

# 华宝兴业行业精选股票型证券投资基金 2012 年半年度报告

2012 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：中国建设银行股份有限公司

送出日期：2012 年 8 月 27 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根据本基金合同规定，于 2012 年 8 月 20 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 2012 年 01 月 01 日起至 06 月 30 日止。

## 1.2 目录

<b>§1 重要提示及目录</b> .....	<b>2</b>
1.1 重要提示.....	2
1.2 目录.....	3
<b>§2 基金简介</b> .....	<b>5</b>
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
<b>§3 主要财务指标和基金净值表现</b> .....	<b>6</b>
3.1 主要会计数据和财务指标.....	6
3.2 基金净值表现.....	7
<b>§4 管理人报告</b> .....	<b>8</b>
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.....	13
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.....	13
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	14
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	14
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	14
<b>§5 托管人报告</b> .....	<b>15</b>
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 托管人对本半年度报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见.....	15
<b>§6 半年度财务会计报告（未经审计）</b> .....	<b>15</b>
6.1 资产负债表.....	15
6.2 利润表.....	16
6.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	17
6.4 报表附注.....	19
<b>§7 投资组合报告</b> .....	<b>34</b>
7.1 期末基金资产组合情况.....	34
7.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	35
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.....	36
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	45
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	46
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.....	47
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.....	47
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.....	47
7.9 投资组合报告附注.....	47
<b>§8 基金份额持有人信息</b> .....	<b>48</b>
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	48
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	48

<b>§9 开放式基金份额变动</b> .....	<b>49</b>
<b>§10 重大事件揭示</b> .....	<b>49</b>
10.1 基金份额持有人大会决议.....	49
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.....	49
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	49
10.4 基金投资策略的改变.....	49
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	50
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.....	50
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	50
10.8 其他重大事件.....	53
<b>§11 影响投资者决策的其他重要信息</b> .....	<b>54</b>
<b>§12 备查文件目录</b> .....	<b>54</b>
12.1 备查文件目录.....	54
12.2 存放地点.....	55
12.3 查阅方式.....	55

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	华宝兴业行业精选股票型证券投资基金
基金简称	华宝兴业行业精选股票
基金主代码	240010
交易代码	240010
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2007 年 6 月 14 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	12,309,761,754.85 份
基金合同存续期	不定期

### 2.2 基金产品说明

投资目标	把握行业发展趋势和市场运行趋势，精选增长前景良好或周期复苏的行业和企业，在控制风险的前提下，追求基金净值的稳定增长和基金资产的长期增值。
投资策略	本基金将通过分析宏观经济、产业政策和行业景气程度，精选发展前景良好或景气程度向好的行业，通过行业估值模型与波特五力分析，加强对有吸引力行业的配置。在行业配置比例确定后，本基金将对基金管理人股票库相关精选行业的股票运用定量指标筛选排名靠前的股票，并进行定性分析，确定最终投资组合。
业绩比较基准	沪深 300 指数收益率
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	上海浦东新区世纪大道 100 号上海环球金融中心 58 楼	北京市西城区金融大街 25 号
办公地址	上海浦东新区世纪大道 100 号上海环球金融中心 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 100 号环球金融中心 58 楼
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

## § 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(2012 年 1 月 1 日 - 2012 年 6 月 30 日)
本期已实现收益	-134,235,633.37
本期利润	1,209,239,008.68
加权平均基金份额本期利润	0.0969
本期加权平均净值利润率	11.45%
本期基金份额净值增长率	12.12%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2012 年 6 月 30 日)
期末可供分配利润	-2,672,086,767.24
期末可供分配基金份额利润	-0.2171
期末基金资产净值	10,865,034,912.89

期末基金份额净值	0.8826
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2012年6月30日)
基金份额累计净值增长率	-11.74%

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、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、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。

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

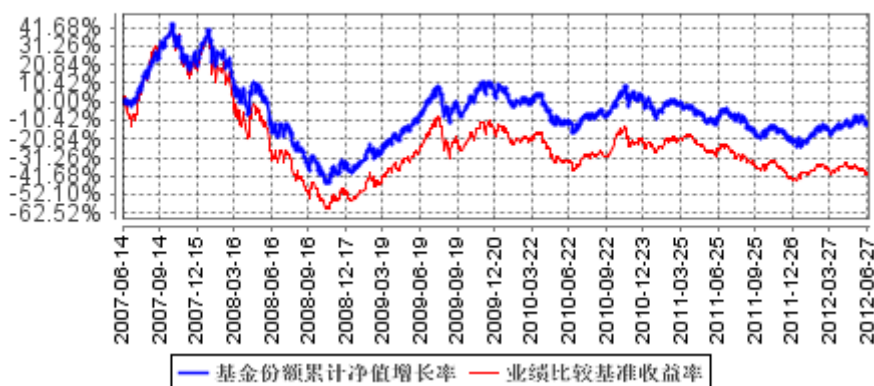
### 3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

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
过去一个月	-3.53%	1.14%	-6.48%	1.09%	2.95%	0.05%
过去三个月	7.99%	1.09%	0.27%	1.12%	7.72%	-0.03%
过去六个月	12.12%	1.22%	4.94%	1.33%	7.18%	-0.11%
过去一年	-4.49%	1.15%	-19.13%	1.35%	14.64%	-0.20%
过去三年	-7.07%	1.32%	-22.26%	1.57%	15.19%	-0.25%
自基金合同生效日起至 今	-11.74%	1.62%	-40.23%	2.06%	28.49%	-0.44%

注：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 2007 年 12 月 14 日，本基金已达到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（2012 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、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、华宝兴业医药生物、华宝短融 50，所管理的开放式证券投资基金资产净值合计 36,429,945,714.42 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		
任志强	公司副总经理、投资总监、本基金基金经理	2007年9月7日	-	15年	硕士，1995年3月至1997年3月就职于上海市外高桥保税区开发（控股）



				<p>公司期货部；1997年4月至1999年2月任职于中国南方证券有限公司，从事证券研究工作。1999年3月至2006年10月在华宝信托投资有限责任公司工作，曾担任研究员、研发中心总经理助理、研发中心总经理、投资管理部总经理、公司总裁助理、公司董事会秘书等职务。2006年10月至2007年8月任华宝证券经纪有限公司董事、副总经理。2007年8月加入华宝兴业基金管理有限公司，任投资总监，2007</p>
--	--	--	--	--

					年 9 月至 今兼任华 宝兴业行 业精选股 票型证券 投资基金 基金经 理，2009 年 6 月任 命为公司 副 总 经 理。
蒋宁	本基金基 金经理	2010年7月3 日	-	17 年	硕 士 ， 1995 年 至 1996 年任 职于上海 万国证券 公司证券 投资总部 从事证券 研 究 工 作，1996 年 至 2010 年 3 月任 职于申银 万国证券 公司证券 投资及金 融衍生品 总部从事 证 券 投 资、研 究 工 作 。 2010 年 4 月加入华 宝兴业基 金管理有 限公司任 华宝兴业 行业精选 股票型证 券投资基 金基金经 理助理， 2010 年 7

					月至今任华宝兴业行业精选股票型证券投资基金基金经理，2012年4月起任投资副总监。
李靖	本基金基金经理、华宝兴业先进成长股票基金经理	2010年9月4日	2012年1月19日	12年	博士，1999年至2000年任和君创业投资有限公司研究员，2000年至2010年在光大证券有限公司先后任行业研究员、策略研究员、投资经理和定向理财部副总经理的职务。2010年7月加入华宝兴业基金管理有限公司任华宝兴业行业精选股票型证券投资基金基金经理助理，2010年9月至2012年1月任华宝兴业行业精选

