华宝兴业成熟市场动量优选证券投资基金

【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	华宝兴业成熟市场动量优选证券投资基金
基金简称	成熟市场动量优选
基金主代码	241002
交易代码	241002
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2011年3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	中国银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	53,241,787.66份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金通过投资于发达市场交易型开放式基金(ETF)等金融工具，在国际范围内分散投资风险，追求基金资产长期增值。
投资策略	本基金的投资策略主要分为资产配置策略和单个金融产品选择策略两个部分，其中，将基金资产在全球成熟金融市场的股票类资产和债券类资产之间进行配置将是本基金获取超额收益的主要来源。
业绩比较基准	50%MSCI全球指数(此处指全收益指数)+50%花旗全球政府债券指数。
风险收益特征	本基金的风险收益特征类似于全球平衡型基金，属于中等预期风险和收益的证券投资品种，其预期风险和收益水平低于全球股票型基金，高于债券基金和货币市场基金。

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 境外投资顾问和境外资产托管人

项目		境外投资顾问	境外资产托管人
名称	英文	Lyxor Asset Management S.A.	Bank of China(Hong Kong)
	中文	领先资产管理公司	中国银行(香港)有限公司
注册地址		17 cours Valmy,Tours Societe Generale,92800 Puteaux,France	香港花园道1号中银大厦
办公地址		17 cours Valmy,Tours Societe Generale,92800 Puteaux,France	香港花园道1号中银大厦

2.5 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	-668,469.58
本期利润	2,534,410.76
加权平均基金份额本期利润	0.0415
本期加权平均净值利润率	4.31%
本期基金份额净值增长率	3.67%
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	-5,303,961.07
期末可供分配基金份额利润	-0.0996
期末基金资产净值	51,191,842.65
期末基金份额净值	0.961
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	-3.90%

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、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。

4、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)。

3.2 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

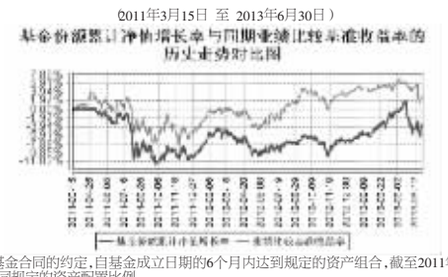
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	-0.41%	0.97%	-1.52%	0.79%	1.11%	0.18%
过去三个月	-1.03%	0.81%	-2.55%	0.52%	1.52%	0.29%
过去六个月	3.67%	0.62%	-0.49%	0.43%	4.16%	0.19%
过去一年	5.37%	0.50%	4.14%	0.42%	1.23%	0.08%
自基金合同生效日起至今	-3.90%	0.59%	2.67%	0.60%	-6.57%	-0.01%

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：50%MSCI全球指数(此处指全收益指数)+50%花旗全球政府债券指数。

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

(2011年3月15日至2013年6月30日)



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2011年9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(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、华宝金砖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		
尤柏年	本基金基金经理、华宝油气基金经理	2011年3月15日	2013年6月18日	10年	博士，曾在澳大利亚BConnect公司Apex投资咨询团队从事投资、金融工程模型开发、资产配置、行业研究等工作。2007年6月加入华宝兴业基金管理有限公司任金融工程部高级数量分析师，2008年8月起任海外投资部高级分析师，2009年3月至2011年3月任华宝兴业海外中国成长股票型证券投资基金基金经理助理兼任高级分析师，2011年3月至2013年6月任华宝兴业成熟市场QDII基金经理，2011年9月至2013年6月任华宝兴业标普石油天然气上游股票指数证券投资基金(LOF)基金经理。
周晶	策略部总经理、本基金基金经理	2013年6月18日	-	7年	博士。先后在美国德州奥斯丁市德亚资本、泛太平洋证券(美国)和汇丰证券(美国)从事数量分析、另类投资分析和证券投资研究工作。2005年至2007年在华宝兴业基金管理有限公司任内控审计风险管理部主管。2011年再次加入华宝兴业基金管理有限公司任策略部总经理兼首席策略分析师。2013年6月起兼任华宝兴业成熟市场QDII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 境外投资顾问为本基金提供投资建议的主要成员简介

