博时新兴成长股票型证券投资基金 2007 年年度报告摘要

(上接 D76 版)

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	期末成本总额	期末估值总额
601007	金陵饭店	07/04/06	07/07/10	新股网下申购	4.25	12.58	106,196	451,333.00	1,335,945.68
002130	沃尔核材	07/04/20	07/07/20	新股网下申购	15.72	45.81	15,964	250,954.08	731,310.84
合 计								702,287.08	2,067,256.52

7.风险管理

(a)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是信用风险、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。

本基金管理人奉行全面风险管理体系的建设,在董事会下设立风险管理委员会,负责制定风险管理的宏观政策,审议通过风险控制的总体措施等;在管理层层面设立风险控制委员会,讨论和制定公司日常经营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监察法律部负责,协调并与各部门合作完成运作风险管理以及进行投资风险分析与绩效评估。监察法律部对公司执行总裁负责。

本基金管理人建立了以风险管理委员会为核心的、由执行总裁和风险控制委员会、督察长、监察法律部和相关业务部门构成的风险管理架构体系。

(b)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%,且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。

(c)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,其余亦可银行间同业市场交易,因此除在附注 6 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,其余均能及时变现。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投资的公允价值。本基金所持有的金融负债的合约约定到期日均为一个月以内且不计息,因此账面余额即为未折现的合约约到期现金流量。

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。

(d)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。

(i)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。

本基金投资于股票、债券的比例不低于基金资产总值的 80%,投资于国家债券的比例不低于基金资产净值的 20%。于 2007 年 7 月 5 日(基金合同失效前日),本基金面临的整体市场价格风险列示如下:

	2007年7月5日(基金合同失效前日)		2006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	1,053,370,762.28	76.74%	813,838,995.47	77.61%
– 债券投资	295,952,870.00	21.56%	216,253,550.00	20.62%
衍生金融资产				
– 权证投资	–	–	5,481,261.09	0.52%
	1,349,323,632.28	98.30%	1,035,573,806.56	98.75%

本基金以“上证指数 X80%+ 国债指数 X20%”为基础衡量市场价格风险。于 2007 年 7 月 5 日(基金合同失效前日),若“上证指数 X80%+ 国债指数 X20%”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 3,363 万元(2006 年:2,801 万元);反之,若“上证指数 X80%+ 国债指数 X20%”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 3,363 万元(2006 年:2,801 万元)。

(ii)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交易形成负债的公允价值,并按照合约规定的重新定价日或到期日孰早者进行了分类。

2007年7月5日 (基金合同失效前日)	1年以内	1至5年	5年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	2,942,092.26	–	–	–	2,942,092.26
结算备付金	16,156,957.56	–	–	–	16,156,957.56
存出保证金	–	–	–	1,685,218.65	1,685,218.65
交易性金融资产	268,022,180.00	27,930,690.00	–	1,053,370,762.28	1,349,323,632.28
应收利息	–	–	–	3,781,573.54	3,781,573.54
应收股利	–	–	–	490,467.78	490,467.78
资产总计	287,121,229.82	27,930,690.00	–	1,059,328,022.25	1,374,379,942.07
负债					
应付管理人报酬	–	–	–	295,650.08	295,650.08
应付托管费	–	–	–	49,275.00	49,275.00
应付交易费用	–	–	–	102,918.18	102,918.18
应交税费	–	–	–	78,252.80	78,252.80
应付利润	–	–	–	128,750.52	128,750.52
其他负债	–	–	–	1,079,286.21	1,079,286.21
负债总计	–	–	–	1,734,132.79	1,734,132.79
利率敏感度缺口	287,121,229.82	27,930,690.00	–	1,057,593,889.46	1,372,645,809.28

