

华夏债券投资基金 2007年年度报告摘要

基金管理人:华夏基金管理有限公司

基金托管人:交通银行股份有限公司

重要提示
基金管理人的董事会及董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏,并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带责任。本报告已经三分之二以上独立董事签字同意,并由董事长签发。

基金托管人交通银行股份有限公司根据本基金合同约定,于2008年3月21日复核了本报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容,保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产,但不保证基金一定盈利,也不保证基金份额持有人的投资本金不受损失。投资有风险,投资者在作出投资决策前应先仔细阅读本基金的招募说明书。

本报告中财务资料经审计,普华永道中天会计师事务所为基金出具了无保留意见的审计报告,请投资者注意阅读。本报告自2007年1月1日起至2007年12月31日止。
本年度报告摘要摘自年度报告正文,投资者欲了解详细内容,应阅读年度报告正文。

(一)基金基本情况
基金名称:华夏债券投资基金
基金简称:华夏债券(A/B类),华夏债券(C类)
基金代码:001001(前端收费模式);001002(后端收费模式);001003(C类收费模式)
基金运作方式:契约开放式
基金合同生效日:2002年10月23日
报告期末基金份总额5,973,466,730.62份
其中:
华夏债券(A/B类):4,532,423,749.53份
华夏债券(C类):1,441,042,981.09份
基金合同存续期:不定期
基金合同存续期:不定期

(二)基金产品说明
基金投资目标:在确保本金安全的前提下,追求较高的当期收入和总回报。
基金投资策略:本基金将在遵守证券法律法规并有明确法律依据的基础上,通过价值分析,结合自上而下确定投资策略和自下而上个股选择程序,采取久期管理、收益率匹配和资产配置等积极投资策略,发现、确认并利用市场失衡实现组合增值。
业绩比较基准:53%中信标普银行间债券指数+46%中信标普国债指数+1%中信标普企业债指数
风险收益特征:本基金属于证券投资基金中相对较低风险的品种,其长期平均的风险和预期收益率低于股票基金和平衡型基金,高于货币市场基金。

(三)基金管理人有关情况
基金管理人名称:华夏基金管理有限公司
CHINA ASSIST MANAGEMENT CO.,LTD.
注册地址:北京市顺义区天竺空港工业A区
办公地址:北京市西城区金融大街33号通泰大厦B座8层
邮政编码:100032
法定代表人:凌新源
信息披露负责人:廖方
客户服务电话:400-919-6666
传真:(010)89066151
国际互联网网址:www.ChinaAMC.com
电子邮箱:service@ChinaAMC.com

(四)基金托管人有关情况
基金托管人名称:交通银行股份有限公司(简称“交通银行”)
注册地址:上海市浦东新区银城中路188号
办公地址:上海市浦东新区银城中路188号
邮政编码:200120
法定代表人:蒋尚义
信息披露负责人:张咏东
联系电话:(021)68888817
传真:(021)68498008
国际互联网网址:www.bankcomm.com
电子邮箱:zhangy@bankcomm.com

(五)信息披露事项
投资者可通过“中国证券报”、“上海证券报”、“证券时报”和基金管理人网站www.ChinaAMC.com查阅本报告。

本报告中基金管理人及基金托管人的住所、投资、投资者可要求查阅、复制。
(六)聘请的会计师事务所
名称:普华永道中天会计师事务所有限公司
注册地址:上海浦东新区陆家嘴环路1233号4楼1111室(邮编:200120)
办公地址:上海市淮海路202号华银大厦中国11楼(邮编:200021)

(七)注册登记机构
名称:华夏基金管理有限公司
注册地址:北京市顺义区天竺空港工业A区
办公地址:北京市西城区金融大街33号通泰大厦B座8层

二、主要财务指标、基金净值表现及收益分配情况
重要提示:下述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用,计入费用后实际收益水平要低于所列数据。

(一)主要财务指标
1.华夏债券(A/B类)基金

项目	2007年	2006年	2005年
本期利润	567,510,205.74	157,730,310.65	89,881,146.03
本期基金份额持有人申购/赎回变动损益	501,648,772.90	112,876,473.14	48,338,773.36
本期公允价值变动损益	1,829,210.22	4,002.73	10,073.21
期间费用	289,229,623.97	10,249,223.67	6,984,928.63
期末基金份额净值	0.0083	0.0083	0.0049
期末基金资产净值	5,037,587,013.27	999,239,316.77	1,462,183,860.65
期末基金份额持有人数量	1,111,111	1,003	1,016
期末基金份额持有人户数	13,868	9,826	8,529
本期基金份额持有人户数	17,254	10,674	10,773
本期基金份额持有人户数	12,678	9,244	10,659

