

Disclosure

汇丰晋信2016生命周期开放式证券投资基金2007年年度报告摘要

(上接194版)
于2007年12月31日,若本基金的业绩比较基准(见附件1)的公允价值上升5%且其他市场变量保持不变,本基金净资产值将相应增加约29,872,108.19元(2006年:61,523,709.55元);反之,若本基金的业绩比较基准(见附件1)的公允价值下降5%且其他市场变量保持不变,本基金净资产值则将相应下降约29,872,108.19元(2006年:61,523,709.55元)。

9.上期比较数据

本基金在2007年7月1日起首次执行企业会计准则2006,有关比较数字的调整参见附件3。

七、投资组合报告

(一)报告期末基金资产组合

	期末市值(元)	占基金总资产的比例
股票	706,374,450.22	53.35%
债券	23,364,456.0	1.76%
权证	421,612.82	0.03%
银行存款和清算备付金	567,224,527.49	42.84%
其他资产	26,677,759.46	2.01%
合计	1,324,062,804.59	100.00%

(二)报告期末按行业分类的股票投资组合

行业分类	股票市值(元)	占基金资产净值比例
A农、林、牧、渔业	0.00	0.00%
B采掘业	123,836,251.00	9.40%
C制造业	348,629,306.63	26.45%
CD食品、饮料	40,619,326.00	3.08%
C1纺织、服装、皮革	0.00	0.00%
C2木材、家具	8,832,000.00	0.67%
C3造纸、印刷	0.00	0.00%
C4石油、化学、塑胶、塑料	88,174,060.75	6.69%
C5电子	16,398,690.00	1.24%
C6金属、非金属	96,126,371.04	6.54%
C7机械设备、仪表	108,478,258.90	8.23%
C8医药、生物制品	0.00	0.00%
C99其他制造业	0.00	0.00%
D电力、煤气及水的生产和供应业	0.00	0.00%
E建筑业	0.00	0.00%
F交通运输、仓储业	42,504,430.00	3.23%
G信息技术业	0.00	0.00%
H批发和零售贸易业	42,446,418.77	3.22%
I金融、保险业	40,113,947.40	3.04%
J房地产业	35,618,000.00	2.70%
K社会服务业	73,227,096.36	5.56%
L传播与文化业	0.00	0.00%
M综合类	0.00	0.00%
合计	706,374,450.22	53.36%

(三)报告期末市占值占比大小排序的前十名股票明细
序号 股票代码 股票名称 期末数量(股) 期末市值(元) 占基金资产净值比例
1 000073 中国联通 1,000,000 39,900,000.00 3.03%
2 002122 天马股份 260,000 38,971,400.00 2.96%
3 601098 中国铝业 587,590 38,551,123.80 2.93%
4 600315 上海银行 748,496 36,204,703.15 2.75%
5 600069 王府井 711,773 35,937,418.77 2.73%
6 600064 黄浦江 1,107,324 35,055,731.36 2.66%
7 000993 西山煤电 530,000 33,639,100.00 2.55%
8 600547 山东黄金 160,000 27,038,400.00 2.06%
9 601067 中阳国际 794,820 24,607,627.20 1.87%
10 600060 青岛啤酒 605,500 23,714,926.00 1.80%

投资者欲了解本报告期末基金的投资股票明细,请阅读登载于“汇丰晋信基金管理有限公司网站www.hsbcjt.com”的《汇丰晋信2016生命周期开放式证券投资基金2007年度报告》正文。

(四)报告期末股票投资组合的重大变动

1.本期期内累计买入或卖出超过期初基金资产净值2%的股票明细或前二十名的股票明细

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入或卖出金额(元)	占期初基金资产净值比例
1	601111	长安航空	83,386,759.63	3.20%
2	000626	国电南瑞	69,458,038.27	2.66%
3	600030	中信证券	68,692,722.03	2.64%
4	601166	兴业银行	66,545,546.75	2.55%
5	002122	天马股份	52,293,241.64	2.01%
6	600000	武钢股份	52,200,483.22	2.00%
7	600002	万科A	48,641,831.76	1.87%
8	600675	中华企业	48,482,557.06	1.86%
9	601000	大秦铁路	47,128,735.00	1.81%
10	000898	鞍钢股份	42,011,055.58	1.61%
11	000958	五粮液	41,523,905.80	1.59%
12	600019	宝钢股份	40,113,124.92	1.54%
13	000723	美的置业	38,551,722.35	1.48%
14	000825	太钢不锈	38,456,253.93	1.48%

