

# 宝盈鸿利收益证券投资基金

## 2007 年半年度报告

基金管理人：宝盈基金管理有限公司

基金托管人：中国农业银行

送出日期：二零零七年八月

# 宝盈鸿利收益证券投资基金 2007 年半年度报告

## 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。本半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。

基金托管人中国农业银行根据本基金合同规定，于 2007 年 8 月 23 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、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。

本报告财务数据未经审计。

## 目 录

第一节	重要提示及目录.....	1
第二节	基金简介.....	2
第三节	主要财务指标和基金净值表现.....	3
第四节	管理人报告.....	5
第五节	托管人报告.....	6
第六节	财务会计报告.....	7
第七节	投资组合报告.....	17
第八节	基金份额持有人户数、持有人结构.....	27
第九节	开放式基金份额变动.....	27
第十节	重大事件揭示.....	28
第十一节	备查文件目录.....	30

## 第二节 基金简介

(一) 基金名称:	宝盈鸿利收益证券投资基金
基金简称:	宝盈鸿利收益
基金代码:	213001
基金运作方式:	契约型开放式、积极成长型基金
基金合同生效日:	2002年10月8日
报告期末基金份额总额:	1,721,760,421.79份

### (二) 基金投资

投资目标: 在严格控制投资风险的前提下, 实现基金资产的稳定增长, 为基金持有人谋求长期最佳收益。

投资策略: 本基金为收益型基金, 主要通过以下投资策略追求基金投资的长期稳定的现金红利分配和资本增值收益:

战略资产配置策略。基金正常运作时期, 本基金债券投资占基金净值的比例不高于 20%, 股票投资占基金净值的比例不高于 75%, 现金留存比例为 5% 左右; 在上述比例范围之内, 基金管理人根据宏观经济形势、证券市场总体市盈率水平等指标, 对不同市场的风险收益状况做出判断, 据此调整股票、债券和现金资产的配置比例。

行业资金配置策略。首先由行业分析师估计各行业今后两到三年的期望增长速度, 以行业增长率对该行业上市公司的总体市盈率进行调整, 寻找总体投资价值被相对低估的行业。根据调整后不同行业的市盈率作为主要参考指标, 结合经济发展不同阶段对不同行业的影响, 决定股票投资中资金在行业之间的配置比例。

公司选择策略。在股票投资方面, 发现并选择业绩能够保持高速增长的上市公司进行投资, 通过公司业绩的高速增长实现投资收益。积极则是指在对所投资上市公司合理定价的基础上, 以积极策略决定买入和卖出时机, 当市场价格低于合理定价时买入, 市场价格高于合理定价时卖出。本基金为积极成长型基金, 投资于成长型企业的比例不低于基金股票投资总额的 50%。

在债券投资方面, 本基金综合平衡不同债券的收益性、安全性和流动性, 希望通过长期持有获得稳定的现金利息收益, 更好地降低基金投资组合的整体风险; 同时, 根据不同发行人和不同期限债券间到期收益率、即期收益率、远期收益率之间的结构性差异, 积极寻求风险套利和无风险套利机会。

业绩比较基准: 以中信综合指数  $\times 80\%$  + 上证国债指数  $\times 20\%$  (国内 A 股统一

指数推出后则变更为国内 A 股统一指数×80%+国债指数×20%)为投资的参照基准。

风险收益特征：本基金属于积极成长型基金，风险水平和期望收益水平相对较高。

### (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：广东省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：0755-83275886  
传真：0755-83515119  
电子邮箱：liuck@byfunds.com

### (四) 基金托管人

法定名称：中国农业银行  
注册地址：北京市海淀区复兴路甲23号  
办公地址：北京市海淀区西三环北路100号金玉大厦  
邮政编码：100036  
法定代表人：项俊波  
信息披露负责人：李芳菲  
联系电话：010-68424199  
传真：010-68424181  
电子邮箱：lifangfei@abchina.com

### (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

## 第三节 主要财务指标和基金净值表现

(一) 主要会计数据和财务指标

单位：人民币元

	主要会计数据和财务指标	2007年6月30日
1	基金本期净收益	151,535,077.86
2	加权平均基金份额本期净收益	0.3266
3	期末可供分配基金收益	89,399,422.91
4	期末可供分配基金份额收益	0.0519
5	期末基金资产净值	1,811,159,844.70
6	期末基金份额净值	1.0519
7	基金加权平均净值收益率	27.28%
8	本期基金份额净值增长率	48.25%
9	基金份额累计净值增长率	248.47%