姓名	在境外投资顾问所任职位	证券从业年限	说明
Guillaume Lasserre	领先资产量化多资产组合管理部(Systematic Multi assets portfolio management)总经理兼机构方案部(Dedicated Solutions)联席负责人	10年	Guillaume Lasserre先生于2009年10月加入领先资产的量化多资产团队，担任组合经理一职。2004年，Lasserre先生的职业生涯开始于法兴资产的量化研究员一职，主要负责组合保险策略以及基金权证方面的研究工作。2006年，Lasserre先生作为量化工程师加入法兴资产另类投资的产品设计团队，负责为共同基金以及对冲基金的结构化产品定价。Lasserre先生拥有巴黎第七大学的金融数学博士学位。

4.3 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》、《合格境内机构投资者境外证券投资管理试行办法》及其各项实施细则、《华宝兴业成熟市场动量优选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，成熟市场动量优选基金在短期内出现过持有的现金与到期日在一年之内的政府债券市值占基金资产净值比低于5%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。

4.4 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.4.1 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。

4.4.2 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。

4.5 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.5.1 报告期内基金投资策略和运作分析

我们在13年上半年，维持了对美国和日本股市的重仓配置，主要是基于对美国经济基本面改善的看好和对日本安倍经济新政的效果有所期待。一季度这一策略获得了成功，美日股市均稳步上扬，以人民币计价，成熟市场股票指数MSCI WORLD一季度上涨了5.43%。但在二季度，海外成熟市场股市波动较1季度明显加大，以人民币计价，成熟市场股票指数MSCI WORLD在单季度下跌了-1.50%。总体来看，今年以来美国市场经济复苏势头持续，就业和房产数据屡超预期，而“财政悬崖”法案中的征税和支出削减对经济的不利影响明显低于预期，这些都是符合我们预期的。但美联储在六月的议息会议上开始讨论QE的退出时间表，这直接导致了美国，乃至全球股市的短期下挫。不过最近伯南克连番温和的评论表明联储内部目前对于QE退出并没有形成统一的时间表，QE的退出可能会是一个缓慢的过程，因此美国市场在短期下挫之后，开始了稳健的反弹，估计从目前到年底，影响美股的主要因素应该还是经济数据和企业盈利，QE的退出应该是十二月之后的事情。

而在日本，安倍首相的经济新政前两部分，即宽松的金融政策和积极的财政政策都稳步推进，而从实体经济来看，一系列经济数据也让人满意，因此今年以来日本股市总体上维持了去年的强势。但是五月中日本国债收益率的突然飙升导致投资者担忧日本的债务问题恶化，从而引发了日股的一轮大规模下挫。不过最近这轮恐慌情绪已经有所缓解，而安倍在最近的参议院选举中获得的决定性胜利将帮助其完成剩余的新政，对日本股市也有比较积极的促进作用。

而对于欧洲而言，我们认为，随着欧央行推行OMT计划，承担了欧洲各国的最后借款人地位之后，欧债再度出现大规模危机的可能性下降。但是由于欧债危机的后遗症，各国经济恢复将比较缓慢，特别是对于边缘国家而言，为了获得欧盟援助而承诺的财政减赤政策将会严重影响后续的经济复苏。因此，我们上半年避免了投资欧洲股市，目前来看这一操作也是成功的。

在市场出现波动的时候，我们基于对美日两国宏观的中长期看法，并没有急速从股市上减仓。从实际效果来看，我们的策略基本成功，在股票市场上取得了一定的超额收益。而对于海外债券市场，我们今年以来一直认为随着美联储QE退出预期的增强，债市的前景并不明朗，因此在债券上采取了降低配置，缩短久期的策略，这样的策略在上半年也为基金取得了超额收益。

4.5.2 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3.67%，同期业绩比较基准收益率为-0.49%，基金表现领先于业绩比较基准4.16%。

4.6 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望下半年，我们仍然对成熟市场的股市保持看好。我们认为对于美国而言，QE退出目前还言之过早，联储真正开始有所行动，很有可能要等到12月的联储议息会议上。在此之前美国股票市场在一系列经济数据令人满意的前提下，还可能继续攀升。而对于日本而言，随着安倍首相在七月二十一日的大选中获胜，其将继续推行其经济改革中的第三步：即鼓励民间投资的成长策略，这将利好于日本经济，对日本股市形成有力的支撑。而对于欧洲市场而言，10月德国大选临近之前，由于政策上的不确定性，有可能会出现向下的波动，但是从目前欧央行的态度来看，其有进一步货币宽松的意愿。因此我们判断在德国大选之后，欧央行很有可能推出新一轮的量化宽松政策，从而推动欧洲市场向上。因此，在配置上我们准备继续维持对美国和日本股市的重点配置，并密切关注欧央行的动向，可能于四季度开始逐步增加对欧洲股市的配置。不过我们认为，今年往后风险会比上半年要大，因此我们也会密切关注海外市场形势变化，随时对股票仓位进行有效的调整。

