

景业证券投资基金

2006 年年度报告

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

送出日期：2007 年 3 月 30 日

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。

基金托管人中国农业银行根据本基金合同规定，于 2007 年 3 月 26 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。

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。

目 录

第一节 基金简介	1
第二节 主要财务指标和基金净值表现及收益分配情况	2
第三节 管理人报告	4
第四节 托管人报告	6
第五节 审计报告	7
第六节 财务会计报告	7
第七节 投资组合报告	19
第八节 基金份额持有人情况	28
第九节 重大事件揭示	28
第十节 备查文件目录	31

第一节 基金简介

一、基金基本资料

- | | |
|-----------------|------------------|
| 1、基金名称: | 景业证券投资基金 |
| 2、基金简称: | 基金景业 |
| 3、基金交易代码: | 500017 |
| 4、基金运作方式: | 契约型封闭式 |
| 5、基金合同生效日(规范后): | 2000 年 8 月 15 日 |
| 6、报告期末基金份额总额: | 500,000,000 份 |
| 7、基金合同存续期: | 15 年 |
| 8、基金份额上市的证券交易所: | 上海证券交易所 |
| 9、上市日期: | 2001 年 12 月 19 日 |

二、基金产品说明

- | | |
|-----------|--|
| 1、投资目标: | 在优化组合投资基础上,尽可能规避投资风险,谋求基金资产增值和收益的最大化。 |
| 2、投资策略: | 本基金以中长线投资为主,辅以适当的短线操作,并注重投资对象的良好流动性和投资组合的合理分散性。投资对象重点关注具有一定技术含量、成长性良好的新兴产业如信息业、新材料等以及适当关注传统产业成长性良好以及新兴产业转型的企业。 |
| 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、注册地址: | 深圳市福田区深南大道 7088 号招商银行大厦 32 层 |
| 3、办公地址: | 深圳市福田区深南大道 7088 号招商银行大厦 32 层 |
| 4、邮政编码: | 518040 |
| 5、国际互联网址: | http://www.dcfund.com.cn |
| 6、法定代表人: | 胡学光 |
| 7、信息披露负责人: | 杜鹏 |
| 8、联系电话: | 0755-83183388 |
| 9、传真: | 0755-83199588 |
| 10、电子邮箱: | dupeng@dcfund.com.cn |

四、基金托管人

- | | |
|------------|--|
| 1、名称: | 中国农业银行 |
| 2、注册地址: | 北京市海淀区复兴路甲 23 号 |
| 3、办公地址: | 北京市海淀区西三环北路 100 号金玉大厦 |
| 4、邮政编码: | 100036 |
| 5、国际互联网址: | http://www.abchina.com |
| 6、法定代表人: | 杨明生 |
| 7、信息披露负责人: | 李芳菲 |
| 8、联系电话: | 010-68435588 |
| 9、传真: | 010-68424181 |
| 10、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》

登载年度报告正文的管理人互联网网 <http://www.dcfund.com.cn>

址：

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

六、其他有关资料

基金注册登记机构名称：中国证券登记结算有限责任公司上海分公司

基金注册登记机构办公地址：上海市浦东新区陆家嘴东路 166 号中国保险大厦 36 楼

第二节 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、主要财务指标

序号	项目	2006 年	2005 年	2004 年
1	基金本期净收益（元）	295,501,548.54	1,681,312.36	8,943,494.12
2	基金份额本期净收益（元）	0.5910	0.0034	0.0179
3	期末可供分配基金收益（元）	210,863,432.41	-84,638,116.13	-86,319,428.49
4	期末可供分配基金份额收益（元）	0.4217	-0.1693	-0.1726
5	期末基金资产净值（元）	905,851,461.22	453,096,864.41	427,357,700.70
6	期末基金份额净值（元）	1.8117	0.9062	0.8547
7	基金加权平均净值收益率	46.49%	0.39%	2.04%
8	本期基金份额净值增长率	99.92%	6.03%	-1.59%
9	基金份额累计净值增长率	65.84%	-17.05%	-21.76%

二、基金净值表现

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
过去 3 个月	34.04%	2.33%
过去 6 个月	29.05%	2.59%
过去 1 年	99.92%	2.93%
过去 3 年	108.60%	2.47%
过去 5 年	133.08%	2.36%
自基金合同生效起至今	65.84%	2.40%

2、基金合同生效以来基金份额净值的变动情况

基金景业累计份额净值增长率历史走势图

（2000 年 8 月 15 日至 2006 年 12 月 31 日）



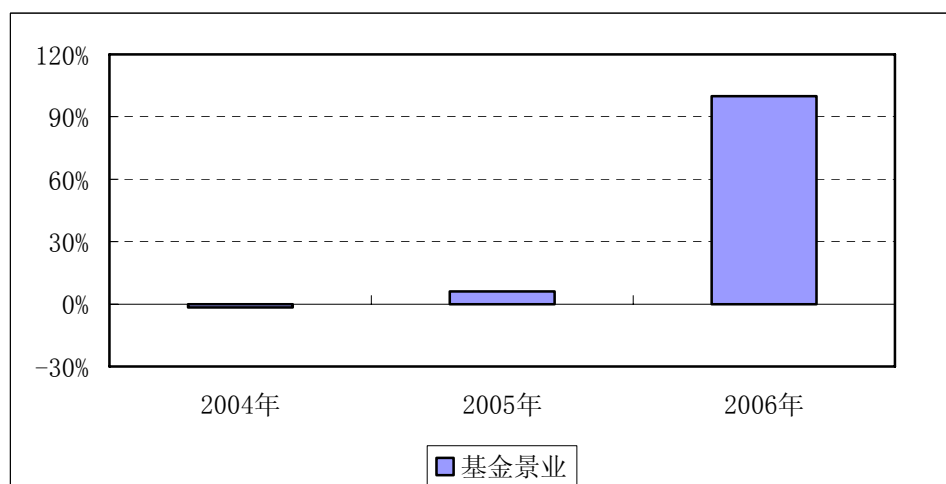
注：(1) 按基金合同规定，本基金自基金上市之日起6个月内为建仓期，截至报告日本基金的各项投资比例已达到基金合同第七条之（五）投资组合中规定的各项比例：本基金投资于股票、债券的比例，不得低于基金资产总值的80%；投资于国家债券的比例，不得低于基金资产净值的20%；持有一家上市公司的股票，不超过基金资产净值的10%。

(2) 2006年12月11日，景业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2006年12月27日证监基金字[2006]263号文核准。自2007年1月16日起，景业证券投资基金在上海证券交易所终止上市，其由《景业证券投资基金基金合同》修订而成的《大成积极成长股票型证券投资基金基金合同》正式生效。

(3) 2006年5月27日，本基金管理人在证券时报发布《大成基金管理有限公司关于基金经理变更的公告》，聘任瞿蕴理女士担任景业证券投资基金经理职务，原基金经理徐彬先生不再担任景业证券投资基金经理职务。

3、本基金过往三年每年的净值增长率：

景业证券投资基金过往三年净值增长率图



三、过往三年每年的基金收益分配情况

年度	每 10 份基金份额分红数	备注
2006 年	4.000 元	分红除权日 2007 年 1 月 11 日
2005 年	无	

2004 年	无	
--------	---	--

第三节 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 2006 年 12 月 31 日,本基金管理人共管理 5 只封闭式证券投资基金:基金景宏、基金景阳、基金景博、基金景福、基金景业,以及 7 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 生命周期基金。

2、基金经理简介

徐彬先生,基金经理,硕士。11 年证券从业经历,曾就职于君安证券研究所,历任大成基金管理公司研究部副经理、基金景博基金经理。2003 年 1 月起担任基金景业基金经理,2006 年 1 月起,兼任基金景福基金经理。

2006 年 5 月 27 日,本基金管理人在证券时报发布《大成基金管理有限公司关于基金经理变更的公告》,聘任瞿蕴理女士担任景业证券投资基金经理职务,原基金经理徐彬先生不再担任景业证券投资基金经理职务。

