

招商银行（资产托管部）

招银资托核算字[2007]160号

招商证券现金牛集合资产管理计划

2007年2季度托管人报告

招商证券股份有限公司：

托管人声明：在本报告期（2007年4月1日至2007年6月30日）内，资产托管人一招商银行股份有限公司不存在任何损害招商证券现金牛集合资产管理计划利益的行为，严格遵守了《招商证券现金牛集合资产管理计划资产管理合同》、《招商证券现金牛集合资产管理计划资产托管协议》及各项法规的相关规定，完全尽职尽责地履行了应尽的义务。

一、本报告期末该资产管理计划主要财务指标

（会计期间：2007年4月1日-6月30日，财务数据未经审计，下同）

人民币：元

项目	金额
资产管理计划资产	5,099,434,142.21
资产管理计划负债	125,733,873.96
资产管理计划净值	4,973,700,268.25
7日年化平均收益率(%)	20.80

二、本报告期末资产管理计划投资组合

1、期末资产组合

单位：元

科目名称	成本	占比(%)
银行存款和清算备付金	3,430,954,689.85	67.28
股票投资	151,286,376.47	2.97
债券投资	836,850,332.11	16.41
基金投资	92,528,047.82	1.81
权证投资	14,594,167.70	0.29
其他资产	573,220,528.26	11.24
资产合计:	5,099,434,142.21	100.00

注：“其他资产”包括“交易保证金”、“应收股利”、“应收证券清算款”、“应收利息”等科目。

2、证券投资组合

单位：元

科目名称	成本	成本占净值(%)
股票投资	151,286,376.47	3.04
交易所国债	132,841,444.64	2.67
企业债券	147,982,921.66	2.98
可转换债券	43,288,000.00	0.87
资产证券化	512,737,965.81	10.31
货币基金	92,528,047.82	1.86
权证投资	14,594,167.70	0.29
合计:	1,095,258,924.10	22.02

3、证券投资前十名明细表

科目名称	成 本	成本占净值 (%)
20 国债 (4)	132,841,444.64	2.67
澜电 03	129,483,106.69	2.60
网通 05	98,516,423.54	1.98
网通 06	97,972,127.76	1.97
网通 07	97,569,359.88	1.96
泰信天天收益基金	90,965,431.14	1.83
04 国泰君安券	72,515,996.00	1.46
交通银行	63,141,856.00	1.27
中信银行	53,640,604.00	1.08
07 武钢债	50,332,832.30	1.01

特此报告。

