华宝兴业新兴产业股票型证券投资基金

2011 半年度 报告摘要

2011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：中国建设银行股份有限公司
送出日期：2011年8月29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	华宝兴业新兴产业股票型证券投资基金
基金简称	华宝兴业新兴产业股票
基金主代码	240017
交易代码	240017
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2010年12月7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	2,684,019,743.90份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	分享新兴产业所带来的投资机会，力争在长期内为基金份额持有人获取超额回报。
投资策略	本基金采取积极的大类资产配置策略，通过宏观策略研究，对相关资产类别的预期收益进行动态跟踪，通过对新兴产业相关行业的辨识，精选以及对新兴产业相关股票的深入分析，挖掘该类型企业的投资价值，分享新兴产业发展所带来的较高回报。本基金通过采取自上而下的方法确定投资组合久期，结合自下而上的个券选择方法构建债券投资组合。
业绩比较基准	75%中证新兴产业指数+25%上证国债指数。
风险收益特征	本基金属于证券投资基金中的较高风险、较高收益的品种。

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

本基金选定的信息披露报纸名称	中国证券报、上海证券报、证券时报
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。

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	基金管理人	上海市世纪大道88号金茂大厦48层
会计师事务所	安永华明会计师事务所	北京市东长安街1号东方广场安永大楼16层

§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	–105,089,081.20
本期利润	–339,671,210.23
加权平均基金份额本期利润	–0.1127
本期加权平均净值利润率	–11.92%
本期基金份额净值增长率	–12.18%
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	–337,972,171.23
期末可供分配基金份额利润	–0.1259
期末基金资产净值	2,346,047,572.67
期末基金份额净值	0.8741
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	–12.59%

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	3.74%	1.14%	2.57%	1.07%	1.17%	0.07%
过去三个月	–7.69%	1.12%	–6.91%	1.02%	–0.78%	0.10%
过去六个月	–12.18%	1.00%	–7.96%	1.13%	–4.22%	–0.13%
自基金合同生效日起至今	–12.59%	0.94%	–8.02%	1.16%	–4.57%	–0.22%

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：75%中证新兴产业指数+25%上证国债指数。

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

注：1、本基金基金合同生效于2010 年12月7日，截止报告日本基金基金合同生效未满一年。

2、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6月6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（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		
郭鹏飞	灵活配置基金经理，新兴产业基金基金经理	2010年12月7日	–	7年	博士，拥有CFA资格。2004年2月加入华宝兴业基金管理有限公司任研究部行业分析师，2007年9月任公司研究部副总经理，2009年3月至2010年6月任公司研究部总经理，2010年6月至今任华宝兴业宝康灵活配置证券投资基金基金经理，2010年12月兼任华宝兴业新兴产业股票型证券投资基金基金经理。
蔡目荣	华宝兴业新兴产业股票基金经理助理、宝康灵活配置基金基金经理助理	2010年12月10日	–	8年	硕士。曾在金信研究、国金证券股份有限公司从事研究工作，2008年6月进入华宝兴业基金管理有限公司，先后担任高级分析师、研究部总经理助理。2010年10至今担任华宝兴业宝康配置混合基金经理助理，2010年12月至今兼任华宝兴业新兴产业股票基金经理助理。

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、《华宝兴业新兴产业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的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2011年上半年，通货膨胀成为中国经济面临的最大问题，CPI持续攀升并不断创出本轮新高，政府频繁上调准备金率和利息并紧缩信贷来控制通胀，导致社会资金紧张，实体经济受到一定影响，企业盈利一季度超出市场预期后，二季度却开始伴随宏观经济指标明显下滑。在资金外流和盈利预期调整的共同作用下，上半年A股出现冲高下跌走势，沪深300指数跌幅为2.69%。同时，市场风格差异明显，2010年涨幅较大的中小盘股票大幅度下跌，中小板指数跌幅为14.83%，创业板指数跌幅达25.64%，其中信息技术、节能环保、生物医药和农业等新兴产业领域个股均出现大幅度下跌，而传统产业和消费类股票跌幅较小。