瞿蕴理女士,基金经理,工学硕士。7 年证券从业经历,曾就职于中兴通讯股份有限公司,大成基金管理有限公司策略分析师、投资决策委员会委员。现同时兼任大成财富管理 2020 生命周期证券投资基金基金经理。2006 年 5 月起担任景业证券投资基金基金经理。

二、基金运作合规守信情况说明

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》、《景业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,基金景业的投资范围、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、2006 年市场回顾和运作情况

2006 年迎来了中国证券史上不可多得的一年。上证综指涨幅达到 130.34%,取得全球涨幅之最;股市规模大幅度扩张,沪深两市总市值已经突破 10 万亿元。长期以来困扰中国股市健康发展的“股权分置”问题基本得以行之有效的解决,股市进入全流通时代,上市公司的价值开始以市值来衡量;股权激励政策的推出将上市公司管理层与经营绩效挂钩,这将有

效的刺激公司的经营治理和业绩的释放。

经济的内生增长以及大量贸易顺差使得资金流动性过剩问题显得越来越突出，给资本市场带来的强劲的资金供给底线。人民币长期升值以及强劲的中国经济增长更使得全球资金增持中国，全球最大 IPO 的工行实现 A+H 同步上市标志着中国资本市场进入一个崭新的蓝筹时代。监管机构不断加强监督上市公司的有关行为，大力组织清理大股东侵占上市公司资产，为 A 股市场的带来良好的治理环境，切实保障了小股东的实际利益。

报告期末本基金已成功转型，转型过程中得到了持有人大会的全票通过。基金景业尽管受制于重仓股长期停牌等因素的干扰，仍旧取得了较为良好的业绩。以绩优成长股为核心持股风格，以食品饮料、商业零售、银行证券、地产等为核心持仓，并配置了军工、有色、机械等行业的股票。

2、2007 年市场展望和投资策略

我们认为 2007 年股市的基础仍旧较好，宏观经济稳健高速发展，人民币升值大趋势不变，资金流动性过剩问题难以一时解决，因此市场仍旧存在较多机会。

在乐观期待中国股市 2007 年向好的同时，我们也有必要看到潜在的风险，股市的上涨会引发一系列的融资和套现行为，包括大量 IPO 上市、定向以及不定向增发股份，以及股改之后的“大小非”流通，这些因素都将改变市场资金和筹码的供求关系。另一方面，考虑到涨幅较大和估值水平提高较多的情况下，可能引发短期获利筹码的流失。股指期货的行将推出将也会在初期增加市场的波动性。因此，我们认为 2007 年的预期收益不能过分提高，仍旧要将眼光放得较为长远，等待长期收益较为合适。

在选股的时机上，我们继续秉承一贯的价值投资理念，寻找具备价值低估、长期发展前景良好的股票作为持股品种，而不会跟随市场一时的概念题材随意转动。不断平衡收益和风险之间的关系管理，争取长时间为股市创造回报。

四、内部监察工作报告

本报告期内，依据相关的法律法规、基金合同以及内部监察稽核制度，本基金管理人对基金运作、内部管理、制度执行及遵规守法情况进行了监察稽核。内部监察稽核的重点是：国家法律法规及行业监管规则的执行情况；基金合同的遵守情况；内部规章制度的执行情况；资讯管制和保密工作落实情况；员工职业操守规范情况，目的是规范基金财产的运作，防范和控制投资风险，确保经营业务的稳健运行和受托资产的安全完整，维护基金份额持有人的合法权益。

1、根据最新的法律法规、规章、规范性文件、证券市场出现的与基金运作相关的新事物以及实践中产生的新问题，我公司及时制定了相应的制度，并对以前的制度进行不断修订和完善，确保公司内控制度的适时性、全面性和合法合规性。2006 年以来，我公司根据新业务发展需要制定了《流通受限证券投资管理制度》、《投资流通受限证券流动性风险处置预案》、《权证投资操作细则》、《资产支持证券投资操作细则》等制度，并根据制度执行与评估存在的问题，进一步修改完善了《股票投资操作细则》、《股票投资限制表制度》、《基金投资关联交易管理制度》等制度。

2、全面加强风险监控，不断提高风险管理水平。2006 年，公司进一步细化了各部门风险监控点，并在各部门定期自查的基础上，公司监察稽核部根据《季度监察稽核项目表》和《公司各部门内部监察稽核明细表》，对公司各部门进行认真复查，并对研究报告、投资决策、投资指令、交易执行和基金销售、运营、客户服务等关键业务方面进行了重点复查。同时，公司各部门针对监察稽核部提出的风险隐患，全面进行落实改进，从而较好地杜绝了各种可能违反基金合同及法律法规行为的发生。

3、不断加强风险控制手段，提高监察稽核效率。一方面，公司充分利用信息技术系统，将法律、法规和公司规定的各种投资禁止、投资限制措施和量化监控指标在投资管理软件系统中进行阈值设置，出现超出阈值的情况，系统将及时报警并拒绝执行指令。这些技术手段的使用将风险的事前防控定型化、客观化、流程化，从而有效控制了风险，提高了监察稽核效率。另一方面，公司继续加强数量化风险控制的开发与投入，提高基金投资的决策效率和风险管理能力。2006 年，我公司对自主开发的大成 VaR 风险管理系统等进行了全面改造。目前，该系统已逐步成为各基金经理小组基金投资组合风险管理的主要工具之一。此外，公司还加强与境外先进资产管理机构的学习，引进境外科学的风险控制措施和手段，提高风险控制水平。

4、严格按照中国证监会对反商业贿赂的工作部署要求，积极开展了治理商业贿赂工作。根据中国证监会有关《通知》的精神和要求，我公司开展了治理商业贿赂的一系列工作，如成立了治理商业贿赂工作领导小组及办事机构；制定了《防止不正当交易及商业贿赂内部控制制度》；设立了举报电话和举报信箱等等，并组织公司全体员工进行了相关反商业贿赂的有关培训，对各种商业贿赂行为的样态进行了全面的分析，使大家认识到了商业贿赂的严重后果，较好地杜绝了商业贿赂现象的产生。

5、努力培育全员风险管理文化。首先，开展多种形式的法律培训，使员工对规范基金业务的法律规定有深刻的理解，约束日常工作行为。如新员工入职培训中有专门的法律培训，就基金销售、基金投资、基金公司运作等法律法规给大家进行详细的讲解，并组织大家进行考试。其次，及时向全公司传达与基金相关的法律法规，供大家学习并要求大家将其贯彻到日常工作中。第三，监察稽核部认真解答各业务部门提出的法律问题，并尽力提供法律依据，对于疑难问题向公司的外部律师咨询或者直接向证监会或者交易所请示，避免了基金业务中的盲目性，防范了可能发生的投诉及诉讼风险，维护了基金份额持有人的利益及公司形象，从而也有利于大家逐步树立合法合规的经营意识，培育全员的风险管理文化。

在本报告期内，本基金管理人运用基金财产进行投资严格按照招募说明书所披露的投资决策程序进行，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以及有损基金投资人利益的关联交易，亦无任何员工发生违法违规行为。

第四节 托管人报告

本基金托管人—中国农业银行根据《景业证券投资基金基金合同》和《景业证券投资基金托管协议》，在托管景业证券投资基金的过程中，严格遵守《证券投资基金法》及各项法规规定，对景业证券投资基金管理人—大成基金管理有限公司 2006 年 1 月 1 日至 2006 年 12 月 31 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，景业基金管理人在景业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。

信息披露符合《证券投资基金信息披露管理办法》及其相关法规的规定，基金管理人所编制和披露的景业证券投资基金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 3 月 26 日

第五节 审计报告

普华永道中天审字(2007)第 20260 号

景业证券投资基金全体基金份额持有人：

我们审计了后附的景业证券投资基金(以下简称“基金景业”) 2006 年 12 月 31 日的资产负债表及 2006 年度的经营业绩表和基金净值变动表。

一、管理层对会计报表的责任

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》、《景业证券投资基金基金合同》及中国证券监督管理委员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会计报表是基金景业的基金管理人大成基金管理有限公司管理层的责任。这种责任包括：

