



中海优质成长证券投资基金

2007 年年度报告

报告期：2007.1.1—2007.12.31

基金管理人：中海基金管理有限公司

基金托管人：交通银行

送出日期：2008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。全体董事出席本次董事会，没有董事对年度报告内容的真实性、准确性、完整性无法保证或存在异议。

本基金托管人交通银行根据本基金合同规定，于2008年3月27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。



目 录

一、基金简介	4
二、主要财务指标、基金净值表现及收益分配情况.....	5
三、基金管理人报告	9
四、基金托管人报告	12
五、基金年度审计报告	13
六、基金财务会计报告	15
七、基金投资组合报告	43
八、基金份额持有人户数、持有人结构.....	64
九、开放式基金份额变动	64
十、重大事件揭示	64
十一、备查文件目录	69



一、基金简介

- (一) **基金名称：**中海优质成长证券投资基金
基金简称：中海成长
交易代码： 398001, 398002
基金运作方式： 契约型开放式
基金合同生效日： 2004 年 9 月 28 日
报告期末基金份额总额： 8, 224, 782, 580. 89 份
基金存续期： 自基金成立之日起至基金终止之日
- (二) **基金投资目标：** 本基金主要通过投资于中国证券市场中具有品质保障和发展潜力的持续成长企业所发行的股票和国内依法公开发行上市的债券，在控制风险、确保基金资产流动性的前提下，以获取资本长期增值和股息红利收益的方式来谋求基金资产的中长期稳定增值。
基金投资策略： 品质过滤、成长精选
业绩比较基准： 新华富时 A600 成长指数×75% + 新华富时中国国债指数×25%（2007 年 1 月 1 日至 2007 年 5 月 31 日）；沪深 300 指数×75%+上证国债指数×25%（2007 年 6 月 1 日至 2007 年 12 月 31 日）。
风险收益特征： 本基金是一只主动型的股票基金，在证券投资基金中属于中等风险品种。本基金力争在严格控制风险的前提下谋求实现基金资产的中长期稳定增值。
- (三) **基金管理人：** 中海基金管理有限公司
注册地址： 上海市浦东新区陆家嘴东路 166 号中国保险大厦 34 层
办公地址： 上海市浦东新区陆家嘴东路 166 号中国保险大厦 34 层
邮政编码： 200120
法定代表人： 储晓明
信息披露负责人： 夏立峰
电话： 021-68419966
传真： 021-68419525
电子信箱： xialf@zhfund.com
- (四) **基金托管人：** 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：蒋超良

信息披露负责人：张咏东

电话：021-68888917

传真：021-58408836

电子信箱：zhangyd@bankcomm.com

(五) 信息披露报纸名称：中国证券报、证券时报

登载年度报告正文的管理人互联网网址：www.zhfund.com

基金年度报告置备地点：上海市浦东新区陆家嘴东路 166 号中国保险大厦 34 层

(六) 会计师事务所：江苏公证会计师事务所

注册地址：无锡市新区旺庄路 52 号

办公地址：无锡市梁溪路 28 号

法定代表人：张彩斌

电话：0510-85888988、85887801

传真：0510-85885275

经办注册会计师：沈岩、李建

(七) 注册登记机构：中海基金管理有限公司

办公地址：上海市浦东新区陆家嘴东路 166 号中国保险大厦 34 层

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	主要财务指标	2007 年度	2006 年度	2005 年度
1	本期利润	55,204,361.36	118,922,902.09	6,833,033.41
2	本期利润扣减本期公允价值变动损益后的净额	25,086,677.86	120,084,524.81	-31,823,178.16
3	加权平均份额本期利润	0.0274	0.8869	0.0131
4	期末可供分配利润	3,343,027,201.88	16,116,445.36	-23,516,006.72
5	期末可供分配份额利润	0.4065	0.1001	-0.0729
6	期末基金资产净值	7,729,485,749.78	177,185,178.30	305,856,420.62
7	期末基金份额净值	0.9398	1.1001	0.9486
8	加权平均净值利润率	2.55%	74.86%	1.37%



9	本月份净值增长率	129.27%	107.77%	-2.32%
10	份额累计净值增长率	351.79%	97.05%	-5.16%

注：1、所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、赎回费等），计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

2、2007年7月1日基金实施新会计准则后，原“基金本期净收益”名称调整为“本期利润扣减本期公允价值变动损益后的净额”，原“加权平均基金份额本期净收益”=本期利润扣减本期公允价值变动损益后的净额/（本期利润/加权平均基金份额本期利润）。

（二）基金净值表现

1、本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 ①	净值增长率标准 差②	业绩比较基准 收益率③	业绩比较基准收 益率标准差④	①-③	②-④
过去3个月	-4.04%	1.49%	-2.84%	1.49%	-1.2%	0.00%
过去6个月	28.96%	1.79%	31.01%	1.57%	-2.05%	0.22%
过去1年	129.27%	2.03%	92.21%	1.70%	37.06%	0.33%
过去3年	365.33%	1.50%	243.21%	1.31%	122.12%	0.19%
基金合同生效起至今	351.79%	1.45%	214.98%	1.29%	136.81%	0.16%

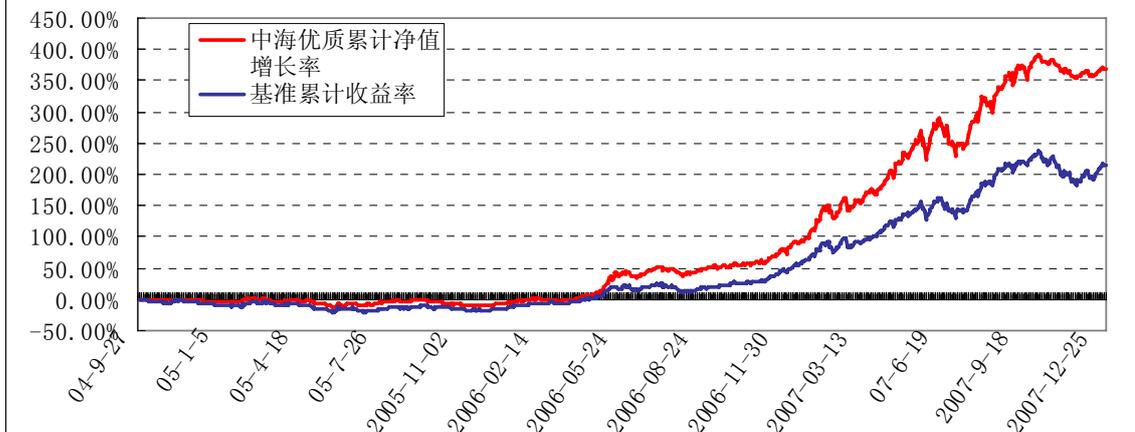
注：基金合同生效起至今指2004年9月28日（基金合同生效日）至2007年12月31日。

2、基金合同生效以来本基金累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比

图

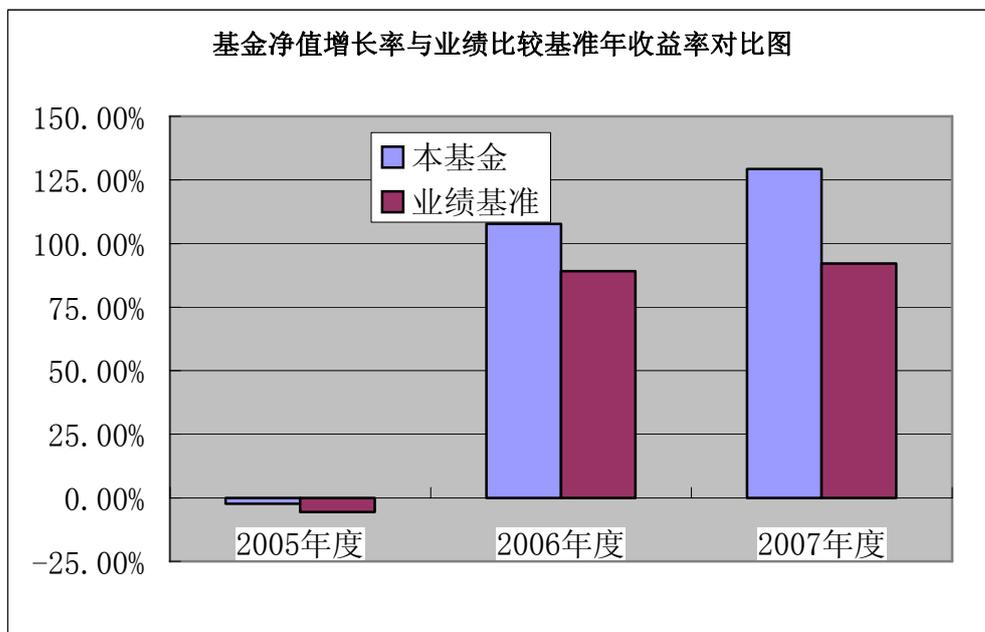


中海优质成长累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率历史走势对比图



注：鉴于《新华富时指数使用许可协议》期限届满终止，中海基金管理有限公司作为基金管理人，已于2007年6月1日将中海优质成长证券投资基金业绩比较基准由“新华富时A600成长指数*75%+新华富时中国国债指数*25%”变更为“沪深300指数*75%+上证国债指数*25%”。

3、本基金净值增长率与业绩比较基准年收益率对比图



(三)、基金合同生效以来每年基金收益分配情况

单位：人民币



年度	每 10 份基金份额分红数 (至少保留三位小数)	备注
自 2004 年 9 月 28 日 (基金合同生效日) 至 2004 年 12 月 31 日止	0.000	-
2005 年度	0.000	-
2006 年度	8.100	本年度共进行了二次收益分配, 合计每 10 份基金份额分红 8.100 元
2007 年度	0.800	本年度共进行了一次收益分配, 合计每 10 份基金份额分红 0.800 元
合计	8.900	

三、基金管理人报告

（一）基金管理人及基金经理情况

基金管理人：自 2004 年 3 月 18 日成立以来，始终坚持“诚实信用、勤勉尽责”的原则，严格履行基金管理人的责任和义务，依靠强大的投研团队、规范的业务管理模式、严密科学的风险管理和内部控制体系，为广大基金份额持有人提供规范、专业的资产管理服务，取得了优异业绩。截至 2007 年 12 月 31 日，共管理开放式证券投资基金 3 只。

基金经理：李涛先生，本科，10 年证券从业经历。历任西南证券投资银行部总经理助理，国泰君安证券股份有限公司资产管理部交易经理、基金经理助理、基金经理，新时代证券有限公司资产管理总部总经理。2005 年进入本公司工作，2005 年 6 月 16 日至 2007 年 7 月 9 日担任中海分红增利混合型证券投资基金基金经理，2007 年 7 月 10 日至本报告期末任中海优质成长证券投资基金基金经理。

彭焰宝先生，清华大学工学士，13 年证券从业经历。历任国联证券有限责任公司交易员、投资经理、投资部副总经理，国联投资管理有限公司投资部总经理。2004 年 3 月至 2007 年 8 月 12 日任本公司投资总监（2004 年 9 月 28 日至 2007 年 7 月 9 日期间，同时担任中海优质成长证券投资基金基金经理），2007 年 8 月 13 日至本报告期末任本公司风险管理部总经理。

（二）管理人合规情况说明

基金管理人在报告期内严格遵守《基金法》及其他有关法律法规、《基金合同》的规定，勤勉尽责地为基金份额持有人谋求利益，不存在损害基金份额持有人利益的行为，不存在违法违规或未履行基金合同承诺。

（三）基金经理工作报告

1、报告期内基金的投资策略和业绩表现

07 年是中国资本市场大发展的一年，在宏观经济向好的大背景下，A 股市场上市公司利润增长不断超出投资人预期，伴随着微观层面企业业绩的大幅度上涨，资本市场也在不断刷新历史记录。

中海优质成长在 07 年较好的把握住了宏观经济整体向好背景下“自上而下”带来的行业机遇，在银行、地产、钢铁、有色、煤炭等大行业中均取得了较好投资业绩，同时本基金坚持

一贯的投资理念，发挥“自下而上”的选股能力，努力挖掘具有中长期成长能力的公司，分享公司在成长过程带来的投资收益。

截至 2007 年 12 月 31 日，本基金份额净值 0.9398 元（累计净值 3.2293 元）。报告期内本基金取得了 129.27% 的净值增长，超越了比较基准 37.06 个百分点。

在谋求基金净值的稳步增长的同时，中海优质成长基金秉承一贯的及时回报投资人的思路，本报告期内共进行了 1 次分红，累计分红收益率为 8%，在市场中取得了较好的口碑，让持有人取得及时回报的思路将会成为我们始终坚持的策略选择。

2、宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

回顾 07 年 A 股市场，中国经济整体向好带来的微观层面企业利润的超预期是推动资本市场不断刷新高点的核心因素，08 年市场面临的外部环境已经有所变化，美国次贷危机的爆发、全球高通胀、国内经济过热引发的宏观调控压力不断加大等，虽然我们认为中国仍处于一个上升的经济周期中，但 08 年宏观经济的不确定因素在不断加大，过热的经济在 08 年面临着不小的调整压力，微观层面的企业利润必然会有分化。

