华宝兴业医药生物优选股票型证券投资基金

2013 年度 报告摘要

2013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：中国建设银行股份有限公司
送出日期：2014年3月31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。

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2014年3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，安永华明会计师事务所为本基金出具了无保留意见的审计报告。

本报告期自2013年01月01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	华宝兴业医药生物优选股票型证券投资基金
基金简称	华宝兴业医药生物
基金主代码	240020
交易代码	240020
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2012年2月28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	701,658,113.43份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	把握医药生物相关行业的长期增长，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。通过对医药生物相关行业的辨识、精选以及对医药生物行业相关股票的深入分析，挖掘该类型企业的投资价值。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	80%×中证医药卫生指数+20%×上证国债指数
风险收益特征	本基金是一只积极型的股票投资基金，属于证券投资基金中较高预期风险和预期收益的品种，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	中国建设银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	刘月华	田青
	联系电话	021-38505888	010-67595096
	电子邮箱	xxpl@fsfund.com	tianqing1.zh@ccb.com
客户服务电话		400-700-5588、021-38924558	010—67595096
传真		021-38505777	010-66275853

2.4 信息披露方式

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	2013年	2012年2月28日(基金合同生效日)–2012年12月31日
本期已实现收益	61,151,735.59	15,277,404.00
本期利润	87,620,965.12	30,612,752.01
加权平均基金份额本期利润	0.3039	0.1019
本期加权平均净值利润率	22.45%	9.77%
本期基金份额净值增长率	33.96%	11.60%
3.1.2 期末数据和指标	2013年末	2012年末
期末可供分配利润	72,877,763.28	16,239,908.11
期末可供分配基金份额利润	0.1039	0.0693
期末基金资产净值	839,958,762.57	261,425,347.17
期末基金份额净值	1.197	1.116
3.1.3 累计期末指标	2013年末	2012年末
基金份额累计净值增长率	49.50%	11.60%

注：1、所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

2、本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

3、净值相关数据计算中涉及天数的，包括所有交易日以及季末最后一自然日（如非交易日）。

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

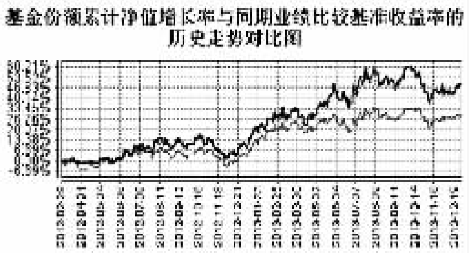
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①–③	②–④
过去三个月	–6.10%	1.22%	–2.66%	1.00%	–3.44%	0.22%
过去六个月	9.04%	1.39%	8.34%	1.11%	0.70%	0.28%
过去一年	33.96%	1.49%	23.66%	1.20%	10.30%	0.29%
自基金合同生效日起至今	49.50%	1.29%	29.56%	1.13%	19.94%	0.16%

注：1、本基金业绩比较基准为：80%×中证医药卫生指数+20%×上证国债指数。

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）。

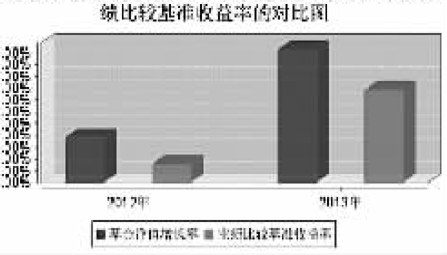
3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

（2012年2月28日至2013年12月31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2012年8月28日，本基金已达到合同规定的资产配置比例。

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：本基金基金合同于2012年2月28日生效，合同生效当年按实际存续期计算，不按整个自然年度进行折算。

3.3 过去三年基金的利润分配情况

单位：人民币元

年度	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	年度利润分配合计	备注
2013	2.8900	175,385,325.92	19,709,489.99	195,094,815.91	
2012	–	–	–	–	
合计	2.8900	175,385,325.92	19,709,489.99	195,094,815.91	

§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（2013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、华宝添益基金和华宝兴业服务优选基金，所管理的开放式证券投资基金资产净值合计42,053,592,319.43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		
范红兵	本基金基金经理、华宝兴业大盘精选基金经理、华宝兴业行业精选基金经理华宝兴业医药生物基金经理	2012年2月28日	–	13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2010年9月任华宝兴业行业精选股票型证券投资基金基金经理，2010年7月起任华宝兴业大盘精选股票型证券投资基金基金经理，2012年2月起兼任华宝兴业医药生物优选股票型证券投资基金基金经理，2013年7月起兼任华宝兴业行业精选股票型证券投资基金基金经理。
王智慧	研究部总经理、本基金基金经理、华宝兴业大盘精选基金经理、华宝兴业多策略基金基金经理	2012年2月28日	–	12年	管理学博士。曾在中国国际金融有限公司、上海申银万国证券研究所、浙江龙盛集团、国元证券有限公司从事投资研究工作。2009年8月加入华宝兴业基金管理有限公司，先后任研究部副总经理、投资经理、基金经理助理的职务，现任研究部总经理，2012年1月至今任华宝兴业大盘精选股票型证券投资基金的基金经理，2012年2月起兼任华宝兴业医药生物优选股票型证券投资基金基金经理，2013年2月起兼任华宝兴业多策略增长开放式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、《华宝兴业医药生物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求最大利益，没有损害基金份额持有人利益的行为。

由于股、债市的系统性风险和申购赎回引起的基金资产规模变化，医药生物基金在短期内出现过持有的现金、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高于40%、个股市值占基金资产净值比超过10%的情况。发生此类情况后，该基金均在合理期限内得到了调整，没有给投资人带来额外风险或损失。

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，由交易部负责人负责执行。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

2013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

2013 年沪深两市演绎了冰火两重天的二八行情，年初在延续2012年四季度大盘蓝筹股尤其是金融股单边大涨格局后，在接下来的三个季度内以创业版和中小板为代表的新兴经济增长方式的成长股走出了单边大幅上涨行情，尤其是以创业板指数在报告期内涨幅更是达到80%左右，但期间传统的价值蓝筹股板块虽有短期振荡行情，但总体价值中枢在下移。我们认为呈现出这种行情格局主要有以下几个方面因素：首先是市场流动性偏紧，6月份一度出现了严重的钱荒，市场对IPO开闸的持续担忧；其次传统的经济增长方式在年初出现了严重的挑战，国内大范围严重的雾霾天气、食品安全等事件的爆发警示了再靠投资拉动的粗放式经济发展方式走到了尽头，经济转型成为必然，代表传统增长方式的大多数价值蓝筹股在这种政策影响下，行业性的投资机会比较小；另外今年新一届政府对经济转型的决心和实施力度空前，出台了一系列鼓励和支持新经济的措施，在市场中行业增长此消彼涨的相对比较中，创业板和中小板等代表经济转型方向的成长股就具备了一定的投资机会。年度内以传媒文化、游戏、环保、医药、新能源、TMT等行业出现了超市场预期的单边行情。

