

华宝兴业大盘精选股票型证券投资基金 2012 年半年度报告（摘要）

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 2012 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	华宝兴业大盘精选股票型证券投资基金
基金简称	华宝兴业大盘精选股票
基金主代码	240011
交易代码	240011
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2008 年 10 月 7 日
基金管理人	华宝兴业基金管理有限公司
基金托管人	中国银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	437,845,862.37 份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

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

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		华宝兴业基金管理有限公司	中国银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	刘月华	唐州徽
	联系电话	021-38505888	010-66594855

	电子邮箱	xxpl@fsfund.com	tgxxpl@bank-of-china.com
客户服务电话		400-700-5588、 021-38924558	95566
传真		021-38505777	010-66594942
注册地址		上海浦东新区世纪大道 100 号上海环球金融中心 58 楼	北京市西城区复兴门内大街 1 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	北京市西城区复兴门内大街 1 号
邮政编码		200120	100818
法定代表人		郑安国	肖钢

2.4 信息披露方式

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

§ 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	18,591,771.87
本期利润	66,398,267.79
加权平均基金份额本期利润	0.1217
本期加权平均净值利润率	9.15%
本期基金份额净值增长率	7.85%
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	102,088,685.30
期末可供分配基金份额利润	0.2332
期末基金资产净值	587,397,866.69
期末基金份额净值	1.3416
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	40.21%

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

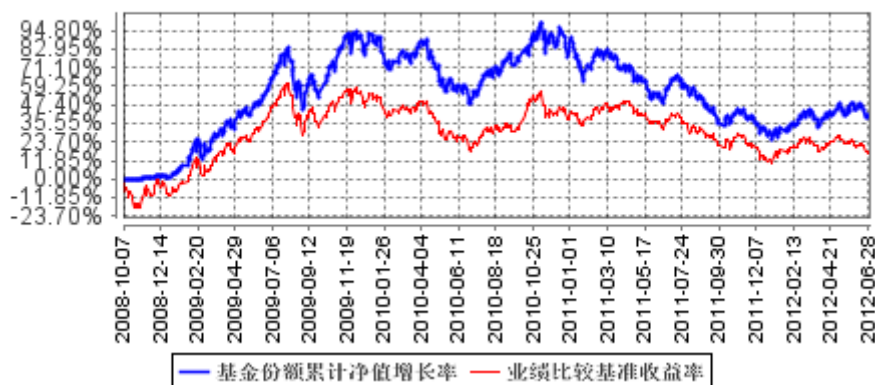
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去一个月	-5.87%	1.00%	-5.14%	0.87%	-0.73%	0.13%
过去三个月	4.57%	1.09%	0.47%	0.90%	4.10%	0.19%
过去六个月	7.85%	1.21%	4.47%	1.06%	3.38%	0.15%
过去一年	-12.20%	1.14%	-14.66%	1.08%	2.46%	0.06%
过去三年	-11.02%	1.41%	-15.41%	1.25%	4.39%	0.16%
自基金合同生效日起至 今	40.21%	1.38%	18.18%	1.41%	22.03%	-0.03%

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

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

3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：按照基金合同的约定，自基金成立日期的 6 个月内达到规定的资产组合，截至 2009 年 4 月 7

日，本基金已达到基金合同规定的资产配置比例。

§ 4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

基金管理人是 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		
范红兵	本基金基金经理、华宝兴业医药生物基金基金经理	2010 年 7 月 28 日	-	12 年	硕士，曾在南方证券股份有限公司、中新苏州工业园创业投资有限公司和平安证券股份有限公司从事证券研究、风险投资工作，于 2007 年 7 月加入华宝兴业基金管理有限公司，先后任高

					<p>级分析师、基金经理助理。2009年2月至2010年9月任华宝兴业行业精选股票型证券投资基金基金经理，2010年7月起任华宝兴业大盘精选股票型证券投资基金基金经理，2012年2月起兼任华宝兴业医药生物优选股票型证券投资基金基金经理。</p>
王智慧	<p>研究部总经理、本基金基金经理、华宝兴业医药生物基金基金经理</p>	<p>2011年1月19日</p>	-	11年	<p>管理学博士，曾在中国国际金融有限公司、上海申银万国证券研究所、浙江龙盛集团、国元证券有限公司从事投资研究工作。2009年8月加入华宝兴业基</p>

					金管理有 限公司， 先后任研 究部副总 经理、投 资经理、 基金经理 助理的职 务，现任 研究部总 经理， 2012 年 1 月至今任 华宝兴业 大盘精选 股票型证 券投资基 金的基金 经理,2012 年 2 月起 兼任华宝 兴业医药 生物优选 股票型证 券投资基 金基金经 理。
--	--	--	--	--	--

