博时第三产业成长股票证券投资基金2007年年度报告摘要

（上接D71版）

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，相应的未实现损益平准金现按企业会计准则直接记入“未分配利润/(累计亏损)”科目。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。

七、基金裕元审计报告

普华永道中天审字(2008)第20267号

裕元证券投资基金全体基金份额持有人：

我们审计了后附的裕元证券投资基金(以下简称“基金裕元”)财务报表，包括2007年4月11日(基金合同失效前日)的资产负债表、2007年1月1日至2007年4月11日(基金合同失效前日)止期间的经营业绩表、基金净值变动表和财务报表附注。

（一）管理层对财务报表的责任

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》、《裕元证券投资基金基金合同》和中国证券监督管理委员会允许的如财务报表附注所列示的基金行业实务操作的有关规定编制财务报表是基金裕元的基金管理人博时基金管理有限公司管理层的责任。这种责任包括：

(1)设计、实施和维护与财务报表编制相关的内部控制，以使财务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财务报表发表审计意见。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财务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，以获取有关财务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财务报表重大错报风险的评估。在进行风险评估时，我们考虑与财务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，以及评价财务报表的总体列报。

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，上述财务报表已经按照企业会计准则、《金融企业会计制度》、《证券投资基金会计核算办法》、《裕元证券投资基金基金合同》和中国证券监督管理委员会允许的如财务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裕元2007年4月11日(基金合同失效前日)的财务状况以及2007年1月1日至2007年4月11日(基金合同失效前日)止期间的经营成果和基金净值变动。

普华永道中天　　注册会计师 薛 竞

会计师事务所有限公司

中国·上海市　　注册会计师 陈 宇

2008年3月20日

八、基金裕元财务会计报告

1、裕元证券投资基金

2007年4月11日（基金合同失效前日）资产负债表

单位：人民币元

资产	2007年4月11日（基金合同失效前日）	2006年12月31日
银行存款	37,726,032.81	229,652,328.14
结算备付金	4,138,411.38	4,124,224.41
交易保证金	854,792.32	348,780.49
应收利息	11,487,966.95	6,743,082.71
股票投资市值	2,490,078,794.15	2,310,071,694.23
其中：股票投资成本	1,271,209,323.03	1,262,706,971.01
债券投资市值	663,523,820.80	617,001,738.60
其中：债券投资成本	662,772,061.07	616,319,162.01
权证投资	6,948,077.41	12,983,990.09
其中：权证投资成本	5,559,661.53	0.00
资产总计	3,214,757,895.82	3,180,925,838.67
负债与持有人权益		
负债		
应付证券清算款	10,394,056.07	172,767,561.23
应付管理人报酬	1,451,089.52	3,510,649.38
应付托管费	241,848.26	585,108.21
应付佣金	258,823.68	979,802.87
其他应付款	1,454,965.35	1,370,275.91
预提费用	205,151.10	140,000.00
负债合计	14,005,933.98	179,353,397.60
持有人权益		
实收基金	1,500,000,000.00	1,500,000,000.00
未实现利得	1,221,009,646.73	1,061,031,289.90
未分配基金净收益	479,742,315.11	440,541,151.17
持有人权益合计	3,200,751,961.84	3,001,572,441.07
(2007年4月11日（基金合同失效前日）基金份额资产净值:2.1338元)		
(2006年12月31日基金份额资产净值:2.0010元)		
负债及持有人权益总计	3,214,757,895.82	3,180,925,838.67

