# 华宝兴业宝康消费品证券投资基金

## 2014 半年度 报告摘要

2014年6月30日

基金管理人：华宝兴业基金管理有限公司
基金托管人：中国建设银行股份有限公司
送出日期：2014年8月29日

### §1 重要提示及目录

1.1 重要提示

基金管理人的董事会、董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带的法律责任。本半年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2014年8月26日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书及其更新。

本半年度报告摘要摘自半年度报告正文，投资者欲了解详细内容，应阅读半年度报告正文。

本报告中财务资料未经审计 。

本报告期自2014年01月01日起至06月30日止。

### §2 基金简介

2.1 基金基本情况

| | |
|---|---|
| 基金名称 | 华宝兴业宝康消费品证券投资基金 |
| 基金简称 | 华宝兴业宝康消费品混合 |
| 基金主代码 | 240001 |
| 交易代码 | 240001 |
| 基金运作方式 | 契约型开放式 |
| 基金合同生效日 | 2003年7月15日 |
| 基金管理人 | 华宝兴业基金管理有限公司 |
| 基金托管人 | 中国建设银行股份有限公司 |
| 报告期末基金份额总额 | 1,111,056,275.94份 |
| 基金合同存续期 | 不定期 |

2.2 基金产品说明

| | |
|---|---|
| 投资目标 | 分享我国全面建设小康社会过程中消费品各相关行业的稳步成长；为基金份额持有人谋求长期稳定回报。 |
| 投资策略 | 本基金看好消费品的发展前景，长期持有消费品组合，并注重资产在其各相关行业的配置，适当进行时机选择。 |
| 业绩比较基准 | 上证180指数和深证100指数的复合指数×80%+中信标普全债指数×20%。<br>复合指数＝（上证180流通市值／成分指数总流通市值）×上证180指数＋（深证100流通市值／成分指数总流通市值）×深证100指数 。<br>成分指数总流通市值＝上证180流通市值＋深证100流通市值。 |

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

| | |
|---|---|
| 登载基金半年度报告正文的管理人互联网网址 | www.fsfund.com |
| 基金半年度报告备置地点 | 本基金半年报置备地点包括基金管理人办公场所和基金托管人办公场所。 |

### §3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

| 3.1.1 期间数据和指标 | 报告期(2014年1月1日 - 2014年6月30日） |
|---|---|
| 本期已实现收益 | 115,582,905.88 |
| 本期利润 | 59,390,660.24 |
| 加权平均基金份额本期利润 | 0.0520 |
| 本期加权平均净值利润率 | 3.23% |
| 本期基金份额净值增长率 | 2.60% |
| 3.1.2 期末数据和指标 | 报告期末（2014年6月30日） |
| 期末可供分配利润 | 1,355,497,853.19 |
| 期末可供分配基金份额利润 | 1.2200 |
| 期末基金资产净值 | 1,802,110,345.36 |
| 期末基金份额净值 | 1.6220 |
| 3.1.3 累计期末指标 | 报告期末（2014年6月30日） |
| 基金份额累计净值增长率 | 477.86% |

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

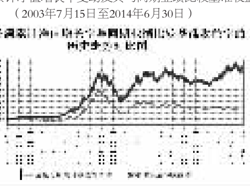
| 阶段 | 份额净值增长率① | 份额净值增长率标准差② | 业绩比较基准收益率③ | 业绩比较基准收益率标准差④ | ①—③ | ②—④ |
|---|---|---|---|---|---|---|
| 过去一个月 | 3.14% | 1.03% | 0.64% | 0.62% | 2.50% | 0.41% |
| 过去三个月 | 3.81% | 1.07% | 1.50% | 0.71% | 2.31% | 0.36% |
| 过去六个月 | 2.60% | 1.16% | -4.23% | 0.83% | 6.83% | 0.33% |
| 过去一年 | 20.13% | 1.18% | -0.01% | 0.95% | 20.14% | 0.23% |
| 过去三年 | 18.84% | 0.99% | -19.78% | 1.05% | 38.62% | -0.06% |
| 自基金合同生效日起至今 | 477.86% | 1.23% | 85.52% | 1.40% | 392.34% | -0.17% |

注：1、本基金业绩比较基准为：上证180指数和深证100指数的复合指数×80%+中信标普全债指数×20%。

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

（2003年7月15日至2014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2004年1月15日，本基金已达到合同规定的资产配置比例。

### §4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

基金管理人是2003 年3 月7 日正式成立的合资基金管理公司，截至本报告期末（2014年6月30日），所管理的开放式证券投资基金包括宝康系列基金、多策略基金、现金宝货币市场基金、动力组合基金、收益增长基金、先进成长基金、行业精选基金、海外中国成长基金、大盘精选基金、增强收益基金、中证100 基金、上证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、华宝兴业活期通货币市场基金（原华宝兴业短融50基金转型）、华宝兴业资源优选基金、华宝添益基金、华宝兴业服务优选基金、华宝兴业创新优选基金以及华宝兴业生态中国基金，所管理的开放式证券投资基金资产净值合计56,168,945,206.12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 | | |
| 胡戈游 | 本基金基金经理、华宝兴业宝康灵活配置基金基金经理 | 2011年2月11日 | - | 9年 | 硕士，拥有CFA资格。2005年2月加入华宝兴业基金管理有限公司，曾任金融工程部数量分析师、华宝兴业宝康灵活配置基金基金经理助理的职务，2009年5月至2010年6月任华宝兴业宝康灵活配置证券投资基金基金经理，2010年1月至2012年1月任华宝兴业多策略增长开放式证券投资基金基金经理，2011年2月起兼任华宝兴业宝康消费品证券投资基金基金经理，2013年7月起兼任华宝兴业宝康灵活配置证券投资基金基金经理。 |
| 光磊 | 本基金基金经理助理、华宝兴业行业精选股票基金经理助理 | 2012年10月11日 | - | 7年 | 硕士，曾在汇添富基金管理有限公司任高级研究员。2012年10月加入华宝兴业基金管理有限公司，任华宝兴业宝康消费品证券投资基金基金经理助理，2014年6月兼任华宝兴业行业精选股票型证券投资基金基金经理助理。 |

注：1、任职日期以及离任日期均以基金公告为准。

2、证券从业含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人遵守《中华人民共和国证券法》、《中华人民共和国证券投资基金法》及其各项实施细则、《华宝兴业宝康系列开放式证券投资基金基金合同》和其他相关法律法规的规定、监管部门的相关规定，依照诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在控制投资风险的基础上，为基金份额持有人谋求最大利益，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，基金管理人通过严格执行投资决策委员会议事规则、公司股票库管理制度、中央交易室制度、防火墙机制、系统中的公平交易程序、每日交易日结报告、定期基金投资绩效评价等机制，确保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。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和公司内部制度要求，分析了本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）的收益率差异以及连续四个季度期间内、不同时间窗下同向交易的交易价差；分析结果未发现异常情况。

4.3.2 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

2014年上半年经济数据总体平稳，微刺激政策初见成效，以社会消费品零售总额为代表的数据有触底反弹的迹象。股票市场维持结构分化的行情，上半年沪深300指数下跌7.08%，内地消费指数也下跌7.76%，创业板上涨7.69%。

上半年本基金维持仓位的稳定，持有优质消费类股票，主要的投资方向仍在大众消费品、传媒、新能源汽车、医疗服务等先前就一直看好的行业，并结合行业数据和上市公司报表对持有的股票做了结构优化。得益于持有个股的稳定表现，本基金持续战胜了业绩基准。

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2.60%，同期业绩比较基准收益率为-4.23%，基金表现领先于基准6.83%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

在稳增长和微刺激的政策下，市场对宏观经济低于预期的担忧已经基本消除，预计全年通胀低于预期，货币政策有较强的回旋余地。因此，我们认为未来经济整体平稳。但制约中国经济发展的房地产泡沫、地方债务风险等不利因素还未能有效化解，长期看经济转型的方向不会改变，消费是核心，扩大内需仍是解决中国经济结构失衡的最好方法。

上半年大盘总体平稳，创业板表现略好，部分股票估值已经较高。我们认为其中既有风险，也孕育着机会。在转型期间市场会出现明显的挤出效应，前景光明的行业和优质的公司可以有合理的溢价。

下阶段我们看好以下几个领域的投资机会：受益互联网盛宴的文化影视、游戏、数字营销、在线教育、软件服务等各个板块；受益于城镇化趋势的大众快消品；长期稳定增长的医疗行业；政策推动的新能源汽车和环保行业。我们会在这几个行业中优中选优，继续寻找和持有优质公司。

感谢持有人一直以来对我们的支持，在后续投资中，我们将继续总结经验，勤勉尽责，努力实现消费品基金的良好表现。

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。

4.7 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2014年1月13日发布了分红公告，本次分红为2013年度的第1次分红。本基金向2014年1月16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0.2元，利润分配合计为人民币23,047,949.81元，其中现金形式发放总额为人民币10,154,385.42元，再投资形式发放总额为人民币12,893,564.39元。

### §5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期，中国建设银行股份有限公司在本基金的托管过程中，严格遵守了《证券投资基金法》、基金合同、托管协议和其他有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

本报告期，本托管人按照国家有关规定、基金合同、托管协议和其他有关规定，对本基金的基金资产净值计算、基金费用开支等方面进行了认真的复核，对本基金的投资运作方面进行了监督，未发现基金管理人有损害基金份额持有人利益的行为。

报告期内，本基金实施利润分配的金额为23,047,949.81元。

5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人复核审查了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

### §6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：华宝兴业宝康消费品证券投资基金

报告截止日：2014年6月30日

单位：人民币元

| 资产 | 附注号 | 本期末<br>2014年6月30日 | 上年度末<br>2013年12月31日 |
|---|---|---|---|
| 资产： | | | |
| 银行存款 | | 116,976,236.37 | 115,499,668.79 |
| 结算备付金 | | 946,227.50 | 2,917,137.46 |
| 存出保证金 | | 350,921.23 | 360,297.72 |
| 交易性金融资产 | | 1,666,118,289.40 | 2,000,300,428.67 |
| 其中：股票投资 | | 1,266,742,289.40 | 1,488,560,428.67 |
| 基金投资 | | - | - |
| 债券投资 | | 399,376,000.00 | 511,740,000.00 |
| 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 | | 14,109,502.17 | 50,040,438.59 |
| 应收利息 | | 12,074,056.16 | 8,219,688.05 |
| 应收股利 | | - | - |
| 应收申购款 | | 190,257.35 | 929,592.55 |
| 递延所得税资产 | | - | - |
| 其他资产 | | - | - |
| 资产总计 | | 1,810,765,490.18 | 2,178,267,251.83 |
| 负债和所有者权益 | 附注号 | 本期末<br>2014年6月30日 | 上年度末<br>2013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 | | 0 | 0 |
| 应付证券清算款 | | - | 8,984,229.61 |
| 应付赎回款 | | 2,589,441.75 | 2,288,826.88 |
| 应付管理人报酬 | | 2,197,028.74 | 2,720,967.99 |
| 应付托管费 | | 366,171.42 | 453,494.66 |
| 应付销售服务费 | | 0.00 | 0.00 |
| 应付交易费用 | | 2,815,085.11 | 2,497,840.49 |
| 应交税费 | | - | 6,446.40 |
| 应付利息 | | - | - |
| 应付利润 | | - | - |
| 递延所得税负债 | | - | - |
| 其他负债 | | 687,417.80 | 718,657.10 |
| 负债合计 | | 8,655,144.82 | 17,670,463.13 |
| 所有者权益： | | | |
| 实收基金 | | 446,612,492.17 | 542,763,732.09 |
| 未分配利润 | | 1,355,497,853.19 | 1,617,833,056.61 |
| 所有者权益合计 | | 1,802,110,345.36 | 2,160,596,788.70 |
| 负债和所有者权益总计 | | 1,810,765,490.18 | 2,178,267,251.83 |

注：报告截止日2014年6月30日，基金份额净值1.6220元，基金份额总额1,111,056,275.94份。

6.2 利润表

会计主体：华宝兴业宝康消费品证券投资基金

本报告期：2014年1月1日至2014年6月30日

单位：人民币元

| 项目 | 附注号 | 本期<br>2014年1月1日至2014年6月30日 | 上年度可比期间<br>2013年1月1日至2013年6月30日 |
|---|---|---|---|
| 一、收入 | | 79,023,287.91 | 185,733,186.82 |
| 1.利息收入 | | 9,461,840.70 | 8,448,969.41 |
| 其中：存款利息收入 | | 378,816.13 | 587,167.37 |
| 债券利息收入 | | 9,083,024.57 | 7,861,802.04 |
| 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） | | 125,058,737.62 | 24,498,988.10 |
| 其中：股票投资收益 | | 122,949,868.14 | 13,768,824.78 |
| 基金投资收益 | | - | - |
| 债券投资收益 | | -5,086,384.26 | -570,044.16 |
| 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 | | 7,195,253.74 | 11,300,207.48 |
| 3.公允价值变动收益（损失以"-"号填列） | | -56,192,245.64 | 152,018,169.56 |
| 4.汇兑收益（损失以"-"号填列） | | - | - |
| 5.其他收入（损失以"-"号填列） | | 694,955.23 | 767,059.75 |
| 减：二、费用 | | 19,632,627.67 | 23,306,953.38 |
| 1．管理人报酬 | | 13,687,081.46 | 15,393,750.17 |
| 2．托管费 | | 2,281,180.23 | 2,565,625.02 |
| 3．销售服务费 | | - | - |
| 4．交易费用 | | 3,548,247.52 | 5,236,680.55 |
| 5．利息支出 | | - | - |
| 其中：卖出回购金融资产支出 | | - | - |
| 6．其他费用 | | 116,118.46 | 110,897.64 |
| 三、利润总额（亏损总额以"-"号填列） | | 59,390,660.24 | 162,426,233.44 |
| 减：所得税费用 | | - | - |
| 四、净利润（净亏损以"-"号填列） | | 59,390,660.24 | 162,426,233.44 |

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：华宝兴业宝康消费品证券投资基金

本报告期：2014年1月1日至2014年6月30日

单位：人民币元

| 项目 | 本期<br>2014年1月1日至2014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） | 542,763,732.09 | 1,617,833,056.61 | 2,160,596,788.70 |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润） | - | 59,390,660.24 | 59,390,660.24 |
| 三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数<br>（净值减少以"-"号填列） | -96,151,239.92 | -298,677,913.85 | -394,829,153.77 |
| 其中：1.基金申购款 | 29,720,286.96 | 90,094,825.04 | 119,815,112.00 |
| 2.基金赎回款 | -125,871,526.88 | -388,772,738.89 | -514,644,265.77 |
| 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） | - | -23,047,949.81 | -23,047,949.81 |
| 五、期末所有者权益（基金净值） | 446,612,492.17 | 1,355,497,853.19 | 1,802,110,345.36 |
| 项目 | 上年度可比期间<br>2013年1月1日至2013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） | 664,245,078.11 | 1,443,757,361.67 | 2,108,002,439.78 |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润） | - | 162,426,233.44 | 162,426,233.44 |
| 三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数<br>（净值减少以"-"号填列） | -91,155,904.24 | -214,190,098.38 | -305,346,002.62 |
| 其中：1.基金申购款 | 44,773,649.10 | 102,061,896.34 | 146,835,545.44 |
| 2.基金赎回款 | -135,929,553.34 | -316,251,994.72 | -452,181,548.06 |
| 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） | - | -16,749,099.57 | -16,749,099.57 |
| 五、期末所有者权益（基金净值） | 573,089,173.87 | 1,375,244,397.16 | 1,948,333,571.03 |

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署：

______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

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

华宝兴业宝康系列开放式证券投资基金(以下简称"本系列基金")经中国证券监督管理委员会(以下简称"中国证监会")证监基金字[2003]第62号《关于同意华宝兴业宝康系列证券投资基金设立的批复》核准，由华宝兴业基金管理有限公司依照《证券投资基金管理暂行办法》及其实施细则、《开放式证券投资基金试点办法》等有关规定和《华宝兴业宝康系列开放式证券投资基金基金契约》(后更名为《华宝兴业宝康系列开放式证券投资基金基金合同》)发起，并于2003年7月15日募集成立。本系列基金为契约型开放式，存续期限不定，目前下设三个子基金，分别为宝康消费品证券投资基金(以下简称"本基金")、宝康灵活配置证券投资基金和宝康债券投资基金。本系列基金首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币3,893,701,931.41元，其中包括本基金人民币1,540,046,055.09元、宝康灵活配置证券投资基金人民币1,066,581,834.53元和宝康债券投资基金人民币1,287,074,041.79元，业经普华永道中天会计师事务所有限公司普华永道验字(2003)第96号验资报告予以验证。本基金的基金管理人为华宝兴业基金管理有限公司，基金托管人为中国建设银行股份有限公司。

根据《华宝兴业宝康系列开放式证券投资基金更新的招募说明书》和《华宝兴业基金管理有限公司关于对华宝兴业宝康消费品证券投资基金实施基金份额拆分的公告》的有关规定，本基金于2007年3月26日进行了基金份额拆分，拆分比例为2.487739364，并于2007年3月26日进行了变更登记。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《华宝兴业宝康系列开放式证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金的投资范围为国内依法公开发行、上市的股票、债券及中国证监会批准的允许基金投资的其他金融工具，其中投资于消费品类股票的比例不低于股票资产的80%，在正常的市场情况下，本基金的股票投资比例范围为基金资产净值的50%-75%；债券为20%-45%；现金比例在5%以上。本基金的业绩比较基准为：上证180指数和深证100指数的复合指数×80%＋中信标普全债指数(原名为"中信全债指数")×20%。

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2014年8月29日批准报出。

6.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于2006年2月15日颁布的《企业会计准则—基本准则》和38项具体会计准则、其后颁布的企业会计准则应用指南、企业会计准则解释以及其他相关规定(以下合称"企业会计准则")、中国证监会颁布的《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》、《华宝兴业宝康系列开放式证券投资基金基金合同》和中国证监会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金2014年半年度财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金2014年6月30日的财务状况以及2014年上半年度的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

6.4.4 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

本基金本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

6.4.5 差错更正的说明

本基金本报告期无重大会计差错。

6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2008]1号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85号《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》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1)以发行基金方式募集资金不属于营业税征收范围，不征收营业税。

(2)基金买卖股票、债券的差价收入暂免征营业税和企业所得税。

(3)对基金取得的企业债券利息收入，由发行债券的企业在向基金派发利息时代扣代缴20%的个人所得税，暂不征收企业所得税。对基金取得的股票的股息、红利收入，由上市公司在向基金派发股息、红利时暂减按50%计入个人应纳税所得额，依照现行税法规定即20%代扣代缴个人所得税，暂不征收企业所得税。

(4)基金卖出股票按0.1%的税率缴纳股票交易印花税，买入股票不征收股票交易印花税。

6.4.7 关联方关系

6.4.7.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

本报告期内存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

6.4.7.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

| 关联方名称 | 与本基金的关系 |
|---|---|
| 华宝兴业基金管理有限公司("华宝兴业") | 基金管理人、注册登记机构、基金销售机构 |
| 中国建设银行股份有限公司("中国建设银行") | 基金托管人、基金代销机构 |
| 华宝信托有限责任公司("华宝信托") | 基金管理人的股东 |
| 领先资产管理有限公司(Lyxor Asset Management S.A.) | 基金管理人的股东 |
| 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。

6.4.8 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.8.1 通过关联方交易单元进行的交易

本基金本期及上年度可比期间无通过关联方交易单元进行的交易。

6.4.8.2 关联方报酬

6.4.8.2.1 基金管理费

单位：人民币元

| 项目 | 本期<br>2014年1月1日至2014年6月30日 | 上年度可比期间<br>2013年1月1日至2013年6月30日 |
|---|---|---|
| 当期发生的基金应支付的管理费 | 13,687,081.46 | 15,393,750.17 |
| 其中：支付销售机构的客户维护费 | 505,044.15 | 564,329.02 |

注：支付基金管理人华宝兴业的管理人报酬按前一日基金资产净值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。

6.4.8.2.2 基金托管费

单位：人民币元

| 项目 | 本期<br>2014年1月1日至2014年6月30日 | 上年度可比期间<br>2013年1月1日至2013年6月30日 |
|---|---|---|
| 当期发生的基金应支付的托管费 | 2,281,180.23 | 2,565,625.02 |

注：支付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。

6.4.8.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金本期及上年度可比期间无与关联方进行的银行间同业市场的债券(含回购)交易。

6.4.8.4 各关联方投资本基金的情况

6.4.8.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

份额单位：份

| 项目 | 本期<br>2014年1月1日至2014年6月30日 | 上年度可比期间<br>2013年1月1日至2013年6月30日 |
|---|---|---|
| 期初持有的基金份额 | 1,917,552.18 | 2,182,025.84 |
| 期间申购/买入总份额 | - | 16,622.42 |
| 期间因拆分变动份额 | - | - |
| 减：期间赎回/卖出总份额 | - | 276,014.36 |
| 期末持有的基金份额 | 1,917,552.18 | 1,922,633.90 |
| 期末持有的基金份额占基金总份额比例 | 0.17% | 0.13% |

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。期间申购/买入总份额中包含红利再投资份额。

6.4.8.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

本报告期末及上年度末除基金管理人外其他关联方未投资本基金。

6.4.8.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

| 关联方名称 | 本期<br>2014年1月1日至2014年6月30日 | | 上年度可比期间<br>2013年1月1日至2013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 | 116,976,236.37 | 359,916.05 | 98,652,723.77 | 555,783.94 |

注：本基金的银行存款由基金托管人中国建设银行保管，按银行同业利率计息。

6.4.8.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本期及上年度可比期间未在承销期内参与关联方承销证券。

6.4.8.7 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。

6.4.9 期末（ 2014年6月30日 ）本基金持有的流通受限证券

6.4.9.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

| 6.4.12.1.1 受限证券类别：股票 | | | | | | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| 证券代码 | 证券名称 | 成功认购日 | 可流通日 | 流通受限类型 | 认购价格 | 期末估值单价 | 数量（单位：股） | 期末成本总额 | 期末估值总额 | 备注 |
| 002727 | 一心堂 | 2014年6月25日 | 2014年7月2日 | 新股流通受限 | 12.20 | 12.20 | 2,690 | 32,818.00 | 32,818.00 | - |

6.4.9.2 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 |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| 300271 | 华宇软件 | 2014年6月27日 | 重大资产重组 | 40.30 | - | - | 149,910 | 5,738,124.50 | 6,041,373.00 | - |

6.4.9.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.9.3.1 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中作为抵押的债券。

6.4.9.3.2 交易所市场债券正回购

本基金本期末无交易所市场债券正回购中作为抵押的债券。

6.4.10 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2014年6月30日，本基金持有的以公允价值计量的金融工具中属于第一层级的余额为1,260,668,098.40元，属于第二层级的余额为405,450,191.00元，无属于第三层级的余额 (2013年12月31日：第一层级1,556,705,428.67元，第二层级443,595,000.00元，无第三层级)。

(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，本基金不会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还是第三层级。

(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。

### §7 投资组合报告

7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

| 序号 | 项目 | 金额 | 占基金总资产的比例（%） |
|---|---|---|---|
| 1 | 权益投资 | 1,266,742,289.40 | 69.96 |
| | 其中：股票 | 1,266,742,289.40 | 69.96 |
| 2 | 固定收益投资 | 399,376,000.00 | 22.06 |
| | 其中：债券 | 399,376,000.00 | 22.06 |
| | 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 | 117,922,463.87 | 6.51 |
| 7 | 其他各项资产 | 26,724,736.91 | 1.48 |
| 8 | 合计 | 1,810,765,490.18 | 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（元） | 占基金资产净值比例(%) |
|---|---|---|---|
| A | 农、林、牧、渔业 | - | - |
| B | 采矿业 | - | - |
| C | 制造业 | 418,649,171.07 | 23.23 |
| D | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | - | - |
| E | 建筑业 | 35,640,000.00 | 1.98 |
| F | 批发和零售业 | 39,982,818.00 | 2.22 |
| 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 | 366,737,477.72 | 20.35 |
| J | 金融业 | - | - |
| K | 房地产业 | - | - |
| L | 租赁和商务服务业 | 216,272,000.00 | 12.00 |
| M | 科学研究和技术服务业 | - | - |
| N | 水利、环境和公共设施管理业 | 100,525,192.71 | 5.58 |
| O | 居民服务、修理和其他服务业 | - | - |
| P | 教育 | - | - |
| Q | 卫生和社会工作 | 39,436,770.00 | 2.19 |
| R | 文化、体育和娱乐业 | 49,498,859.90 | 2.75 |
| S | 综合 | - | - |
| | 合计 | 1,266,742,289.40 | 70.29 |

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

金额单位：人民币元

| 序号 | 股票代码 | 股票名称 | 数量（股） | 公允价值 | 占基金资产净值比例（%） |
|---|---|---|---|---|---|
| 1 | 300058 | 蓝色光标 | 5,000,000 | 132,700,000.00 | 7.36 |
| 2 | 002065 | 东华软件 | 4,200,000 | 84,504,000.00 | 4.69 |
| 3 | 002400 | 省广股份 | 3,400,000 | 83,572,000.00 | 4.64 |
| 4 | 300315 | 掌趣科技 | 4,300,000 | 76,798,000.00 | 4.26 |
| 5 | 600066 | 宇通客车 | 4,200,000 | 67,788,000.00 | 3.76 |
| 6 | 300144 | 宋城演艺 | 2,400,000 | 63,792,000.00 | 3.54 |
| 7 | 000848 | 承德露露 | 2,400,000 | 47,688,000.00 | 2.65 |
| 8 | 000028 | 国药一致 | 1,000,000 | 39,950,000.00 | 2.22 |
| 9 | 300244 | 迪安诊断 | 901,000 | 39,436,770.00 | 2.19 |
| 10 | 300339 | 润和软件 | 2,100,000 | 38,220,000.00 | 2.12 |

注：投资者欲了解本报告期末基金投资的所有股票明细，应阅读登载于www.fsfund.com的半年度报告正文。

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值2%或前20名的股票明细

金额单位：人民币元

| 序号 | 股票代码 | 股票名称 | 本期累计买入金额 | 占期初基金资产净值比例（%） |
|---|---|---|---|---|
| 1 | 002051 | 中工国际 | 56,860,786.86 | 2.63 |
| 2 | 300070 | 碧水源 | 44,835,372.61 | 2.08 |
| 3 | 600587 | 新华医疗 | 37,850,042.36 | 1.75 |
| 4 | 000028 | 国药一致 | 34,211,566.13 | 1.58 |
| 5 | 603288 | 海天味业 | 33,426,361.58 | 1.55 |
| 6 | 600422 | 昆明制药 | 33,233,378.95 | 1.54 |
| 7 | 300010 | 立思辰 | 32,869,477.27 | 1.52 |
| 8 | 600446 | 金证股份 | 31,921,288.90 | 1.48 |
| 9 | 002368 | 太极股份 | 31,715,019.31 | 1.47 |
| 10 | 300212 | 易华录 | 31,711,398.30 | 1.47 |
| 11 | 000651 | 格力电器 | 29,070,901.39 | 1.35 |
| 12 | 300183 | 东软载波 | 28,725,671.02 | 1.33 |
| 13 | 002665 | 首航节能 | 27,522,242.47 | 1.27 |
| 14 | 300170 | 汉得信息 | 26,352,523.66 | 1.22 |
| 15 | 002385 | 大北农 | 25,704,248.95 | 1.19 |
| 16 | 300072 | 三聚环保 | 25,344,140.99 | 1.17 |
| 17 | 002555 | 顺荣股份 | 24,416,080.24 | 1.13 |
| 18 | 002245 | 澳洋顺昌 | 23,436,900.31 | 1.08 |
| 19 | 300168 | 万达信息 | 21,323,175.49 | 0.99 |
| 20 | 000581 | 威孚高科 | 20,344,313.71 | 0.94 |

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 | 300027 | 华谊兄弟 | 72,707,887.89 | 3.37 |
| 2 | 000651 | 格力电器 | 62,819,798.53 | 2.91 |
| 3 | 300015 | 爱尔眼科 | 58,741,032.92 | 2.72 |
| 4 | 600887 | 伊利股份 | 58,703,303.89 | 2.72 |
| 5 | 000069 | 华侨城Ａ | 58,298,623.03 | 2.70 |
| 6 | 300058 | 蓝色光标 | 54,054,169.62 | 2.50 |
| 7 | 000895 | 双汇发展 | 53,417,328.70 | 2.47 |
| 8 | 300133 | 华策影视 | 42,386,282.76 | 1.96 |
| 9 | 002236 | 大华股份 | 42,125,044.37 | 1.95 |
| 10 | 300104 | 乐视网 | 38,133,510.79 | 1.76 |
| 11 | 600703 | 三安光电 | 34,586,486.12 | 1.60 |
| 12 | 300150 | 世纪瑞尔 | 31,642,741.41 | 1.46 |
| 13 | 300332 | 天壕节能 | 30,778,685.77 | 1.42 |
| 14 | 300157 | 恒泰艾普 | 30,772,472.63 | 1.42 |
| 15 | 600422 | 昆明制药 | 29,334,620.92 | 1.36 |
| 16 | 000333 | 美的集团 | 28,833,796.63 | 1.33 |
| 17 | 002245 | 澳洋顺昌 | 28,379,054.32 | 1.31 |
| 18 | 002400 | 省广股份 | 27,160,697.31 | 1.26 |
| 19 | 300315 | 掌趣科技 | 24,040,787.92 | 1.11 |
| 20 | 002051 | 中工国际 | 22,303,829.17 | 1.03 |

注：卖出金额不包括相关交易费用。

7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

| | |
|---|---|
| 买入股票成本（成交）总额 | 986,906,827.53 |
| 卖出股票收入（成交）总额 | 1,264,751,014.84 |

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 | - | - |
| 3 | 金融债券 | 399,376,000.00 | 22.16 |
| | 其中：政策性金融债 | 399,376,000.00 | 22.16 |
| 4 | 企业债券 | - | - |
| 5 | 企业短期融资券 | - | - |
| 6 | 中期票据 | - | - |
| 7 | 可转债 | - | - |
| 8 | 其他 | - | - |
| 9 | 合计 | 399,376,000.00 | 22.16 |

7.6 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 | 130236 | 13国开36 | 1,000,000 | 100,020,000.00 | 5.55 |
| 2 | 130314 | 13进出14 | 700,000 | 69,993,000.00 | 3.88 |
| 3 | 130428 | 13农发28 | 500,000 | 50,090,000.00 | 2.78 |
| 4 | 110418 | 11农发18 | 500,000 | 49,880,000.00 | 2.77 |
| 5 | 120301 | 12进出01 | 500,000 | 49,845,000.00 | 2.77 |

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

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7.8 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。

7.9 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。

7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

7.10.1 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。

7.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金未投资股指期货。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.11.1 本期国债期货投资政策

本基金未投资国债期货。

7.11.2 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。

7.11.3 本期国债期货投资评价

本基金未投资国债期货。

7.12 投资组合报告附注

7.12.1

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。

7.12.2

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。

7.12.3 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 | 350,921.23 |
| 2 | 应收证券清算款 | 14,109,502.17 |
| 3 | 应收股利 | - |
| 4 | 应收利息 | 12,074,056.16 |
| 5 | 应收申购款 | 190,257.35 |
| 6 | 其他应收款 | - |
| 7 | 待摊费用 | - |
| 8 | 其他 | - |
| 9 | 合计 | 26,724,736.91 |

