华宝兴业大盘精选股票型证券投资基金

2014 年度报告摘要

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:2015年3月30日

§1 重要提示

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2015年3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2014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	华宝兴业大盘精选股票型证券投资基金
基金简称	华宝兴业大盘精选股票
基金主代码	240011
交易代码	240011
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2008年10月7日
基金管理人	华宝兴业基金管理有限公司
基金托管人	中国银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	152,529,167.37份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	在控制风险的前提下,争取基金净值中长期增长超越业绩比较基准。
投资策略	本基金将深入研究大盘股基本面和长期发展前景,注重价值挖掘,通过定量与定性相结合的个股精选策略精选个股,通过对宏观经济、行业经济的把握以及对行业运行周期的认识,调整股票资产在不同行业的投资比例。本基金的大盘股指沪深A股按照流通市值从大至小排名在前 1/3的股票。
业绩比较基准	沪深300指数收益率×80%+上证国债指数收益率×20%。
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	中国银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	刘月华	王永民
	联系电话	021-38505888	010-66594896
	电子邮箱	xxpl@fsfund.com	fcid@bankofchina.com
客户服务电话		400-700-5588、021-38924558	95566
传真		021-38505777	010-66594942

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	基金管理人及基金托管人住所

§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	2014年	2013年	2012年
本期已实现收益	61,781,716.40	42,958,622.49	-28,811,573.30
本期利润	46,168,687.83	50,291,085.78	72,093,484.73
加权平均基金份额本期利润	0.1993	0.1334	0.1425
本期加权平均净值利润率	13.57%	9.39%	10.95%
本期基金份额净值增长率	18.03%	9.65%	7.40%
3.1.2 期末数据和指标	2014年末	2013年末	2012年末
期末可供分配利润	81,332,504.44	76,786,149.59	66,281,883.31
期末可供分配基金份额利润	0.5332	0.2404	0.1286
期末基金资产净值	263,717,259.07	467,925,477.18	688,572,665.84
期末基金份额净值	1.7290	1.4649	1.3360
3.1.3 累计期末指标	2014年末	2013年末	2012年末
基金份额累计净值增长率	80.70%	53.09%	39.62%

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

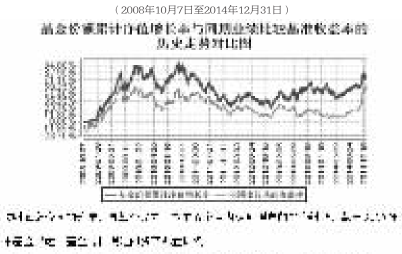
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	12.05%	1.39%	34.58%	1.32%	-22.53%	0.07%
过去六个月	22.06%	1.13%	49.01%	1.06%	-26.95%	0.07%
过去一年	18.03%	1.13%	41.16%	0.97%	-23.13%	0.16%
过去三年	39.00%	1.23%	43.09%	1.04%	-4.09%	0.19%
过去五年	-6.45%	1.26%	4.46%	1.09%	-10.91%	0.17%
自基金合同生效日起至今	80.70%	1.32%	61.86%	1.27%	18.84%	0.05%

注:1、本基金比较基准为:沪深300指数收益率×80%+上证国债指数收益率×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

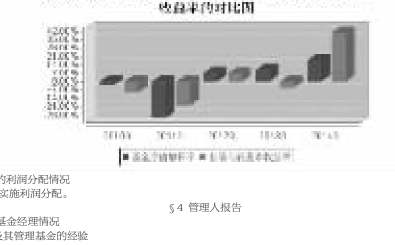
(2008年10月7日至2014年12月31日)



[illegible]

[illegible]

