鸿阳证券投资基金 2007 年年度报告摘要

（上接D109版）

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	139,548,276.85	2.74
3	C 制造业	1,786,677,685.16	35.05
	其中:C0食品、饮料	334,775,331.65	6.57
	C1纺织、服装、皮毛	362,560.40	0.01
	C2木材、家具	---	---
	C3造纸、印刷	4,353,018.00	0.09
	C4石油、化学、塑胶、塑料	28,913,253.64	0.57
	C5电子	57,043,953.17	1.12
	C6金属、非金属	254,115,215.33	4.99
	C7 机械、设备、仪表	745,063,894.96	14.62
	C8 医药、生物制品	357,345,021.33	7.01
	C99其他制造业	4,705,436.68	0.09
4	D电力、煤气及水的生产和供应业	176,457,721.12	3.46
5	E建筑业	---	---
6	F交通运输、仓储业	440,221,051.41	8.64
7	G信息技术业	166,301,030.99	3.26
8	H批发和零售贸易	11,678,383.14	0.23
9	I金融、保险业	694,645,931.14	13.63
10	J房地产业	93,358,595.34	1.83
11	K社会服务业	1,077,828.77	0.02
12	L传播和文化产业	130,664,200.15	2.56
13	M综合类	137,579,959.11	2.71
	合 计	3,778,210,663.18	74.13

（三）基金投资前十名股票明细

序号	股票代码	股票名称	库存数量(股)	期末市值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	000951	中国重汽	5,297,785	351,243,145.50	6.89
2	601006	大秦铁路	11,250,714	288,243,292.68	5.66
3	000858	五 粮 液	5,485,519	249,481,404.12	4.89
4	600036	招商银行	4,540,444	179,937,795.72	3.53
5	600085	同仁堂	5,148,877	179,695,807.30	3.53
6	000001	深发展A	4,177,010	161,232,586.00	3.16
7	000839	中信国安	4,568,344	157,607,868.00	3.09
8	600786	东方锅炉	1,823,547	153,998,544.15	3.02
9	600089	特变电工	4,659,962	150,656,571.46	2.96
10	002102	冠福家用	5,042,335	145,219,248.00	2.85

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、累计买入金额前20名或超过期初资产净值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	423,881,857.44	12.01%
2	601006	大秦铁路	381,883,911.50	10.82
3	600036	招商银行	319,833,976.47	9.06
4	601628	中国人寿	240,174,798.07	6.81
5	000951	中国重汽	237,005,905.72	6.72
6	000858	五 粮 液	235,404,821.39	6.67
7	000002	万 科A	221,605,237.80	6.28
8	000089	深圳机场	212,855,438.36	6.03
9	600649	原水股份	189,077,236.12	5.36
10	600795	国电电力	187,007,787.10	5.30
11	000983	西山煤电	174,140,598.73	4.94
12	000069	华侨城A	172,130,557.00	4.88
13	600737	中粮屯河	171,597,917.86	4.86
14	000839	中信国安	168,030,664.19	4.76
15	600085	同仁堂	164,199,727.76	4.65
16	000001	深发展A	161,802,711.09	4.59
17	600019	宝钢股份	160,057,669.39	4.54
18	600219	南山铝业	158,125,522.31	4.48
19	000825	太钢不锈	157,960,120.81	4.48
20	601318	中国平安	157,083,971.23	4.45
21	600718	东软股份	132,073,785.01	3.74
22	600028	中国石化	130,614,781.28	3.70
23	000539	粤电力A	128,899,634.92	3.65
24	600616	第一食品	128,664,228.37	3.65
25	000039	中集集团	128,663,300.52	3.65
26	600088	中视传媒	125,379,824.26	3.55
27	600283	钱江水利	125,125,629.02	3.55
28	000900	现代投资	122,648,808.47	3.48
29	601939	建设银行	122,064,696.93	3.46
30	600236	桂冠电力	121,193,260.87	3.43
31	600007	中国国贸	121,124,825.89	3.43
32	600879	火箭股份	115,429,122.92	3.27
33	600717	天津港	113,945,588.15	3.23
34	600005	武钢股份	112,613,550.87	3.19
35	600832	东方明珠	110,549,505.52	3.13
36	000800	一汽轿车	108,376,480.50	3.07
37	600809	山西汾酒	108,352,156.89	3.07
38	601166	兴业银行	106,587,152.46	3.02
39	600786	东方锅炉	103,771,587.60	2.94
40	600016	民生银行	102,432,646.81	2.90
41	000088	盐 田 港	99,154,195.23	2.81
42	600436	片仔癀	95,795,415.19	2.72
43	600584	长电科技	91,234,633.50	2.59
44	600015	华夏银行	90,445,216.89	2.56
45	600858	银座股份	89,951,022.50	2.55
46	002102	冠福家用	89,280,952.66	2.53
47	000423	东阿阿胶	89,229,605.66	2.53
48	000400	许继电气	86,490,376.04	2.45
49	601088	中国神华	83,169,378.69	2.36
50	002146	荣盛发展	82,287,811.13	2.33
51	000410	沈阳机床	79,847,734.54	2.26
52	000617	石油济柴	79,110,221.12	2.24
53	600383	金地集团	77,664,612.85	2.20
54	000402	金 融 街	77,552,204.64	2.20
55	000021	长城开发	77,493,933.58	2.20
56	000568	泸州老窖	76,529,223.45	2.17
57	002056	横店东磁	76,461,870.43	2.17
58	600050	中国联通	73,473,041.43	2.08
59	000717	韶钢松山	73,473,041.43	2.07
60	600428	中远航运	71,238,856.54	2.02
61	000031	中粮地产	71,077,577.08	2.01

