

鸿飞证券投资基金

2007 年年度报告摘要

基金管理人:宝盈基金管理有限公司

应付交易费用	470,642.28	799,574.13
应收款项	-	-
应付利息	-	4,807.00
应付股利	-	-
其他负债	1,326,611.18	1,228,611.18
负债合计	4,285,169.02	103,491,035.96
所有者权益	-	-
实收基金	500,000,000.00	500,000,000.00
未分配利润	1,285,793,308.18	427,466,298.89
所有者权益合计	1,785,793,308.18	927,466,298.89
负债及所有者权益合计	1,790,078,477.20	1,030,957,334.85
基金总额(份)	500,000,000.00	500,000,000.00
基金净值	3.5716	1.8549

附注为财务报表的重要组成部分。

鸿飞证券投资基金 利润表

项目	2007年度	2006年度
收入	9,737,812.08	4,512,213.51
利息收入	9,737,812.08	4,512,213.51
其中:存款利息收入	997,312.38	534,177.45
其他利息收入	8,740,499.70	3,978,036.06
资产支持证券利息收入	-	-
买入返售金融资产收入	-	-
投资收益	882,467,481.78	277,935,733.07
其中:股票投资收益(损失)	828,794,089.43	252,524,335.16
债券投资收益(损失)	304,909.61	36,559.76
资产支持证券投资(损失)	-	-
衍生工具收益(损失)	46,993,876.64	17,592,234.00
股利收益	6,374,606.10	7,782,604.10
公允价值变动损益	178,955,828.45	216,055,310.26
其他收入	-	-
收入(损失)合计	1,071,161,123.31	498,503,256.84
费用	-	-
管理人报酬	20,980,164.00	9,400,390.32
托管费	3,496,694.07	1,566,731.74
销售服务费	-	-
交易费用	12,893,348.28	5,231,719.49
利息支出	9,495,948.22	727,964.04
其中:卖出回购金融资产支出	4,995,948.22	727,964.04
其他费用	967,961.05	458,323.70
费用合计	47,834,113.02	17,385,129.29
利润总额	1,023,327,009.29	481,118,127.55

附注为财务报表的重要组成部分。

鸿飞证券投资基金 所有者权益(基金净值)变动表

项目	2007年度		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、年初所有者权益(基金净值)	500,000,000.00	427,466,298.89	927,466,298.89
二、本年经营变动产生的基金净值变动数(本年利润总额)	---	1,023,327,009.29	1,023,327,009.29
三、本年向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动数	---	-165,000,000.00	-165,000,000.00
四、年末所有者权益(基金净值)	500,000,000.00	1,285,793,308.18	1,785,793,308.18

附注为财务报表的重要组成部分。

宝盈基金管理有限公司 所有者权益(基金净值)变动表

项目	2006年度		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、年初所有者权益(基金净值)	500,000,000.00	-53,651,828.66	446,348,171.34
二、本年经营变动产生的基金净值变动数(本年利润总额)	---	481,118,127.55	481,118,127.55
三、本年向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动数	---	-165,000,000.00	-165,000,000.00
四、年末所有者权益(基金净值)	500,000,000.00	427,466,298.89	927,466,298.89

附注为财务报表的重要组成部分。

宝盈基金管理有限公司 所有者权益(基金净值)变动表

项目	2006年度		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、年初所有者权益(基金净值)	500,000,000.00	-53,651,828.66	446,348,171.34
二、本年经营变动产生的基金净值变动数(本年利润总额)	---	481,118,127.55	481,118,127.55
三、本年向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动数	---	-165,000,000.00	-165,000,000.00
四、年末所有者权益(基金净值)	500,000,000.00	427,466,298.89	927,466,298.89

附注为财务报表的重要组成部分。

宝盈基金管理有限公司 所有者权益(基金净值)变动表

项目	2006年度		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、年初所有者权益(基金净值)	500,000,000.00	-53,651,828.66	446,348,171.34
二、本年经营变动产生的基金净值变动数(本年利润总额)	---	481,118,127.55	481,118,127.55
三、本年向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动数	---	-165,000,000.00	-165,000,000.00
四、年末所有者权益(基金净值)	500,000,000.00	427,466,298.89	927,466,298.89