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



3.3 过去三年基金的利润分配情况

本基金过去三年未实施利润分配。

§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(2014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、华宝兴业活期通货币市场基金、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、华宝兴业生态中国基金、华宝兴业量化对冲基金和华宝兴业高端制造基金,所管理的开放式证券投资基金资产净值合计58,663,413,364.76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	助理投资总监、本基金基金经理、华宝兴业医药生物基金经理、华宝兴业行业精选基金基金经理	2010年7月28日	2014年10月22日	14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月至2014年10月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,2014年6月任助理投资总监。
王智慧	助理投资总监、本基金基金经理、华宝兴业医药生物基金经理、华宝兴业多策略基金经理	2012年1月19日	-	13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、基金经理助理和研究部总经理的职务,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,2014年6月任助理投资总监。
夏林锋	本基金基金经理	2014年10月22日	-	5年	硕士。曾在上海高压电器研究所从事研究工作。2010年7月加入华宝兴业基金管理有限公司, 曾任分析师,2012年10月至2014年10月担任华宝兴业大盘精选股票型证券投资基金基金经理助理,2014年10月起担任华宝兴业大盘精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、《华宝兴业大盘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。

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,大盘精选股票型证券投资基金在短期内出现过持有债券及现金投资比例占基金资产净值超过40%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,并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

2014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

回顾2014年,政策整体"托而不举"但略偏宽松,流动性一边规范金融机构运作,一边维持较大幅度放松,经济形势较为低迷,但尾部风险有所降低,企业盈利受限于宏观环境也较为低迷,而A股市场在增量资金推动下表现得较为强势且有明显的节奏差异。政策方面,经济政策基本按照"稳增长、调结构、促改革"的指导思路,维持"双限区间"思维,在就业压力不大的前提下,"托而不举"的意图较为明显,部分兼顾长期改革与短期增长的产业政策陆续出台,如国家集成电路规划、新能源汽车发展规划等,同时地产限购、限贷政策有所放松,资本市场方面,优先股试点顺利推进、IPO正式重启。流动性方面,规范、放松的态势较为明显,一方面承续2013年以来加强影子银行相关政策的影响,以银行为首的金融行业相关业务继续规范,监管层防风险的态度较为坚决,另一方面为缓解企业融资成本过高的问题,央行通过SLF、MLF、定向降准、存贷款口径调整等方式维持整体流动性较为宽松的状态,并于年底开始重启降息降准等措施。经济走势方面,由于整体高产能、高杠杆的格局还未切实改善,加上全球经济复苏较为缓慢,经济整体也较低迷,旺季不旺、淡季较淡的情形明显。同时,以地产投资为首的固定资产投资出现明显回落,全年逐季GDP增速为7.4%、7.5%、7.3%、7.3%,均处于较低水平,不过随着相关放松政策的落地以及改革预期逐步增强,经济尾部风险有所降低。企业盈利方面,限于经济整体较为低迷,工业企业盈利未见改善、甚至略有恶化迹象,从上市公司公布的汇总情况来看还算可以,重点企业甚至略好于预期,不过在整体经济L型的背景下,企业盈利较难向上超预期。海外市场方面,美国经济维持平稳复苏态势,美联储量宽退出的时点、机制逐步明朗,但欧洲、日本情况较为一般,同时乌克兰、伊拉克、叙利亚等地政治局势不稳,美元大幅走强、油价暴跌,全球经济波动性有所加大。

在此背景下,A股市场呈现大小齐涨的态势,上半年由于政策整体"托而不举"、经济较为低迷,转型、成长成为主旋律,下半年随着流动性宽松、增量资金入市等推动,价值蓝筹走出一波较大的估值修复行情。本基金在2014年全年维持中性略高的仓位,并持续进行结构调整,且上下半年为顺应不同的市场风格,进行了较大幅度的配置转换,同时持续优化精选相关个股,持续关注大盘价值与大盘成长之间的轮换。

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18.03%,同期业绩比较基准收益率为41.16%,基金表现落后业绩比较基准23.13%。