2、裕元证券投资基金经营业绩表

2007年1月1日至2007年04月11日（基金合同失效前日）止期间

单位：人民币元

项目	2007年1月1日至2007年4月11日（基金合同失效前日）止期间	2006年度
收入		
股票差价收入	474,626,717.11	421,264,847.16
债券差价损失	(146,354.64)	(9,412,740.29)
权证差价收入	12,932,123.02	21,403,991.18
债券利息收入	5,827,053.42	12,305,722.35
存款利息收入	1,075,792.51	1,667,540.07
股利收入	75,613.53	30,960,389.42
其他收入	0.00	18,303.17
收入合计	494,390,944.95	478,208,053.06
费用		
基金管理人报酬	(13,400,773.49)	(30,213,708.97)
基金托管费	(2,233,462.29)	(5,035,679.69)
卖出回购证券支出	(3,011,830.42)	(4,043,354.02)
其他费用	(1,543,714.81)	(587,366.75)
其中：上市年费	(20,000.00)	(60,000.00)
信息披露费	(83,013.92)	(300,000.00)
审计费用	(22,137.18)	(80,000.00)
费用合计	(20,189,781.01)	(39,880,109.43)
基金净收益	474,201,163.94	438,327,943.63
加：未实现估值增值变动数	159,978,356.83	965,782,481.11
基金经营业绩	634,179,520.77	1,404,110,424.74

3、基金收益分配表

2007年1月1日至2007年04月11日（基金合同失效前日）止期间

单位：人民币元

项目	2007年1月1日至2007年4月11日（基金合同失效前日）止期间	2006年度
基金净收益	474,201,163.94	438,327,943.63
加：年/(期)初基金净收益	440,541,151.17	33,713,207.53
可供分配基金净收益	914,742,315.11	472,041,151.16
减：本年/(期)已分配基金净收益	(435,000,000.00)	(31,499,999.99)
未分配基金净收益	479,742,315.11	440,541,151.17

4、基金净值变动表

2007年1月1日至2007年04月11日（基金合同失效前日）止期间

单位：人民币元

项目	2007年1月1日至2007年4月11日（基金合同失效前日）止期间	2006年度
年/(期)初基金净值	3,001,572,441.07	1,628,962,016.32
本年/(期)经营活动		
基金净收益	474,201,163.94	438,327,943.63
未实现估值增值变动数	159,978,356.83	965,782,481.11
经营活动产生的基金净值变动数	634,179,520.77	1,404,110,424.74
本年/（期）向基金份额持有人分配收益		
向基金持有人分配收益产生的基金净值变动数	(435,000,000.00)	(31,499,999.99)
年/(期)末基金净值	3,200,751,961.84	3,001,572,441.07

（二）会计报表附注

1、基金基本情况

裕元证券投资基金(以下简称“本基金”，原湘证证券投资基金)的前身是湖南证券股份有限公司投资受益基金(以下简称“湘证基金”)。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[1999]24号文批准，1999年9月8日湘证基金持有人大会决议通过，并经中国证监会基金监管部[1999]21号文确认，湘证基金进行了规范清理，并于1999年9月19日办理了产权交易手续。博时基金管理有限公司在受让湘证基金原发起人湖南证券股份有限公司(后更名及以下称为“泰阳证券有限责任公司”)持有的200万份基金份额后，成为基金发起人。泰阳证券有限责任公司尚持有200万份基金份额，仍为基金发起人。根据新通过的基金契约(于2004年10月16日起更名为《裕元证券投资基金基金合同》)，基金管理人更换为博时基金管理有限公司，基金托管人更换为中国工商银行股份有限公司，基金为契约型封闭式，发行规模为2亿份基金份额，存续期调整为1992年6月1日至2002年5月31日，并更名为湘证证券投资基金。本基金经上海证券交易所(以下简称“上交所”)上证上字[1999]69号文审核同意，于1999年10月28日在上交所挂牌交易。

经1999年9月8日湘证基金持有人大会决议及中国证监会证监基金字[1999]31号文批准，湘证证券投资基金于1999年11月11日将基金份额总份额由原有2亿份基金份额扩募至15亿份基金份额，存续期限延长5年至2007年5月31日，扩募后更名为裕元证券投资基金。原基金持有人获配认购的基金份额于1999年11月15日在上交所上市交易。