					股票型证券投资基金基金经理，2011年2月起兼任华宝兴业先进成长股票型证券投资基金基金经理。
沈梦圆	本基金基金经理助理、华宝兴业增强收益债券基金经理助理	2009年11月23日	-	4年	硕士，2008年加入华宝兴业基金管理有限公司任研究部分析师，2009年11月至今任华宝兴业行业精选股票基金经理助理，2010年12月起兼任华宝兴业增强收益债券型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、《华宝兴业行业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。

### 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，基金管理人通过严格执行投资决策委员会议事规则、公司股票库管理制度、中央交易室制度、防火墙机制、系统中的公平交易程序、每日交易日结报告、定期基金投资绩效评价等机制，确保所管理的所有投资组合在授权、研究分析、投资决策、交易执行、业绩评估等投资管理活动和环节得到公平对待。同时，基金管理人严格遵守法律法规关于公平交易的相关规定和公司内部制度要求，分析了本基金与公司旗下所有其他投资组合之间的整体收益率差异、分投资类别（股票、债券）的收益率差异以及连续四个季度期间内、不同时间窗下同向交易的交易价差；分析结果未发现异常情况。

#### 4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内，基金管理人未发生所有投资组合参与的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的 5%。

本报告期内，本基金未发现异常交易行为。

### 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

2012 年上半年, A 股市场呈现大幅震荡. 对于后续政策宽松的乐观预期主导了市场. 股指整体出现了一波上扬. 但此后, 政策放松的步调慢于预期, 经济数据对于市场情绪的打击严重, 周期复苏的逻辑开始受到质疑. 加之上市公司业绩大面积低于预期, 市场预期被迫大幅修正, 同时, 海外新一轮欧债风波又开始演绎. 股指回落整理。

总体看, 市场在惨淡的经济数据和不断摆动的投资者预期之间的作用下, 处于震荡向下寻底的状态。

在政策面、基本面的实际情况和市场预期存在时间落差的情况下, 基金一季度主要加大了对周期类个股的波段操作力度。 二季度的市场情况更为恶劣, 基本呈现单边下行走势。基金在 2300 点以下大幅加仓, 并在 5 月初的高点进行了小幅降仓, 待到市场出现明显回落, 悲观情绪开始扩散时再次提高仓位配置。末次增仓的重点品种集中在长期看好的优质个股, 以及受益于政策, 基本面向好的板块。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截止至本报告期末，本报告期内基金份额净值增长率为 12.12%，业绩比较基准增长率为 4.94%，基金表现领先业绩比较基准 7.18%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

我们认为，大周期上，目前仍然处于衰退的阶段，中报公布期可能还会经历盈利预测的再一次下调，上市公司 ROE 处于持续下滑阶段。受三季度经济依旧底部徘徊的影响，不排除部分公司的业绩在后期继续低于预期。因此，市场存在向下创新低可能。

和 08 年不同的是，更大程度上，我们面对的问题是，需要在底部徘徊多久，而不是底部离目前还有多远。除非政府再次推出大规模的政策性刺激（我们认为概率不大），否则股市出现 V 型反转的走势目前看来并不现实。我们目前需要做的，是不过多的期待政策性的脉冲式刺激，做好打持久战的准备，精选个股，找出在未来真正具备发展前景的行业和公司。在这个阶段，经济仍然下滑，政策和基本面尚未形成共振，投资者信息低迷，正是长线资金布局未来的良好时机。

基于以上对后市的判断，我们目前积极研究，谨慎操作。继续对于周期性个股采取波段操作的思路，在大盘泥沙俱下的阶段，精选质地优良、业绩符合甚至不断超越预期的成长性个股，采用买入并长期持有的策略，分享成长红利。

#### 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，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：华宝兴业行业精选股票型证券投资基金

报告截止日：2012年6月30日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2012年6月30日	上年度末 2011年12月31日
<b>资产：</b>			
银行存款	6.4.7.1	160,622,563.18	1,332,716,415.75
结算备付金		16,265,262.89	9,052,956.23
存出保证金		6,107,858.95	8,923,226.17
交易性金融资产	6.4.7.2	10,501,279,139.60	8,343,445,376.75

其中：股票投资		9,948,859,139.60	8,343,445,376.75
基金投资		-	-
债券投资		552,420,000.00	-
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	-	556,901,155.35
应收证券清算款		227,104,876.73	81,513,571.04
应收利息	6.4.7.5	3,680,374.36	1,113,552.37
应收股利		550,291.72	-
应收申购款		433,522.12	75,835.06
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		10,916,043,889.55	10,333,742,088.72
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2012年6月30日</b>	<b>上年度末 2011年12月31日</b>
<b>负 债：</b>			
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		8,583,085.01	8,834,003.87
应付赎回款		3,523,865.26	1,471,955.43
应付管理人报酬		13,615,946.02	13,425,551.78
应付托管费		2,269,324.34	2,237,591.96
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	21,272,630.58	11,707,777.15
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	1,744,125.45	2,135,163.12
负债合计		51,008,976.66	39,812,043.31
<b>所有者权益：</b>			
实收基金	6.4.7.9	12,309,761,754.85	13,076,037,899.59
未分配利润	6.4.7.10	-1,444,726,841.96	-2,782,107,854.18
所有者权益合计		10,865,034,912.89	10,293,930,045.41
负债和所有者权益总计		10,916,043,889.55	10,333,742,088.72

注：报告截止日 2012 年 6 月 30 日，基金份额净值 0.8826 元，基金份额总额 12,309,761,754.85 份。

## 6.2 利润表

会计主体：华宝兴业行业精选股票型证券投资基金



本报告期：2012 年 1 月 1 日至 2012 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2012 年 1 月 1 日至 2012 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2011 年 1 月 1 日至 2011 年 6 月 30 日
<b>一、收入</b>		1,323,748,318.71	-827,979,472.74
1.利息收入		11,663,724.17	13,779,987.35
其中：存款利息收入	6.4.7.11	5,263,366.67	7,914,104.71
债券利息收入		2,854,520.54	33,505.55
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		3,545,836.96	5,832,377.09
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		-32,194,794.88	265,697,006.40
其中：股票投资收益	6.4.7.12	-85,405,326.42	186,608,569.23
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.13	-	-
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	53,210,531.54	79,088,437.17
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.16	1,343,474,642.05	-1,107,818,910.12
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	804,747.37	362,443.63
<b>减：二、费用</b>		114,509,310.03	171,962,429.78
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	78,561,882.36	99,233,725.25
2. 托管费	6.4.10.2.2	13,093,647.11	16,538,954.23
3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用	6.4.7.18	22,598,796.55	55,902,655.12
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 其他费用	6.4.7.19	254,984.01	287,095.18
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		1,209,239,008.68	-999,941,902.52
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		1,209,239,008.68	-999,941,902.52

### 6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：华宝兴业行业精选股票型证券投资基金

本报告期：2012 年 1 月 1 日至 2012 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2012 年 1 月 1 日至 2012 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)	13,076,037,899.59	-2,782,107,854.18	10,293,930,045.41
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	1,209,239,008.68	1,209,239,008.68
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)	-766,276,144.74	128,142,003.54	-638,134,141.20
其中：1.基金申购款	347,019,524.62	-40,703,464.98	306,316,059.64
2.基金赎回款	-1,113,295,669.36	168,845,468.52	-944,450,200.84
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)	12,309,761,754.85	-1,444,726,841.96	10,865,034,912.89
项目	上年度可比期间 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)	14,526,126,557.26	-52,617,534.53	14,473,509,022.73
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	-999,941,902.52	-999,941,902.52
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)	-1,069,953,033.40	30,851,507.39	-1,039,101,526.01
其中：1.基金申购款	62,420,472.59	-3,030,431.51	59,390,041.08
2.基金赎回款	-1,132,373,505.99	33,881,938.90	-1,098,491,567.09
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)	13,456,173,523.86	-1,021,707,929.66	12,434,465,594.20

