

华宝兴业大盘精选股票型证券投资基金

【2013】半年度报告摘要

随着前期悲观情绪宣泄,短期流动性最为紧张的时间已经过去,同时将于下半年召开的十八届三中全会也会激发市场对于经济改革的憧憬,我们预计市场走势有望企稳,并在环保、新能源、大众消费、医药、铁路设备、国防军工及设备等板块中孕育结构性机会。

本基金计划在下半年增持核心仓位,持续调整结构,并在契约规定的范围内进一步优化大价值与大盘成长之间的配置,深度挖掘估值较低、盈利确定改善的板块和个股。

4.6 管理人对于报告期内基金估值程序等事项的说明

基金管理人对于报告期内基金估值程序事项,公司内部参与估值流程的相关各方职责分工如下:

(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,并在估值时须考虑进行研究所提供的关于上市公司估值调整的结果所提出的建议意见。

(三)估值委员会:定期评估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)、必要时基金经理或估值委员会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 管理人对于报告期内基金利润分配情况的说明

本基金报告期内未进行利润分配,符合相关法规和基金合同的约定。

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵循诚信原则,严格按照《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约定,不存在任何损害基金份额持有人利益的行为,完全尽到了受托人应尽的义务。

5.2 托管人对于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

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约定,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 托管人对本季度报告期内基金投资信息真实、准确和完整发表意见

管理人对于报告期内基金投资信息真实、准确和完整发表意见,符合相关法律法规、基金合同和托管协议的约定,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。

5.4 托管人对本季度报告期内基金投资信息真实、准确和完整发表意见

管理人对于报告期内基金投资信息真实、准确和完整发表意见,符合相关法律法规、基金合同和托管协议的约定,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。

§ 6 半年度财务数据(未经审计)

6.1 资产负债表

单位:人民币元

项目	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		66,544,838.56	59,168,474.80
结算备付金		1,731,964.07	1,756,026.60
存出保证金		398,053.08	47,034.80
交易性金融资产		414,452,072.37	635,963,427.50
其中:股票投资		414,452,072.37	635,963,427.50
基金投资		-	-
债券投资		-	-
衍生金融资产		-	-
买入返售金融资产		-	-
应收证券清算款		-	-
应收利息		14,103.60	19,230.08
应收股利		-	-
应收申购款		117,693.80	106,584.23
递延所得税资产		-	-
其他资产		-	-
资产总计		483,258,725.48	697,060,778.01

负债和所有者权益

项目	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		-	-
应付赎回款		270,393.02	1,303,326.39
应付管理人报酬		622,404.70	801,243.22
应付托管费		103,734.06	133,540.55
应付销售服务费		-	-
应付交易费		2,745,734.35	2,236,994.16
应付税费		-	-
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		161,466.59	330,887.52
其他负债		3,903,732.72	8,488,112.17
负债合计		4,832,732.72	10,957,618.06
所有者权益:			
实收基金		362,201,530.54	515,411,649.30
未分配利润		117,153,462.22	173,161,016.30
所有者权益合计		479,354,992.76	683,572,665.84
负债和所有者权益总计		483,258,725.48	697,060,778.01

6.2 利润表

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		6,995,404.67	76,181,855.24
1.利息收入		366,099.77	483,034.32
其中:存款利息收入		314,473.36	363,880.14
债券利息收入		532.01	80.48
资产支持证券利息收入		51,094.40	119,073.70
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)		26,372,128.12	27,580,913.26
其中:股票投资收益		23,313,856.94	23,231,437.33
基金投资收益		-	-
债券投资收益		147,802.99	29,295.52
资产支持证券投资		-	-
衍生工具损益		-	-
股利收入		2,910,468.19	4,320,180.41
3.公允价值变动收益(损失以“-”号填列)		-20,002,595.62	47,806,495.92
4.汇兑收益(损失以“-”号填列)		-	-
5.其他收入(损失以“-”号填列)		259,772.40	311,414.74
二、费用		9,439,113.42	9,783,587.45
1.管理人报酬		4,292,240.08	5,443,190.30
2.托管费		715,373.23	907,198.38
3.销售服务费		-	-
4.交易费用		4,252,071.34	3,253,588.42
5.利息支出		-	-
其中:卖出回购金融资产支出		-	-
6.其他费用		179,428.77	179,610.35
三、利润总额(亏损总额以“-”号填列)		-2,443,708.75	66,398,267.79
减:所得税费用		-	-
四、净利润(净亏损以“-”号填列)		-2,443,708.75	66,398,267.79

6.3 所有者权益(基金净值)变动表

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	所有者权益合计
一、期初所有者权益(基金净值)		515,411,649.54	173,161,016.30
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)		-	-2,443,708.75
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)		-153,210,119.00	-53,563,845.33
其中:1.基金申购款		44,661,127.48	63,209,514.73
2.基金赎回款		-197,871,246.48	-172,232,582.08
四、本期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)		362,201,530.54	117,153,462.22

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

华宝兴业大盘精选股票型证券投资基金(以下简称“本基金”),系经中国证监会2008年12月31日批准设立,并经中国证监会核准,由华宝兴业基金管理有限公司(以下简称“管理人”)发起设立,并经中国证监会核准,由华宝兴业基金管理有限公司(以下简称“管理人”)担任基金管理人,由中国银行股份有限公司担任基金托管人,本基金自2008年10月13日起正式运作。

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(%)	金额单位:人民币元
1	000002	万科A	36,386,886.04	5.28	
2	000019	浦发银行	36,009,577.04	5.23	
3	600012	南玻A	34,521,292.39	5.01	
4	600519	贵州茅台	25,999,029.30	3.78	
5	000001	平安银行	24,904,486.35	3.62	
6	002594	比亚迪	24,569,643.24	3.57	
7	000063	中兴通讯	24,090,993.26	3.50	
8	600033	三一重工	22,125,419.23	3.21	
9	601318	中国平安	21,877,885.46	3.18	
10	600383	金地集团	20,168,116.66	2.93	
11	600015	华夏银行	19,110,846.00	2.78	
12	600016	民生银行	17,799,282.50	2.58	
13	600309	万华化学	17,252,300.03	2.51	
14	600153	建发股份	16,936,146.54	2.46	
15	601166	DR兴业银	16,847,105.20	2.45	
16	600028	中国石化	16,586,903.29	2.41	
17	002415	海康威视	16,249,692.08	2.36	
18	000400	许继电气	16,199,242.56	2.35	
19	600408	保利地产	15,079,302.68	2.19	
20	002303	美盛森	14,788,142.29	2.15	
21	601111	中国国航	13,861,500.00	2.01	

注:买入金额不包括相关交易费用

7.2.2 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

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(%)	金额单位:人民币元
1	600000	浦发银行	67,112,906.87	9.75	
2	600116	民生银行	46,577,335.86	6.76	
3	601328	交通银行	41,454,349.04	6.02	
4	600015	华夏银行	40,800,632.92	5.93	
5	601166	DR兴业银	36,900,958.04	5.36	
6	600519	贵州茅台	34,803,460.34	5.05	
7	002375	安图医疗	33,301,408.34	4.84	
8	000002	万科A	31,954,971.49	4.57	
9	600309	万华化学	30,360,754.37	4.40	
10	002547	春兴精工	28,636,520.02	4.16	
11	000063	中兴通讯	26,698,753.22	3.88	
12	000001	平安银行	26,620,043.08	3.87	
13	600741	华城汽车	23,905,140.77	3.47	
14	600031	三一重工	22,456,362.86	3.26	
15	600498	烽火通信	21,736,603.82	3.16	
16	002146	荣盛发展	21,581,498.37	3.13	
17	601299	中国北车	20,087,572.31	3.06	
18	600436	片仔癀	21,462,027.68	3.12	
19	601318	中国平安	19,473,931.83	2.83	
20	600104	上汽集团	18,111,213.15	2.69	
21	000002	万科A	18,354,547.48	2.67	
22	600383	金地集团	17,721,541.48	2.57	
23	600805	信达投资	17,520,050.96	2.54	
24	600660	福耀玻璃	16,797,322.39	2.44	
25	600048	保利地产	16,596,698.52	2.41	
26	600028	中国石化	16,589,642.64	2.41	
27	600166	福田汽车	16,260,058.03	2.36	
28	600153	建发股份	16,058,349.87	2.33	
29	600352	浙江广厦	14,011,813.62	2.05	
30	601006	大秦铁路	13,989,083.41	2.03	
31	002285	赛轮轮胎	13,837,561.92	2.01	

