大成蓝筹稳健证券投资基金 2008年半年度报告摘要

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。

基金托管人中国银行股份有限公司银行根据本基金合同规定，于2008年8月19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：	大成蓝筹稳健基金
2、基金交易代码：	090003
3、基金运作方式：	契约型开放式
4、基金合同生效日：	2004年6月3日
5、报告期末基金份额总额：	21,406,546,307.69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：	无
8、上市日期：	无
二、基金产品说明	
1、投资目标：	通过精选符合本基金投资理念、流动性良好的证券，在控制非系统风险的前提下获取投资收益，同时辅助运用一系列数量分析方法，有效控制系统性风险，实现基金资产的中长期稳定增值。
2、投资策略：	本基金资产配置策略利用修正的恒定比例投资组合保险策略（CPPI）来动态调整基金中股票、债券和现金的配置比例；行业配置采取较为积极的策略，以投资基准的行业权重为基础，以行业研究及比较分析为核心，通过适时增大或降低相应行业的投资权重，使整体投资表现跟上或超越投资基准；个股选择策略则采用蓝筹成分股优选策略，运用“价值–势头”选股方法，优选出被市场低估并有良好市场表现，处于价值回归阶段的天相280指数成分股投资。
3、业绩比较基准：	天相280指数×70%+中信国债指数×30%
4、风险收益特征：	本基金属于较低风险证券投资基金，适于承受一定风险，追求当期收益和长期资本增值的基金投资人。
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	
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

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6月30日
1	本期利润	–10,432,193,893.81
2	本期利润扣减本期公允价值变动损益后的净额	–5,059,382,297.59
3	加权平均份额本期利润	–0.4744
4	期末可供分配利润	–7,094,825,590.24
5	期末可供分配份额利润	–0.3314
6	期末基金资产净值	14,311,720,717.45
7	期末基金份额净值	0.6686
8	加权平均净值利润率	–52.64%
9	本期份额净值增长率	–41.60%
10	份额累计净值增长率	192.12%

二、基金净值表现

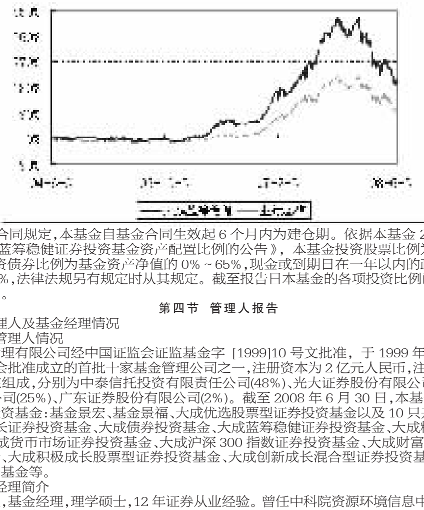
（一）基金历史各时间段净值增长率与同期业绩比较基准收益率比较列表

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	–14.64%	2.26%	–16.14%	2.35%	1.50%	–0.09%
过去3个月	–19.75%	2.44%	–18.45%	2.29%	–1.30%	0.15%
过去6个月	–41.60%	2.49%	–34.65%	2.15%	–6.95%	0.34%
过去1年	–18.75%	2.12%	–15.75%	1.85%	–3.00%	0.27%
过去3年	213.48%	1.76%	136.89%	1.47%	76.59%	0.29%
自基金合同生效起至今	192.12%	1.58%	94.62%	1.37%	97.50%	0.21%

（二）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。

大成蓝筹稳健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

（2004年6月3日至2008年6月30日）



注：按基金合同规定，本基金自基金合同生效起6个月内为建仓期。依据本基金2005年8月31日《关于调整大成蓝筹稳健证券投资基金资产配置比例的公告》，本基金投资股票比例为基金资产净值的30%~95%，投资债券比例为基金资产净值的0%~65%，现金或到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的5%，法律法规另有规定时从其规定。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。

第四节 管理人报告

一、基金管理人及基金经理情况

（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）基金经理简介

施永辉先生，基金经理，理学硕士，12年证券从业经验。曾任中科院资源环境信息中心助理研究员，甘肃证券资产管理部研究员，招商证券研发中心高级分析师、总经理助理。2003年加入大成基金管理有限公司，历任公司研究部高级研究员、投资部副总监、大成精选增值混合型证券投资基金经理助理。2006年1月起担任大成蓝筹稳健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》、《大成蓝筹稳健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，大成蓝筹稳健基金的投资范围、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、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

