

华宝兴业收益增长混合型证券投资基金 2012 年半年度报告（摘要）

2012 年 6 月 30 日

基金管理人：华宝兴业基金管理有限公司

基金托管人：中国建设银行股份有限公司

送出日期：2012 年 8 月 27 日

§ 1 重要提示及目录

1.1 重要提示

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

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

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

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

本半年度报告摘要摘自半年度报告正文，投资者欲了解详细内容，应阅读半年度报告正文。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2012 年 01 月 01 日起至 06 月 30 日止。

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

| | |
|------------|--------------------|
| 基金名称 | 华宝兴业收益增长混合型证券投资基金 |
| 基金简称 | 华宝兴业收益增长混合 |
| 基金主代码 | 240008 |
| 交易代码 | 240008 |
| 基金运作方式 | 契约型开放式 |
| 基金合同生效日 | 2006 年 6 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 | 1,075,010,367.31 份 |
| 基金合同存续期 | 不定期 |

2.2 基金产品说明

| | |
|--------|--|
| 投资目标 | 投资稳定分红和有分红潜力的价值被低估上市公司，以分享该类上市公司的长期稳定的股息收入及资本增值。 |
| 投资策略 | 本基金采取积极的资产配置策略，通过公司自行开发的数量化辅助模型，结合宏观策略研究，对相关资产类别的预期收益进行动态跟踪，决定大类资产配置比例。股票投资部分采用定量与定性分析相结合，行业配置与定期调整策略；债券投资部分通过大资产配置、分类资产配置和个券选择三个层次自上而下进行债券投资管理。 |
| 业绩比较基准 | 65%上证红利指数收益率+35%上证国债指数收益率 |
| 风险收益特征 | 本基金是混合型基金，风险高于债券基金，低于股票型基金，属于证券投资基金中的中等风险品种。 |

2.3 基金管理人和基金托管人

| 项目 | | 基金管理人 | 基金托管人 |
|---------|------|-----------------|--------------------|
| 名称 | | 华宝兴业基金管理有限公司 | 中国建设银行股份有限公司 |
| 信息披露负责人 | 姓名 | 刘月华 | 尹东 |
| | 联系电话 | 021-38505888 | 010-67595003 |
| | 电子邮箱 | xxpl@fsfund.com | yindong.zh@ccb.com |
| 客户服务电话 | | 400-700-5588、 | 010—67595096 |

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

2.4 信息披露方式

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

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

| 3.1.1 期间数据和指标 | 报告期(2012 年 1 月 1 日 - 2012 年 6 月 30 日) |
|---------------|---------------------------------------|
| 本期已实现收益 | -32,733,177.76 |
| 本期利润 | 247,599,380.26 |
| 加权平均基金份额本期利润 | 0.2230 |
| 本期加权平均净值利润率 | 8.45% |
| 本期基金份额净值增长率 | 8.74% |
| 3.1.2 期末数据和指标 | 报告期末(2012 年 6 月 30 日) |
| 期末可供分配利润 | 1,167,696,973.57 |
| 期末可供分配基金份额利润 | 1.0862 |
| 期末基金资产净值 | 2,981,869,639.96 |
| 期末基金份额净值 | 2.7738 |
| 3.1.3 累计期末指标 | 报告期末(2012 年 6 月 30 日) |
| 基金份额累计净值增长率 | 177.38% |

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、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、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。

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

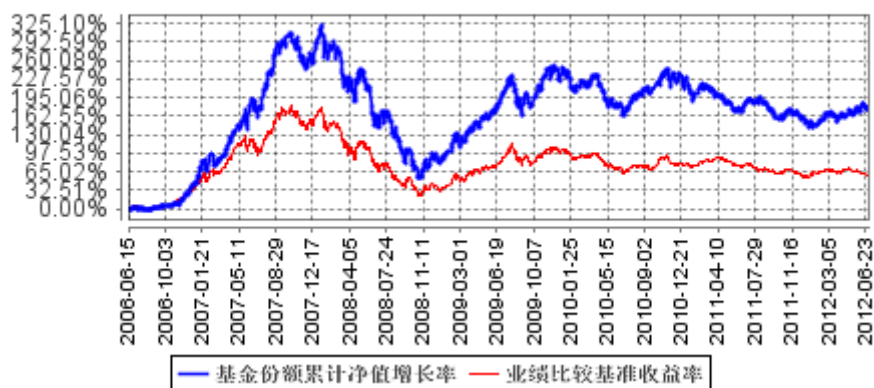
| 阶段 | 份额净值增长率① | 份额净值增长率标准差② | 业绩比较基准收益率③ | 业绩比较基准收益率标准差④ | ①—③ | ②—④ |
|------------|----------|-------------|------------|---------------|---------|-------|
| 过去一个月 | -0.16% | 0.98% | -4.51% | 0.68% | 4.35% | 0.30% |
| 过去三个月 | 8.84% | 0.93% | -1.95% | 0.66% | 10.79% | 0.27% |
| 过去六个月 | 8.74% | 1.07% | 1.11% | 0.75% | 7.63% | 0.32% |
| 过去一年 | -1.87% | 0.97% | -10.05% | 0.77% | 8.18% | 0.20% |
| 过去三年 | -3.66% | 1.30% | -11.65% | 0.98% | 7.99% | 0.32% |
| 自基金合同生效起至今 | 177.38% | 1.72% | 59.55% | 1.40% | 117.83% | 0.32% |