报告期内，医药行业由于其自身增长的内在动力与国家的宏观经济政策相关性不大，支持行业增长的如人口老年化、人均收入增长、政府支持力度等因素继续有利于行业的发展。虽然从全年看，医药指数在期间也出现了因短期涨幅过大下调或药品降价等政策因素影响的下跌，但全年医药工业收入和利润增长依然保持了两位数增长势头，尤其是在国家放开医疗服务业政策的背景下，医药板块的局部子行业如医疗器械、医院服务和外包等公司走出大幅上涨的行情。

本基金在年度内积极应对医药政策变动对相关公司的影响实施了提前布局措施；同时年末本基金实施了自成立以来的首次大额分红，基金仓位的大幅变化部分影响了一段时间的基金净值表现，由于相对周全的考虑减少了影响程度。年度内因相对看好医药行业运行数据同比和环比数据在整个市场中的行业间相对比较优势，基金仓位上保持了相对高位，同时在组合中以优化个股投资权重为主，仓位小幅调整为辅的投资策略。本基金在投资选股优化方面主要集中在一线蓝筹股和相对合理估值的成长股中，聚焦有资源优势、品牌优势、估值优势、创新优势的龙头企业。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末，本报告期内基金份额净值增长率为33.96%，同期业绩比较基准收益率为23.66%，基金表现领先业绩比较基准10.30%。

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2014年，在资本市场扩容压力、偏紧的货币政策、美国量化宽松政策逐步退去的背景下，国内资本市场将可能延续结构性的行情，股市的大幅反弹尚不具备条件。确定性增长行业、国家积极鼓励支持的行业、改革转型受益的行业等将存在较大的投资机会。医药行业由于其自身发展的内在动力如人口老年化加剧、收入增长带来的健康支持能力的增强将继续支持行业保持较快的增长势头，尤其是国家将大力放开医疗服务业的投资进入门槛，鼓励医药创新模式等等。展望未来一年医药行业的投资机会，我们保持相对谨慎乐观态度。

本基金未来投资策略将集中在优化持仓结构，继续重点持有发展格局清晰、业绩增长明确、估值合理的细分领域龙头公司，相对看好医药子行业中具有较强自主创新能力且估值合理的化学处方药、医药服务类、医疗器械类、生物创新平台类、内生和外延均具有优势的中成品牌药等上市公司。

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，明确员工的行为准则，防范道德风险。并在具体工作中坚持加强法规培训，努力培养员工的风险意识、合法合规意识。

（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。公司根据法律法规的变化、监管要求和业务情况不断调整和细化市场、营运、投资研究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。2013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，加强了防控内幕交易等行为的稽核力度；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

根据法律法规及基金合同的规定，本基金于2013年11月26日发布了分红公告，本次分红为2013年度的第一次分红。本基金向2013年11月28日在本基金注册登记机构登记在册的基金份额持有人按每10份基金份额派发红利2.89元，利润分配合计为人民币195094815.91元，其中现金形式发放总额为人民币175385325.92元，再投资形式发放总额为人民币19709489.99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，发现个别监督指标不符合基金合同约定并及时通知了基金管理人，基金管理人在合理期限内进行了调整，对基金份额持有人利益未造成损害。

报告期内，本基金实施利润分配的金额合计为人民币195094815.91元。

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 审计报告

安永华明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：华宝兴业医药生物优选股票型证券投资基金

报告截止日：2013年12月31日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2013年12月31日	上年度末 2012年12月31日
资产：			
银行存款		53,904,188.54	30,910,684.16
结算备付金		3,099,391.18	472,741.58
存出保证金		259,608.25	169,985.64
交易性金融资产		694,301,566.13	227,832,875.36
其中：股票投资		694,068,458.97	217,845,875.36
基金投资		–	–
债券投资		233,107.16	9,987,000.00
资产支持证券投资		–	–
贵金属投资		–	–
衍生金融资产		–	–
买入返售金融资产		–	–
应收证券清算款		92,328,972.25	7,647,427.25
应收利息		23,167.02	132,900.70
应收股利		–	–
应收申购款		1,899,987.96	86,896.53
递延所得税资产		–	–
其他资产		–	–
资产总计		845,816,881.33	267,253,511.22
负债和所有者权益	附注号	本期末 2013年12月31日	上年度末 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		–	–
应付赎回款		2,445,627.45	4,565,884.19
应付管理人报酬		1,029,161.93	308,361.07
应付托管费		171,527.01	51,393.53
应付销售服务费		–	–
应付交易费用		1,898,579.46	559,947.86
应交税费		–	–
应付利息		–	–
应付利润		–	–
递延所得税负债		–	–
其他负债		313,222.91	342,577.40
负债合计		5,858,118.76	5,828,164.05
所有者权益：			
实收基金		701,658,113.43	234,245,077.83
未分配利润		138,300,649.14	27,180,269.34
所有者权益合计		839,958,762.57	261,425,347.17
负债和所有者权益总计		845,816,881.33	267,253,511.22

注：1.报告截止日2013年12月31日，基金份额净值1.197 元，基金份额总额701,658,113.43 份。

2.本财务报表的比较期间为2012年2月28日（基金合同生效日）至2012年12月31日。

7.2 利润表

会计主体：华宝兴业医药生物优选股票型证券投资基金

本报告期：2013年1月1日至2013年12月31日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2013年1月1日至2013年12月31日	上年度可比期间 2012年2月28日(基金合同生效日)至2012年12月31日
一、收入		99,428,599.38	37,966,651.63
1.利息收入		548,558.75	1,394,411.27
其中：存款利息收入		439,040.90	645,710.83
债券利息收入		78,376.17	455,203.19
资产支持证券利息收入		–	–
买入返售金融资产收入		31,141.68	293,497.25
其他利息收入		–	–
2.投资收益（损失以“–”填列）		68,666,811.49	20,086,171.22
其中：股票投资收益		67,081,667.30	17,633,213.49
基金投资收益		–	–
债券投资收益		22,440.00	646,530.00
资产支持证券投资收益		–	–
贵金属投资收益		–	–
衍生工具收益		–	–
股利收益		1,562,704.19	1,806,427.73
3.公允价值变动收益（损失以“–”号填列）		26,469,229.53	15,335,348.01
4.汇兑收益（损失以“–”号填列）		–	–
5.其他收入（损失以“–”号填列）		3,743,999.61	1,150,721.13
减：二、费用		11,807,634.26	7,353,899.62
1. 管理人报酬		5,783,715.84	3,951,279.79
2. 托管费		963,952.60	658,546.70
3. 销售服务费		–	–
4. 交易费用		4,730,696.82	2,403,077.63
5. 利息支出		–	–
其中：卖出回购金融资产支出		–	–
6. 其他费用		329,269.00	340,995.50
三、利润总额（亏损总额以“–”号填列）		87,620,965.12	30,612,752.01
减：所得税费用		–	–
四、净利润（净亏损以“–”号填列）		87,620,965.12	30,612,752.01