根据各基金合同，目前本基金管理人旗下未有与本基金投资风格相似的其他基金。

（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0.6686元，本报告期份额净值增长率为–41.60%，同期业绩比较基准增长率为–34.65%，低于同期业绩比较基准的表现。

（二）2008年上半年证券市场回顾和基金运作回顾

2008年上半年我国A股经历了历史罕见的深幅下跌，这种下跌既有我国经济增长模式面临调整以及投资者结构中“大小非”问题日益突出的缘故，也有因美国次级债引发的一系列世界经济格局变化的原因。近几个月来，全球经济中“弱美元、高油价、高粮价”也逐渐成为各种市场力量和政治因素的“共识”，这种局面给我国经济的通胀问题以及货币政策的灵活性带来了巨大的挑战。

出于对企业利润下降的担心，我们在2007年报中指出：“2008年将是本基金最困难的一年，结构错综复杂且在一定市场热度下的区域性震荡行情，将是一次板块结构和投资者结构大调整的过程。”对应的投资策略为坚持“单位收益风险最小化”原则下“在不确定性中寻找确定性”。然而，这半年来，我们看到经济与市场环境中的“不确定”因素在增加，而未来发展中“确定性”的事件在减少。更让我们觉得困难的是，在单边快速下跌中我们曾寄予厚望的市场反弹行情直到目前一直没有出现。

反思上半年的投资过程，高仓位以及在金融股上的重仓放大了系统性下跌时的伤害。这种结果除了个人对宏观经济欠缺全面分析能力之外，还在于对新出现的困难估计不足。汶川地震、越南经济出现动荡和油价不断创出新高，不但使得之前的投资判断缺乏存在的基础，也使得投资决策变得困难，从而导致结构调整在6月底前无法如期完成。

（三）2008年下半年证券市场展望和基金投资策略

展望下半年，我们注意到宏观经济正在出现一些积极的变化，特别是CPI指数最近几月有所下降，显示信贷紧缩政策的效用正逐步显现。但投资者情绪方面却让人越来越担心，越来越多的投资者开始讨论宏观经济问题，甚至“CPI”“次贷”“经济崩溃”已经成为大家耳熟能详的话题，“多空较量”中“多方”显得越来越无力，毕竟在经济层面的讨论中，提出问题总比解决问题更加容易。所以我们认为，在基础数据还无法给出确定方向之前，恐慌与担忧难以消除。

而就股市本身而言，由于市场的快速下跌，目前市场正在出现长线的投资机会。以沪深300成分股股价测算，其平均动态市盈率已经不足18倍，如果考虑到大盘股发行、业绩增长等因素，市场整体PE水平的确是处于前所未有的低水平，但市场估值是对经济预期的反映，投资者对于企业盈利的前景分歧正在加大。因此，从积极的一面来看，我们认为股市最困难的时候似乎已经过去，但心理上的痛苦也许才刚刚开始。

投资策略方面，本基金认为在石油价格没有确定回落或我国紧缩政策没有明确放松以前采取谨慎防御的“刺猬策略”，在资产配置上继续增持一年期以下的固定收益品种，控制股票投资比例；战术上继续坚持“单位收益风险最小化、精选个股”，技术上增强个股风险和收益相匹配。基于现有基金规模对资产流动性的要求较高，我们仍将高度关注整个市场的流动性以及对相关板块估值带来的影响。投资目标上，我们认为有相当一部分业绩增长稳定的细分行业龙头企业正在具备长期投资的条件。这些治理结构有持续改善潜力、经营上具备长期成长能力的中小型公司前期投资历史已经证明，这类基于长期回报的投资可以大大改善组合的绩效。

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”）在对大成蓝筹稳健证券投资基金（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。未发现本基金管理人存在损害基金份额持有人利益的行为。

