长城久富核心成长股票型证券投资基金(LOF)2007年半年度报告摘要

(上接125版)

第七节 久富证券投资基金财务会计报告(未经审计)

(一)久富证券投资基金半年度会计报表

1、久富证券投资基金2007年2月11日及2006年12月31日的比较式资产负债表

单位:人民币元

项目	2007年2月11日	2006年12月31日
资产:		
银行存款	1,855,695.98	618,936.57
清算备付金	262,176,163.39	111,851,829.25
交易保证金	640,993.11	609,609.61
应收证券清算款	0.00	4,906,661.67
应收股利	0.00	0.00
应收利息	214,198.75	2,234,084.86
应收申购款	0.00	0.00
其他应收款	0.00	0.00
股票投资市值	1,074,968,345.57	932,552,923.22
其中:股票投资成本	651,739,427.78	560,337,318.63
债券投资市值	25,341,047.00	237,588,891.70
其中:债券投资成本	25,341,072.29	238,129,554.67
权证投资市值	811,750.00	0.00
其中:权证投资成本	1,046,534.25	0.00
配股权证	0.00	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
资产合计	1,366,008,193.80	1,290,362,936.88
负债:		
应付证券清算款	6,979,161.93	5,969,957.16
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	607,610.98	1,363,534.50
应付托管费	101,268.50	227,255.76
应付销售服务费	0.00	0.00
应付佣金	573,502.89	1,062,296.42
应付利息	0.00	139,885.74
应付收益	0.00	0.00
未交税金	0.00	0.00
其他应付款	1,250,000.00	1,250,000.00
卖出回购证券款	0.00	100,000,000.00
短期借款	0.00	0.00
预提费用	110,399.58	60,000.00
其他负债	0.00	0.00
负债合计	9,621,943.88	110,072,929.58
持有人权益:		
实收基金	500,000,000.00	500,000,000.00
未实现利得	422,994,108.25	371,674,941.62
未分配收益	433,392,141.67	308,615,065.68
持有人权益合计	1,356,386,249.92	1,180,290,007.30
负债及持有人权益合计	1,366,008,193.80	1,290,362,936.88
附注:每份基金份额净值	2.7128	2.3606

2、久富证券投资基金本报告期(2007年1月1日至2007年2月11日)及上年度可比期间的比较式经营业绩表

单位:人民币元

项目	2007年1月1日至2007年2月11日	2006年1月1日至2006年6月30日
一、收入	127,732,273.22	185,528,539.61
股票差价收入	128,782,677.60	173,214,426.70
债券差价收入	−1,981,502.60	0.00
权证差价收入	0.00	5,631,300.52
债券利息收入	806,824.80	1,848,721.77
存款利息收入	124,273.42	214,401.70
股利收入	0.00	4,619,688.92
买入返售证券收入	0.00	0.00
其他收入	0.00	0.00
二、费用	2,955,197.23	5,784,310.52
基金管理人报酬	2,251,510.63	4,814,053.55
基金托管费	375,251.76	802,342.27
基金销售服务费	0.00	0.00
卖出回购证券支出	272,514.26	0.00
利息支出	0.00	0.00
其他费用	55,920.58	167,914.70
其中:上市年费	6,903.96	29,752.78
信息披露费	34,520.22	99,177.14
审计费用	6,903.96	29,752.78
三、基金净收益	124,777,075.99	179,744,229.09
加:未实现利得	51,319,166.63	157,277,951.56
四、基金经营业绩	176,096,242.62	337,022,180.65

3、久富证券投资基金本报告期(2007年1月1日至2007年2月11日)及上年度可比期间的比较式收益分配表

单位:人民币元

项目	2007年1月1日至2007年2月11日	2006年1月1日至2006年6月30日
本期基金净收益	124,777,075.99	179,744,229.09
加:期初基金净收益	308,615,065.68	−38,925,745.03
本期损益平准金	0.00	0.00
可供分配基金净收益	433,392,141.67	140,818,484.06
加:以前年度损益调整	0.00	0.00
减:本期已分配基金净收益	0.00	0.00
期末基金净收益	433,392,141.67	140,818,484.06

