

兴业全球视野股票型证券投资基金

2006 年年度报告

基金管理人：兴业基金管理有限公司

基金托管人：兴业银行股份有限公司

送出日期：2007 年 3 月 28 日

【重要提示】

本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。本年度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。

本基金的托管人兴业银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2007 年 3 月 26 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。

本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。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。

本报告财务资料已经审计，安永大华会计师事务所有限公司为本基金出具了无保留意见的审计报告。本报告会计期间为 2006 年 9 月 20 日（基金合同生效日）至 2006 年 12 月 31 日。



目录

一、基金简介.....	3
二、主要财务指标、基金净值表现及收益分配情况.....	5
(一) 主要财务指标.....	5
(二) 基金净值表现.....	5
(三) 基金收益分配情况.....	6
三、管理人报告.....	7
(一) 基金管理人情况.....	7
(二) 基金经理介绍.....	7
(三) 本报告期遵规守信情况说明.....	7
(四) 本报告期内的基金的投资策略和业绩表现.....	7
(五) 内部监察报告.....	9
四、基金托管人报告.....	10
五、审计报告.....	11
六、财务会计报告.....	12
(一) 年度会计报表.....	12
(二) 年度会计报表附注(除特别标明外,金额单位为人民币元).....	15
七、投资组合报告.....	27
(一) 本报告期末基金资产组合情况.....	27
(二) 报告期末按行业分类的股票投资组合.....	27
(三) 报告期末按市值占基金资产净值比例大小排序的所有股票明细.....	28
(四) 本报告期内股票投资组合的重大变动.....	30
(五) 本报告期末按券种分类的债券投资组合.....	31
(六) 本报告期末债券明细.....	31
(七) 投资组合报告附注.....	32
八、基金份额持有人户数、持有人结构.....	33
九、基金份额变动.....	33
十、重大事件揭示.....	34
十一、备查文件目录.....	36

一、基金简介

(一) 基金名称：兴业全球视野股票型证券投资基金

基金简称：兴业全球

基金交易代码：340006

基金运作方式：契约型开放式

基金合同生效日：2006 年 9 月 20 日

报告期末基金份额总额：2,596,467,843.33 份

(二) 投资目标：本基金以全球视野的角度，主要投资于富有成长性、竞争力以及价值被低估的公司，追求当期收益实现与长期资本增值。

投资策略：本基金采用“自上而下”与“自下而上”相结合的投资策略。以全球视野的角度挖掘中国证券市场投资的历史机遇，采取“自上而下”的方法，定性与定量研究相结合，在股票与债券等资产类别之间进行资产配置。

投资范围：本基金投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括依法公开发行的股票、国债、金融债、企业债、回购、央行票据、可转换债券、资产支持证券以及经中国证监会批准允许基金投资的其它金融工具。若法律法规或监管机构以后允许基金投资的其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。本基金投资组合范围为：股票65% - 95%，债券0% - 30%，权证0-3%，现金或者到期日在一年以内的政府债券不少于5%。

业绩比较基准： $80\% \times \text{中信标普 300 指数} + 15\% \times \text{中信标普国债指数} + 5\% \times \text{同业存款利率}$

风险收益特征：较高风险、较高收益

(三) 基金管理人：兴业基金管理有限公司

注册地址：上海市黄浦区金陵东路368号

办公地址：上海市张杨路500号时代广场20楼

邮政编码：200122

法定代表人：郑苏芬

信息披露负责人：杜建新

联系电话：021-58368998

传真：021-58368858

电子信箱：dujx@xyfunds.com.cn

(四) 基金托管人：兴业银行股份有限公司

注册地址：福州市湖东路 154 号

办公地址：福州市湖东路 154 号

资产托管部办公地址：上海江宁路 168 号兴业大厦 20 楼

邮政编码：200041

法定代表人：高建平

信息披露负责人：赵建明

联系电话：021-62159219

传真：021-62159217

电子信箱：zhaojianming@cib.com.cn

(五) 信息披露指定报纸：中国证券报、上海证券报、证券时报

登载年度报告正文的基金管理人互联网网址：www.xyfunds.com.cn

基金年度报告置备地点：基金管理人、基金托管人的办公场所

(六) 其他有关资料

注册登记机构：中国证券登记结算有限责任公司

办公地址：中国北京市西城区金融大街 27 号投资广场 22-23 层

审计基金资产的会计师事务所：安永大华会计师事务所

办公地址：上海市长乐路 989 号

二、主要财务指标、基金净值表现及收益分配情况

(一) 主要财务指标

单位：人民币元

序号	项目	2006 年 9 月 20 日(基金合同生效日)至 2006 年 12 月 31 日期间
1	基金本期净收益	124,323,454.28
2	加权平均基金份额本期净收益	0.0039
3	期末可供分配基金收益	116,386,888.73
4	期末可供分配基金份额收益	0.0448
5	期末基金资产净值	3,694,425,074.21
6	期末基金份额净值	1.4229
7	基金加权平均净值收益率	3.52%
8	本期基金份额净值增长率	42.29%
9	基金份额累计净值增长率	42.29%

【提示】

1、上述财务指标采用的计算公式，详见中国证券监督管理委员会发布的《证券投资基金信息披露编报规则第 1 号<主要财务指标的计算及披露>》。

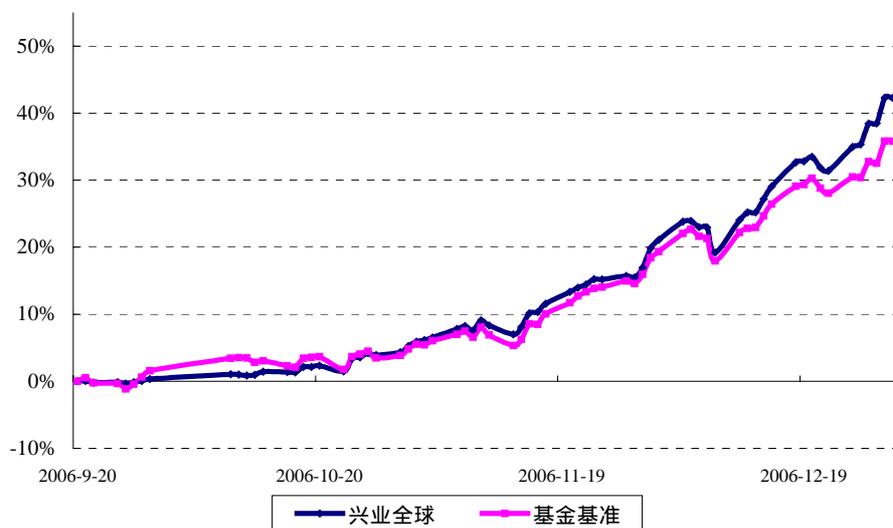
2、上述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用（例如：开放式基金的申购赎回费、红利再投资费、基金转换费等），计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

(二) 基金净值表现

1、本报告期末基金净值增长率与同期业绩比较基准收益率比较表

阶段	净值增长率	净值增长率标准差	业绩比较基准收益率	业绩比较基准收益率标准差	-	-
过去三个月	41.85%	1.14%	33.72%	1.13%	8.13%	0.01%
自基金合同成立起至今	42.29%	1.09%	35.74%	1.09%	6.53%	0.00%

2、基金累计净值增长率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图 (2006 年 9 月 20 日—2006 年 12 月 31 日)



