

# 华宝兴业海外中国成长股票型证券投资基金 2011 年半年度报告（摘要）

2011 年 6 月 30 日

基金管理人：华宝兴业基金管理有限公司

基金托管人：中国建设银行股份有限公司

送出日期：2011 年 8 月 29 日

## § 1 重要提示及目录

### 1.1 重要提示

基金管理人的董事会、董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带的法律责任。本半年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2011 年 8 月 22 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书及其更新。

本半年度报告摘要摘自半年度报告正文，投资者欲了解详细内容，应阅读半年度报告正文。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2011 年 01 月 01 日起至 06 月 30 日止。

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

|            |                     |
|------------|---------------------|
| 基金名称       | 华宝兴业海外中国成长股票型证券投资基金 |
| 基金简称       | 华宝兴业海外中国股票（QDII）    |
| 基金主代码      | 241001              |
| 交易代码       | 241001              |
| 基金运作方式     | 契约型开放式              |
| 基金合同生效日    | 2008年5月7日           |
| 基金管理人      | 华宝兴业基金管理有限公司        |
| 基金托管人      | 中国建设银行股份有限公司        |
| 报告期末基金份额总额 | 80,640,220.16份      |
| 基金合同存续期    | 不定期                 |

### 2.2 基金产品说明

|        |  |
|--------|--|
| 投资目标   | 主要投资于海外上市的中国公司的股票，在全球资本市场分享中国经济增长，追求资本长期增值。  |
| 投资策略   | 本基金将结合宏观经济环境、政策形势、证券市场走势的综合分析，主动判断市场时机，进行积极的资产配置，合理确定基金在股票、债券等各类资产类别上的投资比例，以最大限度地降低投资组合的风险、提高收益。本基金各类资产配置的比例范围为：股票占基金资产总值的60%-95%，债券和其他资产占基金资产总值的5%-40%。 |
| 业绩比较基准 | MSCI china free 指数(以人民币计算)。  |
| 风险收益特征 | 本基金为股票型基金，在证券投资基金中属于风险和收益水平都较高的品种。   |

### 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.cn |
| 客户服务电话  |      | 400-700-5588、<br>021-38924558 | 010-67595096      |
| 传真      |      | 021-38505777                  | 010-66275853      |

|       |                        |                       |
|-------|------------------------|-----------------------|
| 注册地址  | 上海浦东世纪大道 88 号金茂大厦 48 楼 | 北京市西城区金融大街 25 号       |
| 办公地址  | 上海浦东世纪大道 88 号金茂大厦 48 楼 | 北京市西城区闹市口大街 1 号院 1 号楼 |
| 邮政编码  | 200121                 | 100033                |
| 法定代表人 | 郑安国                    | 郭树清                   |

## 2.4 境外投资顾问和境外资产托管人

| 项目   |    | 境外投资顾问 | 境外资产托管人                                 |
|------|----|--------|---|
| 名称   | 英文 | -      | The Bank of New York Mellon Corporation |
|      | 中文 | -      | 纽约梅隆银行                                  |
| 注册地址 |    | -      | One Wall Street New York, NY10286       |
| 办公地址 |    | -      | One Wall Street New York, NY10286       |
| 邮政编码 |    | -      | NY10286                                 |

## 2.5 信息披露方式

|                      |                                  |
|----------------------|----------------------------------|
| 登载基金半年度报告正文的管理人互联网网址 | www.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。 |

## § 3 主要财务指标和基金净值表现

### 3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

| 3.1.1 期间数据和指标 | 报告期(2011年1月1日 - 2011年6月30日) |
|---------------|-----------------------------|
| 本期已实现收益       | 2,384,124.34                |
| 本期利润          | 2,538,034.44                |
| 加权平均基金份额本期利润  | 0.0304                      |
| 本期加权平均净值利润率   | 2.73%                       |
| 本期基金份额净值增长率   | 2.82%                       |
| 3.1.2 期末数据和指标 | 报告期末(2011年6月30日)            |
| 期末可供分配利润      | 2,254,724.63                |
| 期末可供分配基金份额利润  | 0.0280                      |
| 期末基金资产净值      | 91,073,752.91               |
| 期末基金份额净值      | 1.129                       |

|              |                  |
|--------------|------------------|
| 3.1.3 累计期末指标 | 报告期末（2011年6月30日） |
| 基金份额累计净值增长率  | 12.90%           |

