宝盈泛沿海区域增长股票证券投资基金 2010年半年度报告摘要

2010年6月30日

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
报告送出日期:二〇一〇年八月二十四日

1 重要提示及目录

1.1 重要提示

基金管理人的董事会、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的法律责任。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。

基金托管人中国工商银行股份有限公司(简称"中国工商银行")根据本基金合同规定,于2010年8月23日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、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及其更新。

本半年度报告摘要摘自半年度报告正文,投资者欲了解详细内容,应阅读半年度报告正文。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2010年1月1日起至6月30日止。

2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金简称	宝盈泛沿海增长股票
基金主代码	213002
交易代码	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
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
报告期末基金份额总额	4,630,186,891.41份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

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。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		宝盈基金管理有限公司	中国工商银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	刘传赛	姜松云
	联系电话	0755-83276688	010-66106912
	电子邮箱	liuck@byfunds.com	custody@icbc.com.cn
客户服务电话		400-8888-300	95588
传真		0755-83515599	010-66106904

2.4 信息披露方式

登载基金半年度报告正文的管理人互联网网址	www.byfunds.com
基金半年度报告备置地点	基金管理人、基金托管人处

3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位:人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2010年1月1日 至 2010年6月30日)
本期已实现收益	-541,291,018.66
本期利润	-950,430,659.66
加权平均基金份额本期利润	-0.2031
本期基金份额净值增长率	-31.24%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2010年6月30日)
期末可供分配基金份额利润	-0.1531
期末基金资产净值	2,072,609,259.29
期末基金份额净值	0.4476

注:1、本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入(不含公允价值变动收益)扣除相关费用后的余额。
2、本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。
3、期末可供分配利润采用期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数。
4、所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,计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	份额净值增长率①	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
过去一个月	-3.49%	1.30%	-5.98%	1.23%	2.49%	0.07%
过去三个月	-23.38%	1.68%	-18.48%	1.31%	-4.90%	0.37%
过去六个月	-31.24%	1.62%	-21.55%	1.16%	-9.69%	0.46%
过去一年	-35.50%	1.86%	-14.45%	1.40%	-21.05%	0.46%
过去三年	-44.43%	1.90%	-27.09%	1.79%	-17.34%	0.11%
自基金合同生效起至今	79.57%	1.69%	76.58%	1.60%	2.99%	0.09%

3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

宝盈泛沿海区域增长股票证券投资基金

份额累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

(2005年3月8日至2010年6月30日)

注:按基金合同规定,本基金自基金合同生效之日起的6个月内为建仓期。建仓期结束时本基金的各项资产配置比例符合基金合同中的相关约定。

4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

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阳、宝盈鸿利收益、宝盈泛沿海、宝盈策略增长、宝盈增强收益、宝盈资源优选、宝盈核心优势、宝盈货币、宝盈中证100九只基金,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,公司的基金经理具有丰富的证券市场投资经验,以自己的专业知识致力于获得良好业绩,努力为投资者创造丰厚的回报。

4.1.2 基金经理(或基金经理小组)及基金经理助理的简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
陆万山	本基金基金经理、投资执行总监兼宝盈鸿利收益证券投资基金基金经理	2009-03-02	-	12年	陆万山先生,1969年生,工商管理硕士,12年证券从业经历。曾就职于深圳金地集团股份有限公司、亚洲控股有限公司、深圳市永泰投资有限公司从事证券投资及研究业务。2006年2月至2008年1月,任职于诺安基金管理有限公司,历任行业研究员、诺安平衡基金经理。2008年3月加入宝盈基金管理有限公司,担任特定客户资产管理部投资经理。2008年12月22日起担任宝盈鸿利收益证券投资基金基金经理。中国国籍,证券投资基金从业人员资格。
夏和平	本基金基金经理兼投资部总监	2009-12-26	-	12年	夏和平先生,1967年10月生,清华大学管理学博士,12年证券从业经历。曾就职于湖北省鄂州啤酒厂、广发证券股份有限公司和广东粤财信托有限公司从事证券的研究与投资管理工作。并曾先后担任过广发证券股份有限公司固定收益部总经理、广东粤财信托有限公司副总裁。2009年9月加入宝盈基金管理有限公司,负责投资管理、风险管理与绩效评价等工作。中国国籍,证券投资基金从业人员资格。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