附注为财务报表的重要组成部分。

宝盈基金管理有限公司 所有者权益(基金净值)变动表

项目	2006年度		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、年初所有者权益(基金净值)	500,000,000.00	-53,651,828.66	446,348,171.34
二、本年经营变动产生的基金净值变动数(本年利润总额)	---	481,118,127.55	481,118,127.55
三、本年向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动数	---	-165,000,000.00	-165,000,000.00
四、年末所有者权益(基金净值)	500,000,000.00	427,466,298.89	927,466,298.89

于资产负债表日保留的基金的资金及当年度所保管的银行存款产生的利息收入情况如下:

项目	2007年	2006年
年末银行存款余额	7,231,767.68	125,775,937.14
本年银行存款利息收入	875,433.70	505,043.80

单位:人民币元

于资产负债表日保留的基金的资金及当年度所保管的银行存款产生的利息收入情况如下:

项目	2007年12月31日		2006年12月31日	
	基金份额	基金净值	基金份额	基金净值
宝盈基金管理有限公司	25,297,491.00	90,352,518.86	6,250,000.00	11,593,125.00
衡平信托投资有限责任公司	970,000.00	3,464,452.00	-	-
山东省国际信托投资有限公司	375,000.00	1,339,350.00	375,000.00	695,587.50
联合证券有限责任公司	375,000.00	1,339,350.00	375,000.00	695,587.50
重庆国际信托投资有限公司	375,000.00	1,339,350.00	375,000.00	695,587.50
天津信托投资有限责任公司	375,000.00	1,339,350.00	375,000.00	695,587.50
中国对外经济贸易信托投资有限公司	375,000.00	1,339,350.00	375,000.00	695,587.50

单位:人民币元

于资产负债表日保留的基金的资金及当年度所保管的银行存款产生的利息收入情况如下:

项目	2007年12月31日		2006年12月31日	
	基金份额	基金净值	基金份额	基金净值
宝盈基金管理有限公司	25,297,491.00	90,352,518.86	6,250,000.00	11,593,125.00
衡平信托投资有限责任公司	970,000.00	3,464,452.00	-	-
山东省国际信托投资有限公司	375,000.00	1,339,350.00	375,000.00	695,587.50
联合证券有限责任公司	375,000.00	1,339,350.00	375,000.00	695,587.50
重庆国际信托投资有限公司	375,000.00	1,339,350.00	375,000.00	695,587.50
天津信托投资有限责任公司	375,000.00	1,339,350.00	375,000.00	695,587.50
中国对外经济贸易信托投资有限公司	375,000.00	1,339,350.00	375,000.00	695,587.50

单位:人民币元

于资产负债表日保留的基金的资金及当年度所保管的银行存款产生的利息收入情况如下:

项目	2007年12月31日		2006年12月31日	
	基金份额	基金净值	基金份额	基金净值
宝盈基金管理有限公司	25,297,491.00	90,352,518.86	6,250,000.00	11,593,125.00
衡平信托投资有限责任公司	970,000.00	3,464,452.00	-	-
山东省国际信托投资有限公司	375,000.00	1,339,350.00	375,000.00	695,587.50
联合证券有限责任公司	375,000.00	1,339,350.00	375,000.00	695,587.50
重庆国际信托投资有限公司	375,000.00	1,339,350.00	375,000.00	695,587.50
天津信托投资有限责任公司	375,000.00	1,339,350.00	375,000.00	695,587.50
中国对外经济贸易信托投资有限公司	375,000.00	1,339,350.00	375,000.00	695,587.50

单位:人民币元

于资产负债表日保留的基金的资金及当年度所保管的银行存款产生的利息收入情况如下:

项目	2007年12月31日		2006年12月31日	
	基金份额	基金净值	基金份额	基金净值
宝盈基金管理有限公司	25,297,491.00	90,352,518.86	6,250,000.00	11,593,125.00
衡平信托投资有限责任公司	970,000.00	3,464,452.00	-	-
山东省国际信托投资有限公司	375,000.00	1,339,350.00	375,000.00	695,587.50
联合证券有限责任公司	375,000.00	1,339,350.00	375,000.00	695,587.50
重庆国际信托投资有限公司	375,000.00	1,339,350.00	375,000.00	695,587.50
天津信托投资有限责任公司	375,000.00	1,339,350.00	375,000.00	695,587.50
中国对外经济贸易信托投资有限公司	375,000.00	1,339,350.00	375,000.00	695,587.50

单位:人民币元

于资产负债表日保留的基金的资金及当年度所保管的银行存款产生的利息收入情况如下:

项目	2007年12月31日		2006年12月31日	
	基金份额	基金净值	基金份额	基金净值
宝盈基金管理有限公司	25,297,491.00	90,352,518.86	6,250,000.00	11,593,125.00
衡平信托投资有限责任公司	970,000.00	3,464,452.00	-	-
山东省国际信托投资有限公司	375,000.00	1,339,350.00	375,000.00	695,587.50
联合证券有限责任公司	375,000.00	1,339,350.00	375,000.00	695,587.50
重庆国际信托投资有限公司	375,000.00	1,339,350.00	375,000.00	695,587.50
天津信托投资有限责任公司	375,000.00	1,339,350.00	375,000.00	695,587.50
中国对外经济贸易信托投资有限公司	375,000.00	1,339,350.00	375,000.00	695,587.50

单位:人民币元

于资产负债表日保留的基金的资金及当年度所保管的银行存款产生的利息收入情况如下:

项目	2007年12月31日		2006年12月31日	
	基金份额	基金净值	基金份额	基金净值
宝盈基金管理有限公司	25,297,491.00	90,352,518.86	6,250,000.00	11,593,125.00
衡平信托投资有限责任公司	970,000.00	3,464,452.00	-	-
山东省国际信托投资有限公司	375,000.00	1,339,350.00	375,000.00	695,587.50
联合证券有限责任公司	375,000.00	1,339,350.00	375,000.00	695,587.50
重庆国际信托投资有限公司	375,000.00	1,339,350.00	375,000.00	695,587.50
天津信托投资有限责任公司	375,000.00	1,339,350.00	375,000.00	695,587.50
中国对外经济贸易信托投资有限公司	375,000.00	1,339,350.00	375,000.00	695,587.50

单位:人民币元

于资产负债表日保留的基金的资金及当年度所保管的银行存款产生的利息收入情况如下:

项目	2007年12月31日		2006年12月31日	
	基金份额	基金净值	基金份额	基金净值
宝盈基金管理有限公司	25,297,491.00	90,352,518.86	6,250,000.00	11,593,125.00
衡平信托投资有限责任公司	970,000.00	3,464,452.00	-	-
山东省国际信托投资有限公司	375,000.00	1,339,350.00	375,000.00	695,587.50
联合证券有限责任公司	375,000.00	1,339,350.00	375,000.00	695,587.50
重庆国际信托投资有限公司	375,000.00	1,339,350.00	375,000.00	695,587.50
天津信托投资有限责任公司	375,000.00	1,339,350.00	375,000.00	695,587.50
中国对外经济贸易信托投资有限公司	375,000.00	1,339,350.00	375,000.00	695,587.50

单位:人民币元

于资产负债表日保留的基金的资金及当年度所保管的银行存款产生的利息收入情况如下:

项目	2007年12月31日		2006年12月31日	
	基金份额	基金净值	基金份额	基金净值
宝盈基金管理有限公司	25,297,491.00	90,352,518.86	6,250,000.00	11,593,125.00
衡平信托投资有限责任公司	970,000.00	3,464,452.00	-	-
山东省国际信托投资有限公司	375,000.00	1,339,350.00	375,000.00	695,587.50
联合证券有限责任公司	375,000.00	1,339,350.00	375,000.00	695,587.50
重庆国际信托投资有限公司	375,000.00	1,339,350.00	375,000.00	695,587.50
天津信托投资有限责任公司	375,000.00	1,339,350.00	375,000.00	695,587.50
中国对外经济贸易信托投资有限公司	375,000.00	1,339,350.00	375,000.00	695,587.50

单位:人民币元

于资产负债表日保留的基金的资金及当年度所保管的银行存款产生的利息收入情况如下:

项目	2007年12月31日		2006年12月31日	
	基金份额	基金净值	基金份额	基金净值
宝盈基金管理有限公司	25,297,491.00	90,352,518.86	6,250,000.00	11,593,125.00
衡平信托投资有限责任公司	970,000.00	3,464,452.00	-	-
山东省国际信托投资有限公司	375,000.00	1,339,350.00	375,000.00	695,587.50
联合证券有限责任公司	375,000.00	1,339,350.00	375,000.00	695,587.50
重庆国际信托投资有限公司	375,000.00	1,339,350.00	375,000.00	695,587.50
天津信托投资有限责任公司	375,000.00	1,339,350.00	375,000.00	695,587.50
中国对外经济贸易信托投资有限公司	375,000.00	1,339,350.00	375,000.00	695,587.50