

华宝兴业宝康灵活配置证券投资基金 2012 年年度报告

2012 年 12 月 31 日

基金管理人：华宝兴业基金管理有限公司

基金托管人：中国建设银行股份有限公司

送出日期：2013 年 3 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。本年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2013 年 3 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。

本报告中的财务资料已经审计，普华永道中天会计师事务所有限公司为本基金出具了无保留意见的审计报告。

本报告期自 2012 年 01 月 01 日起至 12 月 31 日止。

1.2 目录

§1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
§2 基金简介	5
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人和基金托管人	5
2.4 信息披露方式	6
2.5 其他相关资料	6
§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况	6
3.1 主要会计数据和财务指标	6
3.2 基金净值表现	7
3.3 过去三年基金的利润分配情况	8
§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合规守信情况的说明	10
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	10
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明	12
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	12
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况	13
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	14
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	14
§5 托管人报告	14
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	14
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	14
5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	15
§6 审计报告	15
6.1 审计报告基本信息	15
6.2 审计报告的基本内容	15
§7 年度财务报表	16
7.1 资产负债表	16
7.2 利润表	17
7.3 所有者权益（基金净值）变动表	18
7.4 报表附注	19
§8 投资组合报告	40
8.1 期末基金资产组合情况	40
8.2 期末按行业分类的股票投资组合	40
8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细	41
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动	49
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	51
8.6 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	51
8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细	52
8.8 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	52

8.9 投资组合报告附注	52
§9 基金份额持有人信息	52
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	52
9.2 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金的情况	53
§10 开放式基金份额变动	53
§11 重大事件揭示	53
11.1 基金份额持有人大会决议	53
11.2 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	53
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	54
11.4 基金投资策略的改变	54
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	54
11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况	54
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	54
11.8 其他重大事件	55
§12 影响投资者决策的其他重要信息	58
§13 备查文件目录	58
13.1 备查文件目录	58
13.2 存放地点	58
13.3 查阅方式	58

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	华宝兴业宝康灵活配置证券投资基金
基金简称	华宝兴业宝康配置混合
基金主代码	240002
交易代码	240002
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2003 年 7 月 15 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	618,126,842.86 份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	规避系统风险，降低投资组合波动性，提高投资组合的长期报酬。
投资策略	本基金采用资产灵活配置策略，以债券投资为基础，并把握股市重大投资机会，获取超额回报，同时执行严格的投资制度和风险控制制度。
业绩比较基准	65%中信标普全债指数+35%上证 180 指数和深证 100 指数的复合指数。 复合指数 = (上证 180 流通市值 / 成分指数总流通市值) × 上证 180 指数 + (深证 100 流通市值 / 成分指数总流通市值) × 深证 100 指数 成分指数总流通市值 = 上证 180 流通市值 + 深证 100 流通市值

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		华宝兴业基金管理有限公司	中国建设银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	刘月华	田青
	联系电话	021-38505888	010-67595096
	电子邮箱	xxpl@fsfund.com	tianqingl.zh@ccb.com
客户服务电话		400-700-5588、 021-38924558	010—67595096
传真		021-38505777	010-66275853
注册地址		上海浦东新区世纪大道 100 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	北京市西城区闹市口大街 1 号院 1

	号上海环球金融中心 58 楼	号楼
邮政编码	200120	100033
法定代表人	郑安国	王洪章

2.4 信息披露方式

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

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
会计师事务所	普华永道中天会计师事务所有限责任公司	上海市浦东新区陆家嘴环路 1318 号星展银行大厦 6 楼
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

§ 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

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	2012 年	2011 年	2010 年
本期已实现收益	-60,408,300.47	-16,080,962.98	-20,747,739.53
本期利润	85,860,911.83	-201,730,935.66	-114,288,961.95
加权平均基金份额本期利润	0.1310	-0.2631	-0.1152
本期加权平均净值利润率	10.74%	-19.46%	-8.20%
本期基金份额净值增长率	10.63%	-18.88%	-7.13%
3.1.2 期末数据和指标	2012 年末	2011 年末	2010 年末
期末可供分配利润	177,941,522.29	119,856,239.07	356,708,080.16
期末可供分配基金份额利润	0.2879	0.1641	0.4351
期末基金资产净值	796,068,365.15	850,269,830.52	1,176,462,596.87
期末基金份额净值	1.2879	1.1641	1.4351
3.1.3 累计期末指标	2012 年末	2011 年末	2010 年末
基金份额累计净值增长率	273.40%	237.50%	316.07%

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

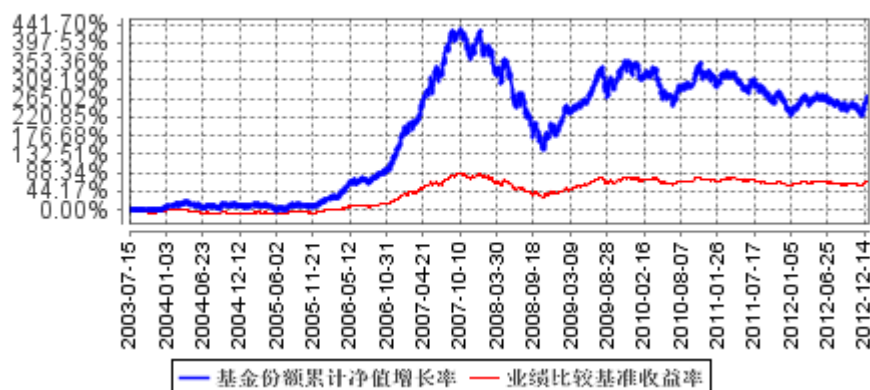
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去三个月	7.67%	0.94%	4.62%	0.46%	3.05%	0.48%
过去六个月	3.78%	0.91%	2.23%	0.44%	1.55%	0.47%
过去一年	10.63%	0.94%	6.40%	0.45%	4.23%	0.49%
过去三年	-16.66%	0.99%	-3.88%	0.49%	-12.78%	0.50%
过去五年	-26.17%	1.32%	-7.34%	0.70%	-18.83%	0.62%
自基金合同生效日起至 今	273.40%	1.19%	69.65%	0.64%	203.75%	0.55%

注：1、本基金业绩比较基准为：65%中信标普全债指数+35%上证 180 指数和深圳 100 指数的复合指数。

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

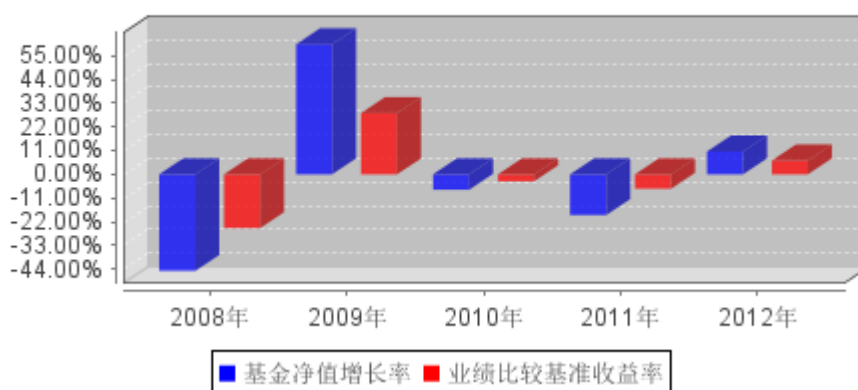
基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



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 2004 年 1 月 15 日，本基金已达到合同规定的资产配置比例。

3.2.3 过去五年基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

过去五年基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的对比图



3.3 过去三年基金的利润分配情况

单位：人民币元

年 度	每 10 份 基金 份额分红数	现金形式发放总额	再投资形式发放总 额	年度利润分配合 计	备注
2012	-	-	-	-	
2011	-	-	-	-	
2010	0.5000	38,801,739.00	26,120,050.80	56,921,789.80	
合计	0.5000	38,801,739.00	26,120,050.80	56,921,789.80	

§ 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 12 月 31 日），所管理的开放式证券投资基金包括宝康系列基金、多策略基金、现金宝货币市场基金、动力组合基金、收益增长基金、先进成长基金、行业精选基金、海外中国成长基金、大盘精选基金、增强收益基金、中证 100 基金、上证 180 价值 ETF、上证 180 价值 ETF 联接基金、新兴产业基金、成熟市场动量优选基金、可转债基金、上证 180 成长 ETF、上证 180 成长 ETF 联接基金、华宝油气基金、华宝兴业医药生物基金、华宝短融 50 基金、华宝兴业资源优选基金和华宝添益基金，所管理的开放式证券投资基金资产净值合计 37,660,892,995.57 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		
郭鹏飞	国内投资部总经理、本基金基金经理，华宝兴业新兴产业股票基金基金经理	2010 年 6 月 26 日	-	8 年	博士，拥有 CFA 资格。2004 年 2 月加入华宝兴业基金管理有限公司任研究部行业分析师，2007 年 9 月任公司研究部副总经理，2009 年 3 月至 2010 年 6 月任公司研究部总经理，2010 年 6 月至今任华宝兴业宝康灵活配置证券投资基金基金经理，2010 年 12 月兼任华宝兴业新兴产业股票型证券投资基金基金经理，2012 年 4 月起任国内投资部总经理。
牟旭东	国内投资部总经理、本基金基金经理、华宝兴业多策略基金基金经理	2010 年 1 月 22 日	2012 年 1 月 19 日	15 年	硕士。1997 年 9 月至 2003 年 1 月在南方证券有限公司从事证券研究工作，2003 年 1 月加入本公司，任高级分析师，2004 年 9 月起任研究部副总经理，2007 年 9 月起任研究部总经理，2007 年 10 月起任华宝兴业多策略增长开放式证券投资基金基金经理，2009 年 2 月至 2011 年 2 月兼任华宝兴业增强收益债券型证券投资基金基金经理，2010 年 1 月至 2012 年 1 月兼任华宝兴业宝康灵活配置证券投资基金基金经理，2010 年 7 月至 2012

					年 3 月任国内投资部总经理, 2012 年 4 月起任投资副总监。
季鹏	本基金基金经理助理	2011 年 11 月 3 日	-	6 年	金融学硕士, FRM。曾任香港大福证券行业研究员, 光大保德信基金管理公司高级行业研究员、首席策略分析师、基金经理助理。2011 年 4 月加盟华宝兴业基金管理公司, 担任高级策略分析师, 2011 年 7 月至 2011 年 11 月任华宝兴业收益增长混合型证券投资基金基金经理助理, 2011 年 11 月起兼任华宝兴业宝康灵活配置证券投资基金基金经理助理。