2.华夏债券(C类)基金

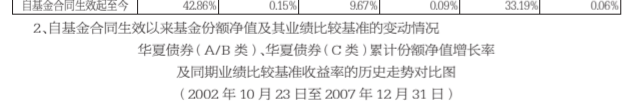
项目	2007年	2006年	2005年
本期利润	128,322,819.02	11,107,691.29	89,881,146.03
本期基金份额持有人申购/赎回变动损益	127,169,904.94	7,146,692.87	48,338,773.36
本期公允价值变动损益	0.95	0.08	0.08
期间费用	81,664,497.87	1,888,603.00	6,984,928.63
期末基金份额净值	0.0097	0.0097	0.0049
期末基金资产净值	1,591,510,122.21	284,566,114.46	1,462,183,860.65
期末基金份额持有人数量	13,868	1,016	1,016
期末基金份额持有人户数	13,868	6,529	8,529
本期基金份额持有人户数	16,509	10,153	10,773
本期基金份额持有人户数	42,268	10,674	10,659

(二)基金净值表现及收益分配情况
1.基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	华夏债券(A/B类)		华夏债券(C类)		①-③	②-④
	份额净值增长率	业绩比较基准收益率	份额净值增长率	业绩比较基准收益率		
过去一个月	2.08%	0.15%	0.23%	0.04%	1.95%	0.13%
过去三个月	3.92%	0.27%	0.34%	0.04%	3.45%	0.23%
过去六个月	8.72%	0.21%	0.68%	0.06%	7.98%	0.15%
过去一年	17.25%	0.19%	-1.27%	0.06%	18.25%	0.13%
过去三年	11.28%	0.20%	-1.27%	0.04%	12.68%	0.08%
过去五年	42.83%	0.15%	9.85%	0.07%	33.34%	0.08%
自基金合同生效至今	43.69%	0.15%	9.67%	0.06%	34.02%	0.06%

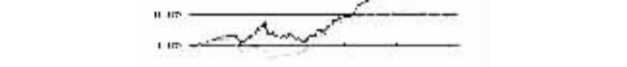
2.自基金合同生效以来基金净值表现及其业绩比较基准的变动情况

华夏债券(A/B类)、华夏债券(C类)基金份额净值增长率及同期业绩比较基准收益的历史走势对比图(2002年10月23日至2007年12月31日)



注:(1)本基金成立于2002年10月23日生效,2002年11月19日开始申购、赎回业务。
(2)根据华夏债券基金合同,本基金自基金合同生效日起3个月内使基金的投资组合比例符合基金合同第十九条(二)投资范围、(七)投资策略的有关约定。

3.过往三年基金每年净值增长率及同期业绩比较基准收益率的柱形对比图



4.过往三年基金每年的收益分配情况

年度	每10份基金份额的分红数
2005年A/B类	1.000元
2005年C类	0.000元
2006年A/B类	0.000元
2006年C类	0.000元
合计A/B类	2.800元
C类	0.000元

三、管理人报告
(一)基金管理人及基金经理情况
1.基金管理人及其管理基金的经验
华夏基金管理有限公司成立于1998年4月9日,是经中国证监会批准成立的首批全国性基金管理

公司,总部设在北京,在北京、上海、深圳和成都设有分公司,华夏基金是全国首批社保基金投资管理
人,首批企业年金基金投资管理、中国内地首批RIF基金管理人及国内首批ODI基金管理人。
华夏基金是国内唯一获得亚洲债券基金管理资格的投资管理机构。

截至2007年12月31日,公司管理证券投资基金规模达到2481亿元,基金份额持有人户数超过
1000万,是国内管理基金资产规模最大的基金管理公司。公司管理兴华、兴和2只封闭式基金,华夏成
长、华夏债券、华夏回报、华夏现金增利、华夏大盘精选、50ETF、华夏红利、中小板ETF、华夏回报二号、
华夏稳增、华夏优势增长、华夏蓝筹、华夏全球、华夏行业14只开放式基金,以及创新型封闭式基金华夏复
兴、亚洲债券基金二期中国子基金、多只全国社保基金投资组合和几十只企业年金组合,管理资产总规模
超过2600亿元。

