

华宝兴业行业精选股票型证券投资基金 2013 年半年度报告

2013 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：2013 年 8 月 24 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 2013 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 2013 年 01 月 01 日起至 06 月 30 日止。

1.2 目录

§1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示.....	2
1.2 目录.....	3
§2 基金简介	5
2.1 基金基本情况.....	5
2.2 基金产品说明.....	5
2.3 基金管理人和基金托管人.....	5
2.4 信息披露方式.....	6
2.5 其他相关资料.....	6
§3 主要财务指标和基金净值表现	6
3.1 主要会计数据和财务指标.....	6
3.2 基金净值表现.....	7
§4 管理人报告	8
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	8
4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明.....	10
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	10
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明.....	10
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	11
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	11
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	12
§5 托管人报告	12
5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明.....	12
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.....	12
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.....	12
§6 半年度财务会计报告（未经审计）	13
6.1 资产负债表.....	13
6.2 利润表.....	14
6.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	15
6.4 报表附注.....	16
§7 投资组合报告	33
7.1 期末基金资产组合情况.....	33
7.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	34
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.....	34
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	43
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	45
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.....	45
7.7 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.....	46
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.....	46
7.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....	46
7.10 投资组合报告附注.....	46
§8 基金份额持有人信息	47
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	47
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	47

§9 开放式基金份额变动	48
§10 重大事件揭示	48
10.1 基金份额持有人大会决议.....	48
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.....	48
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	48
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.....	49
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.....	49
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	49
10.8 其他重大事件.....	52
§11 备查文件目录	53
11.1 备查文件目录.....	53
11.2 存放地点.....	53
11.3 查阅方式.....	54

§ 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	11,732,421,694.89 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	田青
	联系电话	021-38505888	010-67595096
	电子邮箱	xxpl@fsfund.com	tianqingl.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	北京市西城区金融大街 25 号

	号上海环球金融中心 58 楼	
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	上海市浦东新区陆家嘴环路 1318 号星展银行大厦 6 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(2013 年 1 月 1 日 - 2013 年 6 月 30 日)
本期已实现收益	886,094,966.45
本期利润	1,674,757,445.50
加权平均基金份额本期利润	0.1366
本期加权平均净值利润率	14.15%
本期基金份额净值增长率	15.32%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2013 年 6 月 30 日)
期末可供分配利润	-2,317,394,578.41
期末可供分配基金份额利润	-0.1975
期末基金资产净值	11,999,832,260.54
期末基金份额净值	1.0228
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2013 年 6 月 30 日)
基金份额累计净值增长率	2.28%

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	-5.48%	1.75%	-15.57%	1.86%	10.09%	-0.11%
过去三个月	7.91%	1.41%	-11.80%	1.45%	19.71%	-0.04%
过去六个月	15.32%	1.37%	-12.78%	1.50%	28.10%	-0.13%
过去一年	15.88%	1.24%	-10.60%	1.37%	26.48%	-0.13%
过去三年	21.75%	1.21%	-14.14%	1.37%	35.89%	-0.16%
自基金合同生效日起至 今	2.28%	1.57%	-46.56%	1.96%	48.84%	-0.39%

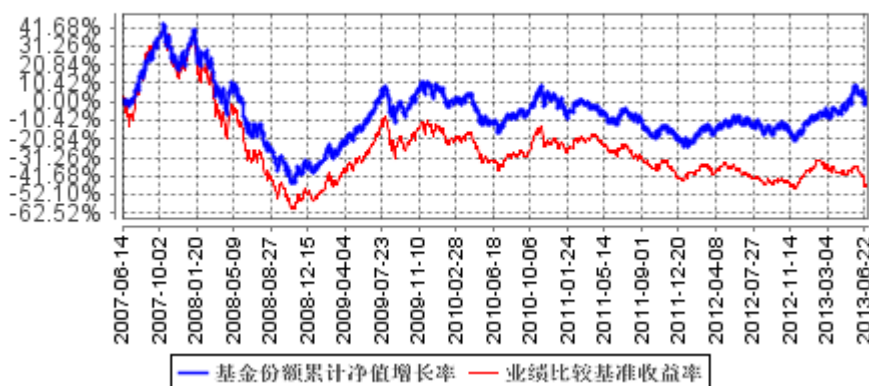
注：1、净值以及比较基准相关数据计算中涉及天数的，包括所有交易日以及季末最后一自然日（如非交易日）。

2、本基金业绩比较基准为：沪深 300 指数收益率。

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

（2007 年 6 月 14 日 至 2013 年 6 月 30 日）

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（2013 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 180 价值 ETF、上证 180 价值 ETF 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、华宝兴业医药生物基金、华宝短融 50 基金、华宝兴业资源优选基金、华宝添益基金和华宝兴业服务优选基金，所管理的开放式证券投资基金资产净值合计 39,612,038,487.56 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	2013 年 2 月 8 日	18 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）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

					<p>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 年 9 月至 2013 年 2 月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。</p>
蒋宁	投资副总监、本基金基金经理	2010 年 7 月 3 日	-	18 年	<p>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。</p>
沈梦圆	本基金基金经理助理	2009 年 11 月 23 日	-	5 年	<p>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基金经理助理，2010 年 12 月至 2012 年 9 月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。</p>
楼鸿强	本基金基金经理助理	2012 年 9 月 25 日	-	4 年	<p>硕士。曾在兴业证券担任研究员。2011 年加入华宝兴业基金管理有限公司任研究员，2012 年 9 月起兼任华宝兴业行业精选股票基金基金经理助理。</p>

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。

3、本基金管理人于 2013 年 7 月 25 日发布《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增聘基金经理公告》，增聘范红兵先生为本基金基金经理。

4、本基金管理人于 2013 年 8 月 22 日发布《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》，增聘李卓先生、沈梦圆女士为本基金基金经理，蒋宁女士不再担任本基金的基金经理。

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

2013 年上半年基金管理人严格遵守公司内部制定的公平交易制度和控制方法，确保了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。公司内部制定的公平交易制度涉及的范围包括境内上市股票、债券的一级市场申购、二级市场交易等投资管理活动。

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，分析了公司旗下所有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；并采集了连续四个季度期间内、不同时间窗下（1 日、3 日、5 日）同向交易的样本，对其进行 95%置信区间下的假设检验分析，同时结合各组合的成交金额，并参考市场成交量等因素综合判断是否存在不公平交易、利益输送的可能。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

上半年市场整体上是强转弱的半年，以创业板为代表的中小市值个股走出较强的结构性行情。国内宏观经济数据在 1 季度部分延续去年底以来的复苏迹象，但未能有效延续，除了前面几个月地产和汽车等少数行业数据尚可之外，大部分中上游行业数据持续低于预期。3 月份地产调

控新政的出台，以及后期陆续发布的流动性管理规定，货币政策也不再中性偏宽，这增加了后期宏观经济复苏的不确定性。

代表转型方向的部分成长性行业如传媒、医药、电子、环保、高端装备等新兴产业，其发展前景和业绩成长性使得相关个股成为稀缺标的，市场从 3 月后结构性分化愈加明显。

从 1 季度末开始，我们对市场的态度从审慎乐观转变为谨慎。1 季度我们保持了较高仓位，在精选成长股的同时，加大了周期类个股的波段操作力度，后期逐步降低复苏不明朗周期行业的配置。2 季度主要围绕 TMT、医药、环保等新兴产业的投资，并在 2 季度末逐步降低仓位，将配置集中到前景明朗业绩确定的优质成长股龙头上。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末，本报告期内基金份额净值增长率为 15.32%，业绩比较基准收益率为 -12.78%，基金表现领先业绩比较基准 28.10%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望后面季度，政府转型之心坚决，除非出现快速迅猛的经济失速，否则大概率不会推出经济刺激政策。因此，不能排除经济增长逐渐回落的可能性，以短期的阵痛换取长期健康的可持续性发展。与此对应，流动性虽然出现边际收紧的迹象，但我们判断在目前宏观经济条件下，流动性仍然会保持相对宽裕。上半年的结构性行情，使得新兴产业相关个股估值偏高，部分缺乏业绩支撑的伪成长股进入验证期。市场机会将继续围绕真正具备成长性的优质成长股上，结构分化行情进一步深化。

