

华宝兴业宝康灵活配置证券投资基金 2011 年年度报告

2011年12月31日

基金管理人：华宝兴业基金管理有限公司

基金托管人：中国建设银行股份有限公司

送出日期：2012年3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根据本基金合同规定，于 2012 年 3 月 26 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。

本报告财务资料已经审计。

本报告期自 2011 年 01 月 01 日起至 12 月 31 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、基金净值表现及利润分配情况	6
3.1 主要会计数据和财务指标	6
3.2 基金净值表现	7
3.3 过去三年基金的利润分配情况	8
§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	12
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	12
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	12
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	13
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况	13
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	14
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	15
§5 托管人报告	15
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	15
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	15
5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见	15
§6 审计报告	15
6.1 审计报告基本信息	15
6.2 审计报告的基本内容	15
§7 年度财务报表	16
7.1 资产负债表	16
7.2 利润表	18
7.3 所有者权益（基金净值）变动表	19
7.4 报表附注	20
§8 投资组合报告	40
8.1 期末基金资产组合情况	40
8.2 期末按行业分类的股票投资组合	40
8.3 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	41
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动	49
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	50
8.6 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	51
8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的所有资产支持证券投资明细	51
8.8 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	51

8.9 投资组合报告附注	51
§9 基金份额持有人信息	52
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	52
9.2 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金的情况	52
§10 开放式基金份额变动	52
§11 重大事件揭示	53
11.1 基金份额持有人大会决议	53
11.2 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	53
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	53
11.4 基金投资策略的改变	53
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	53
11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况	53
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	54
11.8 其他重大事件	55
§12 影响投资者决策的其他重要信息	57
§13 备查文件目录	57
13.1 备查文件目录	57
13.2 存放地点	58
13.3 查阅方式	58

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	华宝兴业宝康灵活配置证券投资基金
基金简称	华宝兴业宝康配置混合
基金主代码	240002
交易代码	240002
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2003 年 7 月 15 日
基金管理人	华宝兴业基金管理有限公司
基金托管人	中国建设银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	730,413,591.45 份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	规避系统风险，降低投资组合波动性，提高投资组合的长期报酬。
投资策略	本基金采用资产灵活配置策略，以债券投资为基础，并把握股市重大投资机会，获取超额回报，同时执行严格的投资制度和风险控制制度。
业绩比较基准	65%中信标普全债指数+35%上证 180 指数和深证 100 指数的复合指数。 复合指数 = (上证 180 流通市值 / 成分指数总流通市值) × 上证 180 指数 + (深证 100 流通市值 / 成分指数总流通市值) × 深证 100 指数 成分指数总流通市值 = 上证 180 流通市值 + 深证 100 流通市值

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	中国建设银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	刘月华	尹东
	联系电话	021-38505888	010-67595003
	电子邮箱	xxpl@fsfund.com	yindong.zh@ccb.com
客户服务电话		400-700-5588、 021-38924558	010-67595096
传真		021-38505777	010-66275853
注册地址		上海浦东世纪大道 88 号金茂大厦 48 楼	北京市西城区金融大街 25 号
办公地址		上海浦东世纪大道 100 号环球金融中心 58 楼	北京市西城区闹市口大街 1 号院 1 号楼
邮政编码		200120	100033

法定代表人	郑安国	王洪章
-------	-----	-----

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
登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	www.fsfund.com
基金年度报告备置地点	本基金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
会计师事务所	普华永道中天会计师事务所有限责任公司	上海市湖滨路 202 号普华永道中心 11 楼
注册登记机构	基金管理人	上海市世纪大道 100 号环球金融中心 58 楼

§ 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

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	2011 年	2010 年	2009 年
本期已实现收益	-16,080,962.98	-20,747,739.53	347,027,396.08
本期利润	-201,730,935.66	-114,288,961.95	958,561,903.28
加权平均基金份额本期利润	-0.2631	-0.1152	0.6282
本期加权平均净值利润率	-19.46%	-8.20%	46.18%
本期基金份额净值增长率	-18.88%	-7.13%	60.45%
3.1.2 期末数据和指标	2011 年末	2010 年末	2009 年末
期末可供分配利润	119,856,239.07	356,708,080.16	682,648,896.82
期末可供分配基金份额利润	0.1641	0.4351	0.5964
期末基金资产净值	850,269,830.52	1,176,462,596.87	1,827,356,817.47
期末基金份额净值	1.1641	1.4351	1.5964
3.1.3 累计期末指标	2011 年末	2010 年末	2009 年末
基金份额累计净值增长率	237.50%	316.07%	348.04%

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、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）。

4、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。

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

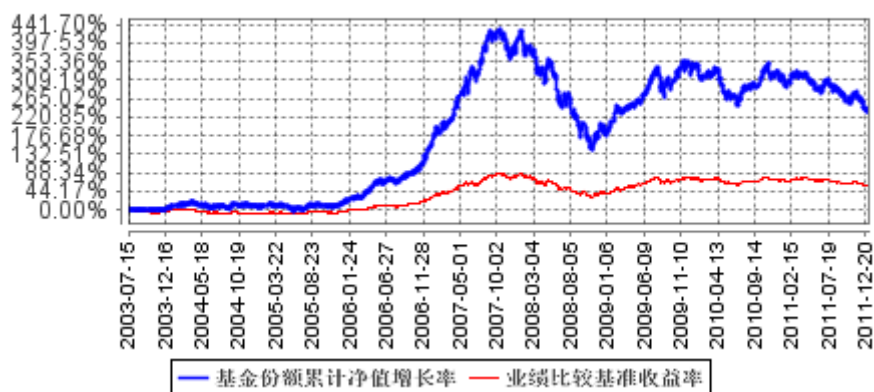
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	-6.08%	1.04%	-1.17%	0.51%	-4.91%	0.53%
过去六个月	-14.95%	0.99%	-6.95%	0.49%	-8.00%	0.50%
过去一年	-18.88%	0.93%	-6.66%	0.47%	-12.22%	0.46%
过去三年	20.86%	1.10%	15.96%	0.59%	4.90%	0.51%
过去五年	32.05%	1.41%	22.82%	0.76%	9.23%	0.65%
自基金合同生效日起至 今	237.50%	1.22%	59.44%	0.66%	178.06%	0.56%

注：1、本基金业绩比较基准为：65%中信标普全债指数+35%上证 180 指数和深圳 100 指数的复合指数。

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

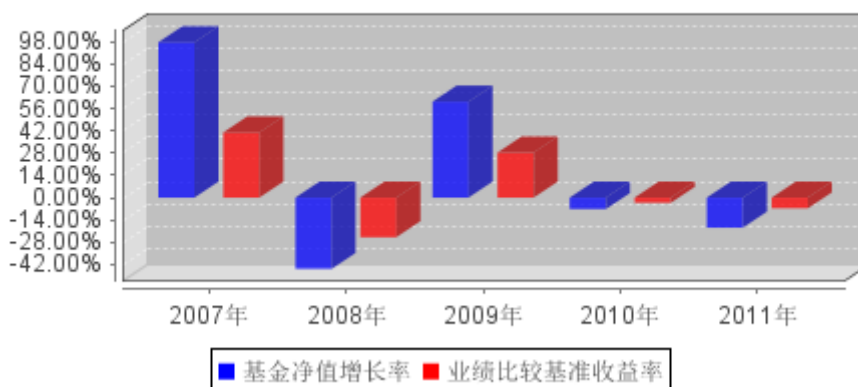
基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



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 2004 年 1 月 15 日，本基金已达到合同规定的资产配置比例。

3.2.3 过去五年基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

过去五年基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的对比图



3.3 过去三年基金的利润分配情况

单位：人民币元

年度	每10份基金份额分红数	现金形式发放总额	再投资形式发放总额	年度利润分配合计	备注
2011	-	-	-	-	-
2010	0.5000	30,801,739.00	26,120,050.80	56,921,789.80	-
2009	0.5000	42,681,846.75	52,932,911.89	95,614,758.64	-
合计	1.0000	73,483,585.75	79,052,962.69	152,536,548.44	-

§ 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 12 月 31 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、可转债基金、上证 180 成长 ETF、上证 180 成长 ETF 联接基金、华宝油气基金，所管理的开放式证券投资基金资产净值合计 37,012,970,285.05 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		

<p>牟旭东</p>	<p>本基金基金经理、国内投资部总经理、华宝兴业多策略股票、华宝兴业增强收益债券基金经理</p>	<p>2010 年 1 月 22 日</p>	<p>-</p>	<p>14 年</p>	<p>硕士。1997 年 9 月至 2003 年 1 月在南方证券有限公司从事证券研究工作, 2003 年 1 月加入本公司, 任高级分析师, 2004 年 9 月起任研究部副总经理, 2007 年 9 月起任研究部总经理, 2007 年 10 月至今任华宝兴业多策略增长开放式证券投资基金基金经理, 2009 年 2 月至 2011 年 2 月兼任华宝兴业增强收益债券型证券投资基金基金经理, 2010 年 1 月至今兼任华宝兴业宝康灵活配置证券投资基金基金经理, 2010 年 7 月起任国内投资部</p>
------------	--------------------------------------------------	------------------------	----------	-------------	-----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------

					总经理。
郭鹏飞	本基金基金经理, 华宝兴业新兴产业股票基金经理	2010 年 6 月 26 日	-	7 年	博士, 拥有 CFA 资格。2004 年 2 月加入华宝兴业基金管理有限公司任研究部行业分析师, 2007 年 9 月任公司研究部副总经理, 2009 年 3 月至 2010 年 6 月任公司研究部总经理, 2010 年 6 月至今任华宝兴业宝康灵活配置证券投资基金基金经理, 2010 年 12 月兼任华宝兴业新兴产业股票型证券投资基金基金经理。
蔡目荣	本基金基金经理助理、华宝兴业新兴产业股票基金经理助理	2010 年 10 月 11 日	2011 年 12 月 22 日	8 年	硕士。曾在金信研究、国金证券股份有限公司从事研究工作, 2008 年 6 月进入华宝兴业基金管理有限公司, 先后担任高