(二)基金业绩说明
韩会亮先生,经济学硕士,曾任职于招商银行北京分行,2000年加入华夏基金管理有限公司,历任
研究发展部副经理、基金经理助理,华夏现金增利基金基金经理(2005年4月至2006年1月期间),
现任固定收益部副经理,华夏债券投资基金基金经理(2004年2月起任职),华夏现金增利
证券投资基金基金经理(2007年1月起任职)。
(三)报告期内基金运作的遵守情况的说明
本报告期内,本基金管理人严格遵守《证券投资基金法》、《证券投资基金销售管理办法》、《证券投资
基金运作管理办法》、基金合同和其他有关法律法规、监管规定,恪尽职守,勤勉尽责,安全合
规地管理和运用基金资产,在风险控制的前提下,为基金份额持有人谋求最大利益,没有损害基金持有
人利益的行为。报告期内,因市场波动导致华夏债券基金于个别交易日基金份额净值合计值
低于基金资产净值低于80%,上述指标已于有关报告期内调整,未违反法律法规及基金合同的规
定,也未对基金份额持有人利益造成实质影响。

(三)报告期内基金的投资表现和投资策略
1.本基金业绩表现
截至2007年12月31日,华夏债券(A/B类)基金份额净值为1.111元,本报告期份额净值增长
率为17.25%,华夏债券(C类)基金份额净值为1.104元,本报告期份额净值增长率为16.90%,同期业
绩比较基准增长率为-1.27%。
2.行情回顾及运作分析
2007年,人民币继续采取渐进升值策略,经常性项目和资本项目双顺差及由此导致的被动货
币投放使市场流动性整体处于过剩状态,压低了实际利率。低利率和宽松的汇率环境对经济生产刺激
作用,经济增速进一步加快,全年国内生产总值增幅达11.4%。信贷增长宽松,通货膨胀加剧,央行先后6
次提高存款利率,而新股申购的高收益率进一步推高了无风险利率,导致全年债券市场出现下跌。全
年中信标普国债指数涨幅为-0.45%,收益率曲线出现大幅上移,其中中期利率上升幅度最大。上半
年受通胀预期上升影响,收益率曲线以陡变为主;下半年随着基准利率的上升,收益率曲线趋于平
滑,信用债市场流动性进一步上升,信用债利率扩大。此外,由于股市涨幅较大,中债转债指数大幅上
升,受通胀预期和流动性宽松等因素影响,转债市场整体处于宽松,转债市场有所上移。
2007年初,长期国债利率上升,本基金逐步降低了长久期,规避了市场调整的风险,并于下
半年逐步提高了短久期,可转债投资,基金于年初增持了城投债仓位,并随市场上逐步进行了减持。
通过增持持有大量久期债基金合同,从今年四月份开始进行新债投资,重点投资了中国远洋等新股,
为基金贡献了较多的收益。

3.市场回顾和投资策略
新的一年,中国经济增长面临外部需求的不确定性,自然灾害对上半年的经济增长会产生一定负
面影响,外需的下降和内部宏观调控使经济增速趋缓,通胀、资金面方面,全年信贷控制使银行对债券的
投资需求有所上升,股票市场则因收益的下降以及新股发行方式而面的冲击也增加了机构投资者对
债券资产的配置需求。从债券类资产看,主权债和准主权债供应有所下降,公司债券供应有所上升。总
体上,2008年债券市场面较好的投资机会,风险因素在于通胀压力为未来债市提供不确定性,此外,
今年新增发行的增加也将使债市市场流动性有所改善。

新增基金份额持有人的每一分投资和每一份信任,华夏债券基金将继续奉行华夏基金管理有限公司
“为信任服务”的经营理念,坚持低风险、流动性的思路,规范运作,审慎投资,在安全的前提下为
持有人谋求长期、稳定的回报。