7.12.4 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。

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末投资前十名股票中不存在流通受限情况。

### §8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

| 持有人户数(户) | 户均持有的基金份额 | 持有人结构 | | | |
|---|---|---|---|---|---|
| | | 机构投资者 | | 个人投资者 | |
| | | 持有份额 | 占总份额比例 | 持有份额 | 占总份额比例 |
| 65,998 | 16,834.70 | 72,350,224.72 | 6.51% | 1,038,706,051.22 | 93.49% |

8.2 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 | 1,661,089.94 | 0.1495% |

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

| 项目 | 持有基金份额总量的数量区间（万份） |
|---|---|
| 本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金 | >=100 |
| 本基金基金经理持有本开放式基金 | 10~50 |

### §9 开放式基金份额变动

单位：份

| | |
|---|---|
| 基金合同生效日（2003年7月15日）基金份额总额 | 1,541,018,133.75 |
| 本报告期期初基金份额总额 | 1,350,255,669.60 |
| 本报告期基金总申购份额 | 73,935,845.18 |
| 减：本报告期基金总赎回份额 | 313,135,238.84 |
| 本报告期基金拆分变动份额 | - |
| 本报告期期末基金份额总额 | 1,111,056,275.94 |

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

本报告期内本基金未召开基金份额持有人大会。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

1、基金管理人的重大人事变动

（1）2014年3月24日，基金管理人发布《华宝兴业基金管理有限公司关于聘任常务副总经理的公告》，Alexandre Werno先生自2014年3月21日起担任公司常务副总经理。

（2）2014年3月31日，基金管理人发布《华宝兴业基金管理有限公司关于聘任副总经理的公告》，向辉先生自2014年3月31日起担任公司副总经理。

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2014年2月7日发布任免通知，解聘尹东中国建设银行投资托管业务部总经理助理职务。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本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

本报告期内本基金的投资策略未发生变更。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

基金管理人为本基金聘任的会计师事务所向本基金提供的审计服务持续期限为：本基金合同生效之日（2003年7月15日）起至本报告期末。

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，管理人、托管人及其高级管理人员未有受到稽查或处罚的情况。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

| 券商名称 | 交易单元数量 | 股票交易 | | 应支付该券商的佣金 | | 备注 |
|---|---|---|---|---|---|---|
| | | 成交金额 | 占当期股票成交总额的比例 | 佣金 | 占当期佣金总量的比例 | |
| 国泰君安 | 2 | 844,493,910.21 | 37.51% | 768,827.37 | 37.87% | - |
| 中投证券 | 1 | 389,829,446.44 | 17.31% | 344,960.46 | 16.99% | - |
| 民生证券 | 1 | 373,484,355.70 | 16.59% | 330,496.73 | 16.28% | - |
| 海通证券 | 1 | 342,492,237.95 | 15.21% | 311,805.46 | 15.36% | - |
| 长江证券 | 1 | 196,268,834.92 | 8.72% | 178,683.34 | 8.80% | - |
| 中信建投 | 1 | 94,952,568.82 | 4.22% | 86,444.64 | 4.26% | - |
| 中金国际 | 1 | 6,716,706.33 | 0.30% | 6,114.88 | 0.30% | - |
| 中信证券 | 1 | 3,386,964.00 | 0.15% | 3,083.45 | 0.15% | - |
| 国信证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 华泰联合 | 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、报告期内无交易席位变动。

10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

| 券商名称 | 债券交易 | | 债券回购交易 | | 权证交易 | |
|---|---|---|---|---|---|---|
| | 成交金额 | 占当期债券成交总额的比例 | 成交金额 | 占当期债券回购成交总额的比例 | 成交金额 | 占当期权证成交总额的比例 |
| 国泰君安 | - | - | - | - | - | - |
| 中投证券 | - | - | - | - | - | - |
| 民生证券 | - | - | - | - | - | - |
| 海通证券 | 68,009,190.20 | 100.00% | - | - | - | - |
| 长江证券 | - | - | - | - | - | - |
| 中信建投 | - | - | - | - | - | - |
| 中金国际 | - | - | - | - | - | - |
| 中信证券 | - | - | - | - | - | - |
| 国信证券 | - | - | - | - | - | - |
| 华泰联合 | - | - | - | - | - | - |

华宝兴业基金管理有限公司

2014年8月29日