4、久富证券投资基金本报告期(2007年1月1日至2007年2月11日)及上年度可比期间的比较式基金净值变动表

单位:人民币元

项目	2007年1月1日至2007年2月11日	2006年1月1日至2006年6月30日
一、期初基金净值	1,180,290,007.30	518,852,678.19
二、本期经营活动:		
已实现基金净收益	124,777,075.99	179,744,229.09
未实现利得	51,319,166.63	157,277,951.56
经营活动产生的基金净值变动数	176,096,242.62	337,022,180.65
三、本期基金单位交易:		
基金申购款	0.00	0.00
基金赎回款	0.00	0.00
基金单位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	1,356,386,249.92	855,874,858.84

(二)久富证券投资基金半年度会计报表附注

1、基金的基本情况

久富证券投资基金是根据中国证券监督管理委员会《关于同意久富证券投资基金上市、续期并扩募及久嘉证券投资基金设立的批复》(证监基金字[2002]11号)批准,由原富岛基金、兴沈基金、久盛基金经清理规范、合并而成的契约型封闭式证券投资基金,基金发起人为长城证券有限责任公司和长城基金管理有限公司。基金久富于2002年4月18日在深交所上市,基金存续期延长五年(至2007年5月20日)。本基金于2002年5月28日成功扩募至5亿份基金单位,每份基金单位面值1元,发起人认购500万份,其余49500万份由社会公众持有,扩募部分于2002年6月6日在深交所上市交易。

基金募集申请的核准机构:中国证券监督管理委员会

核准文号:证监基金字[2002]11号

核准名称:《关于同意久富证券投资基金上市、续期并扩募及久嘉证券投资基金设立的批复》

基金运作方式:契约型、封闭式

基金管理人:长城基金管理有限公司

基金托管人:交通银行

基金合同生效日:2001年12月18日

合同生效日基金份额总额:253,697,560份

2、本报告所采用的会计政策和会计估计:

(1)本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。

(2)主要税项:

①根据《财政部国家税务总局关于证券投资基金税收政策的通知》财税【2004】78号文件规定,基金自2004年1月1日起,继续免征企业所得税和营业税。

②印花税

根据《财政部 国家税务总局关于调整证券(股票)交易印花税税率的通知》财税[2005]11号文件规定, 从2005年1月24日起,减按1‰的税率缴纳证券(股票)交易印花税。

③根据《财政部国家税务总局关于股息红利个人所得税有关政策的通知 》财税【2005】102号文件规定,自2005年6月13日起对个人投资者从上市公司取得的股息红利所得,暂减按50%计入个人应纳税所得额,依照现行税法规定计征个人所得税。

3、本报告期重大会计差错的内容和更正金额

本报告期无重大会计差错的内容和更正金额。

4、关联方

(1)关联方关系

关联公司名称	与本基金关系
长城基金管理有限公司	本基金管理人及发起人
交通银行	本基金托管人
长城证券有限责任公司	本基金发起人及本基金管理人的主要股东、租赁交易席位
东方证券股份有限公司	本基金管理人的股东、租赁交易席位
西北证券有限责任公司	本基金管理人的股东
国投信托投资有限公司	本基金管理人的股东
北方国际信托投资股份有限公司	本基金管理人的股东
银顺长城基金管理有限公司	本基金管理人主要股东控制的机构

(2)关联方交易

声明:本基金与关联方的所有交易均是在正常业务中按照一般商业条款订立。

①通过关联方席位进行的交易

股票投资

2007年1月1日至2007年2月11日 单位:人民币元

序号	租用席位证券公司名称	股票交易金额	股票交易占比
1	长城证券有限责任公司	332,191,092.37	46.08%
2	东方证券股份有限公司	323,754,041.33	44.91%
	合计	655,945,133.70	90.99%

2006年1月1日至2006年6月30日 单位:人民币元

序号	租用席位证券公司名称	股票交易金额	股票交易占比
1	长城证券有限责任公司	426,512,316.48	28.06%
2	东方证券股份有限公司	213,830,049.31	14.07%
	合计	640,342,365.79	42.13%