2、累计卖出金额前20名或超过期初资产净值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	578,267,236.70	16.39
2	000002	万 科A	418,902,693.28	11.87
3	600036	招商银行	386,761,076.00	10.96
4	600019	宝钢股份	343,360,245.37	9.73
5	000069	华侨城A	303,490,898.52	8.60
6	600795	国电电力	288,100,988.84	8.17
7	000039	中集集团	260,965,263.18	7.40
8	000858	五 粮 液	260,762,317.84	7.39
9	000024	招商地产	245,479,954.59	6.96
10	600028	中国石化	244,435,736.61	6.93
11	601006	大秦铁路	242,775,149.16	6.88
12	601398	工商银行	226,914,325.50	6.43
13	600718	东软股份	214,150,472.49	6.07
14	000983	西山煤电	200,931,310.36	5.69
15	600016	民生银行	198,310,543.03	5.62
16	600219	南山铝业	195,429,115.08	5.54
17	600050	中国联通	194,750,512.75	5.52
18	600104	上海汽车	189,075,745.21	5.36
19	601628	中国人寿	188,069,273.52	5.33
20	600547	山东黄金	185,146,253.75	5.25
21	600383	金地集团	179,677,492.70	5.09
22	000825	太钢不锈	178,418,796.05	5.06
23	600737	中粮屯河	170,184,682.85	4.82
24	600519	贵州茅台	162,525,977.42	4.61
25	600236	桂冠电力	161,040,475.73	4.56
26	000900	现代投资	154,926,922.65	4.39
27	000625	长安汽车	151,825,672.54	4.30
28	600717	天津港	147,721,251.83	4.19
29	600887	伊利股份	146,534,793.24	4.15
30	000402	金 融 街	133,927,647.64	3.80
31	600649	原水股份	130,689,056.95	3.70
32	600007	中国国贸	129,515,717.13	3.67
33	600879	火箭股份	127,160,494.05	3.60
34	601166	兴业银行	118,738,111.41	3.37
35	000089	深圳机场	118,681,899.21	3.36
36	600015	华夏银行	118,655,497.40	3.36
37	000951	中国重汽	116,733,751.52	3.31
38	000800	一汽轿车	113,138,125.42	3.21
39	600809	山西汾酒	112,287,689.13	3.18
40	600616	第一食品	111,256,492.11	3.15
41	000088	盐 田 港	110,117,883.87	3.12
42	601939	建设银行	107,516,255.61	3.05
43	600089	特变电工	99,606,106.01	2.82
44	000021	长城开发	92,040,929.26	2.61
45	601318	中国平安	91,832,803.32	2.60
46	002056	横店东磁	91,175,369.86	2.58
47	600269	赣粤高速	90,905,143.20	2.58
48	000539	粤电力A	90,546,002.01	2.57
49	000617	石油济柴	83,280,279.27	2.36
50	600005	武钢股份	83,023,894.29	2.35
51	002122	天马股份	82,636,482.22	2.34
52	600584	长电科技	78,233,022.18	2.22
53	600548	深高速	77,819,573.99	2.21
54	600428	中远航运	76,084,853.68	2.16
55	600138	中青旅	75,997,625.04	2.15
56	000400	许继电气	75,836,055.21	2.15
57	000898	鞍钢股份	75,507,956.67	2.14
58	000410	沈阳机床	74,783,335.49	2.12
59	000060	中金岭南	71,962,703.49	2.04
60	600111	包钢稀土	71,491,499.80	2.03

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	10,672,745,707.28
报告期内卖出股票收入总额	12,085,590,674.14

（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	741,817,104.20	14.55
2	国家政策性金融债	283,600,000.00	5.56
	合计	1,025,417,104.20	20.11

（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(3)	215,309,820.00	4.22
2	99国债(8)	210,412,114.80	4.13
3	20国债(4)	142,858,771.00	2.80
4	04国开14	80,624,000.00	1.58
5	21国债(10)	76,582,200.50	1.50

（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	15,133,783.19
存出保证金	1,660,000.00
应收股利	371.50
合计	16,794,154.69

4、本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

5、本报告期内权证投资明细

（1）本报告期内主动投资权证明细：

序号	权证代码	权证名称	股数(股)	成本(元)	本期余额(股)	类别
1	031003	深发SFC1	1,299,987	28,005,595.82	---	主动投资
合计			1,299,987	28,005,595.82	---	

（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	本期增加(股)	成本(元)	本期余额(股)	类别
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、本报告期末本基金未持有资产支持证券。

7、本报告期末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。

第九节 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

基金份额持有人户数(户)	48,909
平均每户持有基金份额(份)	40,892

（二）基金份额持有人结构

投资者名称	持有基金份额(份)	占总份额的比例(%)
机构投资者	1,011,353,524	50.57
个人投资者	988,646,476	49.43

（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	187,603,929.00	9.38
2	中国人寿保险(集团)公司	181,544,793.00	9.08
3	中国太平洋保险(集团)股份有限公司	172,457,967.00	8.62
4	新华人寿保险股份有限公司	113,424,504.00	5.67
5	中国平安保险(集团)股份有限公司	56,279,376.00	2.81
6	全国社保基金一零九组合	31,979,867.00	1.60
7	全国社保基金六零二组合	16,999,804.00	0.85
8	全国社保基金六零三组合	13,807,978.00	0.69
9	DEUTSCHE BANK AKTIENGESELLSCHAFT	11,309,490.00	0.57
10	宋伟铭	11,302,600.00	0.57

