# 宝康系列开放式证券投资基金2008年半年度报告摘要

(上接C88版)

| 代码 | 分类 | 公允价值(元) | 占基金资产净值比例(%) |
|---|---|---|---|
| A | 农、林、牧、渔业 | 0.00 | 0.00 |
| B | 采掘业 | 215,322,238.86 | 8.33 |
| C | 制造业 | 541,218,545.58 | 20.93 |
| C0 | 其中:食品、饮料 | 172,598,310.24 | 6.67 |
| C1 | 纺织、服装、皮毛 | 7,414,836.00 | 0.29 |
| C2 | 木材、家具 | 0.00 | 0.00 |
| C3 | 造纸、印刷 | 16,876,600.00 | 0.65 |
| C4 | 石油、化学、塑胶、塑料 | 0.00 | 0.00 |
| C5 | 电子 | 0.00 | 0.00 |
| C6 | 金属、非金属 | 116,301,700.10 | 4.50 |
| C7 | 机械、设备、仪表 | 161,524,146.24 | 6.25 |
| C8 | 医药、生物制品 | 63,579,152.40 | 2.46 |
| C99 | 其他制造业 | 2,923,800.00 | 0.11 |
| D | 电力、煤气及水的生产和供应业 | 86,458,051.98 | 3.34 |
| E | 建筑业 | 83,998,287.36 | 3.25 |
| F | 交通运输、仓储业 | 0.00 | 0.00 |
| G | 信息技术业 | 121,079,583.87 | 4.68 |
| H | 批发和零售贸易 | 188,747,148.58 | 7.30 |
| I | 金融、保险业 | 306,462,405.75 | 11.85 |
| J | 房地产业 | 191,701,899.26 | 7.41 |
| K | 社会服务业 | 0.00 | 0.00 |
| L | 传播与文化产业 | 31,651,679.62 | 1.22 |
| M | 综合类 | 0.00 | 0.00 |
| | 合计 | 1,766,639,841.26 | 68.31 |

(3)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股票投资明细

| 序号 | 股票代码 | 股票名称 | 股票数量(股) | 公允价值(元) | 占基金资产净值比例(%) |
|---|---|---|---|---|---|
| 1 | 600068 | 五矿发展 | 4,729,978.00 | 110,728,784.98 | 4.2814 |
| 2 | 000002 | 万 科A | 11,800,000.00 | 106,318,000.00 | 4.1108 |
| 3 | 601808 | 中海油服 | 3,896,015.00 | 91,205,711.15 | 3.5265 |
| 4 | 601186 | 中国铁建 | 8,974,176.00 | 83,998,287.36 | 3.2478 |
| 5 | 601318 | 中国平安 | 1,565,445.00 | 77,113,820.70 | 2.9816 |
| 6 | 600900 | 长江电力 | 5,099,902.00 | 74,713,564.30 | 2.8888 |
| 7 | 600030 | 中信证券 | 3,050,000.00 | 72,956,000.00 | 2.8209 |
| 8 | 000800 | 一汽轿车 | 8,579,826.00 | 71,299,818.44 | 2.7568 |
| 9 | 000895 | 双汇发展 | 1,886,158.00 | 70,353,693.40 | 2.7203 |
| 10 | 000651 | 格力电器 | 2,220,226.00 | 69,493,073.80 | 2.6870 |