本半年度报告中的财务指标、净值表现、财务会计报告、投资组合报告等内容真实、准确和完整。（注：财务会计报告中的“风险管理”部分未在托管人复核范围内。）

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	816,060,298.69	4,065,728,411.80
结算备付金	15,006,636.28	20,234,426.40
存出保证金	10,875,421.84	7,915,000.71
交易性金融资产	12,868,862,202.81	24,474,614,176.83
其中：股票投资	10,817,044,288.41	23,776,335,246.83
债券投资	2,051,817,914.40	698,278,930.00
资产支持证券投资	0.00	0.00
衍生金融资产	5,844,807.36	131,772,583.07
买入返售金融资产	0.00	0.00
应收证券清算款	892,570,848.13	0.00
应收利息	29,266,986.01	18,314,000.89
应收股利	3,512,152.80	0.00
应收申购款	3,940,444.79	0.00
其他资产	0.00	0.00
资产总计	14,645,939,798.71	28,718,578,599.70
负债		
短期借款	0.00	0.00
交易性金融负债	0.00	0.00
衍生金融负债	0.00	0.00
卖出回购金融资产款	0.00	0.00
应付证券清算款	295,029,432.79	1,136,222,136.38
应付赎回款	3,832,065.33	143,150,641.93
应付管理人报酬	18,863,825.48	34,188,578.55
应付托管费	3,143,970.91	5,698,096.44
应付交易费用	11,841,756.15	11,095,517.93
应交税费	7,200.00	7,200.00
应付利息	0.00	0.00
应付利润	0.00	0.00
其他负债	1,500,830.60	1,460,497.34
负债合计	334,219,081.26	1,331,822,668.57
所有者权益		
实收基金	21,406,546,307.69	23,923,257,095.95
未分配利润	–7,094,825,590.24	3,463,498,835.18
所有者权益合计	14,311,720,717.45	27,386,755,931.13
负债及所有者权益总计	14,645,939,798.71	28,718,578,599.70
基金份额总额(份)	21,406,546,307.69	23,923,257,095.95
基金份额净值	0.6686	1.1448

所附附注为本会计报表的组成部分

（二）2008年1月1日至6月30日止期间利润表

	2008年1月1日至6月30日	2007年1月1日至6月30日
一、收入	–10,150,787,839.40	316,213,075.13
1、利息收入	20,030,599.44	243,866.17
其中：存款利息收入	5,364,346.00	243,523.99
债券利息收入	14,600,022.07	342.18
资产支持证券利息收入	0.00	0.00
买入返售金融资产收入	66,231.37	0.00
2、投资收益（损失以"–"填列）	–4,801,702,657.57	288,331,336.68
其中：股票投资收益	–4,869,647,181.38	283,713,105.27
债券投资收益	–842,493.06	409,364.32
资产支持证券投资收益	0.00	0.00
衍生工具收益	–30,762,298.16	393,597.88
股利收益	99,549,315.03	3,815,269.21
3、公允价值变动损益（损失以"–"填列）	–5,372,811,596.22	27,214,080.96
4、其他收入（损失以"–"填列）	3,695,814.95	423,791.32
二、费用	281,406,054.41	13,373,715.37
1、管理人报酬	148,578,049.14	4,870,874.12
2、托管费	24,763,008.20	811,812.35
3、销售服务费	0.00	0.00
4、交易费用	107,738,734.36	7,507,911.19
5、利息支出	75,905.90	0.00
其中：卖出回购金融资产支出	75,905.90	0.00
6、其他费用	250,356.81	183,117.71
三、利润总额	–10,432,193,893.81	302,839,359.76

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6月30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)	23,923,257,095.95	3,463,498,835.18	27,386,755,931.13
本期经营活动产生的基金净值变动数(本期净利润)	0.00	–10,432,193,893.81	–10,432,193,893.81
本期基金份额交易产生的基金净值变动数	–2,516,710,788.26	–126,130,531.61	–2,642,841,319.87
其中：基金申购款	476,519,904.13	–83,216,747.46	393,303,156.67
基金赎回款	–2,993,230,692.39	–42,913,784.15	–3,036,144,476.54
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
期末所有者权益(基金净值)	21,406,546,307.69	–7,094,825,590.24	14,311,720,717.45
	2007年1月1日至6月30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)	316,822,365.84	213,613,826.06	530,436,191.90
本期经营活动产生的基金净值变动数(本期净利润)	0.00	302,839,359.76	302,839,359.76
本期基金份额交易产生的基金净值变动数	142,987,205.81	158,638,977.25	301,626,183.06
其中：基金申购款	351,172,817.03	355,354,874.24	706,527,691.27
基金赎回款	–208,185,611.22	–196,715,896.99	–404,901,508.21
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	–118,361,445.18	–118,361,445.18
期末所有者权益(基金净值)	459,809,571.65	556,730,717.89	1,016,540,289.54