(1) 设计、实施和维护与会计报表编制相关的内部控制，以使会计报表不存在由于舞弊或错误而导致的重大错报；

(2) 选择和运用恰当的会计政策；

(3) 作出合理的会计估计。

二、注册会计师的责任

我们的责任是在实施审计工作的基础上对会计报表发表审计意见。我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。中国注册会计师审计准则要求我们遵守职业道德规范，计划和实施审计工作以对会计报表是否不存在重大错报获取合理保证。

审计工作涉及实施审计程序，以获取有关会计报表金额和披露的审计证据。选择的审计程序取决于注册会计师的判断，包括对由于舞弊或错误导致的会计报表重大错报风险的评估。在进行风险评估时，我们考虑与会计报表编制相关的内部控制，以设计恰当的审计程序，但目的并非对内部控制的有效性发表意见。审计工作还包括评价管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计的合理性，以及评价会计报表的总体列报。

我们相信，我们获取的审计证据是充分、适当的，为发表审计意见提供了基础。

三、审计意见

我们认为，上述会计报表已经按照国家颁布的企业会计准则、《金融企业会计制度》、《证券投资基金会计核算办法》、《景业证券投资基金基金合同》及中国证券监督管理委员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，在所有重大方面公允反映了基金景业 2006 年 12 月 31 日的财务状况以及 2006 年度的经营成果和基金净值变动。

普华永道中天
会计师事务所有限公司
中国·上海市
2007 年 1 月 5 日

注册会计师	汪	棣
注册会计师	陈	宇

第六节 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)

1、2006年12月31日资产负债表

	附注	2006年12月31日	2005年12月31日
资产			
银行存款		83,987,512.37	1,469,476.70
清算备付金		5,676,925.98	1,392,377.07
交易保证金	6 (1)	660,000.00	660,000.00
应收证券清算款		0.00	0.00
应收股利		0.00	0.00
应收利息	6 (2)	1,420,682.15	1,106,687.57
应收申购款		0.00	0.00
其他应收款	6 (3)	2,982,097.54	2,982,097.54
股票投资市值		719,189,484.73	350,849,784.69
其中：股票投资成本		524,839,409.79	313,866,985.79
债券投资市值		182,553,559.40	100,281,129.00
其中：债券投资成本		182,456,383.53	99,528,947.36
权证投资		540,778.00	0.00
其中：权证投资成本		0.00	0.00
买入返售证券		0.00	0.00
待摊费用	6 (4)	0.00	0.00
其他资产		0.00	0.00
资产总计		997,011,040.17	458,741,552.57
负债			
应付证券清算款		83,225,607.58	51,496.19
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		1,056,120.70	553,958.05
应付托管费		176,020.14	92,326.36
应付佣金	6 (5)	2,621,726.75	916,876.53
应付利息		0.00	0.00
应付收益		0.00	0.00
未交税金		0.00	0.00
其他应付款	6 (6)	3,770,103.78	3,770,031.03
卖出回购证券款		0.00	0.00
短期借款		0.00	0.00
预提费用	6 (7)	310,000.00	260,000.00
其他负债		0.00	0.00
负债合计		91,159,578.95	5,644,688.16
持有人权益			
实收基金	6 (8)	500,000,000.00	500,000,000.00
未实现利得	6 (9)	194,988,028.81	37,734,980.54
未分配收益		210,863,432.41	-84,638,116.13
持有人权益合计		905,851,461.22	453,096,864.41
负债及持有人权益总计		997,011,040.17	458,741,552.57

基金份额净值		1.8117	0.9062
--------	--	--------	--------

所附附注为本会计报表的组成部分

2、2006年度经营业绩表

	附注	2006年度	2005年度
一、收入		307,421,176.43	9,835,181.28
1、股票差价收入	6(10)	285,063,631.49	-10,793,802.14
2、债券差价收入	6(11)	688,892.36	3,338,473.64
3、权证差价收入	6(12)	8,219,519.23	8,017,650.41
4、债券利息收入		3,908,587.75	2,691,976.17
5、存款利息收入		428,178.50	389,492.62
6、股利收入		9,093,944.46	6,154,321.65
7、买入返售证券收入		0.00	0.00
8、其他收入	6(13)	18,422.64	37,068.93
二、费用		11,919,627.89	8,153,868.92
1、基金管理人报酬		9,417,876.86	6,398,968.97
2、基金托管费		1,570,668.69	1,066,579.61
3、卖出回购证券支出		463,936.44	230,043.99
4、利息支出		0.00	0.00
5、其他费用	6(14)	467,145.90	458,276.35
其中：上市年费		60,000.00	60,000.00
信息披露费		300,000.00	300,000.00
审计费用		60,000.00	60,000.00
三、基金净收益		295,501,548.54	1,681,312.36
加：未实现利得		157,253,048.27	24,057,851.35
四、基金经营业绩		452,754,596.81	25,739,163.71

所附附注为本会计报表的组成部分

3、2006 年度基金收益分配表

	附注	2006年度	2005年度
本期基金净收益		295,501,548.54	1,681,312.36
加：期初基金净收益		-84,638,116.13	-86,319,428.49
加：本期损益平准金		0.00	0.00
可供分配基金净收益		210,863,432.41	-84,638,116.13
减：本期已分配基金净收益		0.00	0.00
期末基金净收益		210,863,432.41	-84,638,116.13

所附附注为本会计报表的组成部分

4、2006 年度基金净值变动表

	附注	2006年度	2005年度
一、期初基金净值		453,096,864.41	427,357,700.70
二、本期经营活动：			
基金净收益		295,501,548.54	1,681,312.36
未实现利得		157,253,048.27	24,057,851.35
经营活动产生的基金净值变动数		452,754,596.81	25,739,163.71
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		0.00	0.00
五、期末基金净值		905,851,461.22	453,096,864.41

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)

附注1. 基金基本情况

景业证券投资基金(以下简称“本基金”)是由原大连农信基金、宁波金穗基金、浙江农信受益债券、沈阳农信收益债券、天津信托投资公司创业基金和郑州豫源基金六只基金(以下简称“原基金”)经两次合并而设立的。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[2000]21号《关于中国农业银行系统原有投资基金清理规范方案的批复》、证监基金字[2000]6号《关于天津市原有投资基金清理规范补充方案的批复》、证监基金字[2000]32号《关于河南省郑州豫源基金清理规范补充方案的批复》批准，原基金进行了规范清理，并于2000年6月19日与2000年8月11日起分两次办理了资产及负债移交手续，基金资产移交基准日分别为2000年6月22日与2000年8月15日。基金管理人更换为大成基金管理有限公司，基金托管人更换为中国农业银行，合并后基金正式更名为景业证券投资基金。本基金为契约型封闭式，存续期为1992年4月1日至2002年3月30日，发起人为大成基金管理有限公司和天津信托投资公司(后更名为“天津信托投资有限责任公司”)，发行规模为372,874,343份基金份额。

经中国证监会证监基金字[2001]27号文批准及上海证券交易所(以下简称“上交所”)上证上字[2001]202号文审核同意，本基金于2001年12月19日在上交所挂牌交易。

本基金于2002年3月8日将基金份额总份额由原372,874,343份基金份额扩募至500,000,000份基金份额，存续期限延长5年至2007年3月30日，扩募部分基金份额于2002年3月25日上市交易。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《景业证券投资基金基金契约》(后更名为《景业证券投资基金基金合同》)的规定，本基金的投资范围为国内依法公开发行、上市的股票、债券及中国证监会允许基金投资的其他金融工具，主要投资对象为深、沪两市上市A股中成长性好、发展前景广阔的上市公司。

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》、《景业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。

根据《景业证券投资基金基金合同》中的规定，本基金存续期至2007年3月30日终止。根据于2006年12月11日召开的本基金基金份额持有人大会中表决通过的《关于景业证券投资基金转型有关事项的议案》，经中国证监会证监基金字[2006]263号《关于核准景业证券投资基金基金份额持有人大会决议的批复》批准，本基金本次基金份额持有人大会的表决结果核

