

华宝兴业先进成长股票型证券投资基金 2007年半年度报告摘要

基金管理人:华宝兴业基金管理有限公司 基金托管人:中国银行股份有限公司

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。

基金托管人中国银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2007年8月24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预示其未来表现,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。

报告期为2007年1月1日起至2007年6月30日止,本报告财务资料未经审计。
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。

一、基金简介
(一)基金基本情况
1.基金简称:先进成长基金
2.交易代码:240009
3.基金运作方式:契约型开放式
4.基金合同生效日:2006年11月7日

资产负债表
单位:人民币元
2007年6月30日
2006年12月31日
资产合计:7,316,944,723.82 / 7,830,368,011.25
负债合计:1,475,606,626.00 / 1,475,606,626.00
所有者权益合计:5,841,338,095.22 / 6,354,761,385.25

2、经营业绩表及收益分配表
金额单位:人民币元
项目 2007年1月1日至2007年6月30日期间
一、已实现基金收益 3,445,856,605.64

二、关联方交易
关联方名称 与本基金的关系
华宝兴业基金管理有限公司 基金发起人、基金管理人、基金注册登记人、基金销售机构

三、基金净值变动表
金额单位:人民币元
项目 2007年1月1日至2007年6月30日期间
一、期初基金净值 7,752,169,427.83
本期经营活动 3,392,439,385.14

1、投资目标:分享我国经济高速增长方式转变过程中和转变完成后的先进企业的成长,在控制风险的前提下为中高风险承受能力人谋求长期超额回报。
2、投资策略:本基金采取稳健的资产配置策略,通过公司内部开发的量化辅助选股模型,结合宏观策略研究,对相关资产类别的预期收益进行动态跟踪,决定大类资产配置比例。
3、业绩比较基准:本基金的业绩比较基准为60%~95%其中投资于先进企业股票占非现金资产的比例不低于80%。
4、风险收益特征:本基金属于证券投资基金中的较高风险的品种。

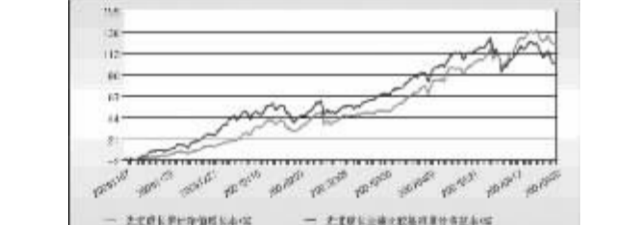
二、主要财务指标和基金净值表现

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,计入费用后实际收益水平要低于所列数据和财务指标。

(一)主要会计数据和财务指标
金额单位:人民币元
序号 主要会计数据和财务指标 2007年1月1日至2007年6月30日

(二)基金净值表现
1.基金历史各时间段净值增长率与同期业绩比较基准收益率的比较列表

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
过去一个月 5.04% 2.24% -4.76% 2.91%



注:1.本基金合同于2006年11月7日生效,截止报告日本基金合同生效未满一年。
2.按基金合同规定,本基金自基金合同生效起六个月内为建仓期,截至2007年5月7日本基金的各项投资比例已达到基金合同第十四条(四)项投资策略中(四)投资策略中规定的各项比例;股权投资比例为60%-95%,其中投资于先进企业股票占非现金资产的比例不低于80%,权证投资比例为0%-3%,债券及现金投资比例为5%-40%。
(其中,现金或到期日在一年以内的政府债券不低于5%)。

三、管理人报告

(一)基金管理人及其管理基金的经验
基金管理人于2003年3月7日正式成立的合资基金管理公司,截至本报告期末(2007年6月30日),所管理的开放式证券投资基金包括宝鼎系列基金、多策略增长基金、现金宝货币市场基金、动力组合基金、收益增长基金、本基金和行业精选基金,所管理的开放式证券投资基金资产净值合计39,886,464,707.17元。

(二)基金净值表现
截至报告期末,本报告期内基金净值增长率为86.41%,同期业绩比较基准增长率为41.03%。

二季度市场以5月30日为界,可以划分为两个阶段,第一阶段市场活跃度跃,两市成交量也达到了一阶段性高峰;第二阶段市场在政策及其他因素影响下,逐步陷入调整,成交萎缩。

(四)宏观政策、证券市场及行业走势的简要展望
宏观上来看,我们从近期公布的一系列数据,如M1/M2增长速度、新增贷款量、CPI、投资增长速度尤其是房地产行业投资增长速度等综合判断,经济过热倾向已经相当明显,我们预期未来国家出台进一步的宏观调控政策难以避免。

(五)报告期内基金投资策略和业绩表现的说明与解释
截至报告期末,本报告期内基金净值增长率为86.41%,同期业绩比较基准增长率为41.03%。

二季度市场以5月30日为界,可以划分为两个阶段,第一阶段市场活跃度跃,两市成交量也达到了一阶段性高峰;第二阶段市场在政策及其他因素影响下,逐步陷入调整,成交萎缩。

(四)宏观政策、证券市场及行业走势的简要展望
宏观上来看,我们从近期公布的一系列数据,如M1/M2增长速度、新增贷款量、CPI、投资增长速度尤其是房地产行业投资增长速度等综合判断,经济过热倾向已经相当明显,我们预期未来国家出台进一步的宏观调控政策难以避免。

(五)报告期内基金投资策略和业绩表现的说明与解释
截至报告期末,本报告期内基金净值增长率为86.41%,同期业绩比较基准增长率为41.03%。

二季度市场以5月30日为界,可以划分为两个阶段,第一阶段市场活跃度跃,两市成交量也达到了一阶段性高峰;第二阶段市场在政策及其他因素影响下,逐步陷入调整,成交萎缩。

(四)宏观政策、证券市场及行业走势的简要展望
宏观上来看,我们从近期公布的一系列数据,如M1/M2增长速度、新增贷款量、CPI、投资增长速度尤其是房地产行业投资增长速度等综合判断,经济过热倾向已经相当明显,我们预期未来国家出台进一步的宏观调控政策难以避免。

(五)报告期内基金投资策略和业绩表现的说明与解释
截至报告期末,本报告期内基金净值增长率为86.41%,同期业绩比较基准增长率为41.03%。

二季度市场以5月30日为界,可以划分为两个阶段,第一阶段市场活跃度跃,两市成交量也达到了一阶段性高峰;第二阶段市场在政策及其他因素影响下,逐步陷入调整,成交萎缩。

(四)宏观政策、证券市场及行业走势的简要展望
宏观上来看,我们从近期公布的一系列数据,如M1/M2增长速度、新增贷款量、CPI、投资增长速度尤其是房地产行业投资增长速度等综合判断,经济过热倾向已经相当明显,我们预期未来国家出台进一步的宏观调控政策难以避免。

(五)报告期内基金投资策略和业绩表现的说明与解释
截至报告期末,本报告期内基金净值增长率为86.41%,同期业绩比较基准增长率为41.03%。

二季度市场以5月30日为界,可以划分为两个阶段,第一阶段市场活跃度跃,两市成交量也达到了一阶段性高峰;第二阶段市场在政策及其他因素影响下,逐步陷入调整,成交萎缩。

(四)宏观政策、证券市场及行业走势的简要展望
宏观上来看,我们从近期公布的一系列数据,如M1/M2增长速度、新增贷款量、CPI、投资增长速度尤其是房地产行业投资增长速度等综合判断,经济过热倾向已经相当明显,我们预期未来国家出台进一步的宏观调控政策难以避免。

(五)报告期内基金投资策略和业绩表现的说明与解释
截至报告期末,本报告期内基金净值增长率为86.41%,同期业绩比较基准增长率为41.03%。

二季度市场以5月30日为界,可以划分为两个阶段,第一阶段市场活跃度跃,两市成交量也达到了一阶段性高峰;第二阶段市场在政策及其他因素影响下,逐步陷入调整,成交萎缩。

(四)宏观政策、证券市场及行业走势的简要展望
宏观上来看,我们从近期公布的一系列数据,如M1/M2增长速度、新增贷款量、CPI、投资增长速度尤其是房地产行业投资增长速度等综合判断,经济过热倾向已经相当明显,我们预期未来国家出台进一步的宏观调控政策难以避免。

(五)报告期内基金投资策略和业绩表现的说明与解释
截至报告期末,本报告期内基金净值增长率为86.41%,同期业绩比较基准增长率为41.03%。

二季度市场以5月30日为界,可以划分为两个阶段,第一阶段市场活跃度跃,两市成交量也达到了一阶段性高峰;第二阶段市场在政策及其他因素影响下,逐步陷入调整,成交萎缩。

(四)宏观政策、证券市场及行业走势的简要展望
宏观上来看,我们从近期公布的一系列数据,如M1/M2增长速度、新增贷款量、CPI、投资增长速度尤其是房地产行业投资增长速度等综合判断,经济过热倾向已经相当明显,我们预期未来国家出台进一步的宏观调控政策难以避免。

(五)报告期内基金投资策略和业绩表现的说明与解释
截至报告期末,本报告期内基金净值增长率为86.41%,同期业绩比较基准增长率为41.03%。

二季度市场以5月30日为界,可以划分为两个阶段,第一阶段市场活跃度跃,两市成交量也达到了一阶段性高峰;第二阶段市场在政策及其他因素影响下,逐步陷入调整,成交萎缩。

(四)宏观政策、证券市场及行业走势的简要展望
宏观上来看,我们从近期公布的一系列数据,如M1/M2增长速度、新增贷款量、CPI、投资增长速度尤其是房地产行业投资增长速度等综合判断,经济过热倾向已经相当明显,我们预期未来国家出台进一步的宏观调控政策难以避免。

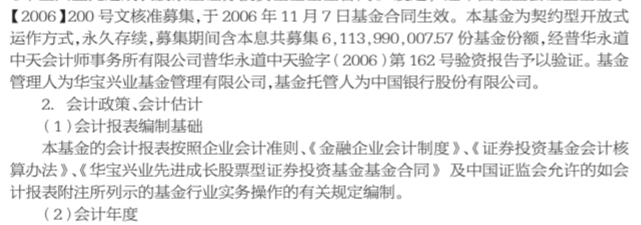
(五)报告期内基金投资策略和业绩表现的说明与解释
截至报告期末,本报告期内基金净值增长率为86.41%,同期业绩比较基准增长率为41.03%。

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,计入费用后实际收益水平要低于所列数据和财务指标。

(一)主要会计数据和财务指标
金额单位:人民币元
项目 2007年1月1日至2007年6月30日期间

(二)基金净值表现
1.基金历史各时间段净值增长率与同期业绩比较基准收益率的比较列表

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
过去一个月 5.04% 2.24% -4.76% 2.91%



注:1.本基金合同于2006年11月7日生效,截止报告日本基金合同生效未满一年。
2.按基金合同规定,本基金自基金合同生效起六个月内为建仓期,截至2007年5月7日本基金的各项投资比例已达到基金合同第十四条(四)项投资策略中(四)投资策略中规定的各项比例;股权投资比例为60%-95%,其中投资于先进企业股票占非现金资产的比例不低于80%,权证投资比例为0%-3%,债券及现金投资比例为5%-40%。
(其中,现金或到期日在一年以内的政府债券不低于5%)。

三、管理人报告

(一)基金管理人及其管理基金的经验
基金管理人于2003年3月7日正式成立的合资基金管理公司,截至本报告期末(2007年6月30日),所管理的开放式证券投资基金包括宝鼎系列基金、多策略增长基金、现金宝货币市场基金、动力组合基金、收益增长基金、本基金和行业精选基金,所管理的开放式证券投资基金资产净值合计39,886,464,707.17元。

(二)基金净值表现
截至报告期末,本报告期内基金净值增长率为86.41%,同期业绩比较基准增长率为41.03%。

二季度市场以5月30日为界,可以划分为两个阶段,第一阶段市场活跃度跃,两市成交量也达到了一阶段性高峰;第二阶段市场在政策及其他因素影响下,逐步陷入调整,成交萎缩。

(四)宏观政策、证券市场及行业走势的简要展望
宏观上来看,我们从近期公布的一系列数据,如M1/M2增长速度、新增贷款量、CPI、投资增长速度尤其是房地产行业投资增长速度等综合判断,经济过热倾向已经相当明显,我们预期未来国家出台进一步的宏观调控政策难以避免。

(五)报告期内基金投资策略和业绩表现的说明与解释
截至报告期末,本报告期内基金净值增长率为86.41%,同期业绩比较基准增长率为41.03%。

二季度市场以5月30日为界,可以划分为两个阶段,第一阶段市场活跃度跃,两市成交量也达到了一阶段性高峰;第二阶段市场在政策及其他因素影响下,逐步陷入调整,成交萎缩。

(四)宏观政策、证券市场及行业走势的简要展望
宏观上来看,我们从近期公布的一系列数据,如M1/M2增长速度、新增贷款量、CPI、投资增长速度尤其是房地产行业投资增长速度等综合判断,经济过热倾向已经相当明显,我们预期未来国家出台进一步的宏观调控政策难以避免。

(五)报告期内基金投资策略和业绩表现的说明与解释
截至报告期末,本报告期内基金净值增长率为86.41%,同期业绩比较基准增长率为41.03%。

二季度市场以5月30日为界,可以划分为两个阶段,第一阶段市场活跃度跃,两市成交量也达到了一阶段性高峰;第二阶段市场在政策及其他因素影响下,逐步陷入调整,成交萎缩。

(四)宏观政策、证券市场及行业走势的简要展望
宏观上来看,我们从近期公布的一系列数据,如M1/M2增长速度、新增贷款量、CPI、投资增长速度尤其是房地产行业投资增长速度等综合判断,经济过热倾向已经相当明显,我们预期未来国家出台进一步的宏观调控政策难以避免。

(五)报告期内基金投资策略和业绩表现的说明与解释
截至报告期末,本报告期内基金净值增长率为86.41%,同期业绩比较基准增长率为41.03%。

二季度市场以5月30日为界,可以划分为两个阶段,第一阶段市场活跃度跃,两市成交量也达到了一阶段性高峰;第二阶段市场在政策及其他因素影响下,逐步陷入调整,成交萎缩。

(四)宏观政策、证券市场及行业走势的简要展望
宏观上来看,我们从近期公布的一系列数据,如M1/M2增长速度、新增贷款量、CPI、投资增长速度尤其是房地产行业投资增长速度等综合判断,经济过热倾向已经相当明显,我们预期未来国家出台进一步的宏观调控政策难以避免。

(五)报告期内基金投资策略和业绩表现的说明与解释
截至报告期末,本报告期内基金净值增长率为86.41%,同期业绩比较基准增长率为41.03%。

二季度市场以5月30日为界,可以划分为两个阶段,第一阶段市场活跃度跃,两市成交量也达到了一阶段性高峰;第二阶段市场在政策及其他因素影响下,逐步陷入调整,成交萎缩。

(四)宏观政策、证券市场及行业走势的简要展望
宏观上来看,我们从近期公布的一系列数据,如M1/M2增长速度、新增贷款量、CPI、投资增长速度尤其是房地产行业投资增长速度等综合判断,经济过热倾向已经相当明显,我们预期未来国家出台进一步的宏观调控政策难以避免。

(五)报告期内基金投资策略和业绩表现的说明与解释
截至报告期末,本报告期内基金净值增长率为86.41%,同期业绩比较基准增长率为41.03%。

二季度市场以5月30日为界,可以划分为两个阶段,第一阶段市场活跃度跃,两市成交量也达到了一阶段性高峰;第二阶段市场在政策及其他因素影响下,逐步陷入调整,成交萎缩。

(四)宏观政策、证券市场及行业走势的简要展望
宏观上来看,我们从近期公布的一系列数据,如M1/M2增长速度、新增贷款量、CPI、投资增长速度尤其是房地产行业投资增长速度等综合判断,经济过热倾向已经相当明显,我们预期未来国家出台进一步的宏观调控政策难以避免。

(五)报告期内基金投资策略和业绩表现的说明与解释
截至报告期末,本报告期内基金净值增长率为86.41%,同期业绩比较基准增长率为41.03%。

二季度市场以5月30日为界,可以划分为两个阶段,第一阶段市场活跃度跃,两市成交量也达到了一阶段性高峰;第二阶段市场在政策及其他因素影响下,逐步陷入调整,成交萎缩。

(四)宏观政策、证券市场及行业走势的简要展望
宏观上来看,我们从近期公布的一系列数据,如M1/M2增长速度、新增贷款量、CPI、投资增长速度尤其是房地产行业投资增长速度等综合判断,经济过热倾向已经相当明显,我们预期未来国家出台进一步的宏观调控政策难以避免。

(五)报告期内基金投资策略和业绩表现的说明与解释
截至报告期末,本报告期内基金净值增长率为86.41%,同期业绩比较基准增长率为41.03%。

二季度市场以5月30日为界,可以划分为两个阶段,第一阶段市场活跃度跃,两市成交量也达到了一阶段性高峰;第二阶段市场在政策及其他因素影响下,逐步陷入调整,成交萎缩。

(四)宏观政策、证券市场及行业走势的简要展望
宏观上来看,我们从近期公布的一系列数据,如M1/M2增长速度、新增贷款量、CPI、投资增长速度尤其是房地产行业投资增长速度等综合判断,经济过热倾向已经相当明显,我们预期未来国家出台进一步的宏观调控政策难以避免。

(五)报告期内基金投资策略和业绩表现的说明与解释
截至报告期末,本报告期内基金净值增长率为86.41%,同期业绩比较基准增长率为41.03%。

二季度市场以5月30日为界,可以划分为两个阶段,第一阶段市场活跃度跃,两市成交量也达到了一阶段性高峰;第二阶段市场在政策及其他因素影响下,逐步陷入调整,成交萎缩。

(四)宏观政策、证券市场及行业走势的简要展望
宏观上来看,我们从近期公布的一系列数据,如M1/M2增长速度、新增贷款量、CPI、投资增长速度尤其是房地产行业投资增长速度等综合判断,经济过热倾向已经相当明显,我们预期未来国家出台进一步的宏观调控政策难以避免。

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。

(1) 投资收益
投资收益为对外发行的基金份额总额,由于申购和赎回引起的实收基金变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日确认,上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的基金份额的实收基金增加和转出实收基金的实收基金减少。

(11) 未实现利得(损失)
未实现利得(损失)包括因投资估值而产生的未实现估值增值(减)值和未实现利得(损失)平准金。

未实现利得(损失)平准金指在申购或赎回基金份额时,申购或赎回款项中包含的按未实现利得(损失)占基金净值比例计算的金额。未实现利得(损失)平准金于基金申购确认日或基金赎回的确认日确认。

(12) 损益平准金
损益平准金指在申购或赎回基金份额时,申购或赎回款项中包含的按未分配基金净收益(累计基金净损失)占基金净值比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日确认,并于期末全额转入未分配基金净收益(累计基金净损失)。

(13) 基金的收益分配政策
每一基金份额享有同等分配权。本基金收益以现金形式分配,但基金份额持有人可选择现金红利或将现金红利按红利发放日前一日的基金份额净值自动转为基金份额进行再投资。基金收益分配每年至多六次,每次基金收益分配比例不低于可分配收益的50%;如当年基金成立未满三个月,则不需分配收益,基金当期收益先弥补以前年度亏损后,方可进行当年收益分配。基金当年亏损,则不进行收益分配。

宣告的拟分配基金收益于分红除权日从持有人权益转出。

(14) 报告期内没有为处理对基金财务状况及基金运作有重大影响的事项而采取的其他会计政策和会计估计。

3、报告期内,本基金无重大会计差错。

4、重大关联方关系及关联交易
本基金成立于2006年11月7日,本半年报报告期没有过往年度的可比期间,本报告仅披露本报告期内发生的关联交易,特此说明。

(1) 关联方关系
关联方名称 与本基金的关系

华宝兴业基金管理有限公司 基金发起人、基金管理人、基金注册登记人、基金销售机构
中国银行股份有限公司(“中国银行”) 基金托管人、基金代理机构
华宝信托投资有限公司(“华宝信托”) 基金管理人的股东

(2) 关联方交易
下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

a. 基金管理人报酬
支付基金管理人华宝兴业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X1.5%/当年天数。

b. 基金托管费
支付基金托管人中国银行股份有限公司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X0.25%/当年天数。

c. 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银行股份有限公司保管,并按银行同业利率计息。基金托管人于2007年6月30日保管的银行存款余额为2,181,837,584.93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3,690,667.89元。

d. 由关联方通过银行间同业市场进行的债券交易
本基金在本会计期间与基金托管人中国银行股份有限公司通过银行间同业市场进行的债券交易如下:

金额单位:人民币元
项目 2007年1月1日至2007年6月30日期间
买入债券结算金额 0.00
卖出债券结算金额 499,278,000.00

e. 关联方持有的基金份额
基金管理人的关联方在本报告期内未对本基金进行投资。

f. 基金管理人持有的基金份额
基金管理人在本报告期内未对本基金进行投资。

g. 基金管理人投资于本基金份额
本基金期末基金管理人持有本基金基金份额为0.00份。

6. 流通受限资产
本基金可流通受限资产包括限售流通股股票,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申购协议认购的新股或增发新股,从新股发行日至新股上市日之间不能自由转让。

本基金截至2007年6月30日止流通受限的股票如下:

股票代码 股票名称 申购日期 可流通日期 申购价格(元) 数量(股) 期末成本总额 期末市值总额
601007 金龙鱼 2007-3-28 2007-7-10 4.25 1442 106.196 461,323.000

六、投资组合报告

(一) 报告期末基金资产组合情况

项目 金额(元) 占总资产比例
股票 5,073,329,136.94 69.34%

(二) 报告期末按行业分类的股票投资组合

序号 行业分类 市值(元) 市值占基金资产净值比例
1 A农林牧渔 55,650,304.10 0.76%

(三) 报告期末按市值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票明细

序号 股票代码 股票名称 数量(股) 期末市值(元) 市值占基金资产净值比例
1 600879 东方股份 13,200,000 306,988,000.00 4.19%

(四) 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产明细

序号 资产名称 公允价值(元) 公允价值占基金资产净值比例
1 601166 兴业银行 986,180,536.41 4.98%

(五) 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产明细

序号 资产名称 公允价值(元) 公允价值占基金资产净值比例
1 601166 兴业银行 986,180,536.41 4.98%

(六) 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产明细

序号 资产名称 公允价值(元) 公允价值占基金资产净值比例
1 601166 兴业银行 986,180,536.41 4.98%

(七) 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产明细

序号 资产名称 公允价值(元) 公允价值占基金资产净值比例
1 601166 兴业银行 986,180,536.41 4.98%

(八) 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产明细

序号 资产名称 公允价值(元) 公允价值占基金资产净值比例
1 601166 兴业银行 986,180,536.41 4.98%

(九) 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产明细

序号 资产名称 公允价值(元) 公允价值占基金资产净值比例
1 601166 兴业银行 986,180,536.41 4.98%

(十) 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产明细

序号 资产名称 公允价值(元) 公允价值占基金资产净值比例
1 601166 兴业银行 986,180,536.41 4.98%

(十一) 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产明细

序号 资产名称 公允价值(元) 公允价值占基金资产净值比例
1 601166 兴业银行 986,180,536.41 4.98%

2. 报告期内累计卖出价值超出期初基金资产净值2%或前20名的股票明细

序号 股票代码 股票名称 累计卖出金额(元) 占期初基金资产净值的比例
1 601398 工商银行 588,356,777.73 7.59%

3. 报告期内买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

买入股票成本总额 8,026,464,966.92
卖出股票收入总额 11,992,013,301.98

(五) 报告期末按券种分类的债券投资组合
本报告期末本基金债券投资组合市值为0.00元。

(六) 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
本报告期末本基金债券投资组合市值为0.00元。

(七) 基金资产支持证券投资
本基金本报告期末未发生资产支持证券投资,特此报告。

(八) 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,也没有在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚,无证券投资基金法律程序特别提示。

2. 本基金本报告期主要对像是先进企业股票,基金管理人建立了有基金股票备选库。本报告期末本基金的前10名股票投资没有超出基金合同规定的股票备选库。

3. 基金其他资产的构成

其他资产 金额(元)
交易保证金 7,960,569.21

4. 本基金在本报告期内未有在转股期内的可转换债券。

5. 本基金在本报告期内持有的权证证明如下:
(1) 权证公允价值变动情况如下:
(2) 主动投资:

权证代码 权证名称 数量(份) 成本(元)
580009 伊利CWB1 700,000.00 12,619,506.28

6. 本基金在本报告期内未有在转股期内的可转换债券。

7. 本基金管理人、托管人及其高级管理人员未出现受监管部门稽查或处罚的情形。

8. 基金租用交易席位情况
报告期内,本基金租用招商证券、西部证券、联合证券、富成证券、申银万国、光大证券、高华证券、东方证券8个交易专用席位。各券商专用席位交易和佣金情况如下:

序号 券商名称 股票交易量(元) 占交易总量比例 佣金(元) 占佣金总额比例

(1) 本基金2007年上半年债券和国债回购交易量情况如下:

序号 债券代码 债券交易量(元) 占交易总量比例 回购交易量(元) 占交易总量比例

(3) 本基金2007年上半年权证交易量情况如下:

序号 券商名称 权证交易量(元) 占交易总量比例

9. 根据基金管理人及中信金通证券有限责任公司签署的《证券投资基金销售代理协议》,中信金通证券自2007年6月19日起代理销售基金管理人管理的宝康系列基金(宝康消费品基金、宝康灵活配置基金和宝康债券基金)、多策略增长基金、现金宝货币市场基金、动力组合基金、收益增长基金和本基金。

基金管理人已于2007年1月19日在《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》发布了此事项公告。

10. 因建设银行系统调整,基金管理人直销专户的联名号于2007年3月7日进行更改。基金管理人已于2007年3月8日在《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》发布了此事项公告。

11. 根据基金管理人及中信金通证券有限责任公司签署的《证券投资基金销售代理协议》,中信金通证券自2007年4月24日起代理销售基金管理人管理的宝康系列基金(宝康消费品基金、宝康灵活配置基金和宝康债券基金)、多策略增长基金、现金宝货币市场基金、动力组合基金、收益增长基金和本基金。

基金管理人已于2007年4月24日在《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》发布了此事项公告。

12. 为满足广大投资者的理财需求,经中国建设银行股份有限公司同意,基金管理人从2007年4月26日起,通过建设银行开办收益增长基金、动力组合基金和本基金的定期定额投资业务。基金管理人已于2007年4月25日在《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》发布了此事项公告。

13. 为满足广大投资者的理财需求,经中国银行股份有限公司同意,基金管理人从2007年