

长盛成长价值证券投资基金 2007年半年度报告摘要

重要提示
本基金管理人长盛基金管理有限公司(以下简称“本公司”)的董事会及董事保证长盛成长价值证券投资基金(以下简称“本基金”)2007年半年度报告(以下简称“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8月24日复核了本报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告和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,投资者在做出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。
本报告期为2007年1月1日至2007年6月30日,本报告期的财务资料未经审计。
本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。

第一章 基金简介
一、基金基本情况
(一)基金简称:长盛成长价值基金
(二)基金交易代码:080001
(三)基金运作方式:契约型开放式
(四)基金合同生效日:2002年9月18日
(五)报告期末基金份额总额:364,076,776.75份
(六)基金合同存续期:不定期
(七)基金份额上市的交易场所:无
(八)上市日期:无
二、基金产品说明
(一)投资目标
本基金为平衡型基金,通过管理人的积极管理,在控制风险的前提下挖掘价值、分享成长,谋求本基金资产的长期稳定增值。
(二)投资策略
本基金投资策略为主动性投资,在战略性资产、战术性资产、股票和债券选择三个层面进行积极配置,力争获得超过投资基准的超额回报。在资产配置方面,股票资产比例为35%~75%,债券资产比例为20%~60%,现金资产比例不低于5%。
(三)业绩比较基准
中信综合指数收益率×80%+中信国债指数收益率×20%
(四)风险收益特征
本基金属平衡型基金,在承担适度风险的前提下,获得长期稳定的收益。
三、基金管理人
(一)名称:长盛基金管理有限公司
(二)信息披露负责人:叶金松
(三)联系电话:010-82255818
(四)传真:010-82255988
(五)电子邮箱:yjs@csfunds.com.cn
四、基金托管人
(一)名称:中国农业银行
(二)信息披露负责人:李芳菲
(三)联系电话:010-68424199
(四)传真:010-68424181
(五)电子邮箱:litfanglei@abcchina.com

长盛成长价值证券投资基金资产负债表 单位:人民币元
项目 2007年6月30日 2006年12月31日
资产
银行存款 58,172,096.28 114,009,971.02
清算备付金 2,204,317.36 1,390,538.47
交易保证金 910,000.00 1,160,000.00
应收证券清算款 49,002,239.62 1,468,190.40
应收股利 0.00 0.00
应收利息 2,060,717.19 1,130,456.72
应收申购款 0.00 122,304.20
其他应收款 0.00 0.00
股票投资市值 370,922,366.98 339,587,562.61
其中:股票投资成本 268,832,411.65 231,673,138.98
债券投资市值 113,922,614.00 93,761,307.63
其中:债券投资成本 114,221,324.09 94,049,736.94
权证投资 867,463.73 0.00
其中:权证投资成本 331,533.39 0.00
买入返售证券 0.00 0.00
待摊费用 0.00 0.00
其他资产 0.00 0.00
资产总计 598,061,815.16 552,630,330.95
负债及所有者权益
应付证券清算款 35,525,502.17 7,737,295.13
应付赎回款 572,386.39 1,267,268.09
应付赎回费 2,157.24 4,776.11
应付管理人报酬 653,697.92 708,366.16
应付托管费 108,949.63 118,061.00
应付销售服务费 0.00 0.00
应付佣金 654,197.07 924,356.06
应付利息 0.00 40,140.85
应付股利 0.00 0.00
应付交款 0.00 0.00
其他应付款 253,317.50 253,145.00
卖出回购证券款 0.00 85,000,000.00
短期借款 0.00 0.00
预提费用 164,139.85 80,000.00
其他负债 0.00 0.00
负债合计 37,934,357.77 96,133,408.40
所有者权益
实收基金 364,076,776.75 241,193,389.69
未实现利得 -38,221,180.85 -15,062,579.67
未分配收益 234,271,861.49 230,366,102.33
所有者权益合计 560,127,457.39 456,496,922.56
负债及所有者权益总计 598,061,815.16 552,630,330.95
注:2007年6月30日每份基金份额资产净值:1.538元,2006年末每份基金份额资产净值:1.893元。后附会计报表附注为本会计报表的组成部分。

