

申万巴黎新动力股票型证券投资基金

2007 年半年度报告

基金管理人：申万巴黎基金管理有限公司

基金托管人：中国工商银行股份有限公司

2007 年 8 月 29 日

重要提示

本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。

本基金托管人—中国工商银行股份有限公司，根据本基金基金合同规定，于 2007 年 8 月 20 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。

本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

一. 基金简介.....	4
二. 主要财务指标和基金净值表现.....	6
(一) 主要财务指标.....	6
(二) 基金净值表现.....	6
三. 管理人报告.....	9
四. 托管人报告.....	11
五. 财务会计报告.....	12
(一) 半年度基金会计报表.....	12
(二) 会计报表附注.....	16
六. 投资组合报告.....	21
(一) 期末基金资产组合:	21
(二) 期末股票投资组合:	21
(三) 期末持有股票明细:	22
(四) 本期股票投资组合的重大变动:	25
(五) 期末债券投资组合.....	30
(六) 期末前五名债券明细.....	30
(七) 投资组合报告附注:	30
七. 基金份额持有人情况.....	32
八. 开放式基金份额变动.....	32
九. 重大事件揭示.....	33
十. 备查文件目录.....	36

一. 基金简介

(一) 基金名称：申万巴黎新动力股票型证券投资基金

基金简称：新动力

交易代码：310328

深交所行情代码：163103

基金运作方式：契约型开放式证券投资基金

基金合同生效日：2005 年 11 月 10 日

期末基金份额总额：10,501,409,672.22 份

(二) 基金投资目标：本基金通过投资受益于促进国民经济持续增长的新动力而具有高成长性和持续盈利增长潜力的上市公司，有效分享中国经济快速持续增长的成果；通过采用积极主动的分散化投资策略，在严密控制投资风险的前提下，保持基金资产的持续增值，为投资者获取超过业绩基准的收益。

基金投资策略：本基金采用双线并行的组合投资策略，‘自上而下’地进行证券品种的一级资产配置，‘自下而上’地精选个股。基于基础性宏观研究，由投资总监和基金经理首先提出初步的一级资产配置比例；同时，根据本基金管理人自主开发的主动式资产配置模型—AAAM（Active Asset Allocation Model）提示的一级资产配置建议方案，在进行综合的对比分析和评估后作出一级资产配置方案。通过基本面分析、综合分析影响企业持续发展的动力因素和其自身发展环境因素和 market 分析，组合投资有高成长性和具备持续发展能力的上市公司股票，经严格的风险管理后，争取持续稳定的经风险调整后的优良回报。在本基金的投资管理过程中，基金管理人将跟随中国经济的发展，分析各个阶段中国经济的发展环境，对持续成长动力评估体系中的新动力指标和各指标评分权重进行适时地调整，以更适合当时的基金投资环境并挖掘各个阶段的最具持续成长性的上市公司股票进行投资。

业绩比较基准：天相成长 100 指数收益率*80%+中信标普国债指数收益率*20%

风险收益特征：本基金是一只进行主动投资的股票型证券投资基金，其风险和预期收益均高于平衡型基金，属于证券投资基金中的中高风险品种。本基金力争通过资产配置、精选个股等投资策略的实施和积极的风险管理而谋求中长期的较高收益。

(三) 基金管理人：申万巴黎基金管理有限公司

注册地址：上海市淮海中路 300 号香港新世界大厦 40 层

办公地址：上海市淮海中路 300 号香港新世界大厦 40 层

邮政编码：200021

法定代表人：姜国芳

信息披露负责人：来肖贤

联系电话：021-63353535

传真：021-63353858

电子邮箱：service@swbnpp.com

（四）基金托管人：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）基金选定的信息披露报纸：《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》

管理人互联网网址：<http://www.swbnpp.com>

本报告置备地点：申万巴黎基金管理有限公司

中国工商银行

（六）注册登记人：申万巴黎基金管理有限公司

办公地址：上海市淮海中路 300 号香港新世界大厦 40 层

二. 主要财务指标和基金净值表现

(一) 主要财务指标

2007 年 1 月 1 日-2007 年 6 月 30 日

基金本期净收益	181,417,378.55
基金份额本期净收益	0.0488
加权平均基金净值收益率	4.24%
期末可供分配基金收益	1,656,718,004.90
期末可供分配基金份额收益	0.1578
期末基金资产净值	11,745,475,880.44
期末基金份额资产净值	1.1185
本期基金份额净值增长率	68.23%
累计基金份额净值增长率	271.44%

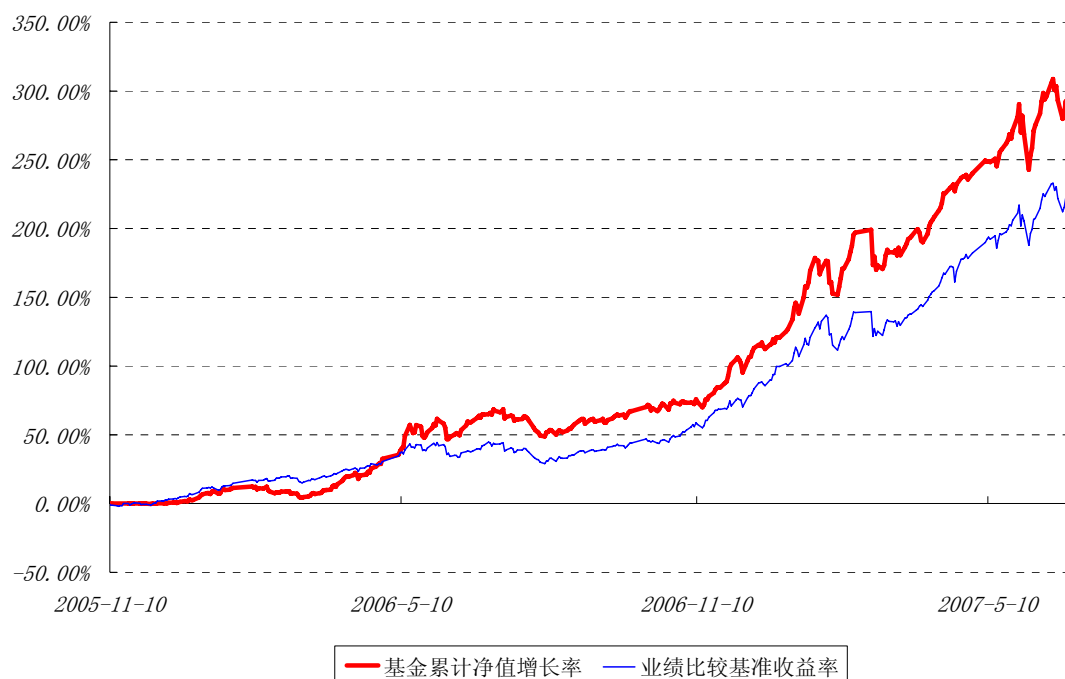
注 1：上述基金业绩指标已扣除了基金的管理费、托管费和各项交易费用，但不包括持有人认/申购或交易基金的各项费用（例如：申购费、赎回费等），计入认/申购或交易基金的各项费用后，实际收益水平要低于所列数字。