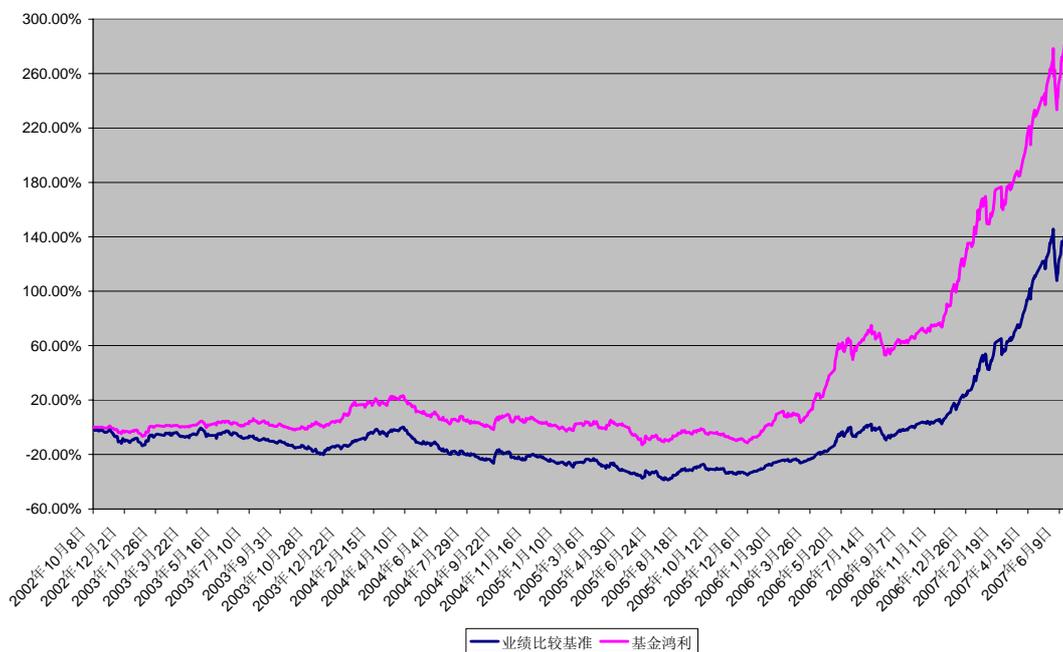
提示：上述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用（例如开放式基金的申购赎回费、红利再投资费、基金转换费、封闭式基金交易佣金等），计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

（二）同期业绩比较（截止 2007 年 6 月 30 日）

阶段	净值增长率 ①	净值增长标准 差②	业绩比较基准 收益率③	业绩比较基准收 益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	-3.93%	2.28%	-6.91%	2.62%	2.98%	-0.34%
过去三个月	22.45%	1.94%	23.29%	2.14%	-0.84%	-0.20%
过去六个月	48.25%	1.85%	68.84%	2.03%	-20.59%	-0.18%
过去一年	109.54%	1.56%	114.38%	1.62%	-4.84%	-0.06%
过去三年	236.62%	1.29%	167.30%	1.33%	69.32%	-0.04%
自基金合同生效起至今	248.47%	1.13%	114.12%	1.20%	134.35%	-0.07%

（三）基金净值表现(截止 2007 年 6 月 30 日)

图示自基金合同生效以来基金份额净值的变动情况



#### 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。公司目前管理基金鸿飞、基金鸿阳、宝盈鸿利收益、宝盈泛沿海、宝盈策略增长五只基金，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：刘丰元先生，男，37岁，北京大学光华管理学院理学硕士，CFA，具有9年证券从业经验。曾就职于国泰君安证券有限公司、中融基金管理有限公司、中国人寿资产管理公司，从事投资银行以及研究投资工作。2005年7月加入宝盈基金管理有限公司，先后从事债券组合管理、行业配置和行业研究等工作。

##### （二）本报告期内基金运作的合规守信情况

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、《宝盈鸿利收益证券投资基金基金合同》和其他有关法律法规的规定，无损害基金持有人利益的行为。

2007年2月本基金进行了大比例分红（每10份基金份额派发红利11元），为保证收益分配事宜的顺利进行，本基金在个别交易日出现了投资比例不符合基金合同规定的情况，但及时在规定期限内调整到了规定比例，符合有关法规的规定。

本基金管理人将继续本着诚实信用、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。

### （三）本报告期内基金的投资策略和业绩表现

从各个月份公布的数据看，2007年上半年我国宏观经济继续保持快速增长势头，投资、消费和出口都保持在高位，受食品价格大幅度上涨影响，CPI有抬头趋势，我们预计三季度CPI将保持在高位。

上半年市场经历了在二线股、三线股的带动下快速上涨，然后剧烈调整的过程。在市场投机气氛较为浓厚的情况下，我们依然坚守价值投资的底线，未参与投机性的股票，为基金持有者赚取稳定的合理的回报是我们的目标。

展望2007年下半年，我们认为牛市的基础依然存在。从OECD等指标看，国际经济在未来的几个月内可能会加速，中国的经济依然高速增长，投资、出口都会维持在高位，消费可能会加速增长，中国流动性过剩的局面不会改变，企业的业绩增长依然会维持在高位，虽然会由于基数的原因增幅可能会小幅回落。从估值的角度看，市场出现了一定程度的泡沫，但是我们认为泡沫是结构性的，由于中国经济的持续高速增长，看的长远一点，还是有很多股票值得持有。从国外牛市运行的规律看，我国目前市场还未到最疯狂的时候。由于经济比预期的要热，CPI高企，外贸出口、投资增速等都维持在高位，我们预期国家将进一步采取加息等宏观调控政策，下半年市场的震荡依然较大。我们将坚持价值底线，为基金持有人争取稳定的回报。行业的配置上，本基金将向金融、地产、品牌消费品、机械、钢铁等行业倾斜。

## 第五节 托管人报告

在托管宝盈鸿利收益证券投资基金的过程中，本基金托管人—中国农业银行严格遵守《证券投资基金法》相关法律法规的规定以及《宝盈鸿利收益证券投资基金基金合同》、《宝盈鸿利收益证券投资基金托管协议》的约定，对宝盈鸿利收益证券投资基金管理人—宝盈基金管理有限公司2007年1月1日至2007年6月30日基金的投资运作，进行了认真、独立的会计核算和必要的投资监督，认真履行了托管人的义务，没有从事任何损害基金份额持有人利益的行为。

本托管人认为，宝盈基金管理有限公司在宝盈鸿利收益证券投资基金的投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支等问题上，不存在损害基金份额持有人利益的行为；在报告期内，遵守了《证券投资基金法》等有关法律法规，在各重要方面的运作按照基金合同的规定进行。

本托管人认为，宝盈基金管理有限公司的信息披露事务符合《证券投资基金信息披露管理办法》及其他相关法律法规的规定，基金管理人所编制和披露的宝盈鸿利收益证券投资基金半年度报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告等信息真实、准确、完整，未发现有关损害基金持有人利益的行为。

