行间同业市场交易前均对交易对手进行信用评估,以控制相应的信用风险。

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一方面来自于基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额,另一方面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。本基金所持大部分证券在证券交易所上市,其余亦可在银行间同业市场交易,因此除在附注(四)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,均能及时变现。此外,本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求,其上限一般不超过基金持有的债券资产的公允价值。本基金所持有的其他金融负债以及可赎回基金份额净值(所有者权益)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。

(1)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或银行间同业市场交易的股票和债券,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40%–95%,现金和固定收益类证券投资为5%–60%。于2008年6月30日,本基金面临的整体市场价格风险列示如下:

	2008年6月30日	
	公允价值	占基金资产净值的比例
交易性金融资产		
–股票投资	7,932,426,209.70	66.99%
–债券投资	215,072,914.40	1.82%
衍生金融资产	5,844,807.36	0.05%
合计	8,153,343,931.46	68.86%

于2008年6月30日,若本基金业绩比较基准上升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6.40亿元;反之,若本基金业绩比较基准下降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6.40亿元。

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	占基金资产净值的比例
交易性金融资产		
–股票投资	19,716,255,687.75	79.686%
–债券投资	689,280.00	0.003%
衍生金融资产	44,612,506.41	0.180%
合计	19,761,557,474.16	79.869%

于2007年12月31日,若本基金业绩比较基准上升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14.14亿元;反之,若本基金业绩比较基准下降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14.14亿元。

(2)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、结算备付金及债券投资等。

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。

2008年6月30日	1年以内	1至5年	5年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	909,434,929.94	–	–	–	909,434,929.94
结算备付金	24,414,926.34	–	–	–	24,414,926.34
存出保证金	160,000.00	–	–	2,700,167.20	2,860,167.20
交易性金融资产	192,160,000.00	–	22,912,914.40	7,932,426,209.70	8,147,499,124.10
衍生金融资产	–	–	–	5,844,807.36	5,844,807.36
买入返售金融资产	1,938,204,184.00	–	–	–	1,938,204,184.00
应收证券清算款	858,639,598.44	–	–	–	858,639,598.44
应收利息	–	–	–	3,219,667.36	3,219,667.36
应收股利	–	–	–	4,337,187.93	4,337,187.93
应收申购款	–	–	–	1,315,073.51	1,315,073.51
资产总计	3,923,013,638.72	–	22,912,914.40	7,949,843,113.06	11,895,769,666.18
负债					
应付证券清算款	–	–	–	13,343,989.78	13,343,989.78
应付赎回款	–	–	–	5,204,263.46	5,204,263.46
应付管理人报酬	–	–	–	15,750,556.47	15,750,556.47
应付托管费	–	–	–	2,625,092.74	2,625,092.74
应付交易费用	–	–	–	15,847,940.76	15,847,940.76
应付税费		–	–	151,287.20	151,287.20
其他负债	–	–	–	779,067.78	779,067.78
负债总计	–	–	–	53,702,198.19	53,702,198.19
利率敏感度缺口	3,923,013,638.72	–	22,912,914.40	7,896,140,914.87	11,842,067,467.99

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	2,194,207,395.33	–	–	–	2,194,207,395.33
结算备付金	3,020,373,676.03	–	–	–	3,020,373,676.03
存出保证金	160,000.00	–	–	1,000,000.00	1,160,000.00
交易性金融资产	–	–	689,280.00	19,716,255,687.75	19,716,944,967.75
衍生金融资产	–	–	–	44,612,506.41	44,612,506.41
应收利息	–	–	–	1,635,145.34	1,635,145.34
资产总计	5,214,741,071.36	–	689,280.00	19,763,503,339.50	24,978,933,690.86
负债					
应付赎回款	–	–	–	178,130,169.05	178,130,169.05
应付管理人报酬	–	–	–	30,738,788.36	30,738,788.36
应付托管费	–	–	–	5,123,131.40	5,123,131.40
应付交易费用	–	–	–	21,075,091.16	21,075,091.16
应付税费				151,287.20	151,287.20
其他负债	–	–	–	1,364,345.70	1,364,345.70
负债总计	–	–	–	236,582,812.87	236,582,812.87
利率敏感度缺口	5,214,741,071.36	–	689,280.00	19,526,920,526.63	24,742,350,877.99