					<p>级分析师、研究部总经理助理。2010 年 10 月至 2011 年 11 月担任华宝兴业宝康配置混合基金经理助理，2010 年 12 月至 2011 年 11 月兼任华宝兴业新兴产业股票基金经理助理。</p>
季鹏	<p>本基金基金经理助理、华宝兴业收益增长混合基金经理助理</p>	<p>2011 年 11 月 3 日</p>	-	5 年	<p>金融学硕士，FRM。曾任香港大福证券担任行业研究员，光大保德信基金管理公司高级行业研究员、首席策略分析师、基金经理助理。2011 年 4 月加盟华宝兴业基金管理公司，担任高级策略分析师，2011 年 7 月至 2011 年 11 月任华宝兴业收益增长混合型证券投资基</p>

					金基金 经理助 理， 2011 年 11 月兼任华宝兴业宝康灵活配置证券投资基金基金经理助理。
--	--	--	--	--	----------------------------------------------------------

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合规守信情况的说明

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、《华宝兴业宝康系列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。

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，全世界范围内“黑天鹅事件”频发，日本地震与海啸、欧债危机恶化、美国评级下调、中东政治危机等等，都超出了投资者合理预期范围，引发海外股市出现大幅震荡；同样，2011 年国内的通胀水平持续超出预期，导致货币政策的紧缩程度和 A 股的下跌幅度也超出了我们原来的预期。一

季度，A 股短暂回调后，由于周期性行业盈利大幅超出预期，推动 A 股出现了一波幅度较大的上涨行情；然而好景不长，通胀持续高企以及严厉紧缩政策，导致社会资金极度紧张，实体经济和资本市场都受到很大影响，A 股开始了连续三个季度的震荡下跌，特别是第四季度，实体经济开始去库存，房地产投资明显下滑，企业盈利也开始显著下调，A 股跌幅较大，市场恐慌情况蔓延。

2011 年全年，上证综指下跌 21.68%，沪深 300 指数下跌 25.01%，中小板指数下跌 37.09%，创业板指数下跌 35.88%；各行业指数都出现了较大幅度下跌，其中金融地产等权重股和消费类股跌幅较小，周期性股票和中小盘个股跌幅很大。

由于低估了宏观紧缩政策对实体经济和资本市场的影响，我们对 A 股全年的下跌幅度也估计不足，较早即将股票仓位提高到了较高水平，因此在持续震荡下跌行情中受到了很大损失；同时，部分重仓的中小盘成长股受到小盘股整体泡沫破灭影响，发生了较大幅度下跌，对本基金净值也造成不利影响。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截止至本报告期末，报告期内基金份额净值增长率为-18.88%，基金基准涨幅为-6.66%，基金表现落后于基准 12.22 个百分点。

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 2012 年，在持续一年多的紧缩政策后，中国经济已经出现了明显的增速缓慢下降，通胀水平从 2011 年四季度开始逐步回落，货币政策也已经从“从紧”逐步恢复到正常状态，社会资金紧张程度随之开始逐渐好转；同时，宏观经济数据和企业盈利数据已经说明，中国经济并未发生“硬着陆”，经济增速下降总体比较温和，企业盈利并不会发生大幅度的下滑。本轮经济回落主要是中央政府主动调控的结果，而一旦通胀压力消除及紧缩政策逐步放开，国内经济增速和企业盈利都将在 2012 年中后期逐渐好转。2011 年 A 股的大幅度下跌，更大程度上是流动性紧缩导致的估值下降，经济下滑带来的企业盈利下降并不是最主要原因；而在经历了大幅下跌后，A 股估值水平已经处于历史很低水平，近期频繁发生的大股东和管理层增持现象，也说明 A 股已经具备了明显的投资价值。

我们认为，长期来看，目前 A 股市场已经进入了较好的安全投资区域。因此，我们计划采取积极的投资策略，维持较高水平的股票仓位，以把握经济复苏和流动性好转带来的投资机会，配置上仍以指数权重股为主，同时增持部分受益于经济结构转型的高成长性股票。感谢基金持有人一直以来对我们的支持，在以后的投资中，我们将继续总结经验教训，勤勉尽责，努力为持有人创造好的回报。

4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

公司自 2003 年 3 月成立以来始终注重合规性和业务风险控制。加强对基金运作的内部操作风险控制、保障基金份额持有人的利益始终是公司制定各项内部制度、流程的指导思想。公司监察稽核部门

对公司遵守各项法规和管理制度及公司所管理的各基金履行合同义务的情况进行核查，发现问题及时提出改进建议并督促业务部门进行整改，同时定期向监管部门、公司管理层及上级公司出具相关报告。

本报告期内，基金管理人内部监察稽核主要工作如下：

（一）规范员工行为操守，加强职业道德教育和风险教育。公司通过对新员工集中组织岗前培训、签署《个人声明书》等形式，明确员工的行为准则，防范道德风险。

（二）完善公司制度体系。公司一方面坚持制度的刚性，不轻易改变、简化已确立的流程。要求从一般员工、部门经理到业务总监，每个人都必须清楚自己的权力和职责，承担相应责任。另一方面，伴随市场变革和产品创新，公司的业务和管理方式也发生着变化。在长期的业务实践中，公司借鉴和吸收海外股东、国内同行经验，在符合公司基本制度的前提下，根据业务的发展不时调整。允许各级员工在职责范围内设计和调整自己的业务流程，涉及其它部门或领域的，由相应级别的负责人在符合公司已有制度的基础上协调和批准。公司根据业务情况调整和细化了市场、营运、投资研究各方面的分工和业务规则，并根据内部控制委员会和监察稽核部门提出的意见、建议调整或改善了前、中、后台的业务流程。

（三）全面开展内部审计工作。2011 年，监察稽核部门按计划对公司营运、投资、市场部门进行了业务审计，并与相关部门进行沟通，形成后续跟踪和业务上相互促进的良性循环，不断提高工作质量。

在今后的工作中，本基金管理人将继续坚持一贯的内部控制理念，完善内控制度，提高工作水平，努力防范和控制各种风险，保障基金份额持有人的合法权益。

4.7 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其适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。

4.8 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，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

本报告期，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关损害基金份额持有人利益的行为。

报告期内，本基金未实施利润分配。

5.3 托管人对本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 审计报告

6.1 审计报告基本信息

财务报表是否经过审计	是
审计意见类型	标准无保留意见
审计报告编号	普华永道中天审字(2012)第 20407 号

6.2 审计报告的基本内容

审计报告标题	审计报告
审计报告收件人	华宝兴业宝康系列开放式证券投资基金下设之宝康灵活配置证券投资基金 全体基金份额持有人：
引言段	我们审计了后附的华宝兴业宝康系列开放式证券投资基金下设之

	宝康灵活配置证券投资基金（以下简称“华宝兴业宝康灵活配置基金”）的财务报表，包括 2011 年 12 月 31 日的资产负债表、2011 年度 的利润表和所有者权益（基金净值）变动表以及财务报表附注。
管理层对财务报表的责任段	编制和公允列报财务报表是 华宝兴业宝康灵活配置基金 的基金管理人 华宝兴业基金管理有限公司 管理层的责任。这种责任包括：（1）按照企业会计准则和中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制财务报表，并使其实现公允反映；（2）设计、执行和维护必要的内部控制，以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。
注册会计师的责任段	<p>我们的责任是在执行审计工作的基础上对财务报表发表审计意见。我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。中国注册会计师审计准则要求我们遵守中国注册会计师职业道德守则，计划和执行审计工作以对财务报表是否不存在重大错报获取合理保证。</p> <p>审计工作涉及实施审计程序，以获取有关财务报表金额和披露的审计证据。选择的审计程序取决于注册会计师的判断，包括对由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险的评估。在进行风险评估时，注册会计师考虑与财务报表编制和公允列报相关的内部控制，以设计恰当的审计程序，但目的并非对内部控制的有效性发表意见。审计工作还包括评价管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计的合理性，以及评价财务报表的总体列报。</p> <p>我们相信，我们获取的审计证据是充分、适当的，为发表审计意见提供了基础。</p>
审计意见段	我们认为，上述华宝兴业宝康灵活配置基金的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则和在财务报表附注中所列示的中国证监会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制，公允反映了 华宝兴业宝康灵活配置基金 2011 年 12 月 31 日的财务状况以及 2011 年度 的经营成果和基金净值变动情况。
注册会计师的姓名	汪棣 单峰
会计师事务所的名称	普华永道中天会计师事务所有限责任公司
会计师事务所的地址	上海市湖滨路 202 号普华永道中心 11 楼
审计报告日期	2012 年 3 月 26 日

§ 7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体：华宝兴业宝康灵活配置证券投资基金

报告截止日：2011 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2011年12月31日	上年度末 2010年12月31日
资产：			
银行存款	7.4.7.1	12,297,256.18	38,624,899.64
结算备付金		289,839.04	1,456,582.31
存出保证金		890,741.00	1,207,722.48
交易性金融资产	7.4.7.2	839,755,146.63	1,137,901,885.91
其中：股票投资		629,984,325.43	831,773,156.79
基金投资		-	-
债券投资		209,770,821.20	306,128,729.12
资产支持证券投资		-	-
衍生金融资产	7.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	-	-
应收证券清算款		-	-
应收利息	7.4.7.5	2,850,284.16	6,987,315.91
应收股利		-	-
应收申购款		2,877.04	94,956.82
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.6	-	-
资产总计		856,086,144.05	1,186,273,363.07
负债和所有者权益	附注号	本期末 2011年12月31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	7.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		-	2,784,002.83
应付赎回款		125,811.89	632,427.48
应付管理人报酬		972,466.40	1,323,523.07
应付托管费		187,012.77	254,523.68
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	7.4.7.7	3,785,879.85	4,069,987.04
应交税费		38,260.00	38,260.00
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.8	706,882.62	708,042.10
负债合计		5,816,313.53	9,810,766.20
所有者权益：			
实收基金	7.4.7.9	730,413,591.45	819,754,516.71
未分配利润	7.4.7.10	119,856,239.07	356,708,080.16