本报告期内,本基金管理人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》等有关法律法规及基金合同等有关基金法律文件的规定,以取信于市场、取信于社会投资公众为宗旨,本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产,在控制风险的前提下,为基金持有人谋求最大利益。在本报告期内,基金运作合法合规,严格遵守法律法规关于公平交易的相关规定,在投资管理活动中公平对待不同投资组合,无损害基金持有人利益的行为。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

基金管理人根据《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》和《宝盈基金管理有限公司公平交易制度》对本基金的日常交易行为进行监控。经检查,在本报告期内基金管理人严格遵守法律法规关于公平交易的相关规定,在投资活动中公平对待不同投资组合,公平交易制度执行情况良好,无损害基金持有人利益的行为。

4.3.2 本投资组合与其他投资风格相似的投资组合之间的业绩比较

本基金为开放式基金,本基金对投资标的所属区域有明确要求。契约规定,基金非现金资产中不低于80%的资金将投资在于泛沿海区域19个省、市、自治区注册的上市公司发行的证券。本基金的投资风格与管理人旗下其它投资组合的投资风格存在较大差异。

由于投资风格的差异,本基金投资组合的业绩与管理人旗下其它组合的投资业绩不具有可比性。

4.3.3 异常交易行为的专项说明

本报告期内本基金与管理人旗下的其他基金和组合不存在有利益输送嫌疑的异常交易行为。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2010年上半年,股票市场单边下行。上半年,上证指数最高3306.75点,最低2382.36点,累计跌幅为26.82%。同期的沪深300指数最高3597.75点,最低2563.07点,累计跌幅为28.32%。本基金上半年净值下跌31.24%。上半年的行情呈现出更为明显的结构性特征,题材股、中小盘股及重组股等表现较好。而银行、保险、证券、煤炭及钢铁等周期类股票走势相对落后。

上半年,央行连续三次调高准备金率,持续收缩流动性,紧缩力度远超预期。本基金由于采取的投资策略失当,一季度采取的积极的投资策略,持仓主要集中在强周期大盘蓝筹股,而市场的热点持续围绕着有高送配的中、小盘股、区域概念或重组概念方面,蓝筹股受到持续的抛弃。本基金在5月份央行第三次上调准备金率后进行了策略调整,改为防御性策略,卖出了强周期、贝塔值高的股票,同时降低了基金仓位。由于组合调整的时间较晚,上半年的投资业绩不理想。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末,本基金的份额净值为0.4476元。本报告期内本基金的份额净值收益率为-31.24%,业绩比较基准收益率为-21.55%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望下一季度,一方面,由于房地产调控的持续,房地产投资将出现下滑;汇改使得人民币对美元可能持续升值,从而使得出口下降;欧洲主权信用危机的持续,欧元区紧缩性财政政策,将减少政府支出,减少其进口,由于股市的持续下滑,楼市的持续调控,居民财富缩水,消费难以大幅上升;另一方面,虽然大盘股的整体估值已回到较为合理的水平,但中、小盘股的估值仍然较高。所以,预期三季度的行情可能仍将继续振荡下行。

基于以上基本面的考虑,本基金在三季度将采取灵活的操作策略上,就仓位策略上,本基金将采取低仓位策略,在持仓结构上,重点配置前期已经大幅下跌的银行、铁路、石油及水电等大盘蓝筹,通过低仓位、低贝塔的方式抵御可能的下跌风险。同时如果遇合适机会,适时参与反弹。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本基金管理人设立估值工作小组,负责估值政策的合理制定和估值流程的监督。本基金管理人按照有关法规确定的原则进行估值,当基金的估值方法发生变更,并导致基金资产净值的变化在0.25%以上时,聘请会计师事务所进行审核。会计师事务所就我司所采用的相关估值模型、假设及参数的适当性发表审核意见并出具报告。托管人负责对基金管理公司采用的估值政策和程序进行核查,并对估值及净值计算进行复核。