(二) 基金净值表现

1、申万巴黎新动力基金历史各时间段净值增长率与同期业绩比较基准收益率的比较：

阶段	基金份额净值增长率①	基金份额净值增长率标准差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
最近一个月	-2.77%	2.69%	-0.76%	2.24%	-2.01%	0.45%
最近三个月	28.05%	2.02%	26.38%	1.89%	1.67%	0.13%
最近六个月	68.23%	2.18%	53.96%	1.98%	14.27%	0.20%
最近一年	125.55%	1.78%	116.03%	1.62%	9.52%	0.16%
自基金合同生效起至今	271.44%	1.63%	207.61%	1.41%	63.83%	0.22%

2、自基金合同生效以来基金份额净值变动与同期业绩比较基准变动的比较：
申万巴黎新动力股票型基金累计净值增长率与业绩比较基准收益率的历史走势对比



注 2: 根据本基金基金合同, 本基金股票投资比例为基金净资产的 60%至 95%, 股票投资资产部分投资于受益于促进国民经济持续增长的新动力而具有高成长性和持续盈利增长潜力的上市公司股票的比例不低于 80%; 债券与货币市场工具的投资比例为基金净资产的 5%至 40%, 其中现金和到期日在一年以内的政府债券为基金净资产的 5%以上。在本基金合同生效后六个月内, 达到上述比例限制。

3: 本基金的业绩基准指数=天相成长 100 指数收益率×80%+中信标普国债指数收益率×20%。其中: 天相成长 100 指数作为衡量股票投资部分的业绩基准, 中信标普国债指数作为衡量基金债券投资部分的业绩基准。

天相成长指数成份股选择主要指标为上市公司公开的最新的净利润增长、主营业务收入增长和主营业务利润增长, 明确反映公司的成长性; 天相成长 100 指数的样本股则是天相成长指数样本中规模最大、最具流动性的 100 家公司, 在成长型股票的基础上充分考虑了指数的覆盖面、指数成份股的市值规模以及良好流动性的同时也充分考虑了指数成份股的行业代表、成份股所代表的上市公司的基本因素, 适合作为关注成长性的投资基准。中信标普国债指数由中信标普指数信息服务有限公司发布, 是中信标普债券系列指数中的一员, 该指数市场影响力大, 被基金业广泛用作衡量债券投资收益的评价基准。

本基金的业绩基准指数按照构建公式每交易日进行计算, 计算方式如下:

$\text{benchmark}_0 = 1000;$

$$\% \text{benchmark}_t = 80\% * (\text{天相成长}100\text{指数}_t / \text{天相成长}100\text{指数}_{t-1} - 1) + 20\% * (\text{中信标普国债指数}_t / \text{中信标普国债指数}_{t-1} - 1);$$

$$\text{benchmark}_t = (1 + \% \text{benchmark}_t) * \text{benchmark}_{t-1};$$

其中 $t=1, 2, 3, \dots$ 。

三. 管理人报告

(一) 基金经理及基金管理经验

基金经理：常永涛 先生

常永涛先生，1970 年出生，澳门国际大学工商管理硕士。自 1992 年起开始从事证券市场投资工作，从事股票市场、债券市场的投资，曾任四川省信托投资公司上海证券管理总部副总经理；自 2001 年起开始从事基金管理工作，2001 年—2004 年任职大成基金管理有限公司交易部、基金经理部基金经理。2004 年 12 月加入本公司任基金经理。

(二) 基金运作的遵规守信情况

本报告期内，本基金管理人严格遵守《证券法》、《证券投资基金法》及其配套法规的规定，严格遵守基金合同约定，本着诚实信用、勤勉尽责等原则管理和运用基金资产，在严格控制风险的基础上为持有人谋求最大利益。

本基金投资运作符合法律法规和基金合同的规定，信息披露及时、准确、完整；本基金资产与本基金管理人与公司资产之间严格分开；没有发生内幕交易、操纵市场和不当关联交易及其他违规行为。在基金资产的管理运作中，无任何损害基金持有人利益的行为，并通过稳健经营、规范运作、规避风险，保护了基金持有人的合法权益。

本基金管理人于 2007 年 4 月 5 日收到中国证监会基金部函(基金部函[2007]88 号)，要求基金管理人将本基金投资“长城股份”(000569)的投资情况做出说明，本基金管理人由风险管理和稽核人员针对投资过程、投资决策依据、相关负责人以及投资合规情况展开独立调查，并向监管机构提交了专题调查报告和相关证明材料和记录。

通过审慎调查和判断，基金管理人对本基金的该项投资的合规性意见如下：该项投资行为和过程

- 1、从决策的程序、买卖的操作未违反该基金合同中关于基金投资的有关约定；
- 2、不存在内幕交易、操纵证券交易价格、利益输送等不当的证券交易行为；
- 3、不存在《中华人民共和国证券法》、《中华人民共和国证券投资基金法》以及《证券投资基金运作管理办法》所禁止或限定的其他交易行为。

(三) 投资报告与业绩表现

在 2006 年强势上涨的基础之上，2007 年上半年，场外源源不断的新增资金让沪深指数在振荡中不断创新高（上证指数于 5 月 29 日创下 4335.96 点的历史新高），尽管农历新年过后罕见的“2.27”大跌调整成为了十年来市场的单日最大波幅，但是宽裕的资金面仍支撑股市的强势格局，二季度从 4 月 1 日起至 5 月 29 日沪深股市走出了强势单边上涨之行情，沪深指数不断攀升。优质资产注入、整体上市等外延式增长不断得到市场的追捧，相关股价表现突出，尤其是题材股、中低价股和 ST 股表现相当活跃。然而上涨并不是一帆风顺的，5 月 30 日，财政部上调印花税成为股市大幅调整的导火线，指数最大跌幅一度超过 20%，投资者上了生动的风险课。当前我国国民经济继续保持平稳快速发展，而适度偏紧的货币政策难以改变中国股市的牛市大趋势。

2007 年中国股市步入“股权分置改革后”时代，激励方式的改变，股权的变更，

新产品新市场的开拓和行业的整合并购等等都可能带来公司价值的较大变化。基于上述判断，上半年本基金秉承了灵活投资和分散化投资的策略，尽可能的分散化投资使得投资者分享到资产证券化带来的投资机会，同时保持了较高的股票仓位。由于本基金 4 月中下旬以来经历了拆分等持续营销的过程，因此在资产配置方面，本基金在第 2 季度把握股票价格的结构性调整进一步深化的机遇，仍然采取了轻指数涨跌、重个股价值判断的投资策略，并保持了适度的股票资产比重。行业配置重点包括消费类（包括消费渠道和品牌消费品），先进装备制造业，地产，金融，医药等，选择行业趋势良好、具有核心竞争力、公司治理结构相对完善的公司为主。在下半年操作中将更加注重结构调整，由于价值投资和基本面分析是决定股价的基本因素，未来股指期货之推出，红筹股公司到国内募集资金，将导致股市结构性调整趋势和市场资源向优质公司集聚的趋势进一步加强，因此在下半年操作中，按照“国际视野，布局为先”的投资理念，本基金将不断寻找主业突出、业绩持续增长的行业优势企业（尤其是在股指的成份股中寻找那些业绩不断超预期且有整体上市或优质资产注入预期的优质标的）和红筹股回归的受益群体来不断优化组合结构。近期我们还会利用中报披露机会，反复检验本基金所持股票的长期发展趋势，进一步提高组合在下阶段行情中的有效性，并且为下阶段即将推出的一些新的投资品种（如股指期货等）做好提前准备。

