

华宝兴业大盘精选股票型证券投资基金

2009 年半年度报告

2009 年 6 月 30 日

基金管理人：华宝兴业基金管理有限公司

基金托管人：中国银行股份有限公司

报告送出日期：二〇〇九年八月二十八日

1 重要提示及目录

1.1 重要提示

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

基金托管人中国银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2009 年 8 月 25 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 2009 年 1 月 1 日起至 2009 年 6 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.....	9
4.3	管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	9
4.4	管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现说明.....	10
4.5	管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	10
4.6	管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	11
4.7	管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	11
5	托管人报告.....	11
5.1	报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	11
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.....	11
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.....	12
6	半年度财务会计报告（未经审计）.....	12
6.1	资产负债表.....	12
6.2	利润表.....	13
6.3	所有者权益（基金净值）变动表.....	14
6.4	报表附注.....	15
7	投资组合报告.....	25
7.1	期末基金资产组合情况.....	25
7.2	期末按行业分类的股票投资组合.....	26
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.....	27
7.4	报告期内股票投资组合的重大变动.....	29
7.5	期末按债券品种分类的债券投资组合.....	33
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.....	33
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.....	34
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.....	34
7.9	投资组合报告附注.....	34

8	基金份额持有人信息.....	35
8.1	期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	35
8.2	期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金的情况.....	35
9	开放式基金份额变动.....	35
10	重大事件揭示.....	35
10.1	基金份额持有人大会决议.....	35
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.....	36
10.3	涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	36
10.4	基金投资策略的改变.....	36
10.5	报告期内改聘会计师事务所情况.....	36
10.6	管理人、托管人及其高级管理人员受监管部门稽查或处罚的情况.....	36
10.7	基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	36
10.8	其他重大事件.....	37
11	备查文件目录.....	38
11.1	备查文件目录.....	38
11.2	存放地点.....	38
11.3	查阅方式.....	39

2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	华宝兴业大盘精选股票型证券投资基金
基金简称	华宝兴业大盘精选股票
交易代码	240011
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2008年10月7日
报告期末基金份额总额	730,245,634.01份

2.2 基金产品说明

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

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		华宝兴业基金管理有限公司	中国银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	刘月华	宁敏
	联系电话	021-38505888	010-66594977
	电子邮箱	xxpl@fsfund.com	tgxxpl@bank-of-china.com
客户服务电话		400-700-5588、 021-38924558	95566

传真	021-38505777	010-66594942
注册地址	上海浦东世纪大道88号金茂大厦48F	北京西城区复兴门内大街1号
办公地址	上海浦东世纪大道88号金茂大厦48F	北京西城区复兴门内大街1号
邮政编码	200121	100818
法定代表人	郑安国	肖钢

2.4 信息披露方式

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

2.5 其他相关资料

项目	注册登记机构
名称	基金管理人
办公地址	上海市世纪大道88号金茂大厦48层

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（2009年1月1日 - 2009年6月30日）
本期已实现收益	153,498,783.31
本期利润	269,408,404.02
加权平均基金份额本期利润	0.5855
本期加权平均净值利润率	44.07%
本期基金份额净值增长率	56.05%
3.1.2 期末数据和指标	报告期（2009年1月1日 - 2009年6月30日）
期末可供分配利润	265,327,551.90
期末可供分配基金份额利润	0.3633
期末基金资产净值	1,150,708,575.81
期末基金份额净值	1.5758
3.1.3 累计期末指标	报告期（2009年1月1日 - 2009年6月30日）
基金份额累计净值增长率	57.58%

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期末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	10.98%	0.92%	11.62%	0.98%	-0.64%	-0.06%
过去三个月	22.60%	1.18%	20.74%	1.24%	1.86%	-0.06%
过去六个月	56.05%	1.50%	56.52%	1.57%	-0.47%	-0.07%
自基金合同生效起至今	57.58%	1.23%	39.70%	1.91%	17.88%	-0.68%

注：1、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）。

2、本基金业绩比较基准为：沪深 300 指数收益率×80%+上证国债指数收益率×20%

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

华宝兴业大盘精选股票型证券投资基金

份额累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

（2008 年 10 月 7 日至 2009 年 6 月 30 日）



注：1、本基金基金合同生效于 2008 年 10 月 7 日，截止报告日本基金基金合同生效未
满一年。

2、按照基金合同的约定，自基金成立日期的 6 个月内达到规定的资产组合，截至
2009 年 4 月 7 日，本基金已达到基金合同规定的资产配置比例。

4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

基金管理人是在 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（2009 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、大盘精选基金和增强收益基金，所管理的开放式证券投资基金资产净值合计 48,400,241,713.33 元。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理的简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
冯刚	国内投资部 总经理、本 基金基金经 理兼任收益 增长基金基	2008-10-8	-	9 年	硕士，曾在联合证券有 限公司、华安基金管理 公司、长城证券从事投 资、研究、投资银行等 工作。2004 年 3 月加入

	金经理				本公司,任高级研究员、多策略增长基金基金经理助理。2006 年 6 月至今任收益增长基金基金经理,2008 年 10 月至今兼任大盘精选基金基金经理。
邵喆阳	本基金基金经理助理兼任收益增长基金经理助理	2008-5-14	-	3 年	硕士,拥有 CFA 资格。2005 年 7 月至 2006 年 12 月任安永会计师事务所审计员。2006 年 12 月加入本公司任分析师,2008 年 5 月起任收益增长基金基金经理助理,2008 年 9 月起兼任大盘精选基金基金经理助理。

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遵规守信情况的说明

本报告期内,本基金管理人遵守《中华人民共和国证券法》、《中华人民共和国证券投资基金法》及其各项实施细则、《华宝兴业大盘精选股票型证券投资基金基金合同》和其他相关法律法规的规定、监管部门的相关规定,依照诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产,在控制投资风险的基础上,为基金份额持有人谋取最大利益,没有损害基金份额持有人利益的行为。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

本报告期内,基金管理人通过交易决策与交易执行相分离、交易部相对投资部门独立、每日交易日结报告等机制,确保所管理的各基金在交易中被公平对待。

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

4.3.2 本投资组合与其他投资风格相似的投资组合之间的业绩比较

本报告期内,基金管理人管理的其他基金没有与本基金的投资风格相似的投资组合。

4.3.3 异常交易行为的专项说明

本报告期内，本基金没有发现异常交易行为。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

09 年上半年本基金净值增长率 56.05%，基金业绩比较基准为 56.52%，2008 年全年本基金净值收益率落后业绩基准 0.47%。

二季度股市持续上涨，指数虽然出现震荡，但总体而言处于上升通道。市场热点不断转换，进入二季度后半段，随着地产销售的持续火爆，不少大中城市的房价也出现一定的涨幅，地产股受到市场的追捧，整体涨幅较大。总体而言，由于对于经济复苏的预期，与宏观经济密切相关的地产、金融、煤炭、钢铁、有色、汽车等行业在上半年维持了强势。

今年以来市场一直在犹豫中上行，本基金的仓位在上半年也经历了一些波动。1 季度处于建仓期，一度达到较高仓位；3-5 月本基金又处于持续营销、申购较多、规模不稳定，股票未能保持高仓位；在货币政策继续超出预期的情况下，5 月开始逐步把股票仓位加上来；在 3 季度宏观经济向上的预期下，短期仍然看好后市，但对政策出现的不稳定因素要时刻保持警惕。

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 09 年下半年，我们认为股指受宏观经济数据的影响将进一步加强，相当部分的企业盈利在三季度将出现回升。地产销售维持在高位，从而带动地产投资的反弹以及地产相关行业的复苏。整体宏观经济有望继续复苏。我们判断，经历多种形式的救市计划后，以美国为代表的发达国家金融体系已经企稳复苏。同时，我们相信对发展中国家的出口很快也会拐头，而且更加持续。但 2 季度以来过剩流动性和经济长期健康增长之间一直存在着矛盾，如何处理两者关系将考验政策制定者，不排除 3 季度末存在政策变化的预期，届时管理层对产品价格容忍度和宏观经济数据全面转好都将促使其做出调整。

我们对市场的总体判断是：下半年震荡比较大，结构与上半年会有所不同，除金融、焦煤、家电、医药、机械、水泥保持较高配置外，由于经济的转暖更多的公司值得研究，个股选择将在波动中显得重要；另外本基金将对大盘股保持较高比重。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

基金管理人在报告期内对旗下基金估值中，各部门参与如下：

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

（二）金融工程部：对特殊品种或由于特殊原因导致投资品种不存在活跃市场的情况下，为估值提供相关模型。

（三）估值委员会：定期评价现行估值政策和程序，在发生了影响估值政策和程序的有效性、适用性的情况后及时修订估值方法。基金在采用新投资策略或投资新品种时，评价现有估值政策和程序的适用性。

（四）必要时基金经理参与制定估值政策制定、估值模型及估值方法的确定工作。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金本报告期内未进行利润分配，本报告期末可供分配的基金份额利润为人民币 0.3633 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

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

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

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

5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告（注：财务会计报告中的“金融工具风险及管理”部分未在托管人复核范围内）、投资组合报告中的数据核对无误。

6 半年度财务会计报告（未经审计）

本基金成立于 2008 年 10 月 7 日，因此本报告期相关报表项目没有过往可比期间。

6.1 资产负债表

会计主体：华宝兴业大盘精选股票型证券投资基金

报告截止日：2009 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2009 年 6 月 30 日	上年度末 2008 年 12 月 31 日
资产：			
银行存款	6.4.2.1	180,547,450.45	119,708,698.87
结算备付金		5,627,832.05	256,149.59
存出保证金		-	-
交易性金融资产	6.4.2.2	967,505,233.51	306,232,535.89
其中：股票投资		947,257,233.51	150,380,903.69
债券投资		20,248,000.00	155,851,632.20
资产支持证券投资		-	-
衍生金融资产	6.4.2.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.2.4	-	-
应收证券清算款		7,154,190.61	-
应收利息	6.4.2.5	235,210.93	3,558,076.30
应收股利		35,640.00	-
应收申购款		13,667,110.73	98,051.59
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.2.6	106,074.50	210,421.00
资产总计		1,174,878,742.78	430,063,933.24
负债和所有者权益	附注号	本期末 2009 年 6 月 30 日	上年度末 2008 年 12 月 31 日
负债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-

衍生金融负债		-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		2,576,142.60	13,506,516.96
应付赎回款		17,720,137.22	490,100.79
应付管理人报酬		1,320,581.89	591,057.98
应付托管费		220,096.96	98,509.66
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.2.7	2,158,286.66	223,589.88
应交税费		-	-
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.2.8	174,921.64	80,461.83
负债合计		24,170,166.97	14,990,237.10
所有者权益：			
实收基金	6.4.2.9	730,245,634.01	411,025,835.66
未分配利润	6.4.2.10	420,462,941.80	4,047,860.48
所有者权益合计		1,150,708,575.81	415,073,696.14
负债和所有者权益总计		1,174,878,742.78	430,063,933.24

注：报告截止日 2009 年 6 月 30 日，基金份额净值 1.5758 元，基金份额总额 730,245,634.01 份。

6.2 利润表

会计主体：华宝兴业大盘精选股票型证券投资基金

本报告期：2009 年 1 月 1 日 - 2009 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2009 年 1 月 1 日 - 2009 年 6 月 30 日
一、收入		280,266,857.98
1.利息收入		1,120,836.96
其中：存款利息收入	6.4.2.11	408,650.28
债券利息收入		712,186.68
资产支持证券利息收入		-
买入返售金融资产收入		-
其他利息收入		-
2.投资收益（损失以“-”填列）		161,910,926.09
其中：股票投资收益	6.4.2.12	154,284,303.24
债券投资收益	6.4.2.13	2,160,120.76