## 第六节 财务会计报告

### （一）基金会计报告

#### 宝盈鸿利收益证券投资基金

#### 2007年6月30日资产负债表

单位：元

	附注	2007年6月30日	2006年12月31日
资产			
银行存款		144,026,568.13	20,243,892.17
清算备付金		1,887,131.41	1,096,200.61
交易保证金	4(1)	1,410,000.00	1,410,000.00
应收证券清算款		---	2,275,595.52
应收利息	4(2)	5,630,287.94	502,236.53
应收申购款		53,328,693.71	38,181,390.00
应收股利		1,615,273.14	4.42
股票投资市值		1,238,394,105.85	140,538,705.57
其中：股票投资成本		1,235,072,407.39	107,291,308.17
债券投资市值		381,408,016.20	47,872,909.20
其中：债券投资成本		381,537,530.38	47,401,676.54
权证投资		---	5,479,500.00
其中：权证投资成本		---	---
资产总计		1,827,700,076.38	257,600,434.02
负债及持有人权益			
负债			
应付证券清算款		5,872,759.78	---
应付赎回款		5,624,538.71	664,895.97
应付赎回费		10,401.07	76.81
应付管理人报酬		1,437,724.10	254,122.70
应付托管费		239,620.67	42,520.61
应付佣金	4(4)	1,598,636.57	593,815.99
应付利息		---	29,657.16

其他应付款	4(5)	1,478,761.15	1,478,356.60
卖出回购证券款		---	20,000,000.00
预提费用	4(6)	277,789.63	350,000.00
负债合计		16,540,231.68	23,413,445.84
持有人权益			
实收基金	4(7)	1,721,760,421.79	118,311,633.82
未实现利得	4(8)	-195,971,715.62	14,725,873.75
未分配收益		285,371,138.53	101,149,480.61
持有人权益合计		1,811,159,844.70	234,186,988.18
负债及持有人权益总计		1,827,700,076.38	257,600,434.02

后附会计报表附注为本会计报表的组成部分。

#### 宝盈鸿利收益证券投资基金

2007年1月1日至2007年6月30日止期间  
经营业绩表及收益分配表

单位：元

	附注	2007年1月1日 至2007年6月30日	2006年1月1日 至2006年6月30日
收入			
股票差价收入	4(9)	145,102,520.28	145,236,792.99
债券差价收入	4(10)	344,165.31	845,175.91
权证差价收入	4(11)	5,765,513.22	8,002,699.63
债券利息收入		1,581,179.03	932,195.46
存款利息收入		338,342.31	71,856.32
股利收入		3,309,589.00	2,123,178.42
买入返售证券收入		---	---
其他收入	4(12)	356,396.29	70,490.54
收入合计		156,797,705.44	157,282,389.27
费用			
基金管理人报酬		3,895,479.67	1,944,652.36
基金托管费		652,988.08	324,369.02
卖出回购证券支出		514,044.58	21,727.90
其他费用	4(13)	200,115.25	120,397.56
其中：信息披露费		148,767.52	64,464.96
审计费用		24,795.19	40,663.46

费用合计		5,262,627.58	2,411,146.84
基金净收益		151,535,077.86	154,871,242.43
加：未实现利得		-36,005,945.78	-9,235,599.70
基金经营业绩		115,529,132.08	145,635,642.73
基金净收益		151,535,077.86	154,871,242.43
加：期初基金净收益		101,149,480.61	-77,992,793.94
本期申购基金份额的损益平准金		441,176,096.02	8,903,182.25
本期赎回基金份额的损益平准金		-156,592,466.25	-17,123,134.72
可供分配基金净收益		537,268,188.24	68,658,496.02
减：本期已分配基金净收益	4(14)	251,897,049.71	12,345,951.73
期末基金净收益		285,371,138.53	56,312,544.29

后附会计报表附注为本会计报表的组成部分。

#### 宝盈鸿利收益证券投资基金

2007年1月1日至2007年6月30日止期间  
基金净值变动表

单位：元

		2007年1月1日 至2007年6月30日	2006年1月1日 至2006年6月30日
期初基金净值		234,186,988.18	347,142,377.04
本期经营活动			
基金净收益		151,535,077.86	154,871,242.43
未实现利得		-36,005,945.78	-9,235,599.70
经营活动产生的基金净值变动数		115,529,132.08	145,635,642.73
本期基金份额交易			
基金申购款		2,324,463,584.74	92,305,109.43
其中：分红再投资		130,527,191.30	3,612,130.64
基金赎回款		-611,122,810.59	-399,245,673.13
基金份额交易产生的基金净值变动数		1,713,340,774.15	-306,940,563.70
本期向基金份额持有人分配收益		-251,897,049.71	-12,345,951.73
向基金份额持有人分配收益产生的基金净值变动数			---

期末基金净值		1,811,159,844.70	173,491,504.34

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 会计报表编制基础

本基金的会计报表按照国家颁布的企业会计准则、《金融企业会计制度》、《证券投资基金会计核算办法》、《宝盈鸿利收益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。

### 2 主要会计政策

本报告期会计报表所采用的会计政策与上年度会计报表相一致。

#### (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，本期会计报表的实际编制期间为2007年1月1日至2007年6月30日止。上年比较会计报表的实际编制期间为2006年1月1日至2006年6月30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成本估值。

##### (iii) 权证投资

从获赠确认日或买入成交确认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。在满足基金分红条件的前提下，基金收益分配每年至少一次；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。