我们在一季度新兴产业相关股票的下跌过程中逐步开展了基金的建仓工作，但相关股票二季度却再次出现了大幅度下跌，因此基金净值遭受了较大损失。同时，我们也认为二季度的大跌后，新兴产业股票已经调整比较充分，估值已经比较合理，不应该再降低总体仓位。因此，我们维持了较高的股票仓位，但进行了显著的个股结构调整，卖出或减持了业绩明显低于预期的股票，买入或增持了业绩并未下调但股价大幅回落的股票。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本报告期，本基金份额净值增长率为–12.18%，基金基准收益率为–7.96%，基金表现落后于基准4.22个百分点。

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2011年下半年，中国经济形势有望明显改善，由于基数效应及紧缩政策效果，预计通胀水平将开始逐步回落，从而紧缩政策将存在明显的松动空间，资金紧张程度有望好转，实体经济增长将获得更有利的环境。我们认为，中国经济不会发生"硬着陆"，相反，经济已经具备较强的内生增长动力，一旦紧缩政策逐步放开，企业盈利有望不断超出预期。同时，经历了上半年的明显下跌后，A股估值水平已经处于历史较低水平，只要经济不出现大幅下滑，股市就没有很大下跌空间，而一旦通胀压力消除后经济恢复快速增长，股市将面临较大的上涨空间。

同时，通胀持续高企说明以投资和制造业为主要动力的传统经济增长模式已经无法持续，资源和劳动力对经济增长的约束越来越显著，中国经济进行转型和结构调整的需求越来越迫切，大力发展战略性新兴产业已经成为中国经济继续保持快速增长的必要条件。上半年，新兴产业各个领域的"十二五规划"以及支持新兴产业发展的各项政策措施正在不断得到落实，这将进一步推动新兴产业各个领域的快速发展，并逐步转变为相关领域上市公司的订单和利润。我们看好节能环保、新一代信息技术、高端装备制造、生物、新能源、新材料等领域的快速增长和良好投资机会，并重点配置了这些领域的龙头上市公司，我们相信，随着行业需求的不断释放和规模效益的逐步体现，这些公司的收入和利润将保持快速增长。经历了上半年股价的大幅度回落后，新兴产业主要股票的估值已经处于合理水平，已经具备了明显的投资价值，业绩低于预期的风险也已经基本释放。

因此，我们对下半年的经济形势和股市走势都持较为乐观态度，对新兴产业龙头公司中长期的表现也充满信心。我们将继续加仓优质个股并长期持有，分享战略性新兴产业中长期快速增长带来的丰厚回报，为持有人创造价值。

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

本基金本报告期亏损，未有应分未分的利润。

§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，本基金未实施利润分配。

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：华宝兴业新兴产业股票型证券投资基金

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	279,955,040.78	679,019,747.38
结算备付金	2,489,787.16	–
存出保证金	3,242,891.65	–
交易性金融资产	1,922,294,071.29	1,075,237,426.04
其中：股票投资	1,922,294,071.29	1,075,237,426.04
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	193,000,529.50	1,879,100,000.00
应收证券清算款	–	10,073,546.18
应收利息	126,563.00	968,562.73
应收股利	–	–
应收申购款	68,255.64	–
递延所得税资产	–	–
其他资产	–	–
资产总计	2,401,177,139.02	3,644,399,282.33
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	–	–
应付证券清算款	48,703,859.16	23,626,662.22
应付赎回款	509,375.79	–
应付管理人报酬	2,838,162.39	3,573,997.42
应付托管费	473,027.04	595,666.24
应付销售服务费	–	–
应付交易费用	2,346,539.47	1,022,344.93
应交税费	–	–
应付利息	–	–
应付利润	–	–
递延所得税负债	–	–
其他负债	258,602.50	40,000.00
负债合计	55,129,566.35	28,858,670.81
所有者权益：		
实收基金	2,684,019,743.90	3,632,789,229.65
未分配利润	–337,972,171.23	–17,248,618.13
所有者权益合计	2,346,047,572.67	3,615,540,611.52
负债和所有者权益总计	2,401,177,139.02	3,644,399,282.33