注：1、净值表现所取数据截至到 2006 年 12 月 31 日。

2、按照《兴业全球视野股票型证券投资基金基金合同》的规定，本基金应自 2006 年 9 月 20 日成立起六个月内，达到本基金合同规定的比例限制及本基金投资组合的比例范围，目前本基金符合基金合同规定的比例限制及投资组合的比例范围。

3、本基金成立于 2006 年 9 月 20 日，截止 2006 年 12 月 31 日，本基金成立不满一年。

(三) 基金收益分配情况

本基金本报告期内未进行收益分配。

三、管理人报告

(一) 基金管理人情况

兴业基金管理有限公司是经中国证监会(证监基字[2003]100号文)批准,于2003年9月30日成立。由兴业证券股份有限公司、国家开发投资公司、中投信用担保有限公司和福建省邮政局共同发起设立,注册资本为9,800万元。截止2006年12月31日,公司旗下管理着四只基金,分别为兴业可转债混合型证券投资基金、兴业趋势投资混合型证券投资基金(LOF)、兴业货币市场证券投资基金和兴业全球视野股票型证券投资基金。

(二) 基金经理介绍

王晓明先生,本基金基金经理。1974年生,经济学硕士,10年证券从业经历。历任上海中技投资顾问有限公司研究员、投资部经理、公司副总经理,兴业基金管理有限公司兴业可转债混合型证券投资基金基金经理。现任兴业基金管理有限公司投资副总监、兴业趋势投资混合型证券投资基金(LOF)基金经理和本基金基金经理。

(三) 本报告期遵规守信情况说明

本报告期内,本基金管理人严格遵循了《证券投资基金法》及其各项实施细则、《兴业全球视野股票型证券投资基金基金合同》和其他相关法律法规的规定,本着诚实信用、勤勉尽责、取信于市场、取信于社会的原则管理和运用基金资产,为基金份额持有人谋求最大利益。本报告期内,基金投资管理符合有关法规和基金合同的规定,无违法违规、未履行基金合同承诺或损害基金份额持有人利益的行为。

(四) 本报告期内的基金的投资策略和业绩表现

1、行情回顾及分析

2006年是中国证券市场表现非常突出的一年,全年指数单边上涨,沪深300指数涨幅120%,位居全球前列。如果考虑到股改因素,则股票的实际涨幅更加乐观。形成06年这样行情的原因是多方面的:多年熊市市场本身超跌;股改对价;人民币升值带来的资金宽裕;经济的持续向好,带来企业利润的增加等等。

从行业和板块上来讲,06年基本上是普涨行情。上半年主要是围绕股改、军工、有色、消费类板块展开;下半年的亮点则是银行、地产、钢铁等大市值的蓝筹公司。同时06年也是股市供给和需求双向大扩容的一年:工行、中行等大市值的股票在A



股市场 IPO；在财富效应的带动下，民间储蓄以基金为管道进入 A 股市场。

2、基金运作情况回顾

本基金成立于 2006 年 9 月 20 日，因此，四季度处于基金的建仓期。在建仓期，我们坚持对大盘蓝筹股的战略配置，对银行、钢铁的龙头公司进行了超配，带来了较好的回报。同时，对高速、机场、地产和消费类股票进行了均衡配置。同时积极的参与了质地优秀的公司的定向增发。

自成立之日起，本基金取得了 42.29%的收益率，高于基金基准 6.53%的涨幅。

3、市场展望及投资策略分析

经过 2006 年的大幅度上涨，很多公司的股价基本上已经反映了大家对 2007 年的业绩预期，甚至部分公司反映了 08 年乃至更长时间的盈利增长。因此，在这种情况下，我们认为 07 年市场的回报同比 06 年会较大幅度的下降。另外，由于大幅度的上涨后，市场的分歧会加大，市场的波动也会加剧。因此，基金的投资难度相比 06 年要高出很多。

但是分析推动此轮牛市的因素：经济形势依然向好，企业利润的增速依然很快（大家对沪深 300 上市公司 07 年的业绩增速预测依然在 20%以上）；人民币升值和市场的财富效应，使得市场的资金供给依然非常宽裕。因此，我们认为此轮牛市的根基依然存在，市场向好的格局不变。

但就估值而言，目前沪深 300 指数 07 年的平均 PE 在 25~30 倍左右的水平，部分龙头公司的估值水平更是 40~50 倍，高于周边市场的估值水平。在这种情况下，市场估值水平要再大幅度的提升，有一定的困难。因此，寻求业绩超过预期的公司和能够获得外延式变化的公司成为市场的热点。外延式变化主要是重组，资产注入和集团的整体上市。股权分置改革后，非流通股股东对市值的关注是空前的。因此，这种外延式变化的公司成为市场的热点有其合理性。但是，我们认为随着对“大非”、“小非”禁售期的结束，参与没有基本面支持的重组是比较危险的，毕竟天下没有免费的午餐。对于这类外延式变化的公司，我们会在一定的安全边际的情况下，适度的参与。

对于绩优的蓝筹公司，买入并持有，以时间换空间，依然是我们主要的投资策略。股市投资主要就是要分享优秀企业的成长。虽然阶段性的热点在不断的切换，但是我们坚信，坚定的持有这些优秀公司必然会给我们带来丰厚的回报。

基于我们对 07 年市场的判断，本基金保持一个比较均衡的仓位。同时，我们



积极寻找具有全球竞争优势的产业和公司，或者是具有中国特色的产业和公司进行投资。同时，对于一些主题投资：如奥运、3G、节能、央企的整体上市等进行适度的参与。

总之，我们会为持有人在 2007 年取得较好的回报而积极的努力。

（五）内部监察报告

2006 年，我司根据中国证监会《证券投资基金法》及其配套法规、《证券投资基金管理公司内部控制指导意见》和《证券投资基金管理公司治理准则（试行）》等一系列新颁布实施的法规的相关规定，结合公司的经营运作、业务发展等内部控制环境的变化，对公司内部控制体系及各项规章制度的合法性、合规性、合理性、完备性和有效性进行了检查和评价，新制定了几项规章制度及流程，并对公司部分基本管理制度、业务规章进行了修订和完善，进一步完善了公司内部控制制度体系，使公司内部管理向制度化、规范化和程序化方向发展。

本报告期内，我司严格按照中国证监会关于《证券投资基金管理公司监察稽核报告内容与格式指引（试行）》、《证券投资基金管理公司内部控制指导意见》和《证券投资基金管理公司治理准则（试行）》的规定，遵循基金份额持有人利益优先的基本原则，坚持“客观性、标准性、实效性”的原则，本着客观、公正、准确的要求，对照监察稽核项目表对公司各项业务进行监督检查，认真履行监察稽核职责，做到重点检查、突击检查与常规检查相结合，专项检查与全面检查相结合，监督与服务相结合。

通过以上工作的开展，我们认为，公司遵循了国家法律法规、中国证监会相关规定及公司各项规章制度的要求，诚信、规范、合法、稳健经营，基金整体运作合法合规，有力地保护了基金份额持有人、公司股东以及其他相关当事人的合法权益。



四、基金托管人报告

本托管人依据《兴业全球视野股票型证券投资基金基金合同》与《兴业全球视野股票型证券投资基金托管协议》，自 2006 年 9 月 20 日起托管兴业全球视野股票型证券投资基金（以下称本基金）的全部资产。