下表为利率风险的敏感性分析,反映了在其他变量不变的假设下,利率发生合理、可能的变动时,将对基金利润总额和净值产生的影响。负数表示可能减少净值,正数表示可能增加净值。

	基准点(%)	对净值的影响
2008年6月30日		
利率	+25	–38.87万元
利率	–25	39.08万元

2007年12月31日,本基金持有的交易性债券投资公允价值占基金资产的比例低于1%,因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响。

(3)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

(六)首次执行企业会计准则

2007年6月12日(基金合同生效日)至2007年6月30日止期间的相关数字已按照《企业会计准则第38号—首次执行企业会计准则》的要求进行追溯调整,所有报表项目已按照本财务报表的披露方式进行了重分类。

按原会计准则和制度列报的2007年6月30日的所有者权益,以及2007年6月12日(基金合同生效日)至2007年6月30日止期间的净损益调整为按企业会计准则列报的所有者权益及净损益的调节过程列示如下:

项目	2007年6月12日(基金合同生效日)至2007年6月30日止期间净损益	2007年6月30日所有者权益
	(未经审计)	(未经审计)
按原会计准则列报的金额	2,536,929.95	11,691,752,074.76
金融资产公允价值变动的调整数	–384,365,421.94	
按新会计准则列报的金额	–381,828,491.99	11,691,752,074.76

根据上述追溯调整,按原会计准则和制度直接记入所有者权益下"未实现利得/(损失)"科目的投资估值增值/(减值)净变动现按企业会计准则在利润表中的"公允价值变动收益/(损失)"科目中核算,相应的未实现损益平准金现按企业会计准则直接记入"未分配利润/(累计亏损)"科目。于会计期末,按原会计准则和制度列示于所有者权益下"未实现利得/(损失)"科目中的全部余额,现按企业会计准则包含于"未分配利润/(累计亏损)"科目中。

(七)资产负债表日后事项

1、因大成基金管理有限公司第三届董事会任期届满,经公司2008年第一次股东会会议审议通过,由张树中先生、曾北川先生、王长林先生、杨赤忠先生、王颢先生、蔺春林先生、于绪刚先生、万曾炜先生、刘大为先生担任公司第四届董事会董事,其中蔺春林先生、于绪刚先生、万曾炜先生、刘大为先生为独立董事。第三届董事会董事胡学光先生、于华先生、徐浩明先生、蔡红标先生及独立董事杨建文先生、胡春元先生、查竞传先生不再继续担任公司董事职务。上述变更事项已报监管部门备案并于2008年8月16日公开披露。

2、因工作需要,大成基金管理有限公司决定聘请王维钢先生为大成积极成长股票型证券投资基金基金经理,王维钢先生不再担任大成创新成长混合型证券投资基金基金经理。该变更事项已于2008年8月23日公开披露。

(八)其他重要事项

经国务院批准,财政部、国家税务总局决定从2008年4月24日起,调整证券(股票)交易印花税税率,由现行的3‰调整为1‰。

第七节 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
银行存款和结算备付金合计	933,849,856.28	7.85%
股票	7,932,426,209.70	66.68%
债券	215,072,914.40	1.81%
权证	5,844,807.36	0.05%
买入返售金融资产 其中:买断式回购买入返售金融资产	1,938,204,184.00 0.00	16.29% 0.00%
其他资产	870,371,694.44	7.32%
合计	11,895,769,666.18	100.00%

二、报告期末按行业分类的股票投资组合

行业	公允价值(元)	占资产净值比例
A农、林、牧、渔业	14,837,940.00	0.13%
B采掘业	1,065,750,607.08	9.00%
C制造业	2,505,739,158.55	21.16%
C0食品、饮料	518,791,580.79	4.38%
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	502,451,432.44	4.24%
C5电子	34,730,965.00	0.29%
C6金属、非金属	686,261,902.23	5.80%
C7机械、设备、仪表	393,176,823.12	3.32%
C8医药、生物制品	370,326,454.97	3.13%
C99其他制造业	0.00	0.00%
D电力、煤气及水的生产和供应业	256,721,835.34	2.17%
E建筑业	231,721,877.16	1.96%
F交通运输、仓储业	642,815,730.92	5.43%
G信息技术业	213,440,000.00	1.80%
H批发和零售贸易	886,192,156.09	7.48%
I金融、保险业	1,522,240,242.50	12.85%
J房地产业	378,214,785.80	3.19%
K社会服务业	125,264,790.07	1.06%
L传播与文化产业	71,087,086.19	0.60%
M综合类	18,400,000.00	0.16%
合计	7,932,426,209.70	66.99%