根据基金裕元基金份额持有人大会2007年3月3日审议通过的《关于裕元证券投资基金转型有关事项的议案》以及中国证监会证监基金字[2007]85号《关于核准裕元证券投资基金基金份额持有人大会决议的批复》，基金裕元的基金管理人博时基金管理有限公司于2007年3月29日发布《裕元证券投资基金基金份额持有人大会决议生效公告》，向上海证券交易所申请提前终止基金裕元的上市交易，并获上海证券交易所上证债字[2007]23号《关于裕元证券投资基金终止上市的决定》同意。根据《中华人民共和国证券投资基金法》、《证券投资基金运作管理办法》、《裕元证券投资基金基金合同》、《上海证券交易所证券投资基金上市规则》、中国证监会《关于核准裕元证券投资基金基金份额持有人大会决议的批复》和《裕元证券投资基金基金份额持有人大会决议生效公告》等的有关规定，基金裕元于2007年4月11日进行终止上市权利登记，2007年4月12日终止上市，《裕元证券投资基金基金合同》自终止上市起失效。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和中国证监会基金监管部(1999)21号文的有关规定，本基金的投资范围为国内依法公开发行、上市的股票、债券及中国证监会批准的允许基金投资的其他金融工具。

2、财务报表编制基础

本基金的财务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》、《裕元证券投资基金基金合同》和中国证监会允许的如财务报表附注所列示的基金行业实务操作的有关规定编制。

经中国证监会批准并经上海证券交易所同意，基金管理人博时基金管理有限公司将本基金于基金合同失效日转型为博时第三产业成长股票证券投资基金并相应延长存续期至不定期，因此本基金财务报表仍以持续经营假设为编制基础。

3、主要会计政策和会计估计

(a)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。本期财务报表的实际编制期间为2007年1月1日至2007年4月11日(基金合同失效前日)。

(b)记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

(c)记账基础和计价原则

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。

(d)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；由于配股和非定向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

买入权证于交易日确认为权证投资。从获赠确认日或因认购新发行分离交易可转债而取得的权证从实际取得日起到卖出成交日或行权日止，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，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。

(e)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，于股权分置方案实施复牌日冲减股票投资成本。

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附注3(e)(iii)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于成交日结转。

(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。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投资成本。

(f)收入/(损失)的确认和计量

股票差价收入/(损失)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/(损失)于卖出成交日确认；银行间同业市场交易的债券差价收入/(损失)于实际收到全部价款时确认。债券差价收入/(损失)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/(损失)于卖出权证成交日按卖出权证成交总额与其成本及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。

(g)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1.5%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。

(h)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。

(i)基金的收益分配政策

每一基金份额享有同等分配权。基金当年收益弥补上一年度亏损后，才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，每年至少分配一次，收益分配比例不低于基金净收益的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。

4、重大关联方关系及关联交易

(a)关联方

关联方名称与本基金的关系

博时基金管理有限公司(“博时基金”)基金发起人、基金管理人

中国工商银行股份有限公司(“中国工商银行”)基金托管人

泰阳证券有限责任公司(“泰阳证券”)基金发起人

金信信托投资股份有限公司基金管理人的股东

招商证券股份有限公司基金管理人的股东

中国长城资产管理公司基金管理人的股东

广厦建设集团有限责任公司基金管理人的股东

下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

(b)通过关联方席位进行的证券交易及交易佣金

2007年1月1日至2007年4月11日（基金合同失效前日）止期间								
	买卖股票成交量		买卖债券成交量		买卖权证成交量		交易佣金	
	成交量 人民币元	占本期成交量的比例	成交量 人民币元	占本期成交量的比例	成交量 人民币元	占本期成交量的比例	佣金 人民币元	占本期佣金总量的比例
泰阳证券	623,632,550.70	24.76%	92,571,425.20	31.97%	12,933,125.34	100.00%	509,290.78	24.98%

	2006年度							
	买卖股票成交量		买卖债券成交量		交易佣金			
	成交量 人民币元	占本期成交量的比例	成交量 人民币元	占本期成交量的比例	佣金 人民币元	占本期佣金总量的比例		
泰阳证券	871,563,438.06	18.23%	135,957,590.05	18.08%	713,321.19	18.57%		

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的证管费、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。