### 3 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
中国农业银行	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

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：

$$\text{日基金管理人报酬} = \text{前一日基金资产净值} \times 1.5\% / \text{当年天数}。$$

本基金在本年度需支付基金管理人报酬 3,895,479.67 元(2006 年同期: 1,944,652.36 元)。

(c) 基金托管费

支付基金托管人中国农业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：

$$\text{日基金托管费} = \text{前一日基金资产净值} \times 0.25\% / \text{当年天数}。$$

本基金在本年度需支付基金托管费 652,988.08 元(2006 年同期: 324,369.02 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农业银行保管，并按银行间同业利率计息。

基金托管人于 2007 年 6 月 30 日保管的银行存款及清算备付金余额为 145,913,699.54 元(2006 年同期: 18,224,882.75 元)。本年度由基金托管人保管的银行存款及清算备付金产生的利息收入为 274,129.19 元(2006 年同期: 70,553.12 元)。

(e) 与关联方通过银行间同业市场进行的债券交易

本基金在本年度未与基金托管人中国农业银行通过银行间同业市场进行的债券交易。

(g) 关联方投资本基金情况

(I) 基金管理公司投资本基金情况

	2007 年 1 月 1 日 至 2007 年 6 月 30 日
持有基金份额(份)	---
占基金总份额的比例(%)	---
报告期内持有份额的变化	---
使用费率	---

(II) 基金管理公司主要股东及控制的机构投资本基金情况

	2007 年 1 月 1 日 至 2007 年 6 月 30 日
持有基金份额(份)	---
占基金总份额的比例(%)	---

(III) 基金管理工作人员持有本基金情况

	2007 年 6 月 30 日
持有基金份额(份)	31,107.63
占基金总份额的比例(%)	0.0018

#### 4 会计报表重要项目的说明

##### (1) 交易保证金

	2007年6月30日
深圳结算保证金	1,250,000.00
权证交易保证金	160,000.00
合计	1,410,000.00

##### (2) 应收利息

	2007年6月30日
应收债券利息	5,579,470.25
应收银行存款利息	30,601.39
应收申购款利息	19,295.10
应收清算备付金利息	849.20
应收权证保证金利息	72.00
合计	5,630,287.94

##### (3) 投资估值增值

	2007年6月30日
股票投资估值增值	3,321,698.46
债券投资估值增值	-129,514.18
权证投资估值增值	---
合计	3,192,184.28

##### (4) 应付佣金

	2007年6月30日
海通证券有限责任公司	289,813.42
招商证券股份有限公司	118,549.15
国元证券有限责任公司	918,530.89
国泰君安证券股份有限公司	75,290.78
国都证券有限责任公司	196,452.33
合计	1,598,636.57

##### (5) 其他应付款

	2007年6月30日
应付券商席位保证金	1,250,000.00
应付债券利息收入和股利收入的个人所得税	228,296.60
银行间交易手续费	464.55
合计	1,478,761.15

## (6) 预提费用

	2007年6月30日
信息披露费	248,767.52
审计费用	24,795.19
债券账户维护费	4,226.92
合计	277,789.63

## (7) 实收基金

	基金份额	基金面值
2006年12月31日	118,311,633.82	118,311,633.82
本年申购	2,099,345,697.60	2,099,345,697.60
本年赎回	-495,896,909.63	-495,896,909.63
2007年6月30日	1,721,760,421.79	1,721,760,421.79

## (8) 未实现利得

	2007年1月1日 至2007年6月30日
2006年12月31日	14,725,873.75
未实现估值增值变动数	-36,005,945.78
本期申购基金单位的未实现利得平准金	-216,058,208.88
本期赎回基金单位的未实现利得平准金	41,366,565.29
2007年6月30日	-195,971,715.62

## (9) 股票差价收入

	2007年1月1日 至2007年6月30日
卖出股票成交总额	1,255,782,122.03
减：应付佣金总额	1,051,188.94
减：卖出股票成本总额	1,109,628,412.81
股票差价收入	145,102,520.28

## (10) 债券差价收入

	2007年1月1日 至2007年6月30日
卖出及到期兑付债券结算金额	71,346,811.99
减：应收利息总额	947,708.16
减：卖出及到期兑付债券成本总额	70,054,938.52

债券差价收入	344,165.31
--------	------------

(11) 权证差价收入

	2007年1月1日 至2007年6月30日
卖出权证成交总额	6,476,456.07
减：卖出权证成本总额	710,942.85
权证差价收入	5,765,513.22

(12) 其他收入

	2007年1月1日 至2007年6月30日
赎回基金补偿收入	356,396.29
合计	356,396.29

(13) 其他费用

	2007年1月1日 至2007年6月30日
信息披露费	148,767.52
审计费用	24,795.19
债券维护费	13,826.92
银行间交易手续费	494.55
交易所回购交易费用	2,987.59
其他	9,243.48
合计	200,115.25

(14) 收益分配

	登记日/除权日	分红率	现金形式发放	再投资形式发放	发放红利合计
1	2007-02-02	每10份基金单位11.00元	48,731,685.47	66,905,319.72	115,637,005.19
2	2007-06-04	每10份基金单位3.50元	72,638,172.94	63,621,871.58	136,260,044.52
	合计		121,369,858.41	130,527,191.30	251,897,049.71

5 流通受限制不能自由转让的基金资产

(1) 本基金截止本报告期末流通受限股票列示如下：

A. 本基金截至2007年6月30日止无因股权分置而暂时停牌的股票。

B. 本基金获配的新股和配股为流通受限、不能转让的资产。在估值时如果该股票还未上市，则按成本计价；如已上市，则按当日市场平均价计价。申购新股从新股申购日至新股上市日之间不能自由流通。

股票代码	股票名称	可流通日期	数量	成本总额	估值总额	估值方法	受限原因
------	------	-------	----	------	------	------	------