08 年的资本市场，我们认为将会在动荡中度过，实体层面的波动必然会引导资本市场投资方向、投资标的的变化，我们认为成长类公司在 08 年应该会有较优异的表现，在整体市场相对较高的估值背景下，唯有高成长类的公司才有消化目前相对较高的估值压力的可能，同时伴随着股指期货、创业板的开设等制度层面的完善，主题投资也蕴涵不少投资机会，而与宏观经济挂钩比较密切的银行、地产、钢铁、煤炭等行业在估值逐步回归到合理区域，其中不乏优秀公司值得投资人长期关注。

（四）内部监察报告

报告期内，本基金管理人在内部监察工作中一切从合规运作、保障基金份额持有人利益出发，由独立的监察稽核部门对公司经营、基金运作及员工行为的合规性进行定期和不定期检查，推动内部控制机制的完善与优化，保证各项法规和管理制度的落实，发现问题及时提出建议并督促有关部门改进。

公司各项业务能遵循国家法律法规、中国证监会规章制度、公司内部的规章制度以及各项业务规范流程，公司运行符合合法性、合规性的要求，主要内控制度基本有效。

在本报告期内，本基金管理人内部监察工作重点集中于以下几个方面：



(1) 根据基金监管法律法规的重大变化，推动公司各部门完善制度建设和业务流程，并加强内部法规培训；

(2) 全面开展基金运作监察稽核工作，确保基金投资的合法合规。通过电脑监控、现场检查人员询问、重点抽查等方法开展工作，不断提高全体员工的风险意识，保证了基金的合法合规运作，没有出现违规行为；

(3) 按照中国证监会的要求，在公司内部严格推行风险控制自我评估制度。通过各部门的参与和自我评估，明确了各部门的风险点，对控制不足的风险点，制订了进一步的控制措施；

(4) 根据监管部门的要求，完成与基金投资业务相关的定期监察报告，报送中国证监会和董事会。

公司自成立以来，各项业务运作正常，内部控制和风险防范措施逐步完善并积极发挥作用。基金运作合法合规，保障了基金份额持有人的利益。我们将继续以风险控制为核心，提高内部监察工作的科学性和有效性，保障基金合规运作。

四、托管人报告

2007 年度，基金托管人在中海优质成长证券投资基金的托管过程中，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，中海基金管理有限公司在中海优质成长证券投资基金投资运作、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。

2007 年度，由中海基金管理有限公司编制并经托管人复核审查的有关中海优质成长证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。

交通银行

2008 年 3 月 27 日

五、基金年度审计报告

苏公 W[2008]A221 号

中海优质成长证券投资基金全体持有人：

我们审计了后附的中海优质成长证券投资基金(以下简称中海成长)财务报表，包括2007年12月31日的资产负债表，2007年度的利润表和所有者权益（基金净值）变动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、《中海优质成长证券投资基金基金合同》及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定编制财务报表是中海成长的管理人中海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；(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，中海成长财务报表已经按照企业会计准则、《中海优质成长证券投资基金基金合同》及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定编制，在所有重大方面公允反映了中海成长2007年12月31日的财务状况以及2007年度的经营成果、净值变动情况。

江苏公证会计师事务所有限公司

中国注册会计师： 沈岩

中国·无锡市

中国注册会计师： 李建

2008年3月27日

六、基金财务会计报告
(一) 会计报表内容
1、资产负债表
资产负债表

单位：人民币元

资产	2007年12月31日	2006年12月31日	附注	负债与持有人权益	2007年12月31日	2006年12月31日	附注
资产：				负债：			
银行存款	78,464,888.94	40,757,251.34		短期借款	—	—	
结算备付金	382,994,840.21	6,300,822.67		交易性金融负债	—	—	
交易保证金	2,883,248.10	359,609.61		衍生金融负债	—	—	
交易性金融资产	6,808,124,608.47	163,688,367.52		卖出回购金融资产款	—	—	
其中：股票投资	6,292,382,315.57	157,062,615.12	(1)	应付证券清算款	19,703,516.84	40,431,020.39	
债券投资	515,742,292.90	6,625,752.40	(1)	应付赎回款	6,531,130.93	69,032.96	
资产支持证券投资	—	—		应付管理人报酬	9,346,912.40	214,398.19	
基金投资	—	—		应付托管费	1,557,818.74	35,733.04	
衍生金融资产	—	4,531,507.00	(2)	应付销售服务费	—	—	
买入返售金融资产	500,000,870.00	—		应付交易费用	9,351,492.26	557,412.33	(4)
应收证券清算款	—	—		应付税费	—	—	
应收利息	4,107,337.81	83,408.65	(3)	应付利息	—	—	
应收股利	—	—		应付利润	—	—	
应收申购款	34,167.92	3,322,092.59		其他负债	633,340.50	550,284.17	(5)
其他资产	—	—		负债合计	47,124,211.67	41,857,881.08	
				所有者权益：			
				实收基金	3,304,293,132.61	161,068,732.94	(6)
				未分配利润	4,425,192,617.17	16,116,445.36	
				所有者权益合计	7,729,485,749.78	177,185,178.30	
资产合计	7,776,609,961.45	219,043,059.38		负债及所有者权益总计	7,776,609,961.45	219,043,059.38	

注：所附附注为本会计报表的组成部分

2、利润表
利润表

单位：人民币元

项 目	附注	2007 年度	2006 年度
一、收入		172,656,564.12	126,381,805.99
1、利息收入（合计）		6,913,756.18	629,407.84
其中：存款利息收入		3,900,223.36	316,439.03
债券利息收入		2,860,112.30	234,696.19
资产支持证券利息收入		—	—
买入返售金融资产收入		153,420.52	78,272.62
2、投资收益（合计）		133,915,999.90	126,484,198.37
其中：股票投资收益	(7)	125,766,498.90	122,369,041.33
债券投资收益	(8)	1,571,948.88	-95,430.35
资产支持证券投资收益		—	—
基金投资收益		—	—
衍生工具收益	(9)	2,443,366.88	3,024,098.07
股利收益		4,134,185.24	1,186,489.32
3、公允价值变动收益	(10)	30,117,683.50	-1,161,622.72
4、其他收入	(11)	1,709,124.54	429,822.50
二、费用		117,452,202.76	7,458,903.90
1、基金管理人报酬		30,723,035.50	2,443,394.02
2、基金托管费		5,120,505.94	407,232.35
3、销售服务费		—	—
4、交易费用	(12)	79,234,765.84	4,284,453.07
5、利息支出		2,007,918.33	3,242.70
其中：卖出回购金融资产支出		2,007,918.33	3,242.70
6、财务费用		—	—
7、其他费用	(13)	365,977.15	320,581.76
三、利润总额		55,204,361.36	118,922,902.09

注：所附附注为本会计报表的组成部分

3、所有者权益（基金净值）变动表



所有者权益（基金净值）变动表

单位：人民币元

项 目	行 次	本金额（2007年）			上年金额（2006年）		
		实收基金	未分配利润	所有者权益合计	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	161,068,732.94	16,116,445.36	177,185,178.30	322,418,814.74	-16,562,394.12	305,856,420.62
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期净利润）	2	—	55,204,361.36	55,204,361.36	—	118,922,902.09	118,922,902.09
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数	3	—	—	7,510,571,274.88	—	—	-135,945,759.65
其中：1. 基金申购款	4	3,896,457,342.08	5,006,266,582.96	8,902,723,925.04	261,008,935.06	75,997,239.18	337,006,174.24
2. 基金赎回款	5	753,232,942.41	638,919,707.75	1,392,152,650.16	422,359,016.86	50,592,917.03	472,951,933.89
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动数	6	—	13,475,064.76	13,475,064.76	—	111,648,384.76	111,648,384.76
五、期末所有者权益（基金净值）	7	3,304,293,132.61	4,425,192,617.17	7,729,485,749.78	161,068,732.94	16,116,445.36	177,185,178.30

注：所附附注为本会计报表的组成部分

（二）会计报表附注

1、基金基本情况

中海优质成长证券投资基金(以下简称“本基金”)原名国联优质成长证券投资基金,由国联基金管理有限公司(现已更名为“中海基金管理有限公司”)依照《中华人民共和国证券投资基金法》、《证券投资基金运作管理办法》及有关法规规定,经中国证券监督管理委员会证监基金字【2004】92号《关于同意国联优质成长证券投资基金设立的批复》核准募集设立。经国联基金管理有限公司股东会2006年第一次、第二次临时会议决议和修改后章程的规定,并经中国证券监督管理委员会证监基金字[2006]90号“关于同意国联基金管理有限公司股权转让、增加注册资本、修改公司章程和变更公司名称的批复”批准,名称变更为中海基金管理有限公司;另经中海基金管理有限公司第一届董事会第十六次会议审议通过,并经各基金托管人同意

及中国证券监督管理委员会基金监管部核准，将管理的开放式基金名称进行相应变更，原“国联优质成长证券投资基金”更名为“中海优质成长证券投资基金”。

本基金为契约型开放式，存续期限不定，基金管理人为中海基金管理有限公司，基金托管人为交通银行；有关基金募集文件已按规定向中国证券监督管理委员会备案；基金合同于2004年9月28日生效，该日的基金份额总额为1,017,619,728.79份。

本基金于2007年10月19日(拆分日)进行了基金份额拆分。当日，本基金拆分前基金份额净值为2.4891元，精确到小数点后第9位为2.489131393元，基金份额总额为1,480,631,490.88份，本基金管理人按照1:2.489131393的拆分比例对本基金的份额进行了拆分。实施拆分后，拆分日基金份额净值调整为1.0000元，拆分后基金份额总额为3,685,486,326.68份，基金份额计算结果保留到小数点后2位，小数点2位后的部分截去，截去部分所代表的资产归基金资产所有。

2、 会计报表编制基础

本基金的会计报表按中国财政部2006年颁布的《企业会计准则》（以下简称“新会计准则”）、中国证券业协会2007年颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》（以下简称“指引”）编制，会计报表披露的方式则是根据中国证券监督管理委员会颁布并于2004年7月1日起实施的《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》、证券投资基金信息披露编报规则第4号《基金投资组合报告的编制及披露》及基金合同的规定进行编制及披露。

本基金自2007年7月1日起执行“新会计准则”和“指引”，本基金自成立之日起至2007年6月30日止，仍执行原企业会计准则、《金融企业会计制度》和《证券投资基金会计核算办法》。

2007年度会计报表为本基金首份按照“新会计准则”、“指引”、《中海优质成长证券投资基金合同》和适用的基金行业实务操作的有关规定编制的年度会计报表，本基金已按照《企业会计准则第38号-首次执行企业会计准则》第五条至第十九条及其他相关规定，对自基金成立日至2007年6月30日止期间的会计报表予以追溯调整，并对2006年度会计报表以及相关的重要项目的披露按照新会计准则和指引的要求进行了重述。调整涉及的主要内容包括：

- a 将所持有的股票投资、债券投资和权证投资等划分为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产；

- b 以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产按照公允价值调整账面价值，且将原计入权益的公允价值变动计入当期损益；

上述变更及调整对自本基金成立至 2007 年 6 月 30 日止期间的净损益及所有者权益的汇总影响见会计报表主要项目注释的（15）。

3、 主要会计政策

（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。比较会计报表的实际编制期间为 2006 年 1 月 1 日至 2006 年 12 月 31 日止。

（2） 记账本位币

以人民币为记账本位币；

（3） 记账基础和计价原则

本基金的会计核算以权责发生制为记账基础，除金融工具按本附注所述的估值原则计价外，其他报表项目均以历史成本为计价原则。

（4） 金融工具

金融工具是指形成本基金的金融资产，并形成其他单位的金融负债或权益工具的合同。

a 金融工具的确认和终止确认

本基金于成为金融工具合同的一方时确认一项金融资产或金融负债。

金融资产满足下列条件之一的，终止确认：

- 收取该金融资产现金流量的合同权利终止；
- 该金融资产已转移，且符合下述金融资产转移的终止确认条件。

金融负债的现时义务全部或部分已经解除的，终止确认该金融负债或其一部分。

b 金融资产分类和计量

本基金的金融资产于初始确认时分为以下两类：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、贷款和应收款项。金融资产在初始确认时以公允价值计量。对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，相关交易费用直接计入当期损益，其他类别的金融资产相关交易费用计入其初始确认金额。

c 衍生金融工具

本基金的衍生金融工具主要系认股权证。衍生金融工具以公允价值计量，因公允价值变动而产生的任何不符合套期会计规定的利得或损失，直接计入当期损益。公允价值为正数的衍生金融工具确认为一项资产，公允价值为负数的确认为一项负债。

d 金融资产转移

➤ 金融资产转移，是指本基金将金融资产让与或交付给该金融资产发行方以外的另一方(转入方)。

➤ 本基金已将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方的，终止确认该金融资产；保留了金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬的，不终止确认该金融资产。

➤ 本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬的，分别下列情况处理：放弃了对该金融资产控制的，终止确认该金融资产并确认产生的资产和负债；未放弃对该金融资产控制的，按照其继续涉入所转移金融资产的程度确认有关金融资产，并相应确认有关负债。

e 金融负债分类和计量

本基金的金融负债于初始确认时归类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债和其他金融负债。本基金目前持有的金融负债划分为其他金融负债。

(5) 金融工具的估值方法

(a) 上市股票以估值日证券交易所挂牌的市场收盘价估值；该日无交易的，以最近交易日收盘价估值；

(b) 未上市的股票的估值

➤ 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；因持有股票而享有的配股权，采用估值技术确定公允价值；

