华宝兴业宝康系列证券投资基金 2007 年半年度报告摘要

(上接 D81 版)

日基金托管费 = 前一日基金资产净值 X 0.20% / 当年天数。

本基金在本报告期需支付基金托管费 2,946,079.55 元。（去年同期的托管费为 287,191.11 元）

(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建设银行保管，并按银行间同业利率计息。基金托管人截止 2007 年 6 月 30 日保管的银行存款余额为 639,979,110.61 元。（基金托管人截止 2006 年 6 月 30 日保管的银行存款余额为 90,517,564.80 元）

本报告期由基金托管人保管的银行存款产生的利息收入为 3,069,694.68 元。（去年同期由基金托管人保管的银行存款产生的利息收入为 180,839.51 元）

(d) 与基金托管人之间通过银行间同业市场进行的债券交易（含回购）

本基金在本报告期及上年度可比区间的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：

金额单位：人民币元

	2007年1月1日至 2007年6月30日止期间		2006年1月1日至 2006年6月30日止期间	
	协议金额	利息支出	协议金额	利息支出
卖出回购证券	1,022,850,000.00	409,038.36	186,900,000.00	51,185.35
买入债券结算金额	208,160,960.00	0.00	0.00	0.00

(e) 关联方持有的基金份额

	2007年6月30日			2006年6月30日		
	基金份额（份）	净值（元）	占基金总份额的比例	基金份额（份）	净值（元）	占基金总份额的比例
宝钢集团	664,786,594.19	801,732,632.59	17.68%	317,257,984.80	322,461,015.75	67.50%
华宝信托	0.00	0.00	0.00%	76,876,601.61	78,137,377.88	16.36%

(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) 基金管理人员工投资基金份额

本报告期末基金管理人员工持有本基金共计 380,060.18 份，占本基金总份额的 0.0101%。

4）流通受限制不能自由转让的基金资产

根据中国证监会的政策规定和证券交易所的交易规则，基金认购或配售的新股在一定时期以内不能上市自由流通。本基金截至 2007 年 6 月 30 日止流通受限制的股票情况如下：

股票名称	成功申购日期	上市日期	可流通日期	申购价格(元)	期末估价（元）	成功申购股数（股）	成本（元）	市值（元）
交通银行	2007-4-27	2007-5-15	2007-8-16	7.90	10.99	3,302,188	26,087,285.20	36,291,046.12
中国远洋	2007-6-20	2007-6-26	2007-9-26	8.48	18.26	1,872,500	15,878,800.00	34,191,850.00
中信银行	2007-4-23	2007-4-27	2007-7-30	5.80	9.20	2,381,000	13,809,800.00	21,905,200.00
露天煤业	2007-4-10	2007-4-18	2007-7-18	9.80	36.10	87,837	860,802.60	3,170,915.70
广宇集团	2007-4-20	2007-4-27	2007-7-27	10.80	17.79	119,692	1,292,673.60	2,129,320.68
连云港	2007-4-17	2007-4-26	2007-7-26	4.98	14.60	138,007	687,274.86	2,014,902.20
天津普林	2007-4-26	2007-5-16	2007-8-16	8.28	17.51	95,400	789,912.00	1,670,454.00
中环股份	2007-4-10	2007-4-20	2007-7-20	5.81	15.52	98,899	574,603.19	1,534,912.48
金陵饭店	2007-3-26	2007-4-6	2007-7-10	4.25	14.42	106,196	451,333.00	1,531,346.32
东南网架	2007-5-11	2007-5-30	2007-8-30	9.60	23.24	46,891	450,153.60	1,089,746.84
拓邦电子	2007-6-22	2007-6-29	2007-9-29	10.48	60.00	17,838	186,942.24	1,070,280.00
恒星科技	2007-4-17	2007-4-27	2007-7-27	8.00	18.80	44,423	355,384.00	835,152.40
新民科技	2007-4-10	2007-4-18	2007-7-18	9.40	18.14	44,106	414,596.40	800,082.84
沃尔核材	2007-4-10	2007-4-20	2007-7-20	15.72	48.85	15,964	250,954.08	779,841.40
湘潭电化	2007-3-21	2007-4-3	2007-7-3	6.50	17.83	38,467	250,035.50	685,866.61
顺络电子	2007-6-5	2007-6-13	2007-9-13	13.60	34.31	19,675	267,580.00	675,049.25
银轮股份	2007-4-9	2007-4-18	2007-7-18	8.38	18.06	35,867	300,565.46	647,758.02
利欧股份	2007-4-17	2007-4-27	2007-7-27	13.69	30.31	19,284	263,997.96	584,498.04
天邦股份	2007-3-21	2007-4-3	2007-7-3	10.25	20.88	26,954	276,278.50	562,799.52
安纳达	2007-5-23	2007-5-30	2007-8-30	8.08	22.81	14,784	119,454.72	337,223.04
合计							63,568,426.91	112,508,245.46

说明：“期末估价”是以 2007 年 6 月 29 日的股票收盘价估值。

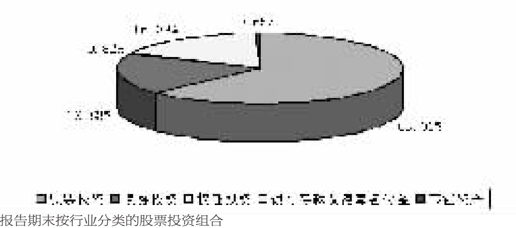
第六章 投资组合报告

1. 宝康消费品证券投资基金投资组合报告

（1）报告期末基金资产组合

截至 2007 年 6 月 30 日，本基金资产组合列表及图示如下：

类别	合计（元）	占基金总资产比例（%）
股票投资	3,434,689,239.69	63.01
债券投资	1,015,547,767.50	18.63
权证投资	44,800,000.00	0.82
银行存款及清算备付金	920,682,163.93	16.89
其它资产	35,185,680.48	0.65
合计	5,450,904,851.60	100.00