相应的，我们将采取相对谨慎的投资策略。在保持中性偏低仓位的前提下，继续精选优质成长股，把握回调过程中的加仓机会，积极布局全年机会。同时，我们将时刻关注宏观经济走势，观察等待周期股可能出现的机会。

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过程中，公司内部参与估值流程的各方职责分工如下：

(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)、量化投资部：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，根据估值委员会对停牌股票或异常交易股票估值调整的方法（比如：指数收益法）进行估值，并在估值时兼顾考虑行业研究员提供的根据上市公司估值模型计算的结果所提出的建议或意见。

(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 & 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)、必要时基金经理就估值模型及估值方法的确定提出建议和意见，但由估值委员会做最终决策。

上述参与估值流程的人员均具备估值业务所需的专业胜任能力，参与估值流程各方之间不存在重大利益冲突。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金本报告期末未进行利润分配，符合相关法规及基金合同的规定。

§ 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：2013 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2013 年 6 月 30 日	上年度末 2012 年 12 月 31 日
资产：			
银行存款	6.4.7.1	1,065,381,053.01	1,211,605,460.95
结算备付金		13,278,078.69	10,876,398.12
存出保证金		3,583,021.48	5,597,121.08
交易性金融资产	6.4.7.2	9,716,258,132.12	9,238,445,031.83
其中：股票投资		8,808,259,132.12	8,613,600,031.83
基金投资		-	-
债券投资		907,999,000.00	624,845,000.00
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	892,402,578.60	296,100,764.15
应收证券清算款		489,238,787.96	501,786,489.74
应收利息	6.4.7.5	14,797,049.56	15,018,020.21
应收股利		874,104.34	-
应收申购款		830,707.19	30,179,805.53
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		12,196,643,512.95	11,309,609,091.61
负债和所有者权益	附注号	本期末 2013 年 6 月 30 日	上年度末 2012 年 12 月 31 日
负 债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		73,136,294.01	-
应付赎回款		86,239,036.29	5,336,427.91
应付管理人报酬		15,202,959.27	13,255,075.23
应付托管费		2,533,826.53	2,209,179.21
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	18,957,323.84	19,517,388.43
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	741,812.47	1,983,785.89
负债合计		196,811,252.41	42,301,856.67
所有者权益：			
实收基金	6.4.7.9	11,732,421,694.89	12,703,673,009.50
未分配利润	6.4.7.10	267,410,565.65	-1,436,365,774.56
所有者权益合计		11,999,832,260.54	11,267,307,234.94
负债和所有者权益总计		12,196,643,512.95	11,309,609,091.61

注：报告截止日 2013 年 6 月 30 日，基金份额净值 1.0228 元，基金份额总额 11,732,421,694.89 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：2013 年 1 月 1 日至 2013 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2013 年 1 月 1 日至 2013 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2012 年 1 月 1 日至 2012 年 6 月 30 日
一、收入		1,808,309,755.62	1,323,748,318.71
1.利息收入		19,912,616.18	11,663,724.17
其中：存款利息收入	6.4.7.11	5,522,640.31	5,263,366.67
债券利息收入		9,389,809.60	2,854,520.54
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		5,000,166.27	3,545,836.96
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		999,017,068.23	-32,194,794.88
其中：股票投资收益	6.4.7.12	950,680,204.15	-85,405,326.42
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.13	-186,215.15	-
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	48,523,079.23	53,210,531.54
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.16	788,662,479.05	1,343,474,642.05
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	717,592.16	804,747.37
减：二、费用		133,552,310.12	114,509,310.03
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	87,975,158.15	78,561,882.36
2. 托管费	6.4.10.2.2	14,662,526.35	13,093,647.11
3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用	6.4.7.18	30,655,627.67	22,598,796.55
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	258,997.95	254,984.01
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		1,674,757,445.50	1,209,239,008.68
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		1,674,757,445.50	1,209,239,008.68

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：2013 年 1 月 1 日至 2013 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2013 年 1 月 1 日至 2013 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）	12,703,673,009.50	-1,436,365,774.56	11,267,307,234.94
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	1,674,757,445.50	1,674,757,445.50
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）	-971,251,314.61	29,018,894.71	-942,232,419.90
其中：1.基金申购款	512,865,945.64	-11,456,213.55	501,409,732.09
2.基金赎回款	-1,484,117,260.25	40,475,108.26	-1,443,642,151.99
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）	11,732,421,694.89	267,410,565.65	11,999,832,260.54
项目	上年度可比期间 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	-	1,209,239,008.68	1,209,239,008.68

的基金净值变动数（本期利润）			
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

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：

_____ 黄小慧	_____ 向辉	_____ 张幸骏
基金管理人负责人	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%，债券及现金占 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 2013 年 8 月 24 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”)、中国证监会颁布的[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>》、中国证券投资基金业协会颁布的《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 2013 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 2013 年 6 月 30 日的财务状况以及 2013 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[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) 对基金从证券市场中取得的收入, 包括买卖股票、债券的差价收入, 股权的股息、红利收入, 债券的利息收入及其他收入, 暂不征收企业所得税。
- (3) 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支付利息时代扣代缴 20% 的个人所得税。对基金取得的股票的股息、红利收入, 按财政部、国家税务总局、中国证监会于 2012 年 11 月 16 日联合发布财税[2012]85 号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》(以下简称“通知”), 要求个人从公开发行和转让市场取得的上市公司股票,

持股期限在 1 个月以内(含 1 个月)的, 其股息红利所得全额计入应纳税所得额; 持股期限在 1 个月以上至 1 年(含 1 年)的, 暂减按 50%计入应纳税所得额; 持股期限超过 1 年的, 暂减按 25%计入应纳税所得额。上述所得统一适用 20%的税率计征个人所得税。证券投资基金从上市公司取得的股息红利所得, 按照本通知的规定计征个人所得税。通知自 2013 年 1 月 1 日起施行。

(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 2013 年 6 月 30 日
活期存款	1,065,381,053.01
定期存款	-
其中: 存款期限 1-3 个月	-
其他存款	-
合计:	1,065,381,053.01

6.4.7.2 交易性金融资产

单位: 人民币元

项目	本期末 2013 年 6 月 30 日			
	成本	公允价值	公允价值变动	
股票	6,939,383,199.05	8,808,259,132.12	1,868,875,933.07	
债券	交易所市场	-	-	
	银行间市场	910,072,639.74	907,999,000.00	-2,073,639.74
	合计	910,072,639.74	907,999,000.00	-2,073,639.74
资产支持证券	-	-	-	
基金	-	-	-	
其他	-	-	-	
合计	7,849,455,838.79	9,716,258,132.12	1,866,802,293.33	

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**

单位：人民币元

项目	本期末 2013年6月30日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
买入返售证券_银行间	892,402,578.60	-
合计	892,402,578.60	-

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 2013年6月30日
应收活期存款利息	265,091.60
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	5,975.10
应收债券利息	13,626,256.87
应收买入返售证券利息	898,112.21
应收申购款利息	1.48
其他	1,612.30
合计	14,797,049.56

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 2013年6月30日
交易所市场应付交易费用	18,934,293.16
银行间市场应付交易费用	23,030.68
合计	18,957,323.84

