

华宝兴业动力组合股票型证券投资基金
2007 年半年度报告

基金管理人： 华宝兴业基金管理有限公司

基金托管人： 中国银行股份有限公司

送出日期： 2007年8月28日

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。

基金托管人中国银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2007 年 8 月 24 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。

报告期为 2007 年 1 月 1 日起至 2007 年 6 月 30 日止，本报告财务资料未经审计。

目 录

一、基金简介	4
(一) 基金基本资料.....	4
(二) 基金产品说明.....	4
(三) 基金管理人.....	4
(四) 基金托管人.....	5
(五) 信息披露.....	5
(六) 其他有关资料.....	5
二、主要财务指标和基金净值表现	5
(一) 主要会计数据和财务指标.....	5
(二) 基金净值表现.....	6
三、管理人报告	6
(一) 基金管理人及基金经理情况.....	6
(二) 报告期内基金运作的遵规守信情况的说明.....	7
(三) 报告期内基金投资策略和业绩表现的说明与解释.....	7
(四) 宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	7
四、托管人报告	8
五、财务会计报告	8
(一) 基金会计报表.....	8
(二) 会计报表附注.....	10
六、投资组合报告	16
(一) 报告期末基金资产组合情况.....	16
(二) 报告期末按行业分类的股票投资组合.....	16
(三) 报告期末按市值占基金资产净值比例大小排序的所有股票明细.....	17
(四) 报告期内股票投资组合的重大变动.....	18
(五) 报告期末按券种分类的债券投资组合.....	25
(六) 报告期末按市值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券明细.....	25
(七) 基金资产支持证券投资明细.....	25
(八) 投资组合报告附注.....	25
七、基金份额持有人情况	26
(一) 报告期末基金份额持有人户数.....	26
(二) 报告期末基金份额持有人结构.....	26
八、基金份额变动情况	26
九、重大事件揭示	26
十、备查文件	29

一、基金简介

(一) 基金基本资料

1、基金名称:	华宝兴业动力组合股票型证券投资基金
2、基金简称:	动力组合基金
3、交易代码:	240004
4、基金运作方式:	契约型开放式
5、基金合同生效日:	2005 年 11 月 17 日
6、报告期末基金份额总额:	1,907,997,410.26 份
7、基金合同存续期:	无
8、基金份额上市的证券交易所:	无
9、上市日期:	无

(二) 基金产品说明

1、投资目标:	通过对基金组合的动态优化管理,使基金收益持续稳定超越比较基准,并追求单位风险所获得的超额收益最大化。
2、投资策略:	本基金根据中国股市价值驱动因子与成长驱动因子的变动趋势,调整评估个股“价值因子”与“成长因子”的权重比例,自下而上精选个股,获取超额收益。 在正常的市场情况下,本基金的投资比例范围为:股票占基金资产净值的 60%—95%;债券占 0%—40%,现金或者到期日在一年内的政府债券比例在 5%以上。
3、业绩比较基准:	80%上证 180 指数收益率与深证 100 指数收益率的流通市值加权平均+20%上证国债指数收益率。
4、风险收益特征:	本基金是一只积极型的股票投资基金,属于证券投资基金中的中高风险品种。

(三) 基金管理人

1、名称:	华宝兴业基金管理有限公司
2、注册地址:	上海市世纪大道 88 号金茂大厦 48 层
3、办公地址:	上海市世纪大道 88 号金茂大厦 48 层
4、邮政编码:	200121
5、法定代表人:	郑安国
6、信息披露负责人:	刘月华
7、联系电话:	021-50499588
8、传真:	021-50499688
9、电子邮箱:	xxpl@fsfund.com

(二) 基金净值表现

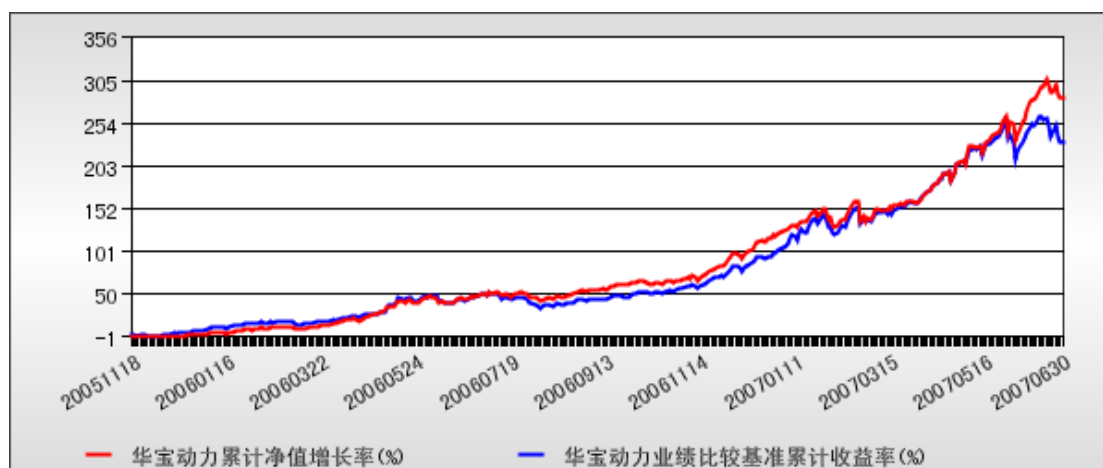
1、基金历史各时间段净值增长率与同期业绩比较基准收益率的比较列表

阶段	净值增长率 ①	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
过去一个月	7.61%	2.16%	-2.39%	2.42%	10.00%	-0.26%
过去三个月	48.06%	1.94%	27.99%	2.01%	20.07%	-0.07%
过去六个月	71.65%	1.94%	62.65%	2.01%	9.00%	-0.07%
过去一年	157.42%	1.57%	123.30%	1.62%	34.12%	-0.05%
自基金合同 生效日起至今	283.60%	1.36%	231.89%	1.43%	51.71%	-0.07%

2、基金合同生效以来基金份额净值的变动情况，并与同期业绩比较基准的变动的比较

动力组合基金累计份额净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比

(2005 年 11 月 17 日至 2007 年 6 月 30 日)



注：按基金合同规定，本基金自基金合同生效起六个月内为建仓期，截至 2006 年 3 月 31 日本基金的各项投资比例已达到基金合同第十三条（二）投资范围、（四）投资策略中规定的各项比例：股票占基金资产净值的 60%—95%；债券占 0%—40%，现金或者到期日在一年内的政府债券比例在 5%以上。

三、管理人报告

(一) 基金管理人及基金经理情况

1、基金管理人及其管理基金的经验

基金管理人是在 2003 年 3 月 7 日正式成立的合资基金管理公司，截至本报告期末（2007 年 6 月 30 日），所管理的开放式证券投资基金包括宝康系列基金、多策略增长基金、现金宝货币市场基金、本基金、收益增长基金、先进成长基金和行业精选基金，所管理的开放式证券投资基金资产净值合计 39,886,464,707.17 元。

