# 华宝兴业行业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:中国建设银行股份有限公司
送出日期:2015年3月30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,普华永道中天会计师事务所有限公司为本基金出具了无保留意见的审计报告。

本报告期自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 | 华宝兴业行业精选股票型证券投资基金 |
| 基金简称 | 华宝兴业行业精选股票 |
| 基金主代码 | 240010 |
| 交易代码 | 240010 |
| 基金运作方式 | 契约型开放式 |
| 基金合同生效日 | 2007年6月14日 |
| 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 | 6,597,670,239.07份 |
| 基金合同存续期 | 不定期 |

2.2 基金产品说明

| | |
|---|---|
| 投资目标 | 把握行业发展趋势和市场运行趋势,精选增长前景良好或周期复苏的行业和企业,在控制风险的前提下,追求基金净值的稳定增长和基金资产的长期增值。 |
| 投资策略 | 本基金将通过分析宏观经济、产业政策和行业景气程度,精选发展前景良好或景气程度向好的行业,通过行业估值模型与波特五力分析,加强对有吸引力行业的配置。在行业配置比例确定后,本基金将对基金管理人股票库相关精选行业的股票运用定量指标筛选排名靠前的股票,并进行定性分析,确定最终投资组合。 |
| 业绩比较基准 | 沪深300 指数收益率。 |
| 风险收益特征 | 本基金属于证券投资基金中的较高风险、较高收益的品种。 |

2.3 基金管理人和基金托管人

| 项目 | | 基金管理人 | 基金托管人 |
|---|---|---|---|
| 名称 | | 华宝兴业基金管理有限公司 | 中国建设银行股份有限公司 |
| 信息披露负责人 | 姓名 | 刘月华 | 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 | 2014年 | 2013年 | 2012年 |
|---|---|---|---|
| 本期已实现收益 | 2,031,850,001.31 | 1,579,202,019.97 | -806,722,552.17 |
| 本期利润 | 1,387,049,290.91 | 2,111,283,323.86 | 1,261,523,465.64 |
| 加权平均基金份额本期利润 | 0.1638 | 0.1874 | 0.1008 |
| 本期加权平均净值利润率 | 15.45% | 18.37% | 11.88% |
| 本期基金份额净值增长率 | 17.35% | 18.64% | 12.67% |
| 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 | 874,093,168.38 | -1,219,259,623.23 | -3,438,641,697.84 |
| 期末可供分配基金份额利润 | 0.1325 | -0.1274 | -0.2707 |
| 期末基金资产净值 | 8,146,663,914.88 | 10,068,599,149.59 | 11,267,307,234.94 |
| 期末基金份额净值 | 1.2348 | 1.0522 | 0.8869 |
| 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 | 23.48% | 5.22% | -11.31% |

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

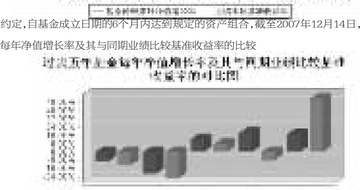
| 3.1.1 期间数据和指标 | | 份额净值增长率① | 份额净值增长率标准差② | 业绩比较基准收益率③ | 业绩比较基准收益率标准差④ | ①-③ | ②-④ |
|---|---|---|---|---|---|---|---|
| 过去三个月 | 9.75% | 1.39% | 44.17% | 1.65% | -34.42% | -0.26% | |
| 过去六个月 | 21.12% | 1.18% | 63.21% | 1.32% | -42.09% | -0.14% | |
| 过去一年 | 17.35% | 1.28% | 51.66% | 1.21% | -34.31% | 0.07% | |
| 过去三年 | 56.86% | 1.27% | 50.64% | 1.30% | 6.22% | -0.03% | |
| 过去五年 | 12.73% | 1.26% | -1.17% | 1.36% | 13.90% | -0.10% | |
| 自基金合同生效日起至今 | 23.48% | 1.52% | -14.19% | 1.84% | 37.67% | -0.32% | |

注:1、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)。

2、本基金业绩比较基准为:沪深300 指数收益率。

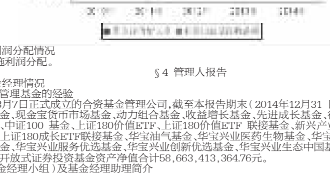
3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

(2007年6月14日至2014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2007年12月14日,本基金已达到合同规定的资产配置比例。

3.2.3 过去五年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基金经理 | 2013年7月25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。 |
| 李卓 | 本基金基金经理、研究部总经理 | 2013年8月22日 | – | 9年 | 硕士。曾在中银基金管理有限公司、富邦证券上海代表处从事研究工作。2008年加入华宝兴业基金管理有限公司,历任分析师、高级分析师、基金经理助理、研究部总经理助理、研究部副总经理。2013年8月起任华宝兴业行业精选股票型证券投资基金基金经理,2014年任研究部总经理。 |
| 闫旭 | 助理投资总监、本基金基金经理 | 2014年7月9日 | – | 15年 | 硕士。曾在富国基金管理有限公司从事证券研究、交易和投资工作,2004年10月至2010年7月任职于华宝兴业基金管理有限公司,先后任基金经理助理、基金经理的职务。2010年7月至2014年2月任纽银梅隆西部基金管理有限公司投资副总监兼基金经理,2014年3月加入华宝兴业基金管理有限公司,现任助理投资总监。2014年7月起任华宝兴业行业精选股票型证券投资基金基金经理。 |
| 沈梦圆 | 本基金基金经理,华宝兴业生态中国股票型证券投资基金基金经理 | 2013年8月22日 | 2014年8月30日 | 6年 | 硕士。2008年加入华宝兴业基金管理有限公司先后任研究部分析师,基金经理助理的职务。2013年8月至2014年8月任华宝兴业行业精选股票型证券投资基金基金经理,2014年8月至11月任华宝兴业生态中国股票型证券投资基金基金经理。 |
| 楼鸿强 | 本基金基金经理助理、华宝兴业服务股票基金基金经理 | 2012年9月25日 | 2014年6月18日 | 5年 | 硕士。曾在兴业证券担任研究员。2011年加入华宝兴业基金管理有限公司任研究员,2012年9月至2014年6月任华宝兴业行业精选股票基金基金经理助理。2014年6月至2014年10月任华宝兴业服务优选股票型证券投资基金基金经理助理,2014年10月起任华宝兴业服务优选股票型证券投资基金基金经理。 |
| 光磊 | 本基金基金经理助理、华宝兴业宝康消费品混合基金基金经理助理 | 2014年6月18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、《华宝兴业行业精选股票型证券投资基金基金合同》和其他相关法律法规的规定、监管部门的相关规定,依照诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产,在控制投资风险的基础上,为基金份额持有人谋取最大利益,没有损害基金份额持有人利益的行为。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度和控制方法