6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2013年6月30日
应付券商交易单元保证金	500,000.00
应付赎回费	1,980.08
预提费用	239,832.39
合计	741,812.47

6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2013年1月1日至2013年6月30日	
	基金份额(份)	账面金额
上年度末	12,703,673,009.50	12,703,673,009.50
本期申购	512,865,945.64	512,865,945.64
本期赎回(以“-”号填列)	-1,484,117,260.25	-1,484,117,260.25
本期末	11,732,421,694.89	11,732,421,694.89

注：申购含转换入份额；赎回含转换出份额。

6.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-3,438,641,697.84	2,002,275,923.28	-1,436,365,774.56
本期利润	886,094,966.45	788,662,479.05	1,674,757,445.50
本期基金份额交易产生的变动数	235,152,152.98	-206,133,258.27	29,018,894.71
其中：基金申购款	-124,034,565.74	112,578,352.19	-11,456,213.55
基金赎回款	359,186,718.72	-318,711,610.46	40,475,108.26
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-2,317,394,578.41	2,584,805,144.06	267,410,565.65

6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2013年1月1日至2013年6月30日
活期存款利息收入	5,341,763.45
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	140,399.37

其他	40,477.49
合计	5,522,640.31

6.4.7.12 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2013年1月1日至2013年6月30日
卖出股票成交总额	10,629,457,135.30
减：卖出股票成本总额	9,678,776,931.15
买卖股票差价收入	950,680,204.15

6.4.7.13 债券投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2013年1月1日至2013年6月30日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	844,572,275.68
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	823,774,350.28
减：应收利息总额	20,984,140.55
债券投资收益	-186,215.15

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 2013年1月1日至2013年6月30日
股票投资产生的股利收益	48,523,079.23
基金投资产生的股利收益	-
合计	48,523,079.23

6.4.7.16 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2013年1月1日至2013年6月30日
1. 交易性金融资产	788,662,479.05

——股票投资	790,113,968.79
——债券投资	-1,451,489.74
——资产支持证券投资	-
2. 衍生工具	-
——权证投资	-
3. 其他	-
合计	788,662,479.05

6.4.7.17 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2013年1月1日至2013年6月30日
基金赎回费收入	578,539.24
转换费收入	139,052.92
合计	717,592.16

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. 本基金的转换费由申购补差费和转出基金的赎回费两部分构成，其中转出基金的赎回费的 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 2013年1月1日至2013年6月30日
交易所市场交易费用	30,646,727.67
银行间市场交易费用	8,900.00
合计	30,655,627.67

6.4.7.19 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2013年1月1日至2013年6月30日
审计费用	84,300.75
信息披露费	155,531.64
银行费用	9,765.56
其他手续费	400.00
银行间帐户维护费	9,000.00
合计	258,997.95

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
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”)	华宝信托的最终控制人
华宝证券有限责任公司(“华宝证券”)	受宝钢集团控制的公司
华宝投资有限公司(“华宝投资”)	受宝钢集团控制的公司

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 2013年1月1日至2013年6月30日		上年度可比期间 2012年1月1日至2012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	290,482,237.25	1.47%	635,526,114.75	4.25%

6.4.10.1.2 权证交易

本基金本报告期及上年度可比期间无通过关联方交易单元进行的权证交易。

6.4.10.1.3 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2013年1月1日至2013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	264,451.72	1.49%	-	-
关联方名称	上年度可比期间 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%	-	-

注：1. 上述佣金参考市场价格经本基金的基金管理人与对方协商确定，以扣除由中国证券登记结算有限责任公司收取的证管费和经手费的净额列示。

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 2013年1月1日至2013年6月 30日	上年度可比期间 2012年1月1日至2012年6月30日
	当期发生的基金应支付的管理费	87,975,158.15
其中：支付销售机构的客户维护费	15,219,852.25	14,410,085.60

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 2013年1月1日至2013年6月30日	上年度可比期间 2012年1月1日至2012年6月30日

当期发生的基金应支付的托管费	14,662,526.35	13,093,647.11
----------------	---------------	---------------

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

本基金本期及上年度可比期间无与关联方进行的银行间同业市场的债券(含回购)交易。

6.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

份额单位：份

项目	本期	上年度可比期间
	2013 年 1 月 1 日至 2013 年 6 月 30 日	2012 年 1 月 1 日至 2012 年 6 月 30 日
期初持有的基金份额	1,879,090.65	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	267,765.66	-
期末持有的基金份额	1,611,324.99	1,879,090.65
期末持有的基金份额占基金总份额比例	0.01%	0.02%

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

本基金本报告期末及上年度末无除管理人之外的其他关联方投资本基金的情况。

6.4.10.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期		上年度可比期间	
	2013 年 1 月 1 日至 2013 年 6 月 30 日		2012 年 1 月 1 日至 2012 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	1,065,381,053.01	5,341,763.45	160,622,563.18	5,137,554.97

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。

6.4.10.7 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期及上年度可比期间无须作说明的其他关联交易事项。

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（2013 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

金额单位：人民币元

6.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量 (单位：股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
002313	日海通讯	2012 年 7 月 17 日	2013 年 7 月 18 日	非公开发行流通受限	20.00	16.42	2,000,000	40,000,000.00	32,840,000.00	2013 年 5 月 10 日, 每 10 股派息 3.0 元(含税)
002313	日海通讯	-	2013 年 7 月 18 日	非公开发行流通受限	-	16.42	600,000	-	9,852,000.00	2013 年 5 月 10 日每 10 股转增 3.0 股

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	复牌开盘价	数量(股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
300027	华谊兄弟	2013 年 6 月 5 日	重大事项停牌	28.55	2013 年 7 月 24 日	31.41	8,886,866	212,504,324.00	253,720,024.30	-
300326	凯利泰	2013 年 6 月 17 日	重大事项停牌	35.55	2013 年 7 月 29 日	39.11	954,950	31,130,481.14	33,948,472.50	-
601989	中国重工	2013 年 5 月 17 日	重大事项停牌	4.52	尚未复牌	尚未复牌	429,016	2,300,473.53	1,939,152.32	-
600598	北大荒	2013 年 5 月 27 日	重大事项停牌	8.35	2013 年 7 月 19 日	8.35	54,953	456,489.93	458,857.55	-
601918	国投新集	2013 年 5 月 16 日	重大事项停牌	7.55	尚未复牌	尚未复牌	53,009	557,333.37	400,217.95	-
600547	山东黄金	2013 年 4 月	重大事项	24.30	2013 年 7 月	28.77	67,652	2,460,660.78	1,643,943.60	-

		3 日	停牌		1 日					
000999	华润三九	2013 年 6 月 3 日	重大事项停牌	26.55	2013 年 8 月 19 日	26.51	18,309	448,862.29	486,103.95	-
300133	华策影视	2013 年 5 月 28 日	重大事项停牌	23.88	2013 年 7 月 30 日	26.87	9,363,952	162,108,359.32	223,611,173.76	-

注：本基金截至 2013 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，因此没有在银行间市场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，因此没有在交易所市场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“风险与收益相匹配”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内部控制委员会、副总经理、督察长、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。内部控制委员会负责对公司经营管理和基金运作中的风险进行评估并研究制订相应的控制制度。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；监察稽核部在督察长的领导下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；第三层监控防线为风险管理部和监察稽核部对各岗位、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，并对风险管理部和监察稽核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。

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。

本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。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以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，违约风险可能性很小；在银行间同业市场进行交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式进行限制以控制相应的信用风险。

本基金的基金管理人建立了信用风险管理流程，通过对投资品种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 2013 年 06 月 30 日，本基金持有的除国债、央行票据和政策性金融债以外的债券占基金资产净值的比例为 4.58% (2012 年 12 月 31 日：本基金持有的除国债、央行票据和政策性金融债以外的债券占基金资产净值的比例为 0.66%)。