2、基金经理情况

史伟先生，先后毕业于上海复旦大学和英国雷丁大学，分获经济学学士和经济学硕士。2001 年进入东方证券证券投资部工作，2003 年加入华宝兴业基金管理有限公司投资部，先后担任研究员、基金经理助理，2005 年 11 月起任本基金基金经理。

（二）报告期内基金运作的遵规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人遵守《中华人民共和国证券法》、《中华人民共和国证券投资基金法》及其各项实施细则、《华宝兴业动力组合开放式证券投资基金基金合同》和其他相关法律法规的规定、监管部门的相关规定，依照诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在控制投资风险的基础上，为基金份额持有人谋取最大利益，没有损害基金份额持有人利益的行为。

（三）报告期内基金投资策略和业绩表现的说明与解释

截至报告期末，本基金份额净值为 1.9245 元，本报告期份额净值增长率为 71.65%，同期业绩比较基准增长率为 62.65%。

上半年沪深 300 指数涨幅超过 80%，整体呈现震荡上涨格局，期间出现了几次剧烈的震荡，股票涨跌格局出现过大幅改变。1 月份随着多个基金进入到持续营销的高潮，基金重仓股也阶段性进入到高潮，在 1、2 月份两次震荡后基金重仓股开始弱于指数。3、4、5 月随着散户的大量入市，散户成了市场的主导力量，其相对偏好的低价股、题材股出现暴涨。5 月底受印花税政策导致的调整，颠覆了前期的疯狂局面，价值投资重新回归主流，具备业绩和估值支撑的股票再次表现良好。

本基金规模在 1 月份增长巨大，而在随后的 2、3 月份的赎回潮中又使得基金规模缩水超过一半，基金规模的巨幅变动给基金的投资管理带来了一定的压力，业绩表现一般。但是本基金坚持了一贯的价值投资理念，整个组合都是有业绩和估值支撑的股票，在 6 月份的震荡和调整中，动力组合基金净值表现相对较好，排名逐渐上升。

在经过接近 2 年的基金管理后，本基金对价值投资有着深一步的了解，并且自身形成了五好的投资理念。相信优秀企业的价值会不断提升，长期持有肯定会带来超越指数、甚至惊人的回报。五好的标准为：1、好的行业，行业增长要好，商业模式也要好；2、好的管理层，好的管理层才有望做出好的企业并持续创造企业价值；3、好的产品，能够生产好的产品往往制造出林奇的“壁龛”，使自身与其他企业从激烈竞争隔离开；4、好的机制，完善的机制更加保证股东财富的增长；5、好的竞争力，使企业在竞争中越来越领先。同时在行业配置角度也摸索出，坚持对低估值行业加大配置的操作风格。07 年上半年净值回报与排名大幅提升，与上述投资理念的运用存在密切关系。

（四）宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望下半年，国内外的宏观经济依然向好，美国经济虽有次级抵押贷款的隐忧，但经济界基本乐观。而国内经济处于高速增长之中，展现出多年来少有的增长态势且没有瓶颈产业，企业盈利增幅也非常快。但通货膨胀和人民币升值是经济的不确定因素，中央对过热的理解和宏观调控对经济和股市都可能产生显著影响。

目前的估值水平不可谓不贵，即使考虑业绩高增长，我国的 PEG 也高于印度和俄罗斯，

静态估值更是全球较高。然后从我们能看到的情况判断，股市虽然贵了，但看不到变得便宜的理由，倒是流动性等诸多因素支持资产的价格变得更贵。

本基金将继续秉承价值投资理念，对满足五好标准的企业长期投资，同时注重对低估值的行业和人民币升值相关行业加大配置。注重成长与价值的均衡投资，运用本基金所特有的量化模型，为持有人进一步创造回报。

四、托管人报告

本报告期内，中国银行股份有限公司（以下称“本托管人”）在对华宝兴业动力组合股票型证券投资基金（以下称“本基金”）的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了应尽的义务。

本报告期内，本托管人根据《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，对本基金管理人的投资运作进行了必要的监督，对基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算以及基金费用开支等方面进行了认真地复核，未发现本基金管理人存在损害基金份额持有人利益的行为。

本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、投资组合报告等内容真实、准确和完整。

五、财务会计报告

（一）基金会计报表

1、资产负债表

金额单位：人民币元

资 产	截至 2007 年 6 月 30 日	截至 2006 年 12 月 31 日
银行存款	1, 158, 678, 329. 21	184, 550, 867. 71
清算备付金	13, 490, 993. 37	1, 274, 207. 99
交易保证金	5, 916, 034. 70	316, 700. 00
应收证券清算款	0. 00	16, 743, 437. 19
应收股利	0. 00	0. 00
应收利息	252, 340. 54	45, 592. 06
应收申购款	42, 429, 844. 35	31, 250, 414. 09
其他应收款	0. 00	0. 00
股票投资市值	2, 546, 141, 374. 99	400, 013, 649. 12
其中：股票投资成本	2, 031, 170, 191. 47	371, 304, 977. 59
债券投资市值	0. 00	0. 00
其中：债券投资成本	0. 00	0. 00
权证投资	8, 942, 730. 00	10, 153, 287. 20

其中：权证投资成本	0.00	9,355,522.52
买入返售证券	0.00	0.00
待摊费用	90,739.85	226,015.84
其他资产	0.00	0.00
资产合计	3,775,942,387.01	644,574,171.20
负债与持有人权益		
应付证券清算款	71,183,688.53	17,934,671.74
应付赎回款	22,364,246.43	20,121,194.59
应付赎回费	83,440.62	2,849.33
应付管理人报酬	3,893,729.36	406,738.58
应付托管费	648,954.90	67,789.77
应付佣金	5,289,539.23	1,381,020.81
应付利息	0.00	0.00
应付收益	0.00	0.00
未交税金	0.00	0.00
其他应付款	500,000.00	500,000.00
卖出回购证券款	0.00	0.00
短期借款	0.00	0.00
预提费用	24,795.19	70,000.00
其他负债	0.00	0.00
负债合计	103,988,394.26	40,484,264.82
实收基金	1,907,997,410.26	279,510,938.29
未实现利得	570,891,888.01	31,359,125.90
未分配收益	1,193,064,694.48	293,219,842.19
持有人权益合计	3,671,953,992.75	604,089,906.38
负债及持有人权益合计	3,775,942,387.01	644,574,171.20

2、经营业绩表及收益分配表

金额单位：人民币元

项目	本期数	2006年1月1日至 2006年6月30日止期间
一、已实现基金收入	1,351,535,270.71	101,835,500.84
其中：股票差价收入	1,300,043,192.68	90,450,829.31
债券差价收入	4,173,175.84	197,223.85
权证差价收入	28,326,618.12	7,236,272.43
债券利息收入	16,008.41	351,447.02
存款利息收入	3,477,996.60	295,898.33
股利收入	8,590,818.63	2,709,103.38
买入返售证券收入	0.00	44,383.56
其他收入	6,907,460.43	550,342.96
减：基金费用	32,809,225.70	3,026,234.17
其中：基金管理人报酬	27,953,741.10	2,432,225.33
基金托管费	4,658,956.88	405,370.91