所有者权益合计		850,269,830.52	1,176,462,596.87
负债和所有者权益总计		856,086,144.05	1,186,273,363.07

注：报告截止日 2011 年 12 月 31 日，基金份额净值 1.1641 元，基金份额总额 730,413,591.45 份。

7.2 利润表

会计主体：华宝兴业宝康灵活配置证券投资基金

本报告期：2011 年 1 月 1 日至 2011 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2011 年 1 月 1 日至 2011 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2010 年 1 月 1 日至 2010 年 12 月 31 日
一、收入		-184,206,065.10	-85,709,333.02
1. 利息收入		9,506,226.84	13,443,762.52
其中：存款利息收入	7.4.7.11	324,654.04	953,217.46
债券利息收入		9,181,572.80	12,490,545.06
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）		-8,394,681.64	-6,924,471.50
其中：股票投资收益	7.4.7.12	-10,123,745.65	-12,855,989.17
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.13	-6,254,738.71	-5,942,183.66
资产支持证券投资收益		-	-
衍生工具收益	7.4.7.14	-	-
股利收益	7.4.7.15	7,983,802.72	11,873,701.33
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.16	-185,649,972.68	-93,541,222.42
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.17	332,362.38	1,312,598.38
减：二、费用		17,524,870.56	28,579,628.93
1. 管理人报酬	7.4.10.2.1	13,505,460.92	18,150,711.78
2. 托管费	7.4.10.2.2	2,597,203.94	3,490,521.53
3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用	7.4.7.18	1,192,355.94	6,618,760.75
5. 利息支出		722.26	82,609.88
其中：卖出回购金融资产支出		722.26	82,609.88
6. 其他费用	7.4.7.19	229,127.50	237,024.99
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-201,730,935.66	-114,288,961.95
减：所得税费用		-	-

四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-201,730,935.66	-114,288,961.95
-------------------	--	-----------------	-----------------

7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：华宝兴业宝康灵活配置证券投资基金

本报告期：2011 年 1 月 1 日 至 2011 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2011 年 1 月 1 日至 2011 年 12 月 31 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）	819,754,516.71	356,708,080.16	1,176,462,596.87
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-201,730,935.66	-201,730,935.66
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）	-89,340,925.26	-35,120,905.43	-124,461,830.69
其中：1. 基金申购款	40,778,705.41	14,347,564.18	55,126,269.59
2. 基金赎回款	-130,119,630.67	-49,468,469.61	-179,588,100.28
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）	730,413,591.45	119,856,239.07	850,269,830.52
项目	上年度可比期间 2010 年 1 月 1 日至 2010 年 12 月 31 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）	1,144,707,920.65	682,648,896.82	1,827,356,817.47
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-114,288,961.95	-114,288,961.95
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）	-324,953,403.94	-154,730,064.91	-479,683,468.85
其中：1. 基金申购款	231,264,895.17	98,544,711.18	329,809,606.35
2. 基金赎回款	-556,218,299.11	-253,274,776.09	-809,493,075.20

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）	-	-56,921,789.80	-56,921,789.80
五、期末所有者权益（基金净值）	819,754,516.71	356,708,080.16	1,176,462,596.87

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.4 财务报表由下列负责人签署：

<u> 裴长江 </u>	<u> 黄小蕙 </u>	<u> 张幸骏 </u>
基金管理公司负责人	主管会计工作负责人	会计机构负责人

7.4 报表附注

7.4.1 基金基本情况

华宝兴业宝康系列开放式证券投资基金(以下简称“本系列基金”)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 2003 第 62 号《关于同意华宝兴业宝康系列证券投资基金设立的批复》核准,由华宝兴业基金管理有限公司依照《证券投资基金管理暂行办法》及其实施细则、《开放式证券投资基金试点办法》等有关规定和《华宝兴业宝康系列开放式证券投资基金基金契约》(后更名为《华宝兴业宝康系列开放式证券投资基金基金合同》)发起,并于 2003 年 7 月 15 日募集成立。本系列基金为契约型开放式,存续期限不定,目前下设三个子基金,分别为宝康灵活配置证券投资基金(以下简称“本基金”)、宝康消费品证券投资基金和宝康债券投资基金。本系列基金首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币 3,893,701,931.41 元,其中包括本基金人民币 1,066,581,834.53 元、宝康消费品证券投资基金人民币 1,540,046,055.09 元和宝康债券投资基金人民币 1,287,074,041.79 元,业经普华永道中天会计师事务所有限公司普华永道验字(2003)第 96 号验资报告予以验证。本基金的基金管理人为华宝兴业基金管理有限公司,基金托管人为中国建设银行股份有限公司。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《华宝兴业宝康系列开放式证券投资基金基金合同》的有关规定,本基金的投资范围为国内依法公开发行、上市的股票、债券及中国证监会批准的允许基金投资的其他金融工具。债券投资方面,主要投资交易所和银行间债券市场上的各类债券,包括国债、金融债、企业债、可转债等;股票投资方面,主要投资对象为上证 180 指数、深圳 100 指数的成分股。在正常的市场情况下,本基金组合投资的基本范围为:债券 20%-90%;股票 5%-75%;现金 5%以上。本基金的业绩比较基准为:中信标普全债指数(原名为“中信全债指数”)×65%+上证 180 指数和深圳 100 指数的复合指数×35%。

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 2012 年 3 月 26 日批准报出。

7.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于 2006 年 2 月 15 日颁布的《企业会计准则—基本准则》和 38 项具体会计准则、其后颁布的企业会计准则应用指南、企业会计准则解释以及其他相关规定(以下合称“企业会计准则”)、中国证监会公告[2010]5 号《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>》、中国证券业协会于 2007 年 5 月 15 日颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《华宝兴业宝康系列开放式证券投资基金基金合同》和在财务报表附注 7.4.4 所列示的中国证监会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2011 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 12 月 31 日的财务状况以及 2011 年度的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

7.4.4 重要会计政策和会计估计

本基金本年度所采用的会计政策上年度会计报表相一致。

7.4.4.1 会计年度

本基金会计年度为公历 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

7.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

(1) 金融资产的分类

金融资产于初始确认时分类为:以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、应收款项、可供出售金融资产及持有至到期投资。金融资产的分类取决于本基金对金融资产的持有意图和持有能力。本基金现无金融资产分类为可供出售金融资产及持有至到期投资。

本基金持有的股票投资、债券投资和衍生工具(主要为权证投资)分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。除衍生工具所产生的金融资产在资产负债表中以衍生金融资产列示外,以公允价值计量且其公允价值变动计入损益的金融资产在资产负债表中以交易性金融资产列示。

本基金持有的其他金融资产分类为应收款项,包括银行存款和各类应收款项等。应收款项是指在活跃市场中没有报价、回收金额固定或可确定的非衍生金融资产。

(2) 金融负债的分类

金融负债于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债及其他金融负债。本基金目前暂无金融负债分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。本基金持有的其他金融负债包括卖出回购金融资产款和各类应付款项等。

7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

金融资产或金融负债于本基金成为金融工具合同的一方时，于交易日按公允价值在资产负债表内确认。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，取得时发生的相关交易费用计入当期损益；对于支付的价款中包含已宣告但尚未发放的现金股利或债券起息日或上次除息日至购买日止的利息，单独确认为应收项目。应收款项和其他金融负债的相关交易费用计入初始确认金额。

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，按照公允价值进行后续计量；对于应收款项和其他金融负债采用实际利率法，以摊余成本进行后续计量。

当收取某项金融资产现金流量的合同权利已终止或该金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬已转移时，终止确认该金融资产。终止确认的金融资产的成本按移动加权平均法于交易日结转。

7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

本基金持有的股票投资、债券投资和衍生工具(主要为权证投资)按如下原则确定公允价值并进行估值：

(1) 存在活跃市场的金融工具按其估值日的市场交易价格确定公允价值；估值日无交易，但最近交易日后经济环境未发生重大变化且证券发行机构未发生影响证券价格的重大事件的，按最近交易日的市场交易价格确定公允价值。

(2) 存在活跃市场的金融工具，如估值日无交易且最近交易日后经济环境发生了重大变化，参考类似投资品种的现行市价及重大变化等因素，调整最近交易市价以确定公允价值。

(3) 当金融工具不存在活跃市场，采用市场参与者普遍认同且被以往市场实际交易价格验证具有可靠性的估值技术确定公允价值。估值技术包括参考熟悉情况并自愿交易的各方最近进行的市场交易中使用的价格、参照实质上相同的其他金融工具的当前公允价值、现金流量折现法和期权定价模型等。采用估值技术时，尽可能最大程度使用市场参数，减少使用与本基金特定相关的参数。

7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

本基金持有的资产和承担的负债基本为金融资产和金融负债。当本基金依法有权抵销债权债务且交易双方准备按净额结算时，金融资产与金融负债按抵销后的净额在资产负债表中列示。

7.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行基金份额所募集的总金额在扣除损益平准金分摊部分后的余额。由于申购和赎回引起的实收基金变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日认列。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

7.4.4.8 损益平准金

损益平准金包括已实现平准金和未实现平准金。已实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现损益占基金净值比例计算的金额。未实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未实现损益占基金净值比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日认列，并于期末全额转入未分配利润/(累计亏损)。

7.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

股票投资在持有期间应取得的现金股利扣除由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额确认为投资收益。债券投资在持有期间应取得的按票面利率或者发行价计算的利息扣除在适用情况下由债券发行企业代扣代缴的个人所得税后的净额确认为利息收入。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在持有期间的公允价值变动确认为公允价值变动损益；于处置时，其公允价值与初始确认金额之间的差额确认为投资收益，其中包括从公允价值变动损益结转的公允价值累计变动额。