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

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

2014年A股整体表现较好,上证指数全年上涨52.87%,深圳成指涨35.62%,沪深300上涨51.66%,中小板指数上涨9.67%,创业板指数上涨12.83%。但从全年行情看,上下半年差异明显。上半年市场仍在追捧转型预期,互联网相关、信息安全、军工等表现较好;下半年市场受到沪港通、“930”新政和降息降准刺激,以蓝筹股估值修复为主题,金融、地产、建筑等权重板块表现较好。

本基金在选股和操作上积极应对,依据市场的变化适度调整仓位和持股。在上半年,本基金延续着2013年的风格,持股偏向于转型预期的公司;下半年积极调整仓位,参与了非银、交运等的投资机会,取得了一定收益。

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17.35%,同期业绩比较基准收益率为51.66%,基金表现落后业绩基准34.31%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

目前股票市场的流动性相对充裕,经济则在经历转型的痛苦期。部分行业等待着出清;部分企业加快步伐兼并收购、攻城掠地,而部分企业则濒临破产或竞争力遇到瓶颈而面临着被整合的命运;部分企业开始初露峥嵘,部分企业则在默默耕耘。在互联网开始渗透到生产、生活的每个环节时,有的企业发现了新模式而受到资金的青睐,而有的企业则在冲击中被动应对或主动突围。模式与盈利、热情与理性、梦想与现实、能力与谎言、价值与估值……在这个立体交易的时代,投资变得更加多维,也使我们的投资行为更加严谨。我们试图拨开迷雾去寻找能够接受检验的公司,拥抱成长的喜悦、分享改革的红利,也期待价值的发现。

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,努力实现本基金的良好表现。

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

本基金本报告期未进行利润分配,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,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,本基金未实施利润分配。

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

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

## §7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体:华宝兴业行业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

| 姓名 | 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 | | 527,076,070.81 | 666,649,304.85 |
| 结算备付金 | | 13,528,948.44 | 18,180,273.16 |
| 存出保证金 | | 2,856,897.22 | 1,743,736.76 |
| 交易性金融资产 | | 7,488,995,712.39 | 8,784,133,815.31 |
| 其中:股票投资 | | 7,488,995,712.39 | 8,425,809,815.31 |
| 基金投资 | | – | – |
| 债券投资 | | – | 358,324,000.00 |
| 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 | | 98,000,267.00 | 479,453,169.18 |
| 应收证券清算款 | | 115,214,418.40 | 169,958,141.47 |
| 应收利息 | | 169,859.98 | 8,767,866.16 |
| 应收股利 | | – | – |
| 应收申购款 | | 311,352.61 | 295,967.81 |
| 递延所得税资产 | | – | – |
| 其他资产 | | – | – |
| 资产总计 | | 8,246,153,526.85 | 10,129,182,274.70 |
| 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 | | – | 14,998,818.15 |
| 应付赎回款 | | 53,649,495.86 | 10,411,009.99 |
| 应付管理人报酬 | | 10,834,871.31 | 12,737,340.63 |
| 应付托管费 | | 1,805,811.87 | 2,122,890.11 |
| 应付销售服务费 | | – | – |
| 应付交易费用 | | 32,146,149.83 | 19,555,694.69 |
| 应交税费 | | – | – |
| 应付利息 | | – | – |
| 应付利润 | | – | – |
| 递延所得税负债 | | – | – |
| 其他负债 | | 1,053,283.10 | 757,371.54 |
| 负债合计 | | 99,489,611.97 | 60,583,125.11 |
| 所有者权益: | | | |
| 实收基金 | | 6,597,670,239.07 | 9,569,338,196.01 |
| 未分配利润 | | 1,548,993,675.81 | 499,260,953.58 |
| 所有者权益合计 | | 8,146,663,914.88 | 10,068,599,149.59 |
| 负债和所有者权益总计 | | 8,246,153,526.85 | 10,129,182,274.70 |