准于现有存续期结束前转型为开放式基金并相应延长存续期至不定期，因此本基金本年度会计报表仍以持续经营假设为编制基础。

(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。

(3) 记帐本位币

本基金的记账本位币为人民币。

(4) 记帐基础和计价原则

本基金的记账基础为权责发生制。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均价估值；估值日无交易的，以最近交易日的市场交易均价估值。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均价估值。

(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均价估值；估值日无交易的，以最近交易日的市场交易均价估值。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均价减去债券均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均价减去债券均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和未上市流通的债券按成本估值。

(iii) 权证投资

从获赠确认日起到卖出日或行权日止，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均价估值；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，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。

(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时冲减股票投资成本。

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，权证投资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于卖出成交日确认；银行间同业市场交易的债券差价收入于实际收到全部价款时确认。债券差价收入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。如果由于卖出回购证券和现金分红以外原因造成基金持有现金比例超过基金资产净值的20%，超过部分不计提基金管理人报酬。

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。

卖出回购证券支出按融入资金额及约定利率，在回购期限内采用直线法逐日计提。

(9) 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。

(10) 基金的收益分配政策

每一基金份额享有同等分配权。基金当年收益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。基金收益分配采取现金方式，根据2006年11月13日发布的《大成基金管理有限公司关于修改旗下封闭式基金收益分配条款的公告》，基金收益分配次数由每会计年度分配一次变更为每年度至少分配一次，收益分配比例由不低于基金

净收益的90%变更为不低于基金可分配收益的90%。基金收益分配后，每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持有人权益转出。

(11) 本报告期重大会计差错的内容和更正金额
无。

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]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》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，自2004年1月1日起继续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) 基金买卖股票于2005年1月24日前按照0.2%的税率缴纳股票交易印花税，自2005年1月24日起减按0.1%的税率缴纳。
- (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. 资产负债表日后事项

本基金的基金管理人于2007年1月5日拟定2006年度第一次分红，向截至2007年1月10日止在本基金注册登记机构中国证券登记结算有限责任公司上海分公司登记在册的全体基金份额持有人，按每10份基金份额派发红利4.00元，占年末可分配收益的比例为94.85%。

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、基金发起人
中国农业银行	基金托管人
天津信托投资有限责任公司(“天津信托”)	基金发起人
光大证券股份有限公司(“光大证券”)	基金管理人的股东
中泰信托投资有限责任公司	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2005年6月9日被郑州市中级人民法院冻结，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。广东证券持有的大成基金股权的继承机构尚待明确。

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	2006年度		2005年度	
	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	1,131,832,391.93	13.07%	1,055,118,218.50	25.29%
光大证券	2,186,411,978.01	25.24%	765,604,540.45	18.35%
合计	3,318,244,369.94	38.31%	1,820,722,758.95	43.64%

B 债券买卖

关联方名称	2006年度		2005年度	
	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	53,366,276.60	9.92%	233,688,565.70	41.00%
光大证券	25,484,511.36	4.74%	0.00	0.00%
合计	78,850,787.96	14.66%	233,688,565.70	41.00%

C 债券回购

关联方名称	2006年度		2005年度	
	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	0.00	0.00%	100,000,000.00	19.19%

D 权证买卖

关联方名称	2006年度		2005年度	
	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	16,429,182.43	35.08%	0.00	0.00%
光大证券	7,657,505.32	16.35%	6,592,287.28	82.21%
合计	24,086,687.75	51.43%	6,592,287.28	82.21%

E 佣金

关联方名称	2006年度		2005年度	
	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	927,560.68	13.30%	862,032.25	25.68%
光大证券	1,710,892.23	24.54%	599,092.74	17.85%
合计	2,638,452.91	37.84%	1,461,124.99	43.53%

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) 与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易

本基金在本年度与基金托管人中国农业银行通过银行间同业市场进行的债券交易如下：

	2006年度	2005年度
买入债券结算金额	39,829,400.00	29,886,000.00
卖出回购证券协议金额	0.00	38,800,000.00

卖出回购证券利息支出	0.00	9,487.39
------------	------	----------

(4) 关联方报酬

A 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 1.50% 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 × 1.50% / 当年天数。

本基金在本年度需支付基金管理人报酬 9,417,876.86 元(2005 年：6,398,968.97 元)。

B 基金托管人报酬

支付基金托管人中国农业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 × 0.25% / 当年天数。

本基金在本年度需支付基金托管费 1,570,668.69 元(2005 年：1,066,579.61 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农业银行保管，并按银行间同业利率计息。基金托管人于 2006 年 12 月 31 日保管的银行存款余额为 83,987,512.37 元(2005 年：1,469,476.70 元)。本年度由基金托管人保管的银行存款产生的利息收入为 361,207.85 元(2005 年：339,368.84 元)。

(5) 基金各关联方投资本基金的情况

	2006 年 12 月 31 日		2005 年 12 月 31 日	
	基金份额	净值	基金份额	净值
大成基金	23,408,298.00	42,408,813.49	7,928,035.00	7,184,385.32
天津信托	2,500,000.00	4,529,250.00	2,500,000.00	2,265,500.00

附注6. 基金会计报表重要项目说明

(1) 交易保证金

项目	2006年12月31日	2005年12月31日
深圳结算保证金	500,000.00	500,000.00
权证交易保证金	160,000.00	160,000.00
合计	660,000.00	660,000.00

(2) 应收利息

项目	2006年12月31日	2005年12月31日
应收银行存款利息	11,935.27	3,026.29
应收清算备付金利息	2,554.60	626.60
应收交易保证金利息	72.00	72.00
应收债券利息	1,406,120.28	1,102,962.68
合计	1,420,682.15	1,106,687.57

(3) 其他应收款

项目	2006年12月31日	2005年12月31日
应收合并前原个别基金管理人未支付给受益人的红利(*)	2,895,040.56	2,895,040.56
应收合并前基金管理人的预提合并费用(**)	87,056.98	87,056.98
合计	2,982,097.54	2,982,097.54

* 根据中天信会计师事务所于 2000 年 6 月 22 日为筹建中的本基金第一次合并出具的验资报告, 合并前原个别基金红利受益人未领取的红利占用的资金暂不转入本基金。待原个别基金受益人实际领取红利时, 由原个别基金管理人从尚未划付给本基金的应付红利中支付。截至 2006 年 12 月 31 日止, 应收原天津信托投资有限责任公司创业基金受益人及浙江农信受益债券受益人尚未领取的红利转入天津信托投资有限责任公司及中国银河证券有限责任公司的款项分别为 2,856,131.41 元及 38,909.15 元 (2005 年: 同)

** 根据上述验资报告, 合并前原个别基金于合并基准日前发生的各项费用均在原基金列支。对个别不能及时取得凭证的费用, 采用由原个别基金预提、新基金管理人监督使用的办法。该预提合并费用于 2006 年度无发生额 (2005 年: 同)。本基金将在确认无发生后转销该预提合并费用。

(4) 待摊费用

无。

(5) 应付佣金

券商名称	2006 年 12 月 31 日	2005 年 12 月 31 日
国信证券有限责任公司	1,173,764.21	317,128.57
中信证券股份有限公司	695,403.99	82,836.52
光大证券股份有限公司	408,405.17	131,646.46
东海证券有限责任公司	132,338.60	0.00
中国银河证券有限责任公司	113,311.40	258,187.49
中银国际证券有限责任公司	61,805.20	0.00
蔚深证券有限责任公司	36,698.18	98,759.84
平安证券有限责任公司	0.00	28,317.65
合计	2,621,726.75	916,876.53

(6) 其他应付款

项目	2006 年 12 月 31 日	2005 年 12 月 31 日
应付合并前原个别基金受益人未领取的红利(附注 6.(3)*)	2,895,040.56	2,895,040.56
应付券商席位保证金	500,000.00	500,000.00
应付股利收入的个人所得税	235,358.58	235,358.58
由合并前原基金管理人承担的预提合并费用(附注 6.(3)* *)	87,056.98	87,056.98
应付债券利息收入的个人所得税	1,500.00	1,500.00
其他	51,147.66	51,074.91
合计	3,770,103.78	3,770,031.03

(7) 预提费用

项目	2006 年 12 月 31 日	2005 年 12 月 31 日
信息披露费	200,000.00	100,000.00
审计费用	60,000.00	60,000.00
律师费	50,000.00	100,000.00
合计	310,000.00	260,000.00