注：1、所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

2、本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

3、期末可供分配利润采用资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数。

4、净值相关数据计算中涉及天数的，包括所有交易日以及季末最后一自然日（如非交易日）。

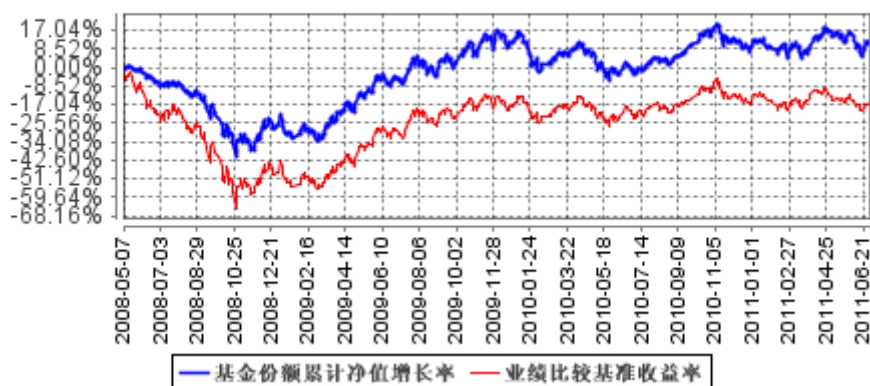
### 3.2 基金净值表现

#### 3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

| 阶段          | 份额净值增长率① | 份额净值增长率标准差② | 业绩比较基准收益率③ | 业绩比较基准收益率标准差④ | ①-③    | ②-④    |
|-------------|----------|-------------|------------|---------------|--------|--------|
| 过去一个月       | -3.01%   | 1.18%       | -3.92%     | 1.04%         | 0.91%  | 0.14%  |
| 过去三个月       | 3.86%    | 1.02%       | -3.02%     | 0.99%         | 6.88%  | 0.03%  |
| 过去六个月       | 2.82%    | 1.07%       | -0.81%     | 1.13%         | 3.63%  | -0.06% |
| 过去一年        | 14.50%   | 0.99%       | 7.11%      | 1.09%         | 7.39%  | -0.10% |
| 过去三年        | 21.27%   | 1.58%       | 6.59%      | 2.36%         | 14.68% | -0.78% |
| 自基金合同生效日起至今 | 12.90%   | 1.54%       | -16.02%    | 2.34%         | 28.92% | -0.80% |

#### 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，自基金合同生效之日起不超过 6 个月内完成建仓，截至 2008 年 11 月 6 日，本基金已经达到基金合同规定的资产配置比例。

## § 4 管理人报告

### 4.1 基金管理人及基金经理情况

#### 4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

基金管理人是在 2003 年 3 月 7 日正式成立的合资基金管理公司，截至本报告期末（2011 年 6 月 30 日），所管理的开放式证券投资基金包括宝康系列基金、多策略基金、现金宝货币市场基金、动力组合基金、收益增长基金、先进成长基金、行业精选基金、海外中国成长基金、大盘精选基金、增强收益基金、中证 100 基金、上证 180ETF、上证 180ETF 联接基金、新兴产业基金、成熟市场动量优选基金以及可转债基金，所管理的开放式证券投资基金资产净值合计 39,729,234,601.24 元。

#### 4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

| 姓名 | 职务                    | 任本基金的基金经理（助理）期限  |      | 证券从业年限 | 说明   |
|----|-----------------------|------------------|------|--------|--|
|    |                       | 任职日期             | 离任日期 |        |  |
| 周欣 | 海外中国基金基金经理，海外投资管理部总经理 | 2009 年 12 月 31 日 | -    | 12 年   | 北京大学经济学硕士、耶鲁大学商学院工商管理硕士，曾在德意志银行亚洲证券、法国巴黎银行亚洲 |

|     |                                 |                 |                 |     |   |
|-----|---------------------------------|-----------------|-----------------|-----|---|
|     |                                 |                 |                 |     | <p>证券、东方证券资产管理部从事证券研究投资工作。2009年12月加入华宝兴业基金管理有限公司，任海外投资管理部总经理。2009年12月至今兼任华宝兴业海外中国成长股票型证券投资基金基金经理。</p>           |
| 尤柏年 | 海外中国基金基金经理助理、华宝兴业成熟市场 QDII 基金经理 | 2009 年 3 月 20 日 | 2011 年 3 月 15 日 | 8 年 | <p>博士，曾在澳大利亚 BConnect 公司 Apex 投资咨询团队从事投资、金融工程模型开发、资产配置、行业研究等工作。2007 年 6 月加入本公司任金融工程部高级数量分析师，2008 年 8 月起任海外投</p> |

|  |  |  |  |  |   |
|--|--|--|--|--|---|
|  |  |  |  |  | <p>资部高级分析师，2009 年 3 月至 2011 年 3 月任华宝兴业海外中国成长股票型证券投资基金基金经理助理兼任高级分析师，2011 年 3 月至今任华宝兴业成熟市场 QDII 基金经理。</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。

#### 4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人遵守《中华人民共和国证券法》、《中华人民共和国证券投资基金法》、《合格境内机构投资者境外证券投资管理试行办法》及其各项实施细则、《华宝兴业海外中国成长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，基金管理人通过交易决策与交易执行相分离、交易部相对投资部门独立、每日交易日结报告等机制，确保所管理的各基金在交易中被公平对待。

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

##### 4.3.2 本投资组合与其他投资风格相似的投资组合之间的业绩比较

本报告期内，基金管理人管理的其他基金没有与本基金的投资风格相似的投资组合。



### 4.3.3 异常交易行为的专项说明

本报告期内，本基金没有发现异常交易行为。

## 4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

### 4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

香港市场 2011 上半年在多重利空因素作用下呈现震荡盘整，小幅下跌的走势，恒生指数、恒生国企指数分别下跌 2.77%和 0.91%，MSCI China Free 指数下跌 0.81%。在一季度，由于新兴市场国家因为经济复苏较早，自去年下半年开始纷纷开始收紧货币政策以应对日渐增长的通胀压力，而美国、欧洲的 CPI 仍然比较低，通胀压力尚不明显，因而大量资金从新兴市场流向发达市场。伴随中国连续提高存款准备金率和 2 月提高存贷款利率，香港市场情绪较为疲弱。同时中东政治形势不稳，政治危机蔓延，市场担心全球石油供应短缺造成全球经济陷入滞涨。香港市场震荡下行，必需消费、可选消费和周期类股跌幅较大。3 月上旬日本大地震和其后的核泄露危机严重打击市场情绪，港股一度下挫 7%。5 月初美国击毙基地组织头目本拉登，推动美元反弹，市场风险预期下降，带动大宗商品价格较大幅度调整，使得港股市场上石油、煤炭、有色金属等板块下跌。中国 4-6 月 PMI 指数连续回落，低于市场预期，引发市场对于中国经济硬着陆的担忧，带动周期类股下跌。而二季度 CPI 和 PPI 持续上涨，显示通胀压力仍然较大。6 月份中国审计署公布中国地方政府融资平台贷款达 10 万亿元，引发市场对于中国银行业资产质量的担忧。由美国上市的部分中国概念股诚信问题引发的做空中国概念股的风潮在 6 月也波及港股市场，引发部分农业食品股深幅下挫。