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。

第十节 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》，决定聘任于志先生为公司副总经理职务。

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去公司副总经理职务的公告》，决定同意晏晓辉先生辞去公司副总经理职务。

本公司于2007年3月26日刊登《宝盈基金管理有限公司关于变更鸿阳证券投资基金基金经理的公告》，决定聘任欧阳东华担任鸿阳证券投资基金基金经理职务，同意蒋峰辞去鸿阳证券投资基金基金经理职务。

本公司于2007年4月21日刊登《宝盈基金管理有限公司关于督察长离任的公告》，赵炬辉先生因个人原因辞去公司督察长职务。

本公司于2007年5月8日刊登《宝盈基金管理有限公司关于变更公司督察长的公告》，授权刘传葵先生代为履行公司督察长职务。

本公司于2007年5月12日刊登《宝盈基金管理有限公司关于增加鸿阳证券投资基金基金经理的公告》，决定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。

本公司于2007年7月3日刊登《宝盈基金管理有限公司关于变更公司督察长的公告》，决定聘任刘传葵先生担任公司督察长职务。

本公司于2007年9月28日刊登《关于修改鸿阳证券投资基金、宝盈鸿利收益证券投资基金、宝盈策略增长股票型证券投资基金基金合同的公告》，根据中国证监会基金部【2007】26号《关于基金实施<企业会计准则>后修改原有基金合同相关条款的通知》要求，对鸿阳证券投资基金、宝盈鸿利收益证券投资基金、宝盈策略增长股票型证券投资基金《基金合同》估值方法进行修改；《托管协议》中相关内容同时进行相应修改；此修改不需召开持有人大会。

本公司于2007年12月1日刊登《宝盈基金管理有限公司关于增加鸿阳证券投资基金基金经理的公告》，决定聘任陈茂仁担任鸿阳证券投资基金基金经理职务，与现任基金经理共同管理鸿阳证券投资基金。

（三）本报告期内，托管人行长变更。

依据国务院文件，2007年6月16日国务院决定任命项俊波同志为中国农业银行行长。依据相关法律规定，中国农业银行法定代表人变更为项俊波先生。

（四）本报告期内，托管人注册地址变更。

托管人已做工商登记变更，注册地址由北京市海淀区复兴路甲23号变更为北京市东城区建国门内大街69号。

（五）基金管理人、基金财产、基金托管业务本报告期内无重大诉讼事项。

（六）报告期基金的投资组合策略没有重大改变。

（七）本公司于2008年2月2日刊登《宝盈基金管理有限公司关于更换旗下基金会计师事务所的公告》，由普华永道中天会计师事务所有限公司更换为德勤华永会计师事务所有限公司（北京分所）。报告年度支付给德勤华永会计师事务所审计费用100,000.00元人民币，德勤华永会计师事务所从2007年开始为本基金提供审计服务。

（八）基金管理人、基金托管人及其高级管理人员在本期内未受到任何处罚。

（九）本公司于2007年3月29日刊登《鸿阳证券投资基金2006年度收益分配公告》，进行基金红利分配，分配的红利为每10份基金份额派发现金红利2.60元；2007年4月5日完成权益登记，红利发放日为2007年4月6日。

本公司于2007年10月19日刊登《鸿阳证券投资基金第五次分红公告》，进行基金红利分配，分配的红利为每10份基金份额派发现金红利2.00元；2007年10月24日完成权益登记，红利发放日为2007年10月25日。

（十）基金租用证券公司专用交易席位的有关情况

基金管理人选择使用基金专用交易席位的证券经营机构的选择标准为：

（1）实力雄厚，信誉良好，注册资本不少于3 亿元人民币。

（2）财务状况良好，各项财务指标显示公司经营状况稳定。

（3）经营行为规范，最近两年未发生重大违规行为而受到中国证监会处罚。

（4）内部管理规范、严格，具备健全的内控制度，并能满足基金运作高度保密的要求。

（5）具备基金运作所需的高效、安全的通讯条件，交易设施符合代理本基金进行证券交易的需要，并能为本基金提供全面的信息服务。

（6）研究实力较强，有固定的研究机构和专门的研究人员，能及时为本基金提供高质量的咨询服务。

基金管理人根据以上标准进行评估后确定证券经营机构的选择，与被选择的券商签订证券交易席位租用协议。

本报告期内基金鸿阳通过各证券经营机构的交易席位的成交及佣金情况见下表：

1、股票交易情况：

券商名称	租用席位数量(个)	股票成交量(元)	比例(%)	佣金额(元)	比例(%)
申银万国证券股份有限公司	2	4,809,058,548.16	21.27	3,911,066.22	21.53
第一创业证券有限责任公司	1	3,707,773,274.89	16.40	3,009,460.57	16.56
中国国际金融有限公司	1	3,243,486,301.39	14.35	2,648,260.32	14.58
国泰君安证券股份有限公司	2	2,747,501,247.48	12.15	2,149,941.22	11.83
兴业证券股份有限公司	1	2,534,344,792.75	11.21	1,983,140.27	10.92
中信万通证券有限责任公司	1	1,881,662,625.00	8.32	1,536,840.35	8.46
长城证券有限责任公司	1	1,386,613,046.04	6.13	1,085,037.25	5.97
金元证券有限责任公司	1	730,908,257.64	3.23	597,673.10	3.29
中信建投证券有限责任公司	1	662,430,965.02	2.93	518,355.78	2.85
渤海证券有限责任公司	1	537,395,441.68	2.38	440,405.25	2.42
国信证券有限责任公司	1	368,291,648.55	1.63	288,190.16	1.59
合计		22,609,466,148.60	100.00	18,168,370.49	100.00