单位:人民币元
股票 股票名称 期末市值 申购日期 可流通日期 数量(股) 期末成本 期末市值
601007 金鹰饭店 1442 07/03/26 07/07/10 46,374 192,539.50 654,293.08
601008 连云港 1460 07/04/17 07/07/26 36,301 183,268.58 537,294.60
601998 中信银行 920 07/04/23 07/07/30 110,434 640,517.20 1,055,392.40
合计 1,016,625.68 2,207,580.48

第六节 投资组合报告
一、报告期末基金投资组合情况
资产项目 金额(人民币元) 占基金资产总额比例
股票 370,922,366.98 62.02%
债券 113,922,614.00 19.56%
其他 867,463.73 0.14%
资产支持证券 0.00 0.00%
银行存款及清算备付金 60,376,434.64 10.10%
其他资产 51,972,568.81 8.69%
资产总计 598,061,815.16 100.00%

二、报告期末按行业分类的股票投资组合
分类 市值(人民币元) 占基金资产净值比例
A 农林牧渔 0.00 0.00%
B 采掘业 0.00 0.00%
C 制造业 158,491,196.55 28.30%
C1 食品、饮料 54,008,921.10 9.65%
C11 饮料、酒类 0.00 0.00%
C2 纺织服装 0.00 0.00%
C3 医药、生物制品 7,591,003.22 1.38%
C5 电子 0.00 0.00%
C6 金属、非金属 13,072,000.00 2.33%
C7 机械、设备、仪表 46,361,833.13 8.10%
C8 医药、生物制品 38,497,407.00 6.88%
C9 其他制造业 0.00 0.00%
D 电力、煤气及水务生产和供应业 27,861,200.00 4.98%
E 建筑业 0.00 0.00%
F 交通运输、仓储业 21,192,794.60 3.78%
G 信息技术业 10,770,713.60 1.93%
H 批发和零售贸易 49,389,731.07 8.92%
I 金融、保险业 43,976,438.08 7.85%
J 房地产业 46,707,000.00 8.34%
L 社会服务业 64,260.08 0.11%
M 传播与文化产业 14,390,000.00 2.57%
M 综合类 0.00 0.00%
合计 370,922,366.98 66.22%

三、报告期末按市值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票明细
序号 股票代码 股票名称 数量(股) 市值(人民币元) 市值占基金资产净值比例
1 000895 双汇发展 754,009 43,657,121.10 7.79%
2 002004 苏宁电器 602,165 26,277,689.40 5.05%
3 600028 华发股份 999,516 25,577,928.28 4.83%
4 000623 吉林敖东 451,002 22,441,827.00 4.01%
5 600325 华谊股份 600,000 18,199,000.00 3.25%
6 600267 海正药业 1,069,912 14,978,768.00 2.76%
7 000024 招商地产 300,000 14,730,000.00 2.63%
8 600037 中国南车 550,000 14,399,000.00 2.57%
9 601318 中国平安 200,000 14,302,000.00 2.55%
10 600048 保利地产 300,000 13,779,000.00 2.46%