(五)报告期内按券种分类的债券投资组合
序号 股票代码 债券类别 债券市值(元) 占基金资产净值的比例
1 500016 国债 706,374,450.22 53.35%

备注:按照新会计准则,本期累计买入或卖出时相应的公允价值之和,不包含相关交易费用。

2.本期报告期内累计卖出价值超过期初基金资产净值2%的股票明细或前二十名的股票明细

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出或买入金额(元)	占期初基金资产净值比例
1	601111	长安航空	83,386,759.63	3.20%
2	000626	国电南瑞	69,458,038.27	2.66%
3	600030	中信证券	68,692,722.03	2.64%
4	601166	兴业银行	66,545,546.75	2.55%
5	002122	天马股份	52,293,241.64	2.01%
6	600000	武钢股份	52,200,483.22	2.00%
7	600002	万科A	48,641,831.76	1.87%
8	600675	中华企业	48,482,557.06	1.86%
9	601000	大秦铁路	47,128,735.00	1.81%
10	000898	鞍钢股份	42,011,055.58	1.61%
11	000958	五粮液	41,523,905.80	1.59%
12	600019	宝钢股份	40,113,124.92	1.54%
13	000723	美的置业	38,551,722.35	1.48%
14	000825	太钢不锈	38,456,253.93	1.48%

备注:按照新会计准则,本期累计买入或卖出时相应的公允价值之和,不包含相关交易费用。

3.本期内累计买入或卖出超过期初基金资产净值2%的股票明细或前二十名的股票明细

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入或卖出金额(元)	占期初基金资产净值比例
1	600583	海油工程	196,649,242.61	9.20%
2	600016	民生银行	182,482,895.50	8.54%
3	600000	浦发银行	160,696,156.97	7.52%
4	600036	招商银行	139,025,116.62	6.50%
5	601111	中国国航	136,137,632.04	6.37%
6	601166	兴业银行	127,333,542.02	5.96%
7	600309	烟台万华	120,880,503.34	5.66%
8	600030	中信证券	106,317,005.91	4.97%
9	601318	中国平安	104,692,294.45	4.90%
10	002122	天马股份	102,984,086.96	4.82%
11	002023	海特高新	101,772,480.89	4.76%
12	601939	建设银行	100,651,237.35	4.71%
13	000963	华东医药	99,493,933.37	4.70%
14	000663	中兴通讯	99,493,996.77	4.65%
15	000723	美锦能源	94,951,819.19	4.44%
16	600352	浙江龙盛	92,796,469.28	4.34%
17	600639	浦东金桥	92,555,037.45	4.33%
18	600337	美克股份	90,812,645.50	4.25%
19	600050	中国联通	87,705,514.25	4.10%
20	600019	宝钢股份	85,041,471.74	3.98%
21	600025	长城汽车	83,310,616.35	3.90%
22	600048	承德露露	83,058,105.67	3.89%
23	600886	国投电力	80,216,321.22	3.75%
24	600829	三精制药	76,714,206.34	3.58%
25	600320	海螺型材	72,327,178.00	3.57%
26	600067	兴业银行	72,044,396.80	3.37%
27	600047	浦东金桥	67,595,823.46	3.16%
28	600029	南方航空	64,110,656.35	3.00%
29	600628	新世界	63,681,915.29	2.98%
30	600360	华微电子	62,471,848.52	2.92%
31	000837	秦川发展	62,436,215.44	2.92%
32	600880	博瑞传播	62,205,906.63	2.91%
33	601006	大秦铁路	61,955,807.00	