7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：华宝兴业医药生物优选股票型证券投资基金

本报告期：2013年1月1日至2013年12月31日

单位：人民币元

项目	本期 2013年1月1日至2013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）	234,245,077.83	27,180,269.34	261,425,347.17
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	–	87,620,965.12	87,620,965.12
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）	467,413,035.60	218,594,230.59	686,007,266.19
其中：1.基金申购款	1,268,968,453.16	515,414,495.47	1,784,382,948.63
2.基金赎回款	–801,555,417.56	–296,820,264.88	–1,098,375,682.44
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）	–	–195,094,815.91	–195,094,815.91
五、期末所有者权益（基金净值）	701,658,113.43	138,300,649.14	839,958,762.57
项目	上年度可比期间 2012年2月28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）	554,397,242.54	–	554,397,242.54
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	–	30,612,752.01	30,612,752.01
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）	–320,152,164.71	–3,432,482.67	–323,584,647.38
其中：1.基金申购款	267,839,550.36	25,121,649.25	292,961,199.61
2.基金赎回款	–587,991,715.07	–28,554,131.92	–616,545,846.99
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）	234,245,077.83	27,180,269.34	261,425,347.17

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：

黄小薏	向辉	张幸骏
基金管理人负责人	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

华宝兴业医药生物优选股票型证券投资基金(以下简称“本基金”)，系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[2011]1115号文《关于核准华宝兴业医药生物优选股票型证券投资基金募集的批复》的核准，由华宝兴业基金管理有限公司作为发起人于2012年1月30日至2012年2月24日向社会公开募集，募集期结束经安永华明会计师事务所有限公司验证并出具安永华明(2012)验字第60737318_B01号验资报告后，向中国证监会报送基金备案材料。基金合同于2012年2月28日生效。本基金为契约型开放式，存续期限不定。设立时募集的扣除认购费后的实收基金（本金）为人民币554,322,041.80元，在募集期间产生的活期存款利息为人民币75,200.74元，以上实收基金（本息）合计为人民币554,397,242.54元，折合554,397,242.54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，注册登记机构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。

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、权证、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，投资于医药生物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。

本基金的业绩比较基准为：80%中证医药卫生指数+20%上证国债指数。

7.4.2 会计报表的编制基础

本财务报表系按照中国财政部2006年2月颁布的《企业会计准则—基本准则》和38项具体会计准则、其后颁布的应用指南、解释以及其他相关规定（以下合称“企业会计准则”）编制，同时，对于在具体会计核算和信息披露方面，也参考了中国证券投资基金业协会制定的《证券投资基金会计核算业务指引》、中国证监会制定的《关于进一步规范证券投资基金估值业务的指导意见》、《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》、《证券投资基金信息披露管理办法》、《证券投资基金信息披露内容与格式准则》第2号《年度报告的内容与格式》、《证券投资基金信息披露编报规则》第3号《会计报表附注的编制及披露》、《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>》及其他中国证监会颁布的相关规定。

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本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于2013年12月31日的财务状况以及2013年度的经营成果和净值变动情况。

7.4.4 重要会计政策和会计估计

本基金财务报表所载财务信息根据下列依照企业会计准则、《证券投资基金会计核算业务指引》和其他相关规定所厘定的主要会计政策和会计估计编制。

7.4.4.1 会计年度

本基金会计年度采用公历年度，即每年1月1日起至12月31日止。本期财务报表的实际编制期间系2013年1月1日起至2013年12月31日止。

7.4.4.2 记账本位币

本基金记账本位币和编制本财务报表所采用的货币均为人民币。除有特别说明外，均以人民币元为单位表示。

7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

金融工具是指形成本基金的金融资产（或负债），并形成其他单位的金融负债（或资产）或权益工具的合同。

(1)金融资产分类

本基金的金融资产于初始确认时分为以下两类：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、贷款和应收款项；

本基金目前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主要包括股票投资、债券投资和衍生工具（主要系权证投资）；

(2)金融负债分类

本基金的金融负债于初始确认时归类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债和其他金融负债。本基金目前持有的金融负债划分为其他金融负债。

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

本基金于成为金融工具合同的一方时确认一项金融资产或金融负债。

划分为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产的股票、债券等，以及不作为有效套期工具的衍生工具，按照取得时的公允价值作为初始确认金额，相关的交易费用在发生时计入当期损益；

在持有以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产期间取得的利息或现金股利，应当确认为当期收益。每日，本基金将以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产或金融负债的公允价值变动计入当期损益；

处置该金融资产或金融负债时，其公允价值与初始入账金额之间的差额应确认为投资收益，同时调整公允价值变动收益；

当收取该金融资产现金流量的合同权利终止，或该金融资产已转移，且符合金融资产转移的终止确认条件的，金融资产将终止确认；

当金融负债的现时义务全部或部分已经解除的，该金融负债或其一部分将终止确认；

金融资产转移，是指本基金将金融资产让与或交付给该金融资产发行方以外的另一方(转入方)；本基金已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的，终止确认该金融资产；保留了金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬的，不终止确认该金融资产；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的，分别下列情况处理：放弃了对该金融资产控制的，终止确认该金融资产并确认产生的资产和负债；未放弃对该金融资产控制的，按照其继续涉入所转移金融资产的程度确认有关金融资产，并相应确认有关负债；

本基金主要金融工具的成本计价方法具体如下：

(1)股票投资

买入股票于成交日确认为股票投资，股票投资成本，按成交日应支付的全部价款扣除交易费用入账；

卖出股票于成交日确认股票投资收益，卖出股票的成本按移动加权平均法于成交日结转；

(2)债券投资

买入债券于成交日确认为债券投资。债券投资成本，按成交日应支付的全部价款扣除交易费用入账，其中所包含的债券应收利息单独核算，不构成债券投资成本；

买入零息债券视同到期一次性还本付息的附息债券，根据其发行价、到期价和发行期限按直线法推算内含票面利率后，按上述会计处理方法核算；

卖出债券于成交日确认债券投资收益，卖出债券的成本按移动加权平均法结转；

(3)权证投资

买入权证于成交日确认为权证投资。权证投资成本按成交日应支付的全部价款扣除交易费用后入账；

卖出权证于成交日确认衍生工具投资收益，卖出权证的成本按移动加权平均法于成交日结转；

(4)分离交易可转债

申购新发行的分离交易可转债于获得日，按可分离权证公允价值占分离交易可转债全部公允价值的比例将购买分离交易可转债实际支付全部价款的一部分确认为权证投资成本，按实际支付的全部价款扣减可分离权证确定的成本确认债券成本；