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的重大变动

1)报告期内累计买入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 | 本期累计买入金额(元) | 占基金资产净值比例 |
|---|---|---|---|---|
| 1 | 600036 | 招商银行 | 270,189,637.37 | 6.91% |
| 2 | 601318 | 中国平安 | 267,924,540.32 | 6.85% |
| 3 | 000002 | 万 科A | 267,868,034.30 | 6.85% |
| 4 | 601166 | 兴业银行 | 238,114,151.64 | 6.09% |
| 5 | 601666 | 平煤天安 | 221,393,896.47 | 5.66% |
| 6 | 600596 | 新安股份 | 215,435,425.65 | 5.51% |
| 7 | 600030 | 中信证券 | 197,616,067.49 | 5.05% |
| 8 | 000422 | 湖北宜化 | 192,358,912.10 | 4.92% |
| 9 | 601919 | 中国远洋 | 175,290,350.57 | 4.48% |
| 10 | 000960 | 锡业股份 | 174,280,424.73 | 4.46% |
| 11 | 600585 | 海螺水泥 | 167,703,227.12 | 4.29% |
| 12 | 600737 | 中粮屯河 | 157,393,316.28 | 4.02% |
| 13 | 000651 | 格力电器 | 151,845,530.62 | 3.88% |
| 14 | 000792 | 盐湖钾肥 | 138,721,910.04 | 3.55% |
| 15 | 601088 | 中国神华 | 137,658,400.08 | 3.52% |
| 16 | 600000 | 浦发银行 | 135,618,791.16 | 3.47% |
| 17 | 600058 | 五矿发展 | 135,288,437.77 | 3.46% |
| 18 | 000800 | 一汽轿车 | 135,167,591.86 | 3.46% |
| 19 | 002001 | 新 和 成 | 128,178,108.94 | 3.28% |
| 20 | 000031 | 中粮地产 | 124,413,593.24 | 3.18% |
| 21 | 000568 | 泸州老窖 | 110,999,393.05 | 2.84% |
| 22 | 002024 | 苏宁电器 | 106,821,690.33 | 2.73% |
| 23 | 600015 | 华夏银行 | 106,195,127.12 | 2.72% |
| 24 | 601628 | 中国人寿 | 100,748,870.21 | 2.58% |
| 25 | 601808 | 中海油服 | 100,172,447.87 | 2.56% |
| 26 | 600970 | 中材国际 | 99,578,234.26 | 2.55% |
| 27 | 000001 | 深发展A | 98,901,551.25 | 2.53% |
| 28 | 601186 | 中国铁建 | 98,208,467.24 | 2.51% |
| 29 | 600028 | 中国石化 | 95,080,756.80 | 2.43% |
| 30 | 600547 | 山东黄金 | 90,775,877.42 | 2.32% |
| 31 | 600900 | 长江电力 | 87,273,461.87 | 2.23% |
| 32 | 600005 | 武钢股份 | 84,622,026.00 | 2.16% |
| 33 | 600123 | 兰花科创 | 83,673,954.98 | 2.14% |
| 34 | 600423 | 柳化股份 | 82,624,869.45 | 2.11% |

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 | 本期累计卖出金额(元) | 占基金资产净值比例 |
|---|---|---|---|---|
| 1 | 600036 | 招商银行 | 380,839,455.01 | 9.74% |
| 2 | 600000 | 浦发银行 | 304,519,032.42 | 7.79% |
| 3 | 601166 | 兴业银行 | 243,769,626.06 | 6.23% |
| 4 | 002001 | 新 和 成 | 243,373,181.07 | 6.22% |
| 5 | 000651 | 格力电器 | 234,817,751.04 | 6.00% |
| 6 | 000002 | 万 科A | 223,510,839.32 | 5.72% |
| 7 | 002024 | 苏宁电器 | 216,264,271.85 | 5.53% |
| 8 | 601919 | 中国远洋 | 204,752,553.16 | 5.24% |
| 9 | 000960 | 锡业股份 | 183,813,836.97 | 4.70% |
| 10 | 601666 | 平煤天安 | 180,549,837.35 | 4.62% |
| 11 | 601318 | 中国平安 | 180,057,295.52 | 4.60% |
| 12 | 600970 | 中材国际 | 169,566,886.36 | 4.34% |
| 13 | 600596 | 新安股份 | 168,247,632.04 | 4.30% |
| 14 | 600423 | 柳化股份 | 165,174,210.51 | 4.22% |
| 15 | 000422 | 湖北宜化 | 157,336,393.90 | 4.03% |
| 16 | 601088 | 中国神华 | 145,471,859.25 | 3.72% |
| 17 | 002122 | 科华生物 | 142,039,330.75 | 3.63% |
| 18 | 000792 | 盐湖钾肥 | 140,396,721.26 | 3.59% |
| 19 | 600660 | 福耀玻璃 | 132,283,417.21 | 3.38% |
| 20 | 600585 | 海螺水泥 | 132,264,266.82 | 3.38% |
| 21 | 600195 | 中牧股份 | 127,566,530.93 | 3.26% |
| 22 | 000157 | 中联重科 | 109,130,795.07 | 2.79% |
| 23 | 000655 | 金岭矿业 | 104,554,391.47 | 2.67% |
| 24 | 600737 | 中粮屯河 | 99,073,379.91 | 2.53% |
| 25 | 000402 | 金 融 街 | 90,492,883.22 | 2.31% |
| 26 | 000731 | 四川美丰 | 90,325,410.65 | 2.31% |
| 27 | 000910 | 大亚科技 | 85,748,331.08 | 2.19% |
| 28 | 600612 | 中国铅笔 | 83,144,123.34 | 2.13% |
| 29 | 600830 | 香溢融通 | 82,073,557.73 | 2.10% |