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2015年,政策与经济组合可能会是"改革关键之年+经济L型企稳",市场单边上涨的趋势较难持续,可能重回振荡走势。政策方面,改革进入关键之年,相关改革措施有望陆续落地,叠加"十三五规划"的制定,市场信心有望持续提振,同时相关托底、放松政策也有望陆续出台,"多措并举降低企业融资成本"的思路也将持续,而降息降准周期也已重启,利率中枢有望持续下行,流动性整体偏松的局面有望维持。经济走势方面,由于面临主导产业换挡的压力以及整体高产能、高杠杆的局面较难逆转,整体经济可能仍较低迷,不过随着相关托底政策落地及流动性持续宽松,长尾风险爆发的可能性较低,预期大概率将是"L型"企稳,经济有望进入"形态更高级、分工更复杂、结构更合理"的新常态。

综上判断,预估2015年有望成为改革预期逐步兑现之年,中长期信心将会持续修复,不过增量资金逻辑下的估值重构可能进入下半场。A股市场可能从趋势上涨重回振荡格局。结构方面须关注金融、互联网、国企改革、大众消费等板块,以及油价下跌、利率下行等受益品种;风险方面则需关注并购逻辑破坏、IPO进度加快及注册制推进等因素的影响。2015年,本基金将继续坚持相对积极的操作策略,维持中性略高仓位,并在契约规定的范围内进一步优化大盘价值与大盘成长之间的配置,持续挖掘代表未来增长方向的优质成长股、估值合理且盈利增长确定的优质消费股等投资机会。

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。2014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,不断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

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。

4.9 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

本报告期内,本基金不存在连续二十个工作日基金份额持有人低于二百人或者基金资产净值低于五千万元的情形。

§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")在对华宝兴业大盘精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

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:华宝兴业大盘精选股票型证券投资基金

报告截止日: 2014年12月31日

单位:人民币元

资产	附注号	本期末 2014年12月31日	上年度末 2013年12月31日
资 产:			
银行存款		30,066,992.54	26,737,668.73
结算备付金		1,315,528.93	1,104,071.88
存出保证金		180,265.81	151,144.16
交易性金融资产		237,543,239.32	407,348,169.54
其中:股票投资		237,543,239.32	407,348,169.54
基金投资		-	-
债券投资		-	-
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		-	38,535,121.59
应收利息		8,959.74	11,687.35
应收股利		-	-
应收申购款		284,946.90	51,150.14
递延所得税资产		-	-
其他资产		-	-
资产总计		269,399,933.24	473,939,013.39
负债和所有者权益	附注号	本期末 2014年12月31日	上年度末 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		-	-
应付证券清算款		1,675,965.28	3,105,218.13
应付赎回款		1,163,180.40	998,460.24
应付管理人报酬		343,591.08	602,722.68
应付托管费		57,265.14	100,453.77
应付销售服务费		-	-
应付交易费用		1,931,639.15	876,153.99
应交税费		-	-
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债		511,033.12	330,527.40
负债合计		5,682,674.17	6,013,536.21
所有者权益:			
实收基金		152,529,167.37	319,417,631.23
未分配利润		111,188,091.70	148,507,845.95
所有者权益合计		263,717,259.07	467,925,477.18
负债和所有者权益总计		269,399,933.24	473,939,013.39

注:报告截止日2014年12月31日,基金份额净值1.7290元,基金份额总额152,529,167.37份。

7.2 利润表

会计主体:华宝兴业大盘精选股票型证券投资基金

本报告期: 2014年1月1日至2014年12月31日

单位:人民币元

项目	附注号	本期 2014年1月1日至2014年12月31日	上年度可比期间 2013年1月1日至2013年12月31日
一、收入		56,485,730.87	66,206,729.59
1.利息收入		331,666.98	646,945.97
其中:存款利息收入		314,037.54	560,560.56
债券利息收入		-	778.31
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		17,629.44	85,607.10
其他利息收入		-	-
2.投资收益(损失以"-"填列)		71,721,583.81	57,885,387.36
其中:股票投资收益		66,750,811.17	53,300,194.08
基金投资收益		-	-
债券投资收益		-	353,569.24
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		4,970,772.64	4,231,624.04
3.公允价值变动收益(损失以"-"号填列)		-15,613,028.57	7,332,463.29
4.汇兑收益(损失以"-"号填列)		-	-
5.其他收入(损失以"-"号填列)		45,508.65	341,932.97
减:二、费用		10,317,043.04	15,915,643.81
1.管理人报酬		5,124,310.62	8,077,816.11
2.托管费		854,051.72	1,346,302.58
3.销售服务费		-	-
4.交易费用		3,979,060.38	6,129,339.21
5.利息支出		-	-
其中:卖出回购金融资产支出		-	-
6.其他费用		359,620.32	362,185.91
三、利润总额(亏损总额以"-"号填列)		46,168,687.83	50,291,085.78
减:所得税费用		-	-
四、净利润(净亏损以"-"号填列)		46,168,687.83	50,291,085.78

