

### 工银瑞信稳健成长股票型证券投资基金 2007 年年度报告摘要

资产	1年以内	1至5年	5年以上	本息	合计
银行存款	8,540,001,226.72	-	-	-	8,540,001,226.72
交易性金融资产	984,607,748.71	-	-	-	984,607,748.71
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
应收证券清算款	-	-	-	-	-
应收利息	-	-	-	13,867,149.56	13,867,149.56
其他流动资产	-	-	-	1,363,780,116.67	1,363,780,116.67
其他资产	-	-	-	280,051.50	280,051.50
资产总计	9,524,608,974.43	-	-	4,476,325,500.89	14,000,934,475.32

负债	合计
应付证券清算款	128,367,212.88
应付赎回款	7,343,216.14
应付管理人报酬	12,746,909.77
应付托管费	2,124,484.56
应付交易费用	2,233,206.77
其他负债	277,076.28
负债合计	153,082,904.77
所有者权益	13,847,851,570.55
未分配利润	13,847,851,570.55
净资产	13,847,851,570.55

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	期末市值(元)	市值占基金资产净值比例(%)
1	600036	招商银行	20,326,331	806,492,867.53	7.04%
2	000709	渤海银行	29,592,881	739,230,167.38	6.47%
3	600000	浦发银行	8,489,891	448,261,492.80	3.92%
4	601919	中国平安	9,987,800	420,360,348.00	3.68%
5	600622	天华超净	7,785,507	389,916,589.66	3.50%
6	000027	华能国际	12,146,386	341,434,910.46	2.99%
7	600000	中信证券	3,724,184	320,460,764.00	2.81%
8	000688	神州数码	4,500,000	320,760,000.00	2.80%
9	600070	中国国贸	5,485,003	320,321,983.26	2.80%
10	000002	万科A	11,281,248	325,261,193.22	2.85%

下表为利率风险的敏感性分析,反映了在其他变量不变的假设下,利率发生合理、可能的变动时,对交易而持有的债券公允价值变动对基金净值产生的影响。

注:投资者欲了解本报告期内基金投资的股票明细,应阅读刊登于本公司网站的年度报告正文。

注:投资者欲了解本报告期内基金投资的股票明细,应阅读刊登于本公司网站的年度报告正文。

项目	增加/减少基点	对净值的影响(元)
利率	+25	-282,079.00
利率	-25	280,984.71

项目	增加/减少基点	对净值的影响(元)
利率	+25	-1,107,678.26
利率	-25	1,111,743.20

3. 外汇风险  
本基金的所有资产及负债均以人民币计价,因此无重大外汇风险。

3. 外汇风险  
本基金的所有资产及负债均以人民币计价,因此无重大外汇风险。

项目	2007年年初所有者权益(未审计)	2007年上半年净损益(未经审计)	2007年上半年末所有者权益(未经审计)
按原会计准则列报的金额	13,847,879,670.65	1,865,749,282.70	13,066,138,388.20
金融资产公允价值变动的调整数	-	4,479,234,363.53	-
按新会计准则列报的金额	13,847,879,670.65	6,345,043,746.23	13,066,138,388.20

项目	2006年12月31日所有者权益(未经审计)	2006年12月6日至2006年12月31日止净损益(未经审计)	2006年末所有者权益(未经审计)
按原会计准则列报的金额	12,229,368,670.26	30,656,150.85	12,260,024,821.11
金融资产公允价值变动的调整数	-	241,544,849.67	-
按新会计准则列报的金额	12,229,368,670.26	302,199,000.72	12,531,523,821.98

注:根据上述追溯调整,按2007年7月1日之前执行的会计准则和制度直接计入所有者权益下“未实现利得(损失)”科目的投资价值增值(减值)净变动,按现行会计准则,根据公允价值变动的期间在相关期间实现的“公允价值变动收益(损失)”科目中核算,相应的未实现利得/公允价值变动损益按现行会计准则直接计入“未分配利润(累计亏损)”科目。于会计期末,按2007年7月1日之前执行的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,按按企业会计准则则包含于“未分配利润(累计亏损)”科目中。

注:根据上述追溯调整,按2007年7月1日之前执行的会计准则和制度直接计入所有者权益下“未实现利得(损失)”科目的投资价值增值(减值)净变动,按现行会计准则,根据公允价值变动的期间在相关期间实现的“公允价值变动收益(损失)”科目中核算,相应的未实现利得/公允价值变动损益按现行会计准则直接计入“未分配利润(累计亏损)”科目。于会计期末,按2007年7月1日之前执行的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,按按企业会计准则则包含于“未分配利润(累计亏损)”科目中。