注:报告截止日2014年12月31日,基金份额净值1.2348元,基金份额总额 6,597,670,239.07份。

7.2 利润表

会计主体:华宝兴业行业精选股票型证券投资基金

本报告期:2014年1月1日至2014年12月31日

单位:人民币元

| 姓名 | 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 | | 1,618,498,716.98 | 2,371,495,929.01 |
| 1.利息收入 | | 13,133,627.92 | 35,358,196.76 |
| 其中:存款利息收入 | | 7,909,976.85 | 10,597,364.42 |
| 债券利息收入 | | 2,648,839.40 | 15,948,256.52 |
| 资产支持证券利息收入 | | – | – |
| 买入返售金融资产收入 | | 2,574,811.67 | 8,812,575.82 |
| 其他利息收入 | | – | – |
| 2.投资收益(损失以“-”填列) | | 2,249,875,415.81 | 1,801,716,750.74 |
| 其中:股票投资收益 | | 2,184,227,075.32 | 1,745,661,928.96 |
| 基金投资收益 | | – | – |
| 债券投资收益 | | 610,777.12 | 1,290,257.88 |
| 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 | | 65,037,563.37 | 54,764,563.90 |
| 3.公允价值变动收益(损失以“-”号填列) | | -644,800,710.40 | 532,081,303.89 |
| 4.汇兑收益(损失以“-”号填列) | | – | – |
| 5.其他收入(损失以“-”号填列) | | 290,383.65 | 2,339,677.62 |
| 减:二、费用 | | 231,449,426.07 | 260,212,605.15 |
| 1.管理人报酬 | | 135,018,963.45 | 172,574,657.76 |
| 2.托管费 | | 22,503,160.53 | 28,762,442.94 |
| 3.销售服务费 | | – | – |
| 4.交易费用 | | 73,311,625.33 | 58,320,980.50 |
| 5.利息支出 | | – | – |
| 其中:卖出回购金融资产支出 | | – | – |
| 6.其他费用 | | 615,676.76 | 554,523.95 |
| 三、利润总额(亏损总额以“-”号填列) | | 1,387,049,290.91 | 2,111,283,323.86 |
| 减:所得税费用 | | – | – |
| 四、净利润(净亏损以“-”号填列) | | 1,387,049,290.91 | 2,111,283,323.86 |

7.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体:华宝兴业行业精选股票型证券投资基金

本报告期: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) | 9,569,338,196.01 | 499,260,953.58 | 10,068,599,149.59 |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润) | – | 1,387,049,290.91 | 1,387,049,290.91 |
| 三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数(净值减少以“-”号填列) | -2,971,667,956.94 | -337,316,568.68 | -3,308,984,525.62 |
| 其中:1.基金申购款 | 107,986,101.90 | 13,285,277.75 | 121,271,379.65 |
| 2.基金赎回款 | -3,079,654,058.84 | -350,601,846.43 | -3,430,255,905.27 |
| 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) | 6,597,670,239.07 | 1,548,993,675.81 | 8,146,663,914.88 |
| 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) | 12,703,673,009.50 | -1,436,365,774.56 | 11,267,307,234.94 |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润) | – | 2,111,283,323.86 | 2,111,283,323.86 |
| 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) | -3,134,334,813.49 | -175,656,595.72 | -3,309,991,409.21 |
| 其中:1.基金申购款 | 632,192,174.08 | -4,235,410.35 | 627,956,763.73 |
| 2.基金赎回款 | -3,766,526,987.57 | -171,421,185.37 | -3,937,948,172.94 |
| 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) | 9,569,338,196.01 | 499,260,953.58 | 10,068,599,149.59 |

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

华宝兴业行业精选股票型证券投资基金(以下简称“本基金”)经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监基金字[2007]第156号《关于同意华宝兴业行业精选股票型证券投资基金募集的批复》核准,由华宝兴业基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《华宝兴业行业精选股票型证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式,存续期限不定,首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币9,998,141,906.12元,业经普华永道中天会计师事务所有限公司普华永道中天验字(2007)第071号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《华宝兴业行业精选股票型证券投资基金基金合同》于2007年6月14日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为9,998,540,080.34份基金份额,其中认购资金利息折合398,174.22份基金份额。本基金的基金管理人为华宝兴业基金管理有限公司,基金托管人为中国建设银行股份有限公司。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《华宝兴业行业精选股票型证券投资基金基金合同》的有关规定,本基金的投资范围为国内依法公开发行、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。本基金的投资比例范围为:股票占基金资产总值的60%-95%,权证占0%-3%,资产支持证券占0%-20%,债券及现金占5%-40%,其中,现金或者到期日在一年内的政府债券比例在5%以上。本基金的业绩比较基准为沪深300指数收益率。

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2015年3月26日批准报出。

7.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于2006年2月15日及以后期间颁布的《企业会计准则-基本准则》、各项具体会计准则及相关规定(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》、《华宝兴业行业精选股票型证券投资基金基金合同》和在财务报表附注7.4.4所列示的中国证监会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金2014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12月31日的财务状况以及2014年度 的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

7.4.4 重要会计政策和会计估计

7.4.4.1 会计年度

本基金会计年度为公历1月1日起至12月31日止。

7.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

(1)金融资产的分类

金融资产于初始确认时分类为:以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、应收款项、可供出售金融资产及持有至到期投资。金融资产的分类取决于本基金对金融资产的持有意图和持有能力。本基金现无金融资产分类为可供出售金融资产及持有至到期投资。

本基金目前以交易目的持有的股票投资和债券投资分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在资产负债表中以交易性金融资产列示。

本基金持有的其他金融资产分类为应收款项,包括银行存款、买入返售金融资产和其他各类应收款项等。应收款项是指在活跃市场中没有报价、回收金额固定或可确定的非衍生金融资产。

(2)金融负债的分类

金融负债于初始确认时分类为:以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债及其他金融负债。本基金目前暂无金融负债分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。本基金持有的其他金融负债包括其他各类应付款项等。

7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

金融资产或金融负债于本基金成为金融工具合同的一方时,按公允价值在资产负债表内确认。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产,取得时发生的相关交易费用计入当期损益;对于支付的价款中包含的债券起息日或上次除息日至购买日止的利息,单独确认为应收项目。应收款项和其他金融负债的相关交易费用计入初始确认金额。

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产,按照公允价值进行后续计量;对于应收款项和其他金融负债采用实际利率法,以摊余成本进行后续计量。

