

## Disclosure

D110

## 工銀瑞信精选平衡混合型证券投资基金2007年度报告摘要

(上接D109版)

	增加/减少(基准点)	对净值的影响(元)
--	------------	-----------

2006-12-31 利率 +25 -4,699,367/22 利率 -25 4,742,362/42

3. 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。

九、比较数据 本年度首次执行企业会计准则,本基金按其列报要求对比较数据进行了重述。按企业会计准则的要求,对年末所有者权益及期间净利润的影响数如下:

2007年初所有者权益	2007年上半年净损益	2007年下半年所有者权益
-------------	-------------	---------------

(未审计)	(未审计)	(未审计)
-------	-------	-------

按报告准则列报的金额 8,643,760,643/68 2,511,743,003/24 11,140,085,938/62

金融资产公允价值变动的调整数 -401,390,319/67 -

按新会计准则列报的金额 8,643,760,643/68 2,912,933,329/61 11,140,085,938/62

2006年7月13日至2006年12月31日所有者权益 2006年7月13日至2006年12月31日所有者权益

按报告准则列报的金额 8,369,914,482/23 337,405,801/06 8,643,760,643/68

金融资产公允价值变动的调整数 -2,099,944,978/05 -

按新会计准则列报的金额 8,369,914,482/23 2,437,400,679/10 8,643,760,643/68

根据上述追溯调整,按2007年1月1日前执行的企业会计准则,所有者权益由“未实现利得/损失”科目的投资估值增值/减值的变动,现按企业会计准则,根据变动发生的时间在相关期间内直接计入“未分配利润(累计亏损)”科目,会计期末,按2007年1月1日前执行的企业会计准则和制度分别于所有者权益下“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。

十、其他事项 本基金并无意说明的重大或有事项。

截至报告期末,本基金并无意披露的其他事项。

第十一章 投资组合报告

一、报告期末基金资产组合情况

资产类别	金额(元)	占基金总资产的比例
股票投资	12,606,690,885/21	78.34%
债券投资	3,147,962,494/85	19.95%
权证投资	9,087,408/11	0.09%
银行存款和结算备付金合计	176,496,966/41	1.11%
资产支持证券投资	-	0.00%
其他资产	149,183,929/00	0.93%
合计	16,091,451,588/00	100.00%

二、报告期末按行业分类的股票投资组合

行业 股票市值(元) 占基金资产净值比例

A 农林、牧、渔业	46,891,769/60	0.29%
-----------	---------------	-------

B 采矿业	1,463,682,307/90	9.17%
-------	------------------	-------

C 制造业	4,356,089,800/50	27.27%
-------	------------------	--------

D 建筑业	99,365,417/41	0.65%
-------	---------------	-------

E 交通运输、仓储和邮政业	27,740,368/65	0.17%
---------------	---------------	-------

F 工业、建筑业	706,327,489/05	4.81%
----------	----------------	-------

G 钢铁、有色、汽车、制造	157,762,565/45	0.99%
---------------	----------------	-------

H 纺织、服装、皮毛	697,470,286/69	3.01%
------------	----------------	-------

I 金融、保险业	954,586,948/72	5.98%
----------	----------------	-------

J 信息技术业	210,481,769/38	1.32%
---------	----------------	-------

K 地产业	611,740,582/04	3.85%
-------	----------------	-------

L 商业服务与文化业	27,639,471/47	0.17%
------------	---------------	-------

M 综合类	37,531,392/28	0.24%
-------	---------------	-------

合计	12,606,690,885/21	79.02%
----	-------------------	--------

注:由于四舍五入的原因,因市值占基金资产净值的比例之和可能有尾数。

三、报告期内按市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) 占基金资产净值比例(%)

