

华宝兴业海外中国成长股票型证券投资基金 2012 年半年度报告

2012 年 6 月 30 日

基金管理人：华宝兴业基金管理有限公司

基金托管人：中国建设银行股份有限公司

送出日期：2012 年 8 月 27 日

§ 1 重要提示及目录

1.1 重要提示

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

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2012 年 8 月 20 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2012 年 01 月 01 日起至 06 月 30 日止。

1.2 目录

§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 境外投资顾问和境外资产托管人.....	6
2.5 信息披露方式.....	6
2.6 其他相关资料.....	6
§3 主要财务指标和基金净值表现	7
3.1 主要会计数据和财务指标.....	7
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.....	9
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.....	12
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	13
§5 托管人报告	13
5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明.....	13
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.....	13
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.....	13
§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.....	15
6.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	16
6.4 报表附注.....	17
§7 投资组合报告	33
7.1 期末基金资产组合情况.....	33
7.2 期末在各个国家（地区）证券市场的权益投资分布.....	34
7.3 期末按行业分类的权益投资组合.....	34
7.4 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有权益投资明细.....	34
7.5 报告期内权益投资组合的重大变动.....	37
7.6 期末按债券信用等级分类的债券投资组合.....	39
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.....	39
7.8 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细.....	39
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.....	39
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.....	39

7.11 投资组合报告附注	39
§8 基金份额持有人信息.....	40
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	40
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	40
§9 开放式基金份额变动.....	41
§10 重大事件揭示.....	41
10.1 基金份额持有人大会决议	41
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	41
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	41
10.4 基金投资策略的改变	42
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	42
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	42
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	42
10.8 其他重大事件	43
§11 影响投资者决策的其他重要信息.....	44
§12 备查文件目录.....	44
12.1 备查文件目录	44
12.2 存放地点	44
12.3 查阅方式	45

§ 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	76,079,537.93 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.com
客户服务电话		400-700-5588、	010-67595096

	021-38924558	
传真	021-38505777	010-66275853
注册地址	上海浦东新区世纪大道100号上海环球金融中心58楼	北京市西城区金融大街25号
办公地址	上海浦东新区世纪大道100号上海环球金融中心58楼	北京市西城区闹市口大街1号院1号楼
邮政编码	200120	100033
法定代表人	郑安国	王洪章

2.4 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

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。

2.6 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	基金管理人	上海市世纪大道100号环球金融中心58楼
会计师事务所	普华永道中天会计师事务所有限责任公司	上海市湖滨路202号普华永道中心11楼

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2012年1月1日 - 2012年6月30日)
本期已实现收益	-4,872,888.50
本期利润	-1,357,582.54
加权平均基金份额本期利润	-0.0177
本期加权平均净值利润率	-2.03%
本期基金份额净值增长率	-2.23%
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	-12,749,146.69
期末可供分配基金份额利润	-0.1676
期末基金资产净值	63,330,391.24
期末基金份额净值	0.832
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	-16.80%

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

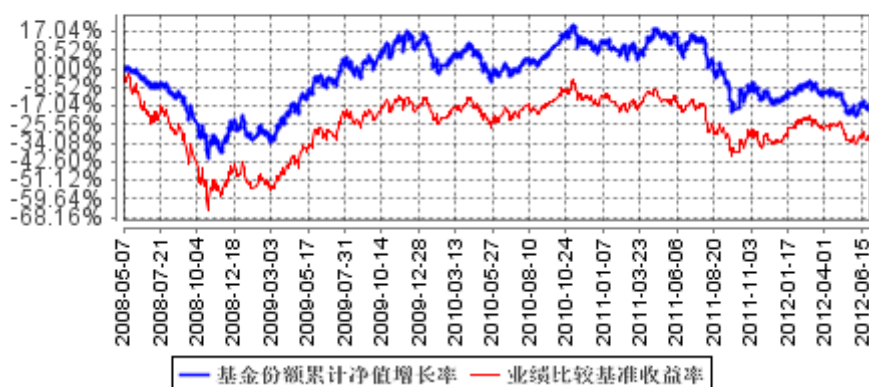
3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

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	1.96%	1.37%	1.80%	1.47%	0.16%	-0.10%
过去三个月	-5.99%	1.25%	-4.73%	1.31%	-1.26%	-0.06%
过去六个月	-2.23%	1.10%	4.76%	1.27%	-6.99%	-0.17%
过去一年	-26.31%	1.42%	-17.50%	1.80%	-8.81%	-0.38%
过去三	-12.42%	1.28%	-2.85%	1.53%	-9.57%	-0.25%

年						
自基金合同生效日起至今	-16.80%	1.51%	-30.71%	2.22%	13.91%	-0.71%

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（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		
周欣	本基金基金经理、海外投资管理部总经理	2009 年 12 月 31 日	-	13 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。

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》、《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 年上半年香港市场宽幅震荡，先涨后跌，恒生指数上涨 5.7%，恒生国企指数下跌 3.7%，MSCI China Free 指数上涨 4.5%，国企指数跑输恒生指数的原因是中国经济硬着陆的担心使得国企股指数中权重较大的原材料、可选消费、能源等板块下跌较多，拖累了指数的表现。一季度在欧洲债务危机持续缓和、中国继续放松流动性政策、欧美股市走势强劲等因素的刺激带动下，香港市场快速上行。去年年底欧洲央行向欧洲的银行系统提供了 4,890 亿欧元的低息贷款极大地缓解了欧洲银行流动性紧张的问题，欧洲央行在 2 月底实施了第二轮长期再融资操作，希腊政府与私人债权人就债务置换的谈判最后获得成功，避免了债务违约，从而缓解了市场的紧张情绪，也带动了香港市场的强劲反弹。中国央行一季度表示将通过信贷支持首套房和改善性住房需求，在 2 月中旬宣布继续下调存款准备金率 50 个基点，若干地方政府也推出鼓励住房购买的政策，加强了市场对中国放松流动性、放宽房地产调控政策的预期，中国国内住宅市场新房成交量出现较