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

金融资产终止确认时,其账面价值与收到的对价的差额,计入当期损益。

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

7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

本基金持有的股票投资和债券投资按如下原则确定公允价值并进行估值:

(1)存在活跃市场的金融工具按其估值日的市场交易价格确定公允价值;估值日无交易,但最近交易日后经济环境未发生重大变化且证券发行机构未发生影响证券价格的重大事件的,按最近交易日的市场交易价格确定公允价值。

(2)存在活跃市场的金融工具,如估值日无交易且最近交易日后经济环境发生了重大变化,参考类似投资品种的现行市价及重大变化等因素,调整最近交易市价以确定公允价值。

(3)当金融工具不存在活跃市场,采用市场参与者普遍认同且被以往市场实际交易价格验证具有可靠性的估值技术确定公允价值。估值技术包括参考熟悉情况并自愿交易的各方最近进行的市场交易中使用的价格、参照实质上相同的其他金融工具的当前公允价值、现金流量折现法和期权定价模型等。采用估值技术时,尽可能最大程度使用市场参数,减少使用与本基金特定相关的参数。

7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

本基金持有的资产和承担的负债基本为金融资产和金融负债。当本基金1) 具有抵销已确认金额的法定权利且该种法定权利现在是可执行的;且2) 交易双方准备按净额结算时,金融资产与金融负债按抵销后的净额在资产负债表中列示。

7.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行基金份额所募集的总金额在扣除损益平准金分摊部分后的余额。由于申购和赎回引起的实收基金变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日认列。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

7.4.4.8 损益平准金

损益平准金包括已实现平准金和未实现平准金。已实现平准金指在申购或赎回基金份额时,申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现损益占基金净值比例计算的金额。未实现平准金指在申购或赎回基金份额时,申购或赎回款项中包含的按累计未实现损益占基金净值比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日认列,并于期末全额转入未分配利润/(累计亏损)。

7.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

股票投资在持有期间应取得的现金股利扣除由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额确认为投资收益。债券投资在持有期间应取得的按票面利率或者发行价计算的利息扣除在适用情况下由债券发行企业代扣代缴的个人所得税后的净额确认为利息收入。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在持有期间的公允价值变动确认为公允价值变动损益;于处置时,其处置价格与初始确认金额之间的差额确认为投资收益,其中包括从公允价值变动损益结转的公允价值累计变动额。

应收款项在持有期间确认的利息收入按实际利率法计算,实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

7.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬和托管费在费用涵盖期间按基金合同约定的费率和计算方法逐日确认。

其他金融负债在持有期间确认的利息支出按实际利率法计算,实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

7.4.4.11 基金的收益分配政策

每一基金份额享有同等分配权。本基金收益以现金形式分配,但基金份额持有人可选择现金红利或将现金红利按除息日的基金份额净值自动转为基金份额进行再投资。若期末未分配利润中的未实现部分为正数,包括基金经营活动产生的未实现损益以及基金份额交易产生的未实现平准金等,则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润中的已实现部分;若期末未分配利润的未实现部分为负数,则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润,即已实现部分相抵未实现部分后的余额。

经宣告的拟分配基金收益于分红除权日从所有者权益转出。

7.4.4.12 分部报告

本基金以内部组织结构、管理要求、内部报告制度为依据确定经营分部,以经营分部为基础确定报告分部并披露分部信息。经营分部是指本基金内同时满足下列条件的组成部分:(1) 该组成部分能够在日常活动中产生收入、发生费用;(2) 本基金的基金管理人能够定期评价该组成部分的经营成果,以决定向其配置资源、评价其业绩;(3) 本基金能够取得该组成部分的财务状况、经营成果和现金流量等有关会计信息。如果两个或多个经营分部具有相似的经济特征,并且满足一定条件的,则合并为一个经营分部。

本基金目前以一个单一的经营分部运作,不需要披露分部信息。

7.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计

根据本基金的估值原则和中国证监会允许的基金行业估值实务操作,本基金确定以下类别股票投资和债券投资的公允价值时采用的估值方法及其关键假设如下:

(1)对于证券交易所上市的股票,若出现重大事项停牌或交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)等情况,本基金根据中国证监会公告[2008]38号《关于进一步规范证券投资基金估值业务的指导意见》,根据具体情况采用《关于发布中基协(AMAC)基金行业股票估值指数的通知》提供的指数收益法等估值技术进行估值。

(2)对于在锁定期内的非公开发行股票,根据中国证监会证监会计字[2007]21号《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》之附件《非公开发行有明确锁定期股票的公允价值的确定方法》,若在证券交易所挂牌的同一股票的市场交易收盘价低于非公开发行股票的初始投资成本,按估值日证券交易所挂牌的同一股票的市场交易收盘价估值;若在证券交易所挂牌的同一股票的市场交易收盘价高于非公开发行股票的初始投资成本,按锁定期内已经过交易天数占锁定期内总交易天数的比例将两者之间差价的一部分确认为估值增值。

(3)在银行间同业市场交易的债券品种,根据中国证监会证监会计字[2007]21号《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》采用估值技术确定公允价值。本基金持有的银行间同业市场债券按现金流量折现法估值,具体估值模型、参数及结果由中央国债登记结算有限责任公司独立提供。

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

财政部于2014年颁布 《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》、《企业会计准则第41号——在其他主体中权益的披露》和修订后的《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》、《企业会计准则第33号——合并财务报表》以及《企业会计准则第37号——金融工具列报》,要求除《企业会计准则第37号——金融工具列报》自2014年度财务报表起施行外,其他准则自2014年7月1日起施行。上述准则对本基金本报告期无重大影响。

7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

7.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

7.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[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。基金买卖股票、债券的差价收入不予征收营业税。