注：1、报告截止日2011 年6 月30日，基金份额净值0.8741元，基金份额总额2,684,019,743.90份。

6.2 利润表

会计主体：华宝兴业新兴产业股票型证券投资基金

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
一、收入	–305,077,994.56
1.利息收入	13,076,501.40
其中：存款利息收入	1,799,794.93
债券利息收入	82.35
资产支持证券利息收入	–
买入返售金融资产收入	11,276,624.12
其他利息收入	–
2.投资收益(损失以"–"填列)	–85,147,899.76
其中：股票投资收益	–93,474,212.01
基金投资收益	–
债券投资收益	74,863.40
资产支持证券投资收益	–
衍生工具收益	–
股利收益	8,251,448.85
3.公允价值变动收益(损失以"–"号填列)	–234,582,129.03
4.汇兑收益(损失以"–"号填列)	–
5.其他收入(损失以"–"号填列)	1,575,532.83
减：二、费用	34,593,215.67
1.管理人报酬	21,383,810.72
2.托管费	3,563,968.47
3.销售服务费	–
4.交易费用	9,407,160.21
5.利息支出	–
其中：卖出回购金融资产支出	–
6.其他费用	238,276.27
三、利润总额(亏损总额以"–"号填列)	–339,671,210.23
减：所得税费用	–
四、净利润(净亏损以"–"号填列)	–339,671,210.23

注：该基金成立于2010年12月7日，无上年度可比期间。

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：华宝兴业新兴产业股票型证券投资基金

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)	3,632,789,229.65	–17,248,618.13	3,615,540,611.52
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	–	–339,671,210.23	–339,671,210.23
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）	–948,769,485.75	18,947,657.13	–929,821,828.62
其中：1.基金申购款	192,267,824.15	–3,828,823.87	188,439,000.28
2.基金赎回款	–1,141,037,309.90	22,776,481.00	–1,118,260,828.90
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)	2,684,019,743.90	–337,972,171.23	2,346,047,572.67

注：该基金成立于2010年12月7日，无上年度可比期间。

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　　　　黄小薏　　　　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

华宝兴业新兴产业股票型证券投资基金（以下简称"本基金"）根据中国证券监督管理委员会（以下简称"中国证监会"）《关于核准华宝兴业新兴产业股票型证券投资基金募集的批复》（证监许可［2010］1241号），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《华宝兴业行业精选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3,632,254,340.43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（2010）第381号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《华宝兴业新兴产业股票型证券投资基金基金合同》于2010 年12月7 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为3,632,789,229.65份基金份额，其中认购资金利息折合534,889.22 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《华宝兴业新兴产业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具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行、上市的股票、债券、货币市场工具以及经中国证监会批准的允许基金投资的其它金融工具。本基金的股票投资比例为基金资产的60%–95%，其中投资于新兴产业相关股票的比例不低于股票资产的80%，投资于权证投资范围为基金资产的0–3%；现金、债券资产及中国证监会允许基金投资的其他证券品种占基金资产比例为5%–40%（其中现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值5%）。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其它品种，基金管理人在履行适当的程序后，可以将其纳入投资范围。

本基金的业绩比较基准为：75%中证新兴产业指数+25%上证国债指数。

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》、《华宝兴业新兴产业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2011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2011年6月30日的财务状况以及2011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 重要会计政策和会计估计

本基金成立于2010年12月7日，本报告期所采用的会计政策、会计估计与上一期间相一致。

6.4.4.1 会计年度

本基金会计年度为公历1 月1 日起至12 月31 日止。

6.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

6.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

（1）金融资产的分类

金融资产于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、应收款项、可供出售金融资产及持有至到期投资。金融资产的分类取决于本基金对金融资产的持有意图和持有能力。本基金现无金融资产分类为可供出售金融资产及持有至到期投资。

本基金持有的股票投资、债券投资和衍生工具（主要为权证投资）分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。除衍生工具所产生的金融资产在资产负债表中以衍生金融资产列示外，以公允价值计量且其公允价值变动计入损益的金融资产在资产负债表中以交易性金融资产列示。