（2）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）	占净值比例（%）
1	农、林、牧、渔业	23,538,823.00	0.49
2	采掘业	232,594,316.51	4.85
3	制造业	1,685,650,383.90	35.13
	其中：食品、饮料	604,591,110.44	12.60
	纺织、服装、皮毛	800,082.84	0.02
	木材、家具	0.00	0.00
	造纸、印刷	12,969,610.90	0.27
	石油、化学、塑胶、塑料	237,874,946.15	4.96
	电子	3,880,415.73	0.08
	金属、非金属	210,475,328.24	4.39
	机械、设备、仪表	325,542,564.42	6.78
	医药、生物制品	288,736,483.78	6.02
	其他制造业	779,841.40	0.02
4	电力、煤气及水的生产和供应业	0.00	0.00
5	建筑业	95,138,660.04	1.98
6	交通运输、仓储业	74,503,729.50	1.55
7	信息技术业	0.00	0.00
8	批发和零售贸易	412,764,250.02	8.60
9	金融、保险业	687,588,374.24	14.33
10	房地产业	221,379,356.16	4.61
11	社会服务业	1,531,346.32	0.03
12	传播与文化产业	0.00	0.00
13	综合类	0.00	0.00
	合计	3,434,689,239.69	71.57

（3）报告期末基金投资股票前 10 名明细

序号	股票代码	股票名称	股票数量（股）	期末市值（元）	市值占基金净值比例（%）
1	600519	贵州茅台	2,100,000	251,328,000.00	5.2371
2	601318	中国平安	3,397,824	242,978,394.24	5.0631
3	600000	浦发银行	6,000,000	219,540,000.00	4.5747
4	000002	万 科 A	10,000,000	191,200,000.00	3.9842
5	600331	宏达股份	3,499,770	169,563,856.50	3.5333
6	600036	招商银行	6,600,000	162,228,000.00	3.3805
7	000419	通程控股	7,607,884	159,841,642.84	3.3308
8	600195	中牧股份	7,548,791	159,430,465.92	3.3222
9	000423	东阿阿胶	5,505,791	143,811,260.92	2.9967
10	000848	承德露露	4,204,550	121,931,950.00	2.5408

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 www.fsfund.com 网站的半年度报告正文。

（4）报告期内股票投资组合重大变动

1）累计买入重大变动

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额（元）	本期累计买入占期初基金资产净值比例(%)
1	600000	浦发银行	218,748,807.03	10.74
2	600331	宏达股份	188,250,154.12	9.24
3	601318	中国平安	185,322,828.89	9.10
4	600195	中牧股份	176,202,561.79	8.65
5	600036	招商银行	163,341,128.74	8.02
6	000755	山西三维	154,689,379.87	7.60
7	000419	通程控股	143,715,267.07	7.06
8	000002	万 科 A	140,137,048.66	6.88
9	600028	中国石化	135,022,307.05	6.63
10	600016	民生银行	121,589,228.25	5.97
11	600030	中信证券	121,410,962.15	5.96
12	600153	建发股份	110,062,228.61	5.41
13	000090	深 天 健	109,254,546.99	5.37
14	000898	鞍钢股份	104,752,029.43	5.14
15	000983	西山煤电	104,381,169.34	5.13
16	600309	烟台万华	101,093,683.43	4.96
17	600519	贵州茅台	90,802,602.32	4.46
18	600104	上海汽车	89,322,047.61	4.39
19	000651	格力电器	89,125,712.94	4.38
20	000623	吉林敖东	86,443,780.50	4.25
21	000157	中联重科	86,366,259.59	4.24
22	000878	云南铜业	82,769,851.35	4.06
23	000792	盐湖钾肥	81,936,673.81	4.02
24	002024	苏宁电器	80,201,729.22	3.94
25	000423	东阿阿胶	76,765,835.45	3.77
26	600761	安徽合力	75,351,588.24	3.70
27	600879	火箭股份	74,716,941.61	3.67
28	600596	新安股份	73,724,880.20	3.62
29	600316	洪都航空	72,837,406.57	3.58
30	600582	天地科技	72,092,435.96	3.54
31	000655	金岭矿业	68,845,491.31	3.38
32	601699	潞安环能	68,554,372.51	3.37
33	601006	大秦铁路	67,552,639.56	3.32
34	600900	长江电力	64,035,939.05	3.14
35	000338	潍柴动力	62,493,299.47	3.07
36	000858	五 粮 液	62,035,542.91	3.05
37	000401	冀东水泥	62,027,737.52	3.05
38	600067	冠城大通	56,197,397.00	2.76
39	600533	栖霞建设	55,781,385.76	2.74
40	600489	中金黄金	54,869,263.80	2.69
41	600973	宝胜股份	53,096,144.44	2.61
42	000516	开元控股	53,095,789.37	2.61
43	600064	南京高科	48,825,713.00	2.40
44	000063	中兴通讯	48,144,325.08	2.36
45	600809	山西汾酒	45,354,225.77	2.23
46	600058	五矿发展	43,612,378.39	2.14
47	000666	经纬纺机	43,456,678.09	2.13
48	000069	华侨城 A	42,762,124.49	2.10
49	002084	海鸥卫浴	42,702,879.12	2.10
50	600005	武钢股份	41,080,211.53	2.02
51	600230	沧州大化	40,738,830.22	2.00