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

(3)对基金取得的企业债券利息收入,应由发行债券的企业在向基金支付利息时代扣代缴20%的个人所得税。自2013年1月1日起,对基金从上市公司取得的股息红利所得,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。对基金持有的上市公司限售股,解禁后取得的股息、红利收入,按照上述规定计算纳税,持股时间自解禁日起计算;解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按50%计入应纳税所得额。上述所得统一适用20%的税率计征个人所得税。

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

7.4.7 关联方关系

| 项目 | 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。

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 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 | |
|---|---|---|---|---|
| | 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 | 667,144,228.99 | 1.41% | 1,339,304,209.88 | 3.57% |

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 2014年1月1日至2014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 | 607,365.75 | 1.41% | 223,403.97 | 0.69% |
| 关联方名称 | 上年度可比期间 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 | 1,219,295.81 | 3.58% | 715,334.91 | 3.66% |

1. 上述佣金参考市场价格经本基金的基金管理人与对方协商确定,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 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 | 135,018,963.45 | 172,574,657.76 |
| 其中:支付销售机构的客户维护费 | 25,161,265.39 | 30,613,261.16 |

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 × 1.5% / 当年天数。

7.4.8.2.2 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 | 22,503,160.53 | 28,762,442.94 |

注:支付基金托管人 中国建设银行 的托管费按前一日基金资产净值0.25%的年费率计提,逐日累计至每月月底,按月支付。其计算公式为:

日托管费=前一日基金资产净值 × 0.25% / 当年天数。

7.4.8.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金本期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 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 |
|---|---|---|
| 基金合同生效日(2007年6月14日)持有的基金份额 | – | – |
| 期初持有的基金份额 | 1,475,240.59 | 1,879,090.65 |
| 期间申购/买入总份额 | – | 191,807.97 |
| 期间因拆分变动份额 | – | – |
| 减:期间赎回/卖出总份额 | – | 595,658.03 |
| 期末持有的基金份额 | 1,475,240.59 | 1,475,240.59 |
| 期末持有的基金份额占基金总份额比例 | 0.02% | 0.02% |

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

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。

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 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 |
| 中国建设银行 | 527,076,070.81 | 7,562,890.38 | 666,649,304.85 | 10,287,836.72 |

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

本基金本报告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( 2014年12月31日 )本基金持有的流通受限证券

7.4.9.2 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

| 7.4.12.1.1 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 |
| 000725 | 京东方A | 2014年4月4日 | 2015年4月7日 | 非公开发行流通受限 | 2.10 | 3.05 | 28,571,429 | 60,000,000.90 | 87,142,858.45 | – |

注:基金可使用以基金名义开设的股票账户,选择网上或者网下一种方式进行新股申购。其中基金作为一般法人或战略投资者认购的新股,根据基金与上市公司所签订申购协议的规定,在新股上市后的约定期限内不能自由转让;基金作为个人投资者参与网上认购获配的新股,从新股获配日至新股上市日之间不能自由转让。此外,基金还可作为特定投资者,认购由中国证监会《上市公司证券发行管理办法》规范的非公开发行股票,所认购的股票自发行结束之日起12个月内不得转让。

7.4.9.3 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 |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| 300168 | 万达信息 | 2014年12月31日 | 重大事项停牌 | 46.20 | 2015年1月8日 | 44.50 | 5,879,871 | 166,741,235.85 | 271,650,040.20 | – |
| 002009 | 天奇股份 | 2014年10月20日 | 重大事项停牌 | 16.30 | 2015年1月28日 | 17.93 | 5,146,043 | 72,851,848.72 | 83,880,500.90 | – |
| 600399 | 抚顺特钢 | 2014年12月12日 | 重大事项停牌 | 28.38 | 2015年1月26日 | 31.22 | 1,972,827 | 39,266,103.41 | 55,988,830.26 | – |
| 300269 | 联建光电 | 2014年12月30日 | 重大事项停牌 | 36.13 | 2015年1月7日 | 35.00 | 869,283 | 28,002,374.67 | 31,407,194.79 | – |
| 300140 | 启源装备 | 2014年12月3日 | 重大事项停牌 | 25.01 | 2015年2月16日 | 27.51 | 650,584 | 16,577,872.48 | 16,271,105.84 | – |
| 002396 | 星网锐捷 | 2014年10月20日 | 重大事项停牌 | 27.31 | 2015年2月9日 | 30.04 | 500,000 | 11,975,390.67 | 13,655,000.00 | – |
| 300170 | 汉得信息 | 2014年12月10日 | 重大事项停牌 | 13.22 | 2015年1月28日 | 14.54 | 999,941 | 11,026,459.22 | 13,219,220.02 | – |
| 300063 | 天龙集团 | 2014年12月1日 | 重大事项停牌 | 17.75 | – | – | 482,659 | 7,908,405.28 | 8,567,197.25 | – |
| 002331 | 皖通科技 | 2014年11月10日 | 重大事项停牌 | 15.62 | 2015年3月25日 | 16.96 | 2,330,900 | 38,741,129.21 | 36,408,658.00 | – |
| 300144 | 宋城演艺 | 2014年12月18日 | 重大事项停牌 | 27.38 | 2015年3月18日 | 33.13 | 466,250 | 13,862,063.00 | 12,765,925.00 | – |
| 300183 | 东软载波 | 2014年9月29日 | 重大事项停牌 | 54.78 | 2015年1月5日 | 47.42 | 749,952 | 27,659,025.61 | 41,082,370.56 | – |
| 300315 | 掌趣科技 | 2014年7月14日 | 重大事项停牌 | 19.59 | 2015年2月16日 | 17.41 | 6,261,104 | 109,537,385.31 | 122,655,027.36 | – |
| 300296 | 利亚德 | 2014年9月29日 | 重大事项停牌 | 21.95 | 2015年1月5日 | 22.60 | 1,000,000 | 16,169,511.19 | 21,950,000.00 | – |