002127	新民科技	2007-07-18	44,106	414,596.40	800,082.84	市价估值	网下申购新股锁定
002130	沃尔核材	2007-07-20	15,964	250,954.08	779,841.40	市价估值	网下申购新股锁定
601998	中信银行	2007-07-30	110,434	640,517.20	1,015,992.80	市价估值	网下申购新股锁定
合 计				1,306,067.68	2,595,917.04		

(2) 本基金截止本报告期末无流通受限的债券。

## 第七节 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	145,913,699.54	7.98
股票	1,238,394,105.85	67.76
债券	381,408,016.20	20.87
权证	---	---
其他资产	61,984,254.79	3.39
合计	1,827,700,076.38	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	57,017,677.54	3.15
2	B 采掘业	46,269,101.04	2.55
3	C 制造业	501,573,327.02	27.69
	其中：C0 食品、饮料	175,213,049.80	9.67
	C1 纺织、服装、皮毛	2,824,182.84	0.16
	C2 木材、家具	13,251,572.04	0.73
	C3 造纸、印刷	21,145,678.70	1.17
	C4 石油、化学、塑胶、塑料	16,676,597.07	0.92
	C5 电子	18,003,239.08	0.99
	C6 金属、非金属	109,949,942.28	6.07
	C7 机械、设备、仪表	119,069,002.89	6.57
	C8 医药、生物制品	24,660,220.92	1.36
	C99 其他制造业	779,841.40	0.05
4	D 电力、煤气及水的生产和供应业	89,627,445.55	4.95
5	E 建筑业	58,100.00	0.00

6	F 交通运输、仓储业	63,413,216.29	3.50
7	G 信息技术业	---	---
8	H 批发和零售贸易	46,320,843.64	2.56
9	I 金融、保险业	118,534,742.53	6.54
10	J 房地产业	159,508,661.02	8.81
11	K 社会服务业	79,058,755.84	4.37
12	L 传播和文化产业	77,012,235.38	4.26
13	M 综合类	---	---
	合 计	1,238,394,105.85	68.38

(三) 基金投资股票明细

序号	证券代码	证券名称	库存数量(股)	证券市值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	600238	海南椰岛	7,124,384	79,080,662.40	4.37
2	000069	华侨城A	1,794,929	71,438,174.20	3.94
3	600383	金地集团	1,885,009	64,505,007.98	3.56
4	600075	新疆天业	3,299,915	53,920,611.10	2.98
5	600028	中国石化	3,499,932	46,269,101.04	2.55
6	600030	中信证券	859,910	45,549,432.70	2.51
7	600616	第一食品	1,799,847	45,212,156.64	2.50
8	601006	大秦铁路	2,799,926	42,390,879.64	2.34
9	000568	泸州老窖	999,957	42,098,189.70	2.32
10	600005	武钢股份	4,082,641	41,071,368.46	2.27
11	000024	招商地产	830,120	40,758,892.00	2.25
12	000951	中国重汽	708,518	36,063,566.20	1.99
13	600649	原水股份	2,409,425	33,804,232.75	1.87
14	000858	五 粮 液	980,000	30,830,800.00	1.70
15	600088	中视传媒	1,008,728	30,675,418.48	1.69
16	600900	长江电力	2,000,000	30,240,000.00	1.67
17	002102	冠福家用	1,600,098	29,425,802.22	1.62
18	601398	工商银行	5,712,753	28,620,892.53	1.58
19	601318	中国平安	399,950	28,600,424.50	1.58

20	600879	火箭股份	987,711	26,263,235.49	1.45
21	600795	国电电力	1,949,940	25,583,212.80	1.41
22	000917	电广传媒	1,709,954	25,392,816.90	1.40
23	000401	冀东水泥	1,695,225	23,326,296.00	1.29
24	600597	光明乳业	2,494,989	23,203,397.70	1.28
25	600308	华泰股份	859,930	21,145,678.70	1.17
26	600037	歌华有线	800,000	20,944,000.00	1.16
27	000002	万科A	1,000,000	19,120,000.00	1.06
28	000031	中粮地产	799,909	18,093,941.58	1.00
29	002106	莱宝高科	599,908	18,003,239.08	0.99
30	600320	振华港机	899,915	17,881,311.05	0.99
31	600675	中华企业	749,926	17,030,819.46	0.94
32	000157	中联重科	421,455	16,226,017.50	0.90
33	600085	同仁堂	399,865	15,382,806.55	0.85
34	600036	招商银行	600,000	14,748,000.00	0.81
35	002043	兔宝宝	1,660,598	13,251,572.04	0.73
36	000022	深赤湾A	499,917	13,222,804.65	0.73
37	600482	风帆股份	501,693	10,992,093.63	0.61
38	600740	山西焦化	618,531	10,793,365.95	0.60
39	600253	天方药业	1,342,607	9,277,414.37	0.51
40	600111	稀土高科	300,000	8,346,000.00	0.46
41	600087	南京水运	599,964	7,799,532.00	0.43
42	600350	山东高速	994,854	7,620,581.64	0.42
43	000550	江铃汽车	457,289	7,490,393.82	0.41
44	000060	中金岭南	246,692	7,228,075.60	0.40
45	600527	江南高纤	297,969	4,314,591.12	0.24
46	600202	哈空调	278,310	4,152,385.20	0.23
47	600467	好当家	244,634	3,097,066.44	0.17
48	600677	航天通信	117,000	2,024,100.00	0.11