卖出回购证券支出	0.00	0.00
利息支出	0.00	0.00
其他费用	196,527.72	188,637.93
其中：上市年费	0.00	0.00
信息披露费	135,275.99	143,377.34
审计费用	24,795.19	30,978.15
二、已实现基金收益	1,318,726,045.01	98,809,266.67
加：未实现利得	494,407,477.31	20,179,503.92
三、基金经营业绩	1,813,133,522.32	118,988,770.59
本期基金净收益	1,318,726,045.01	98,809,266.67
加：期初基金净收益	293,219,842.19	228,038.84
加：本期损益平准金	-112,390,034.07	-20,604,835.43
可供分配基金净收益	1,499,555,853.13	78,432,470.08
减：本期已分配基金净收益	306,491,158.65	12,817,197.30
期末基金净收益	1,193,064,694.48	65,615,272.78

3、基金净值变动表

金额单位：人民币元

项目	本期数	2006 年 1 月 1 日至 2006 年 6 月 30 日止期间
一、期初基金净值	604,089,906.38	434,239,607.34
二、本期经营活动		
基金净收益	1,318,726,045.01	98,809,266.67
未实现利得	494,407,477.31	20,179,503.92
经营活动产生的基金净值变动数	1,813,133,522.32	118,988,770.59
三、本期基金单位交易		
基金申购款	7,087,162,207.13	147,316,359.19
基金赎回款	-5,525,940,484.43	-440,274,201.20
基金单位交易产生的基金净值变动数	1,561,221,722.7	-292,957,842.01
四、本期向持有人分配收益		
向基金持有人分配收益产生金净值变动数	306,491,158.65	12,817,197.30
五、期末基金净值	3,671,953,992.75	247,453,338.62

(二) 会计报表附注

1. 基金简介

“华宝兴业动力组合股票型证券投资基金”（以下简称“本基金”）由基金发起人华宝兴业基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》及其配套法规等有关规定和《华宝兴业动力组合股票型证券投资基金基金合同》发起，经中国证监会证监基金字【2005】162号文批准，于2005年11月17日募集成立。本基金为契约型开放式运作方式，永久存续，首次设立募集规模为535,410,310.23份基金份额，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167、168、169号验资报告予以验证。基金管理人为华宝兴业基金管理有限公司，基金托管人为中国银行股份有限公司。

2. 本报告期会计报表所采用的会计政策、会计估计与上年度会计报表一致。

3. 报告期内，本基金无重大会计差错。

4. 重大关联方关系及关联交易

(1) 关联方关系

关联方名称	与本基金的关系
华宝兴业基金管理有限公司	基金发起人、基金管理人、基金注册登记人、基金销售机构
中国银行股份有限公司(“中国银行”)	基金托管人、基金代销机构
华宝信托投资有限责任公司(“华宝信托”)	基金管理人的股东
法国兴业资产管理有限公司 (Société Générale Asset Management SA)	基金管理人的股东
上海宝钢集团公司(“宝钢集团”)	基金管理人的股东的母公司

(2) 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. 基金管理人报酬

支付基金管理人华宝兴业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。

本基金在本会计期间需支付基金管理人报酬 27,953,741.10 元。(去年同期的管理人报酬为 2,432,225.33 元)

b. 基金托管费

支付基金托管人中国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。

本基金在本会计期间需支付基金托管费 4,658,956.88 元。(去年同期的托管费为 405,370.91 元)

c. 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 日保管的银行存款余额为 1,158,678,329.21 元。本会计期间由基金托管人保管的银行存款产生的利息收入为 3,303,266.04 元。基金托管人于 2006 年 6 月 30 日保管的银行存款余额为 51,798,477.23 元，由基金托管人保管的银行存款产生的利息收入为 284,121.28 元。

d. 与关联方通过银行间同业市场进行的债券交易(含回购)

本基金在本会计期间与基金托管人中国银行通过银行间同业市场进行的债券交易如下：

金额单位：人民币元

	2007 年 1 月 1 日 至 2007 年 6 月 30 日止期间	2006 年 1 月 1 日 至 2006 年 6 月 30 日止期间
买入债券结算金额	0.00	0.00
卖出回购证券协议金额	0.00	0.00
卖出回购证券利息支出	0.00	0.00

e. 关联方持有的基金份额

基金管理人的关联方在本报告期内未对本基金进行投资，去年同期也未对本基金进行投资。

f. 基金管理人持有的基金份额

基金管理人在本报告期内未对本基金进行投资。

g. 基金管理人工投资基金份额

本报告期末基金管理人工持有本基金共计 47,382.36 份，占本基金总份额的 0.0025%。

5. 基金会计报表重要项目说明

(1) 交易保证金

金额单位：人民币元

	2007 年 6 月 30 日
深圳结算保证金	5,849,334.70
权证交易保证金	66,700.00
合计	5,916,034.70

(2) 应收利息

金额单位：人民币元

	2007 年 6 月 30 日
应收银行存款利息	244,925.46
应收清算备付金利息	7,385.08
应收权证保证金利息	30.00
应收债券利息	0.00
应收买入反售证券利息	0.00
合计	252,340.54

(3) 待摊费用

金额单位：人民币元

	2007 年 6 月 30 日
上证报信息披露费	50,411.43
中证报信息披露费	40,328.42
证券时报信息披露费	0.00
合计	90,739.85

(4) 投资估值增值

金额单位：人民币元

	2007 年 6 月 30 日
股票估值增值	514,971,183.52
权证估值增值	8,942,730.00
合计	523,913,913.52

(5) 应付佣金

金额单位：人民币元

	2007 年 6 月 30 日
申银万国	2,994,367.10
招商证券	1,615,647.03
长江证券	679,525.10
合计	5,289,539.23

(6) 其他应付款

金额单位：人民币元

	2007 年 6 月 30 日
券商	500,000.00
合计	500,000.00

(7) 预提费用

金额单位：人民币元

	2007 年 6 月 30 日
注册登记费	0.00
审计费	24,795.19
律师费	0.00
信息披露费	0.00
合计	24,795.19

(8) 实收基金

金额单位：人民币元

	基金份额(份)	金额
2006 年 12 月 31 日	279,510,938.29	279,510,938.29
本期申购	5,749,685,582.09	5,749,685,582.09
其中：红利转再投资	148,373,130.94	148,373,130.94
本期赎回	4,121,199,110.12	4,121,199,110.12
2007 年 6 月 30 日	1,907,997,410.26	1,907,997,410.26

(9) 未实现利得

金额单位：人民币元

	未实现估值增值	未实现利得平准金	未实现利得权证	合计
2006 年 12 月 31 日	28,708,671.53	1,852,689.69	797,764.68	31,359,125.90
本期净变动数	486,262,511.99	45,125,284.80	8,144,965.32	539,532,762.11