6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金在履行与金融负债有关的义务时遇到资金短缺的风险。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，因此除附注 6.4.12 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。

于 2013 年 06 月 30 日，本基金所承担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。

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 2013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	1,065,381,053.01	-	-	-	1,065,381,053.01
结算备付金	13,278,078.69	-	-	-	13,278,078.69
存出保证金	3,583,021.48	-	-	-	3,583,021.48
交易性金融资产	907,999,000.00	-	-	8,808,259,132.12	9,716,258,132.12
买入返售金融资产	892,402,578.60	-	-	-	892,402,578.60
应收证券清算款	-	-	-	489,238,787.96	489,238,787.96
应收利息	-	-	-	14,797,049.56	14,797,049.56
应收股利	-	-	-	874,104.34	874,104.34
应收申购款	248.51	-	-	830,458.68	830,707.19
资产总计	2,882,643,980.29	-	-	9,313,999,532.66	12,196,643,512.95
负债					
应付证券清算款	-	-	-	73,136,294.01	73,136,294.01
应付赎回款	-	-	-	86,239,036.29	86,239,036.29
应付管理人报酬	-	-	-	15,202,959.27	15,202,959.27
应付托管费	-	-	-	2,533,826.53	2,533,826.53
应付交易费用	-	-	-	18,957,323.84	18,957,323.84
其他负债	-	-	-	741,812.47	741,812.47
负债总计	-	-	-	196,811,252.41	196,811,252.41
利率敏感度缺口	2,882,643,980.29	-	-	9,117,188,280.25	11,999,832,260.54
上年度末 2012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	1,211,605,460.95	-	-	-	1,211,605,460.95
结算备付金	10,876,398.12	-	-	-	10,876,398.12
存出保证金	-	-	-	5,597,121.08	5,597,121.08
交易性金融资产	550,220,000.00	74,625,000.00	-	8,613,600,031.83	9,238,445,031.83
买入返售金融资产	296,100,764.15	-	-	-	296,100,764.15

资产					
应收证券清算款	-	-	-	501,786,489.74	501,786,489.74
应收利息	-	-	-	15,018,020.21	15,018,020.21
应收申购款	29,999,793.46	-	-	180,012.07	30,179,805.53
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	2,098,802,416.68	74,625,000.00	-	9,136,181,674.93	11,309,609,091.61
负债					
应付赎回款	-	-	-	5,336,427.91	5,336,427.91
应付管理人报酬	-	-	-	13,255,075.23	13,255,075.23
应付托管费	-	-	-	2,209,179.21	2,209,179.21
应付交易费用	-	-	-	19,517,388.43	19,517,388.43
其他负债	-	-	-	1,983,785.89	1,983,785.89
负债总计	-	-	-	42,301,856.67	42,301,856.67
利率敏感度缺口	2,098,802,416.68	74,625,000.00	-	9,093,879,818.26	11,267,307,234.94

注：表中所示为本基金资产及负债的账面价值，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（2013年6月30日）	上年度末（2012年12月31日）
	1. 市场利率下降 25个基点	1,278,172.27	-
2. 市场利率上升 25个基点	-1,274,028.80	-	

注：上年度末，本基金持有的交易性债券投资公允价值占基金资产净值的比例为 5.55%，因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响。

6.4.13.4.2 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。

6.4.13.4.3 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，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%，债券及现金占 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。

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2013 年 6 月 30 日		上年度末 2012 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	8,808,259,132.12	73.40	8,613,600,031.83	76.45
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	8,808,259,132.12	73.40	8,613,600,031.83	76.45

6.4.13.4.3.2 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 (2013 年 6 月 30 日)	上年度末 (2012 年 12 月 31 日)
	1. 业绩比较基准上升 5%	630,432,187.51	452,663,504.80
2. 业绩比较基准下降 5%	-630,432,187.51	-452,663,504.80	

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 2013 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 8,249,359,186.19 元，属于二层级的余额为 1,466,898,945.93 元，无属于第三层级的余额(2012 年 12 月 31 日：第一层级 8,269,072,479.19 元，第二层级 969,372,552.64 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(2012 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	8,808,259,132.12	72.22
	其中：股票	8,808,259,132.12	72.22
2	固定收益投资	907,999,000.00	7.44
	其中：债券	907,999,000.00	7.44
	资产支持证券	-	-
3	金融衍生品投资	-	-
4	买入返售金融资产	892,402,578.60	7.32
	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	1,078,659,131.70	8.84

6	其他各项资产	509,323,670.53	4.18
7	合计	12,196,643,512.95	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（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	1,436,537.36	0.01
B	采矿业	96,608,884.68	0.81
C	制造业	3,587,919,869.20	29.90
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	49,253,346.55	0.41
E	建筑业	1,397,521,763.41	11.65
F	批发和零售业	37,182,332.02	0.31
G	交通运输、仓储和邮政业	4,771,028.46	0.04
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	338,322,698.70	2.82
J	金融业	66,251,851.48	0.55
K	房地产业	921,837,562.53	7.68
L	租赁和商务服务业	628,359,893.51	5.24
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	782,786,748.84	6.52
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	7,200,000.00	0.06
R	文化、体育和娱乐业	477,757,712.04	3.98
S	综合	411,048,903.34	3.43
	合计	8,808,259,132.12	73.40

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	300070	碧水源	20,739,217	781,453,696.56	6.51
2	002375	亚厦股份	18,152,213	559,088,160.40	4.66

3	002038	双鹭药业	8,213,147	481,290,414.20	4.01
4	300058	蓝色光标	10,797,733	450,265,466.10	3.75
5	600256	广汇能源	31,647,285	410,148,813.60	3.42
6	000002	万科A	35,843,771	353,061,144.35	2.94
7	002450	康得新	12,000,000	335,760,000.00	2.80
8	600887	伊利股份	9,577,919	299,597,306.32	2.50
9	600518	康美药业	14,763,528	283,902,643.44	2.37
10	300027	华谊兄弟	8,886,866	253,720,024.30	2.11
11	600048	保利地产	24,204,581	239,867,397.71	2.00
12	300133	华策影视	9,363,952	223,611,173.76	1.86
13	002081	金螳螂	7,319,520	208,386,734.40	1.74
14	300273	和佳股份	9,700,049	207,775,049.58	1.73
15	300026	红日药业	6,000,000	203,640,000.00	1.70
16	002310	东方园林	5,011,462	191,888,879.98	1.60
17	002415	海康威视	5,018,851	177,366,194.34	1.48
18	002400	省广股份	6,700,000	176,880,000.00	1.47
19	002241	歌尔声学	4,718,037	171,217,562.73	1.43
20	000961	中南建设	17,016,514	166,421,506.92	1.39
21	002051	中工国际	5,850,000	163,039,500.00	1.36
22	002244	滨江集团	17,000,000	142,800,000.00	1.19
23	600535	天士力	3,527,944	138,119,007.60	1.15
24	300147	香雪制药	8,138,000	136,555,640.00	1.14
25	300115	长盈精密	4,148,373	133,328,708.22	1.11
26	300315	掌趣科技	3,300,000	108,834,000.00	0.91
27	000024	招商地产	4,032,911	97,919,079.08	0.82
28	002475	立讯精密	4,500,000	94,500,000.00	0.79
29	000917	电广传媒	7,367,849	86,719,582.73	0.72
30	600376	首开股份	15,063,928	83,604,800.40	0.70
31	300157	恒泰艾普	2,303,828	79,666,372.24	0.66
32	600703	三安光电	4,031,100	79,170,804.00	0.66
33	300090	盛运股份	2,508,339	77,457,508.32	0.65
34	002236	大华股份	1,915,887	73,244,360.01	0.61
35	002663	普邦园林	4,500,000	67,815,000.00	0.57
36	300210	森远股份	2,581,800	51,636,000.00	0.43
37	300037	新宙邦	2,525,191	51,261,377.30	0.43
38	002410	广联达	2,700,000	51,192,000.00	0.43
39	002065	东华软件	2,413,080	47,778,984.00	0.40
40	600332	广州药业	1,350,000	46,251,000.00	0.39
41	000800	一汽轿车	3,587,423	44,125,302.90	0.37

