华宝兴业资源优选股票型证券投资基金

2012 年度 报告摘要

2012年12月31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
送出日期:2013年3月27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3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。

本年度报告摘要摘自年度报告正文,投资者欲了解详细内容,应阅读年度报告正文。

本报告中的财务资料已经审计,普华永道中天会计师事务所有限公司为本基金出具了无保留意见的审计报告。

本报告期自2012年8月21日(基金合同生效日)起至12月31日止。

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	华宝兴业资源优选股票型证券投资基金
基金简称	华宝兴业资源优选
基金主代码	240022
交易代码	240022
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2012年8月21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	123,559,139.58份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	把握资源相关行业的投资机会,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,决定大类资产配置比例。本基金采用自上而下和自下而上相结合的方法,通过对资源相关子行业的精选以及对行业内相关股票的深入分析,挖掘该类型企业的投资价值,分享资源稀缺性所带来的行业高回报。本基金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。本基金将根据市场的实际情况及基金的申购赎回状况,将部分资产投资于中国证监会批准的允许基金投资的其他金融工具,包括但不限于可转换债券、央行票据,以捕捉市场机会,提高基金资产的使用效率。
业绩比较基准	80%×中证内地资源主题指数收益率+20%×上证国债指数收益率
风险收益特征	本基金为股票型基金,在证券投资基金中属于风险和收益水平都较高的品种。其预期风险收益水平高于混合型基金、债券型基金及货币市场基金。

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	010-66594855
	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
注册地址		上海浦东新区世纪大道100号上海环球金融中心58楼	北京市西城区复兴门内大街1号
办公地址		上海浦东新区世纪大道100号上海环球金融中心58楼	北京市西城区复兴门内大街1号
邮政编码		200120	100818
法定代表人		郑安国	肖钢

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
登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	www.fsfund.com
基金年度报告备置地点	本基金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、基金净值表现及利润分配情况

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	2012年8月21日(基金合同生效日)-2012年12月31日
本期已实现收益	1,775,019.25
本期利润	3,322,060.95
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	1.33%
本期基金份额净值增长率	2.40%
3.1.2 期末数据和指标	2012年末
期末可供分配利润	1,201,682.34
期末可供分配基金份额利润	0.0097
期末基金资产净值	126,577,703.32
期末基金份额净值	1.024
3.1.3 累计期末指标	2012年末
基金份额累计净值增长率	2.40%

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)。

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。

5、本基金成立2012年8月21日,本报告期不完整且没有过往可比期间。

3.2 基金净值表现

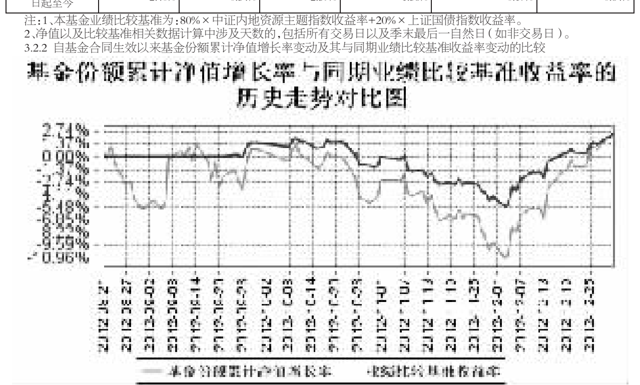
3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

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
过去三个月	0.79%	0.64%	1.73%	1.20%	-0.94%	-0.56%
自基金合同生效日起至今	2.40%	0.54%	2.59%	1.38%	-0.19%	-0.84%

注:1、本基金业绩比较基准为:80%×中证内地资源主题指数收益率+20%×上证国债指数收益率。

2、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)。

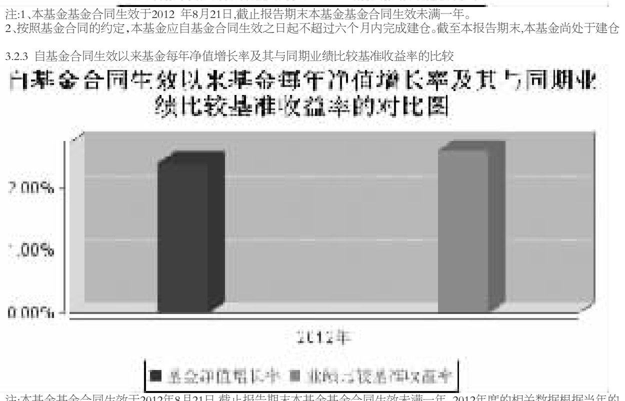
3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较