债券和回购交易

2007年1月1日至2007年2月11日 单位:人民币元

序号	租用席位证券公司名称	债券交易金额	债券回购金额	债券交易占比	回购交易占比
1	长城证券有限责任公司	53,677,562.80	160,000,000.00	17.09%	100.00%
2	东方证券股份有限公司	0.00	0.00	0.00%	0.00%
	合计	53,677,562.80	160,000,000.00	17.09%	100.00%

2006年1月1日至2006年6月30日 单位:人民币元

序号	租用席位证券公司名称	债券交易金额	债券回购金额	债券交易占比	回购交易占比
1	长城证券有限责任公司	8,644,213.90	0.00	12.57%	0.00%
2	东方证券股份有限公司	5,954,245.70	0.00	8.66%	0.00%
	合计	14,598,459.60	0.00	21.22%	0.00%

权证交易

2007年1月1日至2007年2月11日 单位:人民币元

序号	租用席位证券公司名称	权证交易金额	权证交易占比
1	长城证券有限责任公司	0.00	0.00%
2	东方证券股份有限公司	1,046,429.66	100.00%
	合计	1,046,429.66	100.00%

2006年1月1日至2006年6月30日 单位:人民币元

序号	租用席位证券公司名称	权证交易金额	权证交易占比
1	长城证券有限责任公司	4,963,717.07	88.14%
2	东方证券股份有限公司	0.00	0.00%
	合计	4,963,717.07	88.14%

佣金

2007年1月1日至2007年2月11日 单位:人民币元

序号	租用席位证券公司名称	佣金	佣金占比
1	长城证券有限责任公司	271,055.93	47.26%
2	东方证券股份有限公司	253,340.12	44.17%
	合计	524,396.05	91.44%

2006年1月1日至2006年6月30日 单位:人民币元

序号	租用席位证券公司名称	佣金	佣金占比
1	长城证券有限责任公司	346,666.00	28.21%
2	东方证券股份有限公司	172,161.17	14.01%
	合计	518,827.17	42.23%

* 本基金对关联方席位交易佣金的计算方式及佣金比率与其他非关联方交易佣金的计算方式及佣金比率一致。

** 佣金协议的服务范围:

除进行证券交易外,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。

②本基金关联方报酬(本报告期:2007年1月1日至2007年2月11日)

关联方名称	本报告期	上年度可比报告期	计算标准	计算方式
长城基金管理有限公司	2,251,510.63	4,814,053.55	年费率1.5%	按前一天基金资产净值乘以费率每天计提
交通银行	375,251.76	802,342.27	年费率2.5%	
合计	2,626,762.39	5,616,395.82		

③与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金本报告期无与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。

④各关联方投资本基金的情况

A.本基金管理人投资本基金的情况

2007年1月1日至2007年2月11日投资本基金情况

关联方名称	项目	持有份额(份)	占总份额比例
长城基金管理有限公司	2006年12月31日	2,500,000.00份	0.50%
	加:本期增加	0.00	0.00%
	减:本期减少	0.00	0.00%
	2007年2月11日	2,500,000.00份	0.50%

2006年1月1日至2006年6月30日投资本基金情况

关联方名称	项目	持有份额(份)	占总份额比例
长城基金管理有限公司	2005年12月31日	2,500,000.00份	0.50%
	加:本期增加	0.00	0.00%
	减:本期减少	0.00	0.00%
	2006年6月30日	2,500,000.00份	0.50%

B.基金管理人主要股东及其控制的机构在期末持有本基金份额的情况

关联方名称	2007年2月11日		2006年6月30日	
	持有份额(份)	比例	持有份额(份)	比例
长城证券有限责任公司	2,500,000.00	0.50%	2,500,000.00	0.50%

除本基金管理人外,本基金管理人主要股东控制的其它机构上期末及本期末均未持有本基金。

⑤关联方保管的银行存款余额

关联方名称	项目	2007年2月11日	2006年6月30日
交通银行	银行存款	1,855,695.98	1,262,081.98

⑥从关联方取得的利息收入(本报告期:2007年1月1日至2007年2月11日)