本基金持有的其他金融资产分类为应收款项，包括银行存款、买入返售金融资产和各类应收款项等。应收款项是指在活跃市场中没有报价、回收金额固定或可确定的非衍生金融资产。

（2）金融负债的分类

金融负债于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债及其他金融负债。本基金目前暂无金融负债分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。本基金持有的其他金融负债为各类应付款项等。

6.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

金融资产或金融负债于本基金成为金融工具合同的一方时，于交易日按公允价值在资产负债表内确认。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，取得时发生的相关交易费用计入当期损益；对于支付的价款中包含已宣告但尚未发放的现金股利或债券起息日或上次除息日至购买日止的利息，单独确认为应收项目。应收款项和其他金融负债的相关交易费用计入初始确认金额。

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，按照公允价值进行后续计量；对于应收款项和其他金融负债采用实际利率法，以摊余成本进行后续计量。

当收取某项金融资产现金流量的合同权利已终止或该金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬已转移时，终止确认该金融资产。终止确认的金融资产的成本按移动加权平均法于交易日结转。

6.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

本基金持有的股票投资、债券投资和衍生工具（主要为权证投资）按如下原则确定公允价值并进行估值：

（1）存在活跃市场的金融工具按其估值日的市场交易价格确定公允价值；估值日无交易，但最近交易日后经济环境未发生重大变化且证券发行机构未发生影响证券价格的重大事件的，按最近交易日的市场交易价格确定公允价值。

（2）存在活跃市场的金融工具，如估值日无交易且最近交易日后经济环境发生了重大变化，参考类似投资品种的现行市价及重大变化等因素，调整最近交易市价以确定公允价值。

（3）当金融工具不存在活跃市场，采用市场参与者普遍认同且被以往市场实际交易价格验证具有可靠性的估值技术确定公允价值。估值技术包括参考熟悉情况并自愿交易的各方最近进行的市场交易中使用的价格、参照实质上相同的其他金融工具的当前公允价值、现金流量折现法和期权定价模型等。采用估值技术时，尽可能最大程度使用市场参数，减少使用与本基金特定相关的参数。

6.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

本基金持有的资产和承担的负债基本为金融资产和金融负债。当本基金依法有权抵销债权债务且交易双方准备按净额结算时，金融资产与金融负债按抵销后的净额在资产负债表中列示。

6.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行基金份额所募集的总金额在扣除损益平准金分摊部分后的余额。由于申购和赎回引起的实收基金变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日认列。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

6.4.4.8 损益平准金

损益平准金包括已实现平准金和未实现平准金。已实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现损益占基金净值比例计算的金额。未实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未实现损益占基金净值比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日认列，并于期末全额转入未分配利润/（累计亏损）。

6.4.4.9 收入/（损失）的确认和计量

股票投资在持有期间应取得的现金股利扣除由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额确认为投资收益。债券投资在持有期间应取得的按票面利率计算的利息扣除在适用情况下由债券发行企业代扣代缴的个人所得税后的净额确认为利息收入。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在持有期间的公允价值变动确认为公允价值变动损益；处置时其公允价值与初始确认金额之间的差额确认为投资收益，其中包括从公允价值变动损益结转的公允价值累计变动额。

应收款项在持有期间确认的利息收入按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

6.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬和托管费在费用涵盖期间按基金合同约定的费率和计算方法逐日确认。

其他金融负债在持有期间确认的利息支出按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的也可按直线法计算。

6.4.4.11 基金的收益分配政策

每一基金份额享有同等分配权。本基金收益以现金形式分配，但基金份额持有人可选择现金红利或将现金红利按分红除权日的基金份额净值自动转为基金份额进行再投资。若期末未分配利润中的未实现部分（包括基金经营活动产生的未实现损益以及基金份额交易产生的未实现平准金等）为正数，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润中的已实现部分；若期末未分配利润的未实现部分为负数，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润（已实现部分相抵未实现部分后的余额）。经宣告的拟分配基金收益于分红除权日从所有者权益转出。

6.4.4.12 分部报告

本基金以内部组织结构、管理要求、内部报告制度为依据确定经营分部，以经营分部为基础确定报告分部并披露分部信息。

经营分部是指本基金内同时满足下列条件的组成部分：（1）该组成部分能够在日常活动中产生收入、发生费用；（2）本基金管理人能够定期评价该组成部分的经营成果，以决定向其配置资源、评价其业绩；（3）本基金能够取得该组成部分的财务状况、经营成果和现金流量等有关会计信息。如果两个或多个经营分部具有相似的经济特征，并且满足一定条件的，则合并为一个经营分部。

本基金目前以一个单一的经营分部运作，不需要进行分部报告的披露。

6.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计

重要会计估计及其关键假设

根据本基金的估值原则和中国证监会允许的基金行业估值实务操作，本基金确定以下类别股票投资和债券投资的公允价值时采用的估值方法及其关键假设如下：

（a）对于特殊事项停牌股票，根据中国证监会公告［2008］38 号《关于进一步规范证券投资基金估值业务的指导意见》，本基金采用《中国证券业协会基金估值工作小组关于停牌股票估值的参考方法》提供的指数收益法对重大影响基金资产净值的特殊事项停牌股票估值，通过停牌股票所处行业的行业指数变动以大致反映市场因素在停牌期间对于停牌股票公允价值的影响。上述指数收益法的关键假设包括所选取行业指数的变动能在重大方面基本反映停牌股票公允价值的变动，停牌股票的发行者在停牌期间的各项变化未对停牌股票公允价值产生重大影响等。本基金采用中证协（SAC）基金行业股票估值指数。

（b）在银行间同业市场交易的债券品种，根据中国证监会证监会计字［2007］21 号《关于证券投资基金执行<企业会计准则>估值业务及份额净值计价有关事项的通知》采用估值技术确定公允价值。本基金持有的银行间同业市场债券按现金流量折现法估值，具体估值模型、参数及结果由中央国债登记结算有限责任公司独立提供。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期无会计政策变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期无会计估计变更。

6.4.5.3 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［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
华宝证券经纪有限责任公司("华宝证券")	受基金管理人的股东控制的公司

以下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

6.4.8.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2011年1月1日至2011年6月30日	
	成交金额	占当期股票成交总额的比例
华宝证券	224,890,872.80	3.40%

注：该基金成立于2010年12月7日，无上年度可比期间。

6.4.8.1.2 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2011年1月1日至2011年6月30日			
	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	191,154.82	3.50%	22,665.11	0.97%

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。

3. 该基金成立于2010年12月7日，无上年度可比期间。

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
当期发生的基金应支付的管理费	21,383,810.72
其中：支付销售机构的客户维护费	10,979,937.34

注：1. 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。

2. 该基金成立于2010年12月7日，无上年度可比期间。

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
当期发生的基金应支付的托管费	3,563,968.47

注：1. 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。

2. 该基金成立于2010年12月7日，无上年度可比期间。

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 2011年1月1日至2011年6月30日
基金合同生效日（2010年12月7日）持有的基金份额	–
期初持有的基金份额	3,303,880.99
期间申购/买入总份额	1,408,570.87
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	4,712,451.86
期末持有的基金份额占基金总份额比例	0.18%

注：1. 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。

2. 该基金成立于2010年12月7日，无上年度可比期间。

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

份额单位：份

关联方名称	本期末 2011年6月30日		上年度末 2010年12月31日	
	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例
宝钢集团	100,007,000.00	3.73%	100,007,000.00	2.75%

报告期末除基金管理人之外的其他关联方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。

6.4.8.5 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	
	期末余额	当期利息收入
中国建设银行	279,955,040.78	1,698,321.71

注：1. 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。

2. 该基金成立于2010年12月7日，无上年度可比期间。

6.4.8.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期内与上年度可比期间无参与关联方承销证券的情况。

6.4.9 利润分配情况

本基金本报告期内未进行利润分配。

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

本基金无因认购新发/增发而于期末持有的流通受限证券。

6.4.10.2 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
002296	辉煌科技	2011年6月28日	重大资产重组	26.00	–	–	1,145,728	38,768,097.54	29,788,928.00	–
000876	新希望	2011年6月29日	重大资产重组	19.95	2011年7月5日	21.95	1,002,052	21,072,948.86	19,990,937.40	–

注：本基金截至2011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。

6.4.10.3 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1,872,514,205.89元，属于第二层级的余额49,779,865.40元，无属于第三层级的余额（于2010年12月31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1,075,237,426.04元，无属于第二层级和第三层级的余额）。

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	1,922,294,071.29	80.06
	其中：股票	1,922,294,071.29	80.06
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	193,000,529.50	8.04
	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	282,444,827.94	11.76
6	其他各项资产	3,437,710.29	0.14
7	合计	2,401,177,139.02	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	118,346,076.53	5.04
B	采掘业	–	–
C	制造业	1,085,184,460.77	46.26
C0	食品、饮料	67,348,141.12	2.87
C1	纺织、服装、皮毛	20,294,975.66	0.87
C2	木材、家具	–	–
C3	造纸、印刷	33,018,768.67	1.41
C4	石油、化学、塑胶、塑料	183,835,509.46	7.84
C5	电子	111,572,341.03	4.76
C6	金属、非金属	43,143,373.74	1.84
C7	机械、设备、仪表	483,107,898.09	20.59
C8	医药、生物制品	142,863,453.00	6.09
C99	其他制造业	–	–
D	电力、煤气及水的生产和供应业	67,684,809.40	2.89
E	建筑业	109,235,494.00	4.66
F	交通运输、仓储业	–	–
G	信息技术业	218,426,095.78	9.31
H	批发和零售贸易	93,345,863.92	3.98
I	金融、保险业	–	–
J	房地产业	–	–
K	社会服务业	230,071,270.89	9.81
L	传播与文化产业	–	–
M	综合类	–	–
	合计	1,922,294,071.29	81.94

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	300070	碧水源	2,142,237	85,689,480.00	3.65
2	002503	搜于特	1,952,426	64,273,863.92	2.74
3	002299	圣农发展	3,599,553	58,348,754.13	2.49
4	000826	桑德环境	2,299,577	57,328,454.61	2.44
5	600303	曙光股份	6,585,605	56,306,922.75	2.40
6	300124	汇川技术	803,246	55,343,649.40	2.36
7	600292	九龙电力	3,465,572	53,716,366.00	2.29
8	300105	龙源技术	1,037,276	49,042,409.28	2.09
9	600537	海通集团	1,293,206	47,357,203.72	2.02
10	000998	隆平高科	1,799,985	46,799,610.00	1.99

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

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	300070	碧水源	71,574,521.99	1.98
2	000826	桑德环境	69,158,309.21	1.91
3	600303	曙光股份	68,421,561.75	1.89
4	300124	汇川技术	65,183,730.86	1.80
5	600292	九龙电力	63,106,505.14	1.75
6	000998	隆平高科	62,564,366.39	1.73
7	600835	上海机电	62,014,960.07	1.72
8	300105	龙源技术	59,723,830.88	1.65
9	002081	金 螳 螂	57,150,661.60	1.58
10	600111	包钢稀土	53,200,607.46	1.47
11	002313	日海通讯	51,473,489.90	1.42
12	300025	华星创业	51,395,029.78	1.42
13	600805	悦达投资	49,970,314.35	1.38
14	002261	拓维信息	49,461,607.30	1.37
15	002369	卓翼科技	49,088,293.89	1.36
16	002503	搜于特	48,921,209.77	1.35
17	002079	苏州固锝	48,062,596.87	1.33
18	600537	海通集团	47,977,864.22	1.33
19	002375	亚厦股份	47,261,614.36	1.31
20	000157	中联重科	46,603,266.70	1.29

