长盛成长价值证券投资基金2007年年度报告摘要

（上接D59版）

27	600519	贵州茅台	44,615,743.56	9.77%
28	600795	国电电力	44,609,628.22	9.77%
29	002122	天马股份	44,396,875.33	9.73%
30	000878	云南铜业	44,128,839.27	9.67%
31	600240	华业地产	41,585,983.93	9.11%
32	600029	南方航空	40,843,893.23	8.95%
33	601699	潞安环能	40,360,406.67	8.84%
34	000690	宝新能源	40,065,385.77	8.78%
35	002106	莱宝高科	39,382,621.30	8.63%
36	000031	中粮地产	37,699,874.06	8.26%
37	000024	招商地产	36,524,927.65	8.00%
38	600028	中国石化	35,735,543.00	7.83%
39	000028	一致药业	35,639,467.63	7.81%
40	600062	双鹤药业	34,806,604.89	7.62%
41	600557	康缘药业	32,113,542.27	7.03%
42	000895	双汇发展	31,635,681.24	6.93%
43	600258	首旅股份	30,447,942.61	6.67%
44	600282	南钢股份	29,561,686.00	6.48%
45	600021	上海电力	28,028,455.64	6.14%
46	601600	中国铝业	27,988,536.79	6.13%
47	002124	天邦股份	27,433,424.55	6.01%
48	000022	深赤湾A	27,290,505.83	5.98%
49	000623	吉林敖东	26,485,634.70	5.80%
50	600015	华夏银行	26,226,577.36	5.75%
51	600104	上海汽车	26,053,871.38	5.71%
52	601857	中国石油	24,415,212.00	5.35%
53	600489	中金黄金	23,456,344.00	5.14%
54	600361	华联综超	23,380,489.69	5.12%
55	600037	歌华有线	23,079,780.05	5.06%
56	600966	博汇纸业	22,586,448.13	4.95%
57	000759	武汉中百	22,383,781.36	4.90%
58	600880	博瑞传播	21,964,178.49	4.81%
59	000401	冀东水泥	21,948,136.55	4.81%
60	000761	本钢板材	21,797,150.38	4.77%
61	000422	湖北宜化	21,138,481.30	4.63%
62	600820	隧道股份	20,501,819.39	4.49%
63	000960	锡业股份	20,254,822.50	4.44%
64	600690	青岛海尔	20,169,763.54	4.42%
65	002080	中材科技	20,104,977.70	4.40%
66	000063	中兴通讯	19,608,630.35	4.30%
67	002073	青岛软控	19,009,674.56	4.16%
68	002152	广电运通	18,681,550.00	4.09%
69	600765	力源液压	17,826,577.80	3.91%
70	002177	御银股份	17,572,900.33	3.85%
71	600886	国投电力	16,884,461.35	3.70%
72	002078	太阳纸业	16,818,469.47	3.68%
73	600655	豫园商城	15,803,680.52	3.46%
74	000709	唐钢股份	15,624,220.40	3.42%
75	600267	海正药业	14,567,012.36	3.19%
76	600322	天房发展	14,243,656.15	3.12%
77	600016	民生银行	13,849,716.83	3.03%
78	000488	晨鸣纸业	13,330,196.20	2.92%
79	000729	燕京啤酒	13,050,422.02	2.86%
80	000581	威孚高科	12,839,296.56	2.81%
81	600717	天津港	12,573,331.78	2.75%
82	600005	武钢股份	12,392,089.66	2.71%
83	601111	中国国航	12,012,271.28	2.63%
84	600887	伊利股份	11,337,826.68	2.48%
85	600183	生益科技	10,663,897.74	2.34%
86	600067	冠城大通	10,523,503.81	2.31%
87	000777	中核科技	10,325,682.09	2.26%
88	600569	安阳钢铁	10,217,819.97	2.24%
89	600628	新世界	10,019,489.38	2.19%
90	600748	上实发展	9,806,117.00	2.15%
91	000507	粤富华	9,443,333.74	2.07%
92	600238	海南椰岛	9,352,062.83	2.05%
93	000062	深圳华强	9,240,531.84	2.02%

