

德盛安心成长混合型证券投资基金 2007 年年度报告摘要

(上接 D60 页)

项目	境内	1至6月	7至12月	合计
资产				
银行存款	15,734,449.21	-	-	15,734,449.21
货币资金	415,560.63	-	-	415,560.63
买入返售资产	-	-	290,000.00	290,000.00
交易性金融资产	3,216,070.00	13,228,421.30	963,992.20	14,607,883.50
应收利息	-	-	228,855.54	228,855.54
应收申购款	-	-	191,026.79	191,026.79
其他资产	-	-	86,773.11	86,773.11
负债				
应付赎回款	-	-	289,763.22	289,763.22
应付利息	-	-	65,514.00	65,514.00
应付管理费	-	-	30,919.03	30,919.03
应付托管费	-	-	54,546.72	54,546.72
其他负债	-	-	569,004.99	569,004.99
所有者权益	19,366,079.84	13,228,421.30	963,992.20	18,558,493.34

于 2007 年 12 月 31 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 22,504.65 元(2006 年:29,443.62 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,本基金资产净值将相应减少约 22,504.65 元(2006 年:29,443.62 元)。

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值因未来现金流量现值因利率和外汇汇率以外的市场价格变动而发生变动的风险。本基金主要投资于证券市场,上市股票价格和债券以及银行间市场的交易价格变动,所面临的最大的市场风险由所持金融工具公允价值变动引起。本基金通过投资组合的分散化降低非系统风险,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。本基金投资组合中股票投资比例为基金资产净值的 45.44%、债券投资为 20.95%、权证投资为 0.04%。于 2007 年 12 月 31 日,本基金面临的非系统市场风险列示如下:

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	106,791,009.50	66.39%	32,059,564.14	67.18%
一股票投资	33,700,591.10	20.95%	17,898,483.50	36.46%
二债券投资	62,078.16	0.04%	236,936.50	0.50%
衍生金融资产	106,832,097.66	66.43%	32,296,499.64	67.68%

于 2007 年 12 月 31 日,本基金根据持仓类别加权上证指数涨跌幅 500%、沪深 300 涨跌幅为市场公允价值变动敏感分析基准,若该基准的公允价值上升或下降 5%且其他市场变量保持不变,本基金资产净值将相应增加或下降人民币 8,898,567.37 元。于 2006 年 12 月 31 日,本基金根据持仓类别加权上证指数涨跌幅 50%、沪深 300 涨跌幅为市场公允价值变动敏感分析基准,若该基准的公允价值上升或下降 5%且其他市场变量保持不变,本基金资产净值将相应增加或下降人民币 2,781,397.78 元。

24 年以上比较数字  
本基金于 2007 年 7 月 1 日起首次执行企业会计准则(2006)。有关比较数字的调整参见附注 4。

(一) 基金资产组合情况

项目	期末市值(元)	占基金总资产的比例
银行存款和货币资金合计	44,056,105.69	27.16%
股票	73,090,418.40	45.38%
债券	33,700,591.10	20.79%
权证	62,078.16	0.04%
其他资产	11,247,571.95	6.83%
合计	162,136,786.20	100.00%

(二) 按行业分类的股票投资组合

行业分类	市值(元)	占基金资产净值比例
A. 农、林、牧、渔业	1,887,000.00	1.17%
B. 采掘业	12,090,844.00	7.51%
C. 制造业	24,236,454.60	15.08%
C1. 食品、饮料	3,182,572.04	1.98%
C2. 纺织、服装、皮毛	0.00	0.00%
C3. 木材、家具	0.00	0.00%
C4. 造纸、印刷	4,200,262.56	2.61%
C5. 石油、化学、塑胶、塑料	5,983,800.00	3.65%
C6. 电子	0.00	0.00%
C7. 金属、非金属	3,110,890.00	1.94%
C8. 机械、设备、仪表	6,177,020.00	4.03%
C9. 医药、生物制品	0.00	0.00%
D. 电力、煤气及水的生产和供应业	1,401,300.00	0.87%
E. 建筑业	1,694,100.00	1.05%
F. 交通运输、仓储业	12,188,500.00	9.41%
G. 信息技术业	2,416,000.00	1.50%
H. 批发和零售业	9,666,360.00	6.01%
I. 房地产业	1,158,908.00	0.94%
J. 社会服务业	4,492,350.00	2.79%
K. 传播与文化产业	0.00	0.00%
M. 综合类	73,090,418.40	45.44%