3)报告期内买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

| 本期买入股票成本总额 | 本期卖出股票收入总额 |
|---|---|
| 7,200,533,358.60元 | 7,205,666,300.33元 |

注:卖出股票收入总额为清算金额。

(5)报告期末按债券品种分类的债券投资组合

| 序号 | 债券品种 | 公允价值(元) | 占基金资产净值比例(%) |
|---|---|---|---|
| 1 | 国家债券 | 0.00 | 0.00 |
| 2 | 央行票据 | 548,404,000.00 | 21.20 |
| 3 | 金融债券 | 79,640,000.00 | 3.08 |
| | 其中:政策性金融债 | 79,640,000.00 | 3.08 |
| 4 | 企业债券 | 0.00 | 0.00 |
| 5 | 企业短期融资券 | 0.00 | 0.00 |
| 6 | 可转债 | 0.00 | 0.00 |
| 7 | 其他 | 0.00 | 0.00 |
| 8 | 合计 | 628,044,000.00 | 24.28 |

(6)报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名债券投资明细

| 序号 | 债券代码 | 债券名称 | 数量(张) | 公允价值(元) | 占基金资产净值比例(%) |
|---|---|---|---|---|---|
| 1 | 0701121 | 07央票121 | 3,400,000 | 327,250,000.00 | 12.65 |
| 2 | 0701124 | 07央票124 | 1,000,000 | 96,220,000.00 | 3.72 |
| 3 | 0801010 | 08央行票据10 | 1,000,000 | 96,110,000.00 | 3.72 |
| 4 | 040220 | 04国开(20) | 800,000 | 79,640,000.00 | 3.08 |
| 5 | 0801025 | 08央行票据25 | 300,000 | 28,824,000.00 | 1.11 |

(7)报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名资产支持证券投资明细

本基金报告期末未持有资产支持证券。

(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十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十名股票投资没有超出基金合同规定的股票备选库。

3)本基金报告期末其他资产构成如下:

| 序号 | 名称 | 金额(元) |
|---|---|---|
| 1 | 存出保证金 | 5,497,696.77 |
| 2 | 应收证券清算款 | 0.00 |
| 3 | 应收股利 | 298,430.71 |
| 4 | 应收利息 | 12,731,994.19 |
| 5 | 应收申购款 | 2,464,397.99 |
| 6 | 其他应收款 | 0.00 |
| 7 | 待摊费用 | 33,517.70 |
| 8 | 其他 | 0.00 |
| 9 | 合计 | 21,026,037.36 |

4)本基金报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

5)本基金在本报告期内获得的权证明细如下:

a.股权分置改革被动持有:无。

b. 本报告期内本基金无主动投资权证情况,因投资分离交易的可转换公司债券获得发行人派发的认股权证情况如下:

| 权证代码 | 权证名称 | 数量(份) | 成本(元) |
|---|---|---|---|
| 580022 | 国电CWB1 | 986,219.00 | 2,310,612.50 |
| 580023 | 康美CWB1 | 489,140.00 | 813,831.13 |
| 合计 | | 1,475,359.00 | 3,124,443.63 |

6)本基金报告期末未持有权证。

7)基金管理人于2008年3月3日通过代销机构申购本基金402,500元,申购费率为1.2%。基金管理人按照有关规定于2008年2月28日进行了公开披露。

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情况

截至2008年6月30日,本基金资产组合列表如下:

| 序号 | 项目 | 金额(元) | 占基金总资产的比例(%) |
|---|---|---|---|
| 1 | 权益类投资 | 1,640,730,883.13 | 69.41 |
| | 其中:股票 | 1,640,730,883.13 | 69.41 |
| 2 | 固定收益类投资 | 608,421,663.70 | 25.74 |
| | 其中:债券 | 608,421,663.70 | 25.74 |
| | 资产支持证券 | 0.00 | 0.00 |
| 3 | 金融衍生品投资－权证 | 0.00 | 0.00 |
| 4 | 买入返售金融资产 | 0.00 | 0.00 |
| | 其中:买断式回购的买入返售金融资产 | 0.00 | 0.00 |
| 5 | 银行存款和结算备付金合计 | 95,714,703.55 | 4.05 |
| 6 | 其他资产 | 18,845,636.18 | 0.80 |
| 7 | 合计 | 2,363,712,886.56 | 100.00 |