报告期内，本托管人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，诚信、尽责地履行了基金托管人义务，不存在损害本基金份额持有人利益的行为。

报告期内，本托管人根据国家有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，对基金管理人在本基金的投资运作、基金资产净值的计算、基金收益的计算、基金费用开支等方面进行了必要的监督、复核和审查，未发现其存在任何损害本基金份额持有人利益的行为；基金管理人在报告期内，严格遵守了《证券投资基金法》等有关法律法规，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

本托管人认真复核了本半年度报告中的财务指标、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，认为其真实、准确和完整，不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

兴业银行股份有限公司资产托管部

2007 年 3 月 26 日

五、审计报告

审计报告

安永大华业字（2007）第048号

兴业全球视野股票型证券投资基金全体基金份额持有人：

我们审计了后附的兴业全球视野股票型证券投资基金（以下简称“贵基金”）财务报表，包括 2006 年 12 月 31 日的资产负债表和 2006 年度的经营业绩表、基金净值变动表及基金收益分配表以及财务报表附注。

一、管理层对财务报表的责任

按照企业会计准则、《金融企业会计制度》和《证券投资基金会计核算办法》的规定编制财务报表是贵基金的基金管理人兴业基金管理有限公司的责任。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；（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，包括对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有效性发表意见。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基础。

三、 审计意见

我们认为，贵基金财务报表已经按照企业会计准则、《金融企业会计制度》和《证券投资基金会计核算办法》的规定编制，在所有重大方面公允反映了贵基金 2006 年 12 月 31 日的财务状况以及 2006 年度的经营成果、净值变动及收益分配情况。

安永大华会计师事务所有限责任公司

中国注册会计师：徐 艳

中国注册会计师：蒋燕华

2007 年 3 月 22 日

六、 财务会计报告

(一) 年度会计报表

1、 资产负债表

单位：人民币元

项目	附注	2006 年 12 月 31 日
资 产		
银行存款	8(1)	365,457,735.93
清算备付金		6,211,848.21
交易保证金		2,252,160.00
应收证券交易清算款		33,411,212.89
应收股利		-
应收利息	8(2)	110,817.11
应收申购款		18,177,542.15
其他应收款		—



股票投资市值	8(3)	3,262,625,139.50
其中：股票投资成本		2,137,971,945.47
债券投资市值	8(3)	5,933,342.80
其中：债券投资成本		5,533,060.80
权证投资	8(3)	55,915,588.76
其中：权证投资成本		38,949,940.37
买入返售证券		-
待摊费用	8(4)	96,000.00
其他资产		-
资产总计		3,750,191,387.35
负债及持有人权益		
负债		
应付证券清算款		-
应付赎回款		47,976,530.26
应付赎回费		179,656.20
应付管理人报酬		4,611,033.86
应付托管费		768,505.68
应付佣金	8(5)	1,657,181.74
应付利息		-
应付收益		-
未交税金		-
其他应付款	8(6)	503,405.40
卖出回购证券款		-
短期借款		-
预提费用	8(7)	70,000.00
其他负债		-
负债合计		55,766,313.14
持有人权益		
实收基金	8(8)	2,596,467,843.33
未实现利得	8(9)	981,570,342.15
未分配收益		116,386,888.73
持有人权益合计		3,694,425,074.21

2006 年末基金份额净值：1.4229		
负债与持有人权益总计		3,750,191,387.35

2、经营业绩表

单位：人民币元

项目	附注	2006 年 9 月 20 日(基金合同生效日)至 2006 年 12 月 31 日期间
收入		
股票差价收入	8(10)	133,984,586.36
债券差价收入	8(11)	-209,194.16
权证差价收入	8(12)	826,174.03
债券利息收入		2,468,521.43
存款利息收入		2,740,818.81
股利收入		638,313.86
买入返售证券收入		-
其他收入	8(13)	1,850,153.67
收入合计		142,299,374.00
费用		
基金管理人报酬		14,747,913.28
基金托管费		2,457,985.58
卖出回购证券支出		585,422.46
利息支出		-
其他费用	8(14)	184,598.40
其中：上市年费		-
信息披露费		104,000.00
审计费用		70,000.00
费用合计		17,975,919.72
基金净收益		124,323,454.28
加：未实现利得		1,142,019,124.42
基金经营业绩		1,266,342,578.70

3、收益分配表

单位：人民币元

项目	附注	2006 年 9 月 20 日(基金合同生效日)至 2006 年 12 月 31 日期间
基金净收益		124,323,454.28
加：期初基金净收益		—
加：本期申购基金份额的损益平准金		3,379,473.27
减：本期赎回基金份额的损益平准金		11,316,038.82



可供分配基金净收益		116,386,888.73
减：本期已分配基金净收益		—
期末基金净收益		116,386,888.73

4、基金净值变动表

单位：人民币元

项目	附注	2006年9月20日(基金合同生效日)至2006年12月31日期间
一、期初基金净值		3,289,724,684.59
二、本期经营活动		
基金净收益		124,323,454.28
未实现估值增值/(减值)变动数		1,142,019,124.42
经营活动产生的基金净值变动数		1,266,342,578.70
三、本期基金单位交易		
基金申购款		592,716,566.02
基金赎回款		-1,454,358,755.10
基金单位交易产生的基金净值变动数		-861,642,189.08
四、本期向持有人分配收益		
向基金持有人分配收益产生的基金净值变动数		—
五、期末基金净值		3,694,425,074.21

(二) 年度会计报表附注 (除特别标明外，金额单位为人民币元)

1、基金基本情况

兴业全球视野股票型证券投资基金(以下简称“本基金”),系经中国证监会2006年7月27日证监基金字[2006]149号文批准,由兴业基金管理有限公司作为管理人于2006年8月15日开始向社会公开发行,2006年9月20日募集成立。本基金为契约型开放式,存续期限不定。设立时募集的扣除认购费后的实收基金(本金)为人民币3,288,479,690.07元,在募集期间产生的活期存款利息为人民币1,244,994.52元,以上实收基金(本息)合计为人民币3,289,724,684.59元,折合3,289,724,684.59份基金份额,业经安永大华会计师事务所有限责任公司验证并出具验资报告。本基金的基金托管人为兴业银行,有关基金设立文件已按规定向中国证券监督管理委员会备案。



2. 基本会计假设

本年度会计报表的编制遵守基本会计假设。

3、会计报表编制基础

本基金的财务报表系按照企业会计准则、《金融企业会计制度》、《证券投资基金会计核算办法》、基金合同、中国证券监督管理委员会颁布的《证券投资基金信息披露管理办法》、《证券投资基金信息披露内容与格式准则》第 2 号《年度报告的内容与格式》、《证券投资基金信息披露编报规则》第 3 号《会计报表附注的编制及披露》及其他中国证监会颁布的相关规定而编制。

4、主要会计政策和会计估计

(1) 会计年度

本基金会计年度为公历 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。本会计报表的实际编制期间为 2006 年 9 月 20 日至 2006 年 12 月 31 日。