49	002068	黑猫股份	68,800	1,568,640.00	0.09
50	000417	合肥百货	121,700	1,108,687.00	0.06
51	601998	中信银行	110,434	1,015,992.80	0.06
52	002127	新民科技	44,106	800,082.84	0.04
53	002130	沃尔核材	15,964	779,841.40	0.04
54	002082	栋梁新材	40,000	552,400.00	0.03
55	002135	东南网架	2,500	58,100.00	0.00

(四) 股票投资组合的重大变动

1、累计买入金额超过期初资产净值 2% 的股票明细

序号	股票代码	股票名称	累计买入金额(元)	占期初资产净值比例(%)
1	600238	海南椰岛	84,953,295.47	36.28
2	600028	中国石化	83,765,697.24	35.77
3	600383	金地集团	74,249,830.99	31.71
4	000069	华侨城 A	74,071,452.79	31.63
5	600030	中信证券	70,971,301.03	30.31
6	601006	大秦铁路	65,353,941.85	27.91
7	000024	招商地产	61,048,176.11	26.07
8	600616	第一食品	56,068,238.98	23.94
9	600005	武钢股份	54,900,845.83	23.44
10	600075	新疆天业	52,001,272.04	22.21
11	600036	招商银行	45,778,167.97	19.55
12	000568	泸州老窖	44,097,419.67	18.83
13	000002	万 科 A	41,240,152.59	17.61
14	600900	长江电力	40,989,608.60	17.50
15	000917	电广传媒	39,252,597.67	16.76
16	000858	五 粮 液	38,969,809.97	16.64
17	600879	火箭股份	37,644,937.41	16.07
18	600111	稀土高科	37,140,883.20	15.86
19	600597	光明乳业	36,785,300.73	15.71

20	000401	冀东水泥	36,777,234.38	15.70
21	600649	原水股份	36,555,406.82	15.61
22	600088	中视传媒	31,993,330.71	13.66
23	600482	风帆股份	31,627,855.10	13.51
24	002102	冠福家用	31,402,214.27	13.41
25	000951	中国重汽	30,668,982.40	13.10
26	600308	华泰股份	29,793,323.08	12.72
27	601398	工商银行	29,439,276.17	12.57
28	600795	国电电力	28,782,855.15	12.29
29	600016	民生银行	27,608,282.22	11.79
30	000157	中联重科	26,773,242.16	11.43
31	600740	山西焦化	24,495,925.09	10.46
32	002082	栋梁新材	24,265,031.52	10.36
33	601318	中国平安	23,580,932.24	10.07
34	600037	歌华有线	23,181,569.12	9.90
35	600087	南京水运	22,799,224.95	9.74
36	002056	横店东磁	22,324,926.47	9.53
37	600737	中粮屯河	20,055,952.76	8.56
38	000515	攀渝钛业	19,813,246.95	8.46
39	600675	中华企业	19,807,724.66	8.46
40	600320	振华港机	19,524,842.63	8.34
41	000022	深赤湾A	19,197,345.91	8.20
42	600050	中国联通	19,041,578.78	8.13
43	000031	中粮地产	18,589,788.92	7.94
44	600717	天津港	18,452,490.10	7.88
45	600501	航天晨光	18,033,740.27	7.70
46	601628	中国人寿	17,751,338.32	7.58
47	002043	兔宝宝	17,303,779.56	7.39
48	002106	莱宝高科	17,061,771.61	7.29

49	600007	中国国贸	16,095,998.65	6.87
50	600019	宝钢股份	15,369,846.35	6.56
51	600230	沧州大化	15,142,347.56	6.47
52	600449	赛马实业	14,948,892.71	6.38
53	002018	华星化工	14,571,458.34	6.22
54	000617	石油济柴	14,509,846.23	6.20
55	600357	承德钒钛	13,718,025.03	5.86
56	000792	盐湖钾肥	13,396,020.50	5.72
57	000717	韶钢松山	13,292,328.94	5.68
58	000021	长城开发	13,122,995.85	5.60
59	600997	开滦股份	12,378,349.88	5.29
60	600058	五矿发展	12,124,566.59	5.18
61	000825	太钢不锈	11,492,771.83	4.91
62	600253	天方药业	10,936,380.85	4.67
63	000538	云南白药	10,460,793.25	4.47
64	000012	南玻A	10,444,497.79	4.46
65	000690	宝新能源	10,120,625.83	4.32
66	600677	航天通信	9,579,394.29	4.09
67	600470	六国化工	9,307,585.50	3.97
68	600085	同仁堂	8,989,291.20	3.84
69	600367	红星发展	8,897,810.26	3.80
70	000063	中兴通讯	8,752,650.45	3.74
71	600317	营口港	8,625,547.15	3.68
72	600350	山东高速	8,489,830.95	3.63
73	000550	江铃汽车	8,085,503.37	3.45
74	600527	江南高纤	7,899,229.40	3.37
75	600859	王府井	7,659,437.20	3.27
76	000060	中金岭南	7,549,866.02	3.22
77	600183	生益科技	6,984,777.88	2.98

78	600027	华电国际	6,949,414.57	2.97
79	600886	国投电力	6,829,824.66	2.92
80	600831	广电网络	6,762,744.26	2.89
81	600548	深高速	6,585,077.61	2.81
82	000539	粤电力A	6,576,031.21	2.81
83	600132	重庆啤酒	6,545,648.16	2.80
84	600583	海油工程	6,412,502.90	2.74
85	600547	山东黄金	6,312,756.19	2.70
86	600966	博汇纸业	6,170,422.33	2.63
87	000762	西藏矿业	5,729,714.05	2.45
88	002073	青岛软控	5,643,091.83	2.41
89	600519	贵州茅台	5,522,243.92	2.36
90	000528	柳工	5,384,172.96	2.30
91	600584	长电科技	5,286,062.67	2.26
92	000039	中集集团	5,138,025.58	2.19
93	600410	华胜天成	5,129,824.68	2.19
94	000400	许继电气	4,714,662.34	2.01