(8) 实收基金

	2006 年 12 月 31 日		2005 年 12 月 31 日	
	基金份额	基金面值	基金份额	基金面值
发起人持	5,000,000.00	5,000,000.00	5,000,000.00	5,000,000.00

有基金份额				
- 非流通部分				
发起人持有基金份额				
- 可流通部分	20,908,298.00	20,908,298.00	5,428,035.00	5,428,035.00
社会公众持有基金份额	474,091,702.00	474,091,702.00	489,571,965.00	489,571,965.00
合计	500,000,000.00	500,000,000.00	500,000,000.00	500,000,000.00

根据《景业证券投资基金基金合同》的有关规定，在本基金首次扩募前，全部基金发起人持有基金份额不得低于基金总规模的1%，超出1%的部分在基金上市后即可流通。在本基金首次扩募后的整个存续期内，各基金发起人持有基金份额不得低于基金总规模的0.5%，超出0.5%的部分可在基金扩募部分上市两个月后流通。

(9) 未实现利得

	股票投资的未实现估值增值	债券投资的未实现估值增值	权证投资的未实现估值增值	合计
2005 年 12 月 31 日	36,982,798.90	752,181.64	0.00	37,734,980.54
本年净变动数	157,367,276.04	-655,005.77	540,778.00	157,253,048.27
2006 年 12 月 31 日	194,350,074.94	97,175.87	540,778.00	194,988,028.81

(10) 股票差价收入

项目	2006 年度	2005 年度
卖出股票成交总额	4,376,790,312.16	2,089,982,477.03
减：应付佣金总额	3,664,314.50	1,751,360.19
减：卖出股票成本总额	4,088,062,366.17	2,099,024,918.98
股票差价收入	285,063,631.49	-10,793,802.14

本基金于本年度获得股权分置改革中由非流通股股东支付的现金对价共计 7,001,632.31 元(2005 年：801,117.80 元)，已全额冲减股票投资成本。

(11) 债券差价收入

项目	2006 年度	2005 年度
卖出及到期兑付债券结算金额	389,921,516.06	338,404,088.20
减：应收利息总额	5,395,218.77	4,818,659.62
减：卖出及到期兑付债券成本总额	383,837,404.93	330,246,954.94
债券差价收入	688,892.36	3,338,473.64

(12) 权证差价收入

项目	2006 年度	2005 年度
卖出权证成交金额	28,260,840.71	8,017,650.41
减：卖出权证成本总额	20,041,321.48	0.00
权证差价收入	8,219,519.23	8,017,650.41

(13) 其他收入

项目	2006 年度	2005 年度
新股申购手续费返还	0.00	18,461.87
其他	18,422.64	18,607.06
合计	18,422.64	37,068.93

(14) 其他费用

项目	2006 年度	2005 年度
信息披露费	300,000.00	300,000.00
审计费用	60,000.00	60,000.00
上市年费	60,000.00	60,000.00
交易所回购交易费用	4,441.27	3,156.83
其他	42,704.63	35,119.52
合计	467,145.90	458,276.35

(15) 本报告期已分配基金净收益

无。

附注7. 报告期末流通转让受到限制的基金资产

(1) 本基金截至2006年12月31日止持有以下因股权分置改革而暂时停牌的股票，这些股票将在上市公司完成与流通股股东的沟通协商程序后或在股权分置改革规定的程序结束后复牌。(估值方法：以最近交易日的市场交易均价估值。)

股票代码	股票名称	停牌日期	年末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量	年末成本总额	年末估值总额
方案沟通协商阶段停牌：								
000423	S 阿胶	06/12/04	13.72	未知	未知	1,056,215	12,361,796.31	14,491,269.80
方案实施阶段停牌：								
000895	S 双汇	06/06/01	31.02	未知	未知	1,539,410	26,247,572.71	47,752,498.20
600102	S 莱钢	06/09/20	6.18	07/01/18	未知	1,410,000	8,147,231.95	8,713,800.00
合 计							46,756,600.97	70,957,568.00

(2) 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。(估值方法：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均价估值；首次公开发行但未上市的股票，按成本估值。)

本基金截至2006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	申购价格	期末估值单价	数量	期末成本总额	期末估值总额
002073	青岛软控	06/09/28	07/01/18	26.00	47.28	8,281	215,306.00	391,525.68
600017	日照港	06/09/28	07/01/17	4.70	7.18	48,847	229,580.90	350,721.46
601006	大秦铁路	06/07/26	07/02/01	4.95	8.09	283,860	1,405,107.00	2,296,427.40
601588	北辰实业	06/09/28	07/01/16	2.40	6.74	442,203	1,061,287.20	2,980,448.22
601628	中国人寿	06/12/28	07/04/09	18.88	18.88	149,940	2,830,867.20	2,830,867.20
601988	中国银行	06/06/28	07/01/05	3.08	5.27	589,463	1,815,546.04	3,106,470.01

合 计							7, 557, 694. 34	11, 956, 459. 97
-----	--	--	--	--	--	--	-----------------	------------------

附注8. 其他重要事项
无。

第七节 投资组合报告

一、本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
银行存款和清算备付金合计	89, 664, 438. 35	8. 99%
股票	719, 189, 484. 73	72. 14%
债券	182, 553, 559. 40	18. 31%
权证	540, 778. 00	0. 05%
其他资产	5, 062, 779. 69	0. 51%
合计	997, 011, 040. 17	100. 00%

二、本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	0. 00	0. 00%
B 采掘业	13, 264, 977. 00	1. 46%
C 制造业	360, 131, 853. 98	39. 76%
C0 食品、饮料	94, 099, 315. 48	10. 39%
C1 纺织、服装、皮毛	6, 816, 344. 40	0. 75%
C2 木材、家具	0. 00	0. 00%
C3 造纸、印刷	68, 670, 419. 78	7. 58%
C4 石油、化学、塑胶、塑料	3, 034, 179. 00	0. 33%
C5 电子	0. 00	0. 00%
C6 金属、非金属	67, 452, 384. 00	7. 45%
C7 机械、设备、仪表	87, 309, 136. 12	9. 64%
C8 医药、生物制品	32, 750, 075. 20	3. 62%
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	10, 495, 505. 52	1. 16%
G 信息技术业	52, 383, 444. 40	5. 78%
H 批发和零售贸易	36, 295, 734. 85	4. 01%
I 金融、保险业	160, 734, 862. 51	17. 74%
J 房地产业	59, 576, 729. 66	6. 58%
K 社会服务业	25, 068, 713. 67	2. 77%
L 传播与文化产业	0. 00	0. 00%
M 综合类	1, 237, 663. 14	0. 13%
合计	719, 189, 484. 73	79. 39%

