鸿阳证券投资基金 2007年半年度报告摘要

基金管理人:宝盈基金管理有限公司　　基金托管人:中国农业银行

第一节 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。本半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。

基金托管人中国农业银行根据本基金合同规定,于2007年8月23日复核了本报告中的财务指标、净值表现、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。

本报告财务数据未经审计。

本半年度报告摘要摘自半年度报告正文,投资者欲了解详细内容,应阅读半年度报告正文。

第二节 基金简介

(一)基金名称:鸿阳证券投资基金

基金简称:基金鸿阳

交易代码:184728

基金运作方式:契约型封闭式、平衡型基金

基金合同生效日:2001年12月10日

报告期末基金份额总额:20亿

基金合同存续期:15年

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12月18日

(二)基金投资

投资目标:本基金主要投资于业绩能够持续高速增长的成长型上市公司和业绩优良而稳定的价值型上市公司,利用成长型和价值型两种投资方法的复合效果更好地分散和控制风险,在保持基金资产良好的流动性的基础上,实现基金资产的稳定增长,为基金持有人谋求长期最佳利益。

投资策略:作为成长价值复合型基金,本基金股票投资包括两部分:一部分为成长型投资,另一部分为价值型投资。成长型和价值型投资的比例关系根据市场情况的变化进行调整,但对成长型或价值型上市公司的投资最低均不得低于股票投资总额的30%,最高均不得高于股票投资总额的70%。本基金将遵循流动性、安全性、收益性的原则,在综合分析宏观经济、行业、企业以及影响证券市场的各种因素的基础上确定投资组合,分散和降低投资风险,确保基金资产安全,谋求基金长期稳定的收益。

风险收益特征:风险水平和期望收益适中。

(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:0755-83275886

传真:0755-83515119

电子邮箱:liuck@byfunds.com

(四)基金托管人

法定名称:中国农业银行

信息披露负责人:李芳菲

联系电话:010-68424199

传真:010—68424181

电子邮箱:lifangfei@abchina.com

(五)基金半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

第三节 主要财务指标和基金净值表现

(一)主要会计数据和财务指标

单位:元

	主要会计数据和财务指标	2007年6月30日
1	基金本期净收益	1,686,275,040.27
2	基金份额本期净收益	0.8431
3	期末可供分配基金收益	1,754,296,998.18
4	期末可供分配基金份额收益	0.8771
5	期末基金资产净值	4,389,754,678.27
6	期末基金份额净值	2.1949
7	基金加权平均净值收益率	41.46%
8	本期基金份额净值增长率	42.00%
9	基金份额累计净值增长率	173.23%

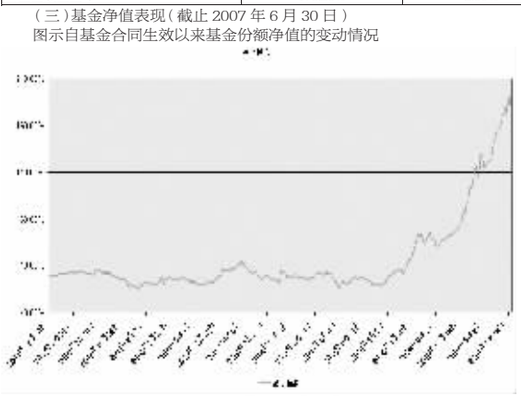
提示:上述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用(例如开放式基金的申购赎回费、红利再投资费、基金转换费、封闭式基金交易佣金等),计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

(二)同期业绩比较(截止2007年6月30日)

阶段	净值增长率①	净值增长标准差②
过去一个月	-1.25%	3.80%
过去三个月	22.95%	2.89%
过去六个月	42.00%	3.49%
过去一年	91.28%	3.03%
过去三年	184.54%	2.93%
自基金成立至今	173.23%	2.50%

(三)基金净值表现(截止2007年6月30日)

图示自基金合同生效以来基金份额净值的变动情况



第四节 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。公司目前管理基金鸿飞、基金鸿阳、宝盈鸿利收益、宝盈泛沿海、宝盈策略增长五只基金,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,2006年8月起担任鸿飞证券投资基金基金经理,2007年3月26日起同时担任鸿阳证券投资基金基金经理。

宝盈基金管理有限公司于2007年5月12日刊登公告增加牛春晖为鸿阳证券投资基金基金经理,实行双基金经理制。

牛春晖,男,1972年生,经济学硕士。曾任君安证券研究所核心研究员、大成基金管理有限公司研究部副经理、基金景宏基金经理助理,2004年10月至2006年12月担任基金景博基金经理。2007年1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、《鸿阳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

回顾

上半年中国实体经济的运行状况很好:消费需求增长持续加快,1-5月累计的社会消费品零售总额同比增长15.2%,是近10年同期最高水平,国家信息中心预期2007年全年将增长15.8%,作为拉动经济增长的三驾马车中最稳定的一驾,消费的快速增长对延长经济上升期和提高经济增长稳定性都具有重要意义;此外,由于社会资金宽松和投资回报率较高,固定资产投资热度不减,1-5月同比增长25.9%且增长呈现加速趋势,国家信息中心预期全年增速将达到26.1%;最后出口快速增长、外贸顺差扩大的速度并未减缓。

实体经济在快速发展的同时也出现了一些问题:农产品价格快速上涨对CPI形成显著影响、流动性过剩引致的房地产、股票等资产价格的暴涨、工业快速增长使节能减排压力增大等等;而政府在宏观调控方面又因汇率和利率的相互制约而投鼠忌器,迄今出台的调控措施效果均不显著。

在充沛的流动性和实体经济良好运行趋势的支撑下,上半年的资本市场向投资者充分展示了前所未有的牛市特征,但在6月份因政府调控出现了快速的大幅调整——与此前的多次单日快速调整相比,此次调整的时间和幅度对于投资者的信心都形成了较大的打击。

展望

中国经济经历了多年低通胀环境下的高增长后出现了过热迹象,今年上半年CPI的增长趋势引发了政府对通胀的担忧并已经明确提出要防止经济由偏快转向过热,预期未来的宏观调控措施还会陆续出台,除了已经公布尚未实施的特别国债发行外,其他已经在预期之中调控措施包括利息税的减免、继续加息等等;虽然此前出台的调控措施并未在经济降温等方面取得显著效果,但政策的累积效果将会逐步显现。我们希望调控政策能够抑制经济的过热趋势并对中国经济发展的前景和质量充满信心。

虽然A股市场的累积涨幅巨大,但由于上市公司业绩的快速增长,市场整体的泡沫成分并不严重;有分析报告预期2007年中期上市公司整体的业绩增长幅度约为50-60%,全年增长40%以上,2008年的增速仍在25%以上;有快速增长的业绩为支撑,A股市场的估值基础是比较坚实的;此外H股和红筹股的回归将进一步夯实估值的基础;当前的A股市场即便有泡沫或者透支现象也仅仅是结构性问题。我们看好A股市场的长期表现。低价劣质股和题材股在6月的暴跌给投资者上了一堂风险教育课,而优质蓝筹股的抗跌性能越发凸显。预期未来优质蓝筹股由于业绩的实质性增长,将有望改变上半年的颓势。

第五节 托管人报告

在托管鸿阳证券投资基金的过程中,本基金托管人——中国农业银行严格遵守《证券投资基金法》相关法律法规的规定以及《鸿阳证券投资基金基金合同》、《鸿阳证券投资基金托管协议》的约定,对鸿阳证券投资基金管理人—宝盈基金管理有限公司2007年1月1日至2007年6月30日基金的投资运作,进行了认真、独立的会计核算和必要的投资监督,认真履行了托管人的义务,没有从事任何损害基金份额持有人利益的行为。

本托管人认为,宝盈基金管理有限公司在鸿阳证券投资基金的投资运作、基金资产净值的计算、基金费用开支等问题上,不存在损害基金份额持有人利益的行为;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。

本托管人认为,鸿阳证券投资基金的信息披露事务符合《证券投资基金信息披露管理办法》及其他相关法律法规的规定,基金管理人所编制和披露的鸿阳证券投资基金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、投资组合报告等信息真实、准确、完整,未发现有损害基金持有人利益的行为。

第六节 财务会计报告

(一)会计报表

鸿阳证券投资基金

2007年6月30日资产负债表

单位:元

	附注	2007年6月30日	2006年12月31日
资产			
银行存款		249,965,955.63	44,747,579.12
清算备付金		13,882,825.14	5,054,038.30
交易保证金	4(1)	3,375,224.57	1,660,000.00
应收证券清算款		---	---
应收利息	4(2)	21,768,036.68	7,018,989.82
应收股利		140,329.42	371.50
股票投资		3,109,101,059.46	2,674,361,398.93
其中:股票投资成本		2,503,626,346.04	1,771,833,434.07
债券投资		975,426,957.80	720,830,069.90
其中:债券投资成本		980,197,560.92	715,425,786.29
权证投资		34,753,569.79	85,895,926.96
其中:权证投资成本		---	53,493,890.03
待摊费用		1,052,480.00	---
资产总计		4,409,466,438.49	3,539,568,374.53
负债及持有人权益			
负债			
应付证券清算款		4,336,372.16	---
应付管理人报酬		5,536,100.69	4,092,952.70
应付托管费		922,683.44	682,158.78
应付佣金	4(4)	5,771,417.73	3,162,870.80
其他应付款	4(5)	2,817,079.14	2,817,148.94
预提费用	4(6)	328,107.06	457,000.00
负债合计		19,711,760.22	11,212,131.22
持有人权益			
实收基金		2,000,000,000.00	2,000,000,000.00
未实现利得	4(3)	635,457,680.09	940,334,285.40
未分配收益		1,754,296,998.18	588,021,957.91
持有人权益合计		4,389,754,678.27	3,528,356,243.31
负债及持有人权益总计		4,409,466,438.49	3,539,568,374.53

后附会计报表附注为本会计报表的组成部分。

鸿阳证券投资基金

2007年1月1日至2007年6月30日止期间

经营业绩表及收益分配表

单位:元

	附注	2007年1月1日至2007年6月30日	2006年1月1日至2006年6月30日
收入			
股票差价收入	4(7)	1,670,820,373.71	556,851,665.87
债券差价收入	4(8)	639,835.91	-42,536.74
权证差价收入	4(9)	27,773,033.28	74,908,703.85
债券利息收入		13,645,317.63	7,931,603.48
存款利息收入		1,903,530.04	347,792.62
股利收入		12,158,536.14	33,482,572.10
买入返售证券收入		---	---
其他收入	4(10)	420.00	440.01
收入合计		1,726,941,046.71	673,480,241.19
费用			
基金管理人报酬		30,311,171.80	17,119,574.17
基金托管费		5,051,861.98	2,853,262.32
卖出回购证券支出		4,539,600.46	326,739.60
其他费用	4(11)	763,372.20	253,038.46
其中:上市年费		29,752.78	29,752.78
信息披露费		148,765.71	148,765.71
审计费用		49,588.57	51,076.39
费用合计		40,666,006.44	20,552,614.55
基金净收益		1,686,275,040.27	652,927,626.64
加:未实现利得		-304,876,605.31	279,055,563.10
基金经营业绩		1,381,398,434.96	931,983,189.74
本期基金净收益		1,686,275,040.27	652,927,626.64
加:期初基金净收益		588,021,957.91	-284,508,400.99
可供分配基金净收益		2,274,296,998.18	368,419,225.65
减:本期已分配基金净收益	4(12)	520,000,000.00	---
期末基金净收益		1,754,296,998.18	368,419,225.65

后附会计报表附注为本会计报表的组成部分。

鸿阳证券投资基金

2007年1月1日至2007年6月30日止期间

基金净值变动表

单位:元

		2007年1月1日至2007年6月30日	2006年1月1日至2006年6月30日
期初基金净值		3,528,356,243.31	1,868,284,461.12
本期经营活动			
基金净收益		1,686,275,040.27	652,927,626.64
未实现利得		-304,876,605.31	279,055,563.10
经营活动产生的基金净值变动数		1,381,398,434.96	931,983,189.74
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		-520,000,000.00	---
期末基金净值		4,389,754,678.27	2,800,267,650.86

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 本报告期会计报表所采用的会计政策、会计估计与上年度会计报告相一致。

2 本报告期无重大会计差错的内容和更正金额。

3 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
中国农业银行	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

		2007年1月1日至2007年6月30日		2006年1月1日至2006年6月30日	
关联方名称	交易类型	成交量(元)	占本期比例(%)	成交量(元)	占本期比例(%)
联合证券有限责任公司	股票	---	---	139,620,603.42	2.30
	债券	---	---	7,043,204.00	2.25
	回购	---	---	200,100,000.00	100.00
	权证	---	---	46,240,500.69	15.63
	佣金	---	---	112,416.70	2.30

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。

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。

本基金在本会计期间需支付基金管理人报酬30,311,171.80元(2006年同期:17,119,574.17元)。

(d) 基金托管费

支付基金托管人中国农业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。

本基金在本会计期间需支付基金托管费5,051,861.98元(2006年同期:2,853,262.32元)。

(e) 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农业银行保管,并按银行间同业利率计息。基金托管人于2007年6月30日保管的银行存款及清算备付金余额为263,848,780.77元(2006年同期:68,606,716.73元)。本会计期间由基金托管人保管的银行存款及清算备付金产生的利息收入为1,902,226.84元(2006年同期:346,489.42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农业银行通过银行间同业市场进行的债券交易如下:

	2007年1月1日至2007年6月30日	2006年1月1日至2006年6月30日
卖出回购证券协议金额	---	19,600,000.00
卖出回购证券利息支出	---	3,769.64

(g)基金管理公司及股东投资本基金情况

(Ⅰ)基金管理公司投资本基金情况

关联方名称	项目名称	2007年1月1日至2007年6月30日
宝盈基金管理有限公司	持有基金份额(份)	5,000,000
	占基金总份额的比例(%)	0.25
	报告期内持有份额的变化	---
	使用费率	---

(Ⅱ)基金管理公司主要股东及控制的机构投资本基金情况

关联方名称	项目名称	2007年1月1日至2007年6月30日
中国对外经济贸易信托投资有限公司	持有基金份额(份)	3,000,000
	占基金总份额的比例(%)	0.15

4 流通受限制不能自由转让的基金资产

(1)本基金截止本报告期末流通受限股票列示如下:

A. 本基金截至2007年6月30日止无因股权分置改革而暂时停牌的股票。

B. 本基金获配的新股和配股为流通受限、不能转让的资产。在估值时如果该股票还未上市,则按成本计价;如已上市,则按当日市场平均价计价。申购新股从新股申购日至新股上市日之间不能自由流通。

股票代码	股票名称	可流通日期	数量	成本总额	估值总额	估值方法	受限原因
002126	银轮股份	2007/07/18	35,867	300,565.46	653,138.07	市价估值	网下申购新股锁定
002127	新民科技	2007/07/18	44,106	414,596.40	805,375.56	市价估值	网下申购新股锁定
002128	露天煤业	2007/07/18	87,837	860,802.60	3,136,659.27	市值估值	网下申购新股锁定
002129	中环股份	2007/07/20	98,899	574,603.19	1,561,615.21	市值估值	网下申购新股锁定
002130	沃尔核材	2007/07/20	15,964	250,954.08	788,461.96	市值估值	网下申购新股锁定
002131	利欧股份	2007/07/27	19,284	263,997.96	585,462.24	市值估值	网下申购新股锁定
002132	恒星科技	2007/07/27	44,423	355,384.00	850,700.45	市值估值	网下申购新股锁定
002135	东南网架	2007/08/30	46,891	450,153.60	1,070,521.53	市值估值	网下申购新股锁定
002136	安纳达	2007/08/30	14,784	119,454.72	338,997.12	市值估值	网下申购新股锁定
002137	实益达	2007/09/13	24,630	253,689.00	1,180,515.90	市值估值	网下申购新股锁定
601007	金陵饭店	2007/07/10	106,196	451,333.00	1,569,576.88	市值估值	网下申购新股锁定
601008	连云港	2007/07/26	138,007	687,274.86	2,052,164.09	市值估值	网下申购新股锁定
601328	交通银行	2007/08/16	1,066,552	8,425,760.80	11,785,399.60	市值估值	网下申购新股锁定
601919	中国远洋	2007/09/26	426,930	3,620,366.40	7,893,935.70	市值估值	网下申购新股锁定
601998	中信银行	2007/07/30	953,600	5,530,880.00	8,792,192.00	市值估值	网下申购新股锁定
合 计			3,123,970	22,559,816.07	43,064,715.58		

(2)本基金截止本报告期未无流通受限的债券。

第七节 基金投资组合报告

(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	263,848,780.77	5.98
股票	3,109,101,059.46	70.51
债券	975,426,957.80	22.12
权证	34,753,569.79	0.79
其他资产	26,336,070.67	0.60
合计	4,409,466,438.49	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	3,136,659.27	0.07
3	C 制造业	1,759,927,011.72	40.10
	C0 食品、饮料	373,477,475.32	8.51
	C1 纺织、服装、皮毛	805,375.56	0.02
	C2 木材、家具	93,769,668.46	2.14
	C3 造纸、印刷	---	---
	C4 石油、化学、塑胶、塑料	35,437,950.42	0.81
	C5 电子	96,164,634.82	2.19
	C6 金属、非金属	268,613,785.99	6.12
	C7 机械、设备、仪表	576,076,542.51	13.12
	C8 医药、生物制品	314,793,116.68	7.17
	C99 其他制造业	788,461.96	0.02
4	D 电力、煤气及水的生产和供应业	88,678,861.94	2.02
5	E 建筑业	1,070,521.53	0.02
6	F 交通运输、仓储业	9,946,099.79	0.23
7	G 信息技术业	227,840,746.56	5.19
8	H 批发和零售贸易	117,423,524.07	2.67
9	I 金融、保险业	228,666,261.59	5.21
10	J 房地产业	264,522,000.00	6.03
11	K 社会服务业	171,133,492.40	3.90
12	L 传播与文化产业	132,779,663.03	3.02
13	M 综合类	103,976,217.56	2.37
	合计	3,109,101,059.46	70.83

(三)基金投资股票明细

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	000858	五 粮 液	9,466,542	295,924,102.92	6.74
2	600718	东软股份	5,353,401	227,840,746.56	5.19
3	600085	同仁堂	5,028,678	193,805,250.12	4.41
4	600219	南山铝业	7,385,881	170,539,992.29	3.89
5	000069	华侨城 A	4,343,338	169,563,915.52	3.86
6	000024	招商地产	3,400,000	165,342,000.00	3.77
7	601628	中国人寿	3,601,695	150,442,800.15	3.43
8	600088	中视传媒	4,182,905	128,833,474.00	2.93
9	600786	东方锅炉	1,966,066	123,488,605.46	2.81

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网站的半年度报告正文。

(四)股票投资组合的重大变动

1、累计买入金额超过期初资产净值2%的股票明细

序号	股票代码	股票名称	累计买入金额(元)	占基金期初资产净值比例(%)
1	600030	中信证券	243,940,291.10	6.91
2	000858	五 粮 液	219,197,301.51	6.21
3	600795	国电电力	187,394,003.26	5.31
4	000069	华侨城 A	172,474,820.34	4.89
5	600737	中粮屯河	172,047,369.69	4.88
6	000983	西山煤电	159,699,062.94	4.53
7	600219	南山铝业	158,595,655.34	4.49
8	601006	大秦铁路	151,729,294.69	4.30
9	601628	中国人寿	145,775,042.80	4.13
10	600085	同仁堂	141,866,107.25	4.02
11	600718	东软股份	132,340,004.02	3.75
12	600616	第一食品	129,099,079.19	3.66
13	600028	中国石化	126,906,660.58	3.60
14	600088	中视传媒	125,883,435.67	3.57
15	000539	粤电力 A	122,949,163.39	3.48
16	000900	现代投资	122,894,109.79	3.48
17	600236	桂冠电力	121,373,157.98	3.44
18	600879	火箭股份	115,662,405.24	3.28
19	600717	天津港	111,048,936.23	3.15
20	000800	一汽轿车	108,593,238.62	3.08
21	600809	山西汾酒	108,570,322.01	3.08
22	600786	东方锅炉	104,038,247.68	2.95
23	600649	原水股份	104,022,323.37	2.95
24	000088	盐 田 港	99,434,296.77	2.82
25	600436	片仔癀	95,999,430.07	2.72
26	000089	深圳机场	94,187,348.12	2.67
27	002102	冠福家用	83,815,610.79	2.38
28	600858	银座股份	80,286,306.24	2.28
29	000410	沈阳机床	80,066,119.82	2.27
30	600016	民生银行	79,775,918.52	2.26
31	000617	石油济柴	79,268,442.59	2.25
32	600036	招商银行	79,024,129.15	2.24
33	600383	金地集团	77,822,189.39	2.21
34	000021	长城开发	77,648,922.93	2.20
35	601166	兴业银行	77,585,875.37	2.20
36	002056	横店东磁	76,614,795.15	2.17
37	600050	中国联通	73,627,487.89	2.09

2、累计卖出金额超过期初资产净值2%的股票明细

序号	股票代码	股票名称	累计卖出金额(元)	占基金期初资产净值比例(%)
1	600030	中信证券	470,050,411.42	13.32
2	600795	国电电力	287,757,465.90	8.16
3	000002	万 科 A	284,818,154.87	8.07
4	600036	招商银行	281,453,178.84	7.98
5	600028	中国石化	239,922,104.54	6.80
6	601398	工商银行	201,024,236.01	5.70
7	600050	中国联通	194,506,547.81	5.51
8	000983	西山煤电	190,987,371.12	5.41
9	600547	山东黄金	184,730,878.66	5.24
10	600104	上海汽车	181,445,033.90	5.14
11	600016	民生银行	174,862,181.57	4.96
12	000039	中集集团	168,186,357.94	4.77
13	600519	贵州茅台	162,338,255.94	4.60
14	600236	桂冠电力	160,849,196.12	4.56
15	000900	现代投资	154,742,944.47	4.39
16	000625	长安汽车	151,645,377.51	4.30
17	601006	大秦铁路	149,440,318.29	4.24
18	600887	伊利股份	146,363,616.84	4.15
19	600717	天津港	145,409,687.13	4.12
20	600019	宝钢股份	142,523,536.02	4.04
21	600879	火箭股份	127,011,835.05	3.60
22	000858	五 粮 液	120,810,642.16	3.42
23	600809	山西汾酒	111,932,522.71	3.17
24	600737	中粮屯河	111,384,159.59	3.16
25	000088	盐 田 港	109,913,775.46	3.12
26	000089	深圳机场	105,036,309.49	2.98
27	000021	长城开发	91,931,628.69	2.61
28	600269	赣粤高速	90,795,426.54	2.57
29	000951	中国重汽	85,611,139.21	2.43
30	000825	太钢不锈	84,822,365.72	2.40
31	000617	石油济柴	83,014,822.60	2.35
32	601166	兴业银行	82,867,731.56	2.35
33	000539	粤电力 A	82,629,871.99	2.34
34	600548	深高速	77,570,468.79	2.20
35	600138	中青旅	75,884,531.33	2.15
36	600111	稀土高科	71,407,133.62	2.02
37	600428	中远航运	70,810,369.78	2.01

3、买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

项目名称	金额(元)
报告期内买入股票成本总额	6,637,815,774.63
报告期内卖出股票收入总额	7,583,209,635.64

(五)按券种分类的债券投资组合

序号	债券名称	市值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	国债	677,639,957.80	15.44
2	银行间政策性金融债	297,787,000.00	6.78
	合计	975,426,957.80	22.22

(六)基金投资前五名债券明细

序号	债券名称	市值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	02国债(14)	200,520,000.00	4.57
2	99国债(8)	191,401,100.00	4.36
3	04国开 14	86,080,000.00	1.96
4	04国开 16	63,651,000.00	1.45
5	21国债(15)	56,657,487.00	1.29

(七)投资组合报告附注

1、本报告期内基金投资的前十名证券的发行主体未被监管部门立案调查;在本报告编制日前一年内未受到公开谴责、处罚。

2、基金投资的前十名股票中未有超出基金合同规定备选股票库之外的股票。

3、其他资产明细

项目名称	金额(元)
应收利息	21,768,036.68
交易保证金	3,375,224.57
应收股利	140,329.42
待摊费用	1,052,480.00
合计	26,336,070.67

4、本报告期内处于转股期的可转换债券

本报告期内无处于转股期的可转换债券。

5、本报告期内权证投资明细

(1)本报告期内未主动投资权证;

(2)本报告期内被动持有的权证明细如下:

序号	权证代码	权证名称	股数(股)	成本(元)	类别(被动持有/主动投资)
1	580012	云化 CWB1	280,854	1,662,957.10	被动持有
2	580013	武钢 CWB1	252,200	584,398.17	被动持有
合计			533,054	2,247,355.27	

6、本报告期内本基金未投资资产支持证券。

7、本报告期内基金未持有可分离可转换债券。

8、由于四舍五入的原因,分项与合计项之间可能存在尾差。

(八)本基金管理公司运用固有资金投资本基金情况

截止本报告期末,本基金管理公司运用固有资金投资本基金的份额为5,000,000份,本报告期内持有本基金份额无变动。

第八节 基金份额持有人户数、持有人结构(及前十名持有人)

(一)基金份额持有人户数(截止2007年6月30日)

基金份额持有人户数(户)	55,142
平均每户持有基金份额(份)	36,269.99

(二)基金份额持有人结构(截止2007年6月30日)

投资者名称	持有基金份额(份)	占总份额的比例(%)
机构投资者	936,520,588	46.83
个人投资者	1,063,479,412	53.17

(三)基金前十名持有人

序号	名称	持有份额(份)	占总份额的比例(%)
1	中国人寿保险股份有限公司	161,317,746	8.07
2	中国太平洋保险(集团)股份有限公司	146,301,772	7.32
3	中国人寿保险(集团)公司	138,075,079	6.90
4	新华人寿保险股份有限公司	93,389,095	4.67
5	中国人民财产保险股份有限公司	59,087,757	2.95
6	中国平安保险(集团)股份有限公司	42,652,056	2.13
7	光大证券-中国工商银行-光大阳光2号集合资产管理计划	40,194,407	2.01
8	全国社保基金一零九组合	32,979,924	1.65
9	全国社保基金六零三组合	23,929,448	1.20
10	新华人寿保险股份有限公司	19,646,449	0.98

注:上述本基金前十名持有人相关资料由中国证券登记结算有限责任公司深圳分公司提供。

第九节 重大事件揭示

(一)本基金在本报告期内未召开基金份额持有人大会。

(二)本公司于2007年1月23日刊登《宝盈基金管理有限公司关于聘任公司副总经理的公告》,经宝盈基金管理有限公司董事会审议通过,决定聘任于志先生为公司副总经理;本公司于2007年3月26日刊登《宝盈基金管理有限公司关于同意晏晓辉先生辞