

中海优质成长证券投资基金 2007 年年度报告摘要

(上接 D89 页) 2006年末行业配置风险状况

Table with 4 columns: 行业, 权重, 沪深300, 跟踪误差贡献. Lists various industries like 医药, 食品饮料, 公用事业, etc.

(5) 利率风险: 本基金持有的大部分金融资产和金融负债不计息, 因此本基金的收入及经营活动的现金流量在很大程度上独立于利率的变化...

(6) 汇率风险: 本基金没有持有外汇资产及负债, 故本基金受汇率变化的直接影响。

(7) VaR分析: 本报告期内进行 VaR 分析, 在 95% 的置信水平下, 24 小时之内最大损失率 (跌幅) 为 3.01%, 在 99% 的置信水平下, 24 小时之内最大损失率 (跌幅) 为 4.41%...

七、基金投资组合报告: 本基金管理人——交通银行已于 2008 年 3 月 27 日更新了本报告, 截至 2007 年 12 月 31 日, 中海优质成长证券投资基金资产净值为 7,729,496,749.79 元, 份额净值为 0.9398 元, 基金份额为 8,224,782,500.82 份。

Table with 3 columns: 项目市值 (人民币元), 占基金资产净值比例(%), 基金份额. Lists various assets like 股票, 债券, 银行存款及结算备付金, etc.

Table with 3 columns: 行业, 市值 (人民币元), 占基金资产净值比例(%). Lists industries like 农林牧渔, 医药, 食品饮料, etc.

Table with 3 columns: 序号, 股票代码, 股票名称. Lists top 100 stocks by market value.

注: 投资者想了解本报告期末基金投资的有关说明, 应当阅读刊登于中国证监会官方网站 (www.zhonghai.com) 的年度报告正文。

八、报告期内基金投资组合的重大变动: (1) 报告期内买入/卖出股票市值占期末基金资产净值比例超过 2% 的股票明细

Table with 4 columns: 序号, 股票代码, 股票名称, 买入/卖出金额. Lists significant stock transactions.

(2) 报告期内买入/卖出债券市值占期末基金资产净值比例超过 2% 的债券明细

Table with 4 columns: 序号, 股票代码, 债券名称, 买入/卖出金额. Lists significant bond transactions.

Table with 4 columns: 序号, 股票代码, 股票名称, 期末市值 (人民币元). Lists top 100 stocks by market value at the end of the period.

累计卖出金额占期末基金资产净值比例超过 2% 的股票明细

Table with 4 columns: 序号, 股票代码, 股票名称, 卖出金额. Lists significant stock sell-off transactions.

Table with 4 columns: 序号, 股票代码, 股票名称, 期末市值 (人民币元). Lists top 100 stocks by market value at the end of the period.

Table with 3 columns: 券种, 市值 (人民币元), 市值占基金资产净值比例(%). Lists bond holdings.

Table with 3 columns: 券种, 市值 (人民币元), 市值占基金资产净值比例(%). Lists equity holdings.

7. 投资组合报告附注: 1. 报告期内本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本报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情况。

Table with 4 columns: 权证代码, 权证名称, 权证数量, 权证成本. Lists warrant holdings.

Table with 4 columns: 基金代码, 基金名称, 基金市值, 基金占比. Lists mutual fund holdings.

八、基金份额持有人户数、持有人结构: 截至 2007 年 12 月 31 日, 本基金基金份额持有人户数为 103,498.07 户, 机构投资者持有 9,621,562.92 份, 个人投资者持有 2,202,747,236.06 份。

Table with 5 columns: 持有人户名, 持有份额 (份), 持有比例 (%), 持有份额 (份), 持有比例 (%). Lists major shareholders.

Table with 2 columns: 项目, 份额 (份). Lists fund assets and liabilities.

Table with 2 columns: 项目, 份额 (份). Lists fund assets and liabilities.

Table with 2 columns: 项目, 份额 (份). Lists fund assets and liabilities.

Table with 2 columns: 项目, 份额 (份). Lists fund assets and liabilities.

Table with 2 columns: 项目, 份额 (份). Lists fund assets and liabilities.

Table with 2 columns: 项目, 份额 (份). Lists fund assets and liabilities.

Table with 2 columns: 项目, 份额 (份). Lists fund assets and liabilities.

Table with 2 columns: 项目, 份额 (份). Lists fund assets and liabilities.

Table with 2 columns: 项目, 份额 (份). Lists fund assets and liabilities.

Table with 2 columns: 项目, 份额 (份). Lists fund assets and liabilities.

Table with 2 columns: 项目, 份额 (份). Lists fund assets and liabilities.

Table with 2 columns: 项目, 份额 (份). Lists fund assets and liabilities.

Table with 2 columns: 项目, 份额 (份). Lists fund assets and liabilities.

Table with 2 columns: 项目, 份额 (份). Lists fund assets and liabilities.

Table with 2 columns: 项目, 份额 (份). Lists fund assets and liabilities.

Table with 2 columns: 项目, 份额 (份). Lists fund assets and liabilities.

Table with 2 columns: 项目, 份额 (份). Lists fund assets and liabilities.

Table with 2 columns: 项目, 份额 (份). Lists fund assets and liabilities.

Table with 2 columns: 项目, 份额 (份). Lists fund assets and liabilities.

Table with 2 columns: 项目, 份额 (份). Lists fund assets and liabilities.

Table with 2 columns: 项目, 份额 (份). Lists fund assets and liabilities.

Table with 2 columns: 项目, 份额 (份). Lists fund assets and liabilities.