

兴业货币市场证券投资基金2007年年度报告摘要

(上接 227 版)

	增加/减少基准点(%)	对净值的影响(千元)
2007年12月31日		
利率	+1.00	-864.90
	-1.00	914.50
2006年12月31日		
利率	+1.00	-590.00
	-1.00	599.60

注:此处的基准利率变化采用收益率曲线的平移进行模拟。因本基金债券多为央票,所以以银行间国债作为样本拟和收益率曲线。具体采用 Nelson-siegel 模型模拟收益率曲线。

(c) 外汇风险

本基金的所有资产及负债以人民币计价,因此无外汇风险。

七、投资组合报告

(一) 本报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	债券投资	109,308,488.58	50.45%
2	买入返售证券	95,000,282.50	43.84%
	其中:买断式回购的买入返售证券	—	—
3	银行存款及清算备付金合计	11,739,330.59	5.42%
	其中:定期存款	—	—
4	其他资产	638,890.14	0.29%
	合计	216,686,971.81	100%

(二) 报告期债券回购融资情况

序号	项目	金额(元)	占基金资产净值的比例(%)
1	报告期内债券回购融资余额	1,709,093,865.29	3.27%
	其中:买断式回购融资	—	—
2	报告期末债券回购融资余额	—	—
	其中:买断式回购融资	—	—

注:1、上表中报告期内债券回购融资余额为报告期内每日的融资余额的合计数,报告期内债券回购融资余额占基金资产净值的比例为报告期内每日融资余额占基金资产净值的简单平均值。

2、本报告期内货币市场基金正回购的资金余额超过资产净值的20%的情况有:

序号	发生日期	融资余额占基金资产净值比例(%)	调整期	原因
1	2007-4-19	20.04%	2007-4-23	由于兴业货币市场基金发生巨额赎回,导致正回购资金占基金资产净值超过20%。
2	2007-4-20	20.06%	2007-4-23	
3	2007-4-21	20.06%	2007-4-23	
4	2007-4-22	20.06%	2007-4-23	

(三) 基金投资组合平均剩余期限

1、投资组合平均剩余期限基本情况

序号	项目	天数
1	报告期末投资组合平均剩余期限	46
2	报告期内投资组合平均剩余期限最高值	165
3	报告期内投资组合平均剩余期限最低值	38

报告期内投资组合平均剩余期限没有超过180天。

2、期末投资组合平均剩余期限分布比例

序号	平均剩余期限	各期限资产占基金资产净值的比例(%)	各期限负债占基金资产净值的比例(%)
1	30天以内	72.57%	—
2	30天(含)-60天	—	—
3	60天(含)-90天	4.61%	—
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	4.61%	—
4	90天(含)-180天	9.26%	—
5	180天(含)-397天(含)	13.60%	—
	合计	100.04%	—

(四) 报告期末债券投资组合

1、按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	成本(元)	占基金资产净值的比例(%)
1	国家债券	—	—
2	金融债券	9,951,186.02	4.61%
	其中:政策性金融债	—	—
3	央行票据	99,357,302.56	46.01%
4	企业债券	—	—
5	其他	—	—
	合计	109,308,488.58	50.62%
	剩余存续期超过397天的浮动利率债券	9,951,186.02	4.61%

注:上表中,债券的成本包括债券面值和折溢价。

2、基金投资前十名债券明细

序号	债券名称	债券数量(张)		成本(元)	占基金资产净值的比例(%)
		自有投资	买断式回购		
1	07央行01	500,000	—	49,989,841.02	23.15%
2	07央票91	300,000	—	29,380,261.56	13.60%
3	06央行04	200,000	—	19,988,199.98	9.26%
4	06央行02	100,000	—	9,951,186.02	4.61%

注:上表中,“债券数量”中的“自有投资”和“买断式回购”指自有的债券投资和通过债券买断式回购业务买入的债券卖出后的余额。

(五) “影子定价”与“摊余成本法”确定的基金资产净值的偏离

项目	偏离情况
报告期内偏离度的绝对值在0.25%(含)-0.5%间的次数	0
报告期内偏离度的最高值	0.0667%
报告期内偏离度的最低值	-0.1802%
报告期内每个工作日偏离度的绝对值的简单平均值	0.0543%

