华宝兴业动力组合股票型证券投资基金

【2013】半年度报告摘要

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
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2013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	华宝兴业动力组合股票型证券投资基金
基金简称	华宝兴业动力组合股票
基金主代码	240004
交易代码	240004
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2005年11月17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
报告期末基金份额总额	2,159,650,988.64份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	通过对基金组合的动态优化管理,使基金收益持续稳定超越比较基准,并追求单位风险所获得的超额收益最大化。
投资策略	本基金根据中国股市价值驱动因子与成长驱动因子的变动趋势,调整评估个股"价值因子"与"成长因子"的权重比例,自下而上精选个股,获取超额收益。
业绩比较基准	80%上证180指数收益率与深证100指数收益率的流通市值加权平均+20%上证国债指数收益率。
风险收益特征	本基金是一只积极型的股票投资基金,属于证券投资基金中的中高风险品种。

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	中国银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	刘月华	唐州徽
	联系电话	021-38505888	95566
	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

2.4 信息披露方式

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(2013年1月1日 - 2013年6月30日)
本期已实现收益	94,090,314.69
本期利润	-40,564,390.39
加权平均基金份额本期利润	-0.0181
本期加权平均净值利润率	-2.34%
本期基金份额净值增长率	-2.74%
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	-581,954,216.16
期末可供分配基金份额利润	-0.2695
期末基金资产净值	1,577,696,772.48
期末基金份额净值	0.7305
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	242.80%

注:1、所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用,计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

2、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	-10.19%	1.48%	-12.43%	1.50%	2.24%	-0.02%
过去三个月	-2.20%	1.11%	-8.97%	1.17%	6.77%	-0.06%
过去六个月	-2.74%	1.29%	-10.09%	1.23%	7.35%	0.06%
过去一年	-1.06%	1.34%	-7.02%	1.11%	5.96%	0.23%
过去三年	-9.46%	1.11%	-8.30%	1.10%	-1.16%	0.01%
自基金合同生效日起至今	242.80%	1.46%	140.45%	1.54%	102.35%	-0.08%

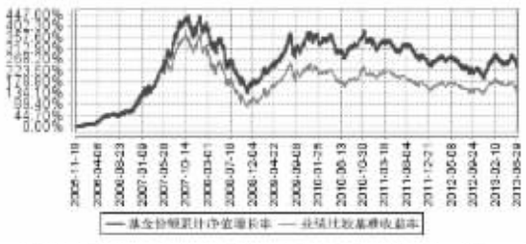
注:1、本基金比较基准为:80%上证180 指数收益率与深证100 指数收益率的流通市值加权平均+20%上证国债指数收益率。

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

(2005年11月17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2006 年3 月31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(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		
刘自强	投资副总监、本基金基金经理	2008年3月19日	-	12年	硕士。2001年7月至2003年7月,在天同证券任研究员,2003年7月至2003年11月,在中原证券任行业研究部副经理,2003年11月至2006年3月,在上海融昌资产管理公司先后任研究员、研究总监。2006年5月加入华宝兴业基金管理有限公司,先后任高级分析师、研究部总经理助理、基金经理助理职务,2008年3月至今任华宝兴业动力组合股票型证券投资基金的基金经理,2010年6月至2012年1月兼任华宝兴业宝康消费品证券投资基金基金经理,2012年4月起任投资副总监。

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、《华宝兴业动力组合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

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

2013年上半年,市场继续维持去年底的逼空走势,强势突破2400点。春节后,市场在连续上涨25%以后终于开始回调。在经历了半个月的震荡整固后,3月初新国五条的出台彻底打破了反弹预期。此后市场几度抵抗,小盘股也出现抱团取暖的逆势行情,但仍然无法阻止下跌,市场陷入阴跌状态。5月中旬,市场信心逐步恢复,在对政策放松的憧憬中,再次出现放量上涨。但是,随着央行极端收紧的政策推出,资金紧张的格局突然强化,银行间利率出现创纪录的飙升,导致这次反弹很快夭折,并迅速演变为大崩溃的走势。

在操作方面,本基金新年以来继续保持高仓位和重周期的组合,但在超预期的地产调控政策出台后,预计国内经济将再度陷入一段低谷期,因此进行了全面的组合调整,仓位降低到较低水平,配置开始转向防御性品种。尽管事后来看,减持周期品完全正确,但由于增持的白酒类股票未能体现出防御性,因此调整未能取得预期的效果。二季度本基金积极调整策略,及时配置了LED、电子支付等行业,但由于重点持仓的白酒类股票进一步走弱,因此上半年基金业绩表现较差。

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-2.74%,同期业绩比较基准收益率为-10.09%,基金表现领先业绩基准7.35%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

短期市场在资金紧张导致的崩溃式下跌后,已具备了反弹基础。同时,央行也开始重新调整动作,资金紧张问题大幅度缓解。小盘股的快速反弹以及大盘股的明显护盘都有利于市场信心的恢复。因此短期出现一定幅度的反弹可能性较大。从中长期来看,新一届政府调整结构的决心日渐明显,而IPO的即将开闸对市场供求也将产生负面冲击,持续上涨的小盘股也再次出现泡沫化的迹象。因此三季度的市场可能出现冲高回落走势。

综合目前的市场情况,我认为可适当控制仓位,但结构上应尽量规避高估值和强周期品种,适时加大对节能环保、政府投资、低端消费等行业的投资。未来本基金将更加注重投资的安全性,重点通过自下而上的选股模式,选取可靠的投资品种,适时调整仓位与行业配置,为持有人进一步创造回报。

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

本基金本报告期未进行利润分配,符合相关法规及基金合同的规定。

§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")在对华宝兴业动力组合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),投资组合报告等数据真实、准确和完整。

§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:华宝兴业动力组合股票型证券投资基金

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		185,294,285.79	104,599,203.70
结算备付金		11,472,504.78	715,124.17
存出保证金		267,751.22	1,331,341.11
交易性金融资产		1,227,498,293.37	1,623,657,555.44
其中:股票投资		1,227,498,293.37	1,623,657,555.44
基金投资		-	-
债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
衍生金融资产		-	-
买入返售金融资产		150,000,000.00	-
应收证券清算款		11,447,709.25	19,752,172.78
应收利息		320,716.53	25,319.61
应收股利		1,215,787.96	-
应收申购款		10,769.83	69,330.93
递延所得税资产		-	-
其他资产		-	-
资产总计		1,587,527,818.73	1,750,150,047.74
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		-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		-	14,799,214.19
应付赎回款		326,924.74	827,600.02
应付管理人报酬		2,068,236.51	2,027,257.47
应付托管费		344,706.06	337,876.24
应付销售服务费		-	-
应付交易费用		5,885,643.08	2,267,612.86
应交税费		-	-
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债		1,205,535.86	1,670,498.80
负债合计		9,831,046.25	21,930,059.58
所有者权益:			
实收基金		2,159,650,988.64	2,300,873,714.87
未分配利润		-581,954,216.16	-572,653,726.71
所有者权益合计		1,577,696,772.48	1,728,219,988.16
负债和所有者权益总计		1,587,527,818.73	1,750,150,047.74

注:报告截止日2013年6月30日,基金份额净值0.7305元,基金份额总额2,159,650,988.64份。

6.2 利润表

会计主体:华宝兴业动力组合股票型证券投资基金

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		-18,042,573.85	21,166,219.54
1.利息收入		2,244,008.59	3,048,617.22
其中:存款利息收入		1,032,441.28	1,576,276.93
债券利息收入		-	-
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		1,211,567.31	1,472,340.29
其他利息收入		-	-
2.投资收益(损失以"-"填列)		114,316,890.36	-64,063,201.82
其中:股票投资收益		99,882,218.02	-74,286,331.53
基金投资收益		-	-
债券投资收益		-	-
资产支持证券投资收益		-	-
衍生工具收益		-	-
股利收益		14,434,672.34	10,223,129.71
3.公允价值变动收益(损失以"-"号填列)		-134,654,705.08	82,070,540.27
4.汇兑收益(损失以"-"号填列)		-	-
5.其他收入(损失以"-"号填列)		51,232.28	110,263.87
减:二、费用		22,521,816.54	22,913,198.97
1.管理人报酬		12,899,481.95	14,226,370.25
2.托管费		2,149,913.67	2,371,061.78
3.销售服务费		-	-
4.交易费用		7,249,197.94	6,087,438.49
5.利息支出		-	-
其中:卖出回购金融资产支出		-	-
6.其他费用		223,222.98	228,328.45
三、利润总额(亏损总额以"-"号填列)		-40,564,390.39	-1,746,979.43
减:所得税费用		-	-
四、净利润(净亏损以"-"号填列)		-40,564,390.39	-1,746,979.43

6.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体:华宝兴业动力组合股票型证券投资基金

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)	2,300,873,714.87	-572,653,726.71	1,728,219,988.16
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	-40,564,390.39	-40,564,390.39
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)	-141,222,726.23	31,263,900.94	-109,958,825.29
其中:1.基金申购款	36,139,329.77	-7,796,220.42	28,343,109.35
2.基金赎回款	-177,362,056.00	39,060,121.36	-138,301,934.64
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)	2,159,650,988.64	-581,954,216.16	1,577,696,772.48
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)	2,509,798,463.99	-647,760,821.48	1,862,037,642.51
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	-1,746,979.43	-1,746,979.43
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)	-136,994,804.42	28,529,355.94	-108,465,448.48
其中:1.基金申购款	38,699,042.08	-8,379,967.46	30,319,074.62
2.基金赎回款	-175,693,846.50	36,909,323.40	-138,784,523.10
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)	2,372,803,659.57	-620,978,444.97	1,751,825,214.60

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:

黄小憨 向辉 张幸骏

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

华宝兴业动力组合股票型证券投资基金(以下简称"本基金")经中国证券监督管理委员会(以下简称"中国证监会")证监基金字[2005]第162号《关于同意华宝兴业动力组合股票型证券投资基金募集的批复》核准,由华宝兴业基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《华宝兴业动力组合股票型证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式,存续期限不定,首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币535,344,206.95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(2005)第168号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《华宝兴业动力组合股票型证券投资基金基金合同》于2005年11月17日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为535,410,310.23份基金份额,其中认购资金利息折合66,103.28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《华宝兴业动力组合股票型证券投资基金基金合同》的有关规定,本基金的投资范围为国内依法公开发行、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60%-95%;债券占0%-40%;现金或者到期日在一年内的政府债券比例在5%以上。本基金的业绩比较基准为:上证180指数收益率与深证100指数收益率的流通市值加权平均×80%+上证国债指数收益率×20%。

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》、《华宝兴业动力组合股票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 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
中国银行股份有限公司("中国银行")	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。

6.4.8 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

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。

6.4.8.2 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 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	12,899,481.95	14,226,370.25
其中:支付销售机构的客户维护费	1,504,765.50	1,633,865.48

注:支付基金管理人华宝兴业的管理人报酬按前一日基金资产净值1.5%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 X 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 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	2,149,913.67	2,371,061.78

注:支付基金托管人中国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。

6.4.8.4 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 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	1,408,901.97	1,147,244.75
期间申购/买入总份额	-	261,657.22
期间因拆分变动份额	-	-
减:期间赎回/卖出总份额	5,742.72	-
期末持有的基金份额	1,403,159.25	1,408,901.97
期末持有的基金份额占基金总份额比例	0.06%	0.06%

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

6.4.8.4.2 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

本基金本期末及上年度末无除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况。

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 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
中国银行	185,294,285.79	984,643.76	151,304,386.61	1,548,094.42

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。

6.4.8.6 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。

6.4.8.7 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须作说明的其他关联交易事项。

6.4.9 期末(2013年6月30日)本基金持有的流通受限证券

6.4.9.1 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。

6.4.9.2 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
300165	天瑞仪器	2013年6月24日	重大资产重组	16.01	-	-	899,906	13,306,638.44	14,407,495.06	-
600983	合肥三洋	2013年5月14日	重大事项	9.96	2013年8月14日	10.90	519,153	5,032,285.91	5,170,763.88	-
300326	凯利泰	2013年6月17日	重大事项	35.55	2013年7月29日	39.11	60,000	2,014,561.00	2,133,000.00	-

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。

6.4.9.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.9.3.1 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。

6.4.9.3.2 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。

6.4.10 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且其变动计入当期损益的金融资产中属于第一层级的余额为1,377,498,293.37 元,无属于第二层级和第三层级的余额。(2012年12月31日:第一层级1,579,016,383.04元,属于第二层级的余额为44,641,172.40元,无属于第三层级的余额)。

(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	1,227,498,293.37	77.32
	其中:股票	1,227,498,293.37	77.32
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	150,000,000.00	9.45
	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	196,766,790.57	12.39
6	其他各项资产	13,262,734.79	0.84
7	合计	1,587,527,818.73	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	12,809,451.00	0.81
B	采矿业	17,648,723.95	1.12
C	制造业	952,502,832.20	60.37
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	5,630,000.00	0.36
E	建筑业	15,663,525.68	0.99
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	7,852,000.00	0.50
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	41,930,523.14	2.66
J	金融业	104,675,966.48	6.63
K	房地产业	37,394,908.75	2.37
L	租赁和商务服务业	15,982,635.77	1.01
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	15,407,726.40	0.98
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	1,227,498,293.37	77.80

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	600519	贵州茅台	350,000	67,329,500.00	4.27
2	002104	恒宝股份	3,599,729	46,472,501.39	2.95
3	600809	山西汾酒	1,599,721	39,193,164.50	2.48
4	000858	五 粮 液	1,600,000	32,064,000.00	2.03
5	002436	兴森科技	1,900,000	32,015,000.00	2.03
6	600199	金种子酒	2,299,947	31,072,283.97	1.97
7	000568	泸州老窖	1,289,899	30,673,798.22	1.94
8	601788	光大证券	2,899,899	29,578,969.80	1.87
9	300263	隆华节能	1,680,000	27,602,400.00	1.75
10	600030	中信证券	2,599,920	26,337,189.60	1.67

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

|