(三) 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	期末数量(股)	期末市值(元)	占基金资产净值比例
1	600028	中国石化	270,800	6,344,844.00	3.94%
2	600115	东方航空	250,000	5,322,500.00	3.31%
3	600019	华联综服	80,400	4,492,350.00	2.79%
4	601919	中国远洋	19,000	4,266,000.00	2.65%
5	600150	中国联通	16,000	3,746,100.00	2.33%
6	600423	中国船舶	130,000	3,478,800.00	2.16%
7	000088	五粮液	69,973	3,112,370.04	1.98%
8	000060	中金岭南	70,000	3,180,200.00	1.93%
9	600033	福建高速	320,000	3,048,000.00	1.89%
10	601318	中国平安	26,000	2,760,600.00	1.71%

投资者欲了解本报告期末基金投资的所有股票明细,应阅读刊登于国联安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

买入返售资产前十大及卖出买入返售资产前十大明细

序号	股票代码	股票名称	期末数量(股)	期末市值(元)	占基金资产净值比例
1	600028	中国石化	8,306,578.72	18,462.91	11.26%
2	600030	中信证券	2,381,000.00	5,280.00	3.23%
3	600019	华联综服	5,210,536.28	11,626.28	7.06%
4	600115	东方航空	4,761,904.21	9,963.41	6.08%
5	601166	兴业银行	4,460,630.76	9,936.76	6.08%
6	601919	中国远洋	4,407,518.00	9,241.00	5.63%
7	600025	中国太保	3,395,303.14	7,423.14	4.57%
8	600000	浦发银行	3,701,643.02	8,176.02	5.04%
9	000002	万科 A	3,488,016.62	7,678.62	4.73%
10	600150	中国联通	3,369,793.80	7,383.80	4.54%
11	600060	中金岭南	3,186,531.00	6,979.00	4.30%
12	600037	华谊兄弟	1,072,942.01	2,319.01	1.43%
13	000000	平安银行	2,392,255.31	5,205.31	3.19%
14	600033	福建高速	2,382,601.00	5,161.00	3.17%
15	600426	华建集团	2,300,864.46	5,034.46	3.09%
16	601939	华资实业	2,159,243.00	4,721.00	2.89%
17	600028	中国石化	1,972,942.01	4,353.01	2.67%
18	000069	张裕 A	2,625,316.26	5,928.26	3.64%
19	600423	中国船舶	2,797,476.00	5,868.00	3.61%
20	000027	华电国际	2,730,882.02	5,729.02	3.52%
21	600162	袁隆平高	2,687,000.00	5,613.00	3.42%
22	600048	高速传动	2,388,585.42	5,075.42	3.12%
24	600048	保利地产	2,356,302.00	4,941.00	3.03%
25	000204	苏宁电器	2,297,505.83	4,884.83	2.99%
26	600077	东信软件	2,300,130.00	4,789.00	2.92%
36	601001	大同煤业	2,196,342.00	4,622.00	2.82%
28	000029	天药股份	2,192,362.06	4,601.06	2.80%
29	000039	中集集团	2,146,150.00	4,501.00	2.75%
30	000729	燕巢转债	2,136,726.68	4,473.68	2.73%
31	000025	中国太保	2,081,033.71	4,387.71	2.69%
32	601088	中国神华	2,039,000.00	4,274.00	2.62%
33	600016	民生证券	1,974,483.94	4,121.94	2.54%
34	600063	岳阳纸业	1,967,180.00	4,101.00	2.52%
35	000023	深天地	1,880,520.00	3,941.00	2.42%
36	000027	华电国际	1,872,294.04	3,934.04	2.41%
37	002106	莱茵高科	1,872,310.28	3,929.28	2.40%
38	000119	宝硕股份	1,818,570.00	3,811.00	2.34%
39	601318	中国平安	1,811,102.49	3,801.49	2.33%
40	600075	新疆广天	1,800,533.00	3,779.00	2.32%
41	600048	保利地产	1,800,242.00	3,774.00	2.31%
42	600016	民生证券	1,801,433.23	3,743.23	2.29%
43	600060	中金岭南	1,686,947.94	3,543.94	2.18%
44	600877	伊泰煤炭	1,694,275.21	3,481.21	2.14%
45	600000	浦发银行	1,476,262.00	3,242.00	1.99%
46	600025	中国太保	1,393,193.43	3,023.43	1.87%
47	600039	中信银行	1,562,277.62	3,272.62	1.99%
48	600886	国电电力	1,565,747.80	3,261.80	1.98%
49	601333	广南铁路	1,540,063.00	3,221.00	1.95%
50	000793	华海药业	1,475,463.00	3,081.00	1.89%
51	000120	渤海银行	1,460,000.00	3,020.00	1.85%
52	000088	五粮液	1,383,660.00	2,901.00	1.79%
53	600619	贵州茅台	1,366,033.67	2,861.67	1.75%
54	600122	安泰高科	1,315,831.16	2,763.16	1.69%
55	600026	中国国贸	1,290,000.00	2,729.00	1.66%
56	600027	华电国际	1,264,700.00	2,724.00	1.65%
57	000000	一汽轿车	1,232,000.00	2,681.00	1.63%
58	002156	鸿博传媒	1,229,630.00	2,589.00	1.59%
59	600316	洪都航空	1,149,165.63	2,411.63	1.48%
60	600031	三一重工	1,090,285.00	2,228.00	1.37%
61	600008	浦发银行	1,090,285.00	2,228.00	1.37%
62	600486	中国信通	1,009,587.70	2,121.70	1.30%
63	600809	中信银行	1,009,587.00	2,121.00	1.30%
64	600271	航天信息	970,463.42	2,031.42	1.24%
65	600898	华鲁恒升	980,223.78	2,028.78	1.23%
66	000026	长电科技	962,393.28	2,023.28	1.22%