7.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体:华宝兴业大盘精选股票型证券投资基金

本报告期:2014年1月1日至2014年12月31日

单位:人民币元

项目	本期 2014年1月1日至2014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)	319,417,631.23	148,507,845.95	467,925,477.18
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	46,168,687.83	46,168,687.83
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)	-166,888,463.86	-83,488,442.08	-250,376,905.94
其中:1.基金申购款	22,125,561.99	11,735,284.43	33,860,846.42
2.基金赎回款	-189,014,025.85	-95,223,726.51	-284,237,752.36
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)	152,529,167.37	111,188,091.70	263,717,259.07

项目	上年度可比期间 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)	515,411,649.54	173,161,016.30	688,572,665.84
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	50,291,085.78	50,291,085.78
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)	-195,994,018.31	-74,944,256.13	-270,938,274.44
其中:1.基金申购款	56,851,034.65	24,443,529.04	81,294,563.69
2.基金赎回款	-252,845,052.96	-99,387,785.17	-352,232,838.13
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)	319,417,631.23	148,507,845.95	467,925,477.18

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

华宝兴业大盘精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")证监基金字[2008]956号文《关于核准华宝兴业大盘精选股票型证券投资基金募集的批复》的核准,由基金管理人华宝兴业基金管理有限公司向社会公开发行募集,基金合同于2008年10月7日正式生效,首次设立募集规模为490,050,880.11份基金份额。本基金为契约型开放式,存续期限不定。本基金的基金管理人及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,包括国内依法公开发行、上市的股票和债券以及中国证监会允许基金投资的其它金融工具。本基金对股票投资比例为基金资产净值的60%-95%,其中投资于大盘股市值占非现金资产的比例不低于80%;权证投资比例为基金资产净值的0%-3%;资产支持证券比例为基金资产净值的0%-20%;债券及现金投资比例为基金资产的5%-40%(其中,现金或到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的5%)。本基金股票投资的业绩比较基准为沪深300指数,债券投资的业绩比较基准为上证国债指数。整体业绩比较基准为:沪深300指数收益率×80%+上证国债指数收益率×20%。

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颁布的《企业会计准则—基本准则》以及其后颁布及修订的具体会计准则、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修订的《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。

采用若干修订后/新会计准则

2014年1至3月,财政部制定了《企业会计准则第39号——公允价值计量》、《企业会计准则第40号——合营安排》和《企业会计准则第41号——在其他主体中权益的披露》;修订了《企业会计准则第2号——长期股权投资》、《企业会计准则第9号——职工薪酬》、《企业会计准则第30号——财务报表列报》和《企业会计准则第33号——合并财务报表》;上述7项会计准则均自2014年7月1日起施行。2014年6月,财政部修订了《企业会计准则第37号——金融工具列报》,在2014年年度及以后期间的财务报告中施行。

上述会计准则的变化对本基金的财务报表无重大影响。

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2014年12月31日的财务状况以及2014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

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。

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

公允价值是指市场参与者在计量日发生的有序交易中,出售一项资产所能收到或者转移一项负债所需支付的价格。本基金主要金融工具的估值方法如下:

(1)存在活跃市场的金融工具

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。估值日无交易且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,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。

(2)不存在活跃市场的金融工具

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。本基金采用在当前情况下适用并且有足够可利用数据和其他信息支持的估值技术,优先使用相关可观察输入值,只有在可观察输入值无法取得或取得不切实可行的情况下,才使用不可观察输入值。

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1.50%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) 基金收益分配采用现金方式或红利再投资方式(将现金红利按红利发放日前一日的该基金份额净值自动转为基金份额的方式),基金份额持有人可自行选择收益分配方式;基金份额持有人事先未做出选择的,默认的分红方式为现金红利;

(2)每一基金份额享有同等分配权;

(3)基金当期收益先弥补前期亏损后,方可进行当期收益分配;

(4)基金收益分配后每份基金份额的净值不能低于面值;

(5)如果基金当期出现亏损,则不进行收益分配;

(6)在符合有关基金分红条件的前提下,基金收益分配每年至多6次;

(7)全年基金收益分配比例不得低于年度基金已实现净收益的10%。基金合同生效不满三个月,收益可不分配;

(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

本基金本报告期会计政策变更的说明在7.4.2会计报表的编制基础中披露。

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

7.4.6.1 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。

7.4.6.2 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。

7.4.6.3 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、储蓄存款利息收入,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

本基金本期及上年度可比期间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 2014年1月1日至2014年12月31日	上年度可比期间 2013年1月1日至2013年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	5,124,310.62	8,077,816.11
其中:支付销售机构的客户维护费	822,159.10	1,090,343.47

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为每日应计提的基金管理费

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,基金托管人复核后于次月首日起10个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。

1.1.1.1.1 基金托管费

单位:人民币元

项目	本期 2014年1月1日至2014年12月31日	上年度可比期间 2013年1月1日至2013年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	854,051.72	1,346,302.58

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为每日应计提的基金托管费

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,基金托管人复核后于次月首日起10个工作日内从基金财产中一次性支付给基金托管人。

1.1.1.2 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。

1.1.1.3 各关联方投资本基金的情况

1.1.1.3.1 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 2014年1月1日至2014年12月31日	上年度可比期间 2013年1月1日至2013年12月31日
期初持有的基金份额	266,740.28	849,605.64
期间申购/买入总份额	-	-
期间因拆分变动份额	-	-
减:期间赎回/卖出总份额	-	582,865.36
期末持有的基金份额	266,740.28	266,740.28
期末持有的基金份额占基金总份额比例	0.17%	0.08%

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。

1.1.1.3.2 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

本基金本期末及上年度末无除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况。

1.1.1.4 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 2014年1月1日至2014年12月31日		上年度可比期间 2013年1月1日至2013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
中国银行	30,066,992.54	298,772.07	26,737,668.73	525,196.96

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。

1.1.1.5 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。

1.1.1.6 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。

1.1.2 期末(2014年12月31日)本基金持有的流通受限证券

1.1.2.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

本基金本期末无因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券。

1.1.2.2 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
600584	长电科技	2014年11月3日	筹划重大事项	11.13	2015年1月14日	12.24	495,000	5,658,056.99	5,509,350.00	-
600649	城投控股	2014年11月3日	筹划重大事项	10.05	-	-	1,116,531	9,830,050.64	11,221,136.55	-
002482	广田股份	2014年12月10日	筹划重大事项	19.66	2015年1月6日	16.64	320,000	4,965,073.72	6,291,200.00	-

注:本基金截至2014年12月31日止持有以上因公布的重大事项可能产生重大影响而被暂时停牌的股票,该类股票将在所公布事项的重大影响消除后,经交易所批准复牌。

1.1.2.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

1.1.2.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末2014年12月31日止,本基金无因从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购金融资产款余额。

1.1.2.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末2014年12月31日止,本基金无因从事交易所市场债券正回购交易形成的卖出回购金融资产款余额。

1.1.3 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

7.4.14.1.1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贷款和应收款项以及其他金融负债,其因剩余期限不长,公允价值与账面价值相若。

7.4.14.1.2以公允价值计量的金融工具

7.4.14.1.2.1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)。

7.4.14.1.2.2各层次金融工具公允价值

于2014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人民币214,521,552.77元,属于第二层级的余额为23,021,686.55元,无属于第三层级的余额。

于2013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人民币407,348,169.54元,无属于第二层级和第三层级的余额。

7.4.14.1.2.3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。

7.4.14.1.2.4第三层次公允价值余额和本期变动金额

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工具第三层级公允价值本期未发生变动。

7.4.14.2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。

7.4.14.3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。

7.4.14.4财务报表的批准

本财务报表已于2015年3月26日经本基金的基金管理人批准。

§8投资组合报告

2.1 期末基金资产组合情况

金额单位:人民币元

股票代码	项目	金额	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	237,543,239.32	88.17
	其中:股票	237,543,239.32	88.17
2	固定收益投资	-	-
	其中:债券	-	-
	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	31,382,521.47	11.65
7	其他各项资产	474,172.45	0.18
8	合计	269,399,933.24	100.00

2.2 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	21,399,400.00	8.11
C	制造业	65,011,862.60	24.65
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	4,650,831.80	1.76
E	建筑业	15,670,554.24	5.94
F	批发和零售业	1,574,091.20	0.60
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	3,855,428.00	1.46
J	金融业	68,915,395.12	26.13
K	房地产业	41,131,136.55	15.60
L	租赁和商务服务业	2,756,045.01	1.05
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	10,085,494.80	3.82
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	2,493,000.00	0.95
S	综合	-	-
	合计	237,543,239.32	90.07

2.3 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

代码	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	600649	城投控股	1,116,531	11,221,136.55	4.25
2	601628	中国人寿	320,000	10,928,000.00	4.14
3	000002	万 科A	780,000	10,842,000.00	4.11
4	000024	招商地产	400,000	10,556,000.00	4.00
5	600000	浦发银行	600,000	9,414,000.00	3.57
6	601318	中国平安	125,000	9,338,750.00	3.54
7	600837	海通证券	329,952	7,938,645.12	3.01
8	600352	浙江龙盛	400,000	7,872,000.00	2.99
9	600030	中信证券	230,400	7,810,560.00	2.96
10	300070	碧水源	209,951	7,306,294.80	2.77

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。

2.4 报告期内股票投资组合的重大变动

2.4.1 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	600000	浦发银行	42,405,035.00	9.06
2	600048	保利地产	30,744,420.53	6.57
3	000002	万 科A	24,458,743.60	5.23
4	000001	平安银行	24,049,692.08	5.14
5	000024	招商地产	22,931,538.71	4.90
6	601318	中国平安	20,691,180.27	4.42
7	600837	海通证券	19,268,427.08	4.12
8	601328	交通银行	18,495,187.25	3.95
9	600030	中信证券	17,741,143.82	3.79
10	000937	冀中能源	16,106,091.29	3.44
11	601628	中国人寿	14,305,553.85	3.06
12	600028	中国石化	13,559,192.14	2.90
13	300242	明家科技	13,126,683.21	2.81
14	601788	光大证券	12,447,608.13	2.66
15	002368	太极股份	11,745,699.50	2.51
16	600188	兖州煤业	11,362,464.66	2.43
17	300058	蓝色光标	10,995,467.35	2.35
18	000963	华东医药	10,930,700.89	2.34
19	600776	东方通信	10,283,847.45	2.20
20	300334	津膜科技	10,207,159.86	2.18
21	000712	锦龙股份	10,181,491.57	2.18
22	600290	华仪电气	10,079,316.30	2.15
23	002051	中工国际	10,018,347.11	2.14
24	600104	上汽集团	9,686,265.68	2.07
25	000651	格力电器	9,663,806.25	2.07
26	002063	远光软件	9,500,665.75	2.03
27	000983	西山煤电	9,446,785.86	2.02
28	300032	金龙机电	9,441,530.44	2.02