➤ 首次公开发行的股票

自本基金成立至2007年6月30日按成本价估值；

自2007年7月1日开始，采用估值技术确定公允价值，在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下，按其成本价估值；

首次公开发行有明确锁定期的股票，同一股票在交易所上市后，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估值；

➤ 本基金持有的非公开发行且有明确锁定期的股票估值时分两种情况进行估值：



1、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的非公开发行股票的初始取得成本时，应采用在证券交易所上市交易的同一股票的市价作为估值日该非公开发行股票的价值。

2、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的非公开发行股票的初始取得成本时，应按下列公式确定估值日该非公开发行股票的价值：

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

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；Dt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）。

(c) 上市交易的权证投资按估值日在证券交易所挂牌的该权证投资的市场交易收盘价估值；

(d) 未上市交易的权证投资采用估值技术确定公允价值，在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下，按成本价估值；

(e) 上市债券以不含息价格计价，按估值日证券交易所挂牌的市场收盘价计算后的净价估值；该日无交易的，以最近交易日收盘价估值，并按债券面值与票面利率在债券持有期间内计提利息；

(f) 未上市债券和在银行间同业市场交易的债券

自本基金成立至2007年6月30日按成本价估值；

自2007年7月1日开始，采用估值技术确定公允价值，在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下，按成本价估值；

(g) 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相关原则进行估值；

(h) 银行存款应计利息系按银行存款日余额从上一收息日逐日计息至估值日；

(i) 如有确凿证据表明按上述方法对基金进行估值不能客观反映其公允价值，基金管理人可根据具体情况与基金托管人商定后，按最能反映公允价值的方法估值；

(j) 每个工作日均对基金资产进行估值；

(k) 如有新增事项，按国家最新规定估值。

(6) 金融工具的成本计价方法

按移动加权平均法计算库存证券的成本。当日同时有买入和卖出时，先计算买入成本后再计算买卖证券价差。

(a) 股票

➤ 上交所买入股票成本

自本基金成立至2007年6月30日由买入金额、买入印花税、买入过户费、买入经手费、买入证管费和买入佣金组成；

自2007年7月1日开始，由买入金额组成；

➤ 深交所买入股票成本：

自本基金成立至2007年6月30日由买入金额、买入印花税、买入经手费和买入佣金组成；

自2007年7月1日开始，由买入金额组成；

➤ 上海股票的佣金是按买卖股票成交金额的1‰减去经手费和证管费计算。深圳股票的佣金是按买卖股票成交金额的1‰减经手费计算。

➤ 因股权分置改革而获得非流通股股东支付的现金对价于正股复牌日确认冲减股票投资成本。

(b) 债券

➤ 自本基金成立至2007年6月30日，买入上市债券按应支付的全部价款入账，如果应支付的价款中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。

自2007年7月1日开始，买入上市债券按应支付的全部价款扣减交易费用入账，如果应支付的价款中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。

➤ 买入未上市和银行间同业市场交易的债券按应支付的全部价款入账，如果应支付的价款中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。

➤ 债券交易不计佣金。

(c) 权证

➤ 自本基金成立至2007年6月30日，权证投资按成交日应支付的全部价款入账；

自2007年7月1日开始，权证投资按成交日应支付的全部价款扣减交易费用后入账；

➤ 因股权分置改革获得的权证于正股复牌日确认为权证投资。



➤ 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；

(d) 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。

(e) 买入返售金融资产和卖出回购金融资产

➤ 自本基金成立至2007年6月30日，买入返售金融资产和卖出回购金融资产于成交日按协议金额确认初始成本；

➤ 自2007年7月1日开始，买入返售金融资产于成交日按融出资金应付或实际支付的总额确认初始成本，卖出回购金融资产于成交日按融入资金应收或实际收到的总额确认初始成本。

(7) 收入的确认

a 股票投资收益

➤ 自本基金成立至2007年6月30日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；

自2007年7月1日开始于卖出股票成交日确认，并按卖出股票成交总额与其成本的差额入账；

b 债券投资收益：

➤ 自本基金成立至2007年6月30日，卖出交易所上市债券于成交日确认债券投资收益，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；

自2007年7月1日开始，卖出交易所上市债券于成交日确认债券投资收益，并按应收取的全部价款与其成本、应收利息的差额入账；

➤ 自本基金成立至2007年6月30日，卖出银行间市场交易债券于按实际收到价款时确认债券投资收益，并按实际收到的全部价款与其成本、应收利息的差额入账；

自2007年7月1日开始，卖出银行间市场交易债券于按成交日确认债券投资收益，并按实际收到的全部价款与其成本、应收利息的差额入账；



- c 债券利息收入按实际持有期内逐日计提，并按债券票面价值与票面利率计提的金额入账；
- d 权证投资收益
 - 自本基金成立至2007年6月30日于卖出权证成交日按卖出权证成交总额与其成本和相关费用的差额确认。
 - 自2007年7月1日开始，于卖出权证成交日按卖出权证成交总额与其成本的差额确认。
- e 存款利息收入按本金与适用的利率逐日计提的金额入账；
- f 股利收益于除息日确认，并按上市公司宣告的分红派息比例计算的金额入账；
- g 资产支持证券利息收入按证券票面价值与票面利率计算的金额，在证券实际持有期内逐日计提；
- h 买入返售金融资产收入
 - 自本基金成立至2007年6月30日按协议金额及协议利率在回购期限内逐日计提的金额入账；
 - 自2007年7月1日开始按买入返售金融资产的摊余成本及实际利率在回购期内逐日计提的金额入账；
- i 公允价值变动收益系本基金持有的采用公允价值模式计量的交易性金融资产、交易性金融负债等公允价值变动形成的应计入当期损益的利得或损失；
- j 其他收入在主要风险和报酬已经转移给对方，经济利益很可能流入且金额可以可靠计量的时候确认。

(8) 费用的确认和计量

a 基金管理费

根据《中海优质成长证券投资基金基金合同》的规定，基金管理费按前一日基金资产净值1.5%的年费逐日计提。

b 基金托管费

根据《中海优质成长证券投资基金基金合同》的规定，基金托管费按前一日基金资产净值0.25%的年费率逐日计提。

c 卖出回购金融资产支出



➤ 自本基金成立至2007年6月30日卖出回购金融资产支出按协议金额及协议利率，在回购期限内采用直线法逐日计提。

➤ 自2007年7月1日开始按卖出回购金融资产的摊余成本及实际利率在回购期内逐日计提；

- d 证券交易费用
- e 基金信息披露费用
- f 基金持有人大会费用
- g 与基金相关的会计师费、律师费
- h 按照国家有关规定可以列入其他费用

上述d至h项费用由基金托管人根据其他有关法规及相应协议的规定，按费用实际支出金额支付，列入当期基金费用。根据《中海优质成长证券投资基金基金合同》的约定，基金成立前所产生的费用、基金管理人和基金托管人因未履行或未完全履行义务导致的费用支出或基金资产的损失，以及处理与基金运作无关的事项发生的费用等不列入基金费用。

(9) 基金的收益分配政策

- a 每一基金份额享有同等分配权；
- b 基金投资当年亏损，则不进行收益分配；
- c 基金当年收益先弥补上一年度亏损后，才可进行当年收益分配；
- d 在符合有关基金分红条件的前提下，本基金收益每年至少分配一次，但若成立不满3个月可不进行收益分配，年度分配在基金会计年度结束后的4个月内完成；
- e 本基金收益分配采用现金形式。基金管理人为持有人提供红利再投资服务。投资者选择红利再投资服务的，其分红资金按除息日的基金份额净值转成相应的基金份额；
- f 法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

4、 主要税项

根据财政部、国家税务总局财税字 [2002]128 号《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《关于证券投资基金税收政策的通知》、财税[2005]102 号《关于股息红利个人所得税有关政策的通知》、财税[2005]103 号《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》、财税[2005]11 号《关于调整证券(股票)交易印花税税率的通知》及其他相关税务法规和实务操作，主要税项列示如下：

- (a) 印花税

根据财政部、国家税务总局财税字[2002]128号文《财政部、国家税务总局关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》的规定,本基金本报告期按2%的税率缴纳股票交易印花税。根据财政部、国家税务总局税字[2005]11号文《财政部、国家税务总局关于调整证券(股票)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,按0.1%的税率缴纳证券(股票)交易印花税。自2005年6月13日起股权分置改革过程中因非流通股股东向流通股股东支付对价而发生的股权转让,暂免征收印花税。从2007年5月30日起,调整证券(股票)交易印花税率,由现行1%调整为3%。

(b) 营业税

根据财政部、国家税务总局财税字[2002]128号文《财政部、国家税务总局关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》的规定,以发行基金方式募集资金不属于营业税的征税范围,不缴纳营业税;根据财政部、国家税务总局财税字[2004]78号文《国家税务总局关于证券投资基金税收政策的通知》的规定,基金管理人运用基金买卖股票、债券的价差收入暂免缴营业税。

(c) 企业所得税

根据财政部、国家税务总局财税字[2004]78号文《国家税务总局关于证券投资基金税收政策的通知》的规定,本基金自证券市场中取得的收入,包括买卖股票、债券的价差收入,股票的股息、红利收入,债券的利息收入及其他收入,暂不缴纳企业所得税。

(d) 个人所得税

根据财政部、国家税务总局财税字[2002]128号文《财政部、国家税务总局关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》的规定,本基金取得的股票的股息、红利收入及企业债券的利息收入,由上市公司及债券发行企业在向其派发股息、红利收入和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]102号文《关于股息红利有关个人所得税政策的补充通知》,对本基金自2005年6月13日起从上市公司取得的股息红利所得,暂减按50%计入个人应纳税所得额,依照现行税法规定计征个人所得税。

5、 本报告期重大会计差错:

无

6、 关联方关系及其交易



(1) 关联方关系

企业名称	与本基金的关系
中海基金管理有限公司	基金管理人、直销机构
交通银行	基金托管人、代销机构
中海信托股份有限公司(“中海信托”)	基金管理人的股东
国联证券有限责任公司(“国联证券”)	基金管理人的股东、代销机构
云南烟草兴云投资股份有限公司(“兴云投资”)	基金管理人的股东

(2) 2006年基金各关联方投资本基金的情况:

关联人	年初数					年末数	
	持有份数	持有比例	买入	卖出	分红再投资	持有份数	持有比例
中海基金管理有限公司	0.00	0.00	7,381,449.45	0.00	5,313,916.43	12,695,365.88	7.88%
中海信托	25,000,000.00	7.75%	7,405,213.27	25,000,000.00	5,331,024.05	12,736,237.32	7.91%

2007年基金各关联方投资本基金的情况:

关联人	年初数						年末数	
	持有份数	持有比例	买入	卖出	分红再投资	拆分	持有份数	持有比例



中海基金管理有限公司	12,695,365.88	7.88%	15,393,990.62	0.00	1,310,858.80	27,606,739.69	57,006,954.99	0.69%
中海信托	12,736,237.32	7.91%	0.00	0.00	969,087.87	20,409,029.99	34,114,355.18	0.41%

(3) 通过关联方席位进行的交易：国联证券

2006年1月1日—2006年12月31日

单位：人民币元

股票成交金额	占股票总成交额	债券成交金额	占债券总成交额	权证成交金额	占权证总成交额	回购成交金额	占回购总成交额	佣金	占佣金总额
638,474,489.27	30.61%	5,666,654.28	17.91%	5,817,469.29	32.50%	0.00	0.00%	501,205.28	29.82%

2007年1月1日—2007年12月31日

单位：人民币元

股票成交金额	占股票总成交额	债券成交金额	占债券总成交额	权证成交金额	占权证总成交额	回购成交金额	占回购总成交额	佣金	占佣金总额
3,875,245,966.62	18.04%	0.00	0.00%	14,939,534.85	33.96%	0.00	0.00%	3,032,414.81	17.51%

注：上述佣金按市场佣金率计算，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后的净额列示。



沪市交易佣金=股票买（卖）成交金额*1‰-股票买（卖）经手费（买卖成交金额*0.11‰）-股票买（卖）证管费（买卖成交金额*0.04‰）-证券结算风险金（股票成交金额*0.03‰+国债现货成交全价金额*0.01‰+国债回购成交金额*0.01‰）

深市交易佣金=股票买（卖）成交金额*1‰-股票买（卖）经手费（买卖成交金额*0.1875‰）-证券结算风险金（股票成交金额*0.03‰+国债现货成交全价金额*0.01‰+国债回购成交金额*0.01‰）

国联证券符合我司选择证券经营机构、使用其席位作为基金专用交易席位的标准，与其签订的席位租用合同是在正常业务中按照一般商业条款订立的。其为本基金提供证券投资研究成果和市场信息服务。

（4） 基金管理人及托管人报酬

a 基金管理人报酬——基金管理费

- 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

- 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五个工作日内从基金资产中一次性支付给基金管理人。2007年本基金应支付基金管理人管理费共30,723,035.50元，其中已支付基金管理人21,376,123.10元，尚余人民币9,346,912.40元未支付。2006年本基金应支付基金管理人管理费共2,443,394.02元已支付。

b 基金托管人报酬——基金托管费

- 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

- 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五个工作日内从基金资产中一次性支取。2007年本基金应支付基金托管人托管费共计人民币5,120,505.94元，其中已支付人民币3,562,687.20元，尚余人民币1,557,818.74元未支付。2006年本基金应支付基金托管人托管费共计人民币407,232.35元已支付。