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。

7.4.9.4 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.9.4.1 银行间市场债券正回购

本基金本期末无银行间市场债券正回购,因此没有在债券正回购交易中作为抵押的债券。

7.4.9.4.2 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

(1)公允价值

(a)金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属的层次,由对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次决定:

第一层次:相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次:除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次:相关资产或负债的不可观察输入值。

(b)持续的以公允价值计量的金融工具

(i)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次的余额为 6,672,351,783.76元,属于第二层次的余额为 816,643,928.63元,无属于第三层次的余额(2013年12月31日:第一层次8,425,809,815.31元,第二层次358,324,000.00元,无第三层次)。

(ii)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次;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次还是第三层次。

(iii)第三层次公允价值余额和本期变动金额

无。

(c)非持续的以公允价值计量的金融工具

于2014年12月31日,本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产(2013年12月31日:同)。

(d)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。

(2)除公允价值外,截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

## §8 投资组合报告

8.1 期末基金资产组合情况

金额单位:人民币元

| 股票代码 | 项目 | 金额 | 占基金总资产的比例(%) |
|---|---|---|---|
| 1 | 权益投资 | 7,488,995,712.39 | 90.82 |
| | 其中:股票 | 7,488,995,712.39 | 90.82 |
| 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 | 98,000,267.00 | 1.19 |
| | 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 | 540,605,019.25 | 6.56 |
| 7 | 其他各项资产 | 118,552,528.21 | 1.44 |
| 8 | 合计 | 8,246,153,526.85 | 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 | 247,894,497.85 | 3.04 |
| B | 采矿业 | 228,123,579.62 | 2.80 |
| C | 制造业 | 2,595,760,269.54 | 31.86 |
| D | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | 87,639,667.31 | 1.08 |
| E | 建筑业 | 81,264,135.13 | 1.00 |
| F | 批发和零售业 | 405,417,504.33 | 4.98 |
| G | 交通运输、仓储和邮政业 | 223,332,483.62 | 2.74 |
| H | 住宿和餐饮业 | – | – |
| I | 信息传输、软件和信息技术服务业 | 1,085,330,635.82 | 13.32 |
| J | 金融业 | 1,366,594,564.68 | 16.77 |
| K | 房地产业 | 620,138,881.78 | 7.61 |
| L | 租赁和商务服务业 | 86,576,878.39 | 1.06 |
| M | 科学研究和技术服务业 | 5,236,000.00 | 0.06 |
| N | 水利、环境和公共设施管理业 | 213,821,257.20 | 2.62 |
| O | 居民服务、修理和其他服务业 | – | – |
| P | 教育 | – | – |
| Q | 卫生和社会工作 | 13,527,656.10 | 0.17 |
| R | 文化、体育和娱乐业 | 192,047,535.02 | 2.36 |
| S | 综合 | 36,290,166.00 | 0.45 |
| | 合计 | 7,488,995,712.39 | 91.93 |

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

| 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 | 300168 | 万达信息 | 5,879,871 | 271,650,040.20 | 3.33 |
| 2 | 300147 | 香雪制药 | 15,176,708 | 253,147,489.44 | 3.11 |
| 3 | 000024 | 招商地产 | 9,179,704 | 242,252,388.56 | 2.97 |
| 4 | 300070 | 碧水源 | 6,144,289 | 213,821,257.20 | 2.62 |
| 5 | 002368 | 太极股份 | 4,574,036 | 200,800,180.40 | 2.46 |
| 6 | 601166 | 兴业银行 | 11,513,464 | 189,972,156.00 | 2.33 |
| 7 | 601988 | 中国银行 | 44,965,200 | 186,605,580.00 | 2.29 |
| 8 | 000001 | 平安银行 | 9,909,224 | 156,962,108.16 | 1.93 |
| 9 | 600158 | 中体产业 | 8,761,532 | 155,166,731.72 | 1.90 |
| 10 | 601288 | 农业银行 | 37,276,500 | 138,295,815.00 | 1.70 |

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 | 601166 | 兴业银行 | 367,423,713.97 | 3.65 |
| 2 | 600198 | 大唐电信 | 322,977,209.06 | 3.21 |
| 3 | 600109 | 国金证券 | 316,617,136.21 | 3.14 |
| 4 | 300168 | 万达信息 | 309,919,787.23 | 3.08 |
| 5 | 601318 | 中国平安 | 278,420,767.00 | 2.77 |
| 6 | 601328 | 交通银行 | 275,998,137.85 | 2.74 |
| 7 | 000541 | 佛山照明 | 245,693,773.34 | 2.44 |
| 8 | 300315 | 掌趣科技 | 233,302,589.69 | 2.32 |
| 9 | 600446 | 金证股份 | 230,320,804.13 | 2.29 |
| 10 | 000001 | 平安银行 | 220,332,973.03 | 2.19 |
| 11 | 600104 | 上汽集团 | 216,684,566.76 | 2.15 |
| 12 | 000024 | 招商地产 | 208,506,390.73 | 2.07 |
| 13 | 300170 | 汉得信息 | 203,226,541.49 | 2.02 |
| 14 | 002421 | 达实智能 | 199,169,199.61 | 1.98 |
| 15 | 300253 | 卫宁软件 | 190,510,051.21 | 1.89 |
| 16 | 002038 | 双鹭药业 | 186,529,064.99 | 1.85 |
| 17 | 000002 | 万 科A | 185,665,100.87 | 1.84 |
| 18 | 600060 | 海信电器 | 180,549,902.82 | 1.79 |
| 19 | 600187 | 国中水务 | 177,324,902.83 | 1.76 |
| 20 | 300150 | 世纪瑞尔 | 177,208,781.62 | 1.76 |

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 | 300058 | 蓝色光标 | 533,757,872.80 | 5.30 |
| 2 | 300070 | 碧水源 | 494,254,731.88 | 4.91 |
| 3 | 600109 | 国金证券 | 435,817,790.48 | 4.33 |
| 4 | 002375 | 亚厦股份 | 425,819,761.19 | 4.23 |
| 5 | 600312 | 平高电气 | 370,503,465.98 | 3.68 |
| 6 | 600887 | 伊利股份 | 339,039,579.80 | 3.37 |
| 7 | 002400 | 省广股份 | 336,375,317.51 | 3.34 |
| 8 | 600446 | 金证股份 | 322,839,231.36 | 3.21 |
| 9 | 601318 | 中国平安 | 304,249,580.70 | 3.02 |
| 10 | 300133 | 华策影视 | 282,543,064.10 | 2.81 |
| 11 | 002236 | 大华股份 | 275,325,823.00 | 2.73 |
| 12 | 000002 | 万 科A | 272,352,922.69 | 2.70 |
| 13 | 300315 | 掌趣科技 | 265,678,912.52 | 2.64 |
| 14 | 002415 | 海康威视 | 257,892,419.23 | 2.56 |
| 15 | 002038 | 双鹭药业 | 252,523,659.44 | 2.51 |
| 16 | 000541 | 佛山照明 | 245,717,956.75 | 2.44 |
| 17 | 002450 | 康得新 | 244,949,091.05 | 2.43 |
| 18 | 002230 | 科大讯飞 | 238,567,378.42 | 2.37 |
| 19 | 600837 | 海通证券 | 238,009,327.44 | 2.36 |
| 20 | 300170 | 汉得信息 | 229,110,230.07 | 2.28 |
| 21 | 601166 | 兴业银行 | 227,229,668.39 | 2.26 |
| 22 | 002421 | 达实智能 | 216,672,814.04 | 2.15 |
| 23 | 000063 | 中兴通讯 | 216,304,426.78 | 2.15 |
| 24 | 000712 | 锦龙股份 | 210,524,135.06 | 2.09 |
| 25 | 600104 | 上汽集团 | 208,094,413.93 | 2.07 |
| 26 | 600703 | 三安光电 | 202,870,264.45 | 2.01 |

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 | 22,429,243,364.19 |
| 卖出股票收入(成交)总额 | 24,904,132,431.35 |

注:买入股票成本、卖出股票收入均不包括相关交易费用。

8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

8.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

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

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

8.8 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。

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

8.10.8 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未投资股指期货。

8.10.9 本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期末未持有股指期货。

8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

8.11.8 本期国债期货投资政策

本基金本报告期末未投资国债期货。

8.11.9 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有国债期货。

8.11.10 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末未投资国债期货。

8.12 投资组合报告附注

8.12.8

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。

8.12.9

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。

8.12.10 期末其他各项资产构成

单位:人民币元

| 序号 | 名称 | 金额 |
|---|---|---|
| 1 | 存出保证金 | 2,856,897.22 |
| 2 | 应收证券清算款 | 115,214,418.40 |
| 3 | 应收股利 | – |
| 4 | 应收利息 | 169,859.98 |
| 5 | 应收申购款 | 311,352.61 |
| 6 | 其他应收款 | – |
| 7 | 待摊费用 | – |
| 8 | 其他 | – |
| 9 | 合计 | 118,552,528.21 |

8.12.11 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。

8.12.12 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

金额单位:人民币元

| 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 | 300168 | 万达信息 | 271,650,040.20 | 3.33 | 重大事项停牌 |

## §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 |
| 314,997 | 20,945.18 | 108,058,181.24 | 1.64% | 6,489,612,057.83 | 98.36% |

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 | 1,297,308.01 | 0.0197% |

9.3 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 | 10~50 |
| 本基金基金经理持有本开放式基金 | >100 |

## §10 开放式基金份额变动

单位:份

| 项目 | 9,998,540,080.34 |
|---|---|
| 本报告期期初基金份额总额 | 9,569,338,196.01 |
| 本报告期基金总申购份额 | 107,986,101.90 |
| 减:本报告期基金总赎回份额 | 3,079,654,058.84 |
| 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 | 6,597,670,239.07 |

注:总申购份额含转换入份额;总赎回份额含转换出份额。

## §11 重大事件揭示

11.1 基金份额持有人大会决议

| 项目 |
|---|

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)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)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。
(2)本基金托管人2014年11月03日发布公告,聘任赵观甫为中国建设银行投资托管业务部总经理。

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

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。

11.5 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160,000.00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(2007年6月14日)起至本报告期末。

11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内,管理人、托管人及其高级管理人员未有受到稽查或处罚的情况。