(2) 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

(3) 记账基础和计价原则

本基金以权责发生制为记账基础，除上市股票、权证和在证券交易所上市的债券按市值计价外，其余均以历史成本为计价原则。

(4) 基金资产的估值原则

上市流通的股票按估值日该股票在证券交易所的收盘价估值；该日无交易的证券，以最近一个交易日的收盘价计算；

未上市的股票的估值

A. 送股、转增股、公开增发新股或配股的股票，以其在证券交易所挂牌的同一证券估值日的收盘价估值，该日无交易的，以最近一个交易日的收盘价计算；

B. 首次公开发行的股票，以其成本价计算；

C. 非公开发行的股票的估值

根据基金部通知[2006]37号文《关于进一步加强基金投资非公开发行股票风险控制有关问题的通知》，2006年11月13日前投资的非公开发行的股票按估值日该股票在证券交易所的收盘价估值；该日无交易的证券，以最近一个交易日的收盘价计算；2006年11月13日后投资的非公开发行的股票按以下方法估值：

a. 估值日在证券交易所上市交易的同一股票的市价低于非公开发行股票
初始取得成本时，应采用在证券交易所的同一股票的市价作为估值日该非公开发
行股票的价值；

b. 估值日在证券交易所上市交易的同一股票的市价高于非公开发行股票
初始取得成本时，应按以下公式确定估值日该非公开发行股票的价值：

$$FV=C+(P-C) \times (DI-Dr) / DI$$

（其中：FV为估值日该非公开发行股票的价值；C为该非公开发行股票的初
始取得成本；P为估值日在证券交易所上市交易的同一股票的市价；DI为该非公开发
行股票锁定期所含的交易天数；Dr为估值日剩余锁定期，即估值日至锁定期结
束所含的交易天数，不含估值日当天）。

证券交易所市场实行净价交易的债券按估值日收盘价估值；该日无交易的，
以最近交易日净价估值，并按债券面值与票面利率扣除应由债券发行单位代扣代缴
的个人所得税后在债券持有期间内逐日计提利息；

证券交易所市场未实行净价交易的债券按估值日收盘价减去债券收盘价中所
含的债券应收利息得到的净价进行估值；该日没有交易的，按最近交易日债券收盘
价减去债券收盘价中所含的债券应收利息得到的净价估值，并按债券面值与票面利
率扣除应由债券发行单位代扣代缴的个人所得税后在债券持有期间内逐日计提利
息；

未上市债券和在银行间同业市场交易的债券以不含息价格计价，按成本估
值，并按债券面值与票面利率扣除应由债券发行单位代扣代缴的个人所得税后在债
券持有期间内计提利息；

上市流通的认股权证按估值日该权证在证券交易所的收盘价估值；该日无
交易的权证，以最近一个交易日的收盘价计算；

未上市流通的认股权证，由基金管理人和托管人综合考虑市场情况、标的
股票价格、行权价格、剩余期限、市场无风险利率、标的股票价格波动等因素，按
照最能反映权证公允价值的价格估值；

配股权证，从配股除权日到配股确认日止，按收盘价高于配股价的差额估
值；如果收盘价等于或低于配股价，则估值额为零；

分离交易可转债，上市日前，按以下方法分别计算债券和权证的估值：获
得分离交易可转债的债券部分时，按成本估值；获得权证部分后，按照中国证券业
协会公布的债券报价和权证报价分别确定当日债券和权证的估值；

自上市日起，上市流通的债券和权证分别按上述 、 中相关原则进行估值；

如有确凿证据表明按上述规定不能客观反映基金资产公允价值的，基金管理人可根据具体情况，在与基金托管人商议后，按最能反映基金资产公允价值的方法估值；

如有新增事项，按国家最新规定估值。

(5) 证券投资的成本计价方法

股票投资

买入股票于成交日确认为股票投资，股票投资成本按成交日应支付的全部价款入账；因股权分置改革而获得非流通股股东支付的现金对价，于股权分置改革方案实施后的股票复牌日，冲减股票投资成本；

卖出股票于成交日确认股票差价收入/（损失），出售股票的成本按移动加权平均法于成交日结转；

债券投资

买入证券交易所交易的债券于成交日确认为债券投资。债券投资按成交日应支付的全部价款入账，其中所包含债券起息日或上次除息日至购买日止的利息，作为应收利息单独核算，不构成债券投资成本；

买入银行间同业市场交易的债券于实际支付价款时确认为债券投资。债券投资按实际支付的全部价款入账，其中所包含债券起息日或上次除息日至购买日止的利息，作为应收利息单独核算，不构成债券投资成本；

买入央行票据和零息债券视同到期一次性还本付息的附息债券，根据其发行价、到期价和发行期限按直线法推算内含票面利率后，按上述会计处理方法核算；

卖出证券交易所交易的债券于成交日确认债券差价收入/（损失）；卖出银行间同业市场交易的债券于实际收到全部价款时确认债券差价收入/（损失）。出售债券的成本按移动加权平均法结转；

权证投资

买入权证于成交日确认为权证投资，权证投资成本按成交日应支付的全部价款入账；

配股权证及由股权分置改革而被动获得的权证，在确认日记录所获分配的权证数量，该等权证初始成本为零；

卖出权证于成交日确认权证差价收入/（损失），出售权证的成本按移动加权平均法于成交日结转；

分离交易可转债

申购新发行的分离交易可转债于权益登记日获得债券，按分离交易可转债的面值确认债券成本；于权证获得日，根据中国证券业协会公布的债券和权证的报价计算出两者分别占面值的比例，根据此比例来确认债券和权证分别应承担的成本；

上市后，上市流通的债券和权证分别按上述 、 中相关原则进行计算。

(6) 待摊费用的摊销方法和摊销期限

本基金待摊费用核算已经发生的、影响基金份额净值小数点后第五位的费用，采用直线法在受益期内平均摊销。

(7) 收入的确认和计量

股票差价收入于卖出股票成交日确认，并按卖出股票成交总额与其成本和相关费用的差额入账；

债券差价收入

A. 卖出证券交易所上市债券：于成交日确认债券差价收入，并按应收取的全部价款与其成本、应收利息和相关费用的差额入账；

B. 卖出银行间市场交易债券：于实际收到价款时确认债券差价收入，并按实际收到的全部价款与其成本、应收利息的差额入账；

权证差价收入于卖出权证成交日确认，并按卖出权证成交总额与其成本和相关费用的差额入账；

债券利息收入按债券票面价值与票面利率或内含票面利率计算的金额扣除应由债券发行企业代扣代缴的个人所得税后的净额确认，在债券实际持有期内逐日计提；

存款利息收入按存款的本金与适用的利率逐日计提的金额入账。若提前支取定期存款，按协议规定的利率及持有期重新计算存款利息收入，并根据提前支取所实际收到的利息收入与账面已确认的利息收入的差额确认利息损失，列入利息收入减项，存款利息收入以净额列示；

股利收入于除息日确认，并按上市公司宣告的分红派息比例计算的金额扣除应由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额入账；