本期申购基金份额	0.00	854,871,615.73	0.00	854,871,615.73
其中：分红转再投资	0.00	16,321,526.64	0.00	16,321,526.64
本期赎回基金份额	0.00	809,746,330.93	0.00	809,746,330.93
2007年6月30日	514,971,183.52	46,977,974.49	8,942,730.00	570,891,888.01

未实现估值增值按投资类别分项列示如下：

金额单位：人民币元

	2007年6月30日
股票投资	514,971,183.52
债券投资	0.00
权证投资	0.00

(10) 股票差价收入

金额单位：人民币元

	2007年1月1日 至2007年6月30日止期间
卖出股票成交总额	8,227,953,097.98
减：应付佣金总额	6,902,437.38
减：卖出股票成本总额	6,921,007,467.92
股票差价收入	1,300,043,192.68

本基金于本报告期获得股权分置改革中由非流通股股东支付的现金对价：3,867.89元。

(11) 债券差价收入

金额单位：人民币元

	2007年1月1日至2007年6月30日止期间
卖出债券结算金额	19,869,184.25
减：应收利息总额	16,008.41
减：卖出债券成本总额	15,680,000.00
减：银行间债券交易费用	0.00
债券差价收入	4,173,175.84

(12) 权证差价收入

金额单位：人民币元

	2007年1月1日至2007年6月30日止期间
卖出权证成交金额	153,196,571.09
减：卖出权证成本总额	124,869,952.97
权证差价收入	28,326,618.12

(13) 其他收入

金额单位：人民币元

	2007年1月1日至2007年6月30日止期间
赎回基金补偿收入(a)	6,730,527.48
转换基金补偿收入(b)	176,932.95

其他	0.00
合计	6,907,460.43

根据《华宝兴业动力组合股票型证券投资基金基金合同》的规定，从基金赎回总额中扣除的赎回费及从基金转换总额中扣除的转换费分别按 50%和 25%的比例计入被赎回或被转出的基金的资产。

(14) 其他费用

金额单位：人民币元

2007 年 1 月 1 日至 2007 年 6 月 30 日止期间	
注册登记费	0.00
上市年费	0.00
银行费用	27,456.54
信息披露费	135,275.99
审计费用	24,795.19
债券帐户维护费	9,000.00
银行间回购交易费用	0.00
律师费	0.00
合计	196,527.72

(15) 收益分配

基金管理人于 2007 年 1 月 5 日发布公告，向截至 2007 年 1 月 4 日止在本基金注册登记人华宝兴业基金管理有限公司登记在册的全体份额持有人，按每 10 份基金单位 10.40 元派发现金红利。该分红的发放日为 2007 年 1 月 5 日，共发放红利 306,491,158.65 元，其中以现金形式发放 137,776,050.64 元，以红利再投资形式发放 168,715,108.01 元。

(16) 银行存款

金额单位：人民币元

2007 年 6 月 30 日	
活期存款	1,158,678,329.21
定期存款	0.00

6. 流通受限制不能自由转让的基金资产

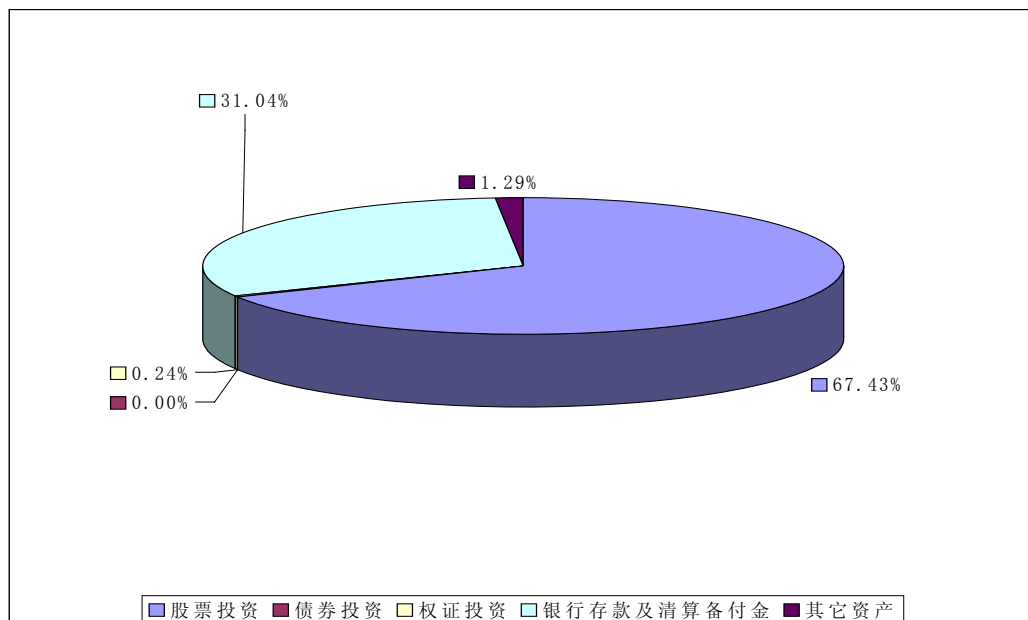
基金可使用以基金名义开设的股票账户，比照个人投资者和一般法人、战略投资者参与新股认购。其中基金作为一般法人或战略投资者认购的新股，根据基金与上市公司所签订申购协议的规定，在新股上市后的约定期限内不能自由转让；基金作为个人投资者参与网上认购获配的新股或增发新股，从新股获配日至新股上市日之间不能自由转让。

股票代码	股票名称	成功申购日期	可流通日期	申购价格(元)	期末估值单价(元)	数量(股)	年末成本总额(元)	年末估值总额(元)
601328	交通银行	07/04/27	07/07/27	7.90	10.99	215,808	1,704,883.20	2,371,729.92
601919	中国远洋	07/06/20	07/09/20	8.48	18.26	224,700	1,905,456.00	4,103,022.00
002124	天邦股份	07/03/21	07/06/21	10.25	20.88	26,954	276,278.50	562,799.52
002136	安纳达	07/05/23	07/08/23	8.08	22.81	14,784	119,454.72	337,223.04
合计							3,971,211.74	6,051,293.92

六、投资组合报告

(一) 报告期末基金资产组合情况

项目	金额 (元)	占总资产比例
股票	2,546,141,374.99	67.43%
债券	0.00	0.00%
权证	8,942,730.00	0.24%
银行存款和清算备付金合计	1,172,169,322.58	31.04%
资产支持证券	0.00	0.00%
其他资产	48,688,959.44	1.29%
合计	3,775,942,387.01	100.00%