(5) 与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易

本基金自2007年1月1日起至2007年12月31日止，未与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易。

(6) 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交通银行保管，并按银行间同业利率计息。基金托管人于2007年12月31日保管的银行存款余额为78,464,888.94元。该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1,779,603.56元。基金托管人于2006年12月31日保管的银行存款余额为40,757,251.34元。该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86,342.62元。

根据中国证券登记结算有限责任公司要求的证券投资基金结算模式，本基金需通过以基金托管人名义开立的“交通银行基金托管结算资金专用存款账户”进行证券交易结算。于2007年12月31日，本基金用于证券交易结算的资金通过“交通银行基金托管结算资金专用存款账户”转存于中国证券登记结算有限责任公司，相关余额382,994,840.21元计入结算备付金科目。于2006年12月31日，本基金用于证券交易结算的资金通过“交通银行基金托管结算资金专用存款账户”转存于中国证券登记结算有限责任公司，相关余额6,300,822.67元计入结算备付金科目。

7、会计报表主要项目注释
(1) 交易性金融资产项目说明

单位：人民币元

项目	2007-12-31			2006-12-31			
	成本	公允价值	估值增值	成本	公允价值	估值增值	
股票投资	6,256,386,900.50	6,292,382,315.57	35,995,415.07	146,749,851.68	157,062,615.12	10,312,763.44	
债券投资	交易所市场	9,257,000.00	13,975,292.90	4,718,292.90	6,626,314.50	6,625,752.40	-562.10
	银行间市场	501,497,050.00	501,767,000.00	269,950.00	—	—	—
	合计	510,754,050.00	515,742,292.90	4,988,242.90	6,626,314.50	6,625,752.40	-562.10
资产支持证券投资	—	—	—	—	—	—	
基金投资（适用于QDII）	—	—	—	—	—	—	



基金)

(2) 衍生金融资产项目说明

单位：人民币元

项目	2007-12-31			2006-12-31		
	成本	公允价值	估值增值	成本	公允价值	估值增值
权证投资	-	-	-	3,977,733.87	4,531,507.00	553,773.13
其他衍生金融资产（适用于QDII基金）	-	-	-	-	-	-

(3) 应收利息

单位：人民币元

	2007年12月31日	2006年12月31日
应收银行存款利息	119,485.48	8,858.91
应收清算备付金利息	175,436.78	8,099.63
应收权证交收价差保证金利息	45.60	49.30
应收债券利息	3,678,271.43	66,400.81
应收质押式买入返售利息	134,098.52	-
合计	4,107,337.81	83,408.65

(4) 应付交易费用

单位：人民币元



	2007年12月31日	2006年12月31日
应付佣金:	9,339,961.46	557,412.33
其中: 国联证券	219,669.50	180,119.54
申银万国	2,735,084.46	194,617.08
东吴证券	1,069,201.50	—
中金公司	2,583,959.89	—
银河证券	—	182,675.71
中投证券	485,261.78	—
长城证券	2,246,784.33	—
应付银行间交易费用	11,530.80	—
合计	9,351,492.26	557,412.33

(5) 其他负债

单位: 人民币元

	2007年12月31日	2006年12月31日
应付赎回费	26,140.50	255.37
其他应付款	507,200.00	250,028.80
预提费用	100,000.00	300,000.00
合计	633,340.50	550,284.17

(6) 实收基金

单位: 人民币元



	2007年12月31日	2006年12月31日
期初数	161,068,732.94	322,418,814.74
本期认购	—	—
本期申购	3,896,457,342.08	261,008,935.06
本期赎回	753,232,942.41	422,359,016.86
期末数	3,304,293,132.61	161,068,732.94

(7) 股票投资收益

单位：人民币元

	2007年度	2006年度
卖出股票成交总额	7,829,352,585.31	1,147,912,852.29
卖出股票成本总额	7,703,586,086.41	1,025,543,810.96
股票投资收益	125,766,498.90	122,369,041.33

(8) 债券投资收益

单位：人民币元

	2007年度	2006年度
卖出债券清算总额	831,405,749.99	38,123,036.08
卖出债券成本总额	815,943,899.13	36,929,840.73
应收利息总额	13,889,901.98	1,288,625.70
债券投资收益	1,571,948.88	-95,430.35

(9) 权证投资收益

单位：人民币元

	2007年度	2006年度
卖出权证清算总额	24,155,719.86	8,474,342.10
卖出权证成本总额	21,712,352.98	5,450,244.03
权证投资收益	2,443,366.88	3,024,098.07

(10) 公允价值变动收益/损失项目说明

单位：人民币元

项目名称	2007年度	2006年度
交易性金融资产		
——股票投资	25,682,651.63	-1,776,257.11
——债券投资	4,988,805.00	60,861.26
——资产支持证券投资	—	—
——基金投资（适用于 QDII 基金）	—	—
衍生工具		
——权证投资	-553,773.13	553,773.13
——其他衍生工具（适用于 QDII 基金）	—	—
交易性金融负债	—	—
合计	30,117,683.50	-1,161,622.72

(11) 其他收入

单位：人民币元

	2007年度	2006年度
配股手续费返还	—	—

新股手续费返还	—	—
赎回及转出基金补偿收入 (a)	1,709,124.54	429,822.50
合计	1,709,124.54	429,822.50

注：(a) 根据《中海优质成长证券投资基金基金合同》的规定，基金赎回（转出）时收取赎回费，其中赎回费用的25%归入基金资产，作为对其他基金份额持有人的补偿。

(12) 交易费用

	2007年度	2006年度
交易所交易费用	79,227,265.84	4,283,852.57
银行间交易费用	7,500.00	600.50
合计	79,234,765.84	4,284,453.07

(13) 其他费用

单位：人民币元

	2007年度	2006年度
银行费用	7,977.15	2,481.76
开户费	—	—
账户服务费	18,000.00	18,000.00
审计师费用	100,000.00	100,000.00
信息披露费用	240,000.00	200,000.00
其他	—	100.00



合计	365,977.15	320,581.76
----	------------	------------

(14) 收益分配

单位：人民币元

除息日	红利发放日	分红率	红利总金额(元)
2007-1-5	2007-1-8	每10份基金份额0.80元	13,475,064.76

(15) 按新准则调整原会计准则的所有者权益及净损益

单位：人民币元

项目	2006 年年初所有者权益	2006 年度 净损益	2006 年年末所有者 权益
按原会计准则列报的金额	305,856,420.62	120,084,524.81	177,185,178.30
金融资产公允价值变动的调整数	-	-1,161,622.72	-
按新会计准则列报的金额	305,856,420.62	118,922,902.09	177,185,178.30

项目	2007 年年初所有者权 益	2007 年上半年净损益	2007 年上半年末 所有者权益
按原会计准则列报的金额	177,185,178.30	218,935,239.52	927,583,075.80
金融资产公允价值变动的调整数	-	26,852,697.53	-
按新会计准则列报的金额	177,185,178.30	245,787,937.05	927,583,075.80

注：按原会计准则直接记入所有者权益下“未实现利得”科目的投资估值增值净变动现按新会计准则在利润表中的“公允价值变动损益”科目中核算，相应的未实现损益平准金现按新会计准则直接记入“未分配利润”科目。于会计期末，按原会计准则列示于所有者权益下“未实现利得”科目中的全部余额，现按新会计准则包含于“未分配利润”科目中。

8、报告期末流通转让受限制的基金资产

(1) 截至2007年12月28日，基金因认购新发或增发证券而持有的流通转让受限制的基金资产明细如下：

股票代码	股票名称	成功认购日	可流通日	认购价格	期末估值 单价	数量(股)	期末成本总额(元)	期末估值总额(元)	流通受限类型
601601	中国太保	2007-12-18	2008-03-26	30.00	49.45	638,742	19,162,260.00	31,585,791.90	网下申购新股锁定
601857	中国石油	2007-10-30	2008-02-05	16.70	30.96	3,128,233	52,241,491.10	96,850,093.68	
601918	国投新集	2007-12-07	2008-03-19	5.88	15.92	445,632	2,620,316.16	7,094,461.44	
002177	御银股份	2007-10-24	2008-02-01	13.79	68.00	10,305	142,105.95	700,740.00	
002178	延华智能	2007-10-24	2008-02-01	7.89	23.20	10,994	86,742.66	255,060.80	
002179	中航光电	2007-10-22	2008-02-01	16.19	45.85	17,146	277,593.74	786,144.10	
002181	粤传媒	2007-11-07	2008-02-18	7.49	26.68	12,421	93,033.29	331,392.28	
002182	云海金属	2007-11-02	2008-02-13	10.79	27.93	32,956	355,595.24	920,461.08	
002183	怡亚通	2007-11-02	2008-02-13	24.89	77.95	20,376	507,158.64	1,588,309.20	
002184	海得控制	2007-11-07	2008-02-18	12.90	23.01	16,852	217,390.80	387,764.52	
002185	华天科技	2007-11-08	2008-02-20	10.55	21.44	33,697	355,503.35	722,463.68	
002186	全聚德	2007-11-07	2008-02-20	11.39	59.03	18,259	207,970.01	1,077,828.77	
002187	广百股份	2007-11-12	2008-02-22	11.68	42.99	19,759	230,785.12	849,439.41	
002188	新嘉联	2007-11-12	2008-02-22	10.07	21.46	11,180	112,582.60	239,922.80	
002189	利达光电	2007-11-19	2008-03-03	5.10	14.70	24,710	126,021.00	363,237.00	
002190	成飞集成	2007-11-19	2008-03-03	9.90	21.16	14,098	139,570.20	298,313.68	
002193	山东如意	2007-11-28	2008-03-07	13.07	24.10	15,044	196,625.08	362,560.40	
002194	武汉凡谷	2007-11-28	2008-03-07	21.10	51.91	33,001	696,321.10	1,713,081.91	
002195	海隆软件	2007-12-04	2008-03-12	10.49	32.86	6,796	71,290.04	223,316.56	
002196	方正电机	2007-12-04	2008-03-12	7.48	24.38	9,880	73,902.40	240,874.40	
002201	九鼎新材	2007-12-13	2008-03-26	10.19	31.87	10,176	103,693.44	324,309.12	
600087	南京水运	2007-12-20	从2007年12月20日起12个月	16.80	17.00	3,500,000	58,800,000.00	59,500,000.00	非公开发行 流通受限
合计							136,817,951.92	206,415,566.73	

(2) 截至2007年12月28日，基金持有的暂时停牌股票明细如下：

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值 单价	复牌日期	复牌开 盘单价	数量(股)	期末成本总额(元)	期末估值总额(元)
000024	招商地产	2007-12-28	重大事项停牌	59.20	2008-01-02	59.00	800,000	67,112,840.07	47,360,000.00
000723	美锦能源	2007-11-12		39.99	2008-01-30	35.99	2,797,191	89,253,421.46	111,859,668.09



000825	太钢不锈	2007-12-28		24.77	2008-01-02	25.05	4,714,719	127,945,412.44	116,783,589.63
002180	万力达	2007-12-28		34.39	2008-01-02	34.03	26,500	367,820.00	911,335.00
002182	云海金属	2007-12-28		27.93	2008-01-02	27.63	18,000	194,220.00	502,740.00
合计								284,873,713.97	277,417,332.72

(3) 估值方法

本基金所持有的暂时停牌的股票，按停牌日交易所的股票收市价估值；

本基金所持有的认购新发或增发证券在锁定期间按当日交易所上市的同一股票的市价估值；

本基金持有的非公开发行股票估值时分两种情况进行估值：

1、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的初始取得成本时，应采用在证券交易所上市交易的同一股票的市价作为估值日该非公开发行股票的价值。

2、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的初始取得成本时，应按下列公式确定估值日该非公开发行股票的价值：

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

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；Dt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）。

9、风险控制报告

(1) 风险管理政策和组织架构

本基金在日常经营活动中涉及的财务风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金管理人制定了《中海基金投资决策委员会议事规则》、《中海基金投资业务流程》、《中海基金权限管理办法》、《中海基金研究管理办法》、《中海基金股票库管理办法》等一系列相应的制度和流程来控制这些风险，并设定适当的风险阈值及内部控制流程，通过可靠的管理及信息系统持续实时监控上述各类风险。

本基金管理人建立了以风险控制委员会为核心的、由督察长、风险管理部、监察稽核部、相关职能部门和业务部门构成的风险管理架构体系。

(2) 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息，导致基金资产损失和收益变化的风险。本基金均投资于具有良好信用等级的证券，且通过分散化投资以分散信用风险。本基金投资于一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的10%，且本基金与由本基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司的证券，不得超过该证券的10%。

本基金在交易所进行的交易均与中国证券登记结算有限责任公司完成证券交收和款项清算，因此违约风险发生的可能性很小；基金在进行银行间同业市场交易前均对交易对手进行信用评估，以控制相应的信用风险。

（3）流动性风险

流动性风险是指基金所持金融工具变现的难易程度。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难。

本基金所持大部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券资产的公允价值。本基金所持有的金融负债的合约约定到期日均为一年以内且不计息，因此账面余额即为未折现的合约到期现金流量。