(2)报告期末按行业分类的股票投资组合

| 代码 | 分类 | 公允价值(元) | 占基金资产净值比例(%) |
|---|---|---|---|
| A | 农、林、牧、渔业 | 12,163,058.52 | 0.52 |
| B | 采掘业 | 134,049,178.35 | 5.70 |
| C | 制造业 | 641,142,768.41 | 27.26 |
| C0 | 其中:食品、饮料 | 159,690,205.37 | 6.79 |
| C1 | 纺织、服装、皮毛 | 0.00 | 0.00 |
| C2 | 木材、家具 | 0.00 | 0.00 |
| C3 | 造纸、印刷 | 20,800,000.00 | 0.88 |
| C4 | 石油、化学、塑胶、塑料 | 58,295,338.97 | 2.48 |
| C5 | 电子 | 5,099,243.50 | 0.22 |
| C6 | 金属、非金属 | 118,629,619.00 | 5.05 |
| C7 | 机械、设备、仪表 | 245,328,361.57 | 10.44 |
| C8 | 医药、生物制品 | 33,300,000.00 | 1.42 |
| C99 | 其他制造业 | 0.00 | 0.00 |
| D | 电力、煤气及水的生产和供应业 | 43,950,000.00 | 1.87 |
| E | 建筑业 | 49,924,836.00 | 2.12 |
| F | 交通运输、仓储业 | 107,460,000.00 | 4.57 |
| G | 信息技术业 | 0.00 | 0.00 |
| H | 批发和零售贸易 | 161,166,873.29 | 6.86 |
| I | 金融、保险业 | 356,618,861.22 | 15.17 |
| J | 房地产业 | 50,704,447.18 | 2.16 |
| K | 社会服务业 | 45,495,000.00 | 1.94 |
| L | 传播与文化产业 | 0.00 | 0.00 |
| M | 综合类 | 38,055,860.16 | 1.62 |
| | 合计 | 1,640,730,883.13 | 69.79 |

(3)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股票投资明细

| 序号 | 股票代码 | 股票名称 | 股票数量(股) | 公允价值(元) | 占基金资产净值比例(%) |
|---|---|---|---|---|---|
| 1 | 000001 | 深发展A | 4,400,920.00 | 85,089,783.60 | 3.6185 |
| 2 | 601318 | 中国平安 | 1,400,000.00 | 68,964,000.00 | 2.9334 |
| 3 | 600547 | 山东黄金 | 1,300,857.00 | 67,059,178.35 | 2.8524 |
| 4 | 600028 | 中国石化 | 6,600,000.00 | 66,990,000.00 | 2.8494 |
| 5 | 600000 | 浦发银行 | 2,900,000.00 | 63,800,000.00 | 2.7137 |
| 6 | 600585 | 海螺水泥 | 1,390,952.00 | 55,624,170.48 | 2.366 |
| 7 | 000338 | 潍柴动力 | 1,380,000.00 | 55,614,000.00 | 2.3655 |
| 8 | 000895 | 双汇发展 | 1,400,866.00 | 52,252,301.80 | 2.2226 |
| 9 | 600739 | 辽宁成大 | 2,000,000.00 | 49,680,000.00 | 2.1131 |
| 10 | 601398 | 工商银行 | 10,000,000.00 | 49,600,000.00 | 2.1097 |

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的重大变动

1)报告期内累计买入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 | 本期累计买入金额(元) | 占基金资产净值比例 |
|---|---|---|---|---|
| 1 | 600900 | 长江电力 | 175,538,631.57 | 4.51% |
| 2 | 000001 | 深发展A | 96,754,267.15 | 2.49% |
| 3 | 601318 | 中国平安 | 92,834,351.92 | 2.39% |
| 4 | 600000 | 浦发银行 | 86,778,618.09 | 2.23% |
| 5 | 600028 | 中国石化 | 81,861,597.61 | 2.11% |
| 6 | 600585 | 海螺水泥 | 79,810,106.00 | 2.05% |
| 7 | 600739 | 辽宁成大 | 76,584,513.50 | 1.97% |
| 8 | 600547 | 山东黄金 | 75,320,642.53 | 1.94% |
| 9 | 600361 | 华联综超 | 69,771,963.95 | 1.79% |
| 10 | 600030 | 中信证券 | 66,388,405.86 | 1.71% |
| 11 | 600761 | 安徽合力 | 64,011,636.12 | 1.65% |
| 12 | 600195 | 中牧股份 | 57,918,338.85 | 1.49% |
| 13 | 000895 | 双汇发展 | 55,250,678.91 | 1.42% |
| 14 | 601857 | 中国石油 | 53,597,380.21 | 1.38% |
| 15 | 601898 | 中煤能源 | 52,421,166.61 | 1.35% |
| 16 | 000800 | 一汽轿车 | 51,389,463.46 | 1.32% |
| 17 | 600895 | 张江高科 | 50,763,938.55 | 1.31% |
| 18 | 600308 | 华泰股份 | 48,891,150.74 | 1.26% |
| 19 | 601186 | 中国铁建 | 48,760,037.77 | 1.25% |
| 20 | 000338 | 潍柴动力 | 47,969,375.13 | 1.23% |