七、其他重要事项  
截至资产负债表日,本基金无需要说明的其他重要事项。

七、其他重要事项  
截至资产负债表日,本基金无需要说明的其他重要事项。

七、其他重要事项  
截至资产负债表日,本基金无需要说明的其他重要事项。

七、其他重要事项  
截至资产负债表日,本基金无需要说明的其他重要事项。

资产类别	金额(元)	占基金总资产的比例
股票投资	10,063,326,511.56	87.23%
债券投资	803,634,523.61	6.97%
权证投资	2,891,433.17	0.03%
银行存款及结算备付金合计	130,725,448.89	1.13%
资产支持证券投资	0	0.00%
其他资产	534,380,251.33	4.64%
合计	11,524,956,188.56	100.00%

行业	股票市值(元)	市值占基金资产净值比例
A 农林牧渔	827,266.00	0.01%
B 采掘业	1,500,900,640.19	13.13%
C 制造业	3,361,430,606.05	29.40%
D 食品饮料	421,710,000.00	3.69%
E 纺织服装	362,560.00	0.00%
F 建筑材料	0	0.00%
G 造纸、印刷	35,400,000.00	0.31%
H 石油、化学、塑胶、塑料	537,655,636.60	4.70%
I 电子	2,201,282.30	0.02%

行业	股票市值(元)	市值占基金资产净值比例
A 农林牧渔	827,266.00	0.01%
B 采掘业	1,500,900,640.19	13.13%
C 制造业	3,361,430,606.05	29.40%
D 食品饮料	421,710,000.00	3.69%
E 纺织服装	362,560.00	0.00%
F 建筑材料	0	0.00%
G 造纸、印刷	35,400,000.00	0.31%
H 石油、化学、塑胶、塑料	537,655,636.60	4.70%
I 电子	2,201,282.30	0.02%

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	期末市值(元)	市值占基金资产净值比例(%)
1	600619	中国平安	497,326,419.23	3.49%	
2	000709	渤海银行	460,412,224.54	3.32%	
3	600000	浦发银行	575,510,347.88	2.71%	
4	601006	大秦铁路	363,856,364.88	2.63%	
5	600410	沈阳机床	312,905,706.30	2.40%	
6	600039	贵州茅台	305,184,754.19	2.20%	
7	600116	兴业银行	304,398,406.61	2.20%	
8	000001	浦发银行	282,822,634.94	2.04%	
9	601318	中国平安	281,631,326.51	2.03%	
10	000027	华能国际	269,698,949.00	1.95%	
11	600150	中国铝业	256,556,291.96	1.85%	
12	000083	中信证券	251,297,315.73	1.81%	
13	600030	中信证券	249,289,116.26	1.81%	
14	600600	中化国际	243,348,463.36	1.76%	
15	600682	天地科技	228,738,583.36	1.66%	
16	000021	深发展A	214,486,883.13	1.56%	
17	600415	小商品城	212,364,562.02	1.53%	
18	000968	绿岛化学	203,394,579.45	1.47%	
19	000029	中航地产	201,354,653.15	1.46%	

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	期末市值(元)	市值占基金资产净值比例(%)
1	000063	中兴通讯	1,060,522,121.40	7.69%	
2	600036	招商银行	897,011,269.45	5.83%	
3	600009	上海证券	693,225,822.99	5.01%	
4	601218	中国平安	602,026,582.81	4.69%	
5	600000	浦发银行	620,029,562.91	4.48%	
6	600410	沈阳机床	559,998,412.28	4.04%	
7	600039	贵州茅台	439,069,374.34	3.13%	
8	601628	中国人寿	427,002,227.00	3.08%	
9	000709	渤海银行	416,598,009.49	3.01%	
10	601006	大秦铁路	388,415,264.14	2.80%	
11	600276	恒顺醋业	384,720,686.36	2.78%	
12	000561	粤传媒	367,063,794.12	2.69%	
13	600415	小商品城	355,956,689.66	2.54%	
14	600000	浦发银行	344,666,747.25	2.47%	
15	600717	天津港	342,644,880.00	2.44%	
16	600010	中国平安	338,079,380.00	2.42%	
17	000029	中航地产	334,974,586.32	2.42%	
18	000086	中国国贸	329,569,946.69	2.36%	
19	000088	阳光股份	272,024,060.07	1.97%	
20	000617	石炼化	242,362,604.87	1.76%	

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	期末市值(元)	市值占基金资产净值比例(%)
1	000063	中兴通讯	1,060,522,121.40	7.69%	
2	600036	招商银行	897,011,269.45	5.83%	
3	600009	上海证券	693,225,822.99	5.01%	
4	601218	中国平安	602,026,582.81	4.69%	
5	600000	浦发银行	620,029,562.91	4.48%	
6	600410	沈阳机床	559,998,412.28	4.04%	
7	600039	贵州茅台	439,069,374.34	3.13%	
8	601628	中国人寿	427,002,227.00	3.08%	
9	000709	渤海银行	416,598,009.49	3.01%	
10	601006	大秦铁路	388,415,264.14	2.80%	
11	600276	恒顺醋业	384,720,686.36	2.78%	
12	000561	粤传媒	367,063,794.12	2.69%	
13	600415	小商品城	355,956,689.66	2.54%	
14	600000	浦发银行	344,666,747.25	2.47%	
15	600717	天津港	342,644,880.00	2.44%	
16	600010	中国平安	338,079,380.00	2.42%	
17	000029	中航地产	334,974,586.32	2.42%	
18	000086	中国国贸	329,569,946.69	2.36%	
19	000088	阳光股份	272,024,060.07	1.97%	
20	000617	石炼化	242,362,604.87	1.76%	