大回升，刺激了地产板块强劲反弹。二季度香港市场在欧债危机重新发酵与中国经济增长数据不佳的双重打击下迅速回落。5 月份法国大选中左翼领导人奥朗德当选新总统，引发了投资者对德法政策冲突以至引发欧债风险扩大的担忧。希腊议会选举造成希腊政治前景不明，市场担忧希腊可能主动选择最终退出欧元区，希腊开始出现银行挤提，投资人担心欧债危机升级恶化，也殃及到经济体量更大的西班牙和意大利，带动香港市场的持续下跌，部分中小市值股票遭到洗仓式抛售，前期涨幅较大的地产板块也因获利了结压力一度跌幅较大。12 年一季度中国 GDP 增速仅为 8.1%，二季度 GDP 增长 7.6%，三年来首次低于 8%，重新引发市场对于中国经济硬着陆的担心。同时近几个月中国工业增加值增速和新增信贷数据均显著低于市场预期，显示中国经济仍处在探底的过程之中，加剧了市场的悲观情绪。6 月 8 日中国宣布三年来首次降息，同时也开启了国内存款利率市场化的过程，允许银行在基准存款利率基础之上上浮 10%，投资人担忧银行利差缩窄而引发对银行股的抛售，使得在指数中权重较大的银行板块表现疲弱。

上半年表现最为强劲的是信息科技板块，大涨 28.1%，大幅超越大盘表现，主要是由于板块内的权重股腾讯科技受到美国社交网络股脸谱网上市的刺激带动。公用事业板块上涨 12.7%，是由于火电企业的盈利对于煤价和利率十分敏感，煤价下跌和降息使得投资者对于火电企业的盈利预期大幅改善。去年跌幅较深的医疗保健板块表现也很强劲，上涨 8.4%，超越大盘表现。同期市场表现最弱的是与宏观经济联系密切的原材料和可选消费板块，分别下跌 9.3%和 9.0%，大幅落后大盘表现。必需消费和能源板块也表现疲弱，分别下跌 3.5%和 2.7%。工业、电讯服务和金融板块表现平淡，分别上涨 1.0%、1.2%和 2.7%。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。我们在一季度提高了股票的总体仓位，增持了受益于流动性好转、地方融资平台政策调整的银行类股，受益于销售数据改善、调控政策微调放松的中国地产股；二季度我们减持了业绩增长乏力、近期缺乏催化剂并且利差可能有所缩窄的银行类股；继续增持了销售数据持续改善的中国地产类股、以及受益于煤价下跌和减息的火力发电股，并且增加了部分可能受益于政府消费刺激政策的家电和智能手机类股，减持了部分销售放缓的可选消费类股。

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-2.23%，而同期业绩比较基准的收益率为 4.76%，基金表现落后业绩比较基准 6.99%。业绩差异主要由于在一季度投资组合为规避欧洲债务危机可能引发的市场系统性风险而保持了较高的现金配置。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望 2012 年下半年，我们认为香港市场以及海外中国概念股市场可能呈现小幅震荡上行的格

局。首先，外围市场出现了回稳的迹象。6 月底召开的欧元区首脑峰会取得了两个主要的积极成果：第一，为挽救西班牙银行危机，将通过 EFSF/ESM 直接向西班牙银行系统注资，而且这些贷款将放弃优先级别，这种安排既不会使现有西班牙国债沦为次级债券，又不会大幅增加西班牙政府的或有债务，打消了投资者的疑虑，使得市场情绪大幅好转。第二，欧元区向银行联盟迈出了第一步，将最早在 2012 年底之前建立以欧洲央行为中心的区域银行监管系统，并且一旦该系统建立之后，ESM 可以直接向欧元区银行注资，这将有助于切断银行系统危机和国家财政危机之间的恶性循环，并且为今后将 ESM 设立成一家银行机构打开了方便之门。虽然这些措施距离根本解决欧元区债务危机尚有很大距离，而且其实施仍可能出现反复，但短期内会起到稳定市场情绪的作用。美国方面，美联储的政策倾向于继续宽松。在决定将“扭曲操作”延期之后，美联储向市场发出十分确定的信号，如果经济进一步下滑，美联储将坚定地推出新的刺激措施，比如第三轮量化宽松货币政策。其次，中国方面，随着工业生产和通胀数据持续回落，中国政府的政策重心已明显从前期的“控通胀”转向“稳增长”。6 月份 CPI 增速下降至 2.2%，创 29 个月以来新低，PPI 同比下降 2.1%，连续第四个月下降。未来数月仍可能继续保持下行态势，为经济政策的放松提供了空间。6 月以来中国已经两次降息，下调一次存款准备金率，并且两次降息实质上都是非对称降息，力图降低工商业企业负担，刺激需求。我们估计中国政府可能在下半年继续放松货币信贷政策，同时推出支持加大基建、保障房、水利等公共投资的政策，这将缓解市场对于中国经济硬着陆和企业盈利下滑的担忧，推动市场风险偏好上升。但是，随着房地产行业的持续调整和制造业产能调整，过去十年推动中国经济增长的投资扩张周期已经终止，近期投资反弹的力度可能是有一定限度的。

总之，我们认为下半年港股市场可能温和震荡上行的趋势。我们将关注欧债危机反复和叙利亚、伊朗等地缘政治紧张所带来的市场震荡风险，进行波段操作，重点挖掘受益于中国流动性改善的地产、发电、保险板块和可能受益于政府消费刺激政策的相关行业机会。

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

本基金本报告期亏损，未有应分未分的利润。

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期，中国建设银行股份有限公司在本基金的托管过程中，严格遵守了《证券投资基金法》、基金合同、托管协议和其他有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

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

本报告期，本托管人按照国家有关规定、基金合同、托管协议和其他有关规定，对本基金的基金资产净值计算、基金费用开支等方面进行了认真的复核，对本基金的投资运作方面进行了监督，未发现基金管理人有关损害基金份额持有人利益的行为。