三、本报告期末按市值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

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	600963	岳阳纸业	6,125,818	68,670,419.78	7.58%
2	601398	工商银行	9,863,298	59,475,686.94	6.57%
3	600019	宝钢股份	6,894,200	58,738,584.00	6.48%
4	000002	万 科 A	3,419,152	52,894,281.44	5.84%
5	600030	中信证券	1,811,500	49,399,605.00	5.45%
6	000895	S 双 汇	1,539,410	47,752,498.20	5.27%
7	600718	东软股份	1,958,338	46,608,444.40	5.15%
8	000568	泸州老窖	1,535,796	39,070,650.24	4.31%
9	000625	长安汽车	3,633,035	32,297,681.15	3.57%
10	600036	招商银行	1,815,500	29,465,565.00	3.25%
11	600138	中青旅	1,947,841	25,068,713.67	2.77%
12	000927	一汽夏利	4,467,466	24,437,039.02	2.70%
13	000987	广州友谊	1,247,578	21,271,204.90	2.35%
14	600750	江中药业	1,357,532	18,258,805.40	2.02%
15	600016	民生银行	1,626,153	16,456,668.36	1.82%
16	600104	上海汽车	1,943,234	15,817,924.76	1.75%
17	600327	大厦股份	1,705,395	15,024,529.95	1.66%
18	000423	S 阿 胶	1,056,215	14,491,269.80	1.60%
19	600028	中国石化	1,452,900	13,264,977.00	1.46%
20	600761	安徽合力	486,317	10,908,090.31	1.20%
21	600102	莱钢股份	1,410,000	8,713,800.00	0.96%
22	600439	瑞贝卡	411,615	6,816,344.40	0.75%
23	600887	伊利股份	245,768	6,581,667.04	0.73%
24	600386	北京巴士	681,118	6,041,516.66	0.67%
25	000839	中信国安	250,000	5,775,000.00	0.64%
26	600383	金地集团	200,000	3,702,000.00	0.41%
27	600006	东风汽车	1,070,240	3,456,875.20	0.38%
28	601988	中国银行	589,463	3,106,470.01	0.34%
29	000792	盐湖钾肥	126,900	3,034,179.00	0.34%
30	601588	北辰实业	442,203	2,980,448.22	0.33%
31	601628	中国人寿	149,940	2,830,867.20	0.31%
32	601006	大秦铁路	283,860	2,296,427.40	0.25%
33	601333	广深铁路	252,000	1,806,840.00	0.20%
34	600858	银座股份	61,089	1,237,663.14	0.14%
35	600600	青岛啤酒	50,000	694,500.00	0.08%
36	002073	青岛软控	8,281	391,525.68	0.04%
37	600017	日照港	48,847	350,721.46	0.04%
合计				719,189,484.73	79.39%

四、本报告期股票投资组合的重大变动

1、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	170,236,505.09	37.57%
2	601398	工商银行	128,904,240.32	28.45%
3	000898	鞍钢股份	113,261,359.67	25.00%
4	600028	中国石化	106,516,715.49	23.51%
5	600016	民生银行	101,987,018.91	22.51%
6	000002	万 科 A	88,000,912.85	19.42%
7	600019	宝钢股份	71,367,054.24	15.75%
8	600005	武钢股份	69,919,643.94	15.43%
9	600887	伊利股份	69,900,309.35	15.43%
10	000568	泸州老窖	68,951,098.76	15.22%
11	600009	上海机场	67,689,768.10	14.94%
12	000930	丰原生化	67,286,059.81	14.85%
13	600519	贵州茅台	66,411,875.87	14.66%
14	600900	长江电力	64,241,565.53	14.18%
15	600029	S 南航	61,899,563.54	13.66%
16	000063	中兴通讯	59,080,558.94	13.04%
17	600547	山东黄金	56,577,615.33	12.49%
18	600309	烟台万华	56,087,802.05	12.38%
19	600030	中信证券	55,735,150.24	12.30%
20	000709	唐钢股份	55,636,395.06	12.28%
21	600963	岳阳纸业	54,859,467.79	12.11%
22	000423	S 阿 胶	52,245,593.10	11.53%
23	000839	中信国安	52,033,680.13	11.48%
24	600220	江苏阳光	48,847,723.19	10.78%
25	600739	辽宁成大	47,800,003.33	10.55%
26	000538	云南白药	47,475,768.11	10.48%
27	000024	招商地产	46,829,793.56	10.34%
28	600550	天威保变	45,966,137.46	10.14%
29	600832	东方明珠	45,770,389.19	10.10%
30	000858	五 粮 液	45,367,929.73	10.01%
31	600316	洪都航空	42,689,575.44	9.42%
32	600718	东软股份	41,096,363.24	9.07%
33	000987	广州友谊	40,452,856.35	8.93%
34	000792	盐湖钾肥	38,968,474.23	8.60%
35	000629	新 钢 钒	36,715,622.79	8.10%
36	000623	吉林敖东	35,823,592.10	7.91%
37	600331	宏达股份	35,486,519.29	7.83%
38	000768	西飞国际	35,467,754.07	7.83%
39	000069	华侨城 A	35,027,127.37	7.73%
40	600117	西宁特钢	32,190,204.33	7.10%

41	000869	张 裕 A	31,482,866.19	6.95%
42	600879	火箭股份	31,045,616.68	6.85%
43	600797	浙大网新	28,896,975.75	6.38%
44	000625	长安汽车	28,485,481.53	6.29%
45	600867	通化东宝	27,996,606.62	6.18%
46	000878	云南铜业	27,234,896.74	6.01%
47	600361	华联综超	26,682,226.60	5.89%
48	000895	S 双 汇	26,247,572.71	5.79%
49	601006	大秦铁路	26,222,483.46	5.79%
50	600050	中国联通	25,355,450.00	5.60%
51	600688	S 上石化	23,692,929.88	5.23%
52	600001	邯郸钢铁	23,672,943.41	5.22%
53	000927	一汽夏利	23,568,568.19	5.20%
54	600054	黄山旅游	23,400,658.89	5.16%
55	600296	S 兰 铝	23,197,666.92	5.12%
56	600010	包钢股份	22,819,001.30	5.04%
57	600150	沪东重机	22,518,005.66	4.97%
58	000911	南宁糖业	22,387,896.68	4.94%
59	600258	S 首旅	21,496,906.55	4.74%
60	002008	大族激光	21,244,706.33	4.69%
61	600104	上海汽车	20,680,536.32	4.56%
62	600138	中青旅	20,678,248.10	4.56%
63	600583	海油工程	20,198,895.57	4.46%
64	000050	深天马 A	20,101,937.69	4.44%
65	000012	南 玻 A	19,774,837.59	4.36%
66	600031	三一重工	19,766,436.95	4.36%
67	000617	S 济 柴	19,619,805.97	4.33%
68	600491	龙元建设	19,240,746.24	4.25%
69	000917	电广传媒	19,216,602.92	4.24%
70	000888	峨眉山 A	18,819,251.23	4.15%
71	000807	云铝股份	18,697,635.13	4.13%
72	000825	太钢不锈	17,919,263.38	3.95%
73	600489	中金黄金	17,615,774.74	3.89%
74	600535	天士力	17,283,767.50	3.81%
75	600088	中视传媒	17,273,117.77	3.81%
76	600102	莱钢股份	17,040,682.67	3.76%
77	600211	S 藏药业	17,004,446.90	3.75%
78	600750	江中药业	16,402,024.15	3.62%
79	600694	大商股份	16,210,554.32	3.58%
80	600151	航天机电	16,179,875.40	3.57%
81	600439	瑞贝卡	16,005,844.31	3.53%

82	600303	曙光股份	15,997,504.45	3.53%
83	600585	海螺水泥	15,887,810.10	3.51%
84	000061	农产品	15,820,923.43	3.49%
85	002053	云南盐化	15,775,367.96	3.48%
86	000549	S 湘火炬	15,493,630.42	3.42%
87	000761	本钢板材	15,090,294.67	3.33%
88	600327	大厦股份	15,041,899.77	3.32%
89	000550	江铃汽车	14,283,740.47	3.15%
90	000978	桂林旅游	14,273,143.58	3.15%
91	000758	中色股份	14,162,517.14	3.13%
92	600037	歌华有线	14,056,457.45	3.10%
93	600269	赣粤高速	13,760,172.78	3.04%
94	600048	保利地产	13,030,895.20	2.88%
95	000729	燕京啤酒	12,679,251.88	2.80%
96	600307	酒钢宏兴	12,670,841.66	2.80%
97	002024	苏宁电器	12,143,661.97	2.68%
98	600362	江西铜业	11,971,335.25	2.64%
99	600438	通威股份	11,901,998.32	2.63%
100	600795	国电电力	11,657,892.36	2.57%
101	600011	华能国际	11,402,104.19	2.52%
102	600858	银座股份	11,014,879.11	2.43%
103	000410	沈阳机床	10,973,467.44	2.42%
104	600675	中华企业	10,954,442.61	2.42%
105	000027	深能源 A	10,728,198.96	2.37%
106	600125	铁龙物流	10,457,265.40	2.31%
107	600754	锦江股份	10,406,518.49	2.30%
108	002030	达安基因	10,137,004.98	2.24%
109	600064	南京高科	9,945,189.54	2.19%
110	600330	天通股份	9,644,293.80	2.13%
111	000562	宏源证券	9,398,171.50	2.07%
112	600472	包头铝业	9,344,361.44	2.06%
113	600533	栖霞建设	9,184,968.04	2.03%
114	600084	新天国际	9,082,073.64	2.00%