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1月1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）、资产负债表日后事项

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。

（四）、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	基金管理人、注册登记机构、基金销售机构
中国银行股份有限公司(“中国银行”)	基金托管人、基金代销机构
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”)①	基金管理人的股东
中国银河证券股份有限公司(“银河证券”)①	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”)②	基金管理人的股东、基金代销机构
中泰信托投资有限责任公司(“中泰信托”)③	基金管理人的股东

①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。

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。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。

③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，该部分股权于2008年7月2日由北京市高级人民法院裁定解除冻结。

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

	2008年1月1日至2008年6月30日		2007年1月1日至2007年6月30日	
银河证券：	成交量	占上半年成交量的比例	成交量	占上半年成交量的比例
买卖股票	6,317,465,667.31	20.69%	0.00	0.00%
买卖债券	25,321,723.40	29.39%	0.00	0.00%
买卖权证	25,652,249.61	51.22%	0.00	0.00%
光大证券：				
买卖股票	3,376,569,378.63	11.06%	0.00	0.00%
买卖债券	29,455,116.50	34.19%	0.00	0.00%
买卖权证	8,040,250.79	16.05%	0.00	0.00%
	佣金	占上半年佣金总量的比例	佣金	占上半年佣金总量的比例
银河证券	5,369,807.15	20.98%	0.00	0.00%
光大证券	2,870,080.00	11.21%	0.00	0.00%

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的证管费、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、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1.5%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 1.5% / 当年天数。

本基金在2008年上半年需支付基金管理人报酬148,578,049.14元，其中已支付基金管理人人民币129,714,223.66元，尚余人民币18,863,825.48元未支付。(2007年上半年：4,870,874.12元)。

4、基金托管费

支付基金托管人中国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2008年上半年需支付基金托管费24,763,008.20元，其中已支付基金托管人人民币21,619,037.29元，尚余人民币3,143,970.91元未支付。(2007年上半年：811,812.35元)。

5、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2008年6月30日保管的银行存款余额为816,060,298.69元(2007年6月30日：95,115,560.66元)。上半年由基金托管人保管的银行存款产生的利息收入为5,122,285.93元(2007年上半年：221,589.97元)。

（五）、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)
002242	九阳股份	08/05/20	08/08/28	新股网下申购	22.54	40.44	47,488	1,070,379.52	1,920,414.72
002257	立立电子	08/06/30	未知	新股网上申购	21.81	21.81	27,000	588,870.00	588,870.00
002258	利尔化学	08/06/30	08/07/08	新股网上申购	16.06	16.06	28,500	457,710.00	457,710.00
000043	中航地产	07/09/24	08/09/26	定向增发	24.00	9.20	2,000,000	48,000,000.00	18,400,000.00
合计								50,116,959.52	21,366,994.72

(2)截至2008年6月30日，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	复牌日期	停牌原因	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	未知	公告重大事项	未知	65,496,911	1,217,513,023.17	959,529,746.15
000792	盐湖钾肥	08/06/26	88.12	未知	公告重大事项	未知	4,700,000	387,933,594.65	414,164,000.00
合计								1,605,446,617.82	1,373,693,746.15

2、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，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(元)	期末估值单价(元)	认购数量(张)	期末成本总额(元)	期末估值总额(元)
网下认购								
126016	08宝钢债	08/06/25	08/07/04	77.60	75.08	305,180.00	23,681,947.80	22,912,914.40

3、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获得送配权证，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(元)	期末估值单价(元)	送配数量(份)	期末成本总额(元)	期末估值总额(元)
网下认购								
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