估值工作小组由本基金管理人的分管投资的总经理、督察长、投资部总监、研究部总监、金融工程部总监、基金运营部总监、基金会计主管组成。其中总经理陆金海先生拥有4年的基金公司高级管理人员经验。督察长刘传葵先生拥有18年金融、证券、基金行业从业经验,其中11年证券投资研究管理经验、5年基金合规管理经验。投资部总监夏和平先生拥有12年的证券研究和投资管理经验。研究部总监余述胜先生拥有12年的基金公司从业经验。金融工程部总监杨宏亮先生拥有3年的基金风险管理经验。基金运营部总监陈戈先生拥有3年的基金公司运营管理经验。基金会计主管何瑜女士拥有7年的基金会计经验。

上述参与估值流程的本基金管理人、本基金托管人和本基金聘请的会计师事务所各方不存在任何重大利益冲突。基金经理不参与决定本基金估值的程序。本基金未接受任何已签约的与估值相关的任何定价服务。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金合同约定:

1、基金收益分配采用现金方式,投资者可选择获取现金红利或者将现金红利按权益登记日除息后的基金份额净值自动转为基金份额进行再投资。若投资者不选择,本基金默认投资者选择获取现金红利;

2、每一基金份额享有同等分配权;

3、基金当期收益先弥补上期亏损后,方可进行当期收益分配;

4、基金收益分配后每基金份额净值不能低于面值;

5、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%;

6、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。

法律、法规或监管机构另有规定的从其规定。

本报告期末可供分配利润-709,107,938.21元,基金份额净值0.4476元,不符合利润分配条件,因此本报告期未无法实施利润分配。

最近三年利润分配情况

	利润分配次数	每10份累计分配金额(元)
2008年	0	0
2009年	0	0
2010年上半年	0	0

5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

2010年上半年,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。

5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

2010年上半年,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。本报告期内,宝盈泛沿海区域增长股票证券投资基金未进行利润分配。

5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人依法对宝盈基金管理有限公司编制和披露的宝盈泛沿海区域增长股票证券投资基金2010年半年度报告中财务指标、净值表现、利润分配情况、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。

6 半年度财务会计报告(未经审计)

6.1 资产负债表

会计主体:宝盈泛沿海区域增长股票证券投资基金

报告截止日:2010年6月30日

单位:人民币元

资 产	附注号	本期末 2010年6月30日	上年度末 2009年12月31日
资 产:			
银行存款		298,049,556.83	158,802,949.67
结算备付金		18,780,875.80	5,495,912.54
存出保证金		1,910,763.93	5,294,874.24
交易性金融资产		1,789,647,313.84	2,923,931,687.22
其中:股票投资		1,789,647,313.84	2,923,931,687.22
基金投资		-	-
债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
衍生金融资产		-	-
买入返售金融资产		-	-
应收证券清算款		1,517,940.00	20,315,453.74
应收利息		82,709.96	40,195.86
应收股利		126,000.00	-
应收申购款		403,301.95	332,301.27
递延所得税资产		-	-
其他资产		-	-
资产总计		2,110,518,462.31	3,114,213,374.54
负债和所有者权益	附注号	本期末 2010年6月30日	上年度末 2009年12月31日
负 债:			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债		-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		26,527,954.33	18,376,139.42
应付赎回款		681,435.45	4,007,631.64
应付管理人报酬		2,615,075.20	3,863,097.62
应付托管费		435,845.87	643,849.62
应付销售服务费		-	-
应付交易费用		5,144,652.05	5,894,114.90
应交税费		-	-
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债		2,504,240.12	1,354,156.42
负债合计		37,909,203.02	34,138,989.62
所有者权益:			
实收基金		2,670,788,211.98	2,728,983,530.87
未分配利润		-598,178,952.69	351,090,854.05
所有者权益合计		2,072,609,259.29	3,080,074,384.92
负债和所有者权益总计		2,110,518,462.31	3,114,213,374.54