应收款项在持有期间确认的利息收入按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

7.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬和托管费在费用涵盖期间按基金合同约定的费率和计算方法逐日确认。

其他金融负债在持有期间确认的利息支出按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的也可按直线法计算。

7.4.4.11 基金的收益分配政策

每一基金份额享有同等分配权。本基金收益以现金形式分配，但基金份额持有人可选择现金红利或将现金红利转为基金份额进行再投资。若期末未分配利润中的未实现部分(包括基金经营活动产生的未实现损益以及基金份额交易产生的未实现平准金等)为正数，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润中的已实现部分；若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(已实现部分相抵未实现部分后的余额)。

经宣告的拟分配基金收益于分红除权日从所有者权益转出。

7.4.4.12 分部报告

本基金以内部组织结构、管理要求、内部报告制度为依据确定经营分部，以经营分部为基础确定报告分部并披露分部信息。

经营分部是指本基金内同时满足下列条件的组成部分：(1) 该组成部分能够在日常活动中产生收入、发生费用；(2) 本基金管理人能够定期评价该组成部分的经营成果，以决定向其配置资源、评价其业绩；(3) 本基金能够取得该组成部分的财务状况、经营成果和现金流量等有关会计信息。如果两个或多个经营分部具有相似的经济特征，并且满足一定条件的，则合并为一个经营分部。

本基金目前以一个单一的经营分部运作，不需要进行分部报告的披露。

7.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计

根据本基金的估值原则和中国证监会允许的基金行业估值实务操作，本基金确定以下类别股票投资和债券投资的公允价值时采用的估值方法及其关键假设如下：

(a) 对于证券交易所上市的股票，若出现重大事项停牌等情况，本基金根据中国证监会公告[2008]38号《关于进一步规范证券投资基金估值业务的指导意见》，根据具体情况采用《中国证券业协会基金估值工作小组关于停牌股票估值的参考方法》提供的指数收益法、市盈率法等估值技术进行估值。

(b) 在银行间同业市场交易的债券品种，根据中国证监会证监会计字[2007]21号《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》采用估值技术确定公允价值。本基金持有的银行间同业市场债券按现金流量折现法估值，具体估值模型、参数及结果由中央国债登记结算有限责任公司独立提供。

7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

7.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期未发生会计政策变更。

7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

7.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期无会计差错。

7.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2004]78号《关于证券投资基金税收政策的通知》、财税[2005]102号《关于股息红利个人所得税有关政策的通知》、财税[2005]107号《关于股息红利有关个人所得税政策的补充通知》、财税[2008]1号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

- (1) 以发行基金方式募集资金不属于营业税征收范围，不征收营业税。
- (2) 基金买卖股票、债券的差价收入暂免征营业税和企业所得税。
- (3) 对基金取得的企业债券利息收入，由发行债券的企业在向基金派发利息时代扣代缴 20% 的个人所得税，暂不征收企业所得税。对基金取得的股票的股息、红利收入，由上市公司在向基金派发股息、红利时暂减按 50% 计入个人应纳税所得额，依照现行税法规定即 20% 代扣代缴个人所得税，暂不征收企业所得税。
- (4) 基金卖出股票按 0.1% 的税率缴纳股票交易印花税，买入股票不征收股票交易印花税。

7.4.7 重要财务报表项目的说明

7.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2011 年 12 月 31 日	上年度末 2010 年 12 月 31 日
活期存款	12,297,256.18	38,624,899.64
定期存款	-	-
其中：存款期限 1-3 个月	-	-
其他存款	-	-
合计：	12,297,256.18	38,624,899.64

7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2011 年 12 月 31 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	800,477,182.54	629,984,325.43	-170,492,857.11
债券	交易所市场	9,629,192.16	9,595,821.20
	银行间市场	203,074,600.00	200,175,000.00
	合计	212,703,792.16	209,770,821.20
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	1,013,180,974.70	839,755,146.63	-173,425,828.07
项目	上年度末 2010 年 12 月 31 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	810,966,304.99	831,773,156.79	20,806,851.80
债券	交易所市场	74,734,084.26	74,105,729.12
	银行间市场	239,977,352.05	232,023,000.00
	合计	314,711,436.31	306,128,729.12
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	1,125,677,741.30	1,137,901,885.91	12,224,144.61

7.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本期末及上年度末未持有衍生金融资产/负债。

7.4.7.4 买入返售金融资产

7.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本基金本期末及上年度末未持有买入返售金融资产。

7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末及上年度末均未持有买断式逆回购交易中取得的债券。

7.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2011 年 12 月 31 日	上年度末 2010 年 12 月 31 日
应收活期存款利息	3,319.59	14,062.95
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	143.45	560.78
应收债券利息	2,846,751.34	6,972,637.83
应收买入返售证券利息	-	-
应收申购款利息	0.15	0.23
其他	69.63	54.12
合计	2,850,284.16	6,987,315.91

7.4.7.6 其他资产

本基金本期末及上年度末未持有其他资产。

7.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2011年12月31日	上年度末 2010年12月31日
交易所市场应付交易费用	3,785,604.85	4,067,187.04
银行间市场应付交易费用	275.00	2,800.00
合计	3,785,879.85	4,069,987.04

7.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2011年12月31日	上年度末 2010年12月31日
应付券商交易单元保证金	500,000.00	500,000.00
应付赎回费	216.62	1,376.10
预提费用	206,666.00	206,666.00
合计	706,882.62	708,042.10

7.4.7.9 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12月31日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	819,754,516.71	819,754,516.71
本期申购	40,778,705.41	40,778,705.41
本期赎回（以“-”号填列）	-130,119,630.67	-130,119,630.67
本期末	730,413,591.45	730,413,591.45

注：申购含转换入份额；赎回含转换出份额。

7.4.7.10 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	520,193,115.20	-163,485,035.04	356,708,080.16
本期利润	-16,080,962.98	-185,649,972.68	-201,730,935.66
本期基金份额交易产生的变动数	-56,597,593.80	21,476,688.37	-35,120,905.43
其中：基金申购款	25,833,432.23	-11,485,868.05	14,347,564.18
基金赎回款	-82,431,026.03	32,962,556.42	-49,468,469.61
本期已分配利润	-	-	-
本期末	447,514,558.42	-327,658,319.35	119,856,239.07

7.4.7.11 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12月31日	上年度可比期间 2010年1月1日至2010年12月31日
活期存款利息收入	315,386.33	927,461.40
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	7,040.74	19,339.47
其他	2,226.97	6,416.59
合计	324,654.04	953,217.46

7.4.7.12 股票投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2011年1月1日至2011年12月31日	上年度可比期间 2010年1月1日至2010年12月31日
卖出股票成交总额	393,567,254.21	2,283,436,445.70
减：卖出股票成本总额	403,690,999.86	2,296,292,434.87
买卖股票差价收入	-10,123,745.65	-12,855,989.17

7.4.7.13 债券投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2011年1月1日至2011年12月31日	上年度可比期间 2010年1月1日至2010年12月31日
卖出债券（债转股及债券到	475,166,060.85	811,837,215.32

期兑付)成交总额		
减: 卖出债券(债转股及债券到期兑付)成本总额	467,788,513.15	803,805,374.66
减: 应收利息总额	13,632,286.41	13,974,024.32
债券投资收益	-6,254,738.71	-5,942,183.66

7.4.7.14 衍生工具收益

本基金本期及上年度可比期间无衍生工具收益。

7.4.7.15 股利收益

单位: 人民币元

项目	本期 2011年1月1日至2011年12月31日	上年度可比期间 2010年1月1日至2010年12月31日
股票投资产生的股利收益	7,983,802.72	11,873,701.33
基金投资产生的股利收益	-	-
合计	7,983,802.72	11,873,701.33

7.4.7.16 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12月31日	上年度可比期间 2010年1月1日至2010年12月31日
1. 交易性金融资产	-185,649,972.68	-93,541,222.42
——股票投资	-191,299,708.91	-92,508,525.80
——债券投资	5,649,736.23	-1,032,696.62
——资产支持证券投资	-	-
2. 衍生工具	-	-
——权证投资	-	-
3. 其他	-	-
合计	-185,649,972.68	-93,541,222.42

7.4.7.17 其他收入

单位: 人民币元

项目	本期 2011年1月1日至2011年12月31日	上年度可比期间 2010年1月1日至2010年12月31日
基金赎回费收入	324,317.16	1,218,366.80
转换费收入	8,045.22	89,531.00

印花税返还	-	4,700.58
合计	332,362.38	1,312,598.38

注：1. 本基金的赎回费率按持有期间递减，赎回费总额的 50% 归入基金资产。

2. 部分基金之间的转换费采用固定转换费率，转换费总额的 25% 归入转出基金的基金资产；部分基金之间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。

7.4.7.18 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2011 年 1 月 1 日至 2011 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2010 年 1 月 1 日至 2010 年 12 月 31 日
交易所市场交易费用	1,190,705.94	6,613,560.75
银行间市场交易费用	1,650.00	5,200.00
合计	1,192,355.94	6,618,760.75

7.4.7.19 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2011 年 1 月 1 日至 2011 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2010 年 1 月 1 日至 2010 年 12 月 31 日
审计费用	100,000.00	100,000.00
信息披露费	106,666.00	106,666.00
债券帐户维护费	18,000.00	18,000.00
银行费用	4,461.50	12,358.99
合计	229,127.50	237,024.99

7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

7.4.8.1 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。

7.4.8.2 资产负债表日后事项

截至本财务报表批准报出日，本基金无其它需作披露的资产负债表日后事项。

7.4.9 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（“华宝兴业”）	基金管理人、注册登记机构、基金销售机构

中国建设银行股份有限公司(“中国建设银行”)	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
宝钢集团有限公司(“宝钢集团”)	基金管理人的最终控制方

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。

7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

本基金本报告期内未通过关联方交易单位进行交易。

7.4.10.2 关联方报酬

7.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2011年1月1日至2011年12月31日	2010年1月1日至2010年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	13,505,460.92	18,150,711.78
其中：支付销售机构的客户维护费	208,498.02	261,187.36