（四）基金管理人宏观经济环境、市场环境的判断

自今年年初以来，投资、消费和出口的数据均好于预期，甚至自 2003 年 3 月以来，GDP 连续多个季度超过 11%，宏观经济的强劲表现既支撑股市维持强势，同时也导致政府对经济过热的担忧，随后的宏观调控表明了这一点，“流动性过剩”成为市场最为关注的焦点，其中既有主要西方国家处于加息周期后，国际资金开始从一些新兴市场撤出而导致这些国家股票市场大幅波动，也包括央行为控制贷款增速过快而不断出台的流动性紧缩措施。我们认为，投资增长过快、信贷投放过猛、外贸收支不平衡加剧等都是表面现象，根本原因是由于对人民币升值预期而导致的过量流动性，使得银行有钱可贷，基础货币投放量过大。因此在后续的宏观调控措施中，汇率调整可能成为重要工具，央行对人民币升值的容忍度在提高，人民币汇率上涨幅度或会超过市场之前的判断。对具体行业的产业结构调整政策会取代全面紧缩，通过科技创新来完成产业结构升级的基本政策还会强化。股市作为重要的逐步完善中的直接融资市场，将成为完成这一历史性变革的重要平台。

无论是居全球最高的经济增长率，还是上市公司盈利的强劲增长；无论是人民币持续升值趋势，还是新会计准则对上市公司业绩的提升；无论是股改体现了大股东的利益诉求，还是政府对上市公司重组、购并、注资、整合的战略决策，这一系列中国股市独有的利好因素，为 A 股的牛市行情提供了坚实基础。展望后市，A 股的大牛市格局仍然没有改变，目前大盘高位宽幅震荡，我们相信那些主导中国经济增长并且符合国家产业政策的绩优蓝筹股会在未来行情中整体跑赢大市。

四. 托管人报告

2007年上半年,本基金托管人在对申万巴黎新动力股票型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。

2007年上半年,申万巴黎新动力股票型证券投资基金的管理人——申万巴黎基金管理有限公司在申万巴黎新动力股票型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。

本托管人依法对申万巴黎基金管理有限公司在2007年上半年所编制和披露的申万巴黎新动力股票型证券投资基金半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

2007 年 8 月 20 日

五. 财务会计报告

(一) 半年度基金会计报表

资产负债表

单位：人民币元

项 目	附注	2007 年 6 月 30 日	2006 年 12 月 31 日
资产：			
银行存款		1,882,002,053.19	66,617,603.52
清算备付金		51,351,530.63	1,498,901.19
交易保证金		1,054,619.17	250,000.00
应收证券清算款		21,538,590.08	7,629,989.55
应收股利		4,733,956.85	-
应收利息	5(1)	3,104,964.17	21,934.84
应收申购款		144,710,397.28	31,700,646.97
其他应收款		-	-
股票投资市值		9,638,113,153.85	416,254,137.82
其中：股票投资成本		8,694,722,119.94	368,690,874.49
债券投资市值		100,008,600.00	-
其中：债券投资成本		100,008,600.00	-
权证投资市值		3,106,422.00	-
其中：权证投资成本		-	-
买入返售证券		-	-
待摊费用		-	-
其他资产		-	-
资产总计		11,849,724,287.22	523,973,213.89

负债：

应付证券清算款	-	5,519,885.08
应付赎回款	79,068,659.66	16,464,720.39
应付赎回费	297,996.32	62,008.24
应付管理人报酬	13,641,490.16	417,831.73

12 of 36

制作：

校核：

签发：

应付托管费		2,273,581.69	69,638.61
应付佣金	5(3)	8,002,821.47	757,519.98
应付利息		—	—
应付收益		—	—
未交税金		—	—
其他应付款	5(4)	750,625.00	500,000.00
卖出回购证券款		—	—
预提费用	5(5)	213,232.48	190,000.00
其他负债		—	—
负债合计		104,248,406.78	23,981,604.03

所有者权益：

实收基金	5(6)	5,783,846,198.54	414,184,470.19
未实现利得	5(7)	4,304,911,677.00	84,422,329.71
未分配收益		1,656,718,004.90	1,384,809.96
所有者权益合计		11,745,475,880.44	499,991,609.86
基金份额	5(6)	10,501,409,672.22	414,184,470.19
基金份额资产净值		1.1185	1.2072

经营业绩表

单位：人民币元

项 目	附注	2007 年 1 月 1 日 -2007 年 6 月 30 日	2005 年 11 月 10 日 -2006 年 6 月 30 日
一、收入		216,900,552.84	81,889,786.12
1、股票差价收入	5(8)	180,101,890.71	75,673,492.01
2、债券差价收入	5(9)	55,361.54	-
3、权证差价收入		-	2,399,237.90
4、债券利息收入		807,086.40	-
5、存款利息收入		3,577,479.10	524,728.63
6、股利收入		29,569,137.89	1,701,619.91
7、买入返售证券收入		-	660,909.00
8、其他收入	5(10)	2,789,597.20	929,798.67
二、费用		35,483,174.29	3,844,873.30
1、基金管理人报酬		30,222,225.56	3,072,032.06
2、基金托管费		5,037,037.56	512,005.36
3、卖出回购证券支出		-	-
4、利息支出		-	-
5、其他费用	5(11)	223,911.17	260,835.88
其中：信息披露费		178,520.30	201,151.23
审计费用		34,712.18	39,113.71
三、基金净收益		181,417,378.55	78,044,912.82
加：未实现利得	5(7)	898,934,192.58	60,477,454.20
四、基金经营业绩		1,080,351,571.13	138,522,367.02

制作：

校核：

签发：

收益分配表

单位：人民币元

项 目	附注	2007 年 1 月 1 日 -2007 年 6 月 30 日	2005 年 11 月 10 日 -2006 年 6 月 30 日
本期基金净收益		181,417,378.55	78,044,912.82
加：期初基金净收益		1,384,809.96	-
加：本期损益平准金		1,473,915,816.39	-844,099.34
可供分配基金净收益		1,656,718,004.90	77,200,813.48
减：本期已分配基金净收益		-	10,578,215.66
期末未分配净收益		1,656,718,004.90	66,622,597.82

基金净值变动表

单位：人民币元

项 目	附注	2007 年 1 月 1 日 -2007 年 6 月 30 日	2005 年 11 月 10 日 -2006 年 6 月 30 日
一、期初基金净值		499,991,609.86	669,603,985.69
二、本期经营活动：			
基金净收益		181,417,378.55	78,044,912.82
未实现经营利得变动数	5(7)	898,934,192.58	60,477,454.20
经营活动产生的基金净值变动数		1,080,351,571.13	138,522,367.02
三、本期基金单位交易			
基金申购款		12,418,022,172.55	238,434,597.25
基金赎回款		2,252,889,473.10	703,290,118.27
基金单位交易产生的基金净值变动数		10,165,132,699.45	-464,855,521.02
四、本期向持有人分配收益：			
向持有人分配收益产生的基金净值变动数		-	10,578,215.66
五、期末基金净值		11,745,475,880.44	332,692,616.03