（六）、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（六）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净值的30%–95%，债券投资比例为基金资产净值的0–65%，现金或到期日在一年以内的政府债券投资比例不低于基金资产净值的5%。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		2007年12月31日	
	公允价值	占基金资产净值的比例	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	10,817,044,288.41	75.58%	23,776,335,246.83	86.82%
–债券投资	2,051,817,914.40	14.34%	698,278,930.00	2.55%
衍生金融资产				
–权证投资	5,844,807.36	0.04%	131,772,583.07	0.48%
合计	12,874,707,010.17	89.96%	24,606,386,759.90	89.85%

于2008年6月30日，若本基金业绩比较基准的公允价值上升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81,577.59万元（2007年12月31日：157,894.23万元）；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81,577.59万元（2007年12月31日：157,894.23万元）。

(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、存出保证金及债券投资等。本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。

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	816,060,298.69	0.00	0.00	0.00	816,060,298.69
结算备付金	15,006,636.28	0.00	0.00	0.00	15,006,636.28
存出保证金	138,549.12	0.00	0.00	10,736,872.72	10,875,421.84
交易性金融资产	2,028,905,000.00	0.00	22,912,914.40	10,817,044,288.41	12,868,862,202.81
衍生金融资产	0.00	0.00	0.00	5,844,807.36	5,844,807.36
应收证券清算款	0.00	0.00	0.00	892,570,848.13	892,570,848.13
应收利息	0.00	0.00	0.00	29,266,986.01	29,266,986.01
应收股利	0.00	0.00	0.00	3,512,152.80	3,512,152.80
应收申购款	0.00	0.00	0.00	3,940,444.79	3,940,444.79
资产总计	2,860,110,484.09	0.00	22,912,914.40	11,762,916,400.22	14,645,939,798.71
负债					
应付证券清算款	0.00	0.00	0.00	295,029,432.79	295,029,432.79
应付赎回款	0.00	0.00	0.00	3,832,065.33	3,832,065.33
应付管理人报酬	0.00	0.00	0.00	18,863,825.48	18,863,825.48
应付托管费	0.00	0.00	0.00	3,143,970.91	3,143,970.91
应付交易费用	0.00	0.00	0.00	11,841,756.15	11,841,756.15
应交税费	0.00	0.00	0.00	7,200.00	7,200.00
其他负债	0.00	0.00	0.00	1,500,830.60	1,500,830.60
负债总计	0.00	0.00	0.00	334,219,081.26	334,219,081.26
利率敏感度缺口	2,860,110,484.09	0.00	22,912,914.40	11,428,697,318.96	14,311,720,717.45
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	4,065,728,411.80	0.00	0.00	0.00	4,065,728,411.80
结算备付金	20,234,426.40	0.00	0.00	0.00	20,234,426.40
存出保证金	138,549.12	0.00	0.00	7,776,451.59	7,915,000.71
交易性金融资产	680,950,000.00	0.00	17,328,930.00	23,776,335,246.83	24,474,614,176.83
衍生金融资产	0.00	0.00	0.00	131,772,583.07	131,772,583.07
应收利息	0.00	0.00	0.00	18,314,000.89	18,314,000.89
资产总计	4,767,051,387.32		17,328,930.00	23,934,198,282.38	28,718,578,599.70
负债					
应付证券清算款	0.00	0.00	0.00	1,136,222,136.38	1,136,222,136.38
应付赎回款	0.00	0.00	0.00	143,150,641.93	143,150,641.93
应付管理人报酬	0.00	0.00	0.00	34,188,578.55	34,188,578.55
应付托管费	0.00	0.00	0.00	5,698,096.44	5,698,096.44
应付交易费用	0.00	0.00	0.00	11,095,517.93	11,095,517.93
应交税费	0.00	0.00	0.00	7,200.00	7,200.00
其他负债	0.00	0.00	0.00	1,460,497.34	1,460,497.34
负债总计	0.00	0.00	0.00	1,331,822,668.57	1,331,822,668.57
利率敏感度缺口	4,767,051,387.32	0.00	17,328,930.00	22,602,375,613.81	27,386,755,931.13

于2008年6月30日，若市场利率下降25个基点且其他市场变量保持不变，本基金资产净值将相应增加约328.19万元；反之，若市场利率上升25个基点且其他市场变量保持不变，本基金资产净值则将相应下降326.34万元。（2007年12月31日：交易性债券投资公允价值占基金资产的比例低于5%，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。