2、累计卖出金额超过期初资产净值 2%的股票明细

序号	股票代码	股票名称	累计卖出金额(元)	占期初资产净值比例(%)
1	600036	招商银行	53,773,383.89	22.96
2	000002	万科A	53,314,397.88	22.77
3	600111	稀土高科	43,553,533.18	18.60
4	600030	中信证券	37,983,996.66	16.22
5	600028	中国石化	34,449,762.33	14.71
6	002082	栋梁新材	29,942,120.32	12.79
7	600482	风帆股份	28,759,919.94	12.28
8	000401	冀东水泥	27,954,910.28	11.94
9	600016	民生银行	27,331,512.48	11.67
10	000951	中国重汽	25,614,883.03	10.94

11	000515	攀渝钛业	24,703,712.06	10.55
12	601006	大秦铁路	23,963,106.24	10.23
13	000024	招商地产	23,778,706.57	10.15
14	002056	横店东磁	23,331,195.05	9.96
15	000858	五粮液	22,591,884.71	9.65
16	600005	武钢股份	21,793,998.30	9.31
17	600050	中国联通	21,743,870.90	9.28
18	600737	中粮屯河	21,646,667.20	9.24
19	002018	华星化工	19,246,834.49	8.22
20	600519	贵州茅台	18,719,686.16	7.99
21	600501	航天晨光	18,642,990.65	7.96
22	600230	沧州大化	18,185,517.54	7.77
23	600717	天津港	17,962,120.96	7.67
24	601628	中国人寿	17,756,811.51	7.58
25	600859	王府井	17,448,181.40	7.45
26	000157	中联重科	17,245,803.55	7.36
27	600058	五矿发展	16,972,569.40	7.25
28	600308	华泰股份	16,738,349.74	7.15
29	600007	中国国贸	16,570,846.71	7.08
30	600879	火箭股份	16,391,332.88	7.00
31	600449	赛马实业	16,351,194.49	6.98
32	600087	南京水运	15,761,615.96	6.73
33	600019	宝钢股份	15,683,743.52	6.70
34	600740	山西焦化	15,160,426.86	6.47
35	000825	太钢不锈	14,883,444.49	6.36
36	600031	三一重工	14,625,429.71	6.25
37	600900	长江电力	13,829,121.47	5.91
38	000617	石油济柴	13,797,005.82	5.89
39	000792	盐湖钾肥	13,600,965.04	5.81

40	000021	长城开发	13,302,519.34	5.68
41	000012	南玻A	12,821,243.79	5.47
42	000690	宝新能源	12,321,628.14	5.26
43	000063	中兴通讯	12,321,579.83	5.26
44	600997	开滦股份	12,288,670.08	5.25
45	600596	新安股份	11,584,262.72	4.95
46	000528	柳工	11,376,642.32	4.86
47	000717	韶钢松山	11,365,017.04	4.85
48	600367	红星发展	10,928,184.95	4.67
49	600470	六国化工	9,444,105.93	4.03
50	000538	云南白药	8,982,824.15	3.84
51	600886	国投电力	8,970,179.98	3.83
52	600317	营口港	8,658,217.93	3.70
53	600357	承德钒钛	8,412,015.29	3.59
54	000039	中集集团	8,109,896.40	3.46
55	600677	航天通信	8,100,386.09	3.46
56	600132	重庆啤酒	8,007,674.55	3.42
57	600383	金地集团	7,985,365.81	3.41
58	600037	歌华有线	7,679,325.28	3.28
59	600183	生益科技	7,382,933.10	3.15
60	600548	深高速	7,241,758.56	3.09
61	600027	华电国际	7,121,625.63	3.04
62	000917	电广传媒	7,026,616.95	3.00
63	002102	冠福家用	7,001,106.92	2.99
64	000539	粤电力A	6,983,496.31	2.98
65	600966	博汇纸业	6,790,589.94	2.90
66	600583	海油工程	6,766,689.34	2.89
67	000069	华侨城A	6,594,240.36	2.82
68	600547	山东黄金	6,198,247.26	2.65

69	000762	西藏矿业	6,120,438.09	2.61
70	600831	广电网络	5,932,099.54	2.53
71	000022	深赤湾A	5,897,098.66	2.52
72	002073	青岛软控	5,491,775.78	2.35
73	000568	泸州老窖	5,423,333.42	2.32
74	600584	长电科技	5,279,061.86	2.25

3、报告期内买入股票成本总额：2,237,409,512.03 元

4、报告期内卖出股票收入总额：1,255,782,122.03 元

(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	220,921,916.20	12.20
2	银行间政策性金融债	160,486,100.00	8.86
	合计	381,408,016.20	21.06

(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	07 农发 02	149,726,100.00	8.27
2	21 国债(15)	84,821,100.00	4.68
3	99 国债 8	41,262,003.00	2.28
4	20 国债(10)	35,171,500.00	1.94
5	20 国债(4)	27,729,000.00	1.53

(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)
应收申购款	53,328,693.71
交易保证金	1,410,000.00
应收利息	5,630,287.94
应收股利	1,615,273.14
合计	61,984,254.79

4、本报告期内权证投资明细如下：

(1) 本报告期内未主动投资权证。

(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	股数（股）	成本（元）	本期余额（股）	类别
1	580013	武钢 CWB1	306,811	710,942.85	---	被动持有
合计			306,811	710,942.85	---	