制作：

校核：

签发：

（二） 会计报表附注

1、 基金的基本情况

本基金是经中国证券监督管理委员会核准（见证监基金字[2005]159 号文，“关于同意申万巴黎新动力股票型开放式证券投资基金募集的批复”）募集设立的契约型开放式基金，基金管理人为申万巴黎基金管理有限公司，基金托管人为中国工商银行，基金合同于 2005 年 11 月 10 日生效，该日基金份额总额为 669,603,985.69 份。

2、 本半年度会计报表所采用的会计政策、会计估计与上年度会计报表相一致。

3、 本报告期内，本基金未发生重大会计差错及更正事项。

4、 关联方关系及关联方交易

a) 本报告期内，关联方关系未发生变化。

b) 关联方交易

下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

A. 通过关联方交易单元进行的交易

(a) 基金通过关联方交易单元的股票投资成交金额和权证投资成交金额：

	关 联 人	股票交易量	占股票总交 易量比例	权证交易量	占权证总交 易量比例
本期	申银万国	3,905,626,567.54	33.89%	-	-
上期	申银万国	687,571,979.29	28.96%	-	-

(b) 基金通过关联方交易单元的债券投资成交金额和债券回购成交金额

	关 联 人	债券交易量	占债券总 交易量比	债券回购交易量	占债券回购 总交易量比
本期	申银万国	-	-	-	-
上期	申银万国	-	-	-	-

(c) 基金通过关联方交易单元进行交易而支付的佣金金额

关 联 人	本期佣金	占本期总佣金比	上期佣金	占上年同期总佣金比
申银万国	3,202,599.87	34.35%	563,799.10	29.76%

(d) 交易佣金的计算方式：

股票交易佣金 = 买（卖）成交金额 * 1% - 买（卖）经手费 - 买（卖）证管费；

债券现券交易和债券回购交易不计交易佣金；

两交易所按证券成交量（包括股票、债券现券及债券回购交易量）收取的证券交易结算风险基金从券商获得的交易佣金中扣除。

B. 关联方报酬

（a）基金管理人报酬

支付基金管理人申万巴黎基金管理有限公司的管理费按前一日基金资产净值的 1.50% 年费率每日计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日基金管理费 = 前一日基金资产净值 * 1.50% ÷ 当年天数。

本基金在本会计期间需支付基金管理费 30,222,225.56 元（2005 年 11 月 10 日至 2006 年 6 月 30 日：3,072,032.06 元）。

（b）基金托管费

支付基金托管人中国工商银行的托管费按前一日的基金资产净值的 0.25% 年费率每日计提，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。

本基金在本会计期间需支付基金托管费 5,037,037.56 元（2005 年 11 月 10 日至 2006 年 6 月 30 日：512,005.36 元）。

C. 基金与关联方进行的银行间同业市场的债券和债券回购交易

	关 联 人	债券成交金额	回购成交金额	回购利息收入	回购利息支出
本期	中国工商银行	-	-	-	-
上期	中国工商银行	-	-	-	-
本期	申银万国	-	-	-	-
上期	申银万国	-	-	-	-

D. 关联方投资本基金的情况

a) 本基金管理人本期内和上期间均未投资本基金。

b) 本基金管理人主要股东及其控制的机构在本期末和上期末均未持有本基金份额。

E. 本期末管理人基金从业人员持有本基金的情况

持有基金份额	占基金总份额比例
1, 841, 505. 12	0. 02%

F. 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入。

本基金的银行存款由基金托管人中国工商银行保管，并按银行间同业存款利率计息。

	关 联 人	银行存款余额	存款利息收入
本期	中国工商银行	1, 882, 002, 053. 19	3, 454, 833. 03
上期	中国工商银行	24, 419, 312. 89	479, 322. 71

5、基金会计报表重要项目

(1) 应收利息：

	期末数
应收银行存款利息	353, 207. 89
应收清算备付金利息	20, 797. 38
应收债券利息	<u>2, 730, 958. 90</u>
合 计	<u>3, 104, 964. 17</u>

(2) 投资估值增值：

	期末数
股票估值增值	943, 391, 033. 91
权证估值增值	<u>3, 106, 422. 00</u>
合 计	<u>946, 497, 455. 91</u>

(3) 应付佣金：

	期末数
申银万国	2, 922, 032. 95
海通证券	1, 616, 792. 13
中银国际	1, 469, 821. 18
中金公司	672, 654. 51

光大证券	666,098.56
联合证券	587,465.46
银河证券	<u>67,956.68</u>
合 计	<u>8,002,821.47</u>

(4) 其他应付款:

	期末数
应付席位保证金	750,000.00
应付银行间债券交易费用	625.00
合 计	<u>750,625.00</u>

(5) 预提费用:

	期末数
信息披露费	178,520.30
审计费	<u>34,712.18</u>
合 计	<u>213,232.48</u>

(6) 实收基金:

	份额	金额
期初数	414,184,470.19	414,184,470.19
申购增加数	11,097,876,716.27	6,568,388,827.15
拆分增加数	853,833,772.59	-
赎回减少数	<u>1,864,485,286.83</u>	<u>1,198,727,098.80</u>
期末数	<u>10,501,409,672.22</u>	<u>5,783,846,198.54</u>

(7) 未实现利得:

	本期数
期初数	84,422,329.71
投资估值增值变动数	898,934,192.58
本期申购的未实现利得平准金	4,094,813,346.17
本期赎回的未实现利得平准金	<u>-773,258,191.46</u>
期末数	<u>4,304,911,677.00</u>

(8) 股票差价收入:

	本期数
卖出股票成交总额	1,711,623,701.42
卖出股票成本总额	1,530,084,180.48
券商佣金总额	<u>1,437,630.23</u>
股票差价收入	<u>180,101,890.71</u>

(9) 债券差价收入:

	本期数
卖出债券成交总额或收到的全部价款	150,000,000.00
卖出债券成本总额	148,999,638.46
应收利息总额	<u>945,000.00</u>
债券差价收入	<u>55,361.54</u>

(10) 其他收入:

	本期数
基金赎回费补偿	2,789,597.20

(11) 其他费用:

	本期数
信息披露费	178,520.30
审计费	34,712.18
银行间债券账户维护费	9,000.00
银行汇划费	1,053.69
银行间债券交易费用	<u>625.00</u>
合 计	<u>223,911.17</u>

6、期末流通转让受到限制的基金资产: 无。

六. 投资组合报告

(一) 期末基金资产组合：

	市 值 (元)	占总资产比例
股票	9,638,113,153.85	81.34%
债券	100,008,600.00	0.84%
权证	3,106,422.00	0.03%
银行存款和清算备付金	1,933,353,583.82	16.32%
其他资产	175,142,527.55	1.48%
合 计	11,849,724,287.22	100.00%