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 1.3% 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：

$$\text{日管理人报酬} = \text{前一日基金资产净值} \times 1.3\% / \text{当年天数}。$$

7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2011年1月1日至2011年12月31日	2010年1月1日至2010年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	2,597,203.94	3,490,521.53

注：支付基金托管人中国建设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：

$$\text{日托管费} = \text{前一日基金资产净值} \times 0.25\% / \text{当年天数}。$$

7.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

单位：人民币元

本期 2011 年 1 月 1 日至 2011 年 12 月 31 日						
银行间市场交易 的各关联方名称	债券交易金额		基金逆回购		基金正回购	
	基金买入	基金卖出	交易金额	利息收入	交易金额	利息支出
中国建设银行	-	-	-	-	10,000,000.00	722.26
上年度可比期间 2010 年 1 月 1 日至 2010 年 12 月 31 日						
银行间市场交易 的各关联方名称	债券交易金额		基金逆回购		基金正回购	
	基金买入	基金卖出	交易金额	利息收入	交易金额	利息支出
中国建设银行	-	158,889,983.56	-	-	150,000,000.00	41,109.93

7.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

7.4.10.4.1 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 12 月 31 日	上年度可比期间 2010 年 1 月 1 日至 2010 年 12 月 31 日
	期初持有的基金份额	843,407.93
期间申购/买入总份额	-	26,756.16
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	843,407.93	843,407.93
期末持有的基金份额 占基金总份额比例	0.12%	0.10%

7.4.10.4.2 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

本基金本期末及上年度末无除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况。

7.4.10.5 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 2011 年 1 月 1 日至 2011 年 12 月 31 日		上年度可比期间 2010 年 1 月 1 日至 2010 年 12 月 31 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	12,297,256.18	315,386.33	38,624,899.64	927,461.40
--------	---------------	------------	---------------	------------

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。

7.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本期及上年度可比期间未在承销期内参与关联方承销证券。

7.4.10.7 其他关联交易事项的说明

本基金本期及上年度可比期间无其他关联交易事项。

7.4.11 利润分配情况

本基金本期无利润分配事项。

7.4.12 期末（2011年12月31日）本基金持有的流通受限证券

7.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

本基金本期末无因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券。

7.4.12.2 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
600132	重庆啤酒	2011年12月23日	重大事项公告	28.45	2012年1月10日	25.61	31,531	1,742,152.64	897,056.95	-
000768	西飞国际	2011年12月28日	重大资产重组	7.26	2012年1月4日	7.61	145,882	1,811,477.56	1,059,103.32	-

注：本基金截至2011年12月31日止持有以上因公布的重大事项可能产生重大影响而被暂时停牌的股票，该类股票将在所公布事项的重大影响消除后，经交易所批准复牌。

7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.12.3.1 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，因此没有在银行间市场债券正回购交易中作为抵押的债券。

7.4.12.3.2 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，因此没有在交易所市场债券正回购交易中作为抵押的债券。

7.4.13 金融工具风险及管理

7.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金是一只平衡型证券投资基金，属于风险适中、收益适中的基金品种。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相对风险控制再限定的范围之内，使本基金在风险和收益之间取得最佳的平衡以实现“相对收益高、风险适中”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、监察稽核部、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。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；监察稽核部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通过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。

7.4.13.2 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建设银行，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与中国证券登记结算有限责任公司完成证券交收和款项清算，违约风险发生的可能性很小；基

金在进行银行间同业市场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。于 2011 年 12 月 31 日，本基金未持有信用类债券。(2010 年 12 月 31 日：本基金持有的信用类债券投资市值占基金资产净值的比例为 0.42%)。

7.4.13.3 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。本基金所持大部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易，因此除在附注 7.4.12 中列示的部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况外，其余金融资产均能以合理价格适时变现。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同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。

7.4.13.4 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。

7.4.13.4.1 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及债券投资等。

7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2011 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	12,297,256.18	-	-	-	12,297,256.18
结算备付金	289,839.04	-	-	-	289,839.04
存出保证金	-	-	-	890,741.00	890,741.00
交易性金融资产	104,827,500.00	100,355,000.00	4,588,321.20	629,984,325.43	839,755,146.63
应收利息	-	-	-	2,850,284.16	2,850,284.16
应收申购款	1,988.07	-	-	888.97	2,877.04
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	117,416,583.29	100,355,000.00	4,588,321.20	633,726,239.56	856,086,144.05
负债					
应付赎回款	-	-	-	125,811.89	125,811.89
应付管理人报酬	-	-	-	972,466.40	972,466.40
应付托管费	-	-	-	187,012.77	187,012.77
应付交易费用	-	-	-	3,785,879.85	3,785,879.85
应交税费	-	-	-	38,260.00	38,260.00
其他负债	-	-	-	706,882.62	706,882.62
负债总计	-	-	-	5,816,313.53	5,816,313.53
利率敏感度缺口	117,416,583.29	100,355,000.00	4,588,321.20	627,909,926.03	850,269,830.52
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	38,624,899.64	-	-	-	38,624,899.64
结算备付金	1,456,582.31	-	-	-	1,456,582.31
存出保证金	-	-	-	1,207,722.48	1,207,722.48

交易性金融资产	250,438,004.12	51,315,000.00	4,375,725.00	831,773,156.79	1,137,901,885.91
应收利息	-	-	-	6,987,315.91	6,987,315.91
应收申购款	3,472.03	-	-	91,484.79	94,956.82
资产总计	290,522,958.10	51,315,000.00	4,375,725.00	840,059,679.97	1,186,273,363.07
负债					
应付证券清算款	-	-	-	2,784,002.83	2,784,002.83
应付赎回款	-	-	-	632,427.48	632,427.48
应付管理人报酬	-	-	-	1,323,523.07	1,323,523.07
应付托管费	-	-	-	254,523.68	254,523.68
应付交易费用	-	-	-	4,069,987.04	4,069,987.04
应交税费	-	-	-	38,260.00	38,260.00
其他负债	-	-	-	708,042.10	708,042.10
负债总计	-	-	-	9,810,766.20	9,810,766.20
利率敏感度缺口	290,522,958.10	51,315,000.00	4,375,725.00	830,248,913.77	1,176,462,596.87

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。

7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	除市场利率以外的其他市场变量保持不变		
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12月31日）	上年度末（2010年12月31日）
	1. 市场利率下降 25 个基点	增加 570,262.65	增加 690,431.09
2. 市场利率上升 25 个基点	下降 565,646.73	下降 684,177.56	

7.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无重大外汇风险。

7.4.13.4.3 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，做出资产配置及组合构建的决定；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其他价格风险。本基金投资组合中股票投资比例范围为基金资产净值的 5%-75%；债券为 20%-90%；现金比例在 5%以上。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对基金进行风险度量，包括 VaR(Value at Risk) 指标等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。

7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2011 年 12 月 31 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	629,984,325.43	74.09	831,773,156.79	70.70
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	629,984,325.43	74.09	831,773,156.79	70.70

7.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除 70%×上证 180 和深证 100 复合指数+30%×中信全债指数以外的其他市场变量保持不变		
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 12 月 31 日）	上年度末（2010 年 12 月 31 日）
	1. 除 70×上证 180 和深证 100 复合指数+30×中信全债指数上升 5%	增加 42,670,791.44	增加 84,064,854.02
2. 除 70×上证 180 和深证 100 复合指数+30×中信全债指数下降 5%	下降 42,670,791.44	下降 84,064,854.02	

7.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

(1) 公允价值

不以公允价值计量的金融工具

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括应收款项和其他金融负债，其账面价值与公允价值相差很小。

以公允价值计量的金融工具

金融工具公允价值计量的方法

根据在公允价值计量中对计量整体具有重大意义的最低层级的输入值，公允价值层级可分为：

第一层级：相同资产或负债在活跃市场上(未经调整)的报价。

第二层级：直接(比如取自价格)或间接(比如根据价格推算的)可观察到的、除第一层级中的市场报价以外的资产或负债的输入值。

第三层级：以可观察到的市场数据以外的变量为基础确定的资产或负债的输入值(不可观察输入值)。

各层次金融工具公允价值

于 2011 年 12 月 31 日，本基金持有的以公允价值计量的金融工具中属于第一层级的余额为 637,623,986.36 元，属于第二层级的余额为 202,131,160.27 元，无属于第三层级的余额(2010 年 12 月 31 日：第一层级 899,030,498.36 元，第二层级 238,871,387.55 元，无第三层级)。

公允价值所属层次间的重大变动

对于证券交易所上市的股票和债券，若出现重大事项停牌、交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)、或属于非公开发行等情况，本基金分别于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间不将相关股票和债券的公允价值列入第一层级；并根据估值调整中采用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度，确定相关股票和债券公允价值应属第二层级或第三层级。

第三层次公允价值余额和本期变动金额

于本期末，本基金未持有公允价值归属于第三层级的金融工具(2010 年 12 月 31 日：同)。本基金本期净转入/(转出)第三层级零元，计入损益的第三层级金融工具公允价值变动零元(2010 年度：无)，涉及河南双汇投资发展股份有限公司(“双汇发展”)发行的股票。

(2) 除公允价值外，截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

§ 8 投资组合报告

8.1 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	629,984,325.43	73.59
	其中：股票	629,984,325.43	73.59
2	固定收益投资	209,770,821.20	24.50
	其中：债券	209,770,821.20	24.50
	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	12,587,095.22	1.47
6	其他各项资产	3,743,902.20	0.44
7	合计	856,086,144.05	100.00