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	_____ 黄小薏	_____ 张幸骏
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

## 6.4 报表附注

### 6.4.1 基金基本情况

华宝兴业行业精选股票型证券投资基金(以下简称“本基金”)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 2007 第 156 号《关于同意华宝兴业行业精选股票型证券投资基金募集的批复》核准,由华宝兴业基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《华宝兴业行业精选股票型证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式,存续期限不定,首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币 9,998,141,906.12 元,业经普华永道中天会计师事务所有限公司普华永道中天验字(2007)第 071 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《华宝兴业行业精选股票型证券投资基金基金合同》于 2007 年 6 月 14 日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为 9,998,540,080.34 份基金份额,其中认购资金利息折合 398,174.22 份基金份额。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《华宝兴业行业精选股票型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。本基金的投资比例范围为:股票占基金资产总值的 60%-95%,权证占 0%-3%,资产支持证券占 0%-20%,债券占 5%-40%,其中,现金或者到期日在一年内的政府债券比例在 5%以上。本基金的业绩比较基准为沪深 300 指数收益率。

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 8 月 27 日批准报出。

### 6.4.2 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》、《华宝兴业行业精选股票型证券投资基金基金合同》和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。

### 6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2012 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 2012 年 6 月 30 日的财务状况以及 2012 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

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。

### 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 2012 年 6 月 30 日
活期存款	160,622,563.18
定期存款	-
其中：存款期限 1-3 个月	-
其他存款	-

合计:	160,622,563.18
-----	----------------

### 6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2012年6月30日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	9,597,443,551.08	9,948,859,139.60	351,415,588.52
债券	交易所市场	-	-
	银行间市场	550,467,150.00	552,420,000.00
	合计	550,467,150.00	552,420,000.00
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	10,147,910,701.08	10,501,279,139.60	353,368,438.52

### 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/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 2012年6月30日
应收活期存款利息	86,000.00
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	7,319.40
应收债券利息	3,587,054.79
应收买入返售证券利息	-
应收申购款利息	0.17
其他	-
合计	3,680,374.36

### 6.4.7.6 其他资产

本基金本报告期末未持有其他资产。

### 6.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2012年6月30日
交易所市场应付交易费用	21,270,355.58
银行间市场应付交易费用	2,275.00
合计	21,272,630.58

### 6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2012年6月30日
应付券商交易单元保证金	1,500,000.00
应付赎回费	465.67
预提费用	243,659.78
合计	1,744,125.45

### 6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2012年1月1日至2012年6月30日	
	基金份额(份)	账面金额
上年度末	13,076,037,899.59	13,076,037,899.59
本期申购	347,019,524.62	347,019,524.62
本期赎回(以“-”号填列)	-1,113,295,669.36	-1,113,295,669.36
本期末	12,309,761,754.85	12,309,761,754.85

注：申购含红利再投以及转换入份额；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	-2,708,297,998.14	-73,809,856.04	-2,782,107,854.18
本期利润	-134,235,633.37	1,343,474,642.05	1,209,239,008.68
本期基金份额交易	170,446,864.27	-42,304,860.73	128,142,003.54

产生的变动数			
其中：基金申购款	-76,431,724.57	35,728,259.59	-40,703,464.98
基金赎回款	246,878,588.84	-78,033,120.32	168,845,468.52
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-2,672,086,767.24	1,227,359,925.28	-1,444,726,841.96

#### 6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2012年1月1日至2012年6月30日
活期存款利息收入	5,137,554.97
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	118,595.83
其他	7,215.87
合计	5,263,366.67

#### 6.4.7.12 股票投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2012年1月1日至2012年6月30日
卖出股票成交总额	7,311,820,091.09
减：卖出股票成本总额	7,397,225,417.51
买卖股票差价收入	-85,405,326.42

#### 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

本基金本报告期内无衍生工具收益。

#### 6.4.7.15 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2012年1月1日至2012年6月30日
股票投资产生的股利收益	53,210,531.54
基金投资产生的股利收益	-

合计	53,210,531.54
----	---------------

#### 6.4.7.16 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2012年1月1日至2012年6月30日
1. 交易性金融资产	1,343,474,642.05
——股票投资	1,341,521,792.05
——债券投资	1,952,850.00
——资产支持证券投资	-
2. 衍生工具	-
——权证投资	-
3. 其他	-
合计	1,343,474,642.05

#### 6.4.7.17 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2012年1月1日至2012年6月30日
基金赎回费收入	802,448.03
转换费收入	2,299.34
合计	804,747.37

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 2012年1月1日至2012年6月30日
交易所市场交易费用	22,596,521.55
银行间市场交易费用	2,275.00
合计	22,598,796.55

#### 6.4.7.19 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2012年1月1日至2012年6月30日
----	----------------------------



审计费用	84,535.36
信息披露费	159,124.42
银行费用	2,324.23
银行间帐户维护费	9,000.00
合计	254,984.01

#### 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，本基金并无须作披露的或有事项。

##### 6.4.8.2 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。

#### 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
法国兴业资产管理有限公司(Société Générale Asset Management SA)	基金管理人的原股东
宝钢集团有限公司(“宝钢集团”)	基金管理人的最终控制方
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

##### 6.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2012年1月1日至2012年6月30日	上年度可比期间 2011年1月1日至2011年6月30日
-------	----------------------------	---------------------------------

	成交金额	占当期股票成交总额的比例	成交金额	占当期股票成交总额的比例
华宝证券	635,526,114.75	4.25%	2,100,259,552.19	5.73%

#### 6.4.10.1.2 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2012年1月1日至2012年6月30日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例
华宝证券	540,195.80	4.32%	-	-
关联方名称	上年度可比期间 2011年1月1日至2011年6月30日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例
华宝证券	1,785,212.85	5.84%	1,785,212.85	4.63%

注：1.上述佣金按市场佣金率计算，以扣除由中国证券登记结算有限责任公司收取的证管费、经手费和适用期间内由券商承担的证券结算风险基金后的净额列示。权证交易不计佣金。

2.该类佣金协议的服务范围还包括佣金收取方为本基金提供的证券投资研究成果和市场信息服务等。

#### 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 2012年1月1日至2012年6月30日	上年度可比期间 2011年1月1日至2011年6月30日
	当期发生的基金应支付的管理费	78,561,882.36
其中：支付销售机构的客户维护费	14,410,085.60	17,460,828.65

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 2012年1月1日至2012年6月	上年度可比期间 2011年1月1日至2011年6月30

	30 日	日
当期发生的基金应支付的托管费	13,093,647.11	16,538,954.23

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：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

单位：人民币元

本期 2012 年 1 月 1 日至 2012 年 6 月 30 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
-	-	-	-	-	-	-
上年度可比期间 2011 年 1 月 1 日至 2011 年 6 月 30 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	-	-	291,000,000.00	374,473.15	-	-

### 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 2012 年 1 月 1 日至 2012 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2011 年 1 月 1 日至 2011 年 6 月 30 日
	期初持有的基金份额	1,879,090.65
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	1,879,090.65	1,879,090.65
期末持有的基金份额 占基金总份额比例	0.02%	0.01%

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

本报告期末及上年度可比期末除基金管理人外其他关联方未投资本基金。

### 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	
	2012 年 1 月 1 日至 2012 年 6 月 30 日		2011 年 1 月 1 日至 2011 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	160,622,563.18	5,137,554.97	840,946,915.45	7,654,660.03

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。

### 6.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期内与上年度可比期间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（2012 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/增发证券而流通受限的证券。

#### 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
000059	辽通化工	2012 年 6 月 26 日	刊登重要事项	7.91	2012 年 7 月 3 日	8.15	42,867	392,193.00	339,077.97	-
002500	山西证券	2012 年 5 月 15 日	重大资产重组	8.19	-	-	5,495	35,879.15	45,004.05	-

