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:2011年8月29日

华宝兴业宝康债券投资基金

2011 半年度 报告摘要

2011年6月30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2011年8月22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2011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	华宝兴业宝康债券投资基金
基金简称	华宝兴业宝康债券
基金主代码	240003
交易代码	240003
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2003年7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	232,755,762.30份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	在保持投资组合低风险和充分流动性的前提下,确保基金财产安全及追求资产长期稳定增值。
投资策略	本基金将采用类属配置、久期偏离、收益率曲线配置和特定券种选择等积极投资策略,并把握市场创新机会。
业绩比较基准	中信标普全债指数。

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.cn
客户服务电话		400-700-5588.021-38924558	010—67595096
传真		021-38505777	010-66275853
注册地址		上海浦东世纪大道88号金茂大厦48楼	北京市西城区金融大街25号
办公地址		上海浦东世纪大道88号金茂大厦48楼	北京市西城区闹市口大街1号院1号楼
邮政编码		200121	100033
法定代表人		郑安国	郭树清

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(2011年1月1日-2011年6月30日)
本期已实现收益	3,146,612.27
本期利润	-3,447,107.23
加权平均基金份额本期利润	-0.0132
本期加权平均净值利润率	-1.14%
本期基金份额净值增长率	-1.22%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2011年6月30日)
期末可供分配利润	34,433,749.93
期末可供分配基金份额利润	0.1479
期末基金资产净值	267,189,512.23
期末基金份额净值	1.1479
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2011年6月30日)
基金份额累计净值增长率	79.55%

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

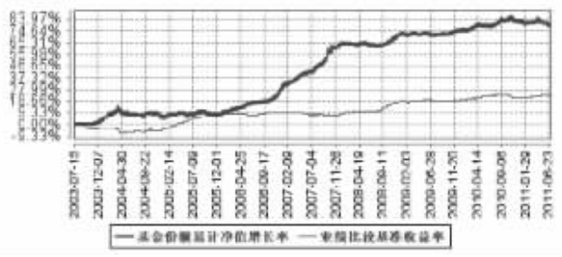
3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

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	-0.69%	0.14%	-0.14%	0.06%	-0.55%	0.08%
过去三个月	-1.06%	0.24%	0.53%	0.04%	-1.59%	0.20%
过去六个月	-1.22%	0.21%	1.33%	0.04%	-2.55%	0.17%
过去一年	0.83%	0.21%	0.40%	0.06%	0.43%	0.15%
过去三年	10.17%	0.15%	11.37%	0.08%	-1.20%	0.07%
自基金合同生效日起至今	79.55%	0.23%	23.02%	0.09%	56.53%	0.14%

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

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2004年1月15日,本系列基金下设的各基金均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(2011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以及可转债基金,所管理的开放式证券投资基金资产净值合计39,729,234,601.24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		
Tan Weisi	固定收益部总经理、宝康债券基金基金经理	2009年3月31日	-	16年	美国国籍。纽约大学理学博士,拥有CFA资格。曾在平资产管理公司、塞克资产管理公司、美国汇丰银行、彭博公司、普天寿证券公司、美林公司从事固定收益研究、交易和投资工作。2009年2月加入华宝兴业基金管理有限公司,任固定收益部总经理,2009年3月至今兼任华宝兴业宝康债券投资基金基金经理。
李栋梁	宝康债券基金基金经理	2011年6月28日	-	8年	硕士。曾在国联证券有限责任公司、华宝信托有限责任公司和太平资产管理有限公司从事固定收益的研究和投资,2010年9月加入华宝兴业基金管理有限公司担任债券分析师,2010年12月至2011年6月任华宝兴业宝康债券基金经理助理,2011年6月起担任华宝兴业宝康债券基金经理。

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、《华宝兴业宝康系列开放式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的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2011年年初以来宏观经济呈现增速小幅度下降、物价水平持续攀升的局面。为了控制通胀水平,央行持续采取紧缩的货币政策,除每月提高存款准备金率一次之外,央行在2月份和4月份两次提高金融机构人民币存贷款基准利率。债券收益率先上升后下降,然后再度上升,整体来看在一个小的区间内震荡。1至2月份受到高企的货币市场收益率和央行加息的双重影响,债券收益率持续攀升,随后货币市场收益率的快速下降带动了债券收益率的下降,4月份央行再度加息对债券收益率的冲击很小,6月份货币市场收益率再度高企,债券收益率也随之上升。