2006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	6,643,880.04	–	–	–	6,643,880.04
结算备付金	12,249,617.13	–	–	–	12,249,617.13
存出保证金	–	–	–	359,609.61	359,609.61
交易性金融资产	87,120,030.00	29,083,520.00	100,050,000.00	813,838,995.47	1,030,092,545.47
衍生金融资产	–	–	–	5,481,261.09	5,481,261.09
应收利息	–	–	–	2,089,528.80	2,089,528.80
资产总计	106,013,527.17	29,083,520.00	100,050,000.00	821,769,394.97	1,056,916,442.14
负债					
应付证券清算款	–	–	–	4,809,567.77	4,809,567.77
应付管理人报酬	–	–	–	1,222,134.93	1,222,134.93
应付托管费	–	–	–	203,689.15	203,689.15
应付交易费用	–	–	–	1,096,731.30	1,096,731.30
应交税费				78,252.80	78,252.80
应付利润	–	–	–	128,750.52	128,750.52
其他负债	–	–	–	814,500.00	814,500.00
负债总计	–	–	–	8,353,626.47	8,353,626.47
利率敏感度缺口	106,013,527.17	29,083,520.00	100,050,000.00	813,415,768.50	1,048,562,815.67

于 2007 年 7 月 5 日(基金合同失效前日),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 49 万元(2006 年:165 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约 49 万元(2006 年:165 万元)。

(ii)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。

8.首次执行企业会计准则

如附注 2 所述,本财务报表为本基金首份按照企业会计准则编制的财务报表。2006 年度和 2007 年 1 月 1 日至 2007 年 6 月 30 日止期间的相关比较数字已按照《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,所有报表项目已按照本财务报表的披露方式进行了重分类。

按照会计准则和制度列报的 2006 年 1 月 1 日、2006 年 12 月 31 日和 2007 年 6 月 30 日的所有者权益,以及 2006 年度和 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:

	2006年初所有者权益	2006年度净损益 / 利润总额	2006年末所有者权益
按原会计准则和制度列报的金额	521,788,894.25	253,814,296.41	1,048,562,815.67
以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产(附注 2)	–	275,459,614.71	–
按企业会计准则列报的金额	521,788,894.25	529,273,911.12	1,048,562,815.67

	2007年初所有者权益	2007年上半年净损益 / 利润总额(未经审计)	2007年上半年末所有者权益(未经审计)
按原会计准则和制度列报的金额	1,048,562,815.67	717,849,364.58	1,453,671,124.83
以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产(附注 2)	–	(62,741,055.42)	–
按企业会计准则列报的金额	1,048,562,815.67	655,108,309.16	1,453,671,124.83

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。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、博时新兴成长基金投资组合报告

(一)本报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例
1	股票投资	23,958,925,097.32	72.04%
2	债券投资	16,157,690.00	0.05%
3	权证投资	6,906,731.08	0.02%
4	银行存款和结算备付金	9,071,279,813.78	27.28%
5	其它资产	202,521,204.18	0.61%
6	合计	33,255,790,536.36	100.00%

(二)本报告期末按行业分类的股票投资组合

序号	行业	股票市值(元)	占基金资产净值比例
A	农、林、牧、渔业	17,659,882.00	0.05%
B	采掘业	1,978,109,921.25	5.99%
C	制造业	8,481,422,747.88	25.70%
C0	其中:食品、饮料	919,399,129.78	2.79%
C1	纺织、服装、皮毛	13,630,000.00	0.04%
C2	木材、家具	0.00	0.00%
C3	造纸、印刷	100,683,622.50	0.31%
C4	石油、化学、塑胶、塑料	351,033,585.30	1.06%
C5	电子	239,922.80	0.00%
C6	金属、非金属	2,522,437,291.90	7.64%
C7	机械、设备、仪表	4,464,012,413.83	13.53%
C8	医药、生物制品	109,986,781.77	0.33%
C99	其他制造业	0.00	0.00%
D	电力、煤气及水的生产和供应业	1,269,130,487.28	3.85%
E	建筑业	0.00	0.00%
F	交通运输、仓储业	3,220,857,974.99	9.76%
G	信息技术业	1,518,724,331.68	4.60%
H	批发和零售贸易	804,187,973.22	2.44%
I	金融、保险业	5,391,976,192.88	16.34%
J	房地产业	1,095,649,609.46	3.32%
K	社会服务业	112,400,640.40	0.34%
L	传播与文化产业	331,392.28	0.00%
M	综合类	68,473,944.00	0.21%
	合 计	23,958,925,097.32	72.60%