受益于市场对平台类互联网龙头公司的价值重估，以腾讯为代表的信息科技类股上半年大涨 14.89%，大幅跑赢市场大盘。由于电价上调，发电企业股价上涨，带动公用事业板块上涨 4.42%。在上半年中东政治危机蔓延的环境下，原油价格大幅上涨。日本地震造成核泄漏危机之后，引发世界各国对核电利用前景的长期忧虑，煤炭作为传统能源的价值重新凸显，也推动煤炭股价的上升，带动能源板块上升 4.37%。受国内外宏观经济政策影响较小的消费类股在业绩推动下表现平稳良好，必需消费类股和可选消费类股分别上涨 3.02%和 2.93%。受益于供应商价格协调能力显著增强，水泥股盈利前景改善，带动原材料股上涨 2.49%，也跑赢了大盘。由于工程机械的销售数据在信贷趋紧的环境下在二季度大幅萎缩，工业股大幅下跌 15.41%。医疗体制改革改限制药价的政策导致医疗保健类板块下跌 10.48%。都大幅跑输大盘。对中国银行资产质量和对中国经济硬着陆的担心引发金融板块下跌 4.35%。由于中国移动新的竞争环境下业绩增长缓慢，拖累电讯服务类股在上半年只小幅增长了 1.50%。

本基金在上半年通过总体仓位控制和行业配置和精选个股提高投资组合回报率。在年初时考

考虑到国内外错综复杂的宏观经济形势包括中国信贷货币政策的收紧和绵延不绝的欧洲债务危机的负面影响，我们判断上半年市场难以出现趋势性上涨的机会，因此保持了比较谨慎的总体仓位，在一定程度上规避了市场的下行风险。另外我们利用消费类股遭到抛售的时机增加了受益于黄金价格上涨的珠宝零售个股；减持了部分估值较高的汽车制造股，增加了受益于汽车售后服务需求上升和行业整合而增长持续性更为确定的汽车经销商股票；减持了产品价格压力持续的风电设备股，增持了受益于此而价值低估的风电运营商。我们增持了受益于中国 3G 用户数据改善的强势电讯股，增持了受益于保障房建设提速和供求关系改善的建材水泥股，减持了业绩增长受到铁道部下调铁路投资影响的铁路设备和铁路基建股。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本报告期，本基金份额净值增长率为 2.82%，而同期比较基准的收益率为-0.81%，基金跑赢业绩基准 3.63%。业绩差异主要由于本基金出于对中国宏观经济政策保持偏紧的判断低配金融类和工业设备股，同时高配业绩持续性强的高端消费和信息科技类股以及受益于供求关系改善的建材水泥类股，取得了一定的超额收益。

#### 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 2011 年下半年，我们预期中国将继续保持偏紧的货币信贷政策。受翘尾因素影响以及猪肉价格大幅上升推动，6 月 CPI 同比上涨 6.4%，创出年内新高。由于猪肉供给增长的时滞以及饲料价格的上升，估计猪肉价格将在 7、8 月份继续保持高位运行，从而导致 CPI 增速在三季度下调幅度不大。在这种形势下，虽然中国政府可能对部分资金极为紧张的中小企业有针对性地提供信贷支持，但总体上仍将保持偏紧的货币信贷政策以压低通胀和通胀预期。受翘尾因素减弱影响以及年初以来实施的一系列紧缩政策逐渐表现成效，通胀压力可能在四季度逐步减弱。国际方面，希腊在 7 月初获得欧盟新一轮资金援助后虽然市场情绪有所缓和，但输血式的资金援助并没有改善希腊经济的造血功能，由国内财政紧缩引起的政治压力仍有可能在下一次偿债高峰临近时造成其债务的违约风险，并且随时可能蔓延到其他几个财政脆弱的欧债国家。因此久拖不决的欧洲债务危机仍将在三季度对全球投资者的风险偏好构成压力。好坏参半的美国经济数据也揭示出在缺乏新的政策刺激的环境下，美国经济复苏的动力趋于减弱。因此这几个因素将抑制港股市场的表现。

另一方面，我们估计在下半年中国解决地方政府融资平台的方案将进一步明晰，投资者对中国银行业资产质量恶化的担心将有所减弱。此外随着各地保障房建设计划的落实，开工率将显著提升，这将减少市场对中国经济硬着陆的担心。同时在 7-8 月披露的部分企业和行业的良好半

年报业绩也将增强市场信心。在四季度通胀压力可能减弱，信贷政策有望放松的预期之下，投资者可能进场增持股票，推动市场的表现。

总之，我们认为下半年港股市场可能呈现先震荡整理而后逐步抬升的走势。我们将重点挖掘受中国国内、国外宏观经济政策影响较小的信息科技、电讯服务和消费板块，以及受益于中国“十二五”规划的保障房、新能源等板块以及前期调整幅度较大的互联网板块。