注:1、本基金基金合同生效于2012 年8月21日,截止报告期末本基金基金合同生效未满一年。

2、按照基金合同的约定,本基金应自基金合同生效之日起不超过六个月内完成建仓。截至本报告期末,本基金尚处于建仓期。

3.2.3 自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较



注:本基金基金合同生效于2012年8月21日,截止报告期末本基金基金合同生效未满一年。2012年度的相关数据根据当年的实际存续期计算。

3.3 过去三年基金的利润分配情况

本基金成立于2012年8月21日,基金成立至今未进行利润分配。

§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(2012年12月31 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、华宝短融50基金、华宝兴业资源优选基金和华宝添益基金,所管理的开放式证券投资基金资产净值合计37,660,892,995.57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		
蔡目荣	本基金基金经理	2012年8月21日	-	9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、基金经理助理和交易员的职务。2012年8月起任华宝兴业资源优选股票型证券投资基金基金经理。

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、《华宝兴业资源优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 公平交易制度和控制方法

基金管理人从研究分析、授权、投资决策、交易执行、业绩评估等投资管理活动的各个环节出发制定了公司内部的公平交易制度以确保公司所有投资组合在各个环节得到公平的对待。公平交易制度和控制方法适用公司管理所有投资组合(包括公募基金、特定客户资产管理组合),对应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。

研究分析方面,公司使用统一的投资研究管理系统,并规定所有与投资业务相关的研究报告和股票入库信息必须在该系统中发表和存档。同时,该系统对所有投资组合经理设置相同的使用权限。

授权和投资决策方面,投资组合经理在其权限范围内的投资决策保持独立,并对其投资决策的结果负责。通过各个系统的权限设置使投资组合经理仅能看到自己的组合情况。

交易执行方面,所有投资组合的投资指令必须通过交易系统分发和执行。对于交易所公开竞价交易,交易系统内置公平交易执行程序。公司内部制度规定此类交易指令需执行公平交易程序,由交易部负责人执行。针对其他不能通过系统执行公平交易程序且必须以公司名义统一进行交易的指令,公司内部制定相关制度流程以确保此类交易的公允分配。同时,公司根据法规要求在交易系统中设置一系列投资禁止与限制指标对公平交易的执行进行事前控制,主要包括限制公司旗下组合自身及组合间反向交易、对敲交易、银行间关联方交易等。

事后监督,公司的风险管理部作为独立第三方对所有投资行为进行事后监督,主要监督的事项包括以下内容。

1) 每季度和每年度对公司管理的不同投资组合的整体收益率差异、分投资类别(股票、债券)的收益率差异进行分析。

2) 每季度和每年度对公司管理的不同投资组合所有交易所二级市场交易进行1日、3日、5日同向交易价差分析。

3) 对公司管理的不同投资组合的所有银行间债券买卖和回购交易进行分析。监督的内容包括以下几点,同一投资组合短期内对同一债券的反向交易,债券买卖到期收益率与中债登估价收益率之间的差异,回购利率与当日市场平均利率之间的差异。对上述监督内容存在异常的情况要求投资组合经理进行合理性解释。

4) 对非公开发行股票申购、以公司名义进行的债券一级市场申购的申购方案和分配过程的公允性进行监督。

4.3.2 公平交易制度的执行情况

2012年全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。

4.3.3 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。

4.4 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

2012年1-3季度国内经济增速不断下滑,4季度才呈现弱势复苏。从海外情况看,上半年在欧债危机拖累了全球经济增长,美国经济相对较好。为应对国内经济下滑局面,政府2012年二季度起陆续启动了部分停工基建项目,基建投资快速回升,国内经济四季度得以提振。欧盟、美国下半年也分别实施了宽松的货币政策,欧美经济下半年也略有好转。

2012年A股市场走势是先上涨,然后持续下跌,最后一个月快速拉升的走势。年初上涨主要是对国内货币政策宽松良好预期,但受国内外经济增速持续下滑以及国内货币政策宽松不达预期影响,市场5月份以后持续下跌。12月份市场在经济回暖、市场估值低、未来预期好转等因素带动下市场出现了一段快速拉升的行情。全年看,上证综指涨幅6.52%,深成指涨幅5.71%,内地资源指数涨幅-0.03%,中信煤炭指数涨幅-3.22%,中信有色指数跌幅11.73%。煤炭有色等资源行业年初曾经爆发了一轮"煤飞色舞"的行情,但后来受资源产品价格下滑,下半年整个板块不断下跌,12月份虽有反弹但幅度明显滞后于大盘。

本基金2012年8月21日成立,还处于建仓期,由于资源行业景气较低,建仓较为缓慢,低估了市场上涨的幅度,虽然前期避免了净值的较大损失,但也错失了后面的市场上涨行情。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截止至本报告期末,本报告期内基金份额净值增长率为2.40%,同期业绩比较基准收益率为2.59%,基金表现落后于基准0.19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2013年,房地产行业由于2012年销售良好,预计2013年地产投资将会好转;预计政府换届后城镇化建设将会逐步启动;预计通胀率还会维持较低水平,因此货币政策也会维持稳健偏适度宽松的状态,因此预计中国经济状况将会好于2012年,主要风险是来自于通胀率的快速回升以及部分城市房价涨幅过大带来政策收紧。从海外情况看,欧债危机虽然还会有所反复,但预计最困难的时期已经过去;美国财政悬崖和债务上限在上半年还有不确定性,但预计最后实现平稳过渡是大概率事件,下半年继续呈现经济复苏的态势。

对于A股市场来说,经历了持续调整以后,目前已经进入了长期投资的底部区域,我们对中国未来经济的平稳增长有信心,因此我们2013年尽快完成建仓工作,操作上会更加积极。配置上主要偏向于投资资源行业里面景气处于底部,未来有望受益于经济复苏的子行业。我们将努力为投资人创造好的回报。

4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

公司自2003年3月成立以来始终注重合规性和业务风险控制。加强对基金运作的内部操作风险控制、保障基金份额持有人的利益始终是公司制定各项内部制度、流程的指导思想。公司监察稽核部门对公司遵守各项法规和管理制度及公司所管理的各基金履行合同义务的情况进行核查,发现问题及时提出改进建议并督促业务部门进行整改,同时定期向监管部门、公司管理层及上级公司出具相关报告。

本报告期内,基金管理人内部监察稽核主要工作如下:

(一)规范员工行为操守,加强职业道德教育和风险教育。公司通过对新员工集中组织岗前培训、签署《个人声明书》等形式,明确员工行为准则,防范道德风险。

(二)完善公司制度体系。公司一方面坚持制度的刚性,不轻易改变、简化已确立的流程。要求从一般员工、部门经理到业务总监,每个人都必须清楚自己的权力和职责,承担相应责任。另一方面,伴随市场变革和产品创新,公司的业务和管理方式也发生着变化。在长期的业务实践中,公司借鉴和吸收海外股东、国内同行经验,在符合公司基本制度的前提下,根据业务的发展不时调整。允许各级员工在职责范围内设计和调整自己的业务流程,涉及其它部门或领域的,由相应级别的负责人在符合公司已有制度的基础上协调和批准。公司根据业务情况调整和细化了市场、营运、投资研究等各方面的分工和业务规则,并根据内部控制委员会和监察稽核部门提出的意见,建议调整或改善了前、中、后台的业务流程。

(三)有重点地全面开展内部审计稽核工作。2012年,监察稽核部门按计划对公司营运、投资、市场部门进行了业务审计,并与相关部门进行沟通,形成后续跟踪和业务上相互促进的良性循环,不断提高工作质量。

在今后的工作中,本基金管理人将继续坚持一贯的内部控制理念,完善内控制度,提高工作水平,努力防范和控制各种风险,保障基金份额持有人的合法权益。

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

本基金本报告期末进行利润分配,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")在对华宝兴业资源优选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 审计报告

普华永道中天会计师事务所为本基金出具了无保留意见的审计报告,投资者可通过年度报告正文查看审计报告全文。

§7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体:华宝兴业资源优选股票型证券投资基金

报告截止日:2012年12月31日

单位:人民币元

资 产	附注号	本期末 2012年12月31日
资 产:		
银行存款		52,400,559.27
结算备付金		601,215.61
存出保证金		2,185.49
交易性金融资产		69,509,107.34
其中:股票投资		69,509,107.34
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		15,000,000.00
应收证券清算款		-
应收利息		28,430.78
应收股利		-
应收申购款		1,580.77
递延所得税资产		-
其他资产		-
资产总计		137,543,079.26
负债和所有者权益	附注号	本期末 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		4,566,518.23
应付赎回款		5,767,526.25
应付管理人报酬		174,461.88
应付托管费		29,076.97
应付销售服务费		-
应付交易费用		266,069.00
应交税费		-
应付利息		-
应付利润		-
递延所得税负债		-
其他负债		161,723.61
负债合计		10,965,375.94
所有者权益:		
实收基金		123,559,139.58
未分配利润		3,018,563.74
所有者权益合计		126,577,703.32
负债和所有者权益总计		137,543,079.26

注:

1. 报告截止日2012年12月31日,基金份额净值1.024元,基金份额总额123,559,139.58份。

2. 本财务报表的实际编制期间为2012年8月21日(基金合同生效日)至2012年12月31日。

7.2 利润表

会计主体:华宝兴业资源优选股票型证券投资基金

本报告期:2012年8月21日(基金合同生效日) 至 2012年12月31日

单位:人民币元

项 目	附注号	本期 2012年8月21日(基金合同生效日)至2012年12月31日
一、收入		5,474,060.98
1.利息收入		1,157,848.00
其中:存款利息收入		377,548.75
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		780,299.25
其他利息收入		-
2.投资收益(损失以"-"填列)		2,287,514.60
其中:股票投资收益		2,287,514.60
基金投资收益		-
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		-
3.公允价值变动收益(损失以"-"号填列)		1,547,041.70
4.汇兑收益(损失以"-"号填列)		-
5.其他收入(损失以"-"号填列)		481,656.68
减:二、费用		2,152,000.03
1. 管理人报酬		1,315,275.23
2. 托管费		219,212.62
3. 销售服务费		-
4. 交易费用		469,123.60
5. 利息支出		-
其中:卖出回购金融资产支出		-
6. 其他费用		148,388.58
三、利润总额(亏损总额以"-"号填列)		3,322,060.95
减:所得税费用		-
四、净利润(净亏损以"-"号填列)		3,322,060.95

7.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体:华宝兴业资源优选股票型证券投资基金

本报告期:2012年8月21日(基金合同生效日) 至 2012年12月31日

单位:人民币元

项目	本期 2012年8月21日(基金合同生效日)至2012年12月31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)	502,977,780.46	-	502,977,780.46
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	3,322,060.95	3,322,060.95
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)	-379,418,640.88	-303,497.21	-379,722,138.09
其中:1.基金申购款	3,495,533.59	3,512.19	3,499,045.78
2.基金赎回款	-382,914,174.47	-307,009.40	-383,221,183.87
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)	123,559,139.58	3,018,563.74	126,577,703.32

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.4 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

7.4 报表附注

7.4.1 基金基本情况

华宝兴业资源优选股票型证券投资基金(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[2012]685号《关于核准华宝兴业资源优选股票型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《华宝兴业资源优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502,951,385.57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(2012)第316号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《华宝兴业资源优选股票型证券投资基金基金合同》于2012 年8月21日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为502,977,780.46份基金份额,其中认购资金利息折合26,394.89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。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《华宝兴业资源优选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A股股票(包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票)、债券、货币市场工具、资产支持证券以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具,但需符合中国证监会的相关规定。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种,基金管理人在履行适当程序后,可以将其纳入投资范围。本基金的股票投资比例为基金资产的60%-95%,其中,投资于资源相关股票的比例不低于股票资产的80%。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,持有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的5%。其它金融工具的投资比例依照法规和监管机构的规定执行。

根据《华宝兴业资源优选股票型证券投资基金基金合同》的规定,本基金的投资组合应在基金成立六个月内达到基金合同规定的比例限制。截至2012年12月31日止,本基金尚处于建仓期。

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3月25日批准报出。

7.4.2 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》、《华宝兴业资源优选股票型证券投资基金基金合同》和在财务报表附注7.4.4所列示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。

7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金2012年8月21日(基金合同生效日)至2012年12月31日止期间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2012年12月31日的财务状况以及2012年8月21日(基金合同生效日)至2012年12月31日止期间的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

7.4.4 重要会计政策和会计估计

7.4.4.1 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。本期财务报表的实际编制期间为2012年8月21日(基金合同生效日)至2012年12月31日。

7.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

7.4.4.3 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。

本基金目前以交易目的持有的股票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。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其他各类应收款项等。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包括其他各类应付款项等。

7.4.4.4 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,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的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。

金融资产满足下列条件之一的,予以终止确认:(1) 收取该金融资产现金流量的合同权利终止;(2) 该金融资产已转移,且本基金将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方;或者(3) 该金融资产已转移,虽然本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬,但是放弃了对该金融资产控制。

金融资产终止确认时,其账面价值与收到的对价的差额,计入当期损益。

当金融负债的现时义务全部或部分已经解除时,终止确认该金融负债或义务已解除的部分。终止确认部分的账面价值与支付的对价之间的差额,计入当期损益。

7.4.4.5 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。

7.4.4.6 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1) 具有抵销已确认金额的法定权利且该种法定权利现在是可执行的;且2) 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。

7.4.4.7 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。

7.4.4.8 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)。

7.4.4.9 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。

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;于处置时,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。

7.4.4.10 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则按直线法计算。

7.4.4.11 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为正数,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,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,即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。

7.4.4.12 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) 本基金的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,不需要披露分部信息。

7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

7.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期末发生会计政策变更。

7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期末发生会计估计变更。

7.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

7.4.6 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[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) 对基金从证券市场中取得的收入,包括买卖股票、债券的差价收入,股权的股息、红利收入,债券的利息收入及其他收入,暂不征收企业所得税。

(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支付利息时代扣代缴20%的个人所得税。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。

(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。

7.4.7 关联方关系

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
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
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。

7.4.8 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.8.1 通过关联方交易单元进行的交易

本基金本期无通过关联方交易单元进行的交易。

7.4.8.2 关联方报酬

7.4.8.2.1 基金管理费

单位:人民币元

项目	本期 2012年8月21日(基金合同生效日)至2012年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	1,315,275.23
其中:支付销售机构的客户维护费	432,398.74

注:支付基金管理人 华宝兴业基金管理有限公司 的管理人报酬按前一日基金资产净值1.50%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 × 1.50% / 当年天数。

7.4.8.2.2 基金托管费

单位:人民币元

项目	本期 2012年8月21日(基金合同生效日)至2012年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	219,212.62

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0.25%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 × 0.25% / 当年天数。

7.4.8.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金本期未与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。

7.4.8.4 各关联方投资本基金的情况

7.4.8.4.1 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 2012年8月21日(基金合同生效日)至2012年12月31日
基金合同生效日(2012年8月21日)持有的基金份额	-
期初持有的基金份额	0.00
期间申购/买入总份额	293,904.22
期间因拆分变动份额	0.00
减:期间赎回/卖出总份额	0.00
期末持有的基金份额	293,904.22
期末持有的基金份额占基金总份额比例	0.24%

注:1. 基金管理人华宝兴业基金管理有限公司在本年度申购本基金的交易委托国泰君安证券股份有限公司办理,适用费率为1.5%。

7.4.8.4.2 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 2012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
宝钢集团有限公司	29,999,000.00	24.28%

7.4.8.5 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 2012年8月21日(基金合同生效日)至2012年12月31日	
	期末余额	当期利息收入
中国银行	52,400,559.27	360,706.85

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。

7.4.8.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本期无在承销期内参与关联方承销证券的情况。

7.4.8.7 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期无须作说明的其他关联交易事项。

7.4.9 期末(2012年12月31日)本基金持有的流通受限证券

7.4.9.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

本基金本期末未持有因认购新发、增发证券而流通受限的证券。

7.4.9.2 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的股票。

7.4.9.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.9.3.1 银行间市场债券正回购

本基金本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。

7.4.9.3.2 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,因此没有在债券正回购交易中作为抵押的债券。

7.4.10 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2012年12月31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69,509,107.34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

对于证券交易所上市的股票和债券,若出现重大事项停牌、交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)、或属于非公开发行等情况,本基金分别于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间不将相关股票和债券的公允价值列入第一层级;并根据估值调整中采用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度,确定相关股票和债券公允价值应属第二层级或第三层级。

(iv)第三层级公允价值余额和本期变动金额

无。

(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。

§8 投资组合报告

8.1 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	69,509,107.34	50.54
	其中:股票	69,509,107.34	50.54
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	15,000,000.00	10.91
	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	53,001,774.88	38.53
6	其他各项资产	32,197.04	0.02
7	合计	137,543,079.26	100.00

