宝盈资源优选股票型证券投资基金 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:中国建设银行股份有限公司
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。

基金托管人中国建设银行股份有限公司(简称"中国建设银行")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		宝盈资源优选股票
基金主代码		213008
交易代码	213008	213908
基金运作方式		契约型开放式
基金合同生效日		2008年4月15日
基金管理人		宝盈基金管理有限公司
基金托管人		中国建设银行股份有限公司
报告期末基金份额总额		178,624,538.44份
基金合同存续期		不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	基于中国经济处于宏观变革期以及对资本市场未来持续、健康增长的预期,处于稀缺状态的资源凸现其强大的经济价值,相关上市公司体现出较好的投资价值。本基金根据研究部的估值模型,优选各个行业中具有资源优势的上市公司,建立股票池。在严格控制投资风险的前提下保持基金资产持续增值,并力争创造超越业绩基准的主动管理回报。
投资策略	本基金将中长期持有具有资源优势的股票为主的股票投资组合,并注重资产在各相关行业的配置,适当进行时机选择。采用"自上而下"进行资产配置和行业配置、"自下而上"精选个股的积极投资策略。 ①资产配置策略 本基金根据宏观经济运行状况、财政、货币政策、国家产业政策及证券监管政策调整情况、市场资金环境等因素,决定股票、债券及现金的配置比例。 ②股票投资策略 本基金将把握资源的价值变化规律,对各类资源的现状和发展进行分析判断,及时适当调整各类资源行业的配置比例,重点投资于各类资源行业中的优势企业,分享资源长期价值提升所带来的投资收益。 在个股选择层面,本基金以净资产收益率、预期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。 ③债券及短期金融工具投资策略 本基金的债券投资采取主动投资策略,运用利率预测、久期管理、收益率曲线预测、相对价值评估、收益率利差策略、套利交易策略以及利用正逆回购进行杠杆操作等积极的投资策略,力求获得超过债券市场的收益。 ④权证投资策略 本基金在进行权证投资时将在严格控制风险的前提下谋取最大的收益,以不改变投资组合的风险收益特征为首要条件,运用有关数量模型进行估值和风险评估,谨慎投资。
业绩比较基准	沪深300指数×75%+上证国债指数×25%
风险收益特征	风险水平和期望收益相对较高

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	中国建设银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	刘传葵	尹东
	联系电话	0755-83276688	010-67595003
	电子邮箱	liuck@byfunds.com	yindong.zh@ccb.cn
客户服务电话		400-8888-300	010-67595096
传真		0755-83515599	010-66275853

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	-30,310,957.46
本期利润	-59,946,365.13
加权平均基金份额本期利润	-0.3124
本期基金份额净值增长率	-27.54%
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	-0.1606
期末基金资产净值	142,700,228.11
期末基金份额净值	0.7989

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,本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

2.期末可供分配利润:如果期末未分配利润的未实现部分为正数,则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润的已实现部分,如果期末未分配利润的未实现部分为负数,则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润(已实现部分扣除未实现部分)。

3.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	-6.55%	1.62%	-5.64%	1.25%	-0.91%	0.37%
过去三个月	-21.09%	1.84%	-17.73%	1.36%	-3.36%	0.48%
过去六个月	-27.54%	1.59%	-21.34%	1.19%	-6.20%	0.40%
过去一年	-14.76%	1.65%	-13.17%	1.42%	-1.59%	0.23%
自基金合同生效起至今	-14.49%	1.93%	-16.97%	1.77%	2.48%	0.16%

3.2.2 自基金转型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

宝盈资源优选股票型证券投资基金

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

(2008年4月15日至2010年6月30日)

注:1.本基金在2008年4月15日由原封闭式基金转换成立。

2.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		
杨宏亮	本基金基金经理、宝盈核心优势灵活配置混合型证券投资基金基金经理兼金融工程部总监	2009-05-25	-	7年	杨宏亮先生,1974年生,经济学博士,具有7年金融从业经历。曾就职于国家开发银行综合计划局、深圳国信证券综合研究所和中再资产管理股份有限公司从事统计模型与方法研究、宏观研究、证券市场投资策略构建、产品设计和风险管理等工作。2007年10月加入宝盈基金管理有限公司,现任金融工程部总监。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

本基金在2008年4月15日由原封闭式基金转换成立。成立后,基金的投资风格和原来作为封闭式基金的投资风格有较大差异,和管理人旗下的其他封闭式基金和开放式基金的投资风格也存在较大差异。由于投资风格的差异,本基金的投资组合业绩和管理人旗下其他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

从上半年的市场走势来看,年初基于估值水平不高,退出政策与实体复苏相对冲,因此判断10年为震荡市是错误的,没有意识到宏观调控以及外围经济体危机双重叠加对市场的严重影响。

一季度大盘监筹重心下移,二季度在房地产严厉调控以及欧债危机效应双重叠加下,大盘大幅下跌。个人操作上低估了大盘下跌的幅度,在仓位及板块配置上没有能够根据市场变化及时调整,过于僵化。

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0.7989元。本报告期内本基金的份额净值收益率为-27.54%,业绩比较基准收益率为-21.34%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

上半年二季度的急剧下挫,释放了较大的市场的风险。因此需要重新对下半年的市场状态进行评估。

上半年的几个负面因素,严厉的宏观调控、欧债危机预期在下半年都会有所缓解。但美国在刺激政策到期后,仍然表现疲软,这是下半年的一个不确定因素,人民币是否会因此有较大幅度升值,以及美元是否会再次贬值,都具有一定可能性。从某种意义上讲,危机是对以前过度增长的一种缓释,因此危机过后,不可能立刻回到之前的增长、消费以及金融杠杆水平,预期仍然会有一缓慢恢复期。

从国内来看,将迎来一个经济结构的转型期,在控制通胀的前提下,实现宏观经济有质量的较快增长应是未来经济政策的一个重要目标,预期经济将在这种两难中摇摆前行。

我们维持在二季报的判断,三季度会是一个筑底回升的态势,但是下半年是否能够走出象样的行情,取决于经济结构转型的效果。地区、产业、制度方面的促进与改革是否能够取得成效,将决定下半年乃至未来几年的行情。

3G、新疆建设、节能、静脉产业、再制造、先进制造等代表区域结构、产业结构转型方向的产业仍然值得关注。

我们将继续努力尽责地做好本基金的管理工作,尽力为投资者谋取较好的回报。

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,其中总经理陈金海先生拥有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。基金运营部总监陈文先生拥有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.本基金的每份基金份额享有同等分配权;

2.收益分配时所发生的银行转账或其他手续费用由投资人自行承担。当投资人的现金红利小于一定金额,不足以支付银行转账或其他手续费用时,基金登记结算机构可将投资人的现金红利按红利发放日的基金份额净值自动转为基金份额。

3本基金收益每年最多分配12次,每次基金收益分配比例不低于可分配收益的20%,全年基金收益分配比例不低于年度基金可分配收益的30%;

4.若基金合同生效不满3个月则可不进行收益分配;

5.本基金收益分配方式分为两种:现金分红与红利再投资,投资人可选择现金红利或将现金红利按除息日的基金份额净值自动转为基金份额进行再投资;若投资人不选择,本基金默认的收益分配方式是现金分红;

6.基金投资当期出现净亏损,则不进行收益分配;

7.基金当期收益应先弥补上期亏损后,方可进行当期收益分配;

8.法律法规或监管机构另有规定的从其规定。

报告期内,本基金对2009年利润进行了分配,利润分配的金额为36,412,062.11元。

本报告期末可供分配利润-28,692,836.47元,基金份额净值0.7989元,不符合利润分配条件,因此本报告期末无法实施利润分配。

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	1	1.7

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

本报告期,中国建设银行股份有限公司在本基金的托管过程中,严格遵守了《证券投资基金法》、基金合同、托管协议和其他有关规定,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

报告期,本托管人按照国家有关规定、基金合同、托管协议和其他有关规定,对本基金的基金资产净值计算、基金费用开支等方面进行了认真的复核,对本基金的投资运作方面进行了监督,未发现基金管理人有损害基金份额持有人利益的行为。

报告期内,本基金实施利润分配的金额为36,412,062.11元。

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

本托管人复核审查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。

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:宝盈资源优选股票型证券投资基金

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		25,848,751.25	24,008,164.57
结算备付金		665,600.01	1,461,210.20
存出保证金		890,741.00	692,346.61
交易性金融资产		119,833,787.77	255,996,830.29
其中:股票投资		119,833,787.77	255,996,830.29
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		-	-
应收利息		3,541.12	4,476.88
应收股利		9,720.00	-
应收申购款		36,982.06	440,953.00
递延所得税资产		-	-
其他资产		-	-
资产总计		147,289,123.21	282,603,981.55
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		2,466,824.75	5,216,356.88
应付赎回款		157,981.08	1,170,878.28
应付管理人报酬		187,154.74	342,335.33
应付托管费		31,192.44	57,055.89
应付销售服务费		-	-
应付交易费用		438,263.36	906,105.10
应交税费		366,611.18	366,611.18
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债		940,867.55	813,972.43
负债合计		4,588,895.10	8,873,315.09
所有者权益:			
实收基金		164,218,045.10	197,445,095.58
未分配利润		-21,517,816.99	76,285,570.88
所有者权益合计		142,700,228.11	273,730,666.46
负债和所有者权益总计		147,289,123.21	282,603,981.55

注:报告截止日2010年6月30日,基金份额净值0.7989元,基金份额总额178,624,538.44份。

6.2 利润表

会计主体:宝盈资源优选股票型证券投资基金

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		-55,699,533.43	113,126,346.06
1.利息收入		65,936.24	254,790.32
其中:存款利息收入		65,936.24	254,790.32
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)		-26,183,879.13	12,001,998.38
其中:股票投资收益		-26,563,855.51	7,413,853.23
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		-	2,947,648.52
股利收益		379,976.38	1,640,496.63
3.公允价值变动收益(损失以"-"号填列)		-29,635,407.67	100,738,156.16
4.汇兑收益(损失以"-"号填列)		-	-
5.其他收入(损失以"-"号填列)		53,817.13	131,401.20
减:二、费用		4,246,831.70	4,085,903.37
1.管理人报酬		1,412,619.91	2,030,390.45
2.托管费		235,436.67	338,398.44
3.销售服务费		-	-
4.交易费用		2,409,215.33	1,508,941.27
5.利息支出		-	-
其中:卖出回购金融资产支出		-	-
6.其他费用		189,559.79	208,173.21
三、利润总额(亏损总额以"-"号填列)		-59,946,365.13	109,040,442.69
减:所得税费用		-	-
四、净利润(净亏损以"-"号填列)		-59,946,365.13	109,040,442.69

6.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体:宝盈资源优选股票型证券投资基金

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)	197,445,095.58	76,285,570.88	273,730,666.46
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	-59,946,365.13	-59,946,365.13
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)	-33,227,050.48	-1,444,960.63	-34,672,011.11
其中:1.基金申购款	25,064,855.28	3,642,214.49	28,707,069.77
2.基金赎回款	-58,291,905.76	-5,087,175.12	-63,379,080.88
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)	-	-36,412,062.11	-36,412,062.11
五、期末所有者权益(基金净值)	164,218,045.10	-21,517,816.99	142,700,228.11

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)	291,436,724.77	-63,849,743.14	227,586,981.63
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	109,040,442.69	109,040,442.69
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)	-81,070,906.61	-7,646,969.59	-88,717,876.20
其中:1.基金申购款	39,202,693.16	-154,739.48	39,047,953.68
2.基金赎回款	-120,273,599.77	-7,492,230.11	-127,765,829.88
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)	210,365,818.16	37,543,729.96	247,909,548.12

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

本基金本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

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
中国建设银行股份有限公司(以下简称"中国建设银行")	基金托管人、基金代销机构
中国对外经济贸易信托有限公司	基金管理人股东

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	1,412,619.91	2,030,390.45
其中:支付销售机构的客户维护费	137,039.97	123,419.53

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	235,436.67	338,398.44

注:支付基金托管人中国建设银行股份有限公司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的债券(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

份额单位:份

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
期初持有的基金份额	24,976,677.57	27,516,801.93
期间申购/买入总份额	-	-
期间因拆分变动份额	-	-
减:期间赎回/卖出总份额	-	1,553,984.74
期末持有的基金份额	24,976,677.57	25,962,817.19
期末持有的基金份额占基金总份额比例	13.98%	11.35%

注:1.根据本基金的基金管理人宝盈基金管理有限公司于2008年1月29日发布的《鸿飞证券投资基金转型方案说明书》,2009年3月16日发布的《宝盈基金管理有限公司关于对原鸿飞基金份额持有人实施第一次基金份额激励的公告》及2009年8月14日发布的《宝盈基金管理有限公司关于对原鸿飞基金份额持有人实施第二次基金份额激励的公告》,本基金的基金管理人于2009年度对原鸿飞基金份额持有人实施份额激励,份额激励累计使用份额2,540,124.36份。

2.本基金管理人运用固有资金投资本基金所采用的费率适用招募说明书规定的费率结构。

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

份额单位:份

关联方名称	本期末 2010年6月30日		上年度末 2009年12月31日	
	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例
中国对外经济贸易信托有限公司	413,523.18	0.23%	413,523.18	0.19%

注:报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金所采用的费率适用招募说明书规定的费率结构。

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
中国建设银行	25,848,751.25	55,931.43	14,995,550.26	249,687.08

注:本基金的银行存款由基金托管人中国建设银行保管,按银行同业利率计息。

6.4.5.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期间及上年度可比期间在承销期内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

本基金本报告期末未持有因认购新发/增发证券而流通受限的证券。

6.4.6.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金本报告期末未持有暂时停牌等流通受限的股票。

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	119,833,787.77	81.36
	其中:股票	119,833,787.77	81.36
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	26,514,351.26	18.00
6	其他各项资产	940,984.18	0.64
7	合计	147,289,123.21	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	3,009,225.10	2.11
B	采掘业	5,121,420.00	3.59
C	制造业	73,721,811.07	51.66
C0	食品、饮料	10,909,402.72	7.64
C1	纺织、服装、皮毛	-	-
C2	木材、家具	-	-
C3	造纸、印刷	-	-
C4	石油、化学、塑胶、塑料	14,665,773.72	10.28
C5	电子	296,225.15	0.21
C6	金属、非金属	13,023,570.98	9.13
C7	机械、设备、仪表	17,642,776.15	12.36
C8	医药、生物制品	17,184,062.35	12.04
C99	其他制造业	-	-
D	电力、煤气及水的生产和供应业	85,700.00	0.06
E	建筑业	6,583,942.40	4.61
F	交通运输、仓储业	8,092,900.00	5.67
G	信息技术业	11,596,912.02	8.13
H	批发和零售贸易	9,153,672.18	6.41
I	金融、保险业	-	-
J	房地产业	-	-
K	社会服务业	-	-
L	传播与文化产业	2,468,205.00	1.73
M	综合类	-	-
	合计	119,833,787.77	83.98

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	600329	中新药业	224,100	5,649,561.00	3.96
2	000762	西藏矿业	200,840	5,121,420.00	3.59
3	600050	中国联通	919,338	4,900,071.54	3.43
4	000423	东阿阿胶	138,806	4,824,896.56	3.38
5	000538	云南白药	73,927	4,768,291.50	3.34
6	000581	威孚高科	320,000	4,352,000.00	3.05
7	000425	徐工机械	140,000	4,288,200.00	3.01
8	002205	国统股份	188,100	3,950,100.00	2.77
9	002124	天邦股份	483,815	3,933,415.95	2.76
10	000096	广聚能源	768,100	3,901,948.00	2.73

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	000568	泸州老窖	18,518,740.24	6.77
2	000623	吉林敖东	17,373,646.46	6.35
3	000728	国元证券	16,792,432.01	6.13
4	600019	宝钢股份	16,247,925.00	5.94
5	000063	中兴通讯	15,852,507.31	5.79
6	601601	中国太保	15,096,994.87	5.52
7	000898	鞍钢股份	13,645,891.00	4.99
8	000858	五粮液	13,566,484.85	4.96
9	000651	格力电器	13,240,444.78	4.84
10	600765	中航重机	13,073,489.54	4.78
11	600583	海油工程	11,756,166.32	4.29
12	600362	江西铜业	11,668,247.80	4.26
13	600475	华光股份	11,175,737.00	4.08
14	000917	电广传媒	11,137,664.59	4.07
15	600517	置信电气	11,021,005.44	4.03
16	600600	青岛啤酒	10,864,672.38	3.97
17	600231	凌钢股份	10,563,301.22	3.86
18	601166	兴业银行	10,505,992.25	3.84
19	600060	海信电器	9,773,054.18	3.57
20	600559	老白干酒	9,660,976.50	3.53
21	600329	中新药业	9,526,948.96	3.48
22	000762	西藏矿业	8,972,927.10	3.28
23	000001	深发展A	8,795,980.86	3.21
24	002022	科华生物	8,501,168.32	3.11
25	000877	天山股份	8,269,615.64	3.02
26	002205	国统股份	8,059,139.09	2.94
27	600000	浦发银行	7,886,805.00	2.88
28	002238	天威视讯	7,802,355.20	2.85
29	002041	登海种业	7,633,136.20	2.79
30	000581	威孚高科	7,615,797.02	2.78
31	000983	西山煤电	7,557,500.00	2.76
32	601919	中国远洋	7,505,733.48	2.74
33	002073	软控股份	7,486,656.62	2.74
34	601666	平煤股份	7,351,193.40	2.69
35	000807	云铝股份	7,331,854.01	2.68
36	000338	潍柴动力	7,205,337.18	2.63
37	000926	福星股份	7,132,708.05	2.61
38	600062	双鹤药业	6,967,387.00	2.55
39	600173	卧龙地产	6,578,058.06	2.40
40	000060	中金岭南	6,509,286.29	2.38
41	600588	用友软件	6,355,982.25	2.32
42	600030	中信证券	6,205,540.34	2.27
43	002146	荣盛发展	6,152,198.68	2.25
44	000