鸿飞证券投资基金 2006年年度报告摘要

基金管理人:宝盈基金管理有限公司　基金托管人:中国建设银行股份有限公司

重要提示

重要提示

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。

基金托管人中国建设银行股份有限公司(简称"中国建设银行")根据本基金合同规定,于2007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。

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。

本年度报告摘要摘自年度报告正文,投资者欲了解详细内容,应阅读年度报告正文。

第一节　基金简介

(一)基金名称:　鸿飞证券投资基金
基金简称:　基金鸿飞
交易代码:　194700
基金运作方式:　契约型封闭式
基金合同生效日:　2001年5月18日
报告期末基金份额总额:　5亿份
基金合同存续期:　至2008年4月14日
基金份额上市的证券交易所:　深圳证券交易所
上市日期:　2001年11月28日

(二)基金投资

投资目标:在严格控制投资风险的前提下,实现基金资产的稳定增长,为基金持有人谋求长期最佳收益。

投资策略:稳健规范,价值投资,发现并选择高成长的上市公司进行投资,通过公司业绩的高速增长实现投资收益,在对所投资公司合理定价的基础上,以积极策略决定买入和卖出时机。本基金选择的成长型企业主要有以下几类:属于朝阳行业的企业、国际竞争中具备比较优势的企业、国家产业政策重点扶持的企业、实现产业转型的企业、具备行业垄断或优势的龙头企业等;公司处于市场导入后期或高速增长期,主营业务前景较好,在可以预见的将来可以保持较高的增长速度,股本扩张能力较强;公司的经营发展将发生积极变化,而市场价格并未完全反映这种变化等。

风险收益特征:风险水平和期望收益相对较高。

(三)基金管理人

法定名称:　宝盈基金管理有限公司
信息披露负责人:　刘传葵
联系电话:　0755-83276688-5698
传真:　0755-83515622
电子邮箱:　liuck@byfunds.com

(四)基金托管人

法定名称:　中国建设银行股份有限公司
信息披露负责人:　尹　东
联系电话:　010-67595104
传真:　010—66275865
电子邮箱:　yindong@ccb.cn

(五)基金年度报告正文查阅方式

基金管理人互联网网址:http://www.byfunds.com

基金年度报告置备地点:基金管理人、基金托管人处

第二节　主要财务指标、基金净值表现及收益分配情况

(一)主要会计数据和财务指标

单位:人民币元

	主要会计数据和财务指标	2006年	2005年	2004年
1	基金本期净收益	265,062,817.29	-91,394,831.37	57,279,681.70
2	基金份额本期净收益	0.5301	-0.1828	0.1146
3	期末可供分配基金收益	178,617,893.28	-86,444,924.01	-5,224,322.25
4	期末可供分配基金份额收益	0.3572	-0.1729	-0.0104
5	期末基金资产净值	927,466,298.89	446,348,171.34	494,775,677.75
6	期末基金份额净值	1.8549	0.8927	0.9896
7	基金加权平均净值收益率	41.79%	-20.14%	10.97%
8	本期基金份额净值增长率	107.79%	-9.79%	-5.69%
9	基金份额累计净值增长率	83.92%	-11.49%	-1.88%

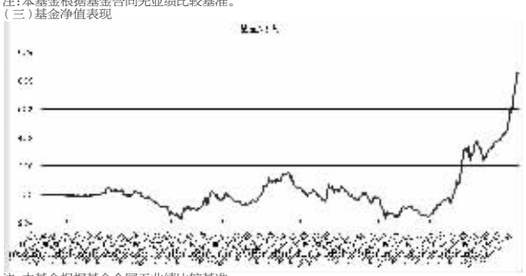
提示:上述基金业绩指标不包括份额持有人认购或交易基金的各项费用,计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

(二)同期业绩比较

阶段	净值增长率①	净值增长标准差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	35.15%	2.26%	-	-	-	-
过去6个月	37.29%	2.46%	-	-	-	-
过去一年	107.79%	2.92%	-	-	-	-
过去三年	76.77%	2.57%	-	-	-	-
自基金成立至今	83.92%	2.33%	-	-	-	-

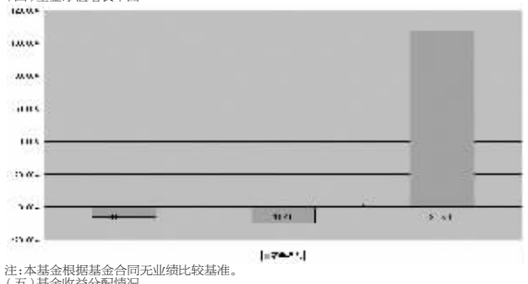
注:本基金根据基金合同无业绩比较基准。

(三)基金净值表现



注:本基金根据基金合同无业绩比较基准。

(四)基金净值增长率图



注:本基金根据基金合同无业绩比较基准。

(五)基金收益分配情况

单位:人民币元

年度	每10份基金份额分红数	备注
2006年	---	本期未分配收益
2005年	---	本期未分配收益
2004年	---	本期未分配收益
2003年	---	本期未分配收益
2002年	---	本期未分配收益
合计	---	

第三节　管理人报告

(一)基金管理人及基金经理简介

基金管理人:宝盈基金管理有限公司是2001年按照证监会"新的治理结构、新的内控体系"标准设立的首批基金管理公司之一,2001年5月18日成立,注册资本为人民币1亿元,注册地在深圳。公司目前管理两只封闭式基金(基金鸿飞、基金鸿阳)和两只开放式基金(宝盈鸿利收益证券投资基金、宝盈泛沿海区域增长股票证券投资基金),公司恪守价值投资的投资理念,并逐渐形成了稳健、规范的投资风格。公司拥有一支经验丰富的投资管理团队,在研究方面,公司汇聚着一批从事宏观经济、行业、上市公司、债券和金融工程研究的专业人才,为公司的投资决策提供科学的研究支持;在投资方面,公司的基金经理都具有丰富的证券市场投资经验,并有着良好的过往业绩,他们以自己专业知识使基金业绩不断提高,努力为投资者创造丰厚的回报。

基金经理:欧阳东华先生,43岁,工学硕士,9年证券、基金从业经历。曾在深圳蓝天基金管理公司从事证券研究工作,2002年5月加入宝盈基金管理有限公司从事行业研究工作。

(二)本报告期内基金运作的遵规守信情况

在本报告期内,本基金管理人严格遵守了《中华人民共和国证券投资基金法》及各项配套法规、《鸿飞证券投资基金基金合同》和其他有关法律法规的规定,并本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产,在严格控制风险的基础上,为基金持有人谋求最大利益。无损害基金持有人利益的行为。基金投资范围、投资比例、投资组合符合有关法规及基金合同的规定。

(三)本报告期内基金的投资策略和业绩表现

2006年证券市场与投资管理回顾:

虽然在2006年经历了加息和准备金率上调等较温和的宏观调控措施,但全年投资增幅依然高企、消费增长快速、在人民币不断升值的情况下出口竞争力依然较强,外贸顺差持续加大——2006年我国宏观经济继续保持了高速增长的态势。

一方面宏观经济持续向好,另一方面股权分置改革已基本完成,在这两方面的因素共同作用下,2006年A股市场走出了一波波澜壮阔的上升行情。具体而言,此轮牛市的推动因素是从股改除权效应开始的价值回归,到以消费升级、制造升级和人民币升值、资产升值为主题的价值发现,再到全流通条件下、公司主体对股票市场认识变化导致的以整体上市为主要内容的价值创造。与此同时,资本市场在中国经济运行和人民日常生活中所起到的作用是越来越重要,投资者队伍的不断扩大为股市带来了充裕的流动性资金,投资者信心不断增强。

总体来说,2006年我们坚持了价值判断原则,在行业和个股方面做出了相对正确的选择。具体来说,本基金2006年的配置是:长期持有具备长期增长能力的消费、金融等行业的重点股票;阶段性地持有了某些行业板块的重点股票,其中上半年主要是有色金属行业、房地产行业及电子科技板块,下半年主要是金融和地产板块。

虽然我们在2006年的投资取得了相对较好的成绩,但也有遗憾,如对军工等主题性投资机会参与较少,基本没有分享到军工概念所带来的回报

(四)2007年的宏观经济和市场前景展望

我们对2007年的股票市场仍然抱以乐观的预期。因为影响中国经济这一轮上升周期的因素并没有消失。

从宏观经济的角度看,我国经济在调控之后仍呈现良性发展的态势,消费和出口保持了良好的增长势头,投资增长仍处高位,2007年GDP增速有望保持在9%以上。而政府的宏观调控也较温和,显示出政府也不希望经济出现大的波动,国际经济环境依然良好。

从自下而上的研究看,相当一部分上市公司的利润仍保持在较高水平上,企业盈利将为股市提供上升动力。税制改革、股权激励、优质新股的加入等因素也将成为上市企业盈利增长的额外惊喜。充裕的流动性甚至过剩的状况将不断提高A股的流动性溢价。充裕的流动性既来自外汇储备增加所导致的货币被动投放,更来源于储蓄向股票市场的转移,而且将是未来几年时间的一种常态。充裕的流动性加上充沛的信心,成为股市上涨的强大驱动因素。

但是,我们同时也要意识到市场存在一定的负面因素。首先,2007年"小非"不小、"大非"减持也将逐渐增加,其释出将考验市场承受能力。其次,全流通后的市场格局已由原来的机构间博弈转化为中小股东与大股东之间的博弈,在市场监管尚不完善的我国,中小股东的投资风险有可能上升;此外,宏观调控依然会影响到股票市场的运行;经过2006年的大幅上涨,许多A股已经不便宜。

因此,2007年本基金的投资策略将由前期的进攻型投资策略逐步转化攻防结合的投资策略,即谋求行业间的均衡配置,仅对少数重点优势行业进行集中超额配置,并不断根据经济、市场状况进行动态调整。行业选择上本基金继续看好:扩大内需相关的消费服务类行业,包括金融、地产、食品饮料、医药、旅游和信息传媒行业;"十一五规划"中相关的装备制造业以及具备领先优势的制造业。在个股选择上,坚持自下而上的重点研究,强调公司的核心竞争优势和持续增长能力。

(五)内部监察报告

本报告期,公司监察稽核部门通过加强对基金投资交易业务的日常交易监控、交易流程检查、注册登记、客户服务等业务进行日常跟踪检查等工作,不断加强和完善对投资交易的事前、事中和事后控制,并定期出具专项监察报告及合规性报告等,对基金投资运作的合规性情况等进行总结和报告。

通过以上工作,在本报告期内本基金运作过程中未发生关联交易、内幕交易,也不存在本基金管理人管理的各基金之间的违规交叉交易,基金运作整体合法合规。

本基金管理人将继续坚持一贯的内部控制理念,提高内部监察稽核工作的科学性和有效性,努力防范和控制各种风险,充分保障基金持有人的合法权益。

第四节　托管人报告

中国建设银行股份有限公司根据《鸿飞证券投资基金基金合同》和《鸿飞证券投资基金托管协议》,托管鸿飞证券投资基金(以下简称基金鸿飞)。

本报告期,中国建设银行股份有限公司在基金鸿飞的托管过程中,严格遵守了《证券投资基金法》、基金合同、托管协议和其他有关规定,依法安全保管了基金财产,按规定如实、独立地向中国证监会提交了本基金运作情况报告,不存在损害基金份额持有人利益的行为,完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

本报告期,按照国家有关规定、基金合同、托管协议和其他有关规定,本托管人对基金管理人-宝盈基金管理有限公司在基金鸿飞投资运作方面进行了监督,对基金资产净值计算、基金费用开支等方面进行了认真的复核,发现个别监督指标不符合基金合同约定并及时通知了基金管理人。基金管理人在合理期限内进行了调整,对基金份额持有人利益未造成损害。

由基金鸿飞管理人-宝盈基金管理有限公司编制、并经本托管人复核审查的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真实、准确和完整。

第五节　审计报告

本基金2006年年度财务会计报告经普华永道中天会计师事务所有限公司审计,注册会计师签字出具了普华永道中天审字(2007)第20300号"标准无保留意见的审计报告"。

第六节　财务会计报告

(一)会计报表

鸿飞证券投资基金

2006年12月31日资产负债表

单位:人民币元

资产		2006年12月31日	2005年12月31日
银行存款		125,775,937.14	27,074,383.02
清算备付金		1,681,966.95	1,087,895.57
交易保证金		140,741.00	140,741.00
应收证券清算款		-	3,369,446.68
应收利息		2,030,590.94	1,243,075.62
股票投资市值		678,474,536.90	322,799,028.50
其中:股票投资成本		451,407,061.86	290,146,907.76
债券投资市值		195,598,796.95	93,105,498.10
其中:债券投资成本		194,452,639.46	92,964,523.49
权证投资		27,254,764.97	-
其中:权证投资成本		6,619,991.89	-
资产总计		1,030,957,334.85	448,820,068.49
负债及持有人权益			
负债			
应付证券清算款		5,196,825.69	-
应付管理人报酬		1,081,043.97	544,101.36
应付托管费		180,173.99	90,683.55
应付佣金		799,124.88	360,501.06
应付利息		4,807.00	-
其他应付款		867,060.43	1,116,611.18
卖出回购证券款		95,000,000.00	-
预提费用		362,000.00	360,000.00
负债合计		103,491,035.96	2,471,897.15
持有人权益			
实收基金		500,000,000.00	500,000,000.00
未实现利得		248,848,405.61	32,793,095.35
未分配收益		178,617,893.28	-86,444,924.01
持有人权益合计		927,466,298.89	446,348,171.34
(2006年末基金份额净值:1.8549元)			
(2005年末基金份额净值:0.8927元)			
负债及持有人权益总计		1,030,957,334.85	448,820,068.49

后附会计报表附注为本会计报表的组成部分。

鸿飞证券投资基金

2006年度经营业绩表及利润分配表

单位:人民币元

		2006年度	2005年度
收入			
股票差价收入		247,303,022.14	-94,054,037.79
债券差价收入		30,130.31	-1,861,893.29
权证差价收入		17,588,256.98	2,851,102.37
债券利息收入		3,978,036.06	3,005,367.30
存款利息收入		534,177.45	267,759.92
股利收入		7,782,604.15	6,924,949.34
买入返售证券收入		-	39,743.00
其他收入		-	8,113.46
收入合计		277,216,227.09	-82,818,895.69
费用			
基金管理人报酬		9,400,390.32	6,828,650.48
基金托管费		1,566,731.74	1,138,108.36
卖出回购证券支出		720,652.37	160,114.96
其他费用		465,635.37	449,061.88
其中:上市年费		60,000.00	60,000.00
信息披露费		300,000.00	300,000.00
审计费用		62,000.00	60,000.00
费用合计		12,153,409.80	8,575,935.68
基金净收益		265,062,817.29	-91,394,831.37
加:未实现利得		216,055,310.26	42,967,324.96
基金经营业绩		481,118,127.55	-48,427,506.41
本期基金净收益		265,062,817.29	-91,394,831.37
加:期初基金净收益		-86,444,924.01	4,949,907.36
可供分配基金净收益		178,617,893.28	-86,444,924.01
减:本期已分配基金净收益			-
期末基金净收益		178,617,893.28	-86,444,924.01

后附会计报表附注为本会计报表的组成部分。

鸿飞证券投资基金

2006年度基金净值变动表

单位:人民币元

		2006年度	2005年度
期初基金净值		446,348,171.34	494,775,677.75
本期经营活动			
基金净收益		265,062,817.29	-91,394,831.37
未实现利得		216,055,310.26	42,967,324.96
经营活动产生的基金净值变动数		481,118,127.55	-48,427,506.41
本期向基金持有人分配收益			
向基金持有人分配收益产生的基金净值变动数		-	-
期末基金净值		927,466,298.89	446,348,171.34

后附会计报表附注为本会计报表的组成部分。

(二)会计报表附注

1　本基金年度会计报表所采用的会计政策、会计估计除以下变更外,与上年度会计报表相一致。

(a) 基金资产的估值原则

权证投资:从获赠确认日、买入或交日或因认购新发行分离交易可转债而取得的权证从实际取得日起到卖出日或行权日止,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;未上市交易的权证投资(包括配股权证)按公允价值估值。

(b) 证券投资基金成本计价方法

(i)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;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。认购新发行的分离交易可转债于成交日先按支付的全部价款确认为债券投资,后于权证实际取得日按权证投资的成本计价方法单独核算权证成本,并相应调整债券投资成本。

买入贴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摊算内含票面利率后,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;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。出售债券的成本按移动加权平均法结转。

(ii)权证投资:获赠权证(包括配股权证)在确认日,按持有的股数及获赠比例计算并记录增加的权证数量;买入权证于成交日确认为权证投资,相应成本按成交日应支付的全部价款入账;因认购新发行的分离交易可转债而取得的权证在实际取得日,按权证公允价值占分离交易可转债全部公允价值的比例将购买分离交易可转债实际支付全部价款的一部分确认为权证成本。

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

2　本报告期无重大会计差错的内容和更正金额。

3　主要税项

根据财政部、国家税务总局财税[1998]55号《关于证券投资基金税收问题的通知》、财税[2004]78号《关于证券投资基金税收政策的通知》、财税[2005]11号《关于调整证券(股票)交易印花税税率的通知》、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》及其他相关税务法规和实务操作,主要税项列示如下:

(a) 以发行基金方式募集资金,不属于营业税征收范围,不征收营业税。

(b) 基金买卖股票、债券的差价收入,暂免征营业税和企业所得税。

(c) 对基金取得的企业债券利息收入,由发行债券的企业在向基金派发利息时代扣代缴20%的个人所得税,暂不征收企业所得税。对基金取得的股票的股息、红利收入,自2005年6月13日起由上市公司在向基金派发股息、红利时暂减按50%(此前按100%)计入个人应纳税所得额,依照现行税法规定即20%代扣代缴个人所得税,暂不征收企业所得税。

(d) 基金买卖股票于2005年1月24日前按照0.2%的税率缴纳股票交易印花税,自2005年1月24日起减按0.1%的税率缴纳。

(e) 基金作为流通股股东在股权分置改革过程中收到由非流通股股东支付的股份、现金等对价,暂免征收印花税、企业所得税和个人所得税。

4　重大关联方关系及关联交易

(a) 关联方

关联方名称	与本基金的关系
宝盈基金管理有限公司	基金发起人、基金管理人
中国建设银行股份有限公司("中国建设银行")	基金托管人
中国对外经济贸易信托投资有限公司	基金发起人、基金管理人的股东
衡平信托投资有限责任公司	基金管理人的股东
成都工业投资经营有限责任公司	基金管理人的股东
联合证券有限责任公司("联合证券")	基金发起人
重庆国际信托投资有限公司	基金发起人
天津信托投资有限责任公司	基金发起人
山东省国际信托投资有限公司	基金发起人

下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

(b) 通过关联方席位进行的证券交易及交易佣金

	2006年度	
	成交量	占本年成交量的比例
联合证券:		
买卖股票	229,932,214.54	8.98%
买卖债券	13,521,437.60	10.61%
买卖权证	10,331,690.78	23.32%
	佣金	占本年佣金总量的比例
联合证券	187,660.72	9.14%
	2005年度	
	成交量	占本年成交量的比例
联合证券:		
买卖股票	200,386,930.73	20.09%
买卖债券	41,484,536.10	26.70%
买卖权证	2,434,303.26	85.37%
	佣金	占本年佣金总量的比例
联合证券	160,554.35	20.31%

上述佣金按市场佣金率计算,以扣除由中国证券登记结算有限责任公司收取证管费、经手费和开由券商承担的证券结算风险基金后的净额列示。债券及权证交易不计佣金。

该类佣金协议的服务范围还包括佣金收取方为本基金提供的证券投资研究成果和市场信息服务。

(c) 基金管理人报酬

支付基金管理人宝盈基金管理有限公司的基金管理人报酬按前一日基金资产净值1.5%的年费率计提,逐日累计至每月月底,按月支付。其计算公式为:日基金管理人报酬=前一日基金资产净值X 1.5%/当年天数。

本基金在本年度需支付基金管理人报酬9,400,390.32元(2005年:6,828,650.48元)。

(d) 基金托管费

支付基金托管人中国建设银行的基金托管费按前一日基金资产净值0.25%的年费率计提,逐日累计至每月月底,按月支付。其计算公式为:

日基金托管费=前一日基金资产净值×0.25%/当年天数。

本基金在本年度需支付基金托管费1,566,731.74元(2005年:1,138,108.36元)。

(e)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中国建设银行保管,并按银行同同业利率计息。基金托管人于2006年12月31日保管的银行存款余额为125,775,937.14元(2005年:27,074,383.02元)。本年度由基金托管人保管的银行存款产生的利息收入为505,043.80元(2005年:223,018.01元)。

(f) 与关联方通过银行间同业市场进行的债券交易

本基金在本年度与基金托管人中国建设银行通过银行间同业市场进行的债券交易如下:

	2006年度	2005年度
卖出回购证券协议金额	400,000,000.00	20,000,000.00
卖出回购证券利息支出	200,090.69	4,210.96

(g) 基金管理公司及其股东持有的基金份额

	2006年12月31日		2005年12月31日	
	基金份额	净值	基金份额	净值
宝盈基金管理有限公司	6,250,000	11,593,125.00	6,250,000	5,579,375.00
中国对外经济贸易信托投资有限公司	375,000	695,587.50	375,000	334,762.50

5　流通受限制不能自由转让的基金资产

(a) 流通受限制不能自由转让的股票

(1) 本基金截至2006年12月31日止持有以下因股权分置改革而暂时停牌的股票,这些股票将在股权分置改革规定的程序结束后复牌。

股票代码	股票名称	停牌日期	年末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量	年末成本总额	年末估值总额	估值方法
方案实施阶段停牌:									
600258	S首旅	06/12/21	18.88	07/01/18	18.80	800,000	11,654,523.32	15,104,000.00	停牌前市价

(2) 基金可使用以基金名义开设的股票账户,比照个人投资者和一般法人、战略投资者参与新股认购。其中基金作为一般法人或战略投资者认购的新股,根据基金与上市公司所签订申购协议的规定,在新股上市后的约定期限内不能自由转让;基金作为个人投资者参与网上认购获配的新股或增发新股,从新股获配日至新股上市日之间不能自由转让。

本基金截至2006年12月31日止投资的流通受限制的股票情况如下:

股票代码	股票名称	成功申购日期	可流通日期	申购价格	期末估值单价	数量	期末成本总额	期末估值总额	估值方法
601006	大秦铁路	06/07/26	07/02/01	4.95	8.09	177,600	879,120.00	1,436,784.00	市价估值
601398	工商银行	06/10/23	07/01/29	3.12	6.03	2,704,056	8,436,654.72	16,305,457.68	市价估值
601628	中国人寿	06/12/28	07/04/09	18.88	18.88	180,810	3,413,692.80	3,413,692.80	市价估值
002080	中材科技	06/11/07	07/02/26	8.98	19.52	50,455	453,085.90	984,881.60	市价估值
002082	栋梁新材	06/11/07	07/02/26	6.36	12.43	64,597	410,836.92	802,940.71	市价估值
002084	海鸥卫浴	06/11/14	07/02/26	8.03	22.42	71,104	570,965.12	1,594,151.68	市价估值
002088	鲁阳股份	06/11/21	07/02/28	11.00	26.95	38,917	428,087.00	1,048,813.15	市价估值
002093	国脉科技	06/12/06	07/03/15	10.10	20.27	25,125	253,762.50	509,283.75	市价估值
002094	青岛金王	06/12/06	07/03/15	7.69	11.90	55,377	425,849.13	658,986.30	市价估值
002095	网盛科技	06/12/06	07/03/15	14.09	55.84	17,772	250,407.48	992,388.48	市价估值
002096	南岭民爆	06/12/13	07/03/22	9.38	15.12	51,783	485,724.54	782,958.96	市价估值
002097	山河智能	06/12/11	07/03/22	10.00	32.57	51,885	518,850.00	1,689,894.45	市价估值
002100	天康生物	06/12/13	07/03/26	10.86	18.96	40,410	438,852.60	766,173.60	市价估值
002102	冠福家用	06/12/20	07/03/29	5.96	10.85	58,384	347,968.64	633,466.40	市价估值
002106	莱宝高科	06/12/28	07/01/12	20.00	20.00	9,500	190,000.00	190,000.00	成本估值
合计							17,503,857.35	31,809,873.56	

(b) 流通受限制不能自由转让的债券

本基金截至2006年12月31日止从事证券交易所债券回购交易形成的卖出回购证券款余额95,000,000.00元(2005年:无),于2007年1月4日到期。该类交易要求本基金在回购期内持有的证券交易所交易的债券,按证券交易所规定的比例折算为标准券后,不低于债券回购交易的余额。

第七节　投资组合报告

(一)基金资产组合情况

项目名称	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
银行存款和清算备付金	127,457,904.09	12.36
股票	678,474,536.90	65.81
债券	195,598,796.95	18.97
权证	27,254,764.97	2.64
其他资产	2,171,331.94	0.22
合计	1,030,957,334.85	100.00

(二)按行业分类的股票投资组合

序号	分类	市值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	A 农、林、牧、渔业	-	-
2	B 采掘业	-	-
3	C 制造业	380,244,062.19	41.00
	C0 食品、饮料	58,910,599.50	6.35
	C1 纺织、服装、皮毛	-	-
	C2 木材、家具	-	-
	C3 造纸、印刷	26,719,398.80	2.88
	C4 石油、化学、塑胶、塑料	46,444,911.06	5.01
	C5 电子	13,331,301.52	1.44
	C6 金属、非金属	135,211,424.61	14.58
	C7 机械、设备、仪表	79,211,804.37	8.54
	C8 医药、生物制品	16,721,136.03	1.80
	C99 其他制造业	3,693,486.30	0.40
4	D 电力、煤气及水的生产和供应业	9,652,500.00	1.04
5	E 建筑业	-	-
6	F 交通运输、仓储业	27,945,197.86	3.01
7	G 信息技术业	62,485,187.99	6.74
8	H 批发和零售贸易	13,752,920.84	1.48
9	I 金融、保险业	84,317,322.57	9.09
10	J 房地产业	40,478,100.89	4.36
11	K 社会服务业	35,220,561.08	3.80
12	L 传播与文化产业	24,378,683.48	2.63
13	M 综合类	-	-
	合计	678,474,536.90	73.15

(三)基金投资前十名股票明细

序号	股票代码	股票名称	数　量(股)	期末市值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	000951	中国重汽	2,659,433	65,847,561.08	7.10
2	600050	中国联通	10,049,252	46,930,006.84	5.06
3	000858	五 粮 液	1,939,647	44,068,779.84	4.75
4	600036	招商银行	2,300,033	37,329,535.59	4.02
5	000039	中集集团	2,003,265	37,320,826.95	4.02
6	000898	鞍钢股份	3,599,861	36,070,607.22	3.89
7	600030	中信证券	999,950	27,268,636.50	2.94
8	600308	华泰股份	1,999,955	26,719,398.80	2.88
9	600037	歌华有线	999,946	24,378,683.48	2.63
10	600111	稀土高科	2,000,157	22,701,781.95	2.45

注:投资者欲了解本报告期末基金投资的所有股票明细,应阅读登载于宝盈基金管理有限公司http://www.byfunds.com网站的年度报告正文。

(四)股票投资组合的重大变动

1、累计买入金额超过期初净值2%的股票明细

序号	股票代码	股票名称	累计买入金额(元)	占期初资产净值比例(%)
1	000898	鞍钢股份	50,132,562.41	11.23
2	600050	中国联通	45,486,268.51	10.19
3	000858	五 粮 液	38,951,415.98	8.73
4	600028	中国石化	38,143,260.32	8.55
5	000951	中国重汽	35,599,108.24	7.98
6	000089	深圳机场	31,259,012.13	7.00
7	600111	稀土高科	30,238,100.39	6.77
8	000039	中集集团	26,816,959.91	6.01
9	000400	许继电气	24,730,302.76	5.54
10	000709	唐钢股份	23,829,629.26	5.34
11	600017	日照港	21,536,084.30	4.82
12	600330	天通股份	19,814,031.15	4.44
13	000060	中金岭南	19,768,322.98	4.43
14	600808	马钢股份	19,606,241.88	4.39
15	000792	盐湖钾肥	19,191,414.37	4.30
16	000031	中粮地产	19,069,634.77	4.27
17	600001	邯郸钢铁	18,107,037.56	4.06
18	600030	中信证券	17,336,519.24	3.88
19	600547	山东黄金	17,166,745.45	3.85
20	600195	中牧股份	17,153,586.30	3.84
21	600308	华泰股份	16,943,726.93	3.80
22	002039	黔源电力	16,134,722.80	3.61
23	600557	康缘药业	15,812,998.34	3.54
24	600037	歌华有线	15,467,664.19	3.47
25	600426	华鲁恒升	15,325,128.95	3.43
26	600584	长电科技	15,213,373.51	3.41
27	000807	云铝股份	14,439,256.10	3.23
28	002082	栋梁新材	14,317,948.26	3.21
29	600258	S首旅	13,982,820.28	3.13
30	000630	铜都铜业	13,982,305.69	3.13
31	600219	南山铝业	13,695,310.18	3.07
32	600010	包钢股份	13,217,221.99	2.96
33	600269	赣粤高速	12,988,190.24	2.91
34	600015	华夏银行	12,961,777.98	2.90
35	600362	江西铜业	12,707,852.91	2.85
36	000960	锡业股份	12,025,971.22	2.69
37	000063	中兴通讯	11,527,984.88	2.58
38	600433	冠豪高新	11,499,642.44	2.58
39	000629	新 钢 钒	11,313,082.83	2.53
40	601398	工商银行	11,219,694.72	2.51
41	600596	新安股份	11,050,385.53	2.48
42	600761	安徽合力	10,995,287.31	2.46
43	000932	华菱管线	10,125,492.79	2.27
44	600628	新世界	9,972,097.87	2.23
45	600009	上海机场	9,769,529.33	2.19
46	000617	S 济　柴	9,726,603.86	2.18
47	002024	苏宁电器	9,706,618.08	2.17
48	600309	烟台万华	9,431,102.63	2.11
49	600616	第一食品	9,298,367.50	2.08
50	000725	京东方 A	8,965,672.46	2.01
51	600123	兰花科创	8,956,032.34	2.01

2、累计卖出金额超过期初净值2%的股票明细

序号	股票代码	股票名称	累计卖出金额(元)	占期初资产净值比例(%)
1	600028	中国石化	63,775,439.74	14.29
2	000630	铜都铜业	34,494,553.07	7.73
3	600183	生益科技	34,274,983.71	7.68
4	600616	第一食品	34,185,246.63	7.66
5	600547	山东黄金	31,350,106.96	7.02
6	000709	唐钢股份	30,257,981.84	6.78
7	000060	中