(二) 期末股票投资组合：

序号	分 类	市 值 (元)	占净值比例
A	农、林、牧、渔业	19,500,461.40	0.17%
B	采掘业	332,169,277.64	2.83%
C	制造业	4,663,333,346.99	39.70%
C0	其中：食品、饮料	520,386,703.98	4.43%
C1	纺织、服装、皮毛	33,262,500.00	0.28%
C2	木材、家具	49,768,626.00	0.42%
C3	造纸、印刷	75,560,006.42	0.64%
C4	石油、化学、塑胶、塑料	346,613,470.44	2.95%
C5	电子	12,948,336.00	0.11%
C6	金属、非金属	1,131,324,255.10	9.63%
C7	机械、设备、仪表	1,683,496,052.73	14.33%
C8	医药、生物制品	752,636,618.64	6.41%
C99	其他	57,336,777.68	0.49%
D	电力、煤气及水的生产和供应业	192,167,313.12	1.64%
E	建筑业	13,074,304.70	0.11%
F	交通运输、仓储业	704,063,674.31	5.99%
G	信息技术业	389,541,628.13	3.32%
H	批发和零售贸易	508,213,644.60	4.33%
I	金融、保险业	1,356,563,642.96	11.55%
J	房地产业	986,000,895.44	8.39%
K	社会服务业	392,578,843.44	3.34%
L	传播与文化产业	-	-
M	综合类	80,906,121.12	0.69%
合 计		9,638,113,153.85	82.06%

(三) 期末持有股票明细:

序号	股票代码	股票名称	数量	市 值 (元)	占净值比例
1	000069	华侨城 A	9,602,243	382,169,271.40	3.25%
2	600016	民生银行	32,681,376	373,548,127.68	3.18%
3	600675	中华企业	14,406,022	327,160,759.62	2.79%
4	600000	浦发银行	8,339,789	305,152,879.51	2.60%
5	600685	广船国际	5,929,852	298,093,660.04	2.54%
6	000002	万 科 A	13,317,366	254,628,037.92	2.17%
7	600717	天 津 港	9,887,792	248,875,724.64	2.12%
8	600085	同 仁 堂	6,173,616	237,499,007.52	2.02%
9	600036	招商银行	9,399,838	231,048,018.04	1.97%
10	600150	沪东重机	1,598,779	221,015,208.96	1.88%
11	600309	烟台万华	4,010,298	214,791,560.88	1.83%
12	600219	南山铝业	8,801,791	199,712,637.79	1.70%
13	600521	华海药业	8,161,547	178,084,955.54	1.52%
14	600030	中信证券	3,193,901	169,180,935.97	1.44%
15	000039	中集集团	5,696,376	167,017,744.32	1.42%
16	600009	上海机场	4,099,891	155,836,856.91	1.33%
17	600628	新 世 界	7,941,752	152,561,055.92	1.30%
18	000402	金 融 街	5,137,518	148,988,022.00	1.27%
19	600067	冠城大通	6,450,418	139,006,507.90	1.18%
20	600887	伊利股份	4,445,652	138,526,516.32	1.18%
21	600100	同方股份	3,955,074	135,659,038.20	1.15%
22	000617	石油济柴	4,355,498	135,020,438.00	1.15%
23	600585	海螺水泥	2,264,959	133,541,982.64	1.14%
24	600019	宝钢股份	11,999,912	131,999,032.00	1.12%
25	000157	中联重科	3,373,061	129,862,848.50	1.11%
26	000768	西飞国际	4,199,997	129,653,907.39	1.10%
27	000858	五 粮 液	4,012,050	126,219,093.00	1.07%
28	600607	上实医药	7,461,044	125,196,318.32	1.07%
29	600748	上实发展	6,225,540	121,149,008.40	1.03%
30	600900	长江电力	7,999,973	120,959,591.76	1.03%
31	000729	燕京啤酒	9,100,240	120,578,180.00	1.03%
32	000528	柳 工	4,905,916	120,194,942.00	1.02%
33	600005	武钢股份	11,498,685	115,676,771.10	0.98%
34	000063	中兴通讯	1,973,182	107,341,100.80	0.91%
35	000625	长安汽车	6,399,984	105,471,736.32	0.90%

36	000024	招商地产	2,015,023	98,937,629.30	0.84%
37	000651	格力电器	2,759,923	96,321,312.70	0.82%
38	600583	海油工程	2,639,970	95,566,914.00	0.81%
39	600320	振华港机	4,800,000	95,376,000.00	0.81%
40	600028	中国石化	7,148,389	94,501,702.58	0.80%
41	000878	云南铜业	2,685,055	92,634,397.50	0.79%
42	600849	上海医药	5,248,404	91,059,809.40	0.78%
43	600015	华夏银行	6,999,959	84,279,506.36	0.72%
44	600111	稀土高科	3,000,000	83,460,000.00	0.71%
45	601318	中国平安	1,121,900	80,227,069.00	0.68%
46	600050	中国联通	13,299,916	78,070,506.92	0.66%
47	600963	岳阳纸业	2,971,294	75,560,006.42	0.64%
48	600072	江南重工	5,091,072	72,598,686.72	0.62%
49	600886	国投电力	4,599,982	71,207,721.36	0.61%
50	600859	王府井	1,371,729	67,420,480.35	0.57%
51	601006	大秦铁路	4,400,000	66,616,000.00	0.57%
52	600161	天坛生物	1,946,326	62,496,527.86	0.53%
53	600125	铁龙物流	5,601,257	61,781,864.71	0.53%
54	002024	苏宁电器	1,299,980	61,047,060.80	0.52%
55	600631	百联股份	3,519,869	59,098,600.51	0.50%
56	000568	泸州老窖	1,400,224	58,949,430.40	0.50%
57	600867	通化东宝	5,000,000	58,300,000.00	0.50%
58	600208	中宝股份	4,692,044	57,336,777.68	0.49%
59	000839	中信国安	2,000,000	56,000,000.00	0.48%
60	600428	中远航运	2,531,998	55,425,436.22	0.47%
61	601628	中国人寿	1,300,000	53,443,000.00	0.46%
62	600026	中海发展	2,308,726	53,054,523.48	0.45%
63	000807	云铝股份	3,308,557	52,969,997.57	0.45%
64	000022	深赤湾 A	1,999,983	52,899,550.35	0.45%
65	600761	安徽合力	1,847,786	52,661,901.00	0.45%
66	600337	美克股份	2,241,830	49,768,626.00	0.42%
67	600096	云天化	1,843,302	45,142,465.98	0.38%
68	600361	华联综超	1,551,827	42,970,089.63	0.37%
69	000419	通程控股	1,901,663	39,953,939.63	0.34%
70	600519	贵州茅台	326,898	39,123,152.64	0.33%
71	000898	鞍钢股份	2,199,866	38,915,629.54	0.33%
72	600895	张江高科	2,143,779	37,044,501.12	0.32%
73	601001	大同煤业	1,448,562	36,634,132.98	0.31%

23 of 36

制作:

校核:

签发:

74	000001	深发展 A	1,320,000	36,326,400.00	0.31%
75	600383	金地集团	1,026,810	35,137,438.20	0.30%
76	000698	沈阳化工	3,041,226	34,305,029.28	0.29%
77	600809	山西汾酒	1,019,907	34,248,477.06	0.29%
78	600177	雅戈尔	1,250,000	33,262,500.00	0.28%
79	000060	中金岭南	1,100,000	32,230,000.00	0.27%
80	600838	上海九百	4,225,160	31,561,945.20	0.27%
81	600660	福耀玻璃	999,917	30,517,466.84	0.26%
82	600888	新疆众和	933,972	29,999,180.64	0.26%
83	600832	东方明珠	1,808,000	29,271,520.00	0.25%
84	600327	大厦股份	2,551,310	28,064,410.00	0.24%
85	600997	开滦股份	1,199,894	26,397,668.00	0.22%
86	600616	第一食品	1,016,563	25,536,062.56	0.22%
87	600391	成发科技	1,147,140	24,801,166.80	0.21%
88	600312	平高电气	1,080,503	24,624,663.37	0.21%
89	000983	西山煤电	832,757	23,508,730.11	0.20%
90	601699	潞安环能	572,406	23,394,233.22	0.20%
91	601328	交通银行	2,125,360	23,357,706.40	0.20%
92	600031	三一重工	473,450	20,940,693.50	0.18%
93	000792	盐湖钾肥	470,280	20,871,026.40	0.18%
94	000663	永安林业	2,653,124	19,500,461.40	0.17%
95	600348	国阳新能	500,000	18,480,000.00	0.16%
96	002010	传化股份	995,223	17,048,169.99	0.15%
97	600595	中孚实业	457,457	15,498,643.16	0.13%
98	600790	轻纺城	1,330,000	14,590,100.00	0.12%
99	600596	新安股份	334,689	14,455,217.91	0.12%
100	600528	中铁二局	773,170	13,074,304.70	0.11%
101	002129	中环股份	834,300	12,948,336.00	0.11%
102	600118	中国卫星	399,327	12,470,982.21	0.11%
103	600192	长城电工	857,145	10,842,884.25	0.09%
104	002128	露天煤业	300,000	10,830,000.00	0.09%
105	600754	锦江股份	694,898	10,409,572.04	0.09%
106	601919	中国远洋	524,300	9,573,718.00	0.08%
107	600432	吉恩镍业	145,400	7,150,772.00	0.06%
108	000837	秦川发展	499,964	7,009,495.28	0.06%
109	600489	中金黄金	60,725	2,855,896.75	0.02%
110	600600	青岛啤酒	105,904	2,741,854.56	0.02%

(四) 本期股票投资组合的重大变动:**1、本期累计买入、累计卖出价值达到或超过基金净值 2%的股票明细:**

累计买入价值达到或超过基金净值 2%的股票:

序号	股票代码	股票名称	累计买入金额	占期初净值比例
1	600016	民生银行	370,769,854.49	74.16%
2	000069	华侨城 A	275,889,585.02	55.18%
3	600675	中华企业	265,438,849.48	53.09%
4	600000	浦发银行	249,249,787.16	49.85%
5	600085	同仁堂	207,824,834.37	41.57%
6	600036	招商银行	195,936,963.87	39.19%
7	600521	华海药业	195,639,921.14	39.13%
8	600685	广船国际	183,765,580.72	36.75%
9	000002	万科 A	181,568,846.52	36.31%
10	600717	天津港	176,131,820.69	35.23%
11	600030	中信证券	174,514,581.04	34.90%
12	600309	烟台万华	173,014,779.60	34.60%
13	600900	长江电力	163,995,378.63	32.80%
14	600150	沪东重机	160,256,255.75	32.05%
15	600867	通化东宝	156,461,426.34	31.29%
16	600628	新世界	155,128,059.57	31.03%
17	600009	上海机场	153,943,111.30	30.79%
18	600219	南山铝业	153,290,911.04	30.66%
19	600019	宝钢股份	147,892,612.42	29.58%
20	600607	上实医药	147,870,906.68	29.57%
21	600005	武钢股份	145,696,551.38	29.14%
22	000617	石油济柴	142,175,087.29	28.44%
23	600748	上实发展	141,663,909.69	28.33%
24	000039	中集集团	140,260,338.17	28.05%
25	600887	伊利股份	132,617,700.78	26.52%
26	000157	中联重科	129,325,627.30	25.87%
27	000729	燕京啤酒	125,542,069.96	25.11%
28	600100	同方股份	121,560,490.34	24.31%
29	000402	金融街	120,264,330.71	24.05%
30	000528	柳工	116,828,651.23	23.37%
31	000768	西飞国际	109,593,939.88	21.92%
32	000625	长安汽车	109,475,753.49	21.90%

25 of 36

制作:

校核:

签发:

33	000063	中兴通讯	102,424,116.27	20.49%
34	600028	中国石化	100,614,513.97	20.12%
35	600849	上海医药	99,426,399.41	19.89%
36	000858	五 粮 液	97,344,865.98	19.47%
37	600015	华夏银行	96,314,386.72	19.26%
38	600320	振华港机	96,022,688.72	19.20%
39	600585	海螺水泥	91,299,042.25	18.26%
40	600072	江南重工	90,955,764.83	18.19%
41	600067	冠城大通	89,558,022.73	17.91%
42	000878	云南铜业	86,043,509.54	17.21%
43	600050	中国联通	84,689,983.96	16.94%
44	000024	招商地产	84,110,950.12	16.82%
45	600583	海油工程	81,343,388.07	16.27%
46	600111	稀土高科	75,166,605.27	15.03%
47	600125	铁龙物流	75,158,694.52	15.03%
48	000839	中信国安	74,446,020.01	14.89%
49	000651	格力电器	70,769,639.61	14.15%
50	600886	国投电力	69,690,134.41	13.94%
51	600963	岳阳纸业	68,909,849.83	13.78%
52	600161	天坛生物	68,211,866.68	13.64%
53	600790	轻 纺 城	67,052,716.83	13.41%
54	601628	中国人寿	66,174,865.48	13.24%
55	601318	中国平安	64,576,991.12	12.92%
56	600428	中远航运	62,711,335.03	12.54%
57	000807	云铝股份	57,178,277.72	11.44%
58	600026	中海发展	57,072,969.25	11.41%
59	000022	深赤湾 A	56,162,323.48	11.23%
60	600761	安徽合力	55,281,622.96	11.06%
61	600631	百联股份	53,276,756.05	10.66%
62	000568	泸州老窖	52,536,483.39	10.51%
63	601006	大秦铁路	52,251,557.52	10.45%
64	600118	中国卫星	50,825,358.14	10.17%
65	600832	东方明珠	48,269,441.06	9.65%
66	600859	王 府 井	47,263,229.09	9.45%
67	600192	长城电工	45,800,703.77	9.16%
68	600838	上海九百	45,190,524.89	9.04%
69	000898	鞍钢股份	44,010,440.37	8.80%
70	600096	云 天 化	43,472,939.24	8.69%