关联方名称	项目	本报告期	上年度可比报告期
交通银行	存款利息收入	1,739.93	8,415.95

⑦关联方往来款项余额

往来项目	关联方名称	经济内容	2006年2月11日	2006年6月30日
应付管理人报酬	长城基金管理有限公司	管理费	607,610.98	998,837.43
应付基金托管费	交通银行	托管费	101,268.50	166,472.92
应付佣金	长城证券有限责任公司	佣金	271,055.93	173,104.79
应付佣金	东方证券股份有限公司	佣金	253,340.12	38,107.53
其他应付款	长城证券有限责任公司	代垫席位交易保证金、清算备付金	500,000.00	500,000.00
其他应付款	东方证券股份有限公司	代垫席位交易保证金	250,000.00	250,000.00
其他应付款	西北证券有限责任公司	代垫席位交易保证金	250,000.00	250,000.00
应收利息	交通银行	存款利息	1,910.13	312.39
合计			2,235,185.66	2,376,835.06

5、本报告期末流通转让受到限制的基金资产

本基金截至2007年2月11日止流通受限制不能自由转让的基金资产如下:

(1) 因股权分置改革而暂时停牌的股票情况:

股票代码	股票名称	停牌日期	复牌日期	复牌开盘单价	数量	期末估值单价	期末估值总额	估值方法
000895	S双汇	2006−6−1	2007−6−29	57.88	454,600	31.02	14,101,692.00	按股票停牌日的前一日市场平均价估值

(2)因重大事项而暂时停牌的股票情况:

股票代码	股票名称	停牌日期	复牌日期	数量	期末估值单价	期末估值总额	估值方法
000617	S济柴	2007−2−3	2007−3−6	1,359,452	21.26	28,901,949.52	按股票停牌日的前一日市场平均价估值
600967	北方创业	2007−2−8	2007−2−12	900,000	8.98	8,082,000.00	

6、本基金在本报告期内,无或有事项。

第八节 长城久富核心成长股票型证券投资基金(LOF)投资组合报告

(一)期末基金资产组合情况

序号	资产项目	金额(元)	占基金总资产比例
1	股票	8,375,308,385.03	84.76%
2	债券	4,150,129.94	0.04%
3	权证	2,200,868.16	0.02%
4	资产支持证券	0.00	0.00%
5	银行存款和清算备付金合计	1,489,534,143.47	15.07%
6	其它资产	10,307,147.54	0.10%
	合计	9,881,500,674.14	100.00%

(二)期末按行业分类的股票投资组合

分 类	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	430,476,273.25	4.41%
C 制造业	4,490,564,400.51	46.04%
C0 食品、饮料	845,417,662.78	8.67%
C1 纺织、服装、皮毛	72,752,472.69	0.75%
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	1,032,836,917.56	10.59%
C5 电子	37,618,056.61	0.39%
C6 金属、非金属	214,894,651.54	2.20%
C7 机械、设备、仪表	1,970,758,229.41	20.20%
C8 医药、生物制品	314,822,668.52	3.23%
C99 其他制造业	1,463,741.40	0.02%
D 电力、煤气及水的生产和供应业	118,185,991.74	1.21%
E 建筑业	117,792,232.76	1.21%
F 交通运输、仓储业	217,333,574.69	2.23%
G 信息技术业	94,473,890.65	0.97%
H 批发和零售贸易业	159,670,618.00	1.64%
I 金融、保险业	1,500,993,178.03	15.39%
J 房地产业	372,900,331.20	3.82%
K 社会服务业	278,888,484.62	2.86%
L 传播与文化产业	510,859,088.20	5.24%
M 综合类	83,170,321.38	0.85%
合计	8,375,308,385.03	85.86%