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 | 本期累计卖出金额(元) | 占基金资产净值比例 |
|---|---|---|---|---|
| 1 | 600900 | 长江电力 | 165,729,931.03 | 4.26% |
| 2 | 600879 | 火箭股份 | 132,014,524.03 | 3.40% |
| 3 | 000069 | 华侨城A | 119,841,952.41 | 3.08% |
| 4 | 000338 | 潍柴动力 | 112,084,584.61 | 2.88% |
| 5 | 601398 | 工商银行 | 106,190,916.99 | 2.73% |
| 6 | 600428 | 中远航运 | 96,360,375.98 | 2.48% |
| 7 | 601318 | 中国平安 | 80,729,436.37 | 2.08% |
| 8 | 600309 | 烟台万华 | 75,855,906.19 | 1.95% |
| 9 | 600118 | 中国卫星 | 74,350,259.23 | 1.91% |
| 10 | 600887 | 伊利股份 | 71,989,763.57 | 1.85% |
| 11 | 600153 | 建发股份 | 66,723,905.06 | 1.72% |
| 12 | 600739 | 辽宁成大 | 65,187,723.35 | 1.68% |
| 13 | 600036 | 招商银行 | 64,393,623.53 | 1.66% |
| 14 | 600423 | 柳化股份 | 60,612,242.02 | 1.56% |
| 15 | 601898 | 中煤能源 | 52,539,322.73 | 1.35% |
| 16 | 601088 | 中国神华 | 49,163,488.12 | 1.26% |
| 17 | 000402 | 金 融 街 | 47,607,499.42 | 1.22% |
| 18 | 601857 | 中国石油 | 47,178,146.50 | 1.21% |
| 19 | 600533 | 栖霞建设 | 45,342,458.48 | 1.17% |
| 20 | 601919 | 中国远洋 | 44,758,361.38 | 1.15% |

3)报告期内买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

| 本期买入股票成本总额 | 本期卖出股票收入总额 |
|---|---|
| 2,660,044,318.04元 | 2,365,903,124.33元 |

注:卖出股票收入总额为清算金额。

(5)报告期末按债券品种分类的债券投资组合

| 序号 | 债券品种 | 公允价值(元) | 占基金资产净值比例(%) |
|---|---|---|---|
| 1 | 国家债券 | 260,208,391.30 | 11.07 |
| 2 | 央行票据 | 345,984,000.00 | 14.72 |
| 3 | 金融债券 | 2,229,272.40 | 0.09 |
| | 其中:政策性金融债 | 0.00 | 0.00 |
| 4 | 企业债券 | 0.00 | 0.00 |
| 5 | 企业短期融资券 | 0.00 | 0.00 |
| 6 | 可转债 | 0.00 | 0.00 |
| 7 | 其他 | 0.00 | 0.00 |
| 8 | 合计 | 608,421,663.70 | 25.88 |

(6)报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名债券投资明细

| 序号 | 债券代码 | 债券名称 | 数量(张) | 公允价值(元) | 占基金资产净值比例(%) |
|---|---|---|---|---|---|
| 1 | 0801019 | 08央行票据19 | 1,900,000 | 182,571,000.00 | 7.77 |
| 2 | 010115 | 21国债(15) | 1,300,000 | 129,935,000.00 | 5.53 |
| 3 | 010210 | 02国债(10) | 1,300,000 | 128,219,000.00 | 5.45 |
| 4 | 0801028 | 08央行票据28 | 1,000,000 | 96,080,000.00 | 4.09 |
| 5 | 0701133 | 07央行票据133 | 700,000 | 67,333,000.00 | 2.86 |

(7)报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名资产支持证券投资明细

本基金报告期末未持有资产支持证券。

(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十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。本基金投资的前十名股票均为合同规定的成分股。

3)本基金报告期末其他资产构成如下:

| 序号 | 名称 | 金额(元) |
|---|---|---|
| 1 | 存出保证金 | 1,455,716.77 |
| 2 | 应收证券清算款 | 6,698,901.47 |
| 3 | 应收股利 | 0.00 |
| 4 | 应收利息 | 10,220,688.50 |
| 5 | 应收申购款 | 436,811.74 |
| 6 | 其他应收款 | 0.00 |
| 7 | 待摊费用 | 33,517.70 |
| 8 | 其他 | 0.00 |
| 9 | 合计 | 18,845,636.18 |