（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的比例
1	000895	双汇发展	118,147,411.92	25.88%
2	600036	招商银行	97,031,871.15	21.26%
3	000001	深发展A	96,244,457.81	21.08%
4	600547	山东黄金	91,003,303.53	19.94%
5	600019	宝钢股份	79,204,802.11	17.35%
6	002024	苏宁电器	79,017,460.83	17.31%
7	601318	中国平安	71,282,162.51	15.62%
8	600835	上海机电	66,119,296.55	14.48%
9	600031	三一重工	61,470,019.49	13.47%
10	601166	兴业银行	61,102,578.03	13.39%
11	600028	中国石化	56,691,143.76	12.42%
12	000898	鞍钢股份	54,993,867.20	12.05%
13	601939	建设银行	53,785,556.32	11.78%
14	600325	华发股份	53,581,595.16	11.74%
15	600030	中信证券	52,770,123.12	11.56%
16	601088	中国神华	50,372,513.08	11.03%
17	000983	西山煤电	45,725,172.91	10.02%
18	000024	招商地产	42,808,835.39	9.38%
19	601600	中国铝业	40,091,032.88	8.78%
20	600322	天房发展	38,152,473.27	8.36%
21	600048	保利地产	36,842,367.44	8.07%
22	000623	吉林敖东	36,783,076.92	8.06%
23	000823	超声电子	35,989,965.46	7.88%
24	600519	贵州茅台	34,545,946.79	7.57%
25	000858	五粮液	33,499,046.91	7.34%
26	000878	云南铜业	32,585,488.07	7.14%
27	600104	上海汽车	31,360,958.23	6.87%
28	601006	大秦铁路	31,207,305.76	6.84%
29	600489	中金黄金	30,272,667.06	6.63%
30	600016	民生银行	29,944,008.43	6.56%
31	600058	五矿发展	29,931,028.57	6.56%
32	600258	首旅股份	29,860,914.74	6.54%
33	600694	大商股份	29,792,313.21	6.53%
34	600282	南钢股份	28,449,280.17	6.23%
35	600050	中国联通	28,249,992.68	6.19%
36	002073	青岛软控	27,624,671.60	6.05%
37	601398	工商银行	27,494,111.01	6.02%
38	000401	冀东水泥	27,095,769.85	5.94%
39	000709	唐钢股份	26,084,117.83	5.71%
40	600900	长江电力	26,040,103.45	5.70%
41	000022	深赤湾A	25,451,094.53	5.58%
42	600037	歌华有线	24,625,597.25	5.39%
43	600021	上海电力	23,665,769.28	5.18%
44	000031	中粮地产	22,901,139.53	5.02%
45	002124	天邦股份	22,530,852.01	4.94%
46	600015	华夏银行	22,400,315.34	4.91%
47	600690	青岛海尔	22,368,472.78	4.90%
48	600887	伊利股份	22,036,371.24	4.83%
49	600361	华联综超	21,993,029.10	4.82%
50	600880	博瑞传播	21,667,273.96	4.75%
51	000759	武汉中百	21,272,638.08	4.66%
52	601111	中国国航	20,844,815.83	4.57%
53	600820	隧道股份	20,801,994.67	4.56%
54	000063	中兴通讯	20,782,151.39	4.55%
55	600765	力源液压	20,297,185.99	4.45%
56	601699	潞安环能	20,162,900.96	4.42%
57	600011	华能国际	20,132,634.81	4.41%
58	000012	南玻A	19,929,932.35	4.37%
59	000807	云铝股份	19,854,330.33	4.35%
60	000960	锡业股份	19,043,459.58	4.17%
61	600655	豫园商城	18,823,900.09	4.12%
62	600508	上海能源	17,772,892.18	3.89%
63	600886	国投电力	17,769,881.44	3.89%
64	000761	本钢板材	17,465,554.82	3.83%
65	002078	太阳纸业	17,371,294.24	3.81%
66	600005	武钢股份	16,988,975.80	3.72%
67	600459	贵研铂业	15,587,777.89	3.41%
68	600406	国电南瑞	15,491,269.21	3.39%
69	000777	中核科技	15,303,017.86	3.35%
70	000488	晨鸣纸业	15,031,304.67	3.29%
71	600267	海正药业	14,271,549.38	3.13%
72	000069	华侨城A	14,121,247.38	3.09%
73	002106	莱宝高科	14,000,914.91	3.07%
74	000729	燕京啤酒	13,289,262.46	2.91%
75	600067	冠城大通	13,014,289.28	2.85%
76	600675	中华企业	12,931,640.77	2.83%
77	000581	威孚高科	11,922,921.61	2.61%
78	600685	广船国际	11,496,161.26	2.52%
79	600717	天津港	11,256,196.43	2.47%
80	000568	泸州老窖	11,130,000.50	2.44%
81	600748	上实发展	11,016,882.71	2.41%
82	600238	海南椰岛	10,593,482.97	2.32%
83	000507	粤富华	10,478,567.08	2.30%
84	000625	长安汽车	10,181,206.63	2.23%
85	000002	万科A	10,085,958.10	2.21%
86	600569	安阳钢铁	9,829,095.22	2.15%
87	000422	湖北宜化	9,688,694.78	2.12%
88	600827	友谊股份	9,632,428.32	2.11%
89	601628	中国人寿	9,563,298.17	2.09%
90	600183	生益科技	9,520,668.17	2.09%
91	000026	飞亚达A	9,189,822.99	2.01%
92	000062	深圳华强	9,131,142.13	2.00%