上市后，上市流通的债券和权证分别按上述(2)、(3)中相关原则进行计算；

(5)回购协议

基金持有的回购协议（封闭式回购），以成本列示，按实际利率（当实际利率与合同利率差异较小时，也可以用合同利率）在实际持有期间内逐日计提利息。

7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

公允价值是指在公平交易中熟悉情况的交易双方自愿进行资产交换或者债务清偿的金额。本基金的公允价值的计量分为三个层次，第一层次是本基金在计量日能获得相同资产或负债在活跃市场上报价的，以该报价为依据确定公允价值；第二层次是本基金在计量日能获得类似资产或负债在活跃市场上的报价，或相同或类似资产或负债在非活跃市场上的报价的，以该报价为依据做必要调整确定公允价值；第三层次是本基金无法获得相同或类似资产可比市场交易价格的，以其他反映市场参与者对资产或负债定价时所使用的参数为依据确定公允价值。本基金主要金融工具的估值方法如下：

1)股票投资

(1)上市流通的股票的估值

上市流通的股票按估值日该股票在证券交易所的收盘价估值。估值日无交易的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，按最近交易日的收盘价估值；如最近交易日后经济环境发生了重大变化或证券发行机构发生了影响证券价格的重大事件，可参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易市价，确定公允价值。如有充足证据表明最近交易市价不能真实反映公允价值，调整最近交易市价，确定公允价值；

(2)未上市的股票的估值

A.送股、转增股、公开增发新股或配股的股票，以其在证券交易所挂牌的同一证券估值日的估值方法估值；

B.首次公开发行的股票，采用估值技术确定公允价值，在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下，按其成本价计算；

首次公开发行有明确锁定期的股票，同一股票在交易所上市后，以其在证券交易所挂牌的同一证券估值日的估值方法估值；

C.非公开发行有明确锁定期的股票的估值

本基金投资的非公开发行的股票按以下方法估值：

a. 估值日在证券交易所上市交易的同一股票的市价低于非公开发行股票的初始取得成本时，采用在证券交易所的同一股票的市价作为估值日该非公开发行股票的价值；

b. 估值日在证券交易所上市交易的同一股票的市价高于非公开发行股票的初始取得成本时，按中国证监会相关规定处理；

2) 债券投资

(1)证券交易所市场实行净价交易的债券按估值日收盘价估值。估值日无交易的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，按最近交易日的收盘价估值；如最近交易日后经济环境发生了重大变化或证券发行机构发生了影响证券价格的重大事件，可参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易市价，确定公允价值。如有充足证据表明最近交易市价不能真实反映公允价值，调整最近交易市价，确定公允价值；

(2)证券交易所市场未实行净价交易的债券按估值日收盘价减去债券收盘价中所含的债券应收利息得到的净价进行估值。估值日无交易的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，按最近交易日债券收盘净价估值；如最近交易日后经济环境发生了重大变化或证券发行机构发生了影响证券价格的重大事件，可参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易市价，确定公允价值。如有充足证据表明最近交易市价不能真实反映公允价值，调整最近交易市价，确定公允价值；

(3)未上市债券、交易所以大宗交易方式转让的资产支持证券，采用估值技术确定公允价值，在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下，按成本进行后续计量；

(4)在全国银行间债券市场交易的债券、资产支持证券等固定收益品种，采用估值技术确定公允价值；

3) 权证投资

(1)上市流通的权证按估值日该权证在证券交易所的收盘价估值。估值日无交易的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，按最近交易日的收盘价估值；如最近交易日后经济环境发生了重大变化或证券发行机构发生了影响证券价格的重大事件，可参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易市价，确定公允价值。如有充足证据表明最近交易市价不能真实反映公允价值，调整最近交易市价，确定公允价值；

(2)未上市流通的权证，采用估值技术确定公允价值，在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下，按成本计量；

(3)因持有股票而享有的配股权证，采用估值技术确定公允价值进行估值；

4)分离交易可转债

分离交易可转债，上市日前，采用估值技术分别对债券和权证进行估值；自上市日起，上市流通的债券和权证分别按上述2)、3)中的相关原则进行估值；

5)其他

(1)如有确凿证据表明按上述方法进行估值不能客观反映金融资产公允价值的，基金管理人可根据具体情况与基金托管人商定后，按最能反映公允价值的方法估值；

(2)如有新增事项，按国家最新规定估值。

7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

当本基金具有抵销已确认金融资产和金融负债的法定权利，且该种法定权利现在是可执行的，同时本基金计划以净额结算或同时变现该金融资产和清偿该金融负债时，金融资产和金融负债以相互抵销后的金额在资产负债表内列示。除此以外，金融资产和金融负债在资产负债表内分别列示，不予相互抵销。

7.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行的基金份额总额所对应的金额。由于申购和赎回引起的实收基金份额变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日确认。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损益平准金和未实现损益平准金。已实现损益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收益/(损失)占基金净值比例计算的金额。未实现损益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利得/(损失)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确认。

未实现损益平准金与已实现损益平准金均在“损益平准金”科目中核算，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

(1)存款利息收入按存款的本金与适用的利率逐日计提的金额入账。若提前支取定期存款，按协议规定的利率及持有期重新计算存款利息收入，并根据提前支取所实际收到的利息收入与账面已确认的利息收入的差额确认利息损失，列入利息收入减项，存款利息收入以净额列示；

(2)债券利息收入按债券票面价值与票面利率或内含票面利率计算的金额扣除应由债券发行企业代扣代缴的个人所得税后的净额确认，在债券实际持有期内逐日计提；

(3)资产支持证券利息收入按证券票面价值与票面利率计算的金额，扣除应由资产支持证券发行企业代扣代缴的个人所得税后的净额确认，在证券实际持有期内逐日计提；

(4)买入返售金融资产收入，按买入返售金融资产的摊余成本及实际利率（当实际利率与合同利率差异较小时，也可以用合同利率），在回购期内逐日计提；

(5)股票投资收益/(损失)于卖出股票成交日确认，并按卖出股票成交金额与其成本的差额入账；

(6)债券投资收益/(损失)于成交日确认，并按成交总额与其成本、应收利息的差额入账；

(7)衍生工具收益/(损失)于卖出权证成交日确认，并按卖出权证成交金额与其成本的差额入账；

(8)股利收益于除息日确认，并按上市公司宣告的分红派息比例计算的金额扣除应由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额入账；