投资者想了解本报告期内基金投资组合的所有股票明细,应阅读登载于本公司互联网网站: http://www.csfunds.com.cn 的半年度报告正文。

四、报告期内股票投资组合的重大变动
(一)报告期内累计买入价值超出期初基金资产净值2%或前20名的股票明细
序号 股票代码 股票名称 累计买入金额(人民币元) 占期初基金资产净值比例
1 000623 华发股份 26,485,634.70 5.89%
2 600325 华谊股份 24,424,966.63 5.36%
3 60094 大亚股份 22,931,409.71 5.02%
4 000401 冀东水泥 21,948,136.55 4.81%
5 000761 山东钢铁 21,797,153.38 4.77%
6 000958 五矿发展 18,986,838.89 4.15%
7 000024 招商地产 17,747,369.49 3.89%
8 600048 保利地产 17,041,485.00 3.72%
9 600886 国电电力 16,894,461.25 3.67%
10 600655 豫园商城 15,803,689.52 3.46%
11 600237 歌华有线 13,816,910.73 3.02%
12 600267 海正药业 14,567,012.36 3.19%
13 600036 招商银行 14,533,153.02 3.18%
14 601318 中国平安 14,521,742.16 3.18%
15 600222 天鸿置业 14,243,656.15 3.12%
16 002004 苏宁电器 14,107,018.52 3.07%
17 000121 华联控股 13,817,960.00 3.02%
18 000729 美兰酒店 13,050,422.02 2.88%
19 000581 威孚高科 12,639,296.56 2.81%
20 600056 五粮液 12,302,089.66 2.71%
21 601111 中国船舶 12,012,771.28 2.63%
22 600835 上海机场 11,482,919.84 2.52%
23 600887 伊泰股份 11,337,826.68 2.48%
24 000063 中信证券 11,240,630.35 2.46%
25 600183 远兴能源 10,663,897.74 2.34%
26 600667 冠城大通 10,523,503.81 2.31%
27 000777 中核科技 10,325,620.09 2.28%
28 600628 新世界 10,019,488.38 2.19%
29 000507 华鲁恒升 9,443,337.74 2.07%
30 600238 海南橡胶 9,332,023.93 2.02%
31 000062 国际控股 9,240,531.94 2.00%

(二)报告期内累计卖出价值超出期初基金资产净值2%或前20名股票明细
序号 股票代码 股票名称 累计卖出金额(人民币元) 占期初基金资产净值比例
1 000895 双汇发展 38,352,229.68 8.38%
2 002022 天际资源 31,186,272.27 6.83%
3 000623 华发股份 35,989,965.76 7.88%
4 600019 宝钢股份 30,524,310.73 6.69%
5 002024 苏宁电器 25,136,606.67 5.52%
6 600028 华发股份 23,483,380.04 5.13%
7 600050 中国联通 22,046,757.98 4.85%
8 600036 招商银行 22,357,833.23 4.90%
9 600887 伊泰股份 22,038,371.24 4.83%
10 000012 葡葡 A 19,929,932.34 4.37%
11 000897 石化股份 19,354,329.32 4.25%
12 000018 深国投 18,986,238.68 4.16%
13 600965 泰达股份 18,722,183.09 4.10%
14 600900 长力电力 17,587,666.87 3.85%
15 000761 山东钢铁 17,465,548.82 3.75%
16 600005 武钢股份 16,398,975.30 3.52%
17 600869 张裕A 15,307,778.82 3.31%
18 600049 医药股份 15,491,282.11 3.30%
19 000023 宝通科技 15,329,240.93 3.30%
20 000777 中核科技 15,303,017.88 3.30%
21 000069 华鲁恒升 14,121,247.28 3.09%
22 000958 五矿发展 13,480,966.12 2.95%
23 000729 美兰酒店 13,289,262.46 2.91%
24 000401 冀东水泥 13,265,587.28 2.91%
25 600067 冠城大通 13,014,288.28 2.85%
26 600676 华中企业 12,931,640.77 2.83%
27 600984 大商股份 11,647,211.61 2.56%
28 000029 张裕A 11,643,889.68 2.55%
29 600028 华发股份 11,411,011.35 2.50%
30 600238 海南橡胶 10,595,829.59 2.32%
31 000079 华鲁恒升 10,478,467.08 2.30%
32 000625 长安汽车 10,181,266.83 2.23%
33 002073 青岛软件 9,341,854.83 2.05%
34 600027 华发股份 9,622,428.28 2.11%
35 601063 宁波银行 9,520,681.77 2.09%
36 000026 三友A 9,199,628.14 2.01%
37 000062 国际控股 9,131,142.13 2.00%