买入返售证券收入按证券持有期内采用直线法逐日计提的金额入账；

其他收入于实际收到时确认收入。

(8) 费用的确认和计量

基金管理费按前一日的基金资产净值的 1.5% 的年费率逐日计提；

基金托管费按前一日的基金资产净值的 0.25% 的年费率逐日计提；

卖出回购证券支出按融入资金额及约定利率，在回购期限内采用直线法逐日计提；

其他费用系根据有关法规及相应协议规定，按实际支出金额，列入当期基金费用。如果影响基金份额净值小数点后第五位的，则采用待摊或预提的方法。

(9) 基金的收益分配政策

在符合有关基金分红条件的前提下，本基金每年收益分配次数最多为 6 次，分配比例不低于可分配收益的 50%，若基金合同生效不满 3 个月可不进行收益分配；

本基金收益分配方式分两种：现金分红与红利再投资，投资者可选择现金红

利或将现金红利按权益登记日除权后的基金份额净值自动转为基金份额进行再投资；若投资者不选择，本基金默认的收益分配方式是现金分红；

基金投资当期出现净亏损，则不进行收益分配；

基金当年收益应先弥补上一年度亏损后，才可进行当年收益分配；

基金收益分配后基金份额净值不能低于面值；

每一基金份额享有同等分配权；

法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

5、本报告期重大会计差错

无。

6、主要税项

根据财政部、国家税务总局财税字[2002]128号文《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税字[2004]78号文《关于证券投资基金税收政策的通知》及其他相关税务法规和实务操作的规定，主要税项为：

A. 印花税

根据财政部、国家税务总局财税字[2005]11号文《关于调整证券（股票）交易印花税率的通知》，自2005年1月24日起，调整证券（股票）交易印花税率，由原先的2‰调整为1‰。

B. 营业税、企业所得税

根据财政部、国家税务总局财税字[2004]78号文《关于证券投资基金税收政策的通知》，自2004年1月1日起，对证券投资基金（封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金）管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入，继续免征营业税和企业所得税。

C. 个人所得税

根据财政部、国家税务总局财税字[2002]128号文《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》，对基金取得的股票的股息、红利收入、债券的利息收入及储蓄利息收入，由上市公司、债券发行企业及金融机构在向基金派发股息、红利收入、债券的利息收入及储蓄利息收入时代扣代缴 20% 的个人所得税；

根据财政部、国家税务总局财税字[2005]107号文《关于股息红利有关个人所得税政策的补充通知》的规定，自 2005 年 6 月 13 日起，对证券投资基金从上市公司分配取得的股息红利所得，按照财税[2005]102号文规定，扣缴义务人在代扣代缴个人所得税时，减按 50% 计算应纳税所得额。

7、重大关联方关系及关联交易

(1) 关联方关系

<u>企业名称</u>	<u>与本基金的关系</u>
兴业基金管理有限公司	基金发起人、基金管理人、注册登记机构、直销机构
兴业银行股份有限公司	基金托管人、基金代销机构
兴业证券股份有限公司	基金管理人的股东、基金代销机构
国家开发投资公司	基金管理人的股东
中投信用担保有限公司	基金管理人的股东
福建省邮政局	基金管理人的股东

以下关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

(2) 通过关联方席位进行的证券交易及交易佣金

<u>关联方名称</u>	<u>2006 年 9 月 20 日至 2006 年 12 月 31 日</u>	
股票买卖	本期成交金额	占本期交易金额的比例
兴业证券股份有限公司	2,279,243,638.71	82.84%
债券买卖	本期成交金额	占本期交易金额的比例
兴业证券股份有限公司	—	—
权证买卖	本期成交金额	占本期交易金额的比例
兴业证券股份有限公司	52,752,842.30	84.02%
证券回购	本期成交金额	占本期交易金额的比例
兴业证券股份有限公司	—	—
佣金	本期佣金	占本期佣金总量的比例
兴业证券股份有限公司	1,840,550.58	82.62%

注：上述佣金已扣除中国证券登记结算有限责任公司收取的由券商承担的证券结算风险基金。

股票交易佣金为成交金额的1‰扣除证券公司需承担的费用（包括但不限于买（卖）经手费、买（卖）证管费和证券结算风险基金等）；转债交易佣金为成交金额的0.1‰扣除证券公司需承担的费用（包括但不限于买（卖）经手费、买（卖）证管费和证券结算风险基金等）；证券公司不向本基金收取国债现券及国债回购和企业债券的交易佣金，但交易的经手费和证管

费由本基金交纳，其所计提的证券结算风险基金从支付给证券公司的股票交易佣金中扣除。佣金的比率是公允的，符合证监会有关规定。管理人因此从关联方获得的服务主要包括：为本基金提供的证券投资研究成果和市场信息服务。

(3) 与关联方进行的银行间同业市场的债券（含回购）交易

本基金自2006年9月20日(基金合同生效日)至2006年12月31日止期间未通过银行间同业市场与关联方进行债券（含回购）交易。

(4) 由关联方保管的银行存款余额及由此产生的利息收入

本基金的银行存款由基金托管人兴业银行股份有限公司保管，并按银行间同业利率计息。基金托管人于2006年12月31日保管的银行存款余额为人民币365,457,735.93元。本会计期间由基金托管人保管的银行存款产生的利息收入为人民币2,703,923.11元。

(5) 基金管理人及托管人报酬

A. 基金管理人报酬——基金管理费

- a. 基金管理费按前一日的基金资产净值的1.5%的年费率计提。计算方法如下：

$$H=E \times 1.5\% / \text{当年天数}$$

H为每日应支付的基金管理费

E为前一日的基金资产净值

- b. 基金管理费每日计算，逐日累计至每月月底，按月支付；由基金托管人于次月前两个工作日内从基金资产中一次性支付给基金管理人。

本基金在2006年9月20日（基金合同生效日）至2006年12月31日止期间需支付基金管理费14,747,913.28元。

B. 基金托管人报酬——基金托管费

- a. 基金托管费按前一日的基金资产净值的0.25%的年费率计提。计算方法如下：

$$H=E \times 0.25\% / \text{当年天数}$$

H为每日应支付的基金托管费

E为前一日的基金资产净值

- b. 基金托管费每日计算，逐日累计至每月月底，按月支付；由基金托管人于次月前两个工作日内从基金资产中一次性支取。

本基金在2006年9月20日（基金合同生效日）至2006年12月31日止期间需支付基金托管费2,457,985.58元。

(6) 关联方持有基金份额

本基金各关联方于自2006年9月20日(基金合同生效日)至2006年12月31日止期间均未持有本基金份额。

8、会计报表重要项目说明

(1) 银行存款

<u>项 目</u>	<u>2006-12-31</u>
活期存款	365,457,735.93
定期存款	-
合 计	<u>365,457,735.93</u>

本基金自2006年9月20日（基金合同生效日）至2006年12月31日止期间未投资于定期存款，没有发生定期存款到期前支取的情况。

(2) 应收利息

<u>项 目</u>	<u>2006-12-31</u>
应收银行存款利息	96,441.49
应收清算备付金利息	2,795.30
应收债券利息	10,679.32
应收权证保证金利息	901.00
合 计	<u>110,817.11</u>

(3) 投资估值增值明细

<u>明细项目</u>	<u>2006-12-31</u>
股票估值增值余额	1,124,653,194.03
其中：成本	2,137,971,945.47
市值	3,262,625,139.50
债券估值增值余额	400,282.00
其中：成本	5,533,060.80
市值	5,933,342.80
权证估值增值余额	16,965,648.39
其中：成本	38,949,940.37
市值	<u>55,915,588.76</u>
合 计	<u>1,142,019,124.42</u>

(4) 待摊费用

<u>项 目</u>	<u>2006-12-31</u>
信息披露费	<u>96,000.00</u>

(5) 应付佣金

<u>项 目</u>	<u>2006-12-31</u>
兴业证券股份有限公司	1,270,071.15
湘财证券有限责任公司	<u>387,110.59</u>
合 计	<u>1,657,181.74</u>