（三）报告期内买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

项　目	金额（人民币元）
买入股票成本总额	3,577,324,931.77
卖出股票收入总额	2,940,364,444.61

五、报告期末按券种分类的债券投资组合

债券品种	市值（人民币元）	占基金资产净值比例
国　债	56,449,871.00	2.93%
金融债	217,704,000.00	11.32%
央行票据	119,407,000.00	6.21%
企业债	0.00	0.00%
可转债	0.00	0.00%
债券投资合计	393,560,871.00	20.46%

六、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	07农发14	188,043,000.00	9.78%
2	05票据31	99,970,000.00	5.20%
3	99国债08	29,738,571.00	1.55%
4	06国开31	29,661,000.00	1.54%
5	02国债10	16,305,300.00	0.85%

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

本基金期末未持有资产支持证券。

八、报告期末本基金投资权证明细

（一）报告期末持有权证明细

获得方式	权证名称	权证代码	数量（份）	市值（人民币元）	市值占基金净资产比例
被动持有	武钢CWB1	580013	143,075	1,130,435.58	0.06%
合计				1,130,435.58	0.06%

（二）报告期内获得权证明细

获取方式	权证代码	权证名称	数量（份）	成本总额（人民币元）
被动持有	580013	武钢CWB1	143,075	331,533.39

九、投资组合报告附注

（一）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http://www.csfunds.com.cn网站的年度报告正文。

（二）本报告期内基金投资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。

（三）基金投资的前十名股票，均为基金合同规定备选股票库之内的股票。

（四）报告期末基金的其他资产构成

其他资产项目	金额（人民币元）
存出保证金	660,000.00
应收利息	6,191,583.56
应收申购款	1,087,543.91
合　计	7,939,127.47

（五）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。

（六）本报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

本基金管理人在本报告期内未投资本基金。

第八章　基金份额持有人情况

一、报告期末基金份额持有人户数

报告期末基金份额持有人户数	85,372户
报告期末平均每户持有的基金份额	19,242.14份

二、报告期末基金份额持有人结构

项目	数量（份）	占总份额的比例
基金份额总额	1,642,739,781.87	100.00%
其中：机构投资者持有的基金份额	105,132,528.24	6.40%
个人投资者持有的基金份额	1,537,607,253.63	93.60%

三、报告期末基金管理公司从业人员持有本基金情况

项　目	期末持有本开放式基金份额的总量（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	1,313.73	0.00%

第九章　开放式基金份额变动情况

本基金份额变动情况如下：

单位：份

基金合同生效日（2002年9月18日）基金份额总额	3,166,886,000.00
本报告期期初基金份额总额	241,193,399.89
本报告期期间基金总申购份额	2,365,982,822.28
本报告期期间基金总赎回份额	964,436,440.30
本报告期期末基金份额总额	1,642,739,781.87