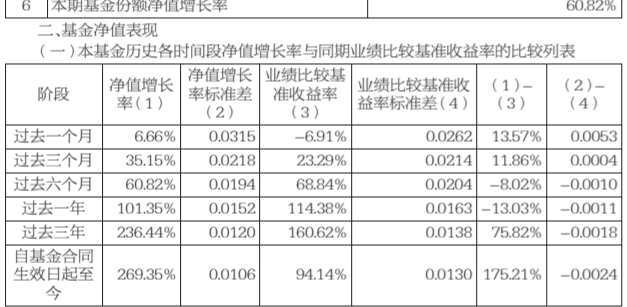
三、报告期末按市值占基金资产净值比例大小排序前五名债券明细
序号 债券名称 市值(人民币元) 占基金资产净值比例
1 02国债08 32,383,980.00 5.78%
2 02国债14 28,771,750.00 5.14%
3 20国债04 17,656,184.00 3.15%
4 02国债10 16,203,000.00 2.89%
5 20国债10 15,073,500.00 2.69%

七、投资组合报告附注
(一)本报告期内基金持有的前十名证券的发行主体无被监管部门立案调查记录,无在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚。
(二)本基金持有的前十名股票,均符合基金合同规定备选股票库之内的股票。
(三)报告期末基金的其他资产构成
单位:人民币元
项目 金额(人民币元)
买入返售金融资产 630,870,625.81
其他资产 802,104,523.94
合计 1,432,975,149.75

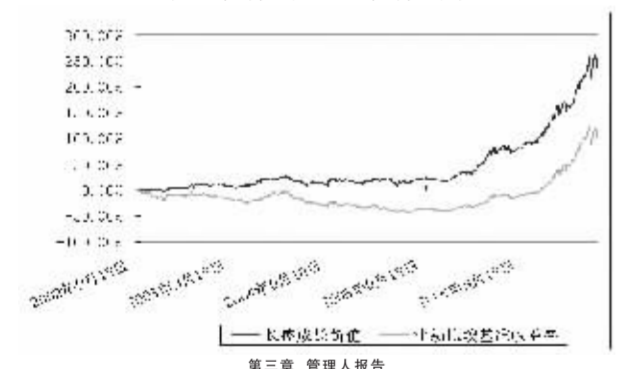
第二章 主要财务指标和基金净值表现
所述基金业绩指标不包括基金份额持有人交易基金的各项费用,计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

主要财务指标
序号 主要财务指标
1 基金本期净收益(元) 207,178,516.59
2 基金份额本期净收益(元/份) 0.6601
3 期末可供分配基金份额收益(元/份) 0.5386
4 期末基金资产净值(元) 560,127,457.39
5 期末基金份额净值(元/份) 1.538
6 本期基金份额净值增长率 60.82%

二、基金净值表现
(一)本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的对比列表
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)
过去一个月 6.66% 0.0315 -6.91% 0.0262 13.57% 0.0063
过去三个月 35.15% 0.0218 23.29% 0.0214 11.86% 0.0004
过去六个月 60.82% 0.0194 68.84% 0.0204 -8.02% -0.0010
过去一年 101.25% 0.0152 114.28% 0.0163 -13.03% -0.0011
过去三年 236.44% 0.0120 160.62% 0.0138 75.82% -0.0018
自基金合同生效至今 269.35% 0.0106 94.14% 0.0130 175.21% -0.0024



(二)自基金合同生效以来基金份额净值的情况,并与同期业绩比较基准的变动的比较
长盛成长价值证券投资基金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 (2002年9月18日至2007年6月30日)