(四)内部控制监督
报告期内,本基金管理人在内部控制工作中一切从合规运作,保障基金持有人利益出发,由独立于各
业务部门内部监察人员对公司经营、基金业务及员工行为合规性进行定期和不定期的检查,发现问题
及时报告有关部门整改,并及时向监管部门报告管理层。报告期内,本基金管理人内部控制工作点
增加了以下几个方面:

- 1.对所有员工进行了相关法规培训。
 - 2.进一步完善了有关合同审查的制度。
 - 3.制定了员工投资证券基金等有关规定。
 - 4.加强了对投资人的监督,制定并落实了关于防范投资人道德风险的有关措施。
 - 5.完成了对投资、营销等业务专项稽核。
- 本报告期内,本基金管理人所管理的基金整体运作合规合法,无不当内幕交易和关联交易,保障了基
金持有人利益。我们将继续以风险控制为核心,提高内部监督工作的科学性和有效性,切实保障基金安
全、合规运作。

(五)为投资人提供的服务
2007年,华夏债券凭借自身强大的研发投入,旗下基金得到广泛业绩认可,全年为投资者创造收益达
到880亿元。

- 根据中国银河证券研究中心的统计,截至2007年底,在股票型、偏股型及平衡型三个主要基金
类型中,排名第一的全部为华夏基金旗下管理的基金。
 - 2007年全部主动型股票基金收益排行榜中,前20名华夏基金占4席(来源于wind资讯)。
 - 华夏基金于2007年净值增长率超过150%的基金有4只,所有合同生效在一年以上的偏股型
基金2007年净值增长率全部超过100%。
- 2007年,华夏基金继续加大软硬件投入,不断提高客户服务水平,全力打造高质量的客户服务品牌。
●获得客户等级标准体系五星认证,成为基金行业唯一通过此认证的企企业。
●搭建投资者俱乐部,建立有效沟通机制,提升人员服务水平。
●采取多种手段,全面提高服务质量:1.加大呼叫中心硬件投入,扩充客服人员;2.通过网站热点问
题,服务支持等方式,提高信息服务质量;3.根据客户需求,每季度为持有人寄送基金年度报告、客户服
务问答等服务材料,加强与持有人的信息沟通。

●新增服务手段,2007年,华夏基金增加了自助电话服务项目,推出电子账单、个性化净值短信等
新服务项目,丰富服务内容。
●提高网上交易服务能力,增加网上交易支付渠道,目前网上交易支持建行卡、农行卡、兴业卡、广发
卡、招行卡、浦发卡等多种银行卡支付,不断优化网上交易操作界面,提高客户体验。
●为树立专业的基金投资理念,增进与投资人之间的交流,2007年华夏基金在投资理财服务方面加大
投入:

- 在网站开辟投资者教育专区,制作专题页面,并开展“我的理财故事”有奖征文活动。
- 与各大媒体合作开展“投资者走进华夏基金”等客户交流活动。
- 编撰出版60万册投资者教育丛书《华夏基金投资者百问》,免费发放给投资者阅读,在26家都市
报及全国性财经报刊开设“投资者教育专栏”。
- 举办投资者教育系列活动“华夏基金理财大讲堂”及“华夏理财365”活动,持续进行基金理财知
识普及。
- 举办中秋拜师暨投资者教育报告会,在中秋佳节来临之际,与广大投资人交流并分享国内外资
本市场的发展情况及投资机会。
- 参加第三届中国国际金融博览会及第七届上海国际博览会。现场开设理财课堂,发放投资者教育
书籍,并与到场投资者开展充分互动,提供一对一理财服务。
- 召开了以“携手华夏,相约2008”为主题的投资者策略报告会,就2008年度中国经济运行走势、金融
政策展望、2008年华夏基金投资策略、海外市场投资策略及理财产品发展情况等主题向投资人进行了
报告。

2007年,华夏基金凭借优异的业绩和稳健的经营,荣获多家机构评选的多个奖项:
●2007年1月,在《中国证券报》主办的“第四届中国基金金牛奖”评选中,华夏基金获“2006年
度十大金牛基金”及“2006年度中国最佳客户服务奖”。