(c)基金管理人报酬

支付基金管理人博时基金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X1.5%/当年天数。

本基金在本会计期间需支付基金管理人报酬13,400,773.49元(2006年：30,213,708.97元)。

(d)基金托管费

支付基金托管人中国工商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X0.25%/当年天数。

本基金在本会计期间需支付基金托管费2,233,462.29元(2006年：5,035,679.69元)。

(e)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工商银行保管，并按银行同业利率计息。基金托管人于2007年4月11日(基金合同失效前日)保管的银行存款余额为37,726,032.81元(2006年：229,652,328.14元)。本会计期间由基金托管人保管的银行存款产生的利息收入为1,043,456.82元(2006年：1,628,878.80元)。

(f)关联方持有的基金份额

	2007年4月11日（基金合同失效前日）			2006年12月31日		
	基金份额	净值	占基金总份额的比例	基金份额	净值	占基金总份额的比例
博时基金	15,000,000.00	32,007,000.00	1.00%	15,000,000.00	30,015,000.00	1.00%
泰阳证券	15,000,000.00	32,007,000.00	1.00%	15,000,000.00	30,015,000.00	1.00%

5、报告期末流通受限不能自由转让的基金资产

（a）流通受限不能自由转让的股票

（1）本基金截至2007年4月11日(基金合同失效前日)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(元)	复牌日期	复牌开盘单价(元)	数量	期末成本总额	期末估值总额
方案沟通协商阶段停牌：								
000895	双汇	06-6-01	31.02	07-6-29	57.88	999,950	17,111,681.19	31,018,449.00
600029	南航	07-3-23	7.41	07-4-25	7.80	1,000,000	6,306,781.50	7,410,000.00
合计							23,418,462.69	38,428,449.00

（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。

本基金截至2007年4月11日(基金合同失效前日)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(元)	期末估值单价(元)	数量	期末成本总额	期末估值总额
601166	兴业银行	2007-2-05	2007-5-08	15.98	32.33	437,000	6,983,260.00	14,128,210.00
601318	中国平安	2007-3-01	2007-6-01	33.80	53.97	320,124	10,820,191.20	17,277,092.28
002121	科陆电子	2007-3-06	2007-6-06	11.00	30.00	43,753	481,283.00	1,312,590.00
002122	天马股份	2007-3-28	2007-6-28	29.00	69.02	34,709	1,006,561.00	2,395,615.18
002123	荣信股份	2007-3-28	2007-6-28	18.90	67.54	15,147	286,278.30	1,023,028.38
合 计							19,577,573.50	36,136,535.84

(b)流通受限制不能自由转让的债券

基金认购新发行分离交易可转债而取得的债券，从债券认购日至债券上市日期间暂无法流通。本基金截至2007年4月11日(基金合同失效前日)止流通受限制的债券情况如下：

债券代码	债券名称	成功认购日期	可流通日期	认购价格(元)	期末估值单价(元)	认购数量	期末成本总额	期末估值总额
126005	07武钢债	07/03/29	07/04/17	77.52	82.40	247,340	19,174,338.47	20,380,816.00

(c)流通受限制不能自由转让的权证

基金认购新发行分离交易可转债而取得的权证，从权证获配日至权证上市日期间暂无法流通。本基金截至2007年4月11日(基金合同失效前日)止流通受限制的权证情况如下：

权证代码	权证名称	获配日期	可流通日期	单位成本(元)	期末估值单价(元)	获配数量	期末成本总额	期末估值总额
580013	武钢CWB1	07/04/04	07/04/17	2.320	2.896	2,399,198	5,559,661.53	6,948,077.41

七、博时第三产业成长股票证券投资基金投资组合报告

（报告期间为2007年4月12日（基金合同生效日）至2007年12月31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	16,281,959,512.16	73.44%
2	债券投资	0.00	0.00
3	权证投资	0.00	0.00
4	银行存款和结算备付金	5,854,362,862.02	26.40%
5	其它资产	35,584,571.35	0.16%
	合计	22,171,906,945.53	100%