三、报告期末按公允价值占基金资产净值比例前十名股票投资明细

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例
1	600036	招商银行	17,791,153	416,668,803.26	3.52%
2	000983	西山煤电	7,970,697	398,534,850.00	3.37%
3	600000	浦发银行	14,017,050	308,375,100.00	2.60%
4	601088	中国神华	7,600,000	285,532,000.00	2.41%
5	000898	鞍钢股份	19,000,000	247,570,000.00	2.09%
6	601939	建设银行	39,569,276	233,854,421.16	1.97%
7	601166	兴业银行	9,046,358	230,410,738.26	1.95%
8	600026	中海发展	11,499,991	228,734,820.99	1.93%
9	600058	五矿发展	9,221,908	215,884,866.28	1.82%
10	600050	中国联通	32,000,000	213,440,000.00	1.80%

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的半年度报告正文。

四、本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初基金资产净值2%或前二十名的股票明细

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	601398	工商银行	1,057,874,423.87	4.28%
2	601939	建设银行	938,322,079.42	3.79%
3	600036	招商银行	532,912,093.66	2.15%
4	601166	兴业银行	406,333,890.26	1.64%
5	600028	中国石化	337,393,009.22	1.36%
6	600000	浦发银行	290,052,900.50	1.17%
7	600005	武钢股份	271,594,388.78	1.10%
8	000568	泸州老窖	247,815,977.99	1.00%
9	600016	民生银行	244,212,207.97	0.99%
10	000002	万科A	232,219,089.00	0.94%
11	600309	烟台万华	230,075,308.28	0.93%
12	600694	大商股份	221,342,658.32	0.89%
13	002024	苏宁电器	216,975,608.58	0.88%
14	600143	金发科技	215,658,183.01	0.87%
15	601318	中国平安	196,040,302.14	0.79%
16	600009	上海机场	193,358,221.23	0.78%
17	600519	贵州茅台	187,243,582.56	0.76%
18	601006	大秦铁路	179,671,902.74	0.73%
19	000858	五粮液	166,323,558.38	0.67%
20	000024	招商地产	159,135,392.80	0.64%

(二)报告期内累计卖出价值超出期初基金资产净值2%或前二十名的股票明细

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	601398	工商银行	967,221,271.55	3.91%
2	601939	建设银行	755,906,993.06	3.06%
3	600251	冠农股份	664,830,027.73	2.69%
4	600036	招商银行	609,143,338.86	2.46%
5	000898	鞍钢股份	502,054,222.98	2.03%
6	600028	中国石化	500,631,647.82	2.02%
7	600030	中信证券	417,087,801.07	1.69%
8	600019	宝钢股份	400,371,387.27	1.62%
9	601988	中国银行	398,995,197.73	1.61%
10	000960	锡业股份	372,410,940.24	1.51%
11	000758	中色股份	326,924,711.46	1.32%
12	600050	中国联通	324,141,721.12	1.31%
13	000709	唐钢股份	312,357,612.02	1.26%
14	600029	南方航空	292,689,500.46	1.18%
15	600000	浦发银行	287,911,061.31	1.16%
16	601857	中国石油	284,586,854.96	1.15%
17	600649	城投控股	248,482,035.30	1.00%
18	000878	云南铜业	241,289,459.19	0.98%
19	000060	中金岭南	235,007,602.23	0.95%
20	600508	上海能源	209,366,869.28	0.85%

(三)报告期内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	10,741,280,006.45
卖出股票的收入总额	13,328,559,808.79

五、报告期末按券种分类的债券投资组合

序号	债券品种	公允价值(元)	占基金资产净值比例
1	国债	0.00	0.00%
2	金融债	0.00	0.00%
3	央行票据	192,160,000.00	1.62%
4	企业债	22,912,914.40	0.20%
5	可转债	0.00	0.00%
6	其他	0.00	0.00%
	合计	215,072,914.40	1.82%

六、报告期末按公允价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	公允价值(元)	占基金资产净值比例
1	08央行票据28	96,080,000.00	0.81%
2	08央行票据31	96,080,000.00	0.81%
3	08宝钢债	22,912,914.40	0.20%