（七）2007年首次执行企业会计准则

本报告中2007年1月1日至2007年6月30日止期间的相关财务数字已按照《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，并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1月1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：

	2007年年初所有者权益	2007年上半年净损益	2007年上半年末所有者权益
按原会计准则列报的金额	530,436,191.90	275,625,278.80	1,016,540,289.54
金融资产公允价值变动的调整数	0.00	27,214,080.96	0.00
按新会计准则列报的金额	530,436,191.90	302,839,359.76	1,016,540,289.54

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。

（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
股票	10,817,044,288.41	73.86%
债券	2,051,817,914.40	14.01%
权证	5,844,807.36	0.04%
资产支持证券	0.00	0.00%
银行存款和清算备付金合计	831,066,934.97	5.67%
其他资产	940,165,853.57	6.42%
合计	14,645,939,798.71	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）	占基金资产净值比例
A农、林、牧、渔业	95,996,794.63	0.67%
B采掘业	1,010,877,254.12	7.06%
C制造业	4,738,940,800.45	33.11%
C0食品、饮料	1,219,180,892.16	8.52%
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	1,279,447,056.09	8.94%
C5电子	105,957,870.00	0.74%
C6金属、非金属	756,154,644.10	5.28%
C7机械、设备、仪表	477,829,083.58	3.34%
C8医药、生物制品	824,919,351.26	5.76%
C99其他制造业	75,451,903.26	0.53%
D电力、煤气及水的生产和供应业	959,529,746.15	6.70%
E建筑业	0.00	0.00%
F交通运输、仓储业	596,506,000.00	4.17%
G信息技术业	31,028,900.00	0.22%
H批发和零售贸易	406,471,963.44	2.84%
I金融、保险业	2,375,185,957.65	16.60%
J房地产业	216,240,000.00	1.51%
K社会服务业	367,866,871.97	2.57%
L传播与文化产业	0.00	0.00%
M综合类	18,400,000.00	0.13%
合计	10,817,044,288.41	75.58%

三、报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的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)	公允价值占净值比
1	600900	长江电力	65,496,911	959,529,746.15	6.70%
2	600036	招商银行	37,000,000	866,540,000.00	6.05%
3	601398	工商银行	173,500,000	860,560,000.00	6.01%
4	600596	新安股份	7,768,267	469,514,057.48	3.28%
5	600583	海油工程	20,423,868	445,036,083.72	3.11%
6	000792	盐湖钾肥	4,700,000	414,164,000.00	2.89%
7	600519	贵州茅台	2,812,537	389,761,377.46	2.72%
8	600428	中远航运	14,700,000	377,496,000.00	2.64%
9	600005	武钢股份	37,439,628	365,410,769.28	2.55%
10	000568	泸州老窖	10,643,790	320,271,641.10	2.24%

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

（一）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	600036	招商银行	770,027,418.97	2.81%
2	601939	建设银行	727,322,257.60	2.66%
3	600900	长江电力	702,316,837.21	2.56%
4	600050	中国联通	630,141,397.48	2.30%
5	000002	万科A	619,020,893.74	2.26%
6	600309	烟台万华	517,511,833.17	1.89%
7	600519	贵州茅台	456,013,279.09	1.67%
8	000792	盐湖钾肥	401,003,820.30	1.46%
9	601318	中国平安	383,427,997.47	1.40%
10	600596	新安股份	380,088,088.21	1.39%
11	600028	中国石化	364,773,131.07	1.33%
12	000568	泸州老窖	326,055,024.40	1.19%
13	601398	工商银行	302,948,046.89	1.11%
14	000061	农产品	292,499,568.88	1.07%
15	000983	西山煤电	287,801,018.65	1.05%
16	601666	平煤天安	285,079,613.44	1.04%
17	000069	华侨城A	282,682,723.01	1.03%
18	600583	海油工程	280,351,738.33	1.02%
19	600196	复星医药	254,712,174.11	0.93%
20	600048	保利地产	249,013,442.77	0.91%