(9)公允价值变动收益/(损失)系本基金持有的采用公允价值模式计量的交易性金融资产、交易性金融负债等公允价值变动形成的应计入当期损益的利得或损失；

(10)其他收入在主要风险和报酬已经转移给对方，经济利益很可能流入且金额可以可靠计量的时候确认。

7.4.4.10 费用的确认和计量

(1)基金管理费按前一日基金资产净值的1.5%的年费率逐日计提；

(2)基金托管费按前一日基金资产净值的0.25%的年费率逐日计提；

(3)卖出回购金融资产支出，按卖出回购金融资产的摊余成本及实际利率（当实际利率与合同利率差异较小时，也可以用合同利率）在回购期内逐日计提；

(4)其他费用系根据有关法规及相应协议规定，按实际支出金额，列入当期基金费用。如果影响基金份额净值小数点后第四位的，则采用待摊或预提的方法。

7.4.4.11 基金的收益分配政策

(1)本基金的每份基金份额享有同等分配权；

(2)收益分配时所发生的银行转账或其他手续费用由投资人自行承担。当投资人的现金红利小于一定金额，不足以支付银行转账或其他手续费用时，基金注册登记机构可将投资人的现金红利按除息日的单位净值自动转为基金份额；

(3)在符合有关基金分红条件的前提下，本基金收益每年最多分配6次，每次基金收益分配比例不低于收益分配基准日可供分配利润的10%；

(4)若基金合同生效不满3个月则可不进行收益分配；

(5)本基金收益分配方式分为两种：现金分红与红利再投资，投资人可选择现金红利或将现金红利按除息日的单位净值自动转为基金份额进行再投资；若投资人不选择，本基金默认的收益分配方式是现金分红；

(6)基金红利发放日距离收益分配基准日（即可供分配利润计算截止日）的时间不得超过15个工作日；

(7)基金收益分配后每一基金份额净值不能低于面值，即基金收益分配基准日的基金份额净值减去每单位基金份额收益分配金额后不能低于面值；

(8)法律法规或监管机构另有规定的从其规定。

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

本基金本报告期无会计政策变更。

7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期无会计估计变更。

7.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期无重大会计差错的内容和更正金额。

7.4.6 税项

1. 印花税

经国务院批准，财政部、国家税务总局研究决定，自2008年4月24日起，调整证券（股票）交易印花税税率，由原先的3‰调整为1‰；

经国务院批准，财政部、国家税务总局研究决定，自2008年9月19日起，调整由出让方按证券（股票）交易印花税税率缴纳印花税，受让方不再征收，税率不变；

根据财政部、国家税务总局财税字[2005]103号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》的规定，股权分置改革过程中因非流通股股东向流通股股东支付对价而发生的股权转让，暂免征收印花税。

2. 营业税、企业所得税

根据财政部、国家税务总局财税字[2004]78号文《关于证券投资基金税收政策的通知》的规定，自2004年1月1日起，对证券投资基金（封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金）管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入，继续免征营业税和企业所得税；

根据财政部、国家税务总局财税字[2005]103号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》的规定，股权分置改革中非流通股股东通过对价方式向流通股股东支付的股份、现金等收入，暂免征收流通股股东应缴纳的企业所得税；

根据财政部、国家税务总局财税[2008]1号文《关于企业所得税若干优惠政策的通知》的规定，对证券投资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，股票的股息、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. 个人所得税

根据财政部、国家税务总局财税字[2002]128号文《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》的规定，对基金取得的股票的股息、红利收入、债券的利息收入、储蓄利息收入，由上市公司、发行债券的企业和银行在向基金支付上述收入时代扣代缴20%的个人所得税；

根据财政部、国家税务总局财税字[2005]103号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》的规定，股权分置改革中非流通股股东通过对价方式向流通股股东支付的股份、现金等收入，暂免征收流通股股东应缴纳的个人所得税；

根据财政部、国家税务总局财税字[2008]132号文《财政部、国家税务总局关于储蓄存款利息所得有关个人所得税政策的通知》的规定，自2008年10月9日起，对储蓄存款利息所得暂免征收个人所得税；

根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2012]85号文《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》的规定，自2013年1月1日起，证券投资基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，持股期限在1个月以内（含1个月）的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在1个月以上至1年（含1年）的，暂减按50%计入应纳税所得额；持股期限超过1年的，暂减按25%计入应纳税所得额。

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
宝钢集团有限公司(“宝钢集团”)	华宝信托的最终控制人
华宝投资有限公司(“华宝投资”)	受宝钢集团控制的公司
华宝证券有限责任公司(“华宝证券”)	受宝钢集团控制的公司

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。

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

7.4.8.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2013年1月1日至2013年12月31日		上年度可比期间 2012年2月28日(基金合同生效日)至2012年12月31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	109,145,052.37	3.37%	52,509,243.57	3.19%

7.4.8.1.2 权证交易

本基金本期及上年度可比期间无通过关联方交易单元进行的权证交易。

7.4.8.1.3 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2013年1月1日至2013年12月31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	99,365.97	3.38%	30,209.36	1.59%
关联方名称	上年度可比期间 2012年2月28日(基金合同生效日)至2012年12月31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	46,691.69	3.30%	46,691.69	8.34%

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和经手费的净额列示。

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。

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 2013年1月1日至2013年12月31日	上年度可比期间 2012年2月28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	5,783,715.84	3,951,279.79
其中：支付销售机构的客户维护费	1,804,521.42	2,095,602.36

注：基金管理费按前一日的基金资产净值的1.5%的年费率计提。计算方法如下：

H=E×1.5%/当年天数

H为每日应支付的基金管理费

E为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计提，按月支付。由基金管理人向基金托管人发送基金管理费划付指令，经基金托管人复核后于次月首日起5个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人，若遇法定节假日、休息日，支付日期顺延。

7.4.8.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2013年1月1日至2013年12月31日	上年度可比期间 2012年2月28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	963,952.60	658,546.70

注：基金托管费按前一日的基金资产净值的0.25%的年费率计提。计算方法如下：

H=E×0.25%/当年天数

H为每日应支付的基金托管费

E为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计提，按月支付。由基金管理人向基金托管人发送基金托管费划付指令，经基金托管人复核后于次月首日起5个工作日内从基金财产中一次性支付给基金托管人，若遇法定节假日、休息日，支付日期顺延。

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。

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 2013年1月1日至2013年12月31日	上年度可比期间 2012年2月28日(基金合同生效日)至2012年12月31日
基金合同生效日（2012年2月28日）持有的基金份额	–	–
期初持有的基金份额	512,581.01	–
期间申购/买入总份额	513,960.75	512,581.01
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	1,026,541.76	512,581.01
期末持有的基金份额占基金总份额比例	0.15%	0.22%

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。

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 2013年12月31日		上年度末 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	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例
华宝投资有限公司	–	–	18,974,383.30	8.10%

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 2013年1月1日至2013年12月31日		上年度可比期间 2012年2月28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	期末余额	当期利息收入
中国建设银行	53,904,188.54	400,745.64	30,910,684.16	632,583.97

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。

7.4.8.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本期及上年度可比期间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