(六) 投资组合报告附注

1、基金计价方法说明

本基金估值采用摊余成本法,即估值对象以买入成本列示,按照实际利率每日计提应收利息,2007年7月1日前按直线法,2007年7月1日起按实际利率法在其剩余期限内摊销其买入时的溢价或折价。

2、本报告期内不存在剩余期限小于397天但剩余存续期超过397天的浮动利率债券的摊余成本超过当日基金资产净值的20%的情况。

3、本报告期内无需要说明的证券投资决策程序,报告期内本基金投资的前十名证券的发

行主体未被监管部门立案调查。

4、报告期内本基金未投资资产支持证券。

5、本报告期末基金的其他资产构成

序号	项目	金额
1	应收利息	638,890.14
	合计	638,890.14

八、基金份额变动

序号	项目	份额(份)
1	期初基金份额总额	156,057,486.62
2	期间基金总申购份额	1,847,920,261.69
3	期间基金总赎回份额	1,788,019,981.93
4	期末基金份额总额	215,457,766.38

九、基金份额持有人户数,持有人结构

基金持有人户数	户均户数	基金持有人份额结构(%)			
		机构投资者持有份额	占总份额比例	个人投资者持有份额	占总份额比例
1,608	134,302.09	75,682,910.71	35.05%	140,284,856.67	64.95%

期末本基金管理公司从业人员持有本开放式基金情况

项目	期末持有本开放式基金份额的总量(份)	占本基金总份额的比例(%)
本基金管理公司持有本基金的所有从业人员	16,301.18	0.0075%

十、重大事件揭示

(一) 报告期内本基金未召开基金份额持有人大会。

(二) 报告期内本基金管理人和托管人的重大人事变动。

1、报告期内本基金管理人无重大人事变动。

2、报告期内本基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

(三) 报告期内无涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

(四) 报告期内本基金投资策略未发生变更。

(五) 报告期内本基金分配收益事项。

本基金在本报告期内共进行了12次基金收益集中支付并结转为基金份额,本基金管理人在《中国证券报》刊登收益支付公告,具体如下:

序号	分红公告日	收益支付日
1	2007/1/10	2007/1/10
2	2007/2/12	2007/2/12
3	2007/3/12	2007/3/12
4	2007/4/10	2007/4/10
5	2007/5/10	2007/5/10
6	2007/6/11	2007/6/11
7	2007/7/10	2007/7/10
8	2007/8/10	2007/8/10
9	2007/9/10	2007/9/10
10	2007/10/10	2007/10/10
11	2007/11/12	2007/11/12
12	2007/12/10	2007/12/10

(六) 本基金自合同生效日起聘请安永大华会计师事务所有限公司为本基金提供审计服务。报告期内本基金未改聘会计师事务所。本年度支付给所聘任的会计师事务所8万元人民币。

兴业全球视野股票型证券投资基金2007年年度报告摘要

(上接 225 版)

	增加/减少基准点	对净值的影响
	%	千元
2007年12月31日		
利率	+1%	-2,171.50
	-1%	2,207.30
2006年12月31日		
利率	+1%	—
	-1%	—

注:1此处的基准利率变化采用收益率曲线的平移进行模拟。因本基金债券多为央票,所以以银行间国债作为样本拟和收益率曲线。具体采用 Nelson-siegel 模型模拟收益率曲线。

2、可转债受正股价格影响较大,受利率变动影响较小,因此不适合做利率敏感性分析。

(c) 外汇风险

本基金的所有资产及负债以人民币计价,因此无外汇风险。

七、投资组合报告

(一) 本报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额	占基金总资产的比例
1	股票	6,673,635,262.30	78.43%
2	债券	492,037,414.49	5.78%
3	权证	—	—
4	银行存款及清算备付金合计	1,252,882,134.06	14.72%
5	其他资产	90,458,925.15	1.07%
	资产合计	8,509,013,736.00	100.00%