8.2 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	42,017,079.37	33.19
C	制造业	25,704,027.97	20.31
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	5,753,260.00	4.55
C5	电子	-	-
C6	金属、非金属	19,950,767.97	15.76
C7	机械、设备、仪表	-	-
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	400,800.00	0.32
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	1,387,200.00	1.10
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	69,509,107.34	54.91

8.3 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	600028	中国石化	600,000	4,152,000.00	3.28
2	600123	兰花科创	194,957	3,955,677.53	3.13
3	601857	中国石油	430,000	3,887,200.00	3.07
4	601899	紫金矿业	1,000,000	3,830,000.00	3.03
5	601898	中煤能源	470,000	3,675,400.00	2.90
6	600547	山东黄金	94,927	3,622,414.32	2.86
7	601088	中国神华	140,000	3,549,000.00	2.80
8	002155	辰州矿业	145,000	2,911,600.00	2.30
9	600403	大有能源	130,000	2,676,700.00	2.11
10	600997	开滦股份	256,375	2,620,152.50	2.07

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的年度报告正文。

8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

8.4.1 累计买入金额超出期末基金资产净值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	占期末基金资产净值比例(%)
1	601857	中国石油	12,010,516.87	9.49
2	600157	永泰能源	9,906,640.48	7.83
3	600348	阳泉煤业	8,214,610.89	6.49
4	000059	辽通化工	7,865,289.38	6.21
5	600123	兰花科创	7,442,472.52	5.88
6	601088	中国神华	7,335,022.04	5.79
7	000422	湖北宜化	7,165,718.52	5.66
8	600546	山煤国际	6,689,428.43	5.28
9	002155	辰州矿业	6,628,256.90	5.24
10	601918	国投新集	6,371,391.00	5.03
11	600547	山东黄金	6,170,811.10	4.88
12	600489	中金黄金	5,929,570.96	4.68
13	600028	中国石化	5,245,593.85	4.14
14	000937	冀中能源	5,157,586.00	4.07
15	601699	潞安环能	4,966,933.33	3.92
16	601899	紫金矿业	4,953,000.00	3.91
17	000807	云铝股份	4,950,248.71	3.91
18	601898	中煤能源	4,296,354.30	3.39
19	600141	兴发集团	4,250,299.24	3.36
20	002501	利源铝业	4,088,948.80	3.23
21	600362	江西铜业	3,875,713.32	3.06
22	600309	烟台万华	3,698,125.60	2.92
23	601991	大唐发电	3,667,500.00	2.90
24	600549	厦门钨业	3,588,370.11	2.83
25	600673	东阳光铝	3,543,601.70	2.80
26	600352	浙江龙盛	3,438,697.90	2.72
27	600459	贵研铂业	3,267,404.45	2.58
28	600111	包钢稀土	3,238,544.80	2.56
29	000630	铜陵有色	3,221,490.41	2.55
30	000960	锡业股份	2,709,784.00	2.14
31	600403	大有能源	2,573,021.00	2.03
32	000612	焦作万方	2,571,422.48	2.03
33	600997	开滦股份	2,554,190.50	2.02

注:买入金额不包括相关交易费用。

8.4.2 累计卖出金额超出期末基金资产净值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	占期末基金资产净值比例(%)
1	600157	永泰能源	9,669,279.96	7.64
2	000059	辽通化工	8,597,085.17	6.79
3	601857	中国石油	8,290,907.06	6.55
4	000422	湖北宜化	7,393,504.56	5.84
5	600348	阳泉煤业	6,835,730.38	5.40
6	600546	山煤国际	6,674,769.53	5.27
7	000937	冀中能源	5,571,025.68	4.40
8	601699	潞安环能	5,382,409.00	4.25
9	601918	国投新集	4,699,950.06	3.71
10	002501	利源铝业	4,244,705.50	3.35
11	600123	兰花科创	4,152,322.00	3.28
12	601088	中国神华	4,139,585.16	3.27
13	600309	烟台万华	3,994,644.76	3.16
14	002155	辰州矿业	3,750,654.91	2.96
15	601991	大唐发电	3,731,500.00	2.95
16	600489	中金黄金	3,638,617.97	2.87
17	600673	东阳光铝	3,558,438.96	2.81
18	600549	厦门钨业	3,240,614.49	2.56
19	000807	云铝股份	3,229,326.71	2.55
20	000060	中金岭南	2,465,733.40	1.95