(二) 报告期末按行业分类的股票投资组合

序号	行业分类	市值 (元)	市值占基金资产净值比例
1	A 农、林、牧、渔业	0.00	0.00%
2	B 采掘业	126,613,000.00	3.45%
3	C 制造业	1,297,448,272.31	35.33%
	其中: C0 食品、饮料	220,569,692.88	6.01%
	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	0.00	0.00%
	C4 石油、化学、塑胶、塑料	264,420,023.04	7.20%
	C5 电子	30,579,410.97	0.83%
	C6 金属、非金属	207,280,167.93	5.64%
	C7 机械、设备、仪表	528,302,588.85	14.39%
	C8 医药、生物制品	46,296,388.64	1.26%
	C99 其他制造业	0.00	0.00%
4	D 电力、煤气及水的生产和供应业	116,573,627.52	3.17%
5	E 建筑业	0.00	0.00%
6	F 交通运输、仓储业	79,097,432.74	2.15%
7	G 信息技术业	104,130,500.00	2.84%
8	H 批发和零售贸易	70,587,718.51	1.92%
9	I 金融、保险业	568,631,075.45	15.49%
10	J 房地产业	112,051,355.50	3.05%
11	K 社会服务业	53,730,000.00	1.46%
12	L 传播与文化产业	0.00	0.00%
13	M 综合类	17,278,392.96	0.47%
	合计	2,546,141,374.99	69.34%

(三) 报告期末按市值占基金资产净值比例大小排序的所有股票明细

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	期末市值(元)	市值占基金资产净值比例
1	600309	烟台万华	4,350,000	232,986,000.00	6.35%
2	000568	泸州老窖	4,300,000	181,030,000.00	4.93%
3	600879	火箭股份	5,850,000	155,551,500.00	4.24%
4	600000	浦发银行	4,200,000	153,678,000.00	4.19%
5	600219	南山铝业	5,999,990	136,139,773.10	3.71%
6	601318	中国平安	1,800,000	128,718,000.00	3.51%
7	600900	长江电力	7,709,896	116,573,627.52	3.17%
8	000024	招商地产	2,282,105	112,051,355.50	3.05%
9	600104	上海汽车	6,000,000	103,620,000.00	2.82%
10	600016	民生银行	8,000,000	91,440,000.00	2.49%
11	601699	潞安环能	2,200,000	89,914,000.00	2.45%
12	000063	中兴通讯	1,600,000	87,040,000.00	2.37%
13	000001	深发展A	3,000,000	82,560,000.00	2.25%
14	601398	工商银行	13,999,858	70,139,288.58	1.91%
15	000338	潍柴动力	750,000	58,875,000.00	1.60%
16	600153	建发股份	2,999,887	57,267,842.83	1.56%
17	000069	华侨城A	1,350,000	53,730,000.00	1.46%
18	600877	中国嘉陵	6,509,879	46,480,536.06	1.27%
19	601006	大秦铁路	2,799,950	42,391,243.00	1.15%

20	600030	中信证券	749,935	39,724,056.95	1.08%
21	000983	西山煤电	1,300,000	36,699,000.00	1.00%
22	600519	贵州茅台	300,000	35,904,000.00	0.98%
23	000625	长安汽车	2,000,000	32,960,000.00	0.90%
24	600029	南方航空	3,799,903	32,603,167.74	0.89%
25	600596	新安股份	720,000	31,096,800.00	0.85%
26	600282	南钢股份	2,299,900	30,680,666.00	0.84%
27	002009	天奇股份	1,600,000	30,192,000.00	0.82%
28	600584	长电科技	2,549,907	29,859,410.97	0.81%
29	600031	三一重工	649,955	28,747,509.65	0.78%
30	000970	中科三环	1,999,977	23,579,728.83	0.64%
31	000157	中联重科	600,000	23,100,000.00	0.63%
32	600479	千金药业	997,946	22,952,758.00	0.63%
33	600129	太极集团	1,299,988	22,398,793.24	0.61%
34	600312	平高电气	800,000	18,232,000.00	0.50%
35	600895	张江高科	999,907	17,278,392.96	0.47%
36	600786	东方锅炉	273,250	17,209,285.00	0.47%
37	600588	用友软件	350,000	17,090,500.00	0.47%
38	600569	安阳钢铁	2,000,000	16,880,000.00	0.46%
39	600280	南京中商	749,993	13,319,875.68	0.36%
40	000400	许继电气	899,967	12,077,557.14	0.33%
41	601919	中国远洋	224,700	4,103,022.00	0.11%
42	000869	张裕A	49,982	3,072,893.36	0.08%
43	601328	交通银行	215,808	2,371,729.92	0.06%
44	002123	荣信股份	15,147	1,257,201.00	0.03%
45	000790	华神集团	54,301	944,837.40	0.03%
46	002139	N 拓邦	12,000	720,000.00	0.02%
47	002124	天邦股份	26,954	562,799.52	0.02%
48	002136	安纳达	14,784	337,223.04	0.01%

(四) 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	累计买入金额(元)	占期初 基金资产净值的比例
1	600016	民生银行	260,363,995.52	43.10%
2	600036	招商银行	260,302,046.07	43.09%
3	600028	中国石化	212,939,745.41	35.25%
4	600309	烟台万华	211,682,821.76	35.04%
5	600000	浦发银行	201,620,105.74	33.38%
6	600030	中信证券	189,676,465.74	31.40%

7	000568	泸州老窖	171,979,567.16	28.47%
8	000983	西山煤电	165,861,294.91	27.46%
9	601318	中国平安	160,808,205.02	26.62%
10	000024	招商地产	157,931,449.53	26.14%
11	000898	鞍钢股份	153,004,838.68	25.33%
12	000858	五粮液	150,596,635.35	24.93%
13	000063	中兴通讯	143,481,676.12	23.75%
14	600219	南山铝业	140,427,258.48	23.25%
15	000039	中集集团	136,460,276.05	22.59%
16	600900	长江电力	134,874,657.58	22.33%
17	600879	火箭股份	132,837,724.84	21.99%
18	600415	小商品城	127,913,771.94	21.17%
19	000402	金融街	116,392,341.82	19.27%
20	600895	张江高科	115,057,424.07	19.05%
21	600153	建发股份	114,032,683.32	18.88%
22	601699	潞安环能	113,179,414.67	18.74%
23	600104	上海汽车	112,767,983.28	18.67%
24	601006	大秦铁路	108,194,957.81	17.91%
25	600009	上海机场	106,242,901.55	17.59%
26	600519	贵州茅台	102,537,772.39	16.97%
27	600005	武钢股份	101,396,027.08	16.78%
28	000970	中科三环	98,269,979.79	16.27%
29	000001	深发展A	98,165,131.22	16.25%
30	600877	中国嘉陵	96,992,017.16	16.06%
31	601628	中国人寿	96,862,248.04	16.03%
32	000157	中联重科	95,278,442.97	15.77%
33	000709	唐钢股份	92,690,231.69	15.34%
34	600269	赣粤高速	91,570,897.48	15.16%
35	000792	盐湖钾肥	87,490,328.24	14.48%
36	600312	平高电气	86,347,771.45	14.29%
37	000002	万科A	85,857,212.51	14.21%
38	601398	工商银行	82,444,752.49	13.65%
39	000069	华侨城A	79,899,566.03	13.23%
40	600456	宝钛股份	77,579,346.95	12.84%
41	600150	中国船舶	77,478,137.28	12.83%
42	600282	南钢股份	75,775,314.95	12.54%
43	600717	天津港	72,475,859.71	12.00%
44	600331	宏达股份	71,124,961.25	11.77%
45	600500	中化国际	70,533,859.51	11.68%
46	600096	云天化	68,167,281.33	11.28%
47	000338	潍柴动力	66,379,174.64	10.99%