（二）本报告期内累计卖出价值超出期初基金资产净值2%或前二十名的股票明细

序号	股票代码	股票名称	累计卖出金额(元)	占期初基金资产净值比例
1	601318	中国平安	1,097,245,425.95	4.01%
2	000002	万科A	981,092,946.88	3.58%
3	600030	中信证券	967,608,789.89	3.53%
4	601628	中国人寿	775,344,444.08	2.83%
5	600036	招商银行	622,108,325.27	2.27%
6	600019	宝钢股份	581,476,609.23	2.12%
7	601939	建设银行	497,752,534.67	1.82%
8	601328	交通银行	465,764,550.02	1.70%
9	600050	中国联通	459,056,726.28	1.68%
10	600028	中国石化	411,322,451.57	1.50%
11	000858	五粮液	378,698,566.48	1.38%
12	601088	中国神华	369,121,368.00	1.35%
13	600519	贵州茅台	363,705,299.05	1.33%
14	601398	工商银行	311,763,857.71	1.14%
15	000422	湖北宜化	287,759,880.54	1.05%
16	600048	保利地产	276,572,107.56	1.01%
17	600001	邯郸钢铁	270,748,627.70	0.99%
18	002024	苏宁电器	246,691,193.89	0.90%
19	000401	冀东水泥	242,447,703.06	0.89%
20	600660	福耀玻璃	234,626,826.05	0.86%

（三）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	13,980,902,060.93
卖出股票的收入总额	16,701,799,334.24

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	99,980,000.00	0.70%
3	央行票据	1,928,925,000.00	13.48%
4	企业债	22,912,914.40	0.16%
5	可转债	0.00	0.00%
6	其他	0.00	0.00%
	合计	2,051,817,914.4	14.34%

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央票25	528,440,000.00	3.69%
2	07央票133	288,570,000.00	2.02%
3	08央票58	288,240,000.00	2.01%
4	08央票42	198,340,000.00	1.39%
5	08央票34	192,160,000.00	1.34%

七、报告期间本基金投资权证明细

（一）报告期末按公允价值占基金资产净直比例大小排序的所有权证明细

序号	代码	权证名称	数量（份）	公允价值（元）	公允价值占基金净资产比例	获得方式
1	580024	宝钢CWB1	4,882,880	5,844,807.36	0.04%	被动持有

（二）报告期内权证投资情况

权证代码	权证名称	期初数量（份）	期间买入数量（份）	期间买入成本（元）	期间卖出数量（份）	权证卖出收入（元）	期末数量（份）	备注
580016	上汽CWB1	868,860	0	0.00	868,860	11,290,879.20	0	被动持有
580017	赣粤CWB1	0	612,081	2,701,606.58	612,081	5,202,688.50	0	被动持有
580018	中远CWB1	0	819,966	5,318,240.55	819,966	8,205,110.12	0	被动持有
580019	石化CWB1	0	459,853	1,307,674.40	459,853	1,372,857.75	0	被动持有
580020	上港CWB1	0	1,106,343	1,646,982.75	1,106,343	3,086,239.88	0	被动持有
580021	青啤CWB1	0	1,729,840	5,329,288.15	1,729,840	10,871,593.24	0	被动持有
580022	国电CWB1	0	998,203	2,338,367.50	998,203	4,070,429.03	0	被动持有
580023	康美CWB1	0	1,132,940	1,603,795.38	1,132,940	3,969,821.76	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
031006	中兴ZXC1	0	130,550	1,311,638.81	130,550	2,014,606.90	0	被动持有
030002	五粮YCG1	2,602,323	0	0.00	2,602,323	71,115,704.35	0	主动投资

八、报告期末资产支持证券公允价值占基金净资产的比例以及按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券明细

无。

九、投资组合报告附注

（一）报告期内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的，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的。

（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的股票。

（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	10,875,421.84
2	应收证券清算款	892,570,848.13
3	应收利息	29,266,986.01
4	应收申购款	3,940,444.79
5	应收股利	3,512,152.80
	合计	940,165,853.57

（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

无。

（六）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、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	1,076,033户
报告期末平均每户持有的基金份额	19,893.95份

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	21,406,546,307.69	100.00%
其中：机构投资者持有的基金份额	130,908,985.38	0.61%
个人投资者持有的基金份额	21,275,637,322.31	99.39%