第三章 管理人报告
一、基金管理人及基金经营情况
(一)基金管理人及其管理基金的经验
本基金管理人经中国证监会证监基金字[1999]6号文件批准,于1999年3月成立,注册资本为人民币10000万元。目前,本公司股东及出资比例均为:国元证券有限责任公司占注册资本的41%;新加坡星展资产管理有限公司占注册资本的33%;安徽省创新投资有限公司占注册资本的13%;安徽省投资集团有限责任公司占注册资本的13%。截止2007年6月30日,基金管理人共管理3支封闭式基金,6支开放式基金,并于2002年12月,首次取得了全国社保基金资产管理资格。
(二)基金经理简介
裴蔚倩,女,1979年12月出生,2001年7月获经济学学士学位,2003年7月获法学硕士学位。2003年9月加入长盛基金管理有限公司,历任研究员、发展部经理、长盛成长价值基金基金经理助理、长盛动态精选基金基金经理助理,现任长盛成长价值基金基金经理。
二、对报告期内基金运作的回顾与情况的说明
本报告期内,本基金管理人严格按照《基金法》及其各项实施细则、《长盛成长价值证券投资基金合同》和其他有关法律法规、监管部门的相关规定,依照诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产,在认真控制投资风险的基础上,为基金份额持有人谋求最大利益,没有出现损害基金份额持有人利益的行为。
三、报告期内基金投资策略和业绩表现的说明与分析
(一)报告期内行情回顾和本基金投资策略分析
上半年上证指数涨幅43%,沪深300涨幅94%,远超过上证指数涨幅。由此我们可以推断上半年大盘存在价值和加价的背景下,有色、煤炭和电力股票获得了远超过平均水平的收益,而铁路、运输、金融、石化相对表现偏弱。
本基金上半年的申购和赎回相对均衡,对仓位的调整造成了一定影响。在符合合同规定的前提下,平均股票仓位基本保持在68%-73%的较高比例。
(二)本基金业绩表现
截止报告期末,本基金份额净值为1.538元,本报告期份额净值增长率为60.82%,同期业绩比较基准增长率为68.84%。
四、市场展望和投资策略
我们对下半年的市场行情仍然保持谨慎乐观态度,宏观经济的快速稳健增长,上市公司业绩的超预期释放,人民币升值进程的加快等因素都将继续夯实市场的牛市基础,股指期货的推出则会为蓝筹股价值的提升提供额外刺激,但是来自政策面的紧缩信号如加息、上调存款准备金率、为外债投资公司发行特别国债等可能继续对市场发展形成扰动,市场仍将在震荡中保持向上态势。
三季度的投资标的选择,我们偏向于绩优股票。我们判断,成长性明确,估值合理的股票一定是其优势,今年上半年,特别是在四、五月间,A股市场出现了自2003年以来少有的快速上涨行情,印花税率于五月底由0.1%调高到0.3%,突显了官方压短钱交易的决心。到了六月份,我们观察到成交量萎缩,同时绩优与绩差股之间的表现也趋于分歧。我们认为蓝筹股表现将优于三季大幅超越绩差股。从个股角度,我们下半年将主要投资于业绩超过预期潜力的股票,从行业角度,我们关注估值低的绩优板块。

第四章 基金托管人报告
在托管长盛成长价值证券投资基金的过程中,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《长盛成长价值证券投资基金基金合同》、《长盛成长价值证券投资基金托管协议》的约定,对长盛成长价值证券投资基金管理人——长盛基金管理有限公司2007年1月1日至2007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,长盛基金管理有限公司在长盛成长价值证券投资基金的投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支等方面上,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,长盛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,基金管理人编制和披露的长盛成长价值证券投资基金2007年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,没有出现损害基金份额持有人利益的行为。
中国农业银行托管业务部
2007年8月24日