注：1、任职日期以及离任日期均以基金公告为准。

2、证券从业含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

本报告期内, 本基金管理人遵守《中华人民共和国证券法》、《中华人民共和国证券投资基金法》及其各项实施细则、《华宝兴业宝康系列开放式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 公平交易制度和控制方法

基金管理人从研究分析、授权、投资决策、交易执行、业绩评估等投资管理活动的各个环节出发制定了公司内部的公平交易制度以确保公司所有投资组合在各个环节得到公平的对待。公平交易制度和控制方法适用公司管理所有投资组合（包括公募基金、特定客户资产管理组合），对应的范围包括境内上市股票、债券的一级市场申购、二级市场交易等投资管理活动。

研究分析方面, 公司使用统一的投资研究管理系统, 并规定所有与投资业务相关的研究报告和股票入库信息必须在该系统中发表和存档。同时, 该系统对所有投资组合经理设置相同的使用权限。

授权和投资决策方面，投资组合经理在其权限范围内的投资决策保持独立，并对其投资决策的结果负责。通过各个系统的权限设置使投资组合经理仅能看到自己的组合情况。

交易执行方面，所有投资组合的投资指令必须通过交易系统分发和执行。对于交易所公开竞价交易，交易系统内置公平交易执行程序。公司内部制度规定此类交易指令需执行公平交易程序，由交易部负责人负责执行。针对其他不能通过系统执行公平交易程序且必须以公司名义统一进行交易的指令，公司内部制定相关制度流程以确保此类交易的公允分配。同时，公司根据法规要求在交易系统中设置一系列投资禁止与限制指标对公平交易的执行进行事前控制，主要包括限制公司旗下组合自身及组合间反向交易、对敲交易、银行间关联方交易等。

事后监督，公司的风险管理部作为独立第三方对所有投资行为进行事后监督，主要监督的事项包括以下内容。

- 1) 每季度和每年度对公司管理的不同投资组合的整体收益率差异、分投资类别（股票、债券）的收益率差异进行分析。
- 2) 每季度和每年度对公司管理的不同投资组合所有交易所二级市场交易进行 1 日、3 日、5 日同向交易价差分析。
- 3) 对公司管理的不同投资组合的所有银行间债券买卖和回购交易进行分析。监督的内容包括以下几点，同一投资组合短期内对同一债券的反向交易，债券买卖到期收益率与中债登估价收益率之间的差异，回购利率与当日市场平均利率之间的差异。对上述监督内容存在异常的情况要求投资组合经理进行合理性解释。
- 4) 对非公开发行股票申购、以公司名义进行的债券一级市场申购的申购方案和分配过程的公允性进行监督。

4.3.2 公平交易制度的执行情况

2012 年全年基金管理人严格遵守公司内部制定的公平交易制度和控制方法，确保了所管理的所有投资组合在授权、研究分析、投资决策、交易执行、业绩评估等投资管理活动和环节得到公平对待。公司内部制定的公平交易制度涉及的范围包括境内上市股票、债券的一级市场申购、二级市场交易等投资管理活动。

同时，基金管理人严格遵守法律法规关于公平交易的相关规定，分析了公司旗下所有投资组合之间的整体收益率差异、分投资类别（股票、债券）的收益率差异；并采集了连续四个季度期间内、不同时间窗下（1 日、3 日、5 日）同向交易的样本，对其进行 95%置信区间下的假设检验分析，同时结合各组合的成交金额，并参考市场成交量等因素综合判断是否存在不公平交易、利益输送的可能。分

析结果未发现异常情况。

4.3.3 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，中国经济出现探底回升走势。经历了连续两年的增速下降后，中国经济在 2012 年的前三个季度继续惯性下滑，三季度出现阶段性低点，随后于四季度出现了明显的触底回升。相应地，A 股也出现了触底反弹走势，年初在政策放松和降息降准预期下出现了明显的反弹，但随后又受到经济下滑及盈利下调影响而持续震荡下跌，上证指数一度跌破 2000 点，创出 2009 年股市调整以来的新低，但就在市场一片悲观气氛中，A 股却又在 12 月份出现大幅上涨，一举扭转了全年下跌的局面。2012 年全年，沪深 300 指数上涨 7.55%，上证综指上涨 3.17%，深证成指上涨 2.22%，中小板指数下跌 1.38%，创业板指数下跌 2.14%。总体而言，大盘股表现好于小盘股，各行业表现差异明显，其中房地产年度涨幅第一、超过 30%，金融服务、家用电器、有色金属和建筑建材行业涨幅超过 10%，而信息服务、商业贸易、机械设备和纺织服装的跌幅都超过 10%。

我们 2012 年坚持了逢低加仓的主要策略，在市场较低迷时将股票仓位提高到了接近上限的水平，并且维持了以蓝筹股为主的组合配置，充分享受到了年底指数上涨带来的收益；同时，我们长期持有的部分优秀成长股表现出色，提供了明显的超额收益。全年来看，基金获得了较好的收益，同类基金中的排名比较靠前。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截止至 2012 年末，本基金单位净值为 1.2879 元，2012 年全年基金份额净值增长率为 10.63%，同期业绩比较基准收益率为 6.40%，基金表现超越基准 4.23 个百分点。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

2012 年三季度以来，中国经济在经历了持续两年的回落之后，出现了明显的企稳反弹。企业盈利和流动性有所好转，加上新一届领导层上台后所带来的投资者长期预期的显著改善，共同导致了 A 股市场 2012 年 12 月初以来的强劲反弹。

展望 2013 年，我们认为支持 A 股市场进一步回升的动力有所增强。国内方面，在房地产回升和中央基建投资增加的带动下，经济企稳的趋势将进一步明确，各行业的经济活力都将陆续表现出来；特别是新一届中央领导人的平稳接班及其表现出来的改革及反腐决心，对稳定国内经济形势以及增强投资者长期信心都起到了强大的推动作用。国外方面，过去两年高度动荡的欧债问题也趋向稳定，欧美经济目前也回到了稳定复苏的趋势之中。我们预计，2013 年国内通胀压力不大，资金成本的明显下降将带来全社会资产的重新配置，A 股的相对投资价值明显提高，市场的估值水平有望进一步回升。

因此，我们将继续保持积极的投资策略，计划维持较高水平的股票仓位，以分享股市上涨带来的较好回报。感谢投资者多年来对本基金的信任和支持，我们将继续勤勉尽责，努力为持有人创造好的回报。

4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

公司自 2003 年 3 月成立以来始终注重合规性和业务风险控制。加强对基金运作的内部操作风险控制、保障基金份额持有人的利益始终是公司制定各项内部制度、流程的指导思想。公司监察稽核部门对公司遵守各项法规和管理制度及公司所管理的各基金履行合同义务的情况进行核查，发现问题及时提出改进建议并督促业务部门进行整改，同时定期向监管部门、公司管理层及上级公司出具相关报告。

本报告期内，基金管理人内部监察稽核主要工作如下：

（一）规范员工行为操守，加强职业道德教育和风险教育。公司通过对新员工集中组织岗前培训、签署《个人声明书》等形式，明确员工的行为准则，防范道德风险。

（二）完善公司制度体系。公司一方面坚持制度的刚性，不轻易改变、简化已确立的流程。要求从一般员工、部门经理到业务总监，每个人都必须清楚自己的权力和职责，承担相应责任。另一方面，伴随市场变革和产品创新，公司的业务和管理方式也发生着变化。在长期的业务实践中，公司借鉴和吸收海外股东、国内同行经验，在符合公司基本制度的前提下，根据业务的发展不时调整。允许各级员工在职责范围内设计和调整自己的业务流程，涉及其它部门或领域的，由相应级别的负责人在符合公司已有制度的基础上协调和批准。公司根据业务情况调整和细化了市场、营运、投资研究各方面的分工和业务规则，并根据内部控制委员会和监察稽核部门提出的意见、建议调整或改善了前、中、后台的业务流程。

（三）有重点地全面开展内部审计稽核工作。2012 年，监察稽核部门按计划对公司营运、投资、市场部门进行了业务审计，并与相关部门进行沟通，形成后续跟踪和业务上相互促进的良性循环，不断提高工作质量。

在今后的工作中，本基金管理人将继续坚持一贯的内部控制理念，完善内控制度，提高工作水平，

努力防范和控制各种风险，保障基金份额持有人的合法权益。

4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

基金管理人在报告期内对旗下基金估值过程中，公司内部参与估值流程的各方职责分工如下：

（一）、基金会计：根据《基金会计核算业务指引》对基金日常交易进行记账核算，并对基金投资品种进行估值。

（二）、量化投资部：对特殊品种或由于特殊原因导致投资品种不存在活跃市场的情况下，根据估值委员会对停牌股票或异常交易股票估值调整的方法（比如：指数收益法）进行估值，并在估值时兼顾考虑行业研究员提供的根据上市公司估值模型计算的结果所提出的建议或意见。

（三）、估值委员会：定期评价现行估值政策和程序，在发生了影响估值政策和程序的有效性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）、必要时基金经理就估值模型及估值方法的确定提出建议和意见，但由估值委员会做最终决策。

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

4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

根据法律法规及基金合同的规定，本基金于 2013 年 1 月 16 日发布了分红公告，本次分红为 2012 年度的第 1 次分红。本基金向 2013 年 1 月 18 日在本基金注册登记机构登记在册的基金份额持有人按每 10 份基金份额派发红利 0.1 元，利润分配合计为人民币 6,138,841.24 元，其中现金形式发放总额为人民币 2,614,032.22 元，再投资形式发放总额为人民币 3,524,809.02 元。

§ 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

现基金管理人没有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 审计报告

6.1 审计报告基本信息

财务报表是否经过审计	是
审计意见类型	标准无保留意见
审计报告编号	普华永道中天审字(2013)第 20424 号

6.2 审计报告的基本内容

审计报告标题	审计报告
审计报告收件人	华宝兴业宝康系列开放式证券投资基金下设之宝康灵活配置证券投资基金全体基金份额持有人
引言段	我们审计了后附的华宝兴业宝康系列开放式证券投资基金下设之宝康灵活配置证券投资基金(以下简称“华宝兴业宝康灵活配置基金”)的财务报表，包括 2012 年 12 月 31 日的资产负债表、2012 年度的利润表和所有者权益(基金净值)变动表以及财务报表附注。
管理层对财务报表的责任段	编制和公允列报财务报表是华宝兴业宝康灵活配置基金的基金管理人华宝兴业基金管理有限公司管理层的责任。这种责任包括： (1) 按照企业会计准则和中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制财务报表，并使其实现公允反映； (2) 设计、执行和维护必要的内部控制，以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。
注册会计师的责任段	我们的责任是在执行审计工作的基础上对财务报表发表审计意见。我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。中国注册会计师审计准则要求我们遵守中国注册会计师职业道德守则，计划和执行审计工作以对财务报表是否不存在重大错报获取合理保证。 审计工作涉及实施审计程序，以获取有关财务报表金额和披露的审计证据。选择的审计程序取决于注册会计师的判断，包括对由于舞

	弊或错误导致的财务报表重大错报风险的评估。在进行风险评估时，注册会计师考虑与财务报表编制和公允列报相关的内部控制，以设计恰当的审计程序，但目的并非对内部控制的有效性发表意见。审计工作还包括评价管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计的合理性，以及评价财务报表的总体列报。 我们相信，我们获取的审计证据是充分、适当的，为发表审计意见提供了基础。
审计意见段	我们认为，上述华宝兴业宝康灵活配置基金的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则和在财务报表附注中所列示的中国证监会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制，公允反映了华宝兴业宝康灵活配置基金 2012 年 12 月 31 日的财务状况以及 2012 年度的经营成果和基金净值变动情况。
注册会计师的姓名	汪棣 刘颖
会计师事务所的名称	普华永道中天会计师事务所有限公司
会计师事务所的地址	中国上海市浦东新区陆家嘴环路 1318 号星展银行大厦 6 楼 邮政编码 200120
审计报告日期	2013 年 3 月 25 日

§ 7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体：华宝兴业宝康灵活配置证券投资基金

报告截止日： 2012 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2012 年 12 月 31 日	上年度末 2011 年 12 月 31 日
资 产：			
银行存款	7.4.7.1	25,846,681.30	12,297,256.18
结算备付金		51,374.24	289,839.04
存出保证金		750,000.00	890,741.00
交易性金融资产	7.4.7.2	761,151,563.51	839,755,146.63
其中：股票投资		586,262,347.41	629,984,325.43
基金投资		-	-
债券投资		174,889,216.10	209,770,821.20
资产支持证券投资		-	-
衍生金融资产	7.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	-	-

应收证券清算款		7,912,024.76	-
应收利息	7.4.7.5	3,154,664.67	2,850,284.16
应收股利		-	-
应收申购款		110,860.90	2,877.04
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.6	-	-
资产总计		798,977,169.38	856,086,144.05
负债和所有者权益	附注号	本期末 2012 年 12 月 31 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	7.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		-	-
应付赎回款		555,281.47	125,811.89
应付管理人报酬		821,270.47	972,466.40
应付托管费		157,936.60	187,012.77
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	7.4.7.7	628,305.03	3,785,879.85
应交税费		38,260.00	38,260.00
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.8	707,750.66	706,882.62
负债合计		2,908,804.23	5,816,313.53
所有者权益:			
实收基金	7.4.7.9	618,126,842.86	730,413,591.45
未分配利润	7.4.7.10	177,941,522.29	119,856,239.07
所有者权益合计		796,068,365.15	850,269,830.52
负债和所有者权益总计		798,977,169.38	856,086,144.05

注：报告截止日 2012 年 12 月 31 日，基金份额净值 1.2879 元，基金份额总额 618,126,842.86 份。

7.2 利润表

会计主体：华宝兴业宝康灵活配置证券投资基金

本报告期：2012 年 1 月 1 日至 2012 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2012 年 1 月 1 日至 2012 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2011 年 1 月 1 日至 2011 年 12 月 31 日
一、收入		99,827,952.19	-184,206,065.10
1. 利息收入		7,472,652.54	9,506,226.84

其中：存款利息收入	7.4.7.11	340,869.23	324,654.04
债券利息收入		7,063,692.71	9,181,572.80
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		68,090.60	-
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		-54,282,296.17	-8,394,681.64
其中：股票投资收益	7.4.7.12	-63,007,594.48	-10,123,745.65
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.13	-72,342.40	-6,254,738.71
资产支持证券投资收益		-	-
衍生工具收益	7.4.7.14	-	-
股利收益	7.4.7.15	8,797,640.71	7,983,802.72
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.16	146,269,212.30	-185,649,972.68
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.17	368,383.52	332,362.38
减：二、费用		13,967,040.36	17,524,870.56
1. 管理人报酬	7.4.10.2.1	10,413,996.13	13,505,460.92
2. 托管费	7.4.10.2.2	2,002,691.49	2,597,203.94
3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用	7.4.7.18	1,323,324.05	1,192,355.94
5. 利息支出		-	722.26
其中：卖出回购金融资产支出		-	722.26
6. 其他费用	7.4.7.19	227,028.69	229,127.50
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		85,860,911.83	-201,730,935.66
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		85,860,911.83	-201,730,935.66

7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：华宝兴业宝康灵活配置证券投资基金

本报告期：2012 年 1 月 1 日 至 2012 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2012 年 1 月 1 日至 2012 年 12 月 31 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）	730,413,591.45	119,856,239.07	850,269,830.52

二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	85,860,911.83	85,860,911.83
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）	-112,286,748.59	-27,775,628.61	-140,062,377.20
其中：1. 基金申购款	26,793,664.03	5,815,083.38	32,608,747.41
2. 基金赎回款	-139,080,412.62	-33,590,711.99	-172,671,124.61
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）	618,126,842.86	177,941,522.29	796,068,365.15
项目	上年度可比期间 2011 年 1 月 1 日至 2011 年 12 月 31 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）	819,754,516.71	356,708,080.16	1,176,462,596.87
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-201,730,935.66	-201,730,935.66
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）	-89,340,925.26	-35,120,905.43	-124,461,830.69
其中：1. 基金申购款	40,778,705.41	14,347,564.18	55,126,269.59
2. 基金赎回款	-130,119,630.67	-49,468,469.61	-179,588,100.28
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）	730,413,591.45	119,856,239.07	850,269,830.52

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.4 财务报表由下列负责人签署：

裴长江

黄小慧

张幸骏

基金管理公司负责人

主管会计工作负责人

会计机构负责人

7.4 报表附注

7.4.1 基金基本情况

华宝兴业宝康系列开放式证券投资基金(以下简称“本系列基金”)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[2003]第 62 号《关于同意华宝兴业宝康系列证券投资基金设立的批复》核准,由华宝兴业基金管理有限公司依照《证券投资基金管理暂行办法》及其实施细则、《开放式证券投资基金试点办法》等有关规定和《华宝兴业宝康系列开放式证券投资基金基金契约》(后更名为《华宝兴业宝康系列开放式证券投资基金基金合同》)发起,并于 2003 年 7 月 15 日募集成立。本系列基金为契约型开放式,存续期限不定,目前下设三个子基金,分别为宝康灵活配置证券投资基金(以下简称“本基金”)、宝康消费品证券投资基金和宝康债券投资基金。本系列基金首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币 3,893,701,931.41 元,其中包括本基金人民币 1,066,581,834.53 元、宝康消费品证券投资基金人民币 1,540,046,055.09 元和宝康债券投资基金人民币 1,287,074,041.79 元,业经普华永道中天会计师事务所有限公司普华永道验字(2003)第 96 号验资报告予以验证。本基金的基金管理人为华宝兴业基金管理有限公司,基金托管人为中国建设银行股份有限公司。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《华宝兴业宝康系列开放式证券投资基金基金合同》的有关规定,本基金的投资范围为国内依法公开发行、上市的股票、债券及中国证监会批准的允许基金投资的其他金融工具。债券投资方面,主要投资交易所和银行间债券市场上的各类债券,包括国债、金融债、企业债、可转债等;股票投资方面,主要投资对象为上证 180 指数、深圳 100 指数的成分股。在正常的市场情况下,本基金组合投资的基本范围为:债券 20%-90%;股票 5%-75%;现金 5%以上。本基金的业绩比较基准为:中信标普全债指数(原名为“中信全债指数”)×65%+上证 180 指数和深圳 100 指数的复合指数×35%。

本财务报表由本基金的基金管理人华宝兴业基金管理有限公司于 2013 年 3 月 25 日批准报出。

7.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于 2006 年 2 月 15 日颁布的《企业会计准则—基本准则》和 38 项具体会计准则、其后颁布的企业会计准则应用指南、企业会计准则解释以及其他相关规定(以下合称“企业会计准则”)、中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和半年度报告>》、中国证券投资基金业协会颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《华宝兴业宝康系列开放式证券投资基金基金合同》和在财务报表附注 7.4.4 所列示的中国证监会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

7.4.3 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 12 月 31 日的财务状况以及 2012 年度的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

7.4.4 重要会计政策和会计估计

7.4.4.1 会计年度

本基金会计年度为公历 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

7.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

(1) 金融资产的分类

金融资产于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、应收款项、可供出售金融资产及持有至到期投资。金融资产的分类取决于本基金对金融资产的持有意图和持有能力。本基金现无金融资产分类为可供出售金融资产及持有至到期投资。

本基金目前以交易目的持有的股票投资和债券投资分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。以公允价值计量且其公允价值变动计入损益的金融资产在资产负债表中以交易性金融资产列示。

本基金持有的其他金融资产分类为应收款项，包括银行存款、买入返售金融资产和其他各类应收款项等。应收款项是指在活跃市场中没有报价、回收金额固定或可确定的非衍生金融资产。

(2) 金融负债的分类

金融负债于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债及其他金融负债。本基金目前暂无金融负债分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。本基金持有的其他金融负债包括其他卖出回购金融资产款和各类应付款项等。

7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

金融资产或金融负债于本基金成为金融工具合同的一方时，按公允价值在资产负债表内确认。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，取得时发生的相关交易费用计入当期损益；对于支付的价款中包含的债券起息日或上次除息日至购买日止的利息，单独确认为应收项目。应收款项和其他金融负债的相关交易费用计入初始确认金额。

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，按照公允价值进行后续计量；对于应收

款项和其他金融负债采用实际利率法，以摊余成本进行后续计量。

金融资产满足下列条件之一的，予以终止确认：(1)收取该金融资产现金流量的合同权利终止；(2)该金融资产已转移，且本基金将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方；或者(3)该金融资产已转移，虽然本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬，但是放弃了对该金融资产控制。

金融资产终止确认时，其账面价值与收到的对价的差额，计入当期损益。

当金融负债的现时义务全部或部分已经解除时，终止确认该金融负债或义务已解除的部分。终止确认部分的账面价值与支付的对价之间的差额，计入当期损益。

7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

本基金持有的股票投资和债券投资按如下原则确定公允价值并进行估值：

(1)存在活跃市场的金融工具按其估值日的市场交易价格确定公允价值；估值日无交易，但最近交易日后经济环境未发生重大变化且证券发行机构未发生影响证券价格的重大事件的，按最近交易日的市场交易价格确定公允价值。

(2)存在活跃市场的金融工具，如估值日无交易且最近交易日后经济环境发生了重大变化，参考类似投资品种的现行市价及重大变化等因素，调整最近交易市价以确定公允价值。

(3)当金融工具不存在活跃市场，采用市场参与者普遍认同且被以往市场实际交易价格验证具有可靠性的估值技术确定公允价值。估值技术包括参考熟悉情况并自愿交易的各方最近进行的市场交易中使用的价格、参照实质上相同的其他金融工具的当前公允价值、现金流量折现法和期权定价模型等。采用估值技术时，尽可能最大程度使用市场参数，减少使用与本基金特定相关的参数。

7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

本基金持有的资产和承担的负债基本为金融资产和金融负债。当本基金依法 1) 具有抵销已确认金额的法定权利且该种法定权利现在是可执行的；且 2) 交易双方准备按净额结算时，金融资产与金融负债按抵销后的净额在资产负债表中列示。

7.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行基金份额所募集的总金额在扣除损益平准金分摊部分后的余额。由于申购和赎回引起的实收基金变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日认列。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

7.4.4.8 损益平准金

损益平准金包括已实现平准金和未实现平准金。已实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现损益占基金净值比例计算的金额。未实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未实现损益占基金净值比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日认列，并于期末全额转入未分配利润/(累计亏损)。

7.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

股票投资在持有期间应取得的现金股利扣除由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额确认为投资收益。债券投资在持有期间应取得的按票面利率或者发行价计算的利息扣除在适用情况下由债券发行企业代扣代缴的个人所得税后的净额确认为利息收入。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在持有期间的公允价值变动确认为公允价值变动损益；于处置时，其公允价值与初始确认金额之间的差额确认为投资收益，其中包括从公允价值变动损益结转的公允价值累计变动额。

应收款项在持有期间确认的利息收入按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

7.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬和托管费在费用涵盖期间按基金合同约定的费率和计算方法逐日确认。

其他金融负债在持有期间确认的利息支出按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

7.4.4.11 基金的收益分配政策

每一基金份额享有同等分配权。本基金收益以现金形式分配，但基金份额持有人可选择现金红利或将现金红利按分红除权日的基金份额净值自动转为基金份额进行再投资。若期末未分配利润中的未实现部分为正数，包括基金经营活动产生的未实现损益以及基金份额交易产生的未实现平准金等，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润中的已实现部分；若期末未分配利润的未实现部分为负数，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润，即已实现部分相抵未实现部分后的余额。

经宣告的拟分配基金收益于分红除权日从所有者权益转出。

7.4.4.12 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) 本基金的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。

本基金目前以一个单一的经营分部运作，不需要披露分部信息。

7.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计

根据本基金的估值原则和中国证监会允许的基金行业估值实务操作，本基金确定以下类别股票投资和债券投资的公允价值时采用的估值方法及其关键假设如下：

(1) 对于证券交易所上市的股票，若出现重大事项停牌等情况，本基金根据中国证监会公告[2008]38号《关于进一步规范证券投资基金估值业务的指导意见》，根据具体情况采用《中国证券业协会基金估值工作小组关于停牌股票估值的参考方法》提供的指数收益法等估值技术进行估值。

(2) 在银行间同业市场交易的债券品种，根据中国证监会证监会计字[2007]21号《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》采用估值技术确定公允价值。本基金持有的银行间同业市场债券按现金流量折现法估值，具体估值模型、参数及结果由中央国债登记结算有限责任公司独立提供。

7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

7.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期未发生会计政策变更。

7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

7.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

7.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2005]102号《关于股息红利个人所得税有关政策的通知》、财税[2005]107号《关于股息红利有关个人所得税政策的补充通知》、财税[2008]1号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1) 以发行基金方式募集资金不属于营业税征收范围，不征收营业税。

(2) 对基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股权的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

(3) 对基金取得的企业债券利息收入，由发行债券的企业在向基金支付利息时代扣代缴 20% 的个人所得税。对基金取得的股票的股息、红利收入，由上市公司在向基金派发股息、红利时暂减按 50% 计入个人应纳税所得额，依照现行税法规定即 20% 代扣代缴个人所得税。

(4) 基金卖出股票按 0.1% 的税率缴纳股票交易印花税，买入股票不征收股票交易印花税。

7.4.7 重要财务报表项目的说明

7.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2012 年 12 月 31 日	上年度末 2011 年 12 月 31 日
活期存款	25,846,681.30	12,297,256.18
定期存款	-	-
其中：存款期限 1-3 个月	-	-
其他存款	-	-
合计：	25,846,681.30	12,297,256.18

7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末 2012 年 12 月 31 日		
		成本	公允价值	公允价值变动
股票		610,108,107.12	586,262,347.41	-23,845,759.71
债券	交易所市场	4,621,192.16	4,469,216.10	-151,976.06
	银行间市场	173,578,880.00	170,420,000.00	-3,158,880.00
	合计	178,200,072.16	174,889,216.10	-3,310,856.06

资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	788,308,179.28	761,151,563.51	-27,156,615.77
项目	上年度末 2011 年 12 月 31 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	800,477,182.54	629,984,325.43	-170,492,857.11
债券	交易所市场	9,629,192.16	9,595,821.20
	银行间市场	203,074,600.00	200,175,000.00
	合计	212,703,792.16	209,770,821.20
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	1,013,180,974.70	839,755,146.63	-173,425,828.07

7.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本期末及上年度末未持有衍生金融资产/负债。

7.4.7.4 买入返售金融资产

7.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本基金本期末及上年度末未持买入返售金融资产。

7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末及上年度末均未持有买断式逆回购交易中取得的债券。

7.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2012 年 12 月 31 日	上年度末 2011 年 12 月 31 日
应收活期存款利息	5,282.00	3,319.59
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	25.41	143.45
应收债券利息	3,149,357.12	2,846,751.34
应收买入返售证券利息	-	-
应收申购款利息	0.14	0.15
其他	-	69.63
合计	3,154,664.67	2,850,284.16

7.4.7.6 其他资产

本基金本期末及上年度末未持有其他资产。

7.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2012 年 12 月 31 日	上年度末 2011 年 12 月 31 日
交易所市场应付交易费用	627,955.03	3,785,604.85
银行间市场应付交易费用	350.00	275.00
合计	628,305.03	3,785,879.85

7.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2012 年 12 月 31 日	上年度末 2011 年 12 月 31 日
应付券商交易单元保证金	500,000.00	500,000.00
应付赎回费	1,084.66	216.62
预提费用	206,666.00	206,666.00
合计	707,750.66	706,882.62

7.4.7.9 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 12 月 31 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	730,413,591.45	730,413,591.45
本期申购	26,793,664.03	26,793,664.03
本期赎回（以“-”号填列）	-139,080,412.62	-139,080,412.62
本期末	618,126,842.86	618,126,842.86

注：申购含转换入份额；赎回含转换出份额。

7.4.7.10 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	447,514,558.42	-327,658,319.35	119,856,239.07
本期利润	-60,408,300.47	146,269,212.30	85,860,911.83
本期基金份额交易产生的变动数	-61,842,101.31	34,066,472.70	-27,775,628.61
其中：基金申购款	15,124,763.74	-9,309,680.36	5,815,083.38

基金赎回款	-76,966,865.05	43,376,153.06	-33,590,711.99
本期已分配利润	-	-	-
本期末	325,264,156.64	-147,322,634.35	177,941,522.29

7.4.7.11 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 12 月 31 日	上年度可比期间 2011 年 1 月 1 日至 2011 年 12 月 31 日
活期存款利息收入	335,088.64	315,386.33
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	5,376.61	7,040.74
其他	403.98	2,226.97
合计	340,869.23	324,654.04

7.4.7.12 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2012 年 1 月 1 日至 2012 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2011 年 1 月 1 日至 2011 年 12 月 31 日
卖出股票成交总额	474,952,761.61	393,567,254.21
减：卖出股票成本总额	537,960,356.09	403,690,999.86
买卖股票差价收入	-63,007,594.48	-10,123,745.65

7.4.7.13 债券投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2012年1月1日至2012年12 月31日	上年度可比期间 2011年1月1日至2011年12月31 日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	263,404,512.71	475,166,060.85
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	258,378,492.40	467,788,513.15
减：应收利息总额	5,098,362.71	13,632,286.41
债券投资收益	-72,342.40	-6,254,738.71

7.4.7.14 衍生工具收益

本基金本期及上年度可比期间无衍生工具收益。

7.4.7.15 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2012 年 1 月 1 日至 2012 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2011 年 1 月 1 日至 2011 年 12 月 31 日
股票投资产生的股利收益	8,797,640.71	7,983,802.72
基金投资产生的股利收益	-	-
合计	8,797,640.71	7,983,802.72

7.4.7.16 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2012 年 1 月 1 日至 2012 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2011 年 1 月 1 日至 2011 年 12 月 31 日
1. 交易性金融资产	146,269,212.30	-185,649,972.68
——股票投资	146,647,097.40	-191,299,708.91
——债券投资	-377,885.10	5,649,736.23
——资产支持证券投资	-	-
2. 衍生工具	-	-
——权证投资	-	-
3. 其他	-	-
合计	146,269,212.30	-185,649,972.68

7.4.7.17 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2012 年 1 月 1 日至 2012 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2011 年 1 月 1 日至 2011 年 12 月 31 日
基金赎回费收入	353,465.54	324,317.16
印花税返还	9,815.97	-
转换费收入	5,102.01	8,045.22
合计	368,383.52	332,362.38

注：

1. 本基金的赎回费率按持有期间递减，赎回费总额的 50%归入基金资产。
2. 部分基金之间的转换费采用固定转换费率，转换费总额的 25%归入转出基金的基金资产；部分基金之间的转换费由赎回费和申购费补差两部分构成，其中赎回费部分的 25%归入转出基金的基金资产。

7.4.7.18 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2012 年 1 月 1 日至 2012 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2011 年 1 月 1 日至 2011 年 12 月 31 日
交易所市场交易费用	1,321,524.05	1,190,705.94
银行间市场交易费用	1,800.00	1,650.00
合计	1,323,324.05	1,192,355.94

7.4.7.19 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2012 年 1 月 1 日至 2012 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2011 年 1 月 1 日至 2011 年 12 月 31 日
审计费用	100,000.00	100,000.00
信息披露费	106,666.00	106,666.00
债券帐户维护费	18,000.00	18,000.00
银行费用	2,362.69	4,461.50
合计	227,028.69	229,127.50

7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明**7.4.8.1 或有事项**

截至资产负债表日，本基金并无须作披露的或有事项。

7.4.8.2 资产负债表日后事项

1、本基金的基金管理人于 2013 年 1 月 16 日宣告 2012 年度第一次分红，向截至 2013 年 1 月 18 日止在本基金注册登记人华宝兴业基金管理有限公司登记在册的全体持有人，按每 10 份基金份额派发红利 0.1 元。

2、财政部、国家税务总局、中国证监会于 2012 年 11 月 16 日联合发布财税[2012]85 号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》（以下简称“通知”），要求个人从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，持股期限在 1 个月以内（含 1 个月）的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在 1 个月以上至 1 年（含 1 年）的，暂减按 50% 计入应纳税所得额；持股期限超过 1 年的，暂减按 25% 计入应纳税所得额。上述所得统一适用 20% 的税率计征个人所得税。证券投

资基金从上市公司取得的股息红利所得，按照本通知的规定计征个人所得税。通知自 2013 年 1 月 1 日起施行。

7.4.9 关联方关系

关联方名称	与本基金的关系
华宝兴业基金管理有限公司（“华宝兴业”）	基金管理人、注册登记机构、基金销售机构
中国建设银行股份有限公司（“中国建设银行”）	基金托管人、基金代销机构
华宝信托有限责任公司（“华宝信托”）	基金管理人的股东
领先资产管理有限公司（Lyxor Asset Management S.A.）	基金管理人的股东
宝钢集团有限公司（“宝钢集团”）	华宝信托的最终控制人
华宝证券有限责任公司（“华宝证券”）	受宝钢集团控制的公司
华宝投资有限公司（“华宝投资”）	受宝钢集团控制的公司

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

本基金本期及上年度可比期间未通过关联方交易单元进行交易。

7.4.10.2 关联方报酬

7.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2012 年 1 月 1 日至 2012 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2011 年 1 月 1 日至 2011 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的管理费	10,413,996.13	13,505,460.92
其中：支付销售机构的客户维护费	177,511.65	208,498.02

注：支付基金管理人华宝兴业的管理人报酬按前一日基金资产净值 1.3%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 1.3% / 当年天数。

7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2012 年 1 月 1 日至 2012 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2011 年 1 月 1 日至 2011 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的托管费	2,002,691.49	2,597,203.94

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 × 0.25% / 当年天数。

7.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

单位：人民币元

本期 2012 年 1 月 1 日至 2012 年 12 月 31 日						
银行间市场交易的 各关联方名称	债券交易金额		基金逆回购		基金正回购	
	基金买入	基金卖出	交易金额	利息收入	交易金额	利息支出
中国建设银行	-	-	-	-	-	-
上年度可比期间 2011 年 1 月 1 日至 2011 年 12 月 31 日						
银行间市场交易的 各关联方名称	债券交易金额		基金逆回购		基金正回购	
	基金买入	基金卖出	交易金额	利息收入	交易金额	利息支出
中国建设银行	-	-	-	-	10,000,000.00	722.26

7.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

7.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

份额单位：份

项目	本期 2012 年 1 月 1 日至 2012 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2011 年 1 月 1 日至 2011 年 12 月 31 日
期初持有的基金份额	843,407.93	843,407.93
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	843,407.93	843,407.93
期末持有的基金份额占基金总份额比例	0.14%	0.12%

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。

7.4.10.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

本基金本期末及上年度末无除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况。

7.4.10.5 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 2012 年 1 月 1 日至 2012 年 12 月 31 日		上年度可比期间 2011 年 1 月 1 日至 2011 年 12 月 31 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	25,846,681.30	335,088.64	12,297,256.18	315,386.33

注：本基金的银行存款由基金托管人中国建设银行保管，按银行同业利率计息。

7.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本期及上年度可比期间无在承销期内参与关联方承销证券的情况。

7.4.10.7 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期及上年度可比期间无须作说明的其他关联交易事项。

7.4.11 利润分配情况

本基金本期无利润分配事项。

本基金的基金管理人于资产负债表日后，报告批准报出日前宣告的利润分配情况，请参见资产负债表日后事项(附注：7.4.8.2)。

7.4.12 期末（2012 年 12 月 31 日）本基金持有的流通受限证券

7.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

本基金本期末无因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券。

7.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末 估值单 价	复牌日期	复牌 开盘单 价	数量（股）	期末 成本总额	期末估值总 额	备注
000002	万科 A	2012 年 12 月 26 日	重大事项公告	10.12	2013 年 1 月 21 日	11.13	898,588	7,744,903.83	9,093,710.56	-
000527	美的电器	2012 年 8 月 27 日	重大资产重组	9.18	-	-	183,186	2,722,697.75	1,681,647.48	-
600100	同方股份	2012 年 12 月 27 日	关联交易	7.48	2013 年 1 月 10 日	7.90	147,521	1,604,715.41	1,103,457.08	-

601618	中国中冶	2012 年 12 月 28 日	关联交易	2.26	2013 年 1 月 4 日	2.33	442,071	1,540,119.15	999,080.46	-
--------	------	------------------	------	------	----------------	------	---------	--------------	------------	---

注：本基金截至 2012 年 12 月 31 日止持有以上因公布的重大事项可能产生重大影响而被暂时停牌的股票，该类股票将在所公布事项的重大影响消除后，经交易所批准复牌。

7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

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

7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

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

7.4.13 金融工具风险及管理

7.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金是一只平衡型证券投资基金，属于风险适中、收益适中的基金品种。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相对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“相对收益高、风险适中”的风险收益目标。

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

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

本基金的基金管理人对于金融工具的风险管理方法是通过结合定性分析和定量分析方法，估测各种风险产生的可能损失。从定性分析的角度出发，判断风险损失的严重程度和出现风险损失的频度。而从定量分析的角度出发，根据本基金的投资目标，结合基金资产所运用金融工具的特征，通过特定的风险量化指标、模型、日常的量化报告，确定相应置信程度和风险损失的限度，及时可靠地对各种风险进行监督、检查和评估，并通过相应决策，将风险控制在可承受的范围内。

7.4.13.2 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同责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息等情况，导致基金资产损失和收益变化的风险。

本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的银行存款存放在本基金的托管行中国建设银行，与该银行存款相关的信用风险不重大。本基金在交易所进行的交易均以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，违约风险可能性很小；在银行间同业市场进行交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式进行限制以控制相应的信用风险。

本基金的基金管理人建立了信用风险管理流程，通过对投资品种信用等级评估来控制证券发行人的信用风险，且通过分散化投资以分散信用风险。

于 2012 年 12 月 31 日，本基金未持有除国债、央行票据和政策性金融债以外的债券(2011 年 12 月 31 日：同)。

7.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金在履行与金融负债有关的义务时遇到资金短缺的风险。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难或因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理的价格变现。

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

针对投资品种变现的流动性风险，本基金的基金管理人通过独立的风险管理部门设定流动性比例

要求，对流动性指标进行持续的监测和分析，包括组合持仓集中度指标、组合在短时间内变现能力的综合指标、组合中变现能力较差的投资品种比例以及流通受限制的投资品种比例等。本基金投资于一家公司发行的股票市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金的基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司发行的证券不得超过该证券的 10%。本基金所持大部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易，因此除附注 7.4.12 中列示的部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况外，其余均能以合理价格适时变现。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值。

于 2012 年 12 月 31 日，本基金所承担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。

7.4.13.4 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。

7.4.13.4.1 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。

本基金持有及承担的大部分金融资产和金融负债不计息，因此本基金的收入及经营活动的现金流量在很大程度上独立于市场利率变化。本基金持有的利率敏感性资产主要为银行存款、结算备付金及债券投资投资等。

7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2012 年 12 月 31 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	25,846,681.30	-	-	-	25,846,681.30

结算备付金	51,374.24	-	-	-	51,374.24
存出保证金	-	-	-	750,000.00	750,000.00
交易性金融资产	170,420,000.00	-	4,469,216.10	586,262,347.41	761,151,563.51
应收证券清算款	-	-	-	7,912,024.76	7,912,024.76
应收利息	-	-	-	3,154,664.67	3,154,664.67
应收申购款	1,192.85	-	-	109,668.05	110,860.90
资产总计	196,319,248.39	-	4,469,216.10	598,188,704.89	798,977,169.38
负债					
应付赎回款	-	-	-	555,281.47	555,281.47
应付管理人报酬	-	-	-	821,270.47	821,270.47
应付托管费	-	-	-	157,936.60	157,936.60
应付交易费用	-	-	-	628,305.03	628,305.03
应交税费	-	-	-	38,260.00	38,260.00
其他负债	-	-	-	707,750.66	707,750.66
负债总计	-	-	-	2,908,804.23	2,908,804.23
利率敏感度缺口	196,319,248.39	-	4,469,216.10	595,279,900.66	796,068,365.15
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	12,297,256.18	-	-	-	12,297,256.18
结算备付金	289,839.04	-	-	-	289,839.04
存出保证金	-	-	-	890,741.00	890,741.00
交易性金融资产	104,827,500.00	100,355,000.00	4,588,321.20	629,984,325.43	839,755,146.63
应收利息	-	-	-	2,850,284.16	2,850,284.16
应收申购款	1,988.07	-	-	888.97	2,877.04
资产总计	117,416,583.29	100,355,000.00	4,588,321.20	633,726,239.56	856,086,144.05
负债					
应付赎回款	-	-	-	125,811.89	125,811.89
应付管理人报酬	-	-	-	972,466.40	972,466.40
应付托管费	-	-	-	187,012.77	187,012.77
应付交易费用	-	-	-	3,785,879.85	3,785,879.85
应交税费	-	-	-	38,260.00	38,260.00
其他负债	-	-	-	706,882.62	706,882.62
负债总计	-	-	-	5,816,313.53	5,816,313.53
利率敏感度缺口	117,416,583.29	100,355,000.00	4,588,321.20	627,909,926.03	850,269,830.52

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

7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	除市场利率以外的其他市场变量保持不变	
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的

		影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2012 年 12 月 31 日）	上年度末（2011 年 12 月 31 日）
	1. 市场利率下降 25 个基点	272,713.63	570,262.65
	2. 市场利率上升 25 个基点	-270,570.22	-565,646.73

7.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无重大外汇风险。

7.4.13.4.3 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投资比例范围为基金资产净值的 5%-75%；债券为 20%-90%；现金比例在 5%以上。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。

7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2012 年 12 月 31 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	586,262,347.41	73.64	629,984,325.43	74.09

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	586,262,347.41	73.64	629,984,325.43	74.09

7.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除 70%×上证 180 和深证 100 复合指数+30%×中信全债指数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 12 月 31 日）	上年度末（2011 年 12 月 31 日）
	1. 70×上证 180 和深证 100 复合指数+30×中信全债指数上升 5%	40,436,292.61	42,670,791.44
	2. 70×上证 180 和深证 100 复合指数+30×中信全债指数下降 5%	-40,436,292.61	-42,670,791.44

7.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

(1) 公允价值

(a) 不以公允价值计量的金融工具

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

(b) 以公允价值计量的金融工具

(i) 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)。

(ii) 各层级金融工具公允价值

于 2012 年 12 月 31 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

577,853,667.93 元,属于第二层级的余额为 183,297,895.58 元,无属于第三层级的余额(2011 年 12 月 31 日:第一层级 637,623,986.36 元,第二层级 202,131,160.27 元,无第三层级)。

(iii) 公允价值所属层级间的重大变动

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。

(iv) 第三层级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。

§ 8 投资组合报告

8.1 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	586,262,347.41	73.38
	其中:股票	586,262,347.41	73.38
2	固定收益投资	174,889,216.10	21.89
	其中:债券	174,889,216.10	21.89
	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	25,898,055.54	3.24
6	其他各项资产	11,927,550.33	1.49
7	合计	798,977,169.38	100.00

8.2 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	2,704,191.42	0.34
B	采掘业	49,427,072.48	6.21
C	制造业	208,276,709.99	26.16
C0	食品、饮料	28,473,281.39	3.58

C1	纺织、服装、皮毛	1,393,656.70	0.18
C2	木材、家具	-	-
C3	造纸、印刷	722,726.55	0.09
C4	石油、化学、塑胶、塑料	14,929,920.68	1.88
C5	电子	8,131,506.68	1.02
C6	金属、非金属	32,603,768.26	4.10
C7	机械、设备、仪表	100,680,094.75	12.65
C8	医药、生物制品	21,214,709.93	2.66
C99	其他制造业	127,045.05	0.02
D	电力、煤气及水的生产和供应业	11,040,477.31	1.39
E	建筑业	17,623,120.97	2.21
F	交通运输、仓储业	12,042,010.98	1.51
G	信息技术业	14,779,808.93	1.86
H	批发和零售贸易	43,891,781.36	5.51
I	金融、保险业	144,789,144.50	18.19
J	房地产业	30,911,275.89	3.88
K	社会服务业	42,447,576.18	5.33
L	传播与文化产业	1,717,372.80	0.22
M	综合类	6,611,804.60	0.83
	合计	586,262,347.41	73.64

8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	300070	碧水源	945,143	37,900,234.30	4.76
2	002503	搜于特	984,873	24,129,388.50	3.03
3	002358	森源电气	1,432,207	17,386,992.98	2.18
4	600016	民生银行	2,040,784	16,040,562.24	2.01
5	600036	招商银行	1,119,543	15,393,716.25	1.93
6	300257	开山股份	410,771	14,171,599.50	1.78
7	300124	汇川技术	574,531	13,760,017.45	1.73
8	601318	中国平安	302,476	13,699,138.04	1.72
9	601166	兴业银行	683,470	11,407,114.30	1.43
10	601328	交通银行	2,076,072	10,255,795.68	1.29
11	600000	浦发银行	1,014,565	10,064,484.80	1.26
12	000002	万科A	898,588	9,093,710.56	1.14
13	300005	探路者	530,000	9,063,000.00	1.14
14	600030	中信证券	621,541	8,303,787.76	1.04

15	600519	贵州茅台	37,662	7,872,111.24	0.99
16	601088	中国神华	298,032	7,555,111.20	0.95
17	600837	海通证券	732,678	7,509,949.50	0.94
18	300090	盛运股份	351,606	6,539,871.60	0.82
19	601288	农业银行	2,281,914	6,389,359.20	0.80
20	601398	工商银行	1,403,845	5,825,956.75	0.73
21	300285	国瓷材料	170,552	5,797,062.48	0.73
22	601668	中国建筑	1,357,823	5,295,509.70	0.67
23	600048	保利地产	386,409	5,255,162.40	0.66
24	600111	包钢稀土	131,534	4,925,948.30	0.62
25	000858	五 粮 液	171,776	4,849,236.48	0.61
26	000651	格力电器	189,971	4,844,260.50	0.61
27	601169	北京银行	477,246	4,438,387.80	0.56
28	300177	中海达	299,954	3,827,413.04	0.48
29	300157	恒泰艾普	194,794	3,769,263.90	0.47
30	000001	平安银行	231,596	3,710,167.92	0.47
31	000157	中联重科	399,650	3,680,776.50	0.46
32	601006	大秦铁路	535,873	3,622,501.48	0.46
33	600104	上汽集团	198,708	3,505,209.12	0.44
34	600585	海螺水泥	180,853	3,336,737.85	0.42
35	601818	光大银行	1,092,766	3,332,936.30	0.42
36	600015	华夏银行	310,446	3,213,116.10	0.40
37	600887	伊利股份	145,406	3,196,023.88	0.40
38	002285	世联地产	225,128	3,149,540.72	0.40
39	600256	广汇能源	191,017	3,130,768.63	0.39
40	600900	长江电力	447,109	3,071,638.83	0.39
41	600031	三一重工	276,094	2,923,835.46	0.37
42	601628	中国人寿	136,335	2,917,569.00	0.37
43	601857	中国石油	315,717	2,854,081.68	0.36
44	600383	金地集团	402,386	2,824,749.72	0.35
45	601899	紫金矿业	709,013	2,715,519.79	0.34
46	002304	洋河股份	28,592	2,669,635.04	0.34
47	600050	中国联通	762,504	2,668,764.00	0.34
48	600028	中国石化	384,333	2,659,584.36	0.33
49	002024	苏宁电器	379,421	2,523,149.65	0.32
50	000776	广发证券	162,142	2,500,229.64	0.31
51	600547	山东黄金	64,112	2,446,513.92	0.31
52	000069	华侨城 A	326,096	2,445,720.00	0.31
53	600999	招商证券	212,636	2,243,309.80	0.28

54	000568	泸州老窖	62,783	2,222,518.20	0.28
55	600489	中金黄金	130,851	2,176,052.13	0.27
56	000538	云南白药	30,782	2,093,176.00	0.26
57	000338	潍柴动力	80,320	2,032,899.20	0.26
58	600011	华能国际	282,914	2,020,005.96	0.25
59	000983	西山煤电	142,960	1,988,573.60	0.25
60	600690	青岛海尔	145,642	1,951,602.80	0.25
61	000423	东阿阿胶	46,988	1,898,785.08	0.24
62	601989	中国重工	396,879	1,893,112.83	0.24
63	600739	辽宁成大	124,088	1,860,079.12	0.23
64	000024	招商地产	62,121	1,856,796.69	0.23
65	002375	亚厦股份	70,000	1,853,600.00	0.23
66	600518	康美药业	139,821	1,837,247.94	0.23
67	600795	国电电力	693,350	1,823,510.50	0.23
68	601699	潞安环能	82,559	1,807,216.51	0.23
69	600362	江西铜业	74,822	1,785,252.92	0.22
70	601988	中国银行	606,609	1,771,298.28	0.22
71	000725	京东方 A	779,308	1,769,029.16	0.22
72	601788	光大证券	122,180	1,722,738.00	0.22
73	000063	中兴通讯	176,564	1,721,499.00	0.22
74	601299	中国北车	377,789	1,703,828.39	0.21
75	601009	南京银行	185,193	1,703,775.60	0.21
76	601377	兴业证券	137,902	1,693,436.56	0.21
77	000100	TCL 集团	769,813	1,685,890.47	0.21
78	000527	美的电器	183,186	1,681,647.48	0.21
79	600276	恒瑞医药	55,851	1,681,115.10	0.21
80	601186	中国铁建	278,205	1,633,063.35	0.21
81	000895	双汇发展	27,338	1,582,870.20	0.20
82	000629	攀钢钒钛	380,126	1,566,119.12	0.20
83	601766	中国南车	314,616	1,560,495.36	0.20
84	600348	阳泉煤业	107,091	1,556,032.23	0.20
85	600089	特变电工	238,606	1,541,394.76	0.19
86	600535	天士力	27,464	1,517,935.28	0.19
87	600309	烟台万华	97,134	1,516,261.74	0.19
88	000792	盐湖股份	56,571	1,516,102.80	0.19
89	601688	华泰证券	151,520	1,484,896.00	0.19
90	000402	金 融 街	218,907	1,477,622.25	0.19
91	601117	中国化学	178,588	1,471,565.12	0.18
92	000783	长江证券	151,928	1,428,123.20	0.18

93	600315	上海家化	28,006	1,428,025.94	0.18
94	601390	中国中铁	468,459	1,424,115.36	0.18
95	601168	西部矿业	172,817	1,354,885.28	0.17
96	600406	国电南瑞	84,065	1,347,561.95	0.17
97	601600	中国铝业	261,871	1,343,398.23	0.17
98	601111	中国国航	222,594	1,335,564.00	0.17
99	601669	中国水电	344,910	1,317,556.20	0.17
100	000425	徐工机械	113,021	1,303,132.13	0.16
101	601898	中煤能源	164,660	1,287,641.20	0.16
102	600010	宝钢股份	235,569	1,272,072.60	0.16
103	600123	兰花科创	62,391	1,265,913.39	0.16
104	600029	南方航空	317,461	1,241,272.51	0.16
105	000630	铜陵有色	64,052	1,210,582.80	0.15
106	002081	金螳螂	27,247	1,199,412.94	0.15
107	000060	中金岭南	129,604	1,172,916.20	0.15
108	002422	科伦药业	20,859	1,168,521.18	0.15
109	000581	威孚高科	35,907	1,145,433.30	0.14
110	600642	申能股份	258,531	1,142,707.02	0.14
111	000625	长安汽车	171,825	1,142,636.25	0.14
112	600150	中国船舶	48,686	1,131,462.64	0.14
113	600660	福耀玻璃	128,050	1,122,998.50	0.14
114	002241	歌尔声学	29,648	1,117,729.60	0.14
115	002415	海康威视	35,817	1,114,266.87	0.14
116	002142	宁波银行	104,289	1,111,720.74	0.14
117	600100	同方股份	147,521	1,103,457.08	0.14
118	600009	上海机场	87,080	1,085,016.80	0.14
119	000623	吉林敖东	63,423	1,078,191.00	0.14
120	000012	南玻A	129,967	1,072,227.75	0.13
121	600085	同仁堂	60,043	1,069,966.26	0.13
122	600196	复星医药	100,921	1,058,661.29	0.13
123	601998	中信银行	245,220	1,051,993.80	0.13
124	600741	华域汽车	93,995	1,050,864.10	0.13
125	600066	宇通客车	41,519	1,046,278.80	0.13
126	600005	武钢股份	373,924	1,035,769.48	0.13
127	600068	葛洲坝	188,127	1,032,817.23	0.13
128	000709	河北钢铁	385,087	1,032,033.16	0.13
129	600600	青岛啤酒	30,840	1,019,570.40	0.13
130	600583	海油工程	172,304	1,011,424.48	0.13
131	601958	金钼股份	86,217	1,009,601.07	0.13

132	000562	宏源证券	53,263	1,004,007.55	0.13
133	601618	中国中冶	442,071	999,080.46	0.13
134	000728	国元证券	88,879	990,112.06	0.12
135	600188	兖州煤业	54,018	984,748.14	0.12
136	601607	上海医药	87,780	975,235.80	0.12
137	600809	山西汾酒	22,960	956,513.60	0.12
138	600177	雅戈尔	120,471	951,720.90	0.12
139	002155	辰州矿业	47,291	949,603.28	0.12
140	000878	云南铜业	62,693	948,545.09	0.12
141	000768	中航飞机	112,743	938,021.76	0.12
142	600549	厦门钨业	24,022	936,377.56	0.12
143	600369	西南证券	104,482	933,024.26	0.12
144	600694	大商股份	26,340	929,011.80	0.12
145	601919	中国远洋	208,616	919,996.56	0.12
146	600143	金发科技	170,172	917,227.08	0.12
147	601666	平煤股份	107,302	916,359.08	0.12
148	600703	三安光电	65,979	902,592.72	0.11
149	601808	中海油服	54,022	885,960.80	0.11
150	000039	中集集团	76,732	884,719.96	0.11
151	600166	福田汽车	129,362	870,606.26	0.11
152	601018	宁波港	338,337	869,526.09	0.11
153	600153	建发股份	123,488	868,120.64	0.11
154	600376	首开股份	66,113	867,402.56	0.11
155	601100	恒立油缸	76,800	864,000.00	0.11
156	000937	冀中能源	62,202	860,253.66	0.11
157	000009	中国宝安	97,260	855,888.00	0.11
158	000999	华润三九	35,800	848,460.00	0.11
159	600875	东方电气	60,808	844,623.12	0.11
160	600881	亚泰集团	167,500	840,850.00	0.11
161	601633	长城汽车	35,204	834,334.80	0.10
162	000758	中色股份	40,841	833,156.40	0.10
163	600108	亚盛集团	120,580	823,561.40	0.10
164	600415	小商品城	123,868	822,483.52	0.10
165	002353	杰瑞股份	16,901	805,163.64	0.10
166	000960	锡业股份	40,302	801,203.76	0.10
167	600497	驰宏锌锗	56,597	800,847.55	0.10
168	600832	东方明珠	140,726	782,436.56	0.10
169	002038	双鹭药业	19,772	782,180.32	0.10
170	002385	大北农	35,220	760,752.00	0.10

171	601717	郑煤机	73,631	759,871.92	0.10
172	600395	盘江股份	44,334	754,564.68	0.09
173	600655	豫园商城	104,400	749,592.00	0.09
174	002202	金风科技	138,738	747,797.82	0.09
175	600649	城投控股	135,683	742,186.01	0.09
176	601333	广深铁路	252,976	738,689.92	0.09
177	601991	大唐发电	183,199	738,291.97	0.09
178	600804	鹏博士	122,949	732,776.04	0.09
179	002146	荣盛发展	52,311	731,830.89	0.09
180	600219	南山铝业	106,614	727,107.48	0.09
181	600208	新湖中宝	168,224	725,045.44	0.09
182	000825	太钢不锈	200,485	723,750.85	0.09
183	002303	美盈森	41,181	722,726.55	0.09
184	601901	方正证券	163,726	722,031.66	0.09
185	600674	川投能源	85,963	718,650.68	0.09
186	600271	航天信息	48,203	714,368.46	0.09
187	000528	柳 工	71,336	714,073.36	0.09
188	000422	湖北宜化	63,760	708,373.60	0.09
189	600252	中恒集团	77,535	707,894.55	0.09
190	600062	华润双鹤	31,005	703,813.50	0.09
191	600839	四川长虹	338,810	697,948.60	0.09
192	600115	东方航空	194,052	681,122.52	0.09
193	002310	东方园林	10,842	679,684.98	0.09
194	600267	海正药业	45,619	679,266.91	0.09
195	000933	神火股份	90,000	677,700.00	0.09
196	601106	中国一重	239,602	675,677.64	0.08
197	600058	五矿发展	38,786	665,955.62	0.08
198	601992	金隅股份	80,525	652,252.50	0.08
199	000401	冀东水泥	47,257	652,146.60	0.08
200	600811	东方集团	120,028	651,752.04	0.08
201	000046	泛海建设	120,668	651,607.20	0.08
202	000729	燕京啤酒	112,976	637,184.64	0.08
203	000898	鞍钢股份	163,479	634,298.52	0.08
204	600259	广晟有色	10,803	631,759.44	0.08
205	601888	中国国旅	22,978	630,056.76	0.08
206	600109	国金证券	34,781	620,493.04	0.08
207	601118	海南橡胶	108,514	616,359.52	0.08
208	600893	航空动力	48,508	612,656.04	0.08
209	002001	新 和 成	32,581	612,522.80	0.08

210	600827	友谊股份	69,944	600,119.52	0.08
211	000800	一汽轿车	72,034	599,322.88	0.08
212	600718	东软集团	77,628	596,959.32	0.07
213	600779	水井坊	30,593	592,586.41	0.07
214	002106	莱宝高科	38,463	588,868.53	0.07
215	000876	新希望	47,061	587,791.89	0.07
216	600971	恒源煤电	45,557	586,774.16	0.07
217	600125	铁龙物流	81,193	583,777.67	0.07
218	600266	北京城建	38,951	579,980.39	0.07
219	600372	中航电子	36,551	579,333.35	0.07
220	002092	中泰化学	81,293	578,806.16	0.07
221	600352	浙江龙盛	94,449	573,305.43	0.07
222	601101	昊华能源	42,609	567,551.88	0.07
223	000718	苏宁环球	71,508	567,058.44	0.07
224	000869	张裕A	12,063	566,961.00	0.07
225	000061	农产品	98,771	562,994.70	0.07
226	000778	新兴铸管	87,088	562,588.48	0.07
227	600418	江淮汽车	82,195	561,391.85	0.07
228	600997	开滦股份	54,755	559,596.10	0.07
229	601179	中国西电	160,183	557,436.84	0.07
230	600664	哈药股份	89,055	550,359.90	0.07
231	600169	太原重工	148,216	538,024.08	0.07
232	601001	大同煤业	58,194	537,712.56	0.07
233	002007	华兰生物	25,506	536,646.24	0.07
234	600598	北大荒	65,401	533,672.16	0.07
235	600316	洪都航空	38,811	532,486.92	0.07
236	600516	方大炭素	59,537	528,688.56	0.07
237	600863	内蒙华电	70,213	526,597.50	0.07
238	600320	振华重工	154,536	523,877.04	0.07
239	600331	宏达股份	77,291	517,076.79	0.06
240	600216	浙江医药	24,164	507,927.28	0.06
241	601866	中海集运	207,803	507,039.32	0.06
242	600970	中材国际	40,950	504,504.00	0.06
243	000839	中信国安	83,638	503,500.76	0.06
244	600895	张江高科	71,632	502,856.64	0.06
245	600170	上海建工	64,307	502,237.67	0.06
246	600432	吉恩镍业	36,738	495,963.00	0.06
247	601933	永辉超市	19,552	492,905.92	0.06
248	600118	中国卫星	40,298	492,844.54	0.06

249	002690	美亚光电	20,000	487,000.00	0.06
250	600859	王府井	20,228	484,662.88	0.06
251	600498	烽火通信	21,200	482,512.00	0.06
252	002128	露天煤业	35,630	478,154.60	0.06
253	000969	安泰科技	45,203	477,343.68	0.06
254	601928	凤凰传媒	68,188	462,314.64	0.06
255	601918	国投新集	48,158	460,872.06	0.06
256	300058	蓝色光标	20,000	460,000.00	0.06
257	600221	海南航空	108,157	457,504.11	0.06
258	600160	巨化股份	48,436	447,548.64	0.06
259	600588	用友软件	45,369	447,338.34	0.06
260	000961	中南建设	32,370	444,116.40	0.06
261	601158	重庆水务	83,171	441,638.01	0.06
262	600508	上海能源	27,098	436,006.82	0.05
263	601098	中南传媒	48,304	431,837.76	0.05
264	000807	云铝股份	81,132	427,565.64	0.05
265	600812	华北制药	75,103	417,572.68	0.05
266	600528	中铁二局	62,251	415,836.68	0.05
267	601555	东吴证券	51,328	413,703.68	0.05
268	601369	陕鼓动力	45,328	408,858.56	0.05
269	600550	天威保变	62,233	405,136.83	0.05
270	002073	软控股份	53,281	402,804.36	0.05
271	600873	梅花集团	73,901	401,282.43	0.05
272	600022	山东钢铁	182,488	399,648.72	0.05
273	600132	重庆啤酒	25,934	398,605.58	0.05
274	000680	山推股份	81,298	395,921.26	0.05
275	002069	獐子岛	24,449	385,805.22	0.05
276	601558	华锐风电	71,997	378,704.22	0.05
277	002344	海宁皮城	14,057	373,635.06	0.05
278	600770	综艺股份	60,082	371,907.58	0.05
279	600037	歌华有线	54,212	363,220.40	0.05
280	000059	辽通化工	53,217	362,407.77	0.05
281	002405	四维图新	30,848	361,847.04	0.05
282	600500	中化国际	61,723	356,758.94	0.04
283	000686	东北证券	21,353	356,595.10	0.04
284	600595	中孚实业	71,535	353,382.90	0.04
285	600546	山煤国际	17,091	347,801.85	0.04
286	000703	恒逸石化	30,962	344,916.68	0.04
287	002299	圣农发展	32,284	344,793.12	0.04

288	600456	宝钛股份	19,117	339,135.58	0.04
289	000559	万向钱潮	74,829	335,982.21	0.04
290	000780	平庄能源	34,886	334,207.88	0.04
291	002431	棕榈园林	13,982	321,586.00	0.04
292	002122	天马股份	56,223	310,350.96	0.04
293	600096	云天化	23,916	309,951.36	0.04
294	601099	太平洋	55,982	306,221.54	0.04
295	601718	际华集团	99,649	299,943.49	0.04
296	000021	长城开发	59,972	282,468.12	0.04
297	600157	永泰能源	30,000	282,300.00	0.04
298	000968	煤气化	22,574	278,563.16	0.03
299	002399	海普瑞	13,910	260,812.50	0.03
300	600307	酒钢宏兴	78,138	256,292.64	0.03
301	600183	生益科技	60,613	255,180.73	0.03
302	601566	九牧王	15,360	248,524.80	0.03
303	600805	悦达投资	20,000	238,000.00	0.03
304	601258	庞大集团	44,953	232,407.01	0.03
305	002500	山西证券	31,295	229,392.35	0.03
306	002603	以岭药业	9,816	228,418.32	0.03
307	600783	鲁信创投	20,428	225,729.40	0.03
308	600312	平高电气	29,964	217,838.28	0.03
309	002493	荣盛石化	19,917	216,696.96	0.03
310	601216	内蒙君正	34,282	213,234.04	0.03
311	601233	桐昆股份	26,900	193,411.00	0.02
312	002378	章源钨业	7,549	183,893.64	0.02
313	002570	贝因美	7,230	159,638.40	0.02
314	601268	二重重装	28,468	144,048.08	0.02
315	002594	比亚迪	6,243	127,045.05	0.02

8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

8.4.1 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	300257	开山股份	15,781,481.41	1.86
2	300005	探路者	8,020,208.85	0.94
3	300025	华星创业	6,919,932.72	0.81

4	300124	汇川技术	6,630,773.89	0.78
5	600036	招商银行	6,234,199.44	0.73
6	600016	民生银行	6,183,208.80	0.73
7	300136	信维通信	5,656,795.09	0.67
8	300090	盛运股份	5,578,250.12	0.66
9	300070	碧水源	5,411,304.35	0.64
10	601318	中国平安	5,079,993.59	0.60
11	300024	机器人	4,840,036.78	0.57
12	300344	太空板业	4,767,500.20	0.56
13	300285	国瓷材料	4,635,656.96	0.55
14	601288	农业银行	4,363,078.87	0.51
15	600000	浦发银行	4,338,942.00	0.51
16	002358	森源电气	4,260,845.43	0.50
17	002503	搜于特	3,921,696.91	0.46
18	601818	光大银行	3,910,249.00	0.46
19	300157	恒泰艾普	3,884,639.66	0.46
20	601328	交通银行	3,872,042.00	0.46

注：买入金额不包括相关交易费用。

8.4.2 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	300070	碧水源	12,349,977.14	1.45
2	002358	森源电气	11,872,443.50	1.40
3	002367	康力电梯	11,198,326.17	1.32
4	600036	招商银行	10,788,993.30	1.27
5	600016	民生银行	10,402,062.10	1.22
6	300105	龙源技术	9,933,279.50	1.17
7	601318	中国平安	8,623,114.39	1.01
8	300257	开山股份	8,315,168.60	0.98
9	300228	富瑞特装	7,761,829.70	0.91
10	601328	交通银行	7,641,448.35	0.90
11	600000	浦发银行	7,284,104.65	0.86
12	300025	华星创业	7,268,388.24	0.85
13	601166	兴业银行	6,601,215.25	0.78
14	300024	机器人	5,921,508.91	0.70

15	002497	雅化集团	5,911,037.82	0.70
16	600519	贵州茅台	5,784,669.72	0.68
17	002469	三维工程	5,658,438.19	0.67
18	601088	中国神华	5,503,522.47	0.65
19	002013	中航精机	5,430,839.13	0.64
20	002503	搜于特	5,184,413.80	0.61

注：卖出金额不包括相关交易费用。

8.4.3 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	347,591,280.67
卖出股票收入（成交）总额	474,952,761.61

注：买入股票成本、卖出股票收入均不包括相关交易费用。

8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	4,469,216.10	0.56
2	央行票据	59,952,000.00	7.53
3	金融债券	110,468,000.00	13.88
	其中：政策性金融债	110,468,000.00	13.88
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债	-	-
8	其他	-	-
9	合计	174,889,216.10	21.97

8.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名债券投资明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	080215	08 国开 15	500,000	50,460,000.00	6.34
2	1001042	10 央行票据 42	500,000	49,965,000.00	6.28
3	120218	12 国开 18	300,000	30,012,000.00	3.77
4	120405	12 农发 05	200,000	20,010,000.00	2.51
5	1001060	10 央行票据 60	100,000	9,987,000.00	1.25

8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

8.8 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。

8.9 投资组合报告附注

8.9.1 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。

8.9.2 基金投资的前十名股票未超出基金合同规定的备选股票库。

8.9.3 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	750,000.00
2	应收证券清算款	7,912,024.76
3	应收股利	-
4	应收利息	3,154,664.67
5	应收申购款	110,860.90
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	11,927,550.33

8.9.4 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。

8.9.5 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的情况。

§ 9 基金份额持有人信息

9.1 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
35,925	17,206.04	37,891,223.54	6.13%	580,235,619.32	93.87%

9.2 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	625,621.10	0.1012%

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

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：

0 至 10 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。

§ 10 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（ 2003 年 7 月 15 日 ）基金份额总额	1,067,242,501.27
本报告期期初基金份额总额	730,413,591.45
本报告期基金总申购份额	26,793,664.03
减：本报告期基金总赎回份额	139,080,412.62
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	618,126,842.86

注：总申购份额含转换入份额；总赎回份额含转换出份额。

§ 11 重大事件揭示

11.1 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。

11.2 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

2012 年 11 月 15 日，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业务部总经理，其任职资格已经中国证监会审核批准（证监许可〔2012〕961 号）。聘任郑绍平为中国建设银行投资托管业务部副总经理，其任职资格已经中国证监会审核批准（证监许可〔2012〕1036 号）。

本报告期内，本基金管理人未发生重大人事变动。

11.3 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。

11.4 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。

11.5 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在本报告期的审计报酬为 100,000.00 元人民币。目前该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（2003 年 7 月 15 日）起至本报告期末。

11.6 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。

11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

11.7.1 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	
中信建投	1	373,760,166.68	45.46%	310,709.76	44.57%	-
招商证券	1	254,230,205.59	30.92%	216,855.41	31.11%	-
申银万国	1	119,580,163.92	14.55%	102,739.52	14.74%	-
平安证券	1	43,760,494.36	5.32%	39,537.67	5.67%	-
华泰联合	1	26,995,382.56	3.28%	23,855.03	3.42%	-
中银国际	1	3,786,821.37	0.46%	3,447.48	0.49%	-
国元证券	1	-	-	-	-	-
东方证券	1	-	-	-	-	-

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：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、本报告期租用的证券公司交易单元没有变化。

11.7.2 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
中信建投	-	-	-	-	-	-
招商证券	8,497,450.00	19.68%	-	-	-	-
申银万国	34,691,332.40	80.32%	-	-	-	-
平安证券	-	-	-	-	-	-
华泰联合	-	-	-	-	-	-
中银国际	-	-	-	-	-	-
国元证券	-	-	-	-	-	-
东方证券	-	-	-	-	-	-

11.8 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旗下基金资产净值公告	基金管理人网站	2012 年 12 月 31 日
2	华宝兴业基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金延长中信建投证券股份有限公司定时定额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 12 月 31 日
3	华宝兴业基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金参加中国工商银行“2013 倾心回馈”基金定	《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》以及基金管理人	2012 年 12 月 28 日

	投优惠活动的公告	网站	
4	华宝兴业基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金增加代销机构及费率优惠的公告	《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》以及基金管理人网站	2012 年 12 月 27 日
5	华宝兴业基金管理有限公司关于第一代居民身份证停止使用的提示公告	《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 12 月 14 日
6	华宝兴业基金管理有限公司关于旗下部分基金参加中国银行网上银行、手机银行申购和定投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 11 月 28 日
7	华宝兴业基金管理有限公司关于设立华宝兴业资产管理（香港）有限公司的公告	《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 11 月 22 日
8	华宝兴业基金管理有限公司关于公司住所变更的公告	《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 7 月 4 日
9	华宝兴业基金管理有限公司旗下基金资产净值公告	基金管理人网站	2012 年 7 月 1 日
10	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
11	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	《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券	2012 年 6 月 28 日

	费率优惠活动的公告	报》以及基金管理人网站	
12	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
13	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
14	华宝兴业基金管理有限公司关于参加江苏银行网上银行基金申购费率优惠活动的公告	《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》以及基金管理人网站	2012 年 3 月 30 日
15	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
16	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
17	华宝兴业基金管理有限公司关于华宝兴业宝康灵活配置证券投资基金基金经理变更公告	《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》以及基金管理人网站	2012 年 1 月 19 日
18	华宝兴业基金管理有限公司旗下基金资产净值公告	基金管理人网站	2012 年 1 月 1 日

§ 12 影响投资者决策的其他重要信息

1、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。

2、2012 年 11 月 15 日, 根据工作需要, 中国建设银行投资托管服务部更名为投资托管业务部。

§ 13 备查文件目录

13.1 备查文件目录

中国证监会批准基金设立的文件;
华宝兴业宝康系列开放式证券投资基金基金合同;
华宝兴业宝康系列开放式证券投资基金招募说明书;
华宝兴业宝康系列开放式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。

13.2 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。

13.3 查阅方式

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

华宝兴业基金管理有限公司
2013 年 3 月 27 日