●2007年1月26日,华夏基金获得由C21世纪经济报道评选的“中国基金管理综合实力
奖”。

●2007年1月27日,公司获由和讯网评选出的“2006年度中国十大品牌基金公司奖”和“2006
年度中国基金业杰出创新奖”。

●2007年2月,在香港《亚洲资产管理》杂志2006年评选活动中,华夏基金获得了“亚洲地区最佳
客户服务奖”及“中国最佳客户服务奖”。

●2007年4月,在《上海证券报》主办的“第四届中国最佳基金公司评选活动”中,成为唯一一家荣
获“中国最佳基金公司TOP A类”的基金管理公司。

●2007年5月,在《证券时报》2006年度明星基金评选中获得“明星基金管理公司”奖。

●2007年8月,在《中国证券报》评选的“2006年度投资者关系管理最佳表现奖项”中,华夏基
金获得“最佳机构投资者奖”。

●2007年10月,华夏基金获得由《第一财经日报》评选的“金融品牌价值十佳基金公司奖”。

●2007年10月,华夏基金网站在《证券时报》主办的第八届“中国优秀财经证券网站”评选活动中
荣获“中国最佳财经网站奖”。

●2007年12月,华夏基金在搜狐主办的“2007年度搜搜理财网网络调查暨年度颁奖”活动中荣获
“2007年度最佳影响力基金品牌奖”、“2007年度影响力基金投资者教育奖”和“2007年度最受欢迎基金
新产品奖”三个奖项。

四、托管人报告
2007年度,托管人在华夏债券投资基金托管中,严格遵守了《证券投资基金法》及其他有关法
律法规、基金合同、托管协议,尽职尽责地履行了托管人应尽的义务,不存在任何损害基金持有人利益
的行为。

2007年度,华夏基金管理有限公司在华夏债券投资基金托管投资、基金资产净值的计算、基金份
额申购赎回价格的计算、基金费用开支等问题上,托管人未发现损害基金持有人利益的行为。托管人根据
证监会的有关规定,对基金存在证券投资市值占资产净值比例高于80%的情况,对基金管理人进行了提
示,基金管理人根据规定进行了调整。

2007年度,由华夏基金管理有限公司编制并经托管人复核审查的有关华夏债券投资基金的年度报
告中财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告相关内容、投资组合报告等内容真实、准确、完整。

五、审计报告
普华永道中天审字(2008)第20326号
华夏债券投资基金基金份额持有人:

我们审计了基金财务报表(以下简称“华夏债券基金”)的财务报表,包括2007年12月31
日的资产负债表、2007年度的利润表、所有者权益(基金净值)变动表和财务报表附注。
一、管理层的责任
按照企业会计准则、《华夏债券投资基金基金合同》和中国证券监督管理委员会允许的基金行业实
务操作的有关规范编制财务报表是华夏债券基金的基金管理人华夏基金管理有限公司管理层的责任,这
种责任包括:

- (1)设计、实施和维护与财务报表编制相关的内部控制,以使财务报表不存在由于舞弊或错误而导致的
重大错报风险;
- (2)选择和运用恰当的会计政策;
- (3)作出合理的会计估计。

二、注册会计师的责任
我们的责任是在实施审计工作的基础上对财务报表发表审计意见。我们按照中国注册会计师审计准
则的规定执行了审计工作。中国注册会计师审计准则要求我们遵守职业道德规范,计划和实施审计工作
以对财务报表是否不存在重大错报获取合理保证。

审计工作涉及实施审计程序,以获取有关财务报表金额和披露的审计证据。选择的审计程序取决于
注册会计师的判断,包括由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险的评估。在进行风险评估时,我们
考虑与财务报表编制相关的内部控制,以设计恰当的审计程序,但目的并非对内部控制的运行有效性表
示意见。审计工作还包括评价管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计的合理性,以及评价财务报表
的总体列报。

我们相信,我们获取的审计证据是充分、适当的,为发表审计意见提供了合理基础。
三、审计意见
我们认为,上述财务报表已经按照企业会计准则、《华夏债券投资基金基金合同》和中国证券监督
管理委员会允许的财务报表附注所列示的基金行业实务操作的有关规范编制,在所有重大方面公允反
映