注:报告截止日2010年6月30日,基金份额净值0.4476元,基金份额总额4,630,186,891.41份。

6.2 利润表

会计主体:宝盈泛沿海区域增长股票证券投资基金

本报告期:2010年1月1日 至 2010年6月30日

单位:人民币元

项 目	附注号	本期 2010年1月1日 至 2010年6月30日	上年度可比期间 2009年1月1日 至 2009年6月30日
一、收入		-913,829,172.22	1,234,359,907.20
1.利息收入		893,671.40	2,952,428.50
其中:存款利息收入		893,671.40	2,952,428.50
债券利息收入		-	-
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益(损失以"-"填列)		-505,638,168.32	-543,621,429.94
其中:股票投资收益		-519,141,492.60	-568,419,184.81
基金投资收益		-	-
债券投资收益		-	-
资产支持证券投资收益		-	-
衍生工具收益		-	-
股利收益		13,503,324.28	24,797,754.87
3.公允价值变动收益(损失以"-"号填列)		-409,139,641.00	1,774,766,740.23
4.汇兑收益(损失以"-"号填列)		-	-
5.其他收入(损失以"-"号填列)		54,965.70	262,168.41
减:二、费用		36,601,487.44	61,293,830.75
1.管理人报酬		18,989,775.74	23,893,702.39
2.托管费		3,164,962.66	3,982,283.69
3.销售服务费		-	-
4.交易费用		14,231,383.92	33,209,854.04
5.利息支出		-	-
其中:卖出回购金融资产支出		-	-
6.其他费用		215,365.12	207,990.63
三、利润总额(亏损总额以"-"号填列)		-950,430,659.66	1,173,066,076.45
减:所得税费用		-	-
四、净利润(净亏损以"-"号填列)		-950,430,659.66	1,173,066,076.45

6.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体:宝盈泛沿海区域增长股票证券投资基金

本报告期:2010年1月1日 至 2010年6月30日

单位:人民币元

项目	本期 2010年1月1日 至 2010年6月30日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益(基金净值)	2,728,983,530.87	351,090,854.05	3,080,074,384.92
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	-950,430,659.66	-950,430,659.66
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数(净值减少以"-"号填列)	-58,195,318.89	1,160,852.92	-57,034,465.97
其中:1.基金申购款	72,928,753.16	-919,112.79	72,009,640.37
2.基金赎回款	-131,124,072.05	2,079,965.71	-129,044,106.34
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以"-"号填列)	-	-	-
五、期末所有者权益(基金净值)	2,670,788,211.98	-598,178,952.69	2,072,609,259.29
项目	上年度可比期间 2009年1月1日 至 2009年6月30日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益(基金净值)	3,259,345,598.80	-543,368,928.86	2,715,976,669.94
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	1,173,066,076.45	1,173,066,076.45
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数(净值减少以"-"号填列)	-279,707,371.55	-24,565,207.06	-304,272,578.61
其中:1.基金申购款	64,205,896.56	2,416,932.45	66,622,829.01
2.基金赎回款	-343,913,268.11	-26,982,139.51	-370,895,407.62
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以"-"号填列)	-	-	-
五、期末所有者权益(基金净值)	2,979,638,227.25	605,131,940.53	3,584,770,167.78

报告附注为财务报表的组成部分。

本报告6.1至6.4,财务报表由下列负责人签署:

基金管理公司负责人:陆金海,主管会计工作负责人:于志,会计机构负责人:陈戈

6.4 报表附注

6.4.1 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

本基金本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

6.4.2 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.2.1 会计政策变更的说明

本基金在本报告期间无需说明的重大会计政策变更。

6.4.2.2 会计估计变更的说明

本基金在本报告期间无需说明的重大会计估计变更。

6.4.2.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无需说明的重大会计差错更正。

6.4.3 税项

本基金本报告期所采用的税项与最近一期年度报告相一致。

6.4.4 关联方关系

6.4.4.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

本基金本报告期不存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况。

6.4.4.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

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、基金销售机构、基金注册登记机构
中国工商银行股份有限公司	基金托管人、基金代销机构
中铁信托有限责任公司	基金管理人的股东
成都工业投资集团有限公司	基金管理人的股东
中国对外经济贸易信托有限公司	基金管理人的股东