本基金管理人每日预测本基金的流动性需求，并同时通过独立的风险管理部门设定流动性比例要求，对流动性指标进行持续的监测和分析。

本基金现金持有量在基金资产净值中的占比严格控制在平均5%以上的水平，2007年12月28日，本基金股票资产持仓量为81.40%，债券持仓量为7.58%；2006年12月29日，本基金股票资产持仓量为88.64%，债券持仓量3.74%。

以2007年12月28日股票持仓量为基准，在其他变量不变的假设情况下，以当月股票市场的平均活跃度为依据，除去因停牌或其他技术原因没有交易记录的个股之外，本基金的股票资产加权平均变现天数为0.50天，其中持仓股票最长变现天数为2.98天；2007年12月28日，本基金持仓债券组合久期为0.4233年，其中持仓债券最长久期为0.9326年。

以2006年12月29日本基金股票持仓量为基准，在其他变量不变的假设情况下，以当月股票市场的平均活跃度为依据，除去因停牌或其他技术原因没有交易记录的个股之外，本基金的股票资产加权平均变现天数为0.05天，其中持仓股票最长变现天数为0.34天；2006年12月29日本基金持仓债券组合久期为0.4851年，其中持仓债券最长久期为0.803天。

(4) 市场风险

交易性金融资产	2007年12月28日		2006年12月29日	
	公允价值	占基金资产净值的比例	公允价值	占基金资产净值的比例
股票投资	6292382315.57	81.40%	157062615.12	88.64%
债券投资	585721292.90	7.58%	6625752.40	3.74%
衍生金融资产	0	0	4531507.00	2.56%
合计	6878103608.47	88.98%	168219874.52	94.94%

本基金管理人运用 MSCI Barra Aegis System 对本基金的市场风险进行分析，下表为本基金资产配置边际风险分析，反映了在相关变量不变的假设前提下，资产配置每偏离或靠近基准配置（沪深 300）一个百分点，其对本基金潜在风险的影响情况。

2007 年末行业配置风险状况

部门	本基金	沪深 300	边际风险贡献
能源	6.74%	9.15%	0.0012
原材料	18.23%	16.58%	0.0176
工业	22.25%	19.61%	0.0136
非日常生活消费品	6.33%	8.69%	0.0070
日常消费品	3.01%	4.85%	0.0247
医疗保健	1.53%	1.24%	0.0268
金融	19.95%	30.18%	-0.0289
信息技术	0.07%	2.23%	0.0093
电信业务	0.00%	1.92%	-0.0025
公用事业	3.29%	5.56%	0.0205
合计	81.40%	100.01%	-

2006 年末行业配置风险状况

部门	本基金	沪深 300	边际风险贡献
能源	3.76%	2.31%	0.0070
原材料	13.27%	16.88%	0.0026



工业	13.73%	18.97%	0.0068
非日常生活消费品	11.85%	12.08%	0.0064
日常消费品	11.95%	6.51%	0.0141
医疗保健	7.92%	2.90%	0.0119
金融	21.71%	28.09%	0.0023
信息技术	3.25%	5.23%	0.0053
电信业务	0.00%	2.07%	0.0031
公用事业	1.20%	4.96%	0.0062
合计	88.64%	100.00%	-

(5) 利率风险

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的变化，不受利率变化的直接影响。

(6) 汇率风险

本基金没有持有外汇资产及负债，故本基金受不汇率变化的直接影响。

(7) VaR 分析

对本基金 2007 年内进行日收益率绝对 VaR 分析显示：在 95%的置信水平下，24 小时之内最大损失率（跌幅）为 3.01%；在 99%的置信水平下，24 小时之内最大损失率（跌幅）为 4.41%。

对本基金 2006 年内进行日收益率绝对 VaR 分析显示：在 95%的置信水平下，24 小时之内最大损失率（跌幅）为 1.77%；在 99%的置信水平下，24 小时之内最大损失率（跌幅）为 2.62%。

10、 承诺事项

无需要说明的承诺事项。

11、 期后事项



无需要说明的期后事项。

12、其他重要事项

无需要说明的其他重要事项。



七、基金投资组合报告

本基金托管人——交通银行已于 2008 年 3 月 27 日复核了本报告。截至 2007 年 12 月 31 日，中海优质成长证券投资基金资产净值为 7,729,485,749.78 元，份额净值为 0.9398 元，基金份额为 8,224,782,580.89 份。

1、报告期末基金资产组合情况

项目名称	项目市值 (人民币元)	占基金资产总值比例(%)
股票	6,292,382,315.57	80.92
债券	515,742,292.90	6.63
权证	0.00	0.00
银行存款及清算备付金	461,459,729.15	5.93
其他资产	507,025,623.83	6.52
资产合计	7,776,609,961.45	100.00

2、报告期末按行业分类的股票投资组合

行业	市值(人民币元)	占基金资产净值比例(%)
A 农、林、牧、渔业	0.00	0.00
B 采掘业	721,283,625.17	9.33
C 制造业	2,849,026,863.62	36.86
C0 食品、饮料	210,112,980.00	2.72
C1 纺织、服装、皮毛	23,004,560.40	0.30
C2 木材、家具	44,414,043.25	0.57
C3 造纸、印刷	72,589,182.60	0.94
C4 石油、化学、塑胶、塑料	609,036,520.19	7.88
C5 电子	3,321,647.58	0.04
C6 金属、非金属	639,739,335.53	8.28
C7 机械、设备、仪表	1,048,032,020.69	13.56
C8 医药、生物制品	118,542,133.60	1.53
C9 其他制造业	80,234,439.78	1.04
D 电力、煤气及水的生产和供应业	262,535,756.17	3.40

E 建筑业	0.00	0.00
F 交通运输、仓储业	592,804,227.92	7.67
G 信息技术业	3,204,012.99	0.04
H 批发和零售贸易	258,046,538.84	3.34
I 金融、保险业	1,225,697,469.75	15.86
J 房地产业	374,894,280.06	4.85
K 社会服务业	4,558,148.77	0.06
L 传播与文化产业	331,392.28	0.00
M 综合类	0.00	0.00
合 计	6,292,382,315.57	81.41

3、 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投资明细

序号	股票代码	股票名称	库存数量 (股)	期末市值 (人民币元)	市值占基金资 产净值比例
1	600036	招商银行	7,480,468	296,450,946.84	3.84%
2	601919	中国远洋	5,779,009	246,532,523.94	3.19%
3	002097	山河智能	3,925,915	224,366,042.25	2.90%
4	000568	泸州老窖	2,858,680	210,112,980.00	2.72%
5	600031	三一重工	3,499,749	199,625,682.96	2.58%
6	600030	中信证券	1,967,000	175,594,090.00	2.27%
7	601939	建设银行	16,099,910	158,584,113.50	2.05%
8	600005	武钢股份	7,923,432	156,091,610.40	2.02%
9	601088	中国神华	2,378,747	156,069,590.67	2.02%
10	600000	浦发银行	2,873,600	151,726,080.00	1.96%
11	601318	中国平安	1,429,893	151,711,647.30	1.96%
12	000755	山西三维	3,967,192	150,673,952.16	1.95%
13	002024	苏宁电器	1,999,901	143,692,886.85	1.86%
14	601168	西部矿业	3,444,892	143,686,445.32	1.86%
15	601006	大秦铁路	4,730,810	121,203,352.20	1.57%
16	000825	太钢不锈	4,714,719	116,783,589.63	1.51%
17	000002	万 科A	4,000,000	115,360,000.00	1.49%
18	000723	美锦能源	2,797,191	111,859,668.09	1.45%



19	601699	潞安环能	1,498,625	107,556,316.25	1.39%
20	601628	中国人寿	1,808,774	104,800,365.56	1.36%
21	000088	盐田港	6,040,586	102,569,150.28	1.33%
22	600900	长江电力	5,219,882	101,735,500.18	1.32%
23	601857	中国石油	3,128,233	96,850,093.68	1.25%
24	000960	锡业股份	1,244,292	82,197,929.52	1.06%
25	000423	东阿阿胶	2,503,060	81,499,633.60	1.05%
26	000006	深振业A	3,112,880	81,401,812.00	1.05%
27	601601	中国太保	1,638,742	81,035,791.90	1.05%
28	600612	中国铅笔	3,553,341	80,234,439.78	1.04%
29	600806	昆明机床	3,332,239	78,507,550.84	1.02%
30	600096	云天化	1,567,729	77,179,298.67	1.00%
31	600765	力源液压	1,840,281	76,684,509.27	0.99%
32	600309	烟台万华	1,999,799	76,092,351.95	0.98%
33	600066	宇通客车	2,184,472	75,276,905.12	0.97%
34	600357	承德钒钛	3,911,683	74,556,677.98	0.96%
35	600117	西宁特钢	3,399,790	74,183,417.80	0.96%
36	002078	太阳纸业	1,999,702	72,589,182.60	0.94%
37	600509	天富热电	1,804,959	65,826,854.73	0.85%
38	600028	中国石化	2,799,899	65,601,633.57	0.85%
39	600058	五矿发展	1,483,459	65,539,218.62	0.85%
40	601398	工商银行	7,999,925	65,039,390.25	0.84%
41	600426	华鲁恒升	2,416,906	64,048,009.00	0.83%
42	000983	西山煤电	1,000,000	63,470,000.00	0.82%
43	600547	山东黄金	366,232	61,889,545.68	0.80%
44	000700	模塑科技	5,746,953	61,319,988.51	0.79%
45	600795	国电电力	3,500,000	61,040,000.00	0.79%
46	600087	南京水运	3,500,000	59,500,000.00	0.77%
47	600202	哈空调	2,670,529	58,751,638.00	0.76%
48	000837	秦川发展	3,408,450	57,023,368.50	0.74%
49	000338	潍柴动力	649,956	56,286,189.60	0.73%
50	600029	南方航空	1,999,975	55,879,301.50	0.72%



51	600048	保利地产	858,483	55,646,868.06	0.72%
52	600362	江西铜业	1,060,000	54,017,600.00	0.70%
53	600064	南京高科	1,605,000	52,515,600.00	0.68%
54	002054	德美化工	2,047,403	50,939,386.64	0.66%
55	600111	包钢稀土	1,000,000	48,780,000.00	0.63%
56	600104	上海汽车	1,847,876	48,580,660.04	0.63%
57	000800	一汽轿车	2,500,000	47,750,000.00	0.62%
58	600500	中化国际	2,149,937	47,470,608.96	0.61%
59	000024	招商地产	800,000	47,360,000.00	0.61%
60	600978	宜华木业	2,366,225	44,414,043.25	0.57%
61	000707	双环科技	3,042,716	41,380,937.60	0.54%
62	600015	华夏银行	2,127,090	40,755,044.40	0.53%
63	000418	小天鹅A	1,972,372	39,072,689.32	0.51%
64	000623	吉林敖东	550,000	37,042,500.00	0.48%
65	002170	芭田股份	1,099,729	36,862,916.08	0.48%
66	000612	焦作万方	700,000	31,381,000.00	0.41%
67	600098	广州控股	1,999,921	26,838,939.82	0.35%
68	000933	神火股份	500,000	26,160,000.00	0.34%
69	600641	万业企业	1,000,000	22,610,000.00	0.29%
70	600690	青岛海尔	999,920	22,458,203.20	0.29%
71	600439	瑞贝卡	450,000	22,401,000.00	0.29%
72	601866	中海集运	586,000	7,119,900.00	0.09%
73	601918	国投新集	445,632	7,094,461.44	0.09%
74	002183	怡亚通	41,376	3,225,259.20	0.04%
75	002194	武汉凡谷	49,001	2,543,641.91	0.03%
76	002185	华天科技	74,697	1,601,503.68	0.02%
77	002182	云海金属	50,956	1,423,201.08	0.02%
78	002187	广百股份	31,259	1,343,824.41	0.02%
79	002186	全聚德	18,259	1,077,828.77	0.01%
80	002180	万力达	26,500	911,335.00	0.01%
81	002179	中航光电	17,146	786,144.10	0.01%
82	002177	御银股份	10,305	700,740.00	0.01%



83	002193	山东如意	25,044	603,560.40	0.01%
84	002189	利达光电	33,210	488,187.00	0.01%
85	002188	新嘉联	20,180	433,062.80	0.01%
86	002190	成飞集成	19,598	414,693.68	0.01%
87	002184	海得控制	16,852	387,764.52	0.01%
88	002181	粤传媒	12,421	331,392.28	0.00%
89	002201	九鼎新材	10,176	324,309.12	0.00%
90	002196	方正电机	12,380	301,824.40	0.00%
91	002195	海隆软件	8,296	272,606.56	0.00%
92	002178	延华智能	10,994	255,060.80	0.00%
93	002199	东晶电子	500	12,750.00	0.00%