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	600703	三安光电	96,805,354.32	2.68
2	000157	中联重科	48,842,106.50	1.35
3	600111	包钢稀土	45,469,400.39	1.26
4	600805	悦达投资	44,956,010.31	1.24
5	002236	大华股份	44,721,720.62	1.24
6	000698	沈阳化工	41,121,998.92	1.14
7	002202	金风科技	40,930,322.86	1.13
8	601989	中国重工	40,348,655.31	1.12
9	601766	中国南车	40,263,891.40	1.11
10	002405	四维图新	39,902,710.93	1.10
11	600549	厦门钨业	38,933,206.42	1.08
12	002241	歌尔声学	38,632,037.01	1.07
13	002449	国星光电	38,475,654.26	1.06
14	600875	东方电气	38,238,812.86	1.06
15	002061	江山化工	37,538,805.11	1.04
16	002106	莱宝高科	36,999,166.31	1.02
17	600815	厦工股份	36,180,825.43	1.00
18	002123	荣信股份	35,787,870.51	0.99
19	000963	华东医药	35,783,909.12	0.99
20	600104	上海汽车	35,635,100.16	0.99

注：卖出金额不包括相关交易费用。

7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本(成交)总额	3,897,604,835.23
卖出股票收入(成交)总额	2,722,491,848.94

注：买入股票成本、卖出股票收入均不包括相关交易费用。

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券投资。

7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券投资。

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7.8 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

7.9 投资组合报告附注

7.9.1 报告期内本基金投资的前十名证券的发行主体没有被监管部门立案调查，也没有在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚，无证券投资决策程序需特别说明。

7.9.2 基金投资的前十名股票未超出基金合同规定的备选股票库。

7.9.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	3,242,891.65
2	应收证券清算款	–
3	应收股利	–
4	应收利息	126,563.00
5	应收申购款	68,255.64
6	其他应收款	–
7	待摊费用	–
8	其他	–
9	合计	3,437,710.29

7.9.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

7.9.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

§8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

持有人户数(户)	户均持有的基金份额	持有人结构			
		机构投资者		个人投资者	
		持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例
31,365	85,573.72	516,581,263.55	19.25%	2,167,438,480.35	80.75%

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金的情况

项目	持有份额总数(份)	占基金总份额比例
基金管理公司所有从业人员持有本开放式基金	2,823,748.86	0.1052%

§9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2010年12月7日）基金份额总额	3,632,789,229.65
本报告期期初基金份额总额	3,632,789,229.65
本报告期基金总申购份额	192,267,824.15
减：本报告期基金总赎回份额	1,141,037,309.90
本报告期基金拆分变动份额	–
本报告期期末基金份额总额	2,684,019,743.90

注：总申购份额含红利再投、转换入份额；总赎回份额含转换出份额。

§10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

报告期内本基金未召开基金份额持有人大会。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

1、基金管理人于2011年4月9日发布公告，聘任谢文杰先生为公司副总经理，其任职资格已经过中国证监会审核批准。
2、基金托管人2011年1月31日发布任免通知，解聘李春信中国建设银行投资托管服务部副总经理职务。
3、基金托管人2011年2月9日发布公告，经中国建设银行研究决定，聘任杨新丰为中国建设银行投资托管服务部副总经理(主持工作)，其任职资格已经中国证监会审核批准(证监许可〔2011〕115号)。解聘罗中涛中国建设银行投资托管服务部总经理职务。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

报告期内无涉及基金管理人、基金资产和基金托管业务的诉讼事项。

10.4 基金投资策略的改变

本基金的投资策略在报告期内未发生变更。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

基金管理人为本基金聘任的会计师事务所向本基金提供的审计服务持续期限为：本基金合同生效之日起至本报告期末。

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内管理人和托管人及其高级管理人员未有受到稽查或处罚的情况。