第十章　重大事件揭示

一、本报告期内本基金未召开基金份额持有人大会。

二、本报告期内基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

（一）本基金管理人的高级管理人员重大人事变动情况

基金管理人于2007年8月16日发布关于更换董事长的公告：经长盛基金管理有限公司第三届董事会第十九次会议审议通过，并报中国证监会审核批准(证监基金字[2007]229号文)，聘任公司董事陈平先生担任公司董事长，凤良志先生不再担任公司董事长一职。

（二）基金经理的变动情况

基金管理人于2007年3月28日发布关于调整基金经理的公告：因工作需要，经公司第三届董事会第十六次会议审议批准，聘任裴愔愔女士为长盛成长价值基金基金经理，与长盛成长价值基金现任基金经理田荣华先生共同担任该基金基金经理。

基金管理人于2007年5月10日发布关于调整基金经理的公告：因工作需要，根据公司第三届董事会第十八次会议决议，公司批准田荣华先生不再担任长盛成长价值证券投资基金基金经理及基金同德基金经理。裴愔愔女士仍担任长盛成长价值证券投资基金基金经理。

（三）本基金托管人的基金托管部门未发生重大人事变动。

三、本报告期内无涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

四、本报告期内本基金投资策略不曾改变。

五、本报告期内本基金收益分配事项

2007年2月5日，本基金实施成立日起第六次收益分配，向全体基金份额持有人按每10份基金份额派发现金红利10.00元。公告于2007年1月31日刊登。

2007年8月3日，本基金实施成立日起第七次收益分配，向全体基金份额持有人按每10份基金份额派发现金红利6.40元。公告于2007年7月31日刊登。

六、本基金所聘会计师事务所的情况

本报告期内本基金未更换会计师事务所，本基金聘任的会计师事务所为普华永道中天会计师事务所有限公司，报告年度共支付审计费80,000.00元。普华永道中天会计师事务所有限公司已连续为本基金提供审计服务6年。

七、基金管理人、托管人及其高级管理人员未受监管部门稽查或处罚。

八、本基金租用证券公司专用交易席位的有关情况

（一）根据中国证监会《关于加强证券投资基金监管有关问题的通知》、《关于基金证券交易量分配限制有关规定的解释》以及《关于完善证券投资基金交易席位制度有关问题的通知》的有关要求，我司按照选择证券经营机构的标准，经认真研究后，截至本报告期末本基金选择的交易席位如下

序号	证券公司名称	租用上海席位数量	租用深圳席位数量	合计
1	大通证券股份有限公司		1	1
2	中信证券股份有限公司	1		1
3	广发证券股份有限公司	1	1	2
4	国元证券	1		1
5	中国国际金融有限公司	1		1
6	中国银河证券股份有限公司		1	1
7	联合证券有限责任公司		1	1
	合　计	4	4	8

（二）本公司选择证券经营机构的标准

1、研究实力较强，有固定的研究机构和专门研究人员，能及时为本公司提供高质量的咨询服务，包括宏观经济报告、行业报告、市场走向分析、个股分析报告等，并能根据基金投资的特定要求，提供专门研究报告。

2、资力雄厚，信誉良好。

3、财务状况良好，各项财务指标显示公司经营状况稳定。

4、经营行为规范，最近两年未因重大违规行为而受到中国证监会和中国人民银行处罚。

5、内部管理规范、严格，具备健全的内控制度，并能满足基金运作高度保密的要求。

6、具备基金运作所需的高效、安全的通讯条件，交易设施符合代理本公司基金进行证券交易的需要，并能为本公司基金提供全面的信息服务。

（三）本公司租用基金专用席位的程序

1、研究机构提出服务意向，并提供相关研究报告；

2、研究机构的研究报告需要有一定的试用期。试用期视服务情况和研究服务评价结果而定；

3、研究发展部、投资管理等部门试用研究机构的研究报告后，按照研究服务评价规定，对研究机构进行综合评价；

4、试用期满后，评价结果符合条件，双方认为有必要继续合作，经公司领导审批后，我司与研究机构签定《研究服务协议》、《券商席位租用协议》，并办理基金专用席位租用手续。评价结果如不符合条件则终止试用；

5、本公司每两个月对签约机构的服务进行一次综合评价。经过评价，若本公司认为签约机构的服务不能满足要求，或签约机构违规受到国家有关部门的处罚，本公司有权终止签署的协议，并撤销租用的席位；