报告期内，本基金未实施利润分配。

5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人复核审查了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体： 华宝兴业海外中国成长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	6.4.7.1	6,942,893.86	22,081,591.70
结算备付金		-	-
存出保证金		-	-
交易性金融资产	6.4.7.2	55,589,454.59	44,002,183.66
其中：股票投资		55,589,454.59	44,002,183.66
基金投资		-	-
债券投资		-	-
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	-	-
应收证券清算款		622,031.64	486,026.22
应收利息	6.4.7.5	398.45	631.24
应收股利		489,985.40	-
应收申购款		22,551.57	3,384.26
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		63,667,315.51	66,573,817.08
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	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		-	-
应付赎回款		77,786.42	163,185.50
应付管理人报酬		91,917.40	102,713.69
应付托管费		17,872.83	19,972.12
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	-	-
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	149,347.62	360,589.37
负债合计		336,924.27	646,460.68
所有者权益：			
实收基金	6.4.7.9	76,079,537.93	77,471,215.82
未分配利润	6.4.7.10	-12,749,146.69	-11,543,859.42

所有者权益合计		63,330,391.24	65,927,356.40
负债和所有者权益总计		63,667,315.51	66,573,817.08

注：报告截止日 2012 年 6 月 30 日，基金份额净值 0.832 元，基金份额总额 76,079,537.93 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：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		-159,754.25	3,960,450.22
1.利息收入		8,672.96	12,586.46
其中：存款利息收入	6.4.7.11	8,672.96	12,586.46
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）		-3,751,756.69	4,074,699.74
其中：股票投资收益	6.4.7.12	-4,681,418.42	2,952,498.69
基金投资收益	6.4.7.13	-	-
债券投资收益	6.4.7.14	-	-
资产支持证券投资收益		-	-
衍生工具收益	6.4.7.15	-	213,847.98
股利收益	6.4.7.16	929,661.73	908,353.07
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	3,515,305.96	153,910.10
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		66,304.25	-292,404.82
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.18	1,719.27	11,658.74
减：二、费用		1,197,828.29	1,422,415.78
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	598,859.56	831,280.15
2. 托管费	6.4.10.2.2	116,444.89	161,637.79
3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用	6.4.7.19	331,199.73	262,392.17
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 其他费用	6.4.7.20	151,324.11	167,105.67
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-1,357,582.54	2,538,034.44

减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-1,357,582.54	2,538,034.44

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：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）	77,471,215.82	-11,543,859.42	65,927,356.40
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-1,357,582.54	-1,357,582.54
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	-1,391,677.89	152,295.27	-1,239,382.62
其中：1.基金申购款	1,605,177.74	-186,238.41	1,418,939.33
2.基金赎回款	-2,996,855.63	338,533.68	-2,658,321.95
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）	76,079,537.93	-12,749,146.69	63,330,391.24
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）	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

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)。

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 2012 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 2012 年 06 月 30 日的财务状况以及 2012 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一致。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

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 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2012年6月30日
活期存款	6,942,893.86
定期存款	-
其中：存款期限 1-3 个月	-
其他存款	-
合计：	6,942,893.86

注：于 2012 年 6 月 30 日，活期存款包括人民币活期存款 2,079,945.76 元，港元活期存款 5,961,454.89 元(折合人民币 4,861,006.74 元)和美元活期存款 306.94 元(折合人民币 1,941.36 元)。

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2012年6月30日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	59,807,884.77	55,589,454.59	-4,218,430.18
债券	交易所市场	-	-
	银行间市场	-	-
	合计	-	-
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	59,807,884.77	55,589,454.59	-4,218,430.18

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末未持有衍生金融资产/负债。

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本基金本报告期末未持有买入返售金融资产。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末未持有买断式逆回购交易中取得的债券。

6.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2012年6月30日
应收活期存款利息	398.45
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	-
应收债券利息	-
应收买入返售证券利息	-
应收申购款利息	-
其他	-
合计	398.45

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

本基金本报告期末无应付交易费用。

6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2012年6月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	167.68
预提费用	149,179.94
合计	149,347.62

6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2012年1月1日至2012年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	77,471,215.82	77,471,215.82
本期申购	1,605,177.74	1,605,177.74
本期赎回(以“-”号填列)	-2,996,855.63	-2,996,855.63

本期末	76,079,537.93	76,079,537.93
-----	---------------	---------------

注：申购含红利再投以及转换入份额；赎回含转换出份额。

6.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-6,449,763.66	-5,094,095.76	-11,543,859.42
本期利润	-4,872,888.50	3,515,305.96	-1,357,582.54
本期基金份额交易产生的变动数	135,179.68	17,115.59	152,295.27
其中：基金申购款	-186,839.33	600.92	-186,238.41
基金赎回款	322,019.01	16,514.67	338,533.68
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-11,187,472.48	-1,561,674.21	-12,749,146.69

6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2012年1月1日至2012年6月30日
活期存款利息收入	8,668.49
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	-
其他	4.47
合计	8,672.96

6.4.7.12 股票投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2012年1月1日至2012年6月30日
卖出股票成交总额	64,591,304.06
减：卖出股票成本总额	69,272,722.48
买卖股票差价收入	-4,681,418.42

6.4.7.13 基金投资收益

本基金本报告期没有基金投资收益。

6.4.7.14 债券投资收益

本基金本报告期无债券投资收益。

6.4.7.15 衍生工具收益

本基金本报告期内无衍生工具收益。

6.4.7.16 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2012年1月1日至2012年6月30日
股票投资产生的股利收益	929,661.73
基金投资产生的股利收益	-
合计	929,661.73

6.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2012年1月1日至2012年6月30日
1. 交易性金融资产	3,515,305.96
——股票投资	3,515,305.96
——债券投资	-
——资产支持证券投资	-
——基金投资	-
2. 衍生工具	-
——权证投资	-
3. 其他	-
合计	3,515,305.96