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	期末市值(元)	市值占基金资产净值比例(%)
1	000063	中兴通讯	1,060,522,121.40	7.69%	
2	600036	招商银行	897,011,269.45	5.83%	
3	600009	上海证券	693,225,822.99	5.01%	
4	601218	中国平安	602,026,582.81	4.69%	
5	600000	浦发银行	620,029,562.91	4.48%	
6	600410	沈阳机床	559,998,412.28	4.04%	
7	600039	贵州茅台	439,069,374.34	3.13%	
8	601628	中国人寿	427,002,227.00	3.08%	
9	000709	渤海银行	416,598,009.49	3.01%	
10	601006	大秦铁路	388,415,264.14	2.80%	
11	600276	恒顺醋业	384,720,686.36	2.78%	
12	000561	粤传媒	367,063,794.12	2.69%	
13	600415	小商品城	355,956,689.66	2.54%	
14	600000	浦发银行	344,666,747.25	2.47%	
15	600717	天津港	342,644,880.00	2.44%	
16	600010	中国平安	338,079,380.00	2.42%	
17	000029	中航地产	334,974,586.32	2.42%	
18	000086	中国国贸	329,569,946.69	2.36%	
19	000088	阳光股份	272,024,060.07	1.97%	
20	000617	石炼化	242,362,604.87	1.76%	

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	期末市值(元)	市值占基金资产净值比例(%)
1	600619	中国平安	999,360	229,988,500.00	2.36%
2	000752	渤海银行	2,548,553	200,038,507.54	2.09%
3	600024	苏宁电器	8,493,837	177,816,162.38	1.85%
4	000244	苏宁电器	2,449,428	176,020,044.76	1.80%

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	期末市值(元)	市值占基金资产净值比例(%)
1	000063	中兴通讯	1,060,522,121.40	7.69%	
2	600036	招商银行	897,011,269.45	5.83%	
3	600009	上海证券	693,225,822.99	5.01%	
4	601218	中国平安	602,026,582.81	4.69%	
5	600000	浦发银行	620,029,562.91	4.48%	
6	600410	沈阳机床	559,998,412.28	4.04%	
7	600039	贵州茅台	439,069,374.34	3.13%	
8	601628	中国人寿	427,002,227.00	3.08%	
9	000709	渤海银行	416,598,009.49	3.01%	
10	601006	大秦铁路	388,415,264.14	2.80%	
11	600276	恒顺醋业	384,720,686.36	2.78%	
12	000561	粤传媒	367,063,794.12	2.69%	
13	600415	小商品城	355,956,689.66	2.54%	
14	600000	浦发银行	344,666,747.25	2.47%	
15	600717	天津港	342,644,880.00	2.44%	
16	600010	中国平安	338,079,380.00	2.42%	
17	000029	中航地产	334,974,586.32	2.42%	
18	000086	中国国贸	329,569,946.69	2.36%	
19	000088	阳光股份	272,024,060.07	1.97%	
20	000617	石炼化	242,362,604.87	1.76%	

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	期末市值(元)	市值占基金资产净值比例(%)
1	600619	中国平安	999,360	229,988,500.00	2.36%
2	000752	渤海银行	2,548,553	200,038,507.54	2.09%
3	600024	苏宁电器	8,493,837	177,816,162.38	1.85%
4	000244	苏宁电器	2,449,428	176,020,044.76	1.80%

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	期末市值(元)	市值占基金资产净值比例(%)
1	000063	中兴通讯	1,060,522,121.40	7.69%	
2	600036	招商银行	897,011,269.45	5.83%	
3	600009	上海证券	693,225,822.99	5.01%	
4	601218	中国平安	602,026,582.81	4.69%	
5	600000	浦发银行	620,029,562.91	4.48%	
6	600410	沈阳机床	559,998,412.28	4.04%	
7	600039	贵州茅台	439,069,374.34	3.13%	
8	601628	中国人寿	427,002,227.00	3.08%	
9	000709	渤海银行	416,598,009.49	3.01%	
10	601006	大秦铁路	388,415,264.14	2.80%	
11	600276	恒顺醋业	384,720,686.36	2.78%	
12	000561	粤传媒	367,063,794.12	2.69%	
1					