(6) 其他应付款

<u>项 目</u>	<u>2006-12-31</u>
银行间交易手续费	3,405.40
应付券商席位保证金	<u>500,000.00</u>
合 计	<u>503,405.40</u>

(7) 预提费用

<u>项 目</u>	<u>2006-12-31</u>
审计费	<u>70,000.00</u>

(8) 实收基金

<u>项 目</u>	<u>2006年9月20日(基金合同生效日)</u> <u>至2006年12月31日止期间</u>
本期认购	3,288,479,690.07
加：募集期间认购资金利息折份额	1,244,994.52
期初基金净值	3,289,724,684.59
加：本期申购	510,403,797.86
减：本期赎回	<u>1,203,660,639.12</u>
年末实收基金	<u>2,596,467,843.33</u>

(9) 未实现利得

<u>项 目</u>	<u>2006年9月20日(基金合同生效日)</u> <u>至2006年12月31日止期间</u>
期初余额	—
投资估值增/减值	1,142,019,124.42
其中：股票估值增值	1,124,653,194.03
债券估值增值	400,282.00
权证估值增值	16,965,648.39

未实现利得平准金	-160,448,782.27
其中：本期申购	78,933,294.89
本期赎回	<u>-239,382,077.16</u>

年末余额	<u>981,570,342.15</u>
------	-----------------------

注：投资估值增值为本基金于2006年12月31日对证券投资进行估值时，证券投资估值额与其账面成本之差额。

(10) 股票差价收入

<u>项 目</u>	<u>2006年9月20日（基金合同生效日）</u> <u>至2006年12月31日止期间</u>
卖出股票成交总额	513,883,507.26
减：卖出股票成本总额	<u>379,898,920.90</u>
股票差价收入	<u>133,984,586.36</u>

(11) 债券差价收入

<u>项 目</u>	<u>2006年9月20日（基金合同生效日）</u> <u>至2006年12月31日止期间</u>
卖出债券成交总额	618,064,117.26
减：卖出债券成本总额	613,674,043.74
减：应收利息总额	<u>4,599,267.68</u>
债券价差收入	<u>-209,194.16</u>

(12) 权证差价收入

<u>项 目</u>	<u>2006年9月20日（基金合同生效日）</u> <u>至2006年12月31日止期间</u>
卖出权证成交总额	1,566,113.23
减：卖出权证成本总额	<u>739,939.20</u>
权证差价收入	<u>826,174.03</u>

(13) 其他收入

<u>项 目</u>	<u>2006年9月20日（基金合同生效日）</u> <u>至2006年12月31日止期间</u>
赎回费收入	1,836,765.63
转换费收入	13,376.79
其他	<u>11.25</u>
合 计	<u>1,850,153.67</u>

(14) 其他费用

<u>项 目</u>	<u>2006年9月20日（基金合同生效日）</u> <u>至2006年12月31日止期间</u>
信息披露费	104,000.00
审计费用	70,000.00



账户维护费	600.00
回购交易费用	1,655.40
银行费用	4,643.00
债券交易费用	2,800.00
其他	900.00
合计	184,598.40

(15) 本期已分配基金净收益

本基金自2006年9月20日（基金合同生效日）至2006年12月31日止期间未进行收益分配。

(16) 其他重要报表项目的说明

本基金自2006年9月20日（基金合同生效日）至2006年12月31日止期间所投资的股票中，因股权分置改革而获得非流通股股东支付的现金对价为人民币240,000.00元。此等现金对价于股权分置改革方案实施后的股票复牌日，冲减股票投资成本。

9、报告期末流通转让受到限制的基金资产

(1) 报告期末持有的流通转让受到限制的股票

股票代码	股票名称	数量	投资成本	年末 估值 单价	年末估值 总额	可流通 日期	复牌 开盘 单价
因处于网下申购锁定期而流通受限的股票							
601398	工商银行	25,237,000	78,739,440.00	3.12	156,469,400.00	2007/01/29	5.18
601628	中国人寿	132,300	2,497,824.00	18.88	2,497,824.00	2007/04/09	—
601872	招商轮船	959,342	3,559,158.82	3.71	7,626,768.90	2007/03/01	9.14
002079	苏州固锔	53,560	342,248.40	6.39	550,596.80	2007/02/16	11.81
002080	中材科技	50,455	453,085.90	8.98	978,827.00	2007/02/26	26.50
002081	金螳螂	36,846	471,628.80	12.80	884,304.00	2007/02/26	32.80
002082	栋梁新材	64,597	410,836.92	6.36	808,108.47	2007/02/26	19.00
002084	海鸥卫浴	71,104	570,965.12	8.03	1,583,486.08	2007/02/26	30.00
002086	东方海洋	66,640	499,133.60	7.49	775,023.20	2007/02/28	12.88
002095	网盛科技	17,772	250,407.48	14.09	979,592.64	2007/03/15	50.50
002097	山河智能	51,885	518,850.00	10.00	1,681,592.85	2007/03/22	35.90
因股权分置改革而流通受限的股票							
600737	S*ST 屯河	400,000	2,072,616.56	5.18	3,012,000.00	2007/01/23	9.88
600806	S 交科技	499,938	3,921,413.79	7.84	3,934,512.06	2007/03/07	9.90
000549	S 湘火炬	23,138,730	127,724,613.53	5.52	205,934,697.00	—	35.90
因处于非公开发行锁定期而流通受限的股票							
000667	名流置业	13,000,000	59,800,000.00	4.60	79,690,000.00	2007/10/16	—



000926	福星科技	8,000,000	62,400,000.00	7.80	118,000,000.00	2007/10/25	—
因媒体报道需澄清而流通受限的股票							
600631	百联股份	3,022,476	23,545,691.33	7.79	28,743,746.76	2007/01/04	9.65

(2) 截止 2006 年 12 月 31 日，年末未持有流通受限的债券。

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	3,262,625,139.50	87.00%
2	债券	5,933,342.80	0.16%
3	权证	55,915,588.76	1.49%
4	银行存款及清算备付金合计	371,669,584.14	9.91%
5	其他资产	54,047,732.15	1.44%
资产合计		3,750,191,387.35	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	775,023.20	0.02%
B	采掘业	110,256,463.50	2.98%
C	制造业	1,435,200,575.64	38.85%
C0	其中：食品、饮料	179,923,979.89	4.87%
C1	纺织、服装、皮毛	—	—
C2	木材、家具	11,779,732.48	0.32%
C3	造纸、印刷	—	—
C4	石油、化学、塑胶、塑料	122,249,404.35	3.31%
C5	电子	30,046,681.81	0.81%
C6	金属、非金属	604,714,303.50	16.37%
C7	机械、设备、仪表	401,895,673.08	10.88%
C8	医药、生物制品	84,590,800.53	2.29%



C99	其他制造业	—	—
D	电力、煤气及水的生产和供应业	161,411,126.57	4.37%
E	建筑业	14,747,304.00	0.40%
F	交通运输、仓储业	77,425,110.61	2.10%
G	信息技术业	130,374,517.85	3.53%
H	批发和零售贸易	166,762,226.28	4.51%
I	金融、保险业	811,997,339.45	21.98%
J	房地产业	179,521,797.42	4.86%
K	社会服务业	105,028,384.77	2.84%
L	传播与文化产业	69,125,270.21	1.87%
M	综合类	—	—
	合计	3,262,625,139.50	88.31%