4)本基金报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

5)本基金在本报告期内获得的权证明细如下:

a.股权分置改革被动持有:无。

b.本报告期内本基金无主动投资权证情况,因投资分离交易的可转换公司债券获得发行人派发的认股权证情况如下:

| 权证代码 | 权证名称 | 数量(份) | 成本(元) |
|---|---|---|---|
| 580018 | 中远CWB1 | 94,080.00 | 655,925.76 |
| 580020 | 上港CWB1 | 1,106,343.00 | 1,647,123.46 |
| 580021 | 青啤CWB1 | 158,130.00 | 586,203.72 |
| 合计 | | 1,358,553.00 | 2,889,252.94 |

6)本基金报告期末未持有权证。

7)基金管理人于2008年3月3日通过代销机构申购本基金652,500元,申购费率为1.2%。基金管理人按照有关规定于2008年2月28日进行了公开披露。

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情况

截至2008年6月30日,本基金资产组合列表如下:

| 序号 | 项目 | 金额(元) | 占基金总资产的比例(%) |
|---|---|---|---|
| 1 | 权益类投资 | 403,074,296.91 | 4.94 |
| | 其中:股票 | 403,074,296.91 | 4.94 |
| 2 | 固定收益类投资 | 6,760,748,474.60 | 82.79 |
| | 其中:债券 | 6,760,748,474.60 | 82.79 |
| | 资产支持证券 | 0.00 | 0.00 |
| 3 | 金融衍生品投资－权证 | 0.00 | 0.00 |
| 4 | 买入返售金融资产 | 0.00 | 0.00 |
| | 其中:买断式回购的买入返售金融资产 | 0.00 | 0.00 |
| 5 | 银行存款和结算备付金合计 | 121,510,009.52 | 1.49 |
| 6 | 其他资产 | 880,335,809.15 | 10.78 |
| 7 | 合计 | 8,165,668,590.18 | 100.00 |

(2)报告期末按行业分类的股票投资组合

| 代码 | 分类 | 公允价值(元) | 占基金资产净值比例(%) |
|---|---|---|---|
| A | 农、林、牧、渔业 | 326,815.28 | 0.00 |
| B | 采掘业 | 171,339,703.90 | 2.10 |
| C | 制造业 | 178,217,852.80 | 2.19 |
| C0 | 其中:食品、饮料 | 0.00 | 0.00 |
| C1 | 纺织、服装、皮毛 | 235,096.40 | 0.00 |
| C2 | 木材、家具 | 971,774.61 | 0.01 |
| C3 | 造纸、印刷 | 790,039.26 | 0.01 |
| C4 | 石油、化学、塑胶、塑料 | 3,915,244.96 | 0.05 |
| C5 | 电子 | 1,386,456.40 | 0.02 |
| C6 | 金属、非金属 | 161,909,028.28 | 1.99 |
| C7 | 机械、设备、仪表 | 3,950,721.29 | 0.05 |
| C8 | 医药、生物制品 | 4,868,660.67 | 0.06 |
| C99 | 其他制造业 | 190,830.90 | 0.00 |
| D | 电力、煤气及水的生产和供应业 | 0.00 | 0.00 |
| E | 建筑业 | 39,249,849.60 | 0.48 |
| F | 交通运输、仓储业 | 0.00 | 0.00 |
| G | 信息技术业 | 1,532,654.00 | 0.02 |
| H | 批发和零售贸易 | 1,074,994.10 | 0.01 |
| I | 金融、保险业 | 0.00 | 0.00 |
| J | 房地产业 | 10,679,738.16 | 0.13 |
| K | 社会服务业 | 169,267.32 | 0.00 |
| L | 传播与文化产业 | 483,421.75 | 0.01 |
| M | 综合类 | 0.00 | 0.00 |
| | 合计 | 403,074,296.91 | 4.95 |

(3)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股票投资明细

| 序号 | 股票代码 | 股票名称 | 股票数量(股) | 公允价值(元) | 占基金资产净值比例(%) |
|---|---|---|---|---|---|
| 1 | 600585 | 海螺水泥 | 4,006,592.00 | 160,223,614.08 | 1.9675 |
| 2 | 601088 | 中国神华 | 1,399,000.00 | 52,560,430.00 | 0.6454 |
| 3 | 601186 | 中国铁建 | 4,193,360.00 | 39,249,849.60 | 0.4820 |
| 4 | 601899 | 紫金矿业 | 4,899,627.00 | 38,217,090.60 | 0.4693 |
| 5 | 601898 | 中煤能源 | 2,184,274.00 | 34,904,698.52 | 0.4286 |
| 6 | 601958 | 金钼股份 | 1,545,089.00 | 26,297,414.78 | 0.3229 |
| 7 | 601808 | 中海油服 | 827,000.00 | 19,360,070.00 | 0.2377 |
| 8 | 000402 | 金 融 街 | 1,176,296.00 | 8,645,775.60 | 0.1062 |
| 9 | 600557 | 康缘药业 | 214,400.00 | 4,193,664.00 | 0.0515 |
| 10 | 002244 | 滨江集团 | 129,717.00 | 2,033,962.56 | 0.0250 |