(三)本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	股票数量	期末市值(元)	市值占基金资产净值比例
1	600030	中信证券	17,106,117.00	1,527,063,064.59	4.63%
2	600050	中国联通	121,999,826.00	1,473,757,898.08	4.47%
3	601006	大秦铁路	38,614,802.00	989,311,227.24	3.00%
4	600717	天津港	35,159,299.00	963,364,792.60	2.92%
5	600036	招商银行	23,907,273.00	947,445,228.99	2.87%
6	000002	万 科 A	29,840,464.00	860,598,981.76	2.61%
7	600031	三一重工	15,021,675.00	856,836,342.00	2.60%
8	601169	北京银行	41,101,392.00	836,824,341.12	2.54%
9	600000	浦发银行	13,563,131.00	716,133,316.80	2.17%
10	000651	格力电器	11,921,055.00	588,304,064.25	1.78%

投资者欲了解本报告期末基金投资的所有股票明细,应阅读登载于博时基金管理有限公司网站的年度报告正文。

(四)本报告期内股票投资组合的重大变动

1.本期累计买入价值占期末基金资产净值比例的前二十名股票明细

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额(元)	占期末基金资产净值的比例
1	600030	中信证券	1,972,682,083.89	5.98%
2	000002	万 科 A	1,244,678,797.32	3.77%
3	600036	招商银行	1,065,618,865.90	3.23%
4	600717	天津港	1,024,421,975.69	3.10%
5	600050	中国联通	887,424,937.68	2.69%
6	600031	三一重工	841,676,385.67	2.55%
7	601169	北京银行	837,837,138.60	2.54%
8	601006	大秦铁路	759,821,843.08	2.30%
9	601939	建设银行	683,964,695.64	2.07%
10	600005	武钢股份	614,359,082.32	1.86%
11	600000	浦发银行	613,617,790.49	1.86%
12	600104	上海汽车	536,569,701.31	1.63%
13	000651	格力电器	502,299,676.31	1.52%
14	600019	宝钢股份	500,414,721.88	1.52%
15	000001	深发展 A	488,371,630.06	1.48%
16	600009	上海机场	486,293,654.23	1.47%
17	600028	中国石化	433,838,524.64	1.31%
18	600900	长江电力	424,918,586.39	1.29%
19	000858	五 粮 液	409,968,967.58	1.24%
20	000625	长安汽车	406,424,887.85	1.23%

2.本期累计卖出价值占期末基金资产净值比例大小排序的前二十名股票明细

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额(元)	占期末基金资产净值的比例
1	600030	中信证券	575,159,902.77	1.74%
2	600005	武钢股份	427,443,386.31	1.30%
3	601939	建设银行	362,332,668.27	1.10%
4	600019	宝钢股份	346,663,801.91	1.05%
5	000002	万 科 A	335,069,097.94	1.02%
6	600036	招商银行	315,450,878.04	0.96%
7	601398	工商银行	312,935,112.60	0.95%
8	600357	承德钒钛	204,455,179.50	0.62%
9	000001	深发展 A	202,832,501.17	0.61%
10	000623	吉林敖东	192,204,926.50	0.58%
11	600362	江西铜业	159,446,040.33	0.48%
12	600383	金地集团	140,073,903.52	0.42%
13	000878	云南铜业	134,256,584.81	0.41%
14	601318	中国平安	90,359,571.10	0.27%
15	601390	中国中铁	64,612,048.60	0.20%
16	600835	上海机电	64,547,741.19	0.20%
17	000983	西山煤电	59,075,519.92	0.18%
18	601808	中海油服	56,792,647.54	0.17%
19	601628	中国人寿	53,265,698.55	0.16%
20	000060	中金岭南	51,816,960.80	0.16%

3.本报告期内买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位:元

买入股票的成本总额	24,877,355,590.39
卖出股票的收入总额	4,798,915,948.42

(五)本报告期末按券种分类的债券投资组合

序号	债券名称	期末市值(元)	市值占基金资产净值比例
1	国家债券	0.00	0.00%
2	金融债券	0.00	0.00%
3	央行票据	0.00	0.00%
4	企业债券	15,161,288.00	0.05%
5	可转换债券	996,402.00	0.00%
6	债券投资合计	16,157,690.00	0.05%

(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明细

序号	债券名称	期末市值(元)	市值占基金资产净值比例
1	08上汽债	15,161,288.00	0.05%
2	唐钢转债	996,402.00	0.00%
3	–	–	–
4	–	–	–
5	–	–	–

(七)投资组合报告附注

1.报告期内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,或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚;

2.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;