8.2 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	2,795,412.86	0.33
B	采掘业	57,546,139.91	6.77
C	制造业	250,684,871.39	29.48
C0	食品、饮料	38,686,783.61	4.55
C1	纺织、服装、皮毛	1,898,941.72	0.22
C2	木材、家具	-	-
C3	造纸、印刷	-	-
C4	石油、化学、塑胶、塑料	18,759,954.96	2.21
C5	电子	5,631,423.26	0.66
C6	金属、非金属	35,979,036.52	4.23
C7	机械、设备、仪表	122,532,565.61	14.41
C8	医药、生物制品	27,196,165.71	3.20
C99	其他制造业	-	-
D	电力、煤气及水的生产和供应业	12,632,343.90	1.49
E	建筑业	16,119,622.09	1.90
F	交通运输、仓储业	19,011,348.14	2.24
G	信息技术业	18,151,416.41	2.13
H	批发和零售贸易	32,463,605.06	3.82

I	金融、保险业	145,966,913.53	17.17
J	房地产业	26,738,465.69	3.14
K	社会服务业	37,711,949.20	4.44
L	传播与文化产业	1,209,747.16	0.14
M	综合类	8,952,490.09	1.05
	合计	629,984,325.43	74.09

8.3 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	300070	碧水源	705,944	29,282,557.12	3.44
2	002358	森源电气	972,598	19,646,479.60	2.31
3	002503	搜于特	585,574	18,141,082.52	2.13
4	600036	招商银行	1,455,857	17,281,022.59	2.03
5	600016	民生银行	2,658,872	15,660,756.08	1.84
6	601318	中国平安	391,606	13,486,910.64	1.59
7	601328	交通银行	2,847,053	12,754,797.44	1.50
8	002367	康力电梯	849,944	11,754,725.52	1.38
9	600000	浦发银行	1,310,586	11,126,875.14	1.31
10	601166	兴业银行	877,896	10,991,257.92	1.29
11	300124	汇川技术	189,279	10,258,921.80	1.21
12	600519	贵州茅台	51,229	9,902,565.70	1.16
13	601088	中国神华	384,347	9,735,509.51	1.14
14	300105	龙源技术	179,257	9,194,091.53	1.08
15	000002	万科A	1,148,951	8,582,663.97	1.01
16	300228	富瑞特装	209,574	8,529,661.80	1.00
17	601398	工商银行	1,806,988	7,661,629.12	0.90
18	600030	中信证券	769,322	7,470,116.62	0.88
19	000858	五粮液	227,064	7,447,699.20	0.88
20	600837	海通证券	951,129	7,047,865.89	0.83
21	600050	中国联通	1,087,147	5,696,650.28	0.67
22	601006	大秦铁路	713,415	5,322,075.90	0.63
23	601668	中国建筑	1,797,065	5,229,459.15	0.62
24	002497	雅化集团	404,540	5,149,794.20	0.61
25	000001	深发展A	313,343	4,885,017.37	0.57
26	601169	北京银行	510,341	4,735,964.48	0.56
27	601288	农业银行	1,796,270	4,706,227.40	0.55

28	300230	永利带业	297,791	4,535,356.93	0.53
29	601857	中国石油	460,743	4,487,636.82	0.53
30	002013	中航精机	299,892	4,471,389.72	0.53
31	600031	三一重工	348,483	4,369,976.82	0.51
32	002469	三维工程	148,050	4,337,865.00	0.51
33	600048	保利地产	417,848	4,178,480.00	0.49
34	002024	苏宁电器	493,534	4,165,426.96	0.49
35	300039	上海凯宝	200,000	4,156,000.00	0.49
36	600900	长江电力	615,625	3,915,375.00	0.46
37	000651	格力电器	223,468	3,863,761.72	0.45
38	002304	洋河股份	29,472	3,801,003.84	0.45
39	600887	伊利股份	183,595	3,750,845.85	0.44
40	600015	华夏银行	320,919	3,603,920.37	0.42
41	601899	紫金矿业	943,172	3,602,917.04	0.42
42	600028	中国石化	500,836	3,596,002.48	0.42
43	600585	海螺水泥	228,045	3,568,904.25	0.42
44	000063	中兴通讯	201,967	3,413,242.30	0.40
45	600111	包钢稀土	88,998	3,348,994.74	0.39
46	000157	中联重科	431,164	3,315,651.16	0.39
47	601628	中国人寿	177,093	3,123,920.52	0.37
48	000568	泸州老窖	80,913	3,018,054.90	0.35
49	600104	上海汽车	201,005	2,842,210.70	0.33
50	600256	广汇股份	137,521	2,830,182.18	0.33
51	000527	美的电器	231,110	2,828,786.40	0.33
52	000423	东阿阿胶	64,786	2,782,558.70	0.33
53	000338	潍柴动力	88,188	2,777,922.00	0.33
54	601989	中国重工	528,154	2,698,866.94	0.32
55	600999	招商证券	261,064	2,657,631.52	0.31
56	000983	西山煤电	180,965	2,642,089.00	0.31
57	600383	金地集团	533,625	2,641,443.75	0.31
58	600795	国电电力	930,521	2,596,153.59	0.31
59	000895	双汇发展	36,786	2,573,180.70	0.30
60	000792	盐湖股份	76,430	2,443,467.10	0.29
61	600547	山东黄金	85,930	2,439,552.70	0.29
62	600089	特变电工	312,901	2,403,079.68	0.28
63	601988	中国银行	820,029	2,394,484.68	0.28
64	000069	华侨城A	330,191	2,357,563.74	0.28
65	601699	潞安环能	108,902	2,304,366.32	0.27
66	000776	广发证券	109,509	2,299,689.00	0.27

67	601009	南京银行	245,753	2,280,587.84	0.27
68	600406	国电南瑞	72,052	2,248,022.40	0.26
69	601600	中国铝业	349,847	2,246,017.74	0.26
70	002375	亚厦股份	100,000	2,185,000.00	0.26
71	601168	西部矿业	227,398	2,130,719.26	0.25
72	600348	阳泉煤业	139,682	2,120,372.76	0.25
73	600362	江西铜业	93,199	2,043,854.07	0.24
74	601766	中国南车	461,229	1,997,121.57	0.23
75	600276	恒瑞医药	67,819	1,996,591.36	0.23
76	600518	康美药业	177,101	1,987,073.22	0.23
77	600489	中金黄金	111,744	1,956,637.44	0.23
78	600739	辽宁成大	156,855	1,927,747.95	0.23
79	601898	中煤能源	212,535	1,914,940.35	0.23
80	600875	东方电气	78,626	1,817,046.86	0.21
81	600068	葛洲坝	231,255	1,780,663.50	0.21
82	000402	金融街	291,024	1,760,695.20	0.21
83	000538	云南白药	32,914	1,744,442.00	0.21
84	601299	中国北车	395,868	1,682,439.00	0.20
85	601788	光大证券	159,569	1,627,603.80	0.19
86	601390	中国中铁	627,123	1,580,349.96	0.19
87	600309	烟台万华	122,037	1,574,277.30	0.19
88	600690	青岛海尔	175,864	1,570,465.52	0.18
89	600188	兖州煤业	68,906	1,542,805.34	0.18
90	600642	申能股份	336,098	1,542,689.82	0.18
91	601688	华泰证券	196,800	1,538,976.00	0.18
92	601618	中国中冶	572,331	1,510,953.84	0.18
93	600123	兰花科创	38,492	1,496,568.96	0.18
94	600177	雅戈尔	157,304	1,475,511.52	0.17
95	601666	平煤股份	139,481	1,474,314.17	0.17
96	600005	武钢股份	498,777	1,441,465.53	0.17
97	002073	软控股份	94,900	1,435,837.00	0.17
98	600100	同方股份	162,869	1,433,247.20	0.17
99	000024	招商地产	79,042	1,422,756.00	0.17
100	600009	上海机场	115,387	1,412,336.88	0.17
101	000009	中国宝安	129,021	1,406,328.90	0.17
102	000060	中金岭南	169,905	1,398,318.15	0.16
103	000630	铜陵有色	83,080	1,396,574.80	0.16
104	601186	中国铁建	368,295	1,395,838.05	0.16
105	601818	光大银行	481,600	1,387,008.00	0.16

106	000709	河北钢铁	482,107	1,378,826.02	0.16
107	000623	吉林敖东	67,577	1,377,895.03	0.16
108	000937	冀中能源	81,242	1,369,740.12	0.16
109	000425	徐工机械	95,145	1,352,961.90	0.16
110	600600	青岛啤酒	40,397	1,352,491.56	0.16
111	601998	中信银行	333,059	1,345,558.36	0.16
112	600271	航天信息	66,665	1,323,966.90	0.16
113	601958	金铂股份	115,701	1,316,677.38	0.15
114	000869	张裕A	12,100	1,305,590.00	0.15
115	600660	福耀玻璃	162,612	1,304,148.24	0.15
116	600583	海油工程	237,086	1,303,973.00	0.15
117	601919	中国远洋	277,750	1,299,870.00	0.15
118	600143	金发科技	100,422	1,298,456.46	0.15
119	000012	南玻A	142,866	1,294,365.96	0.15
120	600535	天士力	30,777	1,290,787.38	0.15
121	000825	太钢不锈	344,980	1,286,775.40	0.15
122	000725	京东方A	739,585	1,264,690.35	0.15
123	601607	上海医药	113,688	1,259,663.04	0.15
124	002142	宁波银行	135,741	1,243,387.56	0.15
125	000039	中集集团	96,190	1,236,041.50	0.15
126	600150	中国船舶	47,676	1,234,808.40	0.15
127	601111	中国国航	193,831	1,234,703.47	0.15
128	601727	上海电气	240,548	1,226,794.80	0.14
129	600010	包钢股份	297,603	1,226,124.36	0.14
130	002202	金风科技	158,083	1,225,143.25	0.14
131	000878	云南铜业	74,888	1,205,696.80	0.14
132	600415	小商品城	153,282	1,201,730.88	0.14
133	601333	广深铁路	334,368	1,176,975.36	0.14
134	600694	大商股份	34,943	1,162,903.04	0.14
135	000783	长江证券	162,201	1,159,737.15	0.14
136	600029	南方航空	242,515	1,149,521.10	0.14
137	600655	豫园商城	137,015	1,148,185.70	0.14
138	000401	冀东水泥	68,740	1,145,895.80	0.13
139	600058	五矿发展	52,190	1,143,482.90	0.13
140	000100	TCL 集团	608,416	1,119,485.44	0.13
141	000933	神火股份	120,771	1,115,924.04	0.13
142	000422	湖北宜化	61,088	1,078,203.20	0.13
143	600741	华域汽车	115,629	1,070,724.54	0.13
144	000768	西飞国际	145,882	1,059,103.32	0.12