了华夏债券基金2007年12月31日的财务状况以及2007年度的经营成果和基金净值变动情况。
普华永道中天会计师事务所有限公司 注册会计师 许康伟
中国 上海市

六、财务会计报告
(一)基金会计报表
华夏债券投资基金
资产负债表
除特别注明外,金额单位为人民币元

资产	2007年12月31日	2006年12月31日
银行存款	290,874,349.03	142,706,931.06
结算准备金	206,724,982.30	19,902,721.71
存出保证金	272,470.96	250,000.00
交易性金融资产	6,225,622,782.06	1,444,783,275.14
其中:股权投资	184,876,567.49	-
债券投资	5,983,344,052.17	1,270,053,871.54
资产支持证券投资	57,402,142.40	-
衍生金融资产	9,067,408.11	-
买入返售金融资产	-	-
应收证券利息	70,448,511.63	10,226,974.35
应收证券清算款	-	-
其他资产	-	-
负债及所有者权益合计	6,871,119,206.46	1,622,306,798.72
所有者权益合计	-	-
实收基金	69,088,712.37	5,065,900.07
未分配利润	6,802,030,494.09	1,617,400,898.65
所有者权益合计	6,871,119,206.46	1,622,306,798.72

2007年未收基金份额净值A/B类:1.111元C类:1.104元
2006年未收基金份额净值A/B类:1.099元C类:1.036元

负债及所有者权益合计
华夏债券投资基金
利润表
除特别注明外,金额单位为人民币元

	附注	2007年度	2006年度
一、收入			
1.利息收入(合计)		135,020,301.24	38,669,598.31
其中:存款利息收入		13,361,866.44	2,016,638.65
债券利息收入		107,809,000.15	33,658,436.25
资产支持证券利息收入		4,767,044.63	2,993,281.46
买入返售金融资产收入		9,442,390.22	324,211.96
二、投资收益(合计)		595,265,594.88	102,409,891.93
其中:股权投资收益		456,765,321.33	-
债券投资收益		124,783,322.22	92,781,231.99
资产支持证券投资(损失)		4,094,362.73	(2,514,724.30)
衍生工具收益		9,418,583.63	12,143,384.29
股利收益		223,466.36	-
3.公允价值变动收益		473,024,272.23	18,854,830.78
4.其他收入		263,145.45	209,736.60
收入合计		777,572,283.78	160,204,060.24
二、费用			
1.管理人报酬	(27,628,942.28)	(8,888,910.00)	
2.托管费	(9,209,647.43)	(2,962,970.33)	
3.销售服务费	(2,750,436.68)	(2,732,825.57)	
4.交易费用	(4,089,887.05)	(628,163.61)	
5.利息支出	(67,556,402.63)	(2,830,088.78)	
其中:卖出回购金融资产支出	(67,556,402.63)	(2,830,088.78)	
6.其他费用	(5,065,462.33)	(438,114.19)	
费用合计	(101,740,288.32)	(16,321,074.24)	
三、利润总额		675,832,025.46	143,882,986.00

华夏债券投资基金
所有者权益基金净值变动表
除特别注明外,金额单位为人民币元

项目	2007年度	2006年度
一、期初所有者权益(基金净值)	1,217,213,763.74	47,051,694.49
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润总额)	-	675,832,025.46
三、本期基金份额变动产生的基金净值变动数	4,756,252,976.38	5,165,366,229.92
其中:1.基金申购	12,678,877,562.82	1,023,389,313.94
2.基金赎回	(7,922,624,575.94)	(614,283,060.50)
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动	-	(476,365,563.32)
五、期末所有者权益(基金净值)	5,973,466,730.62	6,629,089,134.29

2006年度
项目 实收基金 未分配利润 所有者权益合计

一、期初所有者权益(基金净值) 1,217,213,763.74 47,051,694.49 1,264,265,458.23

二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润总额) - 675,832,025.46 675,832,025.46

三、本期基金份额变动产生的基金净值变动数 4,756,252,976.38 5,165,366,229.92

其中:1.基金申购 12,678,877,562.82 1,023,389,313.94 13,702,266,876.76

2.基金赎回 (7,922,624,575.94) (614,283,060.50) (8,536,907,636.94)

四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动 - (476,365,563.32) (476,365,563.32)

五、期末所有者权益(基金净值) 5,973,466,730.62 6,629,089,134.29

2006年度
项目 实收基金 未分配利润 所有者权益合计

一、期初所有者权益(基金净值) 1,217,213,763.74 47,051,694.49 1,264,265,458.23

二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润总额) - 675,832,025.46 675,832,025.46

三、本期基金份额变动产生的基金净值变动数 4,756,252,976.38 5,165,366,229.92

其中: