

华宝兴业行业精选股票型证券投资基金

2009 年半年度报告

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：中国建设银行股份有限公司
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。

基金托管人中国建设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。

1.2 目录

1	重要提示及目录.....	2
1.1	重要提示.....	2
1.2	目录.....	3
2	基金简介.....	5
2.1	基金基本情况.....	5
2.2	基金产品说明.....	5
2.3	基金管理人和基金托管人.....	5
2.4	信息披露方式.....	6
2.5	其他相关资料.....	6
3	主要财务指标和基金净值表现.....	6
3.1	主要会计数据和财务指标.....	6
3.2	基金净值表现.....	7
4	管理人报告.....	8
4.1	基金管理人及基金经理情况.....	8
4.2	管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明.....	10
4.3	管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	10
4.4	管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现说明.....	10
4.5	管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	11
4.6	管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	11
4.7	管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	11
5	托管人报告.....	12
5.1	报告期内本基金托管人遵规守信情况声明.....	12
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.....	12
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.....	12
6	半年度财务会计报告（未经审计）.....	12
6.1	资产负债表.....	12
6.2	利润表.....	14
6.3	所有者权益（基金净值）变动表.....	15
6.4	报表附注.....	16
7	投资组合报告.....	27
7.1	期末基金资产组合情况.....	27
7.2	期末按行业分类的股票投资组合.....	28
7.3	期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细.....	29
7.4	报告期内股票投资组合的重大变动.....	31
7.5	期末按债券品种分类的债券投资组合.....	33
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.....	33
7.7	期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的所有资产支持证券投资明细.....	33
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.....	33
7.9	投资组合报告附注.....	33

8	基金份额持有人信息.....	34
8.1	期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	34
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.....	34
9	开放式基金份额变动.....	35
10	重大事件揭示.....	35
10.1	基金份额持有人大会决议.....	35
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.....	35
10.3	涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	35
10.4	基金投资策略的改变.....	35
10.5	报告期内改聘会计师事务所情况.....	35
10.6	管理人、托管人及其高级管理人员受监管部门稽查或处罚的情况.....	36
10.7	基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	36
10.8	其他重大事件.....	37
11	影响投资者决策的其他重要信息.....	38
12	备查文件目录.....	38
12.1	备查文件目录.....	38
12.2	存放地点.....	38
12.3	查阅方式.....	38

2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	华宝兴业行业精选股票型证券投资基金
基金简称	华宝兴业行业精选股票
交易代码	240010
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2007年6月14日
报告期末基金份额总额	18,777,420,956.51份

2.2 基金产品说明

投资目标	把握行业发展趋势和市场运行趋势,精选增长前景良好或周期复苏的行业和企业,在控制风险的前提下,追求基金净值的稳定增长和基金资产的长期增值。
投资策略	本基金将通过分析宏观经济、产业政策和行业景气程度,精选发展前景良好或景气程度向好的行业,通过行业估值模型与波特五力分析,加强对有吸引力行业的配置。在行业配置比例确定后,本基金将对基金管理人股票库相关精选行业的股票运用定量指标筛选排名靠前的股票,并进行定性分析,确定最终投资组合。
业绩比较基准	沪深300 指数收益率。
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48F	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48F	北京市西城区闹市口大街一 号院一号楼
邮政编码		200121	100140
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	注册登记机构
名称	基金管理人
办公地址	上海市世纪大道88号金茂大厦48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（2009年1月1日 - 2009年6月30日）
本期已实现收益	-1,390,389,786.98
本期利润	6,585,160,263.32
加权平均基金份额本期利润	0.3462
本期加权平均净值利润率	44.65%
本期基金份额净值增长率	57.34%
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）
期末可供分配利润	-3,400,464,060.98
期末可供分配基金份额利润	-0.1811
期末基金资产净值	17,833,311,945.40

期末基金份额净值	0.9497
3.1.3 累计期末指标	报告期（2009 年 1 月 1 日 - 2009 年 6 月 30 日）
基金份额累计净值增长率	-5.03%

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期末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

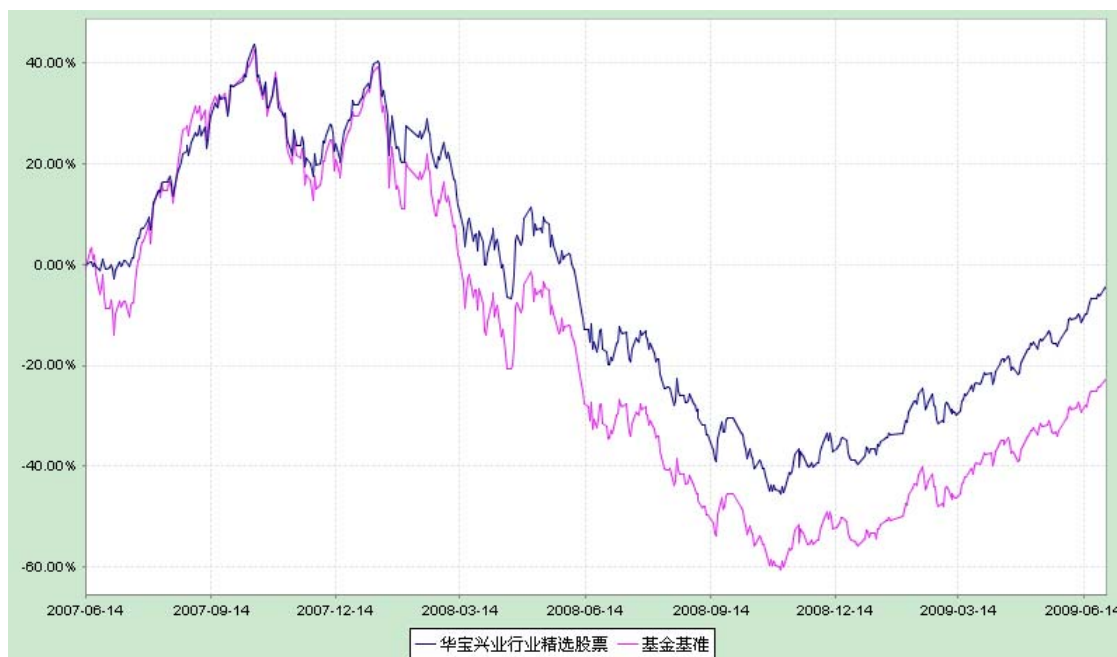
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	12.11%	0.94%	14.74%	1.22%	-2.63%	-0.28%
过去三个月	23.77%	1.16%	26.27%	1.56%	-2.50%	-0.40%
过去六个月	57.34%	1.43%	74.20%	1.96%	-16.86%	-0.53%
过去一年	15.02%	1.98%	13.42%	2.58%	1.60%	-0.60%
自基金合同生效起至今	-5.03%	1.99%	-23.11%	2.61%	18.08%	-0.62%

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

华宝兴业行业精选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

（2007 年 6 月 14 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 12 月 14 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

基金管理人是在 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		
任志强	公司副总经理、投资总监、本基金基金经理	2007-9-7	-	12 年	硕士。1995 年 3 月至 1997 年 3 月就职于上海市外高桥保税区开发（控股）公司期货部；1997 年 4 月至 1999 年 2 月任职于中国南方证券有限公司，从事证券研

					究工作。1999 年 3 月至 2006 年 10 月在华宝信托投资有限责任公司工作，曾担任研究员、研发中心总经理助理、研发中心总经理、投资管理部总经理、公司总裁助理、公司董事会秘书等职务。2006 年 10 月至 2007 年 8 月任华宝证券经纪有限公司董事、副总经理。2007 年 8 月加入华宝兴业基金管理有限公司，任投资总监，2007 年 9 月至今兼任华宝兴业行业精选股票基金基金经理，2009 年 6 月至今兼任公司副总经理。
吴丰树	本基金基金经理、华宝兴业先进成长股票基金基金经理	2008-9-23	-	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。
范红兵	本基金基金经理	2009-2-26	-	9 年	硕士。曾在南方证券股份有限公司、中新苏州工业园创业投资有限公司和平安证券股份有限公司从事证券研究、风险投资工作，于 2007 年 7 月加入华宝兴业基金管理有限公司，先后任高级分析师、基金经理助理。2009 年 2 月至今任行业精选基金基金经理。

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合规守信情况的说明

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、《华宝兴业行业精选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间向交易价差的分析；分析结果没有发现交易价异常。

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

2009 年上半年指数在经历了一季度大幅上涨而短期回调后，二季度呈现出单边加速上扬格局。我们认为上半年推动指数上涨的主要动力前期主要来自国内企业的存货回补、政府年初密集推出的产业振兴计划、4 万亿经济刺激方案的进一步落实、超预期的银行新增贷款带来的超流动性，在宏观经济转暖但微观实体经济尚未见效背景下，一季度市场以新能源、区域振兴、产业振兴等主题和概念性投资为主，相关股票涨幅惊人；从二季度开始，国内消费在政府相关积极有效的鼓励政策引导下，消费热点层出不穷——以内需为主的产业特别是作为关系中国经济增长的重要支柱行业，房地产和汽车销售二季度出现超预期的大幅增长，在资产泡沫渐起、宏观经济向好的大背景下，股市上涨的主线转向了以预期业绩上升为导向的地产、金融、煤炭等大蓝筹行业，与此同时香港股市的大幅上扬也成为 A 股上涨的加速器，

上半年沪深股指涨幅巨大。

本基金一季度主动性地调整了行业配置的弹性，增加了煤炭板块等强周期性行业配置比重；同时针对一些周期性行业的拐点判断，我们对有色金属行业、钢铁行业、造纸行业等进行了波段性操作；二季度本基金较早地聚集主流大蓝筹板块，主动增加了资产类和资源类行业如金融板块、地产板块、煤炭板块的配置权重，同时减少了防御性行业如公用事业、医药、化工等中间制造业行业的权重，取得了实效。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望下半年市场，我们保持着谨慎乐观的心态。经济的复苏、通胀预期和充裕的流动性对目前 A 股市场形成强有力的支撑；另一方面，估值的高企、IPO 的重新开闸、创业板的推出、大小非的减持、对政策转向的预期使得市场面临一定的调整压力。本基金下半年在继续保持对资产和资源类大蓝筹板块行业配置权重的同时，将积极关注前期严重滞涨、中小市值的行业或板块，同时密切跟踪外向型龙头企业，在海外企业补库存或经济恢复过程中可能存在的投资机会。投资策略上我们将保持操作的灵活性，适当增加股票波段性操作机会，积极寻找和挖掘有核心竞争力的上市公司。

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、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

-0.1811 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关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：华宝兴业行业精选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	附注号	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	6.4.2.1	2,904,907,009.78	1,906,379,165.96
结算备付金		14,310,680.74	5,250,737.02
存出保证金		2,970,649.87	1,951,709.05

交易性金融资产	6.4.2.2	14,764,174,409.97	9,703,986,916.83
其中：股票投资		14,281,474,409.97	8,343,776,916.83
债券投资		482,700,000.00	1,360,210,000.00
资产支持证券投资		-	-
衍生金融资产	6.4.2.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.2.4	-	-
应收证券清算款		3,247,476.90	107,062,707.71
应收利息	6.4.2.5	17,131,011.59	34,799,355.35
应收股利		-	-
应收申购款		294,725,275.82	1,325,173.55
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.2.6	50,272.44	218,739.72
资产总计		18,001,516,787.11	11,760,974,505.19
负债和所有者权益	附注号	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		105,872,237.12	-
应付赎回款		27,563,221.57	4,293,497.34
应付管理人报酬		20,839,458.65	15,687,450.76
应付托管费		3,473,243.11	2,614,575.13
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.2.7	9,534,030.29	5,743,697.50
应交税费		-	-
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.2.8	922,650.97	925,665.21
负债合计		168,204,841.71	29,264,885.94
所有者权益：			
实收基金	6.4.2.9	18,777,420,956.51	19,436,351,081.55
未分配利润	6.4.2.10	-944,109,011.11	-7,704,641,462.30
所有者权益合计		17,833,311,945.40	11,731,709,619.25
负债和所有者权益总计		18,001,516,787.11	11,760,974,505.19

注：报告截止日 2009 年 6 月 30 日，基金份额净值 0.9497 元，基金份额总额 18,777,420,956.51 份。

6.2 利润表

会计主体：华宝兴业行业精选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	附注号	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		6,736,967,576.88	-10,133,808,091.59
1.利息收入		27,679,485.79	37,720,197.67
其中：存款利息收入	6.4.2.11	10,493,269.76	19,346,687.68
债券利息收入		17,186,216.03	18,373,509.99
资产支持证券利息收入		-	-
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）		-1,267,521,943.81	1,247,606,176.12
其中：股票投资收益	6.4.2.12	-1,372,833,404.92	1,066,167,499.73
债券投资收益	6.4.2.13	147,400.00	2,876,175.42
资产支持证券投资收益		-	-
衍生工具收益	6.4.2.14	-	43,632,962.69
股利收益	6.4.2.15	105,164,061.11	134,929,538.28
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.2.16	7,975,550,050.30	-11,427,073,604.51
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.2.17	1,259,984.60	7,939,139.13
二、费用（以“-”号填列）		-151,807,313.56	-289,409,375.32
1. 管理人报酬		-108,934,617.15	-178,424,418.61
2. 托管费		-18,155,769.49	-29,737,403.09
3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用	6.4.2.18	-24,446,174.81	-76,878,856.15
5. 利息支出		-	-4,091,073.56
其中：卖出回购金融资产支出		-	-4,091,073.56
6. 其他费用	6.4.2.19	-270,752.11	-277,623.91
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		6,585,160,263.32	-10,423,217,466.91
所得税费用（以“-”号填列）		-	-
四、净利润（净亏损以“-”		6,585,160,263.32	-10,423,217,466.91

号填列			
-----	--	--	--

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：华宝兴业行业精选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）	19,436,351,081.55	-7,704,641,462.30	11,731,709,619.25
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	6,585,160,263.32	6,585,160,263.32
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）	-658,930,125.04	175,372,187.87	-483,557,937.17
其中：1. 基金申购款	623,805,682.06	-78,240,616.12	545,565,065.94
2. 基金赎回款（以“-”号填列）	-1,282,735,807.10	253,612,803.99	-1,029,123,003.11
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）	18,777,420,956.51	-944,109,011.11	17,833,311,945.40
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）	23,027,089,488.19	7,322,797,811.71	30,349,887,299.90
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-10,423,217,466.91	-10,423,217,466.91
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）	-2,845,362,535.18	-416,333,894.33	-3,261,696,429.51
其中：1. 基金申购款	2,517,775,209.29	572,407,802.01	3,090,183,011.30
2. 基金赎回款（以“-”号填列）	-5,363,137,744.47	-988,741,696.34	-6,351,879,440.81

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）	20,181,726,953.01	-3,516,753,549.53	16,664,973,403.48

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 重要财务报表项目的说明

6.4.2.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2009年6月30日
活期存款	2,904,907,009.78
定期存款	-
其他存款	-
合计	2,904,907,009.78

6.4.2.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2009年6月30日			
	成本	公允价值	估值增值	
股票	13,556,375,267.62	14,281,474,409.97	725,099,142.35	
债券	交易所市场	-	-	
	银行间市场	480,500,000.00	482,700,000.00	2,200,000.00
	合计	480,500,000.00	482,700,000.00	2,200,000.00
资产支持证券	-	-	-	
其他	-	-	-	
合计	14,036,875,267.62	14,764,174,409.97	727,299,142.35	

6.4.2.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末未持有衍生金融资产/负债。

6.4.2.4 买入返售金融资产

本基金本报告期末未持有买入返售金融资产。

6.4.2.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2009年6月30日
应收活期存款利息	671,208.37
应收定期存款利息	-
应收其他存款利息	-
应收结算备付金利息	5,008.70
应收债券利息	16,454,794.52
应收买入返售证券利息	-
应收申购款利息	-
其他	-
合计	17,131,011.59

6.4.2.6 其他资产

单位：人民币元

项目	本期末 2009年6月30日
其他应收款	-
待摊费用	50,272.44
合计	50,272.44

6.4.2.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2009年6月30日
交易所市场应付交易费用	9,534,030.29
银行间市场应付交易费用	-
合计	9,534,030.29

6.4.2.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2009年6月30日
应付券商交易单元保证金	750,000.00
应付赎回费	93,307.81
预提费用-审计费	79,343.16
合计	922,650.97

6.4.2.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期

	2009 年 1 月 1 日 - 2009 年 6 月 30 日	
	基金份额 (份)	帐面金额
上年度末	19,436,351,081.55	19,436,351,081.55
本期申购	623,805,682.06	623,805,682.06
本期赎回	-1,282,735,807.10	-1,282,735,807.10
本期末	18,777,420,956.51	18,777,420,956.51

注：申购含红利再投以及转换入份额；赎回含转换出份额。

6.4.2.10 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-2,124,643,393.60	-5,579,998,068.70	-7,704,641,462.30
本期利润	-1,390,389,786.98	7,975,550,050.30	6,585,160,263.32
本期基金份额交易产生的变动数	114,569,119.60	60,803,068.27	175,372,187.87
其中：基金申购款	-111,999,727.84	33,759,111.72	-78,240,616.12
基金赎回款	226,568,847.44	27,043,956.55	253,612,803.99
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-3,400,464,060.98	2,456,355,049.87	-944,109,011.11

6.4.2.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2009 年 1 月 1 日 - 2009 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	10,420,868.65
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	-
结算备付金利息收入	72,277.93
其他	123.18
合计	10,493,269.76

6.4.2.12 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2009 年 1 月 1 日 - 2009 年 6 月 30 日
卖出股票成交总额	8,193,024,405.72
卖出股票成本总额	-9,565,857,810.64
买卖股票差价收入	-1,372,833,404.92

6.4.2.13 债券投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2009年1月1日 - 2009年6月30日
----	------------------------------

卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交金额	900,000,000.00
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	-864,752,600.00
应收利息总额	-35,100,000.00
债券投资收益	147,400.00

6.4.2.14 衍生工具收益

本基金本报告期无衍生工具收益。

6.4.2.15 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2009年1月1日 - 2009年6月30日
股票投资产生的股利收益	105,164,061.11
基金投资产生的股利收益	-
合计	105,164,061.11

6.4.2.16 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目	本期 2009年1月1日 - 2009年6月30日
1. 交易性金融资产	7,975,550,050.30
——股票投资	7,988,307,450.30
——债券投资	-12,757,400.00
——资产支持证券投资	-
——基金投资	-
2. 衍生工具	-
——权证投资	-
3. 其他	-
合计	7,975,550,050.30

6.4.2.17 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2009年1月1日 - 2009年6月30日
基金赎回费收入	1,133,575.57
印花税返还收入	-
基金转出费	126,409.03
合计	1,259,984.60

注：1、本基金的赎回费率按持有期间递减，赎回费总额的 25% 归入基金资产。

2、本基金的转换费由赎回费和申购费补差两部分构成，其中赎回费部分的 25% 归入转出基金的基金资产。

6.4.2.18 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2009年1月1日 - 2009年6月30日
交易所市场交易费用	24,446,174.81
银行间市场交易费用	-
合计	24,446,174.81

6.4.2.19 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2009年1月1日 - 2009年6月30日
审计费用	79,343.16
信息披露费	168,467.28
银行费用	13,941.67
债券托管帐户维护费	9,000.00
其他手续费	-
合计	270,752.11

6.4.3 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.3.1 或有事项

本基金本报告期内无特别或有事项的说明。

6.4.3.2 资产负债表日后事项

本基金本报告期内无特别资产负债表日后事项的说明。

6.4.4 关联方关系

6.4.4.1 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

本基金本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

6.4.4.2 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
华宝证券经纪有限责任公司（“华宝证券”）	受基金管理人的控股股东控制的公司

注：以下关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.5 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.5.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.5.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期	上年度可比期间
	2009年1月1日 - 2009年6月30日	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	1,005,512,387.00	6.40%	2,167,090,743.45	9.94%

6.4.5.1.2 权证交易

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	占当期权证成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例
华宝证券	-	-	19,278,787.07	10.41%

6.4.5.1.3 债券交易

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	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券成交总额的比例
华宝证券	-	-	37,390,119.90	34.38%

6.4.5.1.4 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	854,686.07	6.48%	79,202.57	0.83%
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	1,842,024.74	10.00%	759,197.32	8.13%

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、经手费和由券商承担的证券结算风险基金后的净额列示。债券及权证交易不计佣金。

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。

6.4.5.2 关联方报酬

6.4.5.2.1 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	上年度可比期间 2008年1月1日 - 2008年6月30日

	30日	
当期应支付的管理费	108,934,617.15	178,424,418.61
其中：当期已支付	88,095,158.50	155,745,718.89
期末未支付	20,839,458.65	22,678,699.72

注：支付基金管理人华宝兴业的基金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。

6.4.5.2.2 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	18,155,769.49	29,737,403.09
其中：当期已支付	14,682,526.38	25,957,619.80
期末未支付	3,473,243.11	3,779,783.29

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。

6.4.5.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金本报告期与过往可比期间未有与关联方进行的银行间同业市场的债券（含回购）交易。

6.4.5.4 各关联方投资本基金的情况

6.4.5.4.1 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	1,039,617.78	393,287.88
期间认购总份额	-	-
期间申购/买入总份额	-	646,329.90
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	1,039,617.78	1,039,617.78
期末持有的基金份额 占基金总份额比例	0.01%	0.01%

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。

6.4.5.4.2 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外其他关联方未投资本基金。

6.4.5.5 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
中国建设银行	2,904,907,009.78	10,420,868.65	1,884,650,114.31	19,182,051.16

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。

6.4.5.6 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。

6.4.6 利润分配情况

本基金本报告期内未进行利润分配。

6.4.7 期末（2009年6月30日）本基金持有的流通受限证券

6.4.7.1 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。

6.4.7.2 期末持有的暂时停牌股票

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
000792	盐湖 钾肥	2009-6-26	资产重组	55.14	2009-7-27	60.65	1,567,382	63,420,858.43	86,425,443.48

6.4.7.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.7.3.1 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。

6.4.7.3.2 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。

6.4.8 金融工具风险及管理

6.4.8.1 风险管理政策和组织架构

本基金是一只进行主动投资的股票型证券投资基金，属于具有较高风险、较高收益的基金品种。本基金投资的金融工具主要包括股票、债券及权证等。本基金在日常经营活动中面临的与这些金融工具相关的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金的基金管理人从事风险管理的主要目标是争取将以上风险控制在限定的范围之内，使本基金在风险和收益之间取得最佳的平衡以实现“风险和收益相匹配”的风险收益目标。

本基金的基金管理人奉行全面风险管理体系的建设，公司内部监督和反馈系统包括督察

长、内部控制委员会、副总经理、内控审计风险管理部、各部门负责人和风险控制联络人、各业务岗位。副总经理总管公司的内控事务。督察长向董事会负责，独立地就内控制度的执行情况履行检查、评价、报告和建议职能。内控审计风险管理部在副总经理指导下对公司内部控制运行情况进行监控，主要针对公司内部控制制度的总体构架和内部控制的目标进行评估并提出改进意见；对各部门和岗位的内部控制执行情况进行监督和核查，同时对内控的失控点进行查漏并责令改正。

本基金的基金管理人根据自身经营特点设立顺序递进、权责统一、严密有效的四层监控防线。第一层监控防线为一线岗位自控与互控；第二层防线为大业务板块内部各部门和部门之间的自控和互控；第三层监控防线为内部内控审计风险管理部对各岗位、各部门、各项业务全面实施的监督反馈；最后是以副总经理领导的内部控制委员会为主体的第四层防线，实施对公司各类业务和风险的总体监督、控制，并对内控审计风险管理部的工作予以直接指导。

本基金的基金管理人对于金融工具的风险管理方法是通过结合定性分析和定量分析方法，估测各种风险产生的可能损失。从定性分析的角度出发，判断风险损失的严重程度和出现风险损失的频度。而从定量分析的角度出发，根据本基金的投资目标，结合基金资产所运用金融工具的特征，通过特定的风险量化指标、模型、日常的量化报告，确定风险相应置信程度和损失的限度，及时可靠地对各种风险进行监督、检查和评估，并通过相应决策，将风险控制可在可承受的范围内。

6.4.8.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息等情况，导致基金资产损失和收益变化的风险。

为了规避信用风险，本公司在交易前对交易对手的资信状况进行充分的评估。本基金的银行存款存放在本基金的托管行中国建设银行，因而与该银行存款相关的信用风险不重大。本基金在交易所进行的交易均与中国证券登记结算有限责任公司完成证券交收和款项清算，因此违约风险发生的可能性很小；基金在进行银行间同业市场交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式进行限制以控制相应的信用风险。

本基金的基金管理人建立了信用风险管理流程，通过对投资品种的信用等级评估来控制证券发行人的信用风险，且通过分散化投资以分散信用风险。本基金均投资于具有良好信用等级的证券，且投资于一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金的基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司的证券不得超过该证券的 10%。

6.4.8.3 流动性风险

流动性风险是指基金所持金融工具变现的难易程度。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难或因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理的价格变现。

针对兑付赎回资金的流动性风险，本基金的基金管理人每日对本基金的申购赎回情况进行严密监控并预测流动性需求，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配。本基金的基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。

针对投资品种变现的流动性风险,本基金的基金管理人通过独立的风险管理部门设定流动性比例要求,对流动性指标进行持续的监测和分析,包括组合持仓集中度指标、组合在短时间内变现能力的综合指标、组合中变现能力较差的投资品种比例以及流通受限制的投资品种比例等。本基金所持大部分证券在证券交易所上市,其余亦可在银行间同业市场交易,因此除在附注中列示的部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况外,其余均能及时变现。此外,本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求,其上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值。

本基金所持有的全部金融负债的合同约定到期日均为一个月以内且不计息,可赎回基金份额净值(所有者权益)无固定到期日且不计息,因此账面余额即为未折现的合约到期现金流量。

6.4.8.4 市场风险

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动而发生波动的风险,包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

6.4.8.4.1 利率风险

6.4.8.4.1.1 利率风险敞口

单位:人民币元

本期末 2009年6月30日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	2,904,907,009.78	-	-	-	2,904,907,009.78
结算备付金	14,310,680.74	-	-	-	14,310,680.74
存出保证金	-	-	-	2,970,649.87	2,970,649.87
交易性金融资产	482,700,000.00	-	-	14,281,474,409.97	14,764,174,409.97
应收证券清算款	-	-	-	3,247,476.90	3,247,476.90
应收利息	-	-	-	17,131,011.59	17,131,011.59
应收申购款	18,360.19	-	-	294,706,915.63	294,725,275.82
其他资产	-	-	-	50,272.44	50,272.44
资产总计	3,401,936,050.71	-	-	14,599,580,736.40	18,001,516,787.11
负债					
应付证券清算款	-	-	-	105,872,237.12	105,872,237.12
应付赎回款	-	-	-	27,563,221.57	27,563,221.57
应付管理人报酬	-	-	-	20,839,458.65	20,839,458.65
应付托管费	-	-	-	3,473,243.11	3,473,243.11
应付交易费用	-	-	-	9,534,030.29	9,534,030.29
其他负债	-	-	-	922,650.97	922,650.97
负债总计	-	-	-	168,204,841.71	168,204,841.71
利率敏感度缺口	3,401,936,050.71	-	-	14,431,375,894.69	17,833,311,945.40

上年度末 2008 年 12 月 31 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	1,906,379,165.96	-	-	-	1,906,379,165.96
结算备付金	5,250,737.02	-	-	-	5,250,737.02
存出保证金	-	-	-	1,951,709.05	1,951,709.05
交易性金融资产	1,360,210,000.00	-	-	8,343,776,916.83	9,703,986,916.83
应收证券清算款	-	-	-	107,062,707.71	107,062,707.71
应收利息	-	-	-	34,799,355.35	34,799,355.35
应收申购款	26,801.98	-	-	1,298,371.57	1,325,173.55
其他资产	-	-	-	218,739.72	218,739.72
资产总计	3,271,866,704.96	-	-	8,489,107,800.23	11,760,974,505.19
负债					
应付赎回款	-	-	-	4,293,497.34	4,293,497.34
应付管理人报酬	-	-	-	15,687,450.76	15,687,450.76
应付托管费	-	-	-	2,614,575.13	2,614,575.13
应付交易费用	-	-	-	5,743,697.50	5,743,697.50
其他负债	-	-	-	925,665.21	925,665.21
负债总计	-	-	-	29,264,885.94	29,264,885.94
利率敏感度缺口	3,271,866,704.96	-	-	8,459,842,914.29	11,731,709,619.25

6.4.8.4.1.2 利率风险的敏感性分析

于 2009 年 6 月 30 日，本基金持有的交易性债券投资公允价值占基金资产净值的比例为 2.71% (2008 年 12 月 31 日：11.59%)，因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响。

6.4.8.4.2 外汇风险

本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无重大外汇风险。

6.4.8.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场交易的股票和债券，所面临的其他价格风险来源于单个证券发行主体自身经营情况或特殊事项的影响，也可能来源于证券市场整体波动的影响。

本基金的基金管理人在构建和管理投资组合的过程中，采用“自上而下”的策略，通过对宏观经济情况及政策的分析，结合证券市场运行情况，做出资产配置及投资组合构建的策略；通过对单个证券的定性分析及定量分析，选择符合基金合同约定范围的投资品种进行投资。本基金的基金管理人定期结合宏观及微观环境的变化，对投资策略、资产配置、投资组合进行修正，来主动应对可能发生的市场价格风险。

本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险。此外，本基金的基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控，定期运用多种定量方法对基金进行风险度量，包括 VaR (Value at Risk) 指标等来测试本基金面临的潜在价格风险，及时可靠地对风险进行跟踪

和控制。

本基金投资组合中股票占基金资产总值的 60%-95%，权证占 0%-3%，资产支持证券占 0%-20%，债券占 5%-40%。于 2009 年 6 月 30 日，本基金面临的整体其他价格风险列示如下：

6.4.8.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2009 年 6 月 30 日		上年度末 2008 年 12 月 31 日	
	公允价值	占基金资产 净值比例 (%)	公允价值	占基金资产 净值比例 (%)
交易性金融资产-股票投资	14,281,474,409.97	80.08	8,343,776,916.83	71.12
衍生金融资产-权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	14,281,474,409.97	80.08	8,343,776,916.83	71.12

6.4.8.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除业绩比较基准以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币万元）	
		本期末 2009 年 6 月 30 日	上年度末 2008 年 12 月 31 日
	业绩比较基准上升5%	增加112,742	增加72,819
	业绩比较基准下降5%	减少112,742	减少72,819

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	14,281,474,409.97	79.33
	其中：股票	14,281,474,409.97	79.33
2	固定收益投资	482,700,000.00	2.68

	其中：债券	482,700,000.00	2.68
	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	2,919,217,690.52	16.22
6	其他资产	318,124,686.62	1.77
7	合计	18,001,516,787.11	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	102,974,464.44	0.58
B	采掘业	1,533,830,427.14	8.60
C	制造业	3,575,283,784.97	20.05
C0	食品、饮料	492,385,546.47	2.76
C1	纺织、服装、皮毛	95,051,475.75	0.53
C2	木材、家具	-	-
C3	造纸、印刷	227,664,832.08	1.28
C4	石油、化学、塑胶、塑料	505,822,908.73	2.84
C5	电子	103,724,200.32	0.58
C6	金属、非金属	513,195,818.42	2.88
C7	机械、设备、仪表	804,781,870.49	4.51
C8	医药、生物制品	807,019,968.00	4.53
C99	其他制造业	25,637,164.71	0.14
D	电力、煤气及水的生产和供应业	456,804,836.54	2.56
E	建筑业	171,955,405.00	0.96
F	交通运输、仓储业	935,500,227.03	5.25
G	信息技术业	927,584,207.05	5.20
H	批发和零售贸易	662,925,552.24	3.72
I	金融、保险业	4,595,200,706.99	25.77
J	房地产业	1,194,095,628.55	6.70
K	社会服务业	46,698,379.20	0.26
L	传播与文化产业	78,620,790.82	0.44
M	综合类	-	-
	合计	14,281,474,409.97	80.08

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

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	600000	浦发银行	42,348,988	974,873,703.76	5.47
2	600036	招商银行	39,734,165	890,442,637.65	4.99
3	601398	工商银行	152,325,186	825,602,508.12	4.63
4	600030	中信证券	26,675,293	753,843,780.18	4.23
5	600383	金地集团	38,187,121	615,576,390.52	3.45
6	600050	中国联通	77,207,887	529,646,104.82	2.97
7	601006	大秦铁路	44,511,479	471,376,562.61	2.64
8	600900	长江电力	33,149,843	456,804,836.54	2.56
9	601318	中国平安	8,869,920	438,706,243.20	2.46
10	000402	金融街	31,208,919	429,434,725.44	2.41
11	600016	民生银行	52,542,885	416,139,649.20	2.33
12	601088	中国神华	13,638,846	407,937,883.86	2.29
13	600028	中国石化	25,600,000	272,896,000.00	1.53
14	000800	一汽轿车	17,474,191	269,801,509.04	1.51
15	000527	美的电器	17,245,140	246,605,502.00	1.38
16	000001	深发展 A	11,238,934	245,233,539.88	1.38
17	000898	鞍钢股份	16,758,525	221,044,944.75	1.24
18	000858	五粮液	11,165,177	220,288,942.21	1.24
19	600153	建发股份	14,549,243	196,851,257.79	1.10
20	600123	兰花科创	5,247,894	185,093,221.38	1.04
21	601666	平煤股份	6,322,179	182,774,194.89	1.02
22	600269	赣粤高速	14,859,932	162,567,656.08	0.91
23	000568	泸州老窖	5,586,697	160,338,203.90	0.90
24	000063	中兴通讯	5,601,765	157,409,596.50	0.88
25	002024	苏宁电器	9,270,205	148,972,194.35	0.84
26	000488	晨鸣纸业	18,452,709	142,085,859.30	0.80
27	600309	烟台万华	8,967,697	141,420,581.69	0.79
28	002001	新和成	3,772,573	131,285,540.40	0.74
29	000999	三九医药	7,846,027	123,574,925.25	0.69
30	600739	辽宁成大	3,707,001	122,775,873.12	0.69
31	600380	健康元	18,238,141	117,636,009.45	0.66
32	600196	复星医药	8,052,160	116,675,798.40	0.65
33	600812	华北制药	12,669,200	106,547,972.00	0.60
34	600875	东方电气	2,704,521	105,205,866.90	0.59
35	600348	国阳新能	3,248,747	98,631,958.92	0.55

36	600997	开滦股份	5,245,379	98,036,133.51	0.55
37	600660	福耀玻璃	11,866,374	97,422,930.54	0.55
38	000792	盐湖钾肥	1,567,382	86,425,443.48	0.48
39	600308	华泰股份	7,968,247	85,578,972.78	0.48
40	600004	白云机场	8,778,225	84,007,613.25	0.47
41	000423	东阿阿胶	4,663,250	83,658,705.00	0.47
42	600519	贵州茅台	564,206	83,508,130.06	0.47
43	000338	潍柴动力	2,269,931	82,693,586.33	0.46
44	601186	中国铁建	8,000,000	82,320,000.00	0.46
45	600188	兖州煤业	5,235,851	81,679,275.60	0.46
46	600880	博瑞传播	3,710,278	78,620,790.82	0.44
47	600717	天津港	6,472,057	78,506,051.41	0.44
48	600060	海信电器	6,540,372	75,606,700.32	0.42
49	600628	新世界	6,904,097	74,426,165.66	0.42
50	600035	楚天高速	13,022,739	72,276,201.45	0.41
51	600048	保利地产	2,564,196	71,515,426.44	0.40
52	000937	金牛能源	1,843,617	71,347,977.90	0.40
53	600829	三精制药	3,723,344	67,690,393.92	0.38
54	600664	哈药股份	4,848,698	67,687,824.08	0.38
55	600161	天坛生物	2,983,010	67,416,026.00	0.38
56	600426	华鲁恒升	4,069,432	66,657,296.16	0.37
57	600251	冠农股份	2,584,205	64,191,652.20	0.36
58	600410	华胜天成	5,129,681	63,659,341.21	0.36
59	601699	潞安环能	1,567,906	61,916,607.94	0.35
60	601390	中国中铁	8,656,972	58,780,839.88	0.33
61	600529	山东药玻	4,808,924	58,139,891.16	0.33
62	002029	七匹狼	3,581,995	54,983,623.25	0.31
63	600498	烽火通信	3,260,000	53,464,000.00	0.30
64	601628	中国人寿	1,827,900	50,358,645.00	0.28
65	600361	华联综超	4,899,869	46,842,747.64	0.26
66	600741	华域汽车	5,765,232	46,698,379.20	0.26
67	600588	用友软件	2,426,190	46,073,348.10	0.26
68	600271	航天信息	2,829,378	44,958,816.42	0.25
69	600971	恒源煤电	1,742,634	44,367,461.64	0.25
70	002152	广电运通	1,725,225	44,338,282.50	0.25
71	000417	合肥百货	4,655,040	40,079,894.40	0.22
72	000726	鲁泰A	4,713,865	40,067,852.50	0.22
73	600325	华发股份	1,763,324	39,833,489.16	0.22
74	600897	厦门空港	2,537,821	39,666,142.23	0.22
75	600005	XD 武钢股	4,999,930	39,399,448.40	0.22
76	600354	敦煌种业	3,199,902	38,782,812.24	0.22

77	002208	合肥城建	2,604,251	37,735,596.99	0.21
78	000623	吉林敖东	857,889	34,718,767.83	0.19
79	000987	广州友谊	1,692,886	32,977,419.28	0.18
80	600535	天士力	2,000,000	32,780,000.00	0.18
81	600570	恒生电子	2,700,000	32,373,000.00	0.18
82	600352	浙江龙盛	4,506,000	32,037,660.00	0.18
83	600068	XD 葛洲坝	2,537,382	30,854,565.12	0.17
84	000932	华菱钢铁	3,980,865	29,498,209.65	0.17
85	600276	恒瑞医药	837,889	29,250,704.99	0.16
86	600583	海油工程	2,464,050	29,149,711.50	0.16
87	600066	宇通客车	2,349,696	28,807,272.96	0.16
88	000869	张裕A	501,781	28,250,270.30	0.16
89	002008	大族激光	3,450,000	28,117,500.00	0.16
90	000598	蓝星清洗	2,772,733	28,004,603.30	0.16
91	002073	青岛软控	1,369,231	27,329,850.76	0.15
92	600029	南方航空	5,000,000	27,100,000.00	0.15
93	000538	云南白药	773,521	27,073,235.00	0.15
94	002003	伟星股份	1,631,901	25,637,164.71	0.14
95	600486	扬农化工	622,797	19,991,783.70	0.11

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	600050	中国联通	366,766,046.57	3.13
2	600030	中信证券	352,799,945.48	3.01
3	601398	工商银行	322,774,596.37	2.75
4	601006	大秦铁路	301,891,746.37	2.57
5	600036	招商银行	255,447,269.24	2.18
6	000402	金融街	253,523,146.00	2.16
7	000527	美的电器	159,014,257.64	1.36
8	601088	中国神华	158,462,490.72	1.35
9	000858	五粮液	148,743,812.49	1.27
10	000012	南玻A	142,437,225.50	1.21
11	000999	三九医药	125,932,900.34	1.07
12	000937	金牛能源	124,587,439.06	1.06
13	002001	新和成	119,965,494.86	1.02
14	600739	辽宁成大	119,656,563.86	1.02

15	000568	泸州老窖	118,095,795.89	1.01
16	600795	国电电力	104,713,498.82	0.89
17	002024	苏宁电器	97,806,853.60	0.83
18	600153	建发股份	91,847,395.30	0.78
19	600309	烟台万华	90,687,631.60	0.77
20	600251	冠农股份	80,444,647.76	0.69

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	600256	广汇股份	299,748,070.46	2.56
2	601398	工商银行	268,500,283.36	2.29
3	600005	武钢股份	231,263,370.39	1.97
4	600997	开滦股份	205,447,323.64	1.75
5	600058	五矿发展	196,571,489.13	1.68
6	000012	南玻A	180,246,876.54	1.54
7	600000	浦发银行	180,208,943.60	1.54
8	000024	招商地产	156,775,283.66	1.34
9	600036	招商银行	154,338,887.17	1.32
10	600015	华夏银行	153,734,339.32	1.31
11	601088	中国神华	151,183,884.18	1.29
12	000898	鞍钢股份	147,303,347.49	1.26
13	600886	国投电力	135,074,350.95	1.15
14	600219	南山铝业	132,456,131.19	1.13
15	601666	平煤股份	124,091,420.48	1.06
16	000983	西山煤电	120,336,443.73	1.03
17	000157	中联重科	119,827,424.65	1.02
18	600795	国电电力	114,940,837.76	0.98
19	600362	江西铜业	114,630,765.41	0.98
20	600675	中华企业	114,616,240.70	0.98

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

买入股票的成本（成交）总额	7,515,247,853.48
卖出股票的收入（成交）总额	8,193,024,405.72

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

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
1	国家债券	-	-
2	央行票据	482,700,000.00	2.71
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	可转债	-	-
7	其他	-	-
8	合计	482,700,000.00	2.71

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

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量 (张)	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
1	0801098	08 央行票据 98	5,000,000	482,700,000.00	2.71

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的所有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 本基金股票投资的主要对象是增长前景良好或周期复苏的行业和企