48	600677	航天通信	65,945,960.66	10.92%
49	600886	国投电力	63,974,769.69	10.59%
50	600423	柳化股份	63,755,650.07	10.55%
51	600660	福耀玻璃	62,226,728.16	10.30%
52	600835	上海机电	61,505,782.38	10.18%
53	002069	獐子岛	61,257,226.13	10.14%
54	600100	同方股份	60,616,593.19	10.03%
55	600350	山东高速	57,876,379.07	9.58%
56	601166	兴业银行	56,985,691.56	9.43%
57	600408	安泰集团	56,776,134.60	9.40%
58	600011	华能国际	53,420,496.18	8.84%
59	002078	太阳纸业	52,455,950.94	8.68%
60	600616	第一食品	52,427,778.16	8.68%
61	600596	新安股份	51,071,459.98	8.45%
62	002106	莱宝高科	50,311,756.33	8.33%
63	000088	盐田港	49,594,639.77	8.21%
64	600584	长电科技	47,909,904.78	7.93%
65	002009	天奇股份	47,481,332.10	7.86%
66	600050	中国联通	45,298,874.08	7.50%
67	000807	云铝股份	44,444,290.20	7.36%
68	000823	超声电子	44,368,685.36	7.34%
69	600511	国药股份	43,773,659.85	7.25%
70	600970	中材国际	43,440,979.22	7.19%
71	600426	华鲁恒升	42,780,128.69	7.08%
72	000937	金牛能源	40,334,940.48	6.68%
73	600129	太极集团	39,784,224.60	6.59%
74	600296	S 兰铝	39,319,058.20	6.51%
75	002032	苏泊尔	38,550,499.89	6.38%
76	000625	长安汽车	37,323,954.77	6.18%
77	600031	三一重工	36,965,515.37	6.12%
78	600479	千金药业	36,585,210.48	6.06%
79	600048	保利地产	35,106,874.79	5.81%
80	002008	大族激光	34,679,991.98	5.74%
81	600588	用友软件	34,067,775.92	5.64%
82	600410	华胜天成	33,932,469.36	5.62%
83	600029	南方航空	33,421,280.69	5.53%
84	000790	华神集团	32,637,471.77	5.40%
85	600132	重庆啤酒	31,206,102.51	5.17%
86	600495	晋西车轴	30,731,790.45	5.09%
87	002084	海鸥卫浴	30,454,185.72	5.04%
88	600004	白云机场	29,532,286.74	4.89%

89	000410	沈阳机床	29,113,851.93	4.82%
90	600428	中远航运	29,086,942.12	4.82%
91	600859	王府井	28,479,724.99	4.71%
92	600352	浙江龙盛	27,608,936.84	4.57%
93	002031	巨轮股份	26,947,918.82	4.46%
94	002028	思源电气	26,866,318.73	4.45%
95	600489	中金黄金	26,807,729.22	4.44%
96	000759	武汉中百	26,759,681.71	4.43%
97	000559	万向钱潮	26,538,615.04	4.39%
98	000811	烟台冰轮	26,313,134.17	4.36%
99	600675	中华企业	26,070,121.06	4.32%
100	000528	柳工	26,030,416.64	4.31%
101	600525	长园新材	25,762,180.19	4.26%
102	600205	S 山东铝	25,730,195.50	4.26%
103	600694	大商股份	25,453,937.64	4.21%
104	600655	豫园商城	24,100,357.97	3.99%
105	000623	吉林敖东	19,880,400.98	3.29%
106	600636	三爱富	18,694,178.02	3.09%
107	600528	中铁二局	18,190,116.49	3.01%
108	600786	东方锅炉	18,032,822.04	2.99%
109	600973	宝胜股份	17,574,399.82	2.91%
110	600280	南京中商	16,407,635.67	2.72%
111	000837	秦川发展	16,167,146.67	2.68%
112	600240	华业地产	15,626,481.76	2.59%
113	000400	许继电气	15,483,007.96	2.56%
114	600582	天地科技	15,276,320.75	2.53%
115	600085	同仁堂	15,163,457.77	2.51%
116	600569	安阳钢铁	14,946,154.81	2.47%
117	600122	宏图高科	14,845,771.03	2.46%
118	600888	新疆众和	14,701,625.10	2.43%
119	000014	沙河股份	14,600,316.72	2.42%
120	600685	广船国际	14,447,198.94	2.39%
121	600533	栖霞建设	13,937,730.87	2.31%
122	000927	一汽夏利	13,443,237.87	2.23%
123	600820	隧道股份	12,670,112.31	2.10%
124	600316	洪都航空	12,611,681.50	2.09%

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	累计卖出金额（元）	占期初 基金资产净值的比例
1	600036	招商银行	324,229,661.75	53.67%
2	600016	民生银行	258,029,392.04	42.71%

3	600028	中国石化	248,662,535.31	41.16%
4	600030	中信证券	191,418,449.62	31.69%
5	000039	中集集团	181,206,871.37	30.00%
6	000402	金融街	174,643,781.57	28.91%
7	000898	鞍钢股份	164,641,051.23	27.25%
8	601600	中国铝业	154,221,251.05	25.53%
9	000983	西山煤电	150,453,366.53	24.91%
10	600309	烟台万华	148,081,623.22	24.51%
11	600895	张江高科	146,313,118.59	24.22%
12	000858	五粮液	144,289,803.65	23.89%
13	600150	中国船舶	132,910,737.58	22.00%
14	600415	小商品城	131,259,876.74	21.73%
15	000792	盐湖钾肥	130,584,694.57	21.62%
16	600000	浦发银行	124,557,180.23	20.62%
17	600005	武钢股份	122,205,387.29	20.23%
18	600009	上海机场	117,131,996.35	19.39%
19	000709	唐钢股份	108,889,566.84	18.03%
20	601318	中国平安	107,089,123.46	17.73%
21	000970	中科三环	105,427,215.01	17.45%
22	601628	中国人寿	102,270,934.29	16.93%
23	000069	华侨城 A	100,819,252.04	16.69%
24	000157	中联重科	97,828,097.98	16.19%
25	600717	天津港	97,684,941.24	16.17%
26	600423	柳化股份	94,747,921.39	15.68%
27	000002	万科 A	94,668,870.52	15.67%
28	000024	招商地产	92,763,355.80	15.36%
29	600677	航天通信	91,519,400.19	15.15%
30	600269	赣粤高速	91,519,265.73	15.15%
31	600456	宝钛股份	88,445,192.94	14.64%
32	600096	云天化	88,360,999.74	14.63%
33	600153	建发股份	85,172,820.34	14.10%
34	600500	中化国际	84,372,163.36	13.97%
35	000063	中兴通讯	84,142,645.63	13.93%
36	600519	贵州茅台	82,438,802.92	13.65%
37	600312	平高电气	81,544,132.30	13.50%
38	600331	宏达股份	80,060,138.34	13.25%
39	601006	大秦铁路	77,901,171.60	12.90%
40	600877	中国嘉陵	77,506,934.44	12.83%
41	600100	同方股份	76,083,825.04	12.59%
42	600886	国投电力	73,885,206.02	12.23%