3.基金的其他资产包括:存出保证金5,856,409.27元,应收利息4,463,314.9元,应收申购款116,964,997.85元,应收证券清算款75,236,482.16元;

4.本报告期末未持有处于转股期的可转换债券;

5.本报告期末未持有资产支持证券;

6.本报告期内基金主动从一级市场投资分离交易可转债和权证的明细:

可分离债名称	代码	名称	数量	成本总额(元)
07深高债	126006	07深高债	162,000(张)	11,234,488.75
	580014	深高 CWB1	1,166,400(份)	4,965,511.25
08上汽债	126008	08上汽债	211,160(张)	15,048,892.65
	580016	上汽 CWB1	760,176(份)	6,067,107.35

7.由于四舍五入的原因,分项之和与合计项之间可能存在尾差。

九、原基金裕华投资组合报告(截至 2007 年 7 月 5 日)

(一)本报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例
1	股票投资	1,053,370,762.28	76.64%
2	债券投资	295,952,870.00	21.53%
3	权证投资	0.00	0.00%
4	银行存款和结算备付金	19,099,049.82	1.39%
5	其它资产	5,957,259.97	0.43%
6	合计	1,374,379,942.07	100.00%

(二)本报告期末按行业分类的股票投资组合

序号	行业	股票市值(元)	占基金资产净值比例
A	农、林、牧、渔业	0.00	0.00%
B	采掘业	109,202,676.68	7.96%
C	制造业	322,363,962.11	23.48%
C0	其中:食品、饮料	72,629,847.07	5.29%
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	35,198,900.00	2.56%
C4	石油、化学、塑胶、塑料	33,840,188.90	2.47%
C5	电子	0.00	0.00%
C6	金属、非金属	72,619,426.64	5.29%
C7	机械、设备、仪表	65,962,870.49	4.80%
C8	医药、生物制品	41,391,408.17	3.02%
C99	其他制造业	731,310.84	0.05%
D	电力、煤气及水的生产和供应业	39,480,000.00	2.88%
E	建筑业	0.00	0.00%
F	交通运输、仓储业	28,559,790.00	2.08%
G	信息技术业	0.00	0.00%
H	批发和零售贸易	29,407,559.46	2.14%
I	金融、保险业	461,814,838.35	33.64%
J	房地产业	58,369,000.00	4.25%
K	社会服务业	1,335,945.68	0.10%
L	传播与文化产业	0.00	0.00%
M	综合类	2,837,000.00	0.21%
	合 计	1,053,370,762.28	76.74%

(三)本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	股票数量	期末市值(元)	市值占基金资产净值比例
1	600000	浦发银行	3,199,897	107,356,544.35	7.82%
2	600030	深发展 A	3,699,891	93,237,253.20	6.79%
3	600036	云南铜业	2,001,638	72,619,426.64	5.29%
4	600104	中国平安	983,224	68,953,499.12	5.02%
5	600351	中国人寿	1,749,938	68,737,564.64	5.01%
6	600519	中信证券	1,299,946	64,360,326.46	4.69%
7	600572	招商银行	2,499,774	59,169,650.58	4.31%
8	600814	万 科 A	2,400,000	44,544,000.00	3.25%
9	600827	双汇发展	972,397	44,535,782.60	3.24%
10	600858	深能源 A	2,000,000	39,480,000.00	2.88%

投资者欲了解本报告期末基金投资的所有股票明细,应阅读登载于博时基金管理有限公司网站的年度报告正文。

(四)本报告期内股票投资组合的重大变动(以下数据按旧会计核算办法统计)