10.7基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
中金公司	1	–	–	–	–	–
安信证券	1	–	–	–	–	–
华安证券	1	–	–	–	–	–
招商证券	1	–	–	–	–	–
宏源证券	1	–	–	–	–	–
华创证券	1	–	–	–	–	–
中信证券	1	867,248,064.75	13.10%	704,644.14	12.89%	–
申银万国	1	725,815,612.66	10.96%	589,729.86	10.78%	–
华泰联合	1	611,523,015.24	9.24%	496,866.86	9.09%	–
海通证券	1	541,850,922.92	8.18%	460,572.48	8.42%	–
江海证券	1	523,565,313.09	7.91%	425,399.68	7.78%	–
西藏同信	1	495,382,501.35	7.48%	421,075.53	7.70%	–
中银国际	1	422,213,147.57	6.38%	343,051.77	6.27%	–
国泰君安	1	421,297,809.51	6.36%	358,101.77	6.55%	–
平安证券	1	361,778,854.92	5.46%	293,947.16	5.38%	–
东方证券	1	296,374,565.50	4.48%	240,806.62	4.40%	–
华宝证券	1	224,890,872.80	3.40%	191,154.82	3.50%	–
长城证券	1	201,916,560.61	3.05%	164,058.87	3.00%	–
东海证券	1	184,750,857.95	2.79%	150,111.19	2.75%	–
瑞银证券	1	122,715,910.03	1.85%	104,308.67	1.91%	–
中投证券	1	108,420,843.65	1.64%	92,158.05	1.69%	–
光大证券	1	105,243,963.14	1.59%	89,457.94	1.64%	–
高华证券	1	77,683,963.86	1.17%	66,031.10	1.21%	–
民生证券	1	71,989,063.68	1.09%	61,190.96	1.12%	–
银河证券	1	70,357,619.56	1.06%	59,803.43	1.09%	–
兴业证券	1	68,708,672.67	1.04%	58,401.77	1.07%	–
国信证券	1	43,836,903.33	0.66%	35,617.92	0.65%	–
金元证券	1	39,251,558.63	0.59%	33,363.24	0.61%	–
齐鲁证券	1	30,096,987.68	0.45%	25,582.90	0.47%	–
中航证券	1	3,183,099.07	0.05%	2,705.67	0.05%	–

注：基金管理人选择交易单元的标准和程序如下：

（1）选择标准：资力雄厚，信誉良好，注册资本不少于5亿元人民币；财务状况良好，各项财务指标显示公司经营状况稳定；经营行为规范，最近两年未因重大违规行为受到中国证监会和中国人民银行处罚；内部管理规范、严格，具备健全的内控制度，并能满足基金运作高度保密的要求；具备基金运作所需要的高效、安全的通讯条件，交易设施符合代理本基金进行证券交易的需要，并能为本基金提供全面的信息服务；研究实力较强，有固定的研究机构和专门的研究人员，能及时为本基金提供高质量的咨询服务，并能根据基金投资的特定要求，提供专门研究报告；适当的地域分散化。

（2）选择程序：（a）服务评价；（b）拟定备选交易单元；（c）签约。

2. 本基金本报告期券商交易单元新增：西藏同信，金元证券，平安证券，东海证券，东方证券，申银万国，国信证券，民生证券，中航证券，华创证券，宏源证券。本基金于2010年12月7日成立，其余席位均为上年度增加。

10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例
中金公司	–	–	–	–	–	–
安信证券	–	–	–	–	–	–
华安证券	–	–	–	–	–	–
招商证券	–	–	–	–	–	–
宏源证券	–	–	–	–	–	–
华创证券	–	–	–	–	–	–
中信证券	322,145.75	100.00%	–	–	–	–
申银万国	–	–	–	–	–	–
华泰联合	–	–	–	–	–	–
海通证券	–	–	–	–	–	–
江海证券	–	–	–	–	–	–
西藏同信	–	–	500,000,000.00	10.00%	–	–
中银国际	–	–	–	–	–	–
国泰君安	–	–	–	–	–	–
平安证券	–	–	–	–	–	–
东方证券	–	–	–	–	–	–
华宝证券	–	–	–	–	–	–
长城证券	–	–	–	–	–	–
东海证券	–	–	–	–	–	–
瑞银证券	–	–	–	–	–	–
中投证券	–	–	300,000,000.00	6.00%	–	–
光大证券	–	–	–	–	–	–
高华证券	–	–	–	–	–	–
民生证券	–	–	–	–	–	–
银河证券	–	–	–	–	–	–
兴业证券	–	–	2,100,000,000.00	42.00%	–	–
国信证券	–	–	–	–	–	–
金元证券	–	–	–	–	–	–
齐鲁证券	–	–	2,100,000,000.00	42.00%	–	–
中航证券	–	–	–	–	–	–

华宝兴业基金管理有限公司

2011年8月29日