2）累计卖出重大变动

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额（元）	本期累计卖出占期初基金资产净值比例(%)
1	600036	招商银行	221,862,009.89	10.90
2	600309	烟台万华	171,986,240.71	8.45
3	600028	中国石化	166,784,040.95	8.19
4	600016	民生银行	158,444,389.77	7.78
5	600030	中信证券	132,139,307.46	6.49
6	000157	中联重科	123,960,793.28	6.09
7	000898	鞍钢股份	113,671,778.41	5.58
8	000002	万 科 A	103,199,217.73	5.07
9	000755	山西三维	102,384,553.22	5.03
10	000792	盐湖钾肥	100,097,853.07	4.92
11	600879	火箭股份	96,915,796.18	4.76
12	600887	伊利股份	94,509,206.22	4.64
13	000069	华侨城 A	89,680,925.76	4.40
14	000623	吉林敖东	87,163,250.68	4.28
15	600316	洪都航空	85,246,996.49	4.19
16	000878	云南铜业	84,227,051.86	4.14
17	600761	安徽合力	81,687,854.03	4.01
18	600900	长江电力	77,376,093.86	3.80
19	600596	新安股份	76,797,154.26	3.77
20	600750	江中药业	70,240,594.78	3.45
21	600048	保利地产	69,988,181.55	3.44
22	000858	五 粮 液	68,173,420.33	3.35
23	000759	武汉中百	67,008,323.71	3.29
24	600519	贵州茅台	65,566,279.46	3.22
25	000895	双汇发展	64,812,376.88	3.18
26	601006	大秦铁路	62,532,782.91	3.07
27	600371	万向德农	61,385,516.49	3.01
28	600000	浦发银行	60,168,644.96	2.95
29	002069	獐 子 岛	59,076,855.98	2.90
30	600582	天地科技	57,248,380.10	2.81
31	601628	中国人寿	56,795,512.91	2.79
32	000729	燕京啤酒	55,671,163.82	2.73
33	600005	武钢股份	54,746,417.24	2.69
34	600973	宝胜股份	54,312,028.43	2.67
35	600331	宏达股份	52,763,714.63	2.59
36	600276	恒瑞医药	52,429,174.33	2.57
37	600415	小商品城	51,275,373.11	2.52
38	000063	中兴通讯	47,418,705.34	2.33
39	600064	南京高科	47,233,991.09	2.32
40	600809	山西汾酒	46,267,298.15	2.27
41	600533	栖霞建设	45,880,820.96	2.25
42	600230	沧州大化	43,466,109.42	2.13
43	600859	王府井	43,452,951.34	2.13
44	600009	上海机场	42,608,930.72	2.09
45	000024	招商地产	42,532,035.27	2.09
46	000402	金 融 街	42,054,418.51	2.07
47	600058	五矿发展	41,739,702.97	2.05
48	600677	航天通信	41,083,946.81	2.02
49	601398	工商银行	41,033,565.21	2.02

3）报告期买入股票成本及卖出股票收入

金额单位：人民币元

本期买入股票成本总额	本期卖出股票收入总额
5,955,022,098.53	5,485,834,470.37

（5）报告期末按券种分类的债券投资组合

序号	债券种类	市值（元）	占净值比例（%）
1	国家债券	135,668,767.50	2.8270
2	金融债券	879,879,000.00	18.3348
3	企业债券	0.00	0.0000
4	可转换债券	0.00	0.0000
	合计	1,015,547,767.50	21.1618

（6）报告期末基金债券投资前 5 名明细

序号	债券名称	市值（元）	占净值比例（%）
1	06农发 14	429,097,000.00	8.9415
2	04进出 02	170,238,000.00	3.5474
3	04国开 15	110,297,000.00	2.2984
4	06进出 05	89,847,000.00	1.8722
5	04国开(20)	80,400,000.00	1.6754

（7）基金资产支持证券投资明细

本基金本报告期内未发生资产支持证券投资，特此报告。

（8）投资组合报告附注

1）基金管理人没有发现本基金投资的前 10 名证券的发行主体在报告期内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，无证券投资决策程序需特别说明。

2）基金主要投资对象为消费品类股票，基金管理人建立有基金股票备选库。本报告期内本基金的前 10 名股票投资没有超出基金合同规定的股票备选库。

3）本基金投资组合中其他资产包括：交易保证金 1,310,565.32 元、应收证券清算款 7,821,545.78 元、应收利息 21,589,591.80 元、应收申购款 4,427,010.10 元、待摊费用 36,967.48 元。

4）本基金本报告期内未持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明细如下：

a. 股权分置改革被动持有：无。

b. 主动投资：

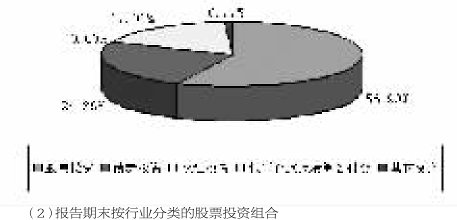
权证代码	权证名称	数量（份）	成本（元）
580005	万华 HXB1	170,000	5,512,431.94
580009	伊利 CWB1	484,263	9,296,818.72
580013	武钢 CWB1	113,490	262,990.38
030002	五粮 YGC1	1,834,050	45,815,315.80
合计		2,601,803	60,887,556.84

2. 宝康灵活配置证券投资基金投资组合报告

（1）报告期末基金资产组合

截至 2007 年 6 月 30 日，本基金资产组合列表及图示如下：

类别	合计(元)	占基金总资产比例（%）
股票投资	2,823,503,461.62	56.90
债券投资	1,208,852,956.57	24.36
权证投资	0.00	0.00
银行存款及清算备付金	891,268,735.03	17.96
其它资产	38,290,799.08	0.77
合计	4,961,915,952.30	100.00