43	601699	潞安环能	73,676,271.42	12.20%
44	000568	泸州老窖	73,050,837.46	12.09%
45	600900	长江电力	70,728,728.90	11.71%
46	600660	福耀玻璃	70,033,386.91	11.59%
47	600835	上海机电	67,742,045.31	11.21%
48	601166	兴业银行	67,081,647.80	11.10%
49	600350	山东高速	63,424,351.72	10.50%
50	600408	安泰集团	63,230,051.02	10.47%
51	002078	太阳纸业	62,868,913.32	10.41%
52	002069	獐子岛	62,020,210.35	10.27%
53	600616	第一食品	60,956,665.49	10.09%
54	600048	保利地产	59,573,435.61	9.86%
55	000823	超声电子	53,610,929.91	8.87%
56	000001	深发展A	53,401,210.21	8.84%
57	600011	华能国际	53,239,439.42	8.81%
58	600410	华胜天成	52,203,171.23	8.64%
59	000807	云铝股份	52,115,771.55	8.63%
60	000937	金牛能源	51,539,382.89	8.53%
61	600970	中材国际	49,897,452.22	8.26%
62	600879	火箭股份	48,382,891.48	8.01%
63	002106	莱宝高科	46,277,804.76	7.66%
64	000088	盐田港	45,836,024.50	7.59%
65	600050	中国联通	45,745,004.50	7.57%
66	600694	大商股份	45,370,451.36	7.51%
67	600511	国药股份	44,692,180.80	7.40%
68	000811	烟台冰轮	44,534,434.72	7.37%
69	002032	苏泊尔	43,809,541.64	7.25%
70	600426	华鲁恒升	43,101,739.56	7.13%
71	002008	大族激光	41,789,022.93	6.92%
72	600219	南山铝业	40,304,798.01	6.67%
73	000559	万向钱潮	40,116,254.71	6.64%
74	600479	千金药业	39,578,260.02	6.55%
75	000759	武汉中百	39,424,113.19	6.53%
76	000410	沈阳机床	38,098,341.55	6.31%
77	000790	华神集团	36,815,722.46	6.09%
78	600859	王府井	35,812,338.32	5.93%
79	600282	南钢股份	33,971,119.92	5.62%
80	002028	思源电气	33,940,224.13	5.62%
81	002084	海鸥卫浴	33,585,545.34	5.56%
82	600675	中华企业	32,771,049.63	5.42%

83	600525	长园新材	32,558,985.65	5.39%
84	600004	白云机场	31,884,298.77	5.28%
85	600428	中远航运	31,228,556.24	5.17%
86	600495	晋西车轴	31,011,402.85	5.13%
87	600132	重庆啤酒	30,855,801.66	5.11%
88	600489	中金黄金	30,515,421.05	5.05%
89	600031	三一重工	30,397,809.08	5.03%
90	600352	浙江龙盛	29,722,273.69	4.92%
91	000528	柳工	29,210,113.07	4.84%
92	002031	巨轮股份	28,132,312.84	4.66%
93	600655	豫园商城	25,023,580.31	4.14%
94	000338	潍柴动力	24,534,330.36	4.06%
95	600528	中铁二局	24,035,552.58	3.98%
96	600596	新安股份	22,531,042.67	3.73%
97	600104	上海汽车	21,941,273.28	3.63%
98	600129	太极集团	21,605,980.70	3.58%
99	002009	天奇股份	20,838,571.26	3.45%
100	000623	吉林敖东	20,514,958.92	3.40%
101	600184	新华光	20,154,033.04	3.34%
102	600588	用友软件	20,137,640.40	3.33%
103	600240	华业地产	19,432,752.22	3.22%
104	600636	三爱富	18,642,878.79	3.09%
105	600973	宝胜股份	18,128,988.20	3.00%
106	600583	海油工程	17,270,456.86	2.86%
107	000837	秦川发展	16,903,129.76	2.80%
108	600122	宏图高科	16,681,006.70	2.76%
109	600582	天地科技	16,636,863.60	2.75%
110	600685	广船国际	16,328,545.63	2.70%
111	600887	伊利股份	16,270,374.76	2.69%
112	000927	一汽夏利	16,263,132.91	2.69%
113	600584	长电科技	16,025,820.54	2.65%
114	000014	沙河股份	15,857,448.03	2.63%
115	600085	同仁堂	15,614,108.98	2.58%
116	600888	新疆众和	14,828,782.73	2.45%
117	600533	栖霞建设	14,684,766.08	2.43%
118	600820	隧道股份	14,487,595.40	2.40%
119	601398	工商银行	14,041,766.00	2.32%
120	600316	洪都航空	13,684,436.59	2.27%
121	600858	银座股份	13,089,942.21	2.17%

3、报告期内买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

金额单位：人民币元

买入股票成本总额	卖出股票收入总额
8,580,876,549.69	8,227,953,097.98

(五) 报告期末按券种分类的债券投资组合

本报告期末本基金债券投资市值为 0.00 元。

(六) 报告期末按市值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券明细

本报告期末本基金债券投资市值为 0.00 元。

(七) 基金资产支持证券投资明细

本基金本报告期内未发生资产支持证券投资，特此报告。

(八) 投资组合报告附注

1、报告期内本基金投资的前十名证券的发行主体没有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、本基金根据中国股市价值驱动因子与成长驱动因子的变动趋势，调整评估个股“价值因子”与“成长因子”的权重比例，自下而上精选个股，没有特定的股票备选库。

3、基金其他资产的构成

项目	金额（元）
交易保证金	5,916,034.70
应收利息	252,340.54
应收申购款	42,429,844.35
待摊费用	90,739.85
合计	48,688,959.44

4、本基金在本报告期内未持有在转股期内的可转换债券。

5、本基金在本报告期内获得的权证明细如下：

(1) 股权分置改革被动持有：

权证代码	权证名称	数量（份）	成本（元）
031003	深发 SFC1	380,000.00	0.00
031004	深发 SFC2	190,000.00	0.00
总计		570,000.00	0.00

(2) 因认购分离交易的可转换公司债券持有：

权证代码	权证名称	数量（份）	成本（元）
580012	云化 CWB1	193,158.00	0.00

(3) 主动投资：

权证代码	权证名称	数量（份）	成本（元）
031001	侨城 HQC1	3,903,851.00	47,417,760.88

580005	万华 HXB1	818,250.00	19,577,965.90
030002	五粮 YGC1	3,829,738.00	77,446,210.43