(三)期末按市值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票明细

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	期末市值	市值占基金资产净值比例
1	600143	金发科技	13,835,575	533,223,060.50	5.47%
2	600037	歌华有线	18,900,000	494,802,000.00	5.07%
3	000568	泸州老窖	11,709,324	492,962,540.40	5.05%
4	600036	招商银行	19,475,079	478,697,441.82	4.91%
5	600000	浦发银行	9,020,000	330,041,800.00	3.38%
6	601318	中国平安	4,500,000	321,795,000.00	3.30%
7	600030	中信证券	5,500,000	291,335,000.00	2.99%
8	600150	沪东重机	1,805,299	249,564,533.76	2.56%
9	600786	东方锅炉	3,910,466	246,281,148.68	2.52%
10	000157	中联重科	5,946,144	228,926,544.00	2.35%

注:1、以上股票名称以2007年6月30日公布的股票简称为准。

2、投资者欲了解本报告期末基金投资的所有股票明细,应阅读登载于长城基金管理有限公司网站(www.ccfund.com.cn)的半年度报告正文。

(四)报告期内投资组合的重大变动

1、本报告期内累计买入价值超出期末基金资产净值2%或前20名的股票明细如下:

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额(元)	占期末基金资产净值的比例
1	600037	歌华有线	389,468,191.00	3.99%
2	000568	泸州老窖	366,167,908.71	3.75%
3	600143	金发科技	275,558,041.48	2.82%
4	600036	招商银行	271,107,839.85	2.78%
5	600030	中信证券	248,887,406.90	2.55%
6	601318	中国平安	236,414,433.05	2.42%
7	600000	浦发银行	235,459,168.13	2.41%
8	600786	东方锅炉	176,948,563.17	1.81%
9	600050	中国联通	161,220,056.95	1.65%
10	600150	沪东重机	154,220,035.39	1.58%
11	600583	海油工程	138,926,358.15	1.42%
12	000858	五粮液	129,982,207.90	1.33%
13	601988	中国银行	129,855,131.84	1.33%
14	600875	东方电机	128,968,194.77	1.32%
15	000002	万 科A	126,116,511.08	1.29%
16	000157	中联重科	114,564,764.12	1.17%
17	601398	工商银行	114,234,509.54	1.17%
18	600309	烟台万华	110,358,063.97	1.13%
19	600761	安徽合力	107,234,112.76	1.10%
20	600028	中国石化	101,750,150.77	1.04%

2、本报告期内累计卖出价值超出期末基金资产净值2%或前20名的股票明细如下:

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额(元)	占期末基金资产净值的比例
1	600050	中国联通	152,337,226.71	1.56%
2	601988	中国银行	130,949,303.57	1.34%
3	000002	万 科A	121,274,208.63	1.24%
4	000876	新希望	118,590,085.08	1.22%
5	601398	工商银行	112,159,173.45	1.15%
6	600005	武钢股份	101,565,790.43	1.04%
7	600030	中信证券	97,745,898.01	1.00%
8	600795	国电电力	94,294,613.16	0.97%
9	600000	浦发银行	87,610,037.09	0.90%
10	600026	中海发展	85,985,931.46	0.88%
11	600482	风帆股份	64,994,407.53	0.67%
12	600717	天津港	61,619,128.34	0.63%
13	600028	中国石化	60,900,620.38	0.62%
14	000625	长安汽车	59,586,063.13	0.61%
15	600206	有研硅股	55,086,175.83	0.56%
16	000858	五粮液	52,471,956.64	0.54%
17	600569	安阳钢铁	51,651,881.85	0.53%
18	601628	中国人寿	46,972,144.70	0.48%
19	000932	华菱管线	42,141,140.44	0.43%
20	000951	中国重汽	41,170,065.22	0.42%

3、本基金报告期内买入股票总成本和卖出股票总收入:

项目	金额(元)
报告期内买入股票的成本总额	7,890,517,609.49
报告期内卖出股票的收入总额	3,359,453,053.70

(五)按券种分类的债券组合

序号	券种分类	市值(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	企业债	2,893,232.00	0.03%
4	可转换债	1,256,897.94	0.01%
5	央行票据	0.00	0.00%
	合 计	4,150,129.94	0.04%