6.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2012年1月1日至2012年6月30日
基金赎回费收入	1,719.27
合计	1,719.27

注：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。

6.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期
----	----

	2012 年 1 月 1 日至 2012 年 6 月 30 日
交易所市场交易费用	331,199.73
银行间市场交易费用	
合计	331,199.73

6.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期
	2012 年 1 月 1 日至 2012 年 6 月 30 日
审计费用	29,835.26
信息披露费	119,344.68
银行汇划费	89.00
其他	2,055.17
合计	151,324.11

6.4.7.21 分部报告

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

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

本基金目前以一个经营分部运作。

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

本基金本报告期内无特别或有事项的说明。

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
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
宝钢集团有限公司(“宝钢集团”)	基金管理人的最终控制方

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.10 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。

6.4.10.2 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	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	598,859.56	831,280.15
其中：支付销售机构的客户维护费	57,340.43	84,767.50

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 X 1.8% / 当年天数。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	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	116,444.89	161,637.79

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 X 0.35% / 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。

6.4.10.4 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
	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	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	6.57%	6.20%

注：基金管理人投资本基金适用的认(申)购/赎回费率按照本基金招募说明书的规定执行。

6.4.10.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

本报告期末除基金管理人外其他关联方未投资本基金。

6.4.10.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期		上年度可比期间	
	2012 年 1 月 1 日至 2012 年 6 月 30 日		2011 年 1 月 1 日至 2011 年 6 月 30 日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国建设银行	2,083,374.78	8,668.49	3,812,155.68	12,564.54
纽约梅隆银行股份有限公司	4,859,519.08	-	16,100,880.71	-

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。

6.4.10.6 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。

6.4.11 利润分配情况

本基金本报告期内未进行利润分配。

6.4.12 期末（2012 年 6 月 30 日）本基金持有的流通受限证券

6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

本基金本报告期末未持有因认购新发/增发证券而流通受限的证券。

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金本期末持有暂时停牌等流通受限股票。

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

本基金本报告期末无银行间市场债券正回购，因此没有在债券正回购交易中作为抵押的债券。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

本基金本报告期末无交易所市场债券正回购，因此没有在债券正回购交易中作为抵押的债券。

6.4.13 金融工具风险及管理

本基金是一只主动投资海外证券的股票型证券投资基金，属于具有较高风险、较高收益的基金品种。本基金投资的金融工具主要包括股票、债券及权证等。本基金在日常经营活动中面临的与这些金融工具相关的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金的基金管理人从事风险管理的主要目标是争取将以上风险控制在限定的范围之内，使本基金在风险和收益之间取得最佳的平衡以实现“风险和收益相匹配”的风险收益目标。

本基金的基金管理人奉行全面风险管理体系的建设，公司内部监督和反馈系统包括督察长、内部控制委员会、副总经理、监察稽核部、风险管理部、各部门负责人和风险控制联络人、各业务岗位。副总经理总管公司的内控事务。督察长向董事会负责，独立地就内控制度的执行情况履行检查、评价、报告和建议职能。风险管理部在副总经理指导下对公司内部控制运行情况进行监控，主要针对公司内部控制制度的总体构架和内部控制的目标进行评估并提出改进意见；监察稽核部对各部门和岗位的内部控制执行情况进行监督和核查，同时对内控的失控点进行查漏并责令改正。

本基金的基金管理人根据自身经营特点设立顺序递进、权责统一、严密有效的四层监控防线。第一层监控防线为一线岗位自控与互控；第二层防线为大业务板块内部各部门和部门之间的自控和互控；第三层监控防线为内部内控审计风险管理部对各岗位、各部门、各项业务全面实施的监督反馈；最后是以副总经理领导的内部控制委员会为主体的第四层防线，实施对公司各类业务和风险的总体监督、控制，并对内控审计风险管理部的工作予以直接指导。

本基金的基金管理人对于金融工具的风险管理方法是通过结合定性分析和定量分析方法，估测各种风险产生的可能损失。从定性分析的角度出发，判断风险损失的严重程度和出现风险损失的频度。而从定量分析的角度出发，根据本基金的投资目标，结合基金资产所运用金融工具的特

征，通过特定的风险量化指标、模型、日常的量化报告，确定相应置信程度和风险损失的限度，及时可靠地对各种风险进行监督、检查和评估，并通过相应决策，将风险控制在可承受的范围内。

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金是一只主动投资海外证券的股票型证券投资基金，属于具有较高风险、较高收益的基金品种。本基金投资的金融工具主要包括股票、债券及权证等。本基金在日常经营活动中面临的与这些金融工具相关的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金的基金管理人从事风险管理的主要目标是争取将以上风险控制在限定的范围之内，使本基金在风险和收益之间取得最佳的平衡以实现“风险和收益相匹配”的风险收益目标。

本基金的基金管理人奉行全面风险管理体系的建设，公司内部监督和反馈系统包括督察长、内部控制委员会、副总经理、内控审计风险管理部、各部门负责人和风险控制联络人、各业务岗位。副总经理总管公司的内控事务。督察长向董事会负责，独立地就内控制度的执行情况履行检查、评价、报告和建议职能。内控审计风险管理部在副总经理指导下对公司内部控制运行情况进行监控，主要针对公司内部控制制度的总体构架和内部控制的目标进行评估并提出改进意见；对各部门和岗位的内部控制执行情况进行监督和核查，同时对内控的失控点进行查漏并责令改正。

本基金的基金管理人根据自身经营特点设立顺序递进、权责统一、严密有效的四层监控防线。第一层监控防线为一线岗位自控与互控；第二层防线为大业务板块内部各部门和部门之间的自控和互控；第三层监控防线为内部内控审计风险管理部对各岗位、各部门、各项业务全面实施的监督反馈；最后是以副总经理领导的内部控制委员会为主体的第四层防线，实施对公司各类业务和风险的总体监督、控制，并对内控审计风险管理部的工作予以直接指导。

本基金的基金管理人对于金融工具的风险管理方法是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。

为了规避信用风险，本公司在交易前对交易对手的资信状况进行充分的评估。本基金的银行

存款存放在本基金的托管行中国建设银行以及境外次托管行纽约梅隆银行，与该等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通过有资格的经纪商进行证券交收和款项清算，违约风险发生的可能性很小；在场外交易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，通过对投资品种的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 2012 年 6 月 30 日，本基金未持有信用类债券。

6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金所持金融工具变现的难易程度。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难或因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理的价格变现。

针对兑付赎回资金的流动性风险，本基金的基金管理人每日对本基金的申购赎回情况进行严密监控并预测流动性需求，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配。本基金的基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。

针对投资品种变现的流动性风险，本基金的基金管理人通过独立的风险管理部门设定流动性比例要求，对流动性指标进行持续的监测和分析，包括组合持仓集中度指标、组合在短时间内变现能力的综合指标、组合中变现能力较差的投资品种比例以及流通受限制的投资品种比例等。本基金投资于一家公司发行的股票市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金的基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司的证券不得超过该证券的 10%。本基金所持大部分证券在证券交易所上市，其余亦可在场外交易市场交易，均能以合理价格适时变现。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值。

本基金所持有的全部金融负债的合约约定到期日均为一个月以内且不计息，可赎回基金份额净值(所有者权益)无固定到期日且不计息，因此账面余额即为未折现的合约到期现金流量。

6.4.13.4 市场风险

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动

而发生波动的风险，包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指金融工具的公允价值或现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。利率敏感性金融工具均面临由于市场利率上升而导致公允价值下降的风险，其中浮动利率类金融工具还面临每个付息期间结束根据市场利率重新定价时对于未来现金流影响的风险。

本基金的基金管理人定期对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控，并通过调整投资组合的久期等方法对上述利率风险进行管理。

本基金持有的大部分金融资产和金融负债不计息，因此本基金的收入及经营活动的现金流量在很大程度上独立于市场利率变化。本基金持有的利率敏感性资产主要为银行存款等。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2012年6月30日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	6,942,893.86	-	-	-	6,942,893.86
交易性金融资产	-	-	-	55,589,454.59	55,589,454.59
应收证券清算款	-	-	-	622,031.64	622,031.64
应收利息	-	-	-	398.45	398.45
应收股利	-	-	-	489,985.40	489,985.40
应收申购款	1,701.76	-	-	20,849.81	22,551.57
资产总计	6,944,595.62	-	-	56,722,719.89	63,667,315.51
负债					
应付赎回款	-	-	-	77,786.42	77,786.42
应付管理人报酬	-	-	-	91,917.40	91,917.40
应付托管费	-	-	-	17,872.83	17,872.83
其他负债	-	-	-	149,347.62	149,347.62
负债总计	0.00	-	-	336,924.27	336,924.27
利率敏感度缺口	6,944,595.62	-	-	56,385,795.62	63,330,391.24
上年度末 2011年12月31日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	22,081,591.70	-	-	-	22,081,591.70
交易性金融资产	-	-	-	44,002,183.66	44,002,183.66
应收证券清算款	-	-	-	486,026.22	486,026.22
应收利息	-	-	-	631.24	631.24

应收申购款	1,704.41	-	-	1,679.85	3,384.26
资产总计	22,083,296.11	-	-	44,490,520.97	66,573,817.08
负债					
应付赎回款	-	-	-	163,185.50	163,185.50
应付管理人报酬	-	-	-	102,713.69	102,713.69
应付托管费	-	-	-	19,972.12	19,972.12
其他负债	-	-	-	360,589.37	360,589.37
负债总计	-	-	-	646,460.68	646,460.68
利率敏感度缺口	22,083,296.11	-	-	43,844,060.29	65,927,356.40

注：表中所示为本基金资产及负债的公允价值，并按照合约规定的利率重新定价日或到期日孰早者予以分类。

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

于 2012 年 6 月 30 日，本基金未持有交易性债券投资，因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响(2011 年 12 月 31 日：同)。

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。本基金持有以非记账本位币人民币计价的资产和负债，因此存在相应的外汇风险。本基金管理人每日对本基金的外汇头寸进行监控。

6.4.13.4.2.1 外汇风险敞口

单位：人民币元

项目	本期末 2012 年 6 月 30 日			
	美元 折合人民币	港币 折合人民币	其他币种 折合人民币	合计
以外币计价的资产				
银行存款	1,941.36	4,861,006.74	-	4,862,948.10
交易性金融资产	2,457,422.26	53,132,032.33	-	55,589,454.59
应收股利	-	106,285.74	-	106,285.74
应收证券清算款	-	622,031.64	-	622,031.64
资产合计	2,459,363.62	58,721,356.45	-	61,180,720.07
以外币计价的负债				
负债合计	-	-	-	-
资产负债表外汇风险敞口净额	2,459,363.62	58,721,356.45	-	61,180,720.07
项目	上年度末 2011 年 12 月 31 日			
	美元 折合人民币	港币 折合人民币	其他币种 折合人民币	合计
以外币计价的资产				

银行存款	1,933.62	19,200,536.00	-	19,202,469.62
交易性金融资产	3,872,761.23	40,129,422.43	-	44,002,183.66
应收证券清算款	-	486,026.22	-	486,026.22
资产合计	3,874,694.85	59,815,984.65	-	63,690,679.50
以外币计价的负债				
负债合计	-	-	-	-
资产负债表外汇风险敞口净额	3,874,694.85	59,815,984.65	-	63,690,679.50

6.4.13.4.2 外汇风险的敏感性分析

假设	除汇率以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2012年6月30日）	上年度末（2011年12月31日）
	所有外币相对人民币升值5	3,062,522.27	3,184,533.98
	所有外币相对人民币贬值5	-3,062,522.27	-3,184,533.98

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，采用“自上而下”的策略，通过对宏观经济情况及政策的分析，结合证券市场运行情况，做出资产配置及组合构建的决定；通过对单个证券的定性分析及定量分析，选择符合基金合同约定范围的投资品种进行投资。本基金的基金管理人定期结合宏观及微观环境的变化，对投资策略、资产配置、投资组合进行修正，来主动应对可能发生的市场价格风险。

本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险。本基金投资组合中股票占基金资产总值的60%-95%，债券和其他资产占基金资产总值的5%-40%。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 2012 年 6 月 30 日		上年度末 2011 年 12 月 31 日	
	公允价值	占基金资产净值比例 (%)	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
交易性金融资产-股票投资	55,589,454.59	87.78	44,002,183.66	66.74
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	55,589,454.59	87.78	44,002,183.66	66.74

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 (2012 年 6 月 30 日)	上年度末 (2011 年 12 月 31 日)
	业绩比较基准上升 5%	2,279,260.78	2,813,120.30
	业绩比较基准下降 5%	-2,279,260.78	-2,813,120.30

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

不以公允价值计量的金融工具

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

以公允价值计量的金融工具

金融工具公允价值计量的方法

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

第一层级：相同资产或负债在活跃市场上(未经调整)的报价。

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

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

各层次金融工具公允价值

于 2012 年 6 月 30 日，本基金持有的以公允价值计量的金融工具中属于第一层级的余额为 55,589,454.59 元，无属于第二层级和第三层级的余额（2011 年 12 月 31 日：第一层级 44,002,183.66 元，无第二层级和第三层级）。

公允价值所属层次间的重大变动

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

第三层次公允价值余额和本期变动金额

无。

(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	55,589,454.59	87.31
	其中：普通股	53,132,032.33	83.45
	存托凭证	2,457,422.26	3.86
	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	6,942,893.86	10.90
8	其他各项资产	1,134,967.06	1.78
9	合计	63,667,315.51	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	53,132,032.33	83.90
美国	2,457,422.26	3.88
合计	55,589,454.59	87.78

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 (%)
工业	4,020,263.61	6.35
必需消费品	3,955,910.13	6.25
信息技术	3,078,808.21	4.86
金融	21,043,182.78	33.23
保健	1,742,359.78	2.75
非必需消费品	13,772,839.51	21.75
电信服务	1,115,654.95	1.76
公用事业	6,810,206.60	10.75
能源	50,229.02	0.08
材料	-	-
合计	55,589,454.59	87.78

7.4 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有权益投资明细

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	SUNAC CHINA HOLDINGS LTD	融创中国控股	1918 HK	香港	中国	1,409,000	3,722,459.36	5.88
2	CHINA POWER INTERNATIONAL	中电国际	2380 HK	香港	中国	1,712,000	2,833,829.78	4.47
3	EVERGRANDE REAL ESTATE GROUP	恒大地产集团	3333 HK	香港	中国	884,000	2,832,818.68	4.47
4	BRILLIANCE CHINA AUTOMOTIVE	华晨中国汽车	1114 HK	香港	中国	476,000	2,616,018.50	4.13
5	CHINA LILANG LTD	中国利郎	1234 HK	香港	中国	589,000	2,540,650.51	4.01
6	CHINA ZHENG TONG AUTO SERVICE	正通汽车	1728 HK	香港	中国	703,000	2,338,780.42	3.69
7	ASIAN CITRUS HOLDINGS LTD	亚洲果业	73 HK	香港	中国	653,000	2,316,201.83	3.66
8	CHINA OVERSEAS LAND & INVEST	中国海外发展	688 HK	香港	中国	154,000	2,257,794.29	3.57
9	SUNNY OPTICAL TECH	舜宇光学科技	2382 HK	香港	中国	999,000	2,134,227.65	3.37
10	SHIMAO PROPERTY HOLDINGS LTD	世茂房地产	813 HK	香港	中国	207,000	1,998,462.53	3.16
11	BAIDU INC - SPON ADR	百度	BIDU US	美国	美国	2,500	1,818,092.51	2.87
12	SKYWORTH DIGITAL HLDGS LTD	创维数码	751 HK	香港	中国	646,000	1,801,493.03	2.84
13	BANK OF COMMUNICATIONS CO-H	交通银行	3328 HK	香港	中国	418,000	1,768,958.32	2.79
14	CHINA STATE CONSTRUCTION INT	中国建筑国际	3311 HK	香港	中国	294,800	1,742,767.48	2.75
15	CHINA MODERN DAIRY HOLDINGS	现代牧业	1117 HK	香港	中国	1,111,000	1,639,708.30	2.59
16	LIJUN INTL PHARMACETL HLDG	利君国际	2005 HK	香港	中国	895,000	1,517,960.02	2.40
17	HUADIAN POWER INTL CORP-H	华电国际	1071 HK	香港	中国	770,000	1,469,198.73	2.32
18	BANK OF CHINA LTD-H	中国银行	3988 HK	香港	中国	546,000	1,308,922.50	2.07
19	CHINA TAIPING INSURANCE HOLD	中国太平	966 HK	香港	中国	123,000	1,257,698.69	1.99
20	CHINA LIFE INSURANCE CO-H	中国人寿	2628 HK	香港	中国	76,000	1,236,938.45	1.95
21	DIGITAL CHINA HOLDINGS LTD	神州数码	861 HK	香港	中国	106,000	1,168,574.81	1.85
22	FAR EAST HORIZON LTD	远东宏信	3360 HK	香港	中国	258,000	1,146,542.53	1.81

23	CHINA RESOURCES LAND LTD	华润置地	1109 HK	香港	中国	88,000	1,133,740.66	1.79
24	CHINA TELECOM CORP LTD-H	中国电信	728 HK	香港	中国	406,000	1,115,654.95	1.76
25	ZOOMLION HEAVY INDUSTRY - H	中联重科	1157 HK	香港	中国	135,800	1,084,067.75	1.71
26	DATANG INTL POWER GEN CO-H	大唐发电	991 HK	香港	中国	420,000	1,041,110.52	1.64
27	CHINA RESOURCES POWER HOLDIN	华润电力	836 HK	香港	中国	80,000	1,037,196.57	1.64
28	NEW WORLD DEPT STORE CHINA	新世界百 货	825 HK	香港	中国	290,000	986,070.61	1.56
29	AGRICULTURAL BANK OF CHINA-H	农业银行	1288 HK	香港	中国	333,000	839,028.43	1.32
30	CHONGQING RURAL COMMERCIAL-H	重庆农村 商业银行	3618 HK	香港	中国	305,000	773,453.47	1.22
31	CHINA CITIC BANK CORP LTD-H	中信银行	998 HK	香港	中国	236,000	760,121.58	1.20
32	SHENZHO INTERNATIONAL GROUP	申洲国际 集团	2313 HK	香港	中国	60,000	655,586.51	1.04
33	CHINA LODGING GROUP-SPON ADS	China Lodging Group Ltd	HTHT US	美国	美国	8,610	639,329.75	1.01
34	BEIJING ENTERPRISES HLDGS	北京控股	392 HK	香港	中国	16,000	606,662.15	0.96
35	LONKING HOLDINGS LTD	中国龙工	3339 HK	香港	中国	380,000	570,131.95	0.90
36	CHINA DATANG CORP RENEWABL-H	中国大唐 集团新能 源	1798 HK	香港	中国	487,000	428,871.00	0.68
37	GUANGZHOU PHARMACEUTICAL-H	广州药业	874 HK	香港	中国	20,000	224,399.76	0.35
38	TENCENT HOLDINGS LTD	腾讯	700 HK	香港	中国	500	92,140.89	0.15
39	CNOOC LTD	中国海洋 石油	883 HK	香港	中国	4,000	50,229.02	0.08
40	LUK FOOK HOLDINGS INTL LTD	六福集团	590 HK	香港	中国	3,000	39,286.27	0.06
41	BELLE INTERNATIONAL HOLDINGS	百丽	1880 HK	香港	中国	2,000	21,396.26	0.03
42	SHANGHAI	上海实业	363 HK	香港	中国	1,000	16,634.28	0.03

	INDUSTRIAL HLDG LTD	控股						
43	CHINA MERCHANTS BANK-H	招商银行	3968 HK	香港	中国	396	4,669.15	0.01
44	IND & COMM BK OF CHINA-H	工商银行	1398 HK	香港	中国	450	1,574.14	0.00

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	CHINA ZHENG TONG AUTO SERVICE	1728 HK	3,884,107.67	5.89
2	EVERGRANDE REAL ESTATE GROUP	3333 HK	3,671,930.52	5.57
3	BANK OF COMMUNICATIONS CO-H	3328 HK	3,566,413.94	5.41
4	BANK OF CHINA LTD-H	3988 HK	3,549,551.46	5.38
5	CHINA STATE CONSTRUCTION INT	3311 HK	3,095,415.33	4.70
6	SHENZHOU INTERNATIONAL GROUP	2313 HK	3,022,735.54	4.58
7	CHINA OVERSEAS LAND & INVEST	688 HK	3,022,222.73	4.58
8	SUNAC CHINA HOLDINGS LTD	1918 HK	2,794,777.72	4.24
9	CHINA POWER INTERNATIONAL	2380 HK	2,718,382.16	4.12
10	CHINA TAIPING INSURANCE HOLD	966 HK	2,517,749.45	3.82
11	CHINA DONGXIANG GROUP CO	3818 HK	2,284,502.75	3.47
12	AGRICULTURAL BANK OF CHINA-H	1288 HK	2,049,526.63	3.11
13	IND & COMM BK OF CHINA-H	1398 HK	2,020,300.07	3.06
14	SUNNY OPTICAL TECH	2382 HK	1,919,142.78	2.91
15	BAIDU INC - SPON ADR	BIDU US	1,913,964.44	2.90
16	WEICHAI POWER CO LTD-H	2338 HK	1,832,769.59	2.78
17	SKYWORTH DIGITAL HLDGS LTD	751 HK	1,807,019.32	2.74
18	SHIMAO PROPERTY HOLDINGS LTD	813 HK	1,644,634.51	2.49
19	CHONGQING RURAL	3618 HK	1,502,993.67	2.28

	COMMERCIAL-H			
20	BRILLIANCE CHINA AUTOMOTIVE	1114 HK	1,441,795.89	2.19
21	GEELY AUTOMOBILE HOLDINGS LT	175 HK	1,426,067.74	2.16
22	CHINA RESOURCES LAND LTD	1109 HK	1,395,082.38	2.12
23	KWG PROPERTY HOLDING LTD	1813 HK	1,394,903.14	2.12
24	FAR EAST HORIZON LTD	3360 HK	1,375,617.14	2.09
25	CHINA LIFE INSURANCE CO-H	2628 HK	1,368,803.25	2.08

注：买入金额不包括相关交易费用。

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

序号	公司名称(英文)	证券代码	本期累计卖出金额	占期初基金 资产净值比 例 (%)
1	IND & COMM BK OF CHINA-H	1398 HK	4,190,609.33	6.36
2	CHINA ZHENG TONG AUTO SERVICE	1728 HK	3,599,797.44	5.46
3	CHINA DONGXIANG GROUP CO	3818 HK	3,018,947.94	4.58
4	ZHONGPIN INC	HOGS US	2,920,056.35	4.43
5	CHINA MOBILE LTD	941 HK	2,630,404.50	3.99
6	CNOOC LTD	883 HK	2,502,225.44	3.80
7	SHENZHOU INTERNATIONAL GROUP	2313 HK	2,460,006.88	3.73
8	COMBA TELECOM SYSTEMS HOLDIN	2342 HK	2,084,998.50	3.16
9	PETROCHINA CO LTD-H	857 HK	1,925,651.70	2.92
10	POWER ASSETS HOLDINGS LTD	6 HK	1,826,533.59	2.77
11	BANK OF CHINA LTD-H	3988 HK	1,825,997.81	2.77
12	WEICHAI POWER CO LTD-H	2338 HK	1,784,679.22	2.71
13	ZIJIN MINING GROUP CO LTD-H	2899 HK	1,682,763.69	2.55
14	CHINA STATE CONSTRUCTION INT	3311 HK	1,619,487.02	2.46
15	BBMG CORPORATION-H	2009 HK	1,467,909.86	2.23
16	FOCUS MEDIA HOLDING-ADR	FMCN US	1,312,853.51	1.99
17	CHINA CITIC BANK CORP LTD-H	998 HK	1,305,802.76	1.98
18	GREAT WALL MOTOR COMPANY-H	2333 HK	1,301,079.11	1.97
19	BEIJING CAPITAL INTL AIRPO-H	694 HK	1,286,172.51	1.95
20	CLP HOLDINGS LTD	2 HK	1,266,489.66	1.92

注：卖出金额不包括相关交易费用。

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	77,344,687.45
卖出收入（成交）总额	64,591,304.06

注：买入股票成本、卖出股票收入均不包括相关交易费用。

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。

7.9 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	622,031.64
3	应收股利	489,985.40
4	应收利息	398.45
5	应收申购款	22,551.57
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	1,134,967.06

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 (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
3,611	21,068.83	9,146,802.56	12.02%	66,932,735.37	87.98%

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	4,530,841.43	5.9554%
-------------------	--------------	---------

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:

100 万份以上

(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 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	77,471,215.82
本报告期基金总申购份额	1,605,177.74
减: 本报告期基金总赎回份额	2,996,855.63
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	76,079,537.93

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5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	
J.P. Morgan Securities (Asia Pacific) Limited	-	32,735,804.18	23.06%	28,098.44	14.94%	-
Nomura International (HK) Ltd	-	29,223,701.47	20.59%	43,650.96	23.22%	-
China International Capital Corporation HK Securities Ltd	-	23,794,498.10	16.76%	47,589.00	25.31%	-
Goldman Sachs Asia LLC	-	22,284,883.02	15.70%	19,175.32	10.20%	-
BNP Paribas Securities (Asia) Ltd	-	20,169,834.96	14.21%	30,254.75	16.09%	-
BOCI Securities Ltd	-	12,414,416.28	8.75%	18,621.63	9.90%	-

Daiwa Securities SMBC Singapore Ltd	-	1,312,853.51	0.92%	631.55	0.34%	-
-------------------------------------	---	--------------	-------	--------	-------	---

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：资质雄厚，信誉良好，注册资本不少于 5 亿元人民币；财务状况良好，各项财务指标显示公司经营状况稳定；经营行为规范，最近两年未因重大违规行为受到中国证监会和中国人民银行处罚；内部管理规范、严格，具备健全的内控制度，并能满足基金运作高度保密的要求；具备基金运作所需要的高效、安全的通讯条件，交易设施符合代理本基金进行证券交易的需要，并能为本基金提供全面的信息服务；研究实力较强，有固定的研究机构和专门的研究人员，能及时为本基金提供高质量的咨询服务，并能根据基金投资的特定要求，提供专门研究报告；适当的地域分散化。

（2）选择程序：（a）服务评价；（b）拟定备选交易单元；（c）签约。

2. 本基金本报告期券商交易单元无新增。

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。

10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	华宝兴业基金管理有限公司关于在“e 网金”网上直销平台新增上海银联电子支付服务有限公司相关银行卡支付业务的公告	《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》以及基金管理人网站	2012 年 6 月 29 日
2	华宝兴业基金管理有限公司关于参加江苏银行网上银行基金申购费率优惠活动的公告	《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》以及基金管理人网站	2012 年 6 月 28 日
3	华宝兴业基金管理有限公司关于在“e 网金”网上直销平台新增上海银联电子支付服务有限公司相关银行卡支付业务的公告	《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》以及基金管理人网站	2012 年 5 月 12 日
4	华宝兴业基金管理有限公司关于参加工商银行网上银行基金申购费率优惠活动的公告	《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》以及基金管理人网站	2012 年 3 月 30 日
5	华宝兴业基金管理有限公司关于	《中国证券报》、《证	2012 年 3 月 30 日

	参加江苏银行网上银行基金申购费率优惠活动的公告	券时报》、《上海证券报》以及基金管理人网站	
6	华宝兴业基金管理有限公司关于旗下部分基金继续参加申银万国证券申购费率优惠活动并继续开通定投业务的公告	《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》以及基金管理人网站	2012 年 3 月 15 日
7	华宝兴业基金管理有限公司关于变更办公地址的预告	《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》以及基金管理人网站	2012 年 2 月 14 日
8	华宝兴业海外中国成长股票型证券投资基金资产净值公告	基金管理人网站	2012 年 1 月 4 日

§ 11 影响投资者决策的其他重要信息

2012 年 1 月 16 日, 托管人中国建设银行股份有限公司发布关于董事长任职的公告, 自 2012 年 1 月 16 日起, 王洪章先生就任本行董事长、执行董事。

§ 12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

中国证监会批准基金设立的文件;
 华宝兴业海外中国成长股票型证券投资基金基金合同;
 华宝兴业海外中国成长股票型证券投资基金招募说明书;
 华宝兴业海外中国成长股票型证券投资基金托管协议;
 基金管理人业务资格批件、营业执照和公司章程;
 基金管理人报告期内在指定报刊上披露的各种公告;
 基金托管人业务资格批件和营业执照。

12.2 存放地点

以上文件存于基金管理人及基金托管人办公场所备投资者查阅。

12.3 查阅方式

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

华宝兴业基金管理有限公司
2012 年 8 月 27 日