#### 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其适用性的情况后及时修订估值方法。基金在采用新投资策略或投资新品种时，评价现有估值政策和程序的适用性。

（四）必要时基金经理参与估值政策制定、估值模型及估值方法的确定工作。

#### 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金本报告期末可供分配基金份额利润为人民币 0.0280 元，报告期内未进行利润分配。

### § 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：华宝兴业海外中国成长股票型证券投资基金

报告截止日：2011年6月30日

单位：人民币元

| 资产              | 本期末<br>2011年6月30日         | 上年度末<br>2010年12月31日         |
|-----------------|---------------------------|-----------------------------|
| <b>资产：</b>      |                           |                             |
| 银行存款            | 19,913,036.39             | 16,947,639.77               |
| 结算备付金           | -                         | -                           |
| 存出保证金           | -                         | -                           |
| 交易性金融资产         | 70,004,010.74             | 79,643,315.56               |
| 其中：股票投资         | 70,004,010.74             | 79,643,315.56               |
| 基金投资            | -                         | -                           |
| 债券投资            | -                         | -                           |
| 资产支持证券投资        | -                         | -                           |
| 衍生金融资产          | -                         | -                           |
| 买入返售金融资产        | -                         | -                           |
| 应收证券清算款         | 1,442,868.82              | 1,518,681.33                |
| 应收利息            | 802.53                    | 546.03                      |
| 应收股利            | 301,371.27                | 6,202.15                    |
| 应收申购款           | 31,506.47                 | 12,763.93                   |
| 递延所得税资产         | -                         | -                           |
| 其他资产            | -                         | -                           |
| 资产总计            | 91,693,596.22             | 98,129,148.77               |
| <b>负债和所有者权益</b> | <b>本期末<br/>2011年6月30日</b> | <b>上年度末<br/>2010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          | -                         | -                           |
| 卖出回购金融资产款       | -                         | -                           |
| 应付证券清算款         | -                         | -                           |
| 应付赎回款           | 262,154.76                | 331,537.55                  |
| 应付管理人报酬         | 132,919.38                | 151,413.64                  |
| 应付托管费           | 25,845.44                 | 29,441.54                   |
| 应付销售服务费         | -                         | -                           |

|               |  |               |               |
|---------------|--|---------------|---------------|
| 应付交易费用        |  | -             | -             |
| 应交税费          |  | -             | -             |
| 应付利息          |  | -             | -             |
| 应付利润          |  | -             | -             |
| 递延所得税负债       |  | -             | -             |
| 其他负债          |  | 198,923.73    | 281,386.85    |
| 负债合计          |  | 619,843.31    | 793,779.58    |
| <b>所有者权益：</b> |  |               |               |
| 实收基金          |  | 80,640,220.16 | 88,640,509.35 |
| 未分配利润         |  | 10,433,532.75 | 8,694,859.84  |
| 所有者权益合计       |  | 91,073,752.91 | 97,335,369.19 |
| 负债和所有者权益总计    |  | 91,693,596.22 | 98,129,148.77 |

注：报告截止日 2011 年 6 月 30 日，基金份额净值 1.129 元，基金份额总额 80,640,220.16 份。

## 6.2 利润表

会计主体：华宝兴业海外中国成长股票型证券投资基金

本报告期：2011 年 1 月 1 日至 2011 年 6 月 30 日

单位：人民币元

| 项目                     | 本期<br>2011年1月1日至<br>2011年6月30日 | 上年度可比期间<br>2010年1月1日至2010<br>年6月30日 |
|------------------------|--------------------------------|-------------------------------------|
| <b>一、收入</b>            | 3,960,450.22                   | -15,003,543.59                      |
| 1. 利息收入                | 12,586.46                      | 9,650.90                            |
| 其中：存款利息收入              | 12,586.46                      | 9,650.90                            |
| 债券利息收入                 | -                              | -                                   |
| 资产支持证券利息收入             | -                              | -                                   |
| 买入返售金融资产收入             | -                              | -                                   |
| 其他利息收入                 | -                              | -                                   |
| 2. 投资收益（损失以“-”填列）      | 4,074,699.74                   | 15,126,153.48                       |
| 其中：股票投资收益              | 2,952,498.69                   | 13,720,198.02                       |
| 基金投资收益                 | -                              | -                                   |
| 债券投资收益                 | -                              | -                                   |
| 资产支持证券投资收益             | -                              | -                                   |
| 衍生工具收益                 | 213,847.98                     | 167,047.01                          |
| 股利收益                   | 908,353.07                     | 1,238,908.45                        |
| 3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列） | 153,910.10                     | -29,934,442.98                      |
| 4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）     | -292,404.82                    | -228,932.51                         |
| 5. 其他收入（损失以“-”号填列）     | 11,658.74                      | 24,027.52                           |
| <b>减：二、费用</b>          | 1,422,415.78                   | 2,107,275.13                        |
| 1. 管理人报酬               | 831,280.15                     | 1,088,198.09                        |
| 2. 托管费                 | 161,637.79                     | 211,594.13                          |
| 3. 销售服务费               | -                              | -                                   |

|                     |  |              |                |
|---------------------|--|--------------|----------------|
| 4. 交易费用             |  | 262,392.17   | 648,736.10     |
| 5. 利息支出             |  | -            | -              |
| 其中：卖出回购金融资产支出       |  | -            | -              |
| 6. 其他费用             |  | 167,105.67   | 158,746.81     |
| 三、利润总额（亏损总额以“-”号填列） |  | 2,538,034.44 | -17,110,818.72 |
| 减：所得税费用             |  | -            | -              |
| 四、净利润（净亏损以“-”号填列）   |  | 2,538,034.44 | -17,110,818.72 |

### 6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：华宝兴业海外中国成长股票型证券投资基金

本报告期：2011年1月1日至2011年6月30日

单位：人民币元

| 项目                                     | 本期<br>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）                        | 88,640,509.35                   | 8,694,859.84  | 97,335,369.19  |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）               | -                               | 2,538,034.44  | 2,538,034.44   |
| 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）      | -8,000,289.19                   | -799,361.53   | -8,799,650.72  |
| 其中：1. 基金申购款                            | 4,713,710.01                    | 635,222.26    | 5,348,932.27   |
| 2. 基金赎回款                               | -12,713,999.20                  | -1,434,583.79 | -14,148,582.99 |
| 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）                        | 80,640,220.16                   | 10,433,532.75 | 91,073,752.91  |
| 项目                                     | 上年度可比期间<br>2010年1月1日至2010年6月30日 |               |                |
|  | 实收基金                            | 未分配利润         | 所有者权益合计        |

|  |                |                |                |
|--|----------------|----------------|----------------|
| 一、期初所有者权益（基金净值）                        | 124,063,573.06 | 16,676,872.87  | 140,740,445.93 |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）               | -              | -17,110,818.72 | -17,110,818.72 |
| 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）      | -14,305,280.37 | -1,112,991.60  | -15,418,271.97 |
| 其中：1. 基金申购款                            | 4,554,928.57   | 237,435.53     | 4,792,364.10   |
| 2. 基金赎回款                               | -18,860,208.94 | -1,350,427.13  | -20,210,636.07 |
| 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）                        | 109,758,292.69 | -1,546,937.45  | 108,211,355.24 |

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：

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

## 6.4 报表附注

### 6.4.1 基金基本情况

华宝兴业海外中国成长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 333 号《关于同意华宝兴业海外中国成长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《华宝兴业海外中国成长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 462,646,980.69 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(2008)第 052 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《华宝兴业海外中国成长股票型证券投资基金基金合同》于 2008 年 5 月 7 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 462,709,489.02 份基金份额，其中认购资金利息折合 62,508.33 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，境外资产托管人为纽约梅隆银行股份有限公司(The Bank of New

York Mellon Corporation)。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》、《合格境内机构投资者境外证券投资管理试行办法》和《华宝兴业海外中国成长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股票、固定收益证券、银行存款和法律法规允许的其他投资工具，其中股票投资范围包括香港证交所上市的所有股票和在新加坡、美国上市的中国公司，中国公司指收入的 50%以上来源于中国大陆的公司；固定收益证券投资范围为具有标准普尔评级为“A”以上或同等评级的发行人在中国证监会认可的中国大陆以外市场(包括香港、新加坡、美国)发行的固定收益证券，在流动性充足的情况下，主要投资香港债券市场。在正常市场情况下，本基金各类资产配置的比例范围是：股票占基金资产总值的 60%-95%，债券和其他资产占基金资产总值的 5%-40%。本基金的业绩比较基准为：MSCI China Free 指数(以人民币计算)。

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

#### 6.4.2 会计报表的编制基础

本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》、《华宝兴业海外中国成长股票型证券投资基金基金合同》和中国证监会允许的基金行业实务操作的有关规定编制。

#### 6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2011 年半年度财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金 2011 年

06 月 30 日的财务状况以及 2011 年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[2008]1号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》及其他相关境内外税务法规和实务操作，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) 目前基金取得的源自境外的差价收入，其涉及的境外所得税税收政策，按照相关国家或地区税收法律和法规执行，在境内暂免征收营业税和企业所得税。

(3) 目前基金取得的源自境外的股利收益，其涉及的境外所得税税收政策，按照相关国家或地区税收法律和法规执行，在境内暂不征收个人所得税和企业所得税。

#### 6.4.7 关联方关系

##### 6.4.7.1 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。

##### 6.4.7.2 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        |
| 纽约梅隆银行股份有限公司（“纽约梅隆银行”）(The Bank of New York Mellon Corporation) | 境外资产托管人             |
| 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  | 基金管理人的股东            |
| 上海宝钢集团公司（“宝钢集团”）  | 基金管理人的最终控制方         |

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。

#### 6.4.8 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

##### 6.4.8.1 通过关联方交易单元进行的交易

本基金本报告期内与上年度可比期间未通过关联方交易单元进行交易。

##### 6.4.8.2 关联方报酬

###### 6.4.8.2.1 基金管理费

单位：人民币元

| 项目              | 本期                   | 上年度可比期间              |
|-----------------|----------------------|----------------------|
|                 | 2011年1月1日至2011年6月30日 | 2010年1月1日至2010年6月30日 |
| 当期发生的基金应支付的管理费  | 831,280.15           | 1,088,198.09         |
| 其中：支付销售机构的客户维护费 | 84,767.50            | 115,116.76           |

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1.8%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 X1.8% / 当年天数。

#### 6.4.8.2.2 基金托管费

单位：人民币元

| 项目             | 本期                   | 上年度可比期间              |
|----------------|----------------------|----------------------|
|                | 2011年1月1日至2011年6月30日 | 2010年1月1日至2010年6月30日 |
| 当期发生的基金应支付的托管费 | 161,637.79           | 211,594.13           |

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0.35%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 X0.35% / 当年天数。

#### 6.4.8.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金本报告期无与关联方进行的银行间同业市场的债券(含回购)交易。

#### 6.4.8.4 各关联方投资本基金的情况

##### 6.4.8.4.1 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              |
|---------------------------|----------------------|----------------------|
|                           | 2011年1月1日至2011年6月30日 | 2010年1月1日至2010年6月30日 |
| 基金合同生效日（2008年5月7日）持有的基金份额 | -                    | -                    |
| 期初持有的基金份额                 | 4,998,704.83         | 4,998,704.83         |
| 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                 | 4,998,704.83         | 4,998,704.83         |
| 期末持有的基金份额占基金总份额比例         | 6.20%                | 4.55%                |

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。

#### 6.4.8.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

本报告期末除基金管理人外其他关联方未投资本基金。

#### 6.4.8.5 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<br>2011年1月1日至2011年6月30日 |           | 上年度可比期间<br>2010年1月1日至2010年6月30日 |          |
|--------------|----------------------------|-----------|---------------------------------|----------|
|              | 期末余额                       | 当期利息收入    | 期末余额                            | 当期利息收入   |
| 中国建设银行       | 3,812,155.68               | 12,564.54 | 2,827,902.30                    | 9,634.83 |
| 纽约梅隆银行股份有限公司 | 16,100,880.71              | -         | 35,639,373.54                   | -        |

注：本基金的银行存款分别由基金托管人中国建设银行和境外资产托管人纽约梅隆银行股份有限公司保管，按适用利率或约定利率计息。

#### 6.4.8.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本期及上年度可比期间未在承销期内参与关联方承销证券。

#### 6.4.9 利润分配情况

本基金本报告期内未进行利润分配。

#### 6.4.10 期末（2011年6月30日）本基金持有的流通受限证券

##### 6.4.10.1 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。

##### 6.4.10.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金本期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

##### 6.4.10.3.1 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。

##### 6.4.10.3.2 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。

#### 6.4.11 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 2011 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 70,004,010.74 元，无属于第二层级和第三层级的余额。

(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    | 70,004,010.74 | 76.35         |
|    | 其中：普通股  | 66,686,429.13 | 72.73         |
|    | 存托凭证    | 3,317,581.61  | 3.62          |
|    | 优先股     | -             | -             |
|    | 房地产信托凭证 | -             | -             |

|   |                   |               |        |
|---|-------------------|---------------|--------|
| 2 | 基金投资              |               |        |
| 3 | 固定收益投资            |               |        |
|   | 其中：债券             |               |        |
|   | 资产支持证券            |               |        |
| 4 | 金融衍生品投资           |               |        |
|   | 其中：远期             |               |        |
|   | 期货                |               |        |
|   | 期权                |               |        |
|   | 权证                |               |        |
| 5 | 买入返售金融资产          |               |        |
|   | 其中：买断式回购的买入返售金融资产 |               |        |
| 6 | 货币市场工具            |               |        |
| 7 | 银行存款和结算备付金合计      | 19,913,036.39 | 21.72  |
| 8 | 其他各项资产            | 1,776,549.09  | 1.94   |
| 9 | 合计                | 91,693,596.22 | 100.00 |

## 7.2 期末在各个国家（地区）证券市场的权益投资分布

金额单位：人民币元

| 国家(地区) | 公允价值          | 占基金资产净值比例 (%) |
|--------|---------------|---------------|
| 香港     | 66,686,429.13 | 73.22         |
| 美国     | 3,317,581.61  | 3.64          |
| 合计     | 70,004,010.74 | 76.87         |

## 7.3 期末按行业分类的权益投资组合

金额单位：人民币元

| 行业类别   | 公允价值          | 占基金资产净值比例 (%) |
|--------|---------------|---------------|
| 能源     | 6,342,986.61  | 6.96          |
| 材料     | 15,546,544.31 | 17.07         |
| 工业     | 11,078,641.97 | 12.16         |
| 非必需消费品 | 8,384,841.13  | 9.21          |
| 必需消费品  | 4,103,785.97  | 4.51          |
| 保健     | 0.00          | -             |
| 金融     | 8,451,118.63  | 9.28          |
| 信息技术   | 7,146,500.06  | 7.85          |
| 电信服务   | 4,694,584.38  | 5.15          |
| 公用事业   | 4,255,007.68  | 4.67          |
| 合计     | 70,004,010.74 | 76.87         |

### 7.4 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名权益投资明细

金额单位：人民币元

| 序号 | 公司名称(英文) | 公司名称(中文)                      | 证券代码    | 所在证券市场 | 所属国家(地区) | 数量(股)   | 公允价值         | 占基金资产净值比例(%) |
|----|----------|-------------------------------|---------|--------|----------|---------|--------------|--------------|
| 1  | 腾讯       | TENCENT HOLDINGS LTD          | 700 HK  | 香港     | 中国       | 29,000  | 5,093,783.73 | 5.59         |
| 2  | 中国联通     | CHINA UNICOM HONG KONG LTD    | 762 HK  | 香港     | 中国       | 360,000 | 4,694,584.38 | 5.15         |
| 3  | 东岳集团     | DONGYUE GROUP                 | 189 HK  | 香港     | 中国       | 573,000 | 4,069,687.69 | 4.47         |
| 4  | 正通汽车     | CHINA ZHENG TONG AUTO SERVICE | 1728 HK | 香港     | 中国       | 399,500 | 2,960,350.12 | 3.25         |
| 5  | 工商银行     | IND & COMM BK OF CHINA-H      | 1398 HK | 香港     | 中国       | 576,450 | 2,833,333.62 | 3.11         |
| 6  | 海螺水泥     | ANHUI CONCH CEMENT CO LTD-H   | 914 HK  | 香港     | 中国       | 90,000  | 2,724,535.58 | 2.99         |
| 7  | 华润燃气     | CHINA RESOURCES GAS GROUP LT  | 1193 HK | 香港     | 中国       | 266,000 | 2,406,905.96 | 2.64         |
| 8  | 中国建筑国际   | CHINA STATE CONSTRUCTION INT  | 3311 HK | 香港     | 中国       | 350,800 | 2,298,975.76 | 2.52         |
| 9  | 中国建材     | CHINA NATIONAL BUILDING MA-H  | 3323 HK | 香港     | 中国       | 180,000 | 2,284,418.29 | 2.51         |
| 10 | 中国山水水泥集团 | CHINA SHANSHUI CEMENT GROUP   | 691 HK  | 香港     | 中国       | 301,000 | 2,250,478.03 | 2.47         |

注：投资者欲了解本报告期末基金投资的所有权益明细，应阅读登载于 [www.fsfund.com](http://www.fsfund.com) 的半年度

报告正文。

## 7.5 报告期内权益投资组合的重大变动

### 7.5.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的权益投资明细

金额单位：人民币元

| 序号 | 公司名称(英文)                      | 证券代码    | 本期累计买入金额     | 占期初基金资产净值比例 (%) |
|----|-------------------------------|---------|--------------|-----------------|
| 1  | ANHUI CONCH CEMENT CO LTD-H   | 914 HK  | 3,965,152.62 | 4.07            |
| 2  | CHINA NATIONAL BUILDING MA-H  | 3323 HK | 3,933,751.73 | 4.04            |
| 3  | DONGYUE GROUP                 | 189 HK  | 3,426,685.33 | 3.52            |
| 4  | CHINA UNICOM HONG KONG LTD    | 762 HK  | 3,140,390.65 | 3.23            |
| 5  | JINGWEI TEXTILE MACHINERY-H   | 350 HK  | 2,830,179.51 | 2.91            |
| 6  | CHINA YURUN FOOD GROUP LTD    | 1068 HK | 2,815,803.59 | 2.89            |
| 7  | CHINA ZHENG TONG AUTO SERVICE | 1728 HK | 2,411,073.75 | 2.48            |
| 8  | CHINA SHANSHUI CEMENT GROUP   | 691 HK  | 2,295,168.59 | 2.36            |
| 9  | CHINA STATE CONSTRUCTION INT  | 3311 HK | 2,268,697.43 | 2.33            |
| 10 | LUK FOOK HOLDINGS INTL LTD    | 590 HK  | 2,072,189.22 | 2.13            |
| 11 | FOCUS MEDIA HOLDING-ADR       | FMCN US | 2,028,745.24 | 2.08            |
| 12 | BEIJING CAPITAL INTL AIRPO-H  | 694 HK  | 1,979,345.60 | 2.03            |
| 13 | JIANGXI COPPER CO LTD-H       | 358 HK  | 1,939,535.25 | 1.99            |
| 14 | GUANGSHEN RAILWAY CO LTD-H    | 525 HK  | 1,835,004.99 | 1.89            |
| 15 | BBMG CORPORATION-H            | 2009 HK | 1,748,510.03 | 1.80            |
| 16 | CHINA DATANG CORP RENEWABL-H  | 1798 HK | 1,706,772.66 | 1.75            |
| 17 | CNOOC LTD                     | 883 HK  | 1,530,227.04 | 1.57            |
| 18 | INTERNATIONAL MINING MACHIN   | 1683 HK | 1,390,709.22 | 1.43            |
| 19 | CHINA SHENHUA ENERGY CO-H     | 1088 HK | 923,791.03   | 0.95            |
| 20 | MINTH GROUP LTD               | 425 HK  | 842,845.24   | 0.87            |

### 7.5.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的权益投资明细

金额单位：人民币元

| 序 | 公司名称(英文) | 证券代码 | 本期累计卖出金额 | 占期初基金 |
|---|----------|------|----------|-------|
|---|----------|------|----------|-------|

| 号  |                              |         |              | 资产净值比例 (%) |
|----|------------------------------|---------|--------------|------------|
| 1  | JINGWEI TEXTILE MACHINERY-H  | 350 HK  | 5,085,586.86 | 5.22       |
| 2  | PING AN INSURANCE GROUP CO-H | 2318 HK | 4,605,081.16 | 4.73       |
| 3  | CHINA STATE CONSTRUCTION INT | 3311 HK | 3,273,972.36 | 3.36       |
| 4  | ANHUI EXPRESSWAY CO LTD-H    | 995 HK  | 3,040,491.47 | 3.12       |
| 5  | MINTH GROUP LTD              | 425 HK  | 2,923,429.63 | 3.00       |
| 6  | LUK FOOK HOLDINGS INTL LTD   | 590 HK  | 2,476,159.07 | 2.54       |
| 7  | CHINA COAL ENERGY CO-H       | 1898 HK | 2,245,021.34 | 2.31       |
| 8  | CHINA NATIONAL BUILDING MA-H | 3323 HK | 2,213,662.76 | 2.27       |
| 9  | DONGFENG MOTOR GRP CO LTD-H  | 489 HK  | 2,050,063.55 | 2.11       |
| 10 | BRILLIANCE CHINA AUTOMOTIVE  | 1114 HK | 1,900,154.68 | 1.95       |
| 11 | NINE DRAGONS PAPER HOLDINGS  | 2689 HK | 1,836,484.14 | 1.89       |
| 12 | JIANGXI COPPER CO LTD-H      | 358 HK  | 1,798,438.47 | 1.85       |
| 13 | CHINA YURUN FOOD GROUP LTD   | 1068 HK | 1,782,376.12 | 1.83       |
| 14 | ANHUI CONCH CEMENT CO LTD-H  | 914 HK  | 1,738,028.81 | 1.79       |
| 15 | TENCENT HOLDINGS LTD         | 700 HK  | 1,733,362.75 | 1.78       |
| 16 | GUANGZHOU SHIPYARD INTL CO-H | 317 HK  | 1,723,251.62 | 1.77       |
| 17 | SHUN TAK HOLDINGS LTD        | 242 HK  | 1,713,751.91 | 1.76       |
| 18 | GUANGDONG INVESTMENT LTD     | 270 HK  | 1,674,773.52 | 1.72       |
| 19 | CHINA MOBILE LTD             | 941 HK  | 1,600,399.83 | 1.64       |
| 20 | CHINA TELECOM CORP LTD-H     | 728 HK  | 1,475,922.08 | 1.52       |

### 7.5.3 权益投资的买入成本总额及卖出收入总额

单位：人民币元

|            |               |
|------------|---------------|
| 买入成本（成交）总额 | 53,422,643.63 |
| 卖出收入（成交）总额 | 66,168,357.24 |

### 7.6 期末按债券信用等级分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。



### 7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

### 7.8 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名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。

### 7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名金融衍生品投资明细

本基金本报告期末未持有金融衍生品。

### 7.10 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名基金投资明细

本基金本报告期末未持有基金。

### 7.11 投资组合报告附注

7.11.1 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。

7.11.2 本基金股票投资范围包括香港证交所上市的所有股票和在新加坡、美国上市的中国公司，中国公司指收入的 50%以上来源于中国大陆的公司，基金管理人建立有股票池。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。

#### 7.11.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

| 序号 | 名称      | 金额           |
|----|---------|--------------|
| 1  | 存出保证金   | -            |
| 2  | 应收证券清算款 | 1,442,868.82 |
| 3  | 应收股利    | 301,371.27   |
| 4  | 应收利息    | 802.53       |
| 5  | 应收申购款   | 31,506.47    |
| 6  | 其他应收款   | -            |
| 7  | 待摊费用    | -            |
| 8  | 其他      | -            |
| 9  | 合计      | 1,776,549.09 |

#### 7.11.4 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。

### 7.11.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

## § 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<br>(户) | 户均持有的<br>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<br>额比例 | 持有份额          | 占总份<br>额比例 |
| 4,076        | 19,784.16     | 9,146,802.56 | 11.34%     | 71,493,417.60 | 88.66%     |

### 8.2 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金的情况

| 项目                   | 持有份额总数 (份)   | 占基金总份额比例 |
|----------------------|--------------|----------|
| 基金管理公司所有从业人员持有本开放式基金 | 4,329,504.49 | 5.3689%  |

## § 9 开放式基金份额变动

单位：份

|                                 |                |
|---------------------------------|----------------|
| 基金合同生效日 (2008 年 5 月 7 日) 基金份额总额 | 462,709,489.02 |
| 本报告期期初基金份额总额                    | 88,640,509.35  |
| 本报告期基金总申购份额                     | 4,713,710.01   |
| 减：本报告期基金总赎回份额                   | 12,713,999.20  |
| 本报告期基金拆分变动份额                    | -              |
| 本报告期期末基金份额总额                    | 80,640,220.16  |

注：总申购份额含红利再投、转换入份额；总赎回份额含转换出份额。

## § 10 重大事件揭示

### 10.1 基金份额持有人大会决议

报告期内本基金未召开基金份额持有人大会。

### 10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

1、基金管理人于 2011 年 4 月 9 日发布公告，聘任谢文杰先生为公司副总经理，其任职资格已经过中国证监会审核批准。 2、基金托管人 2011 年 1 月 31 日发布任免通知，解聘李春信中国建设银行投资托管服务部副总经理职务。 3、基金托管人 2011 年 2 月 9 日发布公告，经中国建设银行研究决定，聘任杨新丰为中国建设银行投资托管服务部副总经理（主持工作），其任职资格已经中国证监会审核批准（证监许可〔2011〕115 号）。解聘罗中涛中国建设银行投资托管服务部总经理职务。

### 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 |    |
| BOCI | -      | 8,486,156.18 | 7.15%        | 12,729.21 | 9.29%      | -  |

|   |  |               |        |           |        |   |
|---|--|---------------|--------|-----------|--------|---|
| Securities Ltd  |  |               |        |           |        |   |
| Goldman Sachs Asia LLC                                    |  | 15,456,025.73 | 13.03% | 11,354.53 | 8.29%  | - |
| Nomura International (HK) Ltd                             |  | 34,448,083.12 | 29.03% | 28,940.42 | 21.12% | - |
| CLSA Ltd  |  | 3,159,338.52  | 2.66%  | 6,318.67  | 4.61%  | - |
| China International Capital Corporation HK Securities Ltd |  | 15,301,794.91 | 12.90% | 30,603.61 | 22.34% | - |
| BNP Paribas Securities (Asia) Ltd                         |  | 15,058,048.58 | 12.69% | 22,587.07 | 16.49% | - |
| J.P. Morgan Securities (Asia Pacific) Limited             |  | 26,750,897.06 | 22.54% | 24,467.53 | 17.86% | - |

注：1、基金管理人选择交易单元的标准和程序如下：

（1）选择标准：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；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、本报告期租用的证券公司交易单元没有变化。

### 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

本基金本报告期内未租用证券公司交易单元进行其它证券投资。

华宝兴业基金管理有限公司  
2011 年 8 月 29 日