七、基金份额持有人情况

(一) 报告期末基金份额持有人户数

报告期末基金份额持有人户数 (户)	74,312
报告期末平均每户持有的基金份额 (份)	25,675.50

(二) 报告期末基金份额持有人结构

项目	数量 (份)	占总份额的比例
基金份额总额:	1,907,997,410.26	100%
其中: 机构投资者持有的基金份额	116,186,219.85	6.09%
个人投资者持有的基金份额	1,791,811,190.41	93.91%

八、基金份额变动情况

本基金份额变动情况如下:

单位: 份

基金合同生效日的基金份额总额	535,410,310.23
本报告期期初基金份额总额	279,510,938.29
本报告期间总申购份额	5,749,685,582.09
本报告期间总赎回份额	4,121,199,110.12
本报告期末基金份额总额	1,907,997,410.26

九、重大事件揭示

- 1、报告期内本基金未召开基金份额持有人大会。
- 2、报告期内本基金管理人、基金托管人的基金托管部门未发生重大人事变动。
- 3、报告期内无涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。
- 4、报告期内本基金投资策略未发生改变。
- 5、本系列基金在本报告期内进行了一次收益分配:

基金管理人按照 2007 年 1 月 4 日基金权益登记情况,将基金可分配收益向本基金基金份额持有人按每 10 份基金单位派发红利 10.40 元。

基金管理人已于 2007 年 1 月 5 日在《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》发布

于此收益分配事项公告。

- 6、 本基金未变更负责审计的会计师事务所。
- 7、 本基金管理人、托管人及其高级管理人员未出现受监管部门稽查或处罚的情形。
- 8、 基金租用交易席位情况

报告期内，本基金共租用兴业证券、光大证券、申银万国 3 个交易专用席位。各券商专用席位交易和佣金情况如下：

(1) 本基金 2007 年上半年股票交易量和实付佣金情况如下：

序号	券商名称	股票交易量（元）	占总交易量比例	佣金（元）	占佣金总量比例
1	兴业证券	2,153,757,980.61	12.87%	1,766,077.75	13.06%
2	光大证券	1,976,322,594.89	11.81%	1,546,483.36	11.44%
3	申万证券	6,421,989,667.41	38.36%	5,266,010.6	38.94%
4	招商证券	3,501,445,582.89	20.92%	2,739,902.91	20.26%
5	长江证券	2,687,534,088.87	16.05%	2,203,764.91	16.30%
合计		16,741,049,914.67	100.00%	13,522,239.53	100.00%

(2) 本基金 2007 年上半年债券和国债回购交易量情况如下：

序号	券商代码	债券交易量（元）	占交易量比例	回购交易量（元）	占交易量比例
1	招商证券	17,066,498.81	85.89%	0.00	0.00%
2	长江证券	2,803,679.00	14.11%	0.00	0.00%
合计		19,870,177.81	100.00%	0.00	0.00%

(3) 本基金 2007 年上半年权证交易量情况如下：

序号	券商名称	权证交易量（元）	占总交易量比例
1	光大证券	91,021,520.57	30.79%
2	申万证券	15,442,730.26	5.22%
3	招商证券	179,756,245.06	60.80%
4	长江证券	9,423,149.63	3.19%
合计		295,643,645.52	100.00%

9、 根据基金管理人与中信金通证券有限责任公司签署的《证券投资基金销售代理协议》，中信金通证券自 2007 年 1 月 19 日起代理销售基金管理人管理的宝康系列基金（宝康消费品基金、宝康灵活配置基金和宝康债券基金）、多策略增长基金、现金宝货币市场基金、本基金、收益增长基金和先进成长基金。

基金管理人已于 2007 年 1 月 19 日在《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》发布了此事项公告。

- 10、 因建设银行系统调整，基金管理人直销专户的联行号于 2007 年 3 月 7 日进行更改。

基金管理人已于 2007 年 3 月 8 日在《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》发布了此事项公告。

11、根据基金管理人与国信证券有限责任公司签署的《证券投资基金销售代理协议》，国信证券自 2007 年 4 月 24 日起代理销售基金管理人所管理的宝康系列基金（宝康消费品基金、宝康灵活配置基金和宝康债券基金）、多策略增长基金、现金宝货币市场基金、本基金、收益增长基金和先进成长基金。

基金管理人已于 2007 年 4 月 24 日在《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》发布了此事项公告。

12、为满足广大投资者的理财需求，经中国建设银行股份有限公司同意，基金管理人从 2007 年 4 月 26 日起，通过建设银行开办收益增长基金、本基金和先进成长基金的定期定额投资业务。

基金管理人已于 2007 年 4 月 25 日在《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》发布了此事项公告。

13、为满足广大投资者的理财需求，经中国银行股份有限公司同意，基金管理人从 2007 年 4 月 27 日起，通过中国银行开办本基金和先进成长基金的定期定额投资业务。

基金管理人已于 2007 年 4 月 26 日在《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》发布了此事项公告。

14、根据中国证券监督管理委员会基金部通知[2007]10 号《关于统一规范证券投资基金认(申)购费用及认(申)购份额计算方法有关问题的通知》要求，自 2007 年 6 月 1 日起，基金管理人所管理的本基金和先进成长基金的有效申购申请的申购费用及申购份额的计算统一采用外扣法。

基金管理人已于 2007 年 5 月 23 日在《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》发布了此事项公告。

15、为方便个人投资者通过网上交易方式投资基金管理人所管理的开放式基金，基金管理人 2007 年 6 月 11 日起推出面向兴业银行股份有限公司借记卡持卡人的基金网上交易业务。适用于基金管理人所管理的宝康系列基金（宝康消费品基金、宝康灵活配置基金和宝康债券基金）、多策略增长基金、现金宝货币市场基金、本基金、收益增长基金和先进成长基金。

基金管理人已于 2007 年 6 月 8 日在《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》发布了此事项公告。

16、根据基金管理人与中信万通证券有限责任公司签署的《证券投资基金销售代理协议》，中信万通证券自 2007 年 6 月 13 日起代理销售基金管理人所管理的宝康系列基金（宝康消费品基金、宝康灵活配置基金和宝康债券基金）、多策略增长基金、现金宝货币市场基金、本基金、收益增长基金、先进成长基金和行业精选基金。

基金管理人已于 2007 年 6 月 12 日在《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》发布了此事项公告。

十、备查文件

（一）备查文件目录

- 1、中国证监会批准华宝兴业动力组合股票型证券投资基金设立的文件；
- 2、《华宝兴业动力组合股票型证券投资基金基金合同》；
- 3、《华宝兴业动力组合股票型证券投资基金招募说明书》；
- 4、《华宝兴业动力组合股票型证券投资基金托管协议》；
- 5、基金发起人的营业执照；
- 6、基金管理人业务资格批件、营业执照和公司章程；
- 7、基金管理人报告期内在指定报刊上披露的各种公告；
- 8、基金托管人业务资格批件和营业执照。

（二）存放地点

以上文件存于基金管理人及基金托管人办公场所备投资者查阅。

（三）查阅方式

投资者可以通过基金管理人网站，查阅或下载基金合同、招募说明书、托管协议及基金的各种定期和临时公告。

华宝兴业基金管理有限公司

二〇〇七年八月二十八日