注:下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.5 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.5.1 通过关联方交易单元进行的交易

本基金本报告期间及上年度可比期间未通过关联方交易单元进行交易。

6.4.5.2 关联方报酬

6.4.5.2.1 基金管理费

单位:人民币元

项目	本期 2010年1月1日 至 2010年6月30日	上年度可比期间 2009年1月1日 至 2009年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	18,989,775.74	23,893,702.39
其中:支付销售机构的客户维护费	3,311,210.92	3,773,147.67

注: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

6.4.5.2.2 基金托管费

单位:人民币元

项目	本期 2010年1月1日 至 2010年6月30日	上年度可比期间 2009年1月1日 至 2009年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	3,164,962.66	3,982,283.69

注: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

6.4.5.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金本报告期间及上年度可比期间未与关联方进行银行间同业市场债券(含回购)交易。

6.4.5.4 各关联方投资本基金的情况

6.4.5.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

本基金本报告期内及上年度可比期间基金管理人未运用固有资金投资本基金。

6.4.5.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

本基金本报告期内及上年度可比期间无基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况。

6.4.5.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位:人民币元

关联方名称	本期 2010年1月1日 至 2010年6月30日		上年度可比期间 2009年1月1日 至 2009年6月30日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国工商银行	298,049,556.83	834,134.54	195,126,562.71	2,868,150.37

注:不含通过托管行备付金转存于中国证券登记结算公司结算账户的结算备付金。

6.4.5.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期内及上年度可比期间未参与关联方承销证券。

6.4.5.7 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期间及上年度可比期间无需披露其他关联交易事项。

6.4.6 期末(2010年6月30日)本基金持有的流通受限证券

6.4.6.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位:人民币元

6.4.6.1.1 受限证券类别:股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量(单位:股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
300094	国联水产	2010-06-30	2010-07-08	新股未上市	14.38	14.38	1,000	14,380.00	14,380.00	-

注:本基金本报告期末未持有因认购新发/增发证券而不能自由转让的基金资产。

6.4.6.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位:人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量(股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
000001	深发展A	2010-06-30	重大资产重组	17.51	-	-	3,310,315	64,083,271.61	57,963,615.65	-
601318	中国平安	2010-06-30	重大资产重组	46.81	-	-	45	2,037.87	2,106.45	-

6.4.6.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.6.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末2010年6月30日止,本基金无从事银行间市场债券正回购交易形成的余额。

6.4.6.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末2010年6月30日止,本基金无从事证券交易所债券正回购交易形成的余额。

6.4.7 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

本基金无有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项。

7 投资组合报告

7.1 期末基金资产组合情况

金额单位:人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	1,789,647,313.84	84.80
	其中:股票	1,789,647,313.84	84.80
2	固定收益投资	-	-
	其中:债券	-	-
	资产支持证券	-	-
3	金融衍生品投资	-	-
4	买入返售金融资产	-	-
	其中:买断式回购的买入返售金融资产	-	-
5	银行存款和结算备付金合计	316,830,432.63	15.01
6	其他各项资产	4,040,715.84	0.19
7	合计	2,110,518,462.31	100.00