4、报告期内股票投资组合的重大变动

(1) 报告期内累计买入、卖出股票金额占期初基金资产净值比例超过2%的股票明细

累计买入金额占期初基金资产净值比例超过2%的股票明细				
序号	股票代码	股票名称	累计买入金额	占期初基金资产净值比
1	600030	中信证券	425,413,547.51	240.10%
2	000002	万科A	396,219,280.36	223.62%
3	601318	中国平安	374,649,774.14	211.45%
4	600036	招商银行	372,468,243.42	210.21%
5	600000	浦发银行	360,631,803.82	203.53%
6	601919	中国远洋	335,253,980.24	189.21%
7	601088	中国神华	245,920,240.20	138.79%
8	002097	山河智能	231,939,222.52	130.90%
9	600362	江西铜业	213,224,428.79	120.34%
10	000568	泸州老窖	212,790,154.73	120.09%
11	600031	三一重工	210,534,444.54	118.82%
12	600005	武钢股份	188,049,133.29	106.13%
13	601168	西部矿业	183,069,970.53	103.32%
14	601166	兴业银行	182,690,241.56	103.11%
15	601628	中国人寿	182,218,286.94	102.84%
16	000960	锡业股份	180,188,401.52	101.69%

17	000755	山西三维	167,985,592.12	94.81%
18	000061	农产品	159,600,241.33	90.08%
19	601939	建设银行	157,436,341.02	88.85%
20	600104	上海汽车	155,631,670.63	87.84%
21	600900	长江电力	153,704,406.03	86.75%
22	000006	深振业A	137,587,717.13	77.65%
23	600426	华鲁恒升	137,510,659.16	77.61%
24	601699	潞安环能	131,644,831.27	74.30%
25	000024	招商地产	130,828,472.67	73.84%
26	002024	苏宁电器	130,623,377.17	73.72%
27	601006	大秦铁路	130,374,134.61	73.58%
28	000825	太钢不锈	127,945,412.44	72.21%
29	000623	吉林敖东	123,926,444.85	69.94%
30	600015	华夏银行	122,851,375.90	69.34%
31	600978	宜华木业	122,776,849.35	69.29%
32	000612	焦作万方	121,988,050.77	68.85%
33	000088	盐田港	121,163,458.80	68.38%
34	601169	北京银行	120,902,257.16	68.23%
35	600028	中国石化	119,327,714.17	67.35%
36	000983	西山煤电	117,831,712.25	66.50%
37	600547	山东黄金	116,498,277.46	65.75%
38	600087	南京水运	116,013,901.05	65.48%
39	600048	保利地产	113,862,383.93	64.26%
40	000858	五粮液	112,803,427.45	63.66%
41	600309	烟台万华	110,260,699.36	62.23%
42	601857	中国石油	108,897,515.74	61.46%
43	600029	南方航空	104,491,294.09	58.97%
44	600690	青岛海尔	100,982,436.83	56.99%
45	000723	美锦能源	97,679,747.56	55.13%
46	600064	南京高科	95,180,610.44	53.72%
47	000800	一汽轿车	93,995,390.52	53.05%
48	600117	西宁特钢	92,346,694.66	52.12%



49	600111	包钢稀土	88,619,057.22	50.01%
50	600765	力源液压	87,478,438.26	49.37%
51	601398	工商银行	82,553,246.09	46.59%
52	600509	天富热电	81,992,893.12	46.28%
53	600058	五矿发展	81,161,037.02	45.81%
54	600500	中化国际	80,615,174.67	45.50%
55	600066	宇通客车	78,555,550.01	44.34%
56	600806	昆明机床	77,627,469.64	43.81%
57	600096	云天化	76,255,571.77	43.04%
58	600383	金地集团	75,925,263.60	42.85%
59	600612	中国铅笔	75,666,877.62	42.70%
60	000423	东阿阿胶	72,970,531.05	41.18%
61	000758	中色股份	72,861,155.05	41.12%
62	600357	承德钒钛	70,477,568.94	39.78%
63	000628	高新发展	69,872,594.47	39.43%
64	000046	泛海建设	69,774,939.97	39.38%
65	000761	本钢板材	69,688,834.20	39.33%
66	600016	民生银行	69,469,409.91	39.21%
67	601601	中国太保	69,160,797.80	39.03%
68	000718	苏宁环球	66,757,499.39	37.68%
69	600202	哈空调	64,691,973.45	36.51%
70	600795	国电电力	63,077,387.60	35.60%
71	600837	海通证券	61,287,892.96	34.59%
72	000700	模塑科技	61,255,978.21	34.57%
73	000159	国际实业	60,443,380.01	34.11%
74	600348	国阳新能	60,324,817.22	34.05%
75	000651	格力电器	59,943,490.24	33.83%
76	000402	金融街	58,233,358.32	32.87%
77	002078	太阳纸业	57,582,845.77	32.50%
78	000837	秦川发展	55,918,794.65	31.56%
79	000338	潍柴动力	53,143,537.70	29.99%
80	600508	上海能源	52,238,641.59	29.48%



81	600060	海信电器	51,427,761.59	29.02%
82	002054	德美化工	49,478,156.53	27.92%
83	600026	中海发展	49,101,135.78	27.71%
84	000001	深发展A	48,233,343.25	27.22%
85	600266	北京城建	45,801,641.60	25.85%
86	002120	新海股份	45,462,629.19	25.66%
87	600456	宝钛股份	45,031,782.55	25.42%
88	000708	大冶特钢	45,004,562.26	25.40%
89	600236	桂冠电力	43,935,972.85	24.80%
90	002116	中国海诚	43,176,912.81	24.37%
91	000767	漳泽电力	41,960,557.35	23.68%
92	000401	冀东水泥	41,332,002.36	23.33%
93	600616	第一食品	40,969,907.61	23.12%
94	000898	鞍钢股份	40,616,276.61	22.92%
95	000878	云南铜业	38,873,778.28	21.94%
96	600785	新华百货	37,835,056.87	21.35%
97	601808	中海油服	37,545,376.00	21.19%
98	600206	有研硅股	37,477,803.49	21.15%
99	000831	关铝股份	37,158,988.19	20.97%
100	000042	深 长 城	36,964,984.68	20.86%
101	000707	双环科技	35,934,470.21	20.28%
102	000528	柳 工	35,658,506.51	20.12%
103	000039	中集集团	35,552,612.03	20.07%
104	600887	伊利股份	34,716,574.75	19.59%
105	600631	百联股份	34,456,868.29	19.45%
106	600685	广船国际	33,742,469.42	19.04%
107	002170	芭田股份	33,594,139.01	18.96%
108	600675	中华企业	33,131,647.61	18.70%
109	600549	厦门钨业	33,104,711.30	18.68%
110	600308	华泰股份	32,957,198.54	18.60%
111	600230	沧州大化	32,281,967.06	18.22%
112	600007	中国国贸	31,602,049.04	17.84%

113	600970	中材国际	31,269,448.54	17.65%
114	000910	大亚科技	30,897,656.17	17.44%
115	002073	青岛软控	30,641,409.53	17.29%
116	000043	中航地产	30,276,038.94	17.09%
117	000823	超声电子	30,249,869.33	17.07%
118	601600	中国铝业	30,150,615.56	17.02%
119	000792	盐湖钾肥	29,993,207.56	16.93%
120	600122	宏图高科	29,444,761.33	16.62%
121	000836	鑫茂科技	29,310,253.91	16.54%
122	600269	赣粤高速	28,547,955.22	16.11%
123	601111	中国国航	28,428,807.00	16.04%
124	000562	宏源证券	27,779,512.51	15.68%
125	600331	宏达股份	27,645,538.40	15.60%
126	000418	小天鹅A	27,527,767.93	15.54%
127	000419	通程控股	27,521,901.74	15.53%
128	600361	华联综超	26,592,876.33	15.01%
129	002029	七匹狼	26,476,422.55	14.94%
130	600098	广州控股	26,358,651.30	14.88%
131	600641	万业企业	26,176,393.74	14.77%
132	600280	南京中商	26,071,077.15	14.71%
133	000726	鲁泰A	26,032,016.05	14.69%
134	600858	银座股份	25,838,450.41	14.58%
135	600009	上海机场	25,614,608.71	14.46%
136	600263	路桥建设	25,579,410.37	14.44%
137	600511	国药股份	25,511,254.82	14.40%
138	000828	东莞控股	25,260,512.80	14.26%
139	000933	神火股份	25,121,712.58	14.18%
140	000609	绵世股份	24,280,688.93	13.70%
141	600825	新华传媒	23,914,658.39	13.50%
142	000501	鄂武商A	22,995,006.93	12.98%
143	600055	万东医疗	22,631,848.67	12.77%
144	600008	首创股份	22,114,711.80	12.48%

145	600590	泰豪科技	21,848,307.04	12.33%
146	000597	东北制药	21,598,285.85	12.19%
147	600089	特变电工	21,591,424.27	12.19%
148	600019	宝钢股份	21,291,404.52	12.02%
149	600638	新黄浦	20,903,452.69	11.80%
150	000999	S 三 九	20,657,462.00	11.66%
151	000417	合肥百货	20,530,026.43	11.59%
152	600188	兖州煤业	20,504,644.88	11.57%
153	600183	生益科技	20,488,595.64	11.56%
154	600519	贵州茅台	20,374,406.71	11.50%
155	600069	银鸽投资	19,857,205.32	11.21%
156	600287	江苏舜天	19,843,518.83	11.20%
157	600011	华能国际	19,700,187.10	11.12%
158	000666	经纬纺机	19,467,943.14	10.99%
159	600761	安徽合力	19,247,901.97	10.86%
160	000932	华菱管线	19,091,122.80	10.77%
161	600740	山西焦化	18,971,987.01	10.71%
162	600282	南钢股份	18,950,188.50	10.70%
163	600635	大众公用	18,430,463.69	10.40%
164	000690	宝新能源	18,426,187.45	10.40%
165	000060	中金岭南	18,319,729.16	10.34%
166	000807	云铝股份	17,648,465.23	9.96%
167	600343	航天动力	17,578,651.56	9.92%
168	000952	广济药业	17,427,914.06	9.84%
169	600210	紫江企业	17,261,769.50	9.74%
170	000584	舒卡股份	17,024,978.21	9.61%
171	600240	华业地产	16,896,869.00	9.54%
172	002083	孚日股份	16,847,543.20	9.51%
173	600835	上海机电	16,797,510.42	9.48%
174	600001	邯郸钢铁	16,545,242.19	9.34%
175	600555	九龙山	16,035,536.75	9.05%
176	002092	中泰化学	15,461,632.50	8.73%



177	000598	蓝星清洗	15,266,206.85	8.62%
178	600583	海油工程	15,171,585.06	8.56%
179	600991	长丰汽车	15,112,801.30	8.53%
180	600085	同仁堂	14,704,331.85	8.30%
181	000900	现代投资	14,660,066.97	8.27%
182	600363	联创光电	14,520,893.00	8.20%
183	600378	天科股份	14,320,401.45	8.08%
184	600589	广东榕泰	14,040,958.87	7.92%
185	600655	豫园商城	13,730,391.92	7.75%
186	600216	浙江医药	13,721,832.77	7.74%
187	600679	金山开发	13,371,362.81	7.55%
188	600389	江山股份	13,193,738.19	7.45%
189	000422	湖北宜化	12,476,025.20	7.04%
190	000582	北海港	12,464,517.08	7.03%
191	600808	马钢股份	12,130,601.17	6.85%
192	600832	东方明珠	11,755,851.30	6.63%
193	000822	山东海化	11,706,492.13	6.61%
194	600517	置信电气	11,618,412.50	6.56%
195	600591	上海航空	11,403,925.98	6.44%
196	600366	宁波韵升	11,369,729.58	6.42%
197	600801	华新水泥	10,602,087.90	5.98%
198	600138	中青旅	10,060,605.64	5.68%
199	600021	上海电力	10,049,446.10	5.67%
200	600559	老白干酒	9,934,710.38	5.61%
201	600153	建发股份	9,827,431.00	5.55%
202	600686	金龙汽车	9,809,596.67	5.54%
203	600050	中国联通	9,640,000.00	5.44%
204	000629	攀钢钢钒	9,594,878.16	5.42%
205	600018	上港集团	9,431,854.50	5.32%
206	600300	维维股份	9,247,477.72	5.22%
207	000541	佛山照明	9,083,882.93	5.13%
208	000839	中信国安	8,945,143.16	5.05%



209	600197	伊力特	8,674,233.82	4.90%
210	600627	上电股份	8,640,251.72	4.88%
211	000400	许继电气	8,440,403.73	4.76%
212	000625	长安汽车	8,290,586.17	4.68%
213	600365	通葡股份	8,276,254.70	4.67%
214	600177	雅戈尔	8,014,965.51	4.52%
215	600798	宁波海运	7,980,899.06	4.50%
216	600123	兰花科创	7,847,029.48	4.43%
217	600600	青岛啤酒	7,801,383.30	4.40%
218	600535	天士力	7,640,358.06	4.31%
219	600713	南京医药	7,318,826.63	4.13%
220	600585	海螺水泥	7,255,832.16	4.10%
221	600037	歌华有线	7,182,173.00	4.05%
222	000063	中兴通讯	6,477,880.50	3.66%
223	601390	中国中铁	6,427,200.00	3.63%
224	000522	白云山A	6,415,552.16	3.62%
225	000717	韶钢松山	5,973,749.50	3.37%
226	600823	世茂股份	5,968,286.61	3.37%
227	600849	上海医药	5,718,576.31	3.23%
228	600162	香江控股	5,700,418.00	3.22%
229	002007	华兰生物	5,494,105.00	3.10%
230	600578	京能热电	5,490,433.22	3.10%
231	002082	栋梁新材	5,311,622.25	3.00%
232	600754	锦江股份	5,089,150.36	2.87%
233	600418	江淮汽车	4,695,882.00	2.65%
234	000069	华侨城A	4,627,130.00	2.61%
235	600720	祁连山	4,038,500.00	2.28%
236	600824	益民商业	4,032,672.00	2.28%
237	600584	长电科技	3,885,919.14	2.19%
238	601866	中海集运	3,879,320.00	2.19%
239	600320	振华港机	3,828,416.00	2.16%
240	000657	中钨高新	3,545,328.50	2.00%

