

宝盈泛沿海区域增长股票 证券投资基金

2006 年年度报告

基金管理人：宝盈基金管理有限公司

基金托管人：中国工商银行股份有限公司

送出日期：二零零七年三月

宝盈泛沿海区域增长股票证券投资基金 2006 年年度报告

第一节 重要提示及目录

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。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2007 年 3 月 27 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代表其未来表现。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。

目 录

第一节	重要提示及目录	1
第二节	基金简介	2
第三节	主要财务指标、基金净值表现及收益分配情况	3
第四节	管理人报告	5
第五节	托管人报告	7
第六节	审计报告	7
第七节	财务会计报告	9
第八节	基金投资组合报告	20
第九节	基金份额持有人户数、持有人结构	27
第十节	开放式基金份额变动	27
第十一节	重大事件揭示	27
第十二节	备查文件目录	30

第二节 基金简介

(一) 基金名称：	宝盈泛沿海区域增长股票证券投资基金
基金简称：	宝盈泛沿海
基金代码：	213002
基金运作方式：	契约型开放式
基金合同生效日：	2005年3月8日
报告期末基金份额总额：	356,608,933.87份

(二) 基金投资

投资目标：通过投资于泛沿海地区有增长潜力的上市公司，有效分享中国经济快速增长的成果，在严格控制基金投资风险的前提下保持基金财产持续稳健增值。

投资策略：本基金采取“自上而下”进行资产配置和行业及类属资产配置，“自下而上”精选个股的积极投资策略。

在整体资产配置层面，本基金根据宏观经济运行状况、财政、货币政策、国家产业政策及各区域经济发展政策调整情况、市场资金环境等因素，决定股票、债券及现金的配置比例。

在区域资产配置及行业权重层面，本基金根据区域经济特点及区域内各行业经营发展情况、行业景气状况、竞争优势等因素动态调整基金财产配置在各行业的权重。

在个股选择层面，本基金以 PEG、每股经营活动现金流量、净利润增长率及行业地位等指标为依据，通过公司投资价值评估方法选择具备持续增长潜力的上市公司进行投资。

业绩比较基准：

上证 A 股指数×80% + 上证国债指数×20%

当市场出现合适的全市场统一指数时，本基金股票部分的业绩比较基准将适时调整为全市场统一指数。

风险收益特征：

本基金属于区域类增长型股票基金，风险介于价值型股票基金与积极成长型股票基金之间，适于能承担一定风险，追求较高收益和长期资本增值的投资人投资。

(三) 基金管理人

法定名称：	宝盈基金管理有限公司
注册及办公地址：	深圳市福田区深圳特区报业大厦15层
邮政编码：	518034
法定代表人：	李建生
信息披露负责人：	刘传葵
联系电话：	0755-83276688-5698
传真：	0755-83515622

电子邮箱： liuck@byfunds.com

(四) 基金托管人

法定名称： 中国工商银行股份有限公司(以下简称"中国工商银行")

注册地址： 北京市西城区复兴门内大街55号

办公地址： 北京市西城区复兴门内大街55号

邮政编码： 100032

法定代表人： 姜建清

信息披露负责人： 蒋松云

联系电话： (010) 66106912

传真： (010) 66106904

电子邮箱： custody@icbc.com.cn

(五) 信息披露媒体

报纸名称： 中国证券报、证券时报、上海证券报

基金管理人互联网网址：<http://www.byfunds.com>

基金年度报告置备地点： 基金管理人、基金托管人处

(六) 注册登记机构

法定名称： 宝盈基金管理有限公司

办公地址： 广东省深圳市福田区深圳特区报业大厦15层

(七) 会计师事务所

法定名称： 普华永道中天会计师事务所有限公司

办公地址： 上海湖滨路202号普华永道中心11楼

第三节 主要财务指标、基金净值表现及收益分配情况

(一) 主要会计数据和财务指标(截止 2006 年 12 月 31 日)

单位：人民币元

	主要会计数据和财务指标	2006年12月31日	2005年12月31日
1	基金本期净收益	74,675,741.84	1,645,951.97
2	基金份额本期净收益	0.7423	0.0071
3	期末可供分配基金收益	34,289,659.82	-4,444,683.48
4	期末可供分配基金份额收益	0.0962	-0.0226
5	期末基金资产净值	392,335,027.49	196,994,831.47
6	期末基金份额净值	1.1002	1.0024
7	基金加权平均净值收益率	59.34%	0.68%

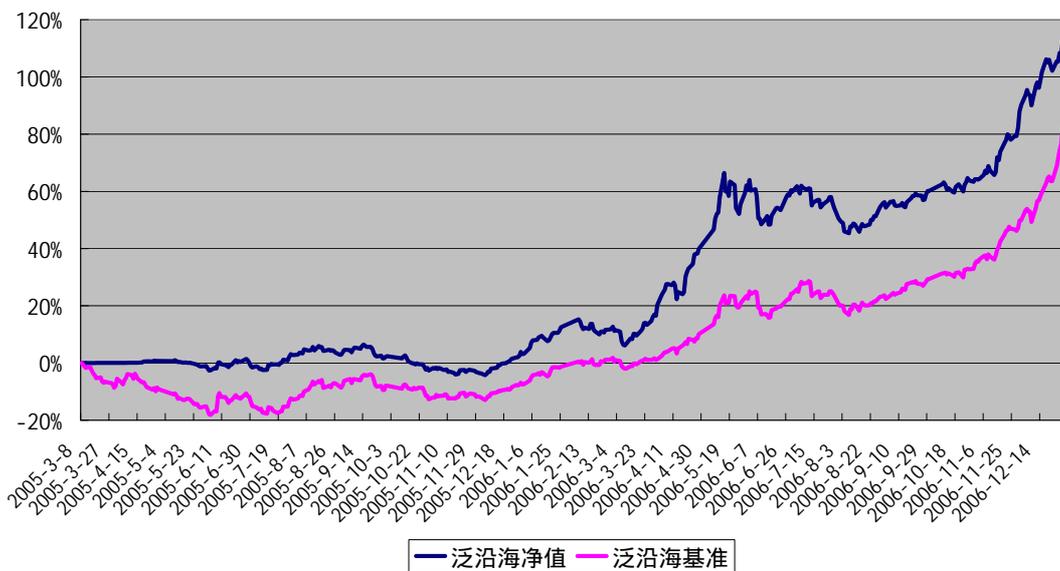
8	本期基金份额净值增长率	105.78%	3.21%
9	基金份额累计净值增长率	112.39%	3.21%