2、债券及回购交易情况：

券商名称	债券成交量(元)	比例(%)	债券回购成交量(元)	比例(%)
中国国际金融有限公司	131,360,039.70	6.42	2,103,000,000.00	24.19
金元证券有限责任公司	15,647,132.50	0.76	300,000,000.00	3.45
第一创业证券有限责任公司	1,398,071,578.50	68.30	3,425,600,000.00	39.41
申银万国证券股份有限公司	445,689,543.00	21.77	1,699,900,000.00	19.56
中信万通证券有限责任公司	31,120,998.70	1.52	1,164,000,000.00	13.40
渤海证券有限责任公司	25,095,637.80	1.23	---	---
合计	2,046,984,930.20	100.00	8,692,500,000.00	100.00

注：上述佣金不包括由中国证券登记结算有限责任公司收取的证券结算风险基金，债券成交量按净价统计。

3、权证交易情况

券商名称	权证成交量(元)	比例(%)
申银万国证券股份有限公司	42,665,003.80	19.67
中信建投证券有限责任公司	105,354,573.78	48.58
国泰君安证券股份有限公司	28,005,595.82	12.91
中信万通证券有限责任公司	40,855,747.20	18.84
合计	216,880,920.60	100.00

4、席位变更情况

（Ⅰ）租用席位情况

本报告期内未租用席位。

（Ⅱ）退租席位情况

券商名称	上海席位(个数)	深圳席位(个数)
中信建投证券有限责任公司	1	---

宝盈基金管理有限公司

二零零八年三月二十六日

长城久恒平衡型证券投资基金2007年年度报告摘要

（上接D111版）

2、本报告期内累计卖出价值超出期初基金资产净值2%的股票明细如下：

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额(元)	占期初基金资产净值的比例%
1	600036	招商银行	429,750,795.71	96.07
2	600016	民生银行	375,941,515.93	84.04
3	600015	华夏银行	257,712,481.82	57.61
4	601318	中国平安	233,420,164.66	52.18
5	600019	宝钢股份	210,468,680.77	47.05
6	600000	浦发银行	182,567,711.75	40.81
7	000001	深发展A	172,962,879.51	38.67
8	000898	鞍钢股份	142,299,749.32	31.81
9	600005	武钢股份	139,243,104.09	31.13
10	601398	工商银行	138,041,265.49	30.86
11	601166	兴业银行	137,794,564.01	30.81
12	600997	开滦股份	125,562,565.17	28.07
13	000039	中集集团	118,432,951.93	26.48
14	002024	苏宁电器	116,159,326.91	25.97
15	000937	金牛能源	103,733,705.17	23.19
16	600383	金地集团	101,175,776.43	22.62
17	600195	中牧股份	98,701,286.94	22.07
18	601666	平煤天安	90,741,757.44	20.29
19	000651	格力电器	89,089,161.14	19.92
20	600123	兰花科创	88,956,761.11	19.89
21	601988	中国银行	86,371,357.23	19.31
22	000002	万 科A	84,456,311.70	18.88
23	002038	双鹭药业	84,343,452.53	18.86
24	600900	长江电力	81,547,498.47	18.23
25	600785	新华百货	79,138,745.85	17.69
26	000792	盐湖钾肥	77,688,754.61	17.37
27	600269	赣粤高速	75,504,180.08	16.88
28	000422	湖北宜化	73,755,579.69	16.49
29	000623	吉林敖东	73,250,973.96	16.38
30	600050	中国联通	73,217,959.92	16.37
31	000063	中兴通讯	73,003,506.43	16.32
32	600717	天津港	71,661,846.10	16.02
33	600075	新疆天业	70,164,379.49	15.69
34	600166	福田汽车	69,763,808.64	15.60
35	600360	华微电子	69,244,145.41	15.48
36	600675	中华企业	66,650,480.76	14.90
37	600030	中信证券	66,148,102.91	14.79
38	600096	云天化	65,949,965.55	14.74
39	600583	海油工程	65,869,800.69	14.73
40	000933	神火股份	65,768,337.49	14.70
41	600022	济南钢铁	65,318,531.38	14.60
42	600780	通宝能源	65,022,559.85	14.54
43	600685	广船国际	63,339,882.10	14.16
44	000088	盐 田 港	61,760,814.01	13.81
45	600177	雅戈尔	61,689,745.15	13.79
46	600037	歌华有线	60,920,469.18	13.62
47	000858	五 粮 液	60,337,409.03	13.49
48	600028	中国石化	59,994,214.61	13.41
49	600307	酒钢宏兴	59,692,474.69	13.34
50	000952	广济药业	57,413,346.20	12.84
51	002010	传化股份	57,346,817.72	12.82
52	600236	桂冠电力	56,778,559.30	12.69
53	000707	双环科技	55,839,724.02	12.48
54	000157	中联重科	55,713,757.03	12.46
55	600739	辽宁成大	55,409,320.68	12.39
56	000402	金 融 街	55,035,321.05	12.30
57	600519	贵州茅台	54,174,547.86	12.11
58	000807	云铝股份	52,462,292.04	11.73
59	600201	金宇集团	52,450,846.15	11.73
60	000616	亿城股份	52,334,257.10	11.70
61	600348	国阳新能	51,840,357.09	11.59
62	000951	中国重汽	51,341,052.15	11.48
63	600467	好当家	51,226,005.80	11.45
64	000060	中金岭南	49,979,916.54	11.17
65	600887	伊利股份	48,532,164.75	10.85
66	000709	唐钢股份	46,508,256.86	10.40
67	600418	江淮汽车	46,225,989.16	10.33
68	600970	中材国际	46,205,033.15	10.33
69	000612	焦作万方	43,365,974.29	9.69
70	000550	江铃汽车	42,928,848.46	9.60
71	000900	现代投资	42,769,730.70	9.56
72	000878	云南铜业	42,405,723.16	9.48
73	600282	南钢股份	41,446,289.78	9.27
74	600697	欧亚集团	41,002,644.36	9.17
75	000983	西山煤电	40,393,211.66	9.03
76	000089	深圳机场	39,621,030.57	8.86
77	600118	中国卫星	39,404,213.27	8.81
78	600795	国电电力	39,001,264.90	8.72
79	600331	宏达股份	38,748,532.59	8.66
80	600150	中国船舶	38,042,699.58	8.50
81	600663	陆家嘴	38,018,136.43	8.50