（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	327,085,518.00	1.49%
C	制造业	3,387,247,74.43	15.47%
C0	其中：食品、饮料	2,634,857,871.74	12.03%
C1	纺织、服装、皮毛	10,349,482.50	0.05%
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	15,477,400.22	0.07%
C5	电子	132,526,066.90	0.61%
C6	金属、非金属	155,362,953.56	0.71%
C7	机械、设备、仪表	321,004,108.01	1.47%
C8	医药、生物制品	107,293,861.50	0.49%
C99	其他制造业	10,376,000.00	0.05%
D	电力、煤气及水的生产和供应业	929,936,515.22	4.25%
E	建筑业	0.00	0.00%
F	交通运输、仓储业	1,226,843,027.45	5.60%
G	信息技术业	828,292,232.60	3.78%
H	批发和零售贸易	626,531,951.77	2.86%
I	金融、保险业	6,298,682,293.80	28.76%
J	房地产业	1,835,459,788.00	8.38%
K	社会服务业	353,082,889.57	1.61%
L	传播与文化产业	304,182,687.76	1.39%
M	综合类	164,614,863.56	0.75%
	合 计	16,281,959,512.16	74.34%

（三）基金投资的前十名股票明细

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	601318	中国平安	15,003,322	1,591,852,464.20	7.27%
2	600036	招商银行	39,999,931	1,585,197,265.53	7.24%
3	600030	中信证券	17,007,241	1,518,236,404.07	6.93%
4	000002	万 科A	45,000,000	1,297,800,000.00	5.93%
5	600900	长江电力	47,003,498	916,098,176.02	4.18%
6	600000	浦发银行	16,499,950	871,197,360.00	3.98%
7	600519	贵州茅台	3,556,941	818,096,430.00	3.74%
8	600009	上海机场	20,009,399	750,752,650.48	3.43%
9	000858	五 粮 液	14,999,650	682,184,082.00	3.11%
10	600887	伊利股份	21,008,852	616,189,629.16	2.81%

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）报告期内股票投资组合的重大变动

1、本期累计买入价值超出期末基金资产净值2%或前二十名股票明细

单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期末基金资产净值的比例
1	600030	中信证券	1,300,379,824.91	5.94%
2	601318	中国平安	995,990,231.23	4.55%
3	600019	宝钢股份	733,149,259.29	3.35%
4	600028	中国石化	687,750,017.99	3.14%
5	600900	长江电力	647,380,204.11	2.96%
6	600050	中国联通	641,322,420.37	2.93%
7	600036	招商银行	638,086,095.23	2.91%
8	601628	中国人寿	589,859,473.23	2.69%
9	600009	上海机场	588,755,295.83	2.69%
10	000002	万 科A	580,448,138.83	2.65%
11	600887	伊利股份	522,085,237.58	2.38%
12	600016	民生银行	514,598,811.75	2.35%
13	600000	浦发银行	490,014,208.52	2.24%
14	600519	贵州茅台	474,751,145.57	2.17%
15	600383	金地集团	397,852,856.01	1.82%
16	600005	武钢股份	355,900,925.12	1.63%
17	600588	用友软件	348,502,509.60	1.59%
18	600004	白云机场	320,817,113.15	1.46%
19	000729	燕京啤酒	315,366,270.19	1.44%
20	600415	小商品城	308,018,398.20	1.41%

2、本期累计卖出价值超出期末基金资产净值2%或前二十名股票明细

单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期末基金资产净值的比例
1	600019	宝钢股份	1,087,150,353.62	4.96%
2	600016	民生银行	820,694,961.26	3.75%
3	600050	中国联通	741,589,482.25	3.39%
4	600028	中国石化	729,320,462.36	3.33%
5	600005	武钢股份	618,838,708.68	2.83%
6	601628	中国人寿	353,149,082.44	1.61%
7	600000	浦发银行	329,914,835.99	1.51%
8	600383	金地集团	266,162,815.83	1.22%
9	600221	海南航空	265,535,499.67	1.21%
10	600004	白云机场	244,007,881.09	1.11%
11	601919	中国远洋	240,372,049.52	1.10%
12	000002	万 科A	238,418,021.05	1.09%
13	600048	保利地产	217,764,418.68	0.99%
14	600591	上海航空	196,318,343.12	0.90%
15	600271	航天信息	186,963,118.61	0.85%
16	601939	建设银行	158,966,718.73	0.73%
17	601168	西部矿业	144,727,000.41	0.66%
18	000625	长安汽车	132,020,637.45	0.60%
19	000895	双汇发展	124,112,025.24	0.57%
20	002056	横店东磁	118,054,055.30	0.54%