注:卖出金额不包括相关交易费用

7.3 基金资产净值及基金份额净值

7.3.1 基金资产净值

7.3.2 基金份额净值

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(%)	金额单位:人民币元
1	600000	浦发银行	67,112,906.87	9.75	
2	600116	民生银行	46,577,335.86	6.76	
3	601328	交通银行	41,454,349.04	6.02	
4	600015	华夏银行	40,800,632.92	5.93	
5	601166	DR兴业银	36,900,958.04	5.36	
6	600519	贵州茅台	34,803,460.34	5.05	
7	002375	安图医疗	33,301,408.34	4.84	
8	000002	万科A	31,954,971.49	4.57	
9	600309	万华化学	30,360,754.37	4.40	
10	002547	春兴精工	28,636,520.02	4.16	
11	000063	中兴通讯	26,698,753.22	3.88	
12	000001	平安银行	26,620,043.08	3.87	
13	600741	华城汽车	23,905,140.77	3.47	
14	600031	三一重工	22,456,362.86	3.26	
15	600498	烽火通信	21,736,603.82	3.16	
16	002146	荣盛发展	21,581,498.37	3.13	
17	601299	中国北车	20,087,572.31	3.06	
18	600436	片仔癀	21,462,027.68	3.12	
19	601318	中国平安	19,473,931.83	2.83	
20	600104	上汽集团	18,111,213.15	2.69	
21	000002	万科A	18,354,547.48	2.67	
22	600383	金地集团	17,721,541.48	2.57	
23	600805	信达投资	17,520,050.96	2.54	
24	600660	福耀玻璃	16,797,322.39	2.44	
25	600048	保利地产	16,596,698.52	2.41	
26	600028	中国石化	16,589,642.64	2.41	
27	600166	福田汽车	16,260,058.03	2.36	
28	600153	建发股份	16,058,349.87	2.33	
29	600352	浙江广厦	14,011,813.62	2.05	
30	601006	大秦铁路	13,989,083.41	2.03	
31	002285	赛轮轮胎	13,837,561.92	2.01	

注:买入金额不包括相关交易费用

7.4 基金资产净值及基金份额净值

7.4.1 基金资产净值

7.4.2 基金份额净值

7.5 期末基金份额净值

7.6 期末基金份额净值

7.7 期末基金份额净值

7.8 期末基金份额净值

7.9 期末基金份额净值

7.10 期末基金份额净值

7.11 期末基金份额净值

7.12 期末基金份额净值

7.13 期末基金份额净值

7.14 期末基金份额净值

7.15 期末基金份额净值

7.16 期末基金份额净值

7.17 期末基金份额净值

7.18 期末基金份额净值

7.19 期末基金份额净值

7.20 期末基金份额净值

7.21 期末基金份额净值

7.22 期末基金份额净值

7.23 期末基金份额净值

7.24 期末基金份额净值

7.25 期末基金份额净值

7.26 期末基金份额净值

7.27 期末基金份额净值

7.28 期末基金份额净值

7.29 期末基金份额净值

7.30 期末基金份额净值

7.31 期末基金份额净值

7.32 期末基金份额净值

7.33 期末基金份额净值

7.34 期末基金份额净值

7.35 期末基金份额净值

7.36 期末基金份额净值

7.37 期末基金份额净值

7.38 期末基金份额净值

7.39 期末基金份额净值

7.40 期末基金份额净值

7.41 期末基金份额净值

7.42 期末基金份额净值

7.43 期末基金份额净值

7.44 期末基金份额净值

7.45 期末基金份额净值

7.46 期末基金份额净值

7.47 期末基金份额净值

7.48 期末基金份额净值

7.49 期末基金份额净值

7.50 期末基金份额净值

7.51 期末基金份额净值

7.52 期末基金份额净值

7.53 期末基金份额净值

7.54 期末基金份额净值

7.55 期末基金份额净值

7.56 期末基金份额净值

7.57 期末基金份额净值

7.58 期末基金份额净值

7.59 期末基金份额净值

7.60 期末基金份额净值

7.61 期末基金份额净值

7.62 期末基金份额净值

7.63 期末基金份额净值

7.64 期末基金份额净值

7.65 期末基金份额净值

7.66 期末基金份额净值

7.67 期末基金份额净值

7.68 期末基金份额净值

7.69 期末基金份额净值

7.70 期末基金份额净值

7.71 期末基金份额净值

7.72 期末基金份额净值

7.73 期末基金份额净值

7.74 期末基金份额净值

7.75 期末基金份额净值

7.76 期末基金份额净值

7.77 期末基金份额净值

7.78 期末基金份额净值

7.79 期末基金份额净值

7.80 期末基金份额净值

7.81 期末基金份额净值

7.82 期末基金份额净值

7.83 期末基金份额净值

7.84 期末基金份额净值

7.85 期末基金份额净值

7.86 期末基金份额净值

7.87 期末基金份额净值

7.88 期末基金份额净值