

鹏华优质治理股票型证券投资基金(LOF)2007年年度报告摘要

(上接136页) 利率风险是指基金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。本基金在资产运作中主要通过存款、结算备付金、权证保证金及债券投资等方式，使基金资产每日对利率变动的利率敏感性进行有效控制。

本基金按以下方法对基金交易的利率风险敞口：表中所示为本基金资产及交易形成负债的公允价值，并按合约约定的期限或到期日最早进行了分类。

Table with columns: 2007年12月31日, 1年内到期, 1至5年, 5年以上, 本货币, 合计. Rows include 总资产, 货币资金, 交易性金融资产, etc.

Table with columns: 项目, 行次, 2007年5月14日, 2006年12月31日. Rows include 资产, 货币资金, 交易性金融资产, etc.

(3) 期末持有到期及提前兑付而持有的作为抵押的债券 截至2007年5月14日，本基金没有从事银行间同业市场的债券回购交易形成的卖出回购证券余额(2006年12月31日:174,000,000.00元)。

Table with columns: 项目, 行次, 2007年5月14日, 2006年12月31日. Rows include 资产, 货币资金, 交易性金融资产, etc.

Table with columns: 项目, 行次, 2007年5月14日, 2006年12月31日. Rows include 资产, 货币资金, 交易性金融资产, etc.

Table with columns: 项目, 行次, 2007年5月14日, 2006年12月31日. Rows include 资产, 货币资金, 交易性金融资产, etc.

Table with columns: 项目, 行次, 2007年5月14日, 2006年12月31日. Rows include 资产, 货币资金, 交易性金融资产, etc.

Table with columns: 项目, 行次, 2007年5月14日, 2006年12月31日. Rows include 资产, 货币资金, 交易性金融资产, etc.

Table with columns: 项目, 行次, 2007年5月14日, 2006年12月31日. Rows include 资产, 货币资金, 交易性金融资产, etc.

Table with columns: 项目, 行次, 2007年5月14日, 2006年12月31日. Rows include 资产, 货币资金, 交易性金融资产, etc.

Table with columns: 项目, 行次, 2007年5月14日, 2006年12月31日. Rows include 资产, 货币资金, 交易性金融资产, etc.

Table with columns: 项目, 行次, 2007年5月14日, 2006年12月31日. Rows include 资产, 货币资金, 交易性金融资产, etc.

Table with columns: 序号, 股票名称, 数量, 期末市值(元), 市值占净值比例(%). Rows include 1. 鹏华, 2. 鹏华, etc.

Table with columns: 序号, 股票名称, 数量, 期末市值(元), 市值占净值比例(%). Rows include 1. A.农林, 2. 鹏华, etc.

Table with columns: 序号, 股票名称, 数量, 期末市值(元), 市值占净值比例(%). Rows include 1. 鹏华, 2. 鹏华, etc.

Table with columns: 序号, 股票名称, 数量, 期末市值(元), 市值占净值比例(%). Rows include 1. 鹏华, 2. 鹏华, etc.

Table with columns: 序号, 股票名称, 数量, 期末市值(元), 市值占净值比例(%). Rows include 1. 鹏华, 2. 鹏华, etc.

Table with columns: 序号, 股票名称, 数量, 期末市值(元), 市值占净值比例(%). Rows include 1. 鹏华, 2. 鹏华, etc.

Table with columns: 序号, 股票名称, 数量, 期末市值(元), 市值占净值比例(%). Rows include 1. 鹏华, 2. 鹏华, etc.

Table with columns: 序号, 股票名称, 数量, 期末市值(元), 市值占净值比例(%). Rows include 1. 鹏华, 2. 鹏华, etc.

Table with columns: 序号, 股票名称, 数量, 期末市值(元), 市值占净值比例(%). Rows include 1. 鹏华, 2. 鹏华, etc.

Table with columns: 序号, 股票名称, 数量, 期末市值(元), 市值占净值比例(%). Rows include 1. 鹏华, 2. 鹏华, etc.

Table with columns: 序号, 股票名称, 数量, 期末市值(元), 市值占净值比例(%). Rows include 1. 鹏华, 2. 鹏华, etc.

Table with columns: 序号, 股票名称, 数量, 期末市值(元), 市值占净值比例(%). Rows include 1. 鹏华, 2. 鹏华, etc.

(3) 鹏华治理基金(资产合并前原鹏华基金)2007年1月1日至2007年5月14日买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

Table with columns: 买入股票的成本总额, 卖出股票的收入总额. Rows include 2007年1月1日至2007年5月14日.

Table with columns: 序号, 债券名称, 数量, 期末市值(元), 市值占净值比例(%). Rows include 1. 鹏华, 2. 鹏华, etc.

Table with columns: 序号, 债券名称, 数量, 期末市值(元), 市值占净值比例(%). Rows include 1. 鹏华, 2. 鹏华, etc.

Table with columns: 序号, 债券名称, 数量, 期末市值(元), 市值占净值比例(%). Rows include 1. 鹏华, 2. 鹏华, etc.

Table with columns: 序号, 债券名称, 数量, 期末市值(元), 市值占净值比例(%). Rows include 1. 鹏华, 2. 鹏华, etc.

Table with columns: 序号, 债券名称, 数量, 期末市值(元), 市值占净值比例(%). Rows include 1. 鹏华, 2. 鹏华, etc.

Table with columns: 序号, 债券名称, 数量, 期末市值(元), 市值占净值比例(%). Rows include 1. 鹏华, 2. 鹏华, etc.

Table with columns: 序号, 债券名称, 数量, 期末市值(元), 市值占净值比例(%). Rows include 1. 鹏华, 2. 鹏华, etc.

Table with columns: 序号, 债券名称, 数量, 期末市值(元), 市值占净值比例(%). Rows include 1. 鹏华, 2. 鹏华, etc.

Table with columns: 序号, 债券名称, 数量, 期末市值(元), 市值占净值比例(%). Rows include 1. 鹏华, 2. 鹏华, etc.

Table with columns: 序号, 债券名称, 数量, 期末市值(元), 市值占净值比例(%). Rows include 1. 鹏华, 2. 鹏华, etc.

Table with columns: 序号, 债券名称, 数量, 期末市值(元), 市值占净值比例(%). Rows include 1. 鹏华, 2. 鹏华, etc.