6、席位租用协议期限为一年，到期后若双方没有异议可自动延期一年。

（四）2007年1–12月各券商股票年交易量及年佣金情况如下

公司名称	股票交易量（人民币元）	占交易量比例	佣金（人民币元）	占佣金比例
国元证券	391,323,433.47	6.08%	320,023.03	6.16%
广发证券股份有限公司	127,084,175.31	1.97%	102,671.54	1.98%
中国国际金融有限公司	2,725,805,956.76	42.33%	2,232,497.72	42.99%
中信证券股份有限公司	927,663,740.31	14.40%	759,463.90	14.63%
中国银河证券股份有限公司	1,249,852,711.60	19.41%	978,016.28	18.83%
联合证券有限责任公司	906,100,287.67	14.07%	709,030.56	13.65%
高华证券有限责任公司	112,008,161.61	1.74%	91,379.73	1.76%
合计	6,439,838,466.73	100.00%	5,193,082.76	100.00%

（五）2007年1–12月各券商债券、回购交易量情况如下

公司名称	债券交易量（人民币元）	占交易量比例	回购年交易量（人民币元）	占交易量比例
国元证券	25,631,893.40	12.58%	120,000,000.00	16.39%
广发证券股份有限公司	1,240,180.00	0.61%	40,000,000.00	5.47%
中国国际金融有限公司	141,973,806.80	69.71%	242,000,000.00	33.06%
中信证券股份有限公司	27,889,744.00	13.69%	250,000,000.00	34.15%
联合证券有限责任公司	506,500.00	0.25%	0.00	0.00%
高华证券有限责任公司	6,436,183.10	3.16%	80,000,000.00	10.93%
合计	203,678,307.30	100.00%	732,000,000.00	100.00%

（六）2007年1–12月各券商权证交易量情况

本基金本报告期内未发生权证交易。

（七）报告期内租用证券公司席位的变更情况：

新增租用

序号	证券公司名称	席位所属市场	数量
1	高华证券有限责任公司	上海	1

停止租用

序号	证券公司名称	席位所属市场	数量
1	高华证券有限责任公司	上海	1
2	平安证券有限责任公司	深圳	1
3	新时代证券有限责任公司	上海	1

九、本报告期内本基金管理人股权变更情况

根据公司2006年第2次临时股东会与2007年第1次临时股东会会议决议，本基金管理人进行股权变更及相应的章程修改。变更后的股东及持股比例分别为：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%。公告于2007年4月19日刊登。

十、本报告期内本基金托管人的重大变动

（一）本报告期内，托管人行长变更情况

依据国务院文件，2007年6月16日国务院决定任命项俊波同志为中国农业银行行长。依据相关法律规定，中国农业银行法定代表人变更为项俊波同志。

（二）本报告期内，托管人注册地址变更情况

本报告期内，本基金托管人已做工商登记变更，注册地址由北京市海淀区复兴路甲23号变更为北京市东城区建国门内大街69号。

十一、本报告期内本基金招募说明书更新情况

本基金管理人经与基金托管人协商，对本基金的招募说明书进行了更新，于2007年5月9日将本基金更新的招募说明书摘要刊登在《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》，同时将本基金更新的招募说明书正文及摘要登载于本公司网站上。

本基金管理人经与基金托管人协商，对本基金的招募说明书进行了更新，于2007年11月2日将本基金更新的招募说明书摘要刊登在《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》，同时将本基金更新的招募说明书正文及摘要登载于本公司网站上。

十二、其他重大事件

除上述事项之外，均已作为临时报告在指定媒体披露过的其他在本报告期内发生的重大事件如下：

序号	公告名称/事项	披露日期
1	关于增加国元证券有限责任公司为代销机构的公告	2007–01–25
2	关于长盛基金旗下三只基金暂停大额申购和转换转入业务的公告	2007–02–01
3	关于本基金暂停大额申购和转入业务的公告	2007–04–28
4	关于本基金暂停申购和转入业务的公告	2007–05–09
5	关于调整旗下开放式基金申购费用和申购份额计算方法及修改基金合同与基金招募说明书的公告	2007–05–18
6	关于旗下基金暂停申购和转换转入业务的提示性公告	2007–05–24
7	关于旗下基金暂停申购和转换转入业务的提示性公告	2007–06–07
8	关于恢复旗下基金申购和转换转入业务的公告	2007–06–28
9	关于恢复旗下基金申购和转换转入业务的提示性公告	2007–06–29
10	关于本公司所管理证券投资基金执行《企业会计》准则的公告	2007–07–02
11	关于本公司工商登记变更的公告	2007–07–04
12	关于参加农业银行“金钥匙·基金宝”基金定期定额申购业务推广活动的公告	2007–07–05
13	关于开通本基金农行定期定额业务的公告	2007–07–05
14	关于增加中信金通证券、渤海证券有限责任公司为代销机构的公告	2007–07–27
15	关于增加海通证券股份有限公司为代销机构的公告	2007–08–03
16	关于本基金第七次收益分配提示性公告	2007–08–06
17	关于增加国联证券有限责任公司为代销机构的公告	2007–09–07
18	关于警惕冒用长盛基金名义进行非法证券活动的提示性公告	2007–09–27
19	关于修改旗下基金基金合同中基金资产估值的有关条款的公告	2007–09–29
20	关于本基金基金资产估值更新后的基金合同	2007–09–29
21	关于本公司工商登记变更的公告	2007–10–09
22	关于增加中信银行股份有限公司为代销机构的公告	2007–10–18
23	关于增加中国银行股份有限公司为代销机构的公告	2007–12–14
24	关于中国银行开办长盛旗下部分基金定期定额投资业务的公告	2007–12–14
25	关于招商银行开办长盛旗下基金定期定额投资业务的公告	2007–12–19

注：如无特别说明，上述重大事件的信息披露媒体均为《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》以及本公司网站。

长盛基金管理有限公司

二〇〇八年三月二十六日

长盛货币市场基金2007年年度报告摘要

（上接D61版）

二、报告期债券回购融资情况

序号	项　目	金额(人民币元)	占基金资产净值的比例
1	报告期内债券回购融资余额	12,738,236,719.78	12.50%
	其中：买断式回购融资	0.00	0.00%
2	报告期末债券回购融资余额	0.00	0.00%
	其中：买断式回购融资	0.00	0.00%

注：（一）上表中报告期内债券回购融资余额为报告期内每日的融资余额的合计数，报告期内债券回购融资余额占基金资产净值的比例为报告期内每日融资余额占基金资产净值比例的简单平均值。