71	600348	国阳新能	43,165,666.93	8.63%
72	600208	中宝股份	42,084,163.07	8.42%
73	600361	华联综超	41,983,903.58	8.40%
74	600337	美克股份	41,964,853.92	8.39%
75	000698	沈阳化工	41,805,477.85	8.36%
76	600895	张江高科	39,082,528.62	7.82%
77	600809	山西汾酒	38,872,525.44	7.77%
78	000663	永安林业	38,199,784.88	7.64%
79	600630	龙头股份	37,401,920.54	7.48%
80	000419	通程控股	36,999,211.50	7.40%
81	600888	新疆众和	35,601,145.41	7.12%
82	600596	新安股份	35,556,561.35	7.11%
83	000060	中金岭南	34,735,194.61	6.95%
84	600519	贵州茅台	34,663,746.17	6.93%
85	000001	深发展 A	32,320,750.35	6.46%
86	600114	东睦股份	32,149,591.18	6.43%
87	600616	第一食品	30,538,461.70	6.11%
88	601001	大同煤业	30,183,840.73	6.04%
89	000759	武汉中百	29,668,427.79	5.93%
90	600660	福耀玻璃	29,375,066.70	5.88%
91	600997	开滦股份	28,154,762.01	5.63%
92	600312	平高电气	27,368,078.89	5.47%
93	000792	盐湖钾肥	27,193,987.97	5.44%
94	002024	苏宁电器	27,136,147.92	5.43%
95	600177	雅 戈 尔	26,713,962.42	5.34%
96	600327	大厦股份	26,434,476.98	5.29%
97	600162	香江控股	25,841,385.35	5.17%
98	000876	新 希 望	25,481,597.86	5.10%
99	000527	美的电器	25,176,437.98	5.04%
100	002031	巨轮股份	25,078,435.48	5.02%
101	600432	吉恩镍业	24,262,854.28	4.85%
102	600383	金地集团	23,270,111.26	4.65%
103	002010	传化股份	23,183,471.74	4.64%
104	000400	许继电气	22,895,689.22	4.58%
105	000619	海螺型材	22,877,644.63	4.58%
106	600391	成发科技	22,810,518.58	4.56%
107	600597	光明乳业	22,746,146.91	4.55%
108	601699	潞安环能	22,626,975.45	4.53%

109	000970	中科三环	22,497,686.95	4.50%
110	600240	华业地产	20,806,679.64	4.16%
111	600031	三一重工	19,004,758.07	3.80%
112	600655	豫园商城	18,855,874.91	3.77%
113	600694	大商股份	18,378,549.37	3.68%
114	600595	中孚实业	18,329,522.22	3.67%
115	000983	西山煤电	17,371,038.07	3.47%
116	601328	交通银行	16,790,344.00	3.36%
117	600380	健康元	16,594,053.32	3.32%
118	000988	华工科技	15,350,447.99	3.07%
119	600528	中铁二局	15,349,217.81	3.07%
120	600198	*ST 大唐	15,135,664.23	3.03%
121	002037	久联发展	14,920,121.29	2.98%
122	000785	武汉中商	14,724,769.73	2.95%
123	600469	风神股份	14,680,380.98	2.94%
124	000751	锌业股份	14,281,794.26	2.86%
125	002129	中环股份	13,598,170.25	2.72%
126	600754	锦江股份	13,315,414.39	2.66%
127	000793	华闻传媒	13,270,667.15	2.65%
128	002021	中捷股份	12,024,733.72	2.40%
129	600416	湘电股份	11,805,045.49	2.36%
130	002128	露天煤业	11,566,369.20	2.31%
131	000012	南玻 A	11,241,380.20	2.25%
132	600978	宜华木业	10,248,585.75	2.05%

累计卖出价值达到或超过基金净值 2%的股票：

序号	股票代码	股票名称	累计卖出金额	占期初净值比例
1	600867	通化东宝	92,652,005.39	18.53%
2	600028	中国石化	57,032,997.45	11.41%
3	600192	长城电工	49,726,370.68	9.95%
4	000527	美的电器	45,740,714.94	9.15%
5	600900	长江电力	44,799,986.48	8.96%
6	600118	中国卫星	42,411,677.83	8.48%
7	000858	五粮液	36,979,325.89	7.40%
8	600111	稀土高科	35,614,519.83	7.12%
9	600162	香江控股	33,034,293.19	6.61%
10	600790	轻纺城	32,425,907.35	6.49%

11	600630	龙头股份	30,912,333.24	6.18%
12	600596	新安股份	30,894,889.05	6.18%
13	000759	武汉中百	30,176,183.70	6.04%
14	600016	民生银行	29,998,609.05	6.00%
15	600636	三 爱 富	27,026,427.58	5.41%
16	600469	风神股份	26,418,415.90	5.28%
17	600009	上海机场	23,312,494.51	4.66%
18	600114	东睦股份	23,244,161.99	4.65%
19	002031	巨轮股份	22,270,142.99	4.45%
20	000970	中科三环	22,129,459.48	4.43%
21	000876	新 希 望	21,969,913.01	4.39%
22	600380	健 康 元	21,954,785.29	4.39%
23	600240	华业地产	21,761,694.92	4.35%
24	000619	海螺型材	21,300,182.79	4.26%
25	600348	国阳新能	21,276,314.62	4.26%
26	000751	锌业股份	21,187,951.33	4.24%
27	600432	吉恩镍业	20,853,396.82	4.17%
28	600327	大厦股份	20,848,076.44	4.17%
29	600655	豫园商城	20,825,194.11	4.17%
30	000792	盐湖钾肥	20,647,896.34	4.13%
31	600694	大商股份	19,980,270.22	4.00%
32	600597	光明乳业	19,815,650.80	3.96%
33	600072	江南重工	18,886,901.56	3.78%
34	000400	许继电气	17,781,562.74	3.56%
35	600198	*ST 大唐	17,620,323.91	3.52%
36	600416	湘电股份	16,929,294.89	3.39%
37	600360	华微电子	16,872,000.26	3.37%
38	600748	上实发展	16,275,036.12	3.26%
39	000839	中信国安	15,783,802.94	3.16%
40	000785	武汉中商	15,695,338.48	3.14%
41	600320	振华港机	15,340,659.39	3.07%
42	600169	太原重工	15,086,698.81	3.02%
43	000793	华闻传媒	14,873,690.43	2.97%
44	002021	中捷股份	14,707,054.90	2.94%
45	600690	青岛海尔	13,731,873.64	2.75%
46	000625	长安汽车	13,172,550.89	2.63%
47	000988	华工科技	12,419,880.64	2.48%
48	000012	南 玻 A	12,393,772.63	2.48%

49	000768	西飞国际	12,146,102.88	2.43%
50	000598	蓝星清洗	11,724,833.05	2.35%
51	600005	武钢股份	11,589,558.94	2.32%
52	600849	上海医药	11,449,780.39	2.29%
53	600586	金晶科技	11,236,188.04	2.25%
54	002037	久联发展	11,044,116.20	2.21%
55	600238	海南椰岛	10,712,762.90	2.14%
56	600978	宜华木业	10,679,765.98	2.14%
57	001696	宗申动力	10,488,302.21	2.10%
58	000822	山东海化	10,377,573.67	2.08%
59	000828	东莞控股	10,367,521.18	2.07%
60	000663	永安林业	10,095,060.79	2.02%

2、本期买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额：

2007 年 1 月 1 日-2007 年 6 月 30 日

买入股票成本总额	9,856,115,425.93
卖出股票收入总额	1,711,623,701.42

(五) 期末债券投资组合

券种	市 值 (元)	占净值比例
金融债券	100,008,600.00	0.85%
合 计	100,008,600.00	0.85%

(六) 期末前五名债券明细

序号	债券名称	市 值 (元)	占净值比例
1	06 农发 06	100,008,600.00	0.85%
2	-	-	-
3	-	-	-
4	-	-	-
5	-	-	-

