

(上接 D116 版)

兴科证券投资基金			
2007年1月1日至2007年4月23日期间基金净值变动表			
单位:人民币元			
		2007年1月1日至2007年4月23日期间	2006年1月1日至2006年6月30日期间
期初基金净值	1,085,016,216.29	525,427,966.60	
本期经营活动			
基金净收益	386,988,077.62	216,283,280.49	
未实现估值增值变动数	(74,004,707.66)	67,979,388.06	
经营活动产生的基金净值变动数	312,983,369.96	284,272,668.55	
本期向基金持有人分配收益			
向基金持有人分配收益产生的基金净值变动数	-	-	
期末基金净值	1,397,999,586.25	809,700,565.15	
后附会计报表附注为本会计报表的组成部分。			

## (二) 会计报表附注

(除特别注明外,金额单位为人民币元)

## 1、主要会计政策和会计估计

本报告期会计报表所采用的会计政策、会计估计与上年度会计报表所采用的会计政策、会计估计一致。本会计报表的实际编制期间为2007年1月1日至2007年4月23日。

2、本报告期无重大会计差错的内容和更正金额。

## 3、重大关联方关系及关联交易

## (1) 关联方

关联方名称

华夏基金管理有限公司

交通银行股份有限公司

西部证券股份有限公司(“西部证券”)

中信证券股份有限公司

北京证券有限责任公司

西南证券有限责任公司

中国科技证券有限责任公司

北京国有资产管理有限责任公司

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证券交易及交易费用

本报告期本基金未通过关联方席位进行证券交易。

上年同期本基金通过关联方席位进行证券交易:

2006年1月1日至2006年6月30日								
买卖成交金额		债券回购成交金额		佣金				
成交金额	占成交比例	成交金额	占成交比例	佣金	占证券基金总资产比例			
人民币元		人民币元		人民币元				
西南证券	238,584,606.38	7.06%	30,227,214.60	20.59%	30,000,000.00	9.08%	35,148.56	7.17%
合计	238,584,606.38	7.06%	30,227,214.60	20.59%	30,000,000.00	9.08%	35,148.56	7.17%

上述佣金按市场佣金率计算,以扣除由中国证券登记结算有限责任公司收取,并由券商承担的证券结算风险基金后的净额列示。

该类佣金协议的服务范围还包括佣金收取方为本基金提供的证券投资研究成果和市场信息服务。

## (3) 基金管理人报酬

支付给基金管理人华夏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×1.5%÷当年天数。

本基金在本报告期需支付基金管理人报酬5,636,514.18元(2006年1月1日至2006年6月30日期间:4,820,177.17)元。

## (4) 基金托管费

支付给基金托管人交通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。

本基金在本报告期需支付基金托管费949,252.31元(2006年1月1日至2006年6月30日期间:803,362.84)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交通银行保管,并按银行同业利率计息。基金托管人于2007年4月23日保管的银行存款余额为286,546.99元(2006年6月30日:2,541,760.97)元。本报告期由基金托管人保管的银行存款产生的利息收入为15,182.28元(2006年1月1日至2006年6月30日期间:41,136.42)元。

## (6) 与关联方通过银行间同业市场进行的债券(含回购)交易

本报告期与2006年1月1日至2006年6月30日期间本基金未与关联方进行银行间市场的债券(含回购)交易。

## (7) 本基金关联方及基金管理公司主要股东的控制机构持有的基金份额

2007年4月23日			
基金名称	基金份额(份)	占基金份额比例	本期卖出份额(份)
华夏基金管理有限公司	49,971,721	9.99%	1,060,016
西部证券股份有限公司	3,229,691	0.65%	-
合计	53,201,412	10.64%	1,060,016

  

2006年6月30日			
基金名称	基金份额(份)	占基金份额比例	2006年1月1日至2006年6月30日期间买入的份额(份)
华夏基金管理有限公司	34,976,263	7.00%	32,476,263
西部证券股份有限公司	3,827,916	0.77%	-
合计	38,814,169	7.76%	32,476,263

本基金适用费率为0%。

## 4、流通受限不能自由转让的基金资产

## (1) 流通受限不能自由转让的股票

本基金截至2007年4月23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。

股票代码	股票名称	停牌日期	期末估值单价	复牌日期	复牌后收盘价	数量(股)	期末估值总额
000862	双汇发展	2006-6-1	31.02	2007-6-29	57.88	1,063,700	32,933,934.00
合计						1,063,700	32,933,934.00

本基金截至2007年4月23日止持有的因申购新股获得的股票流通受限情况如下:

股票名称	申购日期	上市日期	可流通日期	申购价格	期末市价	申购数量	成本	市值	占净值比
连华	2007-4-8	2007-4-26	2007-4-26	4.98	4.88	14,000	69,720.00	69,720.00	0.01%
维达	2007-4-18	2007-4-27	2007-4-27	13.69	13.69	8,000	109,520.00	109,520.00	0.01%
恒利科技	2007-4-18	2007-4-27	2007-4-27	8.00	8.00	14,000	112,000.00	112,000.00	0.01%
合计						29,000	291,240.00	291,240.00	0.02%

## (2) 流通受限不能自由转让的债券

本基金截至2007年4月23日止从事证券交易所债券回购交易形成的卖出回购证券余额110,000,000.00元,于2007年4月24日到期。该类交易要求本基金在回购期内持有的证券交易所交易的债券,按证券交易所规定的比例折算为标准券后,不低于债券回购的余额。

## (3) 估值方法

上述流通受限的基金资产估值方法与上年度采用的估值方法一致。

## 七、华夏基金投资组合报告

(报告期末为2007年6月30日,报告期间为2007年4月24日至2007年6月30日)

## (一) 报告期末基金资产组合情况

	金额(元)	占基金总资产比例
股票	22,052,362,024.16	63.38%
债券	1,060,931,286.60	3.05%
权证	-	-
资产支持证券	-	-
银行存款和结算备付金合计	11,652,228,014.27	33.49%
其他资产	27,270,537.10	0.08%
合计	34,792,781,873.33	100.00%

## (二) 报告期末按行业分类的股票投资组合

序号	行业分类	股票市值(元)	市值占基金资产净值比例
A	农林、牧、渔业	-	-
B	采掘业	1,202,886,588.77	3.52%
C	制造业	6,034,069,896.79	19.42%
C0	其中:食品、饮料	1,031,764,463.78	3.02%
C1	纺织、服装、皮毛	60,988,528.56	0.18%
C2	木材、家具	-	-
C3	造纸、印刷	93,937,349.55	0.27%
C4	石油、化学、塑胶、塑料	411,377,190.77	1.20%
C5	电子	9,833,704.01	0.03%
C6	金属、非金属	1,882,269,454.04	5.51%
C7	机械、设备、仪表	2,750,510,845.40	8.06%
C8	医药、生物制品	346,401,508.87	1.01%
C89	其他制造业	46,967,888.42	0.14%
D	电力、煤气及水的生产和供应业	612,388,000.31	1.79%
E	建筑业	214,793,109.92	0.63%
F	交通运输、仓储业	1,013,076,504.35	2.97%
G	信息技术业	1,708,883,583.78	5.00%
H	批发和零售贸易	2,346,776,750.16	6.87%
I	金融、保险业	5,036,429,644.46	14.74%
J	房地产业	1,834,624,021.60	5.37%
K	社会服务业	746,556,723.34	2.18%
L	传播与文化产业	138,798,820.21	0.40%
M	综合类	566,066,283.67	1.66%
合计		22,052,362,024.16	64.55%

## (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)	期末市值(元)	占净值比例
1	600036	招商银行	76,611,688	1,883,115,291.04	5.51%
2	000224	苏宁电器	24,247,947	1,136,683,561.12	3.33%
3	000063	中兴通讯	20,621,849	1,121,828,368.00	3.28%
4	000002	万科 A	43,380,178	840,901,003.36	2.46%
5	600104	上汽汽车	47,664,506	823,166,001.26	2.41%
6	600016	民生银行	60,676,883	693,536,772.89	2.03%
7	601166	兴业银行	18,017,809	622,244,917.81	1.85%
8	601388	工商银行	119,067,139	596,476,266.29	1.75%
9	600000	长江电力	32,670,387	493,975,948.04	1.45%
10	600383	金地集团	14,172,226	484,972,856.10	1.42%

## (四) 报告期末按市值占基金资产净值比例大小排序的前十名债券明细

序号	债券代码	债券名称	数量(份)	期末市值(元)	占净值比例
1	070009	07国债(9)	279,888,000.00	279,888,000.00	0.82%
2	070008	07国债(8)	249,000,000.00	249,000,000.00	0.73%
3	07央行票据 18	07央行票据 18	145,678,027.40	145,678,027.40	0.43%
4	21国债(04)	21国债(04)	133,050,776.00	133,050,776.00	0.39%
5	070002	07国债(2)	99,820,000.00	99,820,000.00	0.29%

## (五) 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

序号	证券名称	市值(元)	占净值比例
1	国债通	863,107,443.40	2.53%
2	金融债	-	-
3	央行票据	194,178,027.40	0.57%
4	企业债	-	-
5	可转债	3,645,827.80	0.01%
合计		1,060,931,286.60	3.11%

## (六) 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明细

序号	债券名称	市值(元)	占净值比例
1	07国债(9)	279,888,000.00	0.82%
2	07国债(8)	249,000,000.00	0.73%
3	07央行票据 18	145,678,027.40	0.43%
4	21国债(04)	133,050,776.00	0.39%
5	070002	99,820,000.00	0.29%