（二）本报告期内货币市场基金正回购的资金余额超过资产净值的20%的情况

序号	发生日期	融资余额占基金资产净值的比例	原　因	调整期
1	2007–01–01	23.11%	大额赎回导致被动超标	到2007年1月9日调整完毕
2	2007–01–02	23.10%	大额赎回导致被动超标	到2007年1月9日调整完毕
3	2007–01–03	23.10%	大额赎回导致被动超标	到2007年1月9日调整完毕
4	2007–01–04	23.97%	大额赎回导致被动超标	到2007年1月9日调整完毕
5	2007–01–05	24.25%	大额赎回导致被动超标	到2007年1月9日调整完毕
6	2007–01–06	24.25%	大额赎回导致被动超标	到2007年1月9日调整完毕
7	2007–01–07	24.25%	大额赎回导致被动超标	到2007年1月9日调整完毕
8	2007–01–08	24.26%	大额赎回导致被动超标	到2007年1月9日调整完毕
9	2007–01–24	20.27%	大额赎回导致被动超标	到2007年1月30日调整完毕
10	2007–01–25	20.41%	大额赎回导致被动超标	到2007年1月30日调整完毕
11	2007–01–26	20.42%	大额赎回导致被动超标	到2007年1月30日调整完毕
12	2007–01–27	20.42%	大额赎回导致被动超标	到2007年1月30日调整完毕
13	2007–01–28	20.42%	大额赎回导致被动超标	到2007年1月30日调整完毕
14	2007–01–29	20.28%	大额赎回导致被动超标	到2007年1月30日调整完毕
15	2007–02–07	20.89%	大额赎回导致被动超标	到2007年2月13日调整完毕
16	2007–02–08	21.35%	大额赎回导致被动超标	到2007年2月13日调整完毕
17	2007–02–09	21.21%	大额赎回导致被动超标	到2007年2月13日调整完毕
18	2007–02–10	21.21%	大额赎回导致被动超标	到2007年2月13日调整完毕
19	2007–02–11	21.21%	大额赎回导致被动超标	到2007年2月13日调整完毕
20	2007–02–12	21.04%	大额赎回导致被动超标	到2007年2月13日调整完毕
21	2007–04–05	20.84%	大额赎回导致被动超标	到2007年4月6日调整完毕
22	2007–04–20	20.68%	大额赎回导致被动超标	到2007年4月25日调整完毕
23	2007–04–21	20.68%	大额赎回导致被动超标	到2007年4月25日调整完毕
24	2007–04–22	20.68%	大额赎回导致被动超标	到2007年4月25日调整完毕
25	2007–04–23	21.32%	大额赎回导致被动超标	到2007年4月25日调整完毕
26	2007–04–24	25.86%	大额赎回导致被动超标	到2007年4月25日调整完毕
27	2007–05–09	20.41%	大额赎回导致被动超标	到2007年5月10日调整完毕
28	2007–06–15	21.59%	大额赎回导致被动超标	到2007年6月21日调整完毕
29	2007–06–16	21.58%	大额赎回导致被动超标	到2007年6月21日调整完毕
30	2007–06–17	21.58%	大额赎回导致被动超标	到2007年6月21日调整完毕
31	2007–06–18	22.15%	大额赎回导致被动超标	到2007年6月21日调整完毕
32	2007–06–19	22.10%	大额赎回导致被动超标	到2007年6月21日调整完毕
33	2007–06–20	22.09%	大额赎回导致被动超标	到2007年6月21日调整完毕
34	2007–07–02	20.27%	大额赎回导致被动超标	到2007年7月3日调整完毕
35	2007–07–04	20.35%	大额赎回导致被动超标	到2007年7月5日调整完毕
36	2007–07–11	23.01%	大额赎回导致被动超标	到2007年7月12日调整完毕
37	2007–09–24	20.07%	大额赎回导致被动超标	到2007年9月26日调整完毕
38	2007–09–25	21.05%	大额赎回导致被动超标	到2007年9月26日调整完毕
39	2007–11–20	21.28%	大额赎回导致被动超标	到2007年11月23日调整完毕
40	2007–11–21	21.54%	大额赎回导致被动超标	到2007年11月23日调整完毕
41	2007–11–22	21.30%	大额赎回导致被动超标	到2007年11月23日调整完毕

三、基金投资组合平均剩余期限

（一）投资组合平均剩余期限基本情况

项　目	天　数
报告期末投资组合平均剩余期限	135
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	179
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	47

报告期内无投资组合平均剩余期限超过180天情况。

（二）期末投资组合平均剩余期限分布比例

序号	平均剩余期限	各期限资产占基金资产净值的比例	各期限负债占基金资产净值的比例
1	30天内	21.56%	0.00%
2	30天(含)–60天	4.35%	0.00%
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	4.35%	0.00%
3	60天(含)–90天	39.32%	0.00%
4	90天(含)–180天	0.00%	0.00%
5	180天(含)–397天(含)	34.50%	0.00%
	合　计	99.73%	0.00%

四、报告期末债券投资组合

（一）按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	成本(人民币元)	占基金资产净值的比例
1	国家债券	0.00	0.00%
2	金融债券	39,862,710.47	17.53%
	其中：政策性金融债	39,862,710.47	17.53%
3	央行票据	127,878,216.08	56.23%
4	企业债券	39,994,303.69	17.59%
5	其他	0.00	0.00%
合　计		207,735,230.24	91.35%
剩余存续期超过397天的浮动利率债券		9,890,005.35	4.35%

注：上表中，债券的成本包括债券面值和折溢价。

（二）基金投资前十名债券明细

序号	债券名称	债券数量		成本(人民币元)	占基金资产净值的比例
		自有投资	买断式回购		
1	07央行票据18	600000		59,621,267.27	26.22%
2	07央行票据139	400000		38,465,130.17	16.91%
3	07国开13	300000		29,972,705.12	13.18%
4	07央行票据22	300000		29,791,818.64	13.10%
5	07三一CP01	200