1.本期累计买入价值超出期初基金资产净值 2%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的比例
1	600000	浦发银行	130,820,272.34	12.48%
2	000001	深发展 A	103,298,667.96	9.85%
3	601628	中国人寿	91,238,405.31	8.70%
4	601318	中国平安	71,432,705.42	6.81%
5	600036	招商银行	63,082,426.44	6.02%
6	000027	深能源 A	60,296,746.64	5.75%
7	600030	中信证券	54,785,978.78	5.22%
8	000878	云南铜业	52,653,385.70	5.02%
9	600261	浙江阳光	42,741,308.10	4.08%
10	600104	上海汽车	42,147,136.34	4.02%
11	600028	中国石化	40,118,806.76	3.83%
12	600963	岳阳纸业	39,055,417.30	3.72%
13	000002	万 科 A	38,163,191.47	3.64%
14	600019	宝钢股份	33,321,719.07	3.18%
15	000983	西山煤电	32,460,734.52	3.10%
16	600016	民生银行	32,192,902.92	3.07%
17	600005	武钢股份	26,239,615.90	2.50%
18	000039	中集集团	26,018,706.15	2.48%
19	601919	中国远洋	25,330,496.75	2.42%
20	000530	大冶股份	24,973,361.27	2.38%
21	600675	中华企业	24,299,326.87	2.32%
22	600900	长江电力	23,894,165.95	2.28%
23	601666	平煤天安	23,402,820.75	2.23%
24	000927	一汽夏利	23,332,180.75	2.23%
25	600642	申能股份	23,118,693.45	2.20%
26	601699	潞安环能	22,546,224.39	2.15%
27	600001	邯郸钢铁	22,492,417.34	2.15%
28	600351	亚宝药业	22,213,093.55	2.12%

2.本期累计卖出价值超出期初基金资产净值 2%的股票明细

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的比例
1	600000	浦发银行	132,687,138.06	12.65%
2	600028	中国石化	94,420,812.80	9.00%
3	600036	招商银行	88,114,855.81	8.40%
4	000858	五 粮 液	80,850,458.46	7.71%
5	000972	新 中 基	73,431,441.73	7.00%
6	600383	金地集团	69,231,743.55	6.60%
7	600005	武钢股份	63,110,551.46	6.02%
8	600900	长江电力	61,523,474.47	5.87%
9	600261	浙江阳光	50,884,488.71	4.85%
10	000528	柳 工	48,936,221.80	4.67%
11	000807	云铝股份	44,589,143.59	4.25%
12	000831	关铝股份	42,014,426.96	4.01%
13	000002	万 科 A	38,168,954.36	3.64%
14	600019	宝钢股份	37,730,939.50	3.60%
15	000027	深能源 A	35,589,793.55	3.39%
16	600055	万东医疗	35,392,073.16	3.38%
17	000338	潍柴动力	33,471,393.92	3.19%
18	600016	民生银行	33,399,375.50	3.19%
19	600031	三一重工	33,004,134.45	3.15%
20	000001	深发展 A	31,451,595.88	3.00%
21	600582	天地科技	28,975,887.09	2.76%
22	601666	平煤天安	28,888,054.11	2.76%
23	000875	吉电股份	28,590,627.09	2.73%
24	600675	中华企业	27,974,941.66	2.67%
25	600642	申能股份	27,549,599.69	2.63%
26	600063	皖维高新	27,008,582.82	2.58%
27	600329	中新药业	26,644,098.91	2.54%
28	600001	邯郸钢铁	25,602,155.11	2.44%
29	000039	中集集团	25,374,817.03	2.42%
30	600887	伊利股份	24,918,947.30	2.38%
31	000099	中信商直	24,752,518.92	2.36%
32	600666	西南药业	22,324,386.95	2.13%
33	600680	山推股份	21,967,854.51	2.10%
34	000961	中国糖六	21,433,503.67	2.04%
35	600481	双良股份	21,283,726.20	2.03%
36	000927	一汽夏利	21,278,851.41	2.03%

3.本报告期内买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位:元

买入股票的成本总额	1,993,462,824.10
卖出股票的收入总额	2,332,515,412.85

(五)本报告期末按券种分类的债券投资组合

序号	债券名称	期末市值(元)	市值占基金资产净值比例
1	国家债券	148,575,870.00	10.82%
2	金融债券	50,327,000.00	3.67%
3	央行票据	97,050,000.00	7.07%
4	企业债券	0.00	0.00%
5	可转换债券	0.00	0.00%
6	债券投资合计	295,952,870.00	21.56%

(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明细

序号	债券名称	期末市值(元)	市值占基金资产净值比例
1	07央行票据 09	97,050,000.00	7.07%
2	20国债(0)	76,478,750.00	5.57%
3	99国开 02	40,284,000.00	2.93%
4	21国债(9)	27,930,690.00	2.03%
5	21国债(3)	23,995,600.00	1.75%

(七)投资组合报告附注

1.报告期内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,或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚;

2.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;