## (七) 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

截至本报告期末,本基金未持有资产支持证券。

## (八) 投资组合报告附注

1. 报告期内本基金投资的前十名证券的发行主体没有被监管部门立案调查的,也没有在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的。

2. 本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。

3. 报告期末本基金持有的权证及报告期内获得的权证

(1) 报告期末本基金持有权证明细

截至本报告期末,本基金未持有权证。

(2) 报告期内本基金获得权证明细

本报告期内,本基金未获得权证。

4. 报告期末本基金的其他资产构成

单位:元

应收利息	11,102,817.11
证券清算款	8,289,857.83
(1) 应收受限不能自由转让的股票	5,306,225.56
交易保证金	2,572,636.60
合计	27,270,537.10

## 5、至本报告期末,本基金持有的处于转股期的可转换债券

截至本报告期末,本基金未持有处于转股期的可转换债券。

## 八、基金兴科投资组合报告

(报告期末为2007年4月23日,报告期间为2007年1月1日至2007年4月23日)

## (一) 报告期末基金资产组合情况

	金额(元)	占基金总资产比例
股票	910,349,036.49	69.06%
债券	278,199,257.90	18.32%
权证	-	-
资产支持证券	-	-
银行存款和清算备付金合计	17,740,742.01	1.17%
其他资产	312,070,111.78	20.56%
合计	1,518,359,147.18	100.00%

## (二) 报告期末按行业分类的股票投资组合

序号	行业分类	股票市值(元)	市值占基金资产净值比例
A	农林、牧、渔业	-	-
B	采掘业	48,413,186.36	3.46%
C	制造业	318,115,795.12	22.76%
C0	其中:食品、饮料	65,929,136.29	4.72%
C1	纺织、服装、皮毛	-	-
C2	木材、家具	-	-
C3	造纸、印刷	-	-
C4	石油、化学、塑胶、塑料	16,359,395.60	1.17%
C5	电子	296,825.00	0.02%
C6	金属、非金属	113,115,728.91	8.09%
C7	机械、设备、仪表	97,740,807.79	6.90%
C8	医药、生物制品	24,449,026.03	1.76%
C89	其他制造业	226,000.00	0.02%
D	电力、煤气及水的生产和供应业	36,537,818.34	2.61%
E	建筑业	-	-
F	交通运输、仓储业	52,468,809.19	3.75%
G	信息技术业	43,370,224.46	3.10%
H	批发和零售贸易	21,390,000.00	1.53%
I	金融、保险业	126,776,850.51	9.71%
J	房地产业	98,706,728.69	7.07%
K	社会服务业	49,216,587.10	3.52%
L	传播与文化产业	27,806,111.26	1.99%
M	综合类	78,496,384.89	5.61%
合计		910,349,036.49	65.12%

## (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)	期末市值(元)	占净值比例
1	000009	华侨城 A	1,749,614	46,977,159.00	3.36%
2	600306	招商银行	2,265,169	45,497,073.89	3.26%
3	600415	小商品城	479,822	41,725,321.12	3.02%
4	600896	张江高科	2,678,651	36,771,563.36	2.69%
5	600009	上海机场	1,169,728	36,074,349.94	2.68%
6	600519	贵州茅台	349,889	32,996,202.00	2.50%
7	000856	S 双汇	1,061,700	32,993,934.00	2.36%
8	600489	中金黄金	599,505	30,397,180.35	2.17%
9	601318	中国平安	529,580	30,129,363.00	2.16%
10	000400	许继电气	1,799,835	29,049,336.90	2.08%

注:投资者欲了解本报告期末基金投资的所有股票明细,应阅读刊载于本基金管理人网站 www.ChinaAMC.com 的半年度报告正文。

## (四) 报告期末基金投资组合的重大变动

## 1. 报告期内累计买入金额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	本期累计买入金额(元)	占期初基金资产净值比例
1	600050	中国联通	97,323,917.89	8.97%
2	000063	中兴通讯	83,980,139.84	7.94%
3	000002	万科 A	75,426,410.89	6.95%
4	600019	宝钢股份	61,523,531.13	5.65%
5	600000	浦发银行	62,116,532.83	5.72%
6	600000	长江电力	60,784,101.76	5.60%
7	600036	招商银行	56,385,179.63	5.14%
8	000898	鞍钢股份	56,676,622.23	5.22%
9	600016	民生银行	56,016,497.01	5.16%
10	000788	吉林高速	49,062,078.15	4.52%
11	600896	张江高科	47,626,498.36	4.39%
12	600066	宝钢股份	47,280,179.30	4.36%
13	000023	吉林敖东	44,614,0	