资产支持证券投资收益		-
衍生工具收益	6.4.2.14	-
股利收益	6.4.2.15	5,466,502.09
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.2.16	115,909,620.71
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.2.17	1,325,474.22
二、费用（以“-”号填列）		-10,858,453.96
1. 管理人报酬		-4,523,393.54
2. 托管费		-753,898.93
3. 销售服务费		-
4. 交易费用	6.4.2.18	-5,374,352.14
5. 利息支出		-
其中：卖出回购金融资产支出		-
6. 其他费用	6.4.2.19	-206,809.35
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		269,408,404.02
所得税费用（以“-”号填列）		-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		269,408,404.02

本基金成立于 2008 年 10 月 7 日，不存在上年度可比期间金额。

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：华宝兴业大盘精选股票型证券投资基金

本报告期：2009 年 1 月 1 日 - 2009 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2009 年 1 月 1 日 - 2009 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）	411,025,835.66	4,047,860.48	415,073,696.14
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	269,408,404.02	269,408,404.02
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）	319,219,798.35	147,006,677.30	466,226,475.65

其中：1. 基金申购款	1,100,674,153.91	426,969,851.95	1,527,644,005.86
2. 基金赎回款（以“-”号填列）	-781,454,355.56	-279,963,174.65	-1,061,417,530.21
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）	730,245,634.01	420,462,941.80	1,150,708,575.81

6.4 报表附注

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

本基金本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告一致。

6.4.2 重要财务报表项目的说明

6.4.2.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2009年6月30日
活期存款	180,547,450.45
定期存款	-
其他存款	-
合计	180,547,450.45

6.4.2.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2009年6月30日			
	成本	公允价值	估值增值	
股票	831,401,827.04	947,257,233.51	115,855,406.47	
债券	交易所市场	-	-	
	银行间市场	19,919,220.00	20,248,000.00	328,780.00
	合计	19,919,220.00	20,248,000.00	328,780.00
资产支持证券	-	-	-	
其他	-	-	-	
合计	851,321,047.04	967,505,233.51	116,184,186.47	

6.4.2.3 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。

6.4.2.4 买入返售金融资产

本基金本报告期末未持有买入返售金融资产。

6.4.2.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2009年6月30日
应收活期存款利息	27,685.31
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	1,969.70
应收债券利息	205,534.25
应收买入返售证券利息	-
应收申购款利息	21.67
其他	-
合计	235,210.93

6.4.2.6 其他资产

单位：人民币元

项目	本期末 2009年6月30日
其他应收款	-
待摊费用	106,074.50
合计	106,074.50

6.4.2.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2009年6月30日
交易所市场应付交易费用	2,158,286.66
银行间市场应付交易费用	-
合计	2,158,286.66

6.4.2.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2009年6月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	66,360.74
预提审计费	34,712.18
预提信息披露费	73,848.72
合计	174,921.64

6.4.2.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2009年1月1日 - 2009年6月30日	
	基金份额（份）	帐面金额
上年度末	411,025,835.66	411,025,835.66
本期申购	1,100,674,153.91	1,100,674,153.91
本期赎回	-781,454,355.56	-781,454,355.56
本期末	730,245,634.01	730,245,634.01

注：申购含红利再投、转换入份额，赎回含转换出份额。

6.4.2.10 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	4,707,096.98	-659,236.50	4,047,860.48
本期利润	153,498,783.31	115,909,620.71	269,408,404.02
本期基金份额交易产生的变动数	107,121,671.61	39,885,005.69	147,006,677.30
其中：基金申购款	293,536,650.06	133,433,201.89	426,969,851.95
基金赎回款	-186,414,978.45	-93,548,196.20	-279,963,174.65
本期已分配利润	-	-	-
本期末	265,327,551.90	155,135,389.90	420,462,941.80

6.4.2.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2009年1月1日 - 2009年6月30日	
	活期存款利息收入	381,064.04
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	19,298.18	
其他	8,288.06	
合计	408,650.28	

6.4.2.12 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2009年1月1日 - 2009年6月30日	
	卖出股票成交总额	1,580,998,090.55
卖出股票成本总额	-1,426,713,787.31	
买卖股票差价收入	154,284,303.24	

6.4.2.13 债券投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2009年1月1日 - 2009年6月30日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交金额	138,166,256.93
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	-132,621,294.84
应收利息总额	-3,384,841.33
债券投资收益	2,160,120.76

6.4.2.14 衍生工具收益

本基金本报告期无衍生工具收益。

6.4.2.15 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2009年1月1日 - 2009年6月30日
股票投资产生的股利收益	5,466,502.09
基金投资产生的股利收益	-
合计	5,466,502.09

6.4.2.16 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目	本期 2009年1月1日 - 2009年6月30日
1. 交易性金融资产	115,909,620.71
——股票投资	118,891,958.07
——债券投资	-2,982,337.36
——资产支持证券投资	-
——基金投资	-
2. 衍生工具	-
——权证投资	-
3. 其他	-
合计	115,909,620.71

6.4.2.17 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2009年1月1日 - 2009年6月30日
基金赎回费收入	1,254,865.46
转换基金补偿收入	70,608.76
合计	1,325,474.22

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。

6.4.2.18 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2009年1月1日 - 2009年6月30日
交易所市场交易费用	5,373,287.14
银行间市场交易费用	1,065.00
合计	5,374,352.14

6.4.2.19 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2009年1月1日 - 2009年6月30日
审计费用	34,712.18
信息披露费	159,580.46
债券帐户维护费	7,500.00
银行汇划费用	5,016.71
合计	206,809.35