宝康债券基金投资策略以防御为主,缩短久期,调整信用债。利率产品方面以持有短期品种为主,6月份在利率产品收益率上升后尝试性的增加了中长期利率产品的仓位。信用产品方面减持了流动性较差以及期限相对较长的品种,同时增持了短期分离债。可转债方面以波段交易为主,1季度超配了以银行为主的可转债,4月份转债上涨之后大幅度降低了可转债的仓位。新股申购方面以选择个券为主,今年以来尤其是4月份股票市场下跌以来新股破发频率大幅度提高,同时申购中签率攀升。宝康债券基金参与了上交所上市新股的申购,年初申购的新股表现较好,后期申购的新股表现较差,给基金净值带来了损失,随后宝康债券基金对于新股申购趋于谨慎,仅参与了部分新股的网上申购,并抛售了解禁的网下配售新股。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

2011年上半年,本基金份额净值增长率为-1.22%,基金比较基准收益率为1.33%,基金在上半年落后基准2.55%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望下半年,我们认为,宏观经济增速将保持平稳增长,但要关注固定资产投资增速尤其是房地产投资增速和出口的波动;居民消费价格指数在3季度将保持较高水平,4季度有望下降,但绝对水平仍然不低。央行将继续实施紧缩的货币政策,公开市场操作将取代存款准备金率成为货币政策的主要工具,加息的可能性仍然存在。

近期央票、国债和金融债收益率快速上升,金融债隐含的税收利差接近历史高点,未来若通胀压力缓解且货币市场收益率下降,利率产品可能存在交易性机会。信用债仍将面临压力,信用债供给较多、市场要求信用风险溢价的上升和机构的去杠杆化都可能抑制信用债的表现,信用债收益率可能继续上升,信用利差继续扩大;中长期信用债相对短期的保护不足,短融是目前信用债中相对较好的品种。可转债经过持续的下跌之后已经具有较好的防御性,可转债存在投资机会。新股持续破发之后发行市盈率大幅度下降,新股申购的风险得到一定程度的释放,选择性参与新股申购可以带来增量收益。总得来说市场依然存在不确定性,我们会密切关注大类资产的表现,以改善业绩。

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

本基金本报告期末可供分配基金份额利润为人民币0.1479元,2011年1月18日本基金向基金持有人按每10份基金份额派发红利0.20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,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损害基金份额持有人利益的行为。

报告期内,本基金实施利润分配的金额为5,666,869.32元。

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:华宝兴业宝康债券投资基金

报告截止日:2011年6月30日

单位:人民币元

资产		本期末 2011年6月30日	上年度末 2010年12月31日
资产:			
银行存款		3,669,249.70	7,195,125.56
结算备付金		1,416,897.14	1,020,149.46
存出保证金		250,000.00	250,000.00
交易性金融资产		243,527,125.06	326,474,217.32
其中:股票投资		19,384,483.49	21,161,721.66
基金投资		-	-
债券投资		224,142,641.57	305,312,495.66
资产支持证券投资		-	-
衍生金融资产		-	-
买入返售金融资产		15,500,000.00	-
应收证券清算款		1,559,287.74	38,658,914.15
应收利息		4,294,306.03	5,108,834.38
应收股利		-	-
应收申购款		226,707.57	161,462.52
递延所得税资产		-	-
其他资产		-	-
资产总计		270,443,573.24	378,868,703.39
负债和所有者权益		本期末 2011年6月30日	上年度末 2010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		-	35,000,000.00
应付证券清算款		-	-
应付赎回款		731,949.79	1,952,954.50
应付管理人报酬		136,305.58	176,421.62
应付托管费		45,435.21	58,807.23
应付销售服务费		-	-
应付交易费用		337,722.04	247,905.48
应交税费		1,635,154.80	1,491,784.80
应付利息		-	34,027.80
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债		367,493.59	423,719.47
负债合计		3,254,061.01	39,385,620.90
所有者权益:			
实收基金		232,755,762.30	287,215,310.04
未分配利润		34,433,749.93	52,267,772.45
所有者权益合计		267,189,512.23	339,483,082.49
负债和所有者权益总计		270,443,573.24	378,868,703.39

注:报告截止日2011年6月30日,基金份额净值1.1479元,基金份额总额232,755,762.30份。

6.2 利润表

会计主体:华宝兴业宝康债券投资基金

本报告期:2011年1月1日至2011年6月30日

单位:人民币元

项目		本期 2011年1月1日至2011年6月30日	上年度可比期间 2010年1月1日至2010年6月30日
一、收入		-1,850,870.13	16,244,174.76
1.利息收入		3,971,704.81	11,968,685.53
其中:存款利息收入		58,724.79	406,218.67
债券利息收入		3,763,096.45	11,460,137.20
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		149,883.57	102,329.66
其他利息收入		-	-
2.投资收益(损失以"-"填列)		651,063.52	9,928,216.09
其中:股票投资收益		3,177,456.71	8,717,956.46
基金投资收益		-	-
债券投资收益		-2,778,231.37	1,203,209.57
资产支持证券投资收益		-	-
衍生工具收益		-	-
股利收益		251,838.18	7,050.06
3.公允价值变动收益(损失以"-"号填列)		-6,593,719.50	-6,108,057.57
4.汇兑收益(损失以"-"号填列)		-	-
5.其他收入(损失以"-"号填列)		120,081.04	455,330.71
减:二、费用		1,596,237.10	4,075,268.50
1.管理人报酬		904,171.46	2,384,926.07
2.托管费		301,390.48	794,975.36
3.销售服务费		-	-
4.交易费用		128,692.68	149,513.62
5.利息支出		134,569.80	632,314.16
其中:卖出回购金融资产支出		134,569.80	632,314.16
6.其他费用		127,412.68	113,539.29
三、利润总额(亏损总额以"-"号填列)		-3,447,107.23	12,168,906.26
减:所得税费用		-	-
四、净利润(净亏损以"-"号填列)		-3,447,107.23	12,168,906.26

6.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体:华宝兴业宝康债券投资基金

本报告期:2011年1月1日至2011年6月30日

单位:人民币元

项目	本期 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)	287,215,310.04	52,267,772.45	339,483,082.49
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	-3,447,107.23	-3,447,107.23
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)	-54,459,547.74	-8,720,045.97	-63,179,593.71
其中:1.基金申购款	29,627,138.67	4,823,541.96	34,450,680.63
2.基金赎回款	-84,086,686.41	-13,543,587.93	-97,630,274.34
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)	-	-5,666,869.32	-5,666,869.32
五、期末所有者权益(基金净值)	232,755,762.30	34,433,749.93	267,189,512.23
项目	上年度可比期间 2010年1月1日至2010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)	752,809,796.98	135,981,357.03	888,791,154.01
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	12,168,906.26	12,168,906.26
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)	-126,702,436.28	-20,273,596.19	-146,976,032.47
其中:1.基金申购款	271,185,542.57	41,777,772.01	312,963,314.58
2.基金赎回款	-397,887,978.85	-62,051,368.20	-459,939,347.05
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)	-	-28,923,448.40	-28,923,448.40
五、期末所有者权益(基金净值)	626,107,360.70	98,953,218.70	725,060,579.40

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_____ _____黄小蹙_____ _____张幸骏____

基金管理公司负责人 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

华宝兴业宝康系列开放式证券投资基金(以下简称"本系列基金")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[2003]第62号《关于同意华宝兴业宝康系列证券投资基金设立的批复》核准,由华宝兴业基金管理有限公司依照《证券投资基金管理暂行办法》及其实施细则、《开放式证券投资基金试点办法》等有关规定和《华宝兴业宝康系列开放式证券投资基金基金契约》后更名为《华宝兴业宝康系列开放式证券投资基金基金合同》发起,并于2003年7月15日募集成立。本系列基金为契约型开放式,存续期限不定,目前下设三个子基金,分别为宝康债券投资基金(以下简称"本基金")、宝康消费品证券投资基金和宝康灵活配置证券投资基金。本系列基金首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币3,893,701,931.41元,其中包括本基金人民币1,287,074,041.79元、宝康消费品证券投资基金人民币1,540,046,055.09元和宝康灵活配置证券投资基金人民币1,066,581,834.53元,业经普华永道中天会计师事务所有限公司普华永道验字(2003)第96号验资报告予以验证。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《华宝兴业宝康系列开放式证券投资基金基金合同》的有关规定,本基金的投资范围为固定收益类金融工具,包括国内依法公开发行、上市的国债、金融债、企业债(包括可转债)、现金和回购等,以及中国证监会允许基金投资的与固定收益类金融工具相关的其他金融工具;同时还会择机进行新股申购,但新股投资比例不超过基金资产总值20%,所投资的新股上市流通后持有期不超过1年。本基金投资的可转换债券不转换成股票。本基金的业绩比较基准为中信标普全债指数(原名为"中信全债指数")。

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2011年8月29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》、《华宝兴业宝康系列开放式证券投资基金基金合同》和在财务报表附注的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2011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2011年6月30日的财务状况以及2011年度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《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
上海宝钢集团公司("宝钢集团")	基金管理人的最终控制方

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

本基金本报告期内与过往可比期间未通过关联方交易单位进行交易。

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 2011年1月1日至2011年6月30日	上年度可比期间 2010年1月1日至2010年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	904,171.46	2,384,926.07
其中:支付销售机构的客户维护费	35,531.58	43,492.23

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0.6%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 0.6%/当年天数。

6.4.8.2.2 基金托管费

单位:人民币元

项目	本期 2011年1月1日至2011年6月30日	上年度可比期间 2010年1月1日至2010年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	301,390.48	794,975.36

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0.2%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 0.2%/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

单位:人民币元

本期 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	-	-	-	-	80,000,000.00	69,533.15
上年度可比期间 2010年1月1日至2010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	69,941,650.65	120,450,228.40	-	-	829,500,000.00	234,059.85

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 2011年1月1日至2011年6月30日	上年度可比期间 2010年1月1日至2010年6月30日
基金合同生效日(2003年7月15日)持有的基金份额	-	-
期初持有的基金份额	88,618,379.81	85,626,789.65
期间申购/买入总份额	1,528,430.13	2,991,590.16
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	90,146,809.94	88,618,379.81
期末持有的基金份额占基金总份额比例	38.73%	14.15%

注:1、基金管理人投资本基金适用的认(申)购费率按照本基金招募说明书的规定执行。

2、基金管理人华宝兴业在本年度以后端收费方式申购本基金的交易委托国泰君安证券股份有限公司办理,适用费率将按持有期递减。

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

本报告期末除基金管理人之外的其他关联方未有投资本基金的情况。

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 2011年1月1日至2011年6月30日		上年度可比期间 2010年1月1日至2010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	3,669,249.70	46,690.78	7,195,125.56	574,647.03

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。

6.4.9 利润分配情况

金额单位:人民币元

序号	权益登记日	除息日	每10份基金份额分红数	现金形式发放总额	再投资形式发放总额	本期利润分配合计	备注
1	2011年1月17日	2011年1月17日	0.200	1,583,521.11	4,083,348.21	5,666,869.32	
合计	-	-	0.200	1,583,521.11	4,083,348.21	5,666,869.32	

6.4.10 期末(2011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

金额单位:人民币元

6.4.10.1.1 受限证券类别:股票

证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量(单位:股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
601258	庞大集团	2011年4月20日	2011年8月3日	新股流通受限	45.00	29.27	289,855	13,043,475.00	8,484,055.85	-

注:基金可使用以基金名义开设的股票账户,选择网上或者网下一种方式进行新股申购。其中基金作为一般法人或战略投资者认购的新股,根据基金与上市公司所签订申购协议的规定,在新股上市后的约定期限内不能自由转让;基金作为个人投资者参与网上认购获配的新股,从新股获配日至新股上市日之间不能自由转让。

6.4.10.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金本报告期末未持有暂时停牌等流通受限的股票。

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,因此没有在银行间市场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

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)。

于2011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205,550,125.06元,第二层级的余额为37,977,000.00元,无属于第三层级的余额(2010年12月31日:第一层级237,673,217.32元,第二层级88,801,000.00元,无第三层级)。对于持有的重大事项停牌股票,本基金将相关股票公允价值所属层级于停牌期间从第一层级转入第二层级,并于复牌后从第二层级转回第一层级(2010年度: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	19,384,483.49	7.17
	其中:股票	19,384,483.49	7.17
2	固定收益投资	224,142,641.57	82.88
	其中:债券	224,142,641.57	82.88
	资产支持证券	-	-
3	金融衍生品投资	-	-
4	买入返售金融资产	15,500,000.00	5.73
	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	5,086,146.84	1.88
6	其他各项资产	6,330,301.34	2.34
7	合计	270,443,573.24	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	6,164,427.64	2.31
C0	食品、饮料	-	-
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	-	-
C6	金属、非金属	-	-
C7	机械、设备、仪表	6,164,427.64	2.31
C8	医药、生物制品	-	-
C99	其他制造业	-	-
D	电力、煤气及水的生产和供应业	4,736,000.00	1.77
E	建筑业	-	-
F	交通运输、仓储业	-	-
G	信息技术业	-	-
H	批发和零售贸易	8,484,055.85	3.18
I	金融、保险业	-	-
J	房地产业	-	-
K	社会服务业	-	-
L	传播与文化产业	-	-
M	综合类	-	-
	合计	19,384,483.49	7.25

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	601258	庞大集团	289,855	8,484,055.85	3.18
2	601616	广电电气	398,734	6,164,427.64	2.31
3	600795	国电电力	1,600,000	4,736,000.00	1.77

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	601258	庞大集团	13,043,475.00	3.84
2	601616	广电电气	7,575,946.00	2.23
3	601199	江南水务	661,797.60	0.19
4	601558	华锐风电	270,000.00	0.08
5	002572	宁基股份	86,000.00	0.03
6	002557	洽洽食品	40,000.00