三、报告期末基金管理公司从业人员投资开放式基金的情况

项目	期末持有本开放式基金份额的总量(份)	占本基金总份额的比例
基金管理公司持有本基金的所有从业人员	29,502.12	0.00014%

第九节 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日的基金份额总额	2,234,307,480.29
本报告期期初基金份额总额	23,923,257,095.95
加：本报告期期间总申购份额	476,519,904.13
减：本报告期期间总赎回份额	2,993,230,692.39
本报告期期末基金份额总额	21,406,546,307.69

第十节 重大事项揭示

一、本报告期内本基金未召开基金份额持有人大会。

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

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没有重大改变。

五、本基金在本报告期收益分配事项

无。

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。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
渤海证券	1	651,682,153.48	2.13%	529,494.75	2.07%
长江证券	1	1,425,651,982.73	4.67%	1,211,801.49	4.73%
东莞证券	1	1,624,174,381.63	5.32%	1,319,647.71	5.16%
高华证券	1	1,613,518,499.30	5.28%	1,371,483.60	5.36%
光大证券	1	3,376,569,378.63	11.06%	2,870,080.00	11.21%
广州证券	1	1,879,812,320.91	6.16%	1,597,837.60	6.24%
国信证券	1	3,365,162,349.47	11.02%	2,860,354.98	11.17%
国元证券	1	523,479,863.91	1.71%	444,955.33	1.74%
联合证券	1	4,697,893,959.57	15.38%	3,817,073.37	14.91%
银河证券	1	6,317,465,667.31	20.69%	5,369,807.15	20.98%
招商证券	1	2,407,028,722.45	7.88%	2,045,963.97	7.99%
中金公司	1	2,656,789,182.89	8.70%	2,158,659.55	8.44%
合计	12	30,539,228,462.28	100.00%	25,597,159.50	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
光大证券	29,455,116.50	34.19%	0.00	0.00%
银河证券	25,321,723.40	29.39%	0.00	0.00%
招商证券	17,087,580.00	19.84%	0.00	0.00%
广州证券	8,011,240.90	9.30%	0.00	0.00%
东莞证券	6,271,203.60	7.28%	0.00	0.00%
合计	86,146,864.40	100.00%	0.00	0.00%

（三）权证交易量情况

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
银河证券	25,652,249.61	51.22%
长江证券	11,290,879.20	22.54%
光大证券	8,040,250.79	16.05%
广州证券	3,086,239.88	6.16%
东莞证券	2,014,606.90	4.03%
合计	50,084,226.38	100.00%

（四）本报告期内租用交易单元变更情况

本报告期内增加交易单元	本报告期内退租交易单元
国信证券	天一证券
中金公司	
渤海证券	

（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
2	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
3	关于大成蓝筹稳健证券投资基金暂停申购、转入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
4	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
5	大成基金管理有限公司关于旗下部分基金在光大银行开展基金转换业务的公告	证券时报、中国证券报、上海证券报	2008年2月25日
6	关于大成蓝筹稳健证券投资基金暂停申购、转入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
7	关于大成蓝筹稳健证券投资基金重新开放申购、基金转入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
8	大成基金管理有限公司增加安信证券股份有限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3月11日
9	大成基金管理有限公司增加渤海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3月11日
10	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
11	大成基金管理有限公司关于增加中国建设银行股份有限公司为基金代销机构并开通基金定投业务的公告	证券时报、中国证券报、上海证券报	2008年3月21日
12	关于大成基金管理有限公司旗下基金在中国建设银行开通定期定额投资业务有关事项的公告	证券时报、中国证券报、上海证券报	2008年3月22日
13	大成基金管理有限公司关于与招商银行合作开通开放式基金网上直销业务的公告	证券时报、中国证券报、上海证券报	2008年4月2日
14	大成基金增加上海农村商业银行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4月30日
15	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
16	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
17	大成基金公司参与中国建设银行网上银行申购费率优惠的公告	证券时报、中国证券报、上海证券报	2008年5月9日
18	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
19	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
20	大成基金管理有限公司增加湘财证券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6月11日
21	大成基金管理有限公司关于旗下基金申购步步高A股的公告	证券时报、中国证券报、上海证券报	2008年6月13日
22	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