82	000401	冀东水泥	37,976,179.34	8.49
83	000825	太钢不锈	37,799,728.69	8.45
84	600309	烟台万华	37,206,072.21	8.32
85	000400	许继电气	37,011,482.70	8.27
86	000006	深振业A	36,656,325.16	8.19
87	600456	宝钛股份	36,480,147.16	8.16
88	600415	小商品城	36,198,178.17	8.09
89	600438	通威股份	36,059,612.80	8.06
90	600963	岳阳纸业	35,791,211.60	8.00
91	000927	一汽夏利	35,506,448.72	7.94
92	600026	中海发展	35,057,624.93	7.84
93	600143	金发科技	34,865,592.91	7.79
94	600469	风神股份	34,495,536.60	7.71
95	600017	日照港	34,027,612.57	7.61
96	002021	中捷股份	33,970,234.96	7.59
97	600971	恒源煤电	33,892,738.03	7.58
98	600054	黄山旅游	33,744,344.20	7.54
99	600600	青岛啤酒	33,577,670.08	7.51
100	600007	中国国贸	33,331,627.06	7.45
101	600299	星新材料	33,216,656.79	7.43
102	000903	云内动力	32,853,782.11	7.34
103	600639	浦东金桥	32,257,560.18	7.21
104	600642	申能股份	32,094,288.25	7.17
105	000528	柳 工	31,288,310.15	6.99
106	000932	华菱管线	30,310,437.71	6.78
107	601111	中国国航	30,139,628.02	6.74
108	600595	中孚实业	29,971,496.82	6.70
109	000968	煤 气 化	29,568,419.02	6.61
110	600012	皖通高速	29,563,079.24	6.61
111	000869	张 裕A	29,477,796.32	6.59
112	600459	贵研铂业	29,458,350.41	6.59
113	600527	江南高纤	29,164,790.14	6.52
114	600590	泰豪科技	29,099,087.23	6.51
115	600129	太极集团	28,400,515.24	6.35
116	600834	申通地铁	28,163,619.43	6.30
117	600725	云维股份	28,098,410.61	6.28
118	000755	山西三维	28,022,529.56	6.26
119	600351	亚宝药业	27,969,431.98	6.25
120	600809	山西汾酒	27,953,578.81	6.25
121	000815	美利纸业	26,931,517.50	6.02
122	000850	华茂股份	26,758,757.96	5.98
123	600206	有研硅股	26,355,680.37	5.89
124	000410	沈阳机床	25,960,583.74	5.80
125	600831	广电网络	25,913,974.02	5.79
126	000717	韶钢松山	25,767,798.00	5.76
127	000729	燕京啤酒	25,319,343.72	5.66
128	600183	生益科技	25,273,470.30	5.65
129	000761	本钢板材	25,088,768.30	5.61
130	601001	大同煤业	25,014,677.04	5.59
131	000619	海螺型材	24,982,674.39	5.59
132	600262	北方股份	24,600,124.96	5.50
133	002068	黑猫股份	24,436,358.17	5.46
134	600589	广东榕泰	23,814,314.43	5.32
135	600067	冠城大通	23,298,757.72	5.21
136	002106	莱宝高科	22,868,797.45	5.11
137	601088	中国神华	22,839,616.50	5.11
138	000531	穗恒运A	22,201,355.69	4.96
139	002022	科华生物	21,896,889.41	4.90
140	600029	南方航空	21,849,284.55	4.88
141	600535	天士力	21,337,359.27	4.77
142	601628	中国人寿	20,785,903.07	4.65
143	600266	北京城建	20,673,529.80	4.62
144	601699	潞安环能	20,620,881.95	4.61
145	600161	天坛生物	20,471,077.98	4.58
146	601919	中国远洋	20,416,892.14	4.56
147	600597	光明乳业	20,338,800.14	4.55
148	600325	华发股份	20,001,666.24	4.47
149	000042	深 长 城	19,655,162.07	4.39
150	000024	招商地产	19,351,674.33	4.33
151	600810	神马实业	19,340,607.97	4.32
152	000708	大冶特钢	19,051,073.14	4.26
153	000680	山推股份	18,919,725.72	4.23
154	002086	东方海洋	18,729,573.16	4.19
155	600718	东软股份	18,544,276.54	4.15
156	000800	一汽轿车	18,116,383.61	4.05
157	000963	华东医药	18,014,966.62	4.03
158	600202	哈空调	17,882,357.74	4.00
159	600867	通化东宝	17,521,806.97	3.92
160	000919	金陵药业	17,451,229.57	3.90
161	600586	金晶科技	17,386,427.37	3.89
162	600966	博汇纸业	17,121,737.91	3.83
163	600748	上实发展	16,808,470.78	3.76
164	600879	火箭股份	16,115,654.91	3.60
165	000939	凯迪电力	15,875,838.15	3.55
166	002078	太阳纸业	15,828,207.96	3.54
167	600033	福建高速	14,957,246.03	3.34
168	600098	广州控股	14,951,456.52	3.34
169	000630	铜陵有色	14,458,876.94	3.23
170	600812	华北制药	14,079,232.07	3.15
171	000562	宏源证券	14,077,154.11	3.15
172	002080	中材科技	13,816,406.45	3.09
173	600122	宏图高科	13,602,507.24	3.04
174	601872	招商轮船	13,334,024.69	2.98
175	601006	大秦铁路	13,097,672.11	2.93
176	002045	广州国光	12,966,332.76	2.90
177	000960	锡业股份	12,953,452.95	2.90
178	000625	长安汽车	12,483,076.72	2.79
179	600290	华仪电气	12,449,040.70	2.78
180	600740	山西焦化	12,142,420.89	2.71
181	002065	东华合创	12,026,370.34	2.69
182	600828	*ST成商	11,960,204.37	2.67
183	000062	深圳华强	11,583,996.70	2.59
184	600160	巨化股份	11,359,423.65	2.54
185	000636	风华高科	10,926,030.19	2.44
186	600786	东方锅炉	10,300,038.00	2.30
187	000690	宝新能源	10,248,162.06	2.29
188	600489	中金黄金	9,313,055.51	2.08
189	600481	双良股份	9,248,096.55	2.07