145	600115	东方航空	274,383	1,042,655.40	0.12
146	600881	亚泰集团	218,951	1,037,827.74	0.12
147	601106	中国一重	325,006	1,033,519.08	0.12
148	601808	中海油服	70,550	1,022,269.50	0.12
149	600832	东方明珠	193,601	1,022,213.28	0.12
150	000898	鞍钢股份	224,009	1,019,240.95	0.12
151	000969	安泰科技	61,445	1,017,529.20	0.12
152	600085	同仁堂	72,515	1,017,385.45	0.12
153	600497	驰宏锌锗	77,516	1,013,134.12	0.12
154	600125	铁龙物流	107,354	996,245.12	0.12
155	600153	建发股份	155,768	993,799.84	0.12
156	600320	振华重工	210,166	987,780.20	0.12
157	600267	海正药业	30,900	981,693.00	0.12
158	600196	复星医药	114,363	976,660.02	0.11
159	000729	燕京啤酒	72,392	976,568.08	0.11
160	600809	山西汾酒	15,385	971,408.90	0.11
161	600066	宇通客车	41,022	970,580.52	0.11
162	600859	王府井	30,100	966,511.00	0.11
163	601001	大同煤业	78,985	960,457.60	0.11
164	600549	厦门钨业	32,255	957,005.85	0.11
165	601117	中国化学	164,412	937,148.40	0.11
166	000758	中色股份	54,269	935,054.87	0.11
167	600550	天威保变	81,972	916,446.96	0.11
168	000960	锡业股份	50,847	905,585.07	0.11
169	600804	鹏博士	155,600	904,036.00	0.11
170	600582	天地科技	48,865	904,002.50	0.11
171	600132	重庆啤酒	31,531	897,056.95	0.11
172	000528	柳 工	76,222	889,510.74	0.10
173	600811	东方集团	162,006	889,412.94	0.10
174	600219	南山铝业	139,713	884,383.29	0.10
175	600588	用友软件	49,107	883,926.00	0.10
176	600893	航空动力	64,900	881,991.00	0.10
177	000778	新兴铸管	134,428	858,994.92	0.10
178	002001	新 和 成	43,088	847,110.08	0.10
179	600166	福田汽车	145,178	843,484.18	0.10
180	002007	华兰生物	33,678	842,286.78	0.10
181	600376	首开股份	86,930	833,658.70	0.10
182	000800	一汽轿车	92,207	816,031.95	0.10
183	600664	哈药股份	110,770	811,944.10	0.10

184	600779	水井坊	38,552	811,905.12	0.10
185	000999	华润三九	46,893	811,248.90	0.10
186	000876	新希望	48,394	810,599.50	0.10
187	600108	亚盛集团	165,305	809,994.50	0.10
188	600997	开滦股份	72,563	808,351.82	0.10
189	600649	城投控股	134,076	807,137.52	0.09
190	601101	昊华能源	46,451	805,460.34	0.09
191	601888	中国国旅	30,378	796,814.94	0.09
192	000625	长安汽车	207,201	783,219.78	0.09
193	000839	中信国安	116,861	781,800.09	0.09
194	601179	中国西电	211,135	781,199.50	0.09
195	000728	国元证券	91,830	780,555.00	0.09
196	600395	盘江股份	37,519	774,767.35	0.09
197	600118	中国卫星	37,589	766,815.60	0.09
198	600703	三安光电	69,529	759,951.97	0.09
199	002155	辰州矿业	37,679	756,217.53	0.09
200	600208	新潮中宝	220,060	752,605.20	0.09
201	601018	宁波港	306,300	732,057.00	0.09
202	600598	北大荒	84,246	729,570.36	0.09
203	600635	大众公用	158,914	729,415.26	0.09
204	000562	宏源证券	67,492	723,514.24	0.09
205	601918	国投新集	64,769	720,878.97	0.08
206	002422	科伦药业	16,525	717,185.00	0.08
207	601866	中海集运	293,299	712,716.57	0.08
208	600827	友谊股份	62,650	712,330.50	0.08
209	600808	马钢股份	285,677	708,478.96	0.08
210	002106	莱宝高科	42,000	703,920.00	0.08
211	600718	东软集团	85,971	699,803.94	0.08
212	600331	宏达股份	83,946	698,430.72	0.08
213	600352	浙江龙盛	121,868	697,084.96	0.08
214	601158	重庆水务	115,924	696,703.24	0.08
215	600008	首创股份	132,419	688,578.80	0.08
216	000061	农产品	61,569	686,494.35	0.08
217	600216	浙江医药	33,891	674,091.99	0.08
218	600018	上港集团	259,090	671,043.10	0.08
219	600516	方大炭素	74,864	655,808.64	0.08
220	600266	北京城建	52,511	650,611.29	0.08
221	600517	置信电气	43,861	645,195.31	0.08
222	600062	双鹤药业	41,151	641,955.60	0.08

223	600312	平高电气	76,834	641,563.90	0.08
224	600970	中材国际	40,703	641,479.28	0.08
225	600221	海南航空	142,619	638,933.12	0.08
226	600169	太原重工	111,657	635,328.33	0.07
227	002069	獐子岛	25,800	633,648.00	0.07
228	600508	上海能源	33,662	630,489.26	0.07
229	600037	歌华有线	78,884	630,283.16	0.07
230	002128	露天煤业	46,977	629,491.80	0.07
231	600812	华北制药	96,374	624,503.52	0.07
232	600879	航天电子	75,938	623,450.98	0.07
233	601118	海南橡胶	91,500	622,200.00	0.07
234	600839	四川长虹	290,549	621,774.86	0.07
235	600895	张江高科	90,412	613,897.48	0.07
236	600717	天津港	100,940	610,687.00	0.07
237	600546	山煤国际	24,925	604,431.25	0.07
238	002310	东方园林	6,900	598,575.00	0.07
239	000680	山推股份	66,595	598,023.10	0.07
240	600418	江淮汽车	100,012	596,071.52	0.07
241	600863	内蒙华电	70,066	581,547.80	0.07
242	601098	中南传媒	64,100	579,464.00	0.07
243	000027	深圳能源	94,811	578,347.10	0.07
244	002146	荣盛发展	65,647	577,693.60	0.07
245	000559	万向钱潮	98,300	556,378.00	0.07
246	600316	洪都航空	33,312	554,644.80	0.07
247	600269	赣粤高速	143,620	545,756.00	0.06
248	600500	中化国际	85,177	544,281.03	0.06
249	600096	云天化	36,005	535,754.40	0.06
250	601933	永辉超市	17,600	530,640.00	0.06
251	600595	中孚实业	91,638	529,667.64	0.06
252	000807	云铝股份	106,673	524,831.16	0.06
253	000059	辽通化工	68,524	520,782.40	0.06
254	600674	川投能源	45,740	512,288.00	0.06
255	600369	西南证券	59,036	509,480.68	0.06
256	002092	中泰化学	67,149	502,946.01	0.06
257	600161	天坛生物	30,799	495,247.92	0.06
258	000718	苏宁环球	92,931	486,958.44	0.06
259	002415	海康威视	11,176	480,568.00	0.06
260	000780	平庄能源	46,434	478,270.20	0.06
261	600432	吉恩镍业	38,474	474,384.42	0.06

262	002399	海普瑞	19,086	471,424.20	0.06
263	600183	生益科技	64,612	466,498.64	0.05
264	601718	际华集团	135,300	462,726.00	0.05
265	002122	天马股份	70,320	455,673.60	0.05
266	600026	中海发展	75,750	448,440.00	0.05
267	000690	宝新能源	146,185	445,864.25	0.05
268	600528	中铁二局	89,381	440,648.33	0.05
269	600971	恒源煤电	33,257	439,990.11	0.05
270	601369	陕鼓动力	38,209	437,875.14	0.05
271	601377	兴业证券	46,800	435,240.00	0.05
272	000612	焦作万方	39,704	431,582.48	0.05
273	600239	云南城投	67,011	431,550.84	0.05
274	600456	宝钛股份	23,639	430,702.58	0.05
275	600675	中华企业	115,154	429,524.42	0.05
276	002493	荣盛石化	24,800	423,832.00	0.05
277	600823	世茂股份	40,526	423,496.70	0.05
278	600220	江苏阳光	148,572	423,430.20	0.05
279	600151	航天机电	57,810	416,232.00	0.05
280	000968	煤气化	29,202	416,128.50	0.05
281	600428	中远航运	100,946	415,897.52	0.05
282	600170	上海建工	46,778	414,920.86	0.05
283	000951	中国重汽	33,659	414,342.29	0.05
284	000031	中粮地产	107,523	408,587.40	0.05
285	000021	长城开发	76,979	394,902.27	0.05
286	600300	维维股份	101,962	392,553.70	0.05
287	002028	思源电气	30,410	377,084.00	0.04
288	601717	郑煤机	15,000	373,050.00	0.04
289	600380	健康元	62,165	367,395.15	0.04
290	600307	酒钢宏兴	95,853	360,407.28	0.04
291	600737	中粮屯河	59,361	356,759.61	0.04
292	000927	一汽夏利	58,370	356,640.70	0.04
293	002500	山西证券	54,700	353,909.00	0.04
294	000686	东北证券	28,328	351,267.20	0.04
295	600481	双良节能	46,673	344,446.74	0.04
296	600109	国金证券	34,476	342,001.92	0.04
297	000961	中南建设	40,586	341,734.12	0.04
298	600998	九州通	32,793	340,719.27	0.04
299	600004	白云机场	54,275	335,962.25	0.04
300	002244	滨江集团	46,200	327,558.00	0.04