注：本基金截至 2012 年 6 月 30 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。

#### 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

本基金是一只进行主动投资的股票型证券投资基金，属于具有较高风险、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，确定风险相应置信程度和损失的限度，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为交易对手完成证券交收和款项清算，违约风险发生的可能性很小；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。

### 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。本基金投资于一家公司发行的股票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%。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 2012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	160,622,563.18	-	-	-	160,622,563.18
结算备付金	16,265,262.89	-	-	-	16,265,262.89
存出保证金	-	-	-	6,107,858.95	6,107,858.95
交易性金融资产	552,420,000.00	-	-	9,948,859,139.60	10,501,279,139.60
应收证券清算款	-	-	-	227,104,876.73	227,104,876.73
应收利息	-	-	-	3,680,374.36	3,680,374.36
应收股利	-	-	-	550,291.72	550,291.72
应收申购款	496.28	-	-	433,025.84	433,522.12
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	729,308,322.35	-	-	10,186,735,567.20	10,916,043,889.55
负债					
应付证券清算款	-	-	-	8,583,085.01	8,583,085.01
应付赎回款	-	-	-	3,523,865.26	3,523,865.26
应付管理人报酬	-	-	-	13,615,946.02	13,615,946.02
应付托管费	-	-	-	2,269,324.34	2,269,324.34
应付交易费用	-	-	-	21,272,630.58	21,272,630.58
其他负债	-	-	-	1,744,125.45	1,744,125.45
负债总计	-	-	-	51,008,976.66	51,008,976.66
利率敏感度缺口	729,308,322.35	-	-	10,135,726,590.54	10,865,034,912.89
上年度末 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	1,332,716,415.75	-	-	-	1,332,716,415.75
结算备付金	9,052,956.23	-	-	-	9,052,956.23
存出保证金	-	-	-	8,923,226.17	8,923,226.17
交易性金融资产	-	-	-	8,343,445,376.75	8,343,445,376.75
买入返售金融资产	556,901,155.35	-	-	-	556,901,155.35
应收证券清算款	-	-	-	81,513,571.04	81,513,571.04
应收利息	-	-	-	1,113,552.37	1,113,552.37
应收申购款	1,043.30	-	-	74,791.76	75,835.06
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	1,898,671,570.63	-	-	8,435,070,518.09	10,333,742,088.72
负债					
应付证券清算款	-	-	-	8,834,003.87	8,834,003.87
应付赎回款	-	-	-	1,471,955.43	1,471,955.43
应付管理人报酬	-	-	-	13,425,551.78	13,425,551.78
应付托管费	-	-	-	2,237,591.96	2,237,591.96
应付交易费用	-	-	-	11,707,777.15	11,707,777.15
其他负债	-	-	-	2,135,163.12	2,135,163.12
负债总计	-	-	-	39,812,043.31	39,812,043.31
利率敏感度缺口	1,898,671,570.63	-	-	8,395,258,474.78	10,293,930,045.41

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者予以分类。

#### 6.4.13.4.1.2 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（2012年6月30日）	上年度末（2011年12月31日）
	1. 市场利率下降 25 个基点	1,095,623.72	-
2. 市场利率上升 25 个基点	-1,095,623.72	-	

上年度末，本基金未持有交易性债券投资，无对比数据。



### 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其他价格风险。本基金投资组合中股票占基金资产总值的 60%-95%，权证占 0%-3%，资产支持证券占 0%-20%，债券占 5%-40%。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。

#### 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 2012 年 6 月 30 日		上年度末 2011 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	9,948,859,139.60	91.57	8,343,445,376.75	81.05
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	9,948,859,139.60	91.57	8,343,445,376.75	81.05

#### 6.4.13.4.2.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除业绩比较基准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（2012年6月30日）	上年度末（2011年12月31日）
	业绩比较基准上升 5%	430,636,793.29	397,551,578.35
	业绩比较基准下降 5%	-430,636,793.29	-397,551,578.35

#### 6.4.14 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

(a) 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。

(b) 以公允价值计量的金融工具

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)。

于 2012 年 6 月 30 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 9,948,475,057.58 元，属于二层级的余额为 552,804,082.02 元，无属于第三层级的余额(2011 年 12 月 31 日：第一层级 8,315,758,376.75 元，第二层级 27,687,000.00 元，无第三层级)。

对于持有的重大事项停牌股票，本基金将相关股票公允价值所属层级于停牌期间从第一层级转入第二层级，并于复牌后从第二层级转回第一层级(2010 年度：同)。

(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。

## § 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	9,948,859,139.60	91.14

	其中：股票	9,948,859,139.60	91.14
2	固定收益投资	552,420,000.00	5.06
	其中：债券	552,420,000.00	5.06
	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	176,887,826.07	1.62
6	其他各项资产	237,876,923.88	2.18
7	合计	10,916,043,889.55	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	1,633,808.67	0.02
B	采掘业	231,676,573.03	2.13
C	制造业	4,610,051,162.77	42.43
C0	食品、饮料	1,254,629,480.93	11.55
C1	纺织、服装、皮毛	20,413,809.89	0.19
C2	木材、家具	-	-
C3	造纸、印刷	-	-
C4	石油、化学、塑胶、塑料	521,457,869.30	4.80
C5	电子	819,355,305.34	7.54
C6	金属、非金属	445,541,024.08	4.10
C7	机械、设备、仪表	1,268,004,093.82	11.67
C8	医药、生物制品	280,535,880.91	2.58
C99	其他制造业	113,698.50	0.00
D	电力、煤气及水的生产和供应业	7,302,386.44	0.07
E	建筑业	1,302,865,500.93	11.99
F	交通运输、仓储业	8,548,299.76	0.08
G	信息技术业	248,076,756.40	2.28
H	批发和零售贸易	152,450,582.66	1.40
I	金融、保险业	1,002,070,716.39	9.22
J	房地产业	1,579,212,225.82	14.53
K	社会服务业	530,829,910.80	4.89
L	传播与文化产业	269,027,162.21	2.48
M	综合类	5,114,053.72	0.05
	合计	9,948,859,139.60	91.57

## 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	002081	金螳螂	14,085,429	535,246,302.00	4.93
2	600048	保利地产	38,274,822	434,036,481.48	3.99
3	600030	中信证券	33,491,084	422,992,390.92	3.89
4	002375	亚厦股份	17,116,319	422,601,916.11	3.89
5	002304	洋河股份	2,729,527	367,257,857.85	3.38
6	002450	康得新	22,298,990	354,776,930.90	3.27
7	000002	万科A	37,598,625	335,003,748.75	3.08
8	600887	伊利股份	16,100,348	331,345,161.84	3.05
9	601318	中国平安	5,699,852	260,711,230.48	2.40
10	000895	双汇发展	4,124,476	255,222,574.88	2.35
11	002415	海康威视	8,823,754	240,006,108.80	2.21
12	300070	碧水源	7,900,000	236,210,000.00	2.17
13	002310	东方园林	3,996,167	234,614,964.57	2.16
14	600256	广汇能源	15,689,342	211,335,436.74	1.95
15	000776	广发证券	6,757,138	201,565,426.54	1.86
16	600031	三一重工	13,399,065	186,514,984.80	1.72
17	000858	五粮液	5,116,186	167,606,253.36	1.54
18	000157	中联重科	16,269,737	163,185,462.11	1.50
19	600060	海信电器	9,399,556	158,006,536.36	1.45
20	600208	新潮中宝	38,109,400	157,391,822.00	1.45
21	600518	康美药业	10,062,315	155,160,897.30	1.43
22	600739	辽宁成大	8,975,440	140,016,864.00	1.29
23	300058	蓝色光标	7,759,411	129,504,569.59	1.19
24	000024	招商地产	5,041,230	123,661,371.90	1.14
25	000960	锡业股份	6,242,945	122,986,016.50	1.13
26	600309	烟台万华	8,567,466	114,375,671.10	1.05
27	000423	东阿阿胶	2,855,709	114,256,917.09	1.05
28	600519	贵州茅台	473,989	113,354,469.35	1.04
29	601117	中国化学	18,118,650	104,544,610.50	0.96
30	000826	桑德环境	4,400,873	100,779,991.70	0.93
31	600376	首开股份	7,546,947	99,921,578.28	0.92
32	002410	广联达	3,999,544	98,148,809.76	0.90
33	002223	鱼跃医疗	6,347,550	94,261,117.50	0.87
34	600123	兰花科创	5,197,100	93,859,626.00	0.86