注：1、本基金比较基准为：65%上证红利指数收益率+35%上证国债指数收益率。

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 2006 年 12 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 2003 年 3 月 7 日正式成立的合资基金管理公司，截至本报告期末（2012 年 6 月 30 日），所管理的开放式证券投资基金包括宝康系列基金、多策略基金、现金宝货币市场基金、动力组合基金、收益增长基金、先进成长基金、行业精选基金、海外中国成长基金、大盘精选基金、增强收益基金、中证 100 基金、上证 180ETF、上证 180ETF 联接基金、新兴产业基金、成熟市场动量优选基金、可转债基金、上证 180 成长 ETF、上证 180 成长 ETF 联接基金、华宝油气基金、华宝兴业医药生物、华宝短融 50，所管理的开放式证券投资基金资产净值合计 36,429,945,714.42 元。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

| 姓名 | 职务 | 任本基金的基金经理（助理）期限 | | 证券从业年限 | 说明 |
|-----|---------|-----------------|------|--------|---|
| | | 任职日期 | 离任日期 | | |
| 邵喆阳 | 本基金基金经理 | 2010 年 6 月 26 日 | - | 6 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 月加入华宝兴业基金管理有限公司先后任行业分析师、华宝兴业收益增长混合型证券投资基金基金经理助理、华宝兴业大盘 |

| | | | | | |
|--|--|--|--|--|--|
| | | | | | 精选股票型证券投资基金基金经理助理，2010年6月至今任华宝兴业收益增长混合型证券投资基金基金经理。 |
|--|--|--|--|--|--|

注：1、任职日期以及离任日期均以基金公告为准。

2、证券从业含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

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

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

本报告期内，基金管理人通过严格执行投资决策委员会议事规则、公司股票库管理制度、中央交易室制度、防火墙机制、系统中的公平交易程序、每日交易日结报告、定期基金投资绩效评价等机制，确保所管理的所有投资组合在授权、研究分析、投资决策、交易执行、业绩评估等投资管理活动和环节得到公平对待。同时，基金管理人严格遵守法律法规关于公平交易的相关规定和公司内部制度要求，分析了本基金与公司旗下所有其他投资组合之间的整体收益率差异、分投资类别（股票、债券）的收益率差异以及连续四个季度期间内、不同时间窗下同向交易的交易价差；分析结果未发现异常情况。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

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

本报告期内，本基金未发现异常交易行为。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

本基金在 2012 年上半年领先于业绩基准，2012 年上半年本基金在一季度由于仓位较低，结构比较防御一度落后于基准和市场，但本基金在二季度适当调整了组合结构加大了对地产及其相关产业链，消费以及若干成长股的配置取得了较明显的效果。同时本基金若干重仓股在一季度涨幅相对落后，在二季度有部分补涨。两者相结合，本基金在 2012 年上半年季度取得了不错的业绩。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截止至本报告期末，本报告期内基金份额净值增长率为 8.74%，基金业绩比较基准收益率为 1.11%，基金表现领先业绩比较基准 7.63%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望 2012 年下半年，我们对宏观经济的看法依旧谨慎，这一点并没有随着通胀回落而有所改变，相反我们对总需求的看法更加悲观。而且，我们坚持之前的看法，即通胀依然会是宏观经济最大的不确定性，通胀并未走远！这是因为本轮通胀的成因相较以往要复杂得多，中国政府由于担心经济增速下滑所以在过去两年内对于过量货币的回收始终比较犹豫且幅度较小。政府面临压通胀和保增长的两难境地，政策腾挪的空间逐步收窄。这既考验政府的管理能力亦是对投资人的投资能力的考验。

但是我们也看到由于通胀暂时的下降，以及宏观经济的快速下滑，中国的宏观政策已经从收紧到观察进而进入较为宽松的阶段，2012 年以来连续的降低准备金和基准利率是很明显的信号。股市结构性的行情就是对政策变化的回应。我们相信结构性的市场已经是较为乐观的表现了，我们并不认为这次政策放松的幅度会很大，经济就此能止住下滑重拾高增长。因为我们认为在通胀威胁没有彻底消除前，任何放松都会引致更严重的通胀和更严厉的紧缩，所以我们必须留一份清醒。我们始终认为鉴于目前中国的宏观经济环境，隐忍和耐心都是政府与民众所最必需的，我们必须付出一段时间经济增速放缓的代价来实现经济体内各个生产要素的价格出清以承担 2008 年至 2009 年的过度刺激的恶果。

但同时，我们始终相信中国经济的潜力还巨大，在新经济出现之前，其实经济不平衡是发展的最大瓶颈，如果不平衡的状况得到缓解：外贸依赖下降，东西部更加平衡，社会保障制度更加充分，各种要素价格、资源配置更加合理，那么，从人均福利的角度看，传统经济在内需方面，无论投资和消费结构性升级仍有很大空间。这既可以保持经济增长的持续性也是对当前通胀压力

的有效疏通。

这也是我们始终没有丧失信心的原因，我们的投资策略将充分考虑上述因素对市场的影响，重点关注业绩明显改善的行业和个股，注重消费升级、劳动力成本上升等重要因素对行业中长期发展的影响。行业中的领先公司或者具有较高管理水平的公司，有可能在经济震荡中进一步增强竞争力，这类公司是我们重点关注的对象。

本基金将在 2012 年下半年以及后面的时间内加强在部分盈利增长稳定，估值合理的行业和个股中把握机会，加大配置。本基金将在考虑流动性的基础上提高持股集中度，以进一步发挥本基金在选股能力上的优势，我们相信未来的一段时间 A 股市场尚难走出大规模的上涨行情，震荡市和结构市已经是相对比较乐观的判断，所以本基金争取继续稳扎稳打，以回报持有人对我们长期的宽容和信任。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

基金管理人在报告期内对旗下基金估值中，各部门参与如下：

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

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

（三）估值委员会：定期评价现行估值政策和程序，在发生了影响估值政策和程序的有效性及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）必要时基金经理参与估值政策制定、估值模型及估值方法的确定工作。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

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

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期，中国建设银行股份有限公司在本基金的托管过程中，严格遵守了《证券投资基金

法》、基金合同、托管协议和其他有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

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

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

报告期内，本基金未实施利润分配。

5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

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

§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：华宝兴业收益增长混合型证券投资基金
报告截止日：2012年6月30日

单位：人民币元

| 资产 | 附注号 | 本期末 2012年6月30日 | 上年度末 2011年12月31日 |
|------------|-----|-------------------|---------------------|
| 资产： | | | |
| 银行存款 | | 361,394,387.93 | 523,552,352.77 |
| 结算备付金 | | 15,797,819.66 | 4,472,132.27 |
| 存出保证金 | | 3,764,443.91 | 3,332,388.64 |
| 交易性金融资产 | | 2,264,369,594.89 | 2,269,693,238.54 |
| 其中：股票投资 | | 2,264,369,594.89 | 2,172,963,238.54 |
| 基金投资 | | - | - |
| 债券投资 | | - | 96,730,000.00 |
| 资产支持证券投资 | | - | - |
| 衍生金融资产 | | - | - |
| 买入返售金融资产 | | 344,001,436.00 | 201,500,502.25 |

| | | | |
|-----------------|------------|---------------------------|-----------------------------|
| 应收证券清算款 | | 16,820,762.30 | - |
| 应收利息 | | 257,619.39 | 2,548,789.75 |
| 应收股利 | | - | - |
| 应收申购款 | | 219,043.94 | 408,909.41 |
| 递延所得税资产 | | - | - |
| 其他资产 | | - | - |
| 资产总计 | | 3,006,625,108.02 | 3,005,508,313.63 |
| 负债和所有者权益 | 附注号 | 本期末 2012年6月30日 | 上年度末 2011年12月31日 |
| 负 债: | | | |
| 短期借款 | | - | - |
| 交易性金融负债 | | - | - |
| 衍生金融负债 | | - | - |
| 卖出回购金融资产款 | | - | - |
| 应付证券清算款 | | - | 48,436,665.49 |
| 应付赎回款 | | 528,838.31 | 636,447.00 |
| 应付管理人报酬 | | 3,672,498.86 | 3,836,032.13 |
| 应付托管费 | | 612,083.15 | 639,338.70 |
| 应付销售服务费 | | - | - |
| 应付交易费用 | | 19,228,392.86 | 14,106,775.09 |
| 应交税费 | | - | - |
| 应付利息 | | - | - |
| 应付利润 | | - | - |
| 递延所得税负债 | | - | - |
| 其他负债 | | 713,654.88 | 927,676.47 |
| 负债合计 | | 24,755,468.06 | 68,582,934.88 |
| 所有者权益: | | | |
| 实收基金 | | 1,075,010,367.31 | 1,151,331,591.71 |
| 未分配利润 | | 1,906,859,272.65 | 1,785,593,787.04 |
| 所有者权益合计 | | 2,981,869,639.96 | 2,936,925,378.75 |
| 负债和所有者权益总计 | | 3,006,625,108.02 | 3,005,508,313.63 |

注:报告截止日 2012 年 6 月 30 日,基金份额净值 2.7738 元,基金份额总额 1,075,010,367.31 份。

6.2 利润表

会计主体: 华宝兴业收益增长混合型证券投资基金

本报告期: 2012 年 1 月 1 日 至 2012 年 6 月 30 日

单位: 人民币元

| 项 目 | 附注号 | 本期 2012 年 1 月 1 日至 2012 年 6 月 30 日 | 上年度可比期间 2011 年 1 月 1 日至 2011 年 6 月 30 日 |
|--------|-----|--|---|
| 一、收入 | | 291,638,602.23 | -465,391,437.96 |
| 1.利息收入 | | 5,026,856.51 | 8,458,494.19 |