累计卖出金额占期初基金资产净值比例超过 2% 的股票明细

序号	股票代码	股票名称	累计卖出金额	占期初基金资产净值比
1	000002	万 科A	268,338,113.96	151.45%
2	600030	中信证券	243,006,294.70	137.15%
3	600000	浦发银行	217,476,902.49	122.74%
4	601166	兴业银行	178,148,267.40	100.54%
5	601318	中国平安	163,191,066.49	92.10%
6	000061	农 产 品	145,066,687.87	81.87%
7	000858	五 粮 液	122,968,727.30	69.40%
8	600362	江西铜业	119,015,190.96	67.17%
9	600104	上海汽车	109,014,857.46	61.53%
10	601169	北京银行	106,732,133.81	60.24%
11	600426	华鲁恒升	98,017,579.13	55.32%
12	000960	锡业股份	93,142,728.77	52.57%
13	600015	华夏银行	89,881,248.31	50.73%
14	600383	金地集团	87,578,705.00	49.43%
15	000612	焦作万方	86,268,457.83	48.69%
16	600036	招商银行	85,032,911.02	47.99%
17	600690	青岛海尔	84,338,128.66	47.60%
18	600978	宜华木业	80,740,081.98	45.57%
19	600005	武钢股份	79,484,626.97	44.86%
20	000623	吉林敖东	75,946,846.97	42.86%
21	600016	民生银行	74,953,647.17	42.30%
22	000402	金 融 街	74,093,850.22	41.82%
23	600508	上海能源	67,119,768.84	37.88%
24	000651	格力电器	66,590,240.76	37.58%
25	601088	中国神华	65,466,466.97	36.95%
26	000628	高新发展	64,833,577.12	36.59%
27	600348	国阳新能	63,548,699.00	35.87%
28	600029	南方航空	61,676,460.39	34.81%
29	601628	中国人寿	60,325,012.39	34.05%
30	000024	招商地产	60,040,443.72	33.89%



31	600087	南京水运	58,967,093.94	33.28%
32	000878	云南铜业	58,634,194.55	33.09%
33	000001	深发展A	58,022,148.94	32.75%
34	000983	西山煤电	57,491,875.08	32.45%
35	000046	泛海建设	57,321,384.09	32.35%
36	000761	本钢板材	56,949,290.86	32.14%
37	000159	国际实业	56,023,976.58	31.62%
38	000708	大冶特钢	54,512,182.05	30.77%
39	600028	中国石化	53,847,268.26	30.39%
40	601857	中国石油	53,297,426.66	30.08%
41	000758	中色股份	52,780,014.24	29.79%
42	000718	苏宁环球	52,747,044.88	29.77%
43	002116	中国海诚	52,684,156.19	29.73%
44	600456	宝钛股份	52,315,212.93	29.53%
45	600060	海信电器	52,211,344.54	29.47%
46	600266	北京城建	52,195,530.29	29.46%
47	600837	海通证券	52,163,049.62	29.44%
48	600230	沧州大化	51,149,753.93	28.87%
49	600026	中海发展	49,807,228.38	28.11%
50	600547	山东黄金	48,456,341.74	27.35%
51	600309	烟台万华	46,860,929.52	26.45%
52	600048	保利地产	46,520,274.81	26.26%
53	000999	S 三 九	45,865,193.65	25.89%
54	600236	桂冠电力	44,939,783.47	25.36%
55	000898	鞍钢股份	42,651,011.56	24.07%
56	000401	冀东水泥	42,554,916.64	24.02%
57	600887	伊利股份	42,046,236.03	23.73%
58	601919	中国远洋	41,645,552.36	23.50%
59	002120	新海股份	41,246,894.17	23.28%
60	600031	三一重工	40,761,060.78	23.00%
61	600900	长江电力	40,555,741.79	22.89%
62	600675	中华企业	39,916,712.73	22.53%



63	600206	有研硅股	39,792,073.03	22.46%
64	600064	南京高科	38,368,870.19	21.65%
65	600685	广船国际	37,544,571.44	21.19%
66	000042	深 长 城	37,024,554.50	20.90%
67	600785	新华百货	36,399,337.47	20.54%
68	600616	第一食品	36,110,273.13	20.38%
69	000831	关铝股份	35,934,596.11	20.28%
70	000039	中集集团	35,873,627.55	20.25%
71	000767	漳泽电力	35,451,241.51	20.01%
72	000528	柳 工	34,509,541.59	19.48%
73	601600	中国铝业	34,301,300.56	19.36%
74	000006	深振业A	34,168,300.87	19.28%
75	000792	盐湖钾肥	33,594,127.04	18.96%
76	600549	厦门钨业	33,503,118.37	18.91%
77	600331	宏达股份	33,205,346.85	18.74%
78	600308	华泰股份	33,180,149.82	18.73%
79	600858	银座股份	32,622,953.75	18.41%
80	000910	大亚科技	32,562,066.15	18.38%
81	000755	山西三维	32,125,969.14	18.13%
82	000836	鑫茂科技	31,986,187.89	18.05%
83	000823	超声电子	31,459,302.73	17.76%
84	002073	青岛软控	31,453,232.36	17.75%
85	600280	南京中商	31,258,218.01	17.64%
86	000043	中航地产	31,104,724.75	17.55%
87	600111	包钢稀土	31,078,842.08	17.54%
88	601398	工商银行	31,007,475.96	17.50%
89	000828	东莞控股	30,822,302.40	17.40%
90	600631	百联股份	30,670,520.02	17.31%
91	600263	路桥建设	30,561,510.66	17.25%
92	600970	中材国际	30,527,552.99	17.23%
93	000609	绵世股份	30,390,515.66	17.15%
94	601808	中海油服	30,254,970.67	17.08%



95	600009	上海机场	29,728,635.22	16.78%
96	600509	天富热电	29,717,447.04	16.77%
97	600361	华联综超	29,201,547.30	16.48%
98	600269	赣粤高速	28,721,092.66	16.21%
99	600011	华能国际	27,892,434.01	15.74%
100	600007	中国国贸	27,280,285.05	15.40%
101	000597	东北制药	27,025,002.95	15.25%
102	002029	七匹狼	26,904,061.45	15.18%
103	000800	一汽轿车	26,894,207.02	15.18%
104	600019	宝钢股份	26,690,248.89	15.06%
105	600122	宏图高科	26,591,394.14	15.01%
106	000562	宏源证券	26,427,316.74	14.92%
107	601111	中国国航	26,277,933.77	14.83%
108	600825	新华传媒	25,891,518.65	14.61%
109	601006	大秦铁路	25,514,230.45	14.40%
110	000726	鲁泰A	24,651,011.40	13.91%
111	600835	上海机电	24,621,912.49	13.90%
112	000419	通程控股	24,354,705.68	13.75%
113	600500	中化国际	23,682,655.64	13.37%
114	601699	潞安环能	23,500,549.60	13.26%
115	600590	泰豪科技	23,365,951.80	13.19%
116	600089	特变电工	22,773,568.92	12.85%
117	600117	西宁特钢	22,735,724.20	12.83%
118	600069	银鸽投资	22,726,385.08	12.83%
119	600511	国药股份	22,577,781.48	12.74%
120	600761	安徽合力	22,428,428.02	12.66%
121	600055	万东医疗	22,030,381.13	12.43%
122	000501	鄂武商A	21,915,648.59	12.37%
123	600343	航天动力	21,776,104.18	12.29%
124	600765	力源液压	21,610,959.42	12.20%
125	000932	华菱管线	21,555,150.65	12.17%
126	600240	华业地产	21,197,486.30	11.96%



127	600638	新黄浦	20,604,685.52	11.63%
128	600183	生益科技	20,301,370.93	11.46%
129	002097	山河智能	20,272,322.74	11.44%
130	600740	山西焦化	20,196,182.61	11.40%
131	600519	贵州茅台	20,118,238.80	11.35%
132	000584	舒卡股份	19,958,816.21	11.26%
133	000060	中金岭南	19,907,825.85	11.24%
134	600001	邯郸钢铁	19,899,825.50	11.23%
135	600188	兖州煤业	19,862,897.88	11.21%
136	000568	泸州老窖	19,614,368.55	11.07%
137	000690	宝新能源	19,470,394.35	10.99%
138	000666	经纬纺机	19,106,042.75	10.78%
139	600282	南钢股份	18,840,987.01	10.63%
140	600555	九龙山	18,320,609.41	10.34%
141	000417	合肥百货	18,260,808.30	10.31%
142	000952	广济药业	18,227,376.86	10.29%
143	000900	现代投资	18,155,790.71	10.25%
144	600287	江苏舜天	17,917,296.79	10.11%
145	600635	大众公用	17,743,917.78	10.01%
146	600991	长丰汽车	17,538,036.97	9.90%
147	000807	云铝股份	17,241,572.48	9.73%
148	002083	孚日股份	15,920,683.05	8.99%
149	000700	模塑科技	15,774,373.95	8.90%
150	600363	联创光电	15,640,402.26	8.83%
151	002092	中泰化学	15,193,495.02	8.57%
152	600008	首创股份	15,121,582.99	8.53%
153	600378	天科股份	15,110,198.33	8.53%
154	600583	海油工程	14,860,222.51	8.39%
155	000598	蓝星清洗	14,227,874.11	8.03%
156	600085	同仁堂	14,168,739.96	8.00%
157	000839	中信国安	13,540,837.80	7.64%
158	600655	豫园商城	13,482,220.48	7.61%



159	600210	紫江企业	13,092,650.14	7.39%
160	000822	山东海化	13,067,486.92	7.38%
161	000063	中兴通讯	13,010,670.00	7.34%
162	600808	马钢股份	12,834,955.75	7.24%
163	600216	浙江医药	12,793,687.23	7.22%
164	600832	东方明珠	12,756,455.96	7.20%
165	600517	置信电气	12,515,725.00	7.06%
166	600389	江山股份	12,504,152.17	7.06%
167	600320	振华港机	11,824,073.18	6.67%
168	600058	五矿发展	11,416,637.00	6.44%
169	000978	桂林旅游	11,401,063.88	6.43%
170	600589	广东榕泰	11,298,843.07	6.38%
171	600679	金山开发	11,178,418.70	6.31%
172	600801	华新水泥	11,034,124.35	6.23%
173	600300	维维股份	10,890,901.01	6.15%
174	000582	北海港	10,781,170.76	6.08%
175	000625	长安汽车	10,710,699.18	6.04%
176	000723	美锦能源	10,561,161.13	5.96%
177	600823	世茂股份	10,268,884.42	5.80%
178	601390	中国中铁	10,244,684.10	5.78%
179	600591	上海航空	10,215,174.76	5.77%
180	000541	佛山照明	10,073,084.43	5.69%
181	600686	金龙汽车	10,017,505.19	5.65%
182	000422	湖北宜化	10,008,291.90	5.65%
183	000629	攀钢钢钒	9,926,534.08	5.60%
184	600021	上海电力	9,856,129.03	5.56%
185	600138	中青旅	9,843,945.48	5.56%
186	600559	老白干酒	9,802,253.45	5.53%
187	600365	通葡股份	9,658,558.01	5.45%
188	600366	宁波韵升	9,557,250.60	5.39%
189	600153	建发股份	9,436,534.30	5.33%
190	600798	宁波海运	9,397,248.60	5.30%



191	600018	上港集团	9,221,442.50	5.20%
192	600050	中国联通	9,022,648.52	5.09%
193	600177	雅戈尔	8,994,809.08	5.08%
194	600197	伊力特	8,825,871.89	4.98%
195	600713	南京医药	8,130,880.87	4.59%
196	600596	新安股份	8,027,255.50	4.53%
197	600600	青岛啤酒	8,008,257.79	4.52%
198	600627	上电股份	7,995,337.57	4.51%
199	600535	天士力	7,993,255.50	4.51%
200	000400	许继电气	7,885,086.28	4.45%
201	000423	东阿阿胶	7,835,459.46	4.42%
202	600585	海螺水泥	7,446,230.38	4.20%
203	600123	兰花科创	7,389,191.50	4.17%
204	600202	哈空调	7,336,339.80	4.14%
205	600578	京能热电	6,989,591.95	3.94%
206	000522	白云山A	6,930,294.90	3.91%
207	600849	上海医药	6,801,940.00	3.84%
208	600162	香江控股	6,551,432.80	3.70%
209	600066	宇通客车	6,398,725.41	3.61%
210	600037	歌华有线	6,327,693.51	3.57%
211	000717	韶钢松山	6,281,141.54	3.54%
212	000852	江钻股份	5,652,735.77	3.19%
213	002082	栋梁新材	5,552,885.40	3.13%
214	002007	华兰生物	5,450,000.00	3.08%
215	000418	小天鹅A	5,428,709.00	3.06%
216	600641	万业企业	5,374,749.19	3.03%
217	600754	锦江股份	5,313,282.38	3.00%
218	600824	益民商业	4,726,686.40	2.67%
219	000069	华侨城A	4,724,178.00	2.67%
220	600867	通化东宝	4,703,509.50	2.65%
221	600802	福建水泥	4,475,048.50	2.53%
222	600219	南山铝业	4,386,066.92	2.48%