35	002475	立讯精密	3,069,140	90,693,087.00	0.83
36	000651	格力电器	4,241,366	88,432,481.10	0.81
37	002051	中工国际	3,300,000	87,648,000.00	0.81
38	002241	歌尔声学	2,400,000	87,576,000.00	0.81
39	000401	冀东水泥	5,832,219	82,000,999.14	0.75
40	300027	华谊兄弟	4,968,161	78,645,988.63	0.72
41	300124	汇川技术	3,308,155	75,425,934.00	0.69
42	600582	天地科技	5,023,988	72,596,626.60	0.67
43	000527	美的电器	6,127,187	67,705,416.35	0.62
44	600104	上汽集团	4,642,376	66,339,553.04	0.61
45	600495	晋西车轴	6,009,113	63,997,053.45	0.59
46	002431	棕榈园林	2,410,450	62,165,505.50	0.57
47	600637	百视通	4,599,931	60,259,096.10	0.55
48	600703	三安光电	4,333,703	58,981,697.83	0.54
49	300105	龙源技术	2,100,000	57,309,000.00	0.53
50	002244	滨江集团	6,103,964	55,362,953.48	0.51
51	000800	一汽轿车	5,055,858	54,906,617.88	0.51
52	000656	金科股份	5,043,969	54,222,666.75	0.50
53	600223	鲁商置业	10,000,000	52,400,000.00	0.48
54	000630	铜陵有色	2,663,051	51,396,884.30	0.47
55	000528	柳工	4,042,217	50,163,912.97	0.46
56	300115	长盈精密	1,957,864	46,597,163.20	0.43
57	000783	长江证券	5,110,263	46,503,393.30	0.43
58	600157	永泰能源	5,119,946	46,489,109.68	0.43
59	600266	北京城建	3,026,326	45,969,891.94	0.42
60	600549	厦门钨业	1,018,750	44,733,312.50	0.41
61	600183	生益科技	8,234,543	42,407,896.45	0.39
62	600176	中国玻纤	4,199,647	41,282,530.01	0.38
63	002106	莱宝高科	2,026,820	40,678,277.40	0.37
64	600406	国电南瑞	2,084,928	38,967,304.32	0.36
65	300210	森远股份	2,520,000	38,808,000.00	0.36
66	002430	杭氧股份	3,205,000	38,748,450.00	0.36
67	002436	兴森科技	2,500,000	37,775,000.00	0.35
68	002230	科大讯飞	1,899,724	37,424,562.80	0.34
69	300101	国腾电子	2,499,981	35,399,730.96	0.33
70	000927	一汽夏利	4,615,710	33,833,154.30	0.31
71	600585	海螺水泥	2,129,662	31,561,590.84	0.29
72	300090	盛运股份	2,099,773	28,535,915.07	0.26
73	000935	四川双马	3,666,601	27,682,837.55	0.25

74	600496	精工钢构	3,175,723	24,611,853.25	0.23
75	000807	云铝股份	4,025,524	23,710,336.36	0.22
76	600967	北方创业	1,302,300	23,688,837.00	0.22
77	000780	平庄能源	2,023,175	21,202,874.00	0.20
78	300219	鸿利光电	1,557,351	15,262,039.80	0.14
79	300198	纳川股份	850,000	14,883,500.00	0.14
80	000665	武汉塑料	1,034,301	13,911,348.45	0.13
81	002497	雅化集团	1,000,000	13,490,000.00	0.12
82	300146	汤臣倍健	199,911	13,428,021.87	0.12
83	601668	中国建筑	3,931,200	13,130,208.00	0.12
84	300017	网宿科技	799,925	13,038,777.50	0.12
85	300157	恒泰艾普	649,781	12,807,183.51	0.12
86	300257	开山股份	400,000	11,400,000.00	0.10
87	002293	罗莱家纺	149,930	11,184,778.00	0.10
88	002564	张化机	799,966	9,759,585.20	0.09
89	300273	和佳股份	499,981	8,879,662.56	0.08
90	600036	招商银行	811,950	8,866,494.00	0.08
91	601088	中国神华	382,966	8,609,075.68	0.08
92	300207	欣旺达	599,959	8,435,423.54	0.08
93	601566	九牧王	300,000	8,355,000.00	0.08
94	600383	金地集团	1,271,700	8,240,616.00	0.08
95	601328	交通银行	1,738,718	7,893,779.72	0.07
96	600016	民生银行	1,305,750	7,821,442.50	0.07
97	300300	汉鼎股份	315,433	7,800,658.09	0.07
98	000669	*ST 领先	250,000	6,497,500.00	0.06
99	601166	兴业银行	484,400	6,287,512.00	0.06
100	000961	中南建设	504,076	6,280,786.96	0.06
101	600335	国机汽车	510,841	6,170,959.28	0.06
102	600000	浦发银行	724,042	5,886,461.46	0.05
103	002096	南岭民爆	400,000	5,236,000.00	0.05
104	300228	富瑞特装	200,000	4,816,000.00	0.04
105	600837	海通证券	490,451	4,723,043.13	0.04
106	600489	中金黄金	210,167	4,522,793.84	0.04
107	600546	山煤国际	212,175	4,438,701.00	0.04
108	000937	冀中能源	281,292	4,295,328.84	0.04
109	600028	中国石化	623,610	3,928,743.00	0.04
110	601398	工商银行	991,825	3,917,708.75	0.04
111	601288	农业银行	1,326,025	3,434,404.75	0.03
112	601918	国投新集	262,143	3,200,766.03	0.03

113	002396	星网锐捷	199,998	2,995,970.04	0.03
114	601699	潞安环能	136,352	2,827,940.48	0.03
115	600348	阳泉煤业	182,725	2,795,692.50	0.03
116	601169	北京银行	283,113	2,766,014.01	0.03
117	601006	大秦铁路	383,500	2,696,005.00	0.02
118	600111	包钢稀土	67,700	2,671,442.00	0.02
119	600395	盘江股份	98,544	2,648,862.72	0.02
120	000001	深发展 A	165,458	2,508,343.28	0.02
121	600547	山东黄金	72,275	2,373,511.00	0.02
122	601898	中煤能源	299,830	2,320,684.20	0.02
123	601818	光大银行	767,800	2,180,552.00	0.02
124	002024	苏宁电器	256,500	2,152,035.00	0.02
125	600015	华夏银行	225,540	2,135,863.80	0.02
126	600900	长江电力	311,300	2,116,840.00	0.02
127	601857	中国石油	233,102	2,109,573.10	0.02
128	600050	中国联通	566,775	2,108,403.00	0.02
129	601899	紫金矿业	517,029	2,006,072.52	0.02
130	600432	吉恩镍业	134,700	1,788,816.00	0.02
131	000063	中兴通讯	125,700	1,754,772.00	0.02
132	000568	泸州老窖	40,725	1,723,074.75	0.02
133	601628	中国人寿	93,634	1,713,502.20	0.02
134	600999	招商证券	141,761	1,645,845.21	0.02
135	000060	中金岭南	190,001	1,637,808.62	0.02
136	000983	西山煤电	92,414	1,441,658.40	0.01
137	000069	华侨城 A	223,145	1,423,665.10	0.01
138	000338	潍柴动力	47,625	1,413,986.25	0.01
139	601989	中国重工	272,110	1,412,250.90	0.01
140	000792	盐湖股份	40,870	1,380,179.90	0.01
141	600795	国电电力	510,375	1,378,012.50	0.01
142	601988	中国银行	448,550	1,264,911.00	0.01
143	600362	江西铜业	52,250	1,249,297.50	0.01
144	600089	特变电工	171,747	1,162,727.19	0.01
145	000402	金融街	174,450	1,139,158.50	0.01
146	601009	南京银行	133,000	1,133,160.00	0.01
147	601600	中国铝业	182,413	1,125,488.21	0.01
148	600690	青岛海尔	92,102	1,079,435.44	0.01
149	601788	光大证券	81,884	1,078,412.28	0.01
150	000629	攀钢钒钛	163,875	1,078,297.50	0.01
151	600276	恒瑞医药	36,997	1,062,183.87	0.01