卖出股票前十大及买入返售资产前十大明细

序号	股票代码	股票名称	期末数量(股)	期末市值(元)	占基金资产净值比例
1	601166	兴业银行	5,747,177.22	11,400.22	7.06%
2	600030	中信证券	2,381,000.00	5,280.00	3.23%
3	600000	浦发银行	4,560,255.31	10,374.31	6.39%
4	600016	民生证券	3,209,319.98	6,739.98	4.14%
5	000028	中国石化	3,045,897.11	6,381.11	3.94%
7	000069	张裕 A	2,925,316.26	6,113.26	3.76%
8	000002	万科 A	2,905,118.64	5,981.64	3.68%
9	000024	苏宁电器	2,773,483.00	5,811.00	3.57%
10	600016	民生证券	2,760,113.32	5,781.32	3.54%
11	000029	天药股份	2,736,446.20	5,711.20	3.50%
12	000027	华电国际	2,687,000.00	5,713.00	3.50%
13	600019	宝硕股份	2,626,599.28	5,513.28	3.39%
14	600026	中国国贸	2,546,225.56	5,341.56	3.26%
15	000025	中国太保	2,492,797.44	5,221.44	3.19%
16	000028	中国石化	2,396,200.00	5,093.00	3.11%
17	601028	华鲁恒升	2,376,763.04	4,983.04	3.04%
18	600048	保利地产	2,301,302.00	4,941.00	3.03%
19	000729	燕巢转债	2,307,106.00	4,894.00	2.99%
20	600162	袁隆平高	2,132,107.00	4,471.00	2.73%
21	600125	华电能源	2,148,000.00	4,474.00	2.73%
22	000026	长电科技	2,107,772.62	4,401.62	2.68%
23	000027	华电国际	2,093,452.02	4,391.02	2.67%
24	600619	贵州茅台	2,045,965.00	4,281.00	2.63%
25	600030	中信证券	2,042,266.96	4,281.96	2.63%
26	000216	荣泰股份	2,020,628.94	4,231.94	2.59%
27	000059	华联综服	2,017,262.88	4,221.88	2.58%
28	000088	五粮液	1,960,001.00	4,011.00	2.46%

买入返售资产前十大及卖出返售资产前十大明细

序号	股票代码	股票名称	期末数量(股)	期末市值(元)	占基金资产净值比例
1	600000	浦发银行	4,560,255.31	10,374.31	6.39%
2	600016	民生证券	3,209,319.98	6,739.98	4.14%
3	600008	浦发银行	3,209,319.98	6,739.98	4.14%
4	000028	中国石化	3,045,897.11	6,381.11	3.94%
5	000069	张裕 A	2,925,316.26	6,113.26	3.76%
6	000002	万科 A	2,905,118.64	5,981.64	3.68%
7	000024	苏宁电器	2,773,483.00	5,811.00	3.57%
8	600016	民生证券	2,760,113.32	5,781.32	3.54%
9	000029	天药股份	2,736,446.20	5,711.20	3.50%
10	000027	华电国际	2,687,000.00	5,713.00	3.50%
11	000019	宝硕股份	2,626,599.28	5,513.28	3.39%
12	000026	中国国贸	2,546,225.56	5,341.56	3.26%
13	000025	中国太保	2,492,797.44	5,221.44	3.19%
14	600028	中国石化	2,396,200.00	5,093.00	3.11%
15	000028	中国石化	2,396,200.00	5,093.00	3.11%
16	000028	中国石化	2,396,200.00	5,093.00	3.11%
17	601028	华鲁恒升	2,376,763.04	4,983.04	3.04%
18	600048	保利地产	2,301,302.00	4,941.00	3.03%
19	000729	燕巢转债	2,307,106.00	4,471.00	2.73%
20	600162	袁隆平高	2,132,107.00	4,471.00	2.73%
21	600125	华电能源	2,148,000.00	4,474.00	2.73%
22	000026	长电科技	2,107,772.62	4,401.62	2.68%
23	000027	华电国际	2,093,452.02	4,391.02	2.67%
24	600619	贵州茅台	2,045,965.00	4,281.00	2.63%
25	600030	中信证券	2,042,266.96	4,281.96	2.63%