

华宝兴业宝康灵活配置证券投资基金 2013 年半年度报告

2013 年 6 月 30 日

基金管理人：华宝兴业基金管理有限公司

基金托管人：中国建设银行股份有限公司

送出日期：2013 年 8 月 24 日

§ 1 重要提示及目录

1.1 重要提示

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

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2013 年 8 月 20 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2013 年 01 月 01 日起至 06 月 30 日止。

1.2 目录

§1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
§2 基金简介	5
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人和基金托管人	5
2.4 信息披露方式	6
2.5 其他相关资料	6
§3 主要财务指标和基金净值表现	6
3.1 主要会计数据和财务指标	6
3.2 基金净值表现	7
§4 管理人报告	8
4.1 基金管理人及基金经理情况	8
4.2 管理人对报告期内本基金运作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	11
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	12
§5 托管人报告	12
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	12
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、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	14
6.3 所有者权益（基金净值）变动表	15
6.4 报表附注	16
§7 投资组合报告	33
7.1 期末基金资产组合情况	33
7.2 期末按行业分类的股票投资组合	33
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细	34
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	42
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	44
7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名债券投资明细	44
7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的所有资产支持证券投资明细	44
7.8 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资明细	45
7.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明	45
7.10 投资组合报告附注	45
§8 基金份额持有人信息	46
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	46
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	46

§9 开放式基金份额变动.....	47
§10 重大事件揭示.....	47
10.1 基金份额持有人大会决议.....	47
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	47
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	47
10.4 基金投资策略的改变.....	48
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	48
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	48
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	48
10.8 其他重大事件	49
§11 影响投资者决策的其他重要信息.....	51
§12 备查文件目录.....	51
12.1 备查文件目录.....	51
12.2 存放地点.....	51
12.3 查阅方式.....	52

§ 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	712,809,375.97 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	北京市西城区金融大街 25 号

	号上海环球金融中心 58 楼	
办公地址	上海浦东新区世纪大道 100 号上海环球金融中心 58 楼	北京市西城区闹市口大街 1 号院 1 号楼
邮政编码	200120	100033
法定代表人	郑安国	王洪章

2.4 信息披露方式

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

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	基金管理人	上海市世纪大道 100 号环球金融中心 58 楼
会计师事务所	普华永道中天会计师事务所有限责任公司	上海市浦东新区陆家嘴环路 1318 号星展银行大厦 6 楼

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2013 年 1 月 1 日 - 2013 年 6 月 30 日)
本期已实现收益	-6,140,337.85
本期利润	616,485.72
加权平均基金份额本期利润	0.0010
本期加权平均净值利润率	0.07%
本期基金份额净值增长率	-0.15%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2013 年 6 月 30 日)
期末可供分配利润	196,829,151.68
期末可供分配基金份额利润	0.2761
期末基金资产净值	909,638,527.65
期末基金份额净值	1.2761
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2013 年 6 月 30 日)
基金份额累计净值增长率	272.83%

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、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）。

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

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	份额净值 增长率①	份额净值 增长率标 准差②	业绩比较 基准收益 率③	业绩比较基 准收益率标 准差④	①—③	②—④
过去一个月	-8.18%	1.26%	-5.80%	0.69%	-2.38%	0.57%
过去三个月	-2.39%	0.95%	-3.41%	0.53%	1.02%	0.42%
过去六个月	-0.15%	0.96%	-2.87%	0.55%	2.72%	0.41%
过去一年	3.62%	0.93%	-0.71%	0.50%	4.33%	0.43%
过去三年	5.01%	0.95%	2.54%	0.49%	2.47%	0.46%
自基金合同 生效日起至 今	272.83%	1.18%	64.78%	0.64%	208.05%	0.54%

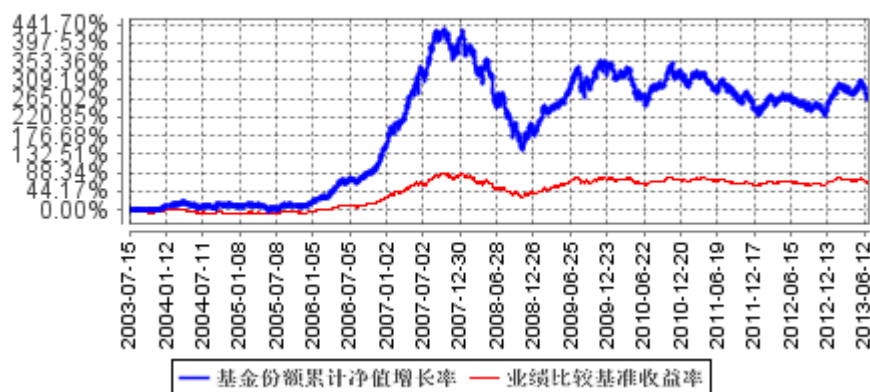
注：1、本基金业绩比较基准为：65%中信标普全债指数+35%上证 180 指数和深圳 100 指数的复合指数。

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

(2003 年 7 月 15 日至 2013 年 6 月 30 日)

基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：按照基金合同的约定，自基金成立日期的 6 个月内达到规定的资产组合，截至 2004 年 1 月 15 日，本基金已达到合同规定的资产配置比例。

§ 4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

基金管理人是在 2003 年 3 月 7 日正式成立的合资基金管理公司，截至本报告期末（2013 年 6 月 30 日），所管理的开放式证券投资基金包括宝康系列基金、多策略基金、现金宝货币市场基金、动力组合基金、收益增长基金、先进成长基金、行业精选基金、海外中国成长基金、大盘精选基金、增强收益基金、中证 100 基金、上证 180 价值 ETF、上证 180 价值 ETF 联接基金、新兴产业基金、成熟市场动量优选基金、可转债基金、上证 180 成长 ETF、上证 180 成长 ETF 联接基金、华宝油气基金、华宝兴业医药生物基金、华宝短融 50 基金、华宝兴业资源优选基金、华宝添益基金和华宝兴业服务优选基金，所管理的开放式证券投资基金资产净值合计 39,612,038,487.56 元。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
郭鹏飞	国内投资部 总 经	2010 年 6 月 26 日	—	9 年	博士，拥有 CFA 资格。2004 年 2

	理、本基金基金经理，华宝兴业新兴产业基金经理				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 月起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。
季鹏	本基金基金经理助理	2011 年 11 月 3 日	-	7 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。

3、本基金管理人于 2013 年 7 月 25 日发布《华宝兴业基金管理有限公司关于华宝兴业宝康灵活配置证券投资基金增聘基金经理公告》，增聘胡戈游先生为本基金基金经理。

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人遵守《中华人民共和国证券法》、《中华人民共和国证券投资基金法》及其各项实施细则、《华宝兴业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。

由于股、债市的系统性风险和申购赎回引起的基金资产规模变化，宝康灵活配置证券投资基金在短期内出现过所持有的证券市值占基金资产总值比例（不含融资）低于 80%的情况。发生此类情况后，该基金均在合理期限内得到了调整，没有给投资人带来额外风险或损失。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

2013 年上半年基金管理人严格遵守公司内部制定的公平交易制度和控制方法，确保了所管理的所有投资组合在授权、研究分析、投资决策、交易执行、业绩评估等投资管理活动和环节得到公平对待。公司内部制定的公平交易制度涉及的范围包括境内上市股票、债券的一级市场申购、二级市场交易等投资管理活动。

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

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内，基金管理人未发生所有投资组合参与的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的 5%。

本报告期内，本基金未发现异常交易行为。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

回顾 2013 年上半年，主板市场在经历一月份强劲反弹后，随后出现了较长时间的下跌。背后的逻辑是中国经济复苏格局弱于预期，房地产调控加码，国内预期流动性收紧等负面因素影响，而与此同时，代表中国经济未来转型方向的部分行业和创业板指数逆市而上，表现出色，而创业板和主板市场的表现差距也创出了历史新高。2013 年上半年，上证指数下跌 12.78%，深成指下跌 15.60%，沪深 300 下跌 12.78%，中小板指数上涨 5.19%，创业板大涨 41.72%，中小板和创业板市场明显好于上证和主板市场表现。板块表现方面，周期类板块表现明显弱于非周期板块：信息服务、电子、医药、信息设备等行业表现靠前，而煤炭、有色、黑色金属、交通运输、纺织服装、建筑建材、商业贸易、金融服务等行业都跌幅靠前，下跌幅度都超过 10%。目前，多数基金都比较偏向专注于投资代表中国经济转型成功的少数新兴和消费行业，并大量持有此类公司股票，忽视传统的周期行业和风格轮动的趋势非常明显，而因此造成业绩差距明显。

我们在二季度对指数采取了逢高减持的操作，并坚持维持了契约允许范围内较高的创业板持仓比例，操作基本吻合市场节奏，虽然业绩表现战胜了基准，但是由于大部分仓位所投资的沪深 300 组合表现疲弱，基金表现明显落后于其它基金。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末，本报告期内基金份额净值增长率为-0.15%，同期业绩比较基准收益率为-2.87%，基金表现超越基准 2.72 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

展望 2013 年三季度，受到经济结构调整及流动性有所收紧的影响，中国经济整体增速不容乐观，周期性行业的盈利恢复过程将更加漫长，而传统行业与新兴行业的发展前景及盈利增速的差距将进一步拉大。正面因素是，目前 A 股主板市场仍处于很低的估值水平，三季度后期将酝酿召开有关重要改革方向的十八届三中全会，市场对中国经济前景及改革方向的预期将更加明朗。我们认为，尽管经济前景不明朗，流动性也并不乐观，但目前市场在整体估值上具有一定安全边际，长期来看投资的风险并不大。

因此，我们计划在操作上稳健为主，根据宏观经济和流动性情况灵活地把握指数的投资机会，关注改革红利所带来的投资机会，但对于国内外流动性从紧对市场所造成的负面影响将充分提高警惕；而对于主动部分的个股选择将更加倾向于严格把关，把握合理的估值安全边际和企业质地，

但是由于目前中国经济正处在关键的转型期，我们仍愿意给予这些代表中国转型方向的行业更多的关注和权重，我们也相信中国转型成功所带来的巨大的投资机会。感谢基金持有人一直以来对我们的支持，在以后的投资中，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。

4.7 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合规守信、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，发现个别监督指标不符合基金合同约定并及时通知了基金管理人，基金管理人在合理期限内进行了调整，对基金份额持有人利益未造成损害。

报告期内，本基金实施收益分配的金额为 6,138,841.24 元。

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：华宝兴业宝康灵活配置证券投资基金

报告截止日：2013 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2013 年 6 月 30 日	上年度末 2012 年 12 月 31 日
资 产：			
银行存款	6.4.7.1	71,407,131.25	25,846,681.30
结算备付金		540,558.59	51,374.24
存出保证金		202,130.71	750,000.00
交易性金融资产	6.4.7.2	835,194,580.55	761,151,563.51
其中：股票投资		609,599,165.95	586,262,347.41
基金投资		-	-
债券投资		225,595,414.60	174,889,216.10
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		-	7,912,024.76
应收利息	6.4.7.5	4,686,089.64	3,154,664.67
应收股利		1,203,934.35	-
应收申购款		226,726.11	110,860.90
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		913,461,151.20	798,977,169.38
负债和所有者权益	附注号	本期末 2013 年 6 月 30 日	上年度末 2012 年 12 月 31 日

负 债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		-	-
应付赎回款		631,415.71	555,281.47
应付管理人报酬		917,140.40	821,270.47
应付托管费		176,373.15	157,936.60
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	1,456,559.08	628,305.03
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	6.4.7.8	602,875.21	707,750.66
负债合计		3,822,623.55	2,908,804.23
所有者权益：			
实收基金	6.4.7.9	712,809,375.97	618,126,842.86
未分配利润	6.4.7.10	196,829,151.68	177,941,522.29
所有者权益合计		909,638,527.65	796,068,365.15
负债和所有者权益总计		913,461,151.20	798,977,169.38

注：报告截止日 2013 年 6 月 30 日，基金份额净值 1.2761 元，基金份额总额 712,809,375.97 份。

6.2 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：2013 年 1 月 1 日至 2013 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2013 年 1 月 1 日至 2013 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2012 年 1 月 1 日至 2012 年 6 月 30 日
一、收入		8,580,908.19	65,775,278.91
1.利息收入		4,011,912.46	3,988,869.32
其中：存款利息收入	6.4.7.11	359,957.72	207,738.50
债券利息收入		3,596,214.19	3,713,040.22
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		55,740.55	68,090.60
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		-2,315,553.81	-42,320,164.54
其中：股票投资收益	6.4.7.12	-8,938,388.16	-48,381,775.26
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.13	1,202,582.67	32,967.60
资产支持证券投资收益		-	-

衍生工具收益	6.4.7.14	-	-
股利收益	6.4.7.15	5,420,251.68	6,028,643.12
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.16	6,756,823.57	103,800,501.95
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	127,725.97	306,072.18
减：二、费用		7,964,422.47	7,587,341.51
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	5,423,566.97	5,435,413.31
2. 托管费	6.4.10.2.2	1,042,993.67	1,045,271.76
3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用	6.4.7.18	1,386,069.96	994,018.45
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 其他费用	6.4.7.19	111,791.87	112,637.99
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		616,485.72	58,187,937.40
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		616,485.72	58,187,937.40

6.3 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：2013 年 1 月 1 日 至 2013 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2013 年 1 月 1 日至 2013 年 6 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	618,126,842.86	177,941,522.29	796,068,365.15
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	616,485.72	616,485.72
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	94,682,533.11	24,409,984.91	119,092,518.02
其中：1.基金申购款	159,810,028.17	45,828,732.36	205,638,760.53
2. 基金赎回款	-65,127,495.06	-21,418,747.45	-86,546,242.51
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基	-	-6,138,841.24	-6,138,841.24

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）	712,809,375.97	196,829,151.68	909,638,527.65
项目	上年度可比期间 2012 年 1 月 1 日至 2012 年 6 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	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）	-	58,187,937.40	58,187,937.40
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）	-85,502,182.57	-22,631,205.84	-108,133,388.41
其中：1.基金申购款	20,001,575.49	4,440,302.71	24,441,878.20
2.基金赎回款	-105,503,758.06	-27,071,508.55	-132,575,266.61
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）	644,911,408.88	155,412,970.63	800,324,379.51

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>黄小慧</u>	<u>向辉</u>	<u>张幸骏</u>
基金管理人负责人	主管会计工作负责人	会计机构负责人

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

华宝兴业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 8 月 24 日批准报出。

6.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于 2006 年 2 月 15 日颁布的《企业会计准则—基本准则》和 38 项具体会计准则、其后颁布的企业会计准则应用指南、企业会计准则解释以及其他相关规定(以下合称“企业会计准则”)、中国证监会颁布的《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》和中国证监会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2013 半年度财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金 2013 年 6 月 30 日的财务状况以及 2013 年上半年度的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

6.4.4 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

本基金本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

6.4.5 差错更正的说明

本基金本报告期无重大会计差错。

6.4.6 税项

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

(1) 以发行基金方式募集资金不属于营业税征收范围，不征收营业税。

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

(3) 对基金取得的企业债券利息收入，由发行债券的企业在向基金支付利息时代扣代缴 20% 的个人所得税。对基金取得的股票的股息、红利收入按财政部、国家税务总局、中国证监会于 2012 年 11 月 16 日联合发布财税[2012]85 号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》（以下简称“通知”），要求个人从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，持股期限在 1 个月以内（含 1 个月）的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在 1 个月以上至 1 年（含 1 年）的，暂减按 50% 计入应纳税所得额；持股期限超过 1 年的，暂减按 25% 计入应纳税所得额。上述所得统一适用 20% 的税率计征个人所得税。证券投资基金从上市公司取得的股息红利所得，按照本通知的规定计征个人所得税。通知自 2013 年 1 月 1 日起施行。

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

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2013 年 6 月 30 日
活期存款	71,407,131.25
定期存款	—
其中：存款期限 1-3 个月	—
其他存款	—
合计：	71,407,131.25

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末 2013 年 6 月 30 日		
		成本	公允价值	公允价值变动
股票		624,520,672.99	609,599,165.95	-14,921,507.04
债券	交易所市场	16,615,169.76	16,472,414.60	-142,755.16
	银行间市场	214,458,530.00	209,123,000.00	-5,335,530.00
	合计	231,073,699.76	225,595,414.60	-5,478,285.16
资产支持证券		-	-	-
基金		-	-	-
其他		-	-	-
合计		855,594,372.75	835,194,580.55	-20,399,792.20

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 2013 年 6 月 30 日
应收活期存款利息	17,276.94
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	243.20
应收债券利息	4,666,478.38
应收买入返售证券利息	-
应收申购款利息	2,000.12
其他	91.00
合计	4,686,089.64

6.4.7.6 其他资产

本基金本报告期末未持有其他资产。

6.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2013 年 6 月 30 日
交易所市场应付交易费用	1,455,543.58
银行间市场应付交易费用	1,015.50
合计	1,456,559.08

6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2013 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	500,000.00
应付赎回费	1,443.34
预提费用	101,431.87
合计	602,875.21

6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2013 年 1 月 1 日至 2013 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	618,126,842.86	618,126,842.86
本期申购	159,810,028.17	159,810,028.17
本期赎回(以“-”号填列)	-65,127,495.06	-65,127,495.06
本期末	712,809,375.97	712,809,375.97

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	325,264,156.64	-147,322,634.35	177,941,522.29
本期利润	-6,140,337.85	6,756,823.57	616,485.72
本期基金份额交易产生的变动数	47,512,120.38	-23,102,135.47	24,409,984.91
其中：基金申购款	79,878,940.65	-34,050,208.29	45,828,732.36

基金赎回款	-32,366,820.27	10,948,072.82	-21,418,747.45
本期已分配利润	-6,138,841.24	-	-6,138,841.24
本期末	360,497,097.93	-163,667,946.25	196,829,151.68

6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2013 年 1 月 1 日至 2013 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	352,095.74
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	4,753.83
其他	3,108.15
合计	359,957.72

6.4.7.12 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2013 年 1 月 1 日至 2013 年 6 月 30 日
卖出股票成交总额	446,028,071.12
减：卖出股票成本总额	454,966,459.28
买卖股票差价收入	-8,938,388.16

6.4.7.13 债券投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2013 年 1 月 1 日至 2013 年 6 月 30 日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	104,382,490.00
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	100,104,600.00
减：应收利息总额	3,075,307.33
债券投资收益	1,202,582.67

6.4.7.14 衍生工具收益

本基金本报告期内无衍生工具收益。

6.4.7.15 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2013 年 1 月 1 日至 2013 年 6 月 30 日
股票投资产生的股利收益	5,420,251.68
基金投资产生的股利收益	-
合计	5,420,251.68

6.4.7.16 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2013 年 1 月 1 日至 2013 年 6 月 30 日
1. 交易性金融资产	6,756,823.57
——股票投资	8,924,252.67
——债券投资	-2,167,429.10
——资产支持证券投资	-
2. 衍生工具	-
——权证投资	-
3. 其他	-
合计	6,756,823.57

6.4.7.17 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2013 年 1 月 1 日至 2013 年 6 月 30 日
基金赎回费收入	96,450.28
转换费收入	31,275.69
合计	127,725.97

注：1. 本基金的赎回费率按持有期间递减，赎回费总额的 25%归入基金资产。

2. 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。

6.4.7.18 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2013 年 1 月 1 日至 2013 年 6 月 30 日
交易所市场交易费用	1,384,969.96
银行间市场交易费用	1,100.00

合计	1,386,069.96
----	--------------

6.4.7.19 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2013 年 1 月 1 日至 2013 年 6 月 30 日
审计费用	49,588.57
信息披露费	51,843.30
债券帐户维护费	9,000.00
银行费用	1,360.00
合计	111,791.87

6.4.7.20 分部报告

无。

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金并无须作披露的或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至本财务报表批准报出日，本基金无其它需作披露的资产负债表日后事项。

6.4.9 关联方关系

6.4.9.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

本报告期内存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

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

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

本基金本期及上年度可比期间无通过关联方交易单元进行的交易。

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 2013 年 1 月 1 日至 2013 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2012 年 1 月 1 日至 2012 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	5,423,566.97	5,435,413.31
其中：支付销售机构的客户维护费	87,123.37	91,873.18

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 1.3%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 × 1.3% / 当年天数。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2013 年 1 月 1 日至 2013 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2012 年 1 月 1 日至 2012 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	1,042,993.67	1,045,271.76

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。

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

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

6.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

份额单位：份

项目	本期 2013 年 1 月 1 日至 2013 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2012 年 1 月 1 日至 2012 年 6 月 30 日
期初持有的基金份额	843,407.93	843,407.93
期间申购/买入总份额	6,423.51	-
期间因拆分变动份额	-	-
减：期间赎回/卖出总份额	376,996.22	-
期末持有的基金份额	472,835.22	843,407.93
期末持有的基金份额 占基金总份额比例	0.07%	0.13%

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。期间申购/买入总份额中包含红利再投资份额。

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

本报告期末及上年度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 2013 年 1 月 1 日至 2013 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2012 年 1 月 1 日至 2012 年 6 月 30 日	
	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 股份有限 公司	71,407,131.25	352,095.74	56,818,661.32	203,278.70

注：本基金的银行存款由基金托管人中国建设银行保管，按银行同业利率计息。

6.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本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。

6.4.10.7 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期及上年度可比期间无须作说明的其他关联交易事项。

6.4.11 利润分配情况

金额单位：人民币元

序号	权益 登记日	除息日	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	本期利润分 配 合计	备注
1	2013 年 1 月 18 日	2013 年 1 月 18 日	0.1000	2,614,032.22	3,524,809.02	6,138,841.24	
合计	-	-	0.1000	2,614,032.22	3,524,809.02	6,138,841.24	

6.4.12 期末（2013 年 6 月 30 日）本基金持有的流通受限证券

6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

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

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
601989	中国 重工	2013 年 5 月 17 日	重大 事项 停牌	4.52	-	-	324,179	1,866,816.99	1,465,289.08	-
600598	北大 荒	2013 年 5 月 27 日	重大 事项 停牌	8.35	2013 年 7 月 19 日	8.35	48,401	493,360.17	404,148.35	-
601918	国投 新集	2013 年 5 月 16 日	重大 事项 停牌	7.55	-	-	37,558	441,614.06	283,562.90	-
600547	山东 黄金	2013 年 4 月 3 日	重大 事项 停牌	24.30	2013 年 7 月 1 日	28.77	49,712	2,098,889.89	1,208,001.60	-
000999	华润 三九	2013 年 6 月 3 日	重大 事项 停牌	26.55	2013 年 8 月 19 日	26.51	27,692	735,082.33	735,222.60	-
300133	华策 影视	2013 年 5 月 28 日	重大 事项 停牌	23.88	2013 年 7 月 30 日	26.87	25,000	548,464.50	597,000.00	-

注：本基金截至 2013 年 6 月 30 日止持有以上因公布的重大事项可能产生重大影响而被暂时停牌的股票，该类股票将在所公布事项的重大影响消除后，经交易所批准复牌。

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

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

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

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

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金是一只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。

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，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与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，违约风险发生的可能性很小；在银行间同业市场进行交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式进行限制以控制相应的信用风险。

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

于 2013 年 6 月 30 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(2012 年 12 月 31 日：同)。

6.4.13.3 流动性风险

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

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

针对投资品种变现的流动性风险，本基金的基金管理人通过独立的风险管理部门设定流动性比例要求，对流动性指标进行持续的监测和分析，包括组合持仓集中度指标、组合在短时间内变

现能力的综合指标、组合中变现能力较差的投资品种比例以及流通受限制的投资品种比例等。本基金投资于一家公司发行的股票市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金的基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司的证券不得超过该证券的 10%。本基金所持大部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易，因此除附注 6.4.12 中列示的部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况外，其余均能以合理价格适时变现。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值。

于 2013 年 6 月 30 日，本基金所持有的全部金融负债的合同约定到期日均为一个月以内且不计息，可赎回基金份额净值(所有者权益)无固定到期日且不计息，因此账面余额即为未折现的合约到期现金流量。

6.4.13.4 市场风险

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动而发生波动的风险，包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

6.4.13.4.1 利率风险

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

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

本基金持有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。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2013 年 6 月 30 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	71,407,131.25	-	-	-	71,407,131.25

结算备付金	540,558.59	-	-	-	540,558.59
存出保证金	202,130.71	-	-	-	202,130.71
交易性金融资产	215,859,257.00	-9,736,157.60	609,599,165.95	835,194,580.55	
应收利息	-	-	4,686,089.64	4,686,089.64	
应收股利	-	-	1,203,934.35	1,203,934.35	
应收申购款	1,491.05	-	225,235.06	226,726.11	
资产总计	288,010,568.60	-9,736,157.60	615,714,425.00	913,461,151.20	
负债					
应付赎回款	-	-	631,415.71	631,415.71	
应付管理人报酬	-	-	917,140.40	917,140.40	
应付托管费	-	-	176,373.15	176,373.15	
应付交易费用	-	-	1,456,559.08	1,456,559.08	
应交税费	-	-	38,260.00	38,260.00	
其他负债	-	-	602,875.21	602,875.21	
负债总计	-	-	3,822,623.55	3,822,623.55	
利率敏感度缺口	288,010,568.60	-9,736,157.60	611,891,801.45	909,638,527.65	
上年度末 2012 年 12 月 31 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	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	
其他资产	-	-	-	-	-
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	

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

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	除市场利率以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的 影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（ 2013 年 6 月 30 日 ）	上年度末（ 2012 年 12 月 31 日 ）
	市场利率上升 25%	-346, 533. 97	-270, 570. 22
	市场利率下降 25%	350, 276. 28	272, 713. 63

6.4.13.4.2 外汇风险

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

6.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场交易的股票和债券，所面临的其他价格风险来源于单个证券发行主体自身经营情况或特殊事项的影响，也可能来源于证券市场整体波动的影响。

本基金的基金管理人在构建和管理投资组合的过程中，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。

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2013 年 6 月 30 日		上年度末 2012 年 12 月 31 日	
	公允价值	占基金资产净值比例（%）	公允价值	占基金资产净值比

				例 (%)
交易性金融资产-股票投资	609,599,165.95	67.02	586,262,347.41	73.64
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	609,599,165.95	67.02	586,262,347.41	73.64

6.4.13.4.3.2 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（2013 年 6 月 30 日）	上年度末（2012 年 12 月 31 日）
	70%×上证 180 和深证 100 复合指数+30%×中信全债指数上升 5%	58,689,877.80	40,436,292.61
	70%×上证 180 和深证 100 复合指数+30%×中信全债指数下降 5%	-58,689,877.80	-40,436,292.61

6.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

(1) 公允价值

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

(b) 以公允价值计量的金融工具

(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 2013 年 6 月 30 日，本基金持有的以公允价值计量的金融工具中属于第一层级的余额为 621,378,356.02 元，属于第二层级的余额为 213,816,224.53 元，无属于第三层级的余额(2012

年 12 月 31 日：第一层级 577,853,667.93 元，第二层级 183,297,895.58，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。

§ 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	609,599,165.95	66.74
	其中：股票	609,599,165.95	66.74
2	固定收益投资	225,595,414.60	24.70
	其中：债券	225,595,414.60	24.70
	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	71,947,689.84	7.88
6	其他各项资产	6,318,880.81	0.69
7	合计	913,461,151.20	100.00

7.2 期末按行业分类的股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	2,605,818.80	0.29
B	采矿业	44,624,976.75	4.91
C	制造业	238,602,483.25	26.23

D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	13,029,769.25	1.43
E	建筑业	17,978,073.89	1.98
F	批发和零售业	11,055,814.74	1.22
G	交通运输、仓储和邮政业	10,589,576.28	1.16
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	20,068,624.70	2.21
J	金融业	149,335,720.17	16.42
K	房地产业	27,260,163.89	3.00
L	租赁和商务服务业	6,961,859.02	0.77
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	59,809,463.53	6.58
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	1,713,275.28	0.19
S	综合	5,963,546.40	0.66
	合计	609,599,165.95	67.02

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	300070	碧水源	1,511,006	56,934,706.08	6.26
2	300090	盛运股份	671,478	20,735,240.64	2.28
3	600016	民生银行	2,329,584	19,964,534.88	2.19
4	600036	招商银行	1,467,143	17,018,858.80	1.87
5	002503	搜于特	1,277,310	14,523,014.70	1.60
6	300263	隆华节能	834,409	13,709,339.87	1.51
7	601318	中国平安	348,976	12,130,405.76	1.33
8	002358	森源电气	902,207	11,918,154.47	1.31
9	601166	兴业银行	793,370	11,718,074.90	1.29
10	300157	恒泰艾普	314,743	10,883,812.94	1.20
11	000002	万科A	1,013,289	9,980,896.65	1.10
12	600000	浦发银行	1,155,665	9,568,906.20	1.05

13	300315	掌趣科技	288,418	9,512,025.64	1.05
14	002303	美盈森	341,063	8,444,719.88	0.93
15	600519	贵州茅台	43,462	8,360,784.94	0.92
16	601328	交通银行	2,042,572	8,313,268.04	0.91
17	600837	海通证券	825,478	7,742,983.64	0.85
18	600030	中信证券	706,141	7,153,208.33	0.79
19	601398	工商银行	1,646,045	6,617,100.90	0.73
20	601288	农业银行	2,628,214	6,465,406.44	0.71
21	000651	格力电器	248,305	6,222,523.30	0.68
22	601088	中国神华	347,832	5,892,274.08	0.65
23	601668	中国建筑	1,576,623	5,155,557.21	0.57
24	600887	伊利股份	148,900	4,657,592.00	0.51
25	600104	上汽集团	347,928	4,596,128.88	0.51
26	600048	保利地产	447,447	4,434,199.77	0.49
27	601169	北京银行	547,146	4,360,753.62	0.48
28	300058	蓝色光标	100,000	4,170,000.00	0.46
29	000858	五粮液	199,476	3,997,499.04	0.44
30	600256	广汇能源	302,976	3,926,568.96	0.43
31	000001	平安银行	375,934	3,748,061.98	0.41
32	601006	大秦铁路	629,273	3,737,881.62	0.41
33	600900	长江电力	517,909	3,583,930.28	0.39
34	601818	光大银行	1,237,066	3,575,120.74	0.39
35	000776	广发证券	307,342	3,405,349.36	0.37
36	600015	华夏银行	353,246	3,186,278.92	0.35
37	600111	包钢稀土	152,434	3,181,297.58	0.35
38	600383	金地集团	462,586	3,173,339.96	0.35
39	600518	康美药业	162,121	3,117,586.83	0.34
40	002690	美亚光电	124,570	2,993,417.10	0.33
41	000538	云南白药	35,562	2,987,563.62	0.33
42	601857	中国石油	371,417	2,826,483.37	0.31
43	600585	海螺水泥	210,953	2,822,551.14	0.31
44	600050	中国联通	887,804	2,769,948.48	0.30
45	000063	中兴通讯	204,464	2,606,916.00	0.29
46	000157	中联重科	462,851	2,513,280.93	0.28
47	600999	招商证券	236,836	2,463,094.40	0.27
48	000527	美的电器	197,286	2,450,292.12	0.27
49	600011	华能国际	452,014	2,413,754.76	0.27
50	600031	三一重工	318,894	2,394,893.94	0.26
51	002024	苏宁云商	469,421	2,351,799.21	0.26

52	600028	中国石化	548,753	2,293,787.54	0.25
53	600089	特变电工	278,320	2,240,476.00	0.25
54	600535	天士力	56,828	2,224,816.20	0.24
55	000895	双汇发展	57,176	2,197,845.44	0.24
56	601628	中国人寿	156,730	2,145,633.70	0.24
57	000423	东阿阿胶	54,788	2,119,199.84	0.23
58	002241	歌尔声学	57,646	2,091,973.34	0.23
59	600795	国电电力	887,650	2,023,842.00	0.22
60	000100	TCL 集团	883,413	2,005,347.51	0.22
61	601899	紫金矿业	836,413	1,990,662.94	0.22
62	000069	华侨城 A	382,239	1,976,175.63	0.22
63	601117	中国化学	203,088	1,933,397.76	0.21
64	600315	上海家化	42,609	1,916,978.91	0.21
65	601988	中国银行	707,309	1,916,807.39	0.21
66	002236	大华股份	49,900	1,907,677.00	0.21
67	600739	辽宁成大	144,288	1,893,058.56	0.21
68	601688	华泰证券	234,240	1,887,974.40	0.21
69	600406	国电南瑞	126,091	1,882,538.63	0.21
70	601009	南京银行	220,593	1,859,598.99	0.20
71	600690	青岛海尔	169,484	1,849,070.44	0.20
72	002304	洋河股份	33,992	1,845,765.60	0.20
73	000625	长安汽车	197,625	1,835,936.25	0.20
74	600309	万华化学	114,434	1,833,232.68	0.20
75	600276	恒瑞医药	68,776	1,812,935.36	0.20
76	000024	招商地产	74,321	1,804,513.88	0.20
77	000568	泸州老窖	73,283	1,742,669.74	0.19
78	601901	方正证券	309,655	1,712,392.15	0.19
79	601299	中国北车	433,789	1,631,046.64	0.18
80	600637	百视通	56,700	1,587,600.00	0.17
81	002038	双鹭药业	26,867	1,574,406.20	0.17
82	002353	杰瑞股份	22,551	1,556,019.00	0.17
83	002415	海康威视	42,417	1,499,016.78	0.16
84	600703	三安光电	76,278	1,498,099.92	0.16
85	000338	潍柴动力	86,140	1,494,529.00	0.16
86	600066	宇通客车	80,525	1,476,023.25	0.16
87	601989	中国重工	324,179	1,465,289.08	0.16
88	600085	同仁堂	66,743	1,460,336.84	0.16
89	601788	光大证券	142,680	1,455,336.00	0.16
90	601377	兴业证券	160,002	1,452,818.16	0.16

91	600489	中金黄金	155,851	1,447,855.79	0.16
92	600804	鹏博士	135,449	1,434,404.91	0.16
93	601633	长城汽车	40,404	1,431,109.68	0.16
94	000581	威孚高科	42,107	1,405,952.73	0.15
95	000725	京东方A	625,659	1,388,962.98	0.15
96	600362	江西铜业	87,922	1,383,892.28	0.15
97	000783	长江证券	173,828	1,374,979.48	0.15
98	002475	立讯精密	65,304	1,371,384.00	0.15
99	601186	中国铁建	325,405	1,366,701.00	0.15
100	600600	青岛啤酒	35,940	1,365,001.20	0.15
101	000983	西山煤电	166,760	1,360,761.60	0.15
102	601766	中国南车	375,816	1,352,937.60	0.15
103	002375	亚厦股份	43,905	1,352,274.00	0.15
104	002422	科伦药业	25,259	1,346,557.29	0.15
105	600583	海油工程	207,858	1,344,841.26	0.15
106	601390	中国中铁	531,559	1,297,003.96	0.14
107	000402	金融街	256,207	1,283,597.07	0.14
108	000009	中国宝安	116,360	1,279,960.00	0.14
109	600010	包钢股份	311,169	1,275,792.90	0.14
110	600196	复星医药	121,021	1,268,300.08	0.14
111	000012	南玻A	135,467	1,255,779.09	0.14
112	600252	中恒集团	89,735	1,245,521.80	0.14
113	000768	中航飞机	137,943	1,227,692.70	0.13
114	600340	华夏幸福	37,400	1,216,996.00	0.13
115	600547	山东黄金	49,712	1,208,001.60	0.13
116	600009	上海机场	100,144	1,193,716.48	0.13
117	002081	金螳螂	41,685	1,186,771.95	0.13
118	600649	城投控股	170,199	1,177,777.08	0.13
119	600348	阳泉煤业	127,291	1,150,710.64	0.13
120	600642	申能股份	297,731	1,131,377.80	0.12
121	000792	盐湖股份	66,371	1,124,324.74	0.12
122	601699	潞安环能	93,359	1,116,573.64	0.12
123	601111	中国国航	262,194	1,111,702.56	0.12
124	601669	中国水电	384,010	1,105,948.80	0.12
125	000623	吉林敖东	75,223	1,096,751.34	0.12
126	002146	荣盛发展	77,411	1,092,269.21	0.12
127	600674	川投能源	106,163	1,079,677.71	0.12
128	601607	上海医药	101,180	1,075,543.40	0.12
129	000629	攀钢钒钛	457,526	1,075,186.10	0.12

130	300273	和佳股份	50,000	1,071,000.00	0.12
131	601168	西部矿业	197,966	1,070,996.06	0.12
132	600660	福耀玻璃	146,850	1,055,851.50	0.12
133	600029	南方航空	372,961	1,051,750.02	0.12
134	000800	一汽轿车	83,534	1,027,468.20	0.11
135	600352	浙江龙盛	108,549	1,018,189.62	0.11
136	002142	宁波银行	119,689	1,013,765.83	0.11
137	000425	徐工机械	128,726	1,010,499.10	0.11
138	601998	中信银行	272,220	1,009,936.20	0.11
139	000060	中金岭南	150,704	997,660.48	0.11
140	000970	中科三环	74,620	973,044.80	0.11
141	002570	贝因美	34,554	965,784.30	0.11
142	002594	比亚迪	32,262	964,956.42	0.11
143	600005	武钢股份	428,171	959,103.04	0.11
144	600369	西南证券	124,382	954,009.94	0.10
145	600108	亚盛集团	146,180	953,093.60	0.10
146	000562	宏源证券	108,126	950,427.54	0.10
147	600694	大商股份	32,741	947,197.13	0.10
148	600143	金发科技	194,972	941,714.76	0.10
149	600150	中国船舶	57,986	937,633.62	0.10
150	600100	同方股份	136,638	937,336.68	0.10
151	601600	中国铝业	294,871	928,843.65	0.10
152	601898	中煤能源	189,060	924,503.40	0.10
153	600123	兰花科创	72,391	915,746.15	0.10
154	600893	航空动力	55,452	913,848.96	0.10
155	600832	东方明珠	163,082	898,581.82	0.10
156	601808	中海油服	63,522	895,024.98	0.10
157	002202	金风科技	164,438	886,320.82	0.10
158	600153	建发股份	140,188	881,782.52	0.10
159	600068	葛洲坝	220,627	869,270.38	0.10
160	000728	国元证券	102,679	868,664.34	0.10
161	002310	东方园林	22,284	853,254.36	0.09
162	300088	长信科技	40,000	843,600.00	0.09
163	600177	雅戈尔	137,671	841,169.81	0.09
164	600741	华域汽车	106,795	833,001.00	0.09
165	000709	河北钢铁	445,687	824,520.95	0.09
166	600208	新潮中宝	266,524	823,559.16	0.09
167	000630	铜陵有色	75,152	810,138.56	0.09
168	601888	中国国旅	27,640	807,088.00	0.09

169	000039	中集集团	77,332	798,839.56	0.09
170	601018	宁波港	393,937	795,752.74	0.09
171	600655	豫园商城	122,197	795,502.47	0.09
172	601958	金钼股份	99,817	791,548.81	0.09
173	600271	航天信息	59,203	782,663.66	0.09
174	601618	中国中冶	485,371	781,447.31	0.09
175	000729	燕京啤酒	135,876	775,851.96	0.09
176	600549	厦门钨业	28,622	764,207.40	0.08
177	600881	亚泰集团	194,400	756,216.00	0.08
178	600166	福田汽车	148,062	755,116.20	0.08
179	600062	华润双鹤	37,305	746,846.10	0.08
180	600497	驰宏锌锗	76,346	744,373.50	0.08
181	600718	东软集团	91,028	740,967.92	0.08
182	002007	华兰生物	32,706	738,501.48	0.08
183	600415	小商品城	145,868	738,092.08	0.08
184	600875	东方电气	71,508	737,962.56	0.08
185	000999	华润三九	27,692	735,222.60	0.08
186	600498	烽火通信	44,600	735,008.00	0.08
187	002385	大北农	70,811	730,769.52	0.08
188	000878	云南铜业	75,093	728,402.10	0.08
189	000046	泛海建设	147,068	717,691.84	0.08
190	600886	国投电力	210,660	712,030.80	0.08
191	000061	农产品	118,040	709,420.40	0.08
192	600839	四川长虹	394,910	706,888.90	0.08
193	600118	中国卫星	49,798	706,135.64	0.08
194	600316	洪都航空	45,144	704,246.40	0.08
195	600811	东方集团	142,228	701,184.04	0.08
196	601333	广深铁路	300,476	691,094.80	0.08
197	002106	莱宝高科	44,763	687,112.05	0.08
198	600267	海正药业	52,919	673,129.68	0.07
199	600809	山西汾酒	27,060	662,970.00	0.07
200	000937	冀中能源	73,602	649,905.66	0.07
201	601666	平煤股份	124,575	647,790.00	0.07
202	601992	金隅股份	129,425	647,125.00	0.07
203	002405	四维图新	45,978	642,772.44	0.07
204	601928	凤凰传媒	75,888	638,218.08	0.07
205	000839	中信国安	98,638	636,215.10	0.07
206	600372	中航电子	30,251	633,758.45	0.07
207	600516	方大炭素	77,765	629,896.50	0.07

208	000825	太钢不锈	240,985	619,331.45	0.07
209	600115	东方航空	241,852	619,141.12	0.07
210	600664	哈药股份	103,055	612,146.70	0.07
211	300133	华策影视	25,000	597,000.00	0.07
212	000960	锡业股份	48,802	595,384.40	0.07
213	002500	山西证券	99,844	591,076.48	0.06
214	000758	中色股份	58,083	588,380.79	0.06
215	600219	南山铝业	125,414	588,191.66	0.06
216	000750	国海证券	56,600	584,112.00	0.06
217	600216	浙江医药	28,364	582,029.28	0.06
218	600027	华电国际	183,800	578,970.00	0.06
219	600188	兖州煤业	61,218	575,449.20	0.06
220	600376	首开股份	103,570	574,813.50	0.06
221	002001	新 和 成	38,281	564,261.94	0.06
222	000528	柳 工	84,136	546,884.00	0.06
223	000898	*ST 鞍钢	208,279	545,690.98	0.06
224	002155	辰州矿业	67,648	543,889.92	0.06
225	600827	友谊股份	78,744	540,971.28	0.06
226	002344	海宁皮城	28,114	537,258.54	0.06
227	601179	中国西电	175,283	536,365.98	0.06
228	601717	郑煤机	85,431	533,943.75	0.06
229	601106	中国一重	260,502	526,214.04	0.06
230	000876	新 希 望	53,261	524,620.85	0.06
231	002073	软控股份	62,081	520,859.59	0.06
232	000422	湖北宜化	76,760	518,130.00	0.06
233	000718	苏宁环球	86,808	510,431.04	0.06
234	600125	铁龙物流	95,593	506,642.90	0.06
235	601158	重庆水务	98,371	506,610.65	0.06
236	002092	中泰化学	99,593	505,932.44	0.06
237	000869	张 裕 A	14,658	500,424.12	0.06
238	000778	新兴铸管	101,888	500,270.08	0.05
239	601118	海南橡胶	120,114	497,271.96	0.05
240	600259	广晟有色	13,303	489,151.31	0.05
241	000686	东北证券	30,053	488,060.72	0.05
242	600170	上海建工	70,807	484,319.88	0.05
243	600058	五矿发展	44,186	481,627.40	0.05
244	600395	盘江股份	52,534	480,686.10	0.05
245	601098	中南传媒	51,404	478,057.20	0.05
246	000401	冀东水泥	57,457	472,296.54	0.05

247	600109	国金证券	40,981	471,281.50	0.05
248	600160	巨化股份	80,732	470,667.56	0.05
249	600266	北京城建	45,951	470,078.73	0.05
250	601800	中国交建	116,000	469,800.00	0.05
251	600588	用友软件	52,369	468,178.86	0.05
252	600132	重庆啤酒	30,734	461,932.02	0.05
253	601933	永辉超市	39,204	457,510.68	0.05
254	600863	内蒙华电	79,913	451,508.45	0.05
255	600895	张江高科	84,632	448,549.60	0.05
256	000559	万向钱潮	84,629	444,302.25	0.05
257	601866	中海集运	231,003	443,525.76	0.05
258	600221	海南航空	217,014	438,368.28	0.05
259	601099	太平洋	87,082	437,151.64	0.05
260	600770	综艺股份	73,982	436,493.80	0.05
261	000969	安泰科技	55,993	434,505.68	0.05
262	000933	神火股份	96,300	429,498.00	0.05
263	601555	东吴证券	60,928	417,356.80	0.05
264	600970	中材国际	45,050	414,460.00	0.05
265	600779	水井坊	35,793	410,187.78	0.05
266	601001	大同煤业	71,394	409,087.62	0.04
267	600598	北大荒	48,401	404,148.35	0.04
268	002299	圣农发展	44,506	402,334.24	0.04
269	600169	太原重工	172,416	401,729.28	0.04
270	600037	歌华有线	65,012	393,972.72	0.04
271	600971	恒源煤电	51,157	393,908.90	0.04
272	600157	永泰能源	67,300	393,705.00	0.04
273	600997	开滦股份	67,357	383,934.90	0.04
274	601101	昊华能源	48,009	380,711.37	0.04
275	600859	王府井	23,428	377,425.08	0.04
276	000961	中南建设	38,570	377,214.60	0.04
277	600528	中铁二局	77,251	373,894.84	0.04
278	002431	棕榈园林	19,579	371,217.84	0.04
279	600550	天威保变	67,833	370,368.18	0.04
280	600331	宏达股份	89,591	362,843.55	0.04
281	600432	吉恩镍业	40,838	355,698.98	0.04
282	002069	獐子岛	29,449	348,970.65	0.04
283	000807	云铝股份	93,532	347,939.04	0.04
284	601369	陕鼓动力	51,228	345,789.00	0.04
285	002128	露天煤业	38,830	339,374.20	0.04

286	600096	云天化	42,016	335,707.84	0.04
287	601558	华锐风电	87,362	332,849.22	0.04
288	000703	恒逸石化	37,862	325,991.82	0.04
289	600873	梅花集团	82,001	325,543.97	0.04
290	600022	山东钢铁	199,188	316,708.92	0.03
291	600582	天地科技	48,800	313,296.00	0.03
292	002673	西部证券	27,000	312,930.00	0.03
293	600783	鲁信创投	23,228	308,467.84	0.03
294	601216	内蒙君正	40,882	306,615.00	0.03
295	002399	海普瑞	17,010	302,778.00	0.03
296	601258	庞大集团	50,783	300,127.53	0.03
297	600508	上海能源	30,798	299,356.56	0.03
298	601918	国投新集	37,558	283,562.90	0.03
299	000059	辽通化工	61,817	280,031.01	0.03
300	600456	宝钛股份	21,817	255,913.41	0.03
301	002603	以岭药业	11,216	255,276.16	0.03
302	600546	山煤国际	21,291	252,085.44	0.03
303	000596	古井贡酒	12,069	252,000.72	0.03
304	002122	天马股份	65,205	232,781.85	0.03
305	000780	平庄能源	40,386	216,872.82	0.02
306	000968	煤气化	26,874	195,642.72	0.02
307	601238	广汽集团	25,800	189,888.00	0.02
308	002378	章源钨业	8,751	163,206.15	0.02
309	601233	桐昆股份	31,900	161,414.00	0.02
310	000883	湖北能源	23,100	111,573.00	0.01

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例（%）
1	600016	民生银行	17,166,035.53	2.16
2	600036	招商银行	15,448,609.44	1.94
3	300263	隆华节能	10,420,446.40	1.31
4	601318	中国平安	10,382,884.53	1.30
5	601166	兴业银行	9,917,598.35	1.25
6	000002	万科A	8,519,823.20	1.07

7	600000	浦发银行	8,445,052.85	1.06
8	300090	盛运股份	7,051,076.76	0.89
9	601328	交通银行	6,955,281.43	0.87
10	300157	恒泰艾普	6,890,546.45	0.87
11	600837	海通证券	6,825,044.08	0.86
12	600030	中信证券	6,608,855.84	0.83
13	002303	美盈森	6,235,903.78	0.78
14	600519	贵州茅台	5,905,174.17	0.74
15	300315	掌趣科技	5,731,763.86	0.72
16	000651	格力电器	5,642,200.55	0.71
17	600104	上汽集团	5,463,381.31	0.69
18	601288	农业银行	5,375,550.00	0.68
19	601088	中国神华	5,294,941.61	0.67
20	002690	美亚光电	5,062,907.30	0.64

注：买入金额不包括相关交易费用。

7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例（%）
1	300257	开山股份	17,668,206.49	2.22
2	300124	汇川技术	15,708,648.64	1.97
3	600016	民生银行	14,537,465.43	1.83
4	600036	招商银行	11,816,161.12	1.48
5	601318	中国平安	9,467,263.46	1.19
6	601166	兴业银行	8,698,788.43	1.09
7	002358	森源电气	8,220,872.68	1.03
8	000002	万科A	7,911,243.09	0.99
9	600000	浦发银行	7,766,438.81	0.98
10	300005	探路者	7,757,729.36	0.97
11	601328	交通银行	7,673,078.86	0.96
12	300285	国瓷材料	6,877,365.09	0.86
13	600030	中信证券	6,269,910.95	0.79
14	600837	海通证券	6,153,682.87	0.77
15	300157	恒泰艾普	5,631,498.35	0.71
16	002285	世联地产	5,152,817.66	0.65
17	600519	贵州茅台	4,962,895.73	0.62

18	601088	中国神华	4,867,515.53	0.61
19	601288	农业银行	4,624,082.80	0.58
20	300177	中海达	4,451,150.06	0.56

注：卖出金额不包括相关交易费用。

7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	469,379,025.15
卖出股票收入（成交）总额	446,028,071.12

注：买入股票成本、卖出股票收入均不包括相关交易费用。

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	16,472,414.60	1.81
2	央行票据	39,719,000.00	4.37
3	金融债券	169,404,000.00	18.62
	其中：政策性金融债	169,404,000.00	18.62
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	225,595,414.60	24.80

7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名债券投资明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	130201	13 国开 01	700,000	69,615,000.00	7.65
2	080215	08 国开 15	500,000	50,005,000.00	5.50
3	120238	12 国开 38	300,000	29,898,000.00	3.29
4	1301002	13 央行票据 02	300,000	29,730,000.00	3.27
5	130218	13 国开 18	200,000	19,886,000.00	2.19

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7.8 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

7.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

7.9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金未投资股指期货。

7.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金未投资股指期货。

7.10 投资组合报告附注

7.10.1

2013 年 6 月 14 日安徽盛运机械股份有限公司发布公告：2013 年 6 月 9 日，公司高管收到中国证券监督管理委员会上海稽查局下达的《调查通知书》（编号：沪调查通字 2013-2-012 号），通知内容如下：“刘玉斌：因调查需要，根据《中华人民共和国证券法》的有关规定，我会决定对你涉嫌泄露内幕信息立案调查，请予以配合”。

本基金管理人通过对该上市公司进行进一步了解和视为，认为本基金已经持有盛运股份较长时间，主要是基于国家大力发展新兴产业的政策，且盛运股份又是环保行业中垃圾处理领域的龙头公司，基金管理人长期看好环保行业的发展前景及该公司的长期投资价值。根据该公司公告，高管被立案调查是由于个人原因、对公司生产经营没有影响，因此，该事项不影响我们对该公司长期投资价值的判断。

报告期内，本基金投资的前十名证券的其余九名证券的发行主体没有被监管部门立案调查或在本报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情况。

7.10.2

基金投资的前十名股票未超出基金合同规定的备选股票库。

7.10.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	202,130.71
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	1,203,934.35

4	应收利息	4,686,089.64
5	应收申购款	226,726.11
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	6,318,880.81

7.10.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

7.10.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

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
33,007	21,595.70	171,076,411.50	24.00%	541,732,964.47	76.00%

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	持有份额总数（份）	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员 持有本基金	626,838.41	0.0879%

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。

§ 9 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	618,126,842.86
本报告期基金总申购份额	159,810,028.17
减：本报告期基金总赎回份额	65,127,495.06
本报告期基金拆分变动份额	—
本报告期期末基金份额总额	712,809,375.97

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

本报告期内本基金未召开基金份额持有人大会。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

1、基金管理人的重大人事变动

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

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

2、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本报告期内，基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内无涉及基金管理人、基金资产和基金托管业务的诉讼事项。

10.4 基金投资策略的改变

本报告期内本基金的投资策略未发生变更。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

基金管理人为本基金聘任的会计师事务所向本基金提供的审计服务持续期限为：本基金合同生效之日(2003 年 7 月 15 日)起至本报告期末。

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

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

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

截至报告披露日，调查仍在进行中，尚无任何结论。

2、本报告期内，基金管理人的高级管理人员未有受到稽查或处罚的情况。

3、本报告期内，基金托管人及其高级管理人员未有受到稽查或处罚的情况。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
平安证券	1	292,710,023.65	31.98%	266,484.67	32.20%	-
中信建投	1	228,953,559.09	25.02%	205,985.80	24.89%	-
申银万国	1	173,964,233.99	19.01%	158,378.31	19.14%	-
华泰联合	1	134,262,171.41	14.67%	119,074.46	14.39%	-

中银国际	1	85,308,682.19	9.32%	77,665.31	9.38%	-
东方证券	1	-	-	-	-	-
招商证券	1	-	-	-	-	-
国元证券	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：资力雄厚，信誉良好，注册资本不少于 5 亿元人民币；财务状况良好，各项财务指标显示公司经营状况稳定；经营行为规范，最近两年未因重大违规行为受到中国证监会和中国人民银行处罚；内部管理规范、严格，具备健全的内控制度，并能满足基金运作高度保密的要求；具备基金运作所需要的高效、安全的通讯条件，交易设施符合代理本基金进行证券交易的需要，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、报告期内退租券商交易单元 国元证券

10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例
平安证券	13,301,467.60	100.00%	15,000,000.00	100.00%	-	-
中信建投	-	-	-	-	-	-
申银万国	-	-	-	-	-	-
华泰联合	-	-	-	-	-	-
中银国际	-	-	-	-	-	-
东方证券	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-
国元证券	-	-	-	-	-	-

10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	关于 e 网金电子直销平台开通支	基金管理人网站	2013 年 5 月 29 日

	付宝第三方支付业务的公告		
2	华宝兴业基金管理有限公司关于旗下基金持有的股票停牌后估值方法调整的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》以及基金管理人网站	2013 年 5 月 21 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增加代销机构及费率优惠的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》以及基金管理人网站	2013 年 5 月 17 日
4	华宝兴业基金管理有限公司关于部分赎回公司旗下基金持有份额的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》以及基金管理人网站	2013 年 5 月 13 日
5	华宝兴业基金管理有限公司关于旗下部分基金持有的“山东黄金”估值方法调整的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》以及基金管理人网站	2013 年 4 月 27 日
6	华宝兴业基金管理有限公司关于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》、《上海证券报》、《证券时报》以及基金管理人网站	2013 年 4 月 1 日
7	华宝兴业基金管理有限公司关于调降建行卡网上直销基金转换业务优惠费率至四折的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》以及基金管理人网站	2013 年 3 月 22 日
8	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》、《上海证券报》、《证券时报》以及基金管理人网站	2013 年 2 月 5 日

9	华宝兴业宝康灵活配置证券投资基金第十次分红公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》以及基金管理人网站	2013 年 1 月 16 日
---	-------------------------	---------------------------------	-----------------

§ 11 影响投资者决策的其他重要信息

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

据公司了解，该调查通知书所涉及的基金和行为为新兴产业基金于 2011 年 2 月期间的交易行为，该交易行为对该基金投资人利益未造成损失。为配合案件调查，公司已暂停郭鹏飞的基金经理职务，由公司具有基金经理任职资格的其他基金经理代理。

§ 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。

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
2013 年 8 月 24 日