4.7 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。

4.8 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”)在对华宝兴业成熟市场动量优选证券投资基金(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：华宝兴业成熟市场动量优选证券投资基金

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		2,873,429.46	24,854,013.17
结算备付金		-	-
存出保证金		-	-
交易性金融资产		37,115,863.39	39,879,313.44
其中：股票投资		-	-
基金投资		37,115,863.39	39,879,313.44
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		-	-
应收证券清算款		11,266,153.04	-
应收利息		323.55	163.81
应收股利		83,424.87	143,615.25
应收申购款		61,210.25	694.06
递延所得税资产		-	-
其他资产		-	-
资产总计		51,400,404.56	64,877,799.73
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		-	2,055,911.62
应付赎回款		66,622.15	156,462.07
应付管理人报酬		63,015.94	79,682.19
应付托管费		12,603.16	15,936.41
应付销售服务费		-	-
应付交易费用		-	-
应交税费		-	-
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债		66,320.66	390,471.27
负债合计		208,561.91	2,698,463.56
所有者权益：			
实收基金		53,241,787.66	67,069,091.41
未分配利润		-2,049,945.01	-4,889,755.24
所有者权益合计		51,191,842.65	62,179,336.17
负债和所有者权益总计		51,400,404.56	64,877,799.73

注：报告截止日2013年6月30日，基金份额净值0.961元，基金份额总额53,241,787.66份。

6.2 利润表

会计主体：华宝兴业成熟市场动量优选证券投资基金

本报告期：2013年1月1日至2013年6月30日

单位：人民币元

资产	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		3,169,944.65	2,839,441.02
1.利息收入		5,369.42	52,003.64
其中：存款利息收入		5,369.42	19,945.08
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		-	32,058.56
其他利息收入		-	-
2.投资收益(损失以“-”填列)		578,575.08	652,023.19
其中：股票投资收益		-	-
基金投资收益		384,907.86	197,203.02
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		193,667.22	454,820.17
3.公允价值变动收益(损失以“-”号填列)		3,202,880.34	2,355,021.06
4.汇兑收益(损失以“-”号填列)		-626,196.24	-257,712.05
5.其他收入(损失以“-”号填列)		9,316.05	38,105.18
减：二、费用		635,533.89	992,727.89
1.管理人报酬		437,581.69	631,889.59
2.托管费		87,516.28	126,377.89
3.销售服务费		-	-
4.交易费用		41,130.28	82,062.28
5.利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6.其他费用		69,305.64	152,398.13
三、利润总额(亏损总额以“-”号填列)		2,534,410.76	1,846,713.13
减：所得税费用		-	-
四、净利润(净亏损以“-”号填列)		2,534,410.76	1,846,713.13

6.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体：华宝兴业成熟市场动量优选证券投资基金

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)	67,069,091.41	-4,889,755.24	62,179,336.17
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	2,534,410.76	2,534,410.76
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)	-13,827,303.75	305,399.47	-13,521,904.28
其中：1.基金申购款	1,201,610.93	-32,858.28	1,168,752.65
2.基金赎回款	-15,028,914.68	338,257.75	-14,690,656.93
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)	53,241,787.66	-2,049,945.01	51,191,842.65
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)	94,928,384.27	-10,313,209.61	84,615,174.66
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	1,846,713.13	1,846,713.13
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)	-19,378,353.35	1,814,740.68	-17,563,612.67
其中：1.基金申购款	21,644,289.95	-1,103,388.34	20,540,901.61
2.基金赎回款	-41,022,643.30	2,918,129.02	-38,104,514.28
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)	75,550,030.92	-6,651,755.80	68,898,275.12

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：

黄小薏　　闾辉　　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

华宝兴业成熟市场动量优选证券投资基金(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”)证监许可[2010]第1694号《关于核准华宝兴业成熟市场动量优选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《华宝兴业成熟市场动量优选证券投资基金基金合同》向贵公开募集。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564,724,606.46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[2011]第082号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《华宝兴业成熟市场动量优选证券投资基金基金合同》于2011年3月15日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为564,846,643.58份基金份额，其中认购资金利息折合122,037.12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，境外资产托管人为中国银行(香港)有限公司，境外投资顾问为领先资产管理有限公司(Lyxor Asset Management S.A.)。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》、《合格境内机构投资者境外证券投资管理试行办法》和《华宝兴业成熟市场动量优选证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括已与中国证监会签署双边监管合作谅解备忘录的国家或地区证券监管机构登记注册的交易型开放式基金(ETF)、债券、货币市场工具以及中国证监会允许本基金投资的其他金融工具。其中，ETF的标的市场是美洲、欧洲、及亚太地区的发达国家和地区。具体为澳大利亚、奥地利、比利时、加拿大、丹麦、芬兰、法国、德国、希腊、香港特别行政区、爱尔兰、意大利、日本、荷兰、新西兰、挪威、葡萄牙、新加坡、西班牙、瑞典、瑞士、美国和美国。在正常市场情况下，本基金各类资产配置的比例范围是：ETF占基金资产的比例为60%-95%，债券、现金及中国证监会允许的其它投资品种的比例为基金资产的5%-40%。本基金的业绩比较基准为：MSCI全球指数(此处指全收益指数)×50%+花旗全球政府债券指数×50%。

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》、《华宝兴业成熟市场动量优选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年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06月30日的财务状况以及2013年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[2008]1号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》及其他相关境内外税务法规和实务操作，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)目前基金取得的源自境外的差价收入，其涉及的境外所得税收政策，按照相关国家或地区税收法律和法规执行，在境内暂免征企业所得税。

(3)目前基金取得的源自境外的股利收益，其涉及的境外所得税收政策，按照相关国家或地区税收法律和法规执行，在境内暂不征收个人所得税。

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
中国银行(香港)有限公司(“中银香港”)	境外资产托管人
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、境外投资顾问
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	437,581.69	631,889.59
其中：支付销售机构的客户维护费	204,075.05	275,235.69

注：支付基金管理人华宝兴业的管理人报酬(包括投资顾问费)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 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	87,516.28	126,377.89

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0.3%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：日托管费=前一日基金资产净值×0.3%/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

单位：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	167,877.09	167,877.09
期间申购/买入总份额	-	0.00
期间因拆分变动份额	-	-
减：期间赎回/卖出总份额	71,886.96	-
期末持有的基金份额	95,990.13	167,877.09
期末持有的基金份额占基金总份额比例	0.18%	0.22%

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 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	1,798,244.89	5,369.42	3,421,735.71	19,571.35
中国银行(香港)有限公司	1,075,184.57	-	23,505,173.19	-

注：本基金的银行存款分别由基金托管人中国银行和境外资产托管人中国银行(香港)有限公司保管，按适用利率或约定利率计息。

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

本基金本期末持有因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券。

6.4.9.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金本期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

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37,115,863.39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39,879,313.44元，无属于第二层级和第三层级的余额)。

(iii)公允价值所属层级间的重大变动

本基金本期及上年度可比期间持有的以公允价值计量的金融工具的公允价值所属层级未发生重大变动。

(iv)第三层级公允价值余额和本期变动金额

无。

(c)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	-	-
	其中：普通股	-	-
	存托凭证	-	-
	优先股	-	-
	房地产信托凭证	-	-
2	基金投资	37,115,863.39	72.21
3	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	资产支持证券	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
	其中：远期	-	-
	期货	-	-
	期权	-	-
	权证	-	-
5	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
6	货币市场工具	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	2,873,429.46	5.59
8	其他各项资产	11,411,111.71	22.20
9	合计	51,400,404.56	100.00

7.2 期末在各个国家(地区)证券市场的权益投资分布

本基金本报告期末未持有权益投资。

7.3 期末按行业分类的权益投资组合

本基金本报告期末未持有权益投资。

7.4 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名权益投资明细

本基金本报告期末未持有权益投资。

7.5 报告期内权益投资组合的重大变动

7.5.1 累计买入金额超出期初基金资产净值2%或前20名的权益投资明细

本基金本报告期未买入权益投资。

7.5.2 累计卖出金额超出期初基金