3.基金的其他资产包括:存出保证金 1,685,218.65 元,应收利息 3,781,573.54 元,应收股利 490,467.78 元;

4.报告期末未持有分离交易可转债和处于转股期的可转换债券;

5.报告期末未持有资产支持证券;

6.报告期末未持有权证;

7.报告期内基金被动持有的权证投资明细:

代码	名称	数量(份)	成本总额(元)
038010	赤湾 NSP1	218,180	0.00
031003	深发 SFC1	369,989	0.00
031004	深发 SFC2	184,995	0.00

8.由于四舍五入的原因,分项之和与合计项之间可能存在尾差。

十、基金份额持有人户数、持有人结构及前十名持有人

(一)博时新兴成长基金持有人户数和持有人结构

1.基金份额持有人户数

基金份额持有人户数	1,344,534
平均每户持有基金份额(份)	21,976.98

2.基金份额持有人结构

	持有份额(份)	占总份额的比例
机构投资者	983,003,362.67	3.33%
个人投资者	28,565,795,935.18	96.67%
合 计	29,548,799,297.85	100.00%

3.报告期末基金管理公司的基金从业人员投资本基金的情况

项 目	期末持有本基金份额的总量(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	864.82	0.0000029%

(二)原基金裕华持有人户数、持有人结构及前十名持有人(截至 2007 年 7 月 5 日)

1.基金份额持有人户数

基金份额持有人户数	12,689
平均每户持有基金份额(份)	39,404

2.基金份额持有人结构

	持有份额(份)	占总份额的比例
机构投资者	306,502,291.00	61.30%
个人投资者	193,497,709.00	38.70%
合 计	500,000,000.00	100.00%

3.基金前十名持有人的名称、持有份额及占总份额的比例

序号	持有人名称	持有份额(份)	占总份额的比例
1	新华人寿保险股份有限公司	27,637,210.00	5.53%
2	中国平安保险(集团)股份有限公司	25,055,813.00	5.01%
3	中国人寿保险股份有限公司	23,138,612.00	4.63%
4	CITIGROUP GLOBAL MARKETS LIMITED	21,072,459.00	4.21%
5	泰康人寿保险股份有限公司	20,929,109.00	4.19%
6	中国人寿保险(集团)公司	18,453,647.00	3.69%
7	生命人寿保险股份有限公司–传统–普通保险产品	18,106,155.00	3.62%
8	中信信托投资有限责任公司–财富二号信托产品	14,999,253.00	3.00%
9	申银万国–澳打–BARCLAYS BANK PLC	14,930,466.00	2.99%
10	中国太平洋保险(集团)股份有限公司	9,696,156.00	1.94%

注:本排名依据交易所提供的基金前 100 名持有人名册,按持有人名称汇总后所得。

十一、博时新兴成长基金份额变动情况

序号	项目	份额(份)
1	基金合同生效日的基金份额总额	500,000,000.00
2	报告期末基金份额总额	29,548,799,297.85
3	报告期初基金份额总额	500,000,000.00
4	报告期间因份额拆分增加份额	1,375,791,603.75
5	报告期间基金总申购份额	33,955,160,363.97
6	报告期间基金总赎回份额	6,282,152,669.87

十二、重大事件揭示

(一)基金管理业务、基金财产、基金托管业务在本报告期内没有发生诉讼事项;

(二)2007 年 12 月 26 日,经过公开拍卖,招商证券股份有限公司竞得我司 48%的股权,根据相关法律规定,该股权转让需经中国证监会批准,股权变更最终以监管部门批准及相关的工商登记变更为准。

(三)本报告期内,本基金管理人副总经理王德英先生任职,相关公告已于 2007 年 3 月 28 日分别刊登在中国证券报、上海证券报、证券时报上;

(四)本报告期内,本基金管理人督察长刘纯兆先生离任,相关公告已于 2007 年 3 月 31 日分别刊登在中国证券报、上海证券报、证券时报上;

(五)本报告期内,本基金管理人督察长孙齾清女士任职,相关公告已于 2007 年 4 月 17 日分别刊登在中国证券报、上海证券报、证券时报上;

(六)基金托管人交通银行于 2007 年 10 月 19 日公布了《交通银行股份有限公司关于基金托管行业高管人员变动的公告》,交通银行资产托管部原总经理阮红同志不再担任资产托管部总经理职务。