152	601168	西部矿业	123,968	1,061,166.08	0.01
153	601766	中国南车	227,670	1,038,175.20	0.01
154	000538	云南白药	17,275	1,024,062.00	0.01
155	601299	中国北车	254,700	1,021,347.00	0.01
156	601688	华泰证券	96,236	1,010,478.00	0.01
157	000969	安泰科技	80,575	985,432.25	0.01
158	000709	河北钢铁	336,725	919,259.25	0.01
159	600068	葛洲坝	138,400	903,752.00	0.01
160	000623	吉林敖东	51,175	887,374.50	0.01
161	600100	同方股份	103,850	874,417.00	0.01
162	601186	中国铁建	194,475	865,413.75	0.01
163	000100	TCL 集团	420,700	854,021.00	0.01
164	600642	申能股份	180,400	831,644.00	0.01
165	601390	中国中铁	318,375	818,223.75	0.01
166	000012	南 玻 A	86,975	782,775.00	0.01
167	601618	中国中冶	312,625	775,310.00	0.01
168	600600	青岛啤酒	20,200	771,438.00	0.01
169	600009	上海机场	60,150	766,311.00	0.01
170	601666	平煤股份	75,300	762,036.00	0.01
171	600143	金发科技	127,166	759,181.02	0.01
172	600150	中国船舶	32,760	752,497.20	0.01
173	000878	云南铜业	41,851	749,132.90	0.01
174	600583	海油工程	121,100	737,499.00	0.01
175	601958	金钼股份	57,975	734,543.25	0.01
176	000425	徐工机械	51,168	733,749.12	0.01
177	600177	雅戈尔	85,035	721,947.15	0.01
178	600010	包钢股份	146,975	717,238.00	0.01
179	600188	兖州煤业	37,685	715,261.30	0.01
180	601998	中信银行	176,650	706,600.00	0.01
181	600005	武钢股份	262,425	705,923.25	0.01
182	000039	中集集团	52,638	700,085.40	0.01
183	601919	中国远洋	150,400	697,856.00	0.01
184	000581	威孚高科	25,442	697,110.80	0.01
185	601991	大唐发电	123,175	693,475.25	0.01
186	002142	宁波银行	69,350	692,113.00	0.01
187	600196	复星医药	66,758	688,274.98	0.01
188	600085	同仁堂	39,250	684,912.50	0.01
189	600066	宇通客车	30,400	682,784.00	0.01
190	600535	天士力	15,378	672,326.16	0.01



191	601111	中国国航	108,850	669,427.50	0.01
192	000009	中国宝安	66,553	665,530.00	0.01
193	600415	小商品城	85,221	664,723.80	0.01
194	600271	航天信息	34,825	658,540.75	0.01
195	002202	金风科技	101,900	653,179.00	0.01
196	002422	科伦药业	13,837	645,634.42	0.01
197	600029	南方航空	136,650	629,956.50	0.01
198	002155	辰州矿业	32,200	623,392.00	0.01
199	600369	西南证券	55,046	622,570.26	0.01
200	600115	东方航空	147,850	618,013.00	0.01
201	600166	福田汽车	85,900	614,185.00	0.01
202	000422	湖北宜化	49,788	609,903.00	0.01
203	000758	中色股份	32,000	607,040.00	0.01
204	600741	华域汽车	67,325	603,905.25	0.01
205	000768	西飞国际	76,575	601,113.75	0.01
206	600881	亚泰集团	108,973	599,351.50	0.01
207	000728	国元证券	54,250	591,867.50	0.01
208	600153	建发股份	82,313	589,361.08	0.01
209	600655	豫园商城	74,450	586,666.00	0.01
210	600058	五矿发展	26,250	586,162.50	0.01
211	601808	中海油服	35,490	585,939.90	0.01
212	600497	驰宏锌锗	41,225	580,035.75	0.01
213	000869	张裕A	8,613	579,310.38	0.01
214	600694	大商股份	17,050	570,322.50	0.01
215	000933	神火股份	62,375	568,860.00	0.01
216	600352	浙江龙盛	98,900	566,697.00	0.01
217	000625	长安汽车	116,100	566,568.00	0.01
218	600320	振华重工	134,244	566,509.68	0.01
219	601333	广深铁路	187,525	551,323.50	0.01
220	000729	燕京啤酒	74,600	544,580.00	0.01
221	601727	上海电气	117,918	537,706.08	0.00
222	600809	山西汾酒	14,250	537,082.50	0.00
223	000562	宏源证券	32,400	535,896.00	0.00
224	600832	东方明珠	98,825	530,690.25	0.00
225	601106	中国一重	166,550	526,298.00	0.00
226	000825	太钢不锈	147,875	521,998.75	0.00
227	600839	四川长虹	245,250	517,477.50	0.00
228	000876	新希望	33,675	504,451.50	0.00
229	601607	上海医药	46,425	495,354.75	0.00

230	601717	郑煤机	42,625	494,450.00	0.00
231	000999	华润三九	22,400	489,440.00	0.00
232	600649	城投控股	66,925	483,198.50	0.00
233	600219	南山铝业	72,100	483,070.00	0.00
234	000898	鞍钢股份	123,800	482,820.00	0.00
235	600125	铁龙物流	56,825	481,876.00	0.00
236	600259	广晟有色	7,275	479,640.75	0.00
237	002001	新和成	22,541	476,291.33	0.00
238	600804	鹏博士	78,250	464,805.00	0.00
239	600267	海正药业	26,520	463,569.60	0.00
240	002038	双鹭药业	14,325	461,265.00	0.00
241	600132	重庆啤酒	21,350	460,946.50	0.00
242	601001	大同煤业	41,700	456,615.00	0.00
243	600779	水井坊	18,750	455,062.50	0.00
244	002092	中泰化学	59,425	454,601.25	0.00
245	002385	大北农	23,011	446,413.40	0.00
246	600811	东方集团	80,400	440,592.00	0.00
247	600331	宏达股份	53,790	432,471.60	0.00
248	002007	华兰生物	17,466	429,314.28	0.00
249	600859	王府井	15,500	424,080.00	0.00
250	601101	昊华能源	24,725	423,292.00	0.00
251	600893	航空动力	32,400	421,524.00	0.00
252	000839	中信国安	62,500	420,000.00	0.00
253	600588	用友软件	27,145	414,232.70	0.00
254	600108	亚盛集团	83,700	412,641.00	0.00
255	601018	宁波港	160,325	405,622.25	0.00
256	600664	哈药股份	61,477	405,133.43	0.00
257	600550	天威保变	46,075	402,234.75	0.00
258	000962	东方钨业	30,000	400,800.00	0.00
259	002069	獐子岛	19,205	400,424.25	0.00
260	600216	浙江医药	15,725	395,483.75	0.00
261	600997	开滦股份	37,675	394,457.25	0.00
262	600895	张江高科	45,475	389,720.75	0.00
263	600660	福耀玻璃	49,238	385,041.16	0.00
264	600875	东方电气	21,125	378,560.00	0.00
265	600252	中恒集团	34,525	378,394.00	0.00
266	600221	海南航空	75,825	370,026.00	0.00
267	000778	新兴铸管	55,200	369,288.00	0.00
268	600718	东软集团	42,565	366,484.65	0.00