（2）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）	占净值比例（%）
1	农、林、牧、渔业	0.00	0.00
2	采掘业	221,688,915.70	4.69
3	制造业	1,131,680,775.56	23.95
	其中：食品、饮料	52,442,799.52	1.11
	纺织、服装、皮毛	28,053,574.73	0.59
	木材、家具	0.00	0.00
	造纸、印刷	0.00	0.00
	石油、化学、塑胶、塑料	202,435,089.65	4.28
	电子	2,254,912.48	0.05
	金属、非金属	90,822,971.03	1.92
	机械、设备、仪表	611,027,437.73	12.93
	医药、生物制品	143,864,149.02	3.05
	其他制造业	779,841.40	0.02
4	电力、煤气及水的生产和供应业	21,960,000.00	0.46
5	建筑业	0.00	0.00
6	交通运输、仓储业	185,375,762.00	3.92
7	信息技术业	271,344,000.00	5.74
8	批发和零售贸易	106,904,000.00	2.26
9	金融、保险业	645,090,008.36	13.65
10	房地产业	60,360,000.00	1.28
11	社会服务业	179,100,000.00	3.79
12	传播与文化产业	0.00	0.00
13	综合类	0.00	0.00
	合计	2,823,503,461.62	59.76

（3）报告期末基金投资股票前 10 名明细

序号	股票代码	股票名称	股票数量（股）	期末市值（元）	市值占基金净值比例（%）
1	600879	火箭股份	10,700,000	284,513,000.00	6.0220
2	600000	浦发银行	6,600,000	241,494,000.00	5.1115
3	600100	同方股份	6,000,000	205,800,000.00	4.3560
4	000069	华侨城 A	4,500,000	179,100,000.00	3.7909
5	000338	潍柴动力	2,200,000	172,700,000.00	3.6554
6	601318	中国平安	2,300,000	164,473,000.00	3.4813
7	600309	烟台万华	2,700,000	144,612,000.00	3.0609
8	601600	中国铝业	5,800,000	133,864,000.00	2.8334
9	600428	中远航运	5,000,000	109,450,000.00	2.3166
10	600153	建发股份	5,600,000	106,904,000.00	2.2627

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 www.fsfund.com 网站的半年度报告正文。

（4）报告期内股票投资组合重大变动

1）累计买入重大变动

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额（元）	本期累计买入占期初基金资产净值比例(%)
1	600879	火箭股份	338,407,660.76	15.67
2	600000	浦发银行	322,899,292.92	14.96
3	601166	兴业银行	303,664,154.48	14.07
4	000069	华侨城 A	243,443,199.60	11.28
5	601318	中国平安	206,480,817.68	9.56
6	601398	工商银行	191,338,482.81	8.86
7	600100	同方股份	186,040,047.17	8.62
8	601628	中国人寿	184,517,270.70	8.55
9	000063	中兴通讯	175,581,816.10	8.13
10	600309	烟台万华	161,503,449.99	7.48
11	000402	金 融 街	158,307,407.88	7.33
12	000338	潍柴动力	149,766,522.91	6.94
13	601006	大秦铁路	147,370,753.82	6.83
14	600048	保利地产	144,834,590.27	6.71
15	600050	中国联通	128,235,424.73	5.94
16	000898	鞍钢股份	126,400,851.64	5.85
17	600489	中金黄金	122,704,593.61	5.68
18	000001	深发展 A	119,161,912.22	5.52
19	600153	建发股份	118,876,859.91	5.51
20	002106	莱宝高科	111,780,571.70	5.18
21	000002	万 科 A	109,132,370.62	5.05
22	600428	中远航运	106,563,989.17	4.94
23	000568	泸州老窖	102,422,679.32	4.74
24	600547	山东黄金	100,912,473.80	4.67
25	600129	太极集团	98,776,105.47	4.58
26	000807	云铝股份	97,888,404.82	4.53
27	600809	山西汾酒	96,690,143.18	4.48
28	600519	贵州茅台	93,781,833.47	4.34
29	000970	中科三环	90,354,311.44	4.19
30	600456	宝钛股份	88,837,615.87	4.11
31	600815	厦工股份	80,578,223.64	3.73
32	600750	江中药业	77,655,031.44	3.60
33	000562	宏源证券	74,179,636.48	3.44
34	000983	西山煤电	68,655,564.24	3.18
35	600755	厦门国贸	67,702,765.22	3.14
36	600331	宏达股份	66,067,805.18	3.06
37	600122	宏图高科	65,243,722.30	3.02
38	601699	潞安环能	64,849,386.90	3.00
39	000823	超声电子	64,224,670.72	2.97
40	000612	焦作万方	61,459,320.70	2.85
41	000401	冀东水泥	60,753,496.21	2.81
42	600030	中信证券	59,306,407.17	2.75
43	600015	华夏银行	58,098,656.15	2.69
44	600897	厦门空港	57,337,019.06	2.66
45	000400	许继电气	57,313,134.11	2.65
46	600895	张江高科	56,214,155.45	2.60
47	000858	五 粮 液	55,728,507.93	2.58
48	600973	宝胜股份	53,790,080.52	2.49
49	000709	唐钢股份	52,653,537.72	2.44
50	600675	中华企业	50,944,759.51	2.36
51	600323	南海发展	49,813,690.32	2.31
52	600582	天地科技	49,336,603.34	2.29
53	600371	万向德农	49,101,374.12	2.27
54	600663	陆家嘴	48,744,692.32	2.26
55	600423	柳化股份	46,321,050.34	2.15
56	600348	国阳新能	46,275,100.50	2.14
57	600533	栖霞建设	45,969,832.86	2.13
58	000792	盐湖钾肥	44,139,022.83	2.04
59	000410	沈阳机床	44,066,573.71	2.04
60	600005	武钢股份	43,880,636.98	2.03
61	600472	包头铝业	43,867,713.26	2.03
62	000039	中集集团	43,228,246.70	2.00