2、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	600036	招商银行	156,959,727.22	34.64%
2	600028	中国石化	142,910,942.54	31.54%
3	000898	鞍钢股份	119,305,743.07	26.33%
4	600519	贵州茅台	118,501,940.00	26.15%
5	600029	S 南航	105,759,685.11	23.34%
6	000002	万科 A	96,036,663.66	21.20%

7	600887	伊利股份	93,594,817.31	20.66%
8	600016	民生银行	92,919,460.08	20.51%
9	601398	工商银行	92,629,470.24	20.44%
10	000930	丰原生化	74,922,618.54	16.54%
11	600005	武钢股份	72,262,994.92	15.95%
12	000024	招商地产	69,375,202.62	15.31%
13	600009	上海机场	67,470,760.06	14.89%
14	600331	宏达股份	67,014,490.77	14.79%
15	600547	山东黄金	63,202,092.80	13.95%
16	600309	烟台万华	62,478,525.45	13.79%
17	600900	长江电力	62,038,773.06	13.69%
18	000063	中兴通讯	58,659,108.34	12.95%
19	600220	江苏阳光	57,232,388.18	12.63%
20	600316	洪都航空	57,008,167.50	12.58%
21	000568	泸州老窖	55,444,125.41	12.24%
22	000538	云南白药	54,814,224.46	12.10%
23	000709	唐钢股份	52,873,651.96	11.67%
24	000792	盐湖钾肥	51,547,255.17	11.38%
25	000858	五 粮 液	50,620,092.68	11.17%
26	600739	辽宁成大	49,804,097.62	10.99%
27	600832	东方明珠	49,772,694.73	10.99%
28	000839	中信国安	47,803,917.76	10.55%
29	000987	广州友谊	44,429,201.01	9.81%
30	600550	天威保变	43,669,227.04	9.64%
31	600858	银座股份	43,457,318.64	9.59%
32	000911	南宁糖业	42,204,514.12	9.31%
33	000623	吉林敖东	40,865,017.77	9.02%
34	600050	中国联通	40,851,194.16	9.02%
35	600150	沪东重机	40,288,378.37	8.89%
36	600030	中信证券	38,185,364.43	8.43%
37	000423	S 阿 胶	37,488,924.67	8.27%
38	000069	华侨城 A	37,198,335.12	8.21%
39	000768	西飞国际	35,402,868.89	7.81%
40	000629	新 钢 钒	35,040,963.31	7.73%
41	600019	宝钢股份	33,848,956.96	7.47%
42	600867	通化东宝	33,035,251.82	7.29%
43	600117	西宁特钢	32,539,338.55	7.18%
44	000869	张 裕 A	32,015,892.99	7.07%
45	600361	华联综超	31,002,221.06	6.84%
46	002008	大族激光	30,806,115.67	6.80%
47	600797	浙大网新	28,127,276.53	6.21%
48	600879	火箭股份	27,543,565.59	6.08%

49	601006	大秦铁路	25,125,894.54	5.55%
50	600054	黄山旅游	24,382,491.65	5.38%
51	000878	云南铜业	23,953,577.33	5.29%
52	600296	S 兰铝	23,637,875.89	5.22%
53	600688	S 上石化	23,413,294.36	5.17%
54	600001	邯郸钢铁	22,636,634.03	5.00%
55	600010	包钢股份	22,212,922.35	4.90%
56	600258	S 首旅	21,950,145.59	4.84%
57	000807	云铝股份	21,208,629.07	4.68%
58	000888	峨眉山 A	21,154,259.68	4.67%
59	600583	海油工程	21,120,796.68	4.66%
60	600031	三一重工	20,618,396.51	4.55%
61	000550	江铃汽车	20,346,847.64	4.49%
62	600151	航天机电	20,325,346.77	4.49%
63	600491	龙元建设	20,086,904.55	4.43%
64	600718	东软股份	19,786,306.63	4.37%
65	000825	太钢不锈	19,577,200.39	4.32%
66	000050	深天马 A	19,163,153.05	4.23%
67	600694	大商股份	18,993,047.89	4.19%
68	000917	电广传媒	18,797,024.98	4.15%
69	000617	S 济 柴	18,286,026.76	4.04%
70	600489	中金黄金	17,741,222.30	3.92%
71	000061	农 产 品	17,459,177.50	3.85%
72	000012	南 玻 A	16,949,477.83	3.74%
73	600585	海螺水泥	16,757,827.26	3.70%
74	600211	S 藏药业	16,588,483.45	3.66%
75	600535	天士力	16,256,903.82	3.59%
76	000761	本钢板材	16,213,029.53	3.58%
77	000978	桂林旅游	15,504,314.78	3.42%
78	000549	S 湘火炬	15,407,756.35	3.40%
79	600533	栖霞建设	15,336,975.24	3.38%
80	600303	曙光股份	15,323,561.51	3.38%
81	600088	中视传媒	15,158,137.78	3.35%
82	600269	赣粤高速	14,581,684.59	3.22%
83	600037	歌华有线	14,510,144.60	3.20%
84	600048	保利地产	13,852,592.38	3.06%
85	000758	中色股份	13,713,368.15	3.03%
86	002053	云南盐化	13,440,700.57	2.97%
87	600754	锦江股份	13,114,808.99	2.89%
88	000729	燕京啤酒	12,900,609.73	2.85%
89	000951	中国重汽	12,418,285.15	2.74%

90	600307	酒钢宏兴	12,263,357.84	2.71%
91	600362	江西铜业	11,949,442.04	2.64%
92	000410	沈阳机床	11,221,160.65	2.48%
93	600795	国电电力	11,091,072.00	2.45%
94	002024	苏宁电器	10,916,629.45	2.41%
95	600675	中华企业	10,775,701.65	2.38%
96	600276	恒瑞医药	10,744,633.22	2.37%
97	600438	通威股份	10,740,380.65	2.37%
98	000027	深能源 A	10,709,359.23	2.36%
99	600011	华能国际	10,625,778.79	2.35%
100	600026	中海发展	10,425,061.40	2.30%
101	600664	S 哈药	10,065,324.71	2.22%
102	600439	瑞贝卡	10,017,088.58	2.21%
103	000997	新大陆	9,945,827.22	2.20%
104	600143	金发科技	9,234,329.31	2.04%
105	600748	上实发展	9,187,325.77	2.03%

3、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	4,306,036,422.48
卖出股票的收入总额	4,376,790,312.16

五、本报告期末按券种分类的债券投资组合

序号	债券品种	市值(元)	占基金资产净值比例
1	国 债	132,578,559.40	14.63%
2	金 融 债	49,975,000.00	5.52%
3	央行票据	0.00	0.00%
4	企 业 债	0.00	0.00%
5	可 转 债	0.00	0.00%
合 计		182,553,559.40	20.15%

六、本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投资明细

序号	债券名称	市值(元)	占基金资产净值比例
1	21 国债(15)	62,597,714.40	6.91%
2	06 农发 17	49,975,000.00	5.52%
3	21 国债(3)	44,716,416.00	4.94%
4	99 国债(8)	8,653,129.00	0.96%
5	20 国债(4)	8,084,000.00	0.89%