269	600674	川投能源	52,920	366,206.40	0.00
270	601558	华锐风电	52,150	365,571.50	0.00
271	600863	内蒙华电	46,175	364,782.50	0.00
272	600160	巨化股份	35,960	363,196.00	0.00
273	601158	重庆水务	61,650	363,118.50	0.00
274	601866	中海集运	143,450	362,928.50	0.00
275	600635	大众公用	77,712	362,137.92	0.00
276	600062	华润双鹤	18,850	359,658.00	0.00
277	600498	烽火通信	13,175	349,269.25	0.00
278	600516	方大炭素	40,743	347,945.22	0.00
279	002073	软控股份	41,250	345,675.00	0.00
280	000061	农产品	58,910	341,678.00	0.00
281	600970	中材国际	29,576	341,307.04	0.00
282	601118	海南橡胶	49,491	340,003.17	0.00
283	000059	辽通化工	42,867	339,077.97	0.00
284	600770	综艺股份	29,375	337,225.00	0.00
285	600118	中国卫星	26,520	333,886.80	0.00
286	002146	荣盛发展	30,375	331,087.50	0.00
287	600808	马钢股份	154,175	329,934.50	0.00
288	600418	江淮汽车	60,925	329,604.25	0.00
289	600372	中航电子	18,220	327,777.80	0.00
290	600008	首创股份	66,711	326,216.79	0.00
291	000680	山推股份	55,380	323,973.00	0.00
292	002299	圣农发展	22,125	319,485.00	0.00
293	600169	太原重工	90,825	318,795.75	0.00
294	000027	深圳能源	49,000	317,030.00	0.00
295	600508	上海能源	17,475	316,821.75	0.00
296	601098	中南传媒	32,575	312,068.50	0.00
297	600879	航天电子	39,100	308,108.00	0.00
298	600037	歌华有线	40,563	305,439.39	0.00
299	600812	华北制药	47,350	301,146.00	0.00
300	601933	永辉超市	11,053	299,536.30	0.00
301	002128	露天煤业	22,875	299,205.00	0.00
302	601369	陕鼓动力	31,225	289,143.50	0.00
303	600500	中化国际	42,475	287,131.00	0.00
304	601179	中国西电	71,575	284,868.50	0.00
305	600595	中孚实业	48,425	270,211.50	0.00
306	600528	中铁二局	39,925	269,893.00	0.00
307	601992	金隅股份	40,275	267,828.75	0.00

308	601377	兴业证券	25,300	265,144.00	0.00
309	000559	万向钱潮	51,875	260,931.25	0.00
310	600098	广州控股	37,600	260,192.00	0.00
311	000686	东北证券	14,825	254,100.50	0.00
312	600971	恒源煤电	18,175	253,177.75	0.00
313	600316	洪都航空	19,000	247,570.00	0.00
314	600456	宝钛股份	12,800	240,256.00	0.00
315	600170	上海建工	33,250	240,065.00	0.00
316	002122	天马股份	36,389	235,072.94	0.00
317	600161	天坛生物	16,400	234,028.00	0.00
318	002344	海宁皮城	8,900	232,112.00	0.00
319	600109	国金证券	16,075	231,319.25	0.00
320	000021	长城开发	41,675	224,211.50	0.00
321	002399	海普瑞	10,550	223,660.00	0.00
322	601888	中国国旅	7,925	223,643.50	0.00
323	601718	际华集团	69,900	220,884.00	0.00
324	600873	梅花集团	32,275	217,856.25	0.00
325	002493	荣盛石化	13,937	213,654.21	0.00
326	600783	鲁信创投	13,300	212,268.00	0.00
327	000968	煤气化	13,075	199,393.75	0.00
328	002405	四维图新	16,437	196,257.78	0.00
329	600151	航天机电	30,325	196,202.75	0.00
330	000718	苏宁环球	24,125	195,412.50	0.00
331	600428	中远航运	47,893	194,924.51	0.00
332	601258	庞大集团	31,750	193,675.00	0.00
333	600307	酒钢宏兴	54,300	188,421.00	0.00
334	002603	以岭药业	6,403	176,402.65	0.00
335	600737	中粮屯河	29,350	174,926.00	0.00
336	600380	健康元	33,570	164,157.30	0.00
337	600598	北大荒	21,645	161,255.25	0.00
338	601233	桐昆股份	17,401	152,084.74	0.00
339	002378	章源钨业	4,522	143,166.52	0.00
340	601268	二重重装	22,850	140,070.50	0.00
341	600481	双良节能	17,525	125,479.00	0.00
342	002594	比亚迪	5,725	113,698.50	0.00
343	600026	中海发展	20,600	104,030.00	0.00
344	601216	内蒙君正	14,050	97,928.50	0.00
345	002498	汉缆股份	8,150	86,634.50	0.00
346	601099	太平洋	12,425	85,732.50	0.00

347	601519	大智慧	11,250	58,162.50	0.00
348	002500	山西证券	5,495	45,004.05	0.00

注：“深发展 A”于 2012 年 8 月 2 日更名“平安银行”。

## 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	600030	中信证券	535,671,452.91	5.20
2	000002	万科A	266,036,728.66	2.58
3	601318	中国平安	261,766,209.45	2.54
4	600256	广汇能源	237,008,882.20	2.30
5	002310	东方园林	221,614,712.89	2.15
6	000776	广发证券	198,075,230.03	1.92
7	000651	格力电器	195,716,894.03	1.90
8	601555	东吴证券	193,965,723.80	1.88
9	600031	三一重工	191,134,669.75	1.86
10	600060	海信电器	186,516,575.21	1.81
11	002415	海康威视	185,981,336.55	1.81
12	000157	中联重科	160,596,115.39	1.56
13	600739	辽宁成大	160,318,597.26	1.56
14	600048	保利地产	150,374,529.78	1.46
15	600549	厦门钨业	145,926,287.69	1.42
16	000960	锡业股份	138,550,409.51	1.35
17	600406	国电南瑞	131,474,618.82	1.28
18	600637	百视通	122,350,585.39	1.19
19	600376	首开股份	119,208,700.60	1.16
20	000401	冀东水泥	105,036,451.72	1.02

### 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	600036	招商银行	567,993,737.00	5.52

2	600123	兰花科创	360,602,303.11	3.50
3	600000	浦发银行	348,152,112.62	3.38
4	600519	贵州茅台	309,575,726.52	3.01
5	600016	民生银行	306,377,396.70	2.98
6	601555	东吴证券	244,705,125.37	2.38
7	000858	五粮液	223,419,994.43	2.17
8	601088	中国神华	190,399,597.79	1.85
9	002304	洋河股份	155,235,349.67	1.51
10	002081	金螳螂	131,755,866.11	1.28
11	000651	格力电器	123,087,558.72	1.20
12	600030	中信证券	122,868,266.01	1.19
13	600549	厦门钨业	118,608,110.77	1.15
14	600031	三一重工	118,484,753.34	1.15
15	300070	碧水源	113,848,529.69	1.11
16	601398	工商银行	96,707,552.15	0.94
17	600111	包钢稀土	94,525,620.98	0.92
18	600518	康美药业	88,659,848.79	0.86
19	601668	中国建筑	87,417,497.38	0.85
20	600537	亿晶光电	84,848,229.99	0.82