注：1、任职日期以及离任日期均以基金公告为准。

2、证券从业含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.2 管理人对报告期内本基金运作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、《华宝兴业大盘精选股票型证券投资基金基金合同》和其他相关法律法规的规定、监管部门的相关规定，依照诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在控制投资风险的基础上，为基金份额持有人谋取最大利益，没有损害基金份额持有人利益的行为。

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，国内经济持续回落，工业增加值同比增速在 4 月份创出 2009 年 6 月份以来的新低，并且从 PMI、发电量、信贷数据、房地产投资等重要指标看经济依然在寻找底部。尽管央行 1 季度即开始降低存款准备金率、6 月份实施了 2008 年底以来的首次降息，但是囿于传统行业产能过剩严重、存货压力过大、出口动力衰竭以及地方政府的资产负债表恶化等因素，实体经济尤其是工业部门并未出现显著的好转信号，PPI 和大宗商品价格下滑驱动的去库存压力依然较大。而海外市场由于政治换届和欧债危机的叠加效应导致危机进一步发酵，全球资产避险情绪高涨和美国经济相对强势推动美元指数大涨，对全球股票资产构成压力。在国内外经济经历短暂的复苏曙光继而重归困境后，A 股市场在 1 季度经历一轮反弹后又在 2 季度冲高回落，上半年上证综指仅仅略微上涨。虽然市场整体在上半年表现一般，但是结构性机会依然不少，非银行金融、食品饮料、房地产和少数成长股涨幅可观，银行股由于实质上的非对称降息出现较大幅度调整。本基金在上半年适时加大了房地产板块的配置，较好地把握了地产股的投资机会，并及时减持了银行板块权重，较好地规避了银行股的下跌风险。但是，本基金在食品饮料和成长股的投资机会把握上略有不足，未能创造更好的超额收益。

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 7.85%，基金基准增长率为 4.47%，基金表现领先业绩比较基准 3.38%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望下半年，我们依然认为本轮经济增速下滑过程中最剧烈的阶段已经过去，通货膨胀已经不是今年中国经济的焦点问题，经济处在衰退后期和复苏前期的过渡阶段。近期房地产市场开始回暖是经济中的一个积极信号，刚性需求的释放有助于消化地产库存并推动开发商的购地热情和新开工投资，但同时当房价出现上涨预期时又可能倒逼政府出台新的调控政策。预计政府在舆论上将保持目前严格执行调控政策的高压态势，未来房价走势将决定新的政策动向。在成交量持续放大、开发商拿地热情提高的背景下，房地产行业对经济的推动作用下半年有望提升。同时，预计政府将继续通过确保国家重大在建续建项目资金需求、有序推进“十二五”规划重大项目按期实施以及加强农村和西部地区基础设施、城市市政工程、铁路、节能环保建设等措施来扩大内需，货币政策将会维持相对宽松的环境，从而支撑经济不至于继续回落。但是，由于存量货币供应量规模过大、传统行业产能过剩突出、银行坏账上升风险较大等制约因素，今年货币政策和财政政策的放松力度不可能与 2008 年底的宽松政策相提并论，结构转型更是本轮经济调整的必由之路和期望目标。

证券市场方面，企业盈利季度同比增速由于基数原因预计在下半年季度将出现环比改善，CPI 维持低位以及流动性持续宽松将有助于维持目前市场整体较低的估值水平，市场整体在下半年出现大幅度下跌的可能性不大。同时，由于经济整体依然低迷、结构性问题难以在下半年出现明显转机，市场也难以出现系统性的上涨机会，更大的可能是呈现指数低位箱体震荡、结构性机会为主的状况。不排除政府在 7-8 月份之间稳增长力度加大导致有色、煤炭、工程机械及水泥等周期性板块出现阶段性行情，但是持续的相对收益更大可能来自于消费、服务类等弱周期行业。下半年，本基金将整体采取相对谨慎的操作策略，维持中性仓位，并在契约规定的范围内逐步调整结构，增加弱周期板块的配置，波段操作强周期行业的机会，并适度增加优质成长股的配置。

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

截止本报告期末，根据相关法律法规及基金合同的约定，本基金本报告期无应分配但尚未实施分配的利润。

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内，中国银行股份有限公司（以下称“本托管人”）在对华宝兴业大盘精选股票型证券投资基金（以下称“本基金”）的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了应尽的义务。

5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

本报告期内，本托管人根据《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，对本基金管理人的投资运作进行了必要的监督，对基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算以及基金费用开支等方面进行了认真地复核，未发现本基金管理人存在损害基金份额持有人利益的行为。

5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告（注：财务会计报告中的“金融工具风险及管理”部分未在托管人复核范围内）、投资组合报告等数据真实、准确和完整。

§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：华宝兴业大盘精选股票型证券投资基金

报告截止日：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
资产：			
银行存款		129,576,397.90	168,477,995.42
结算备付金		1,116,865.43	636,410.50
存出保证金		118,118.55	516,245.41
交易性金融资产		458,400,615.48	629,688,287.23
其中：股票投资		458,400,615.48	629,688,287.23
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		-	2,660,817.72
应收利息		23,855.33	38,533.55
应收股利		-	-
应收申购款		1,097,526.00	14,031.62
递延所得税资产		-	-
其他资产		-	-
资产总计		590,333,378.69	802,032,321.45
负债和所有者权益	附注号	本期末 2012 年 6 月 30 日	上年度末 2011 年 12 月 31 日
负债：			
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		-	3,070,261.42
应付赎回款		245,761.54	35,601,924.64
应付管理人报酬		746,754.62	1,029,343.87
应付托管费		124,459.09	171,557.34
应付销售服务费		-	-
应付交易费用		1,653,721.26	2,313,098.16
应交税费		-	-
应付利息		-	-

应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债		164,815.49	370,200.16
负债合计		2,935,512.00	42,556,385.59
所有者权益：			
实收基金		437,845,862.37	610,576,706.78
未分配利润		149,552,004.32	148,899,229.08
所有者权益合计		587,397,866.69	759,475,935.86
负债和所有者权益总计		590,333,378.69	802,032,321.45

注：报告截止日 2012 年 6 月 30 日，基金份额净值 1.3416 元，基金份额总额 437,845,862.37 份。

6.2 利润表

会计主体：华宝兴业大盘精选股票型证券投资基金

本报告期：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
一、收入		76,181,855.24	-186,095,147.14
1.利息收入		483,034.32	749,677.79
其中：存款利息收入		363,880.14	749,677.79
债券利息收入		80.48	-
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		119,073.70	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		27,580,913.26	-91,668,603.71
其中：股票投资收益		23,231,437.33	-96,804,805.95
基金投资收益		-	-
债券投资收益		29,295.52	-
资产支持证券投资收益		-	-
衍生工具收益		-	-
股利收益		4,320,180.41	5,136,202.24
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）		47,806,495.92	-95,712,690.04
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）		311,411.74	536,468.82
减：二、费用		9,783,587.45	23,115,601.13
1. 管理人报酬		5,443,190.30	9,812,277.37
2. 托管费		907,198.38	1,635,379.61
3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用		3,253,588.42	11,464,823.27
5. 利息支出		-	-

其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 其他费用		179,610.35	203,120.88
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		66,398,267.79	-209,210,748.27
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		66,398,267.79	-209,210,748.27

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：华宝兴业大盘精选股票型证券投资基金

本报告期：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）	610,576,706.78	148,899,229.08	759,475,935.86
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	66,398,267.79	66,398,267.79
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）	-172,730,844.41	-65,745,492.55	-238,476,336.96
其中：1.基金申购款	27,111,013.08	9,356,036.52	36,467,049.60
2.基金赎回款	-199,841,857.49	-75,101,529.07	-274,943,386.56
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）	437,845,862.37	149,552,004.32	587,397,866.69
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）	915,990,786.85	723,044,659.54	1,639,035,446.39

二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-209,210,748.27	-209,210,748.27
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	-217,872,036.01	-145,221,613.19	-363,093,649.20
其中：1.基金申购款	64,761,464.69	43,544,355.47	108,305,820.16
2.基金赎回款	-282,633,500.70	-188,765,968.66	-471,399,469.36
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-	-
五、期末所有者权益（基金净值）	698,118,750.84	368,612,298.08	1,066,731,048.92

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署：

 裴长江
基金管理公司负责人

 黄小慧
主管会计工作负责人

 张幸骏
会计机构负责人

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

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

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

6.4.2 会计报表的编制基础

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

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 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

1. 印花税

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

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

2. 营业税、企业所得税

根据财政部、国家税务总局财税字[2004]78 号文《关于证券投资基金税收政策的通知》的规

定，自 2004 年 1 月 1 日起，对证券投资基金（封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金）管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入，继续免征营业税和企业所得税；

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

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

3. 个人所得税

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

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

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

6.4.7 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、基金发起人、注册登记机构、基金销售机构
中国银行股份有限公司(“中国银行”)	基金托管人、基金代销机构
华宝信托有限责任公司(“华宝信托”)	基金管理人的主要发起人
领先资产管理有限公司	基金管理人的股东
宝钢集团有限公司(“宝钢集团”)	基金管理人的主要发起人的母公司

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。

6.4.8 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

本基金本报告期未通过关联方交易单元进行交易。

6.4.8.1 关联方报酬

6.4.8.1.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	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
当期发生的基金应支付的管理费	5,443,190.30	9,812,277.37
其中：支付销售机构的客户维护费	600,640.38	994,023.01

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。

6.4.8.1.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	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
当期发生的基金应支付的托管费	907,198.38	1,635,379.61

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。

6.4.8.2 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。

6.4.8.3 各关联方投资本基金的情况

6.4.8.3.1 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
	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
期初持有的基金份额	772,701.53	772,701.53
期间申购/买入总份额	76,904.11	-
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	849,605.64	772,701.53
期末持有的基金份额 占基金总份额比例	0.19%	0.11%

注：期间申购/买入总份额含红利再投、转换入份额。期间赎回/卖出总份额转换出份额。

6.4.8.3.2 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。

6.4.8.4 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
中国银行	129,576,397.90	350,086.31	136,301,782.77	700,210.25

注：本基金的银行存款由基金托管人中国工商银行保管，按银行同业利率计息。

6.4.8.5 其他关联交易事项的说明

本基金本期及上年度可比期间无其他关联交易事项。

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（2012 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

本基金本报告期末未持有暂时停牌股票。

6.4.10.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

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。

§ 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	458,400,615.48	77.65
	其中：股票	458,400,615.48	77.65
2	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	资产支持证券	-	-
3	金融衍生品投资	-	-
4	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
5	银行存款和结算备付金合计	130,693,263.33	22.14
6	其他各项资产	1,239,499.88	0.21
7	合计	590,333,378.69	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	13,240,036.00	2.25
B	采掘业	17,915,139.18	3.05
C	制造业	241,084,548.64	41.04
C0	食品、饮料	52,004,878.24	8.85
C1	纺织、服装、皮毛	15,983,809.89	2.72
C2	木材、家具	-	-
C3	造纸、印刷	-	-
C4	石油、化学、塑胶、塑料	8,244,997.25	1.40
C5	电子	-	-
C6	金属、非金属	34,877,939.40	5.94
C7	机械、设备、仪表	103,122,038.80	17.56
C8	医药、生物制品	26,850,885.06	4.57
C99	其他制造业	-	-
D	电力、煤气及水的生产和供应业	3,976,087.66	0.68
E	建筑业	8,740,000.00	1.49
F	交通运输、仓储业	-	-

G	信息技术业	20,492,265.62	3.49
H	批发和零售贸易	7,800,000.00	1.33
I	金融、保险业	71,208,242.62	12.12
J	房地产业	65,288,164.46	11.11
K	社会服务业	8,656,131.30	1.47
L	传播与文化产业	-	-
M	综合类	-	-
	合计	458,400,615.48	78.04

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

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	300185	通裕重工	5,580,000	29,127,600.00	4.96
2	600030	中信证券	1,599,970	20,207,621.10	3.44
3	000002	万科A	2,200,226	19,604,013.66	3.34
4	000895	双汇发展	299,941	18,560,349.08	3.16
5	600519	贵州茅台	70,000	16,740,500.00	2.85
6	000858	五粮液	509,891	16,704,029.16	2.84
7	600048	保利地产	1,300,000	14,742,000.00	2.51
8	600837	海通证券	1,500,000	14,445,000.00	2.46
9	000800	一汽轿车	1,300,000	14,118,000.00	2.40
10	002299	圣农发展	916,900	13,240,036.00	2.25

注：投资者欲了解本报告期末基金投资的所有股票明细，应阅读登载于 www.fsfund.com 的半年度报告正文。

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	300185	通裕重工	53,748,199.41	7.08
2	601318	中国平安	30,420,882.13	4.01
3	600030	中信证券	29,794,668.21	3.92

4	600837	海通证券	28,669,743.63	3.77
5	002547	春兴精工	27,919,243.49	3.68
6	600166	福田汽车	27,440,251.64	3.61
7	600000	浦发银行	22,429,624.79	2.95
8	600015	华夏银行	22,286,892.19	2.93
9	600048	保利地产	21,827,343.61	2.87
10	000895	双汇发展	20,365,033.29	2.68
11	000800	一汽轿车	19,879,523.41	2.62
12	600016	民生银行	19,390,000.00	2.55
13	600739	辽宁成大	17,748,354.27	2.34
14	600028	中国石化	17,415,520.00	2.29
15	000528	柳 工	15,863,374.67	2.09
16	600123	兰花科创	15,359,497.11	2.02
17	601898	中煤能源	14,006,356.90	1.84
18	601668	中国建筑	13,815,909.19	1.82
19	000783	长江证券	13,355,444.74	1.76
20	000651	格力电器	13,301,270.19	1.75

注：买入金额不包括相关交易费用。

7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	600016	民生银行	43,011,430.32	5.66
2	600036	招商银行	41,340,792.29	5.44
3	600000	浦发银行	39,913,743.25	5.26
4	600166	福田汽车	32,898,986.01	4.33
5	600383	金地集团	30,822,814.26	4.06
6	002230	科大讯飞	30,321,840.93	3.99
7	601166	兴业银行	29,942,728.72	3.94
8	601006	大秦铁路	29,280,368.89	3.86
9	002081	金螳螂	27,530,851.04	3.62
10	600837	海通证券	27,406,032.72	3.61
11	002547	春兴精工	26,789,089.42	3.53
12	002375	亚厦股份	24,482,000.38	3.22
13	000028	国药一致	24,143,896.16	3.18
14	600048	保利地产	23,480,550.53	3.09

15	300144	宋城股份	23,057,953.67	3.04
16	300185	通裕重工	22,883,332.15	3.01
17	600157	永泰能源	22,516,427.13	2.96
18	601318	中国平安	19,756,716.60	2.60
19	600104	上汽集团	19,320,156.55	2.54
20	600015	华夏银行	18,700,307.32	2.46
21	600028	中国石化	17,342,000.00	2.28
22	601009	南京银行	16,930,722.27	2.23
23	000869	张裕A	16,486,976.83	2.17
24	601088	中国神华	15,831,455.86	2.08
25	000625	长安汽车	15,273,742.60	2.01

注：卖出金额不包括相关交易费用。

7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	901,933,850.55
卖出股票收入（成交）总额	1,144,259,455.55

注：买入股票成本、卖出股票收入均不包括相关交易费用。

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的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。

7.8 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

7.9 投资组合报告附注

7.9.1 报告期内本基金投资的前十名证券的发行主体没有被监管部门立案调查,也没有在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚,无证券投资决策程序需特别说明。

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

7.9.3 期末其他各项资产构成

单位:人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	118,118.55
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	23,855.33
5	应收申购款	1,097,526.00
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	1,239,499.88

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
24,859	17,613.17	96,819,913.27	22.11%	341,025,949.10	77.89%

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	1,090,241.18	0.2490%

其他

（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：

10 万份至 50 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（2008 年 10 月 7 日）基金份额总额	490,050,880.11
本报告期期初基金份额总额	610,576,706.78
本报告期基金总申购份额	27,111,013.08
减：本报告期基金总赎回份额	199,841,857.49
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	437,845,862.37

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(2008 年 10 月 7 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	
齐鲁证券	1	461,691,697.50	22.60%	392,438.44	22.88%	-
国联证券	1	448,354,299.91	21.94%	366,050.79	21.34%	-
长江证券	1	216,294,866.74	10.59%	184,561.01	10.76%	-
广发证券	1	173,822,912.62	8.51%	148,209.81	8.64%	-
海通证券	1	142,757,333.40	6.99%	118,443.02	6.91%	-
国泰君安	1	129,258,319.78	6.33%	109,870.49	6.41%	-

国信证券	1	120,583,152.64	5.90%	103,220.32	6.02%	-
中信建投	1	85,997,259.11	4.21%	73,502.77	4.29%	-
中金国际	2	83,458,728.94	4.08%	68,513.44	4.00%	-
光大证券	1	75,372,794.00	3.69%	61,240.60	3.57%	-
兴业证券	1	74,463,509.02	3.64%	63,294.28	3.69%	-
招商证券	1	23,068,522.21	1.13%	18,743.43	1.09%	-
申银万国	1	8,086,266.71	0.40%	6,873.46	0.40%	-
中信金通	1	-	-	-	-	-
太平洋证券	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. 本基金本报告期无新增券商交易单元。

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
齐鲁证券	-	-	-	-	-	-
国联证券	-	-	-	-	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-
广发证券	488,376.00	100.00%	-	-	-	-
海通证券	-	-	-	-	-	-
国泰君安	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-
中信建投	-	-	-	-	-	-
中金国际	-	-	-	-	-	-

光大证券	-	-	-	-	-	-
兴业证券	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-
申银万国	-	-	-	-	-	-
中信金通	-	-	-	-	-	-
太平洋证券	-	-	-	-	-	-

华宝兴业基金管理有限公司
2012 年 8 月 27 日