42	000669	金鸿能源	1,151,705	43,580,517.20	0.36
43	002313	日海通讯	2,600,000	42,692,000.00	0.36
44	002509	天广消防	4,817,502	42,249,492.54	0.35
45	002635	安洁科技	880,187	39,670,028.09	0.33
46	600261	阳光照明	3,099,962	39,307,518.16	0.33
47	002612	朗姿股份	1,800,000	36,648,000.00	0.31
48	300326	凯利泰	954,950	33,948,472.50	0.28
49	002221	东华能源	3,000,000	32,040,000.00	0.27
50	002429	兆驰股份	4,199,838	31,456,786.62	0.26
51	002421	达实智能	1,887,962	31,415,687.68	0.26
52	002325	洪涛股份	2,200,000	26,180,000.00	0.22
53	300146	汤臣倍健	563,171	24,773,892.29	0.21
54	002297	博云新材	1,943,214	22,249,800.30	0.19
55	300205	天喻信息	1,000,000	16,700,000.00	0.14
56	600062	华润双鹤	815,542	16,327,150.84	0.14
57	300110	华仁药业	1,600,000	12,624,000.00	0.11
58	002296	辉煌科技	719,668	11,485,901.28	0.10
59	600479	千金药业	1,000,000	10,250,000.00	0.09
60	300057	万顺股份	700,000	10,045,000.00	0.08
61	600352	浙江龙盛	1,059,070	9,934,076.60	0.08
62	600016	民生银行	1,014,213	8,691,805.41	0.07
63	600720	祁连山	1,000,000	8,540,000.00	0.07
64	002482	广田股份	400,000	8,400,000.00	0.07
65	002368	太极股份	400,000	7,676,000.00	0.06
66	002327	富安娜	600,000	7,668,000.00	0.06
67	600036	招商银行	634,520	7,360,432.00	0.06
68	300244	迪安诊断	200,000	7,200,000.00	0.06
69	600184	光电股份	300,000	6,768,000.00	0.06
70	002503	搜于特	570,000	6,480,900.00	0.05
71	002303	美盈森	225,215	5,576,323.40	0.05
72	601318	中国平安	150,253	5,222,794.28	0.04
73	601166	兴业银行	341,485	5,043,733.45	0.04
74	600000	浦发银行	501,251	4,150,358.28	0.03
75	600837	海通证券	388,481	3,643,951.78	0.03
76	600519	贵州茅台	18,659	3,589,431.83	0.03
77	601328	交通银行	879,427	3,579,267.89	0.03
78	600030	中信证券	328,105	3,323,703.65	0.03
79	601398	工商银行	768,959	3,091,215.18	0.03
80	601288	农业银行	1,147,218	2,822,156.28	0.02

81	601088	中国神华	162,242	2,748,379.48	0.02
82	000651	格力电器	109,466	2,743,217.96	0.02
83	601668	中国建筑	728,159	2,381,079.93	0.02
84	300005	探路者	240,000	2,289,600.00	0.02
85	601169	北京银行	259,390	2,067,338.30	0.02
86	000001	平安银行	201,125	2,005,216.25	0.02
87	601989	中国重工	429,016	1,939,152.32	0.02
88	600104	上汽集团	141,247	1,865,872.87	0.02
89	000858	五粮液	91,662	1,836,906.48	0.02
90	601006	大秦铁路	292,006	1,734,515.64	0.01
91	601818	光大银行	590,939	1,707,813.71	0.01
92	600900	长江电力	239,617	1,658,149.64	0.01
93	600547	山东黄金	67,652	1,643,943.60	0.01
94	600015	华夏银行	170,231	1,535,483.62	0.01
95	600383	金地集团	215,897	1,481,053.42	0.01
96	600893	航空动力	85,000	1,400,800.00	0.01
97	601857	中国石油	174,920	1,331,141.20	0.01
98	600050	中国联通	424,672	1,324,976.64	0.01
99	600111	包钢稀土	63,307	1,321,217.09	0.01
100	600585	海螺水泥	98,655	1,320,003.90	0.01
101	000776	广发证券	118,232	1,310,010.56	0.01
102	000538	云南白药	15,446	1,297,618.46	0.01
103	000063	中兴通讯	96,057	1,224,726.75	0.01
104	000895	双汇发展	30,580	1,175,495.20	0.01
105	600999	招商证券	112,684	1,171,913.60	0.01
106	000157	中联重科	209,642	1,138,356.06	0.01
107	600028	中国石化	271,785	1,136,061.30	0.01
108	600031	三一重工	145,390	1,091,878.90	0.01
109	002024	苏宁云商	207,516	1,039,655.16	0.01
110	600011	华能国际	189,263	1,010,664.42	0.01
111	601628	中国人寿	72,966	998,904.54	0.01
112	000423	东阿阿胶	25,620	990,981.60	0.01
113	600406	国电南瑞	64,029	955,952.97	0.01
114	600795	国电电力	411,250	937,650.00	0.01
115	601899	紫金矿业	388,938	925,672.44	0.01
116	601988	中国银行	336,184	911,058.64	0.01
117	000069	华侨城 A	174,841	903,927.97	0.01
118	601117	中国化学	94,279	897,536.08	0.01
119	000100	TCL 集团	378,414	858,999.78	0.01

120	601009	南京银行	101,470	855,392.10	0.01
121	600276	恒瑞医药	32,351	852,772.36	0.01
122	000625	长安汽车	90,893	844,395.97	0.01
123	600309	万华化学	52,286	837,621.72	0.01
124	600739	辽宁成大	63,701	835,757.12	0.01
125	600690	青岛海尔	75,804	827,021.64	0.01
126	600089	特变电工	99,628	802,005.40	0.01
127	000527	美的电器	63,674	790,831.08	0.01
128	000568	泸州老窖	33,161	788,568.58	0.01
129	600066	宇通客车	42,850	785,440.50	0.01
130	600649	城投控股	111,452	771,247.84	0.01
131	000338	潍柴动力	44,148	765,967.80	0.01
132	601688	华泰证券	94,677	763,096.62	0.01
133	601901	方正证券	135,750	750,697.50	0.01
134	601299	中国北车	198,702	747,119.52	0.01
135	002304	洋河股份	12,455	676,306.50	0.01
136	600804	鹏博士	63,848	676,150.32	0.01
137	600085	同仁堂	30,849	674,976.12	0.01
138	601788	光大证券	64,693	659,868.60	0.01
139	600489	中金黄金	70,702	656,821.58	0.01
140	600694	大商股份	22,325	645,862.25	0.01
141	000581	威孚高科	19,311	644,794.29	0.01
142	600362	江西铜业	40,313	634,526.62	0.01
143	601186	中国铁建	149,892	629,546.40	0.01
144	000783	长江证券	79,210	626,551.10	0.01
145	601766	中国南车	173,735	625,446.00	0.01
146	000402	金融街	124,185	622,166.85	0.01
147	600600	青岛啤酒	16,330	620,213.40	0.01
148	600583	海油工程	93,954	607,882.38	0.01
149	000983	西山煤电	74,444	607,463.04	0.01
150	600315	上海家化	13,407	603,180.93	0.01
151	000012	南玻A	64,938	601,975.26	0.01
152	002422	科伦药业	11,260	600,270.60	0.01
153	601390	中国中铁	246,011	600,266.84	0.01
154	000009	中国宝安	51,478	566,258.00	0.00
155	600196	复星医药	53,954	565,437.92	0.00
156	600009	上海机场	46,993	560,156.56	0.00
157	000768	中航飞机	61,350	546,015.00	0.00
158	000623	吉林敖东	37,197	542,332.26	0.00