(六)期末按市值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券明细

序号	债券名称	市值(元)	占基金资产净值比例
1	07武钢债	2,893,232.00	0.03%
2	强业转债	1,256,897.94	0.01%

(七)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

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

(八)投资组合报告附注

1、本报告期内基金投资的前十名证券的发行主体未被监管部门立案调查,或在报告编制日前一年内受到过公开谴责、处罚的情况。

2、本基金投资的前十名股票中,未有投资于超出基金合同规定备选股票库之外的股票。

3、其他资产的构成:

序号	其他资产	金额(元)
1	交易保证金	3,385,827.94
2	应收证券清算款	0.00
3	应收股利	44,344.11
4	应收利息	442,426.96
5	应收申购款	6,434,548.53
6	其他应收款	0.00
7	待摊费用	0.00
	合计	10,307,147.54

4、本基金本期未持有处于转股期的可转换债券。

5、本报告期末按市值占基金资产净值比例大小排序的所有权证明细

权证代码	权证名称	数量(份)	期末市值(元)	市值占基金资产净值比例
031003	深发SFC1	93,521	1,425,260.04	0.0146%
031004	深发SFC2	46,760	775,608.12	0.0080%

6、本基金本报告期内权证投资情况:

权证代码	权证名称	获得认购(沽)权证	获得认购成本(元)	期间买入数量(份)	买入成本(元)	期间卖出数量(份)	卖出收入(元)	期末数量(份)
580013	武钢CWB1	2,731,714	6,330,134.38	0	0.00	2,731,714	10,029,854.46	0
580989	南航JTP1	424,620	0.00	0	0.00	424,620	985,042.05	0
030002	五粮YGC1	0	0.00	0	0.00	50,000	−232,463.81	0
031001	侨城HQC1	0	0.00	100,000	2,870,273.02	100,000	116,513.87	0
031003	深发SFC1	93,521	0.00	0	0.00	0	0.00	93,521
031004	深发SFC2	46,760	0.00	0	0.00	0	0.00	46,760

7、以上各表的股票名称均以2007年6月30日公布的股票简称为准。

8、由于四舍五入的原因,以上各表的分项之和与合计项之间可能存在尾差。

第九节 久富证券投资基金投资组合报告

(一)期末(2007年2月11日)基金资产组合情况

序号	资产项目	金额(元)	占基金总资产比例
1	股票	1,074,968,345.57	78.69%
2	债券	25,341,047.00	1.86%
3	权证	811,750.00	0.06%
4	资产支持证券	0.00	0.00%
5	银行存款和清算备付金合计	264,031,859.37	19.33%
6	其它资产	855,191.86	0.06%
	合计	1,366,008,193.80	100.00%

(二)期末(2007年2月11日)按行业分类的股票投资组合

分 类	市值(元)	占基金资产净值比例
A 农、林、牧、渔业	1,730,778.00	0.13%
B 采掘业	21,840,000.00	1.61%
C 制造业	643,911,206.06	47.47%
C0 食品、饮料	80,490,396.76	5.93%
C1 纺织、服装、皮毛	0.00	0.00%
C2 木材、家具	7,550,000.00	0.56%
C3 造纸、印刷	0.00	0.00%
C4 石油、化学、塑胶、塑料	255,451,950.08	18.83%
C5 电子	5,715,669.36	0.42%
C6 金属、非金属	0.00	0.00%
C7 机械、设备、仪表	186,786,657.59	13.77%
C8 医药、生物制品	107,916,532.27	7.96%
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	24,948,691.60	1.84%
G 信息技术业	0.00	0.00%
H 批发和零售贸易业	16,452,881.28	1.21%
I 金融、保险业	204,082,197.20	15.05%
J 房地产业	84,374,000.00	6.22%
K 社会服务业	37,785,697.29	2.79%
L 传播与文化产业	0.00	0.00%
M 综合类	39,842,894.14	2.94%
合计	1,074,968,345.57	79.25%

