

Disclosure

D111

中邮核心优选股票型证券投资基金2007年年度报告摘要

(上接D110版)

001111	中国国航	366,723,221.96	17.03%
000649	顺丰股份	357,711,820.70	16.65%
000538	云南白药	356,073,980.67	16.57%
600900	长江电力	362,613,666.14	16.41%
600890	博瑞传播	351,331,409.68	16.38%
000792	盐湖钾肥	345,768,325.34	16.09%
000616	亿阳信通	328,366,242.29	15.97%
000609	光大银行	310,191,942.67	14.44%
000675	中华企业	305,729,219.74	14.23%
600309	烟台万华	303,248,710.87	14.12%
000639	浦东金桥	283,623,982.52	13.20%
600475	华光环通	276,572,271.30	12.87%
600685	广船国际	267,473,595.69	12.46%
000659	贵州茅台	264,841,599.40	12.33%
000412	海螺水泥	261,181,461.49	12.29%
000690	中金黄金	262,397,042.25	12.21%
600629	山东东岳	259,865,982.43	12.10%
000619	贵州茅台	257,963,493.06	12.00%
600201	金字火腿	244,469,341.25	11.38%
000795	国电电力	226,612,041.64	10.95%
600267	海正药业	225,037,069.97	10.47%
000605	美的集团	221,068,597.91	10.29%
000623	东软集团	220,269,449.49	10.29%
000646	海通建设	217,245,634.96	10.11%
601919	中国银行	206,938,130.46	9.63%
000748	上海家化	204,166,165.73	9.50%
600293	南方航空	193,075,133.06	8.89%
000635	四川长虹	191,465,056.69	8.91%
600608	马钢股份	189,601,424.63	8.87%
600605	武钢股份	181,978,936.62	8.47%
600602	柳钢股份	174,741,601.04	8.37%
600657	康佳电子	172,670,940.00	8.04%
600440	中纺国际	169,272,339.44	7.88%
600897	鞍钢股份	168,018,281.66	7.82%
000755	山西太钢	160,960,700.62	7.49%
000331	鞍钢股份	146,331,511.64	6.81%
600666	宇通客车	142,114,070.62	6.66%
600602	张裕A	140,490,100.00	6.52%
600729	新钢股份	137,496,672.22	6.40%
600629	攀钢钒钛	136,811,566.97	6.32%
600899	王府井	129,523,989.69	6.03%
600973	宝胜股份	129,211,791.17	6.01%
600600	中化国际	128,156,513.63	5.97%
600633	中兴通讯	127,825,756.65	5.96%
600695	双汇发展	120,159,836.96	5.56%
600659	鞍钢股份	115,720,400.00	5.50%
600661	格力电器	117,700,761.13	5.46%
601957	中国石油	114,964,104.00	5.36%
600930	鲁西化工	112,004,067.07	5.21%
600100	STT TCL	110,330,705.17	5.14%
600281	中航技	109,628,011.90	5.11%
000687	保利地产	108,694,035.75	5.06%
600707	新钢股份	107,500,000.00	5.05%
600130	中行	106,396,684.30	5.04%
000659	华能国际	106,771,322.12	4.97%
600456	宝胜股份	105,616,394.06	4.92%
601666	平煤股份	103,240,506.37	4.81%
600748	长城电脑	103,062,776.09	4.80%
601600	中远国际	100,818,149.63	4.69%
600120	晋亿实业	100,765,452.27	4.69%
600607	风华高科	99,760,000.00	4.63%
600711	风华高科	99,070,690.70	4.61%
600423	恒华股份	99,133,367.07	4.20%
000717	韶能股份	89,519,000.21	4.19%
600160	巨化股份	82,073,488.26	3.85%
600704	中航资本	79,730,447.14	3.71%
600177	雅戈尔	78,913,351.73	3.21%
600677	元通股份	77,519,963.42	3.14%
600100	方正富邦	76,475,467.00	3.11%
600100	同方股份	66,775,467.01	3.00%
600090	青岛海尔	61,878,396.29	2.98%
600362	浙江龙盛	60,929,376.01	2.84%
600696	新安股份	59,513,194.96	2.72%
600281	新世界	58,254,110.94	2.71%
600257	利源铝业	58,115,616.63	2.71%
600481	双钱股份	56,077,113.62	2.70%
600103	生益科技	55,760,000.00	2.69%
600697	云铝股份	55,600,000.00	2.69%
600100	白云山A	46,833,424.25	2.10%
600622	农产品	43,811,510.03	2.04%
600601	鄂武钢A	43,655,173.62	2.03%
600449	丽人药业	43,307,107.16	2.02%
600883	金地集团	42,966,465.97	2.00%
2. 报告期内累计卖出价值超出期初基金资产净值2%或前20名的股票明细			
股票代码	股票名称	累计买入金额(元)	占期末基金资产净值比例
000623	吉林敖东	2,188,961,964.58	10.18%
600739	辽宁成大	2,056,390,181.43	9.60%
000619	宝钢股份	1,990,392,393.13	9.26%
000703	唐钢股份	1,834,001,266.56	8.57%
600150	中国联通	1,658,200,000.00	7.61%
600230	中国船舶	1,601,163,165.00	7.22%
600694	柳钢股份	1,506,346,962.69	7.02%
600222	海南钢铁	1,361,261,691.91	6.43%
600636	上海机电	1,264,394,626.97	5.87%
000602	万科A	1,174,596,706.82	5.46%
000696	鞍钢股份	1,168,416,071.02	5.43%
600028	中行	1,155,422,164.04	5.19%
601318	中国平安	1,096,744,204.93	5.10%

中邮核心成长股票型证券投资基金2007年年度报告摘要

(上接D112版)

注:本基金的收益率为2007年十年期间收益率平均值3.9%,利用2007年9月17日完成建仓开放申赎至2007年底基金日收益率计算得到基金的Beta系数为0.89,利用CAPM模型得到最后结果。

(2) 利率风险

利率风险指基金的财务状况和现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。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市场利率变化,本基金的现金资产主要为银行存款、结算备付金和债券投资等。

下表显示了本基金面对的利率风险敞口。表中所示为本基金资产及负债的公允价值,并按照行约定期的利率重新定价或到期限孰低者予以分类。

2007年12月31日,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增加约13,206,311.53元;反之,若市场利率下降25个基点且其他市场变量保持不变,本基金资产净值将下降约13,206,311.53元。

七、投资组合报告

(一)报告期末基金资产组成部分

项目名称	项目市值(元)	占基金总资产比例
股票	42,955,595,403.79	88.10%
债券	51,344,595.06	0.11%
银行存款及结算备付金合计	5,591,766,425.61	11.47%
权证	—	—
其他资产	157,328,798.02	0.32%
资产总计	48,766,025,222.48	100.00%

(二)报告期末按行业分类的股票投资组合

行业分类

股票代码

股票名称

累计买入金额(元)

占期末基金资产净值比例

占基金总资产比例

占基金总资产比例