159	600100	同方股份	78,785	540,465.10	0.00
160	600642	申能股份	139,942	531,779.60	0.00
161	601699	潞安环能	44,217	528,835.32	0.00
162	000792	盐湖股份	31,086	526,596.84	0.00
163	600348	阳泉煤业	57,500	519,800.00	0.00
164	601168	西部矿业	94,872	513,257.52	0.00
165	601998	中信银行	134,298	498,245.58	0.00
166	600010	宝钢股份	119,677	490,675.70	0.00
167	000999	华润三九	18,309	486,103.95	0.00
168	002353	杰瑞股份	6,938	478,722.00	0.00
169	601377	兴业证券	52,668	478,225.44	0.00
170	000562	宏源证券	54,370	477,912.30	0.00
171	000629	攀钢钒钛	199,633	469,137.55	0.00
172	002142	宁波银行	55,250	467,967.50	0.00
173	000060	中金岭南	69,956	463,108.72	0.00
174	600637	百视通	16,453	460,684.00	0.00
175	600598	北大荒	54,953	458,857.55	0.00
176	600143	金发科技	93,944	453,749.52	0.00
177	600674	川投能源	44,448	452,036.16	0.00
178	601607	上海医药	42,470	451,456.10	0.00
179	601111	中国国航	105,969	449,308.56	0.00
180	600005	XD 武钢股	199,885	447,742.40	0.00
181	601898	中煤能源	90,438	442,241.82	0.00
182	601600	中国铝业	139,822	440,439.30	0.00
183	002146	荣盛发展	30,888	435,829.68	0.00
184	600150	中国船舶	26,616	430,380.72	0.00
185	600832	东方明珠	77,881	429,124.31	0.00
186	000709	河北钢铁	230,130	425,740.50	0.00
187	600108	亚盛集团	64,142	418,205.84	0.00
188	002202	金风科技	77,223	416,231.97	0.00
189	600153	建发股份	65,073	409,309.17	0.00
190	600068	葛洲坝	103,727	408,684.38	0.00
191	600497	驰宏锌锗	41,783	407,384.25	0.00
192	000425	徐工机械	51,854	407,053.90	0.00
193	601633	长城汽车	11,393	403,540.06	0.00
194	600029	南方航空	142,895	402,963.90	0.00
195	600660	福耀玻璃	55,664	400,224.16	0.00
196	601918	国投新集	53,009	400,217.95	0.00
197	000725	京东方 A	179,960	399,511.20	0.00

198	600741	华域汽车	50,913	397,121.40	0.00
199	600369	西南证券	51,445	394,583.15	0.00
200	600177	雅戈尔	64,554	394,424.94	0.00
201	601808	中海油服	27,986	394,322.74	0.00
202	601618	中国中冶	241,419	388,684.59	0.00
203	002385	大北农	37,656	388,609.92	0.00
204	000039	中集集团	37,433	386,682.89	0.00
205	000728	国元证券	45,106	381,596.76	0.00
206	600655	豫园商城	57,199	372,365.49	0.00
207	000630	铜陵有色	34,390	370,724.20	0.00
208	600498	烽火通信	22,376	368,756.48	0.00
209	601958	金铂股份	45,795	363,154.35	0.00
210	600549	厦门钨业	13,593	362,933.10	0.00
211	002500	山西证券	59,932	354,797.44	0.00
212	600271	航天信息	26,759	353,753.98	0.00
213	600166	福田汽车	68,564	349,676.40	0.00
214	600340	华夏幸福	10,670	347,201.80	0.00
215	600881	亚泰集团	88,843	345,599.27	0.00
216	000729	燕京啤酒	58,668	334,994.28	0.00
217	600415	小商品城	65,323	330,534.38	0.00
218	600208	新湖中宝	106,325	328,544.25	0.00
219	601333	广深铁路	141,465	325,369.50	0.00
220	601669	中国水电	112,819	324,918.72	0.00
221	002570	贝因美	11,598	324,164.10	0.00
222	000878	云南铜业	33,262	322,641.40	0.00
223	600839	四川长虹	180,038	322,268.02	0.00
224	601018	宁波港	159,340	321,866.80	0.00
225	600811	东方集团	65,007	320,484.51	0.00
226	000970	中科三环	24,370	317,784.80	0.00
227	002007	华兰生物	14,061	317,497.38	0.00
228	600718	东软集团	38,802	315,848.28	0.00
229	002594	比亚迪	10,489	313,725.99	0.00
230	002106	莱宝高科	20,032	307,491.20	0.00
231	000758	中色股份	30,073	304,639.49	0.00
232	000839	中信国安	46,854	302,208.30	0.00
233	601888	中国国旅	10,307	300,964.40	0.00
234	601666	平煤股份	57,554	299,280.80	0.00
235	600809	山西汾酒	12,139	297,405.50	0.00
236	600316	洪都航空	19,051	297,195.60	0.00

237	600118	中国卫星	20,944	296,985.92	0.00
238	000061	农产品	49,393	296,851.93	0.00
239	600516	方大炭素	36,572	296,233.20	0.00
240	600267	海正药业	23,109	293,946.48	0.00
241	000937	冀中能源	33,192	293,085.36	0.00
242	000825	太钢不锈	113,492	291,674.44	0.00
243	002405	四维图新	20,797	290,742.06	0.00
244	600372	中航电子	13,862	290,408.90	0.00
245	600115	东方航空	112,402	287,749.12	0.00
246	002344	海宁皮城	14,970	286,076.70	0.00
247	600664	哈药股份	47,805	283,961.70	0.00
248	600997	开滦股份	48,588	276,951.60	0.00
249	600123	兰花科创	21,834	276,200.10	0.00
250	600875	东方电气	26,326	271,684.32	0.00
251	600188	XD 兖州煤	28,881	271,481.40	0.00
252	000960	锡业股份	22,020	268,644.00	0.00
253	002155	辰州矿业	33,169	266,678.76	0.00
254	002001	新和成	17,765	261,856.10	0.00
255	600216	浙江医药	12,657	259,721.64	0.00
256	600219	南山铝业	55,358	259,629.02	0.00
257	601106	中国一重	127,896	258,349.92	0.00
258	002073	软控股份	29,643	248,704.77	0.00
259	601098	中南传媒	26,620	247,566.00	0.00
260	000876	新希望	24,981	246,062.85	0.00
261	601992	金隅股份	49,073	245,365.00	0.00
262	601158	重庆水务	47,333	243,764.95	0.00
263	000422	湖北宜化	35,995	242,966.25	0.00
264	600221	海南航空	118,896	240,169.92	0.00
265	000528	柳工	36,463	237,009.50	0.00
266	000898	*ST 鞍钢	90,398	236,842.76	0.00
267	600125	铁龙物流	44,511	235,908.30	0.00
268	601717	郑煤机	37,707	235,668.75	0.00
269	002092	中泰化学	46,305	235,229.40	0.00
270	601933	永辉超市	20,135	234,975.45	0.00
271	000401	冀东水泥	28,422	233,628.84	0.00
272	600132	重庆啤酒	15,294	229,868.82	0.00
273	601179	中国西电	73,937	226,247.22	0.00
274	000869	张裕 A	6,623	226,109.22	0.00
275	600058	五矿发展	20,675	225,357.50	0.00

276	600886	国投电力	66,307	224,117.66	0.00
277	600259	广晟有色	6,023	221,465.71	0.00
278	600266	北京城建	21,069	215,535.87	0.00
279	000778	新兴铸管	43,761	214,866.51	0.00
280	601866	中海集运	110,948	213,020.16	0.00
281	000933	神火股份	47,619	212,380.74	0.00
282	600395	盘江股份	23,200	212,280.00	0.00
283	000686	东北证券	12,966	210,567.84	0.00
284	601118	海南橡胶	50,686	209,840.04	0.00
285	600770	综艺股份	35,492	209,402.80	0.00
286	600863	内蒙华电	37,011	209,112.15	0.00
287	600170	上海建工	30,200	206,568.00	0.00
288	000559	万向钱潮	39,207	205,836.75	0.00
289	600970	中材国际	22,013	202,519.60	0.00
290	600895	张江高科	37,259	197,472.70	0.00
291	000046	泛海建设	39,834	194,389.92	0.00
292	600588	用友软件	21,725	194,221.50	0.00
293	600859	王府井	11,752	189,324.72	0.00
294	000718	苏宁环球	32,172	189,171.36	0.00
295	601001	大同煤业	32,720	187,485.60	0.00
296	600037	歌华有线	30,637	185,660.22	0.00
297	600779	水井坊	16,190	185,537.40	0.00
298	002299	圣农发展	20,512	185,428.48	0.00
299	000969	安泰科技	23,868	185,215.68	0.00
300	600157	永泰能源	31,500	184,275.00	0.00
301	600160	巨化股份	31,595	184,198.85	0.00
302	600109	国金证券	16,013	184,149.50	0.00
303	600550	天威保变	33,115	180,807.90	0.00
304	600169	太原重工	77,293	180,092.69	0.00
305	601101	昊华能源	22,691	179,939.63	0.00
306	601928	凤凰传媒	21,278	178,947.98	0.00
307	600432	吉恩镍业	19,453	169,435.63	0.00
308	002431	棕榈园林	8,814	167,113.44	0.00
309	601369	陕鼓动力	24,595	166,016.25	0.00
310	000750	国海证券	16,051	165,646.32	0.00
311	600027	华电国际	52,359	164,930.85	0.00
312	600528	中铁二局	34,027	164,690.68	0.00
313	002069	獐子岛	13,857	164,205.45	0.00
314	002128	露天煤业	18,579	162,380.46	0.00

315	000807	云铝股份	43,344	161,239.68	0.00
316	600331	宏达股份	39,676	160,687.80	0.00
317	600827	友谊股份	23,071	158,497.77	0.00
318	600971	恒源煤电	19,847	152,821.90	0.00
319	600582	天地科技	23,438	150,471.96	0.00
320	601558	华锐风电	39,200	149,352.00	0.00
321	601099	太平洋	29,556	148,371.12	0.00
322	600252	中恒集团	10,678	148,210.64	0.00
323	601258	庞大集团	24,602	145,397.82	0.00
324	002399	海普瑞	8,057	143,414.60	0.00
325	000059	辽通化工	31,380	142,151.40	0.00
326	600783	鲁信创投	10,268	136,359.04	0.00
327	600508	上海能源	13,941	135,506.52	0.00
328	600873	梅花集团	33,702	133,796.94	0.00
329	601800	中国交建	32,813	132,892.65	0.00
330	600456	宝钛股份	10,670	125,159.10	0.00
331	601216	内蒙君正	16,592	124,440.00	0.00
332	601555	东吴证券	17,721	121,388.85	0.00
333	600546	山煤国际	9,619	113,888.96	0.00
334	002603	以岭药业	4,981	113,367.56	0.00
335	000780	平庄能源	18,487	99,275.19	0.00
336	002122	天马股份	27,429	97,921.53	0.00
337	600096	云天化	11,598	92,668.02	0.00
338	600022	山东钢铁	56,286	89,494.74	0.00
339	000968	煤气化	11,652	84,826.56	0.00
340	000703	恒逸石化	9,371	80,684.31	0.00
341	002673	西部证券	6,526	75,636.34	0.00
342	002378	章源钨业	3,780	70,497.00	0.00
343	000596	古井贡酒	3,279	68,465.52	0.00
344	601233	桐昆股份	13,052	66,043.12	0.00
345	601238	广汽集团	5,011	36,880.96	0.00
346	000883	湖北能源	6,464	31,221.12	0.00

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	000024	招商地产	407,315,264.46	3.62
2	002038	双鹭药业	347,769,506.27	3.09
3	600519	贵州茅台	255,032,390.93	2.26
4	000961	中南建设	238,227,667.55	2.11
5	002244	滨江集团	222,695,681.94	1.98
6	300273	和佳股份	216,346,330.26	1.92
7	300027	华谊兄弟	212,504,324.00	1.89
8	601166	兴业银行	211,301,653.46	1.88
9	601169	北京银行	206,296,071.53	1.83
10	600383	金地集团	203,431,696.09	1.81
11	002400	省广股份	203,096,313.90	1.80
12	600376	首开股份	190,398,394.22	1.69
13	000002	万科A	184,948,597.79	1.64
14	002051	中工国际	183,054,017.44	1.62
15	300133	华策影视	162,108,359.32	1.44
16	300026	红日药业	152,292,197.46	1.35
17	300147	香雪制药	149,535,858.90	1.33
18	600048	保利地产	142,771,450.90	1.27
19	000001	平安银行	139,557,396.90	1.24
20	300115	长盈精密	136,095,437.12	1.21

注：买入金额不包括相关交易费用。

7.4.2 累计卖出金额超期初基金资产净值 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	002081	金螳螂	558,086,455.50	4.95
2	002304	洋河股份	469,993,995.50	4.17
3	002450	康得新	379,451,987.88	3.37
4	600519	贵州茅台	370,478,163.02	3.29
5	002241	歌尔声学	340,019,335.28	3.02
6	002236	大华股份	282,842,625.50	2.51
7	600557	康缘药业	268,914,209.99	2.39
8	000024	招商地产	265,576,309.71	2.36
9	002415	海康威视	232,024,923.39	2.06
10	002310	东方园林	210,894,837.54	1.87

11	601166	兴业银行	195,375,306.22	1.73
12	601169	北京银行	190,222,255.55	1.69
13	600383	金地集团	185,315,751.60	1.64
14	002375	亚厦股份	182,127,868.97	1.62
15	601888	中国国旅	172,024,112.91	1.53
16	600546	山煤国际	163,010,768.20	1.45
17	600518	康美药业	151,043,327.19	1.34
18	600315	上海家化	137,098,159.77	1.22
19	600048	保利地产	128,379,703.27	1.14
20	000001	平安银行	126,994,996.80	1.13

注：卖出金额不包括相关交易费用。

7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	9,083,322,062.65
卖出股票收入（成交）总额	10,629,457,135.30

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	358,186,000.00	2.98
	其中：政策性金融债	358,186,000.00	2.98
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	549,813,000.00	4.58
6	中期票据	-	-
7	可转债	-	-
8	其他	-	-
9	合计	907,999,000.00	7.57

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	130218	13 国开 18	2,500,000	248,575,000.00	2.07
2	130201	13 国开 01	500,000	49,725,000.00	0.41

3	041356011	13 统众 CP001	500,000	49,590,000.00	0.41
4	041359026	13 海淀国资 CP001	500,000	49,565,000.00	0.41
5	041259037	12 京热力 CP001	400,000	40,292,000.00	0.34

7.7 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。

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 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