本基金本报告期及上年度可比期间无须作说明的其他关联交易事项。

7.4.9 期末（ 2013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

本基金本报告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

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
002022	科华生物	2013年12月20日	重大事项停牌	16.82	2014年1月27日	18.50	698,532	11,079,724.12	11,749,308.24	–
300049	福瑞股份	2013年12月26日	重大事项停牌	23.80	2014年1月20日	24.90	208,420	4,094,535.19	4,960,396.00	–
600572	康恩贝	2013年11月25日	重大资产重组	13.51	–	–	100,000	1,342,423.86	1,351,000.00	–

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。

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，因此没有在交易所市场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

7.4.10.1公允价值

7.4.10.1.1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。

7.4.10.1.2以公允价值计量的金融工具

7.4.10.1.2.1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)。

7.4.10.1.2.2各层次金融工具公允价值

于2013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676,240,861.89元，属于第二层级的余额为18,060,704.24，无第三层级的余额。(2012年12月31日：第一层级227,832,875.36元，无属于第二层级和第三层级的余额)。

7.4.10.1.2.3公允价值所属层次间的重大变动

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。

7.4.10.1.2.4第三层次公允价值余额和本期变动金额

无。

7.4.10.2承诺事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的承诺事项。

7.4.10.3其他事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的其他重要事项。

7.4.10.4财务报表的批准

本财务报表已于2014年3月27日经本基金的基金管理人批准。

§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	694,068,458.97	82.06
	其中：股票	694,068,458.97	82.06
2	固定收益投资	233,107.16	0.03
	其中：债券	233,107.16	0.03
	资产支持证券	–	–
3	贵金属投资		
4	金融衍生品投资	–	–
5	买入返售金融资产	–	–
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	–	–
6	银行存款和结算备付金合计	57,003,579.72	6.74
7	其他各项资产	94,511,735.48	11.17
8	合计	845,816,881.33	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	采矿业	–	–
C	制造业	578,213,680.48	68.84
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	–	–
E	建筑业	–	–
F	批发和零售业	69,657,126.28	8.29
G	交通运输、仓储和邮政业	–	–
H	住宿和餐饮业	–	–
I	信息传输、软件和信息技术服务业	3,712,133.04	0.44
J	金融业	–	–
K	房地产业	–	–
L	租赁和商务服务业	–	–
M	科学研究和技术服务业	–	–
N	水利、环境和公共设施管理业	–	–
O	居民服务、修理和其他服务业	–	–
P	教育	–	–
Q	卫生和社会工作	42,485,519.17	5.06
R	文化、体育和娱乐业	–	–
S	综合	–	–
	合计	694,068,458.97	82.63

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	300147	香雪制药	3,565,298	66,314,542.80	7.89
2	300298	三诺生物	840,940	57,907,128.40	6.89
3	000538	云南白药	401,409	40,939,703.91	4.87
4	600276	恒瑞医药	1,076,196	40,873,924.08	4.87
5	000028	国药一致	745,465	34,515,029.50	4.11
6	300015	爱尔眼科	1,061,703	33,135,750.63	3.94
7	300171	东富龙	907,988	30,989,630.44	3.69
8	600196	复星医药	1,345,375	26,355,896.25	3.14
9	600079	人福医药	868,748	24,629,005.80	2.93
10	600594	益佰制药	745,724	24,325,516.88	2.90

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	300147	香雪制药	75,529,928.24	28.89
2	300298	三诺生物	61,618,326.71	23.57
3	600276	恒瑞医药	59,647,800.51	22.82
4	000538	云南白药	53,490,845.82	20.46
5	000028	国药一致	48,800,307.43	18.67
6	600518	康美药业	47,943,246.40	18.34
7	600521	华海药业	46,773,050.24	17.89
8	600332	白云山	43,934,044.65	16.81
9	000423	东阿阿胶	42,252,830.31	16.16
10	600079	人福医药	42,030,737.77	16.08
11	300015	爱尔眼科	40,349,434.31	15.43
12	600196	复星医药	38,449,356.00	14.71
13	600594	益佰制药	36,070,416.95	13.80
14	600535	天士力	33,916,629.49	12.97
15	601607	上海医药	32,199,862.75	12.32
16	600436	片仔癀	32,034,390.18	12.25
17	000999	华润三九	31,617,023.14	12.09
18	000661	长春高新	29,935,853.32	11.45
19	300171	东富龙	29,522,878.51	11.29
20	000963	华东医药	28,887,299.32	11.05
21	600161	天坛生物	27,474,906.77	10.51
22	002001	新 和 成	25,707,215.12	9.83
23	000915	山大华特	24,896,357.91	9.52
24	300314	戴维医疗	23,964,865.41	9.17
25	300026	红日药业	23,258,679.06	8.90
26	002262	恩华药业	22,728,643.30	8.69
27	600252	中恒集团	22,659,722.27	8.67
28	600216	浙江医药	22,558,939.41	8.63
29	600285	羚锐制药	21,743,259.13	8.32
30	002022	科华生物	20,594,426.26	7.88
31	600085	同仁堂	20,346,955.26	7.78
32	600587	新华医疗	20,117,623.57	7.70
33	002551	尚荣医疗	19,669,891.75	7.52
34	600557	康缘药业	19,664,563.22	7.52
35	002603	以岭药业	18,772,128.20	7.18
36	300273	和佳股份	18,108,477.70	6.93
37	002030	达安基因	17,654,409.31	6.75
38	002007	华兰生物	17,223,429.28	6.59
39	600422	昆明制药	16,720,947.92	6.40
40	002230	科大讯飞	16,633,974.97	6.36
41	300003	乐普医疗	16,378,848.47	6.27
42	300204	舒泰神	15,560,695.87	5.95
43	600479	千金药业	15,351,682.35	5.87
44	000513	丽珠集团	15,322,290.38	5.86
45	002368	太极股份	14,926,383.99	5.71
46	002241	歌尔声学	14,361,060.54	5.49
47	002294	信立泰	14,045,984.38	5.37
48	300244	迪安诊断	13,564,428.78	5.19
49	300049	福瑞股份	12,609,609.01	4.82
50	600267	海正药业	11,942,014.64	4.57
51	600867	通化东宝	11,879,654.64	4.54
52	002424	贵州百灵	11,713,856.46	4.48
53	300339	润和软件	11,217,166.17	4.29
54	002393	力生制药	11,091,400.08	4.24
55	002317	众生药业	10,694,998.79	4.09
56	002437	誉衡药业	10,584,328.00	4.05
57	002202	金风科技	10,323,524.32	3.95
58	300039	上海凯宝	9,361,320.51	3.58
59	300183	东软载波	9,058,206.85	3.46
60	002405	四维图新	8,734,748.33	3.34
61	600887	伊利股份	8,591,746.15	3.29
62	002653	海思科	8,299,929.23	3.17
63	000566	海南海药	8,067,326.39	3.09
64	600713	南京医药	8,003,999.18	3.06
65	002065	东华软件	7,908,864.32	3.03
66	002261	拓维信息	7,700,958.72	2.95
67	600111	包钢稀土	7,627,900.01	2.92
68	000522	白云山A	7,626,463.28	2.92
69	002440	闰土股份	7,598,514.30	2.91
70	600763	通策医疗	7,111,112.61	2.72
71	600062	华润双鹤	7,082,376.06	2.71
72	300122	智飞生物	6,979,381.30	2.67
73	002626	金达威	6,737,304.64	2.58
74	600055	华润万东	6,612,645.04	2.53
75	002422	科伦药业	6,485,254.03	2.48
76	002439	启明星辰	6,201,647.84	2.37
77	600804	鹏博士	6,130,269.42	2.34
78	600201	金宇集团	6,078,256.26	2.33
79	002664	信质电机	5,708,772.95	2.18
80	600511	国药股份	5,402,369.38	2.07
81	300001	特锐德	5,325,562.08	2.04
82	600369	西南证券	5,319,014.27	2.03
83	300289	利德曼	5,263,202.42	2.01

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	600518	康美药业	50,471,689.68	19.31
2	600332	白云山	46,234,636.66	17.69
3	600436	片仔癀	44,894,733.69	17.17
4	600521	华海药业	42,672,095.16	16.32
5	000963	华东医药	41,269,492.32	15.79
6	600557	康缘药业	39,377,611.52	15.06
7	000999	华润三九	37,987,948.10	14.53
8	000423	东阿阿胶	36,594,018.79	14.00
9	000661	长春高新	35,787,789.28	13.69
10	600535	天士力	34,055,933.54	13.03
11	000028	国药一致	32,137,591.95	12.29
12	600276	恒瑞医药	29,462,417.54	11.27
13	600161	天坛生物	28,558,567.62	10.92
14	600079	人福医药	24,255,839.92	9.28
15	000538	云南白药	23,121,228.35	8.84
16	600252	中恒集团	23,024,490.29	8.81
17	000513	丽珠集团	22,518,447.84	8.61
18	002551	尚荣医疗	21,250,190.70	8.13
19	600085	同仁堂	20,880,567.95	7.99
20	002230	科大讯飞	20,804,815.76	7.96
21	300273	和佳股份	19,629,992.89	7.51
22	300147	香雪制药	19,614,499.27	7.50
23	600594	益佰制药	18,798,049.50	7.19
24	600216	浙江医药	18,700,848.01	7.15
25	601607	上海医药	18,183,887.28	6.96
26	300298	三诺生物	18,147,496.93	6.94
27	600285	羚锐制药	17,872,207.07	6.84
28	000915	山大华特	17,552,354.87	6.71
29	002001	新 和 成	17,258,818.77	6.60
30	002038	双鹭药业	16,844,837.96	6.44
31	002262	恩华药业	16,435,854.71	6.29
32	600196	复星医药	16,012,242.82	6.12
33	300204	舒泰神	14,720,882.40	5.63
34	300039	上海凯宝	14,698,691.25	5.62
35	300314	戴维医疗	14,080,375.03	5.39
36	600479	千金药业	13,877,951.09	5.31
37	002241	歌尔声学	13,406,011.63	5.13
38	300026	红日药业	13,250,818.17	5.07
39	002424	贵州百灵	12,941,277.14	4.95
40	002437	誉衡药业	11,644,511.75	4.45
41	002653	海思科	11,430,504.36	4.37
42	600267	海正药业	11,234,845.09	4.30
43	300339	润和软件	10,973,867.25	4.20
44	300183	东软载波	10,957,838.87	4.19
45	002603	以岭药业	10,566,680.49	4.04
46	002065	东华软件	10,441,043.03	3.99
47	002022	科华生物	10,229,019.52	3.91
48	300049	福瑞股份	9,945,050.48	3.80
49	002202	金风科技	9,794,446.97	3.75
50	600587	新华医疗	9,731,680.15	3.72
51	002368	太极股份	9,371,131.03	3.58
52	600062	华润双鹤	9,076,477.01	3.47
53	600887	伊利股份	8,573,511.57	3.28
54	600867	通化东宝	8,485,606.75	3.25
55	000522	白云山A	8,368,616.62	3.20
56	002030	达安基因	8,253,681.51	3.16
57	002439	启明星辰	8,182,016.49	3.13
58	002294	信立泰	8,113,925.32	3.10
59	300122	智飞生物	8,045,956.50	3.08
60	002440	闰土股份	8,019,352.92	3.07
61	600422	昆明制药	7,752,254.34	2.97
62	002405	四维图新	7,577,266.97	2.90
63	300015	爱尔眼科	7,266,542.54	2.78
64	600111	包钢稀土	7,181,381.12	2.75
65	002422	科伦药业	6,615,499.41	2.53
66	600055	华润万东	6,396,759.32	2.45
67	002261	拓维信息	6,185,920.62	2.37
68	600763	通策医疗	6,173,468.99	2.36
69	600380	健康元	6,117,356.20	2.34
70	002626	金达威	6,016,882.60	2.30
71	000989	九 芝 堂	5,948,624.24	2.28
72	300244	迪安诊断	5,889,573.32	2.25
73	600201	金宇集团	5,711,646.29	2.18
74	002007	华兰生物	5,637,910.20	2.16
75	000566	海南海药	5,593,748.01	2.14
76	000650	仁和药业	5,545,341.49	2.12
77	002664	信质电机	5,469,668.39	2.09
78	600511	国药股份	5,465,780.88	2.09
79	600369	西南证券	5,455,823.42	2.09
80	300251	光线传媒	5,445,500.60	2.08
81	600804	鹏博士	5,421,605.77	2.07

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	1,812,434,839.66
卖出股票收入（成交）总额	1,429,680,325.72

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

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	–	–
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	中期票据	–	–
7	可转债	233,107.16	0.03
8	其他	–	–
9	合计	233,107.16	0.03

8.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序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	128002	东华转债	1,660	233,107.16	0.03

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 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属投资。

8.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

8.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金未投资股指期货。

8.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金未投资股指期货。

8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

8.11.1 本期国债期货投资政策

本基金未投资国债期货。

8.11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金未投资国债期货。

8.11.3 本期国债期货投资评价

本基金未投资国债期货。

8.12 投资组合报告附注

8.12.1

基金管理人没有发现本基金投资的前十名证券的发行主体在报告期内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。

8.12.2

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。

8.12.3 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	259,608.25
2	应收证券清算款	92,328,972.25
3	应收股利	–
4	应收利息	23,167.02
5	应收申购款	1,899,987.96
6	其他应收款	–
7	待摊费用	–
8	其他	–
9	合计	94,511,735.48