1 000036 招商银行 24,913,238 987,311,621/94 6.19%
---

2 000707 国阳股份 34,435,593 891,199,639/2 5.63%
--

3 000004 银行股 12,134,798 640,716,700/80 4.02%
--

4 001150 中信银行 2,028,649 504,636,181/36 3.16%
--

5 000199 中国远洋 11,222,376 540,342,304/49 3.16%
---

6 000001 中国平安 1,400,557 490,978,049/57 3.09%
--

7 000070 中国铁建 6,017,413 365,961,526/02 2.26%
--

8 000315 上海石化 6,496,382 314,205,812/34 1.97%
--

9 000006 中国国航 131,732,958 5,436,349,894/71 34.08%
---

注:投资者欲了解本报告期末基金持有的所有股票明细,请阅读附录中我公司网站的年度报告全文。

四、报告期内股票投资组合的重大变动

一、报告期内累计买入前五位基金资产净值2%以上的股票明细:

序号 股票代码 股票名称 数量(股) 累计买入金额(元) 占基金资产净值的比例(%)

1 000036 招商银行 59,494,463/15 526,100,000/00 3.67%
--

2 000707 浦发银行 5,165,242/08 46,630,000/00 3.65%
--

3 000002 万科 A 565,399,030/60 36,667,000/00 5.64%
--

4 000709 中信证券 474,807,231/11 46,380,000/00 5.49%
--

5 000907 中信国际 407,384,765/61 46,380,000/00 4.71%
--

6 000636 招商银行 403,653,197/98 46,380,000/00 4.67%
--

7 000150 中国船舶 376,635,566/05 46,380,000/00 4.36%
--

8 000717 天津港 375,033,846/75 46,380,000/00 4.34%
---

9 000001 深发展 A 363,246,724/54 46,380,000/00 4.28%
---

10 000616 民生银行 349,462,426/07 46,380,000/00 4.05%
---

二、报告期内累计卖出前五位基金资产净值2%以上的股票明细:

序号 股票代码 股票名称 数量(股) 累计卖出金额(元) 占基金资产净值的比例(%)

1 000036 招商银行 79,704,366/34 526,100,000/00 3.73%
--

2 000707 国阳股份 63,817,825/30 526,100,000/00 3.91%
--

3 000004 银行股 56,699,847/43 526,100,000/00 3.20%
---

4 000205 柳钢股份 65,111,049/40 526,100,000/00 3.27%
--

5 000666 中国银行 50,300,000/00 526,100,000/00 3.00%
--

6 000898 钢研股份 52,757,990/51 526,100,000/00 3.15%
--

7 000663 中兴通讯 51,673,511/82 526,100,000/00 3.14%
--

8 000472 包头铝业 51,412,708/11 526,100,000/00 3.11%
--

9 000660 金隅股份 47,726,632/23 526,100,000/00 3.04%
--

10 000669 旗滨玻璃 41,632,092/74 526,100,000/00 2.90%
---

11 000909 金花股份 31,462,573/45 526,100,000/00 2.87%
---

12 000707 中国远洋 29,141,498/36 526,100,000/00 2.85%
---

13 000001 深发展 A 28,107,800/44 526,100,000/00 2.85%
--

14 000709 中国银行 24,174,441/52 526,100,000/00 2.85%
---

15 000907 中国石化 23,815,765/33 526,100,000/00 2.85%
---

16 000339 中信集团 23,776,492/17 526,100,000/00 2.85%
---

17 000223 康恩贝 23,661,185/41 526,100,000/00 2.85%
--

18 000622 山东华泰 23,542,000/43 526,100,000/00 2.84%
---

19 000620 金隅股份 23,457,560/43 526,100,000/00 2.84%
---

20 000621 旗滨玻璃 23,350,000/43 526,100,000/00 2.84%
---

21 000707 中国远洋 23,245,000/43 526,100,000/00 2.84%
---

22 000622 金隅股份 23,140,000/43 526,100,000/00 2.84%
---

23 000623 旗滨玻璃 23,045,000/43 526,100,000/00 2.84%
---

24 000621 金隅股份 22,950,000/43 526,100,000/00 2.84%
---

--