(三)期末(2007年2月11日)按市值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票明细

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	期末市值	市值占基金资产净值比例
1	600143	金发科技	2,649,136	138,655,778.24	10.22%
2	600000	浦发银行	3,000,000	68,970,000.00	5.08%
3	600519	贵州茅台	700,000	66,388,000.00	4.89%
4	000002	万 科A	4,400,000	65,384,000.00	4.82%
5	600458	时代新材	3,731,000	60,330,270.00	4.45%
6	600036	招商银行	3,652,520	59,207,349.20	4.37%
7	600867	通化东宝	4,314,400	57,510,952.00	4.24%
8	600030	中信证券	1,585,000	55,443,300.00	4.09%
9	000951	中国重汽	1,687,117	44,624,244.65	3.29%
10	600858	银座股份	1,490,011	39,842,894.14	2.94%

注1:以上股票名称以2007年6月30日公布的股票简称为准。

注2:由于市场波动的原因,致使本基金在报告期末投资的金发科技(代码600143)市值超过了基金资产净值的10%,但在规定的期限内进行了调整。

注3、投资者欲了解本报告期末基金投资的所有股票明细,应阅读登载于长城基金管理有限公司网站(www.ccfund.com.cn)的半年度报告正文。

(四)报告期内(2007年1月1日至2007年2月11日)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20名的股票明细如下:

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额(元)	占期初基金资产净值的比例
1	000617	石油济柴	28,324,948.31	2.40%
2	000581	威孚高科	23,495,319.50	1.99%
3	600309	烟台万华	20,528,594.00	1.74%
4	600967	北方创业	19,175,007.08	1.62%
5	000001	S深发展A	17,311,608.66	1.47%
6	000428	华天酒店	16,061,587.30	1.36%
7	000402	金融街	15,557,498.37	1.32%
8	600693	东百集团	15,273,327.59	1.29%
9	600030	中信证券	15,072,864.74	1.28%
10	600016	民生银行	14,824,572.06	1.26%
11	000858	五粮液	14,480,554.13	1.23%
12	600026	中海发展	14,480,517.58	1.23%
13	000927	一汽夏利	14,053,250.09	1.19%
14	600036	招商银行	11,895,480.64	1.01%
15	002038	双鹭药业	10,770,162.22	0.91%
16	600978	宜华木业	9,573,573.81	0.81%
17	000665	武汉塑料	8,963,283.64	0.76%
18	000951	中国重汽	8,180,250.89	0.69%
19	600867	通化东宝	8,088,323.23	0.69%
20	601006	大秦铁路	7,091,468.47	0.60%

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20名的股票明细如下:

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的比例
1	000568	泸州老窖	47,041,131.96	3.99%
2	600028	中国石化	40,110,830.82	3.40%
3	600000	浦发银行	31,673,627.46	2.68%
4	000718	苏宁环球	25,594,250.78	2.17%
5	600016	民生银行	24,388,918.43	2.07%
6	600143	金发科技	22,171,069.80	1.88%
7	000421	南京中北	21,200,004.07	1.80%
8	000428	华天酒店	19,166,667.67	1.62%
9	600036	招商银行	14,732,773.70	1.25%
10	000858	五粮液	14,208,230.83	1.20%
11	000002	万 科A	13,818,474.78	1.17%
12	600967	北方创业	12,530,638.52	1.06%
13	600690	青岛海尔	10,596,742.01	0.90%
14	000951	中国重汽	9,629,732.75	0.82%
15	002024	苏宁电器	9,390,200.59	0.80%
16	000619	海螺型材	8,923,703.09	0.76%
17	600030	中信证券	8,525,149.74	0.72%
18	000402	金融街	7,539,176.02	0.64%
19	000625	长安汽车	6,195,696.39	0.52%
20	600519	贵州茅台	5,107,038.10	0.43%

3、本基金报告期内买入股票总成本和卖出股票总收入:

项目	金额(元)
报告期内买入股票的成本总额	342,323,730.86
报告期内卖出股票的收入总额	380,020,718.86

(五)按券种分类的债券组合

序号	券种分类	市值(元)	占基金资产净值比例
1	国债	1,047.00	0.00%
2	金融债	0.00	0.00