3、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：人民币元

买入股票的成本总额	16,207,076,671.34
卖出股票的收入总额	10,405,684,786.34

（五）报告期末的债券投资组合

本报告期末未持有各类债券。

（六）报告期末的基金投资前五名债券明细

本报告期末未持有各类债券。

（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、处罚的。

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、基金其他资产的构成：

序号	其他资产	金额(元)
1	存出保证金	1,686,449.53
2	应收股利	0.00
3	应收利息	1,731,509.44
4	应收申购款	32,166,612.38
合计		35,584,571.35

4、本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

5、报告期内本基金未持有资产支持证券。

6、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。

八、基金裕元投资组合报告

（报告期末为2007年4月11日，报告期间为2007年1月1日至2007年4月11日（基金合同失效前日））

（一）本报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额	占基金总资产的比例
1	股票投资	2,490,078,794.15	77.46%
2	债券投资	663,523,820.80	20.64%
3	权证投资	6,948,077.41	0.22%
4	银行存款和结算备付金	41,864,444.19	1.30%
5	其它资产	12,342,759.27	0.38%
	合计	3,214,757,895.82	100%

（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	0.00	0.00%
C	制造业	665,225,872.05	20.78%
C0	其中：食品、饮料	386,229,616.60	12.07%
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	0.00	0.00%
C4	石油、化学、塑胶、塑料	2,823,000.00	0.09%
C5	电子	78,429,966.24	2.49%
C6	金属、非金属	0.00	0.00%
C7	机械、设备、仪表	84,091,915.36	2.59%
C8	医药、生物制品	111,476,591.35	3.48%
C99	其他制造业	2,174,782.50	0.00%
D	电力、煤气及水的生产和供应业	38,376,244.08	1.20%
E	建筑业	0.00	0.00%
F	交通运输、仓储业	160,645,000.00	5.02%
G	信息技术业	33,423,381.76	1.04%
H	批发和零售贸易	104,949,860.05	3.28%
I	金融、保险业	708,654,017.01	22.14%
J	房地产业	507,122,344.11	15.84%
K	社会服务业	240,490,121.65	7.51%
L	传播与文化产业	5,681,388.00	0.18%
M	综合类	25,510,565.44	0.80%
	合 计	2,490,078,794.15	77.80%

（三）本报告期末基金投资的前十名股票明细

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	000002	万 科A	15,500,000.00	279,000,000.00	8.72%
2	600000	浦发银行	7,500,000.00	230,025,000.00	7.19%
3	600036	招商银行	12,000,000.00	229,200,000.00	7.16%
4	000069	华侨城A	8,517,861.00	195,399,731.34	6.10%
5	000858	五 粮 液	4,800,000.00	156,336,000.00	4.88%
6	600048	保利地产	4,500,000.00	151,380,000.00	4.73%
7	600887	伊利股份	4,709,620.00	131,775,167.60	4.12%
8	600016	民生银行	9,000,000.00	115,020,000.00	3.59%
9	600009	上海机场	3,500,000.00	96,635,000.00	3.02%
10	600686	金龙汽车	3,000,000.00	77,250,000.00	2.41%

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）报告期内股票投资组合的重大变动

1、本期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

单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值的比例
1	601628	中国人寿	147,360,465.16	4.91%
2	000100	*ST TCL	76,329,704.38	2.54%
3	600048	保利地产	70,419,879.55	2.35%
4	600125	铁龙物流	59,074,407.60	1.97%
5	600030