7.9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金未投资股指期货。

7.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金未投资股指期货。

7.10 投资组合报告附注

7.10.1

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。

7.10.2

基金投资的前十名股票未超出基金合同规定的备选股票库。

7.10.3 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	3,583,021.48
2	应收证券清算款	489,238,787.96
3	应收股利	874,104.34
4	应收利息	14,797,049.56
5	应收申购款	830,707.19
6	其他应收款	-

7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	509,323,670.53

7.10.4 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。

7.10.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值	占基金资产净值比例 (%)	流通受限情况说明
1	300027	华谊兄弟	253,720,024.30	2.11	重大事项停牌

§ 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
481,390	24,371.97	972,382,487.74	8.29%	10,760,039,207.15	91.71%

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
基金管理人所有从业人员 持有本基金	1,495,208.19	0.0127%

注：

(一) 本公司高级管理人员、基金投资和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	12,703,673,009.50
本报告期基金总申购份额	512,865,945.64
减：本报告期基金总赎回份额	1,484,117,260.25
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	11,732,421,694.89

注：总申购份额含转换入份额；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

本报告期内本基金未召开基金份额持有人大会。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

1、基金管理人的重大人事变动

(1) 2013年5月28日，基金管理人发布高级管理人员变更公告，常务副总经理谢文杰因工作变动，自2013年5月24日起不再担任常务副总经理的职务。

(2) 2013年8月8日，基金管理人发布高级管理人员变更公告，公司总经理裴长江先生因个人原因，自2013年7月31日起不再担任总经理职务，由黄小慧女士代任。

2、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，基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本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

本报告期内本基金的投资策略未发生变更。

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

1、基金管理人于 2013 年 6 月 28 日收到证监会上海稽查局编号为沪调查通字[2013]-2-023 号的调查通知书，该通知书内容为：“因调查需要，根据《中华人民共和国证券法》的有关规定，我会决定对你司所管理的基金在交易‘盛运股份’中涉嫌违反《证券法》的有关行为进行立案调查，请予以配合。”

据公司了解，该调查通知书所涉及的基金和行为为新兴产业基金于 2011 年 2 月期间的交易行为，该交易行为对该基金投资人利益未造成损失。

截至报告披露日，调查仍在进行中，尚无任何结论。

2、本报告期内，基金管理人的高级管理人员未有受到稽查或处罚的情况。

3、本报告期内，基金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	2,673,946,836.00	13.56%	2,401,247.44	13.50%	-
中信证券	1	2,583,613,829.32	13.11%	2,322,846.67	13.06%	-
东方证券	1	2,358,001,918.46	11.96%	2,115,096.89	11.89%	-
日信证券	1	1,805,386,461.20	9.16%	1,615,586.16	9.08%	-
广州证券	1	1,536,407,040.02	7.79%	1,398,745.41	7.86%	-
中投证券	1	1,284,829,100.64	6.52%	1,169,714.42	6.58%	-

民生证券	1	969,082,379.57	4.92%	882,250.64	4.96%	-
银河证券	1	880,494,580.33	4.47%	801,602.24	4.51%	-
安信证券	1	864,098,385.61	4.38%	786,673.34	4.42%	-
中银国际	1	808,155,023.23	4.10%	724,302.49	4.07%	-
国信证券	1	658,181,412.01	3.34%	585,232.74	3.29%	-
华创证券	1	655,715,704.58	3.33%	596,964.15	3.36%	-
海通证券	1	472,998,821.75	2.40%	430,617.93	2.42%	-
宏源证券	1	429,260,095.40	2.18%	385,569.69	2.17%	-
广发证券	1	397,710,910.31	2.02%	362,076.55	2.04%	-
兴业证券	1	363,783,391.98	1.85%	331,188.27	1.86%	-
华宝证券	1	290,482,237.25	1.47%	264,451.72	1.49%	-
东北证券	1	249,747,300.47	1.27%	221,001.69	1.24%	-
平安证券	1	228,916,950.20	1.16%	208,407.00	1.17%	-
国金证券	1	125,616,304.82	0.64%	114,360.59	0.64%	-
华泰联合	1	48,201,648.77	0.24%	42,653.70	0.24%	-
国泰君安	1	27,841,762.91	0.14%	25,346.98	0.14%	-
瑞银证券	1	-	-	-	-	-
长城证券	1	-	-	-	-	-
东吴证券	1	-	-	-	-	-
招商证券	1	-	-	-	-	-
高华证券	1	-	-	-	-	-
东海证券	1	-	-	-	-	-
齐鲁证券	1	-	-	-	-	-
财富里昂	1	-	-	-	-	-
中航证券	1	-	-	-	-	-
西南证券	1	-	-	-	-	-
信达证券	1	-	-	-	-	-
江海证券	1	-	-	-	-	-
华安证券	1	-	-	-	-	-
中金国际	1	-	-	-	-	-
光大证券	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：财力雄厚，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

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：财富里昂。停止租用席位：西藏证券，金元证券。

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	10,010.12	0.01%	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-
东方证券	-	-	-	-	-	-
日信证券	-	-	-	-	-	-
广州证券	-	-	-	-	-	-
中投证券	-	-	-	-	-	-
民生证券	-	-	500,000,000.00	22.29%	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-
安信证券	7,946,946.80	9.57%	1,143,200,000.00	50.96%	-	-
中银国际	-	-	-	-	-	-
国信证券	75,094,192.10	90.42%	-	-	-	-
华创证券	-	-	600,000,000.00	26.75%	-	-
海通证券	-	-	-	-	-	-
宏源证券	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-
兴业证券	-	-	-	-	-	-
华宝证券	-	-	-	-	-	-
东北证券	-	-	-	-	-	-
平安证券	-	-	-	-	-	-
国金证券	-	-	-	-	-	-
华泰联合	-	-	-	-	-	-
国泰君安	-	-	-	-	-	-
瑞银证券	-	-	-	-	-	-

长城证券	-	-	-	-	-	-
东吴证券	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-
高华证券	-	-	-	-	-	-
东海证券	-	-	-	-	-	-
齐鲁证券	-	-	-	-	-	-
财富里昂	-	-	-	-	-	-
中航证券	-	-	-	-	-	-
西南证券	-	-	-	-	-	-
信达证券	-	-	-	-	-	-
江海证券	-	-	-	-	-	-
华安证券	-	-	-	-	-	-
中金国际	-	-	-	-	-	-
光大证券	-	-	-	-	-	-

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旗下部分开放式基金增加代销机构及费率优惠的公告	《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》以及基金管理人网站	2013年2月5日
2	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	2013年2月8日
3	华宝兴业基金管理有限公司关于调降建行卡网上直销基金转换业务优惠费率至四折的公告	《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》以及基金管理人网站	2013年3月22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	2013年4月1日

		网站	
5	华宝兴业基金管理有限公司关于旗下部分基金持有的“山东黄金”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	2013 年 4 月 27 日
6	华宝兴业基金管理有限公司关于部分赎回公司旗下基金持有份额的公告	《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》以及基金管理人网站	2013 年 5 月 13 日
7	华宝兴业基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金增加代销机构及费率优惠的公告	《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》以及基金管理人网站	2013 年 5 月 17 日
8	关于 e 网金电子直销平台开通支付宝第三方支付业务的公告	基金管理人网站	2013 年 5 月 29 日

§ 11 备查文件目录

11.1 备查文件目录

中国证监会批准基金设立的文件；
 华宝兴业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。

11.2 存放地点

以上文件存于基金管理人及基金托管人办公场所备投资者查阅。

11.3 查阅方式

投资者可以通过基金管理人网站，查阅或下载基金合同、招募说明书、托管协议及基金的各种定期和临时公告。

华宝兴业基金管理有限公司
2013 年 8 月 24 日