注:买入金额不包括相关交易费用。

2.4.2 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	002415	海康威视	34,900,463.40	7.46
2	600000	浦发银行	33,821,141.92	7.23
3	600048	保利地产	32,075,158.45	6.85
4	600835	上海机电	28,536,132.39	6.10
5	002065	东华软件	26,292,593.97	5.62
6	000001	平安银行	23,593,004.59	5.04
7	600837	海通证券	22,611,556.32	4.83
8	600066	宇通客车	22,580,270.49	4.83
9	000651	格力电器	21,275,665.67	4.55
10	600104	上汽集团	19,714,460.60	4.21
11	000024	招商地产	17,803,881.09	3.80
12	000002	万 科A	17,301,946.25	3.70
13	601607	上海医药	15,884,729.91	3.39
14	002501	利源精制	15,657,330.81	3.35
15	600312	平高电气	14,554,999.73	3.11
16	000848	承德露露	14,322,070.03	3.06
17	600188	兖州煤业	13,797,859.98	2.95
18	600030	中信证券	13,574,031.81	2.90
19	600028	中国石化	13,533,531.93	2.89
20	601318	中国平安	13,435,144.69	2.87
21	600820	隧道股份	13,219,378.57	2.83
22	002690	美亚光电	13,155,292.08	2.81
23	601328	交通银行	12,825,167.00	2.74
24	000816	江淮动力	12,807,995.65	2.74
25	002104	恒宝股份	12,742,070.48	2.72
26	600153	建发股份	12,062,288.16	2.58
27	601788	光大证券	11,909,352.54	2.55
28	002236	大华股份	11,793,738.91	2.52
29	002368	太极股份	11,726,039.75	2.51
30	600887	伊利股份	11,690,007.10	2.50
31	000937	冀中能源	11,125,512.46	2.38
32	600352	浙江龙盛	10,904,850.18	2.33
33	600967	北方创业	10,853,374.50	2.32
34	000712	锦龙股份	10,758,027.53	2.30
35	300058	蓝色光标	10,653,010.14	2.28
36	002241	歌尔声学	10,394,520.26	2.22
37	601965	中国汽研	10,331,341.26	2.21
38	600290	华仪电气	10,304,330.83	2.20
39	002038	双鹭药业	9,871,173.33	2.11
40	600704	物产中大	9,714,828.01	2.08
41	600276	恒瑞医药	9,713,896.08	2.08
42	300199	翰宇药业	9,677,700.36	2.07
43	000983	西山煤电	9,661,423.09	2.06
44	600362	江西铜业	9,597,735.82	2.05
45	300070	碧水源	9,497,825.10	2.03

注:卖出金额不包括相关交易费用。

2.4.3 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	1,166,664,368.83
卖出股票收入(成交)总额	1,388,821,364.35

注:买入股票成本、卖出股票收入均不包括相关交易费用。

2.5 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。

2.6 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

本基金本报告期末未持有债券。

2.7 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。

2.8 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。

2.9 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。

2.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

2.10.1 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。

2.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金未投资股指期货。

2.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

2.11.1 本期国债期货投资政策

本基金未投资国债期货。

2.11.2 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。

2.11.3 本期国债期货投资评价

本基金未投资国债期货。

2.12 投资组合报告附注

2.12.1城投控股于2014 年3 月8日公告。2013年12月5日下午15时10分,公司所属中外合资上海环境集团有限公司与威立雅环境服务中国有限公司合资的上海江桥垃圾焚烧厂(由威立雅公司运营管理)发生事故。在垃圾焚烧厂生产区外,正在维修过程中的约250平米的渗滤液处理一期工程厂房发生爆炸。事故造成3人死亡,3人重伤,1人轻伤。根据《上海市人民政府关于同意<上海环城再生能源有限公司"125"较大爆炸事故调查报告>的批复》(沪府〔2014〕6号)的意见,公司对11名相关责任人予以行政、经济处分。

中国平安控股公司平安证券有限责任公司(以下简称"平安证券")于2014-12-8收到《中国证监会行政处罚决定书》(2014)103号。处罚原因是平安证券出具的保荐书存在虚假记载,且未审慎核查海联讯公开发行募集文件的真实性和准确性。中国证券监督管理委员会决定对平安证券给予警告,没收保荐业务收入400万元,没收承销股票违法所得2,867万元,并处以440万元罚款。

本基金管理人通过对上述上市公司进行进一步了解和分析,认为该处罚不会对公司的投资价值构成实质性影响,因此本基金管理人对上述股票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八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。

2.12.2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。

2.12.3 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	180,265.81
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	8,959.74
5	应收申购款	284,946.90
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	474,172.45

2.12.4 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。

2.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值	占基金资产净值比例(%)	流通受限情况说明
1	600649	城投控股	11,221,136.55	4.26	筹划重大事项

§9 基金份额持有人信息

3.1 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
12,351	12,349.54	984,827.60	0.65%	151,544,339.77	99.35%

1.1 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	517,692.00	0.3394%

1.2 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	10~50
本基金基金经理持有本开放式基金	0~10

§10开放式基金份额变动

单位:份

基金合同生效日(2008年10月7日)基金份额总额	490,050,880.11
本报告期期初基金份额总额	319,417,631.23
本报告期基金总申购份额	22,125,561.99
减:本报告期基金总赎回份额	189,014,025.85
本报告期基金拆分变动份额(份额减少以"-"填列)	-
本报告期期末基金份额总额	152,529,167.37

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

3.1 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。

3.2 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,基金管理人发布高级管理人员变更公告,聘任Alexandre Werno先生为我公司常务副总经理。

(2)2014年3月31日,基金管理人发布高级管理人员变更公告,聘任向辉先生为我公司副总经理。

2、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

(1)2014年2月14日中国银行股份有限公司公告,自2014年2月13日起,陈四清先生担任本行行长。

(2)报告期内本基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

3.3 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。

3.4 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。

3.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金未变更负责审计的会计师事务所。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(2008年10月7日)起至本报告期末。

3.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本基金未变更负责审计的会计师事务所。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(2008年10月7日)起至本报告期末。

3.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

3.7.1 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	
招商证券	1	476,141,218.82	18.63%	421,337.00	18.37%	-
海通证券	1	473,654,719.56	18.53%	419,137.50	18.27%	-
中信建投	1	449,640,042.21	17.60%	409,351.84	17.85%	-
国海证券	2	227,539,087.82	8.90%	203,228.62	8.86%	-
中信金通	1	174,221,608.18	6.82%	158,611.24	6.91%	-
齐鲁证券	1	172,733,672.82	6.76%	157,256.12	6.86%	-
兴业证券	1	139,444,132.02	5.46%	126,950.28	5.53%	-
光大证券	1	117,296,102.30	4.59%	103,795.45	4.53%	-
广发证券	1	99,909,848.07	3.91%	90,957.89	3.97%	-
中金国际	2	64,329,369.48	2.52%	56,924.75	2.48%	-
长江证券	1	52,183,755.27	2.04%	47,509.31	2.07%	-
国信证券	1	50,852,726.94	1.99%	46,296.27	2.02%	-
申银万国	1	34,628,228.78	1.36%	31,525.37	1.37%	-
国泰君安	1	22,911,220.91	0.90%	20,857.77	0.91%	-
国联证券	1	-	-	-	-	-
太平洋证券	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、本基金本报告期券商交易单元无变化。

3.7.2 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
招商证券	-	-	-	-	-	-
海通证券	-	-	-	-	-	-
中信建投	-	-	25,000,000.00	50.00%	-	-
国海证券	-	-	-	-	-	-
中信金通	-	-	10,000,000.00	20.00%	-	-
齐鲁证券	-	-	-	-	-	-
兴业证券	-	-	-	-	-	-
光大证券	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-
中金国际	-	-	-	-	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	15,000,000.00	30.00%	-	-
申银万国	-	-	-	-	-	-
国泰君安	-	-	-	-	-	-
国联证券	-	-	-	-	-	-
太平洋证券	-	-	-	-	-	-

§12 影响投资者决策的其他重要信息

本报告期内,本基金托管人中国银行的专门基金托管部门的名称由托管及投资者服务部更名为托管业务部。

华宝兴业基金管理有限公司
2015年3月30日