提示：上述基金业绩指标不包括份额持有人认购或者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字。

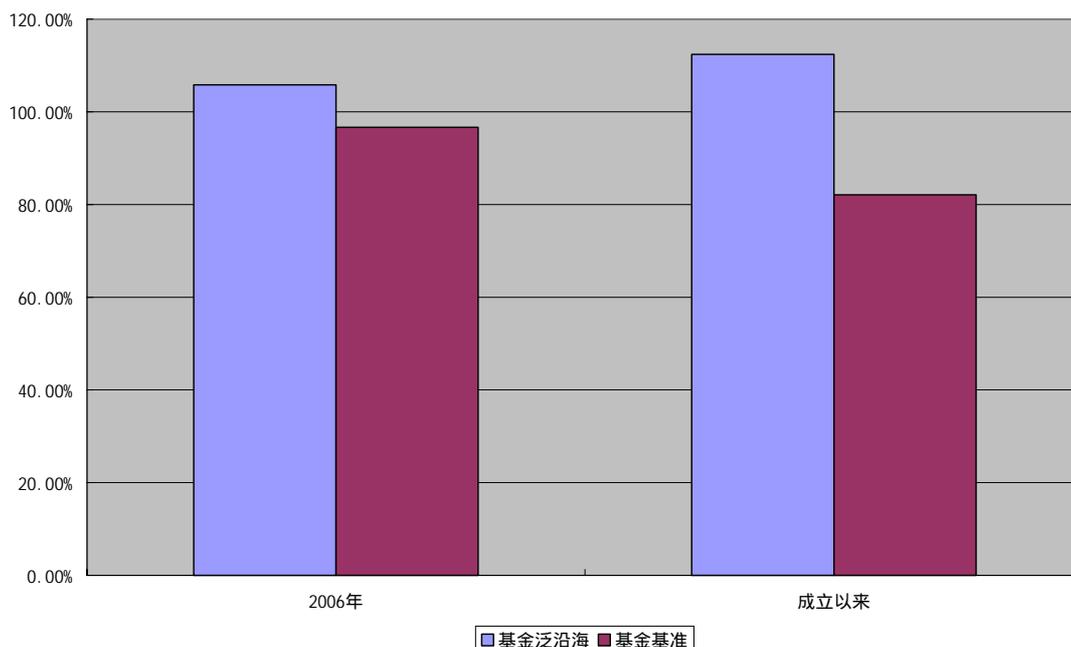
(二) 同期业绩比较(截止 2006 年 12 月 31 日)

阶段	净值增长率	净值增长标准差	业绩比较基准收益率	业绩比较基准收益率标准差	-	-
过去 3 个月	32.67%	1.17%	40.75%	1.10%	-8.08%	0.07%
过去 6 个月	32.84%	1.11%	46.47%	1.07%	-13.63%	0.04%
过去 1 年	105.78%	1.40%	96.64%	1.08%	9.14%	0.32%
自基金成立至今	112.39%	1.11%	82.07%	1.09%	30.32%	0.02%

(三) 基金净值表现(截止 2006 年 12 月 31 日)



(四) 基金净值增长率与业绩比较基准历年收益率对比图



(五) 基金收益分配情况

单位：人民币元

年度	每 10 份基金份额分红数	备注
2005 年	0.30	本年分红 1 次
2006 年	8.20	本年分红 4 次
合计	8.50	

第四节 管理人报告

(一) 基金管理人及基金经理简介

基金管理人：宝盈基金管理有限公司是 2001 年按照证监会“新的治理结构、新的内控体系”标准设立的首批基金管理公司之一，2001 年 5 月 18 日成立，注册资本为人民币 1 亿元，注册地在深圳。公司目前管理两只封闭式基金（基金鸿飞、基金鸿阳）和两只开放式基金（宝盈鸿利收益证券投资基金、宝盈泛沿海区域增长股票证券投资基金），公司恪守价值投资的投资理念，并逐渐形成了稳健、规范的投资风格。公司拥有一支经验丰富的投资管理团队，在研究方面，公司汇聚着一批从事宏观经济、行业、上市公司、债券和金融工程研究的专业人才，为公司的投资决策提供科学的研究支持；在投资方面，公司的基金经理都具有丰富的证券市场投资经验，并有着良好的过往业绩，他们以自己专业知识使基金业绩不断提高，努力为投资者创造丰厚的回报。

基金经理：祝东升先生，上海财经大学经济学硕士，曾在北京证券、联合证券等证券公司从事证券投资业务，12 年证券投资管理经历。2004 年 3 月加盟宝盈基金管理有限公司，

任总经理助理、基金管理部总监。现为宝盈泛沿海股票证券投资基金基金经理。

(二) 本报告期内基金运作的遵规守信情况

在本报告期内,本基金管理人严格遵守了《中华人民共和国证券投资基金法》及各项配套法规、《宝盈泛沿海区域增长股票证券投资基金基金合同》和其他有关法律法规的规定,并本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产,在严格控制风险的基础上,为基金持有人谋求最大利益。无损害基金持有人利益的行为。基金投资范围、投资比例、投资组合符合有关法规及基金合同的规定。

(三) 本报告期内基金的投资策略和业绩表现

2006 年是中国资本市场发展具有重要历史意义的一年,在全球流动性过剩、人民币持续升值和中国宏观经济快速稳健发展的大背景下,A 股市场的制度性变革取得了突破性进展,股权分置改革年内基本完成,证券公司综合治理成效显著,价值投资理念日益深入人心,A 股市场演绎了一轮汹涌壮阔的大幅上扬行情,上证综合指数稳步攀升,创下近十年新高。宝盈泛沿海区域增长股票证券投资基金自 05 年 3 月 8 日成立以来,基金份额净值增长率为 112.39%,业绩比较基准增长率为 82.07%,本基金净值增长优于业经基准。2006 年度净值翻番并为基金持有人实现四次分红,累计分红金额为每 10 份 8.5 元。

2005 年 12 月 A 股市场见底回升。我国宏观经济呈现高增长的格局,城镇固定资产投资延续平稳快速增长的势头,国际贸易顺差持续增长,消费稳定增长。伴随国内经济快速增长以及世界主要经济体经济的复苏,能源及资源紧张,石油、贵金属、基本金属、糖等商品价格持续上涨;房价稳中有升;银行信贷投放较快,流动性充足;人民币持续稳定升值且趋势未变。基于对这些基本面的分析,我们集中重点配置了受益于证券市场快速发展的证券公司;受益于商品涨价的资源类公司;受益于人民币升值及需求强劲的房地产等龙头公司;受益于消费升级而持续增长的食品饮料类公司;3G 主题下的通信设备制造商和具有持续增长潜力的优质银行股成为我们投资的选择对象;制造业中具有全球核心竞争力的公司、部分景气走出低谷的周期性行业的龙头公司(工程机械、水泥、钢铁、石油化工等)以及国家鼓励重点投资行业的部分上市公司也是我们配置的目标。

(四) 2007 年的宏观经济和市场前景展望

随着股权分置改革的基本完成,随着制度性变革的不断推进,证券市场已步入健康、快速、有序的发展时期。展望 2007 年,宏观经济持续发展,中国资本市场将迎来更大的发展空间。投资基金的高速扩容、人民币的持续升值、股指期货等金融衍生品的推出、大型国有企业在 A 股市场的发行与上市等必将使 2007 年成为又一个充满机遇与挑战的一年。我们判断中国经济的增长速度、投资、消费等方面都具有内在的高速增长潜力,2007 年乃至今后两年将是中国经济新一轮景气周期的扩张期。在中国经济持续稳健快速增长的大背景下,我们继续看好 2007 年中国股票市场的投资机会,尤其是更多的具有行业代表性的领导型公司陆续在 A 股市场上市,为投资中国的股票市场提供了良好的机遇。我们继续看好消费升级、