301	002294	信立泰	13,249	321,023.27	0.04
302	002385	大北农	9,800	318,500.00	0.04
303	601558	华锐风电	19,000	297,160.00	0.03
304	000685	中山公用	20,560	293,596.80	0.03
305	601268	二重重装	40,729	287,546.74	0.03
306	002498	汉缆股份	16,300	267,320.00	0.03
307	601107	四川成渝	76,505	265,472.35	0.03
308	002405	四维图新	11,244	225,779.52	0.03
309	000536	华映科技	16,010	214,534.00	0.03
310	601519	大智慧	14,800	161,024.00	0.02

注：“上海汽车”于2012年1月9日更名“上汽集团”。

8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

8.4.1 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	300124	汇川技术	21,550,373.26	1.83
2	300083	劲胜股份	20,544,660.23	1.75
3	002503	搜于特	20,263,468.80	1.72
4	600703	三安光电	16,942,796.92	1.44
5	300105	龙源技术	12,946,377.55	1.10
6	002013	中航精机	12,231,602.04	1.04
7	300070	碧水源	12,073,126.91	1.03
8	002217	联合化工	9,963,682.99	0.85
9	300228	富瑞特装	8,142,140.70	0.69
10	002497	雅化集团	7,001,762.00	0.60
11	300082	奥克股份	6,581,851.80	0.56
12	002427	尤夫股份	6,388,215.88	0.54
13	601678	滨化股份	5,647,830.00	0.48
14	300003	乐普医疗	5,498,572.72	0.47
15	300230	永利带业	5,154,070.72	0.44
16	300039	上海凯宝	4,868,246.40	0.41
17	002324	普利特	4,845,360.42	0.41
18	002469	三维工程	4,357,673.50	0.37
19	000776	广发证券	4,241,269.63	0.36

20	600837	海通证券	4, 113, 447. 87	0. 35
----	--------	------	-----------------	-------

注：买入金额不包括相关交易费用。

8.4.2 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	600703	三安光电	27, 609, 426. 35	2. 35
2	002454	松芝股份	17, 565, 947. 53	1. 49
3	300083	劲胜股份	15, 955, 680. 85	1. 36
4	002303	美盈森	15, 041, 263. 08	1. 28
5	002367	康力电梯	14, 397, 325. 35	1. 22
6	300124	汇川技术	10, 417, 936. 02	0. 89
7	002217	联合化工	10, 148, 243. 11	0. 86
8	002042	华孚色纺	9, 929, 063. 43	0. 84
9	002013	中航精机	9, 756, 858. 10	0. 83
10	002427	尤夫股份	9, 085, 330. 98	0. 77
11	002051	中工国际	8, 753, 868. 93	0. 74
12	300082	奥克股份	8, 311, 695. 10	0. 71
13	300003	乐普医疗	8, 205, 561. 13	0. 70
14	600844	丹化科技	7, 608, 635. 96	0. 65
15	002169	智光电气	7, 539, 514. 81	0. 64
16	600095	哈高科	6, 817, 540. 42	0. 58
17	002100	天康生物	6, 608, 073. 58	0. 56
18	601678	滨化股份	6, 584, 022. 40	0. 56
19	300024	机器人	6, 304, 125. 66	0. 54
20	002092	中泰化学	5, 913, 117. 63	0. 50

注：卖出金额不包括相关交易费用。

8.4.3 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	393, 201, 877. 41
卖出股票收入（成交）总额	393, 567, 254. 21

注：买入股票成本、卖出股票收入均不包括相关交易费用。

8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
----	------	------	---------------

1	国家债券	9,595,821.20	1.13
2	央行票据	99,065,000.00	11.65
3	金融债券	101,110,000.00	11.89
	其中：政策性金融债	101,110,000.00	11.89
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债	-	-
8	其他	-	-
9	合计	209,770,821.20	24.67

8.6 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

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	080215	08 国开 15	500,000	50,880,000.00	5.98
2	110249	11 国开 49	500,000	50,230,000.00	5.91
3	1101077	11 央行票据 77	500,000	49,590,000.00	5.83
4	1001042	10 央行票据 42	500,000	49,475,000.00	5.82
5	010203	02 国债(3)	50,000	5,007,500.00	0.59

8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名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。

8.8 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。

8.9 投资组合报告附注

8.9.1 基金管理人没有发现本基金投资的前十名证券的发行主体在报告期内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。

8.9.2 本基金股票主要投资对象为上证 180 指数、深证 100 指数的成分股。本基金投资的前十名股票均为合同规定的成分股。

8.9.3 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	890,741.00
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	2,850,284.16
5	应收申购款	2,877.04
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	3,743,902.20

8.9.4 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处于转股期的可转换债券。

8.9.5 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未存在流通受限情况。

§ 9 基金份额持有人信息

9.1 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
38,769	18,840.15	112,135,797.30	15.35%	618,277,794.15	84.65%

9.2 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	573,343.60	0.0785%

§ 10 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日(2003年7月15日)基金份额总额	1,067,242,501.27
本报告期期初基金份额总额	819,754,516.71
本报告期基金总申购份额	40,778,705.41

减:本报告期基金总赎回份额	130,119,630.67
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	730,413,591.45

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。

§ 11 重大事件揭示

11.1 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。

11.2 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、本基金管理人于 2011 年 4 月 9 日发布公告，聘任谢文杰先生为公司副总经理，其任职资格已经过中国证监会审核批准。

2、本基金托管人 2011 年 2 月 9 日发布公告，经中国建设银行研究决定，聘任杨新丰为中国建设银行投资托管服务部副总经理（主持工作），其任职资格已经中国证监会审核批准（证监许可〔2011〕115 号）。解聘罗中涛中国建设银行投资托管服务部总经理职务。本基金托管人 2011 年 1 月 31 日发布任免通知，解聘李春信中国建设银行投资托管服务部副总经理职务。本基金托管人 2011 年 10 月 24 日发布任免通知，聘任张军红为中国建设银行投资托管服务部副总经理。

11.3 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。

11.4 基金投资策略的改变

本基金的投资策略在报告期内未发生变更。

11.5 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在本报告期的审计报酬为 100,000.00 元人民币。目前该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（2003 年 7 月 15 日）起至本报告期末。

11.6 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。

11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

11.7.1 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	
华泰联合	1	274,217,180.79	35.01%	222,802.96	34.42%	-
中信建投	1	216,251,688.13	27.61%	175,706.14	27.15%	-
平安证券	1	173,315,922.31	22.13%	147,319.40	22.76%	-
东方证券	1	88,962,273.45	11.36%	75,617.68	11.68%	-
中银国际	1	18,279,149.38	2.33%	15,537.39	2.40%	-
申银万国	1	10,362,205.85	1.32%	8,807.68	1.36%	-
招商证券	1	1,758,021.00	0.22%	1,494.34	0.23%	-
国元证券	1	-	-	-	-	-

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、本基金本报告期券商交易单元无变更情况。

11.7.2 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
华泰联合	-	-	-	-	-	-
中信建投	105,101.83	0.05%	-	-	-	-
平安证券	75,495,668.00	34.17%	-	-	-	-
东方证券	25,622,740.70	11.60%	-	-	-	-

中银国际	74,824,162.20	33.87%	-	-	-	-
申银万国	5,934,766.00	2.69%	-	-	-	-
招商证券	38,962,903.00	17.63%	-	-	-	-
国元证券	-	-	-	-	-	-

11.8 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旗下部分开放式基金参加中国工商银行“2012 倾心回馈”基金定投优惠活动的公告	《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 12 月 31 日
2	华宝兴业基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金参加中国农业银行网上银行基金申购费率优惠活动的公告	《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 12 月 31 日
3	华宝兴业基金管理有限公司关于旗下部分基金参加华夏银行网上银行申购和定期定额申购费率优惠活动的公告	《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 12 月 30 日
4	华宝兴业基金管理有限公司关于变更分红方式业务规则的公告	《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 12 月 24 日
5	华宝兴业基金管理有限公司关于旗下部分基金参加江苏银行网上银行基金申购费率优惠活动的公告	《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 11 月 30 日
6	华宝兴业基金管理有限公司关于旗下部分基金增加民生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 11 月 7 日

		网站	
7	华宝兴业基金管理有限公司关于参加华宝证券网上开放式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 9 月 1 日
8	华宝兴业基金管理有限公司关于网上直销工商银行卡交易费率调整的公告	《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 8 月 9 日
9	华宝兴业基金管理有限公司关于旗下部分基金参加申银万国证券申购费率优惠活动并开通定投业务的公告	《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 7 月 5 日
10	华宝兴业宝康系列证券投资基金资产净值公告	《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 7 月 1 日
11	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
12	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
13	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

14	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
15	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
16	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
17	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

§ 12 影响投资者决策的其他重要信息

1、2011 年 10 月 28 日，托管人中国建设银行股份有限公司发布关于董事长辞任的公告，根据国家金融工作的需要，郭树清先生已向中国建设银行股份有限公司（“本行”）董事会（“董事会”）提出辞呈，请求辞去本行董事长、执行董事等职务。根据《中华人民共和国公司法》等相关法律法规和本行章程的规定，郭树清先生的辞任自辞呈送达本行董事会之日起生效。 2、2012 年 1 月 16 日，托管人中国建设银行股份有限公司发布关于董事长任职的公告，自 2012 年 1 月 16 日起，王洪章先生就任本行董事长、执行董事。

§ 13 备查文件目录

13.1 备查文件目录

中国证监会批准基金设立的文件；

华宝兴业宝康系列开放式证券投资基金基金合同；
华宝兴业宝康系列开放式证券投资基金招募说明书；
华宝兴业宝康系列开放式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。

13.2 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。

13.3 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
2012 年 3 月 29 日