第五章 财务会计报告
一、基金会计报表(未经审计)
(一)资产负债表
单位:人民币元
项目 2007年6月30日 2006年12月31日
资产
银行存款 58,172,096.28 114,009,971.02
清算备付金 2,204,317.36 1,390,538.47
交易保证金 910,000.00 1,160,000.00
应收证券清算款 49,002,239.62 1,468,190.40
应收股利 0.00 0.00
应收利息 2,060,717.19 1,130,456.72
应收申购款 0.00 122,304.20
其他应收款 0.00 0.00
股票投资市值 370,922,366.98 339,587,562.61
其中:股票投资成本 268,832,411.65 231,673,138.98
债券投资市值 113,922,614.00 93,761,307.63
其中:债券投资成本 114,221,324.09 94,049,736.94
权证投资 867,463.73 0.00
其中:权证投资成本 331,533.39 0.00
买入返售证券 0.00 0.00
待摊费用 0.00 0.00
其他资产 0.00 0.00
资产总计 598,061,815.16 552,630,330.95
负债及所有者权益
应付证券清算款 35,525,502.17 7,737,295.13
应付赎回款 572,386.39 1,267,268.09
应付赎回费 2,157.24 4,776.11
应付管理人报酬 653,697.92 708,366.16
应付托管费 108,949.63 118,061.00
应付销售服务费 0.00 0.00
应付佣金 654,197.07 924,356.06
应付利息 0.00 40,140.85
应付股利 0.00 0.00
应付交款 0.00 0.00
其他应付款 253,317.50 253,145.00
卖出回购证券款 0.00 85,000,000.00
短期借款 0.00 0.00
预提费用 164,139.85 80,000.00
其他负债 0.00 0.00
负债合计 37,934,357.77 96,133,408.40
所有者权益
实收基金 364,076,776.75 241,193,389.69
未实现利得 -38,221,180.85 -15,062,579.67
未分配收益 234,271,861.49 230,366,102.33
所有者权益合计 560,127,457.39 456,496,922.56
负债及所有者权益总计 598,061,815.16 552,630,330.95
注:2007年6月30日每份基金份额资产净值:1.538元,2006年末每份基金份额资产净值:1.893元。后附会计报表附注为本会计报表的组成部分。

长盛成长价值证券投资基金
经营业绩表及收益分配表
单位:人民币元
项目 2007年上半年度 2006年上半年度
收入
股票差价收入 207,723,592.84 240,197,823.00
债券差价收入 -448,212.23 1,438,949.16
权证差价收入 0.00 3,340,176.67
债券利息收入 1,212,476.29 2,698,877.47
存款利息收入 260,330.32 323,966.84
股利收入 2,372,342.73 6,782,380.74
买入返售证券收入 0.00 0.00
其他收入 269,940.75 1,075,670.38
收入合计 211,390,470.70 254,857,200.26
费用
基金管理人报酬 3,205,081.59 7,127,342.77
基金托管费 334,180.20 1,187,890.00
基金销售服务费 0.00 0.00
卖出回购证券支出 289,445.72 107,764.79
利息支出 0.00 0.00
其他费用 183,246.60 205,653.47
其中:上市手续费 0.00 0.00
信息披露费 133,891.13 148,767.52
审计费用 30,248.72 47,108.87
费用合计 4,211,954.11 8,628,651.45
基金净收益 207,178,516.59 246,228,548.81
加:未实现利得 -5,298,818.64 124,076,467.00
基金经营业绩 201,879,697.95 370,305,015.81
本期基金净收益 207,178,516.59 246,228,548.81
加:期初基金净收益 230,366,102.33 -8,516,254.87
加:本期损益平准金 43,502,063.83 -19,196,393.71
可供分配基金净收益 481,046,672.75 218,515,900.23
减:本期已分配基金净收益 246,774,811.26 32,048,213.80
期末基金净收益 234,271,861.49 186,467,686.43
后附会计报表附注为本会计报表的组成部分。

长盛成长价值证券投资基金净值变动表 单位:人民币元
项目 2007年上半年度 2006年上半年度
期初基金净值 456,496,922.56 1,124,933,694.47
本期经营活动 基金净收益 207,178,516.59 246,228,548.81
未实现利得 -5,298,818.64 124,076,467.00
经营活动产生的基金净值变动数 201,879,697.95 370,305,015.81
本期基金份额交易 基金申购款 364,478,076.42 354,968,240.57
其中:分红再投资 19,585,043.98 1,142,570.07
基金赎回款 215,362,423.27 890,060,522.26
基金份额交易产生的基金净值变动数 149,525,648.15 -606,102,274.21
本期基金份额持有人分配收益 -924,774,811.26 -32,048,213.80
期末基金净值 560,127,457.39 968,088,122.27