自主创新、人民币升值和大股东向股份公司注入资产、收购兼并等因素带来的投资机会。这些机会出现的行业包括金融、食品饮料、商业零售、地产、医药制造、通信、装备制造、高成长性的新兴行业等。我们仍将持有人的绝对回报放在首位，努力提高经风险调整后的净值增长水平。谢谢持有人对本基金的厚爱和支持。希望继续得到你们一贯的支持和信任。

（五）内部监察稽核报告

本报告期，公司监察稽核部门通过加强对基金投资交易业务的日常交易监控、交易流程检查、注册登记、客户服务等业务进行日常跟踪检查等工作，不断加强和完善对投资交易的事前、事中和事后控制，并定期出具专项监察报告及合规性报告等，对基金投资运作的合规性情况等总结报告。

通过以上工作，在本报告期内本基金运作过程中未发生关联交易、内幕交易，也不存在本基金管理人管理的各基金之间的违规交叉交易，基金运作整体合法合规。

本基金管理人将继续坚持一贯的内部控制理念，提高内部监察稽核工作的科学性和有效性，努力防范和控制各种风险，充分保障基金持有人的合法权益。

第五节 托管人报告

2006年度，本基金托管人在对宝盈泛沿海区域增长股票证券投资基金的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他法律法规和基金合同的有关规定，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

2006年度，宝盈泛沿海区域增长股票证券投资基金的管理人——宝盈基金管理有限公司在宝盈泛沿海区域增长股票证券投资基金的投资运作、基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格计算、基金费用开支等问题上，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

本托管人依法对宝盈基金管理有限公司在2006年度所编制和披露的宝盈泛沿海区域增长股票证券投资基金年度报告中财务指标、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进行了核查，以上内容真实、准确和完整。

中国工商银行股份有限公司资产托管部

第六节 审计报告

普华永道中天审字(2007)第 20303 号

宝盈泛沿海区域增长股票证券投资基金全体基金份额持有人：

我们审计了后附的宝盈泛沿海区域增长股票证券投资基金(以下简称“宝盈泛沿海区域增长股票基金”)会计报表,包括2006年12月31日资产负债表、2006年度经营业绩表和基金净值变动表以及会计报表附注。

一、 管理层对会计报表的责任

按照企业会计准则、《金融企业会计制度》、《证券投资基金会计核算办法》、《宝盈泛沿海区域增长股票证券投资基金基金合同》和中国证券监督管理委员会允许的如会计报表附注所列示的基金行业实务操作的有关规定编制会计报表是宝盈泛沿海区域增长股票基金的基金管理人宝盈基金管理有限公司管理层的责任。这种责任包括:

- (1) 设计、实施和维护与会计报表编制相关的内部控制,以使会计报表不存在由于舞弊或错误而导致的重大错报;
- (2) 选择和运用恰当的会计政策;
- (3) 作出合理的会计估计。

二、 注册会计师的责任

我们的责任是在实施审计工作的基础上对会计报表发表审计意见。我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。中国注册会计师审计准则要求我们遵守职业道德规范,计划和实施审计工作以对会计报表是否不存在重大错报获取合理保证。

审计工作涉及实施审计程序,以获取有关会计报表金额和披露的审计证据。选择的审计程序取决于注册会计师的判断,包括对由于舞弊或错误导致的会计报表重大错报风险的评估。在进行风险评估时,我们考虑与会计报表编制相关的内部控制,以设计恰当的审计程序,但目的并非对内部控制的有效性发表意见。审计工作还包括评价管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计的合理性,以及评价会计报表的总体列报。

我们相信,我们获取的审计证据是充分、适当的,为发表审计意见提供了基础。

三、 审计意见

我们认为,上述会计报表已经按照企业会计准则、《金融企业会计制度》、《证券投资基金会计核算办法》、《宝盈泛沿海区域增长股票证券投资基金基金合同》和中国证券监督管理委员会允许的如会计报表附注所列示的基金行业实务操作的有关规定编制,在所有重大方面公允反映了宝盈泛沿海区域增长股票基金2006年12月31日的财务状况以及2006年度的经营成果和基金净值变动。

普华永道中天

注册会计师

汪 棣

会计师事务所有限公司

注册会计师

张立纲

中国·上海市

2007年3月22日

第七节 财务会计报告

(一) 基金会计报告书

宝盈泛沿海区域增长股票证券投资基金 2006年12月31日资产负债表

单位：人民币元

	附注	2006年12月31日	2005年12月31日
资产			
银行存款		117,979,694.74	11,298,425.90
结算备付金		630,585.31	1,629,463.23
交易保证金	5	598,780.49	348,780.49
应收利息	6	24,288.40	7,399.51
应收申购款		33,939,171.00	41,442,995.00
股票投资市值		265,478,595.40	144,777,044.76
其中：股票投资成本		240,141,205.48	139,089,067.78
债券投资市值		-	-
其中：债券投资成本		-	-
权证投资		-	-
其中：权证投资成本		-	-
资产总计		418,651,115.34	199,504,108.89
负债及持有人权益			
负债			
应付证券清算款		23,026,295.48	585,335.85
应付赎回款		1,717,255.67	1,067,106.68
应付赎回费		6,461.80	1,668.95
应付管理人报酬		234,181.87	222,763.84
应付托管费		39,030.30	37,127.32
应付佣金	7	438,362.73	135,743.28
其他应付款	8	500,000.00	250,031.50
预提费用	9	354,500.00	209,500.00
负债合计		26,316,087.85	2,509,277.42
持有人权益			
实收基金	10	356,608,933.87	196,525,507.50
未实现利得	11	1,436,433.80	4,914,007.45
未分配收益		34,289,659.82	-4,444,683.48
持有人权益合计		392,335,027.49	196,994,831.47

(2006 年末基金份额净值：1.1002 元)			
(2005 年末基金份额净值：1.0024 元)			
负债及持有人权益总计		418,651,115.34	199,504,108.89

后附会计报表附注为本会计报表的组成部分。

宝盈泛沿海区域增长股票证券投资基金
2006 年度经营业绩表及利润分配表

单位：人民币元

	附注	2006 年度	2005 年 3 月 8 日 (基金合同生效日)至 2005 年 12 月 31 日
收入			
股票差价收入	12	71,609,610.24	-3,932,347.85
债券差价收入	13	-	2,682,904.10
权证差价收入	14	3,297,949.60	1,264,761.40
债券利息收入		-	1,617,572.61
存款利息收入		266,287.32	447,704.01
股利收入		1,651,499.92	2,338,092.90
买入返售证券收入		396.00	369,849.00
其他收入	15	405,561.07	446,200.34
收入合计		77,231,304.15	5,234,736.51
费用			
基金管理人报酬		1,883,192.18	2,804,068.54
基金托管费		313,865.38	467,344.81
卖出回购证券支出		-	87,632.41
其他费用	16	358,504.75	229,738.78
其中：信息披露费		300,000.00	145,000.00
审计费用		40,000.00	50,000.00
费用合计		2,555,562.31	3,588,784.54
基金净收益		74,675,741.84	1,645,951.97
加：未实现利得	11	19,649,412.94	5,687,976.98
基金经营业绩		94,325,154.78	7,333,928.95
本期基金净收益		74,675,741.84	1,645,951.97