2）累计卖出重大变动

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额（元）	本期累计卖出占期初基金资产净值比例(%)
1	000069	华侨城 A	370,955,260.13	17.18
2	601166	兴业银行	321,848,299.22	14.91
3	600048	保利地产	284,811,421.00	13.19
4	600879	火箭股份	231,560,187.44	10.73
5	000402	金 融 街	222,452,503.70	10.30
6	601398	工商银行	208,469,448.57	9.66
7	000568	泸州老窖	193,697,634.32	8.97
8	601006	大秦铁路	188,148,723.28	8.71
9	000063	中兴通讯	183,128,072.64	8.48
10	601318	中国平安	164,655,286.61	7.63
11	000898	鞍钢股份	164,238,165.28	7.61
12	000807	云铝股份	161,623,014.35	7.49
13	600000	浦发银行	151,921,189.16	7.04
14	000001	深发展 A	148,961,784.93	6.90
15	000970	中科三环	148,859,900.28	6.89
16	600755	厦门国贸	147,892,657.77	6.85
17	600309	烟台万华	134,948,974.60	6.25
18	601699	潞安环能	125,474,240.30	5.81
19	600050	中国联通	122,758,659.53	5.69
20	600036	招商银行	119,807,395.12	5.55
21	000709	唐钢股份	115,462,149.42	5.35
22	600547	山东黄金	111,034,183.52	5.14
23	600815	厦工股份	106,637,759.44	4.94
24	600895	张江高科	104,511,520.38	4.84
25	000002	万 科 A	103,315,251.15	4.79
26	002106	莱宝高科	103,226,040.11	4.78
27	601628	中国人寿	102,262,849.74	4.74
28	600030	中信证券	101,394,183.94	4.70
29	600809	山西汾酒	100,903,382.82	4.67
30	000401	冀东水泥	95,859,499.48	4.44
31	600519	贵州茅台	95,340,416.65	4.42
32	000823	超声电子	94,477,943.63	4.38
33	000825	太钢不锈	93,835,200.08	4.35
34	600005	武钢股份	90,768,994.12	4.20
35	600331	宏达股份	89,299,163.32	4.14
36	000039	中集集团	86,003,178.99	3.98
37	000612	焦作万方	84,150,175.98	3.90
38	600533	栖霞建设	78,987,512.81	3.66
39	600663	陆家嘴	76,393,302.42	3.54
40	000060	中金岭南	74,421,011.16	3.45
41	000562	宏源证券	73,371,496.94	3.40
42	600348	国阳新能	72,891,887.51	3.38
43	600489	中金黄金	72,665,791.72	3.37
44	600153	建发股份	70,118,319.82	3.25
45	600456	宝钛股份	69,199,077.29	3.21
46	000983	西山煤电	67,771,749.37	3.14
47	601988	中国银行	67,322,966.76	3.12
48	600423	柳化股份	65,030,719.68	3.01
49	600100	同方股份	63,532,995.71	2.94
50	600675	中华企业	63,436,966.65	2.94
51	600900	长江电力	62,223,388.68	2.88
52	600015	华夏银行	61,661,832.44	2.86
53	600122	宏图高科	60,478,775.03	2.80
54	600276	恒瑞医药	59,903,274.00	2.77
55	000410	沈阳机床	59,538,401.22	2.76
56	600472	包头铝业	56,652,913.99	2.62
57	000858	五 粮 液	54,569,313.70	2.53
58	000061	农 产 品	52,493,155.65	2.43
59	000652	泰达股份	50,043,712.81	2.32
60	600582	天地科技	49,450,888.64	2.29
61	600366	宁波韵升	48,095,282.77	2.23
62	600009	上海机场	47,946,874.10	2.22
63	600012	皖通高速	44,183,799.92	2.05
64	000792	盐湖钾肥	43,483,883.80	2.01

3）报告期买入股票成本及卖出股票收入

金额单位：人民币元

本期买入股票成本总额	本期卖出股票收入总额
7,028,430,498.80	7,915,590,959.79

（5）报告期末按券种分类的债券投资组合

序号	债券种类	市值（元）	占净值比例（%）
1	国家债券	939,041,398.60	19.8759
2	金融债券	269,811,557.97	5.7109
3	企业债券	0.00	0.0000
4	可转换债券	0.00	0.0000
	合计	1,208,852,956.57	25.5868

（6）报告期末基金债券投资前 5 名明细

序号	债券名称	市值（元）	占净值比例（%）
1	06央行票据 51	194,740,000.00	4.1219
2	04进出 02	150,210,000.00	3.1794
3	21国债⒂	138,522,392.40	2.9320
4	07央行票据 52	119,184,000.00	2.5227
5	02国债⑽	117,840,000.00	2.4942

（7）基金资产支持证券投资明细

本基金本报告期内未发生资产支持证券投资，特此报告。

（8）投资组合报告附注

1）基金管理人没有发现本基金投资的前 10 名证券的发行主体在报告期内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，无证券投资决策程序需特别说明。

2）本基金股票主要投资对象为上证 180 指数、深圳 100 指数的成分股。本基金投资的前 10 名股票均为合同规定的成分股。

3）本基金投资组合中其他资产包括：交易保证金 5,691,232.82 元、应收利息 24,748,721.94 元、应收申购款 7,813,876.03 元、待摊费用 36,968.29 元。

4）本基金本报告期内未持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明细如下：

a. 股权分置改革被动持有：无。

b. 主动投资：

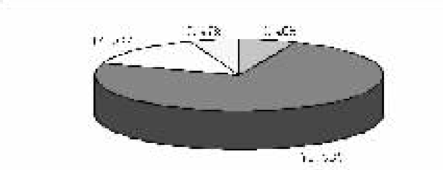
权证代码	权证名称	数量（份）	成本（元）
031001	侨城 HQC1	500,100	6,724,924.83
580013	武钢 CWB1	4,498,472	10,424,309.17
合计		4,998,572	17,149,234.00