6.4.3 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.3.1 或有事项

本基金本报告期内无特别或有事项的说明。

6.4.3.2 资产负债表日后事项

本基金本报告期内无特别资产负债表日后事项的说明。

6.4.4 关联方关系

6.4.4.1 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。

6.4.4.2 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	基金管理人、注册登记机构、基金销售机构
中国银行	基金托管人、基金代销机构

注：以下关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.5 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.5.1 通过关联方交易单元进行的交易

本报告期内未通过关联方交易单位进行交易。

6.4.5.2 关联方报酬

6.4.5.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期
	2009年1月1日 - 2009年6月30日
当期应支付的管理费	4,523,393.54
其中：当期已支付	3,202,811.65
期末未支付	1,320,581.89

注：基金管理费按前一日的基金资产净值的 1.50% 的年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 1.50\% / \text{当年天数}$$

H 为每日应支付的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计提，按月支付。由基金管理人向基金托管人发送基金管理费划付指令，基金托管人复核后于次月首日起十个工作日内从基金资产中一次性支付给基金管理人。

6.4.5.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期
	2009年1月1日 - 2009年6月30日
当期应支付的托管费	753,898.93
其中：当期已支付	533,801.97
期末未支付	220,096.96

注：基金托管费按前一日的基金资产净值的 0.25% 的年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 0.25\% / \text{当年天数}$$

H 为每日应支付的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计提，按月支付。由基金管理人向基金托管人发送基金托管费划付指令，基金托管人复核后于次月首日起十个工作日内从基金资产中一次性支付给基金托管人。

6.4.5.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金本报告期与过往可比期间未有与关联方进行的银行间同业市场的债券（含回购）交易。

6.4.5.4 各关联方投资本基金的情况

6.4.5.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

本报告期内与上年度可比期间基金管理人未投资本基金。

6.4.5.4.2 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

本报告期末与上年度末除基金管理人外其他关联方未投资本基金。

6.4.5.5 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

	2009年1月1日 - 2009年6月30日	
	期末余额	当期利息收入
中国银行	180,547,450.45	381,064.04

注：本基金的银行存款由基金托管人中国银行保管，按银行同业利率计息。

6.4.5.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期内与过往可比期间无参与关联方承销证券的情况。

6.4.6 利润分配情况

本基金本报告期内未进行利润分配。

6.4.7 期末（2009年6月30日）本基金持有的流通受限证券

6.4.7.1 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。

6.4.7.2 期末持有的暂时停牌股票

本基金本报告期末未持有暂时停牌的股票。

6.4.7.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.7.3.1 银行间市场债券正回购

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

6.4.7.3.2 交易所市场债券正回购

本基金本报告期末无债券正回购，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。

6.4.8 金融工具风险及管理

6.4.8.1 风险管理政策和组织架构

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

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

本基金的基金管理人根据自身经营特点设立顺序递进、权责统一、严密有效的四层监控

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

本基金的基金管理人对于金融工具的风险管理方法是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，将风险控制可在可承受的范围内。

6.4.8.2 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银行，因而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，因此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，通过对投资品种的信用等级评估来控制证券发行人的信用风险，且通过分散化投资以分散信用风险。本基金均投资于具有良好信用等级的证券，且投资于一家公司发行的证券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%。

6.4.8.3 流动性风险

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

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

针对投资品种变现的流动性风险，本基金的基金管理人通过独立的风险管理部门设定流动性比例要求，对流动性指标进行持续的监测和分析，包括组合持仓集中度指标、组合在短期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，因此本基金持有的证券均能及时变现。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值。

本基金所持有的全部金融负债的合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。

6.4.8.4 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。

6.4.8.4.1 利率风险

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

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

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

6.4.8.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2009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	180,547,450.45	-	-	-	180,547,450.45
结算备付金	5,627,832.05	-	-	-	5,627,832.05
交易性金融资产	20,248,000.00	-	-	947,257,233.51	967,505,233.51
应收证券清算款	-	-	-	7,154,190.61	7,154,190.61
应收利息	-	-	-	235,210.93	235,210.93
应收股利	-	-	-	35,640.00	35,640.00
应收申购款	293,713.22	-	-	13,373,397.51	13,667,110.73
其他资产	-	-	-	106,074.50	106,074.50
资产总计	206,716,995.72	-	-	968,161,747.06	1,174,878,742.78
负债					
应付证券清算款	-	-	-	2,576,142.60	2,576,142.60
应付赎回款	-	-	-	17,720,137.22	17,720,137.22
应付管理人报酬	-	-	-	1,320,581.89	1,320,581.89
应付托管费	-	-	-	220,096.96	220,096.96
应付交易费用	-	-	-	2,158,286.66	2,158,286.66
其他负债	-	-	-	174,921.64	174,921.64
负债总计	-	-	-	24,170,166.97	24,170,166.97

利率敏感度缺口	206,716,995.72	-	-	943,991,580.09	1,150,708,575.81
上年度末 2008 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	119,708,698.87	-	-	-	119,708,698.87
结算备付金	256,149.59	-	-	-	256,149.59
交易性金融资产	44,897,200.00	105,315,400.00	5,639,032.20	150,380,903.69	306,232,535.89
应收利息	-	-	-	3,558,076.30	3,558,076.30
应收申购款	2,485.09	-	-	95,566.50	98,051.59
其他资产	-	-	-	210,421.00	210,421.00
资产总计	164,864,533.55	105,315,400.00	5,639,032.20	154,244,967.49	430,063,933.24
负债					
应付证券清算款	-	-	-	13,506,516.96	13,506,516.96
应付赎回款	-	-	-	490,100.79	490,100.79
应付管理人报酬	-	-	-	591,057.98	591,057.98
应付托管费	-	-	-	98,509.66	98,509.66
应付交易费用	-	-	-	223,589.88	223,589.88
其他负债	-	-	-	80,461.83	80,461.83
负债总计	-	-	-	14,990,237.10	14,990,237.10
利率敏感度缺口	164,864,533.55	105,315,400.00	5,639,032.20	139,254,730.39	415,073,696.14