3、本基金报告期内买入股票总成本和卖出股票总收入：

项目	金额(元)
报告期内买入股票总成本	9,091,890,472.06
报告期内卖出股票总收入	9,582,577,462.52

（五）期末按券种分类的债券组合

序 号	债券类别	市值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	国债	148,428,394.20	19.90
2	金融债	4,956,000.00	0.66
3	企业债	0.00	0.00
4	可转换债	0.00	0.00
5	央行票据	49,885,000.00	6.69
	合 计:	203,269,394.20	27.25

（六）期末基金投资前五名债券明细

序 号	债券代码	债券名称	市值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	010004	20国债(4)	56,470,240.20	7.57
2	010112	21国债(12)	53,882,010.00	7.23
3	050155	05央行票据55	49,885,000.00	6.69
4	009908	99国债(8)	20,363,634.00	2.73
5	010110	21国债(10)	14,698,710.00	1.97

（七）报告期末按市值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

（八）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，或在报告编制日前一年内受到过公开谴责、处罚。

基金投资的前十名股票中，未有投资于超出基金合同规定备选股票库之外股票。

2、其他资产的构成

序 号	项目	金额(元)
1	交易保证金	1,573,339.12
2	应收利息	2,859,391.07
3	应收申购款	313,595.58
4	应收证券清算款	0.00
	合 计	4,746,325.77

3、本基金报告期末未持有可转换债券。

4、本基金本报告期内权证投资情况

本基金本报告期末有权证投资。

5、本基金本报告期未投资分离交易可转债，期末未持有分离交易可转债。

6、本基金本报告期末投资资产支持证券，期末未持有资产支持证券。

7、由于四舍五入的原因，分项之和与合计项之间可能存在尾差。

第九节 基金份额持有人户数、持有人结构

1、基金份额持有人户数

序号	项目	户数/份额
1	本基金报告期内份额持有人户数	19,560(户)
2	平均每户持有基金份额	22438.56(份)

2、基金份额持有人结构

序号	项目	份额(份)	占总份额比例%
1	机构投资者持有基金份额	133,975,570.09	30.53
2	个人投资者持有基金份额	304,922,674.69	69.47

3、期末本基金管理人从业人员投资本开放式基金的情况

项目	期末持有本开放式基金份额的总量(份)	占本基金总份额比例(%)
本基金管理人持有本基金的所有从业人员	1,236.48	0.0003

第十节 开放式基金份额变动

序号	项目	份额(份)
1	合同生效日的份额总额	1,284,133,805.81
2	期初基金份额总额	267,058,776.60
3	加：本期申购基金份额总额	1,530,462,331.57
4	减：本期赎回基金份额总额	1,358,622,863.39
5	期末基金份额总额	438,898,244.78

第十一节 重大事件揭示

（一）本报告期内未召开基金份额持有人大会。

（二）经长城基金管理有限公司股东会2007年第一次审议通过，选举桑煜先生任公司监事，李建中先生不再任公司监事；选举杨玉成先生任公司董事，贺若先生不再任公司董事。经长城基金管理有限公司股东会2007年第二次会议审议通过，同意麦建光先生辞去公司独立董事，聘任谢志华先生任公司独立董事，选举韩刚先生任公司监事。经长城基金管理有限公司股东会2007年第六次会议审议通过，选举王国斌先生任公司董事，杨玉成先生不再担任公司董事。经长城基金管理有限公司股东会2007年第七次会议审议通过，吕莉女士不再担任公司董事，杨传益女士不再担任公司监事。经长城基金管理有限公司股东会2007年第八次会议审议通过，批准邹平先生、龙熙霖先生不再担任公司董事，选举杨平先生、赵玉华先生任公司董事。监管部门对以上任命无异议。