注:卖出金额不包括相关交易费用。

8.4.3 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	198,228,190.08
卖出股票收入(成交)总额	132,553,639.04

注:买入股票成本、卖出股票收入均不包括相关交易费用。

8.5 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。

8.6 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。

8.7 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。

8.8 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。

8.9 投资组合报告附注

8.9.1 2012年5月11日紫金矿业集团股份有限公司发布《紫金矿业收到中国证监会行政处罚决定书公告》。紫金矿业于2012年5月9日收到了中国证券监督管理委员会《行政处罚决定书》([2012]10号),该决定书对紫金矿业集团股份有限公司及相关责任人进行了行政处罚。本基金管理人通过对该上市公司进行的进一步了解和分析,认为该处罚不会对紫金矿业投资价值构成实质性影响,因此本基金管理人对该上市公司的投资判断未发生改变。报告期内,本基金投资的前十名证券的其余九名证券的发行主体没有被监管部门立案调查或在本报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情况。

8.9.2 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。

8.9.3 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	2,185.49
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	28,430.78
5	应收申购款	1,580.77
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	32,197.04

8.9.4 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。

8.9.5 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。

§9 基金份额持有人信息

9.1 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
826	149,587.34	47,290,904.22	38.27%	76,268,235.36	61.73%

9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

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基金	683,366.94	0.5531%

注:

(一)本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有该只基金份额总量的数量区间:0

(二)该只基金的基金经理持有该只基金份额总量的数量区间:10万份至50万份(含)

附:数量区间为0、0至10万份(含)、10万份至50万份(含)、50万份至100万份(含)、100万份以上。

§10 开放式基金份额变动

单位:份

基金合同生效日(2012年8月21日)基金份额总额	502,977,780.46
基金合同生效日起至报告期期末基金总申购份额	3,495,533.59
减:基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回份额	382,914,174.47
基金合同生效日起至报告期期末基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	123,559,139.58

注:总申购份额含转换入份额;总赎回份额含转换出份额。

§11 重大事件揭示

11.1 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。

11.2 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

本报告期内,本基金管理人、本基金托管人的专门基金托管部门未发生重大人事变动。

2013年3月17日,根据国家金融工作需要,肖钢先生辞去中国银行股份有限公司董事长职务。中国银行股份有限公司已于2013年3月17日公告上述事项。

11.3 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。

11.4 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。

11.5 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在本报告期的审计报酬为50,000.00元人民币。目前该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(2012年8月21日)起至本报告期末。

11.6 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。

11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

11.7.1 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	
中信金通	1	104,947,913.69	31.73%	95,544.34	32.00%	-
招商证券	1	52,687,473.24	15.93%	46,623.18	15.61%	-
中信建投	1	43,277,572.48	13.08%	39,399.81	13.19%	-
长江证券	1	43,192,627.55	13.06%	39,322.29	13.17%	-
海通证券	1	39,158,069.70	11.84%	34,651.07	11.60%	-
齐鲁证券	1	26,745,534.21	8.09%	24,348.93	8.15%	-
国泰君安	1	8,416,954.20	2.54%	7,662.78	2.57%	-
光大证券	1	7,329,139.00	2.22%	6,485.56	2.17%	-
中金国际	2	3,763,393.06	1.14%	3,425.89	1.15%	-
广发证券	1	1,263,151.99	0.38%	1,149.95	0.39%	-
太平洋证券	1	-	-	-	-	-
兴业证券	1	-	-	-	-	-
申银万国	1	-	-	-	-	-
国信证券	1	-	-	-	-	-
国联证券	1	-	-	-	-	-

注:1、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、本基金成立于报告期,所列交易单元均为新增。

11.7.2 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
中信金通	-	-	248,400,000.00	9.48%	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-
中信建投	-	-	2,270,000,000.00	86.63%	-	-
长江证券	-	-	29,300,000.00	1.12%	-	-
海通证券	-	-	-	-	-	-
齐鲁证券	-	-	43,700,000.00	1.67%	-	-
国泰君安	-	-	14,000,000.00	0.53%	-	-
光大证券	-	-	-	-	-	-
中金国际	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	15,000,000.00	0.57%	-	-
太平洋证券	-	-	-	-	-	-
兴业证券	-	-	-	-	-	-
申银万国	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-
国联证券	-	-	-	-	-	-

华宝兴业基金管理有限公司

2013年3月27日