7.2 期末按行业分类的股票投资组合

金额单位:人民币元

代码	行业类别	公允价值	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	14,380.00	0.00
B	采掘业	373,185,775.40	18.01
C	制造业	156,684,903.32	7.56
C0	食品、饮料	15,453.06	0.00
C1	纺织、服装、皮毛	4,354.56	0.00
C2	木材、家具	-	-
C3	造纸、印刷	7,331.34	0.00
C4	石油、化学、塑胶、塑料	62,057,742.34	2.99
C5	电子	7,107.93	0.00
C6	金属、非金属	-	-
C7	机械、设备、仪表	94,591,297.06	4.56
C8	医药、生物制品	1,617.03	0.00
C99	其他制造业	-	-
D	电力、煤气及水的生产和供应业	169,766,613.38	8.19
E	建筑业	93,184,228.80	4.50
F	交通运输、仓储业	35.32	0.00
G	信息技术业	131,638,498.88	6.35
H	批发和零售贸易	-	-
I	金融、保险业	865,147,825.85	41.74
J	房地产业	849.09	0.00
K	社会服务业	10,532.80	0.00
L	传播与文化产业	13,671.00	0.00
M	综合类	-	-
	合计	1,789,647,313.84	86.35

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

金额单位:人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	600900	长江电力	13,592,201	169,766,590.49	8.19
2	601939	建设银行	28,458,872	133,756,698.40	6.45
3	600028	中国石化	16,000,000	125,120,000.00	6.04
4	600016	民生银行	17,780,000	107,569,000.00	5.19
5	600036	招商银行	7,800,000	101,478,000.00	4.90
6	601328	交通银行	16,548,364	99,455,667.64	4.80
7	600000	浦发银行	7,283,777	99,059,367.20	4.78
8	601857	中国石油	9,370,000	96,042,500.00	4.63
9	601186	中国铁建	12,454,754	89,674,228.80	4.33
10	601169	北京银行	7,253,976	87,990,728.88	4.25

注:投资者欲了解本报告期末基金投资的所有股票明细,应阅读登载于www.byfunds.com网站的半年度报告正文。

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值2%或前20名的股票明细

金额单位:人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	601318	中国平安	207,380,661.22	6.73
2	600036	招商银行	194,564,157.65	6.32
3	600900	长江电力	193,928,717.03	6.30
4	600050	中国联通	186,238,843.79	6.05
5	601166	兴业银行	157,761,095.24	5.12
6	601169	北京银行	157,399,034.21	5.11
7	600000	浦发银行	151,389,916.54	4.92
8	601939	建设银行	146,175,564.13	4.75
9	601328	交通银行	140,700,771.16	4.57
10	600015	华夏银行	138,668,375.73	4.50
11	600739	辽宁成大	126,432,910.50	4.10
12	000776	广发证券	126,097,283.01	4.09
13	601857	中国石油	111,422,176.77	3.62
14	601009	南京银行	108,392,322.16	3.52
15	600016	民生银行	102,322,297.62	3.32
16	601699	潞安环能	101,300,047.48	3.29
17	600028	中国石化	95,984,170.26	3.12
18	601186	中国铁建	93,827,416.06	3.05
19	600489	中金黄金	92,231,476.98	2.99
20	000001	深发展A	83,906,260.03	2.72
21	600547	山东黄金	80,645,677.94	2.62
22	601788	光大证券	77,758,710.10	2.52
23	601601	中国太保	76,525,573.99	2.48
24	600581	八一钢铁	71,680,945.16	2.33
25	600999	招商证券	68,872,527.11	2.24
26	601299	中国北车	67,198,357.98	2.18
27	601766	中国南车	65,969,822.04	2.14
28	600030	中信证券	64,297,397.60	2.09
29	000063	中兴通讯	64,263,901.80	2.09
30	601688	华泰证券	61,778,582.55	2.01

注:1.买入包括基金二级市场上主动的买入、新股、配股、债转股、换股及行权等获得的股票。
2."买入股票成本"按买入成交总额,即成交单价乘以成交数量计算,不考虑相关交易费用。

7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值2%或前20名的股票明细

金额单位:人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	600050	中国联通	359,958,074.22	11.69
2	601318	中国平安	214,241,940.69	6.96
3	601628	中国人寿	200,564,507.78	6.51
4	600030	中信证券	187,466,204.95	6.09
5	601601	中国太保	170,596,737.86	5.54
6	600837	海通证券	148,670,651.30	4.83
7	601699	潞安环能	131,294,515.82	4.26
8	601857	中国石油	130,524,111.11	4.24
9	600028	中国石化	129,522,167.67	4.21
10	000898