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的重大变动

1)报告期内累计买入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 | 本期累计买入金额(元) | 占基金资产净值比例 |
|---|---|---|---|---|
| 1 | 600585 | 海螺水泥 | 229,898,249.00 | 1.72% |
| 2 | 601186 | 中国铁建 | 99,129,628.80 | 0.74% |
| 3 | 601898 | 中煤能源 | 91,761,771.42 | 0.68% |
| 4 | 601899 | 紫金矿业 | 50,991,100.51 | 0.38% |
| 5 | 601958 | 金钼股份 | 38,924,404.73 | 0.29% |
| 6 | 600481 | 双良股份 | 27,652,477.35 | 0.21% |
| 7 | 000807 | 云铝股份 | 19,290,561.84 | 0.14% |
| 8 | 000402 | 金 融 街 | 18,043,079.78 | 0.13% |
| 9 | 600557 | 康缘药业 | 5,429,746.74 | 0.04% |
| 10 | 002244 | 滨江集团 | 4,868,652.27 | 0.04% |
| 11 | 002003 | 伟星股份 | 3,827,145.30 | 0.03% |
| 12 | 600409 | 三友化工 | 3,557,871.90 | 0.03% |
| 13 | 002240 | 威华股份 | 2,750,938.30 | 0.02% |
| 14 | 002242 | 九阳股份 | 2,310,079.52 | 0.02% |
| 15 | 002237 | 恒邦股份 | 1,555,942.20 | 0.01% |
| 16 | 002233 | 塔牌集团 | 1,512,493.91 | 0.01% |
| 17 | 002241 | 歌尔声学 | 1,270,185.30 | 0.01% |
| 18 | 002258 | 利尔化学 | 1,267,680.04 | 0.01% |
| 19 | 002251 | 步 步 高 | 1,242,503.36 | 0.01% |
| 20 | 002236 | 大华股份 | 874,409.52 | 0.01% |

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 | 本期累计卖出金额(元) | 占基金资产净值比例 |
|---|---|---|---|---|
| 1 | 601186 | 中国铁建 | 70,916,761.64 | 0.53% |
| 2 | 601898 | 中煤能源 | 55,228,750.34 | 0.41% |
| 3 | 601390 | 中国中铁 | 44,996,982.53 | 0.34% |
| 4 | 601169 | 北京银行 | 43,095,670.35 | 0.32% |
| 5 | 601866 | 中海集运 | 41,188,792.57 | 0.31% |
| 6 | 601318 | 中国平安 | 38,386,948.38 | 0.29% |
| 7 | 002202 | 金风科技 | 32,382,969.25 | 0.24% |
| 8 | 601899 | 紫金矿业 | 30,958,786.57 | 0.23% |
| 9 | 600030 | 中信证券 | 30,272,993.28 | 0.23% |
| 10 | 600481 | 双良股份 | 29,541,782.95 | 0.22% |
| 11 | 601919 | 中国远洋 | 27,527,662.32 | 0.21% |
| 12 | 601857 | 中国石油 | 19,814,634.58 | 0.15% |
| 13 | 002191 | 劲嘉股份 | 18,791,318.04 | 0.14% |
| 14 | 601958 | 金钼股份 | 17,039,522.72 | 0.13% |
| 15 | 000807 | 云铝股份 | 11,937,218.14 | 0.09% |
| 16 | 601999 | 出版传媒 | 7,251,383.64 | 0.05% |
| 17 | 002155 | 辰州矿业 | 4,955,021.19 | 0.04% |
| 18 | 600320 | 振华港机 | 4,648,459.07 | 0.03% |
| 19 | 601918 | 国投新集 | 4,250,923.75 | 0.03% |
| 20 | 600409 | 三友化工 | 3,857,510.60 | 0.03% |