（三）从2007年4月12日起，阮涛先生担任长城久恒平衡型证券投资基金基金经理，杨毅平先生不再担任长城久恒平衡型证券投资基金基金经理。从2007年11月13日起，李硕先生担任长城久恒平衡型证券投资基金基金经理，阮涛先生不再担任长城久恒平衡型证券投资基金基金经理。

（四）本基金管理人注册地址、办公地址由"深圳市福田区深南中路2066号华能大厦25层"变更为"深圳市福田区益田路6009号新世界商务中心41层"。

（五）本基金托管人于2007年9月25日在上海证券交易所上市及开始交易，股票代码为601939。

（六）本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。

（七）本基金投资组合策略在本报告期内未改变。

（八）本基金分别于2007年1月17日、1月22日进行了三次收益分配，每10份基金份额分别派发现金红利6.50元、0.70元、0.30元，本报告期每10份基金份额共分红7.50元。

（九）报告期内基金会计师事务所未更换；本报告期支付本基金聘任会计师事务所2006年度审计服务费捌万元；截止本报告期末，该会计师事务所已为本基金提供审计服务肆年零叁个月。

（十）本报告期内无基金管理人、托管人及其高级管理人员受监管部门稽查或处罚情况。

（十一）基金租用证券公司专用交易席位的有关情况

1、股票、债券及回购、权证交易

租用席位	席位	证券交易量(元)				证券交易量比例(%)			
券商名称	数量	股票	债券	回购	权证	股票	债券	回购	权证
平安证券	2	3108117307.89	113301724	320000000.00	14253256.93	16.66	19.33	34.04	9.16
长城证券	1	2694370312.25	11458240.70	0.00	37620529.40	14.44	1.95	0.00	24.18
国泰君安	2	3842748888.30	57372954.90	220000000.00	56746056.81	20.59	9.79	23.40	36.48
海通证券	1	3380898344.81	187370785.60	180000000.00	0.00	18.12	31.97	19.15	0.00
兴业证券	1	2627734045.64	0.00	0.00	20465224.60	14.08	0.00	0.00	13.16
东方证券	1	3007664298.80	216662208.00	220000000.00	26483311.14	16.12	36.96	23.40	17.02
合计:	8	18661533197.69	586165913.20	940000000.00	155568378.88	100.00	100.00	100.00	100.00

2、支付佣金

证券公司名称	支付佣金金额(元)	占报告期佣金总量的比例(%)
平安证券	2,517,996.01	16.72
长城证券	2,209,257.26	14.67
国泰君安	3,044,831.84	20.22
海通证券	2,769,523.59	18.39
兴业证券	2,056,224.55	13.65
东方证券	2,462,980.34	16.35
合计	15,060,813.59	100.00