七、投资组合报告附注

1、本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。

2、本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。

3、权证投资情况

(1) 报告期末持有所有权证明细

序号	权证代码	权证名称	数 量(份)	市 值(元)	占基金资产净值比例
1	031001	侨城 HQC1	38,000	540,778.00	0.06%

(2) 报告期内获得权证明细

序号	权证代码	权证名称	报告期内 股权分置 改革获得 数量(份)	报告期内买入 数量(份)	报告期内买入 成本(元)	报告期内 卖出数量 (份)	报告期内卖出 收入(元)	获得 方式
1	030002	五粮 YGC1		300,000	2,910,410.37	300,000	2,142,366.28	主动 投资
2	580001	武钢 JTB1		5,300,000	4,179,818.05	5,300,000	5,840,766.60	
3	580005	万华 HXB1		130,000	1,736,970.14	130,000	2,171,687.66	
4	580000	宝钢 JTB1		627,030	923,362.95	627,030	1,005,695.39	
5	580007	长电 CWB1		2,020,790	6,223,935.04	2,020,790	5,901,636.48	
6	030001	鞍钢 JTC1		1,200,000	2,590,764.28	1,200,000	2,604,545.02	
7	580010	马钢 CWB1		2,105,650	1,476,060.65	2,105,650	2,241,960.18	申购分离 交易可转 债 (126001) 时获配的 权证
8	031001	侨城 HQC1	38,000	0	0.00	0	0	股权分置 改革对价 支付
9	580990	茅台 JCP1	2,112,000			2,112,000	6,162,075.47	
1	580997	招行 CMP1	311,676	0	0.00	311,676	190,107.63	
合计					20,041,321.48		28,260,840.71	

4、其他资产的构成:

项目	金额(元)
交易保证金	660,000.00
应收利息	1,420,682.15
其他应收款	2,982,097.54
合计	5,062,779.69

5、本报告期末本基金持有处于转股期的可转换债券明细

无。

6、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。

7、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	7,928,035
报告期内买入基金份额	15,480,263
报告期内卖出基金份额	0
报告期末持有基金份额	23,408,298

8、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	25,468 户
报告期末平均每户持有的基金份额	19,632.48 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	500,000,000	100.00%
其中：机构投资者持有的基金份额	315,573,416	63.12%
个人投资者持有的基金份额	175,865,159	35.17%
未经发行人确认份额	8,561,425	1.71%

三、报告期末本基金前十名持有人明细：

序号	持有人名称	期末持有份额(份)	占总份额的比例
1	中国人寿保险股份有限公司	48,588,976	9.72%
2	中国人寿保险（集团）公司	48,030,200	9.61%
3	新华人寿保险股份有限公司	30,287,444	6.06%
4	大成基金管理有限公司	23,408,298	4.68%
5	UBS AG	20,806,127	4.16%
6	中国太平洋人寿保险股份有限公司	18,135,464	3.63%
7	中国人民财产保险股份有限公司	15,039,048	3.01%
8	招商证券股份有限公司－招商银行股份有限公 司－招商证券基金宝集合资产管理计划	12,579,844	2.52%
9	中国太平洋保险公司	12,171,317	2.43%
10	宝钢集团有限公司	10,650,000	2.13%

注：以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。

第九节 重大事件揭示

一、本报告期内基金份额持有人大会决议情况：

2006年11月10日，本基金管理人在上海证券报、证券时报、中国证券报刊登了《景业证券投资基金召开基金份额持有人大会公告》。2006年12月11日，景业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2006年12月27日证监基金字[2006]263号文

核准。自2007年1月16日起，景业证券投资基金在上海证券交易所终止上市，其由《景业证券投资基金基金合同》修订而成的《大成积极成长股票型证券投资基金基金合同》正式生效。

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：

1、经大成基金管理有限公司第三届董事会第一次会议审议通过，决定聘任周一烽先生为公司副总经理，周一烽的高级管理人员任职资格已获中国证券监督管理委员会审核批准（证监基金字『2006』75号）。本基金管理人已于2006年5月13日在证券时报刊登了《大成基金管理有限公司关于聘任公司副总经理的公告》。

2、2006年5月27日，本基金管理人在证券时报发布《大成基金管理有限公司关于基金经理变更的公告》，聘任瞿蕴理女士担任景业证券投资基金经理职务，原基金经理徐彬先生不再担任景业证券投资基金经理职务。

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

本基金的基金管理人于2007年1月5日拟定2006年度第一次分红，向截至2007年1月10日止在本基金注册登记机构中国证券登记结算有限责任公司上海分公司登记在册的全体基金份额持有人，按每10份基金份额派发红利4.00元，占年末可分配收益的比例为94.85%。

六、本基金改聘会计师事务所情况

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 6 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席位的有关情况

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：

1、股票交易量及佣金情况

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	席位佣金额(元)	占本期佣金总额比例
中信证券	1	2,277,854,183.60	26.30%	1,864,622.72	26.74%
光大证券	1	2,186,411,978.01	25.24%	1,710,892.23	24.54%
国信证券	1	1,887,817,222.06	21.80%	1,543,119.00	22.13%
银河证券	2	1,131,832,391.93	13.07%	927,560.68	13.30%
蔚深证券	1	515,556,760.73	5.95%	403,428.16	5.79%
中银国际	1	309,978,540.14	3.58%	242,560.19	3.48%
平安证券	1	190,077,989.42	2.19%	148,737.47	2.13%
东海证券	1	162,087,008.36	1.87%	132,338.60	1.90%
合计	9	8,661,616,074.25	100.00%	6,973,259.05	100.00%

2、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
中信证券	271,237,117.90	51.14%	86,000,000.00	1.39%
光大证券	25,484,511.36	4.81%		

国信证券	161,529,674.80	30.46%	433,800,000.00	7.00%
银河证券	53,366,276.60	10.06%	0.00	0.00%
蔚深证券	1,800,500.00	0.34%	0.00	0.00%
东海证券	16,951,808.30	3.20%	82,000,000.00	1.32%
合计	530,369,888.96	100.00%	601,800,000.00	100.00%

3、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
中信证券	11,533,907.73	24.63%
光大证券	7,657,505.32	16.35%
国信证券	8,615,735.52	18.40%
银河证券	16,429,182.43	35.08%
平安证券	2,590,505.17	5.53%
合计	46,826,836.17	100.00%

4、本报告期内租用席位变更情况

本报告期内增加席位	本报告期内退租席位
中银国际证券 301301	平安证券 062100

5、租用证券公司专用席位的选择标准和程序

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席位的选择标准和程序。

租用证券公司专用席位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。

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

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	关于开通全国统一客户服务号码 400-888-5558 的公告	证券时报、中国证券报和上海证券报	2006 年 5 月 8 日
3	大成基金管理有限公司关于旗下部分基金申购中国银行 A 股的公告	证券时报、中国证券报和上海证券报	2006 年 6 月 30 日
4	大成基金管理有限公司关于旗下部分基金投资资产支持证券的公告	证券时报、中国证券报和上海证券报	2006 年 7 月 6 日
5	大成基金关于旗下部分基金申购北辰实业 A 股的公告	证券时报、中国证券报和上海证券报	2006 年 10 月 9 日
6	景业证券投资基金召开基金份额持有人大会公告	证券时报、中国证券报和上海证券报	2006 年 11 月 10 日
7	大成基金管理有限公司关于修改旗下封闭式基金收益分配条款的公告	证券时报、中国证券报和上海证券报	2006 年 11 月 13 日
8	景业证券投资基金停牌的提示性公告	证券时报、中国证券报和上海证券报	2006 年 11 月 15 日
9	关于召开景业证券投资基金基金份额持有人大会的提示性公告	证券时报、中国证券报和上海证券报	2006 年 11 月 20 日

10	关于召开景业证券投资基金基金份额持有人大会的第二次提示性公告	证券时报、中国证券报和上海证券报	2006 年 12 月 4 日
11	关于景业证券投资基金基金份额持有人大会表决结果的公告	证券时报、中国证券报和上海证券报	2006 年 12 月 12 日

第十节 备查文件目录

一、备查文件目录：

- 1、中国证监会批准设立景业证券投资基金的文件；
- 2、《景业证券投资基金基金合同》；
- 3、《景业证券投资基金托管协议》；
- 4、大成基金管理有限公司批准文件、营业执照、公司章程；
- 5、本报告期内在指定报刊上披露的各种公告原稿。

二、存放地点：

本期报告存放在本基金管理人和托管人的办公住所。

三、查阅方式：

投资者可在营业时间免费查阅，或登录本基金管理人网站 <http://www.dcfund.com.cn> 进行查阅。

投资者对本报告书如有疑问，可咨询本基金管理人大成基金管理有限公司。

客户服务中心电话：400-888-5558（免长途通话费用）。

国际互联网址：<http://www.dcfund.com.cn>。

大成基金管理有限公司

董事长：胡学光

2007 年 3 月 30 日