(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，或受到公开谴责、处罚的。

2、基金投资的前十名股票中，无投资于超出基金合同规定备选股票库之外的股票。

3、其他资产的构成：

	市 值（元）
深交所交易保证金	1,054,619.17
应收证券清算款	21,538,590.08
应收股利	4,733,956.85
应收利息	3,104,964.17
应收申购款	144,710,397.28
合 计	175,142,527.55

4、基金持有的处于转股期的可转换债券明细：无。

5、基金主动投资权证交易情况：无。

6、本期间基金因股权分置改革而获得的权证：

序号	权证代码	权证名称	获得数量	成本
1	031003	深发 SFC1	132,000	0
2	031004	深发 SFC2	66,000	0

七. 基金份额持有人情况

期末基金份额持有人户数：521,482 户

期末平均每户持有基金份额：2.01 万份

持有人结构：

	持有基金份额	占总份额比例
机构投资者	366,654,913.74	3.49%
个人投资者	10,134,754,758.48	96.51%

八. 开放式基金份额变动

(一) 基金合同生效日基金份额总额：669,603,985.69 份。

(二) 本期基金份额变动：

	2007 年 1 月 1 日-2007 年 6 月 30 日
期初基金份额总额	414,184,470.19
本期基金总申购份额	11,097,876,716.27
本期基金拆分增加份额	853,833,772.59
本期基金总赎回份额	1,864,485,286.83
期末基金份额总额	10,501,409,672.22

九. 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) 本基金管理人在本报告期内的重大人事变动：

本报告期内，本公司股东会对于新一届董事会的董事会成员进行了重新选举，本公司原董事 Francois Petit-Jean 先生不再担任本公司第二届董事会的董事，Max Diulus 先生新任本公司第二届董事会董事。除上述变动事项之外，本基金管理人在本报告期内无其他重大人事变动事项。

本基金托管人的专门基金托管部门在本报告期内未发生重大人事变动。

(三) 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。

(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》中披露的基本投资策略，未发生显著的改变。

(五) 本基金本期未发生收益分配事项。

(六) 本基金于 2007 年 4 月 18 日实行了基金份额拆分，拆分前基金份额净值为 1.8157 元，拆分比例为 1 : 1.815664620。

(七) 本报告期内，本基金聘用德勤华永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。

(八) 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单元的情况：

本期内，基金管理人综合考虑了在各交易市场的交易量和交易单元的配置情况，增加了 2 个上海交易单元，为中金公司和中银国际的交易单元；增加了 1 个深圳交易单元，为联合证券的交易单元。期初基金租用交易单元共 5 个；期末基金租用交易单元共 8 个。本期内，各交易单元未发生债券、回购和权证交易，股票交易量和佣金如下：

证券公司名称	租用席位数量	股票交易量	占股票总交易量比	佣金	占总佣金比例
申银万国证券股份有限公司	1	3,905,626,567.54	33.89%	3,202,599.87	34.35%
海通证券股份有限公司	1	2,268,554,900.84	19.68%	1,775,161.71	19.04%
中银国际证券有限责任公司	1	1,792,477,259.81	15.55%	1,469,821.18	15.76%
光大证券股份有限公司	1	1,285,814,349.17	11.16%	1,054,364.05	11.31%
中国国际金融有限公司	1	820,312,766.58	7.12%	672,654.51	7.21%
联合证券有限责任公司	1	750,746,603.14	6.51%	587,465.46	6.30%
中国银河证券有限责任公司	1	359,640,679.64	3.12%	281,422.90	3.02%
中信建投证券股份有限公司	1	342,505,528.78	2.97%	280,856.59	3.01%

合 计	8	11,525,678,655.50	100.00%	9,324,346.27	100.00%
-----	---	-------------------	---------	--------------	---------

(十)其他重要事项:

事 项	信息披露报纸	披露日期
申万巴黎新动力股票型证券投资基金 2006 年第 4 季度 季度报告	《中国证券报》 《上海证券报》 《证券时报》	2007-01-22
关于开通新经济混合型基金及其他基金之间转换业务 的公告	《中国证券报》 《上海证券报》 《证券时报》 《证券日报》	2007-02-09
申万巴黎新动力股票型证券投资基金 2006 年年度报告 摘要	《中国证券报》 《上海证券报》 《证券时报》	2007-03-27
申万巴黎新动力股票型证券投资基金开展基金份额拆 分及限量持续营销活动的公告	《中国证券报》 《上海证券报》 《证券时报》	2007-04-13
关于对《申万巴黎新动力股票型证券投资基金基金合 同》进行修改的公告	《中国证券报》 《上海证券报》 《证券时报》	2007-04-14
申万巴黎新动力股票型证券投资基金 2007 年第 1 季度 季度报告	《中国证券报》 《上海证券报》 《证券时报》	2007-04-19
关于申万巴黎新动力股票型证券投资基金提前结束持 续销售及暂停申购与转换入业务的公告	《中国证券报》 《上海证券报》 《证券时报》	2007-04-19
关于申万巴黎新动力股票型证券投资基金基金份额拆 分比例的公告	《中国证券报》 《上海证券报》 《证券时报》	2007-04-19
关于申万巴黎新动力股票型证券投资基金持续营销限 量申购确认比例的公告	《中国证券报》 《上海证券报》 《证券时报》	2007-04-20
申万巴黎新动力股票型证券投资基金开放申购和转换 入业务公告	《中国证券报》 《上海证券报》 《证券时报》	2007-04-30
申万巴黎新动力股票型证券投资基金暂停申购及转换 转入业务公告	《中国证券报》 《上海证券报》 《证券时报》	2007-05-12
关于调整旗下基金申购份额计算方法及修改基金合同 相关条款的公告	《中国证券报》 《上海证券报》	2007-05-16

	《证券时报》	
	《证券日报》	
申万巴黎新动力股票型证券投资基金继续暂停申购及转换转入业务公告	《中国证券报》 《上海证券报》 《证券时报》	2007-05-26
申万巴黎新动力股票型证券投资基金开放申购和转换转入业务公告	《中国证券报》 《上海证券报》 《证券时报》	2007-06-05
关于在中国工商银行股份有限公司开通新动力股票基金与收益宝货币市场基金之间转换业务的公告	《中国证券报》 《上海证券报》 《证券时报》	2007-06-05
申万巴黎新动力股票型证券投资基金招募说明书（更新）摘要	《中国证券报》 《上海证券报》 《证券时报》	2007-06-23

十. 备查文件目录

备查文件：基金合同；

招募说明书及其定期更新；

发售公告；

基金合同生效公告；

开放日常交易业务公告；

定期报告；

其他临时公告。

上述备查文件中基金合同、招募说明书及其定期更新、发售公告和基金合同生效公告均放置于本基金管理人及基金托管人的住所；开放日常交易业务公告、基金定期报告和其他临时公告放置于本基金管理人的住所。上述文件均可在本基金管理人的网站进行查阅，查询网址：www.swbnpp.com。

申万巴黎基金管理有限公司

二零零七年八月二十九日