华宝兴业先进成长股票型证券投资基金 2009年半年度报告摘要

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2009年1月1日起至2009年6月30日止。

2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金简称	华宝兴业先进成长股票
交易代码	240009
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2006年11月7日
报告期末基金份额总额	1,681,627,744.35份

2.2 基金产品说明

投资目标	分享我国经济增长方式转变过程中和转变完成后的先进企业的成长,在控制风险的前提下为基金份额持有人谋求长期超额回报。
投资策略	本基金将使用定量与定性相结合的方法,选择具备创新能力强、注重资源节约与环境友好、充分发挥人力资源优势这三个先进因素之一的企业进行投资,重点关注国家产业结构调整中鼓励类行业,同时也兼顾有先进企业的传统行业。
业绩比较基准	新上证综指收益率。
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较高风险品种。

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	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

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住所。

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(2009年1月1日-2009年6月30日)
本期已实现收益	298095778.85
本期利润	1938245772.62
加权平均基金份额本期利润	0.7089
本期基金份额净值增长率	53.43%
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)
期末可供分配基金份额利润	1.1420
期末基金资产净值	3602112095.43
期末基金份额净值	2.1420

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)。

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	13.03%	0.95%	12.48%	1.15%	0.55%	-0.20%
过去三个月	19.42%	1.09%	24.66%	1.41%	-5.24%	-0.32%
过去六个月	53.43%	1.37%	62.44%	1.80%	-9.01%	-0.43%
过去一年	12.47%	2.23%	8.09%	2.40%	4.38%	-0.17%
自基金合同生效起至今	114.20%	2.03%	57.00%	2.42%	57.20%	-0.39%

注: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

华宝兴业先进成长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

(2006年11月7日至2009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2007年5月7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(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		
吴丰树	本基金基金经理、华宝兴业行业精选股票基金基金经理	2009-5-14	-	6年	硕士,拥有CFA资格。2003年2月至2008年5月任中国国际金融有限公司研究部副总经理级研究员。2008年5月加入华宝兴业基金管理有限公司,同年9月至今任行业精选基金基金经理,2009年5月至今兼任华宝兴业先进成长股票基金基金经理。
魏东	本基金基金经理、宝康灵活配置基金基金经理、公司投资副总监、公司国内投资部总经理	2006-11-7	2009-5-14	12年	硕士。1997年至2002年,在平安证券公司、国信证券有限责任公司和深圳市深投科技创业投资有限公司从事证券研究工作和资产管理等工作。2003年初加入本公司,曾任交易部总经理。2004年5月至2009年5月任宝康灵活配置基金基金经理,2006年11月至2009年5月任先进成长基金基金经理。

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、《华宝兴业先进成长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组合同向交易价差的分析;分析结果没有发现交易价差异常。

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

截至2009年6月30日,本基金净值为2.142,半年的净值增长率为53.43%,表现落后于比较基准。

究其原因,最主要是因为本基金上半年的仓位较低,平均不足80%。虽然我们在前两个月成功地把握了一次市场的反弹机会,但3月份开始等待股市较大幅度的调整却是始终没有出现。总体而言,3月份开始的市场的上涨幅度和速度都大大超过预期。事后来看,很显然本基金对于这轮股市上涨的判断出现失误。我们原本以为经济的复苏应没有这么快,且复苏道路应是曲折的,随时都有可能会出现反复;但事实是,在政府推行的积极的财政政策和适度宽松的货币政策直接作用下,经济出现了意想不到的V型反弹,典型代表行业如汽车和地产,其恢复程度大大超过预期。正因为如此,投资者的信心大增,股市做多热情高涨;尤其是在2季度,在银行信贷巨额投放刺激下,资源和资产股得到市场大力追捧。但是,本基金在这些板块的配置力度却不够理想。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

下半年开始,本基金已经改变对于市场的保守态度;我们认为市场下半年很可能继续上行,虽然市场波动较上半年将会明显加大。首先,国内实体经济层面好转迹象已十分明显,不仅是全社会用电量同比增速在回升,经济刺激政策的效果已经真实体现在企业盈利的好转上。其次,发达经济体经济也在复苏,特别是美国经济,诸如房屋销售、非农就业人数、投资银行的盈利等等最近的一些数据表明,其经济复苏迹象十分明显。这对于中国出口部门的盈利好转十分有利。再者,我们认为流动性充裕的局面不会改变。且不说,国际资本向新兴市场的流入才开始没多久,国内储蓄搬家还未大规模出现;并且,随着经济复苏,我们相信国内市场货币流通速度将不断加快。当前,市场担心因前期银行信贷投放过大未来央行适度宽松的货币政策存在微调的可能,这一点我们不否认,但我们认为这将是以实体经济的企稳回升确立为前提。在我们看来,只要经济复苏的趋势能够持续,货币政策的调整只会造成股市的短期波动,而不会改变市场基本走势。

此外,我们认为,只要国内外经济复苏能否最终成功,目前的股票市场估值根本没有什么泡沫可言。在一个依然是低利率甚至是负的真实利率的状况下,目前A股市场的市盈率水平完全可以接受。因此,下半年我们将牢牢把握经济复苏这条主线,努力寻找盈利有可能超预期的公司,争取为投资人取得较好的投资回报。

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1.1420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")在对华宝兴业先进成长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)

6.1 资产负债表

会计主体:华宝兴业先进成长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		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		603,086,363.80	788,762,085.98
结算备付金		12,706,763.50	5,658,269.84
存出保证金		4,200,963.41	1,197,813.66
交易性金融资产		3,020,999,521.88	3,051,171,535.17
其中:股票投资		3,020,999,521.88	2,857,751,535.17
债券投资		-	193,420,000.00
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		7,423,291.78	3,408,021.02
应收利息		154,778.81	6,319,404.04
应收股利		828,630.00	-
应收申购款		102,363,359.52	11,340,527.22
递延所得税资产		-	-
其他资产		-	-
资产总计		3,751,763,672.70	3,867,857,656.93
负债和所有者权益		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		3,630,168.44	275,399.38
应付赎回款		126,604,389.61	5,148,628.77
应付管理人报酬		4,805,448.00	5,172,996.72
应付托管费		800,907.99	862,166.12
应付销售服务费		-	-
应付交易费用		12,635,618.19	5,506,948.71
应交税费		-	-
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债		1,175,045.04	902,043.43
负债合计		149,651,577.27	17,868,183.13
所有者权益:			
实收基金		1,681,627,744.35	2,757,619,360.29
未分配利润		1,920,484,351.08	1,092,370,113.51
所有者权益合计		3,602,112,095.43	3,849,989,473.80
负债和所有者权益总计		3,751,763,672.70	3,867,857,656.93

注:报告截止日2009年6月30日,基金份额净值2.1420元,基金份额总额1,681,627,744.35份。

6.2 利润表

会计主体:华宝兴业先进成长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	上年度可比期间 2008年1月1日-2008年6月30日
一、收入		2,005,563,306.29	-2,568,315,801.56
1.利息收入		9,999,514.24	13,773,353.65
其中:存款利息收入		3,246,834.80	7,403,213.99
债券利息收入		6,752,679.44	5,651,789.66
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	718,350.00
其他利息收入		-	-
2.投资收益(损失以"-"填列)		350,579,177.89	111,814,397.65
其中:股票投资收益		329,130,286.76	72,803,701.79
债券投资收益		-3,521,820.00	3,359,779.39
资产支持证券投资收益		-	-
衍生工具收益		-	2,828,030.87
股利收益		24,970,711.13	32,822,885.60
3.公允价值变动收益(损失以"-"号填列)		1,640,149,993.77	-2,696,299,487.84
4.汇兑收益(损失以"-"号填列)		-	-
5.其他收入(损失以"-"号填列)		4,834,620.39	2,395,934.98
二、费用(以"-"号填列)		-67,317,533.67	-121,862,177.21
1.管理人报酬		-36,076,882.77	-52,568,952.30
2.托管费		-6,012,813.81	-8,761,492.07
3.销售服务费		-	-
4.交易费用		-24,988,631.14	-59,876,388.92
5.利息支出		-	-381,442.32
其中:卖出回购金融资产支出		-	-381,442.32
6.其他费用		-239,205.95	-273,901.60
三、利润总额(亏损总额以"-"号填列)		1,938,245,772.62	-2,690,177,978.77
所得税费用(以"-"号填列)		-	-
四、净利润(净亏损以"-"号填列)		1,938,245,772.62	-2,690,177,978.77

6.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体:华宝兴业先进成长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)	2,757,619,360.29	1,092,370,113.51	3,849,989,473.80
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	1,938,245,772.62	1,938,245,772.62
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)	-1,075,991,615.94	-1,110,131,535.05	-2,186,123,150.99
其中:1.基金申购款	1,262,010,131.54	910,112,176.49	2,172,122,308.03
2.基金赎回款(以"-"号填列)	-2,338,001,747.48	-2,020,243,711.54	-4,358,245,459.02
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)	1,681,627,744.35	1,920,484,351.08	3,602,112,095.43

项目	上年度可比期间 2008年1月1日-2008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)	2,732,059,686.04	5,085,510,903.72	7,817,570,589.76
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	-2,690,177,978.77	-2,690,177,978.77
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)	301,362,849.05	348,323,965.48	649,686,814.53
其中:1.基金申购款	1,070,804,709.26	1,496,556,169.48	2,567,360,878.74
2.基金赎回款(以"-"号填列)	-769,441,860.21	-1,148,232,204.00	-1,917,674,064.21
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)	3,033,422,535.09	2,743,656,890.43	5,777,079,425.52

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 关联方关系

6.4.2.1 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。

6.4.2.2 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
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。

6.4.3 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.3.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.3.1.1 股票交易

金额单位:人民币元

关联方名称	本期 2009年1月1日-2009年6月30日		上年度可比期间 2008年1月1日-2008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	403,534,815.75	2.57%	1,933,029,471.77	10.46%

6.4.3.1.2 债券回购交易

金额单位:人民币元

关联方名称	本期 2009年1月1日-2009年6月30日		上年度可比期间 2008年1月1日-2008年6月30日	
	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例
华宝证券	-	-	500,000,000.00	55.56%

6.4.3.1.3 应支付关联方的佣金

金额单位:人民币元

关联方名称	本期 2009年1月1日-2009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	343,004.98	2.60%	343,004.98	2.60%
关联方名称	上年度可比期间 2008年1月1日-2008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	1,643,072.69	10.56%	1,501,202.31	11.30%

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、经手费和适用期间内由券商承担的证券风险结算基金后的净额列示。

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。

6.4.3.2 关联方报酬

6.4.3.2.1 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	上年度可比期间 2008年1月1日-2008年6月30日
当期应支付的管理费	36,076,882.77	52,568,952.30
其中:当期已支付	31,271,434.77	44,781,501.00
期末未支付	4,805,448.00	7,787,451.30

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。

6.4.3.2.2 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	上年度可比期间 2008年1月1日-2008年6月30日
当期应支付的托管费	6,012,813.81	8,761,492.07
其中:当期已支付	5,211,905.82	7,463,583.50
期末未支付	800,907.99	1,297,908.57

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X 0.25%/当年天数。

6.4.3.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

单位:人民币元

本期 2009年1月1日-2009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
中国银行	-	105,908,194.52	-	-	-	-
上年度可比期间 2008年1月1日-2008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
中国银行	-	-	-	-	361,000,000.00	381,442.32

6.4.3.4 各关联方投资本基金的情况

6.4.3.4.1 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 2009年1月1日-2009年6月30日	上年度可比期间 2008年1月1日-2008年6月30日
期初持有的基金份额	221,730.53	95,565.74
期间认购总份额	-	-
期间申购/买入总份额	-	126,164.79
期间因拆分增加的份额	-	-
期间赎回/卖出总份额	-	-
期末持有的基金份额	221,730.53	221,730.53
期末持有的基金份额占基金总份额比例	0.01%	0.0073%

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。

6.4.3.4.2 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。

6.4.3.5 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		上年度可比期间 2008年1月1日-2008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	603,086,363.80	3,145,273.47	355,373,094.95	7,194,938.42

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。

6.4.3.6 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。

6.4.4 期末(2009年6月30日)本基金持有的流通受限证券

6.4.4.1 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。

6.4.4.2 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证券。

6.4.4.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.4.3.1 银行间市场债券正回购

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

6.4.4.3.2 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。

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	3,020,999,521.88	80.52
	其中:股票	3,020,999,521.88	80.52
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	-	-
	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	615,793,127.30	16.41
6	其他资产	114,971,023.52	3.07
7	合计	3,751,763,672.70	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	178,188,626.20	4.95
C	制造业	1,020,316,884.79	28.33
C0	食品、饮料	317,263,075.59	8.81
C1	纺织、服装、皮毛	102,005,070.09	2.83
C2	木材、家具	-	-
C3	造纸、印刷	42,960,000.00	1.19
C4	石油、化学、塑胶、塑料	138,298,988.84	3.84
C5	电子	46,969,295.71	1.30
C6	金属、非金属	37,965,000.00	1.05
C7	机械、设备、仪表	300,632,022.76	8.35
C8	医药、生物制品	34,223,431.80	0.95
C99	其他制造业	-	-
D	电力、煤气及水的生产和供应业	181,815,694.85	5.05
E	建筑业	67,187,000.00	1.87
F	交通运输、仓储业	99,364,251.69	2.76
G	信息技术业	340,920,170.54	9.46
H	批发和零售贸易	259,588,235.64	7.21
I	金融、保险业	530,067,037.54	14.72
J	房地产业	107,018,045.13	2.97
K	社会服务业	180,769,575.50	5.02
L	传播与文化产业	-	-
M	综合类	55,764,000.00	1.55
	合计	3,020,999,521.88	83.87