加：期初基金净收益		-4,444,683.48	-
本期申购基金份额的损益平准金		51,589,862.70	-839,547.51
本期赎回基金份额的损益平准金		-33,857,237.26	-172,739.73
可供分配基金净收益		87,963,683.80	633,664.73
减：本期已分配基金净收益	17	53,674,023.98	5,078,348.21
期末基金净收益		34,289,659.82	-4,444,683.48

后附会计报表附注为本会计报表的组成部分。

**宝盈泛沿海区域增长股票证券投资基金
2006 年度基金净值变动表**

单位：人民币元

			2005 年 3 月 8 日
			(基金合同生效日)至
		2006 年度	2005 年 12 月 31 日
期初基金净值		196,994,831.47	402,050,224.74
本期经营活动			
基金净收益		74,675,741.84	1,645,951.97
未实现利得		19,649,412.94	5,687,976.98
经营活动产生的基金净值变动数		94,325,154.78	7,333,928.95
本期基金份额交易			
基金申购款		498,039,188.96	149,565,839.96
其中：分红再投资		17,291,077.22	639,249.96
基金赎回款		-343,350,123.74	-356,876,813.97
基金份额交易产生的基金净值变动数		154,689,065.22	-207,310,974.01
本期向基金持有人分配收益			
向基金持有人分配收益产生的基金净值变动数		-53,674,023.98	-5,078,348.21
期末基金净值		392,335,027.49	196,994,831.47

后附会计报表附注为本会计报表的组成部分。

(二) 会计报告书附注

1 基金基本情况

宝盈泛沿海区域增长股票证券投资基金(以下简称“本基金”)经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监基金字[2004]第218号《关于同意宝盈泛沿海区域增长股票证券投资基金募集的批复》核准,由宝盈基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《宝盈泛沿海区域增长证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式,存续期限不定,首次设立募集不包括认购资金利息共募集401,940,889.81元,业经普华永道中天会计师事务所有限公司普华永道中天验字(2005)第18号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《宝盈泛沿海区域增长证券投资基金基金合同》于2005年3月8日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为402,050,224.74份基金份额。本基金的基金管理人为宝盈基金管理有限公司,基金托管人为中国工商银行股份有限公司。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《宝盈泛沿海区域增长证券投资基金基金合同》的有关规定,本基金的投资范围为国内依法公开发行、上市的股票、债券、货币市场工具及中国证监会批准的允许基金投资的其他金融工具。本基金财产中股票投资比例的变动范围为60%-95%,债券投资比例的变动范围为0-35%;现金或持有期限为1年以内政府债券的投资比例不低于5%。本基金非现金资产中,不低于80%的资金将投资于在泛沿海区域注册的上市公司发行的证券。同时,本基金将根据区域经济发展情况、证券市场的阶段性变化,以不超过非现金资产20%的部分投资于泛沿海区域以外地区注册的、具有持续增长潜力的上市公司证券。

2 会计报表编制基础

本基金的会计报表按照企业会计准则、《金融企业会计制度》、《证券投资基金会计核算办法》、《宝盈泛沿海区域增长股票证券投资基金基金合同》和中国证监会允许的如会计报表附注所列示的基金行业实务操作的有关规定编制。

3 主要会计政策和会计估计

(a) 会计年度

本基金会计年度为公历1月1日起至12月31日止。比较会计报表的实际编制期间为2005年3月8日(基金合同生效日)至2005年12月31日。

(b) 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

(c) 记账基础和计价原则

本基金的记账基础为权责发生制。除股票投资、债券投资和权证投资按市值计价外,所有报表项目均以历史成本计价。

(d) 基金资产的估值原则

(i) 股票投资

上市交易的股票按其估值日在证券交易所挂牌的市场交易收盘价估值；估值日无交易的，以最近交易日的市场交易收盘价估值。首次公开发行但未上市的股票，按成本估值；由于配股和非定向增发形成的暂时流通受限制的股票，按估值日在证券交易所挂牌的同一股票的市场交易收盘价估值。

(ii) 债券投资

证券交易所市场实行净价交易的国债按其估值日在证券交易所挂牌的市场交易收盘价估值；估值日无交易的，以最近交易日的市场交易收盘价估值。证券交易所市场未实行净价交易的企业债券及可转换债券按估值日市场交易收盘价减去债券收盘价中所含的债券应收利息得到的净价估值；估值日无交易的，以最近交易日的市场交易收盘价减去债券收盘价中所含的债券应收利息得到的净价估值。银行间同业市场交易的债券和未上市流通的债券按由基金管理人和基金托管人综合考虑成本价、收益率曲线等因素确定的反映公允价值的价格估值。

(iii) 权证投资

从获赠确认日或买入成交日起到卖出日或行权日止，上市交易的权证投资按估值日在证券交易所挂牌的该权证投资的市场交易收盘价估值；未上市交易的权证投资(包括配股权证)按公允价值估值。

(iv) 实际投资成本与估值的差异计入“未实现利得”科目。

(v) 如有确凿证据表明按上述方法进行估值不能客观反映其公允价值，基金管理人应根据具体情况与基金托管人商定后，按最能反映公允价值的价格估值。

(e) 证券投资基金成本计价方法

(i) 股票投资

买入股票于成交日确认为股票投资。股票投资成本按成交日应支付的全部价款入账。收到股权分置改革过程中由非流通股股东支付的现金对价，于股权分置方案实施复牌日冲减股票投资成本。

卖出股票于成交日确认股票差价收入。出售股票的成本按移动加权平均法于成交日结转。

(ii) 债券投资

买入证券交易所交易的债券于成交日确认为债券投资；买入银行间同业市场交易的债券于实际支付价款时确认为债券投资。债券投资按成交日应支付的全部价款入账，其中所包含债券起息日或上次除息日至购买日止的利息，作为应收利息单独核算，不构成债券投资成本。

买入贴息债券视同到期一次性还本付息的附息债券，根据其发行价、到期价和发行期限按直线法推算内含票面利率后，按上述会计处理方法核算。

卖出证券交易所交易的债券于成交日确认债券差价收入；卖出银行间同业市场交易的债券于实际收到全部价款时确认债券差价收入。出售债券的成本按移动加权平均法结转。

(iii) 权证投资

获赠权证(包括配股权证)在确认日,按持有的股数及获赠比例计算并记录增加的权证数量;买入权证于成交日确认为权证投资,相应成本按成交日应支付的全部价款入账。

卖出权证于成交日确认权证差价收入,出售权证的成本按移动加权平均法于成交日结转。

(f) 收入的确认和计量

股票差价收入于卖出股票成交日按卖出股票成交总额与其成本和相关费用的差额确认。

证券交易所交易的债券差价收入于卖出成交日确认;银行间同业市场交易的债券差价收入于实际收到全部价款时确认。债券差价收入按应收取全部价款与其成本、应收利息和相关费用的差额确认。