(二)基金会计报表(未经审计)
一、本基金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。
(一)本报告期间重大会计差错的内容和更正金额:无
(二)本报告期间关联方关系发生变化的情况:本报告期间,关联方关系发生变化的情况:本报告期间,本基金关联方增加新加坡星展资产管理有限公司。
二、关联方关系及其关联方
与本基金的关系
长盛基金管理有限公司 基金管理人、注册登记机构、基金销售机构
中国农业银行 基金托管人、基金代销机构
国元证券有限责任公司 基金管理人的股东、基金代销机构
新加坡星展资产管理有限公司 基金管理人的股东
安徽省创新投资有限公司 基金管理人的股东
安徽省国际信托有限公司 基金管理人的股东
三、关联方交易
1. 关联方交易
下述关联方交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。
(1)通过关联方席位进行的证券交易及债券回购
(2)通过关联方的席位进行的证券交易
单位:人民币元
项目 2007年上半年度 2006年上半年度
项目 成交量 占半年成交量比例 成交量 占半年成交量比例
国元证券 294,414,156.61 20.57% 459,814,926.92 28.41%
买卖股票 25,631,883.40 25.53% 66,304,637.70 48.37%
债券回购 120,000,000.00 50.00% 145,000,000.00 15.15%
买卖权证 0.00 0.00% 0.00 0.00%
2. 通过关联方的席位进行的交易易
单位:人民币元
项目 2007年上半年度 2006年上半年度
项目 佣金 占半年佣金总量 比例 佣金 占半年佣金总量 比例
国元证券 240,568.20 20.94% 375,069.56 28.82%

国元证券 0.00 0.00 0.00% 30,000,000.00 45,350,000.00 4.73%
关联方名称 基金余额(份) 净值 (人民币元) 占基金总资产比例 基金总份数(份) 净值(人民币元) 占基金总资产比例
国元证券 0.00 0.00 0.00% 30,000,000.00 45,350,000.00 4.73%
(四)报告期末本基金前十名受限的基金资产
本基金截至2007年6月30日持有以下受限处于锁定期而流通受限的股票,其期末估值单价是根据最近一个交易日的收盘价确定。
单位:人民币元
序号 股票代码 股票名称 数量(股) 市值(人民币元) 占基金资产净值比例
1 99国债08 32,383,980.00 5.78%
2 02国债14 28,771,750.00 5.14%
3 20国债04 17,656,184.00 3.15%
4 02国债10 16,203,000.00 2.89%
5 20国债10 15,073,500.00 2.69%

其他资产项目 金额(人民币元)
交易保证金 910,000.00
应收证券清算款 49,002,239.62
应收股利 0.00
应收利息 2,060,717.19
应收申购款 0.00
其他应收款 0.00
合计 51,972,568.81

(四)报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细
本基金报告期末未持有可转换债券。
(五)报告期内获得权证情况
1. 报告期末持有可转换债券
获得方式 权证名称 权证代码 数量(份) 市值(人民币元) 市值占基金资产净值比例
被冻结 武钢CWB1 580013 143.075 867,463.73 0.15%
合计 867,463.73 0.15%
2. 报告期内获得权证证明
获得方式 权证名称 权证代码 数量(份) 成本总额(人民币元)
被冻结 武钢CWB1 580013 143.075 331,533.39

(六)报告期末基金持有的资产支持证券明细
本基金报告期末未持有资产支持证券。
(七)报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况
本基金基金管理人报告期内未投资本基金。
第七章 基金份额持有人情况
一、报告期末基金份额持有人户数
报告期末基金总份额(户) 7,320
报告期末平均每户持有基金份额(份) 49,684.41
二、报告期末基金份额持有人结构
项目 数量(份) 占基金份额的比例
基金份额总额 364,076,776.75 100.00%
其中:机构投资者持有的基金份额 169,307,647.22 46.52%
个人投资者持有的基金份额 194,769,129.53 53.48%

三、报告期末基金管理机构员工持有本基金情况
持有基金份额数量(份) 131373 占基金份额比例 0.00%
第八章 开放式基金份额变动情况
本基金份额变动情况如下: