

华宝兴业大盘精选股票型证券投资基金 2011 年半年度报告

2011 年 6 月 30 日

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：2011 年 8 月 29 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。

基金托管人中国银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2011 年 8 月 22 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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2011 年 01 月 01 日起至 06 月 30 日止。

1.2 目录

§1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示.....	2
1.2 目录.....	3
§2 基金简介	5
2.1 基金基本情况.....	5
2.2 基金产品说明.....	5
2.3 基金管理人和基金托管人.....	5
2.4 信息披露方式.....	6
2.5 其他相关资料.....	6
§3 主要财务指标和基金净值表现	6
3.1 主要会计数据和财务指标.....	6
3.2 基金净值表现.....	7
§4 管理人报告	8
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	8
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	9
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	9
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明.....	10
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	10
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	11
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	11
§5 托管人报告	11
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	11
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明.....	11
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.....	11
§6 半年度财务会计报告（未经审计）	12
6.1 资产负债表.....	12
6.2 利润表.....	13
6.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	14
6.4 报表附注.....	15
§7 投资组合报告	30
7.1 期末基金资产组合情况.....	30
7.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	30
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细.....	31
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	33
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	35
7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名债券投资明细.....	35
7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细.....	35
7.8 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资明细.....	35
7.9 投资组合报告附注.....	35
§8 基金份额持有人信息	36
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	36
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金的情况.....	36
§9 开放式基金份额变动	37

§10 重大事件揭示	37
10.1 基金份额持有人大会决议.....	37
10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动.....	37
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	37
10.4 基金投资策略的改变.....	37
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	37
10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况.....	38
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	38
10.8 其他重大事件.....	39
§11 备查文件目录	40
11.1 备查文件目录.....	40
11.2 存放地点.....	40
11.3 查阅方式.....	41

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	华宝兴业大盘精选股票型证券投资基金
基金简称	华宝兴业大盘精选股票
基金主代码	240011
交易代码	240011
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2008 年 10 月 7 日
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
报告期末基金份额总额	698,118,750.84 份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	在控制风险的前提下，争取基金净值中长期增长超越业绩比较基准。
投资策略	本基金将深入研究大盘股基本面和长期发展前景，注重价值挖掘，通过定量与定性相结合的个股精选策略精选个股，通过对宏观经济、行业经济的把握以及对行业运行周期的认识，调整股票资产在不同行业的投资比例。本基金的大盘股指沪深 A 股按照流通市值从大至小排名在前 1/3 的股票。
业绩比较基准	沪深 300 指数收益率×80%+上证国债指数收益率×20%。
风险收益特征	本基金属于证券投资基金中的较高风险、较高收益的品种。

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		华宝兴业基金管理有限公司	中国银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	刘月华	唐州徽
	联系电话	021-38505888	010-66594855
	电子邮箱	xxpl@fsfund.com	tgxxpl@bank-of-china.com
客户服务电话		400-700-5588、 021-38924558	95566
传真		021-38505777	010-66594942
注册地址		上海浦东世纪大道 88 号金茂大厦 48 楼	北京市西城区复兴门内大街 1 号

办公地址	上海浦东世纪大道 88 号金茂大厦 48 楼	北京市西城区复兴门内大街 1 号
邮政编码	200121	100000
法定代表人	郑安国	肖钢

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	中国证券报、上海证券报、证券时报
登载基金半年度报告正文的管理人互联网网址	www.fsfund.com
基金半年度报告备置地点	本基金半年报置备地点包括基金管理人办公场所和基金托管人办公场所。

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	基金管理人	上海市世纪大道 88 号金茂大厦 48 层
会计师事务所	安永华明会计师事务所	北京市东长安街 1 号东方广场安永大楼 16 层

§ 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(2011 年 1 月 1 日 - 2011 年 6 月 30 日)
本期已实现收益	-113,498,058.23
本期利润	-209,210,748.27
加权平均基金份额本期利润	-0.2601
本期加权平均净值利润率	-15.98%
本期基金份额净值增长率	-14.61%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2011 年 6 月 30 日)
期末可供分配利润	289,021,387.24
期末可供分配基金份额利润	0.4140
期末基金资产净值	1,066,731,048.92
期末基金份额净值	1.5280
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2011 年 6 月 30 日)
基金份额累计净值增长率	59.69%

注：1、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。

2、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。

3、期末可供分配利润采用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、净值相关数据计算中涉及天数的，包括所有交易日以及季末最后一自然日（如非交易日）。

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

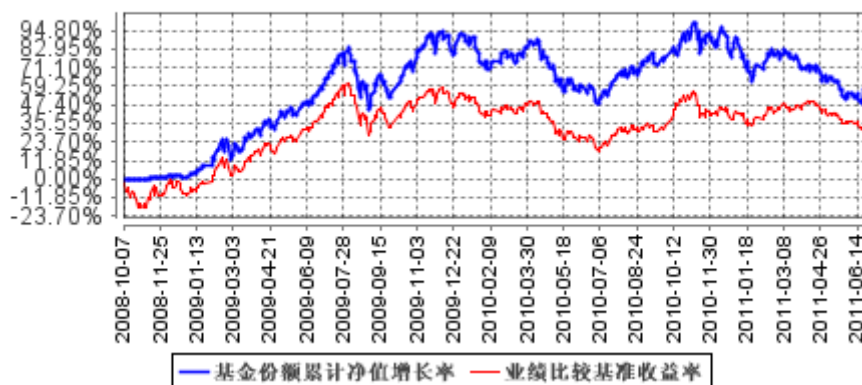
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去一个月	3.80%	1.12%	1.19%	0.95%	2.61%	0.17%
过去三个月	-6.04%	1.06%	-4.28%	0.88%	-1.76%	0.18%
过去六个月	-14.61%	1.23%	-1.67%	0.99%	-12.94%	0.24%
过去一年	6.31%	1.36%	15.72%	1.12%	-9.41%	0.24%
自基金合同生效日起至 今	59.69%	1.46%	38.47%	1.51%	21.22%	-0.05%

注：1、本基金比较基准为：沪深 300 指数收益率×80%+上证国债指数收益率×20%。

2、净值以及比较基准相关数据计算中涉及天数的，包括所有交易日以及季末最后一自然日（如非交易日）。

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

基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：按照基金合同的约定，自基金成立日期的 6 个月内达到规定的资产组合，截至 2009 年 4 月 7 日，本基金已达到基金合同规定的资产配置比例。

§ 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（2011 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、多策略基金、现金宝货币市场基金、动力组合基金、收益增长基金、先进成长基金、行业精选基金、海外中国成长基金、大盘精选基金、增强收益基金、中证 100 基金、上证 180ETF、上证 180ETF 联接基金、新兴产业基金、成熟市场动量优选基金以及可转债基金，所管理的开放式证券投资基金资产净值合计 39,729,234,601.24 元。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
范红兵	大盘精选基金基金经理	2010 年 7 月 28 日	-	11 年	硕士。曾在南方证券股份有限公司、中新苏州工业园创业投资有限公司和平安证券股份有限公司从事证券研究、风险投资工作，于 2007 年 7 月加入华宝兴业基金管理有限公司，先后任高级分析师、基金经理助理。2009 年 2 月至

					2010 年 9 月任华宝兴业行业精选股票型证券投资基金基金经理，2010 年 7 月起任华宝兴业大盘精选股票型证券投资基金基金经理。
--	--	--	--	--	---

注：1、任职日期以及离任日期均以基金公告为准。

2、证券从业含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

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、《华宝兴业大盘精选股票型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。

由于股、债市的系统性风险和申购赎回引起的基金资产规模变化，大盘精选股票型证券投资基金在短期内出现过持有的个股市值占基金净值比例大于 10% 的情况。发生此类情况后，该基金均在合理期限内得到了调整，没有给投资人带来额外风险或损失。

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

本报告期内，基金管理人通过交易决策与交易执行相分离、交易部相对投资部门独立、每日交易日结报告等机制，确保所管理的各基金在交易中被公平对待。

本报告期内，基金管理人严格实施公平交易制度；加强了对所管理的不同投资组合间向交易价差的分析；分析结果没有发现交易价差异常。

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

本报告期内，基金管理人管理的其他基金没有与本基金的投资风格相似的投资组合。

4.3.3 异常交易行为的专项说明

本报告期内，本基金没有发现异常交易行为。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2011 年上半年，市场在国家以控制通货膨胀为主要任务的方向指导下，货币流动性收紧，沪深股市整体呈现出区间振荡格局。年初以来高估值的创业板和中小板股票大幅下跌，而低市盈率和盈利确定性强的蓝筹股票相对抗跌，二八现象再现，持续时间之长超市场预期。本报告期，以食品饮料、地产、白色家电、建筑建材、煤炭等低 PE 和盈利增速确定且股票流动性好的的大中等蓝筹股抗跌性强。本基金在此期间降低了中小股票持仓比例，增加了对大盘蓝筹低估值的股票配置权重。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本报告期，基金份额净值增长率为-14.61%，基准收益率为-1.67%，基金表现落后于基准。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

中国经济如今已走到十字路口。随着刘易斯人口拐点的显现和资源、环境、土地等投入品成本提升，这种建立在“成本领先”基础上的增长模式愈发显现出国内经济发展的不平衡和不可持续性。中国经济高速增长的引擎急需切换，经济转型势在必行。结合实体经济运行，A 股也步入迷局。经济增长平淡；通胀维持高位且难以排除向上反复的风险；货币政策难以放松；流动性边际改善而无惊喜，股指难有大行情。

展望 2011 年下半年，我们认为国内通货膨胀高点将在未来两个月出现；经济增长方面，虽然房地产新调控政策如限购令、限贷令等陆续出台，但国家通过新建地方保障性住房、大搞水利建设等措施可能部分抵消固定资产投资下降的风险，内需消费继续保持稳定快速的增长，短期看经济增长无忧。

证券市场方面，受通胀趋势转折向下和市场流动性相对上半年有所好转等预期的影响，我们认为未来市场整体格局将保持区间震荡上行格局。投资策略上，我们将继续坚持低 PE 价值股估值修复和成长股震荡整理为主、积极关注上市公司中报超预期的投资机会。从行业配置上将继续增加中盘蓝筹股的配置权重，重点关注金融、煤炭、建筑建材等投资机会，同时积极寻找超跌后具备确定性高成长估值合理的中小股票。另外由于中国经济未来长期存在的劳动力成本提升，“劳动替代”必然是未来经济生活中真实可见的大主题，因为我们也将积极寻找制造升级或机器替代人工的相关行业和公司。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

基金管理人在报告期内对旗下基金估值中，各部门参与如下：

（一）基金会计：根据《基金会计核算业务指引》对基金日常交易进行记账核算，并对基金投资品种进行估值。

（二）金融工程部：对特殊品种或由于特殊原因导致投资品种不存在活跃市场的情况下，为估值提供相关模型。

（三）估值委员会：定期评价现行估值政策和程序，在发生了影响估值政策和程序的有效性及应用性的情况后及时修订估值方法。基金在采用新投资策略或投资新品种时，评价现有估值政策和程序的适用性。

（四）必要时基金经理参与估值政策制定、估值模型及估值方法的确定工作。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金本报告期亏损，未有应分未分的利润。

§ 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

本报告期内，中国银行股份有限公司（以下称“本托管人”）在华宝兴业大盘精选证券投资基金（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。

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

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。

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

本报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告（注：财务会计报告中的“金融工具风险及管理”部分未在托管人复核范围内）、投资组合报告等内容真实、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：华宝兴业大盘精选股票型证券投资基金

报告截止日：2011 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2011 年 6 月 30 日	上年度末 2010 年 12 月 31 日
资产：			
银行存款	6.4.7.1	136,301,782.77	181,922,564.20
结算备付金		3,494,500.11	10,656,474.31
存出保证金		2,708,359.43	1,437,510.52
交易性金融资产	6.4.7.2	928,870,289.16	1,403,133,753.86
其中：股票投资		928,870,289.16	1,403,133,753.86
基金投资		-	-
债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
应收证券清算款		5,930,529.92	54,411,274.01
应收利息	6.4.7.5	33,344.74	51,634.03
应收股利		427,743.45	-
应收申购款		123,875.77	907,149.56
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		1,077,890,425.35	1,652,520,360.49
负债和所有者权益	附注号	本期末 2011 年 6 月 30 日	上年度末 2010 年 12 月 31 日
负债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		-	3,611,361.00
应付赎回款		4,155,632.30	796,294.65
应付管理人报酬		1,270,066.47	2,251,576.56
应付托管费		211,677.75	375,262.78
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	5,322,890.27	6,077,761.80
应交税费		-	-
应付利息		-	-
应付利润		-	-

递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	199,109.64	372,657.31
负债合计		11,159,376.43	13,484,914.10
所有者权益：			
实收基金	6.4.7.9	698,118,750.84	915,990,786.85
未分配利润	6.4.7.10	368,612,298.08	723,044,659.54
所有者权益合计		1,066,731,048.92	1,639,035,446.39
负债和所有者权益总计		1,077,890,425.35	1,652,520,360.49

注：报告截止日 2011 年 6 月 30 日，基金份额净值 1.5280 元，基金份额总额 698,118,750.84 份。

6.2 利润表

会计主体：华宝兴业大盘精选股票型证券投资基金

本报告期：2011 年 1 月 1 日至 2011 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2011 年 1 月 1 日至 2011 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2010 年 1 月 1 日至 2010 年 6 月 30 日
一、收入		-186,095,147.14	-391,882,423.04
1. 利息收入		749,677.79	1,279,103.41
其中：存款利息收入	6.4.7.11	749,677.79	474,229.43
债券利息收入		-	804,873.98
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）		-91,668,603.71	-6,259,981.17
其中：股票投资收益	6.4.7.12	-96,804,805.95	-13,628,954.88
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.13	-	-538,900.00
资产支持证券投资收益		-	-
衍生工具收益	6.4.7.14	-	-
股利收益	6.4.7.15	5,136,202.24	7,907,873.71
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.16	-95,712,690.04	-387,708,898.70
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	536,468.82	807,353.42
减：二、费用		23,115,601.13	22,719,819.82
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	9,812,277.37	12,543,847.42
2. 托管费	6.4.10.2.2	1,635,379.61	2,090,641.27
3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用	6.4.7.18	11,464,823.27	7,868,003.87
5. 利息支出		-	13,836.64
其中：卖出回购金融资产支出		-	13,836.64
6. 其他费用	6.4.7.19	203,120.88	203,490.62

三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-209,210,748.27	-414,602,242.86
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-209,210,748.27	-414,602,242.86

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：华宝兴业大盘精选股票型证券投资基金

本报告期：2011 年 1 月 1 日至 2011 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2011 年 1 月 1 日至 2011 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）	915,990,786.85	723,044,659.54	1,639,035,446.39
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-209,210,748.27	-209,210,748.27
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）	-217,872,036.01	-145,221,613.19	-363,093,649.20
其中：1. 基金申购款	64,761,464.69	43,544,355.47	108,305,820.16
2. 基金赎回款	-282,633,500.70	-188,765,968.66	-471,399,469.36
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）	698,118,750.84	368,612,298.08	1,066,731,048.92
项目	上年度可比期间 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）	1,036,865,347.27	965,983,205.53	2,002,848,552.80
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-414,602,242.86	-414,602,242.86

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）	-153,971,681.43	-80,263,150.75	-234,234,832.18
其中：1. 基金申购款	241,900,049.56	179,958,847.92	421,858,897.48
2. 基金赎回款	-395,871,730.99	-260,221,998.67	-656,093,729.66
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）	-	-85,046,070.41	-85,046,070.41
五、期末所有者权益（基金净值）	882,893,665.84	386,071,741.51	1,268,965,407.35

报表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：

 裴长江

基金管理公司负责人

 黄小蕙

主管会计工作负责人

 张幸骏

会计机构负责人

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

华宝兴业大盘精选股票型证券投资基金(以下简称“本基金”)，系经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监基金字 2008 965 号文《关于核准华宝兴业大盘精选股票型证券投资基金募集的批复》的核准，由华宝兴业基金管理有限公司作为发起人向社会公开发行募集，基金合同于 2008 年 10 月 7 日正式生效，首次设立募集规模为 490,050,880.11 份基金份额。本基金为契约型开放式，存续期限不定。本基金的基金管理人及注册登记机构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。

本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法公开发行、上市的股票和债券以及中国证监会允许基金投资的其它金融工具。本基金对股票投资比例为基金资产净值的 60%-95%，其中投资于大盘股市值占非现金资产的比例不低于 80%；权证投资比例为基金资产净值的 0%-3%；债券及现金投资比例为基金资产的 5%-40%；资产支持证券比例为基金资产净值的 0%-20%。本基金股票投资的业绩比较基准为沪深 300 指数，债券投资的业绩比较基准为上证国债指数。整体业绩比较基准为：沪深 300 指数收益率×80%+上证国债指数收益率×20%。

本财务报表由本基金的基金管理人华宝兴业基金管理有限公司于 2011 年 8 月 29 日批准报出。

6.4.2 会计报表的编制基础

本财务报表系按照中国财政部 2006 年 2 月颁布的《企业会计准则—基本准则》和 38 项具体会计准则、其后颁布的应用指南、解释以及其他相关规定（以下合称“企业会计准则”）编制，同时，对于在具体会计核算和信息披露方面，也参考了中国证券业协会制定的《证券投资基金会计核算业务指引》、中国证监会制定的《关于进一步规范证券投资基金估值业务的指导意见》、《关于证券投资基金执行〈企业会计准则〉估值业务及份额净值计价有关事项的通知》、《证券投资基金信息披露管理办法》、《证券投资基金信息披露内容与格式准则》第 2 号《年度报告的内容与格式》、《证券投资基金信息披露编报规则》第 3 号《会计报表附注的编制及披露》、《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号〈年度报告和半年度报告〉》、《证券投资基金参与股指期货交易指引》及其他中国证监会颁布的相关规定。

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2011 半年度财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金 2011 年 6 月 30 日的财务状况以及 2011 半年度的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

6.4.4 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。

6.4.5 差错更正的说明

本基金本报告期无重大会计差错。

6.4.6 税项

1. 印花税

经国务院批准，财政部、国家税务总局研究决定，自 2008 年 4 月 24 日起，调整证券（股票）交易印花税税率，由原先的 3‰调整为 1‰；经国务院批准，财政部、国家税务总局研究决定，自 2008 年 9 月 19 日起，调整由出让方按证券（股票）交易印花税税率缴纳印花税，受让方不再征收，税率不变；

根据财政部、国家税务总局财税字[2005]103 号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》的规定，股权分置改革过程中因非流通股股东向流通股股东支付对价而发生的股权转让，暂免征收印花税。

2. 营业税、企业所得税

根据财政部、国家税务总局财税字[2004]78 号文《关于证券投资基金税收政策的通知》的规定，自 2004 年 1 月 1 日起，对证券投资基金（封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金）管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入，继续免征营业税和企业所得税；

根据财政部、国家税务总局财税字[2005]103 号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》的规定，股权分置改革中非流通股股东通过对价方式向流通股股东支付的股份、现金等收入，暂免征收流通股股东应缴纳的企业所得税；

根据财政部、国家税务总局财税[2008]1 号文《关于企业所得税若干优惠政策的通知》的规定，对证券投资基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股权的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

3. 个人所得税

根据财政部、国家税务总局财税字[2002]128 号文《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》的规定，对基金取得的股票的股息、红利收入、债券的利息收入及储蓄利息收入，由上市公司、债券发行企业及金融机构在向基金派发股息、红利收入、债券的利息收入及储蓄利息收入时代扣代缴 20%的个人所得税；

根据财政部、国家税务总局财税字[2005]107 号文《关于股息红利有关个人所得税政策的补充通知》的规定，自 2005 年 6 月 13 日起，对证券投资基金从上市公司分配取得的股息红利所得，按照财税[2005]102 号文规定，扣缴义务人在代扣代缴个人所得税时，减按 50%计算应纳税所得额；

根据财政部、国家税务总局财税字[2005]103 号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》的规定，股权分置改革中非流通股股东通过对价方式向流通股股东支付的股份、现金等收入，暂免征收流通股股东应缴纳的个人所得税。

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2011 年 6 月 30 日
活期存款	136,301,782.77
定期存款	-
其中：存款期限 1-3 个月	-

其他存款	-
合计:	136,301,782.77

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2011年6月30日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	960,091,579.80	928,870,289.16	-31,221,290.64
债券	交易所市场	-	-
	银行间市场	-	-
	合计	-	-
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	960,091,579.80	928,870,289.16	-31,221,290.64

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末未持有衍生金融资产或负债。

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本基金本报告期末未持有买入返售金融资产。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末未持有买断式逆回购交易中取得的债券。

6.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2011年6月30日
应收活期存款利息	31,770.84
应收定期存款利息	-
应收其他存款利息	-
应收结算备付金利息	1,572.50
应收债券利息	-

应收买入返售证券利息	-
应收申购款利息	1.40
其他	-
合计	33,344.74

6.4.7.6 其他资产

本基金本报告期末无其他资产。

6.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2011年6月30日
交易所市场应付交易费用	5,322,890.27
银行间市场应付交易费用	-
合计	5,322,890.27

6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2011年6月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	15,631.75
预提费用	183,477.89
合计	199,109.64

6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2011年1月1日至2011年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	915,990,786.85	915,990,786.85
本期申购	64,761,464.69	64,761,464.69
本期赎回(以“-”号填列)	-282,633,500.70	-282,633,500.70
本期末	698,118,750.84	698,118,750.84

注：申购含转换入份额；赎回含转换出份额。

6.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	511,995,236.05	211,049,423.49	723,044,659.54
本期利润	-113,498,058.23	-95,712,690.04	-209,210,748.27
本期基金份额交易产生的变动数	-109,475,790.58	-35,745,822.61	-145,221,613.19
其中：基金申购款	33,560,894.31	9,983,461.16	43,544,355.47
基金赎回款	-143,036,684.89	-45,729,283.77	-188,765,968.66
本期已分配利润	-	-	-
本期末	289,021,387.24	79,590,910.84	368,612,298.08

6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2011年1月1日至2011年6月30日
活期存款利息收入	700,210.25
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	-
结算备付金利息收入	49,443.06
其他	24.48
合计	749,677.79

6.4.7.12 股票投资收益

6.4.7.12.1 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2011年1月1日至2011年6月30日
卖出股票成交总额	3,868,148,491.60
减：卖出股票成本总额	3,964,953,297.55
买卖股票差价收入	-96,804,805.95

6.4.7.13 债券投资收益

本基金本报告期无债券投资收益。

6.4.7.14 衍生工具收益

本基金本报告期无衍生工具收益。

6.4.7.15 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2011 年 1 月 1 日至 2011 年 6 月 30 日
股票投资产生的股利收益	5,136,202.24
基金投资产生的股利收益	-
合计	5,136,202.24

6.4.7.16 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2011 年 1 月 1 日至 2011 年 6 月 30 日
1. 交易性金融资产	-95,712,690.04
——股票投资	-95,712,690.04
——债券投资	-
——资产支持证券投资	-
2. 衍生工具	-
——权证投资	-
3. 其他	-
合计	-95,712,690.04

6.4.7.17 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2011 年 1 月 1 日至 2011 年 6 月 30 日
基金赎回费收入	382,139.42
转换费收入	154,329.40
合计	536,468.82

注：1. 本基金的赎回费率按持有期间递减，赎回费总额的 25% 归入基金资产。

2. 本基金的转换费由赎回费和申购费补差两部分构成，其中赎回费部分的 25% 归入转出基金的基金资产。

6.4.7.18 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2011 年 1 月 1 日至 2011 年 6 月 30 日
交易所市场交易费用	11,464,823.27
银行间市场交易费用	-
合计	11,464,823.27

6.4.7.19 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2011年1月1日至2011年6月30日
审计费用	34,712.18
信息披露费	148,765.71
银行汇划费用	10,642.99
债券帐户维护费	9,000.00
合计	203,120.88

6.4.7.20 分部报告

无。

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的重大或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

本基金本报告期内无资产负债表日后事项的说明。

6.4.9 关联方关系

6.4.9.1 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

本报告期内存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

6.4.9.2 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
华宝兴业基金管理有限公司（“华宝兴业”）	基金管理人、注册登记机构、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
华宝信托有限责任公司（“华宝信托”）	基金管理人的股东
领先资产管理有限公司 (Lyxor Asset Management S.A.)	基金管理人的股东
上海宝钢集团公司（“宝钢集团”）	基金管理人的最终控制方
华宝证券经纪有限责任公司（“华宝证券”）	受基金管理人的股东控制的公司

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。

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

本基金本报告期未通过关联方交易单元进行交易。

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2011年1月1日至2011年6月 30日	上年度可比期间 2010年1月1日至2010年6月30 日
当期发生的基金应支付的管理费	9,812,277.37	12,543,847.42
其中：支付销售机构的客户维护费	994,023.01	1,122,555.05

注：支付基金管理人华宝兴业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：日管理人报酬 = 前一日基金资产净值 X 1.5% / 当年天数。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2011年1月1日至2011年6月 30日	上年度可比期间 2010年1月1日至2010年6月30 日
当期发生的基金应支付的托管费	1,635,379.61	2,090,641.27

注：支付基金托管人中国银行的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：日托管费 = 前一日基金资产净值 X 0.25% / 当年天数。

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金本报告期未有与关联方进行的银行间同业市场的债券（含回购）交易。

6.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.4.1 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 2011年1月1日至2011年6 月30日	上年度可比期间 2010年1月1日至2010年6月30 日
基金合同生效日（2008年10月7日）持有的基金份额	-	-
期初持有的基金份额	772,701.53	639,193.22
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	-	-
期末持有的基金份额	772,701.53	639,193.22
期末持有的基金份额 占基金总份额比例	0.11%	0.07%

注：基金管理人投资本基金适用的认(申)购/赎回费率按照本基金招募说明书的规定执行。

6.4.10.4.2 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

本报告期末除基金管理人之外的其他关联方未有投资本基金的情况。

6.4.10.5 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		上年度可比期间	
	2011年1月1日至2011年6月30日		2010年1月1日至2010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
中国银行	136,301,782.77	700,210.25	182,091,983.87	446,207.23

注：本基金的银行存款由基金托管人中国银行保管，按银行同业利率计息。

6.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期内无参与关联方承销证券的情况。

6.4.11 利润分配情况

本基金本报告期内未进行利润分配。

6.4.12 期末（2011年6月30日）本基金持有的流通受限证券

6.4.12.1 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/增发而流通受限的证券。

6.4.12.2 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
600216	浙江医药	2011年6月27日	重大资产重组	31.39	2011年7月4日	32.60	871,647	30,745,715.29	27,360,999.33	-
600170	上海建工	2011年6月29日	重大资产重组	15.59	2011年7月4日	16.25	1,008,470	17,032,803.73	15,722,047.30	-

000759	中百集团	2011 年 4 月 14 日	重大资产重组	12.32	-	-	523,729	6,508,801.51	6,452,341.28	-
--------	------	-----------------	--------	-------	---	---	---------	--------------	--------------	---

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

本基金本报告期末无银行间市场债券正回购，因此没有在债券正回购交易中作为抵押的债券。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

本基金本报告期末无交易所市场债券正回购，因此没有在债券正回购交易中作为抵押的债券。

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金是一只股票型的证券投资基金，属于较高风险较高收益的基金品种。本基金投资的金融工具主要包括股票、债券及权证等。本基金在日常经营活动中面临的与这些金融工具相关的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金的基金管理人从事风险管理的主要目标是争取将以上风险控制在限定的范围之内，使本基金在风险和收益之间取得最佳的平衡以实现“风险和收益相匹配”的风险收益目标。

本基金的基金管理人奉行全面风险管理体系的建设，公司内部监督和反馈系统包括督察长、内部控制委员会、副总经理、内控审计风险管理部、各部门负责人和风险控制联络人、各业务岗位。副总经理总管公司的内控事务。督察长向董事会负责，独立地就内控制度的执行情况履行检查、评价、报告和建议职能。内控审计风险管理部在副总经理指导下对公司内部控制运行情况进行监控，主要针对公司内部控制制度的总体构架和内部控制的目标进行评估并提出改进意见；对各部门和岗位的内部控制执行情况进行监督和核查，同时对内控的失控点进行查漏并责令改正。

本基金的基金管理人根据自身经营特点设立顺序递进、权责统一、严密有效的四层监控防线。第一层监控防线为一线岗位自控与互控；第二层防线为大业务板块内部各部门和部门之间的自控和互控；第三层监控防线为内部内控审计风险管理部对各岗位、各部门、各项业务全面实施的监督反馈；最后是以副总经理领导的内部控制委员会为主体的第四层防线，实施对公司各类业务和风险的总体监督、控制，并对内控审计风险管理部的工作予以直接指导。

本基金的基金管理人对于金融工具的风险管理方法是结合定性分析和定量分析方法，估测各种风险产生的可能损失。从定性分析的角度出发，判断风险损失的严重程度和出现风险损失的频度。而从定量分析的角度出发，根据本基金的投资目标，结合基金资产所运用金融工具的特征，通过特定的风险量化指标、模型、日常的量化报告，确定相应置信程度和风险损失的限度，及时可靠地对各种风险进行监督、检查和评估，并通过相应决策，将风险控制在可承受的范围内。

6.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息等情况，导致基金资产损失和收益变化的风险。

为了规避信用风险，本公司在交易前对交易对手的资信状况进行充分的评估。本基金的银行存款存放在本基金的托管行中国银行股份有限公司，因而与该银行存款相关的信用风险不重大。本基金在交易所进行的交易均以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，因此违约风险可能性很小；在银行间同业市场进行交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式进行限制以控制相应的信用风险。

本基金的基金管理人建立了信用风险管理流程，通过对投资品种的信用等级评估来控制证券发行人的信用风险，且通过分散化投资以分散信用风险。本基金均投资于具有良好信用等级的证券，且投资于一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金的基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司的证券不得超过该证券的 10%。

6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金所持金融工具变现的难易程度。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难或因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理的价格变现。

针对兑付赎回资金的流动性风险，本基金的基金管理人每日对本基金的申购赎回情况进行严密监控并预测流动性需求，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配。本基金的基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。

针对投资品种变现的流动性风险，本基金的基金管理人通过独立的风险管理部门设定流动性比例要求，对流动性指标进行持续的监测和分析，包括组合持仓集中度指标、组合在短时间内变现能力的综合指标、组合中变现能力较差的投资品种比例以及流通受限制的投资品种比例等。本基金所持大部分券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易，因此本基金持有的证券均能及时变现。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值。

本基金所持有的全部金融负债的合约约定到期日均为一个月以内且不计息，可赎回基金份额净值(所有者权益)无固定到期日且不计息，因此账面余额即为未折现的合约到期现金流量。

6.4.13.4 市场风险

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动而发生波动的风险，包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指金融工具的公允价值或现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。利率敏感性金融工具均面临由于市场利率上升而导致公允价值下降的风险，其中浮动利率类金融工具还面临每个付息期间结束根据市场利率重新定价时对于未来现金流影响的风险。

本基金的基金管理人定期对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控，并通过调整投资组合的久期等方法对上述利率风险进行管理。

本基金持有的大部分金融资产和金融负债不计息，因此本基金的收入及经营活动的现金流量在很大程度上独立于市场利率变化。本基金持有的利率敏感性资产主要为银行存款、结算备付金及债券投资等。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2011年6月30日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	136,301,782.77	-	-	-	136,301,782.77

结算备付金	3,494,500.11	-	-	-	3,494,500.11
存出保证金	-	-	-	2,708,359.43	2,708,359.43
交易性金融资产	-	-	-	928,870,289.16	928,870,289.16
应收证券清算款	-	-	-	5,930,529.92	5,930,529.92
应收利息	-	-	-	33,344.74	33,344.74
应收股利	-	-	-	427,743.45	427,743.45
应收申购款	298.21	-	-	123,577.56	123,875.77
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	139,796,581.09	-	-	938,093,844.26	1,077,890,425.35
负债	-	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	4,155,632.30	4,155,632.30
应付管理人报酬	-	-	-	1,270,066.47	1,270,066.47
应付托管费	-	-	-	211,677.75	211,677.75
应付交易费用	-	-	-	5,322,890.27	5,322,890.27
其他负债	-	-	-	199,109.64	199,109.64
负债总计	-	-	-	11,159,376.43	11,159,376.43
利率敏感度缺口	139,796,581.09	-	-	926,934,467.83	1,066,731,048.92
上年度末 2010 年 12 月 31 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	181,922,564.20	-	-	-	181,922,564.20
结算备付金	10,656,474.31	-	-	-	10,656,474.31
存出保证金	-	-	-	1,437,510.52	1,437,510.52
交易性金融资产	-	-	-	1,403,133,753.86	1,403,133,753.86
应收证券清算款	-	-	-	54,411,274.01	54,411,274.01
应收利息	-	-	-	51,634.03	51,634.03
应收申购款	397.02	-	-	906,752.54	907,149.56
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	192,579,435.53	-	-	1,459,940,924.96	1,652,520,360.49
负债	-	-	-	-	-
应付证券清算款	-	-	-	3,611,361.00	3,611,361.00
应付赎回款	-	-	-	796,294.65	796,294.65
应付管理人报酬	-	-	-	2,251,576.56	2,251,576.56
应付托管费	-	-	-	375,262.78	375,262.78
应付交易费用	-	-	-	6,077,761.80	6,077,761.80
其他负债	-	-	-	372,657.31	372,657.31
负债总计	-	-	-	13,484,914.10	13,484,914.10
利率敏感度缺口	192,579,435.53	-	-	1,446,456,010.86	1,639,035,446.39

注：表中所示为本基金资产及负债的公允价值，并按照合约规定的利率重新定价日或到期日孰早予以分类。

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

于 2011 年 6 月 30 日，本基金未持有交易性债券投资(2009 年 6 月 30 日：1.76%)，因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响(2009 年 6 月 30 日：同)。

6.4.13.4.2 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场交易的股票和债券，所面临的其他价格风险来源于单个证券发行主体自身经营情况或特殊事项的影响，也可能来源于证券市场整体波动的影响。

本基金的基金管理人在构建和管理投资组合的过程中，采用“自上而下”的策略，通过对宏观经济情况及政策的分析，结合证券市场运行情况，做出资产配置及投资组合构建的策略；通过对单个证券的定性分析及定量分析，选择符合基金合同约定范围的投资品种进行投资。本基金的基金管理人定期结合宏观及微观环境的变化，对投资策略、资产配置、投资组合进行修正，来主动应对可能发生的市场价格风险。

本基金通过投资组合的分散化降低价格风险。此外，本基金的基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控，定期运用多种定量方法来测试本基金面临的潜在价格风险，及时可靠地对风险进行跟踪和控制。

6.4.13.4.2.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2011 年 6 月 30 日		上年度末 2010 年 12 月 31 日	
	公允价值	占基金 资产净 值比例 (%)	公允价值	占基金资 产净值比 例 (%)
交易性金融资产—股票投资	928,870,289.16	87.08	1,403,133,753.86	85.61
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产—债券投资	-	-	-	-
衍生金融资产—权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	928,870,289.16	87.08	1,403,133,753.86	85.61

6.4.13.4.2.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	比较基准为沪深 300 指数收益率*80%+上证国债指数收益率*20%。		
	估测组合市场价格风险的数据为沪深 300 指数和上证国债指数变动时基金资产相应的理论变动值。		
	假定沪深 300 指数和上证国债指数变化为 5%，其他市场变量均不发生变化。		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2011 年 6 月 30 日）	上年度末（2010 年 12 月 31 日）
	业绩比较基准上升 5%	55,160,662.54	86,692,970.75
	业绩比较基准下降 5%	-55,160,662.54	-86,692,970.75

6.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

无。

§ 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	928,870,289.16	86.17
	其中：股票	928,870,289.16	86.17
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	139,796,282.88	12.97
6	其他各项资产	9,223,853.31	0.86
7	合计	1,077,890,425.35	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	-	-
B	采掘业	78,057,579.47	7.32

C	制造业	467,724,810.07	43.85
C0	食品、饮料	30,718,244.16	2.88
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	46,202,982.80	4.33
C5	电子	55,293,238.41	5.18
C6	金属、非金属	76,525,208.03	7.17
C7	机械、设备、仪表	127,361,405.51	11.94
C8	医药、生物制品	131,623,731.16	12.34
C99	其他制造业	-	-
D	电力、煤气及水的生产和供应业	-	-
E	建筑业	15,722,047.30	1.47
F	交通运输、仓储业	19,461,962.44	1.82
G	信息技术业	103,918,767.02	9.74
H	批发和零售贸易	74,995,092.72	7.03
I	金融、保险业	83,798,889.25	7.86
J	房地产业	50,474,194.13	4.73
K	社会服务业	6,390,000.97	0.60
L	传播与文化产业	15,778,095.84	1.48
M	综合类	12,548,849.95	1.18
	合计	928,870,289.16	87.08

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

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	002230	科大讯飞	2,183,177	88,418,668.50	8.29
2	002436	兴森科技	1,857,663	45,642,779.91	4.28
3	002001	新和成	1,385,704	40,808,982.80	3.83
4	000651	格力电器	1,601,509	37,635,461.50	3.53
5	000423	东阿阿胶	900,801	37,167,049.26	3.48
6	000002	万科A	3,594,331	30,372,096.95	2.85
7	000527	美的电器	1,628,854	29,954,625.06	2.81
8	000028	一致药业	1,134,182	29,284,579.24	2.75
9	600547	山东黄金	649,998	29,145,910.32	2.73
10	601166	兴业银行	2,095,954	28,253,459.92	2.65
11	000401	冀东水泥	1,108,631	27,704,688.69	2.60
12	000538	云南白药	479,776	27,385,614.08	2.57

13	600216	浙江医药	871,647	27,360,999.33	2.56
14	600690	青岛海尔	933,791	26,099,458.45	2.45
15	601288	农业银行	9,000,000	25,200,000.00	2.36
16	600809	山西汾酒	359,040	25,150,752.00	2.36
17	600058	五矿发展	700,000	23,996,000.00	2.25
18	600111	包钢稀土	299,971	21,426,928.53	2.01
19	600125	铁龙物流	1,846,486	19,461,962.44	1.82
20	600664	哈药股份	1,183,238	18,576,836.60	1.74
21	600489	中金黄金	650,000	17,738,500.00	1.66
22	600000	浦发银行	1,649,998	16,235,980.32	1.52
23	601168	西部矿业	1,085,046	16,080,381.72	1.51
24	600880	博瑞传播	1,123,796	15,778,095.84	1.48
25	600170	上海建工	1,008,470	15,722,047.30	1.47
26	600739	辽宁成大	548,999	15,262,172.20	1.43
27	000528	柳 工	616,483	13,951,010.29	1.31
28	601678	滨化股份	710,983	12,548,849.95	1.18
29	000425	徐工机械	496,001	12,295,864.79	1.15
30	000758	中色股份	299,970	10,603,939.50	0.99
31	000063	中兴通讯	349,809	9,892,598.52	0.93
32	600657	信达地产	1,499,936	9,554,592.32	0.90
33	002106	莱宝高科	292,050	8,834,512.50	0.83
34	000060	中金岭南	600,000	7,980,000.00	0.75
35	600557	康缘药业	552,789	7,744,573.89	0.73
36	000001	深发展 A	452,543	7,724,909.01	0.72
37	600048	保利地产	650,000	7,143,500.00	0.67
38	600585	海螺水泥	249,810	6,934,725.60	0.65
39	600276	恒瑞医药	225,000	6,743,250.00	0.63
40	600869	三普药业	246,400	6,645,408.00	0.62
41	000759	中百集团	523,729	6,452,341.28	0.60
42	601888	中国国旅	270,419	6,390,000.97	0.60
43	002161	远 望 谷	250,000	5,607,500.00	0.53
44	000568	泸州老窖	123,393	5,567,492.16	0.52
45	601009	南京银行	600,000	5,382,000.00	0.50
46	000039	中集集团	230,449	5,042,224.12	0.47
47	600395	盘江股份	135,247	4,488,847.93	0.42
48	000878	云南铜业	199,999	4,381,978.09	0.41
49	600892	*ST 宝诚	229,722	3,700,821.42	0.35
50	601766	中国南车	500,000	3,560,000.00	0.33
51	600383	金地集团	531,046	3,404,004.86	0.32

52	600160	巨化股份	100,000	3,246,000.00	0.30
53	000877	天山股份	85,950	3,054,663.00	0.29
54	000683	远兴能源	240,000	2,148,000.00	0.20
55	600036	招商银行	77,000	1,002,540.00	0.09
56	002273	水晶光电	22,760	815,946.00	0.08
57	600031	三一重工	9,100	164,164.00	0.02

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	600029	南方航空	80,865,599.51	4.93
2	000423	东阿阿胶	74,687,624.92	4.56
3	000623	吉林敖东	72,518,702.73	4.42
4	002230	科大讯飞	66,356,077.14	4.05
5	000858	五粮液	62,644,539.07	3.82
6	601166	兴业银行	57,965,442.56	3.54
7	600739	辽宁成大	56,988,899.60	3.48
8	000651	格力电器	56,268,340.80	3.43
9	600111	包钢稀土	53,638,488.78	3.27
10	600216	浙江医药	51,647,984.74	3.15
11	601111	中国国航	51,484,595.90	3.14
12	600352	浙江龙盛	51,386,819.83	3.14
13	000039	中集集团	51,203,201.73	3.12
14	600362	江西铜业	49,942,910.95	3.05
15	002001	新和成	48,600,141.24	2.97
16	600276	恒瑞医药	46,739,345.29	2.85
17	002106	莱宝高科	46,602,719.13	2.84
18	600875	东方电气	45,738,734.90	2.79
19	000538	云南白药	43,914,915.21	2.68
20	601299	中国北车	43,114,770.20	2.63
21	000422	湖北宜化	41,433,984.58	2.53
22	000157	中联重科	41,066,381.35	2.51
23	600030	中信证券	41,037,001.52	2.50

24	601678	滨化股份	39,191,200.94	2.39
25	600547	山东黄金	37,414,635.44	2.28
26	600123	兰花科创	36,747,842.72	2.24
27	000898	鞍钢股份	33,879,738.76	2.07
28	000877	天山股份	33,850,303.50	2.07
29	600115	东方航空	33,540,898.36	2.05
30	601607	上海医药	32,850,454.90	2.00

注：买入金额不包括相关交易费用。

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	002230	科大讯飞	90,783,811.79	5.54
2	601607	上海医药	83,284,295.18	5.08
3	600029	南方航空	77,391,324.22	4.72
4	600519	贵州茅台	76,451,841.56	4.66
5	000623	吉林敖东	72,691,405.12	4.44
6	000858	五粮液	70,659,451.97	4.31
7	000039	中集集团	66,196,783.87	4.04
8	002106	莱宝高科	65,367,133.10	3.99
9	000538	云南白药	63,104,776.53	3.85
10	600352	浙江龙盛	62,583,310.01	3.82
11	000401	冀东水泥	57,010,828.11	3.48
12	000877	天山股份	53,195,350.64	3.25
13	002436	兴森科技	53,145,940.63	3.24
14	600050	中国联通	49,733,586.42	3.03
15	600362	江西铜业	48,821,340.35	2.98
16	601111	中国国航	48,673,118.83	2.97
17	601766	中国南车	47,451,909.36	2.90
18	002056	横店东磁	45,602,549.72	2.78
19	600169	太原重工	43,574,054.25	2.66
20	601299	中国北车	42,923,217.68	2.62
21	000157	中联重科	42,746,764.85	2.61
22	601318	中国平安	42,518,379.13	2.59
23	000568	泸州老窖	41,341,360.26	2.52
24	000012	南玻A	41,291,893.86	2.52
25	600875	东方电气	41,282,718.83	2.52

26	600583	海油工程	40,962,808.91	2.50
27	600739	辽宁成大	40,365,230.04	2.46
28	600030	中信证券	38,996,052.33	2.38
29	600276	恒瑞医药	38,195,328.10	2.33
30	000422	湖北宣化	37,649,282.15	2.30
31	000024	招商地产	37,569,818.63	2.29
32	002008	大族激光	37,229,064.93	2.27
33	600123	兰花科创	36,685,890.16	2.24
34	000988	华工科技	33,264,842.38	2.03
35	000969	安泰科技	33,009,285.51	2.01