3、报告期内租用证券公司席位的变更情况：无

4、专用席位的选择标准和程序

本基金管理人负责选择代理本基金证券买卖的证券经营机构，使用其席位作为基金的专用交易席位，选择的标准是：

（1）实力雄厚，信誉良好，注册资本不少于3亿元人民币；

（2）财务状况良好，各项财务指标显示公司经营状况稳定；

（3）经营行为规范，最近两年未发生重大违规行为而受到中国证监会处罚；

（4）内部管理规范、严格，具备健全的内控制度，并能满足基金运作高度保密的要求；

（5）具备基金运作所需的高效、安全的通讯条件，交易设施符合代理本基金进行证券交易的需要，并能为本基金提供全面的信息服务；

（6）研究实力较强，有固定的研究机构和专门的研究人员，能及时为本基金提供高质量的咨询服务，包括宏观经济报告、行业报告、市场走向分析、个股分析报告及其他专门报告。

根据上述标准考察确定后，基金管理人和被选中的证券经营机构签订委托协议，并通知托管人。

基金管理人应根据有关规定，在基金的中期报告和年度报告中将所选证券经营机构的有关情况、基金通过该证券经营机构买卖证券的成交量、支付的佣金等予以披露。

（十二）其他重要事项

1、2007年1月12日本基金管理人在中国证券报、上海证券报、证券时报刊登了《关于暂停长城久恒平衡型证券投资基金申购及转入业务的公告》。

2、2007年1月13日本基金管理人在中国证券报、上海证券报、证券时报刊登了《长城久恒平衡型证券投资基金分红预告与暂停申购及转入业务的公告》。

3、2007年1月16日本基金管理人在中国证券报、上海证券报、证券时报刊登了《关于长城久恒平衡型证券投资基金调整分红金额的公告》。

4、2007年1月16日本基金管理人在中国证券报、上海证券报、证券时报刊登了《长城久恒平衡型证券投资基金第十一次分红公告》。

5、2007年1月18日本基金管理人在中国证券报、上海证券报、证券时报刊登了《长城基金管理有限公司关于增加世纪证券有限责任公司为代销机构的公告》。

6、2007年1月18日本基金管理人在中国证券报、上海证券报、证券时报刊登了《长城久恒基金、长城久泰基金增加渤海证券为代销机构的公告》。

7、2007年1月19日本基金管理人在中国证券报、上海证券报、证券时报刊登了《长城久恒平衡型证券投资基金分红及暂停申购与转入业务的公告》。

8、2007年1月19日本基金管理人在中国证券报、上海证券报、证券时报刊登了《长城久恒平衡型证券投资基金季度报告（2006年第4季度）》。

9、2007年1月30日本基金管理人在中国证券报、上海证券报、证券时报刊登了《长城久恒平衡型证券投资基金第十三次分红公告》。

10、2007年2月6日本基金管理人在中国证券报、上海证券报、证券时报刊登了《长城基金管理有限公司关于督察长任职的公告》。

11、2007年3月29日本基金管理人在中国证券报、上海证券报、证券时报刊登了《长城久恒平衡型证券投资基金2006年年报摘要》。

12、2007年4月12日本基金管理人在中国证券报、上海证券报、证券时报刊登了《长城基金管理有限公司关于更换基金经理的公告》。

13、2007年4月20日本基金管理人在中国证券报、上海证券报、证券时报刊登了《长城久恒平衡型证券投资基金2007年1季度报告》

14、2007年5月8日本基金管理人在中国证券报、上海证券报、证券时报刊登了《长城基金管理有限公司办公地址变更公告》。

15、2007年5月16日本基金管理人在中国证券报、上海证券报、证券时报刊登了《修改长城久恒平衡型证券投资基金、长城消费增值基金基金合同的公告》。

16、2007年5月16日本基金管理人在中国证券报、上海证券报、证券时报上刊登了《关于调整旗下开放式基金申购费用及申购份额计算方法的公告》。

17、2007年6月9日本基金管理人在证券时报刊登了《关于长城基金管理有限公司股权、注册地址变更的公告》。

18、2007年6月12日本基金管理人在中国证券报、上海证券报、证券时报刊登了《长城久恒平衡型证券投资基金更新的招募说明书摘要》。

19、2007年7月2日本基金管理人在中国证券报、上海证券报、证券时报上刊登了《长城基金管理有限公司关于旗下开放式基金通过交通银行股份有限公司网上银行前端申购实行费率优惠的公告》。

20、2007年7月2日本基金管理人在中国证券报、上海证券报、证券时报上刊登了《长城基金关于增加交通银行股份有限公司为旗下部分开放式基金代销机构的公告》。

21、2007年7月2日本基金管理人在中国证券报、上海证券报、证券时报上刊登了《长城基金管理有限公司关于旗下开放式基金通过交通银行股份有限公司开办定期定额投资业务的公告》。

22、2007年7月19日本基金管理人在中国证券报、上海证券报、证券时报刊登了《长城久恒平衡型证券投资基金2007年第2季度报告》。

23、2007年8月2日本基金管理人在中国证券报、上海证券报、证券时报上刊登了《长城基金管理有限公司关于旗下开放式基金参加中国建设银行网上银行基金交易营销活动的公告》。

24、2007年8月25日本基金管理人在中国证券报、上海证券报、证券时报刊登了《长城久恒平衡型证券投资基金2007年半年度报告摘要》。

25、2007年9月26日本基金管理人在中国证券报、上海证券报、证券时报刊登了《长城基金关于修改长城久恒平衡型证券投资基金、长城消费增值股票型证券投资基金基金合同的公告》。

26、2007年9月28日本基金管理人在中国证券报、上海证券报、证券时报上刊登了《长城基金管理有限公司关于参与交通银行基金"定期定额申购"推广活动的公告》。

27、2007年10月24日本基金管理人在中国证券报、上海证券报、证券时报刊登了《长城久恒平衡型证券投资基金2007年第三季度报告》。

28、2007年10月26日本基金管理人在中国证券报、上海证券报、证券时报上刊登了《关于旗下开放式基金通过广州证券有限责任公司开办定期定额投资业务的公告》。

29、2007年10月31日本基金管理人在中国证券报、上海证券报、证券时报上刊登了《关于增加齐鲁证券有限公司为长城基金管理有限公司旗下开放式基金代销机构的公告》。

30、2007年11月13日本基金管理人在中国证券报、上海证券报、证券时报刊登了《长城基金管理有限公司关于变更"长城久恒平衡型证券投资基金"基金经理的公告》。

31、2007年11月16日本基金管理人在中国证券报、上海证券报、证券时报上刊登了《长城基金管理有限公司关于增加中信万通证券有限责任公司为旗下开放式基金代销机构的公告》。

32、2007年11月23日本基金管理人在中国证券报、上海证券报、证券时报上刊登了《关于调整旗下相关基金定期定额申购业务最低申购金额的公告》。

33、2007年11月28日本基金管理人在中国证券报、上海证券报、证券时报上刊登了《长城基金管理有限公司关于增加注册资本的公告》。

34、2007年12月13日本基金管理人在中国证券报、上海证券报、证券时报刊登了《长城久恒平衡型证券投资基金更新的招募说明书摘要》。

35、2007年12月17日本基金管理人在中国证券报、上海证券报、证券时报上刊登了《关于旗下开放式基金通过各代销券商机构开办定期定额投资业务的公告》。

36、2007年12月18日本基金管理人在中国证券报、上海证券报、证券时报上刊登了《关于通过兴业银行开办旗下开放式基金定期定额投资业务的公告》。

37、2007年12月24日本基金管理人在中国证券报、上海证券报、证券时报上刊登了《关于旗下基金通过国盛证券有限责任公司网上交易前端申购实行费率优惠的公告》。

38、本报告期刊登的其他公告。

长城基金管理有限公司

二ＯＯ八年三月二十六日