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	601398	工商银行	27,000,000	146,340,000.00	4.06
2	002024	苏宁电器	8,838,504	142,034,759.28	3.94
3	000069	华侨城A	6,201,000	129,600,900.00	3.60
4	600050	中国联通	17,305,595	118,716,381.70	3.30
5	000527	美的电器	8,000,000	114,400,000.00	3.18
6	000063	中兴通讯	3,559,716	100,028,019.60	2.78
7	000338	潍柴动力	2,700,000	98,361,000.00	2.73
8	000858	五粮液	4,800,000	94,704,000.00	2.63
9	600036	招商银行	4,000,000	89,640,000.00	2.49
10	000002	万科A	7,000,000	89,250,000.00	2.48

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	601186	中国铁建	330,544,416.28	8.59
2	601166	兴业银行	284,843,179.39	7.40
3	601398	工商银行	277,386,227.91	7.20
4	601939	建设银行	259,013,158.68	6.73
5	600519	贵州茅台	251,161,548.09	6.52
6	000527	美的电器	214,445,771.37	5.57
7	600028	中国石化	204,874,207.04	5.32
8	000858	五粮液	192,476,411.87	5.00
9	600596	新安股份	164,426,790.87	4.27
10	600050	中国联通	157,174,150.06	4.08
11	601390	中国中铁	156,837,718.44	4.07
12	000568	泸州老窖	151,495,060.18	3.93
13	002024	苏宁电器	137,462,288.59	3.57
14	601766	中国南车	136,871,804.41	3.56
15	601628	中国人寿	135,635,107.21	3.52
16	000063	中兴通讯	122,605,745.32	3.18
17	000792	盐湖钾肥	122,579,449.81	3.18
18	600036	招商银行	121,020,463.45	3.14
19	002001	新和成	113,808,214.05	2.96
20	600030	中信证券	111,350,461.15	2.89
21	600031	三一重工	103,129,985.44	2.68
22	600000	浦发银行	102,295,408.20	2.66
23	600547	山东黄金	102,043,237.76	2.65
24	600216	浙江医药	94,276,982.08	2.45
25	600737	中粮屯河	93,819,241.39	2.44
26	600690	青岛海尔	93,410,320.41	2.43
27	000002	万科A	92,559,982.58	2.40
28	000417	合肥百货	89,964,460.36	2.34
29	601169	北京银行	85,382,781.89	2.22
30	600895	张江高科	83,485,416.51	2.17
31	000895	双汇发展	81,065,493.28	2.11
32	000987	广州友谊	77,309,764.11	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	600000	浦发银行	371,086,087.59	9.64
2	601166	兴业银行	314,868,816.61	8.18
3	600036	招商银行	296,626,459.30	7.70
4	000568	泸州老窖	284,396,724.87	7.39
5	601186	中国铁建	276,207,716.23	7.17
6	600309	烟台万华	249,353,008.38	6.48
7	601939	建设银行	248,524,762.00	6.46
8	600519	贵州茅台	247,245,656.86	6.42
9	600547	山东黄金	239,497,953.98	6.22
10	601398	工商银行	221,888,946.23	5.76
11	000069	华侨城A	219,790,700.09	5.71
12	601628	中国人寿	216,840,580.33	5.63
13	000001	深发展A	212,126,928.90	5.51
14	600028	中国石化	199,476,429.13	5.18
15	002001	新和成	180,929,709.62	4.70
16	601766	中国南车	177,475,615.25	4.61
17	000527	美的电器	175,371,193.63	4.56
18	000858	五粮液	171,021,707.31	4.44
19	000792	盐湖钾肥	170,867,785.88	4.44
20	000157	中联重科	162,219,941.52	4.21
21	000002	万科A	162,038,500.63	4.21
22	600596	新安股份	154,986,920.80	4.03
23	600489	中金黄金	148,624,931.51	3.86
24	600031	三一重工	147,325,257.69	3.83
25	600030	中信证券	145,384,293.22	3.78
26	601390	中国中铁	140,311,439.10	3.64
27	000012	南玻A	137,923,960.09	3.58
28	600048	保利地产	137,192,047.93	3.56
29	600005	武钢股份	129,507,957.42	3.36
30	600748	上实发展	122,687,089.46	3.19
31	600153	建发股份	122,532,083.58	3.18
32	000338	潍柴动力	112,836,586.37	2.93
33	601318	中国平安	112,310,968.90	2.92
34	601169	北京银行	103,521,168.37	2.69
35	600060	海信电器	102,529,500.27	2.66
36	600895	张江高科	90,913,084.15	2.36
37	600216