11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

11.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位:人民币元

| 券商名称 | 交易单元数量 | 股票交易 | | 应支付该券商的佣金 | | 备注 |
|---|---|---|---|---|---|---|
| | | 成交金额 | 占当期股票成交总额的比例 | 佣金 | 占当期佣金总量的比例 | |
| 中信证券 | 2 | 8,026,350,561.18 | 16.98% | 7,308,987.82 | 17.03% | – |
| 兴业证券 | 2 | 5,232,161,969.52 | 11.07% | 4,673,640.11 | 10.89% | – |
| 宏源证券 | 2 | 4,654,190,025.13 | 9.85% | 4,237,175.75 | 9.87% | – |
| 申银万国 | 1 | 3,963,024,068.87 | 8.38% | 3,607,939.19 | 8.40% | – |
| 中银国际 | 1 | 2,970,270,832.97 | 6.28% | 2,704,134.50 | 6.30% | – |
| 广发证券 | 1 | 2,610,823,919.42 | 5.52% | 2,376,893.16 | 5.54% | – |
| 国泰君安 | 2 | 2,408,872,866.84 | 5.10% | 2,193,028.04 | 5.11% | – |
| 东方证券 | 1 | 2,287,152,917.64 | 4.84% | 2,082,225.49 | 4.85% | – |
| 中投证券 | 1 | 2,034,585,608.60 | 4.30% | 1,852,288.30 | 4.31% | – |
| 国信证券 | 1 | 1,894,444,448.97 | 4.01% | 1,724,700.90 | 4.02% | – |
| 长江证券 | 1 | 1,731,495,601.13 | 3.66% | 1,576,356.21 | 3.67% | – |
| 海通证券 | 1 | 1,515,860,804.73 | 3.21% | 1,380,041.35 | 3.21% | – |
| 华泰联合 | 1 | 1,317,255,373.17 | 2.79% | 1,199,227.07 | 2.79% | – |
| 广州证券 | 1 | 973,397,748.33 | 2.06% | 886,177.82 | 2.06% | – |
| 国金证券 | 1 | 906,557,337.71 | 1.92% | 825,331.38 | 1.92% | – |
| 安信证券 | 1 | 746,022,006.89 | 1.58% | 679,177.26 | 1.58% | – |
| 华宝证券 | 1 | 667,144,228.99 | 1.41% | 607,365.75 | 1.41% | – |
| 高华证券 | 1 | 579,911,237.99 | 1.23% | 527,952.43 | 1.23% | – |
| 长城证券 | 1 | 447,271,902.18 | 0.95% | 407,196.66 | 0.95% | – |
| 招商证券 | 1 | 444,622,079.41 | 0.94% | 404,782.02 | 0.94% | – |
| 瑞银证券 | 1 | 441,115,158.34 | 0.93% | 401,589.99 | 0.94% | – |
| 银河证券 | 1 | 323,815,954.95 | 0.69% | 294,803.26 | 0.69% | – |
| 东兴证券 | 1 | 304,687,021.71 | 0.64% | 269,617.99 | 0.63% | – |
| 东北证券 | 1 | 298,223,169.29 | 0.63% | 271,502.93 | 0.63% | – |
| 方正证券 | 2 | 200,763,633.06 | 0.42% | 177,655.51 | 0.41% | – |
| 华安证券 | 1 | 177,133,201.06 | 0.37% | 161,261.91 | 0.38% | – |
| 平安证券 | 1 | 106,227,103.20 | 0.22% | 96,709.03 | 0.23% | – |
| 财富里昂 | 1 | – | – | – | – | – |
| 金元证券 | 1 | – | – | – | – | – |
| 中航证券 | 1 | – | – | – | – | – |
| 西南证券 | 1 | – | – | – | – | – |
| 民生证券 | 1 | – | – | – | – | – |
| 信达证券 | 1 | – | – | – | – | – |
| 华创证券 | 1 | – | – | – | – | – |
| 齐鲁证券 | 2 | – | – | – | – | – |
| 东海证券 | 1 | – | – | – | – | – |
| 中金国际 | 1 | – | – | – | – | – |
| 西藏同信 | 1 | – | – | – | – | – |
| 东吴证券 | 1 | – | – | – | – | – |
| 江海证券 | 1 | – | – | – | – | – |
| 光大证券 | 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新增:东兴证券,兴业证券,方正证券,国泰君安证券;停止租用席位:日信证券。

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 |
| 中信证券 | – | – | – | – | – | – |
| 兴业证券 | – | – | – | – | – | – |
| 宏源证券 | – | – | – | – | – | – |
| 申银万国 | – | – | – | – | – | – |
| 中银国际 | – | – | – | – | – | – |
| 广发证券 | – | – | – | – | – | – |
| 国泰君安 | – | – | – | – | – | – |
| 东方证券 | – | – | – | – | – | – |
| 中投证券 | – | – | 100,000,000.00 | 90.91% | – | – |
| 国信证券 | – | – | – | – | – | – |
| 长江证券 | – | – | – | – | – | – |
| 海通证券 | – | – | – | – | – | – |
| 华泰联合 | – | – | – | – | – | – |
| 广州证券 | – | – | 10,000,000.00 | 9.09% | – | – |
| 国金证券 | – | – | – | – | – | – |
| 安信证券 | – | – | – | – | – | – |
| 华宝证券 | – | – | – | – | – | – |
| 高华证券 | – | – | – | – | – | – |
| 长城证券 | – | – | – | – | – | – |
| 招商证券 | – | – | – | – | – | – |
| 瑞银证券 | – | – | – | – | – | – |
| 银河证券 | – | – | – | – | – | – |
| 东兴证券 | – | – | – | – | – | – |
| 东北证券 | – | – | – | – | – | – |
| 方正证券 | – | – | – | – | – | – |
| 华安证券 | – | – | – | – | – | – |
| 平安证券 | – | – | – | – | – | – |
| 财富里昂 | – | – | – | – | – | – |
| 金元证券 | – | – | – | – | – | – |
| 中航证券 | – | – | – | – | – | – |
| 西南证券 | – | – | – | – | – | – |
| 民生证券 | – | – | – | – | – | – |
| 信达证券 | – | – | – | – | – | – |
| 华创证券 | – | – | – | – | – | – |
| 齐鲁证券 | – | – | – | – | – | – |
| 东海证券 | – | – | – | – | – | – |
| 中金国际 | – | – | – | – | – | – |
| 西藏同信 | – | – | – | – | – | – |
| 东吴证券 | – | – | – | – | – | – |
| 江海证券 | – | – | – | – | – | – |
| 光大证券 | – | – | – | – | – | – |

华宝兴业基金管理有限公司
2015年3月30日