3)报告期内买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

| 本期买入股票成本总额 | 本期卖出股票收入总额 |
|---|---|
| 621,872,801.45元 | 592,112,938.38元 |

注:卖出股票收入总额为清算金额。

(5)报告期末按债券品种分类的债券投资组合

| 序号 | 债券品种 | 公允价值(元) | 占基金资产净值比例(%) |
|---|---|---|---|
| 1 | 国家债券 | 9,940,000.00 | 0.12 |
| 2 | 央行票据 | 6,666,136,000.00 | 81.86 |
| 3 | 金融债券 | 77,864,170.40 | 0.96 |
| | 其中:政策性金融债 | 0.00 | 0.00 |
| 4 | 企业债券 | 6,808,304.20 | 0.08 |
| 5 | 企业短期融资券 | 0.00 | 0.00 |
| 6 | 可转债 | 0.00 | 0.00 |
| 7 | 其他 | 0.00 | 0.00 |
| 8 | 合计 | 6,760,748,474.60 | 83.02 |

(6)报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名债券投资明细

| 序号 | 债券代码 | 债券名称 | 数量(张) | 公允价值(元) | 占基金资产净值比例(%) |
|---|---|---|---|---|---|
| 1 | 0801034 | 08央行票据34 | 16,000,000 | 1,537,280,000.00 | 18.88 |
| 2 | 0801047 | 08央行票据47 | 11,000,000 | 1,098,460,000.00 | 13.49 |
| 3 | 0801065 | 08央行票据65 | 10,000,000 | 998,100,000.00 | 12.26 |
| 4 | 0701139 | 07央行票据139 | 5,000,000 | 480,700,000.00 | 5.90 |
| 5 | 0701097 | 07央行票据97 | 4,500,000 | 435,285,000.00 | 5.35 |

(7)报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名资产支持证券投资明细

本基金报告期末未持有资产支持证券。

(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十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。所投资的前十名股票均为按基金合同规定在一级市场申购所得股票。

3)本基金报告期末其他资产构成如下:

| 序号 | 名称 | 金额(元) |
|---|---|---|
| 1 | 存出保证金 | 250,000.00 |
| 2 | 应收证券清算款 | 793,217,725.00 |
| 3 | 应收股利 | 63,379.18 |
| 4 | 应收利息 | 82,806,767.74 |
| 5 | 应收申购款 | 3,964,420.33 |
| 6 | 其他应收款 | 0.00 |
| 7 | 待摊费用 | 33,516.90 |
| 8 | 其他 | 0.00 |
| 9 | 合计 | 880,335,809.15 |

4)本基金报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

5)本基金在本报告期内获得的权证明细如下:

a.股权分置改革被动持有:无。

b.本报告期内本基金无主动投资权证情况,因投资分离交易的可转换公司债券获得发行人派发的认股权证情况如下:

| 权证代码 | 权证名称 | 数量(份) | 成本(元) |
|---|---|---|---|
| 580017 | 赣粤CWB1 | 440,625.00 | 1,808,457.19 |
| 580018 | 中远CWB1 | 218,638.00 | 1,125,854.52 |
| 580019 | 石化CWB1 | 3,319,567.00 | 7,688,449.13 |
| 580020 | 上港CWB1 | 1,106,343.00 | 1,647,123.46 |
| 580021 | 青啤CWB1 | 316,260.00 | 1,172,407.44 |
| 580022 | 国电CWB1 | 998,203.00 | 2,338,689.81 |
| 580023 | 康美CWB1 | 489,140.00 | 813,831.13 |
| 合计 | | 6,888,776.00 | 16,594,812.68 |

6)本基金报告期末未持有权证。

7)基金管理人于2008年2月22日通过代销机构申购本基金80,000,000元,申购费1000元,基金管理人按照有关规定于2008年2月20日进行了公开披露;于2008年3月3日通过代销机构申购本基金1,527,500元,申购费率为0.6%,于2008年2月28日进行了公开披露。

**第七章 基金份额持有人户数、持有人结构**

1.基金份额持有人户数、持有人结构

本系列基金报告期末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(户) | 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 | 73,836 | 31,890.83 | 754,365,840.48 | 1,600,325,306.32 | 32.04% | 67.96% |
| 宝康灵活配置 | 60,611 | 29,714.36 | 647,761,401.66 | 1,153,255,871.83 | 35.97% | 64.03% |
| 宝康债券 | 17,383 | 409,384.37 | 6,460,879,182.27 | 655,449,370.09 | 90.79% | 9.21% |

2.期末基金管理公司从业人员投资开放式基金的情况

| 项目 | | 期末持有本开放式基金份额的总量(份) | 占本基金总份额的比例 |
|---|---|---|---|
| 基金管理公司持有本基金的所有从业人