8.12.4 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。

8.12.5 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
14,801	47,406.13	359,192,733.58	51.19%	342,465,379.85	48.81%

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
基金管理人所有从业人员持有本基金	1,246,219.43	0.1776%

（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：

10万份至50万份（含）

（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：

50万份至100万份（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2月28日 ）基金份额总额	554,397,242.54
本报告期期初基金份额总额	234,245,077.83
本报告期基金总申购份额	1,268,968,453.16
减：本报告期基金总赎回份额	801,555,417.56
本报告期基金拆分变动份额	–
本报告期期末基金份额总额	701,658,113.43

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。

§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

1、基金管理人的重大人事变动

（1）2013年5月28日，基金管理人发布高级管理人员变更公告，常务副总经理谢文杰因工作变动，自2013年5月24日起不再担任常务副总经理的职务。

（2）2013年8月8日，基金管理人发布高级管理人员变更公告，公司总经理裴长江先生因个人原因，自2013年7月31日起不再担任总经理职务，由黄小薏女士代任。

（3）2013年9月27日，基金管理人发布高级管理人员任职公告，黄小薏女士自2013年9月24日起正式担任公司总经理。

2、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本基金托管人2013年12月5日发布任免通知，聘任黄秀莲为中国建设银行投资托管业务部副总经理。

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70,000.00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2月28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

1、基金管理人于2013年6月28日收到证监会上海稽查局编号为沪调查通字[2013]-2-023号的调查通知书，该通知书内容为：“因调查需要，根据《中华人民共和国证券法》的有关规定，我会决定对你司所管理的基金在交易‘盛运股份’中涉嫌违反《证券法》的有关行为进行立案调查，请予以配合。”

据公司了解，该调查通知书所涉及的基金和行为为新兴产业基金于2011年2月期间的交易行为，该交易行为对该基金投资人利益未造成损失。

目前，案件调查工作已结束。截至报告披露日尚无结论。

2、本报告期内，基金管理人的高级管理人员未有受到稽查或处罚的情况。

3、本报告期内，基金托管人及其高级管理人员没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	
民生证券	1	366,087,851.28	11.30%	333,287.38	11.34%	–
广发证券	1	341,399,465.27	10.53%	310,244.42	10.55%	–
长城证券	1	264,563,674.97	8.16%	240,366.34	8.18%	–
中信证券	2	205,106,579.57	6.33%	185,331.68	6.30%	–
广州证券	1	165,740,576.44	5.11%	150,890.70	5.13%	–
国信证券	1	163,352,887.39	5.04%	147,734.33	5.03%	–
东方证券	1	141,987,532.55	4.38%	128,668.45	4.38%	–
安信证券	1	133,412,593.48	4.12%	121,458.60	4.13%	–
中银国际	1	118,853,077.90	3.67%	106,953.66	3.64%	–
东北证券	1	117,929,710.15	3.64%	106,717.27	3.63%	–
华宝证券	1	109,145,052.37	3.37%	99,365.97	3.38%	–
长江证券	1	105,620,164.77	3.26%	96,155.87	3.27%	–
日信证券	1	103,788,371.48	3.20%	92,916.03	3.16%	–
申银万国	1	100,732,830.29	3.11%	91,469.02	3.11%	–
华安证券	1	89,334,490.55	2.76%	81,329.85	2.77%	–
宏源证券	1	83,293,534.45	2.57%	75,830.39	2.58%	–
平安证券	1	74,949,020.04	2.31%	67,767.50	2.31%	–
信达证券	1	71,507,677.55	2.21%	65,100.39	2.21%	–
齐鲁证券	2	67,848,350.70	2.09%	60,039.22	2.04%	–
中投证券	1	60,782,875.73	1.88%	55,336.77	1.88%	–
东吴证券	1	56,253,252.51	1.74%	51,212.79	1.74%	–
兴业证券	1	49,091,205.15	1.51%	44,692.77	1.52%	–
银河证券	1	47,651,371.71	1.47%	43,381.66	1.48%	–
西南证券	1	43,448,958.32	1.34%	39,556.87	1.35%	–
海通证券	1	32,303,214.22	1.00%	29,408.94	1.00%	–
华创证券	1	31,397,966.19	0.97%	28,583.84	0.97%	–
瑞银证券	1	29,976,909.88	0.92%	27,291.00	0.93%	–
财富里昂	1	24,926,046.50	0.77%	22,056.88	0.75%	–
江海证券	1	22,933,601.41	0.71%	20,293.87	0.69%	–
国泰君安	1	8,917,794.02	0.28%	8,118.43	0.28%	–
华泰联合	1	5,013,397.32	0.15%	4,564.16	0.16%	–
东海证券	1	3,774,197.96	0.12%	3,436.13	0.12%	–
高华证券	1	–	–	–	–	–
光大证券	1	–	–	–	–	–
中航证券	1	–	–	–	–	–
国金证券	1	–	–	–	–	–
中金国际	1	–	–	–	–	–
招商证券	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、本基金本报告期新增券商交易单元：财富里昂，中信证券，齐鲁证券，长江证券；停止租用席位：西藏证券，金元证券。

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
民生证券	–	–	–	–	–	–
广发证券	–	–	–	–	–	–
长城证券	–	–	–	–	–	–
中信证券	–	–	–	–	–	–
广州证券	–	–	–	–	–	–
国信证券	–	–	–	–	–	–
东方证券	–	–	–	–	–	–
安信证券	–	–	–	–	–	–
中银国际	–	–	–	–	–	–
东北证券	–	–	–	–	–	–
华宝证券	–	–	–	–	–	–
长江证券	–	–	–	–	–	–
日信证券	–	–	–	–	–	–
申银万国	–	–	–	–	–	–
华安证券	–	–	–	–	–	–
宏源证券	–	–	–	–	–	–
平安证券	–	–	–	–	–	–
信达证券	–	–	–	–	–	–
齐鲁证券	–	–	–	–	–	–
中投证券	–	–	–	–	–	–
东吴证券	–	–	–	–	–	–
兴业证券	–	–	40,000,000.00	100.00%	–	–
银河证券	–	–	–	–	–	–
西南证券	–	–	–	–	–	–
海通证券	–	–	–	–	–	–
华创证券	–	–	–	–	–	–
瑞银证券	–	–	–	–	–	–
财富里昂	–	–	–	–	–	–
江海证券	–	–	–	–	–	–
国泰君安	–	–	–	–	–	–
华泰联合	–	–	–	–	–	–
东海证券	–	–	–	–	–	–
高华证券	–	–	–	–	–	–
光大证券	–	–	–	–	–	–
中航证券	–	–	–	–	–	–
国金证券	–	–	–	–	–	–
中金国际	–	–	–	–	–	–
招商证券	–	–	–	–	–	–

华宝兴业基金管理有限公司
2014年3月31日