| | | | |
|----------------------------|--|----------------|-----------------|
| 其中：存款利息收入 | | 2,274,413.19 | 1,605,677.07 |
| 债券利息收入 | | 1,084,153.01 | 5,181,197.87 |
| 资产支持证券利息收入 | | - | - |
| 买入返售金融资产收入 | | 1,668,290.31 | 1,671,619.25 |
| 其他利息收入 | | - | - |
| 2.投资收益（损失以“-”填列） | | 6,162,352.16 | -226,016,513.73 |
| 其中：股票投资收益 | | -9,492,539.31 | -239,591,265.22 |
| 基金投资收益 | | - | - |
| 债券投资收益 | | -2,600.00 | -3,965,811.71 |
| 资产支持证券投资收益 | | - | - |
| 衍生工具收益 | | - | - |
| 股利收益 | | 15,657,491.47 | 17,540,563.20 |
| 3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列） | | 280,332,558.02 | -248,803,339.32 |
| 4.汇兑收益（损失以“-”号填列） | | - | - |
| 5.其他收入（损失以“-”号填列） | | 116,835.54 | 969,920.90 |
| 减：二、费用 | | 44,039,221.97 | 59,029,363.06 |
| 1. 管理人报酬 | | 21,837,848.48 | 28,378,090.32 |
| 2. 托管费 | | 3,639,641.44 | 4,729,681.78 |
| 3. 销售服务费 | | - | - |
| 4. 交易费用 | | 18,339,467.39 | 25,682,389.34 |
| 5. 利息支出 | | - | - |
| 其中：卖出回购金融资产支出 | | - | - |
| 6. 其他费用 | | 222,264.66 | 239,201.62 |
| 三、利润总额（亏损总额以“-”号填列） | | 247,599,380.26 | -524,420,801.02 |
| 减：所得税费用 | | - | - |
| 四、净利润（净亏损以“-”号填列） | | 247,599,380.26 | -524,420,801.02 |

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：华宝兴业收益增长混合型证券投资基金

本报告期：2012 年 1 月 1 日至 2012 年 6 月 30 日

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2012 年 1 月 1 日至 2012 年 6 月 30 日 | | |
|-----------------|---------------------------------------|------------------|------------------|
| | 实收基金 | 未分配利润 | 所有者权益合计 |
| 一、期初所有者权益（基金净值） | 1,151,331,591.71 | 1,785,593,787.04 | 2,936,925,378.75 |

| | | | |
|--|---------------------------------|------------------|-------------------|
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润） | - | 247,599,380.26 | 247,599,380.26 |
| 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） | -76,321,224.40 | -126,333,894.65 | -202,655,119.05 |
| 其中：1.基金申购款 | 9,396,880.85 | 15,361,101.67 | 24,757,982.52 |
| 2.基金赎回款 | -85,718,105.25 | -141,694,996.32 | -227,413,101.57 |
| 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） | 1,075,010,367.31 | 1,906,859,272.65 | 2,981,869,639.96 |
| 项目 | 上年度可比期间 2011年1月1日至2011年6月30日 | | |
| | 实收基金 | 未分配利润 | 所有者权益合计 |
| 一、期初所有者权益（基金净值） | 1,454,097,261.63 | 3,265,222,179.23 | 4,719,319,440.86 |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润） | - | -524,420,801.02 | -524,420,801.02 |
| 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） | -265,358,609.98 | -569,440,696.93 | -834,799,306.91 |
| 其中：1.基金申购款 | 88,454,798.73 | 165,385,343.60 | 253,840,142.33 |
| 2.基金赎回款 | -353,813,408.71 | -734,826,040.53 | -1,088,639,449.24 |
| 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） | 1,188,738,651.65 | 2,171,360,681.28 | 3,360,099,332.93 |

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署：

裴长江

基金管理公司负责人

黄小慧

主管会计工作负责人

张幸骏

会计机构负责人

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

华宝兴业收益增长混合型证券投资基金(以下简称“本基金”)经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监基金字[2006]第 86 号《关于同意华宝兴业收益增长混合型证券投资基金募集的批复》核准,由华宝兴业基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《华宝兴业收益增长混合型证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式,存续期限不定,首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币 2,339,342,609.46 元,业经普华永道中天会计师事务所有限公司普华永道中天验字(2006)第 70 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《华宝兴业收益增长混合型证券投资基金基金合同》于 2006 年 6 月 15 日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为 2,339,809,854.34 份基金份额,其中认购资金利息折合 467,244.88 份基金份额。本基金的基金管理人为华宝兴业基金管理有限公司,基金托管人为中国建设银行股份有限公司。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《华宝兴业收益增长混合型证券投资基金基金合同》的有关规定,本基金的投资范围为国内依法公开发行、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。在正常的市场情况下,本基金的投资比例范围为:股票占基金资产净值的 30%-95%,权证占 0%-3%,债券占 0%-70%,现金或者到期日在一年内的政府债券比例在 5%以上;投资于稳定分红股票的比例不低于股票资产的 80%(稳定分红指过去三年内至少两次实施现金红利分配)。本基金的业绩比较基准为:65%上证红利指数收益率+35%上证国债指数收益率。

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 2012 年 8 月 27 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”)、中国证监会公告[2010]5 号《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和半年度报告>》、中国证券业协会于 2007 年 5 月 15 日颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《华宝兴业收益增长混合型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 2012 半年度财务报表符合企业会计准则的要求,真实、完整地反映了本基金 2012 年 6 月 30 日的财务状况以及 2012 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[2004]78 号《关于证券投资基金税收政策的通知》、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) 基金买卖股票、债券的差价收入暂免征营业税和企业所得税。

(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派发利息时代扣代缴 20% 的个人所得税，暂不征收企业所得税。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，暂不征收企业所得税。

(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。

6.4.7 关联方关系

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

本报告期内存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

6.4.7.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

| 关联方名称 | 与本基金的关系 |
|---|---------------------|
| 华宝兴业基金管理有限公司(“华宝兴业”) | 基金管理人、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”) | 基金管理人的最终控制方 |
| 华宝证券有限责任公司(“华宝证券”) | 受基金管理人的股东控制的公司 |

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。

6.4.8 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.8.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.8.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

| 关联方名称 | 本期 2012年1月1日至2012年6月30日 | | 上年度可比期间 2011年1月1日至2011年6月30日 | |
|-------|----------------------------|----------------------|---------------------------------|----------------------|
| | 成交金额 | 占当期股票 成交总额的 比例 | 成交金额 | 占当期股票 成交总额的比 例 |
| 华宝证券 | 954,013,734.31 | 7.92% | - | - |

6.4.8.1.2 权证交易

本基金本报告期及上年度可比期间无通过关联方交易单元进行的权证交易。

6.4.8.1.3 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

| 关联方名称 | 本期 2012年1月1日至2012年6月30日 | | | |
|-------|---------------------------------|----------------|--------------|------------------|
| | 当期 佣金 | 占当期佣金 总量的比例 | 期末应付佣金余额 | 占期末应付佣 金总额的比例 |
| 华宝证券 | 814,121.74 | 8.08% | 1,095,742.36 | 5.70% |
| 关联方名称 | 上年度可比期间 2011年1月1日至2011年6月30日 | | | |
| | 当期 佣金 | 占当期佣金 总量的比例 | 期末应付佣金余额 | 占期末应付佣 金总额的比例 |
| 华宝证券 | - | - | - | - |

注： 1. 上述佣金按市场佣金率计算，以扣除由中国证券登记结算有限责任公司收取的证管费和经手费的净额列示。权证交易不计佣金。

2. 该类佣金协议的服务范围还包括佣金收取方为本基金提供的证券投资研究成果和市场信息服务等。

6.4.8.2 关联方报酬

6.4.8.2.1 基金管理费

单位：人民币元

| 项目 | 本期 | 上年度可比期间 |
|----|-------------------|---------------------|
| | 2012年1月1日至2012年6月 | 2011年1月1日至2011年6月30 |
| | | |

| | 30 日 | 日 |
|-----------------|---------------|---------------|
| 当期发生的基金应支付的管理费 | 21,837,848.48 | 28,378,090.32 |
| 其中：支付销售机构的客户维护费 | 3,342,030.92 | 4,168,776.25 |

注：支付基金管理人华宝兴业的基金管理人报酬按前一日基金资产净值 1.5% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日管理人报酬 = 前一日基金资产净值 × 1.5% / 当年天数。

6.4.8.2.2 基金托管费

单位：人民币元

| 项目 | 本期 | 上年度可比期间 |
|----------------|---------------------------------|---------------------------------|
| | 2012 年 1 月 1 日至 2012 年 6 月 30 日 | 2011 年 1 月 1 日至 2011 年 6 月 30 日 |
| 当期发生的基金应支付的托管费 | 3,639,641.44 | 4,729,681.78 |

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。

6.4.8.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

| 本期 | | | | | | |
|---------------------------------|--------|------|----------------|------------|-------|------|
| 2012 年 1 月 1 日至 2012 年 6 月 30 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 |
| - | - | - | - | - | - | - |
| 上年度可比期间 | | | | | | |
| 2011 年 1 月 1 日至 2011 年 6 月 30 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 |
| 中国建设银行股份有限公司 | - | - | 194,000,000.00 | 249,648.77 | - | - |

6.4.8.4 各关联方投资本基金的情况

6.4.8.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

份额单位：份

| 项目 | 本期 | 上年度可比期间 |
|---------------------------------|---------------------------------|---------------------------------|
| | 2012 年 1 月 1 日至 2012 年 6 月 30 日 | 2011 年 1 月 1 日至 2011 年 6 月 30 日 |
| 基金合同生效日（2006 年 6 月 15 日）持有的基金份额 | - | - |
| 期初持有的基金份额 | 403,290.93 | 403,290.93 |
| 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 | 403,290.93 | 403,290.93 |
| 期末持有的基金份额占基金总份额比例 | 0.04% | 0.03% |

6.4.8.4.2 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。

6.4.8.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

| 关联方名称 | 本期 | | 上年度可比期间 | |
|--------|---------------------------------|--------------|---------------------------------|--------------|
| | 2012 年 1 月 1 日至 2012 年 6 月 30 日 | | 2011 年 1 月 1 日至 2011 年 6 月 30 日 | |
| | 期末余额 | 当期利息收入 | 期末余额 | 当期利息收入 |
| 中国建设银行 | 361,394,387.93 | 2,203,872.51 | 299,210,820.38 | 1,456,634.10 |

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。

6.4.8.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期及上年度可比期间未在承销期内参与关联方承销证券。

6.4.8.7 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其他关联交易事项。

6.4.9 利润分配情况

本基金本报告期内未进行利润分配。

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

6.4.10.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

本基金本报告期末未持有因认购新发/增发证券而流通受限的证券。

6.4.10.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

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 |
|--------|------|------------|------|--------|-----------|--------|---------|---------------|---------------|----|
| 600436 | 片仔癀 | 2012年6月29日 | 重大事项 | 87.89 | 2012年7月2日 | 91.19 | 679,283 | 60,311,616.73 | 59,702,182.87 | - |

注：本基金截至 2012 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。

6.4.10.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券**6.4.10.3.1 银行间市场债券正回购**

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

6.4.10.3.2 交易所市场债券正回购

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

6.4.11 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) 各层次金融工具公允价值

于 2012 年 6 月 30 日，本基金持有的以公允价值计量的金融工具中属于第一层级的余额为

2,264,369,594.89 元,无属于第二、三层级的余额(2011 年 12 月 31 日:第一层级 1,965,991,797.83 元,第二层级 303,701,440.71 元,无第三层级)。

(iii) 公允价值所属层次间的重大变动

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

(iv) 第三层次公允价值余额和本期变动金额

于本期末,本基金未持有公允价值归属于第三层级的金融工具(2011 年 12 月 31 日:同)。

(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 | 2,264,369,594.89 | 75.31 |
| | 其中:股票 | 2,264,369,594.89 | 75.31 |
| 2 | 固定收益投资 | - | - |
| | 其中:债券 | - | - |
| | 资产支持证券 | - | - |
| 3 | 金融衍生品投资 | - | - |
| 4 | 买入返售金融资产 | 344,001,436.00 | 11.44 |
| | 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 | 377,192,207.59 | 12.55 |
| 6 | 其他各项资产 | 21,061,869.54 | 0.70 |
| 7 | 合计 | 3,006,625,108.02 | 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 | - | - |
| C | 制造业 | 999,613,741.70 | 33.52 |
| C0 | 食品、饮料 | 563,097,869.59 | 18.88 |
| C1 | 纺织、服装、皮毛 | - | - |
| C2 | 木材、家具 | - | - |
| C3 | 造纸、印刷 | - | - |
| C4 | 石油、化学、塑胶、塑料 | - | - |
| C5 | 电子 | 108,890,083.90 | 3.65 |
| C6 | 金属、非金属 | 25,061,602.70 | 0.84 |
| C7 | 机械、设备、仪表 | - | - |
| C8 | 医药、生物制品 | 302,564,185.51 | 10.15 |
| C99 | 其他制造业 | - | - |
| D | 电力、煤气及水的生产和供应业 | - | - |
| E | 建筑业 | 177,524,850.76 | 5.95 |
| F | 交通运输、仓储业 | - | - |
| G | 信息技术业 | 8,845,564.10 | 0.30 |
| H | 批发和零售贸易 | 7,598,799.20 | 0.25 |
| I | 金融、保险业 | 82,327,746.18 | 2.76 |
| J | 房地产业 | 374,716,618.17 | 12.57 |
| K | 社会服务业 | 470,377,077.44 | 15.77 |
| L | 传播与文化产业 | 143,365,197.34 | 4.81 |
| M | 综合类 | - | - |
| | 合计 | 2,264,369,594.89 | 75.94 |

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明 细

金额单位：人民币元

| 序号 | 股票代码 | 股票名称 | 数量（股） | 公允价值 | 占基金资产净值比例（%） |
|----|--------|------|------------|----------------|--------------|
| 1 | 002051 | 中工国际 | 9,937,198 | 263,931,978.88 | 8.85 |
| 2 | 300058 | 蓝色光标 | 8,589,886 | 143,365,197.34 | 4.81 |
| 3 | 002304 | 洋河股份 | 1,050,178 | 141,301,449.90 | 4.74 |
| 4 | 600809 | 山西汾酒 | 3,720,673 | 140,232,165.37 | 4.70 |
| 5 | 000024 | 招商地产 | 5,710,953 | 140,089,677.09 | 4.70 |
| 6 | 000895 | 双汇发展 | 2,200,008 | 136,136,495.04 | 4.57 |
| 7 | 600048 | 保利地产 | 11,738,047 | 133,109,452.98 | 4.46 |
| 8 | 002375 | 亚厦股份 | 3,943,072 | 97,354,447.68 | 3.26 |
| 9 | 002236 | 大华股份 | 2,922,995 | 89,735,946.50 | 3.01 |

| | | | | | |
|----|--------|-----|-----------|---------------|------|
| 10 | 300070 | 碧水源 | 2,918,686 | 87,268,711.40 | 2.93 |
|----|--------|-----|-----------|---------------|------|

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

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

| 序号 | 股票代码 | 股票名称 | 本期累计买入金额 | 占期初基金资产净值比例 (%) |
|----|--------|------|----------------|-----------------|
| 1 | 601166 | 兴业银行 | 229,976,788.54 | 7.83 |
| 2 | 601699 | 潞安环能 | 207,600,263.43 | 7.07 |
| 3 | 000937 | 冀中能源 | 200,478,689.29 | 6.83 |
| 4 | 601318 | 中国平安 | 171,198,464.84 | 5.83 |
| 5 | 000858 | 五粮液 | 150,840,806.93 | 5.14 |
| 6 | 600123 | 兰花科创 | 147,482,787.63 | 5.02 |
| 7 | 000024 | 招商地产 | 146,260,394.05 | 4.98 |
| 8 | 000651 | 格力电器 | 143,711,145.02 | 4.89 |
| 9 | 002304 | 洋河股份 | 142,587,832.57 | 4.86 |
| 10 | 600153 | 建发股份 | 135,052,906.90 | 4.60 |
| 11 | 600837 | 海通证券 | 118,124,527.24 | 4.02 |
| 12 | 000069 | 华侨城A | 116,387,293.77 | 3.96 |
| 13 | 600887 | 伊利股份 | 115,411,469.21 | 3.93 |
| 14 | 002310 | 东方园林 | 109,724,437.82 | 3.74 |
| 15 | 000002 | 万科A | 109,259,931.37 | 3.72 |
| 16 | 002081 | 金螳螂 | 108,609,524.96 | 3.70 |
| 17 | 600395 | 盘江股份 | 107,434,099.84 | 3.66 |
| 18 | 600030 | 中信证券 | 103,173,338.68 | 3.51 |
| 19 | 600157 | 永泰能源 | 101,222,540.25 | 3.45 |
| 20 | 002146 | 荣盛发展 | 101,149,179.90 | 3.44 |
| 21 | 000961 | 中南建设 | 101,090,285.69 | 3.44 |
| 22 | 000527 | 美的电器 | 97,107,523.66 | 3.31 |
| 23 | 600000 | 浦发银行 | 96,651,666.13 | 3.29 |
| 24 | 002236 | 大华股份 | 90,944,354.10 | 3.10 |
| 25 | 300070 | 碧水源 | 86,518,643.73 | 2.95 |
| 26 | 600383 | 金地集团 | 86,286,932.27 | 2.94 |

| | | | | |
|----|--------|------|---------------|------|
| 27 | 000999 | 华润三九 | 86,066,317.29 | 2.93 |
| 28 | 600048 | 保利地产 | 78,344,182.50 | 2.67 |
| 29 | 600809 | 山西汾酒 | 77,155,694.28 | 2.63 |
| 30 | 600572 | 康恩贝 | 72,541,703.01 | 2.47 |
| 31 | 002241 | 歌尔声学 | 71,402,547.15 | 2.43 |
| 32 | 600376 | 首开股份 | 69,404,351.42 | 2.36 |
| 33 | 000625 | 长安汽车 | 67,288,468.05 | 2.29 |
| 34 | 300251 | 光线传媒 | 65,984,661.51 | 2.25 |
| 35 | 000776 | 广发证券 | 62,299,539.82 | 2.12 |
| 36 | 600436 | 片仔癀 | 60,311,616.73 | 2.05 |
| 37 | 002422 | 科伦药业 | 60,062,984.93 | 2.05 |
| 38 | 000650 | 仁和药业 | 59,792,129.91 | 2.04 |
| 39 | 600518 | 康美药业 | 59,645,056.93 | 2.03 |
| 40 | 600031 | 三一重工 | 59,608,177.22 | 2.03 |

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 | 600123 | 兰花科创 | 223,298,957.34 | 7.60 |
| 2 | 601166 | 兴业银行 | 221,878,770.92 | 7.55 |
| 3 | 601699 | 潞安环能 | 210,112,801.51 | 7.15 |
| 4 | 000937 | 冀中能源 | 206,922,469.55 | 7.05 |
| 5 | 000858 | 五粮液 | 206,289,083.16 | 7.02 |
| 6 | 000069 | 华侨城A | 180,370,677.47 | 6.14 |
| 7 | 600016 | 民生银行 | 179,515,569.71 | 6.11 |
| 8 | 000651 | 格力电器 | 146,550,914.65 | 4.99 |
| 9 | 600153 | 建发股份 | 139,998,433.47 | 4.77 |
| 10 | 600036 | 招商银行 | 136,858,490.74 | 4.66 |
| 11 | 002146 | 荣盛发展 | 134,574,636.22 | 4.58 |
| 12 | 000002 | 万科A | 130,220,068.10 | 4.43 |
| 13 | 600837 | 海通证券 | 119,557,132.50 | 4.07 |
| 14 | 600395 | 盘江股份 | 111,963,933.47 | 3.81 |
| 15 | 600157 | 永泰能源 | 111,777,210.38 | 3.81 |
| 16 | 000961 | 中南建设 | 104,331,706.00 | 3.55 |
| 17 | 600376 | 首开股份 | 103,204,236.18 | 3.51 |

| | | | | |
|----|--------|------|----------------|------|
| 18 | 600030 | 中信证券 | 103,093,555.25 | 3.51 |
| 19 | 601318 | 中国平安 | 96,649,571.00 | 3.29 |
| 20 | 600000 | 浦发银行 | 95,045,591.01 | 3.24 |
| 21 | 000527 | 美的电器 | 92,623,033.68 | 3.15 |
| 22 | 002081 | 金螳螂 | 88,969,430.71 | 3.03 |
| 23 | 600809 | 山西汾酒 | 84,505,957.94 | 2.88 |
| 24 | 600887 | 伊利股份 | 84,180,415.82 | 2.87 |
| 25 | 600031 | 三一重工 | 83,954,998.33 | 2.86 |
| 26 | 002310 | 东方园林 | 80,450,312.56 | 2.74 |
| 27 | 600518 | 康美药业 | 80,192,649.73 | 2.73 |
| 28 | 002474 | 榕基软件 | 79,171,043.93 | 2.70 |
| 29 | 600383 | 金地集团 | 79,085,955.79 | 2.69 |
| 30 | 000401 | 冀东水泥 | 78,848,100.32 | 2.68 |
| 31 | 600519 | 贵州茅台 | 77,259,918.35 | 2.63 |
| 32 | 002241 | 歌尔声学 | 71,672,765.97 | 2.44 |
| 33 | 000028 | 国药一致 | 67,688,509.85 | 2.30 |
| 34 | 000024 | 招商地产 | 67,211,359.40 | 2.29 |
| 35 | 300251 | 光线传媒 | 63,954,938.14 | 2.18 |
| 36 | 000625 | 长安汽车 | 63,280,853.11 | 2.15 |
| 37 | 002013 | 中航精机 | 60,938,888.94 | 2.07 |

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 | 5,933,665,419.52 |
| 卖出股票收入（成交）总额 | 6,113,026,481.88 |

注：买入股票成本、卖出股票收入均不包括相关交易费用。

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7.8 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

7.9 投资组合报告附注

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

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

7.9.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

| 序号 | 名称 | 金额 |
|----|---------|---------------|
| 1 | 存出保证金 | 3,764,443.91 |
| 2 | 应收证券清算款 | 16,820,762.30 |
| 3 | 应收股利 | - |
| 4 | 应收利息 | 257,619.39 |
| 5 | 应收申购款 | 219,043.94 |
| 6 | 其他应收款 | - |
| 7 | 待摊费用 | - |
| 8 | 其他 | - |
| 9 | 合计 | 21,061,869.54 |

7.9.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

7.9.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

§ 8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

| 持有人户数 (户) | 户均持有的 基金份额 | 持有人结构 | | | |
|--------------|---------------|----------------|------------|----------------|------------|
| | | 机构投资者 | | 个人投资者 | |
| | | 持有份额 | 占总份 额比例 | 持有份额 | 占总份 额比例 |
| 78,877 | 13,628.95 | 133,882,105.85 | 12.45% | 941,128,261.46 | 87.55% |

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

| 项目 | 持有份额总数 (份) | 占基金总份额比例 |
|-------------------|------------|----------|
| 基金管理公司所有从业人员持有本基金 | 307,212.73 | 0.0286% |

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：0 至 10 万份 (含)

(二) 该只基金的基金经理持有该只基金份额总量的数量区间：10 万份至 50 万份 (含)

附：数量区间为 0、0 至 10 万份 (含)、10 万份至 50 万份 (含)、50 万份至 100 万份 (含)、100 万份以上。

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

| | |
|---------------------------|------------------|
| 基金合同生效日(2006年6月15日)基金份额总额 | 2,339,809,854.34 |
| 本报告期期初基金份额总额 | 1,151,331,591.71 |
| 本报告期基金总申购份额 | 9,396,880.85 |
| 减:本报告期基金总赎回份额 | 85,718,105.25 |
| 本报告期基金拆分变动份额 | - |
| 本报告期期末基金份额总额 | 1,075,010,367.31 |

注：总申购份额含红利再投、转换入份额；总赎回份额含转换出份额。

§ 10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

报告期内本基金未召开基金份额持有人大会。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本报告期内，本基金管理人、本基金托管人的专门基金托管部门未发生重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

报告期内无涉及基金管理人、基金资产和基金托管业务的诉讼事项。

10.4 基金投资策略的改变

本基金的投资策略在报告期内未发生变更。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

基金管理人为本基金聘任的会计师事务所向本基金提供的审计服务持续期限为：本基金合同生效之日(2006年6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

本报告期内管理人和托管人及其高级管理人员未有受到稽查或处罚的情况。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

| 券商名称 | 交易单元数量 | 股票交易 | | 应支付该券商的佣金 | | 备注 |
|------|--------|------|--------------|-----------|------------|----|
| | | 成交金额 | 占当期股票成交总额的比例 | 佣金 | 占当期佣金总量的比例 | |
| | | | | | | |

| | | | | | | |
|------|---|------------------|--------|--------------|--------|---|
| 国金证券 | 1 | 2,553,290,010.36 | 21.20% | 2,094,000.03 | 20.79% | - |
| 光大证券 | 1 | 1,206,114,008.19 | 10.02% | 992,643.70 | 9.85% | - |
| 安信证券 | 2 | 1,202,834,592.03 | 9.99% | 993,718.47 | 9.87% | - |
| 中信证券 | 1 | 1,034,477,726.95 | 8.59% | 879,593.05 | 8.73% | - |
| 华宝证券 | 1 | 954,013,734.31 | 7.92% | 814,121.74 | 8.08% | - |
| 瑞银证券 | 1 | 889,449,183.75 | 7.39% | 731,521.65 | 7.26% | - |
| 上海证券 | 1 | 827,835,012.07 | 6.87% | 704,660.77 | 7.00% | - |
| 银河证券 | 1 | 787,685,401.57 | 6.54% | 644,347.63 | 6.40% | - |
| 申银万国 | 1 | 683,399,456.44 | 5.67% | 589,335.93 | 5.85% | - |
| 中投证券 | 1 | 561,067,944.01 | 4.66% | 480,527.68 | 4.77% | - |
| 东方证券 | 1 | 516,785,120.68 | 4.29% | 442,409.43 | 4.39% | - |
| 广发证券 | 1 | 361,988,895.35 | 3.01% | 307,689.03 | 3.05% | - |
| 国都证券 | 1 | 361,278,374.99 | 3.00% | 309,136.97 | 3.07% | - |
| 国信证券 | 1 | 102,463,950.50 | 0.85% | 89,449.60 | 0.89% | - |
| 中信建投 | 1 | - | - | - | - | - |
| 红塔证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 华泰证券 | 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、 本基金本报告期券商交易单元未发生变化。

§ 11 影响投资者决策的其他重要信息

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

华宝兴业基金管理有限公司
2012 年 8 月 27 日