(三) 报告期末按市值占基金资产净值比例大小排序的所有股票明细

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	16,476,089	269,548,816.04	7.30%
2	600000	浦发银行	9,737,951	207,515,735.81	5.62%
3	000549	S 湘火炬	23,138,730	205,934,697.00	5.57%
4	600019	宝钢股份	23,000,000	199,180,000.00	5.39%
5	600005	武钢股份	30,780,892	195,766,473.12	5.30%
6	601398	工商银行	28,757,000	178,293,400.00	4.83%
7	600016	民生银行	15,111,918	154,141,563.60	4.17%
8	000858	五粮液	6,665,925	152,316,386.25	4.12%
9	000926	福星科技	10,000,000	147,500,000.00	3.99%
10	600900	长江电力	11,263,841	110,047,726.57	2.98%
11	000402	金融街	5,196,024	87,553,004.40	2.37%
12	600028	中国石化	9,499,890	86,638,996.80	2.35%
13	000667	名流置业	13,000,000	79,690,000.00	2.16%
14	600350	山东高速	17,059,438	74,549,744.06	2.02%
15	000528	柳工	4,236,377	72,442,046.70	1.96%
16	600050	中国联通	13,000,000	60,710,000.00	1.64%
17	000063	中兴通讯	1,316,960	51,493,136.00	1.39%
18	000401	冀东水泥	9,522,327	47,516,411.73	1.29%
19	600409	三友化工	10,375,395	44,095,428.75	1.19%
20	600880	博瑞传播	2,361,894	41,356,763.94	1.12%
21	600089	特变电工	2,680,934	40,079,963.30	1.08%
22	600521	华海药业	2,889,322	39,121,419.88	1.06%
23	600500	中化国际	4,840,323	33,011,002.86	0.89%
24	600309	烟台万华	1,305,182	31,624,559.86	0.86%



25	000888	峨眉山 A	3,178,169	30,478,640.71	0.83%
26	000987	广州友谊	1,733,143	29,550,088.15	0.80%
27	600631	百联股份	3,022,476	28,743,746.76	0.78%
28	601006	大秦铁路	3,508,411	28,418,129.10	0.77%
29	600831	广电网络	1,578,653	27,768,506.27	0.75%
30	000822	山东海化	5,736,005	27,762,264.20	0.75%
31	600011	华能国际	4,070,000	26,251,500.00	0.71%
32	600085	同仁堂	1,463,516	25,143,204.88	0.68%
33	600795	国电电力	4,070,000	25,111,900.00	0.68%
34	002024	苏宁电器	545,000	24,743,000.00	0.67%
35	600269	赣粤高速	2,523,179	21,421,789.71	0.58%
36	600729	重庆百货	1,467,437	20,382,699.93	0.55%
37	600029	S 南航	4,879,810	19,958,422.90	0.54%
38	000157	中联重科	867,110	19,275,855.30	0.52%
39	000983	西山煤电	1,999,946	17,899,516.70	0.48%
40	600600	青岛啤酒	1,178,777	16,373,212.53	0.44%
41	600993	马应龙	502,317	15,978,703.77	0.43%
42	000792	盐湖钾肥	651,312	15,344,910.72	0.42%
43	000759	武汉中百	1,599,950	14,879,535.00	0.40%
44	600686	金龙汽车	865,707	14,768,961.42	0.40%
45	000061	农产品	1,114,904	14,215,026.00	0.38%
46	600588	用友软件	443,107	13,395,124.61	0.36%
47	000758	中色股份	1,500,000	12,375,000.00	0.34%
48	600325	华发股份	891,059	12,278,793.02	0.33%
49	600337	美克股份	1,082,696	11,779,732.48	0.32%
50	600584	长电科技	1,178,473	11,772,945.27	0.32%
51	000811	烟台冰轮	1,552,205	11,703,625.70	0.32%
52	600720	祁连山	3,536,741	10,963,897.10	0.30%
53	000903	云内动力	999,940	9,629,422.20	0.26%
54	600360	华微电子	592,970	8,740,377.80	0.24%
55	600519	贵州茅台	93,617	8,222,381.11	0.23%
56	600563	法拉电子	662,174	8,151,361.94	0.22%
57	000617	S 济 柴	460,000	7,815,400.00	0.21%
58	601872	招商轮船	959,342	7,626,768.90	0.21%
59	000400	许继电气	635,006	5,880,155.56	0.16%
60	601666	平煤天安	527,000	5,717,950.00	0.15%
61	000651	格力电器	405,200	4,809,724.00	0.13%
62	600867	通化东宝	505,520	4,347,472.00	0.12%
63	600806	S 交科技	499,938	3,934,512.06	0.11%
64	600406	国电南瑞	166,156	3,796,664.60	0.10%
65	600636	三爱富	416,331	3,422,240.82	0.10%

66	600737	S*ST 屯河	400,000	3,012,000.00	0.08%
67	601628	中国人寿	132,300	2,497,824.00	0.07%
68	002081	金螳螂	98,846	2,372,304.00	0.06%
69	600587	新华医疗	209,485	1,682,164.55	0.05%
70	002097	山河智能	51,885	1,681,592.85	0.05%
71	002084	海鸥卫浴	71,104	1,583,486.08	0.04%
72	002080	中材科技	71,955	1,395,927.00	0.04%
73	600280	南京中商	112,671	1,237,127.58	0.03%
74	002073	青岛软控	25,500	1,207,425.00	0.03%
75	600673	阳之光	137,812	1,050,127.44	0.03%
76	002095	网盛科技	17,772	979,592.64	0.03%
77	002056	横店东磁	41,570	831,400.00	0.02%
78	002082	栋梁新材	64,597	808,108.47	0.02%
79	002086	东方海洋	66,640	775,023.20	0.02%
80	002079	苏州固锝	53,560	550,596.80	0.01%

(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

单位：人民币元

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	600036	招商银行	170,991,686.13	4.63%
2	600019	宝钢股份	132,623,251.59	3.59%
3	601398	工商银行	131,288,372.82	3.55%
4	000549	S 湘火炬	127,724,613.53	3.46%
5	600000	浦发银行	114,294,172.05	3.09%
6	600005	武钢股份	107,034,540.22	2.90%
7	600016	民生银行	92,682,080.94	2.51%
8	600900	长江电力	91,698,904.86	2.48%
9	000858	五粮液	85,671,960.78	2.32%
10	000926	福星科技	82,576,376.25	2.24%
11	600050	中国联通	79,187,183.43	2.14%
12	600350	山东高速	60,437,722.93	1.64%
13	000667	名流置业	59,800,000.00	1.62%
14	000402	金融街	52,147,241.82	1.41%
15	000629	新钢钒	51,214,522.79	1.39%
16	600028	中国石化	50,630,693.22	1.37%
17	600409	三友化工	46,324,873.67	1.25%
18	000401	冀东水泥	42,035,952.32	1.14%
19	000063	中兴通讯	40,009,251.82	1.08%
20	000528	柳 工	37,720,094.41	1.02%