业，基金管理人建立有基金股票备选库。本报告期内本基金的前十名股票投资没有超出基金合同规定的股票备选库。

7.9.3 其他资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	2,970,649.87
2	应收证券清算款	3,247,476.90
3	应收股利	-
4	应收利息	17,131,011.59
5	应收申购款	294,725,275.82
6	其他应收款	-
7	待摊费用	50,272.44
8	其他	-
9	合计	318,124,686.62

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的情况。

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
743,377	25,259.62	427,903,677.58	2.28%	18,349,517,278.93	97.72%

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

份额单位：份

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	983,293.60	0.0052%

9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2007-06-14）基金份额总额	9,998,540,080.34
报告期期初基金份额总额	19,436,351,081.55
报告期期间基金总申购份额	623,805,682.06
报告期期间基金总赎回份额	-1,282,735,807.10
报告期期间基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-
报告期期末基金份额总额	18,777,420,956.51

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

2009年6月30日，经中国证券监督管理委员会核准，华宝兴业基金管理公司聘任任志强先生、HUANG XIAOYI HELEN（黄小蕙）女士为华宝兴业基金管理有限公司副总经理。

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 报告期内改聘会计师事务所情况

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（2007年6月14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监管部门稽查或处罚的情况

本报告期内管理人和托管人及其高级管理人员未有受到监管部门稽查或处罚的情况。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

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	
		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
中金国际	1	541,570,253.82	3.45%	460,324.34	3.49%
中信证券	1	1,871,814,248.32	11.92%	1,520,866.00	11.54%
银河证券	1	1,819,583,333.88	11.58%	1,546,627.16	11.73%
中银国际	1	1,333,688,394.01	8.49%	1,083,630.60	8.22%
高华证券	1	2,224,679,892.04	14.16%	1,890,971.53	14.34%
西南证券	1	270,010,024.82	1.72%	229,508.34	1.74%
华宝证券	1	1,005,512,387.00	6.40%	854,686.07	6.48%
海通证券	1	1,257,458,921.28	8.01%	1,068,839.25	8.11%
瑞银证券	1	1,969,144,622.72	12.54%	1,673,769.98	12.69%
光大证券	1	783,938,005.46	4.99%	666,346.78	5.05%
长城证券	1	1,254,358,727.98	7.99%	1,019,177.60	7.73%
国泰君安	1	438,468,632.40	2.79%	372,695.56	2.83%
安信证券	1	287,613,883.78	1.83%	244,468.38	1.85%
齐鲁证券	1	547,496,444.64	3.49%	465,367.98	3.53%
中投证券	1	102,934,487.05	0.66%	87,496.00	0.66%
兴业证券	1	-	-	-	-

注：1、本基金本报告期新增国泰君安、安信证券、齐鲁证券和中投证券 4 个交易单元。

2、基金管理人选择交易单元的标准和程序如下：

(1) 选择标准：资质雄厚，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。

10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	关于华宝兴业基金公司部分基金参加工商银行“2009 倾心回馈”基金定期定额业务申购费优惠活动的提示性公告	《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》以及基金管理人网站	2009-1-1
2	关于华宝兴业基金公司部分基金参加建设银行定期定额业务申购费率优惠活动的提示性公告	《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》以及基金管理人网站	2009-1-1
3	华宝兴业基金公司关于网上直销建设银行卡交易费率调整的公告	《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》以及基金管理人网站	2009-1-20
4	华宝兴业基金管理有限公司关于华宝兴业行业精选股票型证券投资基金增聘基金经理公告	《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》以及基金管理人网站	2009-2-26
5	华宝兴业基金管理有限公司关于旗下部分基金开通基金转换业务的公告	《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》以及基金管理人网站	2009-3-3
6	关于华宝兴业基金管理有限公司全部基金增加深圳发展银行股份有限公司为代销机构的公告	《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》以及基金管理人网站	2009-3-23
7	关于华宝兴业基金管理有限公司增加中国国际金融有限公司为代销机构的公告	《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》以及基金管理人网站	2009-3-25
8	关于华宝兴业旗下部分基金增加华宝证券经纪有限责任公司为代销机构的公告	《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》以及基金管理人网站	2009-4-2
9	关于华宝兴业旗下部分基金增加中国农业银行股份有限公司为代销机构的公告	《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》以及基金管理人网站	2009-4-2
10	华宝兴业基金管理有限公司关于旗下基金在部分代销机构开通基金转换业务的公告	《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》以及基金管理人网站	2009-4-17
11	关于华宝兴业基金管理有限公司增加齐鲁证券为代销机构的公告	《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》以及基金管理人网站	2009-4-29
12	关于华宝兴业基金管理有限公司在光大证券开办基金定期定额投资计划业务的公告	《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》以及基金管理人网站	2009-5-8

11 影响投资者决策的其他重要信息

1、2009 年 1 月 16 日，基金托管人公告其聘请胡哲一先生担任中国建设银行股份有限公司副行长；

2、2009 年 5 月 14 日，美国银行公告关于中国建设银行股份有限公司股权变动报告书；

3、2009 年 5 月 26 日，中国建银投资有限责任公司公告关于中国建设银行股份有限公司股权变动报告书；

4、2009 年 5 月 26 日，中央汇金投资有限责任公司公告关于中国建设银行股份有限公司股权变动报告书；

5、2009 年 8 月 2 日，基金托管人公告，自 2009 年 7 月 24 日起陈佐夫先生就任中国建设银行股份有限公司执行董事。

12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

中国证监会批准基金设立的文件；
华宝兴业行业精选股票型证券投资基金基金合同；
华宝兴业行业精选股票型证券投资基金招募说明书；
华宝兴业行业精选股票型证券投资基金托管协议；
基金管理人业务资格批件、营业执照和公司章程；
基金管理人报告期内在指定报刊上披露的各种公告；
基金托管人业务资格批件和营业执照。

12.2 存放地点

以上文件存于基金管理人及基金托管人办公场所备投资者查阅。

12.3 查阅方式

投资者可以通过基金管理人网站，查阅或下载基金合同、招募说明书、托管协议及基金的各种定期和临时公告。

华宝兴业基金管理有限公司
二〇〇九年八月二十八日