七、投资组合报告附注

(一)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。

(二)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。

(三)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)	公允价值(元)	占基金资产净值比例
1	580024	宝钢CWB1	4,882,880	5,844,807.36	0.05%

2、报告期内获得权证明细

权证代码	权证名称	期初数量(份)	期间买入数量	期间买入成本	期间卖出数量(份)	卖出收入(元)	期末数量(份)	备注
580017	赣粤CWB1	0	92,355	481,178.76	92,355	600,537.74	0	被动持有
580018	中远CWB1	0	296,940	2,070,223.61	296,940	2,401,894.73	0	被动持有
580019	石化CWB1	0	4,481,774	10,642,067.91	4,481,774	10,173,109.58	0	被动持有
580021	青啤CWB1	0	281,260	957,716.13	281,260	1,088,953.55	0	被动持有
580022	国电CWB1	0	998,203	2,338,367.50	998,203	4,799,524.26	0	被动持有
580023	康美CWB1	0	489,140	813,756.79	489,140	1,919,841.25	0	被动持有
580024	宝钢CWB1	0	4,882,880	6,836,052.20	0	0.00	4,882,880	被动持有
580014	深高CWB1	1,167,984	0	0.00	1,167,984	6,237,328.66	0	被动持有
580016	上汽CWB1	34,560	0	0.00	34,560	251,923.59	0	被动持有
030002	五粮YGC1	751,200	0	0.00	751,200	20,528,623.54	0	主动投资

注:权证030002(五粮YGC1)的卖出收入为行权时的行权收入。

(四)报告期末其他资产的构成

项目	金额(元)
存出保证金	2,860,167.20
应收证券清算款	858,639,598.44
应收利息	3,219,667.36
应收股利	4,337,187.93
应收申购款	1,315,073.51
合计	870,371,694.44

(五)报告期末本基金持有处于转股期的可转换债券明细。

无。

(六)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。

(七)2008年1月1日至2008年6月30日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)
报告期初持有基金份额	70,687,989.47
报告期间买入基金份额	0
报告期间卖出基金份额	0
报告期末持有基金份额	70,687,989.47

(八)由于四舍五入原因,分项之和与合计可能有尾差。

第八节 基金份额持有人情况

一、基金份额持有人户数

报告期末基金份额持有人户数	706,541户
报告期末平均每户持有的基金份额	22,229份

二、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	15,705,372,352.10	100.00%
其中:机构投资者持有的基金份额	424,663,278.67	2.70%
个人投资者持有的基金份额	15,280,709,073.43	97.30%

三、截止2008年6月30日,本基金场内前十名持有人情况如下:

序号	持有人名称	期末持有份额(份)	占总份额比例
1	中国人寿保险(集团)公司	174,719,744.00	1.11%
2	大成基金管理有限公司	69,551,256.00	0.44%
3	中技国际招标公司	19,866,906.00	0.13%
4	CITIGROUPGLOBALMARKETSLIMITED	17,570,577.00	0.11%
5	国信–中行–国信"金理财"经典组合基金集合资产管理计划	12,075,776.00	0.08%
6	信诚人寿保险有限公司	11,097,989.00	0.07%
7	泰康人寿保险股份有限公司–传统–普通保险产品–019L–CT001深	11,077,542.00	0.07%
8	湘财证券有限责任公司	11,056,706.00	0.07%
9	泰康人寿保险股份有限公司–分红–个人分红–019L–FH002深	9,823,439.00	0.06%
10	金盛人寿保险有限公司	5,726,360.00	0.04%

注:本基金管理人大成基金管理有限公司场外持有本基金份额为1,136,733.47份,基金管理人合计持有份额为70,687,989.47份。

四、期末基金管理公司从业人员投资开放式基金的情况

无。

第九节 开放式基金份额变动

单位:份

期初基金份额总额	18,661,889,584.94
加:本期申购份额	305,659,508.47
减:本期赎回份额	3,262,176,741.31
期末基金份额总额	15,705,372,352.10

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情况

二、基金管理人、基金托管人的基金托管部门的重大人事变动情况

(一)因工作需要,大成基金管理有限公司增聘倪明先生为大成创新成长混合型证券投资基金(LOF)基金经理,与王维刚先生共同管理大成创新成长混合型证券投资基金。该变更事项已于2008年1月12日公开披露。