注：卖出金额不包括相关交易费用。

7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	3,586,402,522.89
卖出股票收入（成交）总额	3,868,148,491.60

注：买入股票成本、卖出股票收入均不包括相关交易费用。

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7.8 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

7.9 投资组合报告附注

7.9.1 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。

7.9.2 本基金股票投资的主要对象是大盘股，基金管理人建立有基金股票备选库。本报告期内本基金的前十名股票投资没有超出基金合同规定的股票备选库。

7.9.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	2,708,359.43
2	应收证券清算款	5,930,529.92
3	应收股利	427,743.45
4	应收利息	33,344.74
5	应收申购款	123,875.77
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	9,223,853.31

7.9.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有转股期的可转换债券。

7.9.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限的情况。

§ 8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

持有人户数 (户)	户均持有的 基金份额	持有人结构			
		机构投资者		个人投资者	
		持有份额	占总份 额比例	持有份额	占总份 额比例
28,185	24,769.16	331,788,736.84	47.53%	366,330,014.00	52.47%

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金的情况

项目	持有份额总数 (份)	占基金总份额比例
----	------------	----------

基金管理公司所有从业人员持有本开放式基金	1,011,690.26	0.1449%
----------------------	--------------	---------

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2008年10月7日）基金份额总额	490,050,880.11
本报告期期初基金份额总额	915,990,786.85
本报告期基金总申购份额	64,761,464.69
减：本报告期基金总赎回份额	282,633,500.70
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	698,118,750.84

注：总申购份额含红利再投、转换入份额；总赎回份额含转换出份额。

§ 10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

报告期内本基金未召开基金份额持有人大会。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

1、基金管理人于2011年4月9日发布公告，聘任谢文杰先生为公司副总经理，其任职资格已经中国证监会审核批准。2、本报告期内，根据证监会《关于核准中国银行股份有限公司李爱华基金行业高级管理人员任职资格的批复》，李爱华先生担任本基金托管人——中国银行托管及投资者服务部总经理；因工作调动，董杰先生不再担任中国银行托管及投资者服务部总经理。该人事变动已按相关规定备案并公告。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

报告期内无涉及基金管理人、基金资产和基金托管业务的诉讼事项。

10.4 基金投资策略的改变

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

基金管理人为本基金聘任的会计师事务所向本基金提供的审计服务持续期限为：本基金合同生效之日起至本报告期末。

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内管理人和托管人及其高级管理人员未有受到稽查或处罚的情况。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
国泰君安	1	-	-	-	-	-
海通证券	1	-	-	-	-	-
中金国际	2	1,363,541,487.60	18.29%	1,109,101.35	17.87%	-
国信证券	1	1,359,197,051.82	18.23%	1,155,310.76	18.62%	-
光大证券	1	1,317,907,195.84	17.68%	1,070,810.22	17.25%	-
招商证券	1	823,190,698.39	11.04%	668,846.59	10.78%	-
广发证券	1	732,436,447.91	9.83%	622,571.79	10.03%	-
齐鲁证券	1	681,057,861.70	9.14%	578,894.19	9.33%	-
申银万国	1	516,355,739.36	6.93%	438,897.45	7.07%	-
中信金通	1	300,413,766.42	4.03%	255,350.29	4.11%	-
兴业证券	1	147,273,304.96	1.98%	125,182.52	2.02%	-
中信建投	1	124,495,226.17	1.67%	105,821.79	1.71%	-
长江证券	1	88,682,234.32	1.19%	75,378.41	1.21%	-

10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例
国泰君安	-	-	-	-	-	-
海通证券	-	-	-	-	-	-
中金国际	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-
光大证券	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-

广发证券	-	-	-	-	-	-
齐鲁证券	-	-	-	-	-	-
申银万国	-	-	-	-	-	-
中信金通	-	-	-	-	-	-
兴业证券	-	-	-	-	-	-
中信建投	-	-	-	-	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-

注：1、基金管理人选择交易单元的标准和程序如下：

(1) 选择标准： 资力雄厚，信誉良好，注册资本不少于 5 亿元人民币；财务状况良好，各项财务指标显示公司经营状况稳定；经营行为规范，最近两年未因重大违规行为受到中国证监会和中国人民银行处罚；内部管理规范、严格，具备健全的内控制度，并能满足基金运作高度保密的要求；具备基金运作所需要的高效、安全的通讯条件，交易设施符合代理本基金进行证券交易的需要，并能为本基金提供全面的信息服务；研究实力较强，有固定的研究机构和专门的研究人员，能及时为本基金提供高质量的咨询服务，并能根据基金投资的特定要求，提供专门研究报告；适当的地域分散化。

(2) 选择程序： (a) 服务评价； (b) 拟定备选交易单元； (c) 签约。

2、本基金本报告期无新增证券席位。

10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	华宝兴业基金管理有限公司关于增加中航证券为代销机构的公告	《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》以及基金管理人网站	2011 年 6 月 25 日
2	华宝兴业基金管理有限公司关于在中信证券开通旗下开放式基金定期定额投资业务及转换业务的公告	《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》以及基金管理人网站	2011 年 4 月 29 日
3	华宝兴业基金管理有限公司关于参加江苏银行网上银行基金申购费率优惠的公告	《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》以及基金管理人网站	2011 年 4 月 27 日

4	华宝兴业基金管理有限公司关于聘任副总经理的公告	《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》以及基金管理人网站	2011 年 4 月 9 日
5	关于华宝兴业旗下基金参加“华夏银行·盈基金 2011”网上银行基金申购 4 折优惠活动的公告	《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》以及基金管理人网站	2011 年 4 月 1 日
6	华宝兴业关于旗下基金持有的“双汇发展”估值方法调整的公告	《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》以及基金管理人网站	2011 年 3 月 22 日
7	华宝兴业基金管理有限公司关于工商登记变更的公告	《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》以及基金管理人网站	2011 年 1 月 4 日

§ 11 备查文件目录

11.1 备查文件目录

中国证监会批准基金设立的文件；
 华宝兴业大盘精选股票型证券投资基金基金合同；
 华宝兴业大盘精选股票型证券投资基金招募说明书；
 华宝兴业大盘精选股票型证券投资基金托管协议；
 基金管理人业务资格批件、营业执照和公司章程；
 基金管理人报告期内在指定报刊上披露的各种公告；
 基金托管人业务资格批件和营业执照。

11.2 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。

11.3 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
2011 年 8 月 29 日