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	000629	新 钢 钒	65,962,381.32	1.79%
2	601398	工商银行	65,123,950.93	1.76%
3	600050	中国联通	60,120,538.00	1.63%
4	600019	宝钢股份	52,749,680.01	1.43%
5	600004	白云机场	43,782,253.41	1.19%
6	600009	上海机场	42,108,649.96	1.14%
7	600016	民生银行	28,862,629.92	0.78%
8	600005	武钢股份	23,009,835.69	0.62%
9	601588	北辰实业	18,851,700.62	0.51%
10	600010	包钢股份	13,931,457.55	0.38%
11	600694	大商股份	12,603,483.57	0.34%
12	600012	皖通高速	11,446,124.79	0.31%
13	600808	马钢股份	10,963,631.42	0.30%
14	600887	伊利股份	10,100,822.87	0.27%
15	601988	中国银行	9,985,351.65	0.27%
16	600001	邯郸钢铁	7,829,577.76	0.21%
17	000002	万 科 A	7,506,171.25	0.20%
18	600011	华能国际	6,991,413.99	0.19%
19	002022	科华生物	6,052,224.36	0.16%
20	600795	国电电力	5,443,410.32	0.15%

3、报告期内买入股票的成本总额为 2,518,110,866.37 元，卖出股票的收入总额为 133,984,586.36 元。

(五) 本报告期末按券种分类的债券投资组合

债券类别	期末市值（元）	市值占基金资产净值比例
国家债券	—	—
央行票据	—	—
企业债券	2,734,454.80	0.07%
可转换债券	3,198,888.00	0.09%
债券投资合计	5,933,342.80	0.16%

(六) 本报告期末债券明细

1、本报告期末按市值占基金资产净值比例大小排序的债券明细

序号	债券名称	期末市值（元）	市值占基金资产净值比例
1	天药转债	3,198,888.00	0.09%



2	06 中化债	2,734,454.80	0.07%
---	--------	--------------	-------

2、报告期末按市值占基金资产净值比例大小排序的可转换债券明细

序号	债券名称	期末市值(元)	市值占基金资产净值比例
1	天药转债	3,198,888.00	0.09%

(七) 投资组合报告附注

1、报告期内本基金投资的前十名证券的发行主体无被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的。

2、本基金投资的前十名股票中，没有投资于超出基金合同规定备选库之外的股票。

3、基金持有每只股票的价值均不超过基金资产净值的 10%。

4、本报告期末基金的其他资产构成

序号	项目	金额
1	交易保证金	2,252,160.00
2	应收证券交易清算款	33,411,212.89
3	应收股利	—
4	应收利息	110,817.11
5	应收申购款	18,177,542.15
6	其他应收款	—
7	待摊费用	96,000.00
合 计		54,047,732.15

5、本报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本报告期末本基金持有的可转换债券均未处于转股期。

6、报告期内基金获得权证的数量明细

获得方式	权证代码	权证名称	获得数量(份)	卖出数量(份)	成本(元)	期末余额(元)
主动投资	580001	武钢 JTB1	6,720,000	6,720,000	4,668,652.54	-
	580005	万华 HXB1	1,860,455	-	29,076,577.98	41,415,588.76
	580011	中化 CWB1	508,200	508,200	739,939.20	-
	030002	五粮 YGC1	1,000,000	-	9,873,362.39	14,500,000.00

7、本报告期末按市值占基金净资产比例大小排序的资产支持证券明细

本报告期末本基金未持有资产支持证券。



八、基金份额持有人户数、持有人结构

基金持有人户数	户均持有的份额	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
32,460	79,989.77	417,252,382.42	16.07%	2,179,215,460.90	83.93%

九、基金份额变动

序号	项目	份额(份)
1	期初基金份额总额	3,289,724,684.59
2	期间基金总申购份额	510,403,797.86
3	期间基金总赎回份额	1,203,660,639.12
4	期末基金份额总额	2,596,467,843.33

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、本基金管理人的重大人事变动。

2006 年 7 月 17 日，本基金管理人在《中国证券报》、《上海证券报》和《证券时报》刊登公告，因工作需要，原公司董事兰荣不再担任兴业基金管理有限公司董事，由张训苏担任兴业基金管理有限公司董事。

2006 年 12 月 5 日，本基金管理人在《中国证券报》、《上海证券报》和《证券时报》刊登公告，陈曦不再担任公司副总经理。

2、报告期内本基金的托管人未发生重大人事变动。

(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改变。

(五) 报告期内本基金分配收益事项。

本基金本报告期内未进行收益分配。

(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 7 万元人民币。

(七) 报告期内本基金管理人、基金托管人及其高级管理人员未受监管部门的稽查或处罚。

(八) 本报告期内，本基金管理人在《中国证券报》、《上海证券报》和《证券时报》刊登的其他重要临时公告：

序号	事项名称	披露日期
1	兴业全球视野股票型证券投资基金基金合同生效公告	2006-9-21
2	关于旗下部分基金投资 G 名流 (000667) 非公开发行股票的公告	2006-10-17
3	兴业全球视野股票型证券投资基金开放申购业务的公告	2006-10-18
4	关于调整旗下部分基金费率结构的公告	2006-10-18
5	关于旗下兴业全球视野基金投资福星科技 (000926) 非公开发行股票的公告	2006-10-27
6	兴业全球视野股票型证券投资基金开放赎回业务的公告	2006-11-15



7	关于增加兴业全球视野股票型证券投资基金代销机构的公告	2006-11-15
8	关于开通兴业全球视野股票型基金定期定额投资业务的公告	2006-11-23
9	关于开通兴业全球与兴业转基、以及兴业全球与兴业货币之间基金转换业务的公告	2006-11-23

(九) 根据中国证监会的有关规定, 我司在综合考量证券经营机构的财务状况、经营状况、研究能力的基础上, 选择基金专用交易席位, 并经公司董事会批准。

1、2006 年 9 月 20 日(基金合同生效日)至 2006 年 12 月 31 日期间通过各证券公司专用席位股票年交易量和年佣金情况

序号	券商名称	席位个数	股票交易量(元)	占交易量比例	交易佣金(元)	占交易量比例
1	兴业证券	2	2,279,243,638.71	82.84%	—	—
2	湘财证券	1	472,088,770.60	17.16%	—	—
合计		3	2,751,332,409.31	100.00%	—	—

2、2006 年 9 月 20 日(基金合同生效日)至 2006 年 12 月 31 日期间通过各证券公司专用席位债券、回购交易量情况

2006 年 9 月 20 日(基金合同生效日)至 2006 年 12 月 31 日期间均未通过各证券公司专用席位进行的债券及债券回购交易。

3、通过各证券公司专用席位进行的权证成交金额

序号	券商名称	权证交易量	占交易量比例
1	兴业证券	52,752,842.30	84.02%
2	湘财证券	10,034,782.89	15.98%
合计		62,787,625.19	100%

4、本报告期内租用证券公司席位变更情况

报告期内本基金专用交易席位增加兴业证券席位 2 个, 湘财证券席位 1 个。

十一、备查文件目录

- 1、中国证监会批准兴业全球视野股票型证券投资基金设立的文件
- 2、《兴业全球视野股票型证券投资基金基金合同》
- 3、《兴业全球视野股票型证券投资基金托管协议》
- 4、《兴业全球视野股票型证券投资基金招募说明书》
- 5、基金管理人业务资格批件、营业执照和公司章程
- 6、本报告期内在中国证监会指定报纸上公开披露的各项公告原件。

存放地点：基金管理人、基金托管人的办公场所。

查阅方式：投资者可登录基金管理人互联网站查阅，或在营业时间内至基金管理人、基金托管人办公场所免费查阅。

客户服务中心电话：021-38714536

兴业基金管理有限公司

2007 年 3 月 28 日