3. 宝康债券投资基金投资组合报告

（1）报告期末基金资产组合

截至 2007 年 6 月 30 日，本基金资产组合列表及图示如下：

类别	合计（元）	占基金总资产比例（%）
股票投资	295,220,028.65	6.46
债券投资	3,381,766,737.70	73.98
银行存款及清算备付金	644,265,947.54	14.09
其它资产	250,026,200.76	5.47
合计	4,571,278,914.65	100.00



（2）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）	占净值比例（%）
1	农、林、牧、渔业	3,416,400.00	0.08
2	采掘业	3,170,915.70	0.07
3	制造业	37,134,268.19	0.82
	其中：食品、饮料	562,799.52	0.01
	纺织、服装、皮毛	800,082.84	0.02
	木材、家具	0.00	0.00
	造纸、印刷	0.00	0.00
	石油、化学、塑胶、塑料	1,023,089.65	0.02
	电子	13,112,743.77	0.29
	金属、非金属	9,865,800.24	0.22
	机械、设备、仪表	10,989,910.77	0.24
	医药、生物制品	0.00	0.00
	其他制造业	779,841.40	0.02
4	电力、煤气及水的生产和供应业	0.00	0.00
5	建筑业	1,089,746.84	0.02
6	交通运输、仓储业	58,776,112.20	1.30
7	信息技术业	0.00	0.00
8	批发和零售贸易	0.00	0.00
9	金融、保险业	187,971,918.72	4.15
10	房地产业	2,129,320.68	0.05
11	社会服务业	1,531,346.32	0.03
12	传播与文化产业	0.00	0.00
13	综合类	0.00	0.00
	合计	295,220,028.65	6.51

（3）报告期末基金投资股票前 10 名明细

序号	股票代码	股票名称	股票数量（股）	期末市值（元）	市值占基金净值比例（%）
1	601318	中国平安	1,100,000	78,661,000.00	1.7348
2	601919	中国远洋	3,108,500	56,761,210.00	1.2518
3	601328	交通银行	3,485,188	38,302,216.12	0.8447
4	601628	中国人寿	767,660	31,558,502.60	0.6960
5	601998	中信银行	2,381,000	21,905,200.00	0.4831
6	601166	兴业银行	500,000	17,545,000.00	0.3869
7	002106	莱宝高科	242,804	7,286,548.04	0.1607
8	002122	天马股份	78,709	5,996,838.71	0.1323
9	002069	獐 子 岛	45,000	3,416,400.00	0.0753
10	002128	露天煤业	87,837	3,170,915.70	0.0699

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 www.fsfund.com 网站的半年度报告正文。

（4）报告期内股票投资组合重大变动

1）累计买入重大变动

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额（元）	本期累计买入占期初基金资产净值比例(%)
1	601318	中国平安	54,113,800.00	3.25
2	601328	交通银行	27,532,985.20	1.65
3	601919	中国远洋	26,360,080.00	1.58
4	601166	兴业银行	24,960,760.00	1.50
5	601998	中信银行	18,937,000.00	1.14
6	601003	柳钢股份	3,360,040.00	0.20
7	601002	晋亿实业	3,065,798.46	0.18
8	600501	航天晨光	3,046,819.18	0.18
9	002122	天马股份	2,282,561.00	0.14
10	002110	三钢闽光	2,271,702.00	0.14
11	002128	露天煤业	2,257,302.60	0.14
12	600527	江南高纤	2,194,810.00	0.13
13	002109	兴化股份	2,118,538.80	0.13
14	000739	普洛康裕	1,754,955.52	0.11
15	002133	广宇集团	1,676,073.60	0.10
16	002134	天津普林	1,543,392.00	0.09
17	002129	中环股份	1,190,463.19	0.07
18	002127	新民科技	1,016,196.40	0.06
19	601008	连云港	891,454.86	0.05
20	002113	天润发展	880,008.96	0.05

2）累计卖出重大变动

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额（元）	本期累计卖出占期初基金资产净值比例(%)
1	601398	工商银行	65,468,928.95	3.93
2	601166	兴业银行	36,665,167.09	2.20
3	601318	中国平安	28,171,314.88	1.69
4	601006	大秦铁路	27,579,982.80	1.65
5	601628	中国人寿	19,357,482.78	1.16
6	601588	北辰实业	15,191,107.64	0.91
7	601333	广深铁路	11,026,158.31	0.66
8	601998	中信银行	7,946,408.27	0.48
9	601872	招商轮船	7,473,840.37	0.45
10	601991	大唐发电	7,229,591.32	0.43
11	600048	保利地产	6,459,859.58	0.39
12	601988	中国银行	5,909,865.64	0.35
13	601002	晋亿实业	5,823,376.71	0.35
14	600000	浦发银行	5,453,471.19	0.33
15	601003	柳钢股份	5,027,669.58	0.30
16	002110	三钢闽光	4,659,522.33	0.28
17	002128	露天煤业	3,736,147.06	0.22
18	002092	中泰化学	3,703,254.17	0.22
19	600501	航天晨光	3,623,817.34	0.22
20	002109	兴化股份	3,327,363.76	0.20

3）报告期买入股票成本及卖出股票收入

金额单位：人民币元

本期买入股票成本总额	本期卖出股票收入总额
190,757,702.43	330,999,637.38

（5）报告期末按券种分类的债券投资组合

序号	债券种类	市值（元）	占净值比例（%）
1	国家债券	3,130,591,995.68	69.0409
2	金融债券	179,668,425.00	3.9623
3	企业债券	0.00	0.0000
4	可转换债券	71,506,317.02	1.5770
	合计	3,381,766,737.70	74.5802

（6）报告期末基金债券投资前 5 名明细

序号	债券名称	市值（元）	占净值比例（%）
1	07央行票据 52	595,846,913.08	13.1406
2	06央行票据 70	534,875,000.00	11.7959
3	07央行票据 31	281,184,000.00	6.2011
4	06央行票据 64	213,862,000.00	4.7164
5	07央行票据 55	198,600,000.00	4.3798