(二) 报告期末按行业分类的股票投资组合

序号	行业	期末市值(元)	市值占基金资产净值比例
A	农、林、牧、渔业	827,356.90	0.01%
B	采掘业	252,414,684.96	2.99%
C	制造业	3,285,120,742.21	38.67%
C0	其中:食品、饮料	535,581,532.49	6.34%
C1	纺织、服装、皮毛	362,560.40	0.00%
C2	木材、家具	60,373,644.75	0.71%
C3	造纸、印刷	58,152,015.60	0.69%
C4	石油、化学、塑胶、塑料	769,285,653.44	9.10%
C5	电子	47,929,452.64	0.57%
C6	金属、非金属	1,069,348,138.88	12.66%
C7	机械、设备、仪表	629,325,385.02	7.45%
C8	医药、生物制品	114,482,368.99	1.35%
C9	其他制造业	—	—
D	电力、煤气及水的生产和供应业	210,890,505.44	2.50%
E	建筑业	—	—
F	交通运输、仓储业	236,228,195.58	2.80%
G	信息技术业	191,656,550.03	2.27%
H	批发和零售贸易	279,112,756.29	3.30%
I	金融、保险业	1,128,099,498.85	13.35%
J	房地产业	719,339,611.24	8.51%
K	社会服务业	57,573,770.92	0.68%
L	传播与文化产业	167,067,477.55	1.98%
M	综合类	145,314,105.33	1.72%
	合计	6,673,635,262.30	78.98%

(三) 报告期末按市值占基金资产净值前十名股票明细

序号	股票代码	股票名称	股票数量	期末市值(元)	市值占基金资产净值比例
1	600036	招商银行	17,499,000	693,485,370.00	8.21%
2	600019	宝钢股份	36,362,409	634,160,412.96	7.51%
3	000667	名流置业	26,000,000	378,040,000.00	4.47%
4	000895	双汇发展	5,265,805	310,629,836.95	3.68%
5	600309	烟台万华	6,458,887	245,760,650.35	2.91%
6	600176	中国玻纤	8,148,547	240,382,136.50	2.85%
7	600096	云天化	4,708,009	231,775,283.07	2.74%
8	600000	浦发银行	3,218,515	169,937,582.00	2.01%
9	601318	中国平安	1,537,266	163,103,922.60	1.93%
10	600270	外运发展	7,942,494	156,705,406.62	1.85%

投资者欲了解本报告期末基金投资的所有股票明细,应阅读载于兴业基金管理有限公司网站的年度报告正文。

(四) 本报告期内股票投资组合的重大变动

1、报告期内累计买入价值超出期初基金资产净值2%或前二十名的股票明细

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例
1	600019	宝钢股份	271,481,605.34	7.25%
2	000895	双汇发展	243,551,487.89	6.59%
3	600036	招商银行	225,154,606.97	6.09%
4	600900	长江电力	222,469,599.28	6.05%

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例
5	000002	万科A	192,851,994.19	5.22%
6	601318	中国平安	171,418,307.23	4.64%
7	600176	中国玻纤	171,375,065.32	4.64%
8	601398	工商银行	144,609,176.01	3.91%
9	600050	中国联通	143,784,190.86	3.89%
10	600096	云天化	143,507,621.71	3.88%
11	600270	外运发展	140,648,377.77	3.81%
12	600748	上实发展	140,168,169.69	3.79%
13	600619	贵州茅台	114,342,306.61	3.09%
14	000822	山东海化	110,843,812.55	3.00%
15	000709	唐钢股份	109,950,715.30	2.96%
16	600325	华发股份	108,717,531.67	2.94%
17	600125	铁龙物流	106,381,569.52	2.88%
18	000063	中兴通讯	106,106,178.04	2.87%
19	600383	金地集团	104,000,000.00	2.82%
20	600686	金龙汽车	102,877,215.82	2.78%
21	600737	中银电河	97,316,599.89	2.63%
22	601666	平煤天安	90,276,599.00	2.44%
23	600309	烟台万华	89,909,615.07	2.42%
24	600529	山东药玻	78,152,364.43	2.13%
25	000708	大冶特钢	75,220,831.61	2.04%

2、报告期内累计卖出价值超出期初基金资产净值2%或前二十名的股票明细

单位:人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例
1	000338	潍柴动力	459,415,249.98	12.44%
2	600005	武钢股份	432,457,	