223	600033	福建高速	4,199,715.75	2.37%
224	600418	江淮汽车	4,155,882.00	2.35%
225	600720	祁连山	3,936,548.52	2.22%
226	000657	中钨高新	3,894,278.72	2.20%
227	600639	浦东金桥	3,829,816.00	2.16%
228	600584	长电科技	3,662,702.78	2.07%

注：本报告期内，买入股票成本总额是以股票成交金额列示的，其中不包括股票交易费用（印花税、经手费、过户费和征管费）；卖出股票收入总额以股票成交金额列示的，其中包括股票交易费用（印花税、经手费、过户费和征管费）。

(2) 报告期内买入股票成本总额及卖出股票收入总额

单位：人民币元

买入股票成本总额	卖出股票收入总额
13,813,223,135.23	7,829,352,585.31

注：本报告期内，买入股票成本总额不包括股票交易费用（印花税、经手费、过户费和征管费）；卖出股票收入总额包括股票交易费用（印花税、经手费、过户费和征管费）。

5、 报告期末按券种分类的债券投资组合

券种	市值（人民币元）	市值占基金资产净值比例（%）
央行票据	351,752,000.00	4.55
金融债	150,015,000.00	1.94
可转债	13,975,292.90	0.18
合计	515,742,292.90	6.67

6、 报告期末按市值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券明细

债券名称	市值（人民币元）	市值占基金资产净值比例（%）
07 央行票据 84	193,080,000.00	2.50
07 央行票据 141	158,672,000.00	2.05
07 进出 13	99,840,000.00	1.29
07 国开 13	50,175,000.00	0.65
唐钢转债	13,975,292.90	0.18

7、 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没有被监管部门立案调查或在本报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情况。

2、报告期内本基金投资的前十名股票中没有在基金合同规定备选股票库之外的股票。

3、截至 2007 年 12 月 31 日，本基金的其他资产项目构成如下：

其他资产项目	金额（人民币元）
深圳交易所保证金	2,781,966.05
权证交收价差保证金	101,282.05
应收利息	4,107,337.81
应收申购款	34,167.92
买入返售证券	500,000,870.00
合计	507,025,623.83

4、截至 2007 年 12 月 31 日，本基金未持有处于转股期的可转债。

5、报告期内，本基金持有权证数量和成本列示如下：

权证代码	权证名称	权证数量	成本总额	获得途径
580003	邯钢 JTB1	630,000	1,594,814.80	主动持有
580005	万华 HXB1	199,517	6,813,065.86	主动持有
580007	长电 CWB1	847,000	5,567,639.20	主动持有
030002	五粮 YGC1	72,000	1,200,960.00	主动持有
031001	侨城 HQC1	100,000	4,661,964.40	主动持有

注：其中对自基金成立至 2007 年 6 月 30 日主动持有的权证成本总额进行了追溯调整，调整后的权证成本总额不包含交易费用。

6、截至 2007 年 12 月 31 日，本基金未持有权证投资。

7、截至 2007 年 12 月 31 日，本公司自有资金持有中海优质成长证券投资基金份额如下：

截止时间	基金份额（份）
2007 年 12 月 31 日	57,006,954.99



八、基金份额持有人户数、持有人结构

基金份额持有人户数	户均持有份额(份)	基金份额持有人份额结构			
		机构		个人	
		持有份额(份)	持有比例(%)	持有份额(份)	持有比例(%)
309,105	26,608.38	621,035,266.83	7.55	7,603,747,325.06	92.45

经本基金管理人统计，截至2007年12月31日，本公司员工持有本基金情况如下：

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(%)
基金管理公司持有本基金的所有从业人员	103,468.07	0.00126

九、开放式基金份额变动

项目	份额(份)
基金合同生效日基金份额总额	1,017,619,728.79
本报告期内基金份额变动情况：	
期初基金份额总额	161,068,732.94
加：本期总申购份额	6,821,552,296.93
本期基金拆分增加份额	2,204,854,835.80
减：本期总赎回份额	962,693,284.78
期末基金份额总额	8,224,782,580.89

十、重大事件揭示

1. 本报告期内未召开基金份额持有人大会。
2. 基金托管人交通银行于2007年10月19日公布了《交通银行股份有限公司关于基金托管行业高管人员变动的公告》，交通银行资产托管部原总经理阮红同志不再担任资产托管部总经理职务。目前暂由资产托管部谷娜莎副总经理主持资产托管部工作。

基金托管人交通银行于2007年12月21日公布了《交通银行股份有限公司关于谷娜莎基金托管行业高管任职资格的公告》，谷娜莎同志担任交通银行资产托管部总经理，主持资产托管部工作。

3. 基金管理人于 2007 年 3 月 24 日公布了聘任储晓明先生担任公司法定代表人以及公司原法定代表人华伟荣离任的公告并分别于 2007 年 7 月 30 日和 2007 年 7 月 31 日公布了聘任康伟先生担任公司总经理的公告以及公司原总经理雷建辉先生离任的公告。
4. 基金管理人于 2007 年 7 月 10 日公布了本基金变更基金经理的公告，本基金基金经理由彭焰宝变更为李涛。
5. 本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。
6. 本报告期内本基金的投资策略未有重大变化。
7. 本报告期内本基金进行了一次收益分配，每 10 份基金份额派发红利 0.80 元（暂免征收所得税），派发红利金额共计 13,475,064.76 元；

	权益登记日、除息日	红利发放日、红利再投资日	每 10 份基金份额分 红金额
本报告期第 1 次分红	2007 年 1 月 5 日	2007 年 1 月 8 日	0.80 元

8. 本基金聘请江苏公证会计师事务所提供审计服务，本报告期内支付会计师费 100,000.00 元，截至 2007 年 12 月 31 日暂未支付；本基金成立以来一直由该会计师事务所提供审计服务。
9. 报告期内本基金管理人、托管机构及其高级管理人员未受监察部门稽查或任何处罚。
10. 本基金租用席位由公司投资研究部门定期对券商的研究报告和相关服务质量进行综合评价，然后确定席位的租用。本基金租用证券公司专用交易席位情况如下：

券商名称	席位数量	股票成交金额（元）	比例（%）	佣金（元）	比例（%）
国联证券	1	3,875,245,966.62	18.04%	3,032,414.81	17.51%
申银万国	1	5,587,431,645.95	26.02%	4,581,672.41	26.46%
东吴证券	1	1,800,059,635.56	8.38%	1,475,948.21	8.52%
中金公司	1	3,302,162,573.27	15.37%	2,583,959.89	14.92%
银河证券	1	3,551,572,936.76	16.54%	2,912,266.95	16.82%
长城证券	1	2,739,987,875.08	12.76%	2,246,784.33	12.97%
中投证券	1	620,137,440.21	2.89%	485,216.78	2.80%
合计	7	21,476,598,073.45	100.00%	17,318,263.38	100.00%

券商名称	席位数量	债券成交金额（元）	比例（%）	权证成交金额（元）	比例（%）	回购成交金额（元）	比例（%）
国联证券	1	-	-	14,939,534.85	33.96%	-	-
申银万国	1	2,137,625.00	100.00%	18,507,539.43	42.07%	-	-
东吴证券	1	-	-	4,375,903.72	9.95%	196,000,000.00	100.00%

中金公司	1	-	-	-			
银河证券	1	-	-	6,171,186.12	14.02%		
长城证券	1	-	-	-			
中投证券	1	-	-	-		-	-
合计	7	2,137,625.00	100.00%	43,994,164.12	100.00%	196,000,000.00	100.00%

注：本报告期内新增了中金公司、长城证券和中投证券的交易席位；

上述佣金按市场佣金率计算，已扣除由中国证券登记结算有限责任公司收取，并由券商承担的证券结算风险基金后的净额列示。

11. 报告期基金披露过的其他重要事项：

公告事项	信息披露报纸	披露日期
中海优质成长证券投资基金 2006 年第 4 季度报告	中国证券报、证券时报	2007-1-19
关于中海旗下基金参与中信建投证券开放式基金网上交易费率优惠的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2007-2-2
中海基金管理有限公司增加天相投资顾问有限公司为开放式基金代销机构的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2007-2-12
中海基金管理有限公司关于旗下基金增加代销机构的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2007-3-20
中海基金管理有限公司关于变更法定代表人的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2007-3-24
中海优质成长证券投资基金 2006 年年度报告	中国证券报、证券时报	2007-3-30
中海优质成长证券投资基金 2007 年第 1 季度报告	中国证券报、证券时报	2007-4-19
关于中海基金管理有限公司旗下基金参与广发证券基金网上交易费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2007-4-23
中海优质成长证券投资基金更新招募说明书（2007 年第 1 号）	中国证券报、证券时报	2007-5-11
中海基金管理有限公司关于修改旗下基金申购费用及申购份额计算方法的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2007-5-18
中海基金管理有限公司关于变更中海优质成长证券投资基金业绩比较基准的公告	中国证券报、证券时报	2007-5-25
中海基金管理有限公司关于基金经理变更的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2007-7-10

中海优质成长证券投资基金 2007 年第 2 季度报告	中国证券报、证券时报	2007-7-20
中海基金管理有限公司关于总经理变更的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2007-7-30
中海基金管理有限公司关于总经理离任的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2007-7-31
关于中海基金管理有限公司旗下基金参与兴业证券基金网上交易费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2007-8-1
中海基金管理有限公司关于增加联合证券为旗下基金代销机构的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2007-8-6
中海基金管理有限公司关于开通旗下开放式基金转换业务的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2007-8-8
中海基金管理有限公司关于增加平安证券为旗下基金代销机构的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2007-8-9
中海基金管理有限公司关于旗下基金参与联合证券基金网上交易费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2007-8-20
中海优质成长证券投资基金 2007 年半年报摘要	中国证券报、证券时报	2007-8-29
中海优质成长证券投资基金 2007 年半年报全文	中海基金网站	2007-8-29
中海基金管理有限公司关于开通全国统一客户服务电话的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2007-8-30
中海基金管理有限公司关于新增安信证券和光大证券为旗下基金代销机构的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2007-9-14
中海基金管理有限公司关于调整旗下基金最低赎回份额及交易账户最低基金份额的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2007-9-28
中海基金管理有限公司关于旗下基金参与交通银行股份有限公司定期定额申购业务推广及费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2007-9-28
关于中海优质成长证券投资基金修改基金合同的公告	中国证券报、证券时报	2007-9-29
关于中海优质成长证券投资基金修改基金托管协议的公告	中国证券报、证券时报	2007-9-29
中海优质成长证券投资基金开展基金份额拆分及限量持续销售活动的公告	中国证券报、证券时报	2007-10-8

中海基金管理有限公司关于旗下基金参与国联证券基金网上交易费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2007-10-8
关于中海优质成长证券投资基金新增中国工商银行股份有限公司为代销机构的公告	中国证券报、证券时报	2007-10-9
关于中海优质成长证券投资基金参与中国工商银行股份有限公司网上银行基金申购费率优惠活动的公告	中国证券报、证券时报	2007-10-10
关于中海优质成长证券投资基金开展基金份额拆分及限量持续销售活动的提示性公告	中国证券报、证券时报	2007-10-12
中海基金管理有限公司关于旗下基金参与海通证券基金网上交易费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2007-10-16
中海优质成长证券投资基金拆分比例公告	中国证券报、证券时报	2007-10-22
中海优质成长证券投资基金暂停申购和转入业务的公告	中国证券报、证券时报	2007-10-22
中海优质成长证券投资基金更新招募说明书	中国证券报、证券时报	2007-11-9
中海基金管理有限公司关于旗下基金参与华泰证券基金网上交易费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2007-12-4
中海基金管理有限公司关于恢复中海优质成长证券投资基金申购和转入业务的公告	中国证券报、证券时报	2007-12-6
中海基金管理有限公司关于运用自有资金申购中海优质成长证券投资基金的公告	中国证券报、证券时报	2007-12-7
中海基金管理有限公司关于旗下基金参与湘财证券开放式基金网上交易费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2007-12-12
中海基金管理有限公司关于中海优质成长证券投资基金再次暂停申购及转入业务的公告	中国证券报、证券时报	2007-12-13
中海基金管理有限公司关于旗下基金参与银河证券基金网上交易费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2007-12-13
关于中海基金管理有限公司旗下基金投资非公开发行的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2007-12-26

十一、备查文件目录

- 1、中国证监会批准募集中海优质成长证券投资基金的文件
- 2、中海优质成长证券投资基金基金合同
- 3、中海优质成长证券投资基金托管协议
- 4、中国证监会批准国联基金管理有限公司更名为中海基金管理有限公司的文件
- 5、中海优质成长证券投资基金财务报表及报表附注
- 6、报告期内在指定报刊上披露的各项公告

查阅地点：上海市浦东新区陆家嘴东路 166 号中国保险大厦 34 层

投资者对本报告书如有疑问，可咨询本基金管理人中海基金管理有限公司。

咨询电话：(021)38789788 或 400-888-9788

公司网址：<http://www.zhfund.com>

中海基金管理有限公司
二〇〇八年三月二十八日