（7）基金资产支持证券投资明细

本基金本报告期内未发生资产支持证券投资，特此报告。

（8）投资组合报告附注

1）基金管理人没有发现本基金投资的前 10 名证券的发行主体在报告期内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，无证券投资决策程序需特别说明。

2）本基金为债券基金，没有特定股票备选库。所投资的股票均为按基金合同规定在一级市场申购所得股票。

3）本基金投资组合中其他资产包括：交易保证金 250,000.00 元、应收股利 34,200.00 元、应收利息 47,028,208.63 元、应收申购款 202,676,823.84 元、待摊费用 36,968.29 元。

4）本基金持有的在转股期内的可转换债券明细如下：

序号	可转债代码	可转债名称	期末市值（元）	市值占基金资产净值比例（%）
1	110021	上电转债	36,716,400.00	0.8097
2	110232	金鹰转债	14,707,373.80	0.3244

5）本基金根据基金合同不进行权证投资。

第七章 基金份额持有人户数、持有人结构

本基金持有人户数及持有人结构列表如下：

基金名称	总持有人户数	持有人户均持有基金份额（份）	机构投资人持有份额（份）	个人投资人持有份额（份）	机构投资人持有份额比例	个人投资人持有份额比例
宝康消费品基金	131,318	28,827.21	900,078,685.66	2,885,453,035.98	23.78%	76.22%
宝康灵活配置基金	105,096	28,045.45	680,637,148.10	2,266,827,894.66	23.09%	76.91%
宝康债券基金	3,785	993,326.72	3,639,689,503.70	120,052,130.84	96.81%	3.19%

第八章 基金份额变动情况

1. 基金合同生效日基金总份额

基金	基金合同生效日基金总份额（份）
宝康消费品	1,541,018,133.75
宝康灵活配置	1,067,242,501.27
宝康债券	1,287,588,981.98

2. 本基金在报告期内基金份额的变动情况列表如下：

单位：份

基金名称	期初总份额	期末总份额	期间总申购份额	期间总赎回份额
宝康消费品	935,598,818.93	3,785,531,721.64	5,200,146,536.37	2,350,213,633.66
宝康灵活配置	965,342,785.71	2,947,465,042.76	5,416,089,991.29	3,433,967,734.24
宝康债券	1,523,483,486.25	3,759,741,634.54	3,501,228,339.64	1,264,970,191.35
合计	3,424,425,090.89	10,492,738,398.94	14,117,464,867.30	7,049,151,559.25

报告期内宝康消费品基金于 3 月 26 日进行基金份额拆分，由拆分导致的新增基金份额计入期间总申购份额，共计 1,137,381,642.76 份。特此说明。

第九章 重大事件揭示

1. 报告期内本基金未召开基金份额持有人大会。

2. 报告期内本基金管理人、基金托管人的基金托管部门未发生重大人事变动。

3. 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。

4. 报告期内本基金投资策略未发生改变。

5. 本系列基金在本报告期内进行了一次收益分配：

基金管理人按照 2007 年 1 月 19 日基金权益登记情况，将基金可分配收益向宝康灵活配置基金份额持有人按每 10 份基金单位派发红利 13.90 元。

基金管理人已于 2007 年 1 月 22 日在《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》发布了此收益分配事项公告。

6. 本基金未变更负责审计的会计师事务所。

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. 宝康消费品基金租用交易席位情况

报告期内，本基金共租用国泰君安证券（2 个席位）、中信建投、海通证券、中金国际、长江证券、联合证券、中信证券和国信证券等 9 个交易专用席位。报告期内租用券商专用席位无变更，各券商专用席位交易和佣金情况如下：

（1）宝康消费品基金 2007 年上半年股票交易量和实付佣金情况如下：

序号	券商名称	股票交易量（元）	占总交易量比例（%）	佣金（元）	占佣金总量比例（%）
1	国泰君安	4,714,785,331.08	41.53	3,853,851.55	42.14
2	联合证券	47,574,292.71	0.42	39,008.60	0.43
3	长江证券	946,761,042.92	8.34	740,845.75	8.10
4	海通证券	1,745,203,549.69	15.37	1,428,953.83	15.63
5	中金国际	233,631,060.59	2.06	190,488.88	2.08
6	中信证券	674,346,375.27	5.94	551,440.32	6.03
7	国信证券	2,991,129,716.24	26.35	2,340,580.64	25.59
	合计	11,353,431,368.50	100.00	9,145,169.57	100.00

（2）宝康消费品基金 2007 年上半年债券和国债回购交易量情况如下：

序号	券商名称	债券交易量（元）	占交易量比例（%）	回购交易量（元）	占交易量比例（%）
1	国泰君安	102,520,249.90	28.55	0.00	0.00
2	联合证券	212,688.00	0.06	0.00	0.00
3	长江证券	0.00	0.00	0.00	0.00
4	海通证券	73,681,547.20	20.52	272,700,000.00	64.01
5	中金国际	31,986,744.40	8.91	153,300,000.00	35.99
6	中信证券	150,707,131.00	41.97	0.00	0.00
7	国信证券	0.00	0.00	0.00	0.00
	合计	359,108,360.50	100.00	426,000,000.00	100.00

9.宝康灵活配置基金租用交易席位情况

报告期内，本基金共租用中银国际、申银万国、中信建投、联合证券、招商证券、国元证券、中信证券和平安证券等 8 个交易专用席位。报告期内租用券商专用席位无变更，各券商专用席位交易和佣金情况如下：

（1）宝康灵活配置基金 2007 年上半年股票交易量和实付佣金情况如下：

序号	券商名称	股票交易量（元）	占总交易量比例（%）	佣金（元）	占佣金总量比例（%）
1	中银国际	6,421,015,976.31	43.26	5,256,562.82	44.00
2	申银万国	1,003,475,304.97	6.76	819,430.80	6.86
3	中信建投	3,716,232,053.97	25.04	2,907,978.59	24.34
4	联合证券	1,798,902,142.89	12.12	1,407,653.02	11.78
5	招商证券	471,326,767.06	3.18	382,735.33	3.20
6	平安证券	1,430,625,199.69	9.64	1,171,750.39	9.81
	合计	14,841,577,444.89	100.00	11,946,110.95	100.00

（2）宝康灵活配置基金 2007 年上半年债券和国债回购情况如下：

序号	券商名称	债券交易量（元）	占交易量比例（%）	回购交易量（元）	占交易量比例（%）
1	中银国际	300,439,192.00	44.59	1,198,800,000.00	55.66
2	申银万国	63,611,588.70	9.44	555,100,000.00	25.77
3	中信建投	911,840.00	0.14	0.00	0.00
4	联合证券	1,495,300.00	0.22	0.00	0.00
5	招商证券	223,038,523.90	33.10	300,000,000.00	13.93
6	平安证券	84,352,500.40	12.52	100,000,000.00	4.64
	合计	673,848,945.00	100.00	2,153,900,000.00	100.00

10.宝康债券基金租用交易席位情况

报告期内，本基金共租用申银万国和联合证券等 2 个交易专用席位。报告期内本基金租用券商专用席位没有变更，各券商专用席位交易和佣金情况如下：

（1）宝康债券基金 2007 年上半年股票交易量和实付佣金情况如下：

序号	券商名称	股票交易量（元）	占总交易量比例（%）	佣金（元）	占佣金总量比例（%）
1	申银万国	265,181,046.09	80.00	223,294.51	81.14
2	联合证券	66,308,979.60	20.00	51,887.27	18.86
	合计	331,490,025.69	100.00	275,181.78	100.00

（2）宝康债券基金 2007 年上半年债券和回购交易量情况如下：

序号	券商代码	债券交易量（元）	占交易量比例（%）	回购交易量（元）	占交易量比例（%）
1	申银万国	130,606,768.20	60.84	2,199,000,000.00	100.00
2	联合证券	84,076,301.97	39.16	0.00	0.00
	合计	214,683,070.17	100.00	2,199,000,000.00	100.00

11.根据基金管理人与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 1 月 19 日起代理销售基金管理人所管理的本系列基金（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、收益增长基金和先进成长基金。

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。

12.根据基金管理人与平安证券有限责任公司签署的《证券投资基金销售代理协议》，平安证券自 2007 年 1 月 22 日起代理销售基金管理人所管理的本系列基金（宝康消费品基金、宝康灵活配置基金和宝康债券基金）、多策略增长基金和现金宝货币市场基金。

基金管理人已于 2007 年 1 月 20 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.因建设银行系统调整，基金管理人直销专户的联行号于 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。

14.基金管理人于 2007 年 3 月 26 日对宝康消费品基金进行了基金份额拆分操作。当日该基金拆分前基金份额净值为 2.4877 元，精确到小数点后第 9 位为 2.487739364，基金管理人按照 1:2.487739364 的拆分比例对该基金的份额进行了拆分。拆分后，基金份额净值变为 1.0000 元，相应地，原来每 1 份基金份额变为 2.487739364 份。基金份额计算结果保留到小数点后 2 位，小数点 2 位以后的部分舍去，舍去部分所代表的资产归基金财产所有。基金管理人根据上述拆分比例，对该基金各持有人的基金份额进行了计算，并于 2007 年 3 月 26 日进行了变更登记。

基金管理人已于 2007 年 3 月 20 日和 2007 年 3 月 27 日在《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》发布了此事项公告。

15.根据基金管理人与兴业证券股份有限公司签署的《证券投资基金销售代理协议》，兴业证券自 2007 年 3 月 21 日起代理销售基金管理人所管理的本系列基金（宝康消费品基金、宝康灵活配置基金和宝康债券基金）。

基金管理人已于 2007 年 3 月 21 日在《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》发布了此事项公告。

16.因工作需要，经基金管理人董事会研究决定，自 2007 年 4 月 12 日起聘任王孝德先生担任宝康消费品证券投资基金的基金经理，与该基金现任基金经理栾杰先生共同管理该基金。以上任职已报中国证监会上海证管局备案。

基金管理人已于 2007 年 4 月 12 日在《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》发布了此事项公告。

17.根据基金管理人与国信证券有限责任公司签署的《证券投资基金销售代理协议》，国信证券自 2007 年 4 月 24 日起代理销售基金管理人所管理的本系列基金（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、收益增长基金和先进成长基金。

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。

18.根据中国证券监督管理委员会基金部通知[2007]10 号《关于统一规范证券投资基金认(申)购费用及认(申)购份额计算方法有关问题的通知》要求，自 2007 年 6 月 1 日起，基金管理人所管理的本系列基金（包括宝康消费品基金、宝康灵活配置基金和宝康债券基金）、多策略增长基金、收益增长基金的有效申购申请的申购费用及申购份额的计算统一采用外扣法。

基金管理人已于 2007 年 5 月 23 日在《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》发布了此事项公告。

19.为方便个人投资者通过网上交易方式投资基金管理人所管理的开放式基金，基金管理人 2007 年 6 月 11 日起推出面向兴业银行股份有限公司借记卡持卡人的基金网上交易业务。适用于基金管理人所管理的本系列基金（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、收益增长基金和先进成长基金。

基金管理人已于 2007 年 6 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。

20.根据基金管理人与中信万通证券有限责任公司签署的《证券投资基金销售代理协议》，中信万通证券自 2007 年 6 月 13 日起代理销售基金管理人所管理的本系列基金（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、先进成长基金和行业精选基金。

基金管理人已于 2007 年 6 月 12 日在《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》发布了此事项公告。

华宝兴业基金管理有限公司
2007 年 8 月 28 日