6.4.8.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	市场利率在各个期限上发生整体的同幅度移动，且其它市场变量保持不变。 使用债券部分资产的久期和凸性对该部分资产所受到的利率风险进行测量。		
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 2009 年 6 月 30 日	上年度末 2008 年 12 月 31 日
	市场利率上升25bp	减少33,840.75	减少512,559.59
	市场利率下降25bp	增加33,980.73	增加518,862.32

6.4.8.4.2 外汇风险

本基金的所有资产及负债均以人民币计价，因此无外汇风险。

6.4.8.4.3 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，做出资产配置及投资组合构建的策略；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价格风险。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。

6.4.8.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2009年6月30日		上年度末 2008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	947,257,233.51	82.32	150,380,903.69	36.23
衍生金融资产-权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	947,257,233.51	82.32	150,380,903.69	36.23

6.4.8.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

本基金管理人运用系统风险系数 Beta 的方法对本基金的市场价格风险进行分析。由于本基金于 2008 年 10 月 7 日成立，没有满足该方法需要一年历史数据的条件，所以该风险分析方法不适用，故对市场价格风险不做披露。

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	947,257,233.51	80.63
	其中：股票	947,257,233.51	80.63
2	固定收益投资	20,248,000.00	1.72

	其中：债券	20,248,000.00	1.72
	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	186,175,282.50	15.85
6	其他资产	21,198,226.77	1.80
7	合计	1,174,878,742.78	100.00

7.2 期末按行业分类的股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采掘业	81,437,503.18	7.08
C	制造业	385,633,919.87	33.51
C0	食品、饮料	17,591,333.68	1.53
C1	纺织、服装、皮毛	-	-
C2	木材、家具	-	-
C3	造纸、印刷	9,366,664.50	0.81
C4	石油、化学、塑胶、塑料	52,215,093.75	4.54
C5	电子	14,832,717.84	1.29
C6	金属、非金属	82,535,101.86	7.17
C7	机械、设备、仪表	140,124,404.67	12.18
C8	医药、生物制品	68,968,603.57	5.99
C99	其他制造业	-	-
D	电力、煤气及水的生产和供应业	-	-
E	建筑业	20,958,000.00	1.82
F	交通运输、仓储业	53,339,306.18	4.64
G	信息技术业	15,206,250.00	1.32
H	批发和零售贸易	82,785,856.25	7.19
I	金融、保险业	244,024,498.03	21.21
J	房地产业	61,752,900.00	5.37
K	社会服务业	-	-
L	传播与文化产业	2,119,000.00	0.18
M	综合类	-	-
	合计	947,257,233.51	82.32

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	600000	浦发银行	2,435,000	56,053,700.00	4.87
2	601166	兴业银行	1,399,973	51,952,998.03	4.51
3	601006	大秦铁路	3,700,000	39,183,000.00	3.41
4	000002	万科A	2,950,000	37,612,500.00	3.27
5	600216	浙江医药	1,235,000	32,900,400.00	2.86
6	600036	招商银行	1,460,000	32,718,600.00	2.84
7	600153	建发股份	2,382,914	32,240,826.42	2.80
8	601398	工商银行	5,800,000	31,436,000.00	2.73
9	000527	美的电器	2,119,995	30,315,928.50	2.63
10	600016	民生银行	3,400,000	26,928,000.00	2.34
11	600030	中信证券	860,000	24,303,600.00	2.11
12	600690	青岛海尔	1,779,985	23,602,601.10	2.05
13	000651	格力电器	1,090,000	22,781,000.00	1.98
14	600309	烟台万华	1,232,600	19,438,102.00	1.69
15	000877	天山股份	1,430,910	18,029,466.00	1.57
16	600266	北京城建	1,050,000	17,871,000.00	1.55
17	600739	辽宁成大	537,000	17,785,440.00	1.55
18	002024	苏宁电器	1,050,000	16,873,500.00	1.47
19	601699	潞安环能	390,000	15,401,100.00	1.34
20	600835	上海机电	1,150,000	14,605,000.00	1.27
21	000157	中联重科	650,942	14,535,534.86	1.26
22	600594	益佰制药	1,250,000	13,875,000.00	1.21
23	000932	华菱钢铁	1,750,000	12,967,500.00	1.13
24	601666	平煤股份	430,500	12,445,755.00	1.08
25	002001	新和成	350,000	12,180,000.00	1.06
26	600585	海螺水泥	280,000	11,799,200.00	1.03
27	000401	冀东水泥	830,893	11,466,323.40	1.00
28	601318	中国平安	230,000	11,375,800.00	0.99
29	000016	深康佳A	2,309,902	11,364,717.84	0.99
30	000937	金牛能源	285,000	11,029,500.00	0.96
31	000623	吉林敖东	270,851	10,961,339.97	0.95
32	600875	东方电气	270,000	10,503,000.00	0.91
33	000063	中兴通讯	350,000	9,835,000.00	0.85
34	000422	湖北宣化	832,915	9,536,876.75	0.83
35	600123	兰花科创	250,000	8,817,500.00	0.77

36	600325	华发股份	380,000	8,584,200.00	0.75
37	000968	煤气化	449,904	8,026,287.36	0.70
38	600449	赛马实业	269,864	7,513,013.76	0.65
39	600001	邯郸钢铁	1,309,910	7,296,198.70	0.63
40	000910	大亚科技	803,815	6,671,664.50	0.58
41	600736	苏州高新	1,050,000	6,583,500.00	0.57
42	600486	扬农化工	201,150	6,456,915.00	0.56
43	600031	三一重工	220,000	6,329,400.00	0.55
44	600572	康恩贝	780,000	6,302,400.00	0.55
45	000895	双汇发展	170,000	6,120,000.00	0.53
46	600829	三精制药	330,000	5,999,400.00	0.52
47	600348	国阳新能	190,000	5,768,400.00	0.50
48	600029	南方航空	1,050,979	5,696,306.18	0.50
49	600660	福耀玻璃	650,000	5,336,500.00	0.46
50	600583	海油工程	433,454	5,127,760.82	0.45
51	600418	江淮汽车	859,694	5,029,209.90	0.44
52	000560	昆百大 A	500,000	4,750,000.00	0.41
53	601333	广深铁路	900,000	4,599,000.00	0.40
54	000686	东北证券	150,000	4,512,000.00	0.39
55	601857	中国石油	300,000	4,344,000.00	0.38
56	600809	山西汾酒	150,000	3,946,500.00	0.34
57	601111	中国国航	550,000	3,861,000.00	0.34
58	000933	神火股份	180,000	3,600,000.00	0.31
59	600887	*ST 伊利	239,928	3,553,333.68	0.31
60	600060	海信电器	300,000	3,468,000.00	0.30
61	600048	保利地产	120,000	3,346,800.00	0.29
62	601001	大同煤业	90,000	3,274,200.00	0.28
63	600761	安徽合力	309,949	3,158,380.31	0.27
64	601186	中国铁建	300,000	3,087,000.00	0.27
65	000680	山推股份	280,000	3,082,800.00	0.27
66	600570	恒生电子	250,000	2,997,500.00	0.26
67	600675	中华企业	180,000	2,872,800.00	0.25
68	000028	一致药业	150,924	2,852,463.60	0.25
69	000059	辽通化工	330,000	2,785,200.00	0.24
70	002208	合肥城建	190,000	2,753,100.00	0.24
71	000488	晨鸣纸业	350,000	2,695,000.00	0.23
72	600826	兰生股份	170,000	2,561,900.00	0.22
73	600837	海通证券	150,000	2,467,500.00	0.21
74	000759	武汉中百	249,980	2,439,804.80	0.21
75	600588	用友软件	125,000	2,373,750.00	0.21
76	000417	合肥百货	275,000	2,367,750.00	0.21

77	000800	一汽轿车	150,000	2,316,000.00	0.20
78	000783	长江证券	130,000	2,276,300.00	0.20
79	000858	五 粮 液	110,000	2,170,300.00	0.19
80	000778	新兴铸管	250,000	2,127,500.00	0.18
81	600880	博瑞传播	100,000	2,119,000.00	0.18
82	000597	东北制药	100,000	2,077,000.00	0.18
83	000528	柳 工	120,000	1,996,800.00	0.17
84	600693	东百集团	220,939	1,937,635.03	0.17
85	600997	开滦股份	100,000	1,869,000.00	0.16
86	600104	上海汽车	125,000	1,868,750.00	0.16
87	600058	五矿发展	100,000	1,829,000.00	0.16
88	000598	蓝星清洗	180,000	1,818,000.00	0.16
89	000911	南宁糖业	120,000	1,801,200.00	0.16
90	601899	紫金矿业	170,000	1,734,000.00	0.15

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	601166	兴业银行	56,464,807.31	13.60
2	600000	浦发银行	50,953,654.66	12.28
3	600036	招商银行	41,540,501.78	10.01
4	601006	大秦铁路	40,004,807.25	9.64
5	600030	中信证券	38,752,736.83	9.34
6	600153	建发股份	38,211,505.54	9.21
7	000651	格力电器	36,851,256.02	8.88
8	600016	民生银行	36,296,585.90	8.74
9	600585	海螺水泥	35,785,344.59	8.62
10	601398	工商银行	35,722,221.12	8.61
11	000002	万 科 A	35,123,869.64	8.46
12	000527	美的电器	31,197,620.45	7.52
13	601318	中国平安	30,323,322.75	7.31
14	000016	深康佳 A	30,244,073.34	7.29
15	600216	浙江医药	27,321,847.60	6.58
16	600309	烟台万华	26,978,515.62	6.50
17	601666	平煤股份	26,541,716.74	6.39
18	002024	苏宁电器	26,436,534.59	6.37
19	600880	博瑞传播	25,895,762.92	6.24

20	600739	辽宁成大	25,548,659.13	6.16
21	000001	深发展 A	25,414,364.95	6.12
22	600690	青岛海尔	24,748,382.69	5.96
23	000157	中联重科	23,585,968.08	5.68
24	601699	潞安环能	23,022,729.95	5.55
25	600887	*ST 伊利	22,867,021.78	5.51
26	600060	海信电器	22,566,331.48	5.44
27	000877	天山股份	22,250,749.58	5.36
28	600266	北京城建	22,004,395.24	5.30
29	600875	东方电气	20,431,191.39	4.92
30	600050	中国联通	20,114,451.30	4.85
31	600809	山西汾酒	19,030,785.76	4.58
32	000932	华菱钢铁	18,653,544.98	4.49
33	600031	三一重工	18,574,464.65	4.47
34	000937	金牛能源	18,007,665.67	4.34
35	000401	冀东水泥	17,786,443.44	4.29
36	600594	益佰制药	17,648,081.66	4.25
37	600835	上海机电	17,631,676.87	4.25
38	601001	大同煤业	16,357,361.21	3.94
39	600449	赛马实业	16,143,501.44	3.89
40	600997	开滦股份	16,020,694.26	3.86
41	000933	神火股份	15,880,564.34	3.83
42	000968	煤气化	15,387,460.64	3.71
43	600123	兰花科创	14,999,984.09	3.61
44	000063	中兴通讯	14,421,321.51	3.47
45	000623	吉林敖东	14,394,577.09	3.47
46	600068	葛洲坝	14,193,682.15	3.42
47	601766	中国南车	14,182,597.24	3.42
48	000910	大亚科技	13,674,680.99	3.29
49	600028	中国石化	13,101,040.27	3.16
50	000028	一致药业	12,626,288.00	3.04
51	601390	中国中铁	12,580,336.41	3.03
52	600348	国阳新能	12,210,881.60	2.94
53	600486	扬农化工	12,172,935.46	2.93
54	000898	鞍钢股份	12,045,174.25	2.90
55	000422	湖北宣化	11,750,562.25	2.83
56	601009	南京银行	11,696,415.00	2.82
57	002001	新 和 成	11,676,863.73	2.81
58	600570	恒生电子	11,549,213.16	2.78
59	000858	五 粮 液	11,468,912.00	2.76
60	600383	金地集团	11,362,651.12	2.74

61	600048	保利地产	11,337,670.67	2.73
62	601899	紫金矿业	11,161,293.00	2.69
63	600660	福耀玻璃	11,122,555.64	2.68
64	600015	华夏银行	11,091,988.09	2.67
65	000895	双汇发展	10,775,518.10	2.60
66	000012	南玻A	10,520,650.34	2.53
67	000792	盐湖钾肥	10,406,027.92	2.51
68	002208	合肥城建	10,319,915.22	2.49
69	600826	兰生股份	10,215,258.44	2.46
70	601186	中国铁建	10,183,062.62	2.45
71	600380	健康元	9,952,334.50	2.40
72	000597	东北制药	9,912,127.41	2.39
73	600837	海通证券	9,852,993.00	2.37
74	600058	五矿发展	9,749,889.50	2.35
75	600971	恒源煤电	9,464,439.43	2.28
76	600829	三精制药	9,132,485.45	2.20
77	000418	小天鹅A	8,964,126.15	2.16
78	600693	东百集团	8,932,095.34	2.15
79	000778	新兴铸管	8,735,758.65	2.10
80	600354	敦煌种业	8,719,280.90	2.10
81	600519	贵州茅台	8,636,755.01	2.08
82	000488	晨鸣纸业	8,618,302.49	2.08
83	600410	华胜天成	8,346,256.17	2.01

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	000001	深发展 A	42,196,062.99	10.17
2	600060	海信电器	30,747,384.72	7.41
3	600880	博瑞传播	29,002,400.30	6.99
4	601166	兴业银行	28,601,697.25	6.89
5	601318	中国平安	27,347,186.69	6.59
6	600585	海螺水泥	25,878,220.64	6.23
7	600887	*ST 伊利	22,718,336.05	5.47
8	600050	中国联通	21,495,611.49	5.18
9	000016	深康佳 A	21,032,855.10	5.07
10	600030	中信证券	20,445,961.56	4.93
11	600016	民生银行	20,314,306.70	4.89
12	600000	浦发银行	19,966,076.99	4.81

13	601666	平煤股份	19,636,161.74	4.73
14	601766	中国南车	18,791,928.16	4.53
15	600809	山西汾酒	18,758,074.35	4.52
16	000933	神火股份	18,593,676.63	4.48
17	600036	招商银行	18,085,487.46	4.36
18	601390	中国中铁	18,008,075.22	4.34
19	000651	格力电器	17,926,582.64	4.32
20	600997	开滦股份	17,190,680.25	4.14
21	600068	葛洲坝	15,301,800.68	3.69
22	002024	苏宁电器	15,268,607.82	3.68
23	000898	鞍钢股份	15,209,640.13	3.66
24	600380	健康元	15,106,533.05	3.64
25	600031	三一重工	15,031,860.69	3.62
26	000932	华菱钢铁	15,028,514.11	3.62
27	601001	大同煤业	14,935,649.21	3.60
28	600383	金地集团	14,806,892.45	3.57
29	600028	中国石化	13,896,389.33	3.35
30	600971	恒源煤电	13,378,649.32	3.22
31	600153	建发股份	13,367,823.57	3.22
32	000418	小天鹅 A	13,105,593.11	3.16
33	600570	恒生电子	13,044,419.23	3.14
34	600739	辽宁成大	13,002,475.17	3.13
35	600354	敦煌种业	12,750,425.59	3.07
36	601699	潞安环能	12,643,438.53	3.05
37	600519	贵州茅台	12,386,056.24	2.98
38	601009	南京银行	12,253,473.68	2.95
39	600015	华夏银行	12,025,363.27	2.90
40	601398	工商银行	11,993,475.17	2.89
41	600812	华北制药	11,929,543.32	2.87
42	600449	赛马实业	11,914,526.58	2.87
43	000792	盐湖钾肥	11,789,436.06	2.84
44	000157	中联重科	11,212,789.32	2.70
45	600410	华胜天成	11,192,493.30	2.70
46	002037	久联发展	11,130,296.83	2.68
47	000002	万科 A	11,089,069.13	2.67
48	000028	一致药业	10,429,446.90	2.51
49	600048	保利地产	10,146,427.21	2.44
50	000012	南玻 A	10,089,812.21	2.43
51	600005	武钢股份	10,089,762.04	2.43
52	600266	北京城建	10,028,358.06	2.42
53	600875	东方电气	9,887,445.15	2.38

54	000858	五 粮 液	9,692,620.40	2.34
55	000983	西山煤电	9,556,975.02	2.30
56	600826	兰生股份	9,463,736.23	2.28
57	000877	天山股份	9,384,234.25	2.26
58	601899	紫金矿业	9,333,220.99	2.25
59	000937	金牛能源	9,316,070.60	2.24
60	600058	五矿发展	9,108,459.15	2.19
61	601006	大秦铁路	9,095,829.34	2.19
62	601186	中国铁建	9,019,269.81	2.17
63	600985	雷鸣科化	8,831,431.38	2.13
64	600423	柳化股份	8,766,638.60	2.11
65	000968	煤 气 化	8,641,174.14	2.08
66	000401	冀东水泥	8,591,410.19	2.07
67	600642	申能股份	8,355,797.18	2.01

注：卖出金额不包括相关交易费用。

7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票的成本（成交）总额	2,104,698,159.06
卖出股票的收入（成交）总额	1,580,998,090.55

注：买入股票成本、卖出股票收入均不包括相关交易费用。

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

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	-	-
2	央行票据	20,248,000.00	1.76
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	可转债	-	-
7	其他	-	-
8	合计	20,248,000.00	1.76

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	0701016	07 央行票据 16	200,000	20,248,000.00	1.76

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资产支持证券。

7.9 投资组合报告附注

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

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

7.9.3 其他资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	-
2	应收证券清算款	7,154,190.61
3	应收股利	35,640.00
4	应收利息	235,210.93
5	应收申购款	13,667,110.73
6	其他应收款	-
7	待摊费用	106,074.50
8	其他	-
9	合计	21,198,226.77

7.9.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有转股期的可转换债券。

7.9.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限的情况。

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
9,664	75,563.50	426,720,607.25	58.44%	303,525,026.76	41.56%

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金的情况

份额单位：份

项目	持有份额总数(份)	占基金总份额比例
基金管理公司所有从业人员持有本开放式基金	586,397.31	0.0803%

9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日(2008-10-07)基金份额总额	490,050,880.11
报告期期初基金份额总额	411,025,835.66
报告期期间基金总申购份额	1,100,674,153.91
报告期期间基金总赎回份额	-781,454,355.56
报告期期间基金拆分变动份额(份额减少以“-”填列)	-
报告期期末基金份额总额	730,245,634.01

注：总申购份额含红利再投、转换入份额；总赎回份额含转换出份额。

10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

报告期内本基金未召开基金份额持有人大会。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

2009 年 6 月 30 日，经中国证券监督管理委员会核准，华宝兴业基金管理公司聘任任志强先生、HUANG XIAOYI HELEN（黄小薏）女士为华宝兴业基金管理有限公司副总经理。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

报告期内无涉及基金管理人、基金资产和基金托管业务的诉讼事项。

10.4 基金投资策略的改变

本基金的投资策略在报告期内未发生变更。

10.5 报告期内改聘会计师事务所情况

基金管理人为本基金聘任的会计师事务所在向本基金提供的审计服务持续期限为：本基金合同生效之日（2008 年 10 月 7 日）起至本报告期末。

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受监管部门稽查或处罚的情况

本报告期内管理人和托管人及其高级管理人员未有受到监管部门稽查或处罚的情况。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		债券交易	
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	成交金额	占当期债券成交总额的比例
兴业证券	1	920,717,709.94	24.98%	5,020,493.00	59.40%
光大证券	1	505,564,220.15	13.72%	-	-
招商证券	1	689,599,239.04	18.71%	-	-
长江证券	1	310,130,267.76	8.41%	-	-
中信金通	1	259,204,402.36	7.03%	1,287,064.60	15.23%
中信建投	1	402,977,342.78	10.93%	2,144,800.00	25.38%
国泰君安	1	477,638,740.48	12.96%	-	-
申银万国	1	119,864,327.10	3.25%	-	-

海通证券	1	-	-	-	-
合计	9	3,685,696,249.61	100.00%	8,452,357.60	100.00%

券商名称	回购交易		权证交易		应支付该券商的佣金	
	成交金额	占当期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	佣金	占当期佣金总量的比例
兴业证券	-	-	-	-	782,605.69	25.34%
光大证券	-	-	-	-	410,775.09	13.30%
招商证券	-	-	-	-	560,304.54	18.14%
长江证券	-	-	-	-	263,609.24	8.54%
中信金通	-	-	-	-	220,323.03	7.13%
中信建投	-	-	-	-	342,528.55	11.09%
国泰君安	-	-	-	-	405,989.42	13.15%
申银万国	-	-	-	-	101,883.98	3.30%
海通证券	-	-	-	-	-	-
合计	-	-	-	-	3,088,019.54	100.00%

注：基金管理人选择交易单元的标准和程序如下：

(1) 选择标准：资力雄厚，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。

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	关于华宝兴业基金公司部分基金参加工商银行“2009 倾心回馈”基金定期定额业务申购费优惠活动的提示性公告	《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》以及基金管理人网站	2009-1-1
2	关于华宝兴业基金公司部分基金参加建设银行定期定额业务申购费率优惠活动的提示性公告	《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》以及基金管理人网站	2009-1-1
3	华宝兴业基金公司关于网上直销建设银行卡交易费率调整的公告	《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》以及	2009-1-20

		基金管理人网站	
4	关于华宝兴业大盘精选股票型证券投资基金开通定期定额投资计划的公告	《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》以及基金管理人网站	2009-2-27
5	华宝兴业基金管理有限公司关于旗下部分基金开通基金转换业务的公告	《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》以及基金管理人网站	2009-3-3
6	关于华宝兴业基金管理有限公司全部基金增加深圳发展银行股份有限公司为代销机构的公告	《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》以及基金管理人网站	2009-3-23
7	关于华宝兴业基金管理有限公司增加中国国际金融有限公司为代销机构的公告	《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》以及基金管理人网站	2009-3-25
8	关于华宝兴业旗下部分基金增加华宝证券经纪有限责任公司为代销机构的公告	《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》以及基金管理人网站	2009-4-2
9	华宝兴业基金管理有限公司关于旗下基金在部分代销机构开通基金转换业务的公告	《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》以及基金管理人网站	2009-4-17
10	关于华宝兴业基金管理有限公司增加齐鲁证券为代销机构的公告	《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》以及基金管理人网站	2009-4-29
11	关于华宝兴业基金管理有限公司在光大证券开办基金定期定额投资计划业务的公告	《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》以及基金管理人网站	2009-5-8

11 备查文件目录

11.1 备查文件目录

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

11.2 存放地点

以上文件存于基金管理人办公场所及基金托管人住所备投资者查阅。

11.3 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
二〇〇九年八月二十八日