### 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	7,661,117,388.31
卖出股票收入（成交）总额	7,311,820,091.09

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

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	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	552,420,000.00	5.08
	其中：政策性金融债	552,420,000.00	5.08
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	552,420,000.00	5.08

## 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

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	120218	12 国开 18	5,500,000	552,420,000.00	5.08
2	-	-	-	-	-
3	-	-	-	-	-
4	-	-	-	-	-
5	-	-	-	-	-

## 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增长前景良好或周期复苏的行业和企业，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	6,107,858.95
2	应收证券清算款	227,104,876.73
3	应收股利	550,291.72
4	应收利息	3,680,374.36
5	应收申购款	433,522.12
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	237,876,923.88

#### 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处于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

本基金本报告期末投资前十名股票中不存在流通受限情况。

### § 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
531,195	23,173.72	351,190,732.48	2.85%	11,958,571,022.37	97.15%

#### 8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

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基金	1,151,652.61	0.0094%

注：

（一）本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有该只基金份额总量的数量区间：



50 万份至 100 万份（含）

（二）该只基金的基金经理持有该只基金份额总量的数量区间：

10 万份至 50 万份（含）

附：数量区间为 0、0 至 10 万份（含）、10 万份至 50 万份（含）、50 万份至 100 万份（含）、100 万份以上。

## § 9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日(2007年6月14日)基金份额总额	9,998,540,080.34
本报告期期初基金份额总额	13,076,037,899.59
本报告期基金总申购份额	347,019,524.62
减:本报告期基金总赎回份额	1,113,295,669.36
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期末基金份额总额	12,309,761,754.85

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

本报告期内，本基金管理人、本基金托管人的专门基金托管部门未发生重大人事变动。

### 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

本基金的投资策略在报告期内未发生变更。

## 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(2007年6月14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	
申银万国	1	2,291,294,480.36	15.34%	1,868,929.52	14.96%	-
银河证券	1	1,470,569,270.92	9.85%	1,249,979.60	10.01%	-
中信证券	1	1,107,763,841.07	7.42%	908,086.03	7.27%	-
海通证券	1	1,021,011,419.81	6.84%	872,594.95	6.99%	-
中银国际	1	867,886,103.45	5.81%	709,527.39	5.68%	-
民生证券	1	787,963,336.82	5.28%	673,527.50	5.39%	-
中金国际	1	756,453,440.76	5.06%	642,986.39	5.15%	-
华创证券	1	699,882,965.73	4.69%	597,703.25	4.78%	-
华泰联合	1	660,741,177.48	4.42%	536,854.74	4.30%	-
华宝证券	1	635,526,114.75	4.25%	540,195.80	4.32%	-
国泰君安	1	628,242,124.09	4.21%	534,005.50	4.27%	-
兴业证券	1	600,381,104.80	4.02%	510,320.08	4.09%	-
光大证券	1	512,032,298.11	3.43%	435,225.83	3.48%	-
国信证券	1	500,584,407.49	3.35%	406,722.70	3.26%	-
西南证券	1	464,952,079.45	3.11%	395,206.54	3.16%	-
中航证券	1	405,289,951.35	2.71%	344,494.15	2.76%	-
东北证券	1	383,407,259.69	2.57%	311,520.13	2.49%	-
广发证券	1	340,825,815.26	2.28%	276,921.90	2.22%	-
信达证券	1	217,212,020.59	1.45%	184,631.12	1.48%	-
高华证券	1	190,949,216.56	1.28%	162,303.80	1.30%	-

瑞银证券	1	141,131,102.67	0.94%	119,961.41	0.96%	-
招商证券	1	120,035,633.86	0.80%	102,030.21	0.82%	-
长城证券	1	108,913,102.79	0.73%	88,492.17	0.71%	-
宏源证券	1	23,856,334.66	0.16%	19,383.52	0.16%	-
齐鲁证券	1	-	-	-	-	-
东方证券	1	-	-	-	-	-
金元证券	1	-	-	-	-	-
安信证券	1	-	-	-	-	-
东海证券	1	-	-	-	-	-
中投证券	1	-	-	-	-	-
西藏同信	1	-	-	-	-	-
平安证券	1	-	-	-	-	-
华安证券	1	-	-	-	-	-
江海证券	1	-	-	-	-	-
国金证券	1	-	-	-	-	-

注：基金管理人选择交易单元的标准和程序如下：

(1) 选择标准：资历雄厚，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新增：国金证券。

### 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
申银万国	-	-	-	-	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-

中信证券	-	-	-	-	-	-
海通证券	-	-	-	-	-	-
中银国际	-	-	-	-	-	-
民生证券	-	-	-	-	-	-
中金国际	-	-	-	-	-	-
华创证券	-	-	-	-	-	-
华泰联合	-	-	-	-	-	-
华宝证券	-	-	-	-	-	-
国泰君安	-	-	-	-	-	-
兴业证券	-	-	-	-	-	-
光大证券	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-
西南证券	-	-	-	-	-	-
中航证券	-	-	-	-	-	-
东北证券	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-
信达证券	-	-	-	-	-	-
高华证券	-	-	-	-	-	-
瑞银证券	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-
长城证券	-	-	-	-	-	-
宏源证券	-	-	-	-	-	-
齐鲁证券	-	-	-	-	-	-
东方证券	-	-	-	-	-	-
金元证券	-	-	-	-	-	-
安信证券	-	-	-	-	-	-
东海证券	-	-	-	-	-	-
中投证券	-	-	-	-	-	-
西藏同信	-	-	-	-	-	-
平安证券	-	-	-	-	-	-
华安证券	-	-	-	-	-	-
江海证券	-	-	-	-	-	-
国金证券	-	-	-	-	-	-

## 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在“e 网金”网上直销平台新增上海银联电子支付服务有限公司相关银行卡支付业务的公告	《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》以及基金管理人网站	2012 年 6 月 29 日
2	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	2012 年 6 月 28 日
3	华宝兴业基金管理有限公司关于在“e 网金”网上直销平台新增上海银联电子支付服务有限公司相关银行卡支付业务的公告	《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》以及基金管理人网站	2012 年 5 月 12 日
4	华宝兴业基金管理有限公司关于参加工商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	2012 年 3 月 30 日
5	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	2012 年 3 月 30 日
6	华宝兴业基金管理有限公司关于旗下部分基金继续参加申银万国证券申购费率优惠活动并继续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	2012 年 3 月 15 日
7	华宝兴业基金管理有限公司关于变更办公地址的预告	《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》以及基金管理人网站	2012 年 2 月 14 日

		网站	
8	华宝兴业基金管理有限公司关于华宝兴业行业精选股票型证券投资基金基金经理变更公告	《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》以及基金管理人网站	2012 年 1 月 19 日
9	华宝兴业基金管理有限公司关于旗下基金所持“蓝色光标”恢复采用收盘价估值的公告	《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》以及基金管理人网站	2012 年 1 月 18 日
10	华宝兴业基金管理有限公司关于旗下基金持有的股票停牌后估值方法调整的提示性公告	《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》以及基金管理人网站	2012 年 1 月 17 日
11	华宝兴业基金管理有限公司旗下基金资产净值公告	基金管理人网站	2012 年 1 月 1 日

## § 11 影响投资者决策的其他重要信息

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。

## § 12 备查文件目录

### 12.1 备查文件目录

中国证监会批准基金设立的文件;  
 华宝兴业行业精选股票型证券投资基金基金合同;  
 华宝兴业行业精选股票型证券投资基金招募说明书;  
 华宝兴业行业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。

## 12.2 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。

## 12.3 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 8 月 27 日