权证差价收入于卖出权证成交日按卖出权证成交总额与其成本和相关费用的差额确认。

债券利息收入按债券票面价值与票面利率或内含票面利率计算的金额扣除适用情况下应由债券发行企业代扣代缴的个人所得税后的净额确认,在债券实际持有期内逐日计提。

存款利息收入按存款的本金与适用利率逐日计提。

股利收入按上市公司宣告的分红派息比例计算的金额扣除由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额于除息日确认。

买入返售证券收入按融出资金额及约定利率,在证券持有期内采用直线法逐日计提。

(g) 费用的确认和计量

本基金的基金管理人报酬按前一日基金资产净值 1.5%的年费率逐日计提。

本基金的基金托管费按前一日基金资产净值 0.25%的年费率逐日计提。

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。

(h) 实收基金

实收基金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认列。

(i) 未实现利得

未实现利得包括因投资估值而产生的未实现估值增值和未实现利得平准金。

未实现利得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占基金净值比例计算的金额。未实现利得平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日认列。

(j) 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认列,并于期末全额转入未分配基金净收益。

(k) 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,但投资人可选择现金红利或将现金红利按分红除权日的基金份额净值自动转为基金份额进行再投资。在符合有关基金

收益分配条件的前提下，基金收益分配每年最多四次，当期基金收益分配的比例不低于当期基金已实现收益的 90%。基金当期收益先弥补上一年度亏损后，方可进行当年收益分配。基金当年亏损，则不进行收益分配。基金收益分配后，基金份额净值不能低于面值。

经宣告的拟分配基金收益于分红除权日从持有人权益转出。

4 主要税项

根据财政部、国家税务总局财税 [2002]128号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税 [2004]78号《关于证券投资基金税收政策的通知》、财税[2005]11号《关于调整证券(股票)交易印花税税率的通知》、财税[2005]102号《关于股息红利个人所得税有关政策的通知》、财税[2005]103号《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》及其他相关税务法规和实务操作，主要税项列示如下：

- (a) 以发行基金方式募集资金，不属于营业税征收范围，不征收营业税。
- (b) 基金买卖股票、债券的差价收入，暂免征营业税和企业所得税。
- (c) 对基金取得的企业债券利息收入，由发行债券的企业在向基金派发利息时代扣代缴 20% 的个人所得税，暂不征收企业所得税。对基金取得的股票的股息、红利收入，自 2005 年 6 月 13 日起由上市公司在向基金派发股息、红利时暂减按 50%(此前按 100%)计入个人应纳税所得额，依照现行税法规定即 20%代扣代缴个人所得税，暂不征收企业所得税。
- (d) 基金买卖股票按 0.1%的税率缴纳股票交易印花税。

基金作为流通股股东在股权分置改革过程中收到由非流通股股东支付的股份、现金等对价，暂免征收印花税、企业所得税和个人所得税。

5 交易保证金

	2006 年 12 月 31 日	2005 年 12 月 31 日
深圳结算保证金	500,000.00	250,000.00
权证交易保证金	98,780.49	98,780.49
	<u>598,780.49</u>	<u>348,780.49</u>

6 应收利息

	2006 年 12 月 31 日	2005 年 12 月 31 日
应收银行存款利息	23,927.27	6,544.04
应收结算备付金利息	312.18	806.52
应收权证交易保证金利息	48.95	48.95
	<u>24,288.40</u>	<u>7,399.51</u>

7 应付佣金

	2006 年 12 月 31 日	2005 年 12 月 31 日
--	------------------	------------------

国联证券有限责任公司	150,310.94	-
国盛证券有限责任公司	114,380.61	-
长城证券有限责任公司	121,268.74	48,986.18
中信证券股份有限公司	51,548.94	1,255.99
国泰君安证券股份有限公司	853.50	20,035.11
国海证券有限责任公司	-	53,835.29
海通证券股份有限公司	-	11,630.71
	<u>438,362.73</u>	<u>135,743.28</u>

8 其他应付款

	2006年12月31日	2005年12月31日
应付券商席位保证金	500,000.00	250,000.00
其他	-	31.50
	<u>500,000.00</u>	<u>250,031.50</u>

9 预提费用

	2006年12月31日	2005年12月31日
信息披露费	300,000.00	145,000.00
审计费用	50,000.00	50,000.00
债券托管账户维护费	4,500.00	4,500.00
其他	-	10,000.00
	<u>354,500.00</u>	<u>209,500.00</u>

10 实收基金

	基金份额	基金面值
2005年12月31日	196,525,507.50	196,525,507.50
本年申购	448,701,829.28	448,701,829.28
其中：红利再投资	16,768,213.74	16,768,213.74
本年赎回	(288,618,402.91)	(288,618,402.91)
2006年12月31日	<u>356,608,933.87</u>	<u>356,608,933.87</u>

11 未实现利得

	未实现估值增值 - 股票投资	未实现利得 /(损失)平准金	合计
2005年12月31日	5,687,976.98	(773,969.53)	4,914,007.45
本期净变动数	19,649,412.94	-	19,649,412.94
本期申购基金份额	-	(2,252,503.02)	(2,252,503.02)
其中：红利再投资	-	(954,193.09)	(954,193.09)

本期赎回基金份额	-	(20,874,483.57)	(20,874,483.57)
2006年12月31日	25,337,389.92	(23,900,956.12)	1,436,433.80

12 股票差价收入

	2006年度	2005年3月8日 (基金合同生效日)至2005 年12月31日止期间
卖出股票成交总额	706,362,271.54	206,744,325.64
减：应付佣金总额	(591,036.89)	(173,841.11)
减：卖出股票成本总额	(634,161,624.41)	(210,502,832.38)
	<u>71,609,610.24</u>	<u>(3,932,347.85)</u>

本基金于本年度获得股权分置改革中由非流通股股东支付的现金对价共计 107,990.26 元 (2005年：1,294,420.00 元)，已全额冲减股票投资成本。

13 债券差价收入

	2006年度	2005年3月8日 (基金合同生效日)至2005 年12月31日止期间
卖出及到期兑付债券结算金额	-	413,131,380.82
减：应收利息总额	-	(1,688,032.88)
减：卖出及到期兑付债券成本总额	-	(408,760,443.84)
	-	<u>2,682,904.10</u>

14 权证差价收入

	2006年度	2005年3月8日 (基金合同生效日)至2005 年12月31日止期间
卖出权证成交总额	6,981,871.35	1,264,761.40
减：卖出权证成本总额	(3,683,921.75)	-
	<u>3,297,949.60</u>	<u>1,264,761.40</u>

15 其他收入

	2006年度	2005年3月8日 (基金合同生效日)至2005 年12月31日止期间
赎回基金补偿收入(a)	405,529.57	446,096.26
新股申购手续费返还	-	92.83
其他	31.50	11.25
	<u>405,561.07</u>	<u>446,200.34</u>