5、本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

6、本报告期内本基金未投资资产支持证券。

7、本报告期内基金未持有可分离可转换债券。

8、截止本报告期末，本基金管理公司没有运用自有资金投资本基金。

9、由于四舍五入的原因，分项与合计项之间可能存在尾差。

## 第八节 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(户)	66,775
户均持有份额(份)	25,784.51

(二) 基金份额持有人结构

	持有基金份额(份)	占总份额比例(%)
个人	1,515,342,131.20	88.01
机构	206,418,290.59	11.99

## 第九节 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	1,446,415,713.90
2	报告期期初基金份额总额	118,311,633.82
3	加：报告期内基金总申购份额	2,099,345,697.60
4	减：报告期内基金总赎回份额	495,896,909.63
5	报告期末基金份额总额	1,721,760,421.79

## 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》，经宝盈基金管理有限公司董事会审议通过，决定聘任于志先生为公司副总经理；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》，经宝盈基金管理有限公司董事会审议通过，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4月13日刊登《宝盈基金管理有限公司关于变更宝盈鸿利收益证券投资基金基金经理的公告》，经宝盈基金管理有限公司董事会审议通过，决定聘任刘丰元担任宝盈鸿利收益证券投资基金基金经理职务，赵龙不再担任宝盈鸿利收益证券投资基金基金经理；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》，经宝盈基金管理有限公司董事会审议通过，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》，经宝盈基金管理有限公司董事会审议通过，授权刘传葵先生代为履行公司督察长职务。

(三) 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。本报告期内未发生涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的重大诉讼事项。

(四) 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》中披露的投资组合策略，未发生显著的改变。

(五) 2007年2月5日基金管理人在《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》发布公告进行第七次分红，每10份基金单位分配红利11元；2007年6月5日基金管理人在《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》发布公告进行第八次分红，每10份基金单位分配红利3.50元。

(六) 本报告期内，本基金未发生改聘会计师事务所事宜。

(七) 本报告期内，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监管部门稽核或处罚。

(八) 基金租用证券公司专用交易席位的有关情况

本报告期内鸿利收益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(%)
招商证券股份有限公司	1	300,279,442.74	8.61	234,970.92	8.37
国泰君安证券股份有限公司	2	95,937,033.73	2.75	75,290.78	2.68
国信证券有限责任公司	1	437,581,698.83	12.55	357,972.66	12.75

国金证券有限责任公司	1	314,487,400.71	9.02	246,088.14	8.76
中国银河证券有限责任公司	1	461,690,887.37	13.24	377,892.86	13.46
海通证券有限责任公司	1	512,295,426.20	14.69	400,875.28	14.28
国元证券有限责任公司	1	1,124,324,892.73	32.24	918,530.89	32.71
国都证券有限责任公司	1	240,286,165.20	6.90	196,452.33	6.99
合计		3,486,882,947.51	100.00	2,808,073.86	100.00

## 2 债券、回购及权证交易情况:

券商名称	债券成交量(元)	比例 (%)	回购成交量 (元)	比例 (%)	权证成交量 (元)	比例 (%)
国信证券有限责任公司	63,305,253.50	20.26	40,000,000.00	8.37	---	---
海通证券有限责任公司	---	---	---	---	4,880,692.49	75.35
国元证券有限责任公司	220,104,440.30	70.45	240,000,000.00	50.21	1,596,375.42	24.65
中国银河证券有限责任公司	13,261,891.10	4.25	112,000,000.00	23.43	---	---
国都证券有限责任公司	15,076,614.20	4.83	86,000,000.00	17.99	---	---
国金证券有限责任公司	657,009.70	0.21	---	---	---	---
合计	312,405,208.80	100.00	478,000,000.00	100.00	6,477,067.91	100.00

## 3、席位变更情况

本报告期内席位未租用和退租席位。

### (九) 其他在报告期内发生的重大事项

下列公告事项刊登在中国证券报、证券时报、上海证券报上。

公告事项名称	披露日期
宝盈基金管理有限公司开通中国建设银行龙卡储蓄卡基金网上交易的公告	2007-1-8
宝盈基金管理有限公司关于开通全国统一客户服务号码的公告	2007-2-5
宝盈基金管理有限公司关于中国建设银行龙卡储蓄卡基金网上交易费率调整的公告	2007-2-7
宝盈基金管理有限公司开通广东发展银行理财通卡基金网上交易的公告	2007-2-9
关于增加海通证券股份有限公司及东海证券有限责任公司为基金代销机构的公告	2007-2-28
宝盈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宝盈鸿利基金及宝盈泛沿海基金销售机构的公告	2007-3-19
增加中信金通证券为宝盈鸿利及宝盈泛沿海代销渠道的公告	2007-4-13
关于调整宝盈鸿利收益证券投资基金申购费率的公告	2007-4-27
关于宝盈鸿利收益证券投资基金和宝盈策略增长股票证券投资基金开放转换业务的公告	2007-4-27

关于宝盈鸿利收益证券投资基金申购费用及申购份额的计算采用外扣法的公告	2007-5-15
宝盈鸿利收益证券投资基金第八次分红预告	2007-5-30
宝盈基金管理有限公司关于增加中国建设银行股份有限公司为宝盈鸿利收益证券投资基金和宝盈泛沿海区域增长股票证券投资基金代销机构的公告	2007-6-4
增加长城证券为鸿利代销渠道的公告	2007-6-5
宝盈鸿利收益证券投资基金第八次分红公告	2007-6-5
宝盈基金增加中国工商银行为宝盈鸿利代销渠道及工行网银费率优惠的公告	2007-6-29

### 第十一节 备查文件目录

- 1、中国证监会批准宝盈鸿利收益证券投资基金设立的文件。
  - 2、《宝盈鸿利收益证券投资基金基金合同》。
  - 3、《宝盈鸿利收益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**

二零零七年八月二十七日