(二)经大成基金管理有限公司第三届董事会第六次会议审议批准,决定聘请刘彩晖女士担任公司副总经理。刘彩晖女士的高级管理人员任职资格和公司副总经理的任职事项已获中国证券监督管理委员会核准(证监许可[2008]718号文)。并于2008年5月28日公开披露。

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无重大改变。

五、本报告期本基金无收益分配事项。

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,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、本报告期本基金管理人、托管人及高级管理人员未受到监管部门稽查或处罚。

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席位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
招商证券	1	1,588,371,359.01	6.65%	1,350,109.04	6.72%
平安证券	1	4,265,172,782.67	17.85%	3,625,342.13	18.05%
国泰君安	1	72,674,580.55	0.30%	59,048.32	0.29%
海通证券	1	2,861,087,044.53	11.98%	2,324,651.78	11.58%
兴业证券	1	3,695,082,879.28	15.47%	3,140,809.06	15.64%
申银万国	1	6,273,277,934.48	26.26%	5,332,275.32	26.55%
中信建投	2	3,188,126,530.54	13.35%	2,668,530.83	13.29%
银河证券	1	1,945,674,878.91	8.14%	1,580,874.10	7.87%
合计	9	23,889,467,989.97	100.00%	20,081,640.58	100.00%

(二)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
招商证券	9,500,696.00	17.59%	0.00	0.00%
海通证券	1,928,820.00	3.57%	0.00	0.00%
兴业证券	6,849,298.60	12.68%	0.00	0.00%
申银万国	1,967,284.00	3.64%	0.00	0.00%
中信建投	33,779,666.80	62.53%	0.00	0.00%
合计	54,025,765.40	100.00%	0.00	0.00%

(三)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
招商证券	6,719,886.26	24.46%
申银万国	1,089,038.09	3.96%
中信建投	19,666,318.16	71.58%
合计	27,475,242.51	100.00%

(四)本报告期内租用交易单元变更情况

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关于调整基金经理的公告	证券时报、中国证券报、上海证券报	2008年1月12日
2	大成基金管理有限公司增加信泰证券有限责任公司为基金代销机构的公告	证券时报、中国证券报、上海证券报	2008年1月24日
3	大成基金管理有限公司关于旗下基金申购中煤能源A股的公告	证券时报、中国证券报、上海证券报	2008年1月31日
4	大成基金管理公司关于在中信万通证券股份有限公司开通基金"定期定额投资计划"的公告	证券时报、中国证券报、上海证券报	2008年2月1日
5	关于大成创新成长混合型证券投资基金暂停申购和定期定额投资业务的提示性公告	证券时报、中国证券报、上海证券报	2008年2月2日
6	大成基金管理有限公司关于在上海浦东发展银行股份有限公司开通基金"定期定额投资计划"的公告	证券时报、中国证券报、上海证券报	2008年2月22日
7	关于大成创新成长混合型证券投资基金暂停申购和定期定额投资业务的提示性公告	证券时报、中国证券报、上海证券报	2008年3月1日
8	关于大成创新成长混合型证券投资基金重新开放申购和定期定额投资业务的公告	证券时报、中国证券报、上海证券报	2008年3月5日
9	大成基金管理有限公司关于在中国工商银行开通基金"定期定投投资计划"的公告	证券时报、中国证券报、上海证券报	2008年3月20日
10	关于大成景阳、大成创新在交通银行开通"定期定额投资计划"的公告	证券时报、中国证券报、上海证券报	2008年5月6日
11	关于市场上出现冒用大成基金管理有限公司名义进行非法证券活动的特别提示	证券时报、中国证券报、上海证券报	2008年5月8日
12	大成基金管理有限公司关于暂停直销网上交易业务的提示	证券时报、中国证券报、上海证券报	2008年5月9日
13	大成基金管理有限公司关于聘任副总经理的公告	证券时报、中国证券报、上海证券报	2008年5月28日
14	大成基金管理有限公司联系地震灾区持有人的公告	证券时报、中国证券报、上海证券报	2008年5月29日
15	大成基金旗下部分基金通过中国银行开办定期定额投资及网上银行交易费率优惠的公告	证券时报、中国证券报和上海证券报	2008年6月17日

大成基金管理有限公司
二〇〇八年八月二十五日