(a) 本基金的赎回费率按持有期间递减，赎回费总额的25%归入基金资产。

16 其他费用

	2006 年度	2005 年 3 月 8 日 (基金合同生效日)至 2005 年 12 月 31 日止期间
信息披露费	300,000.00	145,000.00
审计费用	40,000.00	50,000.00
债券托管账户维护费	18,000.00	15,690.00
其他	504.75	19,048.78
	<u>358,504.75</u>	<u>229,738.78</u>

17 收益分配

	登记日	分红率	现金 形式发放	再投资 形式发放	发放红利 合计
2006 年度		每 10 份基金份额			
第一次中期分红	2006/01/18	0.30 元	3,511,757.08	233,922.37	3,745,679.45
		每 10 份基金份额			
第二次中期分红	2006/02/17	0.30 元	1,525,202.22	851,049.88	2,376,252.10
		每 10 份基金份额			
第三次中期分红	2006/04/24	0.60 元	2,152,494.77	1,829,979.29	3,982,474.06
		每 10 份基金份额			
第四次中期分红	2006/12/13	7.00 元	29,193,492.69	14,376,125.68	43,569,618.37
			<u>36,382,946.76</u>	<u>17,291,077.22</u>	<u>53,674,023.98</u>

18 重大关联方关系及关联交易

(a) 关联方

关联方名称	与本基金的关系
宝盈基金管理有限公司	基金管理人、注册登记机构、基金销售机构
中国工商银行股份有限公司(“中国工商银行”)	基金托管人、基金代销机构
中国对外经济贸易信托投资有限公司	基金管理人的股东
衡平信托投资有限责任公司	基金管理人的股东
成都工业投资经营有限责任公司	基金管理人的股东

下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

(b) 基金管理人报酬

支付基金管理人宝盈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 × 1.5% / 当年天数。

本基金在本年度需支付基金管理人报酬 1,883,192.18 元(2005 年：2,804,068.54 元)。

(c) 基金托管费

支付基金托管人中国工商银行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 × 0.25% / 当年天数。

本基金在本年度需支付基金托管费 313,865.38 元(2005 年：467,344.81 元)。

(d) 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工商银行保管，并按银行间同业利率计息。基金托管人于 2006 年 12 月 31 日保管的银行存款余额为 117,979,694.74 元(2005 年：11,298,425.90 元)。本年度由基金托管人保管的银行存款产生的利息收入为 256,151.22 元(2005 年：363,089.74 元)。

(e) 与关联方通过银行间同业市场进行的债券交易

本基金在本年度与基金托管人中国工商银行通过银行间同业市场进行的债券交易如下：

	2005 年 3 月 8 日 (基金合同生效日)至 2005 2006 年度 年 12 月 31 日止期间
卖出回购证券协议金额	- 552,860,000.00
卖出回购证券利息支出	- 87,632.41
	552,947,632.41

19 流通受限制不能自由转让的基金资产

流通受限制不能自由转让的股票

基金可使用以基金名义开设的股票账户，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网上认购获配的新股或增发新股，从新股获配日至新股上市日之间不能自由转让。

本基金截至 2006 年 12 月 31 日止投资的流通受限制的股票情况如下：

股票代码	股票名称	成功申购日期	可流通日期	申购价格	期末估值单价	数量	期末成本总额	期末估值总额
601006	大秦铁路	06/07/26	07/02/01	4.95	8.10	70,840	350,658.00	573,804.00
601628	中国人寿	06/12/28	07/01/09	18.88	18.88	39,000	736,320.00	736,320.00
合计							1,086,978.00	1,310,124.00

第七节 基金投资组合报告

(一) 基金资产组合情况

项目名称	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
银行存款和清算备付金	118,610,280.05	28.33
股票	265,478,595.40	63.41
债券	-	-
权证	-	-
其他资产	34,562,239.89	8.26
合计	418,651,115.34	100.00

(二) 行业分类的股票投资组合

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	4,474,391.40	1.14
3	C 制造业	120,694,751.78	30.76
	C0 食品、饮料	30,370,112.55	7.74
	C1 纺织、服装、皮毛	-	-
	C2 木材、家具	-	-
	C3 造纸、印刷	-	-
	C4 石油、化学、塑胶、塑料	-	-
	C5 电子	-	-
	C6 金属、非金属	56,492,388.40	14.40
	C7 机械、设备、仪表	17,976,988.24	4.58
	C8 医药、生物制品	15,855,262.59	4.04
	C99 其他制造业	-	-
4	D 电力、煤气及水的生产和供应业	-	-
5	E 建筑业	-	-
6	F 交通运输、仓储业	573,804.00	0.15
7	G 信息技术业	27,217,119.00	6.94
8	H 批发和零售贸易	-	-
9	I 金融、保险业	68,080,346.00	17.35
10	J 房地产业	21,924,800.00	5.59

11	K 社会服务业	20,027,383.22	5.10
12	L 传播与文化产业	2,486,000.00	0.64
13	M 综合类	-	-
	合计	265,478,595.40	67.67

(三) 基金投资股票明细

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	600016	民生银行	3,199,930	32,639,286.00	8.32
2	000063	中兴通讯	696,090	27,217,119.00	6.94
3	000002	万科A	1,420,000	21,924,800.00	5.59
4	000069	华侨城A	909,922	20,027,383.22	5.10
5	600036	招商银行	1,159,000	18,961,240.00	4.83
6	000039	中集集团	999,793	18,836,100.12	4.80
7	600019	宝钢股份	1,831,500	15,860,790.00	4.04
8	600030	中信证券	575,000	15,743,500.00	4.01
9	600519	贵州茅台	140,000	12,296,200.00	3.13
10	000858	五粮液	499,843	11,421,412.55	2.91
11	600111	稀土高科	875,332	9,882,498.28	2.52
12	600495	晋西车轴	453,528	9,446,988.24	2.41
13	600276	恒瑞医药	260,046	8,389,083.96	2.14
14	000538	云南白药	299,967	7,466,178.63	1.90
15	600005	武钢股份	800,000	5,088,000.00	1.30
16	000983	西山煤电	499,932	4,474,391.40	1.14
17	000625	长安汽车	500,000	4,460,000.00	1.14
18	600195	中牧股份	350,000	4,161,500.00	1.06
19	000951	中国重汽	162,800	4,070,000.00	1.04
20	002082	栋梁新材	300,000	3,753,000.00	0.96
21	600022	济南钢铁	400,000	3,072,000.00	0.78
22	000869	张裕A	50,000	2,491,000.00	0.63
23	600037	歌华有线	100,000	2,486,000.00	0.63
24	601628	中国人寿	39,000	736,320.00	0.19
25	601006	大秦铁路	70,840	573,804.00	0.15

(四) 股票投资组合的重大变动

1、累计买入金额超过期初净值 2%的股票明细

序号	股票代码	股票名称	累计买入金额	占净值比(%)
1	600016	民生银行	38,660,608.73	19.63
2	000063	中兴通讯	33,675,569.14	17.09
3	000039	中集集团	33,169,778.45	16.84
4	000002	万 科 A	30,157,012.85	15.31
5	600028	中国石化	27,839,663.47	14.13
6	600036	招商银行	25,639,247.94	13.02
7	600019	宝钢股份	23,624,528.89	11.99
8	000069	华侨城 A	23,324,921.80	11.84
9	600030	中信证券	21,024,638.11	10.67
10	600519	贵州茅台	16,909,233.40	8.58
11	600050	中国联通	13,503,179.63	6.85
12	600111	稀土高科	13,154,941.59	6.68
13	000858	五 粮 液	12,790,990.21	6.49
14	600005	武钢股份	9,817,847.42	4.98
15	600900	长江电力	9,461,590.05	4.80
16	600495	晋西车轴	9,262,194.75	4.70
17	000625	长安汽车	8,785,004.42	4.46
18	600489	中金黄金	8,170,838.76	4.15
19	000060	中金岭南	8,159,953.32	4.14
20	002082	栋梁新材	7,863,551.73	3.99
21	000538	云南白药	7,523,443.89	3.82
22	600808	马钢股份	7,338,129.10	3.73
23	600970	中材国际	7,129,732.83	3.62
24	600037	歌华有线	7,020,611.47	3.56
25	600276	恒瑞医药	6,982,398.90	3.54
26	600361	华联综超	6,467,172.65	3.28
27	000089	深圳机场	6,394,002.17	3.25
28	600588	用友软件	6,205,914.17	3.15

29	600195	中牧股份	6,014,394.62	3.05
30	000839	中信国安	6,013,873.25	3.05
31	000898	鞍钢股份	5,884,235.97	2.99
32	600832	东方明珠	5,794,818.07	2.94
33	000758	中色股份	5,673,306.75	2.88
34	600418	江淮汽车	5,637,660.14	2.86
35	002008	大族激光	5,445,159.21	2.76
36	000951	中国重汽	5,438,608.93	2.76
37	600309	烟台万华	5,152,976.57	2.62
38	002024	苏宁电器	5,028,077.16	2.55
39	600827	友谊股份	5,009,027.00	2.54
40	000528	柳 工	4,970,391.38	2.52
41	600535	天士力	4,919,715.48	2.50
42	600887	伊利股份	4,860,143.68	2.47
43	601988	中国银行	4,702,792.15	2.39
44	000423	S 阿 胶	4,486,013.78	2.28
45	000709	唐钢股份	4,479,105.34	2.27
46	000983	西山煤电	4,478,683.48	2.27
47	600547	山东黄金	4,435,917.24	2.25
48	000568	泸州老窖	4,402,642.49	2.23
49	600315	上海家化	4,328,631.00	2.20
50	000970	中科三环	4,198,619.41	2.13
51	000869	张 裕 A	4,101,645.33	2.08
52	600790	轻纺城	3,940,764.21	2.00

2、累计卖出金额超过期初净值 2%的股票明细

序号	股票代码	股票名称	累计卖出金额	占净值比(%)
1	600028	中国石化	29,615,252.23	15.03
2	600036	招商银行	24,748,970.55	12.56
3	000002	万 科 A	24,291,903.02	12.33
4	000039	中集集团	17,026,279.65	8.64

5	600037	歌华有线	16,482,273.80	8.37
6	000063	中兴通讯	15,969,170.68	8.11
7	000960	锡业股份	13,730,519.35	6.97
8	600900	长江电力	13,463,621.11	6.83
9	600050	中国联通	13,013,015.51	6.61
10	000858	五粮液	11,852,478.68	6.02
11	600016	民生银行	11,761,551.74	5.97
12	000060	中金岭南	11,407,380.09	5.79
13	600019	宝钢股份	10,921,258.94	5.54
14	600030	中信证券	10,465,035.16	5.31
15	000069	华侨城 A	10,171,365.91	5.16
16	600489	中金黄金	9,806,044.77	4.98
17	600383	金地集团	9,705,917.28	4.93
18	600361	华联综超	9,595,279.43	4.87
19	600596	新安股份	9,159,205.40	4.65
20	600970	中材国际	8,701,765.24	4.42
21	000088	盐田港	8,272,952.08	4.20
22	600808	马钢股份	8,166,476.49	4.15
23	002024	苏宁电器	7,731,270.63	3.92
24	600519	贵州茅台	7,671,617.86	3.89
25	600585	海螺水泥	7,570,845.25	3.84
26	600588	用友软件	7,558,469.40	3.84
27	600887	伊利股份	7,508,619.25	3.81
28	600085	同仁堂	7,245,297.76	3.68
29	600547	山东黄金	7,208,686.84	3.66
30	600827	友谊股份	7,063,339.81	3.59
31	600258	S 首旅	6,867,755.93	3.49
32	600308	华泰股份	6,845,904.70	3.48
33	000089	深圳机场	6,516,506.65	3.31
34	600694	大商股份	6,493,523.84	3.30

35	600362	江西铜业	6,193,103.59	3.14
36	000839	中信国安	6,128,735.48	3.11
37	000024	招商地产	5,983,067.31	3.04
38	600331	宏达股份	5,957,417.72	3.02
39	000758	中色股份	5,924,166.40	3.01
40	000898	鞍钢股份	5,823,396.89	2.96
41	600005	武钢股份	5,690,913.14	2.89
42	600418	江淮汽车	5,676,235.61	2.88
43	600584	长电科技	5,675,588.16	2.88
44	002082	栋梁新材	5,674,827.23	2.88
45	002008	大族激光	5,317,866.86	2.70
46	600832	东方明珠	5,284,404.41	2.68
47	000528	柳 工	5,279,017.14	2.68
48	600320	振华港机	5,121,080.32	2.60
49	600309	烟台万华	5,040,706.52	2.56
50	000709	唐钢股份	5,003,236.57	2.54
51	600535	天士力	4,942,777.08	2.51
52	600018	上港集团	4,838,124.83	2.46
53	000568	泸州老窖	4,830,501.53	2.45
54	000970	中科三环	4,811,801.73	2.44
55	601988	中国银行	4,725,100.08	2.40
56	000423	S 阿 胶	4,704,917.47	2.39
57	000625	长安汽车	4,552,329.18	2.31
58	600616	第一食品	4,374,393.33	2.22
59	600296	S 兰铝	4,308,583.68	2.19
60	600017	日照港	4,206,685.18	2.14
61	600183	生益科技	4,081,840.54	2.07
62	000538	云南白药	4,068,184.07	2.07
63	000837	秦川发展	3,995,310.82	2.03
64	600195	中牧股份	3,979,887.63	2.02

65	600583	海油工程	3,968,213.75	2.01
----	--------	------	--------------	------

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	735,321,752.37
报告期内卖出股票收入总额	706,362,271.54

（五）按券种分类的债券投资组合

本报告期末本基金未持有债券。

（六）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无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	24,288.40
应收申购款	33,939,171.00
保证金	598,780.49
合计	34,562,239.89

4、报告期内权证投资明细

(1)本报告期内因股权分置改革被动持有权证证明细如下：

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（被动持有/ 主动投资）
1	031001	侨城 HQC1	129,200	--	--	被动持有
2	580990	茅台 JCP1	32,000	--	--	被动持有
3	580997	招行 CMP1	660,000	--	--	被动持有
4	038003	华菱 JTP1	287,682	--	--	被动持有
合计			1,108,882			

(2)本报告期内主动投资权证证明细如下：

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（被动持有/ 主动投资）
1	580001	武钢 JTB1	500,000	376,303.58	--	主动投资
2	580003	邯钢 JTB1	480,000	561,493.72	--	主动投资
3	030001	鞍钢 JTC1	230,000	777,163.62	--	主动投资

4	030002	五粮 YGC1	245,000	1,968,960.83	--	主动投资
合计			1,455,000	3,683,921.75	--	

5、本报告期内本基金未投资资产支持证券。

第九节 基金份额持有人户数、持有人结构

(一) 基金份额持有人户数

基金持有人户数	17694
户均持有份额(万份)	2.02

(二) 基金份额持有人结构

	持有基金份额	占总份额比例
个人	295,375,548.48	82.83%
机构	61,233,385.39	17.17%

第十节 开放式基金份额变动

单位：份

	项目	份额数
1	合同生效日基金份额总额	402,050,224.74
2	报告期期初基金份额总额	196,525,507.50
3	报告期内基金总申购份额	448,701,829.28
4	报告期内基金总赎回份额	288,618,402.91
5	报告期末基金份额总额	356,608,933.87

第十一节 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2006年1月12日刊登《宝盈基金管理有限公司关于变更公司董事长的公告》，郭伟先生不再担任本公司董事长职务，授权李文众先生代为履行公司董事长职务。

本公司于2006年2月22日刊登《宝盈基金管理有限公司关于更换董事的公告》，选举李建生女士、秦天昌先生和张小康先生为宝盈基金管理有限公司董事，朱佐义女士、郭伟先生和冯志斌先生不再担任宝盈基金管理有限公司董事职务。

本公司于2006年4月28日刊登《宝盈基金管理有限公司关于总经理变更的公告》，聘任陆金海先生为公司总经理。

本公司于2006年5月31日刊登《宝盈基金管理有限公司关于更换董事的公告》，选举陆金海先生为宝盈基金管理有限公司管理层董事，同意金旭女士辞去宝盈基金管理有限公司董事职务。

本公司于2006年7月4日刊登《宝盈基金管理有限公司关于变更公司董事长的公告》，经宝盈基金管理有限公司第二届董事会第三次会议审议通过，决定选举李建生女士担任宝盈及基金管理有限公司董事长职务。

本公司于2006年10月17日刊登《宝盈基金管理有限公司关于同意谭启江先生辞去公司副总经理职务的公告》，经宝盈基金管理有限公司第二届董事会审议通过，决定同意谭启江先生辞去公司副总经理职务。

(三) 本基金托管人的专门基金托管部门在本报告期内无重大人事变动。

(四) 本报告期内未发生涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。

(五) 本报告期内，本基金管理人的基金投资策略严格遵循本基金《招募说明书》中披露的基本投资策略，未发生显著的改变。

(六) 本公司于2006年1月19日刊登《宝盈泛沿海区域增长股票证券投资基金分红公告》，进行基金红利分配。本基金向基金份额持有人分配的红利为每10份基金份额0.30元；2006年1月18日完成权益登记，红利发放日为2006年1月19日。

本公司于2006年2月20日刊登《宝盈泛沿海区域增长股票证券投资基金分红公告》，进行基金红利分配。本基金向基金份额持有人分配的红利为每10份基金份额0.30元；2006年2月17日完成权益登记，红利发放日为2006年2月20日。

本公司于2006年4月25日刊登《宝盈泛沿海区域增长股票证券投资基金分红公告》，进行基金红利分配。本基金向基金份额持有人分配的红利为每10份基金份额0.60元；2006年4月24日完成权益登记，红利发放日为2006年4月25日。

本公司于2006年12月14日刊登《宝盈泛沿海区域增长股票证券投资基金分红公告》，进行基金红利分配。本基金向基金份额持有人分配的红利为每10份基金份额7元；2006年12月13日完成权益登记，红利发放日为2006年12月14日。

(七) 本报告期内，本基金聘用普华永道中天会计师事务所有限公司负责基金审计事务，未发生改聘会计师事务所事宜。报告年度支付给会计师事务所审计费用为50,000.00元人民币，目前的审计机构已连续为本基金提供审计服务2年。

(八) 在本报告期内，基金管理人、托管人及其高级管理人员未受监管部门稽查或处罚。

(九) 基金租用证券公司专用交易席位的情况：

根据中国证监会《关于加强证券投资基金监管有关问题的通知》(证监基字[1998]29号)的有关规定要求，我在比较了多家证券经营机构的财务状况、经营状况、研究水平后，

本基金管理人择定从以下证券经营机构租用基金交易专用席位。

本报告期内宝盈泛沿海区域增长股票证券投资基金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	席位数量	股票成交量(元)	比例(%)	佣金额(元)	比例(%)
长城证券	1	509,964,494.24	35.45	399,051.53	34.46
国泰君安证券	1	336,196,550.72	23.37	275,678.95	23.81
国联证券	1	183,305,988.61	12.74	150,310.94	12.98
海通证券	1	162,702,334.85	11.31	133,348.73	11.52
国盛证券	1	139,489,349.65	9.70	114,380.61	9.88
中信证券	1	65,876,767.14	4.58	51,548.94	4.45
国海证券	1	41,071,151.50	2.85	33,679.01	2.90
合计	7	1,438,606,636.71	100	1,157,998.71	100

2、债券、回购及权证交易情况：

券商名称	债券成交量(元)	比例(%)	债券回购成交量(元)	比例(%)	权证成交量(元)	比例(%)
长城证券	--	--	--	--	7,911,784.21	74.18
国泰君安证券	--	--	--	--	92,160.00	0.86
国联证券	--	--	--	--	--	--
海通证券	--	--	6,600,000.00	100	2,298,499.03	21.55
国盛证券	--	--	--	--	--	--
中信证券	--	--	--	--	--	--
国海证券	--	--	--	--	363,660.00	3.41
合计			6,600,000.00	100	10,666,103.24	100

3、席位变更情况

() 租用席位情况

券商名称	上海席位(个数)	深圳席位(个数)
中信证券股份有限公司	---	1
国盛证券有限责任公司	1	---
国联证券有限责任公司	1	---

() 退租席位情况

券商名称	上海席位(个数)	深圳席位(个数)
国海证券有限责任公司	1	---

(十) 2006年度本公司分别增加中信证券、广发证券、东方证券、长江证券、国都证

券、国盛证券、国元证券、兴业证券、国联证券、第一创业证券等机构在其指定营业网点代理销售本基金。

第十二节 备查文件目录

- 1、中国证监会批准宝盈泛沿海区域增长股票证券投资基金设立的文件。
- 2、《宝盈泛沿海区域增长股票证券投资基金基金合同》。
- 3、《宝盈泛沿海区域增长股票证券投资基金基金托管协议》。
- 4、宝盈基金管理有限公司批准成立批件、营业执照和公司章程。
- 5、本报告期内在中国证监会指定报纸上公开披露的各项公告的原稿。

存放地点：基金管理人、基金托管人处。

查阅方式：投资者可在营业时间免费查阅，也可按工本费购买复印件。

宝盈基金管理有限公司

二零零七年三月二十九日